



Geprüfter Jahresbericht und -abschluss

BNY MELLON GLOBAL FUNDS, PLC

FÜR DAS GESCHÄFTSJAHR ZUM 31. DEZEMBER 2021



BNY MELLON
INVESTMENT MANAGEMENT

INHALT

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

BNY MELLON GLOBAL FUNDS, PLC

HINTERGRUND DER GESELLSCHAFT

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

STRUKTUR

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

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

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

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

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

| Fonds | Anlageverwalter | Auflegungsdatum |
|--|---|--------------------|
| BNY Mellon Global Leaders Fund | Walter Scott & Partners Limited | 7. Dezember 2016 |
| BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund ⁽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 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 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.

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

ANLAGEZIEL

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

SONSTIGE WICHTIGE ANGABEN

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

BNY MELLON GLOBAL FUNDS, PLC

BERICHT DES VERWALTUNGSRATS

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

HAUPTTÄTIGKEITEN

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

AUFGABEN DES VERWALTUNGSRATS

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

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

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

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

ENTSPRECHUNGSERKLÄRUNG DES VERWALTUNGSRATS

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

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

Um der Compliance-Politik Wirkung zu verleihen, hat der

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

Der Verwaltungsrat bestätigt, dass:

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

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

RECHNUNGSLEGUNGSUNTERLAGEN

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

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

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

AUSSCHÜTTUNGEN

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

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

GESCHÄFTSÜBERBLICK UND KÜNFTIGE ENTWICKLUNGEN

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

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

Coronavirus („COVID 19“)

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

ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS

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

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

ERGEBNISSE

Die Ergebnisse für das Geschäftsjahr sind in der Gesamtergebnisrechnung dargelegt.

EREIGNISSE SEIT DEM BILANZSTICHTAG

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

TRANSAKTIONEN MIT UND POSITIONEN BEI NAHESTEHENDEN UNTERNEHMEN UND PERSONEN

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

TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PERSONEN

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

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

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

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

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

CORPORATE-GOVERNANCE-ERKLÄRUNG

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

- (i) der Gründungsurkunde und Satzung der Gesellschaft;

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

PROZESS DER FINANZBERICHTERSTATTUNG – BESCHREIBUNG DER HAUPTMERKMALE

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

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

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

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

VERSAMMLUNGEN DER ANTEILSINHABER

Die Einberufung und Durchführung von Versammlungen der Anteilsinhaber 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 Anteilsinhaber, die mindestens ein Zehntel des eingezahlten Anteilskapitals der Gesellschaft repräsentieren, den Verwaltungsrat zur Einberufung einer Versammlung der Anteilsinhaber 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 Anteilsinhaber erfolgen.

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

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

ZUSAMMENSETZUNG UND ARBEIT DES VERWALTUNGSRATS UND DER AUSSCHÜSSE

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

Die Geschäftstätigkeit der Gesellschaft wird von den

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

DIVERSITÄTSERKLÄRUNG

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

DER VERWALTUNGSRAT

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

David Dillon (Ire)*^

Gerald Rehn (US-Amerikaner)

Greg Brisk (Brite)

Claire Cawley (Irin)^

Alle Verwaltungsratsmitglieder sind nicht-geschäftsführende Verwaltungsratsmitglieder.

* Vorsitzender des Verwaltungsrats.

^ Unabhängiges Verwaltungsratsmitglied

BETEILIGUNGEN DER VERWALTUNGSRATSMITGLIEDER UND DES GESELLSCHAFTSSEKRETÄRS

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

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

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

POLITISCHE SPENDEN

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

OFFENLEGUNG VON INFORMATIONEN AN DIE ABSCHLUSSPRÜFER

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

UNABHÄNGIGE ABSCHLUSSPRÜFER

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

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

Für den Verwaltungsrat

Verwaltungsratsmitglied – **David Dillon**

Verwaltungsratsmitglied – **Claire Cawley**

Datum: 14. April 2022

BNY MELLON GLOBAL FUNDS, PLC

BERICHT DER VERWAHRSTELLE

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

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

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

AUFGABEN DER VERWAHRSTELLE

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

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

GRUNDLAGE FÜR DEN PRÜFUNGSVERMERK DER VERWAHRSTELLE

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

PRÜFUNGSVERMERK

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

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

MICHELLE MORONEY

Michelle Moroney

Für und im Namen von

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

Irland

Datum: 14. April 2022

BNY MELLON GLOBAL FUNDS, PLC

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

PRÜFUNGSVERMERK

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

Unseres Erachtens

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

GRUNDLAGE FÜR DEN PRÜFUNGSVERMERK

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

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

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

SCHLUSSFOLGERUNGEN ZUM FORTFÜHRUNGSPRINZIP

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

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

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

SONSTIGE ANGABEN

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

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

In dieser Hinsicht ist von uns nichts zu berichten.

VOM COMPANIES ACT 2014 VORGESCHRIEBENE STELLUNGNAHMEN ZU SONSTIGEN SACHVERHALTEN

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

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

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

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

SACHVERHALTE, ÜBER DIE WIR IN AUSNAHMEFÄLLEN BERICHTEN MÜSSEN

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

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

In dieser Hinsicht ist von uns nichts zu berichten.

JEWELIGE AUFGABEN

Aufgaben des Verwaltungsrats im Zusammenhang mit dem Abschluss

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

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

Aufgaben der Abschlussprüfer im Zusammenhang mit der Abschlussprüfung

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

Eine ausführlichere Beschreibung unserer Aufgaben im Zusammenhang mit der Abschlussprüfung finden Sie auf der Website der IAASA: http://www.iaasa.ie/getmedia/b2389013-1cf6-458b-9b8f-a98202dc9c3a/Description_of_auditors_responsibilities_for_audit.pdf.

Diese Beschreibung ist Bestandteil unseres Prüfungsberichts.

ZWECK UNSERER PRÜFUNGSHANDLUNGEN UND WEM GEGENÜBER WIR VERANTWORTLICH SIND

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

AIDAN TIERNAN

Aidan Tiernan

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

Datum: 22. April 2022

BERICHTE DER ANLAGEVERWALTER[^]

KONJUNKTUR- & MARKTÜBERBLICK

Einleitung

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

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

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

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

Nordamerika

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

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

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

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

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

Europa

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

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

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

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

Asien

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

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

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

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

Festverzinsliche Wertpapiere

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

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

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

Währungen und Rohstoffe

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

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

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

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

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

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

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

ABSOLUTE RETURN, ALTERNATIVE & MULTI-ASSET

BNY MELLON ABSOLUTE RETURN BOND FUND

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Insight Investment Management (Global) Limited
Januar 2022

BNY MELLON ABSOLUTE RETURN EQUITY FUND

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

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

ABSOLUTE RETURN, ALTERNATIVE & MULTI-ASSET Forts.

BNY MELLON ABSOLUTE RETURN EQUITY FUND Forts.

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

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

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

Insight Investment Management (Global) Limited
Januar 2022

BNY MELLON ABSOLUTE RETURN GLOBAL CONVERTIBLE FUND

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

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

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

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

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

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

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

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

Insight Investment Management (Global) Limited
Januar 2022

ABSOLUTE RETURN, ALTERNATIVE & MULTI-ASSET Forts.

BNY MELLON DYNAMIC FACTOR PREMIA V10 FUND

Der Fonds wurde am 18. November 2021 aufgelegt.

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

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

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

Newton Investment Management North America LLC
Januar 2022

BNY MELLON DYNAMIC TOTAL RETURN FUND

Der Fonds wurde am 26. Februar 2021 geschlossen.

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

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

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

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

Mellon Investments Corporation
Januar 2022

BNY MELLON GLOBAL MULTI – ASSET INCOME FUND

Der Fonds wurde am 18. März 2021 geschlossen.

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

Newton Investments Management Limited
Januar 2022

BNY MELLON GLOBAL REAL RETURN FUND (EUR)

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

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

ABSOLUTE RETURN, ALTERNATIVE & MULTI-ASSET Forts.

BNY MELLON GLOBAL REAL RETURN FUND (EUR) Forts.

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

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

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

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

Newton Investment Management Limited
Januar 2022

BNY MELLON GLOBAL REAL RETURN FUND (GBP)

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

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

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

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

ABSOLUTE RETURN, ALTERNATIVE & MULTI-ASSET Forts.

BNY MELLON GLOBAL REAL RETURN FUND (GBP)

Fort.

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

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

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

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

Newton Investment Management Limited
Januar 2022

BNY MELLON GLOBAL REAL RETURN FUND (USD)

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

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

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

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

ABSOLUTE RETURN, ALTERNATIVE & MULTI-ASSET Forts.

BNY MELLON GLOBAL REAL RETURN FUND (USD) Forts.

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

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

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

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

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

Newton Investment Management Limited
Januar 2022

BNY MELLON GLOBAL UNCONSTRAINED FUND

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

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

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

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

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

ABSOLUTE RETURN, ALTERNATIVE & MULTI-ASSET Forts.

BNY MELLON GLOBAL UNCONSTRAINED FUND Forts.

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

Newton Investment Management Limited
Januar 2022

BNY MELLON SUSTAINABLE GLOBAL REAL RETURN FUND (EUR)

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

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

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

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

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

Im Segment *alternative Anlagen* führte der Anlageverwalter ein neues Engagement in CO₂-Zertifikaten der EU ein, da eine Verschärfung der gesetzlichen Rahmenbedingungen für CO₂-Emissionen den Marktpreis für CO₂ in die Höhe treiben könnte.

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

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

Newton Investment Management Limited
Januar 2022

ABSOLUTE RETURN, ALTERNATIVE & MULTI-ASSET Forts.

BNY MELLON TARGETED RETURN BOND FUND

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

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

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

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

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

Insight North America LLC*
Januar 2022

Globale Aktienmärkte

BNY MELLON GLOBAL EQUITY FUND

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

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

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

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

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

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

Globale Aktienmärkte Forts.

BNY MELLON U.S. EQUITY INCOME FUND Forts.

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

Newton Investment Management Limited
Januar 2022

BNY MELLON GLOBAL EQUITY INCOME FUND

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Newton Investment Management Limited
Januar 2022

BNY MELLON GLOBAL LEADERS FUND

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

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

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

Globale Aktienmärkte Forts.

BNY MELLON GLOBAL LEADERS FUND Forts.

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

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

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

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

Walter Scott & Partners Limited
Januar 2022

BNY MELLON GLOBAL OPPORTUNITIES FUND

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

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

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

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

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

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

Newton Investment Management Limited
Januar 2022

Globale Aktienmärkte Forts.

BNY MELLON LONG-TERM GLOBAL EQUITY FUND

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Walter Scott & Partners Limited
Januar 2022

REGIONALE AKTIEN

BNY MELLON ASIAN EQUITY FUND

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

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

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

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

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

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

Newton Investment Management Limited
Januar 2022

BNY MELLON ASIAN INCOME FUND

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

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

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

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

REGIONALE AKTIEN Forts.

BNY MELLON ASIAN INCOME FUND Forts.

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

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

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

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

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

Newton Investment Management Limited
Januar 2022

BNY MELLON BRAZIL EQUITY FUND

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

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

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

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

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

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

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

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

REGIONALE AKTIEN Forts.

BNY MELLON BRAZIL EQUITY FUND Forts.

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

ARX Investimentos Ltda
Januar 2022

BNY MELLON GLOBAL EMERGING MARKETS FUND

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

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

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

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

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

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

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

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

Newton Investment Management Limited
Januar 2022

BNY MELLON JAPAN SMALL CAP EQUITY FOCUS FUND

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

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

REGIONALE AKTIEN Forts.

BNY MELLON JAPAN SMALL CAP EQUITY FOCUS FUND Forts.

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

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

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

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

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

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

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

BNY Mellon Asset Management Japan Limited
Januar 2022

BNY MELLON S&P 500® INDEX TRACKER

Der Fonds wurde am 15. Januar 2021 geschlossen.

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

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

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

Mellon Investments Corporation
Januar 2022

BNY MELLON SMALL CAP EUROLAND FUND

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

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

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

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

Newton Investment Management North America LLC*
Januar 2022

REGIONALE AKTIEN Forts.

BNY MELLON U.S. DYNAMIC VALUE FUND

Der Fonds wurde am 5. März 2021 geschlossen.

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

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

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

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

Mellon Investments Corporation
Januar 2022

BNY MELLON U.S. EQUITY INCOME FUND

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

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

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

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

Newton Investment Management North America LLC*
Januar 2022

SPEZIALAKTIEN

BNY MELLON BLOCKCHAIN INNOVATION FUND

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

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

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

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

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

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

Newton Investment Management North America LLC*
Januar 2022

BNY MELLON DYNAMIC U.S. EQUITY FUND

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

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

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

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

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

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

Newton Investment Management North America LLC*
Januar 2022

SPEZIALAKTIEN Forts.

BNY MELLON FUTURE EARTH FUND

Der Fonds wurde am 12. Januar 2021 aufgelegt.

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

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

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

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

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

BNY MELLON FUTURE EARTH FUND Forts.

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

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

Newton Investment Management Limited
Januar 2022

BNY MELLON FUTURE FOOD FUND

Der Fonds wurde am 12. Januar 2021 aufgelegt.

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

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

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

SPEZIALAKTIEN Forts.

BNY MELLON FUTURE FOOD FUND Forts.

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

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

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

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

Newton Investment Management Limited
Januar 2022

BNY MELLON FUTURE LIFE FUND

Der Fonds wurde am 12. Januar 2021 aufgelegt.

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

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

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

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

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

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

Newton Investment Management Limited
Januar 2022

SPEZIALAKTIEN Forts.

BNY MELLON GLOBAL INFRASTRUCTURE INCOME FUND

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

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

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

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

Newton Investment Management North America LLC*
Januar 2022

BNY MELLON MOBILITY INNOVATION FUND

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

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

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

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

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

Newton Investment Management North America LLC*
Januar 2022

SPEZIALAKTIEN Forts.

BNY MELLON SMART CURES INNOVATION FUND

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

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

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

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

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

Newton Investment Management North America LLC*
Januar 2022

Globale Festverzinsliche Wertpapiere

BNY MELLON EFFICIENT GLOBAL IG CORPORATE BETA FUND

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

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

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

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

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

Insight North America LLC*
Januar 2022

BNY MELLON GLOBAL BOND FUND

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

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

Globale Festverzinsliche Wertpapiere Forts.

BNY MELLON GLOBAL BOND FUND FORTS.

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

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

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

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

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

Newton Investment Management Limited
Januar 2022

BNY MELLON GLOBAL CREDIT FUND

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

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

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

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

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

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

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

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

Globale Festverzinsliche Wertpapiere Forts.

BNY MELLON GLOBAL CREDIT FUND Forts.

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

Insight Investment Management (Global) Limited
Januar 2022

BNY MELLON GLOBAL DYNAMIC BOND FUND

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Newton Investment Management Limited
Januar 2022

Globale Festverzinsliche Wertpapiere Forts.

BNY MELLON GLOBAL HIGH YIELD BOND FUND

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

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

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

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

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

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

BNY MELLON GLOBAL HIGH YIELD BOND FUND Forts.

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

Alcentra NY, LLC
Januar 2022

BNY MELLON GLOBAL SHORT-DATED HIGH YIELD BOND FUND

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

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

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

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

Globale Festverzinsliche Wertpapiere Forts.

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

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

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

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

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

Insight Investment Management (Global) Limited
Januar 2022

BNY MELLON SUSTAINABLE GLOBAL DYNAMIC BOND FUND

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Newton Investment Management Limited
Januar 2022

BNY MELLON EFFICIENT GLOBAL HIGH YIELD BETA FUND

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

Globale Festverzinsliche Wertpapiere Forts.

BNY MELLON EFFICIENT GLOBAL HIGH YIELD BETA FUND Forts.

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

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

Insight North America LLC*
Januar 2022

Regionale & Spezialanleihen

BNY MELLON EFFICIENT U.S. FALLEN ANGELS BETA FUND

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

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

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

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

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

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

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

REGIONALE & SPEZIALANLEIHEN Forts.

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

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

Insight North America LLC*
Januar 2022

BNY MELLON EFFICIENT U.S. HIGH YIELD BETA FUND

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

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

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

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

Dagegen verzeichnete der relativ *defensive* Kommunikationssektor eine Underperformance.

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

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

Insight North America LLC*
Januar 2022

BNY MELLON EMERGING MARKETS CORPORATE DEBT FUND

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

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

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

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

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

REGIONALE & SPEZIALANLEIHEN Forts.

BNY MELLON EMERGING MARKETS CORPORATE DEBT FUND Forts.

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

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

Insight Investment Management (Global) Limited
Januar 2022

BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT FUND

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

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

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

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

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

Insight Investment Management (Global) Limited*
Januar 2022

BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT LOCAL CURRENCY FUND

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

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

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

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

REGIONALE & SPEZIALANLEIHEN Forts.

BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT LOCAL CURRENCY FUND Forts.

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

Insight Investment Management (Global) Limited*
Januar 2022

BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT OPPORTUNISTIC FUND

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

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

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

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

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

Insight Investment Management (Global) Limited*
Januar 2022

BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT TOTAL RETURN FUND

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

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

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

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

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

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

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

REGIONALE & SPEZIALANLEIHEN Forts.

BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT TOTAL RETURN FUND Forts.

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

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

Daher ist der Fonds vorerst etwas vorsichtig positioniert.

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

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

Insight Investment Management (Global) Limited
Januar 2022

BNY MELLON EUROLAND BOND FUND

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

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

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

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

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

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

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

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

Insight Investment Management (Global) Limited*
Januar 2022

BNY MELLON EUROPEAN CREDIT FUND

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

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

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

REGIONALE & SPEZIALANLEIHEN Forts.

BNY MELLON EUROPEAN CREDIT FUND Forts.

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

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

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

Insight Investment Management (Global) Limited
Januar 2022

BNY MELLON U.S. MUNICIPAL INFRASTRUCTURE DEBT FUND

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

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

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

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

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

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

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

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

Insight North America LLC*
Januar 2022

RESPONSIBLE HORIZONS EURO CORPORATE BOND FUND

Der Fonds wurde am 27. März 2021 aufgelegt.

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

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

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

REGIONALE & SPEZIALANLEIHEN Forts.

RESPONSIBLE HORIZONS EURO CORPORATE BOND FUND Forts.

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

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

Ende Dezember 2021 waren 24,6% des Fonds in *Impact Bonds* investiert (gegenüber einem Anteil von 19,2% im Referenzwert). Allgemein beträgt der gewichtete Durchschnitts-Score für *Umwelt, Soziales und Corporate Governance (ESG)* 2,2 gegenüber einem Score von 2,4 im Referenzwert. (Je niedriger der Score, desto besser die ESG-Performance. Diese Scores werden von der Prime ESG-Rating-Methode von Insight abgeleitet.) Außerdem beträgt die CO₂-Intensität des Fonds 51 % des Scores des Vergleichsindex (die CO₂-Intensität misst, wie viel Kohlendioxid Emittenten im Verhältnis zum Umsatz erzeugen).

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

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

Insight Investment Management (Global) Limited
Januar 2022

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

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

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

GLOSSAR FINANZBEGRIFFE (UNGEPRÜFT)

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

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

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

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

BNY MELLON ABSOLUTE RETURN BOND FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

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

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

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert EUR | Summe Nettover- mögen % | Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert EUR | Summe Nettover- mögen % |
|--|---|----------------------------------|----------------------------------|--|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | | Anleihen Forts. | | | |
| Deutschland - 42.455.945 | | | | Japan - 23.853.958 | | | |
| (31. Dezember 2020: 95.681.356) | | | | (31. Dezember 2020: 21.855.803) | | | |
| 17.000.000 | Bundesschatzanweisungen 0.000% 11-Mar-2022 | 17.019.805 | 4,05 | 3.100.000.000 | Japan Government Thirty Year Bond 0.700% 20-Sep-2051 | 23.853.958 | 5,67 |
| 400.000 | Commerzbank AG FRN (Perpetual) 6.125% 09-Oct-2025 | 438.004 | 0,10 | | | | |
| 8.361.000 | German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 19-Jan-2022 | 8.363.341 | 1,99 | | | | |
| 5.500.000 | German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 23-Feb-2022 | 5.505.555 | 1,31 | | | | |
| 8.295.000 | German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 23-Mar-2022 | 8.308.521 | 1,97 | | | | |
| 2.500.000 | IKB Deutsche Industriebank AG FRN 4.000% 31-Jan-2028 | 2.551.000 | 0,61 | | | | |
| 260.000 | TK Elevator Midco GmbH 'REGS' 4.375% 15-Jul-2027 | 269.719 | 0,06 | | | | |
| Ghana - 298.838 | | | | Kasachstan - 607118 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | | (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 400.000 | Ghana Government International Bond 'REGS' 6.375% 11-Feb-2027 | 298.838 | 0,07 | 300.000.000 | Development Bank of Kazakhstan JSC 'REGS' 10.950% 06-May-2026 | 607118 | 0,14 |
| Indonesien - 305.984 | | | | Luxemburg - 254.805 | | | |
| (31. Dezember 2020: 3.622.277) | | | | (31. Dezember 2020: 1.926.714) | | | |
| 350.000 | Indonesia Government International Bond 3.050% 12-Mar-2051 | 305.984 | 0,07 | 247.328 | ARD Finance SA 'REGS' 5.000% 30-Jun-2027 | 254.805 | 0,06 |
| Irland - 12.160.963 | | | | Mexiko - 4.200.151 | | | |
| (31. Dezember 2020: 7.558.340) | | | | (31. Dezember 2020: 2.935.923) | | | |
| 496.922 | Atom Mortgage Securities DAC FRN 1.400% 22-Jul-2031 | 593.407 | 0,14 | 94.569.400 | Mexican Bonos 5.750% 05-Mar-2026 | 3.856.307 | 0,92 |
| 781.313 | Berg Finance 2021 DAC '2021-1 B' FRN 1.450% 22-Apr-2033 | 781.890 | 0,19 | 400.000 | Petroleos Mexicanos 5.950% 28-Jan-2031 | 343.844 | 0,08 |
| 180.246 | European Residential Loan Securitisation 2019-NPL2 DAC '2019-NPL2 A' FRN 0.857% 24-Feb-2058 | 179.277 | 0,04 | | | | |
| 800.000 | Fortuna Consumer Loan ABS 2021 DAC FRN 0.907% 18-Oct-2030 | 798.602 | 0,19 | | | | |
| 620.221 | Last Mile Logistics Pan Euro Finance DAC FRN 1.400% 17-Aug-2033 | 622.255 | 0,15 | | | | |
| 137.972 | Last Mile Securities PE 2021 DAC '2021-1X C' FRN 1.600% 17-Aug-2031 | 138.691 | 0,03 | | | | |
| 500.000 | Permanent TSB Group Holdings Plc 'EMTN' FRN 2.125% 26-Sep-2024 | 508.315 | 0,12 | | | | |
| 437.000 | Permanent TSB Group Holdings Plc 'EMTN' FRN 3.000% 19-Aug-2031 | 444.549 | 0,11 | | | | |
| 1.009.000 | Portman Square 2021-NPL1 DAC '2021-NPL1X A' FRN 1.433% 25-Oct-2061 | 1.012.626 | 0,24 | | | | |
| 709.419 | Rathlin Residential 2021-1 DAC '2021-1X A' FRN 1.432% 27-Sep-2075 | 699.685 | 0,17 | | | | |
| 312.503 | Retiro Mortgage Securities DAC FRN 1.444% 30-Jul-2075 | 311.266 | 0,07 | | | | |
| 2.820.000 | Shamrock Residential 2021-1 DAC '2021-1 B' FRN 0.757% 24-Dec-2059 | 2.835.605 | 0,67 | | | | |
| 131.038 | Taurus 2021-1 UK DAC '2021-UK1X C' FRN 1.700% 17-May-2031 | 156.390 | 0,04 | | | | |
| 430.000 | Taurus 2021-3 DEU DAC '2021-DE3 B' FRN 1.800% 22-Dec-2030 | 429.458 | 0,10 | | | | |
| 827.135 | Taurus 2021-4 UK DAC '2021-UK4X C' FRN 1.800% 17-Aug-2031 | 982.005 | 0,23 | | | | |
| 1.400.000 | Viridis European Loan Conduit No 38 DAC FRN 1.251% 22-Jul-2029 | 1.666.942 | 0,40 | | | | |
| Italien - 15.746.026 | | | | Niederlande - 4.610.321 | | | |
| (31. Dezember 2020: 26.124.483) | | | | (31. Dezember 2020: 9.926.384) | | | |
| 400.000 | Assicurazioni Generali SpA 'EMTN' FRN (Perpetual) 4.596% 21-Nov-2025 | 445.200 | 0,10 | 200.000 | Achmea BV FRN (Perpetual) 4.625% 24-Mar-2029 | 212.550 | 0,05 |
| 200.000 | Assicurazioni Generali SpA FRN (Perpetual) 6.416% 08-Feb-2022 | 239.083 | 0,06 | 1.903.000 | Athora Netherlands NV FRN 2.250% 15-Jul-2031 | 1.902.048 | 0,45 |
| 3.370.000 | Iccrea Banca SpA 'EMTN' FRN 4.750% 18-Jan-2032 | 3.399.487 | 0,81 | 592.000 | Athora Netherlands NV FRN (Perpetual) 7.000% 19-Jun-2025 | 664.372 | 0,16 |
| 250.000 | Intesa Sanpaolo SpA FRN (Perpetual) 3.750% 27-Feb-2025 | 247.344 | 0,06 | 600.000 | LeasePlan Corp NV FRN (Perpetual) 7.375% 29-May-2024 | 663.300 | 0,16 |
| 9.600.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 2.800% 01-Mar-2067 | 10.869.312 | 2,58 | 410.725 | Summer BidCo BV 'REGS' 9.000% 15-Nov-2025 | 420.102 | 0,10 |
| 500.000 | UnipolSai Assicurazioni SpA 'EMTN' FRN (Perpetual) 5.750% 18-Jun-2024 | 545.600 | 0,13 | 750.000 | Titan Holdings II BV 'REGS' 5.125% 15-Jul-2029 | 747.949 | 0,18 |
| | | | | Neuseeland - 1.032.229 | | | |
| | | | | (31. Dezember 2020: -) | | | |
| | | | | 1.056.000 | ASB Finance Ltd 'EMTN' 0.250% 08-Sep-2028 | 1.032.229 | 0,25 |
| | | | | Peru - 197.567 | | | |
| | | | | (31. Dezember 2020: -) | | | |
| | | | | 200.000 | Peruvian Government International Bond 1.950% 17-Nov-2036 | 197.567 | 0,05 |
| | | | | Portugal - 2.238.126 | | | |
| | | | | (31. Dezember 2020: 2.949.458) | | | |
| | | | | 400.000 | Caixa Geral de Depositos SA FRN (Perpetual) 10.750% 30-Mar-2022 | 411.000 | 0,10 |
| | | | | 1.700.000 | Cia de Seguros Fidelidade SA FRN 4.250% 04-Sep-2031 | 1.827.126 | 0,43 |
| | | | | Republik Serbien - 229.222 | | | |
| | | | | (31. Dezember 2020: -) | | | |
| | | | | 250.000 | Serbia International Bond 'REGS' 2.050% 23-Sep-2036 | 229.222 | 0,05 |
| | | | | Rumänien - 528.753 | | | |
| | | | | (31. Dezember 2020: 1.727.081) | | | |
| | | | | 2.500.000 | Romania Government Bond 5.800% 26-Jul-2027 | 528.753 | 0,13 |
| | | | | Russland - 2.171.295 | | | |
| | | | | (31. Dezember 2020: 2.248.396) | | | |
| | | | | 98.000.000 | Russian Federal Bond - OFZ 7.750% 16-Sep-2026 | 1.125.735 | 0,27 |
| | | | | 90.400.000 | Russian Federal Bond - OFZ 7.950% 07-Oct-2026 | 1.045.560 | 0,25 |
| | | | | Südafrika - 1.372.932 | | | |
| | | | | (31. Dezember 2020: 228.009) | | | |
| | | | | 9.000.000 | Republic of South Africa Government Bond 8.000% 31-Jan-2030 | 461.615 | 0,11 |
| | | | | 14.000.000 | Republic of South Africa Government Bond 8.875% 28-Feb-2035 | 698.713 | 0,17 |
| | | | | 3.462.597 | Republic of South Africa Government Bond 10.500% 21-Dec-2026 | 212.604 | 0,05 |
| | | | | Spanien - 22.103.330 | | | |
| | | | | (31. Dezember 2020: 9.722.581) | | | |
| | | | | 600.000 | Banco de Credito Social Cooperativo SA 'EMTN' FRN 1.750% 09-Mar-2028 | 576.318 | 0,14 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert EUR | Nettovermögen % | Summe |
|--|---|-------------------------------|--------------------|-------|
| Anleihen Forts. | | | | |
| Spanien Forts. | | | | |
| 1.100.000 | Banco de Credito Social Cooperativo SA 'EMTN' FRN 5.250% 27-Nov-2031 | 1.144.665 | 0,27 | |
| 1.100.000 | Cellnex Telecom SA 1.875% 26-Jun-2029 | 1.095.622 | 0,26 | |
| 2.400.000 | Liberbank SA FRN 6.875% 14-Mar-2027 | 2.435.208 | 0,58 | |
| 3.365.000 | Lorca Telecom Bondco SA 'REGS' 4.000% 18-Sep-2027 | 3.436.641 | 0,81 | |
| 6.400.000 | Spain Letras del Tesoro (Zero Coupon) 0.000% 14-Jan-2022 | 6.401.280 | 1,52 | |
| 6.400.000 | Spain Letras del Tesoro (Zero Coupon) 0.000% 11-Feb-2022 | 6.406.080 | 1,52 | |
| 413.131 | TDA 18-Mixto FTA FRN 0.162% 22-Jun-2045 | 408.966 | 0,10 | |
| 200.000 | Unicaja Banco SA FRN (Perpetual) 4.875% 18-Nov-2026 | 198.550 | 0,05 | |
| Schweden - 1.820.236 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.685.211) | | | | |
| 2.050.000 | Skandinaviska Enskilda Banken AB 'REGS' FRN 0.846% 12-Dec-2022 | 1.820.236 | 0,43 | |
| Schweiz - 928.939 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 2.971.622) | | | | |
| 400.000 | Credit Suisse Group AG '144A' FRN (Perpetual) 6.375% 21-Aug-2026 | 381.782 | 0,09 | |
| 250.000 | Credit Suisse Group AG '144A' FRN (Perpetual) 7.500% 11-Dec-2023 | 239.107 | 0,06 | |
| 340.000 | Credit Suisse Group AG FRN (Perpetual) 7.125% 29-Jul-2022 | 308.050 | 0,07 | |
| Ukraine - 854.601 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 263.663) | | | | |
| 350.000 | Ukraine Government International Bond 'REGS' 7.750% 01-Sep-2022 | 307.599 | 0,07 | |
| 650.000 | Ukraine Government International Bond 'REGS' 7.750% 01-Sep-2027 | 547.002 | 0,13 | |
| Vereinigtes Königreich - 50.725.984 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 38.596.726) | | | | |
| 627.704 | Alba 2007-1 Plc '2007-1 B' FRN 0.462% 17-Mar-2039 | 702.343 | 0,17 | |
| 424.000 | Atlas Funding 2021-1 PLC '2021-1 B' FRN 1.550% 25-Jul-2058 | 506.912 | 0,12 | |
| 704.000 | BAT Capital Corp 5.282% 02-Apr-2050 | 705.058 | 0,17 | |
| 2.390.000 | Bellis Acquisition Co Plc 'REGS' 4.500% 16-Feb-2026 | 2.849.332 | 0,68 | |
| 1.742.663 | British Airways 2020-1 Class A Pass Through Trust '144A' 4.250% 15-Nov-2032 | 1.636.154 | 0,39 | |
| 2.396.000 | British American Tobacco Plc FRN (Perpetual) 3.000% 27-Sep-2026 | 2.351.099 | 0,56 | |
| 948.000 | British American Tobacco Plc FRN (Perpetual) 3.750% 27-Jun-2029 | 929.263 | 0,22 | |
| 1.287.635 | Canada Square Funding 2019-1 Plc '2019-1 A' FRN 1.150% 17-Oct-2051 | 1.536.591 | 0,37 | |
| 640.000 | CPUK Finance Ltd 4.500% 28-Aug-2027 | 765.984 | 0,18 | |
| 500.000 | esure Group Plc FRN (Perpetual) 6.000% 29-Jul-2026 | 597.749 | 0,14 | |
| 902.771 | Eurosail 2006-1 Plc '2006-1X B1A' FRN 0.000% 10-Jun-2044 | 874.403 | 0,21 | |
| 3.079.000 | Greene King Finance Plc FRN 2.178% 15-Mar-2036 | 3.010.630 | 0,72 | |
| 2.850.000 | Harbour Energy Plc 'REGS' 5.500% 15-Oct-2026 | 2.501.709 | 0,59 | |
| 2.072.000 | Hastings Group Finance Plc 3.000% 24-May-2025 | 2.596.969 | 0,62 | |
| 1.715.000 | HSBC Holdings Plc 'EMTN' FRN (Perpetual) 4.750% 04-Jul-2029 | 1.890.359 | 0,45 | |
| 1.715.000 | INEOS Quattro Finance 1 Plc 'REGS' 3.750% 15-Jul-2026 | 1.729.106 | 0,41 | |
| 1.750.000 | Ithaca Energy North Sea Plc 'REGS' 9.000% 15-Jul-2026 | 1.586.402 | 0,38 | |
| 1.226.934 | Landmark Mortgage Securities No 1 Plc FRN 0.000% 17-Jun-2038 | 1.152.596 | 0,27 | |
| 1 | Ludgate Funding Plc '2006-1X BB' FRN 0.000% 01-Dec-2060 | 1 | 0,00 | |
| 1.073.089 | Marston's Issuer Plc FRN 1.454% 15-Oct-2027 | 1.193.180 | 0,28 | |
| 523.000 | Newday Funding Master Issuer Plc - Series 2021-2 '2021-2X C' FRN 1.696% 15-Jul-2029 | 622.304 | 0,15 | |
| 500.000 | Newday Funding Master Issuer Plc - Series 2021-3 '2021-3X C' FRN 0.000% 15-Nov-2029 | 595.844 | 0,14 | |

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

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

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

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

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

| Bestände | Beschreibung | Zugrunde liegendes Engagement EUR | Beizulegender Zeitwert EUR | Nettovermögen % | Summe |
|----------|--------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------|-------|
|----------|--------------|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------|-------|

| Bestände | Beschreibung | Zugrunde liegendes Engagement EUR | Beizulegender Zeitwert EUR | Nettovermögen % | Summe | |
|---|--|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------|------------------|-------------|
| Offene Terminkontrakte - 3.776.347 | | | | | | |
| (31. Dezember 2020: 157.757) | | | | | | |
| (21) | Euro-Bobl Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (2.798.040) | 19.721 | 0,00 | | |
| (192) | Euro-Bobl Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (25.582.080) | 143.413 | 0,03 | | |
| (245) | Euro-BTP Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (36.017.450) | 722.004 | 0,17 | | |
| (596) | Euro-BTP Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (67.294.360) | 340.661 | 0,08 | | |
| (1) | Euro-Bund Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (171.370) | 2.429 | 0,00 | | |
| (145) | Euro-Buxl 30 Year Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (29.977.300) | 1.293.487 | 0,31 | | |
| (75) | Japanese 10 Year Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (87.255.344) | 272.855 | 0,07 | | |
| 466 | SFE 10 Year Australian Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2022 | 41.540.571 | 22.417 | 0,01 | | |
| (416) | U.S. 10 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (47.929.480) | 87.287 | 0,02 | | |
| (3) | UK Long Gilt Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (446.160) | 1.747 | 0,00 | | |
| (382) | UK Long Gilt Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (56.811.051) | 870.326 | 0,21 | | |
| Offene Terminkontrakte insgesamt | | | | | 3.776.347 | 0,90 |

Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 6.248.056 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 7.499.543)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt **393.892.842** **93,59**

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

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

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

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

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

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

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

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

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

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

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

BNY MELLON ABSOLUTE RETURN EQUITY FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

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

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

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

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

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

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

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

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

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

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

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

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

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

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

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte

| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|---|---------|------------|------------|------------------|---------------------|-------------------------------------|
| BNY Mellon Absolute Return Equity Fund | | | | | | |
| Pfund Sterling | Euro | 102.184 | 120.000 | 19. Jan. 22 | HSBC Bank plc | 1.361 |
| Pfund Sterling | Euro | 767.307 | 900.000 | 19. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | 11.138 |
| Pfund Sterling | Euro | 6.001.803 | 7.100.000 | 19. Jan. 22 | Barclays Bank PLC | 36.465 |
| | | | | | | GBP 48.964 |

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

| | | | | | | |
|-------------------|-------------------|--------|--------|-------------|-----------------------------|------------------|
| Pfund Sterling | Schweizer Franken | 73 | 90 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - |
| | | | | | | GBP - |
| | | | | | | CHF - |
| Schweizer Franken | Pfund Sterling | 15.133 | 12.406 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (102) |
| | | | | | | GBP (102) |
| | | | | | | CHF (125) |

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

| | | | | | | |
|----------------|----------------|---------|---------|-------------|-----------------------------|--------------------|
| Pfund Sterling | Euro | 980 | 1.152 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 12 |
| | | | | | | GBP 12 |
| | | | | | | EUR 14 |
| Euro | Pfund Sterling | 199.774 | 171.125 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (3.296) |
| | | | | | | GBP (3.296) |
| | | | | | | EUR (3.924) |

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

| | | | | | | |
|----------------|----------------|-----------|-----------|-------------|-----------------------------|-------------------|
| Pfund Sterling | Euro | 25.222 | 29.988 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 36 |
| Euro | Pfund Sterling | 226 | 190 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - |
| Euro | Pfund Sterling | 3 | 3 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - |
| Pfund Sterling | Euro | 206.397 | 241.517 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 3.501 |
| Pfund Sterling | Euro | 8.878 | 10.441 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 107 |
| Pfund Sterling | Euro | 218.418 | 257.663 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.957 |
| Pfund Sterling | Euro | 215.665 | 253.037 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 3.091 |
| Pfund Sterling | Euro | 173.417 | 203.927 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 2.100 |
| Pfund Sterling | Euro | 108.187 | 126.657 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.783 |
| Pfund Sterling | Euro | 8.149 | 9.596 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 87 |
| Pfund Sterling | Euro | 17.358 | 20.406 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 215 |
| Pfund Sterling | Euro | 774 | 918 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 3 |
| Pfund Sterling | Euro | 91.315 | 106.336 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.982 |
| Pfund Sterling | Euro | 59.997 | 71.008 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 344 |
| Pfund Sterling | Euro | 220.154 | 261.767 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 245 |
| Pfund Sterling | Euro | 190 | 226 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - |
| Pfund Sterling | Euro | 8.382 | 9.834 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 120 |
| Pfund Sterling | Euro | 2.755.973 | 3.226.036 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 45.805 |
| | | | | | | GBP 61.376 |
| | | | | | | EUR 73.075 |

Devisenterminkontrakte Forts.

| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|---|----------------|------------|------------|------------------|-----------------------------|-------------------------------------|
| BNY Mellon Absolute Return Equity Fund Anteilsklasse EUR R (Hedged) Forts. | | | | | | |
| Euro | Pfund Sterling | 261.767 | 220.170 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (312) |
| Euro | Pfund Sterling | 39.785 | 33.983 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (560) |
| Euro | Pfund Sterling | 61.046 | 52.151 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (867) |
| Euro | Pfund Sterling | 29.988 | 25.220 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (28) |
| Euro | Pfund Sterling | 38.726.808 | 33.173.128 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (639.028) |
| | | | | | | GBP (640.795) |
| | | | | | | EUR (762.941) |

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

| | | | | | | |
|----------------|----------------|-----------|-----------|-------------|-----------------------------|---------------------|
| Pfund Sterling | Euro | 7.547 | 8.973 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 8 |
| Pfund Sterling | Euro | 12.040 | 14.158 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 146 |
| Pfund Sterling | Euro | 1.953 | 2.296 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 24 |
| | | | | | | GBP 178 |
| | | | | | | EUR 212 |
| Euro | Pfund Sterling | 8.973 | 7.547 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (11) |
| Euro | Pfund Sterling | 2.411.291 | 2.065.496 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (39.789) |
| | | | | | | GBP (39.800) |
| | | | | | | EUR (47.387) |

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

| | | | | | | |
|----------------|----------------|------------|------------|-------------|-----------------------------|------------------|
| Pfund Sterling | Euro | 10.788 | 12.826 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 15 |
| Euro | Pfund Sterling | 220 | 185 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - |
| Pfund Sterling | Euro | 191 | 227 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - |
| Euro | Pfund Sterling | 227 | 191 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - |
| Pfund Sterling | Euro | 185 | 220 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - |
| Pfund Sterling | Euro | 32.001 | 37.446 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 543 |
| Pfund Sterling | Euro | 1.744 | 2.051 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 21 |
| Pfund Sterling | Euro | 55.261 | 64.837 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 792 |
| Pfund Sterling | Euro | 117.959 | 138.712 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.428 |
| Pfund Sterling | Euro | 10.157 | 11.891 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 167 |
| Pfund Sterling | Euro | 5.193 | 6.115 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 56 |
| Pfund Sterling | Euro | 20.890 | 24.558 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 259 |
| Pfund Sterling | Euro | 38.234 | 45.345 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 140 |
| Pfund Sterling | Euro | 16.027 | 18.664 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 348 |
| Pfund Sterling | Euro | 44.160 | 52.507 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 49 |
| Pfund Sterling | Euro | 18.842 | 22.107 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 269 |
| Pfund Sterling | Euro | 52.837 | 61.849 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 878 |
| | | | | | | GBP 4.965 |
| | | | | | | EUR 5.911 |
| Euro | Pfund Sterling | 52.507 | 44.163 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (63) |
| Euro | Pfund Sterling | 12.826 | 10.787 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (12) |
| Euro | Pfund Sterling | 24.194.242 | 20.724.628 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (399.227) |
| Euro | Pfund Sterling | 1.024 | 863 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (3) |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte Forts.

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

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

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

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

Devisenterminkontrakte Forts.

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

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

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

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

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

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

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

BNY MELLON ABSOLUTE RETURN GLOBAL CONVERTIBLE FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

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

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

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

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

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

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

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

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

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

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

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

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte Forts.

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

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

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

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

| | | | | | | |
|----------------|------|---------|---------|-------------|-----------------------------|------------------|
| Pfund Sterling | Euro | 100.551 | 117.403 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 2.113 |
| | | | | | | EUR 2.113 |
| | | | | | | GBP 1.777 |

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

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

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

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

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

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

BNY MELLON ASIAN EQUITY FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

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

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

BNY MELLON ASIAN INCOME FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|---|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| Republik Korea - 194.610 | | | |
| | (31. Dezember 2020: 1.073.801) | 194.610 | 1,30 |
| 16.495 | Macquarie Korea Infrastructure Fund | 194.610 | 1,30 |
| Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen | | 194.610 | 1,30 |
| Aktien | | | |
| Australien - 1.273.553 | | | |
| | (31. Dezember 2020: 4.159.415) | 1.273.553 | 8,50 |
| 50.201 | Dexus (REIT) | 405.812 | 2,71 |
| 139.238 | Insurance Australia Group Ltd | 431.551 | 2,88 |
| 83.086 | Star Entertainment Grp Ltd/The | 221.071 | 1,47 |
| 21.470 | Transurban Group | 215.119 | 1,44 |
| China - 842.361 | | | |
| | (31. Dezember 2020: 1.777.024) | 842.361 | 5,63 |
| 49.417 | By-health Co Ltd | 209.001 | 1,40 |
| 138.341 | Jiangsu Expressway Co Ltd 'H' | 141.652 | 0,95 |
| 58.000 | Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H' | 417.800 | 2,79 |
| 36.000 | Tingyi Cayman Islands Holding Corp | 73.908 | 0,49 |
| Hongkong - 1.936.649 | | | |
| | (31. Dezember 2020: 4.314.897) | 1.936.649 | 12,93 |
| 41.000 | AIA Group Ltd | 413.373 | 2,76 |
| 8.700 | ASM Pacific Technology Ltd | 93.907 | 0,63 |
| 43.500 | CLP Holdings Ltd | 439.555 | 2,93 |
| 6.041 | Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd | 352.931 | 2,36 |
| 72.400 | Link REIT (Units) (REIT) | 636.883 | 4,25 |
| Indien - 1.152.308 | | | |
| | (31. Dezember 2020: 943.031) | 1.152.308 | 7,69 |
| 27.860 | Infosys Ltd ADR | 708.062 | 4,73 |
| 151.104 | ITC Ltd GDR | 444.246 | 2,96 |
| Indonesien - 762.736 | | | |
| | (31. Dezember 2020: 1.056.408) | 762.736 | 5,09 |
| 360.800 | Bank Central Asia Tbk PT | 185.115 | 1,23 |
| 1.138.495 | Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT | 327.909 | 2,19 |
| 879.856 | Telkom Indonesia Persero Tbk PT | 249.712 | 1,67 |
| Neuseeland - 705.032 | | | |
| | (31. Dezember 2020: 2.345.052) | 705.032 | 4,71 |
| 18.763 | Mercury NZ Ltd | 78.125 | 0,52 |
| 59.087 | Meridian Energy Ltd | 196.377 | 1,31 |
| 85.842 | SKYCITY Entertainment Group Ltd | 182.380 | 1,22 |
| 79.615 | Spark New Zealand Ltd | 248.150 | 1,66 |
| Republik Korea - 1.436.637 | | | |
| | (31. Dezember 2020: 3.906.886) | 1.436.637 | 9,59 |
| 20.244 | Samsung Electronics Co Ltd - Preference | 1.213.363 | 8,10 |
| 1.702 | SK Square Co Ltd | 95.140 | 0,63 |
| 2.633 | SK Telecom Co Ltd | 128.134 | 0,86 |
| Singapur - 2.587.373 | | | |
| | (31. Dezember 2020: 7.801.117) | 2.587.373 | 17,27 |
| 95.400 | ComfortDelGro Corp Ltd | 99.298 | 0,66 |
| 32.100 | DBS Group Holdings Ltd | 776.906 | 5,19 |
| 91.100 | Parkway Life Real Estate Investment Trust (Units) (REIT) | 348.243 | 2,33 |
| 142.400 | Singapore Technologies Engineering Ltd | 396.127 | 2,64 |
| 24.700 | United Overseas Bank Ltd | 493.140 | 3,29 |
| 34.900 | Venture Corp Ltd | 473.659 | 3,16 |
| Taiwan - 2.627.833 | | | |
| | (31. Dezember 2020: 5.007.474) | 2.627.833 | 17,54 |
| 42.000 | Delta Electronics Inc | 417.844 | 2,79 |
| 35.000 | Elite Material Co Ltd | 352.315 | 2,35 |
| 31.000 | ITEQ Corp | 158.826 | 1,06 |
| 9.000 | MediaTek Inc | 386.291 | 2,58 |
| 59.000 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | 1.312.557 | 8,76 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|--|---------------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| Aktien Forts. | | | |
| Thailand - 519.216 | | | |
| | (31. Dezember 2020: 1.335.381) | 519.216 | 3,47 |
| 79.800 | Bangkok Bank PCL (Foreign Market) | 289.650 | 1,94 |
| 54.100 | Kasikornbank PCL (Foreign Market) | 229.566 | 1,53 |
| Vereinigtes Königreich - 612.953 | | | |
| | (31. Dezember 2020: 1.020.085) | 612.953 | 4,09 |
| 20.722 | BHP Group Plc | 612.953 | 4,09 |
| Gesamtanlagen in Aktien | | 14.456.651 | 96,51 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 15 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 13) | | 15 | 0,00 |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | 14.651.276 | 97,81 |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (1) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (84)) | | (1) | (0,00) |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | (1) | (0,00) |
| Nettoumlaufvermögen | | 328.471 | 2,19 |
| Summe Nettovermögen | | 14.979.746 | 100,00 |
| Portfolioanalyse | | | |
| | | % des Gesamtvermögens | |
| An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | 97,63 | |
| Derivative OTC-Finanzinstrumente | | 0,00 | |
| Sonstiges Umlaufvermögen | | 2,37 | |
| Gesamtvermögen | | 100,00 | |

BNY MELLON BLOCKCHAIN INNOVATION FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

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

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

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte

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

Devisenterminkontrakte Forts.

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

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

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

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

| | | | | | | | |
|-----------|------|-----|-----|-------------|-----------------------------|------------|-------------|
| US-Dollar | Euro | 117 | 104 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) | |
| | | | | | | USD | (13) |
| | | | | | | EUR | (11) |

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

| | | | | | | | |
|-----------|-----------|---------|---------|-------------|-----------------------------|------------|--------------|
| Euro | US-Dollar | 15.162 | 17.181 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 85 | |
| Euro | US-Dollar | 1.000 | 1.134 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 4 | |
| Euro | US-Dollar | 6.358 | 7.195 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 45 | |
| Euro | US-Dollar | 63.152 | 71.301 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 612 | |
| Euro | US-Dollar | 28.265 | 31.985 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 201 | |
| Euro | US-Dollar | 15.000 | 16.929 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 152 | |
| Euro | US-Dollar | 14.065 | 15.952 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 64 | |
| Euro | US-Dollar | 390.563 | 441.612 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 3.137 | |
| Euro | US-Dollar | 1.000 | 1.136 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 3 | |
| Euro | US-Dollar | 405.127 | 458.477 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 2.856 | |
| | | | | | | USD | 7.159 |
| | | | | | | EUR | 6.288 |
| US-Dollar | Euro | 15.296 | 13.492 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (68) | |
| US-Dollar | Euro | 16.639 | 14.725 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (129) | |
| US-Dollar | Euro | 22.943 | 20.338 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (217) | |
| US-Dollar | Euro | 23.783 | 21.018 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (150) | |
| US-Dollar | Euro | 7.384 | 6.551 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (76) | |
| US-Dollar | Euro | 23.672 | 20.925 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (156) | |
| US-Dollar | Euro | 8.807 | 7.794 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (68) | |
| | | | | | | USD | (864) |
| | | | | | | EUR | (759) |

BNY Mellon Blockchain Innovation Fund Anteilsklasse Sterling E (Acc) (Hedged)

| | | | | | | | |
|----------------|----------------|---------|-----------|-------------|-----------------------------|------------|---------------|
| Pfund Sterling | US-Dollar | 16.017 | 21.482 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 197 | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 6.733 | 9.029 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 85 | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 32.509 | 43.334 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 668 | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 16.529 | 22.044 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 329 | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 952.447 | 1.258.250 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 30.903 | |
| | | | | | | USD | 32.182 |
| | | | | | | GBP | 23.776 |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 19.151 | 14.172 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (31) | |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 45.395 | 34.346 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1.094) | |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 31.805 | 24.014 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (698) | |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 32.787 | 24.678 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (615) | |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 10.075 | 7.618 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (235) | |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 32.547 | 24.569 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (708) | |

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

BNY Mellon Blockchain Innovation Fund Anteilsklasse Sterling E (Acc) (Hedged) Forts.

| | | | | | | | |
|-----------|----------------|--------|-------|-------------|-----------------------------|------------|----------------|
| US-Dollar | Pfund Sterling | 12.155 | 9.160 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (243) | |
| | | | | | | USD | (3.624) |
| | | | | | | GBP | (2.677) |

BNY MELLON BRAZIL EQUITY FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

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

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

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

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

BNY MELLON DYNAMIC FACTOR PREMIA V10 FUND*

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

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

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

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

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

| Bestände | Beschreibung | Zugrunde liegendes Engagement USD | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % |
|---|---|-----------------------------------|----------------------------|-----------------------|
| Offene Terminkontrakte Forts. | | | | |
| 7 | FTSE/JSE Africa Top 40 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2022 | 294.286 | 8.051 | 0,03 |
| (1) | FTSE-Xinhua China A50 Index Short Futures Contracts Exp Jan-2022 | (15.699) | 35 | 0,00 |
| 7 | IBEX 35 Index Long Futures Contracts Exp Jan-2022 | 692.104 | 4.308 | 0,02 |
| 2 | NASDAQ 100 E-Mini Long Futures Contracts Exp Mar-2022 | 652.830 | 16.022 | 0,07 |
| 17 | OMX Stockholm 30 Index Long Futures Contracts Exp Jan-2022 | 455.139 | 18.845 | 0,08 |
| 4 | S&P TSX 60 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2022 | 810.087 | 20.660 | 0,08 |
| 5 | SGX FTSE Taiwan Index Long Futures Contracts Exp Jan-2022 | 320.700 | 1.588 | 0,01 |
| 53 | South Korea Three Year Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2022 | 4.864.631 | 456 | 0,00 |
| 7 | SPI 200 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2022 | 935.430 | 15.516 | 0,06 |
| 23 | Three Month Canadian Bankers' Acceptance Rate Long Futures Contracts Exp Dec-2022 | 4.465.631 | 2.482 | 0,01 |
| 14 | Three Month SONIA Index Long Futures Contracts Exp Dec-2022 | 4.686.027 | 2.826 | 0,01 |
| 4 | TOPIX Index Long Futures Contracts Exp Mar-2022 | 692.689 | 1.554 | 0,01 |
| 9 | U.S. Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2022 | 1.443.938 | 3.547 | 0,01 |
| 4 | U.S. Treasury Ultra Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2022 | 788.500 | 3.555 | 0,01 |
| Offene Terminkontrakte insgesamt | | | 345.671 | 1,40 |

Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 249.524 (siehe unten)

| | | | |
|--|--|-------------------|--------------|
| | | 249.524 | 1,01 |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | 22.671.147 | 91,60 |

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

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

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

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

Offene Terminkontrakte insgesamt (120.124) (0,49)

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

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

Nettoumlaufvermögen 2.388.319 9,66

Summe Nettovermögen 24.751.005 100,00

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

*Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Der Kontrahent für Aktien-Swaps ist Goldman Sachs.

Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist Goldman Sachs.

Der Kontrahent für Credit Default Swaps ist Goldman Sachs.

Portfolioanalyse % des Gesamtvermögens

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

Devisenterminkontrakte

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

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte Forts.

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Devisenterminkontrakte Forts.

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

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

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

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

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

BNY MELLON DYNAMIC U.S. EQUITY FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

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

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

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

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

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

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

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

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

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

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

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Zugrunde liegendes Engagement USD | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % |
|--|--|-----------------------------------|----------------------------|-----------------------|
| Offene Terminkontrakte - 2.927.226 (31. Dezember 2020: 881.377) | | | | |
| 408 | E-mini S&P 500 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2022 | 97.073.400 | 2.576.346 | 0,40 |
| 215 | U.S. Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2022 | 34.494.063 | 350.880 | 0,05 |
| Offene Terminkontrakte insgesamt | | | 2.927.226 | 0,45 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 40.477 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 225.847) | | | | |
| | | | 40.477 | 0,01 |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | | 610.316.339 | 94,49 |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (37) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (8.127)) | | | | |
| | | | (37) | (0,00) |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | | (37) | (0,00) |
| Nettoumlaufvermögen | | | 35.607.812 | 5,51 |
| Summe Nettovermögen | | | 645.924.114 | 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 | | | | 89,70 |
| An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente | | | | 3,40 |
| Derivative OTC-Finanzinstrumente | | | | 0,01 |
| Sonstiges Umlaufvermögen | | | | 6,89 |
| Gesamtvermögen | | | | 100,00 |

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

BNY MELLON EFFICIENT GLOBAL HIGH YIELD BETA FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % | Summe Nettover- Zeitwert USD | Summe mög- en % | Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mög- en % |
|---------------------------------------|--------------------------|---------------------------------------|--------------------------|---------------------------------------|--|----------------------------------|---------------------------------------|
| Anleihen | | | | Anleihen Forts. | | | |
| Euro - 38.737.815 | | | | Euro Forts. | | | |
| (31. Dezember 2020: 5.075.050) | | | | (31. Dezember 2020: 5.075.050) | | | |
| 100.000 | | 116.320 | 0,06 | 100.000 | Banco de Sabadell SA 'EMTN' FRN 5.375% 12-Dec-2028 | 123.168 | 0,06 |
| 100.000 | | 118.874 | 0,06 | 100.000 | Banco de Sabadell SA FRN 2.000% 17-Jan-2030 | 112.140 | 0,06 |
| 100.000 | | 120.759 | 0,06 | 100.000 | Banijay Entertainment SASU 'REGS' 3.500% 01-Mar-2025 | 114.823 | 0,06 |
| 100.000 | | 116.084 | 0,06 | 100.000 | Banijay Group SAS 'REGS' 6.500% 01-Mar-2026 | 118.692 | 0,06 |
| 100.000 | | 115.262 | 0,06 | 100.000 | Bayer AG FRN 2.375% 12-Nov-2079 | 114.088 | 0,06 |
| 100.000 | | 116.585 | 0,06 | 100.000 | Bayer AG FRN 3.125% 12-Nov-2079 | 115.891 | 0,06 |
| 100.000 | | 115.660 | 0,06 | 100.000 | Bayer AG FRN 3.750% 01-Jul-2074 | 118.279 | 0,06 |
| 100.000 | | 94.979 | 0,05 | 100.000 | Bayer AG FRN 3.750% 01-Jul-2074 | 118.279 | 0,06 |
| 100.000 | | 96.437 | 0,05 | 100.000 | BCPV Modular Services Finance II Plc 'REGS' 4.750% 30-Nov-2028 | 115.207 | 0,06 |
| 100.000 | | 99.420 | 0,05 | 100.000 | Belden Inc 'REGS' 4.125% 15-Oct-2026 | 116.156 | 0,06 |
| 100.000 | | 107.667 | 0,06 | 100.000 | Bertelsmann SE & Co KGaA FRN 3.500% 23-Apr-2075 | 121.668 | 0,06 |
| 100.000 | | 116.001 | 0,06 | 100.000 | BK LC Lux Finco1 Sarl 'REGS' 5.250% 30-Apr-2029 | 118.048 | 0,06 |
| 100.000 | | 120.255 | 0,06 | 100.000 | Boxer Parent Co Inc 'REGS' 6.500% 02-Oct-2025 | 119.609 | 0,06 |
| 100.000 | | 119.098 | 0,06 | 100.000 | BPER Banca 'EMTN' FRN 3.625% 30-Nov-2030 | 118.267 | 0,06 |
| 100.000 | | 111.695 | 0,06 | 100.000 | British American Tobacco Plc FRN (Perpetual) 3.000% 27-Sep-2026 | 111.717 | 0,06 |
| 100.000 | | 110.584 | 0,06 | 100.000 | British American Tobacco Plc FRN (Perpetual) 3.750% 27-Jun-2029 | 111.600 | 0,06 |
| 100.000 | | 111.561 | 0,06 | 100.000 | CAB SELAS 'REGS' 3.375% 01-Feb-2028 | 114.111 | 0,06 |
| 100.000 | | 107.944 | 0,06 | 100.000 | Canpack SA / Canpack US LLC 'REGS' 2.375% 01-Nov-2027 | 114.758 | 0,06 |
| 100.000 | | 108.584 | 0,06 | 100.000 | Carnival Corp 'REGS' 7.625% 01-Mar-2026 | 119.799 | 0,06 |
| 100.000 | | 120.821 | 0,06 | 100.000 | Casino Guichard Perrachon SA 'EMTN' 3.580% 07-Feb-2025 | 110.043 | 0,06 |
| 100.000 | | 112.538 | 0,06 | 100.000 | Casino Guichard Perrachon SA 'EMTN' 4.498% 07-Mar-2024 | 115.108 | 0,06 |
| 100.000 | | 111.058 | 0,06 | 100.000 | Castellum AB FRN (Perpetual) 3.125% 02-Dec-2026 | 108.959 | 0,06 |
| 100.000 | | 113.444 | 0,06 | 100.000 | Catalent Pharma Solutions Inc 'REGS' 2.375% 01-Mar-2028 | 114.050 | 0,06 |
| 100.000 | | 119.398 | 0,06 | 100.000 | Cellnex Finance Co SA 'EMTN' 1.250% 15-Jan-2029 | 108.793 | 0,06 |
| 200.000 | | 241.421 | 0,13 | 100.000 | Cellnex Finance Co SA 'EMTN' 1.500% 08-Jun-2028 | 111.726 | 0,06 |
| 100.000 | | 117.417 | 0,06 | 200.000 | Cellnex Finance Co SA 'EMTN' 2.000% 15-Feb-2033 | 216.797 | 0,11 |
| 100.000 | | 111.953 | 0,06 | 100.000 | Cellnex Telecom SA 1.000% 20-Apr-2027 | 111.357 | 0,06 |
| 100.000 | | 111.613 | 0,06 | 100.000 | Cellnex Telecom SA 'EMTN' 1.750% 23-Oct-2030 | 109.648 | 0,06 |
| 100.000 | | 107.759 | 0,06 | 100.000 | Cellnex Telecom SA 'EMTN' 2.375% 16-Jan-2024 | 118.264 | 0,06 |
| 100.000 | | 116.941 | 0,06 | 100.000 | Centurion Bidco SpA 'REGS' 5.875% 30-Sep-2026 | 117.594 | 0,06 |
| 100.000 | | 117.641 | 0,06 | 100.000 | CGG SA 'REGS' 7.750% 01-Apr-2027 | 113.200 | 0,06 |
| 100.000 | | 118.096 | 0,06 | 100.000 | Chemours Co/The 4.000% 15-May-2026 | 115.787 | 0,06 |
| 100.000 | | 117.801 | 0,06 | 100.000 | Cheplapharm Arzneimittel GmbH 'REGS' 4.375% 15-Jan-2028 | 119.112 | 0,06 |
| 100.000 | | 117.456 | 0,06 | 100.000 | Cirsa Finance International Sarl 'REGS' 4.750% 22-May-2025 | 113.433 | 0,06 |
| 100.000 | | 128.093 | 0,07 | 100.000 | Citycon Oyj FRN (Perpetual) 4.496% 24-Nov-2024 | 113.706 | 0,06 |
| 100.000 | | 116.726 | 0,06 | 100.000 | Clarios Global LP / Clarios US Finance Co 'REGS' 4.375% 15-May-2026 | 117.117 | 0,06 |
| 100.000 | | 116.142 | 0,06 | 100.000 | CMA CGM SA 'REGS' 7.500% 15-Jan-2026 | 125.643 | 0,07 |
| 100.000 | | 114.794 | 0,06 | 20.000 | Commerzbank AG 'EMTN' 4.000% 23-Mar-2026 | 25.200 | 0,01 |
| 100.000 | | 111.127 | 0,06 | 15.000 | Commerzbank AG 'EMTN' 4.000% 30-Mar-2027 | 19.165 | 0,01 |
| 100.000 | | 114.284 | 0,06 | 100.000 | Commerzbank AG 'EMTN' FRN 4.000% 05-Dec-2030 | 124.396 | 0,07 |
| 100.000 | | 116.141 | 0,06 | 100.000 | Constellium SE 'REGS' 3.125% 15-Jul-2029 | 113.065 | 0,06 |
| 100.000 | | 123.091 | 0,06 | 200.000 | ContourGlobal Power Holdings SA 'REGS' 4.125% 01-Aug-2025 | 231.811 | 0,12 |
| 100.000 | | 115.743 | 0,06 | 150.000 | Coty Inc 'REGS' 3.875% 15-Apr-2026 | 174.662 | 0,09 |
| 100.000 | | 118.514 | 0,06 | 100.000 | Coty Inc 'REGS' 4.000% 15-Apr-2023 | 114.336 | 0,06 |
| 100.000 | | 121.832 | 0,06 | 100.000 | CPI Property Group SA FRN (Perpetual) 4.875% 18-Aug-2026 | 116.856 | 0,06 |
| 100.000 | | 113.107 | 0,06 | 100.000 | Credit Bank of Moscow Via CBOM Finance Plc 'REGS' 3.100% 21-Jan-2026 | 109.346 | 0,06 |
| 100.000 | | 118.500 | 0,06 | 100.000 | Credito Emiliano Holding SpA FRN 3.500% 16-Dec-2030 | 118.225 | 0,06 |
| 100.000 | | 130.687 | 0,07 | 100.000 | Crown European Holdings SA 'REGS' 3.375% 15-May-2025 | 121.350 | 0,06 |
| | | | | 100.000 | CT Investment GmbH 'REGS' 5.500% 15-Apr-2026 | 115.410 | 0,06 |
| | | | | 100.000 | Deutsche Bank AG 'EMTN' 4.500% 19-May-2026 | 130.267 | 0,07 |
| | | | | 100.000 | Deutsche Bank AG 'EMTN' FRN 5.625% 19-May-2031 | 133.685 | 0,07 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

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

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

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

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

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

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

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

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

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

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

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

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

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

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

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

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

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

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

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

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

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

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

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

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

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

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

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

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

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

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

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

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

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

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

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

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

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

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

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

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

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

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

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

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

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

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

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

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

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

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

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

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

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

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

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

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

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

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

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % |
|--|--|----------------------------|-----------------------|
| Credit Default Swaps Forts. | | | |
| (700.000) | CDS iTraxx Europe Crossover Series 36 Version 1 Index 5.000% 20-Dec-2026 | 94.476 | 0,05 |
| Credit Default Swaps insgesamt | | 462.608 | 0,24 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 3.415.514 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 24.869) | | | |
| | | 3.415.514 | 1,79 |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | 187.835.232 | 98,19 |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (363.707) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (43.183)) | | | |
| | | (363.707) | (0,19) |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | (363.707) | (0,19) |
| Nettoumlaufvermögen | | 3.827.135 | 2,00 |
| Summe Nettovermögen | | 191.298.660 | 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 | 95,86 |
| Derivative OTC-Finanzinstrumente | 2,02 |
| Sonstiges Umlaufvermögen | 2,12 |
| 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 | 660.000 | 746.669 | 14. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | 4.898 | |
| | | | | | | USD | 4.898 |
| US-Dollar | Euro | 39.511.126 | 34.914.000 | 14. Jan. 22 | Goldman Sachs | (246.721) | |
| US-Dollar | Euro | 136.488 | 120.000 | 14. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | (160) | |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 4.387.605 | 3.315.000 | 14. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | (99.306) | |
| | | | | | | USD | (346.187) |

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

| | | | | | | | |
|----------------|-----------|---------|--------|-------------|-----------------------------|------------|------------|
| Dänische Krone | US-Dollar | 106.561 | 16.212 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 105 | |
| | | | | | | USD | 105 |
| | | | | | | DKK | 686 |

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

| | | | | | | | |
|-----------|-----------|------------|------------|-------------|-----------------------------|------------|----------------|
| Euro | US-Dollar | 15.075 | 17.064 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 99 | |
| Euro | US-Dollar | 997 | 1.129 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 6 | |
| Euro | US-Dollar | 3.605 | 4.096 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 9 | |
| Euro | US-Dollar | 56.063.608 | 63.446.476 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 395.202 | |
| Euro | US-Dollar | 1.581 | 1.793 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 7 | |
| Euro | US-Dollar | 1.836.659 | 2.072.796 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 18.675 | |
| Euro | US-Dollar | 480 | 540 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 7 | |
| Euro | US-Dollar | 1.127 | 1.279 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 5 | |
| Euro | US-Dollar | 3.224 | 3.633 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 39 | |
| Euro | US-Dollar | 47.772 | 53.970 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 430 | |
| Euro | US-Dollar | 522 | 592 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 3 | |
| Euro | US-Dollar | 5.101 | 5.775 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 33 | |
| | | | | | | USD | 414.515 |
| | | | | | | EUR | 364.088 |
| US-Dollar | Euro | 5.774 | 5.101 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (34) | |
| US-Dollar | Euro | 2.426 | 2.145 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (17) | |
| US-Dollar | Euro | 3.155 | 2.777 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (7) | |
| US-Dollar | Euro | 383 | 338 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) | |
| US-Dollar | Euro | 7.531 | 6.673 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (68) | |
| US-Dollar | Euro | 3.479 | 3.079 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (27) | |
| US-Dollar | Euro | 7.031 | 6.240 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (75) | |
| US-Dollar | Euro | 1.381 | 1.218 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (7) | |
| US-Dollar | Euro | 1.129 | 997 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (6) | |
| US-Dollar | Euro | 17.068 | 15.075 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (99) | |
| | | | | | | USD | (341) |
| | | | | | | EUR | (300) |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Devisenterminkontrakte Forts. | | | | | | | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|---|-----------|------------|------------|------------------|-----------------------------|------------|-------------------------------------|
| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | | |
| BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR E (Inc) (Hedged) | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 11.732 | 13.277 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 83 |
| | | | | | | USD | 83 |
| | | | | | | EUR | 73 |
| BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged) | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 10.636 | 12.036 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 75 |
| | | | | | | USD | 75 |
| | | | | | | EUR | 66 |
| BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR H (Inc) (Hedged) | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 11.691 | 13.231 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 82 |
| | | | | | | USD | 82 |
| | | | | | | EUR | 72 |
| BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged) | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 10.662 | 12.066 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 75 |
| | | | | | | USD | 75 |
| | | | | | | EUR | 66 |
| BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged) | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 11.718 | 13.261 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 83 |
| | | | | | | USD | 83 |
| | | | | | | EUR | 73 |
| BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse NOK W (Acc) (Hedged) | | | | | | | |
| Norwegische Krone | US-Dollar | 107.434 | 11.935 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 262 |
| | | | | | | USD | 262 |
| | | | | | | NOK | 2.307 |
| BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse SEK W (Acc) (Hedged) | | | | | | | |
| Schwedische Krone | US-Dollar | 107.028 | 11.826 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 19 |
| | | | | | | USD | 19 |
| | | | | | | SEK | 172 |
| BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling E (Acc) (Hedged) | | | | | | | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 15.165 | 20.340 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 187 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 1.007 | 1.360 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 4 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 26.978 | 35.684 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 831 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 18.401 | 24.835 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 72 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 64.313 | 85.386 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 1.662 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 39.573 | 52.306 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 1.257 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 108.749 | 143.856 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 3.338 |

| Devisenterminkontrakte Forts. | | | | | | | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|--|----------------|------------|------------|------------------|-----------------------------|------------|-------------------------------------|
| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | | |
| BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling E (Acc) (Hedged) Forts. | | | | | | | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 36.138 | 47.947 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 966 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 79.982 | 106.611 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 1.646 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 39.216 | 51.914 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 1.165 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 35.004 | 46.233 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 1.146 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 27.225 | 36.132 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 717 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 38.339 | 51.239 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 653 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 22.742 | 30.522 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 260 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 33.545.887 | 44.316.502 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 1.088.446 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 57.610 | 76.242 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 1.734 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 26.579 | 35.649 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 326 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 41.571 | 55.800 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 467 |
| | | | | | | USD | 1.104.877 |
| | | | | | | GBP | 816.281 |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 35.648 | 26.579 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (328) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 24.834 | 18.401 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (73) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 17.683 | 13.369 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (412) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 20.341 | 15.165 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (186) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 1.360 | 1.007 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (4) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 68.759 | 51.789 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (1.338) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 31.701 | 23.984 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (762) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 60.210 | 45.516 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (1.397) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 9.903 | 7.464 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (200) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 59.490 | 44.938 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (1.335) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 104.305 | 78.972 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (2.585) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 28.983 | 21.838 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (575) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 25.048 | 18.742 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (319) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 33.780 | 25.169 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (288) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 16.985 | 12.834 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (386) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 13.711 | 10.287 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (212) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 1.671 | 1.245 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (14) |
| | | | | | | USD | (10.414) |
| | | | | | | GBP | (7.694) |
| BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling E (Inc) (Hedged) | | | | | | | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 79 | 106 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 1 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 42 | 57 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | - |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 5.497 | 7.270 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 169 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 24.188.408 | 31.954.607 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 784.829 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 140 | 186 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 4 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 6 | 8 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | - |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 402 | 531 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 12 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 4.086 | 5.401 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 130 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 4.241 | 5.631 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 110 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 4 | 5 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | - |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte Forts.

| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|--|----------------|------------|------------|------------------|-----------------------------|-------------------------------------|
| BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling E (Inc) (Hedged) Forts. | | | | | | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 167 | 225 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 6.532 | 8.761 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 80 |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 57 | 42 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 4 | 3 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 5 | 4 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 26 | 20 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - |
| USD | | | | | | 785.336 |
| GBP | | | | | | 580.205 |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 8.760 | 6.532 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (81) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 225 | 167 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 47 | 35 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (11) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 647 | 482 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (5) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 5.143 | 3.848 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (65) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 95 | 72 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (2) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 232 | 176 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (6) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 134 | 101 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (2) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 77 | 58 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (2) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 20.092 | 15.189 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (466) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 441 | 333 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (11) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 1.564 | 1.178 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (30) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 106 | 79 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) |
| USD | | | | | | (673) |
| GBP | | | | | | (497) |

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

| | | | | | | |
|----------------|-----------|------------|------------|-------------|-----------------------------|-----------|
| Pfund Sterling | US-Dollar | 1.963 | 2.633 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 24 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 2.377 | 3.207 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 9 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 49.356 | 65.284 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.520 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 8.874 | 11.903 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 109 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 8.060 | 10.877 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 31 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 20.562 | 27.300 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 531 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 40.764 | 53.880 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.295 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 24.953 | 33.009 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 766 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 46.985 | 62.339 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.256 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 23.406 | 31.198 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 482 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 33.605 | 44.385 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.100 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 20.115 | 26.696 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 530 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 35.496 | 47.439 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 605 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 18.922 | 25.395 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 216 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 32.520.678 | 42.962.129 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.055.182 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 11.565 | 15.305 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 348 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 17.405 | 23.040 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 517 |

Devisenterminkontrakte Forts.

| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|--|----------------|------------|------------|------------------|-----------------------------|-------------------------------------|
| BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged) Forts. | | | | | | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 30.132 | 40.445 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 339 |
| USD | | | | | | 1.064.860 |
| GBP | | | | | | 786.716 |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 11.902 | 8.874 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (110) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 10.877 | 8.060 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (32) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 23.476 | 17.748 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (546) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 2.633 | 1.963 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (24) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 3.208 | 2.377 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (9) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 11.208 | 8.442 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (218) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 10.488 | 7.935 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (252) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 23.317 | 17.627 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (541) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 40.388 | 30.441 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (814) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 11.720 | 8.853 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (263) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 43.248 | 32.744 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1.072) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 28.462 | 21.445 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (565) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 18.110 | 13.550 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (231) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 42.355 | 31.559 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (361) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 15.497 | 11.710 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (352) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 18.186 | 13.643 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (281) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 46.081 | 34.331 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (386) |
| USD | | | | | | (6.057) |
| GBP | | | | | | (4.475) |

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

| | | | | | | |
|----------------|----------------|-----------|-----------|-------------|-----------------------------|---------------|
| Pfund Sterling | US-Dollar | 30 | 41 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 1.212.481 | 1.601.774 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 39.341 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 38.678 | 51.692 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 659 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 2.321 | 3.080 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 61 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 400 | 528 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 13 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 380 | 513 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 15.011 | 20.149 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 169 |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 11 | 8 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 16 | 12 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 41 | 30 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - |
| USD | | | | | | 40.244 |
| GBP | | | | | | 29.732 |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 513 | 380 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 393 | 297 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (9) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 168 | 127 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (4) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 65 | 49 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 806 | 609 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (19) |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte Forts.

| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungs- datum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) |
|--|----------------|---------------|---------------|-----------------------|--------------------------------|---|
| BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling W (Inc) (Hedged) Forts. | | | | | | |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 82 | 61 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) |
| | | | | | | USD (35) |
| | | | | | | GBP (26) |

BNY MELLON EFFICIENT GLOBAL IG CORPORATE BETA FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|---------------------------------------|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen | | | |
| Kanadischer Dollar - 825.419 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.695.026) | | 825.419 | 3,99 |
| 5.000 | 407 International Inc 3.830% 11-May-2046 | 4.475 | 0,02 |
| 5.000 | 407 International Inc 5.750% 14-Feb-2036 | 5.059 | 0,02 |
| 5.000 | 407 International Inc 'MTN' 2.840% 07-Mar-2050 | 3.801 | 0,02 |
| 5.000 | 407 International Inc 'MTN' 4.680% 07-Oct-2053 | 5.193 | 0,02 |
| 15.000 | 407 International Inc 'MTN' 5.960% 03-Dec-2035 | 16.135 | 0,08 |
| 5.000 | 55 Ontario School Board Trust/The 5.900% 02-Jun-2033 | 5.281 | 0,03 |
| 10.000 | Algonquin Power Co 4.090% 17-Feb-2027 | 8.578 | 0,04 |
| 10.000 | AltaLink LP 'MTN' 2.747% 29-May-2026 | 8.220 | 0,04 |
| 5.000 | AltaLink LP 'MTN' 4.090% 30-Jun-2045 | 4.699 | 0,02 |
| 5.000 | Anheuser-Busch InBev Finance Inc 4.320% 15-May-2047 | 4.338 | 0,02 |
| 10.000 | Bank of Montreal 2.280% 29-Jul-2024 | 8.028 | 0,04 |
| 10.000 | Bank of Montreal 3.190% 01-Mar-2028 | 8.464 | 0,04 |
| 10.000 | Bank of Montreal FRN 2.880% 17-Sep-2029 | 8.095 | 0,04 |
| 5.000 | Bank of Montreal 'MTN' 2.370% 03-Feb-2025 | 4.021 | 0,02 |
| 5.000 | Bank of Nova Scotia/The 2.160% 03-Feb-2025 | 3.998 | 0,02 |
| 15.000 | Bank of Nova Scotia/The 2.380% 01-May-2023 | 12.027 | 0,06 |
| 5.000 | Bank of Nova Scotia/The 3.100% 02-Feb-2028 | 4.211 | 0,02 |
| 5.000 | Bank of Nova Scotia/The FRN 2.836% 03-Jul-2029 | 4.039 | 0,02 |
| 10.000 | Bank of Nova Scotia/The FRN 3.890% 18-Jan-2029 | 8.239 | 0,04 |
| 10.000 | Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada/The 'MTN' 3.350% 12-Mar-2025 | 8.233 | 0,04 |
| 15.000 | Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada/The 'MTN' 6.170% 26-Feb-2037 | 15.621 | 0,07 |
| 10.000 | Brookfield Infrastructure Finance ULC 'MTN' 3.410% 09-Oct-2029 | 8.247 | 0,04 |
| 10.000 | Brookfield Property Finance ULC 'MTN' 4.300% 01-Mar-2024 | 8.075 | 0,04 |
| 10.000 | Brookfield Renewable Partners ULC 'MTN' 3.630% 15-Jan-2027 | 8.415 | 0,04 |
| 10.000 | Bruce Power LP 3.969% 23-Jun-2026 | 8.497 | 0,04 |
| 2.000 | Cameco Corp 2.950% 21-Oct-2027 | 1.597 | 0,01 |
| 10.000 | Canadian Imperial Bank of Commerce 2.000% 17-Apr-2025 | 7.951 | 0,04 |
| 5.000 | Canadian Imperial Bank of Commerce 2.970% 11-Jul-2023 | 4.059 | 0,02 |
| 10.000 | Canadian Imperial Bank of Commerce 3.290% 15-Jan-2024 | 8.181 | 0,04 |
| 5.000 | Canadian Imperial Bank of Commerce FRN 2.010% 21-Jul-2030 | 3.937 | 0,02 |
| 10.000 | Canadian Imperial Bank of Commerce FRN 3.450% 04-Apr-2028 | 8.091 | 0,04 |
| 5.000 | Canadian National Railway Co 3.050% 08-Feb-2050 | 3.898 | 0,02 |
| 5.000 | Canadian Tire Corp Ltd 'MTN' 6.570% 24-Feb-2034 | 4.978 | 0,02 |
| 10.000 | Canadian Western Bank 2.597% 06-Sep-2024 | 8.060 | 0,04 |
| 15.000 | Cenovus Energy Inc 3.550% 12-Mar-2025 | 12.310 | 0,06 |
| 2.000 | CGI Inc 2.100% 18-Sep-2028 | 1.553 | 0,01 |
| 20.000 | Choice Properties Real Estate Investment Trust 2.981% 04-Mar-2030 | 16.024 | 0,08 |
| 10.000 | Choice Properties Real Estate Investment Trust 4.178% 08-Mar-2028 | 8.647 | 0,04 |
| 5.000 | Choice Properties Real Estate Investment Trust 4.293% 08-Feb-2024 | 4.139 | 0,02 |
| 5.000 | CU Inc 2.963% 07-Sep-2049 | 3.904 | 0,02 |
| 5.000 | CU Inc 3.964% 27-Jul-2045 | 4.559 | 0,02 |
| 5.000 | CU Inc 4.543% 24-Oct-2041 | 4.852 | 0,02 |
| 5.000 | CU Inc 4.722% 09-Sep-2043 | 4.996 | 0,02 |
| 10.000 | Emera Inc 2.900% 16-Jun-2023 | 8.061 | 0,04 |
| 5.000 | Enbridge Gas Inc 'MTN' 4.200% 02-Jun-2044 | 4.655 | 0,02 |
| 5.000 | Enbridge Gas Inc 'MTN' 4.500% 23-Nov-2043 | 4.828 | 0,02 |
| 10.000 | Enbridge Gas Inc 'MTN' 4.880% 21-Jun-2041 | 9.953 | 0,05 |
| 10.000 | Enbridge Pipelines Inc 'MTN' 5.080% 19-Dec-2036 | 9.203 | 0,04 |
| 5.000 | Energir Inc 3.530% 16-May-2047 | 4.360 | 0,02 |
| 10.000 | Fairfax Financial Holdings Ltd 4.250% 06-Dec-2027 | 8.472 | 0,04 |
| 5.000 | First Capital Real Estate Investment Trust 4.790% 30-Aug-2024 | 4.205 | 0,02 |
| 5.000 | Greater Toronto Airports Authority 'MTN' 5.300% 25-Feb-2041 | 5.319 | 0,03 |
| 5.000 | Great-West Lifeco Inc 3.337% 28-Feb-2028 | 4.208 | 0,02 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|----------------------------------|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Kanadischer Dollar Forts. | | | |
| 5.000 | Great-West Lifeco Inc 6.670% 21-Mar-2033 | 5.433 | 0,03 |
| 5.000 | Great-West Lifeco Inc 6.740% 24-Nov-2031 | 5.341 | 0,03 |
| 5.000 | Honda Canada Finance Inc 2.500% 04-Jun-2024 | 4.033 | 0,02 |
| 10.000 | Honda Canada Finance Inc 3.444% 23-May-2025 | 8.320 | 0,04 |
| 15.000 | HSBC Bank Canada 3.245% 15-Sep-2023 | 12.224 | 0,06 |
| 5.000 | Hydro One Inc 7.350% 03-Jun-2030 | 5.402 | 0,03 |
| 5.000 | Hydro One Inc 'MTN' 2.540% 05-Apr-2024 | 4.047 | 0,02 |
| 10.000 | Hydro One Inc 'MTN' 3.630% 25-Jun-2049 | 8.828 | 0,04 |
| 5.000 | Hydro One Inc 'MTN' 3.720% 18-Nov-2047 | 4.455 | 0,02 |
| 5.000 | Hydro One Inc 'MTN' 6.590% 22-Apr-2043 | 6.173 | 0,03 |
| 5.000 | IGM Financial Inc 4.206% 21-Mar-2050 | 4.584 | 0,02 |
| 5.000 | Inter Pipeline Ltd/AB 'MTN' 2.608% 13-Sep-2023 | 3.998 | 0,02 |
| 15.000 | Inter Pipeline Ltd/AB 'MTN' 4.637% 30-May-2044 | 11.863 | 0,06 |
| 10.000 | John Deere Financial Inc 2.410% 14-Jan-2025 | 8.062 | 0,04 |
| 5.000 | Loblaw Cos Ltd 4.488% 11-Dec-2028 | 4.461 | 0,02 |
| 5.000 | Loblaw Cos Ltd 'MTN' 5.900% 18-Jan-2036 | 5.031 | 0,02 |
| 5.000 | Macquarie Group Ltd FRN 2.723% 21-Aug-2029 | 3.933 | 0,02 |
| 15.000 | Manulife Financial Corp FRN 2.818% 13-May-2035 | 12.021 | 0,06 |
| 10.000 | Metropolitan Life Global Funding I 1.950% 20-Mar-2028 | 7.785 | 0,04 |
| 10.000 | Molson Coors International LP 3.440% 15-Jul-2026 | 8.204 | 0,04 |
| 10.000 | Mondelez International Inc 3.250% 07-Mar-2025 | 8.230 | 0,04 |
| 10.000 | National Bank of Canada 2.983% 04-Mar-2024 | 8.141 | 0,04 |
| 10.000 | NAV Canada 7.400% 01-Jun-2027 | 10.034 | 0,05 |
| 5.000 | North West Redwater Partnership / NWR Financing Co Ltd 4.350% 10-Jan-2039 | 4.472 | 0,02 |
| 5.000 | Pembina Pipeline Corp 4.020% 27-Mar-2028 | 4.247 | 0,02 |
| 10.000 | Pembina Pipeline Corp 4.750% 26-Mar-2048 | 8.634 | 0,04 |
| 10.000 | Pembina Pipeline Corp 'MTN' 3.310% 01-Feb-2030 | 8.125 | 0,04 |
| 10.000 | Pembina Pipeline Corp 'MTN' 4.740% 21-Jan-2047 | 8.604 | 0,04 |
| 10.000 | RioCan Real Estate Investment Trust 3.287% 12-Feb-2024 | 8.136 | 0,04 |
| 5.000 | Rogers Communications Inc 3.250% 01-May-2029 | 4.065 | 0,02 |
| 10.000 | Rogers Communications Inc 3.650% 31-Mar-2027 | 8.320 | 0,04 |
| 5.000 | Rogers Communications Inc 4.000% 13-Mar-2024 | 4.120 | 0,02 |
| 5.000 | Rogers Communications Inc 'MTN' 6.560% 22-Mar-2041 | 5.275 | 0,02 |
| 15.000 | Royal Bank of Canada 2.328% 28-Jan-2027 | 11.997 | 0,06 |
| 5.000 | Royal Bank of Canada 2.352% 02-Jul-2024 | 4.022 | 0,02 |
| 15.000 | Royal Bank of Canada 2.609% 01-Nov-2024 | 12.144 | 0,06 |
| 5.000 | Royal Bank of Canada 3.296% 26-Sep-2023 | 4.080 | 0,02 |
| 10.000 | Royal Bank of Canada FRN 2.880% 23-Dec-2029 | 8.101 | 0,04 |
| 10.000 | Shaw Communications Inc 4.350% 31-Jan-2024 | 8.274 | 0,04 |
| 5.000 | Shaw Communications Inc 6.750% 09-Nov-2039 | 5.285 | 0,03 |
| 5.000 | Sun Life Assurance Co of Canada 6.300% 15-May-2028 | 4.820 | 0,02 |
| 5.000 | Sun Life Financial Inc 'MTN' FRN 5.400% 29-May-2042 | 5.038 | 0,02 |
| 15.000 | Suncor Energy Inc 'MTN' 5.000% 09-Apr-2030 | 13.703 | 0,07 |
| 10.000 | Sysco Canada Inc 3.650% 25-Apr-2025 | 8.299 | 0,04 |
| 10.000 | TCHC Issuer Trust 4.877% 11-May-2037 | 10.031 | 0,05 |
| 5.000 | TELUS Corp 3.150% 19-Feb-2030 | 4.092 | 0,02 |
| 5.000 | TELUS Corp 5.150% 26-Nov-2043 | 4.717 | 0,02 |
| 15.000 | TELUS Corp 'MTN' 3.350% 01-Apr-2024 | 12.255 | 0,06 |
| 5.000 | TELUS Corp 'MTN' 4.400% 29-Jan-2046 | 4.304 | 0,02 |
| 2.000 | Teranet Holdings LP 5.754% 17-Dec-2040 | 1.945 | 0,01 |
| 5.000 | TMX Group Ltd 4.461% 03-Oct-2023 | 4.139 | 0,02 |
| 5.000 | Toronto-Dominion Bank/The 1.943% 13-Mar-2025 | 3.972 | 0,02 |
| 10.000 | Toronto-Dominion Bank/The 2.496% 02-Dec-2024 | 8.078 | 0,04 |
| 10.000 | Toronto-Dominion Bank/The 'MTN' FRN 3.060% 26-Jan-2032 | 8.173 | 0,04 |
| 5.000 | Toronto-Dominion Bank/The 'MTN' FRN 3.105% 22-Apr-2030 | 4.083 | 0,02 |
| 10.000 | Toronto-Dominion Bank/The 'MTN' FRN 3.224% 25-Jul-2029 | 8.164 | 0,04 |
| 10.000 | Toronto-Dominion Bank/The 'MTN' FRN 3.589% 14-Sep-2028 | 8.161 | 0,04 |
| 10.000 | TransCanada PipeLines Ltd 3.800% 05-Apr-2027 | 8.452 | 0,04 |
| 10.000 | TransCanada PipeLines Ltd 'MTN' 3.390% 15-Mar-2028 | 8.299 | 0,04 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|--|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Kanadischer Dollar Forts. | | | |
| 10.000 | TransCanada PipeLines Ltd 'MTN' 4.350% 06-Jun-2046 | 8.441 | 0,04 |
| 10.000 | United Parcel Service Inc 2.125% 21-May-2024 | 8.009 | 0,04 |
| 10.000 | Ventas Canada Finance Ltd 2.800% 12-Apr-2024 | 8.072 | 0,04 |
| 5.000 | Ventas Canada Finance Ltd 4.125% 30-Sep-2024 | 4.166 | 0,02 |
| 15.000 | VW Credit Canada Inc 2.850% 26-Sep-2024 | 12.189 | 0,06 |
| 10.000 | Wells Fargo & Co 2.975% 19-May-2026 | 8.176 | 0,04 |
| 10.000 | Wells Fargo & Co 3.184% 08-Feb-2024 | 8.148 | 0,04 |
| Euro - 4.725.066 | | | |
| (31. Dezember 2020: 10.438.007) | | 4.725.066 | 22,84 |
| 10.000 | ABN AMRO Bank NV 'EMTN' 1.000% 16-Apr-2025 | 11.766 | 0,06 |
| 10.000 | ABN AMRO Bank NV 'EMTN' 2.500% 29-Nov-2023 | 11.989 | 0,06 |
| 100.000 | Allianz SE FRN 3.099% 06-Jul-2047 | 126.969 | 0,61 |
| 15.000 | Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN' 2.750% 17-Mar-2036 | 20.277 | 0,10 |
| 50.000 | Assicurazioni Generali SpA 'EMTN' 5.125% 16-Sep-2024 | 65.204 | 0,31 |
| 100.000 | AT&T Inc 1.800% 05-Sep-2026 | 120.975 | 0,58 |
| 100.000 | Banco Santander SA 'EMTN' 1.375% 14-Dec-2022 | 115.840 | 0,56 |
| 100.000 | Bank of America Corp 'EMTN' 0.750% 26-Jul-2023 | 115.482 | 0,56 |
| 100.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN' 1.875% 04-Nov-2026 | 120.014 | 0,58 |
| 50.000 | BASF Finance Europe NV 'EMTN' 0.750% 10-Nov-2026 | 58.941 | 0,28 |
| 5.000 | BASF SE 1.625% 15-Nov-2037 | 6.384 | 0,03 |
| 100.000 | BAT International Finance Plc 'EMTN' 2.250% 16-Jan-2030 | 118.787 | 0,57 |
| 25.000 | Bayer AG FRN 2.375% 02-Apr-2075 | 28.721 | 0,14 |
| 35.000 | Bayer AG FRN 3.750% 01-Jul-2074 | 41.398 | 0,20 |
| 10.000 | BMW Finance NV 'EMTN' 0.375% 24-Sep-2027 | 11.535 | 0,06 |
| 5.000 | BMW Finance NV 'EMTN' 1.000% 21-Jan-2025 | 5.877 | 0,03 |
| 10.000 | BMW Finance NV 'EMTN' 1.500% 06-Feb-2029 | 12.416 | 0,06 |
| 100.000 | BNP Paribas SA 'EMTN' 0.625% 03-Dec-2032 | 109.702 | 0,53 |
| 20.000 | BNP Paribas SA 'EMTN' 2.375% 20-May-2024 | 24.112 | 0,12 |
| 20.000 | BNP Paribas SA 'EMTN' 2.875% 26-Sep-2023 | 24.017 | 0,12 |
| 20.000 | Citigroup Inc 'EMTN' FRN 4.250% 25-Feb-2030 | 25.554 | 0,12 |
| 100.000 | Coca-Cola Co/The 1.625% 09-Mar-2035 | 124.446 | 0,60 |
| 10.000 | Commerzbank AG 'EMTN' 0.375% 01-Sep-2027 | 11.349 | 0,05 |
| 5.000 | Commerzbank AG 'EMTN' 0.500% 13-Sep-2023 | 5.746 | 0,03 |
| 10.000 | Commerzbank AG 'EMTN' 0.500% 04-Dec-2026 | 11.492 | 0,06 |
| 5.000 | Commerzbank AG 'EMTN' 0.625% 28-Aug-2024 | 5.774 | 0,03 |
| 15.000 | Commerzbank AG 'EMTN' 1.000% 04-Mar-2026 | 17.566 | 0,08 |
| 10.000 | Commerzbank AG 'EMTN' 1.500% 28-Aug-2028 | 12.207 | 0,06 |
| 15.000 | Continental AG 0.000% 12-Sep-2023 | 17.114 | 0,08 |
| 15.000 | Continental AG 'EMTN' 0.375% 27-Jun-2025 | 17.183 | 0,08 |
| 15.000 | Cooperative Rabobank UA 4.125% 14-Jul-2025 | 19.604 | 0,09 |
| 15.000 | Cooperative Rabobank UA 'GMTN' 1.250% 23-Mar-2026 | 17.919 | 0,09 |
| 25.000 | Cooperative Rabobank UA 'GMTN' 1.375% 03-Feb-2027 | 30.292 | 0,15 |
| 15.000 | Covestro AG 1.750% 25-Sep-2024 | 17.833 | 0,09 |
| 100.000 | Credit Agricole SA 'EMTN' 2.000% 25-Mar-2029 | 121.158 | 0,59 |
| 20.000 | Daimler AG 'EMTN' 1.000% 15-Nov-2027 | 23.845 | 0,12 |
| 15.000 | Daimler AG 'EMTN' 1.500% 03-Jul-2029 | 18.562 | 0,09 |
| 10.000 | Daimler AG 'EMTN' 2.000% 27-Feb-2031 | 12.892 | 0,06 |
| 10.000 | Daimler AG 'EMTN' 2.125% 03-Jul-2037 | 13.264 | 0,06 |
| 10.000 | Daimler International Finance BV 'EMTN' 0.625% 27-Feb-2023 | 11.518 | 0,06 |
| 20.000 | Deutsche Bank AG 'EMTN' FRN 1.375% 10-Jun-2026 | 23.693 | 0,11 |
| 20.000 | Deutsche Bank AG 'MTN' 1.125% 30-Aug-2023 | 23.237 | 0,11 |
| 30.000 | Deutsche Boerse AG 1.125% 26-Mar-2028 | 36.160 | 0,17 |
| 10.000 | Deutsche Boerse AG 1.625% 08-Oct-2025 | 12.073 | 0,06 |
| 15.000 | Deutsche Post AG 'EMTN' 0.375% 20-May-2026 | 17.281 | 0,08 |
| 15.000 | Deutsche Post AG 'EMTN' 1.250% 01-Apr-2026 | 17.940 | 0,09 |
| 10.000 | Deutsche Telekom AG 'EMTN' 1.375% 05-Jul-2034 | 12.074 | 0,06 |
| 10.000 | Deutsche Telekom AG 'EMTN' 1.750% 25-Mar-2031 | 12.658 | 0,06 |
| 15.000 | Deutsche Telekom AG 'EMTN' 1.750% 09-Dec-2049 | 17.716 | 0,09 |
| 10.000 | Deutsche Telekom AG 'EMTN' 2.250% 29-Mar-2039 | 13.325 | 0,06 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|------------------------|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Euro Forts. | | | |
| 10.000 | Deutsche Telekom International Finance BV 'EMTN' 0.875% 30-Jan-2024 | 11.629 | 0,06 |
| 15.000 | Deutsche Telekom International Finance BV 'EMTN' 1.375% 01-Dec-2025 | 17.928 | 0,09 |
| 10.000 | Deutsche Telekom International Finance BV 'EMTN' 1.375% 30-Jan-2027 | 12.080 | 0,06 |
| 15.000 | Deutsche Telekom International Finance BV 'EMTN' 1.500% 03-Apr-2028 | 18.324 | 0,09 |
| 20.000 | E.ON International Finance BV 1.000% 13-Apr-2025 | 23.459 | 0,11 |
| 10.000 | E.ON International Finance BV 'EMTN' 1.250% 19-Oct-2027 | 12.018 | 0,06 |
| 10.000 | E.ON International Finance BV 'EMTN' 1.500% 31-Jul-2029 | 12.264 | 0,06 |
| 10.000 | E.ON International Finance BV 'EMTN' 3.000% 17-Jan-2024 | 12.128 | 0,06 |
| 5.000 | E.ON International Finance BV 'EMTN' 5.750% 14-Feb-2033 | 8.607 | 0,04 |
| 5.000 | E.ON SE 'EMTN' 0.000% 18-Dec-2023 | 5.716 | 0,03 |
| 10.000 | E.ON SE 'EMTN' 0.100% 19-Dec-2028 | 11.157 | 0,05 |
| 5.000 | E.ON SE 'EMTN' 0.250% 24-Oct-2026 | 5.714 | 0,03 |
| 10.000 | E.ON SE 'EMTN' 0.375% 29-Sep-2027 | 11.476 | 0,06 |
| 5.000 | E.ON SE 'EMTN' 0.750% 18-Dec-2030 | 5.816 | 0,03 |
| 10.000 | E.ON SE 'EMTN' 1.000% 07-Oct-2025 | 11.758 | 0,06 |
| 50.000 | Enel SpA 'EMTN' 5.625% 21-Jun-2027 | 72.688 | 0,35 |
| 5.000 | Engie SA 'EMTN' 3.000% 01-Feb-2023 | 5.904 | 0,03 |
| 5.000 | Engie SA 'EMTN' 5.950% 16-Mar-2111 | 11.295 | 0,05 |
| 15.000 | Evonik Industries AG 'EMTN' 0.375% 07-Sep-2024 | 17.245 | 0,08 |
| 15.000 | Evonik Industries AG 'EMTN' 1.000% 23-Jan-2023 | 17.265 | 0,08 |
| 100.000 | Fidelity National Information Services Inc 1.500% 21-May-2027 | 119.164 | 0,58 |
| 10.000 | Fresenius Medical Care AG & Co KGaA 'EMTN' 1.250% 29-Nov-2029 | 11.828 | 0,06 |
| 10.000 | Fresenius SE & Co KGaA 1.875% 15-Feb-2025 | 11.960 | 0,06 |
| 30.000 | General Electric Co 'EMTN' 4.125% 19-Sep-2035 | 46.635 | 0,23 |
| 15.000 | GlaxoSmithKline Capital Plc 'EMTN' 4.000% 16-Jun-2025 | 19.477 | 0,09 |
| 15.000 | Goldman Sachs Group Inc/The 3.375% 27-Mar-2025 | 18.828 | 0,09 |
| 15.000 | Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 0.125% 19-Aug-2024 | 17.114 | 0,08 |
| 10.000 | Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 0.875% 21-Jan-2030 | 11.451 | 0,06 |
| 5.000 | Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 1.375% 15-May-2024 | 5.814 | 0,03 |
| 10.000 | Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 1.625% 27-Jul-2026 | 12.028 | 0,06 |
| 5.000 | Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 2.000% 27-Jul-2023 | 5.889 | 0,03 |
| 10.000 | Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 2.000% 22-Mar-2028 | 12.308 | 0,06 |
| 10.000 | Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 3.000% 12-Feb-2031 | 13.451 | 0,06 |
| 30.000 | Grenke Finance Plc 'EMTN' 1.500% 05-Oct-2023 | 34.100 | 0,16 |
| 25.000 | HBOS Plc 'EMTN' FRN 4.500% 18-Mar-2030 | 31.992 | 0,15 |
| 10.000 | HeidelbergCement AG 'EMTN' 2.250% 03-Jun-2024 | 11.955 | 0,06 |
| 20.000 | Hella GmbH & Co KGaA 1.000% 17-May-2024 | 23.194 | 0,11 |
| 30.000 | Knorr-Bremse AG 'EMTN' 1.125% 13-Jun-2025 | 35.326 | 0,17 |
| 30.000 | LANXESS AG 'EMTN' 1.000% 07-Oct-2026 | 35.352 | 0,17 |
| 20.000 | LANXESS AG 'EMTN' 1.125% 16-May-2025 | 23.505 | 0,11 |
| 10.000 | Linde Finance BV 'EMTN' 1.875% 22-May-2024 | 11.949 | 0,06 |
| 30.000 | LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE 'EMTN' 0.750% 26-May-2024 | 34.831 | 0,17 |
| 30.000 | Merck KGaA FRN 3.375% 12-Dec-2074 | 37.027 | 0,18 |
| 100.000 | Morgan Stanley 'GMTN' 1.750% 30-Jan-2025 | 119.615 | 0,58 |
| 10.000 | National Australia Bank Ltd 'GMTN' 0.625% 10-Nov-2023 | 11.567 | 0,06 |
| 15.000 | National Australia Bank Ltd 'GMTN' 1.250% 18-May-2026 | 17.865 | 0,09 |
| 85.000 | Nestle Finance International Ltd 'EMTN' 1.500% 01-Apr-2030 | 105.719 | 0,51 |
| 30.000 | OMV AG 'EMTN' 1.000% 14-Dec-2026 | 35.514 | 0,17 |
| 10.000 | Orange SA 'EMTN' 8.125% 28-Jan-2033 | 20.031 | 0,10 |
| 5.000 | PSA Tresorerie GIE 6.000% 19-Sep-2033 | 8.273 | 0,04 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|---------------------------------------|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Euro Forts. | | | |
| 30.000 | Roche Finance Europe BV 'EMTN' 0.875% 25-Feb-2025 | 35.167 | 0,17 |
| 10.000 | RWE AG 0.625% 11-Jun-2031 | 11.184 | 0,05 |
| 100.000 | Ryanair DAC 'EMTN' 2.875% 15-Sep-2025 | 122.808 | 0,59 |
| 10.000 | SAP SE 'EMTN' 1.000% 01-Apr-2025 | 11.762 | 0,06 |
| 10.000 | SAP SE 'EMTN' 1.125% 20-Feb-2023 | 11.539 | 0,06 |
| 10.000 | SAP SE 'EMTN' 1.750% 22-Feb-2027 | 12.321 | 0,06 |
| 30.000 | Schaeffler AG 'EMTN' 1.875% 26-Mar-2024 | 35.109 | 0,17 |
| 20.000 | Schaeffler AG 'EMTN' 2.875% 26-Mar-2027 | 24.706 | 0,12 |
| 10.000 | Siemens Finanzierungsmaatschappij NV 0.000% 05-Sep-2024 | 11.448 | 0,06 |
| 10.000 | Siemens Finanzierungsmaatschappij NV 'EMTN' 0.375% 06-Sep-2023 | 11.528 | 0,06 |
| 100.000 | Societe Generale SA 'EMTN' 1.750% 22-Mar-2029 | 121.065 | 0,58 |
| 10.000 | Stellantis NV 'EMTN' 2.000% 23-Mar-2024 | 11.861 | 0,06 |
| 15.000 | Stellantis NV 'EMTN' 2.375% 14-Apr-2023 | 17.628 | 0,09 |
| 10.000 | Telefonica Europe BV 'EMTN' 5.875% 14-Feb-2033 | 17.226 | 0,08 |
| 50.000 | Telia Co AB 'EMTN' 3.875% 01-Oct-2025 | 64.897 | 0,31 |
| 100.000 | Thermo Fisher Scientific Inc 0.125% 01-Mar-2025 | 114.112 | 0,55 |
| 50.000 | TotalEnergies Capital SA 'EMTN' 5.125% 26-Mar-2024 | 63.642 | 0,31 |
| 100.000 | TotalEnergies SE 'EMTN' FRN (Perpetual) 2.625% 26-Feb-2025 | 119.354 | 0,58 |
| 10.000 | Toyota Motor Credit Corp 'EMTN' 2.375% 01-Feb-2023 | 11.725 | 0,06 |
| 100.000 | UniCredit SpA 'EMTN' FRN 1.250% 25-Jun-2025 | 116.642 | 0,56 |
| 5.000 | Veolia Environnement SA 'EMTN' 6.125% 25-Nov-2033 | 9.037 | 0,04 |
| 100.000 | Verizon Communications Inc 1.375% 27-Oct-2026 | 119.908 | 0,58 |
| 30.000 | Vienna Insurance Group AG Wiener Versicherung Gruppe FRN 3.750% 02-Mar-2046 | 38.284 | 0,18 |
| 100.000 | Volkswagen Bank GmbH 'EMTN' 2.500% 31-Jul-2026 | 124.478 | 0,60 |
| 5.000 | Volkswagen International Finance NV FRN (Perpetual) 4.625% 24-Mar-2026 | 6.378 | 0,03 |
| 26.000 | Vonovia Finance BV 1.500% 31-Mar-2025 | 30.893 | 0,15 |
| 100.000 | Vonovia Finance BV 'EMTN' 0.500% 14-Sep-2029 | 111.795 | 0,54 |
| 100.000 | Wells Fargo & Co 'EMTN' 1.375% 26-Oct-2026 | 118.555 | 0,57 |
| 100.000 | Wintershall Dea Finance BV 1.332% 25-Sep-2028 | 116.390 | 0,56 |
| 20.000 | Wurth Finance International BV 'EMTN' 1.000% 26-May-2025 | 23.510 | 0,11 |
| Pfund Sterling - 859.008 | | | |
| (31. Dezember 2020: 2.053.411) | | 859.008 | 4,15 |
| 5.000 | Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN' 2.250% 24-May-2029 | 6.997 | 0,03 |
| 15.000 | Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN' 2.850% 25-May-2037 | 21.780 | 0,10 |
| 10.000 | Aviva Plc FRN 6.125% 14-Nov-2036 | 15.837 | 0,08 |
| 35.000 | Barclays Bank Plc 'EMTN' 5.750% 14-Sep-2026 | 55.646 | 0,27 |
| 25.000 | Citigroup Inc 'EMTN' 5.150% 21-May-2026 | 38.853 | 0,19 |
| 5.000 | Coöperatieve Rabobank UA 'GMTN' 5.250% 23-May-2041 | 10.516 | 0,05 |
| 10.000 | E.ON International Finance BV 'EMTN' 6.250% 03-Jun-2030 | 17.989 | 0,09 |
| 15.000 | E.ON International Finance BV 'EMTN' 6.375% 07-Jun-2032 | 28.429 | 0,14 |
| 20.000 | Freshwater Finance Plc 5.182% 20-Apr-2035 | 36.276 | 0,18 |
| 10.000 | Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 3.125% 25-Jul-2029 | 14.639 | 0,07 |
| 5.000 | Hammerson Plc 6.000% 23-Feb-2026 | 7.461 | 0,04 |
| 10.000 | HSBC Bank Capital Funding Sterling 1 LP FRN (Perpetual) 5.844% 05-Nov-2031 | 18.882 | 0,09 |
| 10.000 | HSBC Bank Plc 'EMTN' 5.375% 22-Aug-2033 | 17.670 | 0,09 |
| 10.000 | HSBC Bank Plc 'EMTN' 6.500% 07-Jul-2023 | 14.545 | 0,07 |
| 10.000 | HSBC Bank Plc 'EMTN' FRN 5.375% 04-Nov-2030 | 15.252 | 0,07 |
| 10.000 | HSBC Holdings Plc 'EMTN' 5.750% 20-Dec-2027 | 15.967 | 0,08 |
| 20.000 | Legal & General Finance Plc 'EMTN' 5.875% 11-Dec-2031 | 37.259 | 0,18 |
| 5.000 | Lloyds Bank Plc 'EMTN' 6.500% 17-Sep-2040 | 11.367 | 0,05 |
| 10.000 | Lloyds Bank Plc 'EMTN' 7.625% 22-Apr-2025 | 16.064 | 0,08 |
| 50.000 | London & Quadrant Housing Trust 5.500% 27-Jan-2040 | 102.072 | 0,49 |
| 8.000 | McDonald's Corp 'EMTN' 5.875% 23-Apr-2032 | 14.830 | 0,07 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|--|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Pfund Sterling Forts. | | | |
| 30.000 | Northern Powergrid Holdings Co 7.250% 15-Dec-2022 | 43.022 | 0,21 |
| 50.000 | Orange SA 'EMTN' 5.375% 22-Nov-2050 | 110.383 | 0,53 |
| 20.000 | Prudential Plc 'EMTN' 6.125% 19-Dec-2031 | 35.665 | 0,17 |
| 5.000 | Severn Trent Utilities Finance Plc 6.250% 07-Jun-2029 | 8.922 | 0,04 |
| 10.000 | South Eastern Power Networks Plc 'EMTN' 5.500% 05-Jun-2026 | 15.874 | 0,08 |
| 10.000 | Sunderland SHG Finance Plc 6.380% 31-Mar-2042 | 18.711 | 0,09 |
| 10.000 | Thames Water Utilities Finance Plc 'EMTN' 6.750% 16-Nov-2028 | 17.699 | 0,09 |
| 5.000 | THFC Funding No 1 Plc 5.125% 21-Dec-2035 | 9.193 | 0,04 |
| 10.000 | United Utilities Water Ltd 'EMTN' 5.625% 20-Dec-2027 | 16.727 | 0,08 |
| 15.000 | Volkswagen Financial Services NV 'EMTN' 2.250% 12-Apr-2025 | 20.607 | 0,10 |
| 10.000 | Walmart Inc 5.250% 28-Sep-2035 | 19.331 | 0,09 |
| 5.000 | Wessex Water Services Finance Plc 5.375% 10-Mar-2028 | 8.195 | 0,04 |
| 10.000 | Western Power Distribution South West Plc 5.875% 25-Mar-2027 | 16.348 | 0,08 |
| US-Dollar - 13.202.095 | | | |
| (31. Dezember 2020: 27.936.158) | | 13.202.095 | 63,80 |
| 5.000 | 3M Co 2.375% 26-Aug-2029 | 5.139 | 0,02 |
| 5.000 | 3M Co 'MTN' 5.700% 15-Mar-2037 | 6.973 | 0,03 |
| 5.000 | Abbott Laboratories 1.400% 30-Jun-2030 | 4.833 | 0,02 |
| 15.000 | Abbott Laboratories 3.875% 15-Sep-2025 | 16.310 | 0,08 |
| 10.000 | Abbott Laboratories 6.150% 30-Nov-2037 | 14.792 | 0,07 |
| 10.000 | AbbVie Inc 2.600% 21-Nov-2024 | 10.385 | 0,05 |
| 15.000 | AbbVie Inc 2.950% 21-Nov-2026 | 15.824 | 0,08 |
| 10.000 | AbbVie Inc 3.200% 21-Nov-2029 | 10.713 | 0,05 |
| 15.000 | AbbVie Inc 3.600% 14-May-2025 | 15.968 | 0,08 |
| 15.000 | AbbVie Inc 3.800% 15-Mar-2025 | 15.984 | 0,08 |
| 5.000 | AbbVie Inc 4.050% 21-Nov-2039 | 5.775 | 0,03 |
| 15.000 | AbbVie Inc 4.250% 21-Nov-2049 | 18.030 | 0,09 |
| 5.000 | AbbVie Inc 4.450% 14-May-2046 | 6.081 | 0,03 |
| 5.000 | AbbVie Inc 4.500% 14-May-2035 | 6.008 | 0,03 |
| 10.000 | AbbVie Inc 4.700% 14-May-2045 | 12.474 | 0,06 |
| 10.000 | AbbVie Inc 4.850% 15-Jun-2044 | 12.596 | 0,06 |
| 25.000 | AES Corp/The '144A' 3.300% 15-Jul-2025 | 25.972 | 0,13 |
| 10.000 | Aetna Inc 2.800% 15-Jun-2023 | 10.250 | 0,05 |
| 5.000 | Aetna Inc 4.500% 15-May-2042 | 5.950 | 0,03 |
| 5.000 | Aetna Inc 6.625% 15-Jun-2036 | 7.112 | 0,03 |
| 5.000 | Affiliated Managers Group Inc 4.250% 15-Feb-2024 | 5.315 | 0,03 |
| 15.000 | Aflac Inc 3.250% 17-Mar-2025 | 15.871 | 0,08 |
| 5.000 | Ahold Finance USA LLC 6.875% 01-May-2029 | 6.520 | 0,03 |
| 5.000 | AlG SunAmerica Global Financing X '144A' 6.900% 15-Mar-2032 | 6.975 | 0,03 |
| 12.696 | Air Canada 2017-1 Class AA Pass Through Trust '144A' 3.300% 15-Jan-2030 | 12.846 | 0,06 |
| 5.000 | Aircastle Ltd 4.250% 15-Jun-2026 | 5.364 | 0,03 |
| 5.000 | Alexander Funding Trust '144A' 1.841% 15-Nov-2023 | 5.020 | 0,02 |
| 10.000 | Alexandria Real Estate Equities Inc 1.875% 01-Feb-2033 | 9.424 | 0,05 |
| 5.000 | Alexandria Real Estate Equities Inc 2.750% 15-Dec-2029 | 5.167 | 0,02 |
| 10.000 | Alexandria Real Estate Equities Inc 3.000% 18-May-2051 | 9.941 | 0,05 |
| 10.000 | Alibaba Group Holding Ltd 4.400% 06-Dec-2057 | 11.433 | 0,06 |
| 20.000 | Alimentation Couche-Tard Inc '144A' 2.950% 25-Jan-2030 | 20.701 | 0,10 |
| 20.000 | Allegion US Holding Co Inc 3.200% 01-Oct-2024 | 20.816 | 0,10 |
| 15.000 | Allstate Corp/The 3.280% 15-Dec-2026 | 16.129 | 0,08 |
| 9.000 | Allstate Corp/The FRN 5.750% 15-Aug-2053 | 9.362 | 0,05 |
| 5.000 | Allstate Corp/The FRN 6.500% 15-May-2057 | 6.571 | 0,03 |
| 5.000 | Ally Financial Inc 3.050% 05-Jun-2023 | 5.128 | 0,02 |
| 5.000 | Ally Financial Inc 3.875% 21-May-2024 | 5.273 | 0,03 |
| 15.000 | Altera Corp 4.100% 15-Nov-2023 | 15.872 | 0,08 |
| 15.000 | Altria Group Inc 3.700% 04-Feb-2051 | 14.059 | 0,07 |
| 20.000 | Altria Group Inc 4.800% 14-Feb-2029 | 22.596 | 0,11 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % |
|-------------------------|--|----------------------------|-----------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| US-Dollar Forts. | | | |
| 5.000 | Altria Group Inc 5.375% 31-Jan-2044 | 5.799 | 0,03 |
| 5.000 | Altria Group Inc 5.950% 14-Feb-2049 | 6.272 | 0,03 |
| 10.000 | Amazon.com Inc 2.100% 12-May-2031 | 10.154 | 0,05 |
| 5.000 | Amazon.com Inc 2.700% 03-Jun-2060 | 4.858 | 0,02 |
| 5.000 | Amazon.com Inc 3.150% 22-Aug-2027 | 5.407 | 0,03 |
| 5.000 | Amazon.com Inc 3.250% 12-May-2061 | 5.426 | 0,03 |
| 10.000 | Amazon.com Inc 3.875% 22-Aug-2037 | 11.788 | 0,06 |
| 10.000 | Amazon.com Inc 4.250% 22-Aug-2057 | 12.895 | 0,06 |
| 15.000 | Amazon.com Inc 5.200% 03-Dec-2025 | 17.089 | 0,08 |
| 15.000 | Amcor Finance USA Inc 4.500% 15-May-2028 | 17.084 | 0,08 |
| 10.000 | America Movil SAB de CV 6.375% 01-Mar-2035 | 13.859 | 0,07 |
| 5.000 | American Express Co 2.650% 02-Dec-2022 | 5.096 | 0,02 |
| 20.000 | American Express Co 3.700% 03-Aug-2023 | 20.862 | 0,10 |
| 15.000 | American Financial Group Inc/OH 3.500% 15-Aug-2026 | 16.070 | 0,08 |
| 5.000 | American Homes 4 Rent LP 4.900% 15-Feb-2029 | 5.789 | 0,03 |
| 10.000 | American International Group Inc 4.500% 16-Jul-2044 | 12.381 | 0,06 |
| 10.000 | American Tower Corp 2.300% 15-Sep-2031 | 9.735 | 0,05 |
| 10.000 | American Tower Corp 2.400% 15-Mar-2025 | 10.280 | 0,05 |
| 20.000 | American Tower Corp 2.750% 15-Jan-2027 | 20.640 | 0,10 |
| 10.000 | American Tower Corp 2.950% 15-Jan-2025 | 10.396 | 0,05 |
| 15.000 | American Tower Corp 3.375% 15-Oct-2026 | 15.957 | 0,08 |
| 5.000 | American Tower Corp 3.800% 15-Aug-2029 | 5.450 | 0,03 |
| 10.000 | American Tower Corp 4.000% 01-Jun-2025 | 10.714 | 0,05 |
| 10.000 | American Tower Corp 4.400% 15-Feb-2026 | 10.933 | 0,05 |
| 20.000 | American Water Capital Corp 3.400% 01-Mar-2025 | 21.158 | 0,10 |
| 5.000 | American Water Capital Corp 3.450% 01-Jun-2029 | 5.400 | 0,03 |
| 5.000 | American Water Capital Corp 4.150% 01-Jun-2049 | 5.938 | 0,03 |
| 20.000 | AmerisourceBergen Corp 2.700% 15-Mar-2031 | 20.250 | 0,10 |
| 5.000 | AmerisourceBergen Corp 3.400% 15-May-2024 | 5.228 | 0,03 |
| 15.000 | Amgen Inc 1.900% 21-Feb-2025 | 15.297 | 0,07 |
| 10.000 | Amgen Inc 2.300% 25-Feb-2031 | 10.080 | 0,05 |
| 5.000 | Amgen Inc 2.770% 01-Sep-2053 | 4.704 | 0,02 |
| 20.000 | Amgen Inc 3.125% 01-May-2025 | 21.106 | 0,10 |
| 10.000 | Amgen Inc 4.400% 01-May-2045 | 12.000 | 0,06 |
| 10.000 | Amgen Inc 4.663% 15-Jun-2051 | 12.874 | 0,06 |
| 5.000 | Analog Devices Inc 3.500% 05-Dec-2026 | 5.460 | 0,03 |
| 5.000 | Anglo American Capital Plc '144A' 4.875% 14-May-2025 | 5.457 | 0,03 |
| 10.000 | Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 3.650% 01-Feb-2026 | 10.751 | 0,05 |
| 15.000 | Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 4.700% 01-Feb-2036 | 18.157 | 0,09 |
| 20.000 | Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 4.900% 01-Feb-2046 | 25.416 | 0,12 |
| 5.000 | Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 4.350% 01-Jun-2040 | 5.904 | 0,03 |
| 10.000 | Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 4.600% 15-Apr-2048 | 12.282 | 0,06 |
| 10.000 | Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 4.750% 23-Jan-2029 | 11.659 | 0,06 |
| 5.000 | Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 5.450% 23-Jan-2039 | 6.571 | 0,03 |
| 10.000 | Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 5.550% 23-Jan-2049 | 13.913 | 0,07 |
| 5.000 | Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 5.800% 23-Jan-2059 | 7.277 | 0,03 |
| 9.000 | Anthem Inc 2.375% 15-Jan-2025 | 9.289 | 0,04 |
| 10.000 | Anthem Inc 3.350% 01-Dec-2024 | 10.573 | 0,05 |
| 5.000 | Anthem Inc 3.500% 15-Aug-2024 | 5.284 | 0,03 |
| 10.000 | Anthem Inc 3.650% 01-Dec-2027 | 10.986 | 0,05 |
| 10.000 | Anthem Inc 4.375% 01-Dec-2047 | 12.249 | 0,06 |
| 10.000 | Anthem Inc 4.550% 01-Mar-2048 | 12.561 | 0,06 |
| 5.000 | Anthem Inc 4.650% 15-Jan-2043 | 6.279 | 0,03 |
| 5.000 | ANZ New Zealand Int'l Ltd/London '144A' 3.450% 21-Jan-2028 | 5.438 | 0,03 |
| 5.000 | Aon Plc 4.000% 27-Nov-2023 | 5.237 | 0,03 |
| 5.000 | Apollo Management Holdings LP '144A' 2.650% 05-Jun-2030 | 5.053 | 0,02 |
| 5.000 | Appalachian Power Co 3.300% 01-Jun-2027 | 5.343 | 0,03 |
| 5.000 | Apple Inc 2.550% 20-Aug-2026 | 4.735 | 0,02 |
| 20.000 | Apple Inc 2.750% 13-Jan-2020 | 20.915 | 0,10 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % |
|-------------------------|--|----------------------------|-----------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| US-Dollar Forts. | | | |
| 10.000 | Apple Inc 3.200% 13-May-2025 | 10.653 | 0,05 |
| 10.000 | Apple Inc 3.250% 23-Feb-2026 | 10.705 | 0,05 |
| 20.000 | Apple Inc 3.350% 09-Feb-2027 | 21.734 | 0,10 |
| 10.000 | Apple Inc 3.450% 06-May-2024 | 10.584 | 0,05 |
| 5.000 | Applied Materials Inc 5.100% 01-Oct-2035 | 6.510 | 0,03 |
| 20.000 | APT Pipelines Ltd '144A' 4.200% 23-Mar-2025 | 21.411 | 0,10 |
| 15.000 | Aptiv Plc 4.350% 15-Mar-2029 | 17.034 | 0,08 |
| 10.000 | Ares Capital Corp 3.250% 15-Jul-2025 | 10.341 | 0,05 |
| 20.000 | Ares Capital Corp 3.875% 15-Jan-2026 | 21.108 | 0,10 |
| 10.000 | Ares Capital Corp 4.250% 01-Mar-2025 | 10.595 | 0,05 |
| 10.000 | Arrow Electronics Inc 4.500% 01-Mar-2023 | 10.292 | 0,05 |
| 10.000 | AstraZeneca Plc 3.125% 12-Jun-2027 | 10.732 | 0,05 |
| 15.000 | AstraZeneca Plc 3.375% 16-Nov-2025 | 16.120 | 0,08 |
| 10.000 | AstraZeneca Plc 6.450% 15-Sep-2037 | 14.754 | 0,07 |
| 10.000 | AT&T Inc 2.750% 01-Jun-2031 | 10.225 | 0,05 |
| 10.000 | AT&T Inc 3.100% 01-Feb-2043 | 9.772 | 0,05 |
| 15.000 | AT&T Inc 3.400% 15-May-2025 | 15.865 | 0,08 |
| 18.000 | AT&T Inc 3.500% 15-Sep-2053 | 18.265 | 0,09 |
| 17.000 | AT&T Inc 3.550% 15-Sep-2055 | 17.159 | 0,08 |
| 15.000 | AT&T Inc 3.650% 01-Jun-2051 | 15.626 | 0,08 |
| 17.000 | AT&T Inc 3.650% 15-Sep-2059 | 17.274 | 0,08 |
| 5.000 | AT&T Inc 4.125% 17-Feb-2026 | 5.461 | 0,03 |
| 5.000 | AT&T Inc 4.250% 01-Mar-2027 | 5.553 | 0,03 |
| 15.000 | AT&T Inc 4.300% 15-Feb-2030 | 16.915 | 0,08 |
| 5.000 | AT&T Inc 4.300% 15-Dec-2042 | 5.681 | 0,03 |
| 15.000 | AT&T Inc 4.350% 01-Mar-2029 | 16.877 | 0,08 |
| 5.000 | AT&T Inc 4.350% 15-Jun-2045 | 5.667 | 0,03 |
| 5.000 | AT&T Inc 4.450% 01-Apr-2024 | 5.340 | 0,03 |
| 5.000 | AT&T Inc 4.500% 15-May-2035 | 5.793 | 0,03 |
| 5.000 | AT&T Inc 4.500% 09-Mar-2048 | 5.863 | 0,03 |
| 5.000 | AT&T Inc 4.550% 09-Mar-2049 | 5.982 | 0,03 |
| 10.000 | AT&T Inc 4.650% 01-Jun-2044 | 11.786 | 0,06 |
| 5.000 | AT&T Inc 4.850% 15-Jul-2045 | 5.990 | 0,03 |
| 10.000 | Athene Holding Ltd 3.500% 15-Jan-2031 | 10.598 | 0,05 |
| 10.000 | Atmos Energy Corp 1.500% 15-Jan-2031 | 9.406 | 0,05 |
| 15.000 | AutoZone Inc 3.125% 18-Apr-2024 | 15.681 | 0,08 |
| 10.000 | AvalonBay Communities Inc 'MTN' 3.200% 15-Jan-2028 | 10.715 | 0,05 |
| 10.000 | AvalonBay Communities Inc 'MTN' 3.300% 01-Jun-2029 | 10.815 | 0,05 |
| 15.000 | Aviation Capital Group LLC '144A' 4.375% 30-Jan-2024 | 15.744 | 0,08 |
| 15.000 | Aviation Capital Group LLC '144A' 4.875% 01-Oct-2025 | 16.240 | 0,08 |
| 20.000 | Avolon Holdings Funding Ltd '144A' 2.528% 18-Nov-2027 | 19.456 | 0,09 |
| 20.000 | Avolon Holdings Funding Ltd '144A' 2.875% 15-Feb-2025 | 20.453 | 0,10 |
| 15.000 | AXA SA 8.600% 15-Dec-2030 | 21.661 | 0,10 |
| 5.000 | BAE Systems Holdings Inc '144A' 3.850% 15-Dec-2025 | 5.366 | 0,03 |
| 10.000 | Banco de Credito del Peru 'REGS' FRN 3.125% 01-Jul-2030 | 9.892 | 0,05 |
| 10.000 | Banco Internacional del Peru SAA Interbank 'REGS' 3.250% 04-Oct-2026 | 10.223 | 0,05 |
| 10.000 | Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santander 'REGS' 5.375% 17-Apr-2025 | 10.926 | 0,05 |
| 5.000 | Bank of America Corp 3.950% 21-Apr-2025 | 5.351 | 0,03 |
| 5.000 | Bank of America Corp 4.183% 25-Nov-2027 | 5.478 | 0,03 |
| 6.200 | Bank of America Corp 4.750% 21-Apr-2045 | 6.279 | 0,03 |
| 5.000 | Bank of America Corp 6.110% 29-Jan-2037 | 6.750 | 0,03 |
| 30.000 | Bank of America Corp FRN 1.734% 22-Jul-2027 | 29.815 | 0,14 |
| 15.000 | Bank of America Corp FRN 2.592% 29-Apr-2031 | 15.184 | 0,07 |
| 20.000 | Bank of America Corp FRN 3.004% 20-Dec-2023 | 20.419 | 0,10 |
| 5.000 | Bank of America Corp FRN 3.366% 23-Jan-2026 | 5.266 | 0,03 |
| 20.000 | Bank of America Corp FRN 3.419% 20-Dec-2028 | 21.382 | 0,10 |
| 5.000 | Bank of America Corp FRN 3.550% 05-Mar-2024 | 5.150 | 0,02 |
| 5.000 | Bank of America Corp FRN 3.705% 24-Apr-2028 | 5.434 | 0,03 |
| 15.000 | Bank of America Corp FRN 4.244% 24-Apr-2038 | 17.671 | 0,09 |
| 20.000 | Bank of America Corp 'GMTN' 3.300% 11-Jan-2023 | 20.554 | 0,10 |
| 5.000 | Bank of America Corp 'GMTN' FRN 3.593% 21-Jul-2028 | 5.389 | 0,03 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Summe Beizulegender Zeitwert USD | Nettover- mögen % |
|-------------------------|--|---|-------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| US-Dollar Forts. | | | |
| 5.000 | Bank of America Corp 'MTN' 3.248% 21-Oct-2027 | 5.329 | 0,03 |
| 10.000 | Bank of America Corp 'MTN' 4.000% 22-Jan-2025 | 10.691 | 0,05 |
| 10.000 | Bank of America Corp 'MTN' 4.200% 26-Aug-2024 | 10.728 | 0,05 |
| 5.000 | Bank of America Corp 'MTN' 4.250% 22-Oct-2026 | 5.524 | 0,03 |
| 15.000 | Bank of America Corp 'MTN' 4.450% 03-Mar-2026 | 16.539 | 0,08 |
| 5.000 | Bank of America Corp 'MTN' FRN 2.496% 13-Feb-2031 | 5.023 | 0,02 |
| 10.000 | Bank of America Corp 'MTN' FRN 3.458% 15-Mar-2025 | 10.465 | 0,05 |
| 10.000 | Bank of America Corp 'MTN' FRN 3.559% 23-Apr-2027 | 10.705 | 0,05 |
| 5.000 | Bank of America Corp 'MTN' FRN 3.824% 20-Jan-2028 | 5.421 | 0,03 |
| 20.000 | Bank of America Corp 'MTN' FRN 3.864% 23-Jul-2024 | 20.847 | 0,10 |
| 5.000 | Bank of America Corp 'MTN' FRN 3.970% 05-Mar-2029 | 5.483 | 0,03 |
| 15.000 | Bank of America Corp 'MTN' FRN 3.974% 07-Feb-2030 | 16.552 | 0,08 |
| 10.000 | Bank of America Corp 'MTN' FRN 4.078% 23-Apr-2040 | 11.539 | 0,06 |
| 15.000 | Bank of America Corp 'MTN' FRN 4.271% 23-Jul-2029 | 16.748 | 0,08 |
| 10.000 | Bank of Montreal 3.300% 05-Feb-2024 | 10.469 | 0,05 |
| 20.000 | Bank of Montreal FRN 4.338% 05-Oct-2028 | 21.043 | 0,10 |
| 5.000 | Bank of Montreal 'MTN' 2.500% 28-Jun-2024 | 5.160 | 0,02 |
| 5.000 | Bank of Montreal 'MTN' FRN 0.949% 22-Jan-2027 | 4.846 | 0,02 |
| 7.000 | Barclays Plc 3.684% 10-Jan-2023 | 7.003 | 0,03 |
| 20.000 | BAT Capital Corp 2.726% 25-Mar-2031 | 19.454 | 0,09 |
| 10.000 | BAT Capital Corp 3.215% 06-Sep-2026 | 10.424 | 0,05 |
| 10.000 | BAT Capital Corp 3.222% 15-Aug-2024 | 10.401 | 0,05 |
| 15.000 | BAT Capital Corp 3.557% 15-Aug-2027 | 15.754 | 0,08 |
| 10.000 | BAT International Finance Plc '144A' 3.950% 15-Jun-2025 | 10.634 | 0,05 |
| 20.000 | Bayer US Finance II LLC '144A' 4.375% 15-Dec-2028 | 22.377 | 0,11 |
| 15.000 | Bayer US Finance II LLC '144A' 4.875% 25-Jun-2048 | 18.540 | 0,09 |
| 10.000 | Bayer US Finance LLC '144A' 3.375% 08-Oct-2024 | 10.461 | 0,05 |
| 10.000 | Becton Dickinson and Co 3.363% 06-Jun-2024 | 10.477 | 0,05 |
| 10.000 | Becton Dickinson and Co 4.669% 06-Jun-2047 | 12.682 | 0,06 |
| 10.000 | Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada/The 4.464% 01-Apr-2048 | 12.441 | 0,06 |
| 10.000 | Berkshire Hathaway Energy Co 3.500% 01-Feb-2025 | 10.593 | 0,05 |
| 10.000 | Berkshire Hathaway Energy Co 3.750% 15-Nov-2023 | 10.455 | 0,05 |
| 10.000 | Berkshire Hathaway Energy Co 6.125% 01-Apr-2036 | 13.651 | 0,07 |
| 5.000 | Berkshire Hathaway Finance Corp 1.850% 12-Mar-2030 | 4.964 | 0,02 |
| 10.000 | Berkshire Hathaway Inc 2.750% 15-Mar-2023 | 10.214 | 0,05 |
| 5.000 | Berkshire Hathaway Inc 3.125% 15-Mar-2026 | 5.359 | 0,03 |
| 5.000 | BG Energy Capital Plc '144A' 5.125% 15-Oct-2041 | 6.443 | 0,03 |
| 5.000 | Black Hills Corp 3.050% 15-Oct-2029 | 5.209 | 0,02 |
| 10.000 | Black Hills Corp 3.150% 15-Jan-2027 | 10.414 | 0,05 |
| 10.000 | Black Hills Corp 4.250% 30-Nov-2023 | 10.507 | 0,05 |
| 5.000 | BlackRock Inc 2.400% 30-Apr-2030 | 5.155 | 0,02 |
| 15.000 | Blackstone Secured Lending Fund 2.750% 16-Sep-2026 | 15.022 | 0,07 |
| 30.000 | Blackstone Secured Lending Fund 3.625% 15-Jan-2026 | 31.343 | 0,15 |
| 5.000 | BMW US Capital LLC '144A' 3.800% 06-Apr-2023 | 5.186 | 0,02 |
| 20.000 | BMW US Capital LLC '144A' 3.900% 09-Apr-2025 | 21.527 | 0,10 |
| 15.000 | BMW US Capital LLC '144A' 4.150% 09-Apr-2030 | 17.018 | 0,08 |
| 20.000 | BNP Paribas SA '144A' 3.375% 09-Jan-2025 | 21.021 | 0,10 |
| 25.000 | BNP Paribas SA '144A' FRN 5.198% 10-Jan-2030 | 29.135 | 0,14 |
| 20.000 | Boeing Co/The 4.508% 01-May-2023 | 20.897 | 0,10 |
| 10.000 | Boeing Co/The 5.805% 01-May-2050 | 13.611 | 0,07 |
| 10.000 | Boeing Co/The 5.930% 01-May-2060 | 13.967 | 0,07 |
| 10.000 | Boeing Co/The 6.625% 15-Feb-2038 | 13.529 | 0,07 |
| 10.000 | Booking Holdings Inc 4.625% 13-Apr-2030 | 11.683 | 0,06 |
| 10.000 | Boston Properties LP 3.200% 15-Jan-2025 | 10.481 | 0,05 |
| 10.000 | Boston Properties LP 3.250% 30-Jan-2031 | 10.478 | 0,05 |

| Bestände | Beschreibung | Summe Beizulegender Zeitwert USD | Nettover- mögen % |
|-------------------------|---|---|-------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| US-Dollar Forts. | | | |
| 5.000 | Boston Scientific Corp 3.750% 01-Mar-2026 | 5.379 | 0,03 |
| 10.000 | Boston Scientific Corp 3.850% 15-May-2025 | 10.763 | 0,05 |
| 5.000 | Boston Scientific Corp 4.000% 01-Mar-2029 | 5.562 | 0,03 |
| 15.000 | Boston Scientific Corp 4.550% 01-Mar-2039 | 18.020 | 0,09 |
| 5.000 | Boston Scientific Corp 4.700% 01-Mar-2049 | 6.371 | 0,03 |
| 5.000 | BP Capital Markets America Inc 2.750% 10-May-2023 | 5.123 | 0,02 |
| 5.000 | BP Capital Markets America Inc 3.119% 04-May-2026 | 5.294 | 0,03 |
| 5.000 | BP Capital Markets America Inc 3.194% 06-Apr-2025 | 5.275 | 0,03 |
| 5.000 | BP Capital Markets America Inc 3.379% 08-Feb-2061 | 5.174 | 0,02 |
| 5.000 | BP Capital Markets America Inc 3.410% 11-Feb-2026 | 5.341 | 0,03 |
| 5.000 | BP Capital Markets America Inc 3.633% 06-Apr-2030 | 5.533 | 0,03 |
| 5.000 | BP Capital Markets America Inc 3.796% 21-Sep-2025 | 5.403 | 0,03 |
| 5.000 | BP Capital Markets America Inc 3.937% 21-Sep-2028 | 5.545 | 0,03 |
| 10.000 | BP Capital Markets America Inc 4.234% 06-Nov-2028 | 11.304 | 0,05 |
| 5.000 | BP Capital Markets Plc 3.279% 19-Sep-2027 | 5.379 | 0,03 |
| 5.000 | BP Capital Markets Plc 3.814% 10-Feb-2024 | 5.272 | 0,03 |
| 20.000 | BPCE SA '144A' 4.500% 15-Mar-2025 | 21.576 | 0,10 |
| 10.000 | Bristol-Myers Squibb Co 2.900% 26-Jul-2024 | 10.472 | 0,05 |
| 5.000 | Bristol-Myers Squibb Co 3.250% 20-Feb-2023 | 5.133 | 0,02 |
| 15.000 | Bristol-Myers Squibb Co 3.400% 26-Jul-2029 | 16.456 | 0,08 |
| 5.000 | Bristol-Myers Squibb Co 3.875% 15-Aug-2025 | 5.417 | 0,03 |
| 10.000 | Bristol-Myers Squibb Co 4.125% 15-Jun-2039 | 11.880 | 0,06 |
| 5.000 | British Telecommunications Plc 9.625% 15-Dec-2030 | 7.336 | 0,04 |
| 5.000 | British Telecommunications Plc '144A' 3.250% 08-Nov-2029 | 5.121 | 0,02 |
| 15.000 | Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd 3.875% 15-Jan-2027 | 16.283 | 0,08 |
| 10.000 | Broadcom Inc 4.110% 15-Sep-2028 | 10.981 | 0,05 |
| 10.000 | Broadcom Inc 4.300% 15-Nov-2032 | 11.266 | 0,05 |
| 10.000 | Broadcom Inc 4.700% 15-Apr-2025 | 10.947 | 0,05 |
| 15.000 | Broadcom Inc 4.750% 15-Apr-2029 | 17.105 | 0,08 |
| 10.000 | Broadcom Inc 5.000% 15-Apr-2030 | 11.665 | 0,06 |
| 10.000 | Broadcom Inc '144A' 2.450% 15-Feb-2031 | 9.826 | 0,05 |
| 10.000 | Broadcom Inc '144A' 2.600% 15-Feb-2033 | 9.775 | 0,05 |
| 5.000 | Broadcom Inc '144A' 3.750% 15-Feb-2051 | 5.255 | 0,03 |
| 5.000 | Brown & Brown Inc 4.200% 15-Sep-2024 | 5.338 | 0,03 |
| 5.000 | Brown-Forman Corp 3.500% 15-Apr-2025 | 5.334 | 0,03 |
| 15.000 | Burlington Northern Santa Fe LLC 3.250% 15-Jun-2027 | 16.172 | 0,08 |
| 5.000 | Burlington Northern Santa Fe LLC 3.750% 01-Apr-2024 | 5.265 | 0,03 |
| 20.000 | Burlington Northern Santa Fe LLC 3.850% 01-Sep-2023 | 20.822 | 0,10 |
| 15.000 | Cabot Corp 4.000% 01-Jul-2029 | 16.413 | 0,08 |
| 5.000 | Cadence Design Systems Inc 4.375% 15-Oct-2024 | 5.379 | 0,03 |
| 5.000 | Camden Property Trust 2.800% 15-May-2030 | 5.211 | 0,02 |
| 15.000 | Cameron LNG LLC '144A' 3.302% 15-Jan-2035 | 15.711 | 0,08 |
| 10.000 | Campbell Soup Co 3.950% 15-Mar-2025 | 10.704 | 0,05 |
| 20.000 | Canadian Imperial Bank of Commerce 2.250% 28-Jan-2025 | 20.454 | 0,10 |
| 15.000 | Canadian National Railway Co 2.950% 21-Nov-2024 | 15.656 | 0,08 |
| 10.000 | Canadian National Railway Co 6.900% 15-Jul-2028 | 13.053 | 0,06 |
| 20.000 | Canadian Pacific Railway Co 2.900% 01-Feb-2025 | 20.826 | 0,10 |
| 5.000 | Canadian Pacific Railway Co 6.125% 15-Sep-2115 | 7.515 | 0,04 |
| 5.000 | Capital One Financial Corp 3.200% 30-Jan-2023 | 5.123 | 0,02 |
| 10.000 | Capital One Financial Corp 3.200% 05-Feb-2025 | 10.490 | 0,05 |
| 10.000 | Capital One Financial Corp 3.300% 30-Oct-2024 | 10.534 | 0,05 |
| 5.000 | Capital One Financial Corp 3.500% 15-Jun-2023 | 5.184 | 0,02 |
| 5.000 | Capital One Financial Corp 3.750% 24-Apr-2024 | 5.274 | 0,03 |
| 10.000 | Capital One Financial Corp 3.900% 29-Jan-2024 | 10.530 | 0,05 |
| 20.000 | Capital One Financial Corp 4.200% 29-Oct-2025 | 21.774 | 0,11 |
| 5.000 | Cargill Inc '144A' 2.125% 23-Apr-2030 | 4.955 | 0,02 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|-------------------------|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| US-Dollar Forts. | | | |
| 5.000 | Carlisle Cos Inc 2.750% 01-Mar-2030 | 5.106 | 0,02 |
| 15.000 | Carlisle Cos Inc 3.500% 01-Dec-2024 | 15.833 | 0,08 |
| 10.000 | Carrier Global Corp 2.242% 15-Feb-2025 | 10.251 | 0,05 |
| 5.000 | Carrier Global Corp 2.700% 15-Feb-2031 | 5.090 | 0,02 |
| 5.000 | Carrier Global Corp 2.722% 15-Feb-2030 | 5.117 | 0,02 |
| 5.000 | Carrier Global Corp 3.577% 05-Apr-2050 | 5.350 | 0,03 |
| 10.000 | CC Holdings GS V LLC / Crown Castle GS III Corp 3.849% 15-Apr-2023 | 10.352 | 0,05 |
| 5.000 | CH Robinson Worldwide Inc 4.200% 15-Apr-2028 | 5.641 | 0,03 |
| 20.000 | Charles Schwab Corp/The 3.625% 01-Apr-2025 | 21.331 | 0,10 |
| 10.000 | Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 2.800% 01-Apr-2031 | 9.906 | 0,05 |
| 15.000 | Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 4.400% 01-Dec-2061 | 15.617 | 0,08 |
| 5.000 | Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 4.500% 01-Feb-2024 | 5.321 | 0,03 |
| 10.000 | Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 4.800% 01-Mar-2050 | 11.261 | 0,05 |
| 15.000 | Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 4.908% 23-Jul-2025 | 16.521 | 0,08 |
| 5.000 | Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 5.125% 01-Jul-2049 | 5.832 | 0,03 |
| 10.000 | Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 5.375% 01-May-2047 | 11.999 | 0,06 |
| 10.000 | Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 5.750% 01-Apr-2048 | 12.537 | 0,06 |
| 5.000 | Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 6.384% 23-Oct-2035 | 6.462 | 0,03 |
| 5.000 | Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 6.484% 23-Oct-2045 | 6.862 | 0,03 |
| 10.000 | Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 5.875% 31-Mar-2025 | 11.094 | 0,05 |
| 15.000 | Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 7.000% 30-Jun-2024 | 16.604 | 0,08 |
| 20.000 | Chevron Corp 1.995% 11-May-2027 | 20.326 | 0,10 |
| 20.000 | Chevron Corp 2.236% 11-May-2030 | 20.271 | 0,10 |
| 5.000 | Chevron Corp 3.326% 17-Nov-2025 | 5.343 | 0,03 |
| 15.000 | Chevron Phillips Chemical Co LLC / Chevron Phillips Chemical Co LP '144A' 5.125% 01-Apr-2025 | 16.673 | 0,08 |
| 10.000 | Chubb INA Holdings Inc 3.350% 03-May-2026 | 10.737 | 0,05 |
| 15.000 | Church & Dwight Co Inc 3.950% 01-Aug-2047 | 17.594 | 0,08 |
| 5.000 | Cigna Corp 3.000% 15-Jul-2023 | 5.145 | 0,02 |
| 5.000 | Cigna Corp 3.400% 01-Mar-2027 | 5.378 | 0,03 |
| 5.000 | Cigna Corp 3.875% 15-Oct-2047 | 5.620 | 0,03 |
| 5.000 | Cigna Corp 4.125% 15-Nov-2025 | 5.475 | 0,03 |
| 15.000 | Cigna Corp 4.375% 15-Oct-2028 | 17.073 | 0,08 |
| 15.000 | Cigna Corp 4.800% 15-Aug-2038 | 18.526 | 0,09 |
| 10.000 | Cigna Corp 4.900% 15-Dec-2048 | 12.997 | 0,06 |
| 5.000 | Cintas Corp No 2 3.700% 01-Apr-2027 | 5.477 | 0,03 |
| 10.000 | Cisco Systems Inc/Delaware 5.900% 15-Feb-2039 | 14.417 | 0,07 |
| 10.000 | Citigroup Inc 3.200% 21-Oct-2026 | 10.610 | 0,05 |
| 15.000 | Citigroup Inc 3.500% 15-May-2023 | 15.513 | 0,07 |
| 10.000 | Citigroup Inc 3.875% 26-Mar-2025 | 10.684 | 0,05 |
| 10.000 | Citigroup Inc 4.300% 20-Nov-2026 | 11.078 | 0,05 |
| 10.000 | Citigroup Inc 4.400% 10-Jun-2025 | 10.903 | 0,05 |
| 5.000 | Citigroup Inc 4.450% 29-Sep-2027 | 5.583 | 0,03 |
| 10.000 | Citigroup Inc 4.750% 18-May-2046 | 12.366 | 0,06 |
| 5.000 | Citigroup Inc 5.300% 06-May-2044 | 6.559 | 0,03 |
| 20.000 | Citigroup Inc 5.500% 13-Sep-2025 | 22.647 | 0,11 |
| 5.000 | Citigroup Inc 8.125% 15-Jul-2039 | 8.487 | 0,04 |
| 10.000 | Citigroup Inc FRN 2.572% 03-Jun-2031 | 10.108 | 0,05 |
| 10.000 | Citigroup Inc FRN 2.666% 29-Jan-2031 | 10.172 | 0,05 |
| 5.000 | Citigroup Inc FRN 2.976% 05-Nov-2030 | 5.202 | 0,02 |
| 10.000 | Citigroup Inc FRN 3.106% 08-Apr-2026 | 10.494 | 0,05 |
| 20.000 | Citigroup Inc FRN 3.352% 24-Apr-2025 | 20.898 | 0,10 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|-------------------------|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| US-Dollar Forts. | | | |
| 5.000 | Citigroup Inc FRN 3.887% 10-Jan-2028 | 5.427 | 0,03 |
| 20.000 | Citigroup Inc FRN 3.980% 20-Mar-2030 | 22.117 | 0,11 |
| 10.000 | Citigroup Inc FRN 4.044% 01-Jun-2024 | 10.426 | 0,05 |
| 10.000 | Citigroup Inc FRN 4.075% 23-Apr-2029 | 11.045 | 0,05 |
| 10.000 | Citigroup Inc FRN 4.412% 31-Mar-2031 | 11.443 | 0,06 |
| 10.000 | Cleco Corporate Holdings LLC 4.973% 01-May-2046 | 12.183 | 0,06 |
| 15.000 | Cleveland Electric Illuminating Co/The 5.950% 15-Dec-2036 | 20.109 | 0,10 |
| 15.000 | Clorox Co/The 3.900% 15-May-2028 | 16.850 | 0,08 |
| 10.000 | CME Group Inc 3.000% 15-Mar-2025 | 10.509 | 0,05 |
| 10.000 | CNH Industrial Capital LLC 1.450% 15-Jul-2026 | 9.802 | 0,05 |
| 5.000 | Coca-Cola Co/The 2.125% 06-Sep-2029 | 5.093 | 0,02 |
| 10.000 | Coca-Cola Co/The 2.250% 05-Jan-2032 | 10.187 | 0,05 |
| 10.000 | Coca-Cola Co/The 2.500% 01-Jun-2040 | 10.089 | 0,05 |
| 10.000 | Coca-Cola Co/The 2.900% 25-May-2027 | 10.661 | 0,05 |
| 5.000 | Coca-Cola Femsa SAB de CV 2.750% 22-Jan-2030 | 5.121 | 0,02 |
| 10.000 | Colgate-Palmolive Co 'MTN' 3.250% 15-Mar-2024 | 10.494 | 0,05 |
| 10.000 | Columbia Pipeline Group Inc 4.500% 01-Jun-2025 | 10.798 | 0,05 |
| 10.000 | Comcast Corp 1.500% 15-Feb-2031 | 9.462 | 0,05 |
| 10.000 | Comcast Corp 1.950% 15-Jan-2031 | 9.821 | 0,05 |
| 5.000 | Comcast Corp 2.650% 01-Feb-2030 | 5.196 | 0,02 |
| 10.000 | Comcast Corp 3.700% 15-Apr-2024 | 10.631 | 0,05 |
| 10.000 | Comcast Corp 3.950% 15-Oct-2025 | 10.931 | 0,05 |
| 5.000 | Comcast Corp 4.049% 01-Nov-2052 | 5.878 | 0,03 |
| 10.000 | Comcast Corp 4.150% 15-Oct-2028 | 11.369 | 0,05 |
| 10.000 | Comcast Corp 4.200% 15-Aug-2034 | 11.794 | 0,06 |
| 5.000 | Comcast Corp 4.250% 15-Oct-2030 | 5.782 | 0,03 |
| 10.000 | Comcast Corp 4.600% 15-Oct-2038 | 12.184 | 0,06 |
| 5.000 | Comcast Corp 4.950% 15-Oct-2058 | 6.955 | 0,03 |
| 5.000 | Comcast Corp 5.650% 15-Jun-2035 | 6.644 | 0,03 |
| 10.000 | Comcast Corp 6.950% 15-Aug-2037 | 15.201 | 0,07 |
| 10.000 | Comcast Corp '144A' 2.987% 01-Nov-2063 | 9.558 | 0,05 |
| 8.990 | Cometa Energia SA de CV 'REGS' 6.375% 24-Apr-2035 | 10.251 | 0,05 |
| 5.000 | Commonwealth Bank of Australia '144A' 2.625% 06-Sep-2026 | 5.259 | 0,03 |
| 5.000 | Commonwealth Bank of Australia '144A' 3.150% 19-Sep-2027 | 5.420 | 0,03 |
| 25.000 | Commonwealth Bank of Australia '144A' 4.500% 09-Dec-2025 | 27.464 | 0,13 |
| 10.000 | Commonwealth Edison Co 2.950% 15-Aug-2027 | 10.567 | 0,05 |
| 13.000 | Conagra Brands Inc 3.200% 25-Jan-2023 | 13.251 | 0,06 |
| 5.000 | Conagra Brands Inc 5.400% 01-Nov-2048 | 6.772 | 0,03 |
| 10.000 | ConocoPhillips 6.500% 01-Feb-2039 | 14.585 | 0,07 |
| 5.000 | Consolidated Edison Co of New York Inc 3.125% 15-Nov-2027 | 5.272 | 0,03 |
| 15.000 | Consolidated Edison Co of New York Inc 4.500% 15-May-2058 | 18.491 | 0,09 |
| 10.000 | Consolidated Edison Co of New York Inc 5.500% 01-Dec-2039 | 12.907 | 0,06 |
| 15.000 | Coöperatieve Rabobank UA 4.375% 04-Aug-2025 | 16.269 | 0,08 |
| 10.000 | Coöperatieve Rabobank UA 4.625% 01-Dec-2023 | 10.662 | 0,05 |
| 25.000 | Coöperatieve Rabobank UA '144A' 2.625% 22-Jul-2024 | 25.831 | 0,12 |
| 10.000 | Coöperatieve Rabobank UA 'BKNT' 3.750% 21-Jul-2026 | 10.787 | 0,05 |
| 5.000 | Coöperatieve Rabobank UA 'BKNT' 5.250% 24-May-2041 | 7.043 | 0,03 |
| 10.000 | Corning Inc 5.850% 15-Nov-2068 | 14.844 | 0,07 |
| 15.000 | Cox Communications Inc '144A' 3.500% 15-Aug-2027 | 16.136 | 0,08 |
| 5.000 | Credit Agricole SA '144A' 3.250% 14-Jan-2030 | 5.188 | 0,02 |
| 20.000 | Credit Agricole SA '144A' 4.375% 17-Mar-2025 | 21.510 | 0,10 |
| 10.000 | Credit Suisse Group AG 3.750% 26-Mar-2025 | 10.624 | 0,05 |
| 10.000 | Credit Suisse Group AG 4.550% 17-Apr-2026 | 11.035 | 0,05 |
| 15.000 | Credit Suisse Group AG 4.875% 15-May-2045 | 19.096 | 0,09 |
| 8.000 | Credit Suisse Group AG '144A' 3.574% 09-Jan-2023 | 8.002 | 0,04 |
| 5.000 | Credit Suisse Group AG '144A' 4.282% 09-Jan-2028 | 5.435 | 0,03 |
| 10.000 | Credit Suisse Group AG '144A' FRN 4.194% 01-Apr-2031 | 11.051 | 0,05 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|-------------------------|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| US-Dollar Forts. | | | |
| 15.000 | CRH America Finance Inc '144A' 4.400% 09-May-2047 | 18.057 | 0,09 |
| 10.000 | Crown Castle International Corp 1.050% 15-Jul-2026 | 9.673 | 0,05 |
| 15.000 | Crown Castle International Corp 2.100% 01-Apr-2031 | 14.386 | 0,07 |
| 10.000 | Crown Castle International Corp 3.200% 01-Sep-2024 | 10.446 | 0,05 |
| 15.000 | Crown Castle International Corp 3.800% 15-Feb-2028 | 16.347 | 0,08 |
| 5.000 | Crown Castle International Corp 4.300% 15-Feb-2029 | 5.591 | 0,03 |
| 5.000 | Crown Castle International Corp 4.450% 15-Feb-2026 | 5.480 | 0,03 |
| 5.000 | CSX Corp 4.250% 01-Nov-2066 | 6.160 | 0,03 |
| 5.000 | CSX Corp 4.750% 15-Nov-2048 | 6.483 | 0,03 |
| 10.000 | CSX Corp 6.000% 01-Oct-2036 | 13.587 | 0,07 |
| 10.000 | CSX Corp 6.220% 30-Apr-2040 | 14.313 | 0,07 |
| 5.000 | Cummins Inc 1.500% 01-Sep-2030 | 4.743 | 0,02 |
| 5.000 | CVS Health Corp 1.750% 21-Aug-2030 | 4.776 | 0,02 |
| 5.000 | CVS Health Corp 3.750% 01-Apr-2030 | 5.493 | 0,03 |
| 20.000 | CVS Health Corp 3.875% 20-Jul-2025 | 21.520 | 0,10 |
| 20.000 | CVS Health Corp 4.300% 25-Mar-2028 | 22.478 | 0,11 |
| 20.000 | CVS Health Corp 4.780% 25-Mar-2038 | 24.487 | 0,12 |
| 10.000 | CVS Health Corp 5.050% 25-Mar-2048 | 13.140 | 0,06 |
| 10.000 | CVS Health Corp 5.125% 20-Jul-2045 | 13.069 | 0,06 |
| 20.000 | Dai-ichi Life Insurance Co Ltd/The '144A' FRN (Perpetual) 4.000% 24-Jul-2026 | 21.350 | 0,10 |
| 10.000 | Daimler Finance North America LLC 8.500% 18-Jan-2031 | 14.899 | 0,07 |
| 15.000 | Danaher Corp 3.350% 15-Sep-2025 | 15.991 | 0,08 |
| 5.000 | Danske Bank A/S '144A' FRN 1.171% 08-Dec-2023 | 5.000 | 0,02 |
| 5.000 | DENTSPLY SIRONA Inc 3.250% 01-Jun-2030 | 5.292 | 0,03 |
| 10.000 | Deutsche Telekom International Finance BV 8.750% 15-Jun-2030 | 14.559 | 0,07 |
| 5.000 | Deutsche Telekom International Finance BV '144A' 4.375% 21-Jun-2028 | 5.589 | 0,03 |
| 5.000 | DH Europe Finance II Sarl 2.200% 15-Nov-2024 | 5.114 | 0,02 |
| 5.000 | DH Europe Finance II Sarl 2.600% 15-Nov-2029 | 5.176 | 0,02 |
| 15.000 | Diageo Capital Plc 2.375% 24-Oct-2029 | 15.350 | 0,07 |
| 5.000 | Discover Bank 'BKNT' 4.650% 13-Sep-2028 | 5.683 | 0,03 |
| 10.000 | Discover Financial Services 3.950% 06-Nov-2024 | 10.646 | 0,05 |
| 10.000 | DNB Bank ASA '144A' 2.150% 02-Dec-2022 | 10.149 | 0,05 |
| 5.000 | Dollar General Corp 3.500% 03-Apr-2030 | 5.414 | 0,03 |
| 5.000 | Dollar General Corp 3.875% 15-Apr-2027 | 5.496 | 0,03 |
| 10.000 | Dollar General Corp 4.125% 01-May-2028 | 11.132 | 0,05 |
| 5.000 | Dollar General Corp 4.150% 01-Nov-2025 | 5.440 | 0,03 |
| 10.000 | Dominion Energy Inc 3.300% 15-Mar-2025 | 10.475 | 0,05 |
| 5.000 | Dominion Energy Inc 3.375% 01-Apr-2030 | 5.317 | 0,03 |
| 10.000 | Dominion Energy Inc 3.600% 15-Mar-2027 | 10.780 | 0,05 |
| 5.000 | Dominion Energy Inc 3.900% 01-Oct-2025 | 5.400 | 0,03 |
| 10.000 | Dominion Energy Inc Step-Up Coupon 3.071% 15-Aug-2024 | 10.360 | 0,05 |
| 10.000 | Dominion Energy South Carolina Inc 6.050% 15-Jan-2038 | 14.116 | 0,07 |
| 4.000 | Dow Chemical Co/The 4.250% 01-Oct-2034 | 4.631 | 0,02 |
| 5.000 | Dow Chemical Co/The 4.375% 15-Nov-2042 | 5.935 | 0,03 |
| 5.000 | Dow Chemical Co/The 4.625% 01-Oct-2044 | 6.076 | 0,03 |
| 5.000 | Dow Chemical Co/The 4.800% 15-May-2049 | 6.399 | 0,03 |
| 5.000 | Dow Chemical Co/The 5.250% 15-Nov-2041 | 6.422 | 0,03 |
| 10.000 | Dow Chemical Co/The 7.375% 01-Nov-2029 | 13.479 | 0,06 |
| 20.000 | DR Horton Inc 5.750% 15-Aug-2023 | 21.253 | 0,10 |
| 10.000 | Duke Energy Carolinas LLC 5.300% 15-Feb-2040 | 13.221 | 0,06 |
| 15.000 | Duke Energy Corp 2.550% 15-Jun-2031 | 15.047 | 0,07 |
| 10.000 | Duke Energy Corp 3.150% 15-Aug-2027 | 10.534 | 0,05 |
| 5.000 | Duke Energy Florida LLC 2.500% 01-Dec-2029 | 5.149 | 0,02 |
| 5.000 | Duke Energy Florida LLC 3.200% 15-Jan-2027 | 5.326 | 0,03 |
| 30.000 | Duke Energy Florida Project Finance LLC 2.538% 01-Sep-2029 | 30.923 | 0,15 |
| 5.000 | Duke Energy Progress LLC 2.000% 15-Aug-2031 | 4.896 | 0,02 |
| 10.000 | Duke Realty LP 1.750% 01-Feb-2031 | 9.483 | 0,05 |
| 7.000 | DuPont de Nemours Inc 4.205% 15-Nov-2023 | 7.406 | 0,04 |
| 15.000 | DuPont de Nemours Inc 4.725% 15-Nov-2028 | 17.403 | 0,08 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|-------------------------|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| US-Dollar Forts. | | | |
| 10.000 | DuPont de Nemours Inc 5.319% 15-Nov-2038 | 12.938 | 0,06 |
| 5.000 | DuPont de Nemours Inc 5.419% 15-Nov-2048 | 7.020 | 0,03 |
| 15.000 | Eastman Chemical Co 3.800% 15-Mar-2025 | 16.036 | 0,08 |
| 20.000 | eBay Inc 2.700% 11-Mar-2030 | 20.485 | 0,10 |
| 10.000 | eBay Inc 3.450% 01-Aug-2024 | 10.511 | 0,05 |
| 5.000 | Ecotal Inc 2.700% 01-Nov-2026 | 5.257 | 0,03 |
| 15.000 | Edison International 4.125% 15-Mar-2028 | 15.856 | 0,08 |
| 10.000 | EDP Finance BV '144A' 3.625% 15-Jul-2024 | 10.502 | 0,05 |
| 5.000 | Edwards Lifesciences Corp 4.300% 15-Jun-2028 | 5.627 | 0,03 |
| 15.000 | Electronic Arts Inc 1.850% 15-Feb-2031 | 14.409 | 0,07 |
| 15.000 | Electronic Arts Inc 2.950% 15-Feb-2051 | 14.225 | 0,07 |
| 5.000 | Eli Lilly & Co 2.750% 01-Jun-2025 | 5.220 | 0,02 |
| 1.000 | Emera US Finance LP 3.550% 15-Jun-2026 | 1.065 | 0,00 |
| 20.000 | Enbridge Inc 2.500% 15-Jan-2025 | 20.577 | 0,10 |
| 10.000 | Enbridge Inc 4.000% 01-Oct-2023 | 10.445 | 0,05 |
| 5.000 | Enbridge Inc 4.500% 10-Jun-2044 | 5.886 | 0,03 |
| 12.000 | Enel Finance International NV '144A' 2.650% 10-Sep-2024 | 12.368 | 0,06 |
| 5.000 | Enel Finance International NV '144A' 4.750% 25-May-2047 | 6.168 | 0,03 |
| 10.000 | Enel SpA '144A' FRN 8.750% 24-Sep-2073 | 11.158 | 0,05 |
| 8.000 | Energy Transfer LP 4.250% 15-Mar-2023 | 8.223 | 0,04 |
| 10.000 | Energy Transfer LP 7.500% 01-Jul-2038 | 13.843 | 0,07 |
| 10.000 | Entergy Louisiana LLC 4.050% 01-Sep-2023 | 10.407 | 0,05 |
| 15.000 | Enterprise Products Operating LLC 3.350% 15-Mar-2023 | 15.353 | 0,07 |
| 20.000 | Enterprise Products Operating LLC 3.900% 15-Feb-2024 | 21.014 | 0,10 |
| 10.000 | Enterprise Products Operating LLC 3.950% 31-Jan-2060 | 10.875 | 0,05 |
| 5.000 | Enterprise Products Operating LLC 4.200% 31-Jan-2050 | 5.640 | 0,03 |
| 10.000 | Enterprise Products Operating LLC 4.850% 15-Aug-2042 | 12.013 | 0,06 |
| 10.000 | Enterprise Products Operating LLC 5.100% 15-Feb-2045 | 12.395 | 0,06 |
| 5.000 | Enterprise Products Operating LLC FRN 5.250% 16-Aug-2077 | 5.114 | 0,02 |
| 5.000 | Enterprise Products Operating LLC FRN 5.375% 15-Feb-2078 | 5.025 | 0,02 |
| 15.000 | Equifax Inc 3.300% 15-Dec-2022 | 15.268 | 0,07 |
| 20.000 | Equinix Inc 2.625% 18-Nov-2024 | 20.626 | 0,10 |
| 10.000 | Equinix Inc 3.200% 18-Nov-2029 | 10.530 | 0,05 |
| 5.000 | ERP Operating LP 3.500% 01-Mar-2028 | 5.442 | 0,03 |
| 10.000 | ERP Operating LP 4.150% 01-Dec-2028 | 11.312 | 0,05 |
| 15.000 | Essex Portfolio LP 3.875% 01-May-2024 | 15.802 | 0,08 |
| 5.000 | Estee Lauder Cos Inc/The 2.600% 15-Apr-2030 | 5.193 | 0,02 |
| 10.000 | Eversource Energy 1.400% 15-Aug-2026 | 9.817 | 0,05 |
| 10.000 | Eversource Energy 3.300% 15-Jan-2028 | 10.678 | 0,05 |
| 5.000 | Eversource Energy 3.800% 01-Dec-2023 | 5.252 | 0,03 |
| 10.000 | Exelon Generation Co LLC 5.750% 01-Oct-2041 | 11.961 | 0,06 |
| 10.000 | Exelon Generation Co LLC 6.250% 01-Oct-2039 | 12.540 | 0,06 |
| 5.000 | Expedia Group Inc '144A' 6.250% 01-May-2025 | 5.647 | 0,03 |
| 10.000 | Exxon Mobil Corp 2.610% 15-Oct-2030 | 10.386 | 0,05 |
| 5.000 | Exxon Mobil Corp 2.992% 19-Mar-2025 | 5.260 | 0,03 |
| 20.000 | Exxon Mobil Corp 3.043% 01-Mar-2026 | 21.188 | 0,10 |
| 10.000 | Exxon Mobil Corp 4.227% 19-Mar-2040 | 11.877 | 0,06 |
| 10.000 | Farmers Insurance Exchange '144A' FRN 4.747% 01-Nov-2057 | 11.600 | 0,06 |
| 5.000 | Federation des Caisses Desjardins du Quebec '144A' 2.050% 10-Feb-2025 | 5.068 | 0,02 |
| 5.000 | FedEx Corp 4.050% 15-Feb-2048 | 5.647 | 0,03 |
| 5.000 | FedEx Corp 4.550% 01-Apr-2046 | 6.025 | 0,03 |
| 5.000 | FedEx Corp 4.750% 15-Nov-2045 | 6.126 | 0,03 |
| 5.000 | FedEx Corp 5.250% 15-May-2050 | 6.729 | 0,03 |
| 5.000 | Fidelity Insurance Holdings Ltd '144A' 4.875% 30-Jun-2030 | 5.420 | 0,03 |
| 10.000 | Fidelity National Information Services Inc 4.500% 15-Aug-2046 | 12.186 | 0,06 |
| 10.000 | Fifth Third Bancorp 4.300% 16-Jan-2024 | 10.581 | 0,05 |
| 15.000 | First American Financial Corp 4.600% 15-Nov-2024 | 16.252 | 0,08 |
| 35.000 | FirstEnergy Corp 4.750% 15-Mar-2023 | 36.444 | 0,18 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|-------------------------|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| US-Dollar Forts. | | | |
| 10.000 | FirstEnergy Corp 7.375% 15-Nov-2031 | 13.519 | 0,07 |
| 5.000 | Fiserv Inc 2.750% 01-Jul-2024 | 5.176 | 0,02 |
| 10.000 | Fiserv Inc 3.500% 01-Jul-2029 | 10.774 | 0,05 |
| 10.000 | Fiserv Inc 4.400% 01-Jul-2049 | 11.985 | 0,06 |
| 5.000 | Florida Power & Light Co 5.950% 01-Feb-2038 | 6.988 | 0,03 |
| 10.000 | FMC Corp 3.450% 01-Oct-2029 | 10.668 | 0,05 |
| 15.000 | FMC Corp 4.100% 01-Feb-2024 | 15.737 | 0,08 |
| 15.000 | FMC Corp 4.500% 01-Oct-2049 | 18.107 | 0,09 |
| 5.000 | FMR LLC '144A' 7.570% 15-Jun-2029 | 6.899 | 0,03 |
| 10.000 | FNB Corp/PA 2.200% 24-Feb-2023 | 10.088 | 0,05 |
| 4.000 | Fortis Inc/Canada 3.055% 04-Oct-2026 | 4.169 | 0,02 |
| 10.000 | Fortune Brands Home & Security Inc 3.250% 15-Sep-2029 | 10.592 | 0,05 |
| 15.000 | Fox Corp 5.476% 25-Jan-2039 | 19.424 | 0,09 |
| 5.000 | Fresenius Medical Care US Finance III Inc '144A' 2.375% 16-Feb-2031 | 4.789 | 0,02 |
| 10.000 | GE Capital Funding LLC 4.400% 15-May-2030 | 10.863 | 0,05 |
| 25.000 | GE Capital International Funding Co Unlimited Co 4.418% 15-Nov-2035 | 29.919 | 0,14 |
| 5.000 | General Dynamics Corp 3.500% 15-May-2025 | 5.336 | 0,03 |
| 5.000 | General Electric Co 3.625% 01-May-2030 | 5.376 | 0,03 |
| 15.000 | General Mills Inc 3.200% 10-Feb-2027 | 15.964 | 0,08 |
| 5.000 | General Mills Inc 4.000% 17-Apr-2025 | 5.375 | 0,03 |
| 5.000 | General Mills Inc 4.200% 17-Apr-2028 | 5.591 | 0,03 |
| 20.000 | General Motors Co 4.875% 02-Oct-2023 | 21.257 | 0,10 |
| 30.000 | General Motors Co 6.125% 01-Oct-2025 | 34.506 | 0,17 |
| 10.000 | General Motors Financial Co Inc 2.700% 10-Jun-2031 | 9.986 | 0,05 |
| 10.000 | Georgia Power Co 3.250% 30-Mar-2027 | 10.558 | 0,05 |
| 5.000 | Georgia-Pacific LLC '144A' 2.100% 30-Apr-2027 | 5.068 | 0,02 |
| 5.000 | Georgia-Pacific LLC '144A' 2.300% 30-Apr-2030 | 5.016 | 0,02 |
| 20.000 | Georgia-Pacific LLC '144A' 3.734% 15-Jul-2023 | 20.717 | 0,10 |
| 5.000 | Gilead Sciences Inc 1.650% 01-Oct-2030 | 4.803 | 0,02 |
| 5.000 | Gilead Sciences Inc 2.800% 01-Oct-2050 | 4.879 | 0,02 |
| 20.000 | Gilead Sciences Inc 3.650% 01-Mar-2026 | 21.575 | 0,10 |
| 10.000 | Gilead Sciences Inc 4.000% 01-Sep-2036 | 11.539 | 0,06 |
| 15.000 | Gilead Sciences Inc 4.600% 01-Sep-2035 | 18.204 | 0,09 |
| 5.000 | GlaxoSmithKline Capital Inc 2.800% 18-Mar-2023 | 5.123 | 0,02 |
| 5.000 | GlaxoSmithKline Capital Inc 3.375% 15-May-2023 | 5.179 | 0,02 |
| 5.000 | GlaxoSmithKline Capital Inc 3.625% 15-May-2025 | 5.391 | 0,03 |
| 10.000 | GlaxoSmithKline Capital Inc 6.375% 15-May-2038 | 14.691 | 0,07 |
| 5.000 | GlaxoSmithKline Capital Plc 3.000% 01-Jun-2024 | 5.235 | 0,03 |
| 5.000 | GlaxoSmithKline Capital Plc 3.375% 01-Jun-2029 | 5.462 | 0,03 |
| 10.000 | Glencore Funding LLC '144A' 4.125% 30-May-2023 | 10.412 | 0,05 |
| 15.000 | Glencore Funding LLC '144A' 4.875% 12-Mar-2029 | 16.994 | 0,08 |
| 15.000 | Global Atlantic Fin Co '144A' 4.400% 15-Oct-2029 | 16.180 | 0,08 |
| 5.000 | Global Payments Inc 2.650% 15-Feb-2025 | 5.144 | 0,02 |
| 20.000 | Global Payments Inc 2.900% 15-May-2030 | 20.406 | 0,10 |
| 5.000 | GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 4.000% 15-Jan-2030 | 5.297 | 0,03 |
| 5.000 | GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 4.000% 15-Jan-2031 | 5.342 | 0,03 |
| 5.000 | GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 5.300% 15-Jan-2029 | 5.683 | 0,03 |
| 5.000 | GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 5.375% 01-Nov-2023 | 5.312 | 0,03 |
| 15.000 | GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 5.375% 15-Apr-2026 | 16.723 | 0,08 |
| 5.000 | Goldman Sachs Group Inc/The 2.600% 07-Feb-2030 | 5.094 | 0,02 |
| 10.000 | Goldman Sachs Group Inc/The 3.500% 23-Jan-2025 | 10.548 | 0,05 |
| 5.000 | Goldman Sachs Group Inc/The 3.500% 01-Apr-2025 | 5.293 | 0,03 |
| 10.000 | Goldman Sachs Group Inc/The 3.750% 22-May-2025 | 10.684 | 0,05 |
| 10.000 | Goldman Sachs Group Inc/The 3.750% 25-Feb-2026 | 10.784 | 0,05 |
| 10.000 | Goldman Sachs Group Inc/The 3.800% 15-Mar-2030 | 11.030 | 0,05 |
| 10.000 | Goldman Sachs Group Inc/The 3.850% 26-Jan-2027 | 10.759 | 0,05 |
| 20.000 | Goldman Sachs Group Inc/The 4.000% 03-Mar-2024 | 21.218 | 0,10 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|-------------------------|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| US-Dollar Forts. | | | |
| 5.000 | Goldman Sachs Group Inc/The 5.150% 22-May-2045 | 6.534 | 0,03 |
| 10.000 | Goldman Sachs Group Inc/The 6.250% 01-Feb-2041 | 14.601 | 0,07 |
| 5.000 | Goldman Sachs Group Inc/The 6.450% 01-May-2036 | 6.860 | 0,03 |
| 20.000 | Goldman Sachs Group Inc/The 6.750% 01-Oct-2037 | 28.464 | 0,14 |
| 10.000 | Goldman Sachs Group Inc/The FRN 1.542% 10-Sep-2027 | 9.809 | 0,05 |
| 10.000 | Goldman Sachs Group Inc/The FRN 2.383% 21-Jul-2032 | 9.866 | 0,05 |
| 5.000 | Goldman Sachs Group Inc/The FRN 3.272% 29-Sep-2025 | 5.251 | 0,03 |
| 5.000 | Goldman Sachs Group Inc/The FRN 3.691% 05-Jun-2028 | 5.392 | 0,03 |
| 10.000 | Goldman Sachs Group Inc/The FRN 3.814% 23-Apr-2029 | 10.895 | 0,05 |
| 5.000 | Goldman Sachs Group Inc/The FRN 4.017% 31-Oct-2038 | 5.742 | 0,03 |
| 15.000 | Goldman Sachs Group Inc/The FRN 4.223% 01-May-2029 | 16.689 | 0,08 |
| 5.000 | Goldman Sachs Group Inc/The FRN 4.411% 23-Apr-2039 | 5.997 | 0,03 |
| 10.000 | Goldman Sachs Group Inc/The 'MTN' 3.850% 08-Jul-2024 | 10.577 | 0,05 |
| 5.000 | Goodman US Finance Three LLC '144A' 3.700% 15-Mar-2028 | 5.407 | 0,03 |
| 10.000 | Hartford Financial Services Group Inc/The 4.400% 15-Mar-2048 | 12.348 | 0,06 |
| 5.000 | Hasbro Inc 3.000% 19-Nov-2024 | 5.208 | 0,02 |
| 10.000 | Hasbro Inc 3.900% 19-Nov-2029 | 11.047 | 0,05 |
| 5.000 | Hasbro Inc 5.100% 15-May-2044 | 6.255 | 0,03 |
| 5.000 | HBOS Plc '144A' 6.000% 01-Nov-2033 | 6.610 | 0,03 |
| 20.000 | HCA Inc 4.125% 15-Jun-2029 | 22.048 | 0,11 |
| 10.000 | HCA Inc 4.750% 01-May-2023 | 10.478 | 0,05 |
| 5.000 | HCA Inc 5.250% 15-Apr-2025 | 5.538 | 0,03 |
| 5.000 | HCA Inc 5.250% 15-Jun-2049 | 6.455 | 0,03 |
| 5.000 | HCA Inc 5.500% 15-Jun-2047 | 6.579 | 0,03 |
| 5.000 | Health Care Service Corp A Mutual Legal Reserve Co '144A' 2.200% 01-Jun-2030 | 4.907 | 0,02 |
| 5.000 | Healthcare Trust of America Holdings LP 3.100% 15-Feb-2030 | 5.172 | 0,02 |
| 5.000 | Healthpeak Properties Inc 3.000% 15-Jan-2030 | 5.259 | 0,03 |
| 10.000 | Healthpeak Properties Inc 3.400% 01-Feb-2025 | 10.507 | 0,05 |
| 15.000 | Hewlett Packard Enterprise Co 4.450% 02-Oct-2023 | 15.836 | 0,08 |
| 10.000 | Home Depot Inc/The 3.000% 01-Apr-2026 | 10.640 | 0,05 |
| 10.000 | Home Depot Inc/The 3.350% 15-Sep-2025 | 10.689 | 0,05 |
| 5.000 | Home Depot Inc/The 3.500% 15-Sep-2056 | 5.682 | 0,03 |
| 10.000 | Home Depot Inc/The 5.875% 16-Dec-2036 | 14.209 | 0,07 |
| 5.000 | Honeywell International Inc 5.700% 15-Mar-2036 | 6.837 | 0,03 |
| 35.000 | HSBC Holdings Plc 4.300% 08-Mar-2026 | 38.408 | 0,19 |
| 10.000 | HSBC Holdings Plc 4.375% 23-Nov-2026 | 10.985 | 0,05 |
| 20.000 | HSBC Holdings Plc 4.950% 31-Mar-2030 | 23.514 | 0,11 |
| 10.000 | HSBC Holdings Plc 7.625% 17-May-2032 | 13.829 | 0,07 |
| 10.000 | HSBC Holdings Plc FRN 3.803% 11-Mar-2025 | 10.501 | 0,05 |
| 20.000 | HSBC Holdings Plc FRN 3.950% 18-May-2024 | 20.749 | 0,10 |
| 20.000 | HSBC Holdings Plc FRN 3.973% 22-May-2030 | 21.734 | 0,10 |
| 25.000 | HSBC Holdings Plc FRN 4.583% 19-Jun-2029 | 28.051 | 0,14 |
| 20.000 | HSBC USA Inc 3.500% 23-Jun-2024 | 21.112 | 0,10 |
| 14.000 | Hubbell Inc 3.150% 15-Aug-2027 | 14.758 | 0,07 |
| 5.000 | Hubbell Inc 3.350% 01-Mar-2026 | 5.285 | 0,03 |
| 5.000 | Humana Inc 2.900% 15-Dec-2022 | 5.100 | 0,02 |
| 5.000 | Humana Inc 3.850% 01-Oct-2024 | 5.312 | 0,03 |
| 10.000 | Huntington Ingalls Industries Inc 3.483% 01-Dec-2027 | 10.607 | 0,05 |
| 5.000 | Hutchison Whampoa International 03/33 Ltd '144A' 7.450% 24-Nov-2033 | 7.441 | 0,04 |
| 20.000 | Hyundai Capital America '144A' 2.375% 10-Feb-2023 | 20.284 | 0,10 |
| 15.000 | Hyundai Capital America '144A' 5.875% 07-Apr-2025 | 16.802 | 0,08 |
| 5.000 | IHS Markit Ltd 4.125% 01-Aug-2023 | 5.237 | 0,03 |
| 30.000 | IHS Markit Ltd '144A' 4.750% 15-Feb-2025 | 32.741 | 0,16 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|-------------------------|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| US-Dollar Forts. | | | |
| 15.000 | Imperial Brands Finance Plc '144A' 3.500% 11-Feb-2023 | 15.284 | 0,07 |
| 10.000 | Imperial Brands Finance Plc '144A' 4.250% 21-Jul-2025 | 10.750 | 0,05 |
| 10.000 | Intel Corp 2.000% 12-Aug-2031 | 9.957 | 0,05 |
| 10.000 | Intercontinental Exchange Inc 1.850% 15-Sep-2032 | 9.595 | 0,05 |
| 5.000 | Intercontinental Exchange Inc 3.100% 15-Sep-2027 | 5.316 | 0,03 |
| 10.000 | Intercontinental Exchange Inc 3.750% 21-Sep-2028 | 11.052 | 0,05 |
| 10.000 | Intercontinental Exchange Inc 4.250% 21-Sep-2048 | 12.254 | 0,06 |
| 25.000 | International Business Machines Corp 3.500% 15-May-2029 | 27.181 | 0,13 |
| 15.000 | International Business Machines Corp 7.000% 30-Oct-2025 | 18.126 | 0,09 |
| 10.000 | International Flavors & Fragrances Inc 4.375% 01-Jun-2047 | 11.681 | 0,06 |
| 5.000 | International Paper Co 7.300% 15-Nov-2039 | 7.686 | 0,04 |
| 10.000 | Interpublic Group of Cos Inc/The 4.750% 30-Mar-2030 | 11.635 | 0,06 |
| 5.000 | Interstate Power and Light Co 3.250% 01-Dec-2024 | 5.254 | 0,03 |
| 15.000 | Interstate Power and Light Co 3.600% 01-Apr-2029 | 16.335 | 0,08 |
| 10.000 | Intesa Sanpaolo SpA '144A' 4.700% 23-Sep-2049 | 12.027 | 0,06 |
| 15.000 | Intuit Inc 0.650% 15-Jul-2023 | 14.961 | 0,07 |
| 15.000 | Intuit Inc 0.950% 15-Jul-2025 | 14.803 | 0,07 |
| 5.000 | Intuit Inc 1.650% 15-Jul-2030 | 4.833 | 0,02 |
| 15.000 | ITC Holdings Corp '144A' 2.950% 14-May-2030 | 15.352 | 0,07 |
| 10.000 | J M Smucker Co/The 2.375% 15-Mar-2030 | 10.042 | 0,05 |
| 15.000 | Jackson National Life Global Funding '144A' 3.875% 11-Jun-2025 | 16.151 | 0,08 |
| 15.000 | Jefferies Group LLC / Jefferies Group Capital Finance Inc 4.150% 23-Jan-2024 | 16.663 | 0,08 |
| 4.573 | JetBlue 2019-1 Class AA Pass Through Trust 2.750% 15-May-2032 | 4.626 | 0,02 |
| 10.000 | John Deere Capital Corp 'MTN' 2.000% 17-Jun-2031 | 10.020 | 0,05 |
| 10.000 | Johnson & Johnson 1.300% 01-Sep-2030 | 9.655 | 0,05 |
| 10.000 | Johnson & Johnson 2.450% 01-Mar-2026 | 10.443 | 0,05 |
| 10.000 | Johnson & Johnson 2.450% 01-Sep-2060 | 9.523 | 0,05 |
| 10.000 | JPMorgan Chase & Co 3.875% 10-Sep-2024 | 10.616 | 0,05 |
| 10.000 | JPMorgan Chase & Co 4.250% 01-Oct-2027 | 11.234 | 0,05 |
| 10.000 | JPMorgan Chase & Co 5.500% 15-Oct-2040 | 13.664 | 0,07 |
| 5.000 | JPMorgan Chase & Co 6.400% 15-May-2038 | 7.303 | 0,04 |
| 30.000 | JPMorgan Chase & Co FRN 1.470% 22-Sep-2027 | 29.438 | 0,14 |
| 10.000 | JPMorgan Chase & Co FRN 2.083% 22-Apr-2026 | 10.162 | 0,05 |
| 20.000 | JPMorgan Chase & Co FRN 2.739% 15-Oct-2030 | 20.590 | 0,10 |
| 15.000 | JPMorgan Chase & Co FRN 3.220% 01-Mar-2025 | 15.604 | 0,08 |
| 5.000 | JPMorgan Chase & Co FRN 3.509% 23-Jan-2029 | 5.364 | 0,03 |
| 15.000 | JPMorgan Chase & Co FRN 3.540% 01-May-2028 | 16.313 | 0,08 |
| 10.000 | JPMorgan Chase & Co FRN 3.559% 23-Apr-2024 | 10.338 | 0,05 |
| 10.000 | JPMorgan Chase & Co FRN 3.702% 06-May-2030 | 10.949 | 0,05 |
| 5.000 | JPMorgan Chase & Co FRN 3.782% 01-Feb-2028 | 5.420 | 0,03 |
| 35.000 | JPMorgan Chase & Co FRN 3.797% 23-Jul-2024 | 36.493 | 0,18 |
| 10.000 | JPMorgan Chase & Co FRN 3.882% 24-Jul-2038 | 11.395 | 0,05 |
| 10.000 | JPMorgan Chase & Co FRN 4.005% 23-Apr-2029 | 11.055 | 0,05 |
| 15.000 | JPMorgan Chase & Co FRN 4.023% 05-Dec-2024 | 15.824 | 0,08 |
| 20.000 | JPMorgan Chase & Co FRN 4.493% 24-Mar-2031 | 23.190 | 0,11 |
| 10.000 | Kansas City Southern/Old 4.200% 15-Nov-2069 | 11.913 | 0,06 |
| 15.000 | Kellogg Co 4.300% 15-May-2028 | 17.004 | 0,08 |
| 5.000 | Kellogg Co 4.500% 01-Apr-2046 | 6.245 | 0,03 |
| 10.000 | Keurig Dr Pepper Inc 3.130% 15-Dec-2023 | 10.369 | 0,05 |
| 10.000 | Keurig Dr Pepper Inc 4.420% 15-Dec-2046 | 11.930 | 0,06 |
| 10.000 | Keurig Dr Pepper Inc 4.597% 25-May-2028 | 11.391 | 0,05 |
| 10.000 | Keurig Dr Pepper Inc 4.985% 25-May-2038 | 12.409 | 0,06 |
| 5.000 | Keysight Technologies Inc 4.550% 30-Oct-2024 | 5.411 | 0,03 |
| 10.000 | Kilroy Realty LP 3.450% 15-Dec-2024 | 10.484 | 0,05 |
| 15.000 | Kilroy Realty LP 4.750% 15-Dec-2028 | 17.184 | 0,08 |
| 5.000 | Kimco Realty Corp 3.700% 01-Oct-2049 | 5.361 | 0,03 |
| 5.000 | Kimco Realty Corp 4.125% 01-Dec-2046 | 5.675 | 0,03 |
| 5.000 | Kimco Realty Corp 4.450% 01-Sep-2047 | 5.995 | 0,03 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|-------------------------|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| US-Dollar Forts. | | | |
| 5.000 | Kinder Morgan Energy Partners LP 4.150% 01-Feb-2024 | 5.264 | 0,03 |
| 5.000 | Kinder Morgan Energy Partners LP 6.550% 15-Sep-2040 | 6.759 | 0,03 |
| 5.000 | Kinder Morgan Energy Partners LP 'MTN' 6.950% 15-Jan-2038 | 6.944 | 0,03 |
| 10.000 | Kinder Morgan Inc 3.150% 15-Jan-2023 | 10.214 | 0,05 |
| 15.000 | Kinder Morgan Inc 3.600% 15-Feb-2051 | 15.175 | 0,07 |
| 5.000 | Kinder Morgan Inc 5.050% 15-Feb-2046 | 6.026 | 0,03 |
| 5.000 | Kinder Morgan Inc 'GMTN' 7.750% 15-Jan-2032 | 7.040 | 0,03 |
| 5.000 | KLA Corp 3.300% 01-Mar-2050 | 5.355 | 0,03 |
| 5.000 | KLA Corp 4.100% 15-Mar-2029 | 5.654 | 0,03 |
| 20.000 | KLA Corp 4.650% 01-Nov-2024 | 21.701 | 0,10 |
| 5.000 | Koninklijke Philips NV 5.000% 15-Mar-2042 | 6.386 | 0,03 |
| 5.000 | Koninklijke Philips NV 6.875% 11-Mar-2038 | 7.333 | 0,04 |
| 5.000 | Kroger Co/The 2.200% 01-May-2030 | 4.991 | 0,02 |
| 10.000 | L3Harris Technologies Inc 3.832% 27-Apr-2025 | 10.673 | 0,05 |
| 15.000 | L3Harris Technologies Inc 3.950% 28-May-2024 | 15.878 | 0,08 |
| 10.000 | L3Harris Technologies Inc 4.400% 15-Jun-2028 | 11.242 | 0,05 |
| 10.000 | L3Harris Technologies Inc 4.854% 27-Apr-2035 | 12.252 | 0,06 |
| 5.000 | Laboratory Corp of America Holdings 2.950% 01-Dec-2029 | 5.213 | 0,02 |
| 5.000 | Laboratory Corp of America Holdings 4.700% 01-Feb-2045 | 6.118 | 0,03 |
| 10.000 | Las Vegas Sands Corp 3.200% 08-Aug-2024 | 10.189 | 0,05 |
| 10.000 | Lazard Group LLC 3.625% 01-Mar-2027 | 10.728 | 0,05 |
| 5.000 | Lazard Group LLC 3.750% 13-Feb-2025 | 5.324 | 0,03 |
| 5.000 | Legg Mason Inc 4.750% 15-Mar-2026 | 5.611 | 0,03 |
| 5.000 | Leidos Inc 2.300% 15-Feb-2031 | 4.822 | 0,02 |
| 5.000 | Level 3 Financing Inc '144A' 3.400% 01-Mar-2027 | 5.169 | 0,02 |
| 15.000 | Life Storage LP 3.875% 15-Dec-2027 | 16.480 | 0,08 |
| 20.000 | Lockheed Martin Corp 3.550% 15-Jan-2026 | 21.680 | 0,10 |
| 5.000 | Lockheed Martin Corp 4.090% 15-Sep-2052 | 6.168 | 0,03 |
| 20.000 | Lowe's Cos Inc 4.050% 03-May-2047 | 23.146 | 0,11 |
| 10.000 | Lowe's Cos Inc 6.500% 15-Mar-2029 | 12.757 | 0,06 |
| 10.000 | LyondellBasell Industries NV 4.625% 26-Feb-2055 | 12.274 | 0,06 |
| 5.000 | Macquarie Bank Ltd '144A' 3.624% 03-Jun-2030 | 5.228 | 0,03 |
| 10.000 | Macquarie Group Ltd '144A' FRN 2.691% 23-Jun-2032 | 9.996 | 0,05 |
| 5.000 | Magellan Midstream Partners LP 3.950% 01-Mar-2050 | 5.329 | 0,03 |
| 5.000 | Magellan Midstream Partners LP 4.200% 03-Oct-2047 | 5.480 | 0,03 |
| 20.000 | Marriott International Inc/MD 3.600% 15-Apr-2024 | 20.931 | 0,10 |
| 2.000 | Marriott International Inc/MD 5.750% 01-May-2025 | 2.254 | 0,01 |
| 5.000 | Mars Inc '144A' 3.200% 01-Apr-2030 | 5.395 | 0,03 |
| 5.000 | Mars Inc '144A' 4.200% 01-Apr-2059 | 6.448 | 0,03 |
| 15.000 | Marsh & McLennan Cos Inc 3.300% 14-Mar-2023 | 15.399 | 0,07 |
| 5.000 | Marsh & McLennan Cos Inc 3.875% 15-Mar-2024 | 5.292 | 0,03 |
| 10.000 | Marsh & McLennan Cos Inc 4.375% 15-Mar-2029 | 11.419 | 0,05 |
| 15.000 | Martin Marietta Materials Inc 3.500% 15-Dec-2027 | 16.155 | 0,08 |
| 5.000 | Massachusetts Institute of Technology 3.885% 01-Jul-2116 | 6.296 | 0,03 |
| 5.000 | Massachusetts Mutual Life Insurance Co '144A' 3.729% 15-Oct-2070 | 5.580 | 0,03 |
| 10.000 | Mastercard Inc 2.950% 01-Jun-2029 | 10.732 | 0,05 |
| 15.000 | McCormick & Co Inc/MD 0.900% 15-Feb-2026 | 14.518 | 0,07 |
| 15.000 | McCormick & Co Inc/MD 1.850% 15-Feb-2031 | 14.340 | 0,07 |
| 5.000 | McDonald's Corp 'MTN' 1.450% 01-Sep-2025 | 5.051 | 0,02 |
| 5.000 | McDonald's Corp 'MTN' 3.375% 26-May-2025 | 5.320 | 0,03 |
| 5.000 | McDonald's Corp 'MTN' 3.500% 01-Mar-2027 | 5.408 | 0,03 |
| 10.000 | McDonald's Corp 'MTN' 3.700% 30-Jan-2026 | 10.774 | 0,05 |
| 5.000 | McDonald's Corp 'MTN' 3.800% 01-Apr-2028 | 5.502 | 0,03 |
| 5.000 | McDonald's Corp 'MTN' 4.200% 01-Apr-2050 | 6.090 | 0,03 |
| 5.000 | McDonald's Corp 'MTN' 4.450% 01-Sep-2048 | 6.193 | 0,03 |
| 5.000 | McDonald's Corp 'MTN' 4.600% 26-May-2045 | 6.242 | 0,03 |
| 5.000 | McDonald's Corp 'MTN' 4.700% 09-Dec-2035 | 6.106 | 0,03 |
| 5.000 | McDonald's Corp 'MTN' 4.875% 09-Dec-2045 | 6.459 | 0,03 |
| 5.000 | McDonald's Corp 'MTN' 6.300% 15-Oct-2037 | 7.051 | 0,03 |
| 15.000 | Merck & Co Inc 2.750% 10-Feb-2025 | 15.722 | 0,08 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Nettovermögen % |
|-------------------------|--|----------------------------|-----------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| US-Dollar Forts. | | | |
| 10.000 | Merck & Co Inc 2.800% 18-May-2023 | 10.298 | 0,05 |
| 5.000 | Merck & Co Inc 2.900% 07-Mar-2024 | 5.220 | 0,02 |
| 10.000 | Merck & Co Inc 3.400% 07-Mar-2029 | 10.898 | 0,05 |
| 5.000 | MetLife Inc 10.750% 01-Aug-2039 | 8.485 | 0,04 |
| 19.000 | Metropolitan Life Global Funding I '144A' 1.950% 13-Jan-2023 | 19.249 | 0,09 |
| 5.000 | Metropolitan Life Global Funding I '144A' 2.950% 09-Apr-2030 | 5.283 | 0,03 |
| 5.000 | Metropolitan Life Global Funding I '144A' 3.000% 10-Jan-2023 | 5.121 | 0,02 |
| 15.000 | Microchip Technology Inc 0.972% 15-Feb-2024 | 14.852 | 0,07 |
| 20.000 | Microchip Technology Inc 2.670% 01-Sep-2023 | 20.436 | 0,10 |
| 4.000 | Microsoft Corp 2.675% 01-Jun-2060 | 4.019 | 0,02 |
| 10.000 | Microsoft Corp 2.921% 17-Mar-2052 | 10.688 | 0,05 |
| 10.000 | Microsoft Corp 3.041% 17-Mar-2062 | 10.780 | 0,05 |
| 15.000 | Microsoft Corp 4.200% 03-Nov-2035 | 18.426 | 0,09 |
| 15.000 | Mid-America Apartments LP 3.750% 15-Jun-2024 | 15.806 | 0,08 |
| 5.000 | Midwest Connector Capital Co LLC '144A' 3.900% 01-Apr-2024 | 5.186 | 0,02 |
| 10.000 | Mississippi Power Co 3.950% 30-Mar-2028 | 10.976 | 0,05 |
| 10.000 | Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 2.193% 25-Feb-2025 | 10.210 | 0,05 |
| 10.000 | Mitsubishi UFJ Financial Group Inc 2.559% 25-Feb-2030 | 10.106 | 0,05 |
| 10.000 | Mitsubishi UFJ Financial Group Inc FRN 0.848% 15-Sep-2024 | 9.956 | 0,05 |
| 10.000 | Mitsubishi UFJ Financial Group Inc FRN 1.538% 20-Jul-2027 | 9.833 | 0,05 |
| 10.000 | Mitsubishi UFJ Financial Group Inc FRN 2.494% 13-Oct-2032 | 10.036 | 0,05 |
| 15.000 | Mitsui Sumitomo Insurance Co Ltd '144A' FRN (Perpetual) 4.950% 06-Mar-2029 | 17.100 | 0,08 |
| 35.000 | Mizuho Financial Group Inc 4.018% 05-Mar-2028 | 38.895 | 0,19 |
| 15.000 | Mizuho Financial Group Inc FRN 3.153% 16-Jul-2030 | 15.759 | 0,08 |
| 15.000 | Mizuho Financial Group Inc FRN 3.922% 11-Sep-2024 | 15.678 | 0,08 |
| 15.000 | Mondelez International Inc 2.750% 13-Apr-2030 | 15.490 | 0,07 |
| 5.000 | Moody's Corp 4.250% 01-Feb-2029 | 5.651 | 0,03 |
| 5.000 | Morgan Stanley 3.625% 20-Jan-2027 | 5.428 | 0,03 |
| 15.000 | Morgan Stanley 3.875% 29-Apr-2024 | 15.913 | 0,08 |
| 5.000 | Morgan Stanley 3.950% 23-Apr-2027 | 5.505 | 0,03 |
| 10.000 | Morgan Stanley 5.000% 24-Nov-2025 | 11.204 | 0,05 |
| 20.000 | Morgan Stanley FRN 1.593% 04-May-2027 | 19.808 | 0,10 |
| 10.000 | Morgan Stanley FRN 3.591% 22-Jul-2028 | 10.796 | 0,05 |
| 20.000 | Morgan Stanley FRN 3.737% 24-Apr-2024 | 20.699 | 0,10 |
| 10.000 | Morgan Stanley FRN 3.971% 22-Jul-2038 | 11.444 | 0,06 |
| 10.000 | Morgan Stanley 'GMTN' 3.750% 25-Feb-2023 | 10.347 | 0,05 |
| 5.000 | Morgan Stanley 'GMTN' 3.875% 27-Jan-2026 | 5.415 | 0,03 |
| 5.000 | Morgan Stanley 'GMTN' 4.000% 23-Jul-2025 | 5.426 | 0,03 |
| 10.000 | Morgan Stanley 'GMTN' 4.350% 08-Sep-2026 | 11.059 | 0,05 |
| 10.000 | Morgan Stanley 'GMTN' FRN 2.699% 22-Jan-2031 | 10.252 | 0,05 |
| 5.000 | Morgan Stanley 'GMTN' FRN 3.772% 24-Jan-2029 | 5.449 | 0,03 |
| 10.000 | Morgan Stanley 'GMTN' FRN 4.431% 23-Jan-2030 | 11.415 | 0,05 |
| 5.000 | Morgan Stanley 'MTN' 3.125% 27-Jul-2026 | 5.305 | 0,03 |
| 15.000 | Morgan Stanley 'MTN' 4.100% 22-May-2023 | 15.627 | 0,08 |
| 15.000 | Morgan Stanley 'MTN' FRN 2.720% 22-Jul-2025 | 15.470 | 0,07 |
| 20.000 | Morgan Stanley 'MTN' FRN 3.822% 01-Apr-2031 | 21.838 | 0,11 |
| 12.000 | Motorola Solutions Inc 4.000% 01-Sep-2024 | 12.791 | 0,06 |
| 10.000 | Motorola Solutions Inc 4.600% 23-May-2029 | 11.446 | 0,06 |
| 10.000 | MPLX LP 4.500% 15-Jul-2023 | 10.415 | 0,05 |
| 5.000 | MPLX LP 4.500% 15-Apr-2038 | 5.622 | 0,03 |
| 5.000 | MPLX LP 5.200% 01-Mar-2047 | 6.155 | 0,03 |
| 5.000 | MPLX LP 5.500% 15-Feb-2049 | 6.420 | 0,03 |
| 10.000 | Narragansett Electric Co/The '144A' 5.638% 15-Mar-2040 | 12.953 | 0,06 |
| 10.000 | Nasdaq Inc 3.850% 30-Jun-2026 | 10.920 | 0,05 |
| 5.000 | Nasdaq Inc 4.250% 01-Jun-2024 | 5.316 | 0,03 |
| 10.000 | National Australia Bank Ltd '144A' 2.990% 21-May-2031 | 10.051 | 0,05 |
| 15.000 | National Fuel Gas Co 2.950% 01-Mar-2031 | 15.106 | 0,07 |
| 5.000 | National Fuel Gas Co 3.950% 15-Sep-2027 | 5.317 | 0,03 |
| 5.000 | National Fuel Gas Co 5.200% 15-Jul-2025 | 5.487 | 0,03 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Nettovermögen % |
|-------------------------|--|----------------------------|-----------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| US-Dollar Forts. | | | |
| 10.000 | National Retail Properties Inc 3.000% 15-Apr-2052 | 9.520 | 0,05 |
| 10.000 | National Retail Properties Inc 3.900% 15-Jun-2024 | 10.570 | 0,05 |
| 10.000 | National Rural Utilities Cooperative Finance Corp 4.023% 01-Nov-2032 | 11.308 | 0,05 |
| 20.000 | National Rural Utilities Cooperative Finance Corp FRN 5.250% 20-Apr-2046 | 21.538 | 0,10 |
| 35.000 | Nationwide Building Society '144A' 3.900% 21-Jul-2025 | 37.792 | 0,18 |
| 10.000 | Nationwide Building Society '144A' FRN 4.125% 18-Oct-2032 | 10.677 | 0,05 |
| 5.000 | Nationwide Mutual Insurance Co '144A' 9.375% 15-Aug-2039 | 8.678 | 0,04 |
| 25.000 | NatWest Group Plc 5.125% 28-May-2024 | 26.978 | 0,13 |
| 20.000 | NatWest Group Plc 6.100% 10-Jun-2023 | 21.332 | 0,10 |
| 10.000 | NatWest Group Plc FRN 3.032% 28-Nov-2035 | 9.889 | 0,05 |
| 10.000 | NatWest Group Plc FRN 5.076% 27-Jan-2030 | 11.618 | 0,06 |
| 5.000 | Nestle Holdings Inc '144A' 3.350% 24-Sep-2023 | 5.208 | 0,02 |
| 5.000 | Nestle Holdings Inc '144A' 3.500% 24-Sep-2025 | 5.369 | 0,03 |
| 5.000 | Nestle Holdings Inc '144A' 3.900% 24-Sep-2038 | 5.837 | 0,03 |
| 10.000 | Nevada Power Co 6.750% 01-Jul-2037 | 14.881 | 0,07 |
| 5.000 | New York and Presbyterian Hospital/The 3.954% 01-Aug-2119 | 6.129 | 0,03 |
| 5.000 | New York Community Bancorp Inc FRN 5.900% 06-Nov-2028 | 5.386 | 0,03 |
| 10.000 | New York Life Global Funding '144A' 0.950% 24-Jun-2025 | 9.867 | 0,05 |
| 5.000 | New York Life Global Funding '144A' 1.100% 05-May-2023 | 5.024 | 0,02 |
| 5.000 | New York Life Global Funding '144A' 2.000% 22-Jan-2025 | 5.109 | 0,02 |
| 5.000 | New York Life Insurance Co '144A' 6.750% 15-Nov-2039 | 7.597 | 0,04 |
| 10.000 | New York State Electric & Gas Corp '144A' 3.250% 01-Dec-2026 | 10.654 | 0,05 |
| 10.000 | NewMarket Corp 2.700% 18-Mar-2031 | 9.981 | 0,05 |
| 15.000 | NewMarket Corp 4.100% 15-Dec-2022 | 15.455 | 0,07 |
| 5.000 | Newmont Corp 2.800% 01-Oct-2029 | 5.151 | 0,02 |
| 5.000 | Newmont Corp 4.875% 15-Mar-2042 | 6.293 | 0,03 |
| 5.000 | Newmont Corp 6.250% 01-Oct-2039 | 7.002 | 0,03 |
| 5.000 | NextEra Energy Capital Holdings Inc 0.650% 01-Mar-2023 | 4.991 | 0,02 |
| 5.000 | NextEra Energy Capital Holdings Inc 2.750% 01-Nov-2029 | 5.147 | 0,02 |
| 5.000 | NextEra Energy Capital Holdings Inc FRN 4.800% 01-Dec-2077 | 5.334 | 0,03 |
| 5.000 | NextEra Energy Capital Holdings Inc FRN 5.650% 01-May-2079 | 5.675 | 0,03 |
| 10.000 | NGPL PipeCo LLC '144A' 4.875% 15-Aug-2027 | 11.144 | 0,05 |
| 10.000 | Nippon Life Insurance Co '144A' FRN 5.100% 18-Oct-2044 | 10.780 | 0,05 |
| 20.000 | NiSource Inc 0.950% 15-Aug-2025 | 19.493 | 0,09 |
| 10.000 | NiSource Inc 1.700% 15-Feb-2031 | 9.360 | 0,05 |
| 5.000 | NiSource Inc 4.375% 15-May-2047 | 5.922 | 0,03 |
| 5.000 | NiSource Inc 5.250% 15-Feb-2043 | 6.436 | 0,03 |
| 20.000 | Nissan Motor Co Ltd '144A' 3.043% 15-Sep-2023 | 20.532 | 0,10 |
| 20.000 | Nissan Motor Co Ltd '144A' 4.810% 17-Sep-2030 | 22.413 | 0,11 |
| 15.000 | Norfolk Southern Corp 2.550% 01-Nov-2029 | 15.396 | 0,07 |
| 5.000 | Norfolk Southern Corp 3.850% 15-Jan-2024 | 5.243 | 0,03 |
| 10.000 | Norfolk Southern Corp 3.942% 01-Nov-2047 | 11.644 | 0,06 |
| 10.000 | Norfolk Southern Corp 4.650% 15-Jan-2046 | 12.752 | 0,06 |
| 5.000 | Norfolk Southern Corp 4.837% 01-Oct-2041 | 6.341 | 0,03 |
| 10.000 | Northrop Grumman Corp 2.930% 15-Jan-2025 | 10.428 | 0,05 |
| 5.000 | Northrop Grumman Corp 4.030% 15-Oct-2047 | 5.928 | 0,03 |
| 5.000 | Northrop Grumman Corp 4.750% 01-Jun-2043 | 6.322 | 0,03 |
| 10.000 | Northwestern Mutual Life Insurance Co/The '144A' 3.625% 30-Sep-2059 | 11.094 | 0,05 |
| 10.000 | Novartis Capital Corp 2.000% 14-Feb-2027 | 10.173 | 0,05 |
| 10.000 | Novartis Capital Corp 3.400% 06-May-2024 | 10.558 | 0,05 |
| 10.000 | NRG Energy Inc '144A' 2.450% 02-Dec-2027 | 9.924 | 0,05 |
| 10.000 | Nucor Corp 2.979% 15-Dec-2055 | 9.899 | 0,05 |
| 10.000 | Nucor Corp 4.000% 01-Aug-2023 | 10.428 | 0,05 |
| 20.000 | NXP BV / NXP Funding LLC '144A' 5.550% 01-Dec-2028 | 23.998 | 0,12 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|-------------------------|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| US-Dollar Forts. | | | |
| 10.000 | Occidental Petroleum Corp 4.200% 15-Mar-2048 | 10.016 | 0,05 |
| 5.000 | Occidental Petroleum Corp 4.625% 15-Jun-2045 | 5.195 | 0,02 |
| 20.000 | Occidental Petroleum Corp 6.450% 15-Sep-2036 | 25.540 | 0,12 |
| 5.000 | Ohio National Financial Services Inc '144A' 5.800% 24-Jan-2030 | 5.672 | 0,03 |
| 5.000 | Omega Healthcare Investors Inc 4.375% 01-Aug-2023 | 5.220 | 0,02 |
| 15.000 | Omega Healthcare Investors Inc 4.500% 15-Jan-2025 | 16.045 | 0,08 |
| 10.000 | Omega Healthcare Investors Inc 4.500% 01-Apr-2027 | 10.951 | 0,05 |
| 10.000 | ONEOK Inc 4.500% 15-Mar-2050 | 11.147 | 0,05 |
| 5.000 | ONEOK Partners LP 6.125% 01-Feb-2041 | 6.338 | 0,03 |
| 5.000 | ONEOK Partners LP 6.200% 15-Sep-2043 | 6.504 | 0,03 |
| 5.000 | ONEOK Partners LP 6.850% 15-Oct-2037 | 6.736 | 0,03 |
| 10.000 | Oracle Corp 2.400% 15-Sep-2023 | 10.203 | 0,05 |
| 10.000 | Oracle Corp 2.500% 01-Apr-2025 | 10.245 | 0,05 |
| 20.000 | Oracle Corp 2.650% 15-Jul-2026 | 20.586 | 0,10 |
| 10.000 | Oracle Corp 2.800% 01-Apr-2027 | 10.322 | 0,05 |
| 10.000 | Oracle Corp 2.950% 15-Nov-2024 | 10.409 | 0,05 |
| 5.000 | Oracle Corp 3.625% 15-Jul-2023 | 5.184 | 0,02 |
| 10.000 | Oracle Corp 3.800% 15-Nov-2037 | 10.484 | 0,05 |
| 10.000 | Oracle Corp 3.850% 15-Jul-2036 | 10.599 | 0,05 |
| 10.000 | Oracle Corp 3.850% 01-Apr-2060 | 9.945 | 0,05 |
| 10.000 | Oracle Corp 3.900% 15-May-2035 | 10.746 | 0,05 |
| 10.000 | Oracle Corp 4.300% 08-Jul-2034 | 11.107 | 0,05 |
| 10.000 | Oracle Corp 4.375% 15-May-2055 | 11.018 | 0,05 |
| 10.000 | Oracle Corp 4.500% 08-Jul-2044 | 11.351 | 0,05 |
| 10.000 | Oracle Corp 6.500% 15-Apr-2038 | 13.541 | 0,07 |
| 10.000 | Orange SA 9.000% 01-Mar-2031 | 15.354 | 0,07 |
| 10.000 | Orbia Advance Corp SAB de CV 'REGS' 5.875% 17-Sep-2044 | 12.300 | 0,06 |
| 15.000 | O'Reilly Automotive Inc 3.900% 01-Jun-2029 | 16.591 | 0,08 |
| 10.000 | O'Reilly Automotive Inc 4.350% 01-Jun-2028 | 11.298 | 0,05 |
| 15.000 | ORIX Corp 2.250% 09-Mar-2031 | 14.995 | 0,07 |
| 5.000 | ORIX Corp 3.250% 04-Dec-2024 | 5.273 | 0,03 |
| 5.000 | ORIX Corp 4.050% 16-Jan-2024 | 5.281 | 0,03 |
| 10.000 | Otis Worldwide Corp 2.565% 15-Feb-2030 | 10.163 | 0,05 |
| 20.000 | Owl Rock Capital Corp 3.750% 22-Jul-2025 | 20.744 | 0,10 |
| 20.000 | Pacific Gas and Electric Co 1.700% 15-Nov-2023 | 20.051 | 0,10 |
| 10.000 | Pacific Gas and Electric Co 4.250% 15-Mar-2046 | 10.038 | 0,05 |
| 10.000 | Pacific Gas and Electric Co 4.950% 01-Jul-2050 | 10.952 | 0,05 |
| 5.000 | PacifiCorp 3.600% 01-Apr-2024 | 5.244 | 0,03 |
| 10.000 | PacifiCorp 7.700% 15-Nov-2031 | 14.323 | 0,07 |
| 10.000 | Packaging Corp of America 3.000% 15-Dec-2029 | 10.477 | 0,05 |
| 15.000 | Packaging Corp of America 3.650% 15-Sep-2024 | 15.857 | 0,08 |
| 20.000 | Park Aerospace Holdings Ltd '144A' 4.500% 15-Mar-2023 | 20.649 | 0,10 |
| 10.000 | Park Aerospace Holdings Ltd '144A' 5.500% 15-Feb-2024 | 10.730 | 0,05 |
| 5.000 | Parker-Hannifin Corp 4.100% 01-Mar-2047 | 5.848 | 0,03 |
| 15.000 | PartnerRe Finance B LLC 3.700% 02-Jul-2029 | 16.369 | 0,08 |
| 10.000 | PayPal Holdings Inc 1.350% 01-Jun-2023 | 10.085 | 0,05 |
| 5.000 | Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp '144A' 2.700% 14-Mar-2023 | 5.098 | 0,02 |
| 5.000 | Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp '144A' 2.700% 01-Nov-2024 | 5.157 | 0,02 |
| 15.000 | Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp '144A' 3.350% 01-Nov-2029 | 15.935 | 0,08 |
| 15.000 | Pentair Finance Sarl 4.500% 01-Jul-2029 | 17.001 | 0,08 |
| 10.000 | People's United Financial Inc 3.650% 06-Dec-2022 | 10.195 | 0,05 |
| 10.000 | PepsiCo Inc 1.950% 21-Oct-2031 | 10.018 | 0,05 |
| 10.000 | PepsiCo Inc 2.750% 19-Mar-2030 | 10.577 | 0,05 |
| 15.000 | PepsiCo Inc 3.500% 17-Jul-2025 | 16.120 | 0,08 |
| 5.000 | Perrigo Finance Unlimited Co 4.900% 15-Dec-2044 | 4.991 | 0,02 |
| 10.000 | Pfizer Inc 2.550% 28-May-2040 | 10.028 | 0,05 |
| 5.000 | Pfizer Inc 3.000% 15-Jun-2023 | 5.177 | 0,02 |
| 10.000 | Pfizer Inc 7.200% 15-Mar-2039 | 16.202 | 0,08 |
| 5.000 | Philip Morris International Inc 3.125% 17-Aug-2027 | 5.349 | 0,03 |
| 5.000 | Philip Morris International Inc 3.375% 11-Aug-2025 | 5.310 | 0,03 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|-------------------------|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| US-Dollar Forts. | | | |
| 5.000 | Philip Morris International Inc 3.375% 15-Aug-2029 | 5.398 | 0,03 |
| 10.000 | Phillips 66 4.650% 15-Nov-2034 | 11.755 | 0,06 |
| 5.000 | Phillips 66 4.875% 15-Nov-2044 | 6.336 | 0,03 |
| 5.000 | Phillips 66 5.875% 01-May-2042 | 6.919 | 0,03 |
| 10.000 | Phillips 66 Partners LP 4.900% 01-Oct-2046 | 12.243 | 0,06 |
| 5.000 | Physicians Realty LP 3.950% 15-Jan-2028 | 5.471 | 0,03 |
| 10.000 | Plains All American Pipeline LP / PAA Finance Corp 4.700% 15-Jun-2044 | 10.688 | 0,05 |
| 10.000 | PNC Financial Services Group Inc/The 2.550% 22-Jan-2030 | 10.301 | 0,05 |
| 10.000 | Precision Castparts Corp 2.500% 15-Jan-2023 | 10.150 | 0,05 |
| 5.000 | Principal Financial Group Inc 3.100% 15-Nov-2026 | 5.266 | 0,03 |
| 15.000 | Principal Financial Group Inc 3.700% 15-May-2029 | 16.604 | 0,08 |
| 15.000 | Principal Life Global Funding II '144A' 2.250% 21-Nov-2024 | 15.343 | 0,07 |
| 20.000 | Procter & Gamble Co/The 1.200% 29-Oct-2030 | 18.959 | 0,09 |
| 5.000 | Procter & Gamble Co/The 2.700% 02-Feb-2026 | 5.290 | 0,03 |
| 5.000 | Procter & Gamble Co/The 5.550% 05-Mar-2037 | 7.150 | 0,03 |
| 15.000 | Progressive Corp/The 4.000% 01-Mar-2029 | 16.977 | 0,08 |
| 10.000 | Prologis LP 4.375% 01-Feb-2029 | 11.462 | 0,06 |
| 15.000 | Prospect Capital Corp 3.364% 15-Nov-2026 | 14.993 | 0,07 |
| 20.000 | Prospect Capital Corp 3.706% 22-Jan-2026 | 20.369 | 0,10 |
| 10.000 | Prudential Financial Inc FRN 5.200% 15-Mar-2044 | 10.422 | 0,05 |
| 15.000 | Prudential Financial Inc FRN 5.375% 15-May-2045 | 16.023 | 0,08 |
| 20.000 | Prudential Financial Inc FRN 5.625% 15-Jun-2043 | 20.816 | 0,10 |
| 5.000 | Prudential Financial Inc 'MTN' 2.100% 10-Mar-2030 | 5.017 | 0,02 |
| 15.000 | Prudential Plc 3.125% 14-Apr-2030 | 16.043 | 0,08 |
| 10.000 | Public Service Electric and Gas Co 'MTN' 5.500% 01-Mar-2040 | 13.541 | 0,07 |
| 10.000 | Public Storage 3.385% 01-May-2029 | 10.920 | 0,05 |
| 5.000 | Puget Energy Inc 3.650% 15-May-2025 | 5.290 | 0,03 |
| 15.000 | Puget Energy Inc 4.100% 15-Jun-2030 | 16.251 | 0,08 |
| 5.000 | Quest Diagnostics Inc 2.950% 30-Jun-2030 | 5.207 | 0,02 |
| 10.000 | QVC Inc 4.450% 15-Feb-2025 | 10.561 | 0,05 |
| 10.000 | Raytheon Technologies Corp 3.030% 15-Mar-2052 | 10.110 | 0,05 |
| 10.000 | Raytheon Technologies Corp 3.500% 15-Mar-2027 | 10.725 | 0,05 |
| 5.000 | Raytheon Technologies Corp 3.950% 16-Aug-2025 | 5.428 | 0,03 |
| 10.000 | Raytheon Technologies Corp 4.125% 16-Nov-2028 | 11.204 | 0,05 |
| 5.000 | Raytheon Technologies Corp 4.150% 15-May-2045 | 5.860 | 0,03 |
| 10.000 | Raytheon Technologies Corp 4.500% 01-Jun-2042 | 12.491 | 0,06 |
| 5.000 | Raytheon Technologies Corp 4.875% 15-Oct-2040 | 6.361 | 0,03 |
| 10.000 | Realty Income Corp 3.650% 15-Jan-2028 | 10.910 | 0,05 |
| 10.000 | Reckitt Benckiser Treasury Services Plc '144A' 3.000% 26-Jun-2027 | 10.626 | 0,05 |
| 5.000 | Regeneron Pharmaceuticals Inc 2.800% 15-Sep-2050 | 4.718 | 0,02 |
| 5.000 | RELX Capital Inc 4.000% 18-Mar-2029 | 5.556 | 0,03 |
| 10.000 | Republic Services Inc 1.750% 15-Feb-2032 | 9.448 | 0,05 |
| 5.000 | Republic Services Inc 2.300% 01-Mar-2030 | 5.023 | 0,02 |
| 15.000 | Republic Services Inc 3.375% 15-Nov-2027 | 16.098 | 0,08 |
| 15.000 | Reynolds American Inc 4.450% 12-Jun-2025 | 16.209 | 0,08 |
| 5.000 | Reynolds American Inc 5.850% 15-Aug-2045 | 6.105 | 0,03 |
| 20.000 | Roper Technologies Inc 1.000% 15-Sep-2025 | 19.567 | 0,09 |
| 10.000 | Royal Bank of Canada 'GMTN' 2.250% 01-Nov-2024 | 10.281 | 0,05 |
| 20.000 | Royal Bank of Canada 'GMTN' 4.650% 27-Jan-2026 | 22.211 | 0,11 |
| 5.000 | RPM International Inc 4.550% 01-Mar-2029 | 5.676 | 0,03 |
| 10.000 | S&P Global Inc 2.950% 22-Jan-2027 | 10.572 | 0,05 |
| 5.000 | S&P Global Inc 4.000% 15-Jun-2025 | 5.416 | 0,03 |
| 15.000 | Sabal Trail Transmission LLC '144A' 4.682% 01-May-2038 | 18.065 | 0,09 |
| 20.000 | Sabine Pass Liquefaction LLC 4.500% 15-May-2030 | 22.601 | 0,11 |
| 10.000 | Sabine Pass Liquefaction LLC 5.000% 15-Mar-2027 | 11.246 | 0,05 |
| 5.000 | Sabine Pass Liquefaction LLC 5.625% 15-Apr-2023 | 5.231 | 0,03 |
| 5.000 | Sabine Pass Liquefaction LLC 5.625% 01-Mar-2025 | 5.557 | 0,03 |
| 10.000 | Sabine Pass Liquefaction LLC 5.750% 15-May-2024 | 10.883 | 0,05 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % |
|-------------------------|--|----------------------------|-----------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| US-Dollar Forts. | | | |
| 5.000 | Sabine Pass Liquefaction LLC 5.875% 30-Jun-2026 | 5.745 | 0,03 |
| 4.000 | San Diego Gas & Electric Co 1.700% 01-Oct-2030 | 3.836 | 0,02 |
| 20.000 | Sands China Ltd 5.125% 08-Aug-2025 | 21.004 | 0,10 |
| 20.000 | Santander Holdings USA Inc 3.400% 18-Jan-2023 | 20.447 | 0,10 |
| 5.000 | Santander Holdings USA Inc 3.500% 07-Jun-2024 | 5.215 | 0,02 |
| 20.000 | Santander UK Group Holdings Plc FRN 4.796% 15-Nov-2024 | 21.239 | 0,10 |
| 20.000 | Santander UK Plc 2.100% 13-Jan-2023 | 20.294 | 0,10 |
| 5.000 | Santander UK Plc 4.000% 13-Mar-2024 | 5.296 | 0,03 |
| 5.000 | Santander UK Plc '144A' 5.000% 07-Nov-2023 | 5.323 | 0,03 |
| 5.000 | SBL Holdings Inc '144A' 5.125% 13-Nov-2026 | 5.448 | 0,03 |
| 50.000 | Seagate HDD Cayman 4.750% 01-Jan-2025 | 53.553 | 0,26 |
| 35.000 | Seagate HDD Cayman 4.875% 01-Mar-2024 | 37.151 | 0,18 |
| 5.000 | Sempra Energy 6.000% 15-Oct-2039 | 6.931 | 0,03 |
| 10.000 | Sempra Energy FRN 4.125% 01-Apr-2052 | 10.142 | 0,05 |
| 20.000 | Service Properties Trust 4.950% 01-Oct-2029 | 19.029 | 0,09 |
| 10.000 | SES GLOBAL Americas Holdings GP '144A' 5.300% 25-Mar-2044 | 11.487 | 0,06 |
| 10.000 | Shell International Finance BV 6.375% 15-Dec-2038 | 14.621 | 0,07 |
| 5.000 | Sherwin-Williams Co/The 2.300% 15-May-2030 | 5.000 | 0,02 |
| 10.000 | Sherwin-Williams Co/The 2.950% 15-Aug-2029 | 10.541 | 0,05 |
| 5.000 | Sherwin-Williams Co/The 3.800% 15-Aug-2049 | 5.667 | 0,03 |
| 5.000 | Sherwin-Williams Co/The 4.550% 01-Aug-2045 | 6.131 | 0,03 |
| 15.000 | Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 2.875% 23-Sep-2023 | 15.435 | 0,07 |
| 10.000 | Shire Acquisitions Investments Ireland DAC 3.200% 23-Sep-2026 | 10.624 | 0,05 |
| 10.000 | Siemens Financieringsmaatschappij NV '144A' 2.350% 15-Oct-2026 | 10.301 | 0,05 |
| 5.000 | Sirius International Group Ltd '144A' 4.600% 01-Nov-2026 | 5.121 | 0,02 |
| 15.000 | SK Telecom Co Ltd 'REGS' 3.750% 16-Apr-2023 | 15.506 | 0,07 |
| 15.000 | Societe Generale SA '144A' 2.625% 16-Oct-2024 | 15.423 | 0,07 |
| 20.000 | Societe Generale SA '144A' 4.250% 14-Apr-2025 | 21.308 | 0,10 |
| 12.000 | Societe Generale SA '144A' 4.750% 14-Sep-2028 | 13.649 | 0,07 |
| 10.000 | Societe Generale SA '144A' 5.625% 24-Nov-2045 | 13.235 | 0,06 |
| 8.549 | Solar Star Funding LLC '144A' 5.375% 30-Jun-2035 | 9.882 | 0,05 |
| 10.000 | Southern California Edison Co 5.950% 01-Feb-2038 | 12.979 | 0,06 |
| 5.000 | Southern California Gas Co 2.550% 01-Feb-2030 | 5.137 | 0,02 |
| 10.000 | Southern California Gas Co 2.600% 15-Jun-2026 | 10.403 | 0,05 |
| 10.000 | Southern Co Gas Capital Corp 1.750% 15-Jan-2031 | 9.393 | 0,05 |
| 5.000 | Southern Co Gas Capital Corp 2.450% 01-Oct-2023 | 5.107 | 0,02 |
| 5.000 | Southern Co Gas Capital Corp 4.400% 01-Jun-2043 | 5.730 | 0,03 |
| 10.000 | Southern Co/The 1.750% 15-Mar-2028 | 9.750 | 0,05 |
| 5.000 | Southern Co/The 2.950% 01-Jul-2023 | 5.123 | 0,02 |
| 5.000 | Southern Co/The 3.250% 01-Jul-2026 | 5.297 | 0,03 |
| 20.000 | Southern Co/The FRN 4.000% 15-Jan-2051 | 20.500 | 0,10 |
| 10.000 | Southern Copper Corp 3.875% 23-Apr-2025 | 10.701 | 0,05 |
| 5.000 | Southern Copper Corp 5.875% 23-Apr-2045 | 6.876 | 0,03 |
| 5.000 | Southern Copper Corp 6.750% 16-Apr-2040 | 7.005 | 0,03 |
| 5.000 | Southwestern Electric Power Co 3.900% 01-Apr-2045 | 5.427 | 0,03 |
| 10.000 | Southwestern Electric Power Co 6.200% 15-Mar-2040 | 13.926 | 0,07 |
| 5.000 | Spectra Energy Partners LP 4.500% 15-Mar-2045 | 5.812 | 0,03 |
| 10.000 | Spectra Energy Partners LP 4.750% 15-Mar-2024 | 10.660 | 0,05 |
| 5.000 | Standard Chartered Bank '144A' 8.000% 30-May-2031 | 6.817 | 0,03 |
| 30.000 | Standard Chartered Plc '144A' 3.950% 11-Jan-2023 | 30.747 | 0,15 |
| 35.000 | Standard Chartered Plc '144A' 4.050% 12-Apr-2026 | 37.737 | 0,18 |
| 5.000 | Standard Chartered Plc '144A' 5.300% 09-Jan-2043 | 6.116 | 0,03 |
| 20.000 | Standard Chartered Plc '144A' FRN 2.819% 30-Jan-2026 | 20.525 | 0,10 |
| 10.000 | Standard Chartered Plc '144A' FRN 4.644% 01-Apr-2031 | 11.337 | 0,05 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % |
|-------------------------|---|----------------------------|-----------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| US-Dollar Forts. | | | |
| 15.000 | Stanley Black & Decker Inc FRN 4.000% 15-Mar-2060 | 15.432 | 0,07 |
| 5.000 | Starbucks Corp 2.250% 12-Mar-2030 | 4.976 | 0,02 |
| 5.000 | Starbucks Corp 2.550% 15-Nov-2030 | 5.111 | 0,02 |
| 5.000 | Starbucks Corp 3.100% 01-Mar-2023 | 5.121 | 0,02 |
| 5.000 | Starbucks Corp 3.500% 01-Mar-2028 | 5.416 | 0,03 |
| 5.000 | Starbucks Corp 3.750% 01-Dec-2047 | 5.537 | 0,03 |
| 15.000 | Starbucks Corp 3.800% 15-Aug-2025 | 16.203 | 0,08 |
| 5.000 | Starbucks Corp 4.300% 15-Jun-2045 | 5.906 | 0,03 |
| 10.000 | Starbucks Corp 4.500% 15-Nov-2048 | 12.440 | 0,06 |
| 5.000 | Steel Dynamics Inc 5.000% 15-Dec-2026 | 5.140 | 0,02 |
| 5.000 | Stellantis NV 5.250% 15-Apr-2023 | 5.251 | 0,03 |
| 5.000 | Stryker Corp 3.375% 01-Nov-2025 | 5.337 | 0,03 |
| 5.000 | Stryker Corp 3.500% 15-Mar-2026 | 5.366 | 0,03 |
| 10.000 | Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 1.474% 08-Jul-2025 | 9.961 | 0,05 |
| 10.000 | Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 2.130% 08-Jul-2030 | 9.737 | 0,05 |
| 6.000 | Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 2.724% 27-Sep-2029 | 6.156 | 0,03 |
| 5.000 | Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 2.750% 15-Jan-2030 | 5.128 | 0,02 |
| 13.000 | Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 3.040% 16-Jul-2029 | 13.576 | 0,07 |
| 5.000 | Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 3.944% 19-Jul-2028 | 5.550 | 0,03 |
| 7.000 | Suzano Austria GmbH 3.750% 15-Jan-2031 | 7.126 | 0,03 |
| 5.000 | SVB Financial Group 3.500% 29-Jan-2025 | 5.286 | 0,03 |
| 15.000 | Synchrony Financial 4.250% 15-Aug-2024 | 15.899 | 0,08 |
| 5.000 | Sysco Corp 3.300% 15-Jul-2026 | 5.333 | 0,03 |
| 10.000 | Sysco Corp 4.500% 01-Apr-2046 | 11.707 | 0,06 |
| 10.000 | Takeda Pharmaceutical Co Ltd 2.050% 31-Mar-2030 | 9.815 | 0,05 |
| 15.000 | TC PipeLines LP 4.375% 13-Mar-2025 | 16.109 | 0,08 |
| 5.000 | Telstra Corp Ltd '144A' 3.125% 07-Apr-2025 | 5.256 | 0,03 |
| 10.000 | Tencent Holdings Ltd 'REGS' 2.390% 03-Jun-2030 | 9.814 | 0,05 |
| 10.000 | Tencent Holdings Ltd 'REGS' 3.595% 19-Jan-2028 | 10.628 | 0,05 |
| 10.000 | Tencent Holdings Ltd 'REGS' 3.925% 19-Jan-2038 | 10.663 | 0,05 |
| 10.000 | Tencent Holdings Ltd 'REGS' 3.975% 11-Apr-2029 | 10.892 | 0,05 |
| 5.000 | Tennessee Gas Pipeline Co LLC '144A' 2.900% 01-Mar-2030 | 5.089 | 0,02 |
| 5.000 | Texas Eastern Transmission LP 7.000% 15-Jul-2032 | 6.789 | 0,03 |
| 5.000 | Texas Instruments Inc 1.750% 04-May-2030 | 4.914 | 0,02 |
| 5.000 | Texas Instruments Inc 2.250% 04-Sep-2029 | 5.117 | 0,02 |
| 10.000 | Texas Instruments Inc 3.875% 15-Mar-2039 | 11.871 | 0,06 |
| 5.000 | Thomson Reuters Corp 5.500% 15-Aug-2035 | 6.477 | 0,03 |
| 5.000 | Thomson Reuters Corp 5.850% 15-Apr-2040 | 7.022 | 0,03 |
| 5.000 | Time Warner Cable LLC 4.500% 15-Sep-2042 | 5.478 | 0,03 |
| 5.000 | Time Warner Cable LLC 5.500% 01-Sep-2041 | 6.089 | 0,03 |
| 5.000 | Time Warner Cable LLC 5.875% 15-Nov-2040 | 6.266 | 0,03 |
| 5.000 | Time Warner Cable LLC 6.550% 01-May-2037 | 6.566 | 0,03 |
| 5.000 | Time Warner Cable LLC 7.300% 01-Jul-2038 | 7.104 | 0,03 |
| 5.000 | Timken Co/The 3.875% 01-Sep-2024 | 5.261 | 0,03 |
| 10.000 | T-Mobile USA Inc 2.550 % 15-Feb-2031 | 9.969 | 0,05 |
| 25.000 | T-Mobile USA Inc 3.500% 15-Apr-2025 | 26.516 | 0,13 |
| 10.000 | T-Mobile USA Inc 3.750% 15-Apr-2027 | 10.841 | 0,05 |
| 15.000 | T-Mobile USA Inc 3.875% 15-Apr-2030 | 16.441 | 0,08 |
| 10.000 | T-Mobile USA Inc 4.500% 15-Apr-2050 | 11.761 | 0,06 |
| 20.000 | Toronto-Dominion Bank/The 'MTN' 0.750% 12-Jun-2023 | 20.009 | 0,10 |
| 5.000 | Toronto-Dominion Bank/The 'MTN' 1.900% 01-Dec-2022 | 5.063 | 0,02 |
| 19.000 | Toronto-Dominion Bank/The 'MTN' 2.650% 12-Jun-2024 | 19.723 | 0,10 |
| 15.000 | Toyota Motor Corp 3.669% 20-Jul-2028 | 16.635 | 0,08 |
| 5.000 | Toyota Motor Credit Corp 3.350% 08-Jan-2024 | 5.240 | 0,03 |
| 5.000 | Toyota Motor Credit Corp 'MTN' 1.150% 13-Aug-2027 | 4.864 | 0,02 |
| 5.000 | Toyota Motor Credit Corp 'MTN' 2.250% 18-Oct-2023 | 5.130 | 0,02 |
| 5.000 | Toyota Motor Credit Corp 'MTN' 3.000% 01-Apr-2025 | 5.252 | 0,03 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|-------------------------|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| US-Dollar Forts. | | | |
| 5.000 | Trane Technologies Global Holding Co Ltd 5.750% 15-Jun-2043 | 7.079 | 0,03 |
| 5.000 | TransCanada PipeLines Ltd 3.750% 16-Oct-2023 | 5.206 | 0,02 |
| 10.000 | TransCanada PipeLines Ltd 4.625% 01-Mar-2034 | 11.778 | 0,06 |
| 5.000 | TransCanada PipeLines Ltd 4.750% 15-May-2038 | 5.999 | 0,03 |
| 10.000 | TransCanada PipeLines Ltd 5.850% 15-Mar-2036 | 13.105 | 0,06 |
| 10.000 | TransCanada PipeLines Ltd 7.625% 15-Jan-2039 | 15.623 | 0,08 |
| 7.000 | Transelec SA '144A' 4.625% 26-Jul-2023 | 7.329 | 0,04 |
| 10.000 | Travelers Cos Inc/The 'MTN' 6.250% 15-Jun-2037 | 14.401 | 0,07 |
| 10.000 | Trimble Inc 4.150% 15-Jun-2023 | 10.405 | 0,05 |
| 5.000 | Tri-State Generation and Transmission Association Inc '144A' 6.000% 15-Jun-2040 | 6.784 | 0,03 |
| 10.000 | Truist Bank 3.200% 01-Apr-2024 | 10.475 | 0,05 |
| 5.000 | Truist Bank 'BKNT' 2.250% 11-Mar-2030 | 4.997 | 0,02 |
| 20.000 | Truist Bank 'BKNT' 3.000% 02-Feb-2023 | 20.448 | 0,10 |
| 10.000 | Trust Fibrá Uno 'REGS' 6.390% 15-Jan-2050 | 11.695 | 0,06 |
| 5.000 | Tyson Foods Inc 3.550% 02-Jun-2027 | 5.390 | 0,03 |
| 5.000 | Tyson Foods Inc 3.950% 15-Aug-2024 | 5.319 | 0,03 |
| 10.000 | Tyson Foods Inc 4.550% 02-Jun-2047 | 12.465 | 0,06 |
| 5.000 | Tyson Foods Inc 5.100% 28-Sep-2048 | 6.764 | 0,03 |
| 5.000 | UBS Group AG '144A' 3.491% 23-May-2023 | 5.051 | 0,02 |
| 25.000 | UBS Group AG '144A' 4.125% 24-Sep-2025 | 27.027 | 0,13 |
| 5.000 | UDR Inc 3.100% 01-Nov-2034 | 5.202 | 0,02 |
| 5.000 | UDR Inc 'MTN' 3.200% 15-Jan-2030 | 5.265 | 0,03 |
| 15.000 | Unilever Capital Corp 2.125% 06-Sep-2029 | 15.149 | 0,07 |
| 5.000 | Unilever Capital Corp 3.500% 22-Mar-2028 | 5.471 | 0,03 |
| 10.000 | Union Electric Co 8.450% 15-Mar-2039 | 16.801 | 0,08 |
| 5.000 | Union Pacific Corp 2.400% 05-Feb-2030 | 5.106 | 0,02 |
| 5.000 | Union Pacific Corp 3.150% 01-Mar-2024 | 5.215 | 0,02 |
| 5.000 | Union Pacific Corp 3.250% 15-Jan-2025 | 5.264 | 0,03 |
| 10.000 | Union Pacific Corp 3.646% 15-Feb-2024 | 10.458 | 0,05 |
| 5.000 | Union Pacific Corp 3.750% 15-Mar-2024 | 5.260 | 0,03 |
| 5.000 | Union Pacific Corp 3.750% 05-Feb-2070 | 5.713 | 0,03 |
| 5.000 | Union Pacific Corp 'MTN' 3.550% 15-Aug-2039 | 5.567 | 0,03 |
| 10.000 | UnitedHealth Group Inc 2.300% 15-May-2031 | 10.196 | 0,05 |
| 5.000 | UnitedHealth Group Inc 2.875% 15-Mar-2023 | 5.129 | 0,02 |
| 4.000 | UnitedHealth Group Inc 2.950% 15-Oct-2027 | 4.272 | 0,02 |
| 5.000 | UnitedHealth Group Inc 3.500% 15-Feb-2024 | 5.273 | 0,03 |
| 10.000 | UnitedHealth Group Inc 3.500% 15-Aug-2039 | 11.138 | 0,05 |
| 10.000 | UnitedHealth Group Inc 3.750% 15-Jul-2025 | 10.857 | 0,05 |
| 10.000 | UnitedHealth Group Inc 3.875% 15-Aug-2059 | 12.056 | 0,06 |
| 5.000 | University of Southern California 3.226% 01-Oct-2120 | 5.139 | 0,02 |
| 20.000 | US Bancorp 'MTN' 3.600% 11-Sep-2024 | 21.261 | 0,10 |
| 5.000 | Vale Overseas Ltd 6.875% 21-Nov-2036 | 6.652 | 0,03 |
| 15.000 | Valero Energy Corp 6.625% 15-Jun-2037 | 20.291 | 0,10 |
| 5.000 | Ventas Realty LP 4.000% 01-Mar-2028 | 5.541 | 0,03 |
| 20.000 | Verisk Analytics Inc 4.000% 15-Jun-2025 | 21.514 | 0,10 |
| 7.000 | Verizon Communications Inc 1.680% 30-Oct-2030 | 6.665 | 0,03 |
| 10.000 | Verizon Communications Inc 1.750% 20-Jan-2031 | 9.487 | 0,05 |
| 10.000 | Verizon Communications Inc 2.625% 15-Aug-2026 | 10.428 | 0,05 |
| 13.000 | Verizon Communications Inc 2.987% 30-Oct-2056 | 12.388 | 0,06 |
| 15.000 | Verizon Communications Inc 3.376% 15-Feb-2025 | 15.974 | 0,08 |
| 10.000 | Verizon Communications Inc 3.550% 22-Mar-2051 | 10.835 | 0,05 |
| 10.000 | Verizon Communications Inc 3.700% 22-Mar-2061 | 10.912 | 0,05 |
| 10.000 | Verizon Communications Inc 4.016% 03-Dec-2029 | 11.233 | 0,05 |
| 5.000 | Verizon Communications Inc 4.125% 15-Aug-2046 | 5.833 | 0,03 |
| 20.000 | Verizon Communications Inc 4.272% 15-Jan-2036 | 23.535 | 0,11 |
| 20.000 | Verizon Communications Inc 4.329% 21-Sep-2028 | 22.758 | 0,11 |
| 15.000 | Verizon Communications Inc 4.400% 01-Nov-2034 | 17.522 | 0,08 |
| 10.000 | Verizon Communications Inc 4.500% 10-Aug-2033 | 11.789 | 0,06 |
| 10.000 | Verizon Communications Inc 4.862% 21-Aug-2046 | 12.944 | 0,06 |
| 5.000 | Verizon Communications Inc 5.012% 15-Apr-2049 | 6.662 | 0,03 |
| 10.000 | Viatis Inc 3.850% 22-Jun-2040 | 10.636 | 0,05 |
| 5.000 | Vinci SA '144A' 3.750% 10-Apr-2029 | 5.472 | 0,03 |
| 5.000 | Visa Inc 2.750% 15-Sep-2027 | 5.278 | 0,03 |
| 20.000 | Visa Inc 3.150% 14-Dec-2025 | 21.345 | 0,10 |
| 5.000 | Visa Inc 4.150% 14-Dec-2035 | 6.002 | 0,03 |
| 30.000 | Vistra Operations Co LLC '144A' 3.550% 15-Jul-2024 | 30.918 | 0,15 |
| 5.000 | VMware Inc 1.400% 15-Aug-2026 | 4.922 | 0,02 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|-------------------------|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| US-Dollar Forts. | | | |
| 15.000 | VMware Inc 3.900% 21-Aug-2027 | 16.353 | 0,08 |
| 5.000 | VMware Inc 4.500% 15-May-2025 | 5.451 | 0,03 |
| 5.000 | Vodafone Group Plc 4.250% 17-Sep-2050 | 5.807 | 0,03 |
| 10.000 | Vodafone Group Plc 4.375% 30-May-2028 | 11.270 | 0,05 |
| 10.000 | Vodafone Group Plc 5.000% 30-May-2038 | 12.483 | 0,06 |
| 10.000 | Vodafone Group Plc 5.250% 30-May-2048 | 13.099 | 0,06 |
| 20.000 | Volkswagen Group of America Finance LLC '144A' 4.625% 13-Nov-2025 | 22.058 | 0,11 |
| 15.000 | Vulcan Materials Co 3.900% 01-Apr-2027 | 16.437 | 0,08 |
| 5.000 | Vulcan Materials Co 4.500% 15-Jun-2047 | 6.175 | 0,03 |
| 10.000 | W R Berkley Corp 4.750% 01-Aug-2044 | 12.556 | 0,06 |
| 10.000 | Walmart Inc 3.700% 26-Jun-2028 | 11.212 | 0,05 |
| 10.000 | Walmart Inc 3.950% 28-Jun-2038 | 11.994 | 0,06 |
| 10.000 | Walt Disney Co/The 2.650% 13-Jan-2031 | 10.426 | 0,05 |
| 10.000 | Walt Disney Co/The 3.375% 15-Nov-2026 | 10.769 | 0,05 |
| 5.000 | Walt Disney Co/The 3.800% 13-May-2060 | 5.836 | 0,03 |
| 10.000 | Walt Disney Co/The 6.400% 15-Dec-2035 | 14.357 | 0,07 |
| 5.000 | Waste Management Inc 2.400% 15-May-2023 | 5.095 | 0,02 |
| 5.000 | Waste Management Inc 3.150% 15-Nov-2027 | 5.347 | 0,03 |
| 5.000 | Waste Management Inc 4.150% 15-Jul-2049 | 6.355 | 0,03 |
| 5.000 | WEA Finance LLC '144A' 2.875% 15-Jan-2027 | 5.152 | 0,02 |
| 10.000 | WEC Energy Group Inc 1.375% 15-Oct-2027 | 9.657 | 0,05 |
| 10.000 | Weibo Corp 3.375% 08-Jul-2030 | 9.919 | 0,05 |
| 10.000 | Weibo Corp 3.500% 05-Jul-2024 | 10.304 | 0,05 |
| 20.000 | Wells Fargo & Co 3.000% 22-Apr-2026 | 21.040 | 0,10 |
| 20.000 | Wells Fargo & Co 4.125% 15-Aug-2023 | 20.989 | 0,10 |
| 5.000 | Wells Fargo & Co 7.950% 15-Nov-2029 | 6.890 | 0,03 |
| 15.000 | Wells Fargo & Co FRN 3.068% 30-Apr-2041 | 15.457 | 0,07 |
| 10.000 | Wells Fargo & Co 'MTN' 3.750% 24-Jan-2024 | 10.513 | 0,05 |
| 10.000 | Wells Fargo & Co 'MTN' 4.150% 24-Jan-2029 | 11.213 | 0,05 |
| 10.000 | Wells Fargo & Co 'MTN' FRN 2.393% 02-Jun-2028 | 10.177 | 0,05 |
| 10.000 | Wells Fargo & Co 'MTN' FRN 2.406% 30-Oct-2025 | 10.253 | 0,05 |
| 10.000 | Wells Fargo & Co 'MTN' FRN 2.879% 30-Oct-2030 | 10.416 | 0,05 |
| 15.000 | Wells Fargo & Co 'MTN' FRN 3.584% 22-May-2028 | 16.148 | 0,08 |
| 10.000 | Welltower Inc 3.100% 15-Jan-2030 | 10.498 | 0,05 |
| 15.000 | Welltower Inc 4.000% 01-Jun-2025 | 16.174 | 0,08 |
| 5.000 | West Fraser Timber Co Ltd '144A' 4.350% 15-Oct-2024 | 5.351 | 0,03 |
| 20.000 | Western Midstream Operating LP 4.500% 01-Mar-2028 | 21.811 | 0,11 |
| 10.000 | Westinghouse Air Brake Technologies Corp 3.450% 15-Nov-2026 | 10.593 | 0,05 |
| 5.000 | Westinghouse Air Brake Technologies Corp 4.950% 15-Sep-2028 | 5.693 | 0,03 |
| 5.000 | Westlake Chemical Corp 4.375% 15-Nov-2047 | 5.914 | 0,03 |
| 5.000 | Westpac Banking Corp 2.350% 19-Feb-2025 | 5.168 | 0,02 |
| 5.000 | Westpac Banking Corp 3.350% 08-Mar-2027 | 5.405 | 0,03 |
| 10.000 | Westpac Banking Corp 4.421% 24-Jul-2039 | 11.744 | 0,06 |
| 15.000 | Westpac Banking Corp FRN 2.894% 04-Feb-2030 | 15.332 | 0,07 |
| 5.000 | Williams Cos Inc/The 3.700% 15-Jan-2023 | 5.112 | 0,02 |
| 10.000 | Williams Cos Inc/The 3.750% 15-Jun-2027 | 10.811 | 0,05 |
| 10.000 | Williams Cos Inc/The 4.300% 04-Mar-2024 | 10.560 | 0,05 |
| 15.000 | Williams Cos Inc/The 4.550% 24-Jun-2024 | 16.063 | 0,08 |
| 5.000 | Williams Cos Inc/The 4.900% 15-Jan-2045 | 6.023 | 0,03 |
| 5.000 | Williams Cos Inc/The 6.300% 15-Apr-2040 | 6.800 | 0,03 |
| 5.000 | Willis North America Inc 2.950% 15-Sep-2029 | 5.129 | 0,02 |
| 5.000 | Willis North America Inc 3.600% 15-May-2024 | 5.241 | 0,03 |
| 10.000 | WP Carey Inc 4.600% 01-Apr-2024 | 10.624 | 0,05 |
| 10.000 | WW Grainger Inc 1.850% 15-Feb-2025 | 10.198 | 0,05 |
| 5.000 | Wyeth LLC 5.950% 01-Apr-2037 | 7.069 | 0,03 |
| 15.000 | XLIT Ltd 4.450% 31-Mar-2025 | 16.282 | 0,08 |
| 5.000 | Zions Bancorp NA 3.250% 29-Oct-2029 | 5.181 | 0,02 |
| 15.000 | Zoetis Inc 3.900% 20-Aug-2028 | 16.677 | 0,08 |
| 5.000 | Zoetis Inc 3.950% 12-Sep-2047 | 5.906 | 0,03 |
| 10.000 | Zoetis Inc 4.500% 13-Nov-2025 | 11.025 | 0,05 |

Gesamtanlagen in Anleihen 19.611.588 94,78

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % |
|---------------------------------------|---|----------------------------|-----------------------|
| Credit Default Swaps - 43.971 | | | |
| (31. Dezember 2020: 98.005) | | | |
| (1.800.000) | CDS CDX North America Investment Grade Index Series 37 1.000% 20-Dec-2026 | 43.971 | 0,21 |
| Credit Default Swaps insgesamt | | 43.971 | 0,21 |

| Bestände | Beschreibung | Zugrunde liegendes Engagement USD | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % |
|--|---|-----------------------------------|----------------------------|-----------------------|
| Offene Terminkontrakte - 12.616 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.608) | | | | |
| (1) | U.S. 10 Year Ultra Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (146.437) | 1.342 | 0,01 |
| (1) | U.S. 2 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (218.172) | 295 | 0,00 |
| (1) | U.S. 5 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (120.977) | 84 | 0,00 |
| 6 | U.S. Treasury Ultra Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2022 | 1.182.750 | 10.895 | 0,05 |
| Summe Terminkontrakte insgesamt | | | 12.616 | 0,06 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 496.198 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 992.308) | | 496.198 | | 2,40 |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | | 20.164.373 | 97,45 |

| Bestände | Beschreibung | Zugrunde liegendes Engagement USD | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % |
|--|---|-----------------------------------|----------------------------|-----------------------|
| Offene Terminkontrakte - (7.074) 31. Dezember 2020: 44.678 | | | | |
| (1) | Canadian 10 Year Treasury Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (112.747) | (2.888) | (0,01) |
| 1 | Euro-Bund Long Futures Contracts Exp Mar-2022 | 195.105 | (3.872) | (0,02) |
| 1 | SGX 10 Year Mini Japanese Government Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2022 | 131.800 | (314) | (0,00) |
| Summe Terminkontrakte insgesamt | | | (7.074) | (0,03) |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (53.875) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (345.060)) | | (53.875) | | (0,26) |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | | (60.949) | (0,29) |

| | | |
|----------------------------|-------------------|---------------|
| Nettoumlaufvermögen | 587.881 | 2,84 |
| Summe Nettovermögen | 20.691.305 | 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 | 94,38 |
| An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente | 0,06 |
| OTC-derivative Finanzinstrumente | 2,60 |
| Sonstiges Umlaufvermögen | 2,96 |
| Gesamtvermögen | 100,00 |

| Devisenterminkontrakte | | | | | | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|---|--------------------|------------|------------|------------------|-------------------------------|-------------------------------------|
| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | |
| BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 105.000 | 118.858 | 14. Jan. 22 | Bank of America Merrill Lynch | 710 |
| Euro | US-Dollar | 17.000 | 19.336 | 14. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | 23 |
| US-Dollar | Kanadischer Dollar | 3.958 | 5.000 | 14. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | 5 |
| USD | | | | | | 738 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 12.000 | 16.253 | 14. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | (11) |
| US-Dollar | Kanadischer Dollar | 824.683 | 1.048.000 | 14. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | (3.800) |
| US-Dollar | Euro | 4.887.683 | 4.319.000 | 14. Jan. 22 | Goldman Sachs | (30.520) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 863.491 | 652.400 | 14. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | (19.544) |
| USD | | | | | | (53.875) |

| BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged) | | | | | | |
|---|-----------|--------|--------|-------------|-----------------------------|-----------|
| Euro | US-Dollar | 13.613 | 15.405 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 96 |
| USD | | | | | | 96 |
| EUR | | | | | | 84 |

| BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund Anteilsklasse Sterling L (Acc) (Hedged) | | | | | | |
|--|-----------|------------|------------|-------------|-----------------------------|----------------|
| Pfund Sterling | US-Dollar | 15.267.114 | 20.168.943 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 495.364 |
| USD | | | | | | 495.364 |
| GBP | | | | | | 365.974 |

BNY MELLON EFFICIENT U.S. FALLEN ANGELS BETA FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % | Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % |
|--|--|----------------------------|-----------------------|--|---|----------------------------|-----------------------|
| Anleihen | | | | Anleihen Forts. | | | |
| Grundstoffe - 39.961.439 | | | | Zyklische Konsumgüter Forts. | | | |
| (31. Dezember 2020: 84.859.332) | | | | (31. Dezember 2020: 63.388.584) | | | |
| 6.420.000 | Domtar Corp 6.250% 01-Sep-2042 | 6.566.215 | 0,34 | 3.110.000 | Ford Motor Credit Co LLC 3.810% 09-Jan-2024 | 3.229.673 | 0,17 |
| 4.071.000 | Domtar Corp 6.750% 15-Feb-2044 | 4.190.862 | 0,22 | 2.250.000 | Ford Motor Credit Co LLC 3.815% 02-Nov-2027 | 2.382.176 | 0,12 |
| 1.700.000 | HB Fuller Co 4.000% 15-Feb-2027 | 1.789.735 | 0,09 | 5.100.000 | Ford Motor Credit Co LLC 4.063% 01-Nov-2024 | 5.372.774 | 0,28 |
| 3.723.000 | Methanex Corp 4.250% 01-Dec-2024 | 3.903.770 | 0,20 | 5.100.000 | Ford Motor Credit Co LLC 4.134% 04-Aug-2025 | 5.418.138 | 0,28 |
| 14.662.000 | Methanex Corp 5.250% 15-Dec-2029 | 15.505.065 | 0,81 | 2.741.000 | Ford Motor Credit Co LLC 4.140% 15-Feb-2023 | 2.809.662 | 0,15 |
| 5.610.000 | Methanex Corp 5.650% 01-Dec-2044 | 5.641.192 | 0,30 | 3.130.000 | Ford Motor Credit Co LLC 4.271% 09-Jan-2027 | 3.368.287 | 0,18 |
| 2.100.000 | United States Steel Corp 6.650% 01-Jun-2037 | 2.364.600 | 0,12 | 2.200.000 | Ford Motor Credit Co LLC 4.375% 06-Aug-2023 | 2.291.817 | 0,12 |
| Kommunikation - 126.738.429 | | | | Anleihen Forts. | | | |
| (31. Dezember 2020: 63.388.584) | | | | Zyklische Konsumgüter Forts. | | | |
| 800.000 | Belo Corp 7.250% 15-Sep-2027 | 924.272 | 0,05 | 2.510.000 | Ford Motor Credit Co LLC 4.542% 01-Aug-2026 | 2.729.136 | 0,14 |
| 361.000 | Belo Corp 7.750% 01-Jun-2027 | 424.002 | 0,02 | 2.010.000 | Ford Motor Credit Co LLC 4.687% 09-Jun-2025 | 2.162.871 | 0,11 |
| 12.055.000 | Embarq Corp 7.995% 01-Jun-2036 | 13.521.370 | 0,70 | 4.860.000 | Ford Motor Credit Co LLC 5.113% 03-May-2029 | 5.530.510 | 0,29 |
| 464.000 | Frontier Florida LLC 6.860% 01-Feb-2028 | 494.408 | 0,03 | 4.322.000 | Ford Motor Credit Co LLC 5.584% 18-Mar-2024 | 4.662.379 | 0,24 |
| 1.083.000 | Frontier North Inc 6.730% 15-Feb-2028 | 1.155.003 | 0,06 | 3.835.000 | Ford Motor Credit Co LLC 'GMTN' 4.389% 08-Jan-2026 | 4.136.546 | 0,22 |
| 374.000 | Liberty Interactive LLC 8.250% 01-Feb-2030 | 410.055 | 0,02 | 2.235.000 | Genting New York LLC / GENNY Capital Inc '144A' 3.300% 15-Feb-2026 | 2.215.646 | 0,12 |
| 1.405.000 | Liberty Interactive LLC 8.500% 15-Jul-2029 | 1.533.424 | 0,08 | 500.000 | Goodyear Tire & Rubber Co/The 7.000% 15-Mar-2028 | 573.125 | 0,03 |
| 3.276.000 | Lumen Technologies Inc 6.875% 15-Jan-2028 | 3.649.333 | 0,19 | 6.945.929 | Hawaiian Airlines 2013-1 Class A Pass Through Certificates 3.900% 15-Jan-2026 | 6.884.707 | 0,36 |
| 5.367.000 | Lumen Technologies Inc 7.600% 15-Sep-2039 | 5.763.648 | 0,30 | 6.648.000 | Macy's Retail Holdings LLC 2.875% 15-Feb-2023 | 6.723.156 | 0,35 |
| 5.140.000 | Lumen Technologies Inc 7.650% 15-Mar-2042 | 5.538.350 | 0,29 | 5.233.000 | Macy's Retail Holdings LLC 3.625% 01-Jun-2024 | 5.356.263 | 0,28 |
| 3.300.000 | Nokia Oyj 6.625% 15-May-2039 | 4.570.929 | 0,24 | 2.990.000 | Macy's Retail Holdings LLC 4.300% 15-Feb-2043 | 2.628.090 | 0,14 |
| 11.266.000 | Sprint Capital Corp 6.875% 15-Nov-2028 | 14.270.417 | 0,74 | 1.172.000 | Macy's Retail Holdings LLC 4.375% 01-Sep-2023 | 1.211.772 | 0,06 |
| 15.829.000 | Sprint Capital Corp 8.750% 15-Mar-2032 | 23.770.093 | 1,24 | 5.626.000 | Macy's Retail Holdings LLC 4.500% 15-Dec-2034 | 5.564.198 | 0,29 |
| 5.889.000 | Telecom Italia Capital SA 6.000% 30-Sep-2034 | 6.237.481 | 0,33 | 3.634.000 | Macy's Retail Holdings LLC 5.125% 15-Jan-2042 | 3.475.703 | 0,18 |
| 4.015.000 | Telecom Italia Capital SA 6.375% 15-Nov-2033 | 4.329.435 | 0,23 | 2.190.000 | Macy's Retail Holdings LLC 6.375% 15-Mar-2037 | 2.323.426 | 0,12 |
| 4.719.000 | Telecom Italia Capital SA 7.200% 18-Jul-2036 | 5.418.356 | 0,28 | 4.900.000 | Marks & Spencer Plc '144A' 7.125% 01-Dec-2037 | 5.750.836 | 0,30 |
| 7.881.000 | Telecom Italia Capital SA 7.721% 04-Jun-2038 | 9.274.243 | 0,48 | 745.000 | Mattel Inc 3.150% 15-Mar-2023 | 760.604 | 0,04 |
| 987.000 | United States Cellular Corp 6.700% 15-Dec-2033 | 1.195.711 | 0,06 | 5.855.000 | Mattel Inc 5.450% 01-Nov-2041 | 6.997.720 | 0,36 |
| 20.033.000 | Vodafone Group Plc FRN 7.000% 04-Apr-2079 | 24.257.899 | 1,26 | 3.100.000 | Mattel Inc 6.200% 01-Oct-2040 | 4.019.785 | 0,21 |
| Zyklische Konsumgüter - 574.267.939 | | | | Anleihen Forts. | | | |
| (31. Dezember 2020: 358.211.669) | | | | Zyklische Konsumgüter Forts. | | | |
| 10.974.805 | American Airlines 2013-1 Class A Pass Through Trust 4.000% 15-Jul-2025 | 10.618.741 | 0,55 | 496.000 | Newell Brands Inc 4.000% 01-Dec-2024 | 520.733 | 0,03 |
| 14.010.851 | American Airlines 2013-2 Class A Pass Through Trust 4.950% 15-Jan-2023 | 14.325.511 | 0,75 | 11.755.000 | Newell Brands Inc 4.350% 01-Apr-2023 | 12.122.344 | 0,63 |
| 19.333.181 | American Airlines 2014-1 Class A Pass Through Trust 3.700% 01-Oct-2026 | 19.657.504 | 1,02 | 15.372.000 | Newell Brands Inc 4.700% 01-Apr-2026 | 16.782.765 | 0,87 |
| 17.177.154 | American Airlines 2015-1 Class A Pass Through Trust 3.375% 01-May-2027 | 17.060.817 | 0,89 | 3.660.000 | Newell Brands Inc 5.875% 01-Apr-2036 | 4.516.001 | 0,24 |
| 4.513.282 | American Airlines 2016-1 Class A Pass Through Trust 4.100% 15-Jan-2028 | 4.450.197 | 0,23 | 7.032.000 | Newell Brands Inc 6.000% 01-Apr-2046 | 9.032.604 | 0,47 |
| 7.769.614 | American Airlines 2016-2 Class A Pass Through Trust 3.650% 15-Jun-2028 | 7.530.579 | 0,39 | 7.117.000 | Nordstrom Inc 4.000% 15-Mar-2027 | 7.159.702 | 0,37 |
| 7.130.174 | American Airlines 2016-3 Class A Pass Through Trust 3.250% 15-Oct-2028 | 6.803.295 | 0,35 | 18.670.000 | Nordstrom Inc 4.250% 01-Aug-2031 | 18.371.560 | 0,96 |
| 1.959.000 | Bath & Body Works Inc 6.950% 01-Mar-2033 | 2.294.890 | 0,12 | 12.130.000 | Nordstrom Inc 4.375% 01-Apr-2030 | 12.254.939 | 0,64 |
| 1.731.000 | Bath & Body Works Inc 7.600% 15-Jul-2037 | 2.105.597 | 0,11 | 21.310.000 | Nordstrom Inc 5.000% 15-Jan-2044 | 19.904.819 | 1,04 |
| 667.000 | Bed Bath & Beyond Inc 3.749% 01-Aug-2024 | 673.550 | 0,04 | 6.285.000 | Nordstrom Inc 6.950% 15-Mar-2028 | 7.087.657 | 0,37 |
| 140.000 | Bed Bath & Beyond Inc 4.915% 01-Aug-2034 | 126.300 | 0,01 | 12.523.000 | QVC Inc 4.375% 15-Mar-2023 | 12.913.405 | 0,67 |
| 6.091.000 | Bed Bath & Beyond Inc 5.165% 01-Aug-2044 | 5.068.473 | 0,26 | 7.287.000 | QVC Inc 4.450% 15-Feb-2025 | 7.695.473 | 0,40 |
| 480.000 | Brinker International Inc 3.875% 15-May-2023 | 491.398 | 0,03 | 9.640.000 | QVC Inc 4.750% 15-Feb-2027 | 9.916.090 | 0,52 |
| 4.900.000 | Carnival Corp 6.650% 15-Jan-2028 | 5.056.433 | 0,26 | 7.047.000 | QVC Inc 4.850% 01-Apr-2024 | 7.529.649 | 0,39 |
| 4.800.000 | Carnival Plc 7.875% 01-Jun-2027 | 5.595.000 | 0,29 | 5.500.000 | QVC Inc 5.450% 15-Aug-2034 | 5.452.727 | 0,28 |
| 12.852.000 | Delta Air Lines Inc 2.900% 28-Oct-2024 | 13.114.808 | 0,68 | 3.722.000 | QVC Inc 5.950% 15-Mar-2043 | 3.713.272 | 0,19 |
| 8.823.000 | Delta Air Lines Inc 3.750% 28-Oct-2029 | 9.059.688 | 0,47 | 6.000.000 | Resorts World Las Vegas LLC / RWLV Capital Inc '144A' 4.625% 06-Apr-2031 | 5.968.550 | 0,31 |
| 5.918.000 | Delta Air Lines Inc 3.800% 19-Apr-2023 | 6.052.877 | 0,32 | 10.000.000 | Resorts World Las Vegas LLC / RWLV Capital Inc 'REGS' 4.625% 16-Apr-2029 | 10.088.597 | 0,53 |
| 9.910.000 | Delta Air Lines Inc 4.375% 19-Apr-2028 | 10.574.673 | 0,55 | 500.000 | Rite Aid Corp 7.700% 15-Feb-2027 | 457.395 | 0,02 |
| 838.000 | Ford Holdings LLC 9.300% 01-Mar-2030 | 1.167.363 | 0,06 | 8.101.000 | Royal Caribbean Cruises Ltd 3.700% 15-Mar-2028 | 7.617.370 | 0,40 |
| 4.750.000 | Ford Motor Co 4.346% 08-Dec-2026 | 5.187.309 | 0,27 | 4.750.000 | Royal Caribbean Cruises Ltd 5.250% 15-Nov-2022 | 4.821.464 | 0,25 |
| 6.219.000 | Ford Motor Co 4.750% 15-Jan-2043 | 6.875.260 | 0,36 | 4.877.000 | Royal Caribbean Cruises Ltd 7.500% 15-Oct-2027 | 5.650.005 | 0,29 |
| 4.300.000 | Ford Motor Co 5.291% 08-Dec-2046 | 5.060.305 | 0,26 | 22.924.000 | Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 10.875% 01-Jun-2023 | 25.073.469 | 1,30 |
| 550.000 | Ford Motor Co 6.375% 01-Feb-2029 | 647.383 | 0,03 | 30.578.000 | Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 11.500% 01-Jun-2025 | 34.286.041 | 1,78 |
| 1.689.000 | Ford Motor Co 6.625% 01-Oct-2028 | 2.033.353 | 0,11 | 1.507.000 | Travel + Leisure Co 5.650% 01-Apr-2024 | 1.602.694 | 0,08 |
| 600.000 | Ford Motor Co 7.125% 15-Nov-2025 | 690.180 | 0,04 | 2.348.000 | Travel + Leisure Co 6.000% 01-Apr-2027 | 2.560.541 | 0,13 |
| 1.030.000 | Ford Motor Co 7.400% 01-Nov-2046 | 1.420.417 | 0,07 | 1.129.000 | Travel + Leisure Co 6.600% 01-Oct-2025 | 1.257.141 | 0,07 |
| 3.620.000 | Ford Motor Co 7.450% 16-Jul-2031 | 4.908.394 | 0,26 | 27.827 | UAL 2007-1 Pass Through Trust 6.636% 02-Jul-2022 | 28.454 | 0,00 |
| 220.000 | Ford Motor Co 7.500% 01-Aug-2026 | 259.349 | 0,01 | 3.430.000 | Under Armour Inc 3.250% 15-Jun-2026 | 3.541.475 | 0,18 |
| 4.975.000 | Ford Motor Credit Co LLC 3.087% 09-Jan-2023 | 5.065.644 | 0,26 | 1.279.243 | US Airways 2012-2 Class A Pass Through Trust 4.625% 03-Jun-2025 | 1.275.579 | 0,07 |
| 3.952.000 | Ford Motor Credit Co LLC 3.096% 04-May-2023 | 4.031.297 | 0,21 | 16.156.204 | US Airways 2013-1 Class A Pass Through Trust 3.950% 15-Nov-2025 | 16.335.976 | 0,85 |
| 2.235.000 | Ford Motor Credit Co LLC 3.664% 08-Sep-2024 | 2.323.964 | 0,12 | 3.246.000 | Yum! Brands Inc 5.350% 01-Nov-2043 | 3.599.084 | 0,19 |
| | | | | 4.191.000 | Yum! Brands Inc 6.875% 15-Nov-2037 | 5.323.471 | 0,28 |
| | | | | 10.150.000 | ZF North America Capital Inc '144A' 4.750% 29-Apr-2025 | 10.897.344 | 0,57 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Summe Beizulegender Nettover- Zeitwert USD | mögen % |
|--|--|---|--------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Nicht-zyklische Konsumgüter - 225.134.980 | | | |
| (31. Dezember 2020: 105.320.827) | | 225.134.980 | 11,72 |
| 1.661.000 | ADT Security Corp/The 4.125% 15-Jun-2023 | 1.726.942 | 0,09 |
| 2.201.000 | Avon Products Inc 6.500% 15-Mar-2023 | 2.310.500 | 0,12 |
| 804.000 | Avon Products Inc 8.450% 15-Mar-2043 | 990.050 | 0,05 |
| 300.000 | HCA Inc 7.050% 01-Dec-2027 | 369.762 | 0,02 |
| 1.828.000 | HCA Inc 7.500% 15-Nov-2095 | 2.673.450 | 0,14 |
| 600.000 | HCA Inc 7.690% 15-Jun-2025 | 709.553 | 0,04 |
| 500.000 | HCA Inc 8.360% 15-Apr-2024 | 572.917 | 0,03 |
| 2.200.000 | IHS Markit Ltd 3.625% 01-May-2024 | 2.312.948 | 0,12 |
| 1.800.000 | IHS Markit Ltd 4.125% 01-Aug-2023 | 1.885.311 | 0,10 |
| 3.700.000 | IHS Markit Ltd 4.250% 01-May-2029 | 4.221.034 | 0,22 |
| 3.700.000 | IHS Markit Ltd 4.750% 01-Aug-2028 | 4.301.787 | 0,22 |
| 2.700.000 | IHS Markit Ltd '144A' 4.000% 01-Mar-2026 | 2.924.977 | 0,15 |
| 2.700.000 | IHS Markit Ltd '144A' 4.750% 15-Feb-2025 | 2.946.699 | 0,15 |
| 9.540.000 | Kraft Heinz Foods Co 3.000% 01-Jun-2026 | 9.992.718 | 0,52 |
| 16.228.000 | Kraft Heinz Foods Co 4.375% 01-Jun-2046 | 19.071.224 | 0,99 |
| 1.250.000 | Kraft Heinz Foods Co 4.625% 30-Jan-2029 | 1.434.581 | 0,08 |
| 5.004.000 | Kraft Heinz Foods Co 5.000% 15-Jul-2035 | 6.134.705 | 0,32 |
| 7.960.000 | Kraft Heinz Foods Co 5.000% 04-Jun-2042 | 9.919.853 | 0,52 |
| 9.700.000 | Kraft Heinz Foods Co 5.200% 15-Jul-2045 | 12.378.301 | 0,65 |
| 1.160.000 | Kraft Heinz Foods Co 6.375% 15-Jul-2028 | 1.441.948 | 0,08 |
| 3.998.000 | Kraft Heinz Foods Co 6.500% 09-Feb-2040 | 5.695.411 | 0,30 |
| 4.749.000 | Kraft Heinz Foods Co 6.875% 26-Jan-2039 | 6.990.597 | 0,36 |
| 5.463.381 | Kraft Heinz Foods Co '144A' 7.125% 01-Aug-2039 | 8.327.107 | 0,43 |
| 4.456.000 | North Queensland Export Terminal Pty Ltd '144A' 4.450% 15-Dec-2022 | 4.287.399 | 0,22 |
| 500.000 | Owens & Minor Inc 4.375% 15-Dec-2024 | 531.983 | 0,03 |
| 2.940.000 | Perrigo Co Plc 4.000% 15-Nov-2023 | 3.028.901 | 0,16 |
| 25.898.000 | Perrigo Finance Unlimited Co 3.900% 15-Dec-2024 | 27.159.372 | 1,41 |
| 33.767.000 | Perrigo Finance Unlimited Co 3.900% 15-Jun-2030 | 34.275.600 | 1,78 |
| 33.235.000 | Perrigo Finance Unlimited Co 4.375% 15-Mar-2026 | 35.590.391 | 1,85 |
| 10.948.000 | Perrigo Finance Unlimited Co 4.900% 15-Dec-2044 | 10.928.959 | 0,57 |
| Energie - 379.945.923 | | | |
| (31. Dezember 2020: 261.936.133) | | 379.945.923 | 19,77 |
| 5.700.000 | Apache Corp 4.250% 15-Jan-2030 | 6.193.820 | 0,32 |
| 8.226.000 | Apache Corp 4.375% 15-Oct-2028 | 8.973.414 | 0,47 |
| 3.000.000 | Apache Corp 4.750% 15-Apr-2043 | 3.304.425 | 0,17 |
| 10.522.000 | Apache Corp 5.100% 01-Sep-2040 | 11.906.485 | 0,62 |
| 2.083.000 | Apache Corp 5.250% 01-Feb-2042 | 2.408.937 | 0,13 |
| 7.200.000 | Apache Corp 5.350% 01-Jul-2049 | 8.236.728 | 0,43 |
| 3.220.000 | Apache Corp 6.000% 15-Jan-2037 | 3.945.756 | 0,21 |
| 2.411.000 | Apache Corp 7.375% 15-Aug-2047 | 3.029.241 | 0,16 |
| 1.472.000 | Apache Corp 7.750% 15-Dec-2029 | 1.871.089 | 0,10 |
| 6.900.000 | Buckeye Partners LP 3.950% 01-Dec-2026 | 7.039.828 | 0,37 |
| 5.663.000 | Buckeye Partners LP 4.125% 01-Dec-2027 | 5.853.107 | 0,30 |
| 3.081.000 | Buckeye Partners LP 4.150% 01-Jul-2023 | 3.161.275 | 0,16 |
| 295.000 | Buckeye Partners LP 4.350% 15-Oct-2024 | 307.849 | 0,02 |
| 2.566.000 | Buckeye Partners LP 5.600% 15-Oct-2044 | 2.505.712 | 0,13 |
| 6.224.000 | Buckeye Partners LP 5.850% 15-Nov-2043 | 6.116.045 | 0,32 |
| 1.301.000 | Buckeye Partners LP 6.750% 15-Aug-2033 | 1.512.595 | 0,08 |
| 1.317.000 | DCP Midstream Operating LP 3.875% 15-Mar-2023 | 1.352.012 | 0,07 |
| 2.038.000 | DCP Midstream Operating LP 5.600% 01-Apr-2044 | 2.538.166 | 0,13 |
| 1.220.000 | DCP Midstream Operating LP 8.125% 16-Aug-2030 | 1.661.408 | 0,09 |
| 1.158.000 | DCP Midstream Operating LP '144A' 6.450% 03-Nov-2036 | 1.517.044 | 0,08 |
| 1.000.000 | DCP Midstream Operating LP '144A' 6.750% 15-Sep-2037 | 1.339.025 | 0,07 |
| 500.000 | EnLink Midstream Partners LP 4.150% 01-Jun-2025 | 519.277 | 0,03 |
| 300.000 | EnLink Midstream Partners LP 4.400% 01-Apr-2024 | 313.816 | 0,02 |
| 5.400.000 | EnLink Midstream Partners LP 5.050% 01-Apr-2045 | 5.218.830 | 0,27 |
| 5.500.000 | EnLink Midstream Partners LP 5.450% 01-Jun-2047 | 5.556.650 | 0,29 |
| 4.396.000 | EnLink Midstream Partners LP 5.600% 01-Apr-2044 | 4.439.872 | 0,23 |
| 8.792.000 | EQM Midstream Partners LP 4.000% 01-Aug-2024 | 9.141.966 | 0,48 |
| 9.223.000 | EQM Midstream Partners LP 4.125% 01-Dec-2026 | 9.463.305 | 0,49 |
| 13.340.000 | EQM Midstream Partners LP 4.750% 15-Jul-2023 | 13.887.674 | 0,72 |

| Bestände | Beschreibung | Summe Beizulegender Nettover- Zeitwert USD | mögen % |
|---|--|---|-------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Energie Forts. | | | |
| 13.716.000 | EQM Midstream Partners LP 5.500% 15-Jul-2028 | 15.004.138 | 0,78 |
| 11.350.000 | EQM Midstream Partners LP 6.500% 15-Jul-2048 | 13.806.197 | 0,72 |
| 1.989.000 | Murphy Oil Corp 6.375% 01-Dec-2042 | 1.991.795 | 0,10 |
| 706.000 | Murphy Oil Corp 7.050% 01-May-2029 | 777.592 | 0,04 |
| 1.235.000 | Occidental Petroleum Corp 2.700% 15-Feb-2023 | 1.252.204 | 0,07 |
| 3.152.000 | Occidental Petroleum Corp 2.900% 15-Aug-2024 | 3.220.962 | 0,17 |
| 2.300.000 | Occidental Petroleum Corp 3.000% 15-Feb-2027 | 2.336.926 | 0,12 |
| 300.000 | Occidental Petroleum Corp 3.200% 15-Aug-2026 | 309.471 | 0,02 |
| 950.000 | Occidental Petroleum Corp 3.400% 15-Apr-2026 | 974.752 | 0,05 |
| 2.257.000 | Occidental Petroleum Corp 3.500% 15-Jun-2025 | 2.314.125 | 0,12 |
| 950.000 | Occidental Petroleum Corp 3.500% 15-Aug-2029 | 976.296 | 0,05 |
| 1.443.000 | Occidental Petroleum Corp 4.100% 15-Feb-2047 | 1.416.326 | 0,07 |
| 1.154.000 | Occidental Petroleum Corp 4.200% 15-Mar-2048 | 1.155.869 | 0,06 |
| 2.178.000 | Occidental Petroleum Corp 4.300% 15-Aug-2039 | 2.175.354 | 0,11 |
| 2.500.000 | Occidental Petroleum Corp 4.400% 15-Apr-2046 | 2.567.225 | 0,13 |
| 1.200.000 | Occidental Petroleum Corp 4.400% 15-Aug-2049 | 1.216.818 | 0,06 |
| 1.901.000 | Occidental Petroleum Corp 4.500% 15-Jul-2044 | 1.960.910 | 0,10 |
| 1.732.000 | Occidental Petroleum Corp 4.625% 15-Jun-2045 | 1.799.574 | 0,09 |
| 2.985.000 | Occidental Petroleum Corp 5.550% 15-Mar-2026 | 3.326.424 | 0,17 |
| 2.019.000 | Occidental Petroleum Corp 6.200% 15-Mar-2040 | 2.486.318 | 0,13 |
| 3.650.000 | Occidental Petroleum Corp 6.450% 15-Sep-2036 | 4.661.032 | 0,24 |
| 568.000 | Occidental Petroleum Corp 6.600% 15-Mar-2046 | 737.872 | 0,04 |
| 3.715.000 | Occidental Petroleum Corp 6.950% 01-Jul-2024 | 4.124.189 | 0,21 |
| 2.400.000 | Occidental Petroleum Corp 7.500% 01-May-2031 | 3.160.896 | 0,16 |
| 1.970.000 | Occidental Petroleum Corp 7.875% 15-Sep-2031 | 2.632.669 | 0,14 |
| 3.800.000 | Occidental Petroleum Corp 7.950% 15-Jun-2039 | 5.021.339 | 0,26 |
| 1.025.000 | Oceaneering International Inc 4.650% 15-Nov-2024 | 1.031.304 | 0,05 |
| 5.960.000 | Patterson-UTI Energy Inc 3.950% 01-Feb-2028 | 5.995.589 | 0,31 |
| 3.645.000 | Patterson-UTI Energy Inc 5.150% 15-Nov-2029 | 3.703.697 | 0,19 |
| 6.270.000 | Rockies Express Pipeline LLC '144A' 3.600% 15-May-2025 | 6.464.715 | 0,34 |
| 3.800.000 | Rockies Express Pipeline LLC '144A' 4.800% 15-May-2030 | 3.967.257 | 0,21 |
| 7.700.000 | Rockies Express Pipeline LLC '144A' 4.950% 15-Jul-2029 | 8.221.444 | 0,43 |
| 8.529.000 | Rockies Express Pipeline LLC '144A' 6.875% 15-Apr-2040 | 9.652.056 | 0,50 |
| 4.100.000 | Rockies Express Pipeline LLC '144A' 7.500% 15-Jul-2038 | 4.639.560 | 0,24 |
| 279.818 | Ruby Pipeline LLC '144A' 8.000% 01-Apr-2022 | 261.490 | 0,01 |
| 9.505.000 | Southeast Supply Header LLC '144A' 4.250% 15-Jun-2024 | 9.792.051 | 0,51 |
| 718.000 | Southwestern Energy Co 6.450% 23-Jan-2025 | 789.929 | 0,04 |
| 4.662.326 | Topaz Solar Farms LLC '144A' 5.750% 30-Sep-2039 | 5.566.633 | 0,29 |
| 6.698.000 | Transocean Inc 6.800% 15-Mar-2038 | 3.626.331 | 0,19 |
| 4.880.000 | Transocean Inc 7.500% 15-Apr-2031 | 2.888.496 | 0,15 |
| 2.559.000 | Transocean Inc 9.350% 15-Dec-2041 | 1.514.966 | 0,08 |
| 5.090.000 | Western Midstream Operating LP 3.950% 01-Jun-2025 | 5.339.410 | 0,28 |
| 11.361.000 | Western Midstream Operating LP 4.350% 01-Feb-2025 | 11.886.560 | 0,62 |
| 4.303.000 | Western Midstream Operating LP 4.500% 01-Mar-2028 | 4.692.594 | 0,24 |
| 8.610.000 | Western Midstream Operating LP 4.650% 01-Jul-2026 | 9.380.121 | 0,49 |
| 3.841.000 | Western Midstream Operating LP 4.750% 15-Aug-2028 | 4.249.817 | 0,22 |
| 18.393.000 | Western Midstream Operating LP 5.300% 01-Feb-2030 | 20.287.571 | 1,06 |
| 6.293.000 | Western Midstream Operating LP 5.300% 01-Mar-2048 | 7.592.221 | 0,39 |
| 7.184.000 | Western Midstream Operating LP 5.450% 01-Apr-2044 | 8.595.081 | 0,45 |
| 5.460.000 | Western Midstream Operating LP 5.500% 15-Aug-2048 | 6.537.995 | 0,34 |
| 15.664.000 | Western Midstream Operating LP 6.500% 01-Feb-2050 | 18.546.411 | 0,97 |
| Finanzwerte - 130.630.248 | | | |
| (31. Dezember 2020: 105.500.701) | | 130.630.248 | 6,80 |
| 2.973.000 | BrightSphere Investment Group Inc 4.800% 27-Jul-2026 | 3.108.992 | 0,16 |
| 9.714.000 | Commerzbank AG '144A' 8.125% 19-Sep-2023 | 10.709.125 | 0,56 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Summe Beizulegender Zeitwert USD | Nettover- mögen % |
|--|--|---|-------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Finanzwerte Forts. | | | |
| 400.000 | Diversified Healthcare Trust 4.750% 01-May-2024 | 410.000 | 0,02 |
| 785.000 | Diversified Healthcare Trust 4.750% 15-Feb-2028 | 770.446 | 0,04 |
| 8.950.000 | Dresdner Funding Trust I '144A' 8.151% 30-Jun-2031 | 12.682.060 | 0,66 |
| 6.100.000 | Intesa Sanpaolo SpA '144A' 5.017% 26-Jun-2024 | 6.541.589 | 0,34 |
| 2.300.000 | Liberty Mutual Group Inc '144A' 7.800% 15-Mar-2037 | 3.192.917 | 0,17 |
| 700.000 | Navient Corp 5.500% 25-Jan-2023 | 729.890 | 0,04 |
| 889.000 | Navient Corp 'MTN' 5.625% 01-Aug-2033 | 848.022 | 0,04 |
| 300.000 | Provident Financing Trust I 7.405% 15-Mar-2038 | 367.500 | 0,02 |
| 4.537.000 | Service Properties Trust 3.950% 15-Jan-2028 | 4.159.703 | 0,22 |
| 12.000.000 | Service Properties Trust 4.350% 01-Oct-2024 | 11.773.020 | 0,61 |
| 5.626.000 | Service Properties Trust 4.375% 15-Feb-2030 | 5.184.134 | 0,27 |
| 6.650.000 | Service Properties Trust 4.500% 15-Jun-2023 | 6.655.719 | 0,35 |
| 5.874.000 | Service Properties Trust 4.500% 15-Mar-2025 | 5.733.523 | 0,30 |
| 5.362.000 | Service Properties Trust 4.650% 15-Mar-2024 | 5.300.793 | 0,27 |
| 6.325.000 | Service Properties Trust 4.750% 01-Oct-2026 | 6.157.925 | 0,32 |
| 5.363.000 | Service Properties Trust 4.950% 15-Feb-2027 | 5.207.875 | 0,27 |
| 6.316.000 | Service Properties Trust 4.950% 01-Oct-2029 | 6.009.358 | 0,31 |
| 4.790.000 | Service Properties Trust 5.250% 15-Feb-2026 | 4.735.202 | 0,25 |
| 11.300.000 | UniCredit SpA '144A' FRN 5.861% 19-Jun-2032 | 12.353.491 | 0,64 |
| 14.991.000 | UniCredit SpA '144A' FRN 7.296% 02-Apr-2034 | 17.998.964 | 0,94 |
| Industrie - 159.825.622 | | | |
| (31. Dezember 2020: 82.932.064) | | | |
| 5.250.000 | Bombardier Inc '144A' 7.450% 01-May-2034 | 6.457.500 | 0,34 |
| 2.150.000 | Fluor Corp 3.500% 15-Dec-2024 | 2.253.705 | 0,12 |
| 5.840.000 | Fluor Corp 4.250% 15-Sep-2028 | 6.134.190 | 0,32 |
| 13.702.000 | Hexcel Corp 4.200% 15-Feb-2027 | 14.731.057 | 0,77 |
| 9.390.000 | Hexcel Corp 4.950% 15-Aug-2025 | 10.252.938 | 0,53 |
| 5.046.000 | Hillenbrand Inc 5.000% 15-Sep-2026 | 5.631.588 | 0,29 |
| 21.984.000 | Howmet Aerospace Inc 5.125% 01-Oct-2024 | 23.716.339 | 1,23 |
| 13.420.000 | Howmet Aerospace Inc 5.900% 01-Feb-2027 | 15.345.770 | 0,80 |
| 13.994.000 | Howmet Aerospace Inc 5.950% 01-Feb-2037 | 16.568.336 | 0,86 |
| 8.099.000 | Howmet Aerospace Inc 6.750% 15-Jan-2028 | 9.629.266 | 0,50 |
| 11.295.000 | Howmet Aerospace Inc 6.875% 01-May-2025 | 12.990.267 | 0,68 |
| 800.000 | Leonardo US Holdings Inc '144A' 6.250% 15-Jan-2040 | 940.056 | 0,05 |
| 18.800.000 | Rolls-Royce Plc '144A' 3.625% 14-Oct-2025 | 19.103.244 | 0,99 |
| 2.860.000 | Sealed Air Corp '144A' 6.875% 15-Jul-2033 | 3.639.836 | 0,19 |
| 320.000 | Spirit AeroSystems Inc 3.850% 15-Jun-2026 | 327.538 | 0,02 |
| 1.508.000 | Spirit AeroSystems Inc 3.950% 15-Jun-2023 | 1.521.512 | 0,08 |
| 8.054.000 | Spirit AeroSystems Inc 4.600% 15-Jun-2028 | 8.086.337 | 0,42 |
| 1.000.000 | Trinity Industries Inc 4.550% 01-Oct-2024 | 1.049.110 | 0,05 |
| 1.177.000 | XPO CNW Inc 6.700% 01-May-2034 | 1.447.033 | 0,08 |
| Technologie - 127.647.613 | | | |
| (31. Dezember 2020: 55.889.452) | | | |
| 700.000 | CDK Global Inc 5.000% 15-Oct-2024 | 764.085 | 0,04 |
| 400.000 | Pitney Bowes Inc 4.625% 15-Mar-2024 | 409.238 | 0,02 |
| 16.262.000 | Seagate HDD Cayman 4.091% 01-Jun-2029 | 16.854.506 | 0,88 |
| 15.594.000 | Seagate HDD Cayman 4.125% 15-Jan-2031 | 16.246.375 | 0,85 |
| 13.553.000 | Seagate HDD Cayman 4.750% 01-Jun-2023 | 14.180.097 | 0,74 |
| 16.314.000 | Seagate HDD Cayman 4.750% 01-Jan-2025 | 17.473.191 | 0,91 |
| 17.212.000 | Seagate HDD Cayman 4.875% 01-Mar-2024 | 18.269.678 | 0,95 |
| 17.960.000 | Seagate HDD Cayman 4.875% 01-Jun-2027 | 19.594.360 | 1,02 |
| 12.735.000 | Seagate HDD Cayman 5.750% 01-Dec-2034 | 14.695.171 | 0,76 |
| 630.000 | Xerox Corp 3.800% 15-May-2024 | 653.124 | 0,03 |
| 3.000.000 | Xerox Corp 4.375% 15-Mar-2023 | 3.102.750 | 0,16 |
| 2.135.000 | Xerox Corp 4.800% 01-Mar-2035 | 2.158.965 | 0,11 |
| 2.907.000 | Xerox Corp 6.750% 15-Dec-2039 | 3.246.073 | 0,17 |
| Versorger - 106.782.678 | | | |
| (31. Dezember 2020: 51.834.512) | | | |
| 3.402.000 | FirstEnergy Corp 1.600% 15-Jan-2026 | 3.299.906 | 0,17 |
| 3.795.000 | FirstEnergy Corp 2.050% 01-Mar-2025 | 3.776.974 | 0,20 |
| 4.821.000 | FirstEnergy Corp 2.250% 01-Sep-2030 | 4.653.157 | 0,24 |
| 7.835.000 | FirstEnergy Corp 2.650% 01-Mar-2030 | 7.756.650 | 0,40 |
| 5.742.000 | FirstEnergy Corp 3.400% 01-Mar-2050 | 5.641.515 | 0,29 |
| 11.684.000 | FirstEnergy Corp 4.400% 15-Jul-2027 | 12.599.614 | 0,66 |
| 10.630.000 | FirstEnergy Corp 4.750% 15-Mar-2023 | 11.068.488 | 0,58 |

| Bestände | Beschreibung | Summe Beizulegender Zeitwert USD | Nettover- mögen % |
|--|---|---|-------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Versorger Forts. | | | |
| 11.952.000 | FirstEnergy Corp 5.350% 15-Jul-2047 | 14.261.143 | 0,74 |
| 19.400.000 | FirstEnergy Corp 7.375% 15-Nov-2031 | 26.226.860 | 1,37 |
| 6.850.000 | FirstEnergy Transmission LLC '144A' 4.350% 15-Jan-2025 | 7.290.318 | 0,38 |
| 2.336.000 | FirstEnergy Transmission LLC '144A' 4.550% 01-Apr-2049 | 2.682.389 | 0,14 |
| 4.400.000 | FirstEnergy Transmission LLC '144A' 5.450% 15-Jul-2044 | 5.580.498 | 0,29 |
| 534.755 | Lea Power Partners LLC '144A' 6.595% 15-Jun-2033 | 561.851 | 0,03 |
| 1.342.123 | Midland Cogeneration Venture LP '144A' 6.000% 15-Mar-2025 | 1.383.315 | 0,07 |
| Gesamtanlagen in Anleihen | | 1.870.934.871 | 97,38 |
| Offene Terminkontrakte - 409.474 | | | |
| (31. Dezember 2020: 499.680) | | | |
| (102) | U.S. 10 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (13.307.813) | 11.243 |
| 431 | U.S. Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2022 | 69.148.563 | 398.231 |
| Offene Terminkontrakte insgesamt | | 409.474 | 0,02 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 14.611.501 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 5.338.922) | | | |
| | | 14.611.501 | 0,76 |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | 1.885.955.846 | 98,16 |
| Offene Terminkontrakte - (1.062.188) | | | |
| (31. Dezember 2020: (396.547)) | | | |
| (323) | U.S. 10 Year Ultra Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (47.299.312) | (689.133) |
| 338 | U.S. 2 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2022 | 73.742.093 | (1.926) |
| (194) | U.S. 5 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (23.469.453) | (86.839) |
| (111) | U.S. Treasury Ultra Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (21.880.875) | (284.290) |
| Offene Terminkontrakte insgesamt | | (1.062.188) | (0,05) |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (2.130.766) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (49.500)) | | | |
| | | (2.130.766) | (0,11) |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | (3.192.954) | (0,16) |
| Nettoumlaufvermögen | | 38.545.280 | 2,00 |
| Summe Nettovermögen | | 1.921.308.172 | 100,00 |
| Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist Goldman Sachs. | | | |
| Portfolioanalyse | | % des Gesamtvermögens | |
| An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | |
| | | 97,18 | |
| An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente | | | |
| | | 0,02 | |
| Derivative OTC-Finanzinstrumente | | | |
| | | 0,76 | |
| Sonstiges Umlaufvermögen | | | |
| | | 2,04 | |
| Gesamtvermögen | | 100,00 | |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Devisenterminkontrakte | | | | | | | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|--|----------------|-------------|-------------|------------------|-----------------------------|------------|-------------------------------------|
| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | | |
| BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund Anteilsklasse EUR E (Acc) (Hedged) | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 341.270 | 386.922 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 1.695 |
| Euro | US-Dollar | 83.943 | 95.221 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 368 |
| Euro | US-Dollar | 674.12.790 | 76.290.202 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 475.204 |
| | | | | | | USD | 477.267 |
| | | | | | | EUR | 419.207 |
| BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund Anteilsklasse EUR I (Acc) (Hedged) | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 19.000 | 21.452 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 184 |
| Euro | US-Dollar | 1.869.523 | 2.115.715 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 13.179 |
| | | | | | | USD | 13.363 |
| | | | | | | EUR | 11.737 |
| BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund Anteilsklasse EUR N (Acc) (Hedged) | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 9.980 | 11.294 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 70 |
| | | | | | | USD | 70 |
| | | | | | | EUR | 61 |
| BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged) | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 91.318 | 103.343 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 644 |
| | | | | | | USD | 644 |
| | | | | | | EUR | 566 |
| BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged) | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 10.183.767 | 11.524.840 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 71.787 |
| | | | | | | USD | 71.787 |
| | | | | | | EUR | 63.054 |
| BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund Anteilsklasse Sterling X (Acc) (Hedged) | | | | | | | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 6.400 | 8.638 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 25 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 17.400 | 23.338 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 213 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 1.559.448 | 2.107.437 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 3.303 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 19.600 | 25.887 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 641 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 3.800 | 5.042 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 102 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 417 | 552 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 13 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 8.800 | 11.631 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 280 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 17.400 | 23.015 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 536 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 1.999.218 | 2.845.818 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 60.159 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 365.412.045 | 482.735.296 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 11.856.335 |
| | | | | | | USD | 11.921.607 |
| | | | | | | GBP | 8.807.659 |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 23.337 | 17.400 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (215) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 8.637 | 6.400 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (26) |

| Devisenterminkontrakte Forts. | | | | | | | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|---|----------------|------------|------------|------------------|-----------------------------|------------|-------------------------------------|
| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | | |
| BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund Anteilsklasse Sterling X (Acc) (Hedged) Forts. | | | | | | | |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 5.197 | 3.888 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (66) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 89.835.487 | 67.945.780 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (2.130.321) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 191 | 143 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (3) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 6.949 | 5.234 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (135) |
| | | | | | | USD | (2.130.766) |
| | | | | | | GBP | (1.574.206) |
| BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund Anteilsklasse Sterling X (Inc) (Hedged) | | | | | | | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 342.120 | 461.234 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 1.831 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 67.945.780 | 89.840.877 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 2.124.932 |
| | | | | | | USD | 2.126.763 |
| | | | | | | GBP | 1.571.248 |

BNY MELLON EFFICIENT U.S. HIGH YIELD BETA FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Netto- vermögen % |
|--|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen | | | |
| Grundstoffe - 33.447.812 | | | |
| (31. Dezember 2020: 36.952.352) | | | |
| 470.000 | Ahlstrom-Munksjo Holding 3 Oy '144A' 4.875% 04-Feb-2028 | 464.224 | 0,06 |
| 290.000 | Alcoa Nederland Holding BV '144A' 4.125% 31-Mar-2029 | 299.116 | 0,04 |
| 85.000 | Alcoa Nederland Holding BV '144A' 6.125% 15-May-2028 | 91.599 | 0,01 |
| 70.000 | Allegheny Ludlum LLC 6.950% 15-Dec-2025 | 76.986 | 0,01 |
| 255.000 | Arconic Corp '144A' 6.000% 15-May-2025 | 267.112 | 0,04 |
| 362.000 | Arconic Corp '144A' 6.125% 15-Feb-2028 | 385.849 | 0,05 |
| 355.000 | Ashland LLC 6.875% 15-May-2043 | 459.677 | 0,06 |
| 230.000 | Ashland LLC '144A' 3.375% 01-Sep-2031 | 228.605 | 0,03 |
| 575.000 | Axalta Coating Systems LLC / Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV '144A' 4.750% 15-Jun-2027 | 600.013 | 0,08 |
| 695.000 | Axalta Coating Systems LLC '144A' 3.375% 15-Feb-2029 | 673.438 | 0,09 |
| 295.000 | Baffinland Iron Mines Corp / Baffinland Iron Mines LP '144A' 8.750% 15-Jul-2026 | 307.107 | 0,04 |
| 296.000 | Big River Steel LLC / BRS Finance Corp '144A' 6.625% 31-Jan-2029 | 320.458 | 0,04 |
| 527.000 | Chemours Co/The 5.375% 15-May-2027 | 564.417 | 0,08 |
| 400.000 | Chemours Co/The '144A' 4.625% 15-Nov-2029 | 397.506 | 0,05 |
| 495.000 | Chemours Co/The '144A' 5.750% 15-Nov-2028 | 518.141 | 0,07 |
| 150.000 | Clearwater Paper Corp '144A' 4.750% 15-Aug-2028 | 153.154 | 0,02 |
| 150.000 | Cleveland-Cliffs Inc 5.875% 01-Jun-2027 | 156.337 | 0,02 |
| 336.000 | Cleveland-Cliffs Inc 6.250% 01-Oct-2040 | 361.672 | 0,05 |
| 110.000 | Cleveland-Cliffs Inc '144A' 4.625% 01-Mar-2029 | 112.363 | 0,02 |
| 480.000 | Cleveland-Cliffs Inc '144A' 6.750% 15-Mar-2026 | 508.762 | 0,07 |
| 258.000 | Cleveland-Cliffs Inc '144A' 9.875% 17-Oct-2025 | 292.306 | 0,04 |
| 475.000 | Commercial Metals Co 3.875% 15-Feb-2031 | 472.138 | 0,07 |
| 496.000 | Commercial Metals Co 4.875% 15-May-2023 | 511.401 | 0,07 |
| 185.000 | Compass Minerals International Inc '144A' 4.875% 15-Jul-2024 | 189.965 | 0,03 |
| 145.000 | Compass Minerals International Inc '144A' 6.750% 01-Dec-2027 | 153.736 | 0,02 |
| 300.000 | Consolidated Energy Finance SA '144A' 5.625% 15-Oct-2028 | 293.672 | 0,04 |
| 160.000 | Cornerstone Chemical Co '144A' 6.750% 15-Aug-2024 | 144.042 | 0,02 |
| 395.000 | CVR Partners LP / CVR Nitrogen Finance Corp '144A' 6.125% 15-Jun-2028 | 417.308 | 0,06 |
| 9.000 | CVR Partners LP / CVR Nitrogen Finance Corp '144A' 9.250% 15-Jun-2023 | 9.075 | 0,00 |
| 300.000 | Diamond BC BV '144A' 4.625% 01-Oct-2029 | 298.046 | 0,04 |
| 700.000 | Domtar Corp '144A' 6.750% 01-Oct-2028 | 720.510 | 0,10 |
| 500.000 | Element Solutions Inc '144A' 3.875% 01-Sep-2028 | 503.217 | 0,07 |
| 300.000 | EverArc Escrow Sarl '144A' 5.000% 30-Oct-2029 | 300.674 | 0,04 |
| 750.000 | FMG Resources August 2006 Pty Ltd '144A' 4.375% 01-Apr-2031 | 788.798 | 0,11 |
| 215.000 | FMG Resources August 2006 Pty Ltd '144A' 4.500% 15-Sep-2027 | 229.190 | 0,03 |
| 462.000 | FMG Resources August 2006 Pty Ltd '144A' 5.125% 15-May-2024 | 490.200 | 0,07 |
| 410.000 | Freeport-McMoRan Inc 3.875% 15-Mar-2023 | 424.813 | 0,06 |
| 175.000 | Freeport-McMoRan Inc 4.125% 01-Mar-2028 | 181.814 | 0,03 |
| 133.000 | Freeport-McMoRan Inc 4.250% 01-Mar-2030 | 140.506 | 0,02 |
| 155.000 | Freeport-McMoRan Inc 4.375% 01-Aug-2028 | 162.779 | 0,02 |
| 550.000 | Freeport-McMoRan Inc 4.550% 14-Nov-2024 | 589.971 | 0,08 |
| 240.000 | Freeport-McMoRan Inc 4.625% 01-Aug-2030 | 257.798 | 0,04 |
| 335.000 | Freeport-McMoRan Inc 5.000% 01-Sep-2027 | 348.867 | 0,05 |
| 225.000 | Freeport-McMoRan Inc 5.250% 01-Sep-2029 | 246.754 | 0,03 |
| 206.000 | Freeport-McMoRan Inc 5.400% 14-Nov-2034 | 251.095 | 0,03 |
| 720.000 | Freeport-McMoRan Inc 5.450% 15-Mar-2043 | 906.509 | 0,13 |
| 170.000 | GCP Applied Technologies Inc '144A' 5.500% 15-Apr-2026 | 174.420 | 0,02 |
| 300.000 | Glatfelter Corp '144A' 4.750% 15-Nov-2029 | 309.819 | 0,04 |
| 193.000 | GPD Cos Inc '144A' 10.125% 01-Apr-2026 | 205.816 | 0,03 |
| 80.000 | HB Fuller Co 4.250% 15-Oct-2028 | 82.515 | 0,01 |
| 486.000 | Hecla Mining Co 7.250% 15-Feb-2028 | 521.376 | 0,07 |
| 510.000 | Herens Holdco Sarl '144A' 4.750% 15-May-2028 | 500.608 | 0,07 |
| 216.000 | Hexion Inc '144A' 7.875% 15-Jul-2027 | 228.096 | 0,03 |
| 140.000 | Hudbay Minerals Inc 'REGS' 4.500% 01-Apr-2026 | 140.161 | 0,02 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Netto- vermögen % |
|---------------------------|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Grundstoffe Forts. | | | |
| 200.000 | Hudbay Minerals Inc 'REGS' 6.125% 01-Apr-2029 | 212.295 | 0,03 |
| 640.000 | Illuminate Buyer LLC / Illuminate Holdings IV Inc '144A' 9.000% 01-Jul-2028 | 683.414 | 0,09 |
| 300.000 | INEOS Quattro Finance 2 Plc '144A' 3.375% 15-Jan-2026 | 301.448 | 0,04 |
| 100.000 | Infrabuild Australia Pty Ltd '144A' 12.000% 01-Oct-2024 | 103.193 | 0,01 |
| 190.000 | Ingevity Corp '144A' 3.875% 01-Nov-2028 | 185.300 | 0,03 |
| 150.000 | Ingevity Corp '144A' 4.500% 01-Feb-2026 | 150.540 | 0,02 |
| 83.000 | Innophos Holdings Inc '144A' 9.375% 15-Feb-2028 | 90.322 | 0,01 |
| 130.000 | JW Aluminum Continuous Cast Co '144A' 10.250% 01-Jun-2026 | 137.643 | 0,02 |
| 200.000 | Kaiser Aluminum Corp '144A' 4.500% 01-Jun-2031 | 197.053 | 0,03 |
| 300.000 | Kaiser Aluminum Corp '144A' 4.625% 01-Mar-2028 | 303.454 | 0,04 |
| 110.000 | Kraton Polymers LLC / Kraton Polymers Capital Corp '144A' 4.250% 15-Dec-2025 | 114.000 | 0,02 |
| 190.000 | LSF11 A5 HoldCo LLC '144A' 6.625% 15-Oct-2029 | 187.417 | 0,03 |
| 484.000 | Mercer International Inc 5.125% 01-Feb-2029 | 495.161 | 0,07 |
| 117.000 | Methanex Corp 4.250% 01-Dec-2024 | 122.681 | 0,02 |
| 470.000 | Methanex Corp 5.125% 15-Oct-2027 | 493.970 | 0,07 |
| 270.000 | Methanex Corp 5.250% 15-Dec-2029 | 285.525 | 0,04 |
| 275.000 | Methanex Corp 5.650% 01-Dec-2044 | 276.529 | 0,04 |
| 330.000 | Mineral Resources Ltd '144A' 8.125% 01-May-2027 | 356.398 | 0,05 |
| 200.000 | Minerals Technologies Inc '144A' 5.000% 01-Jul-2028 | 207.595 | 0,03 |
| 100.000 | Mountain Province Diamonds Inc '144A' 8.000% 15-Dec-2022 | 92.743 | 0,01 |
| 300.000 | Novelis Corp '144A' 3.250% 15-Nov-2026 | 302.977 | 0,04 |
| 200.000 | Novelis Corp '144A' 3.875% 15-Aug-2031 | 199.061 | 0,03 |
| 1.050.000 | Novelis Corp '144A' 4.750% 30-Jan-2030 | 1.105.629 | 0,15 |
| 200.000 | Nufarm Australia Ltd / Nufarm Americas Inc '144A' 5.750% 30-Apr-2026 | 204.747 | 0,03 |
| 158.000 | Olin Corp 5.000% 01-Feb-2030 | 166.125 | 0,02 |
| 245.000 | Olin Corp 5.125% 15-Sep-2027 | 251.676 | 0,03 |
| 215.000 | Olin Corp 5.625% 01-Aug-2029 | 233.230 | 0,03 |
| 140.000 | Olympus Water US Holding Corp '144A' 4.250% 01-Oct-2028 | 139.425 | 0,02 |
| 200.000 | Perenti Finance Pty Ltd '144A' 6.500% 07-Oct-2025 | 207.350 | 0,03 |
| 140.000 | Polar US Borrower LLC / Schenectady International Group Inc '144A' 6.750% 15-May-2026 | 137.696 | 0,02 |
| 394.000 | Rain CII Carbon LLC / CII Carbon Corp '144A' 7.250% 01-Apr-2025 | 403.212 | 0,06 |
| 591.000 | Rayonier AM Products Inc '144A' 5.500% 01-Jun-2024 | 593.216 | 0,08 |
| 100.000 | Resolute Forest Products Inc '144A' 4.875% 01-Mar-2026 | 101.784 | 0,01 |
| 105.000 | Schweitzer-Mauduit International Inc '144A' 6.875% 01-Oct-2026 | 109.991 | 0,02 |
| 390.000 | SCIH Salt Holdings Inc '144A' 4.875% 01-May-2028 | 375.010 | 0,05 |
| 219.000 | SCIH Salt Holdings Inc '144A' 6.625% 01-May-2029 | 205.073 | 0,03 |
| 211.000 | SPCM SA '144A' 3.125% 15-Mar-2027 | 208.717 | 0,03 |
| 104.000 | Sylvamo Corp '144A' 7.000% 01-Sep-2029 | 108.801 | 0,02 |
| 100.000 | Tacora Resources Inc '144A' 8.250% 15-May-2026 | 100.020 | 0,01 |
| 530.000 | Taseko Mines Ltd '144A' 7.000% 15-Feb-2026 | 551.751 | 0,08 |
| 290.000 | TPC Group Inc '144A' 10.500% 01-Aug-2024 | 210.573 | 0,03 |
| 170.000 | Trinseo Materials Operating SCA / Trinseo Materials Finance Inc '144A' 5.125% 01-Apr-2029 | 173.657 | 0,02 |
| 86.000 | Trinseo Materials Operating SCA / Trinseo Materials Finance Inc '144A' 5.375% 01-Sep-2025 | 87.666 | 0,01 |
| 500.000 | Tronox Inc '144A' 4.625% 15-Mar-2029 | 500.280 | 0,07 |
| 130.000 | Tronox Inc '144A' 6.500% 01-May-2025 | 137.527 | 0,02 |
| 300.000 | Unifrax Escrow Issuer Corp '144A' 5.250% 30-Sep-2028 | 303.810 | 0,04 |
| 180.000 | Unifrax Escrow Issuer Corp '144A' 7.500% 30-Sep-2029 | 182.056 | 0,03 |
| 250.000 | United States Steel Corp 6.650% 01-Jun-2037 | 281.500 | 0,04 |
| 305.000 | United States Steel Corp 6.875% 01-Mar-2029 | 328.747 | 0,05 |
| 250.000 | Valvoline Inc '144A' 3.625% 15-Jun-2031 | 242.444 | 0,03 |
| 570.000 | Valvoline Inc '144A' 4.250% 15-Feb-2030 | 582.366 | 0,08 |
| 77.000 | Venator Finance Sarl / Venator Materials LLC '144A' 5.750% 15-Jul-2025 | 74.000 | 0,01 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|---|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Grundstoffe Forts. | | | |
| 300.000 | WR Grace Holdings LLC '144A' 4.875% 15-Jun-2027 | 308.514 | 0,04 |
| 875.000 | WR Grace Holdings LLC '144A' 5.625% 15-Aug-2029 | 897.969 | 0,12 |
| Kommunikation - 122.602.839 | | | |
| (31. Dezember 2020: 123.543.554) | | 122.602.839 | 16,87 |
| 320.000 | Advantage Sales & Marketing Inc '144A' 6.500% 15-Nov-2028 | 335.733 | 0,05 |
| 380.000 | Altice Financing SA '144A' 5.000% 15-Jan-2028 | 371.431 | 0,05 |
| 700.000 | Altice Financing SA '144A' 5.750% 15-Aug-2029 | 694.061 | 0,10 |
| 530.000 | Altice France Holding SA '144A' 6.000% 15-Feb-2028 | 507.104 | 0,07 |
| 710.000 | Altice France Holding SA '144A' 10.500% 15-May-2027 | 764.251 | 0,11 |
| 260.000 | Altice France SA/France '144A' 5.125% 15-Jan-2029 | 253.874 | 0,03 |
| 1.160.000 | Altice France SA/France '144A' 5.125% 15-Jul-2029 | 1.133.540 | 0,16 |
| 430.000 | Altice France SA/France '144A' 5.500% 15-Jan-2028 | 426.898 | 0,06 |
| 866.000 | Altice France SA/France '144A' 5.500% 15-Oct-2029 | 854.487 | 0,12 |
| 395.000 | Altice France SA/France '144A' 8.125% 01-Feb-2027 | 421.366 | 0,06 |
| 310.000 | AMC Networks Inc 4.250% 15-Feb-2029 | 308.624 | 0,04 |
| 145.000 | AMC Networks Inc 4.750% 01-Aug-2025 | 148.260 | 0,02 |
| 160.000 | ANGI Group LLC '144A' 3.875% 15-Aug-2028 | 156.642 | 0,02 |
| 105.000 | Arches Buyer Inc '144A' 4.250% 01-Jun-2028 | 105.096 | 0,01 |
| 300.000 | Arches Buyer Inc '144A' 6.125% 01-Dec-2028 | 302.295 | 0,04 |
| 665.000 | Audacy Capital Corp '144A' 6.500% 01-May-2027 | 658.483 | 0,09 |
| 95.000 | Audacy Capital Corp '144A' 6.750% 31-Mar-2029 | 92.945 | 0,01 |
| 615.000 | Avaya Inc '144A' 6.125% 15-Sep-2028 | 652.961 | 0,09 |
| 100.000 | Beasley Mezzanine Holdings LLC '144A' 8.625% 01-Feb-2026 | 98.854 | 0,01 |
| 70.000 | Belo Corp 7.250% 15-Sep-2027 | 80.874 | 0,01 |
| 400.000 | Belo Corp 7.750% 01-Jun-2027 | 469.808 | 0,06 |
| 150.000 | Block Communications Inc '144A' 4.875% 01-Mar-2028 | 150.226 | 0,02 |
| 470.000 | British Telecommunications Plc '144A' FRN 4.250% 23-Nov-2081 | 472.458 | 0,07 |
| 235.000 | Cable One Inc '144A' 4.000% 15-Nov-2030 | 230.656 | 0,03 |
| 160.000 | Cablevision Lightpath LLC '144A' 3.875% 15-Sep-2027 | 155.366 | 0,02 |
| 132.000 | Cablevision Lightpath LLC '144A' 5.625% 15-Sep-2028 | 130.312 | 0,02 |
| 387.000 | Cars.com Inc '144A' 6.375% 01-Nov-2028 | 412.710 | 0,06 |
| 1.496.000 | CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 4.500% 01-May-2032 | 1.541.501 | 0,21 |
| 1.745.000 | CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.250% 01-Feb-2031 | 1.764.631 | 0,24 |
| 1.060.000 | CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.250% 15-Jan-2034 | 1.044.776 | 0,14 |
| 1.435.000 | CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.500% 15-Aug-2030 | 1.471.212 | 0,20 |
| 920.000 | CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.500% 01-Jun-2033 | 940.070 | 0,13 |
| 1.858.000 | CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.750% 01-Mar-2030 | 1.935.618 | 0,27 |
| 1.450.000 | CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.000% 01-Feb-2028 | 1.510.900 | 0,21 |
| 1.895.000 | CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.125% 01-May-2027 | 1.954.171 | 0,27 |
| 875.000 | CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.375% 01-Jun-2029 | 945.744 | 0,13 |
| 265.000 | Cengage Learning Inc '144A' 9.500% 15-Jun-2024 | 266.932 | 0,04 |
| 530.000 | Clear Channel Outdoor Holdings Inc '144A' 7.500% 01-Jun-2029 | 566.687 | 0,08 |
| 320.000 | Clear Channel Outdoor Holdings Inc '144A' 7.750% 15-Apr-2028 | 342.890 | 0,05 |
| 305.000 | Clear Channel Worldwide Holdings Inc '144A' 5.125% 15-Aug-2027 | 315.980 | 0,04 |
| 590.000 | Cogent Communications Group Inc '144A' 3.500% 01-May-2026 | 599.472 | 0,08 |
| 290.000 | CommScope Inc '144A' 4.750% 01-Sep-2029 | 288.711 | 0,04 |
| 325.000 | CommScope Inc '144A' 6.000% 01-Mar-2026 | 335.187 | 0,05 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|-----------------------------|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Kommunikation Forts. | | | |
| 355.000 | CommScope Inc '144A' 7.125% 01-Jul-2028 | 349.290 | 0,05 |
| 421.000 | CommScope Inc '144A' 8.250% 01-Mar-2027 | 432.817 | 0,06 |
| 255.000 | CommScope Technologies LLC '144A' 5.000% 15-Mar-2027 | 238.680 | 0,03 |
| 443.000 | CommScope Technologies LLC '144A' 6.000% 15-Jun-2025 | 443.494 | 0,06 |
| 1.331.000 | Connect Finco SARRL / Connect US Finco LLC '144A' 6.750% 01-Oct-2026 | 1.401.011 | 0,19 |
| 130.000 | Consolidated Communications Inc '144A' 6.500% 01-Oct-2028 | 136.825 | 0,02 |
| 176.000 | CSC Holdings LLC 5.250% 01-Jun-2024 | 183.256 | 0,03 |
| 160.000 | CSC Holdings LLC '144A' 3.375% 15-Feb-2031 | 150.059 | 0,02 |
| 240.000 | CSC Holdings LLC '144A' 4.125% 01-Dec-2030 | 234.689 | 0,03 |
| 330.000 | CSC Holdings LLC '144A' 4.500% 15-Nov-2031 | 326.410 | 0,04 |
| 600.000 | CSC Holdings LLC '144A' 4.625% 01-Dec-2030 | 568.764 | 0,08 |
| 180.000 | CSC Holdings LLC '144A' 5.375% 01-Feb-2028 | 186.656 | 0,03 |
| 275.000 | CSC Holdings LLC '144A' 5.500% 15-Apr-2027 | 284.609 | 0,04 |
| 1.078.000 | CSC Holdings LLC '144A' 5.750% 15-Jan-2030 | 1.068.090 | 0,15 |
| 420.000 | CSC Holdings LLC '144A' 6.500% 01-Feb-2029 | 450.253 | 0,06 |
| 250.000 | CSC Holdings LLC '144A' 7.500% 01-Apr-2028 | 268.521 | 0,04 |
| 90.000 | Cumulus Media New Holdings Inc '144A' 6.750% 01-Jul-2026 | 93.490 | 0,01 |
| 700.000 | Diamond Sports Group LLC / Diamond Sports Finance Co '144A' 5.375% 15-Aug-2026 | 350.805 | 0,05 |
| 1.440.000 | Directv Financing LLC / Directv Financing Co- Obligor Inc '144A' 5.875% 15-Aug-2027 | 1.475.741 | 0,20 |
| 680.000 | DISH DBS Corp 5.000% 15-Mar-2023 | 697.775 | 0,10 |
| 1.310.000 | DISH DBS Corp 5.125% 01-Jun-2029 | 1.194.222 | 0,16 |
| 1.075.000 | DISH DBS Corp 5.875% 15-Nov-2024 | 1.104.713 | 0,15 |
| 795.000 | DISH DBS Corp 7.375% 01-Jul-2028 | 806.213 | 0,11 |
| 1.040.000 | DISH DBS Corp 7.750% 01-Jul-2026 | 1.098.552 | 0,15 |
| 1.630.000 | DISH DBS Corp '144A' 5.250% 01-Dec-2026 | 1.658.158 | 0,23 |
| 1.360.000 | DISH DBS Corp '144A' 5.750% 01-Dec-2028 | 1.376.150 | 0,19 |
| 400.000 | DKT Finance ApS '144A' 9.375% 17-Jun-2023 | 406.156 | 0,06 |
| 628.000 | Embarq Corp 7.995% 01-Jun-2036 | 704.390 | 0,10 |
| 320.000 | Endure Digital Inc '144A' 6.000% 15-Feb-2029 | 298.050 | 0,04 |
| 300.000 | Frontier Communications Holdings LLC 5.875% 01-Nov-2029 | 300.422 | 0,04 |
| 958.000 | Frontier Communications Holdings LLC '144A' 5.000% 01-May-2028 | 988.474 | 0,14 |
| 550.000 | Frontier Communications Holdings LLC '144A' 5.875% 15-Oct-2027 | 582.475 | 0,08 |
| 390.000 | Frontier Communications Holdings LLC '144A' 6.000% 15-Jan-2030 | 392.621 | 0,05 |
| 425.000 | Frontier Communications Holdings LLC '144A' 6.750% 01-May-2029 | 442.650 | 0,06 |
| 350.000 | Frontier North Inc 6.730% 15-Feb-2028 | 373.270 | 0,05 |
| 235.000 | Gannett Holdings LLC '144A' 6.000% 01-Nov-2026 | 240.236 | 0,03 |
| 75.000 | GCI LLC '144A' 4.750% 15-Oct-2028 | 77.077 | 0,01 |
| 85.000 | Getty Images Inc '144A' 9.750% 01-Mar-2027 | 90.121 | 0,01 |
| 350.000 | Go Daddy Operating Co LLC / GD Finance Co Inc '144A' 3.500% 01-Mar-2029 | 347.690 | 0,05 |
| 326.000 | Go Daddy Operating Co LLC / GD Finance Co Inc '144A' 5.250% 01-Dec-2027 | 337.464 | 0,05 |
| 785.000 | Gray Escrow II Inc '144A' 5.375% 15-Nov-2031 | 808.978 | 0,11 |
| 500.000 | Gray Television Inc '144A' 4.750% 15-Oct-2030 | 497.728 | 0,07 |
| 242.000 | Gray Television Inc '144A' 5.875% 15-Jul-2026 | 250.273 | 0,03 |
| 295.000 | GrubHub Holdings Inc '144A' 5.500% 01-Jul-2027 | 293.230 | 0,04 |
| 235.000 | Hughes Satellite Systems Corp 5.250% 01-Aug-2026 | 257.274 | 0,04 |
| 274.000 | Hughes Satellite Systems Corp 6.625% 01-Aug-2026 | 306.949 | 0,04 |
| 690.332 | iHeartCommunications Inc 6.375% 01-May-2026 | 716.979 | 0,10 |
| 625.886 | iHeartCommunications Inc 8.375% 01-May-2027 | 660.701 | 0,09 |
| 174.000 | iHeartCommunications Inc '144A' 4.750% 15-Jan-2028 | 176.723 | 0,02 |
| 705.000 | iHeartCommunications Inc '144A' 5.250% 15-Aug-2027 | 733.976 | 0,10 |
| 1.120.000 | Iliad Holding SASU '144A' 6.500% 15-Oct-2026 | 1.178.341 | 0,16 |
| 600.000 | Iliad Holding SASU '144A' 7.000% 15-Oct-2028 | 631.968 | 0,09 |
| 380.000 | Intrado Corp '144A' 8.500% 15-Oct-2025 | 374.695 | 0,05 |
| 350.000 | ION Trading Technologies Sarl '144A' 5.750% 15-May-2028 | 361.016 | 0,05 |
| 395.000 | Koninklijke KPN NV '144A' FRN 7.000% 28-Mar-2073 | 416.606 | 0,06 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|-----------------------------|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Kommunikation Forts. | | | |
| 615.000 | Lamar Media Corp 3.625% 15-Jan-2031 | 599.794 | 0,08 |
| 145.000 | Lamar Media Corp 3.750% 15-Feb-2028 | 145.571 | 0,02 |
| 160.000 | Lamar Media Corp 4.000% 15-Feb-2030 | 162.550 | 0,02 |
| 400.000 | Lamar Media Corp 4.875% 15-Jan-2029 | 418.070 | 0,06 |
| 404.000 | LCPR Senior Secured Financing DAC '144A' 5.125% 15-Jul-2029 | 406.626 | 0,06 |
| 874.000 | LCPR Senior Secured Financing DAC '144A' 6.750% 15-Oct-2027 | 918.574 | 0,13 |
| 200.000 | Level 3 Financing Inc 5.250% 15-Mar-2026 | 204.713 | 0,03 |
| 770.000 | Level 3 Financing Inc '144A' 3.625% 15-Jan-2029 | 732.693 | 0,10 |
| 570.000 | Level 3 Financing Inc '144A' 3.750% 15-Jul-2029 | 542.423 | 0,07 |
| 950.000 | Level 3 Financing Inc '144A' 4.250% 01-Jul-2028 | 942.039 | 0,13 |
| 625.000 | Level 3 Financing Inc '144A' 4.625% 15-Sep-2027 | 638.447 | 0,09 |
| 215.000 | Liberty Interactive LLC 8.250% 01-Feb-2030 | 235.727 | 0,03 |
| 84.000 | Liberty Interactive LLC 8.500% 15-Jul-2029 | 91.678 | 0,01 |
| 1.881.945 | Ligado Networks LLC '144A' 15.500% 01-Nov-2023 | 1.527.518 | 0,21 |
| 560.000 | LogMeIn Inc '144A' 5.500% 01-Sep-2027 | 567.302 | 0,08 |
| 168.000 | Lumen Technologies Inc 5.625% 01-Apr-2025 | 177.896 | 0,02 |
| 205.000 | Lumen Technologies Inc 6.750% 01-Dec-2023 | 221.630 | 0,03 |
| 60.000 | Lumen Technologies Inc 6.875% 15-Jan-2028 | 66.838 | 0,01 |
| 391.000 | Lumen Technologies Inc 7.500% 01-Apr-2024 | 428.614 | 0,06 |
| 325.000 | Lumen Technologies Inc 7.600% 15-Sep-2039 | 349.019 | 0,05 |
| 264.000 | Lumen Technologies Inc 7.650% 15-Mar-2042 | 284.460 | 0,04 |
| 412.000 | Lumen Technologies Inc '144A' 4.000% 15-Feb-2027 | 418.510 | 0,06 |
| 400.000 | Lumen Technologies Inc '144A' 4.500% 15-Jan-2029 | 387.626 | 0,05 |
| 500.000 | Lumen Technologies Inc '144A' 5.125% 15-Dec-2026 | 521.070 | 0,07 |
| 500.000 | Lumen Technologies Inc '144A' 5.375% 15-Jun-2029 | 500.775 | 0,07 |
| 340.000 | Match Group Holdings II LLC '144A' 3.625% 01-Oct-2031 | 330.727 | 0,05 |
| 150.000 | Match Group Holdings II LLC '144A' 4.125% 01-Aug-2030 | 151.715 | 0,02 |
| 150.000 | Match Group Holdings II LLC '144A' 4.625% 01-Jun-2028 | 156.344 | 0,02 |
| 300.000 | Match Group Holdings II LLC '144A' 5.000% 15-Dec-2027 | 312.428 | 0,04 |
| 215.000 | Match Group Holdings II LLC '144A' 5.625% 15-Feb-2029 | 230.347 | 0,03 |
| 400.000 | McGraw-Hill Education Inc '144A' 5.750% 01-Aug-2028 | 396.606 | 0,05 |
| 465.000 | McGraw-Hill Education Inc '144A' 8.000% 01-Aug-2029 | 462.096 | 0,06 |
| 500.000 | Midas OpCo Holdings LLC '144A' 5.625% 15-Aug-2029 | 512.667 | 0,07 |
| 690.000 | Millennium Escrow Corp '144A' 6.625% 01-Aug-2026 | 692.446 | 0,10 |
| 394.000 | Netflix Inc 4.375% 15-Nov-2026 | 436.601 | 0,06 |
| 450.000 | Netflix Inc 4.875% 15-Apr-2028 | 513.776 | 0,07 |
| 365.000 | Netflix Inc 5.875% 15-Feb-2025 | 410.621 | 0,06 |
| 1.145.000 | Netflix Inc 5.875% 15-Nov-2028 | 1.378.786 | 0,19 |
| 460.000 | Netflix Inc 6.375% 15-May-2029 | 572.272 | 0,08 |
| 190.000 | Netflix Inc '144A' 3.625% 15-Jun-2025 | 200.422 | 0,03 |
| 345.000 | Netflix Inc '144A' 4.875% 15-Jun-2030 | 402.951 | 0,06 |
| 346.000 | Netflix Inc '144A' 5.375% 15-Nov-2029 | 411.467 | 0,06 |
| 542.000 | News Corp '144A' 3.875% 15-May-2029 | 548.358 | 0,08 |
| 475.000 | Nexstar Media Inc '144A' 4.750% 01-Nov-2028 | 484.773 | 0,07 |
| 871.000 | Nexstar Media Inc '144A' 5.625% 15-Jul-2027 | 911.314 | 0,13 |
| 75.000 | Nokia Oyj 4.375% 12-Jun-2027 | 81.091 | 0,01 |
| 212.000 | Nokia Oyj 6.625% 15-May-2039 | 293.648 | 0,04 |
| 100.000 | Northwest Fiber LLC / Northwest Fiber Finance Sub Inc '144A' 10.750% 01-Jun-2028 | 109.141 | 0,02 |
| 520.000 | NortonLifeLock Inc '144A' 5.000% 15-Apr-2025 | 524.550 | 0,07 |
| 75.000 | Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp '144A' 4.250% 15-Jan-2029 | 75.250 | 0,01 |
| 80.000 | Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp '144A' 4.625% 15-Mar-2030 | 79.921 | 0,01 |
| 340.000 | Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp '144A' 5.000% 15-Aug-2027 | 348.344 | 0,05 |
| 100.000 | Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp '144A' 6.250% 15-Jun-2025 | 104.102 | 0,01 |
| 360.000 | Photo Holdings Merger Sub Inc '144A' 8.500% 01-Oct-2026 | 374.855 | 0,05 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|-----------------------------|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Kommunikation Forts. | | | |
| 400.000 | Quebecor Media Inc 5.750% 15-Jan-2023 | 416.402 | 0,06 |
| 250.000 | Radiate Holdco LLC / Radiate Finance Inc '144A' 4.500% 15-Sep-2026 | 252.805 | 0,03 |
| 475.000 | Radiate Holdco LLC / Radiate Finance Inc '144A' 6.500% 15-Sep-2028 | 477.874 | 0,07 |
| 465.000 | Rakuten Group Inc '144A' FRN (Perpetual) 5.125% 22-Apr-2026 | 468.116 | 0,06 |
| 400.000 | Rakuten Group Inc '144A' FRN (Perpetual) 6.250% 22-Apr-2031 | 423.000 | 0,06 |
| 155.000 | Scripps Escrow II Inc '144A' 3.875% 15-Jan-2029 | 155.047 | 0,02 |
| 775.000 | Scripps Escrow Inc '144A' 5.875% 15-Jul-2027 | 814.961 | 0,11 |
| 90.000 | Sinclair Television Group Inc '144A' 4.125% 01-Dec-2030 | 85.411 | 0,01 |
| 170.000 | Sinclair Television Group Inc '144A' 5.500% 01-Mar-2030 | 165.139 | 0,02 |
| 118.000 | Sinclair Television Group Inc '144A' 5.875% 15-Mar-2026 | 119.893 | 0,02 |
| 300.000 | Sirius XM Radio Inc '144A' 3.125% 01-Sep-2026 | 300.482 | 0,04 |
| 726.000 | Sirius XM Radio Inc '144A' 3.875% 01-Sep-2031 | 713.095 | 0,10 |
| 770.000 | Sirius XM Radio Inc '144A' 4.000% 15-Jul-2028 | 775.636 | 0,11 |
| 785.000 | Sirius XM Radio Inc '144A' 4.125% 01-Jul-2030 | 786.393 | 0,11 |
| 528.000 | Sirius XM Radio Inc '144A' 5.000% 01-Aug-2027 | 549.426 | 0,08 |
| 503.000 | Sirius XM Radio Inc '144A' 5.500% 01-Jul-2029 | 542.828 | 0,07 |
| 1.212.000 | Sprint Capital Corp 6.875% 15-Nov-2028 | 1.535.216 | 0,21 |
| 958.000 | Sprint Capital Corp 8.750% 15-Mar-2032 | 1.438.609 | 0,20 |
| 1.240.000 | Sprint Corp 7.125% 15-Jun-2024 | 1.393.661 | 0,19 |
| 860.000 | Sprint Corp 7.625% 15-Feb-2025 | 990.088 | 0,14 |
| 689.000 | Sprint Corp 7.625% 01-Mar-2026 | 828.085 | 0,11 |
| 1.597.000 | Sprint Corp 7.875% 15-Sep-2023 | 1.761.052 | 0,24 |
| 80.000 | Summer BC Bidco B LLC '144A' 5.500% 31-Oct-2026 | 82.000 | 0,01 |
| 206.000 | Switch Ltd '144A' 3.750% 15-Sep-2028 | 207.841 | 0,03 |
| 200.000 | Switch Ltd '144A' 4.125% 15-Jun-2029 | 204.787 | 0,03 |
| 545.000 | TEGNA Inc 4.625% 15-Mar-2028 | 552.011 | 0,08 |
| 592.000 | TEGNA Inc 5.000% 15-Sep-2029 | 606.392 | 0,08 |
| 200.000 | TEGNA Inc '144A' 4.750% 15-Mar-2026 | 208.211 | 0,03 |
| 100.000 | Telecom Italia Capital SA 6.000% 30-Sep-2034 | 105.918 | 0,01 |
| 214.000 | Telecom Italia Capital SA 6.375% 15-Nov-2033 | 230.759 | 0,03 |
| 374.000 | Telecom Italia Capital SA 7.200% 18-Jul-2036 | 429.427 | 0,06 |
| 318.000 | Telecom Italia Capital SA 7.721% 04-Jun-2038 | 374.218 | 0,05 |
| 480.000 | Telecom Italia SpA/Milano '144A' 5.303% 30-May-2024 | 505.800 | 0,07 |
| 400.000 | Telenet Finance Luxembourg Notes Sarl '144A' 5.500% 01-Mar-2028 | 414.000 | 0,06 |
| 345.000 | Telesat Canada / Telesat LLC '144A' 4.875% 01-Jun-2027 | 305.670 | 0,04 |
| 385.000 | Telesat Canada / Telesat LLC '144A' 5.625% 06-Dec-2026 | 361.954 | 0,05 |
| 300.000 | Telesat Canada / Telesat LLC '144A' 6.500% 15-Oct-2027 | 233.100 | 0,03 |
| 490.000 | Terrier Media Buyer Inc '144A' 8.875% 15-Dec-2027 | 530.327 | 0,07 |
| 670.000 | T-Mobile USA Inc 2.250% 15-Feb-2026 | 672.697 | 0,09 |
| 775.000 | T-Mobile USA Inc 2.625% 15-Apr-2026 | 779.886 | 0,11 |
| 649.000 | T-Mobile USA Inc 2.625% 15-Feb-2029 | 640.388 | 0,09 |
| 340.000 | T-Mobile USA Inc 2.875% 15-Feb-2031 | 336.372 | 0,05 |
| 644.000 | T-Mobile USA Inc 3.500% 15-Apr-2031 | 670.874 | 0,09 |
| 810.000 | T-Mobile USA Inc 4.750% 01-Feb-2028 | 853.926 | 0,12 |
| 199.000 | T-Mobile USA Inc 5.375% 15-Apr-2027 | 207.288 | 0,03 |
| 450.000 | T-Mobile USA Inc '144A' 2.250% 15-Feb-2026 | 451.811 | 0,06 |
| 350.000 | T-Mobile USA Inc '144A' 3.375% 15-Apr-2029 | 357.234 | 0,05 |
| 160.000 | Townsquare Media Inc '144A' 6.875% 01-Feb-2026 | 169.966 | 0,02 |
| 880 | Trilogy International South Pacific LLC / TISP Finance Inc '144A' 8.875% 15-May-2023 | 860 | 0,00 |
| 300.000 | TripAdvisor Inc '144A' 7.000% 15-Jul-2025 | 316.804 | 0,04 |
| 200.000 | Twitter Inc '144A' 3.875% 15-Dec-2027 | 209.156 | 0,03 |
| 725.000 | Uber Technologies Inc '144A' 4.500% 15-Aug-2029 | 739.656 | 0,10 |
| 300.000 | Uber Technologies Inc '144A' 6.250% 15-Jan-2028 | 322.467 | 0,04 |
| 487.000 | Uber Technologies Inc '144A' 7.500% 15-May-2025 | 512.399 | 0,07 |
| 700.000 | Uber Technologies Inc '144A' 7.500% 15-Sep-2027 | 762.650 | 0,10 |
| 234.000 | United States Cellular Corp 6.700% 15-Dec-2033 | 283.482 | 0,04 |
| 301.000 | Univision Communications Inc '144A' 4.500% 01-May-2029 | 304.546 | 0,04 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Nettovermögen % | Summe |
|--|--|----------------------------|-----------------|-------|
| Anleihen Forts. | | | | |
| Kommunikation Forts. | | | | |
| 660.000 | Univision Communications Inc '144A' 6.625% 01-Jun-2027 | 711.820 | 0,10 | |
| 440.000 | UPC Broadband Finco BV '144A' 4.875% 15-Jul-2031 | 449.511 | 0,06 | |
| 289.000 | UPC Holding BV '144A' 5.500% 15-Jan-2028 | 300.239 | 0,04 | |
| 121.000 | Urban One Inc '144A' 7.375% 01-Feb-2028 | 124.806 | 0,02 | |
| 815.000 | VEON Holdings BV '144A' 3.375% 25-Nov-2027 | 796.915 | 0,11 | |
| 815.000 | VEON Holdings BV '144A' 4.000% 09-Apr-2025 | 831.129 | 0,11 | |
| 325.000 | VEON Holdings BV 'REGS' 4.950% 16-Jun-2024 | 341.513 | 0,05 | |
| 200.000 | VEON Holdings BV 'REGS' 5.950% 13-Feb-2023 | 208.761 | 0,03 | |
| 400.000 | VEON Holdings BV 'REGS' 7.250% 26-Apr-2023 | 421.820 | 0,06 | |
| 210.000 | ViacomCBS Inc FRN 6.250% 28-Feb-2057 | 236.802 | 0,03 | |
| 340.000 | Viasat Inc '144A' 5.625% 15-Sep-2025 | 342.116 | 0,05 | |
| 473.000 | Viasat Inc '144A' 5.625% 15-Apr-2027 | 487.701 | 0,07 | |
| 300.000 | Viasat Inc '144A' 6.500% 15-Jul-2028 | 301.175 | 0,04 | |
| 440.000 | Videotron Ltd '144A' 3.625% 15-Jun-2029 | 442.831 | 0,06 | |
| 300.000 | Videotron Ltd '144A' 5.375% 15-Jun-2024 | 321.311 | 0,04 | |
| 700.000 | Virgin Media Finance Plc '144A' 5.000% 15-Jul-2030 | 697.592 | 0,10 | |
| 450.000 | Virgin Media Secured Finance Plc '144A' 4.500% 15-Aug-2030 | 453.568 | 0,06 | |
| 762.000 | Virgin Media Secured Finance Plc '144A' 5.500% 15-May-2029 | 803.319 | 0,11 | |
| 275.000 | Virgin Media Vendor Financing Notes IV DAC '144A' 5.000% 15-Jul-2028 | 277.489 | 0,04 | |
| 585.000 | Vmed O2 UK Financing I Plc '144A' 4.250% 31-Jan-2031 | 574.248 | 0,08 | |
| 510.000 | Vmed O2 UK Financing I Plc '144A' 4.750% 15-Jul-2031 | 517.298 | 0,07 | |
| 390.000 | Vodafone Group Plc FRN 3.250% 04-Jun-2081 | 382.996 | 0,05 | |
| 800.000 | Vodafone Group Plc FRN 4.125% 04-Jun-2081 | 793.264 | 0,11 | |
| 520.000 | Vodafone Group Plc FRN 5.125% 04-Jun-2081 | 532.535 | 0,07 | |
| 994.000 | Vodafone Group Plc FRN 7.000% 04-Apr-2079 | 1.203.632 | 0,17 | |
| 555.000 | Windstream Escrow LLC / Windstream Escrow Finance Corp '144A' 7.750% 15-Aug-2028 | 589.399 | 0,08 | |
| 495.000 | Zayo Group Holdings Inc '144A' 4.000% 01-Mar-2027 | 488.142 | 0,07 | |
| 464.000 | Zayo Group Holdings Inc '144A' 6.125% 01-Mar-2028 | 457.750 | 0,06 | |
| 126.000 | Ziggo Bond Co BV '144A' 5.125% 28-Feb-2030 | 126.818 | 0,02 | |
| 400.000 | Ziggo BV '144A' 4.875% 15-Jan-2030 | 410.888 | 0,06 | |
| Zyklische Konsumgüter - 145.277.820 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 158.223.089) | | 145.277.820 | 19,99 | |
| 420.000 | 1011778 BC ULC / New Red Finance Inc '144A' 3.500% 15-Feb-2029 | 416.277 | 0,06 | |
| 960.000 | 1011778 BC ULC / New Red Finance Inc '144A' 3.875% 15-Jan-2028 | 973.910 | 0,13 | |
| 860.000 | 1011778 BC ULC / New Red Finance Inc '144A' 4.000% 15-Oct-2030 | 846.739 | 0,12 | |
| 215.000 | 1011778 BC ULC / New Red Finance Inc '144A' 4.375% 15-Jan-2028 | 219.669 | 0,03 | |
| 144.000 | 1011778 BC ULC / New Red Finance Inc '144A' 5.750% 15-Apr-2025 | 149.571 | 0,02 | |
| 104.000 | AAG FH LP / AAG FH Finco Inc '144A' 9.750% 15-Jul-2024 | 103.348 | 0,01 | |
| 170.000 | Abercrombie & Fitch Management Co '144A' 8.750% 15-Jul-2025 | 183.217 | 0,03 | |
| 330.000 | Academy Ltd '144A' 6.000% 15-Nov-2027 | 352.504 | 0,05 | |
| 180.000 | Adient Global Holdings Ltd '144A' 4.875% 15-Aug-2026 | 183.832 | 0,03 | |
| 250.000 | Adient US LLC '144A' 9.000% 15-Apr-2025 | 265.905 | 0,04 | |
| 200.000 | Affinity Gaming '144A' 6.875% 15-Dec-2027 | 208.284 | 0,03 | |
| 600.000 | Air Canada '144A' 3.875% 15-Aug-2026 | 612.789 | 0,08 | |
| 265.000 | Air Canada 2020-1 Class C Pass Through Trust '144A' 10.500% 15-Jul-2026 | 325.602 | 0,04 | |
| 325.000 | Allen Media LLC / Allen Media Co-Issuer Inc '144A' 10.500% 15-Feb-2028 | 339.534 | 0,05 | |
| 400.000 | Allison Transmission Inc '144A' 3.750% 30-Jan-2031 | 390.710 | 0,05 | |
| 215.000 | Allison Transmission Inc '144A' 4.750% 01-Oct-2027 | 224.137 | 0,03 | |
| 250.000 | Allison Transmission Inc '144A' 5.875% 01-Jun-2029 | 272.220 | 0,04 | |
| 600.000 | AMC Entertainment Holdings Inc '144A' 10.500% 15-Apr-2025 | 639.624 | 0,09 | |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Nettovermögen % | Summe |
|-------------------------------------|---|----------------------------|-----------------|-------|
| Anleihen Forts. | | | | |
| Zyklische Konsumgüter Forts. | | | | |
| 200.000 | AMC Entertainment Holdings Inc '144A' 10.500% 24-Apr-2026 | 212.708 | 0,03 | |
| 275.331 | American Airlines 2013-1 Class A Pass Through Trust 4.000% 15-Jul-2025 | 266.399 | 0,04 | |
| 363.599 | American Airlines 2013-2 Class A Pass Through Trust 4.950% 15-Jan-2023 | 371.764 | 0,05 | |
| 240.766 | American Airlines 2014-1 Class A Pass Through Trust 3.700% 01-Oct-2026 | 244.805 | 0,03 | |
| 287.458 | American Airlines 2015-1 Class A Pass Through Trust 3.375% 01-May-2027 | 285.511 | 0,04 | |
| 358.076 | American Airlines 2016-1 Class A Pass Through Trust 4.100% 15-Jan-2028 | 353.071 | 0,05 | |
| 275.220 | American Airlines 2016-2 Class A Pass Through Trust 3.650% 15-Jun-2028 | 266.753 | 0,04 | |
| 192.916 | American Airlines 2016-3 Class A Pass Through Trust 3.250% 15-Oct-2028 | 184.072 | 0,03 | |
| 400.000 | American Airlines 2021-1 Class B Pass Through Trust 3.950% 11-Jul-2030 | 396.000 | 0,05 | |
| 245.000 | American Airlines Group Inc '144A' 3.750% 01-Mar-2025 | 229.343 | 0,03 | |
| 215.000 | American Airlines Group Inc '144A' 5.000% 01-Jun-2022 | 215.716 | 0,03 | |
| 675.000 | American Airlines Inc '144A' 11.750% 15-Jul-2025 | 833.689 | 0,11 | |
| 1.530.000 | American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd '144A' 5.500% 20-Apr-2026 | 1.593.388 | 0,22 | |
| 1.150.000 | American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd '144A' 5.750% 20-Apr-2029 | 1.230.069 | 0,17 | |
| 250.000 | American Builders & Contractors Supply Co Inc '144A' 4.000% 15-Jan-2028 | 256.166 | 0,04 | |
| 152.000 | American Greetings Corp '144A' 8.750% 15-Apr-2025 | 156.342 | 0,02 | |
| 235.000 | Aramark Services Inc '144A' 5.000% 01-Apr-2025 | 239.996 | 0,03 | |
| 711.000 | Aramark Services Inc '144A' 5.000% 01-Feb-2028 | 736.244 | 0,10 | |
| 682.000 | Aramark Services Inc '144A' 6.375% 01-May-2025 | 713.560 | 0,10 | |
| 100.000 | Arko Corp '144A' 5.125% 15-Nov-2029 | 96.769 | 0,01 | |
| 225.000 | Arrow Bidco LLC '144A' 9.500% 15-Mar-2024 | 230.586 | 0,03 | |
| 205.000 | Asbury Automotive Group Inc 4.500% 01-Mar-2028 | 209.394 | 0,03 | |
| 140.000 | Asbury Automotive Group Inc 4.750% 01-Mar-2030 | 142.487 | 0,02 | |
| 540.000 | Asbury Automotive Group Inc '144A' 4.625% 15-Nov-2029 | 551.027 | 0,08 | |
| 200.000 | Asbury Automotive Group Inc '144A' 5.000% 15-Feb-2032 | 207.841 | 0,03 | |
| 120.000 | Ashton Woods USA LLC / Ashton Woods Finance Co '144A' 4.625% 01-Apr-2030 | 118.082 | 0,02 | |
| 25.000 | Ashton Woods USA LLC / Ashton Woods Finance Co '144A' 6.625% 15-Jan-2028 | 26.463 | 0,00 | |
| 840.000 | Aston Martin Capital Holdings Ltd '144A' 10.500% 30-Nov-2025 | 924.941 | 0,13 | |
| 225.000 | At Home Group Inc '144A' 7.125% 15-Jul-2029 | 221.379 | 0,03 | |
| 96.000 | Avient Corp 5.250% 15-Mar-2023 | 100.659 | 0,01 | |
| 385.000 | Avient Corp '144A' 5.750% 15-May-2025 | 401.794 | 0,06 | |
| 535.000 | Banjay Entertainment SASU '144A' 5.375% 01-Mar-2025 | 546.302 | 0,08 | |
| 200.000 | Bath & Body Works Inc 5.250% 01-Feb-2028 | 221.282 | 0,03 | |
| 120.000 | Bath & Body Works Inc 6.694% 15-Jan-2027 | 138.120 | 0,02 | |
| 295.000 | Bath & Body Works Inc 6.750% 01-Jul-2036 | 364.756 | 0,05 | |
| 340.000 | Bath & Body Works Inc 6.875% 01-Nov-2035 | 422.984 | 0,06 | |
| 125.000 | Bath & Body Works Inc 6.950% 01-Mar-2033 | 146.433 | 0,02 | |
| 210.000 | Bath & Body Works Inc 7.500% 15-Jun-2029 | 239.438 | 0,03 | |
| 129.000 | Bath & Body Works Inc 7.600% 15-Jul-2037 | 156.916 | 0,02 | |
| 562.000 | Bath & Body Works Inc '144A' 6.625% 01-Oct-2030 | 637.406 | 0,09 | |
| 130.000 | Bath & Body Works Inc '144A' 9.375% 01-Jul-2025 | 158.730 | 0,02 | |
| 400.000 | BCPE Empire Holdings Inc '144A' 7.625% 01-May-2027 | 408.828 | 0,06 | |
| 190.000 | BCPE Ulysses Intermediate Inc '144A' 7.750% 01-Apr-2027 | 187.815 | 0,03 | |
| 170.000 | Beazer Homes USA Inc 6.750% 15-Mar-2025 | 175.063 | 0,02 | |
| 15.000 | Beazer Homes USA Inc 7.250% 15-Oct-2029 | 16.743 | 0,00 | |
| 130.000 | Bloomin' Brands Inc / OSI Restaurant Partners LLC '144A' 5.125% 15-Apr-2029 | 132.219 | 0,02 | |
| 420.000 | BlueLinx Holdings Inc '144A' 6.000% 15-Nov-2029 | 418.490 | 0,06 | |
| 440.000 | Boyd Gaming Corp 4.750% 01-Dec-2027 | 449.585 | 0,06 | |
| 427.000 | Boyd Gaming Corp '144A' 4.750% 15-Jun-2031 | 436.285 | 0,06 | |
| 353.000 | Brookfield Residential Properties Inc / Brookfield Residential US LLC '144A' 4.875% 15-Feb-2030 | 361.583 | 0,05 | |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|-------------------------------------|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Zyklische Konsumgüter Forts. | | | |
| 284.000 | Brookfield Residential Properties Inc / Brookfield Residential US LLC '144A' 6.250% 15-Sep-2027 | 296.723 | 0,04 |
| 515.000 | Caesars Entertainment Inc '144A' 4.625% 15-Oct-2029 | 516.079 | 0,07 |
| 1.494.000 | Caesars Entertainment Inc '144A' 6.250% 01-Jul-2025 | 1.570.045 | 0,22 |
| 840.000 | Caesars Entertainment Inc '144A' 8.125% 01-Jul-2027 | 930.569 | 0,13 |
| 420.000 | Caesars Resort Collection LLC / CRC Finco Inc '144A' 5.750% 01-Jul-2025 | 439.148 | 0,06 |
| 600.000 | Carnival Corp '144A' 4.000% 01-Aug-2028 | 596.721 | 0,08 |
| 940.000 | Carnival Corp '144A' 5.750% 01-Mar-2027 | 941.410 | 0,13 |
| 475.000 | Carnival Corp '144A' 6.000% 01-May-2029 | 473.563 | 0,07 |
| 725.000 | Carnival Corp '144A' 7.625% 01-Mar-2026 | 760.927 | 0,10 |
| 540.000 | Carnival Corp '144A' 9.875% 01-Aug-2027 | 617.625 | 0,09 |
| 575.000 | Carnival Corp '144A' 10.500% 01-Feb-2026 | 657.058 | 0,09 |
| 130.000 | Carrols Restaurant Group Inc '144A' 5.875% 01-Jul-2029 | 117.183 | 0,02 |
| 530.000 | Carvana Co '144A' 4.875% 01-Sep-2029 | 505.593 | 0,07 |
| 410.000 | Carvana Co '144A' 5.500% 15-Apr-2027 | 406.330 | 0,06 |
| 560.000 | Carvana Co '144A' 5.625% 01-Oct-2025 | 560.700 | 0,08 |
| 150.000 | Carvana Co '144A' 5.875% 01-Oct-2028 | 149.648 | 0,02 |
| 285.000 | CCM Merger Inc '144A' 6.375% 01-May-2026 | 297.598 | 0,04 |
| 330.000 | CD&R Smokey Buyer Inc '144A' 6.750% 15-Jul-2025 | 346.861 | 0,05 |
| 300.000 | CEC Entertainment LLC '144A' 6.750% 01-May-2026 | 294.312 | 0,04 |
| 205.000 | Cedar Fair LP 5.250% 15-Jul-2029 | 210.434 | 0,03 |
| 360.000 | Cedar Fair LP / Canada's Wonderland Co / Magnum Management Corp / Millennium Op 5.375% 15-Apr-2027 | 369.365 | 0,05 |
| 100.000 | Cedar Fair LP / Canada's Wonderland Co / Magnum Management Corp / Millennium Op 6.500% 01-Oct-2028 | 106.648 | 0,01 |
| 290.000 | Cedar Fair LP / Canada's Wonderland Co / Magnum Management Corp / Millennium Op '144A' 5.500% 01-May-2025 | 300.517 | 0,04 |
| 95.000 | Century Communities Inc 6.750% 01-Jun-2027 | 100.320 | 0,01 |
| 200.000 | Century Communities Inc '144A' 3.875% 15-Aug-2029 | 201.787 | 0,03 |
| 425.000 | Churchill Downs Inc '144A' 4.750% 15-Jan-2028 | 440.604 | 0,06 |
| 235.000 | Churchill Downs Inc '144A' 5.500% 01-Apr-2027 | 242.285 | 0,03 |
| 90.000 | Cinemark USA Inc '144A' 5.250% 15-Jul-2028 | 87.904 | 0,01 |
| 215.000 | Cinemark USA Inc '144A' 5.875% 15-Mar-2026 | 217.956 | 0,03 |
| 70.000 | Cinemark USA Inc '144A' 8.750% 01-May-2025 | 74.276 | 0,01 |
| 381.000 | Clarios Global LP / Clarios US Finance Co '144A' 6.250% 15-May-2026 | 399.103 | 0,06 |
| 890.000 | Clarios Global LP / Clarios US Finance Co '144A' 8.500% 15-May-2027 | 944.544 | 0,13 |
| 304.000 | Clarios Global LP '144A' 6.750% 15-May-2025 | 318.749 | 0,04 |
| 315.000 | Constellation Merger Sub Inc '144A' 8.500% 15-Sep-2025 | 301.186 | 0,04 |
| 100.000 | Cooper-Standard Automotive Inc '144A' 13.000% 01-Jun-2024 | 108.104 | 0,01 |
| 595.000 | Dana Inc 4.500% 15-Feb-2032 | 594.414 | 0,08 |
| 165.000 | Dana Inc 5.375% 15-Nov-2027 | 173.300 | 0,02 |
| 115.000 | Dana Inc 5.625% 15-Jun-2028 | 122.346 | 0,02 |
| 204.000 | Dave & Buster's Inc '144A' 7.625% 01-Nov-2025 | 217.722 | 0,03 |
| 180.000 | Dealer Tire LLC / DT Issuer LLC '144A' 8.000% 01-Feb-2028 | 187.620 | 0,03 |
| 300.000 | Delta Air Lines Inc 2.900% 28-Oct-2024 | 306.135 | 0,04 |
| 215.000 | Delta Air Lines Inc 3.750% 28-Oct-2029 | 220.768 | 0,03 |
| 187.000 | Delta Air Lines Inc 3.800% 19-Apr-2023 | 191.262 | 0,03 |
| 190.000 | Delta Air Lines Inc 4.375% 19-Apr-2028 | 202.743 | 0,03 |
| 340.000 | Delta Air Lines Inc 7.375% 15-Jan-2026 | 400.595 | 0,06 |
| 300.000 | Dornoch Debt Merger Sub Inc '144A' 6.625% 15-Oct-2029 | 296.625 | 0,04 |
| 465.000 | eG Global Finance Plc '144A' 6.750% 07-Feb-2025 | 471.296 | 0,06 |
| 300.000 | eG Global Finance Plc '144A' 8.500% 30-Oct-2025 | 311.187 | 0,04 |
| 200.000 | Empire Communities Corp '144A' 7.000% 15-Dec-2025 | 207.232 | 0,03 |
| 190.000 | Ferrellgas LP / Ferrellgas Finance Corp '144A' 5.375% 01-Apr-2026 | 184.029 | 0,03 |
| 310.000 | Ferrellgas LP / Ferrellgas Finance Corp '144A' 5.875% 01-Apr-2029 | 300.592 | 0,04 |
| 75.000 | FirstCash Inc '144A' 4.625% 01-Sep-2028 | 75.040 | 0,01 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|-------------------------------------|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Zyklische Konsumgüter Forts. | | | |
| 200.000 | Foot Locker Inc '144A' 4.000% 01-Oct-2029 | 200.630 | 0,03 |
| 460.000 | Ford Holdings LLC 9.300% 01-Mar-2030 | 640.796 | 0,09 |
| 1.000.000 | Ford Motor Co 3.250% 12-Feb-2032 | 1.026.000 | 0,14 |
| 888.000 | Ford Motor Co 4.346% 08-Dec-2026 | 969.754 | 0,13 |
| 415.000 | Ford Motor Co 4.750% 15-Jan-2043 | 458.793 | 0,06 |
| 749.000 | Ford Motor Co 5.291% 08-Dec-2046 | 881.434 | 0,12 |
| 140.000 | Ford Motor Co 6.375% 01-Feb-2029 | 164.788 | 0,02 |
| 270.000 | Ford Motor Co 6.625% 01-Oct-2028 | 325.048 | 0,04 |
| 295.000 | Ford Motor Co 7.400% 01-Nov-2046 | 406.819 | 0,06 |
| 500.000 | Ford Motor Co 9.000% 22-Apr-2025 | 611.933 | 0,08 |
| 514.000 | Ford Motor Credit Co LLC 2.700% 10-Aug-2026 | 519.140 | 0,07 |
| 100.000 | Ford Motor Credit Co LLC 2.900% 16-Feb-2028 | 100.394 | 0,01 |
| 750.000 | Ford Motor Credit Co LLC 3.087% 09-Jan-2023 | 763.665 | 0,11 |
| 305.000 | Ford Motor Credit Co LLC 3.096% 04-May-2023 | 311.120 | 0,04 |
| 405.000 | Ford Motor Credit Co LLC 3.350% 01-Nov-2022 | 410.595 | 0,06 |
| 750.000 | Ford Motor Credit Co LLC 3.370% 17-Nov-2023 | 774.375 | 0,11 |
| 880.000 | Ford Motor Credit Co LLC 3.375% 13-Nov-2025 | 915.407 | 0,13 |
| 350.000 | Ford Motor Credit Co LLC 3.625% 17-Jun-2031 | 367.937 | 0,05 |
| 430.000 | Ford Motor Credit Co LLC 3.664% 08-Sep-2024 | 447.116 | 0,06 |
| 402.000 | Ford Motor Credit Co LLC 3.810% 09-Jan-2024 | 417.469 | 0,06 |
| 255.000 | Ford Motor Credit Co LLC 3.815% 02-Nov-2027 | 269.980 | 0,04 |
| 585.000 | Ford Motor Credit Co LLC 4.000% 13-Nov-2030 | 630.355 | 0,09 |
| 735.000 | Ford Motor Credit Co LLC 4.063% 01-Nov-2024 | 774.311 | 0,11 |
| 475.000 | Ford Motor Credit Co LLC 4.125% 17-Aug-2027 | 513.294 | 0,07 |
| 493.000 | Ford Motor Credit Co LLC 4.134% 04-Aug-2025 | 523.753 | 0,07 |
| 560.000 | Ford Motor Credit Co LLC 4.140% 15-Feb-2023 | 574.028 | 0,08 |
| 284.000 | Ford Motor Credit Co LLC 4.271% 09-Jan-2027 | 305.621 | 0,04 |
| 445.000 | Ford Motor Credit Co LLC 4.375% 06-Aug-2023 | 463.572 | 0,06 |
| 230.000 | Ford Motor Credit Co LLC 4.542% 01-Aug-2026 | 250.080 | 0,03 |
| 340.000 | Ford Motor Credit Co LLC 4.687% 09-Jun-2025 | 365.859 | 0,05 |
| 560.000 | Ford Motor Credit Co LLC 5.113% 03-May-2029 | 637.260 | 0,09 |
| 845.000 | Ford Motor Credit Co LLC 5.125% 16-Jun-2025 | 920.036 | 0,13 |
| 735.000 | Ford Motor Credit Co LLC 5.584% 18-Mar-2024 | 792.885 | 0,11 |
| 439.000 | Ford Motor Credit Co LLC 'GMTN' 4.389% 08-Jan-2026 | 473.519 | 0,07 |
| 140.000 | Forestar Group Inc '144A' 5.000% 01-Mar-2028 | 144.176 | 0,02 |
| 300.000 | Foundation Building Materials Inc '144A' 6.000% 01-Mar-2029 | 295.172 | 0,04 |
| 140.000 | Full House Resorts Inc '144A' 8.250% 15-Feb-2028 | 147.199 | 0,02 |
| 115.000 | Gap Inc/The '144A' 3.625% 01-Oct-2029 | 113.925 | 0,02 |
| 115.000 | Gap Inc/The '144A' 3.875% 01-Oct-2031 | 113.607 | 0,02 |
| 600.000 | Genting New York LLC / GENNY Capital Inc '144A' 3.300% 15-Feb-2026 | 594.804 | 0,08 |
| 300.000 | G-III Apparel Group Ltd '144A' 7.875% 15-Aug-2025 | 319.500 | 0,04 |
| 156.000 | Golden Entertainment Inc '144A' 7.625% 15-Apr-2026 | 163.703 | 0,02 |
| 675.000 | Golden Nugget Inc '144A' 6.750% 15-Oct-2024 | 675.877 | 0,09 |
| 100.000 | Golden Nugget Inc '144A' 8.750% 01-Oct-2025 | 104.101 | 0,01 |
| 105.000 | Goodyear Tire & Rubber Co/The 4.875% 15-Mar-2027 | 111.288 | 0,02 |
| 185.000 | Goodyear Tire & Rubber Co/The 5.000% 31-May-2026 | 190.100 | 0,03 |
| 70.000 | Goodyear Tire & Rubber Co/The 5.625% 30-Apr-2033 | 76.490 | 0,01 |
| 300.000 | Goodyear Tire & Rubber Co/The 9.500% 31-May-2025 | 324.657 | 0,04 |
| 500.000 | Goodyear Tire & Rubber Co/The '144A' 5.000% 15-Jul-2029 | 538.050 | 0,07 |
| 500.000 | Goodyear Tire & Rubber Co/The '144A' 5.250% 15-Jul-2031 | 543.600 | 0,07 |
| 609.000 | Group 1 Automotive Inc '144A' 4.000% 15-Aug-2028 | 607.730 | 0,08 |
| 150.000 | GYP Holdings III Corp '144A' 4.625% 01-May-2029 | 150.604 | 0,02 |
| 295.000 | H&E Equipment Services Inc '144A' 3.875% 15-Dec-2028 | 293.311 | 0,04 |
| 486.000 | Hanesbrands Inc '144A' 4.625% 15-May-2024 | 509.459 | 0,07 |
| 485.000 | Hanesbrands Inc '144A' 4.875% 15-May-2026 | 518.948 | 0,07 |
| 239.247 | Hawaiian Airlines 2013-1 Class A Pass Through Certificates 3.900% 15-Jan-2026 | 237.138 | 0,03 |
| 245.000 | Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / HawaiianMiles Loyalty Ltd '144A' 5.750% 20-Jan-2026 | 256.661 | 0,04 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|-------------------------------------|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Zyklische Konsumgüter Forts. | | | |
| 572.000 | Hilton Domestic Operating Co Inc 4.875% 15-Jan-2030 | 612.206 | 0,08 |
| 490.000 | Hilton Domestic Operating Co Inc '144A' 3.625% 15-Feb-2032 | 488.238 | 0,07 |
| 255.000 | Hilton Domestic Operating Co Inc '144A' 3.750% 01-May-2029 | 257.278 | 0,04 |
| 755.000 | Hilton Domestic Operating Co Inc '144A' 4.000% 01-May-2031 | 774.056 | 0,11 |
| 580.000 | Hilton Domestic Operating Co Inc '144A' 5.375% 01-May-2025 | 604.148 | 0,08 |
| 568.000 | Hilton Domestic Operating Co Inc '144A' 5.750% 01-May-2028 | 607.646 | 0,08 |
| 162.000 | Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC / Hilton Grand Vacations Borrower Esc '144A' 5,000% 01-Jun-2029 | 166.302 | 0,02 |
| 255.000 | Hilton Worldwide Finance LLC / Hilton Worldwide Finance Corp 4.875% 01-Apr-2027 | 262.905 | 0,04 |
| 240.000 | IAA Inc '144A' 5,500% 15-Jun-2027 | 248.940 | 0,03 |
| 155.000 | IHO Verwaltungs GmbH '144A' 4,750% 15-Sep-2026 | 158.434 | 0,02 |
| 505.000 | IHO Verwaltungs GmbH '144A' 6,000% 15-May-2027 | 521.842 | 0,07 |
| 275.000 | IHO Verwaltungs GmbH '144A' 6,375% 15-May-2029 | 296.128 | 0,04 |
| 150.000 | Installed Building Products Inc '144A' 5,750% 01-Feb-2028 | 156.221 | 0,02 |
| 125.000 | International Game Technology Plc '144A' 4,125% 15-Apr-2026 | 128.914 | 0,02 |
| 100.000 | International Game Technology Plc '144A' 5,250% 15-Jan-2029 | 106.115 | 0,01 |
| 300.000 | International Game Technology Plc '144A' 6,250% 15-Jan-2027 | 336.300 | 0,05 |
| 260.000 | International Game Technology Plc '144A' 6,500% 15-Feb-2025 | 282.426 | 0,04 |
| 300.000 | IRB Holding Corp '144A' 6,750% 15-Feb-2026 | 305.942 | 0,04 |
| 202.000 | IRB Holding Corp '144A' 7,000% 15-Jun-2025 | 213.915 | 0,03 |
| 255.000 | Jaguar Land Rover Automotive Plc '144A' 4,500% 01-Oct-2027 | 247.625 | 0,03 |
| 165.000 | Jaguar Land Rover Automotive Plc '144A' 5,500% 15-Jul-2029 | 165.409 | 0,02 |
| 190.000 | Jaguar Land Rover Automotive Plc '144A' 5,875% 15-Jan-2028 | 193.595 | 0,03 |
| 300.000 | Jaguar Land Rover Automotive Plc '144A' 7,750% 15-Oct-2025 | 324.750 | 0,04 |
| 249.000 | JB Poindexter & Co Inc '144A' 7,125% 15-Apr-2026 | 260.901 | 0,04 |
| 100.000 | K Hovnanian Enterprises Inc '144A' 7,750% 15-Feb-2026 | 104.807 | 0,01 |
| 340.000 | KAR Auction Services Inc '144A' 5,125% 01-Jun-2025 | 345.511 | 0,05 |
| 200.000 | KB Home 4,000% 15-Jun-2031 | 207.787 | 0,03 |
| 156.000 | KB Home 4,800% 15-Nov-2029 | 170.498 | 0,02 |
| 335.000 | KB Home 6,875% 15-Jun-2027 | 393.122 | 0,05 |
| 148.000 | KB Home 7,500% 15-Sep-2022 | 154.438 | 0,02 |
| 39.000 | KB Home 7,625% 15-May-2023 | 41.042 | 0,01 |
| 160.000 | Ken Garff Automotive LLC '144A' 4,875% 15-Sep-2028 | 160.443 | 0,02 |
| 510.000 | Kontoor Brands Inc '144A' 4,125% 15-Nov-2029 | 510.852 | 0,07 |
| 360.000 | LBM Acquisition LLC '144A' 6,250% 15-Jan-2029 | 356.458 | 0,05 |
| 205.000 | LCM Investments Holdings II LLC '144A' 4,875% 01-May-2029 | 211.001 | 0,03 |
| 200.000 | Levi Strauss & Co '144A' 3,500% 01-Mar-2031 | 204.213 | 0,03 |
| 510.000 | LGI Homes Inc '144A' 4,000% 15-Jul-2029 | 508.840 | 0,07 |
| 200.000 | Life Time Inc '144A' 5,750% 15-Jan-2026 | 207.235 | 0,03 |
| 500.000 | Lions Gate Capital Holdings LLC '144A' 5,500% 15-Apr-2029 | 509.637 | 0,07 |
| 835.000 | Lithia Motors Inc '144A' 3,875% 01-Jun-2029 | 860.050 | 0,12 |
| 309.000 | Live Nation Entertainment Inc '144A' 3,750% 15-Jan-2028 | 307.455 | 0,04 |
| 350.000 | Live Nation Entertainment Inc '144A' 4,750% 15-Oct-2027 | 360.150 | 0,05 |
| 165.000 | Live Nation Entertainment Inc '144A' 4,875% 01-Nov-2024 | 166.825 | 0,02 |
| 465.000 | Live Nation Entertainment Inc '144A' 5,625% 15-Mar-2026 | 481.240 | 0,07 |
| 645.000 | Live Nation Entertainment Inc '144A' 6,500% 15-May-2027 | 706.246 | 0,10 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|-------------------------------------|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Zyklische Konsumgüter Forts. | | | |
| 450.000 | LSF9 Atlantis Holdings LLC / Victra Finance Corp '144A' 7,750% 15-Feb-2026 | 455.551 | 0,06 |
| 155.000 | M/I Homes Inc 4,950% 01-Feb-2028 | 161.800 | 0,02 |
| 149.000 | Macy's Retail Holdings LLC 2,875% 15-Feb-2023 | 150.684 | 0,02 |
| 32.000 | Macy's Retail Holdings LLC 3,625% 01-Jun-2024 | 32.754 | 0,00 |
| 270.000 | Macy's Retail Holdings LLC 4,300% 15-Feb-2043 | 237.319 | 0,03 |
| 290.000 | Macy's Retail Holdings LLC 4,500% 15-Dec-2034 | 286.814 | 0,04 |
| 115.000 | Macy's Retail Holdings LLC 5,125% 15-Jan-2042 | 109.991 | 0,02 |
| 521.000 | Macy's Retail Holdings LLC 6,375% 15-Mar-2037 | 552.742 | 0,08 |
| 300.000 | MajorDrive Holdings IV LLC '144A' 6,375% 01-Jun-2029 | 290.671 | 0,04 |
| 92.000 | Marriott Ownership Resorts Inc '144A' 6,125% 15-Sep-2025 | 96.002 | 0,01 |
| 271.000 | Mattamy Group Corp '144A' 4,625% 01-Mar-2030 | 276.400 | 0,04 |
| 240.000 | Mattamy Group Corp '144A' 5,250% 15-Dec-2027 | 252.760 | 0,03 |
| 135.000 | Mattel Inc 6,200% 01-Oct-2040 | 175.055 | 0,02 |
| 210.000 | Mattel Inc '144A' 3,375% 01-Apr-2026 | 215.581 | 0,03 |
| 290.000 | Mattel Inc '144A' 3,750% 01-Apr-2029 | 300.929 | 0,04 |
| 295.000 | Mattel Inc '144A' 5,875% 15-Dec-2027 | 317.520 | 0,04 |
| 930.000 | Melco Resorts Finance Ltd '144A' 5,375% 04-Dec-2029 | 903.542 | 0,12 |
| 385.000 | Melco Resorts Finance Ltd '144A' 5,750% 21-Jul-2028 | 387.672 | 0,05 |
| 550.000 | Melco Resorts Finance Ltd 'REGS' 4,875% 06-Jun-2025 | 542.437 | 0,07 |
| 115.000 | Melco Resorts Finance Ltd 'REGS' 5,250% 26-Apr-2026 | 113.701 | 0,02 |
| 165.000 | Melco Resorts Finance Ltd 'REGS' 5,625% 17-Jul-2027 | 163.050 | 0,02 |
| 17.000 | Meritage Homes Corp 5,125% 06-Jun-2027 | 18.748 | 0,00 |
| 116.000 | Meritage Homes Corp 6,000% 01-Jun-2025 | 129.636 | 0,02 |
| 180.000 | Meritage Homes Corp '144A' 3,875% 15-Apr-2029 | 189.258 | 0,03 |
| 110.000 | Meritor Inc '144A' 4,500% 15-Dec-2028 | 110.442 | 0,02 |
| 100.000 | Meritor Inc '144A' 6,250% 01-Jun-2025 | 104.352 | 0,01 |
| 170.000 | Merlin Entertainments Ltd '144A' 5,750% 15-Jun-2026 | 176.986 | 0,02 |
| 120.000 | MGM China Holdings Ltd '144A' 5,250% 18-Jun-2025 | 119.227 | 0,02 |
| 465.000 | MGM China Holdings Ltd '144A' 5,375% 15-May-2024 | 463.958 | 0,06 |
| 345.000 | MGM China Holdings Ltd '144A' 5,875% 15-May-2026 | 346.216 | 0,05 |
| 155.000 | MGM Resorts International 4,625% 01-Sep-2026 | 161.364 | 0,02 |
| 300.000 | MGM Resorts International 4,750% 15-Oct-2028 | 309.443 | 0,04 |
| 270.000 | MGM Resorts International 5,500% 15-Apr-2027 | 287.842 | 0,04 |
| 640.000 | MGM Resorts International 5,750% 15-Jun-2025 | 689.440 | 0,09 |
| 480.000 | MGM Resorts International 6,000% 15-Mar-2023 | 502.207 | 0,07 |
| 397.000 | MGM Resorts International 6,750% 01-May-2025 | 415.262 | 0,06 |
| 290.000 | Michaels Cos Inc/The '144A' 5,250% 01-May-2028 | 290.117 | 0,04 |
| 675.000 | Michaels Cos Inc/The '144A' 7,875% 01-May-2029 | 666.026 | 0,09 |
| 410.000 | Midwest Gaming Borrower LLC / Midwest Gaming Finance Corp '144A' 4,875% 01-May-2029 | 412.673 | 0,06 |
| 640.000 | Mohegan Gaming & Entertainment '144A' 8,000% 01-Feb-2026 | 672.765 | 0,09 |
| 165.000 | Motion Bondco DAC '144A' 6,625% 15-Nov-2027 | 167.668 | 0,02 |
| 280.000 | Murphy Oil USA Inc 4,750% 15-Sep-2029 | 295.102 | 0,04 |
| 245.000 | Murphy Oil USA Inc '144A' 3,750% 15-Feb-2031 | 243.820 | 0,03 |
| 145.000 | NCL Corp Ltd '144A' 3,625% 15-Dec-2024 | 137.003 | 0,02 |
| 590.000 | NCL Corp Ltd '144A' 5,875% 15-Mar-2026 | 588.156 | 0,08 |
| 214.000 | NCL Corp Ltd '144A' 10,250% 01-Feb-2026 | 248.992 | 0,03 |
| 98.000 | NCL Corp Ltd '144A' 12,250% 15-May-2024 | 116.229 | 0,02 |
| 160.000 | NCL Finance Ltd '144A' 6,125% 15-Mar-2028 | 157.868 | 0,02 |
| 248.000 | Newell Brands Inc 4,000% 01-Dec-2024 | 260.367 | 0,04 |
| 1.116.000 | Newell Brands Inc 4,700% 01-Apr-2026 | 1.218.421 | 0,17 |
| 195.000 | Newell Brands Inc 4,875% 01-Jun-2025 | 212.791 | 0,03 |
| 315.000 | Newell Brands Inc 5,875% 01-Apr-2036 | 388.672 | 0,05 |
| 300.000 | Newell Brands Inc 6,000% 01-Apr-2046 | 385.350 | 0,05 |
| 525.000 | NMG Holding Co Inc / Neiman Marcus Group LLC '144A' 7,125% 01-Apr-2026 | 558.044 | 0,08 |
| 440.000 | Nordstrom Inc 4,000% 15-Mar-2027 | 442.640 | 0,06 |
| 435.000 | Nordstrom Inc 4,250% 01-Aug-2031 | 428.047 | 0,06 |
| 675.000 | Nordstrom Inc 4,375% 01-Apr-2030 | 681.952 | 0,09 |
| 1.010.000 | Nordstrom Inc 5,000% 15-Jan-2044 | 943.401 | 0,13 |
| 305.000 | Nordstrom Inc 6,950% 15-Mar-2028 | 343.952 | 0,05 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|-------------------------------------|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Zyklische Konsumgüter Forts. | | | |
| 183.000 | Papa John's International Inc '144A' 3.875% 15-Sep-2029 | 182.355 | 0,03 |
| 180.000 | Park River Holdings Inc '144A' 5.625% 01-Feb-2029 | 172.153 | 0,02 |
| 135.000 | Park River Holdings Inc '144A' 6.750% 01-Aug-2029 | 132.448 | 0,02 |
| 285.000 | Party City Holdings Inc '144A' 8.750% 15-Feb-2026 | 294.559 | 0,04 |
| 375.000 | Peninsula Pacific Entertainment LLC / Peninsula Pacific Entertainment Finance In '144A' 8.500% 15-Nov-2027 | 405.546 | 0,06 |
| 304.000 | Penske Automotive Group Inc 3.750% 15-Jun-2029 | 301.776 | 0,04 |
| 695.000 | PetSmart Inc / PetSmart Finance Corp '144A' 4.750% 15-Feb-2028 | 714.505 | 0,10 |
| 570.000 | PetSmart Inc / PetSmart Finance Corp '144A' 7.750% 15-Feb-2029 | 620.169 | 0,09 |
| 218.000 | Picasso Finance Sub Inc '144A' 6.125% 15-Jun-2025 | 228.031 | 0,03 |
| 214.000 | PM General Purchaser LLC '144A' 9.500% 01-Oct-2028 | 217.121 | 0,03 |
| 115.000 | Premier Entertainment Sub LLC / Premier Entertainment Finance Corp '144A' 5.625% 01-Sep-2029 | 114.263 | 0,02 |
| 350.000 | Premier Entertainment Sub LLC / Premier Entertainment Finance Corp '144A' 5.875% 01-Sep-2031 | 351.750 | 0,05 |
| 415.000 | QVC Inc 4.375% 15-Mar-2023 | 427.938 | 0,06 |
| 550.000 | QVC Inc 4.375% 01-Sep-2028 | 546.807 | 0,08 |
| 375.000 | QVC Inc 4.450% 15-Feb-2025 | 396.021 | 0,05 |
| 365.000 | QVC Inc 4.750% 15-Feb-2027 | 375.454 | 0,05 |
| 375.000 | QVC Inc 4.850% 01-Apr-2024 | 400.684 | 0,06 |
| 545.000 | QVC Inc 5.450% 15-Aug-2034 | 540.316 | 0,07 |
| 125.000 | QVC Inc 5.950% 15-Mar-2043 | 124.707 | 0,02 |
| 520.000 | Raptor Acquisition Corp / Raptor Co-Issuer LLC '144A' 4.875% 01-Nov-2026 | 525.850 | 0,07 |
| 300.000 | Real Hero Merger Sub 2 Inc '144A' 6.250% 01-Feb-2029 | 299.954 | 0,04 |
| 140.000 | Resideo Funding Inc '144A' 4.000% 01-Sep-2029 | 137.550 | 0,02 |
| 700.000 | Resorts World Las Vegas LLC / RWLV Capital Inc '144A' 4.625% 06-Apr-2031 | 696.331 | 0,10 |
| 600.000 | Resorts World Las Vegas LLC / RWLV Capital Inc 'REGGS' 4.625% 16-Apr-2029 | 605.316 | 0,08 |
| 300.000 | Rite Aid Corp 7.700% 15-Feb-2027 | 274.437 | 0,04 |
| 98.000 | Rite Aid Corp '144A' 7.500% 01-Jul-2025 | 100.846 | 0,01 |
| 200.000 | Rite Aid Corp '144A' 8.000% 15-Nov-2026 | 204.233 | 0,03 |
| 320.000 | Royal Caribbean Cruises Ltd 5.250% 15-Nov-2022 | 324.814 | 0,04 |
| 635.000 | Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 4.250% 01-Jul-2026 | 615.753 | 0,08 |
| 375.000 | Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 5.500% 31-Aug-2026 | 381.720 | 0,05 |
| 875.000 | Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 5.500% 01-Apr-2028 | 886.620 | 0,12 |
| 419.000 | Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 9.125% 15-Jun-2023 | 443.618 | 0,06 |
| 375.000 | Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 10.875% 01-Jun-2023 | 410.162 | 0,06 |
| 488.000 | Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 11.500% 01-Jun-2025 | 547.177 | 0,08 |
| 110.000 | Sally Holdings LLC / Sally Capital Inc 5.625% 01-Dec-2025 | 112.544 | 0,02 |
| 150.000 | Sally Holdings LLC / Sally Capital Inc '144A' 8.750% 30-Apr-2025 | 159.900 | 0,02 |
| 472.000 | Scientific Games International Inc '144A' 5.000% 15-Oct-2025 | 486.549 | 0,07 |
| 325.000 | Scientific Games International Inc '144A' 7.000% 15-May-2028 | 346.665 | 0,05 |
| 95.000 | Scientific Games International Inc '144A' 7.250% 15-Nov-2029 | 106.082 | 0,01 |
| 815.000 | Scientific Games International Inc '144A' 8.250% 15-Mar-2026 | 858.827 | 0,12 |
| 575.000 | Scientific Games International Inc '144A' 8.625% 01-Jul-2025 | 614.502 | 0,08 |
| 198.000 | Scotts Miracle-Gro Co/The 4.500% 15-Oct-2029 | 206.699 | 0,03 |
| 184.000 | Scotts Miracle-Gro Co/The 5.250% 15-Dec-2026 | 189.680 | 0,03 |
| 300.000 | Scotts Miracle-Gro Co/The '144A' 4.000% 01-Apr-2031 | 296.693 | 0,04 |
| 200.000 | Scotts Miracle-Gro Co/The '144A' 4.375% 01-Feb-2032 | 199.803 | 0,03 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|-------------------------------------|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Zyklische Konsumgüter Forts. | | | |
| 190.000 | SeaWorld Parks & Entertainment Inc '144A' 5.250% 15-Aug-2029 | 193.754 | 0,03 |
| 200.000 | SeaWorld Parks & Entertainment Inc '144A' 8.750% 01-May-2025 | 212.200 | 0,03 |
| 265.000 | Shea Homes LP / Shea Homes Funding Corp '144A' 4.750% 15-Feb-2028 | 271.368 | 0,04 |
| 125.000 | Shea Homes LP / Shea Homes Funding Corp '144A' 4.750% 01-Apr-2029 | 127.566 | 0,02 |
| 540.000 | Six Flags Entertainment Corp '144A' 4.875% 31-Jul-2024 | 546.016 | 0,08 |
| 40.000 | Six Flags Entertainment Corp '144A' 5.500% 15-Apr-2027 | 41.440 | 0,01 |
| 190.000 | Six Flags Theme Parks Inc '144A' 7.000% 01-Jul-2025 | 203.122 | 0,03 |
| 255.000 | Specialty Building Products Holdings LLC / SBP Finance Corp '144A' 6.375% 30-Sep-2026 | 267.517 | 0,04 |
| 200.000 | Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd '144A' 8.000% 20-Sep-2025 | 220.611 | 0,03 |
| 250.000 | SRS Distribution Inc '144A' 4.625% 01-Jul-2028 | 251.320 | 0,03 |
| 330.000 | SRS Distribution Inc '144A' 6.000% 01-Dec-2029 | 332.166 | 0,05 |
| 215.000 | SRS Distribution Inc '144A' 6.125% 01-Jul-2029 | 217.455 | 0,03 |
| 933.000 | Staples Inc '144A' 7.500% 15-Apr-2026 | 959.870 | 0,13 |
| 375.000 | Staples Inc '144A' 10.750% 15-Apr-2027 | 353.828 | 0,05 |
| 255.000 | Station Casinos LLC '144A' 4.500% 15-Feb-2028 | 256.943 | 0,04 |
| 415.000 | Studio City Finance Ltd '144A' 5.000% 15-Jan-2029 | 372.074 | 0,05 |
| 120.000 | Studio City Finance Ltd '144A' 6.000% 15-Jul-2025 | 116.825 | 0,02 |
| 28.000 | Suburban Propane Partners LP/Suburban Energy Finance Corp 5.875% 01-Mar-2027 | 29.005 | 0,00 |
| 400.000 | Suburban Propane Partners LP/Suburban Energy Finance Corp '144A' 5.000% 01-Jun-2031 | 405.178 | 0,06 |
| 255.000 | Sugarhouse HSP Gaming Prop Mezz LP / Sugarhouse HSP Gaming Finance Corp '144A' 5.875% 15-May-2025 | 253.990 | 0,04 |
| 275.000 | Superior Plus LP / Superior General Partner Inc '144A' 4.500% 15-Mar-2029 | 283.063 | 0,04 |
| 290.000 | SWF Escrow Issuer Corp '144A' 6.500% 01-Oct-2029 | 279.157 | 0,04 |
| 40.000 | Taylor Morrison Communities Inc / Taylor Morrison Holdings II Inc '144A' 5.625% 01-Mar-2024 | 42.640 | 0,01 |
| 257.000 | Taylor Morrison Communities Inc / Taylor Morrison Holdings II Inc '144A' 5.875% 15-Apr-2023 | 269.475 | 0,04 |
| 175.000 | Taylor Morrison Communities Inc '144A' 5.125% 01-Aug-2030 | 192.748 | 0,03 |
| 200.000 | Taylor Morrison Communities Inc '144A' 5.750% 15-Jan-2028 | 223.776 | 0,03 |
| 200.000 | Taylor Morrison Communities Inc '144A' 5.875% 15-Jun-2027 | 224.200 | 0,03 |
| 475.000 | Taylor Morrison Communities Inc '144A' 6.625% 15-Jul-2027 | 501.427 | 0,07 |
| 226.000 | Tempur Sealy International Inc '144A' 4.000% 15-Apr-2029 | 230.279 | 0,03 |
| 150.000 | Tenneco Inc '144A' 7.875% 15-Jan-2029 | 162.211 | 0,02 |
| 225.000 | Thor Industries Inc '144A' 4.000% 15-Oct-2029 | 223.031 | 0,03 |
| 525.000 | TKC Holdings Inc '144A' 6.875% 15-May-2028 | 537.374 | 0,07 |
| 370.000 | TKC Holdings Inc '144A' 10.500% 15-May-2029 | 400.125 | 0,06 |
| 30.000 | Toll Brothers Finance Corp 3.800% 01-Nov-2029 | 32.293 | 0,00 |
| 130.000 | Toll Brothers Finance Corp 4.875% 15-Mar-2027 | 145.568 | 0,02 |
| 343.000 | Travel + Leisure Co 3.900% 01-Mar-2023 | 348.672 | 0,05 |
| 305.000 | Travel + Leisure Co 5.650% 01-Apr-2024 | 324.367 | 0,04 |
| 110.000 | Travel + Leisure Co 6.000% 01-Apr-2027 | 119.957 | 0,02 |
| 127.000 | Travel + Leisure Co 6.600% 01-Oct-2025 | 141.415 | 0,02 |
| 165.000 | Travel + Leisure Co '144A' 4.625% 01-Mar-2030 | 166.319 | 0,02 |
| 330.000 | Travel + Leisure Co '144A' 6.625% 31-Jul-2026 | 366.313 | 0,05 |
| 87.000 | Tri Pointe Homes Inc 5.250% 01-Jun-2027 | 93.503 | 0,01 |
| 189.000 | Tri Pointe Homes Inc 5.700% 15-Jun-2028 | 208.161 | 0,03 |
| 41.741 | UAL 2007-1 Pass Through Trust 6.636% 02-Jul-2022 | 42.680 | 0,01 |
| 123.000 | Under Armour Inc 3.250% 15-Jun-2026 | 126.998 | 0,02 |
| 215.000 | United Airlines Holdings Inc 4.250% 01-Oct-2022 | 218.492 | 0,03 |
| 625.000 | United Airlines Inc '144A' 4.375% 15-Apr-2026 | 652.531 | 0,09 |
| 490.000 | United Airlines Inc '144A' 4.625% 15-Apr-2029 | 506.332 | 0,07 |
| 100.000 | Univar Solutions USA Inc/Washington '144A' 5.125% 01-Dec-2027 | 104.488 | 0,01 |
| 274.800 | US Airways 2012-2 Class A Pass Through Trust 4.625% 03-Jun-2025 | 274.013 | 0,04 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Nettovermögen % | Summe |
|--|---|----------------------------|-----------------|-------|
| Anleihen Forts. | | | | |
| Zyklische Konsumgüter Forts. | | | | |
| 365.391 | US Airways 2013-1 Class A Pass Through Trust 3.950% 15-Nov-2025 | 369.457 | 0,05 | |
| 160.000 | Vail Resorts Inc '144A' 6.250% 15-May-2025 | 166.560 | 0,02 | |
| 300.000 | Victoria's Secret & Co '144A' 4.625% 15-Jul-2028 | 307.209 | 0,04 | |
| 190.000 | Viking Cruises Ltd '144A' 5.875% 15-Sep-2027 | 181.108 | 0,02 | |
| 295.000 | Viking Cruises Ltd '144A' 6.250% 15-May-2025 | 292.357 | 0,04 | |
| 160.000 | Viking Cruises Ltd '144A' 7.000% 15-Feb-2029 | 160.687 | 0,02 | |
| 220.000 | Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd '144A' 5.625% 15-Feb-2029 | 220.034 | 0,03 | |
| 200.000 | Vista Outdoor Inc '144A' 4.500% 15-Mar-2029 | 201.553 | 0,03 | |
| 90.000 | VOC Escrow Ltd '144A' 5.000% 15-Feb-2028 | 89.231 | 0,01 | |
| 120.000 | Wheel Pros Inc '144A' 6.500% 15-May-2029 | 115.369 | 0,02 | |
| 240.000 | White Cap Buyer LLC '144A' 6.875% 15-Oct-2028 | 250.541 | 0,03 | |
| 140.000 | White Cap Parent LLC '144A' 8.250% 15-Mar-2026 | 143.844 | 0,02 | |
| 322.000 | William Carter Co/The '144A' 5.500% 15-May-2025 | 334.397 | 0,05 | |
| 93.000 | William Carter Co/The '144A' 5.625% 15-Mar-2027 | 96.232 | 0,01 | |
| 350.000 | Winnabago Industries Inc '144A' 6.250% 15-Jul-2028 | 375.286 | 0,05 | |
| 670.000 | WMG Acquisition Corp '144A' 3.750% 01-Dec-2029 | 669.414 | 0,09 | |
| 149.000 | Wolverine Escrow LLC '144A' 8.500% 15-Nov-2024 | 138.352 | 0,02 | |
| 323.000 | Wolverine Escrow LLC '144A' 9.000% 15-Nov-2026 | 307.210 | 0,04 | |
| 200.000 | Wolverine World Wide Inc '144A' 4.000% 15-Aug-2029 | 194.757 | 0,03 | |
| 435.000 | Wyndham Hotels & Resorts Inc '144A' 4.375% 15-Aug-2028 | 448.757 | 0,06 | |
| 230.000 | Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp '144A' 4.250% 30-May-2023 | 231.971 | 0,03 | |
| 400.000 | Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp '144A' 5.250% 15-May-2027 | 409.378 | 0,06 | |
| 895.000 | Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp '144A' 5.500% 01-Mar-2025 | 923.058 | 0,13 | |
| 310.000 | Wynn Macau Ltd '144A' 4.875% 01-Oct-2024 | 291.736 | 0,04 | |
| 275.000 | Wynn Macau Ltd '144A' 5.125% 15-Dec-2029 | 250.250 | 0,03 | |
| 380.000 | Wynn Macau Ltd '144A' 5.500% 15-Jan-2026 | 357.624 | 0,05 | |
| 360.000 | Wynn Macau Ltd '144A' 5.500% 01-Oct-2027 | 335.160 | 0,05 | |
| 400.000 | Wynn Macau Ltd '144A' 6.625% 26-Aug-2028 | 371.000 | 0,05 | |
| 200.000 | Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp '144A' 5.125% 01-Oct-2029 | 203.299 | 0,03 | |
| 280.000 | Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp '144A' 7.750% 15-Apr-2025 | 293.934 | 0,04 | |
| 390.000 | Yum! Brands Inc 3.625% 15-Mar-2031 | 389.138 | 0,05 | |
| 145.000 | Yum! Brands Inc 3.875% 01-Nov-2023 | 151.532 | 0,02 | |
| 216.000 | Yum! Brands Inc 4.625% 31-Jan-2032 | 229.918 | 0,03 | |
| 261.000 | Yum! Brands Inc 5.350% 01-Nov-2043 | 289.390 | 0,04 | |
| 405.000 | Yum! Brands Inc 6.875% 15-Nov-2037 | 514.437 | 0,07 | |
| 610.000 | Yum! Brands Inc '144A' 4.750% 15-Jan-2030 | 661.200 | 0,09 | |
| 230.000 | Yum! Brands Inc '144A' 7.750% 01-Apr-2025 | 242.635 | 0,03 | |
| 815.000 | ZF North America Capital Inc '144A' 4.750% 29-Apr-2025 | 875.008 | 0,12 | |
| Nicht-zyklische Konsumgüter - 121.724.948 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 118.205.967) | | 121.724.948 | 16,75 | |
| 165.000 | 180 Medical Inc '144A' 3.875% 15-Oct-2029 | 167.299 | 0,02 | |
| 270.000 | Acadia Healthcare Co Inc '144A' 5.000% 15-Apr-2029 | 277.835 | 0,04 | |
| 350.000 | Acadia Healthcare Co Inc '144A' 5.500% 01-Jul-2028 | 368.389 | 0,05 | |
| 60.000 | ACCO Brands Corp '144A' 4.250% 15-Mar-2029 | 59.641 | 0,01 | |
| 65.000 | AdaptHealth LLC '144A' 5.125% 01-Mar-2030 | 66.236 | 0,01 | |
| 505.000 | AdaptHealth LLC '144A' 6.125% 01-Aug-2028 | 536.045 | 0,07 | |
| 175.000 | ADT Security Corp/The 4.125% 15-Jun-2023 | 181.947 | 0,02 | |
| 390.000 | ADT Security Corp/The '144A' 4.125% 01-Aug-2029 | 384.854 | 0,05 | |
| 200.000 | ADT Security Corp/The '144A' 4.875% 15-Jul-2032 | 204.500 | 0,03 | |
| 400.000 | Adtalem Global Education Inc '144A' 5.500% 01-Mar-2028 | 391.564 | 0,05 | |
| 384.000 | Ahern Rentals Inc '144A' 7.375% 15-May-2023 | 367.200 | 0,05 | |
| 155.000 | AHP Health Partners Inc '144A' 5.750% 15-Jul-2029 | 153.869 | 0,02 | |
| 200.000 | Air Methods Corp '144A' 8.000% 15-May-2025 | 171.458 | 0,02 | |
| 160.000 | Akumin Escrow Inc '144A' 7.500% 01-Aug-2028 | 150.270 | 0,02 | |
| 200.000 | Akumin Inc '144A' 7.000% 01-Nov-2025 | 190.548 | 0,03 | |
| 300.000 | Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A' 3.250% 15-Mar-2026 | 305.942 | 0,04 | |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Nettovermögen % | Summe |
|---|--|----------------------------|-----------------|-------|
| Anleihen Forts. | | | | |
| Nicht-zyklische Konsumgüter Forts. | | | | |
| 560.000 | Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A' 3.500% 15-Mar-2029 | 562.066 | 0,08 | |
| 730.000 | Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A' 4.625% 15-Jan-2027 | 766.916 | 0,11 | |
| 369.000 | Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A' 4.875% 15-Feb-2030 | 398.985 | 0,05 | |
| 325.000 | Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A' 5.875% 15-Feb-2028 | 344.949 | 0,05 | |
| 300.000 | Albion Financing 1 SARL / Aggreko Holdings Inc '144A' 6.125% 15-Oct-2026 | 303.309 | 0,04 | |
| 212.000 | Albion Financing 2SARL '144A' 8.750% 15-Apr-2027 | 215.710 | 0,03 | |
| 365.000 | Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp '144A' 6.000% 01-Jun-2029 | 355.515 | 0,05 | |
| 743.000 | Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp '144A' 6.625% 15-Jul-2026 | 779.838 | 0,11 | |
| 446.000 | Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp '144A' 9.750% 15-Jul-2027 | 477.037 | 0,07 | |
| 480.000 | Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl '144A' 4.625% 01-Jun-2028 | 480.540 | 0,07 | |
| 154.000 | Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl '144A' 4.625% 01-Jun-2028 | 151.382 | 0,02 | |
| 320.000 | AMN Healthcare Inc '144A' 4.000% 15-Apr-2029 | 324.859 | 0,04 | |
| 210.000 | AMN Healthcare Inc '144A' 4.625% 01-Oct-2027 | 217.875 | 0,03 | |
| 350.000 | API Group DE Inc '144A' 4.125% 15-Jul-2029 | 352.266 | 0,05 | |
| 250.000 | Aptim Corp '144A' 7.750% 15-Jun-2025 | 223.125 | 0,03 | |
| 400.000 | APX Group Inc '144A' 5.750% 15-Jul-2029 | 394.564 | 0,05 | |
| 215.000 | APX Group Inc '144A' 6.750% 15-Feb-2027 | 225.985 | 0,03 | |
| 605.000 | ASGN Inc '144A' 4.625% 15-May-2028 | 627.340 | 0,09 | |
| 400.000 | Avantor Funding Inc '144A' 3.875% 01-Nov-2029 | 404.938 | 0,06 | |
| 775.000 | Avantor Funding Inc '144A' 4.625% 15-Jul-2028 | 809.228 | 0,11 | |
| 348.000 | Avon Products Inc 6.500% 15-Mar-2023 | 365.313 | 0,05 | |
| 89.000 | Avon Products Inc 8.450% 15-Mar-2043 | 109.595 | 0,01 | |
| 386.000 | B&G Foods Inc 5.250% 15-Sep-2027 | 399.454 | 0,05 | |
| 755.000 | Bausch Health Americas Inc '144A' 8.500% 31-Jan-2027 | 793.841 | 0,11 | |
| 1.020.000 | Bausch Health Americas Inc '144A' 9.250% 01-Apr-2026 | 1.078.635 | 0,15 | |
| 445.000 | Bausch Health Cos Inc '144A' 4.875% 01-Jun-2028 | 455.818 | 0,06 | |
| 510.000 | Bausch Health Cos Inc '144A' 5.000% 30-Jan-2028 | 470.003 | 0,06 | |
| 565.000 | Bausch Health Cos Inc '144A' 5.000% 15-Feb-2029 | 499.497 | 0,07 | |
| 605.000 | Bausch Health Cos Inc '144A' 5.250% 30-Jan-2030 | 533.338 | 0,07 | |
| 600.000 | Bausch Health Cos Inc '144A' 5.250% 15-Feb-2031 | 528.180 | 0,07 | |
| 710.000 | Bausch Health Cos Inc '144A' 5.500% 01-Nov-2025 | 722.436 | 0,10 | |
| 80.000 | Bausch Health Cos Inc '144A' 5.750% 15-Aug-2027 | 83.120 | 0,01 | |
| 1.042.000 | Bausch Health Cos Inc '144A' 6.125% 15-Apr-2025 | 1.064.142 | 0,15 | |
| 700.000 | Bausch Health Cos Inc '144A' 6.250% 15-Feb-2029 | 666.316 | 0,09 | |
| 260.000 | Bausch Health Cos Inc '144A' 7.000% 15-Jan-2028 | 259.068 | 0,04 | |
| 480.000 | Bausch Health Cos Inc '144A' 7.250% 30-May-2029 | 475.874 | 0,07 | |
| 806.000 | Bausch Health Cos Inc '144A' 9.000% 15-Dec-2025 | 849.911 | 0,12 | |
| 411.000 | Block Inc '144A' 2.750% 01-Jun-2026 | 412.030 | 0,06 | |
| 440.000 | Block Inc '144A' 3.500% 01-Jun-2031 | 451.761 | 0,06 | |
| 70.000 | Brink's Co/The '144A' 4.625% 15-Oct-2027 | 72.179 | 0,01 | |
| 235.000 | Brink's Co/The '144A' 5.500% 15-Jul-2025 | 244.635 | 0,03 | |
| 220.000 | Cano Health LLC '144A' 6.250% 01-Oct-2028 | 220.315 | 0,03 | |
| 145.000 | Carriage Services Inc '144A' 4.250% 15-May-2029 | 144.495 | 0,02 | |
| 245.000 | Catalent Pharma Solutions Inc '144A' 3.125% 15-Feb-2029 | 242.020 | 0,03 | |
| 300.000 | Catalent Pharma Solutions Inc '144A' 3.500% 01-Apr-2030 | 297.694 | 0,04 | |
| 975.000 | Centene Corp 2.450% 15-Jul-2028 | 961.876 | 0,13 | |
| 1.300.000 | Centene Corp 2.500% 01-Mar-2031 | 1.267.734 | 0,17 | |
| 426.000 | Centene Corp 2.625% 01-Aug-2031 | 418.189 | 0,06 | |
| 1.210.000 | Centene Corp 3.000% 15-Oct-2030 | 1.232.070 | 0,17 | |
| 597.000 | Centene Corp 3.375% 15-Feb-2030 | 610.059 | 0,08 | |
| 2.085.000 | Centene Corp 4.625% 15-Dec-2029 | 2.252.196 | 0,31 | |
| 140.000 | Central Garden & Pet Co 4.125% 15-Oct-2030 | 141.432 | 0,02 | |
| 109.000 | Central Garden & Pet Co 5.125% 01-Feb-2028 | 114.208 | 0,02 | |
| 165.000 | Central Garden & Pet Co '144A' 4.125% 30-Apr-2031 | 166.068 | 0,02 | |
| 845.000 | Charles River Laboratories International Inc '144A' 3.750% 15-Mar-2029 | 854.663 | 0,12 | |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|---|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Nicht-zyklische Konsumgüter Forts. | | | |
| 200.000 | Charles River Laboratories International Inc '144A' 4.000% 15-Mar-2031 | 205.209 | 0,03 |
| 540.000 | Charles River Laboratories International Inc '144A' 4.250% 01-May-2028 | 562.375 | 0,08 |
| 220.000 | Cheplapharm Arzneimittel GmbH '144A' 5.500% 15-Jan-2028 | 223.062 | 0,03 |
| 390.000 | Chobani LLC / Chobani Finance Corp Inc '144A' 7.500% 15-Apr-2025 | 401.593 | 0,06 |
| 200.000 | CHS/Community Health Systems Inc '144A' 4.750% 15-Feb-2031 | 202.074 | 0,03 |
| 455.000 | CHS/Community Health Systems Inc '144A' 5.625% 15-Mar-2027 | 482.095 | 0,07 |
| 145.000 | CHS/Community Health Systems Inc '144A' 6.000% 15-Jan-2029 | 154.835 | 0,02 |
| 600.000 | CHS/Community Health Systems Inc '144A' 6.125% 01-Apr-2030 | 594.501 | 0,08 |
| 300.000 | CHS/Community Health Systems Inc '144A' 6.625% 15-Feb-2025 | 310.840 | 0,04 |
| 165.000 | CHS/Community Health Systems Inc '144A' 6.875% 01-Apr-2028 | 160.283 | 0,02 |
| 700.000 | CHS/Community Health Systems Inc '144A' 6.875% 15-Apr-2029 | 714.196 | 0,10 |
| 465.000 | CHS/Community Health Systems Inc '144A' 8.000% 15-Mar-2026 | 489.338 | 0,07 |
| 90.000 | CHS/Community Health Systems Inc '144A' 8.000% 15-Dec-2027 | 97.325 | 0,01 |
| 450.000 | Cimpress Plc '144A' 7.000% 15-Jun-2026 | 467.906 | 0,06 |
| 138.000 | Cooke Omega Investments Inc / Alpha VesselCo Holdings Inc '144A' 8.500% 15-Dec-2022 | 140.566 | 0,02 |
| 254.000 | CoreCivic Inc 4.625% 01-May-2023 | 258.846 | 0,04 |
| 483.000 | CoreCivic Inc 4.750% 15-Oct-2027 | 437.757 | 0,06 |
| 545.000 | CoreCivic Inc 8.250% 15-Apr-2026 | 570.302 | 0,08 |
| 450.000 | CoreLogic Inc '144A' 4.500% 01-May-2028 | 448.972 | 0,06 |
| 765.000 | Coty Inc '144A' 5.000% 15-Apr-2026 | 789.044 | 0,11 |
| 549.000 | Coty Inc '144A' 6.500% 15-Apr-2026 | 566.859 | 0,08 |
| 75.000 | Coty Inc/HFC Prestige Products Inc/HFC Prestige International US LLC '144A' 4.750% 15-Jan-2029 | 76.333 | 0,01 |
| 265.000 | CPI CG Inc '144A' 8.625% 15-Mar-2026 | 280.578 | 0,04 |
| 114.000 | Darling Ingredients Inc '144A' 5.250% 15-Apr-2027 | 117.819 | 0,02 |
| 935.000 | DaVita Inc '144A' 3.750% 15-Feb-2031 | 910.980 | 0,13 |
| 1.620.000 | DaVita Inc '144A' 4.625% 01-Jun-2030 | 1.661.407 | 0,23 |
| 215.000 | Del Monte Foods Inc '144A' 11.875% 15-May-2025 | 239.821 | 0,03 |
| 80.000 | Deluxe Corp '144A' 8.000% 01-Jun-2029 | 83.714 | 0,01 |
| 200.000 | Edgewell Personal Care Co '144A' 4.125% 01-Apr-2029 | 201.795 | 0,03 |
| 215.000 | Edgewell Personal Care Co '144A' 5.500% 01-Jun-2028 | 228.427 | 0,03 |
| 394.000 | Elanco Animal Health Inc 5.900% 28-Aug-2028 | 457.584 | 0,06 |
| 365.000 | Encompass Health Corp 4.500% 01-Feb-2028 | 376.021 | 0,05 |
| 491.000 | Encompass Health Corp 4.625% 01-Apr-2031 | 500.336 | 0,07 |
| 330.000 | Encompass Health Corp 4.750% 01-Feb-2030 | 340.387 | 0,05 |
| 995.000 | Endo Dac / Endo Finance LLC / Endo Finco Inc '144A' 6.000% 30-Jun-2028 | 742.797 | 0,10 |
| 390.000 | Endo Dac / Endo Finance LLC / Endo Finco Inc '144A' 9.500% 31-Jul-2027 | 397.394 | 0,05 |
| 310.000 | Endo Luxembourg Finance Co I Sarl / Endo US Inc '144A' 6.125% 01-Apr-2029 | 304.412 | 0,04 |
| 620.000 | Envision Healthcare Corp '144A' 8.750% 15-Oct-2026 | 357.191 | 0,05 |
| 162.000 | FAGE International SA / FAGE USA Dairy Industry Inc '144A' 5.625% 15-Aug-2026 | 166.214 | 0,02 |
| 630.000 | Garda World Security Corp '144A' 4.625% 15-Feb-2027 | 627.568 | 0,09 |
| 300.000 | Garda World Security Corp '144A' 6.000% 01-Jun-2029 | 286.922 | 0,04 |
| 240.000 | Garda World Security Corp '144A' 9.500% 01-Nov-2027 | 259.104 | 0,04 |
| 120.000 | Gartner Inc '144A' 3.625% 15-Jun-2029 | 121.521 | 0,02 |
| 270.000 | Gartner Inc '144A' 3.750% 01-Oct-2030 | 276.435 | 0,04 |
| 250.000 | Global Medical Response Inc '144A' 6.500% 01-Oct-2025 | 253.153 | 0,03 |
| 535.000 | Graham Holdings Co '144A' 5.750% 01-Jun-2026 | 556.266 | 0,08 |
| 200.000 | Grifols Escrow Issuer SA '144A' 4.750% 15-Oct-2028 | 204.374 | 0,03 |
| 222.000 | Hadrian Merger Sub Inc '144A' 8.500% 01-May-2026 | 229.431 | 0,03 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|---|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Nicht-zyklische Konsumgüter Forts. | | | |
| 1.330.000 | HCA Inc 3.500% 01-Sep-2030 | 1.408.304 | 0,19 |
| 1.425.000 | HCA Inc 5.375% 01-Feb-2025 | 1.567.927 | 0,22 |
| 450.000 | HCA Inc 5.375% 01-Sep-2026 | 506.273 | 0,07 |
| 495.000 | HCA Inc 5.625% 01-Sep-2028 | 579.234 | 0,08 |
| 660.000 | HCA Inc 5.875% 01-May-2023 | 699.610 | 0,10 |
| 840.000 | HCA Inc 5.875% 15-Feb-2026 | 949.227 | 0,13 |
| 385.000 | HCA Inc 5.875% 01-Feb-2029 | 459.367 | 0,06 |
| 45.000 | HCA Inc 7.050% 01-Dec-2027 | 55.464 | 0,01 |
| 100.000 | HCA Inc 7.500% 06-Nov-2033 | 144.208 | 0,02 |
| 420.000 | HCA Inc 7.690% 15-Jun-2025 | 496.687 | 0,07 |
| 400.000 | HCA Inc 8.360% 15-Apr-2024 | 458.334 | 0,06 |
| 65.000 | HealthEquity Inc '144A' 4.500% 01-Oct-2029 | 64.431 | 0,01 |
| 405.000 | Herbalife Nutrition Ltd / HLF Financing Inc '144A' 7.875% 01-Sep-2025 | 430.740 | 0,06 |
| 650.000 | Herc Holdings Inc '144A' 5.500% 15-Jul-2027 | 676.783 | 0,09 |
| 310.000 | Hertz Corp/The '144A' 4.625% 01-Dec-2026 | 312.351 | 0,04 |
| 250.000 | H-Food Holdings LLC / Hearstside Finance Co Inc '144A' 8.500% 01-Jun-2026 | 250.260 | 0,03 |
| 215.000 | Hill-Rom Holdings Inc '144A' 4.375% 15-Sep-2027 | 224.809 | 0,03 |
| 290.000 | HLF Financing Sarl LLC / Herbalife International Inc '144A' 4.875% 01-Jun-2029 | 284.969 | 0,04 |
| 340.000 | Hologic Inc '144A' 3.250% 15-Feb-2029 | 340.525 | 0,05 |
| 495.000 | Hologic Inc '144A' 4.625% 01-Feb-2028 | 521.285 | 0,07 |
| 500.000 | Horizon Therapeutics USA Inc '144A' 5.500% 01-Aug-2027 | 525.875 | 0,07 |
| 310.000 | IHS Markit Ltd 4.750% 01-Aug-2028 | 360.420 | 0,05 |
| 200.000 | Ingles Markets Inc '144A' 4.000% 15-Jun-2031 | 201.787 | 0,03 |
| 450.000 | IQVIA Inc '144A' 5.000% 15-May-2027 | 466.358 | 0,06 |
| 815.000 | Jazz Securities DAC '144A' 4.375% 15-Jan-2029 | 845.294 | 0,12 |
| 51.000 | KeHE Distributors LLC / KeHE Finance Corp '144A' 8.625% 15-Oct-2026 | 54.812 | 0,01 |
| 175.000 | Korn Ferry '144A' 4.625% 15-Dec-2027 | 180.501 | 0,02 |
| 1.073.000 | Kraft Heinz Foods Co 3.000% 01-Jun-2026 | 1.123.919 | 0,15 |
| 300.000 | Kraft Heinz Foods Co 3.750% 01-Apr-2030 | 324.435 | 0,04 |
| 550.000 | Kraft Heinz Foods Co 3.875% 15-May-2027 | 595.094 | 0,08 |
| 890.000 | Kraft Heinz Foods Co 4.250% 01-Mar-2031 | 1.014.095 | 0,14 |
| 1.459.000 | Kraft Heinz Foods Co 4.375% 01-Jun-2046 | 1.714.624 | 0,24 |
| 100.000 | Kraft Heinz Foods Co 4.625% 01-Oct-2039 | 117.601 | 0,02 |
| 633.000 | Kraft Heinz Foods Co 4.875% 01-Oct-2049 | 797.872 | 0,11 |
| 300.000 | Kraft Heinz Foods Co 5.000% 15-Jul-2035 | 367.788 | 0,05 |
| 800.000 | Kraft Heinz Foods Co 5.000% 04-Jun-2042 | 996.970 | 0,14 |
| 894.000 | Kraft Heinz Foods Co 5.200% 15-Jul-2045 | 1.140.845 | 0,16 |
| 380.000 | Kraft Heinz Foods Co 5.500% 01-Jun-2050 | 517.297 | 0,07 |
| 90.000 | Kraft Heinz Foods Co 6.375% 15-Jul-2028 | 111.875 | 0,02 |
| 250.000 | Kraft Heinz Foods Co 6.500% 09-Feb-2040 | 356.141 | 0,05 |
| 495.000 | Kraft Heinz Foods Co 6.875% 26-Jan-2039 | 728.647 | 0,10 |
| 300.000 | Kraft Heinz Foods Co '144A' 7.125% 01-Aug-2039 | 457.250 | 0,06 |
| 200.000 | Kronos Acquisition Holdings Inc / KIK Custom Products Inc '144A' 5.000% 31-Dec-2026 | 197.783 | 0,03 |
| 295.000 | Kronos Acquisition Holdings Inc / KIK Custom Products Inc '144A' 7.000% 31-Dec-2027 | 278.536 | 0,04 |
| 500.000 | Lamb Weston Holdings Inc '144A' 4.125% 31-Jan-2030 | 513.960 | 0,07 |
| 100.000 | Lamb Weston Holdings Inc '144A' 4.375% 31-Jan-2032 | 103.294 | 0,01 |
| 250.000 | Lamb Weston Holdings Inc '144A' 4.875% 15-May-2028 | 270.981 | 0,04 |
| 160.000 | Lannett Co Inc '144A' 7.750% 15-Apr-2026 | 123.953 | 0,02 |
| 140.000 | Legacy LifePoint Health LLC '144A' 4.375% 15-Feb-2027 | 141.200 | 0,02 |
| 250.000 | Legacy LifePoint Health LLC '144A' 6.750% 15-Apr-2025 | 260.879 | 0,04 |
| 70.000 | Legends Hospitality Holding Co LLC / Legends Hospitality Co-Issuer Inc '144A' 5.000% 01-Feb-2026 | 70.443 | 0,01 |
| 245.000 | LifePoint Health Inc '144A' 5.375% 15-Jan-2029 | 244.128 | 0,03 |
| 90.000 | Magellan Health Inc 4.900% 22-Sep-2024 | 97.519 | 0,01 |
| 432.000 | MEDNAX Inc '144A' 6.250% 15-Jan-2027 | 452.503 | 0,06 |
| 180.000 | Metis Merger Sub LLC '144A' 6.500% 15-May-2029 | 177.047 | 0,02 |
| 182.000 | ModivCare Escrow Issuer Inc '144A' 5.000% 01-Oct-2029 | 186.146 | 0,03 |
| 300.000 | Molina Healthcare Inc '144A' 3.875% 15-Nov-2030 | 311.681 | 0,04 |
| 300.000 | Molina Healthcare Inc '144A' 3.875% 15-May-2032 | 302.363 | 0,04 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|---|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Nicht-zyklische Konsumgüter Forts. | | | |
| 389.000 | Molina Healthcare Inc '144A' 4.375% 15-Jun-2028 | 401.333 | 0,05 |
| 2.270.000 | Mozart Debt Merger Sub Inc '144A' 3.875% 01-Apr-2029 | 2.266.527 | 0,31 |
| 850.000 | Mozart Debt Merger Sub Inc '144A' 5.250% 01-Oct-2029 | 863.362 | 0,12 |
| 600.000 | MPH Acquisition Holdings LLC '144A' 5.500% 01-Sep-2028 | 609.159 | 0,08 |
| 540.000 | MPH Acquisition Holdings LLC '144A' 5.750% 01-Nov-2028 | 514.358 | 0,07 |
| 45.000 | Nathan's Famous Inc '144A' 6.625% 01-Nov-2025 | 46.089 | 0,01 |
| 345.000 | NESCO Holdings II Inc '144A' 5.500% 15-Apr-2029 | 356.825 | 0,05 |
| 85.000 | Nielsen Co Luxembourg SARL/The '144A' 5.000% 01-Feb-2025 | 86.445 | 0,01 |
| 280.000 | Nielsen Finance LLC / Nielsen Finance Co '144A' 4.500% 15-Jul-2029 | 275.871 | 0,04 |
| 300.000 | Nielsen Finance LLC / Nielsen Finance Co '144A' 4.750% 15-Jul-2031 | 296.705 | 0,04 |
| 435.000 | Nielsen Finance LLC / Nielsen Finance Co '144A' 5.625% 01-Oct-2028 | 449.875 | 0,06 |
| 270.000 | Nielsen Finance LLC / Nielsen Finance Co '144A' 5.875% 01-Oct-2030 | 285.471 | 0,04 |
| 345.000 | North Queensland Export Terminal Pty Ltd '144A' 4.450% 15-Dec-2022 | 331.946 | 0,05 |
| 1.130.000 | Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer BV '144A' 4.125% 30-Apr-2028 | 1.150.317 | 0,16 |
| 985.000 | Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer BV '144A' 5.125% 30-Apr-2031 | 1.030.778 | 0,14 |
| 120.000 | Oriflame Investment Holding Plc '144A' 5.125% 04-May-2026 | 111.236 | 0,02 |
| 243.000 | Ortho-Clinical Diagnostics Inc / Ortho-Clinical Diagnostics SA '144A' 7.250% 01-Feb-2028 | 261.582 | 0,04 |
| 268.000 | P&L Development LLC / PLD Finance Corp '144A' 7.750% 15-Nov-2025 | 268.614 | 0,04 |
| 335.000 | Par Pharmaceutical Inc '144A' 7.500% 01-Apr-2027 | 342.849 | 0,05 |
| 540.000 | Paysafe Finance Plc / Paysafe Holdings US Corp '144A' 4.000% 15-Jun-2029 | 501.638 | 0,07 |
| 500.000 | Performance Food Group Inc '144A' 4.250% 01-Aug-2029 | 496.840 | 0,07 |
| 400.000 | Performance Food Group Inc '144A' 5.500% 15-Oct-2027 | 417.906 | 0,06 |
| 100.000 | Performance Food Group Inc '144A' 6.875% 01-May-2025 | 104.741 | 0,01 |
| 150.000 | Perrigo Co Plc 4.000% 15-Nov-2023 | 154.536 | 0,02 |
| 1.110.000 | Perrigo Finance Unlimited Co 3.900% 15-Dec-2024 | 1.164.063 | 0,16 |
| 900.000 | Perrigo Finance Unlimited Co 3.900% 15-Jun-2030 | 913.556 | 0,13 |
| 1.050.000 | Perrigo Finance Unlimited Co 4.375% 15-Mar-2026 | 1.124.414 | 0,15 |
| 1.000.000 | Perrigo Finance Unlimited Co 4.900% 15-Dec-2044 | 998.261 | 0,14 |
| 170.000 | Pilgrim's Pride Corp '144A' 3.500% 01-Mar-2032 | 171.982 | 0,02 |
| 840.000 | Pilgrim's Pride Corp '144A' 4.250% 15-Apr-2031 | 883.298 | 0,12 |
| 449.000 | Pilgrim's Pride Corp '144A' 5.875% 30-Sep-2027 | 474.589 | 0,07 |
| 840.000 | Post Holdings Inc '144A' 4.500% 15-Sep-2031 | 835.061 | 0,11 |
| 975.000 | Post Holdings Inc '144A' 4.625% 15-Apr-2030 | 994.802 | 0,14 |
| 700.000 | Post Holdings Inc '144A' 5.500% 15-Dec-2029 | 736.337 | 0,10 |
| 371.000 | Post Holdings Inc '144A' 5.625% 15-Jan-2028 | 393.650 | 0,05 |
| 440.000 | Post Holdings Inc '144A' 5.750% 01-Mar-2027 | 454.830 | 0,06 |
| 300.000 | PRA Health Sciences Inc '144A' 2.875% 15-Jul-2026 | 300.692 | 0,04 |
| 560.000 | Prestige Brands Inc '144A' 3.750% 01-Apr-2031 | 544.048 | 0,07 |
| 200.000 | Prestige Brands Inc '144A' 5.125% 15-Jan-2028 | 208.536 | 0,03 |
| 300.000 | Prime Healthcare Services Inc '144A' 7.250% 01-Nov-2025 | 318.353 | 0,04 |
| 425.000 | Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc '144A' 3.375% 31-Aug-2027 | 410.450 | 0,06 |
| 460.000 | Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc '144A' 5.250% 15-Apr-2024 | 489.983 | 0,07 |
| 937.000 | Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc '144A' 5.750% 15-Apr-2026 | 1.007.116 | 0,14 |
| 500.000 | Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc '144A' 6.250% 15-Jan-2028 | 522.138 | 0,07 |
| 300.000 | PROG Holdings Inc '144A' 6.000% 15-Nov-2029 | 309.114 | 0,04 |
| 330.000 | Radiology Partners Inc '144A' 9.250% 01-Feb-2028 | 347.007 | 0,05 |
| 170.000 | Rent-A-Center Inc/TX '144A' 6.375% 15-Feb-2029 | 177.466 | 0,02 |
| 300.000 | Ritchie Bros Auctioneers Inc '144A' 5.375% 15-Jan-2025 | 303.360 | 0,04 |
| 330.000 | RP Escrow Issuer LLC '144A' 5.250% 15-Dec-2025 | 333.323 | 0,05 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|---|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Nicht-zyklische Konsumgüter Forts. | | | |
| 75.000 | RR Donnelley & Sons Co '144A' 6.125% 01-Nov-2026 | 82.500 | 0,01 |
| 445.000 | Sabre GLBL Inc '144A' 7.375% 01-Sep-2025 | 465.630 | 0,06 |
| 340.000 | Sabre GLBL Inc '144A' 9.250% 15-Apr-2025 | 384.591 | 0,05 |
| 255.000 | Safeway Inc 7.250% 01-Feb-2031 | 301.064 | 0,04 |
| 666.000 | Select Medical Corp '144A' 6.250% 15-Aug-2026 | 706.050 | 0,10 |
| 225.000 | Service Corp International/US 3.375% 15-Aug-2030 | 221.426 | 0,03 |
| 205.000 | Service Corp International/US 4.000% 15-May-2031 | 207.857 | 0,03 |
| 315.000 | Service Corp International/US 4.625% 15-Dec-2027 | 329.233 | 0,05 |
| 200.000 | Service Corp International/US 5.125% 01-Jun-2029 | 214.783 | 0,03 |
| 102.000 | Service Corp International/US 7.500% 01-Apr-2027 | 122.788 | 0,02 |
| 170.000 | Shift4 Payments LLC / Shift4 Payments Finance Sub Inc '144A' 4.625% 01-Nov-2026 | 176.333 | 0,02 |
| 305.000 | Sigma Holdco BV '144A' 7.875% 15-May-2026 | 294.261 | 0,04 |
| 150.000 | Signal Parent Inc '144A' 6.125% 01-Apr-2029 | 133.362 | 0,02 |
| 480.000 | Simmons Foods Inc/Simmons Prepared Foods Inc/Simmons Pet Food Inc/Simmons Feed '144A' 4.625% 01-Mar-2029 | 473.602 | 0,06 |
| 450.000 | Sotheby's '144A' 7.375% 15-Oct-2027 | 479.711 | 0,07 |
| 100.000 | Sotheby's/Bidfair Holdings Inc '144A' 5.875% 01-Jun-2029 | 102.142 | 0,01 |
| 116.000 | Spectrum Brands Inc '144A' 5.000% 01-Oct-2029 | 121.826 | 0,02 |
| 130.000 | StoneMor Inc '144A' 8.500% 15-May-2029 | 134.483 | 0,02 |
| 410.000 | Surgery Center Holdings Inc '144A' 10.000% 15-Apr-2027 | 436.035 | 0,06 |
| 65.000 | Syneos Health Inc '144A' 3.625% 15-Jan-2029 | 64.281 | 0,01 |
| 256.000 | Team Health Holdings Inc '144A' 6.375% 01-Feb-2025 | 241.226 | 0,03 |
| 355.000 | Teleflex Inc 4.625% 15-Nov-2027 | 369.709 | 0,05 |
| 250.000 | Teleflex Inc '144A' 4.250% 01-Jun-2028 | 257.906 | 0,04 |
| 400.000 | Tenet Healthcare Corp 4.625% 15-Jul-2024 | 405.502 | 0,06 |
| 833.000 | Tenet Healthcare Corp 6.750% 15-Jun-2023 | 891.277 | 0,12 |
| 105.000 | Tenet Healthcare Corp 6.875% 15-Nov-2031 | 120.116 | 0,02 |
| 625.000 | Tenet Healthcare Corp '144A' 4.250% 01-Jun-2029 | 635.794 | 0,09 |
| 297.000 | Tenet Healthcare Corp '144A' 4.375% 15-Jan-2030 | 301.296 | 0,04 |
| 150.000 | Tenet Healthcare Corp '144A' 4.625% 01-Sep-2024 | 153.536 | 0,02 |
| 165.000 | Tenet Healthcare Corp '144A' 4.625% 15-Jun-2028 | 169.776 | 0,02 |
| 1.200.000 | Tenet Healthcare Corp '144A' 4.875% 01-Jan-2026 | 1.234.398 | 0,17 |
| 388.000 | Tenet Healthcare Corp '144A' 5.125% 01-Nov-2027 | 404.603 | 0,06 |
| 1.345.000 | Tenet Healthcare Corp '144A' 6.125% 01-Oct-2028 | 1.423.353 | 0,20 |
| 145.000 | TreeHouse Foods Inc 4.000% 01-Sep-2028 | 139.420 | 0,02 |
| 140.000 | TriNet Group Inc '144A' 3.500% 01-Mar-2029 | 139.676 | 0,02 |
| 284.000 | Triton Water Holdings Inc '144A' 6.250% 01-Apr-2029 | 272.785 | 0,04 |
| 465.000 | Turning Point Brands Inc '144A' 5.625% 15-Feb-2026 | 466.641 | 0,06 |
| 266.000 | United Rentals North America Inc 3.750% 15-Jan-2032 | 268.244 | 0,04 |
| 615.000 | United Rentals North America Inc 3.875% 15-Feb-2031 | 625.283 | 0,09 |
| 355.000 | United Rentals North America Inc 4.000% 15-Jul-2030 | 365.272 | 0,05 |
| 680.000 | United Rentals North America Inc 4.875% 15-Jan-2028 | 715.768 | 0,10 |
| 270.000 | United Rentals North America Inc 5.250% 15-Jan-2030 | 292.657 | 0,04 |
| 389.000 | United Rentals North America Inc 5.500% 15-May-2027 | 405.023 | 0,06 |
| 210.000 | US Acute Care Solutions LLC '144A' 6.375% 01-Mar-2026 | 220.193 | 0,03 |
| 725.000 | US Foods Inc '144A' 4.750% 15-Feb-2029 | 737.963 | 0,10 |
| 105.000 | Varex Imaging Corp '144A' 7.875% 15-Oct-2027 | 116.796 | 0,02 |
| 670.000 | Vector Group Ltd '144A' 5.750% 01-Feb-2029 | 652.965 | 0,09 |
| 160.000 | Vector Group Ltd '144A' 10.500% 01-Nov-2026 | 165.966 | 0,02 |
| 230.000 | Vizient Inc '144A' 6.250% 15-May-2027 | 240.293 | 0,03 |
| 235.000 | WASH Multifamily Acquisition Inc '144A' 5.750% 15-Apr-2026 | 247.266 | 0,03 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % |
|--|--|----------------------------|-----------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Diversifizierte Unternehmen - 202.206 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.314.490) | | 202.206 | 0,03 |
| 195.000 | Stena International SA '144A' 5.750% 01-Mar-2024 | 202.206 | 0,03 |
| Energie - 89.893.903 | | | |
| (31. Dezember 2020: 91.349.765) | | 89.893.903 | 12,37 |
| 300.000 | Aethon United BR LP / Aethon United Finance Corp '144A' 8.250% 15-Feb-2026 | 322.608 | 0,04 |
| 235.000 | Alliance Resource Operating Partners LP / Alliance Resource Finance Corp '144A' 7.500% 01-May-2025 | 238.766 | 0,03 |
| 240.000 | Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp '144A' 5.375% 15-Jun-2029 | 251.204 | 0,03 |
| 350.000 | Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp '144A' 5.750% 01-Mar-2027 | 363.037 | 0,05 |
| 350.000 | Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp '144A' 5.750% 15-Jan-2028 | 367.531 | 0,05 |
| 335.000 | Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp '144A' 7.875% 15-May-2026 | 369.520 | 0,05 |
| 57.000 | Antero Resources Corp '144A' 7.625% 01-Feb-2029 | 63.360 | 0,01 |
| 220.000 | Antero Resources Corp '144A' 8.375% 15-Jul-2026 | 250.765 | 0,03 |
| 410.000 | Apache Corp 4.250% 15-Jan-2030 | 445.520 | 0,06 |
| 255.000 | Apache Corp 4.375% 15-Oct-2028 | 278.169 | 0,04 |
| 540.000 | Apache Corp 5.100% 01-Sep-2040 | 611.053 | 0,08 |
| 120.000 | Apache Corp 5.250% 01-Feb-2042 | 138.777 | 0,02 |
| 135.000 | Apache Corp 5.350% 01-Jul-2049 | 154.439 | 0,02 |
| 115.000 | Apache Corp 6.000% 15-Jan-2037 | 140.920 | 0,02 |
| 234.000 | Archrock Partners LP / Archrock Partners Finance Corp '144A' 6.250% 01-Apr-2028 | 244.329 | 0,03 |
| 211.000 | Archrock Partners LP / Archrock Partners Finance Corp '144A' 6.875% 01-Apr-2027 | 221.761 | 0,03 |
| 325.000 | Ascent Resources Utica Holdings LLC / ARU Finance Corp '144A' 7.000% 01-Nov-2026 | 329.864 | 0,05 |
| 335.000 | Atlantica Sustainable Infrastructure Plc '144A' 4.125% 15-Jun-2028 | 337.993 | 0,05 |
| 102.000 | Baytex Energy Corp '144A' 5.625% 01-Jun-2024 | 102.129 | 0,01 |
| 705.000 | Baytex Energy Corp '144A' 8.750% 01-Apr-2027 | 739.193 | 0,10 |
| 100.000 | Berry Petroleum Co LLC '144A' 7.000% 15-Feb-2026 | 99.104 | 0,01 |
| 145.000 | Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp '144A' 6.625% 15-Jul-2026 | 149.785 | 0,02 |
| 120.000 | Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp '144A' 7.625% 15-Dec-2025 | 127.325 | 0,02 |
| 520.000 | Bristow Group Inc '144A' 6.875% 01-Mar-2028 | 541.653 | 0,07 |
| 262.000 | Buckeye Partners LP 3.950% 01-Dec-2026 | 267.309 | 0,04 |
| 345.000 | Buckeye Partners LP 4.125% 01-Dec-2027 | 356.582 | 0,05 |
| 230.000 | Buckeye Partners LP 4.150% 01-Jul-2023 | 235.993 | 0,03 |
| 275.000 | Buckeye Partners LP 4.350% 15-Oct-2024 | 286.978 | 0,04 |
| 130.000 | Buckeye Partners LP 5.600% 15-Oct-2044 | 131.828 | 0,02 |
| 196.000 | Buckeye Partners LP 5.850% 15-Nov-2043 | 192.600 | 0,03 |
| 50.000 | Buckeye Partners LP 6.750% 15-Aug-2033 | 58.132 | 0,01 |
| 495.000 | Buckeye Partners LP '144A' 4.125% 01-Mar-2025 | 511.709 | 0,07 |
| 555.000 | Buckeye Partners LP '144A' 4.500% 01-Mar-2028 | 560.003 | 0,08 |
| 295.000 | Buckeye Partners LP FRN 6.375% 22-Jan-2078 | 261.317 | 0,04 |
| 300.000 | California Resources Corp '144A' 7.125% 01-Feb-2026 | 312.031 | 0,04 |
| 410.000 | Callon Petroleum Co 6.125% 01-Oct-2024 | 404.276 | 0,06 |
| 530.000 | Callon Petroleum Co 6.375% 01-Jul-2026 | 504.051 | 0,07 |
| 70.000 | Callon Petroleum Co 8.250% 15-Jul-2025 | 68.953 | 0,01 |
| 500.000 | Callon Petroleum Co '144A' 8.000% 01-Aug-2028 | 505.710 | 0,07 |
| 141.000 | Calumet Specialty Products Partners LP / Calumet Finance Corp 7.750% 15-Apr-2023 | 140.618 | 0,02 |
| 125.000 | Calumet Specialty Products Partners LP / Calumet Finance Corp '144A' 9.250% 15-Jul-2024 | 135.804 | 0,02 |
| 300.000 | Calumet Specialty Products Partners LP / Calumet Finance Corp '144A' 11.000% 15-Apr-2025 | 323.937 | 0,04 |
| 450.000 | Centennial Resource Production LLC '144A' 6.875% 01-Apr-2027 | 459.450 | 0,06 |
| 750.000 | Cheniere Energy Inc 4.625% 15-Oct-2028 | 794.344 | 0,11 |
| 1.070.000 | Cheniere Energy Partners LP 4.500% 01-Oct-2029 | 1.136.051 | 0,16 |
| 480.000 | Cheniere Energy Partners LP '144A' 3.250% 31-Jan-2032 | 485.760 | 0,07 |
| 564.063 | Chesapeake Energy Corp 0.000% 15-Apr-2022 | 11.281 | 0,00 |
| 150.000 | Chesapeake Energy Corp '144A' 5.500% 01-Feb-2026 | 158.053 | 0,02 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % |
|------------------------|--|----------------------------|-----------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Energie Forts. | | | |
| 335.000 | Civitas Resources Inc '144A' 5.000% 15-Oct-2026 | 338.735 | 0,05 |
| 140.000 | CNX Resources Corp '144A' 6.000% 15-Jan-2029 | 145.797 | 0,02 |
| 340.000 | CNX Resources Corp '144A' 7.250% 14-Mar-2027 | 360.988 | 0,05 |
| 300.000 | Colgate Energy Partners III LLC '144A' 5.875% 01-Jul-2029 | 309.426 | 0,04 |
| 355.000 | Comstock Resources Inc '144A' 5.875% 15-Jan-2030 | 364.463 | 0,05 |
| 310.000 | Comstock Resources Inc '144A' 6.750% 01-Mar-2029 | 336.344 | 0,05 |
| 436.000 | Comstock Resources Inc '144A' 7.500% 15-May-2025 | 451.576 | 0,06 |
| 235.000 | CONSOL Energy Inc '144A' 11.000% 15-Nov-2025 | 243.621 | 0,03 |
| 252.000 | Coronado Finance Pty Ltd '144A' 10.750% 15-May-2026 | 271.898 | 0,04 |
| 700.000 | CQP Holdco LP / BIP-V Chinook Holdco LLC '144A' 5.500% 15-Jun-2031 | 731.724 | 0,10 |
| 354.000 | Crestwood Midstream Partners LP / Crestwood Midstream Finance Corp 5.750% 01-Apr-2025 | 362.319 | 0,05 |
| 270.000 | Crestwood Midstream Partners LP / Crestwood Midstream Finance Corp '144A' 5.625% 01-May-2027 | 275.333 | 0,04 |
| 457.000 | Crestwood Midstream Partners LP / Crestwood Midstream Finance Corp '144A' 6.000% 01-Feb-2029 | 475.349 | 0,07 |
| 110.000 | CrownRock LP / CrownRock Finance Inc '144A' 5.000% 01-May-2029 | 114.292 | 0,02 |
| 870.000 | CrownRock LP / CrownRock Finance Inc '144A' 5.625% 15-Oct-2025 | 890.593 | 0,12 |
| 187.000 | CSI Compressco LP / CSI Compressco Finance Inc '144A' 7.500% 01-Apr-2025 | 190.740 | 0,03 |
| 240.000 | CVR Energy Inc '144A' 5.250% 15-Feb-2025 | 234.258 | 0,03 |
| 160.000 | CVR Energy Inc '144A' 5.750% 15-Feb-2028 | 155.906 | 0,02 |
| 95.000 | DCP Midstream Operating LP 3.875% 15-Mar-2023 | 97.526 | 0,01 |
| 185.000 | DCP Midstream Operating LP 5.125% 15-May-2029 | 209.312 | 0,03 |
| 235.000 | DCP Midstream Operating LP 5.375% 15-Jul-2025 | 257.010 | 0,04 |
| 170.000 | DCP Midstream Operating LP 5.600% 01-Apr-2044 | 211.721 | 0,03 |
| 175.000 | DCP Midstream Operating LP 5.625% 15-Jul-2027 | 197.925 | 0,03 |
| 74.000 | DCP Midstream Operating LP '144A' 6.450% 03-Nov-2036 | 96.944 | 0,01 |
| 200.000 | DCP Midstream Operating LP '144A' 6.750% 15-Sep-2037 | 267.805 | 0,04 |
| 170.000 | DCP Midstream Operating LP '144A' FRN 5.850% 21-May-2043 | 165.609 | 0,02 |
| 137.000 | Delek Logistics Partners LP / Delek Logistics Finance Corp 6.750% 15-May-2025 | 140.713 | 0,02 |
| 200.000 | Delek Logistics Partners LP / Delek Logistics Finance Corp '144A' 7.125% 01-Jun-2028 | 208.284 | 0,03 |
| 650.000 | DT Midstream Inc '144A' 4.125% 15-Jun-2029 | 666.520 | 0,09 |
| 200.000 | DT Midstream Inc '144A' 4.375% 15-Jun-2031 | 208.308 | 0,03 |
| 450.000 | Encino Acquisition Partners Holdings LLC '144A' 8.500% 01-May-2028 | 468.077 | 0,06 |
| 498.000 | Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc '144A' 5.750% 30-Jan-2028 | 528.321 | 0,07 |
| 190.000 | Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc '144A' 6.625% 15-Jul-2025 | 201.251 | 0,03 |
| 100.000 | Energy Ventures Gom LLC / EnVen Finance Corp '144A' 11.750% 15-Apr-2026 | 103.004 | 0,01 |
| 145.000 | EnLink Midstream LLC 5.375% 01-Jun-2029 | 148.506 | 0,02 |
| 145.000 | EnLink Midstream LLC '144A' 5.625% 15-Jan-2028 | 151.012 | 0,02 |
| 390.000 | EnLink Midstream Partners LP 4.150% 01-Jun-2025 | 405.036 | 0,06 |
| 285.000 | EnLink Midstream Partners LP 4.400% 01-Apr-2024 | 298.126 | 0,04 |
| 175.000 | EnLink Midstream Partners LP 4.850% 15-Jul-2026 | 184.378 | 0,03 |
| 140.000 | EnLink Midstream Partners LP 5.050% 01-Apr-2045 | 135.303 | 0,02 |
| 200.000 | EnLink Midstream Partners LP 5.450% 01-Jun-2047 | 202.060 | 0,03 |
| 245.000 | EnLink Midstream Partners LP 5.600% 01-Apr-2044 | 247.445 | 0,03 |
| 148.000 | EQM Midstream Partners LP 4.000% 01-Aug-2024 | 153.891 | 0,02 |
| 345.000 | EQM Midstream Partners LP 4.125% 01-Dec-2026 | 353.989 | 0,05 |
| 193.000 | EQM Midstream Partners LP 4.750% 15-Jul-2023 | 200.924 | 0,03 |
| 485.000 | EQM Midstream Partners LP 5.500% 15-Jul-2028 | 530.549 | 0,07 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|------------------------|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Energie Forts. | | | |
| 365.000 | EQM Midstream Partners LP 6.500% 15-Jul-2048 | 443.988 | 0,06 |
| 530.000 | EQM Midstream Partners LP '144A' 4.500% 15-Jan-2029 | 551.982 | 0,08 |
| 300.000 | EQM Midstream Partners LP '144A' 4.750% 15-Jan-2031 | 317.726 | 0,04 |
| 220.000 | EQM Midstream Partners LP '144A' 6.000% 01-Jul-2025 | 239.496 | 0,03 |
| 410.000 | EQM Midstream Partners LP '144A' 6.500% 01-Jul-2027 | 459.717 | 0,06 |
| 66.000 | EQT Corp 3.000% 01-Oct-2022 | 66.751 | 0,01 |
| 306.000 | EQT Corp 3.900% 01-Oct-2027 | 328.950 | 0,05 |
| 315.000 | EQT Corp 6.625% 01-Feb-2025 | 355.561 | 0,05 |
| 555.000 | EQT Corp 7.500% 01-Feb-2030 | 714.044 | 0,10 |
| 150.000 | Exterran Energy Solutions LP / EES Finance Corp 8.125% 01-May-2025 | 139.656 | 0,02 |
| 160.000 | Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp 5.625% 15-Jun-2024 | 158.687 | 0,02 |
| 133.000 | Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp 6.250% 15-May-2026 | 129.813 | 0,02 |
| 204.000 | Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp 6.500% 01-Oct-2025 | 201.662 | 0,03 |
| 307.000 | Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp 7.750% 01-Feb-2028 | 309.737 | 0,04 |
| 475.000 | Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp 8.000% 15-Jan-2027 | 490.048 | 0,07 |
| 295.000 | Global Partners LP / GLP Finance Corp 6.875% 15-Jan-2029 | 309.330 | 0,04 |
| 205.000 | Global Partners LP / GLP Finance Corp 7.000% 01-Aug-2027 | 212.892 | 0,03 |
| 230.000 | Gulfport Energy Corp 8.000% 17-May-2026 | 251.227 | 0,03 |
| 300.000 | Harbour Energy Plc '144A' 5.500% 15-Oct-2026 | 298.059 | 0,04 |
| 330.000 | Harvest Midstream I LP '144A' 7.500% 01-Sep-2028 | 353.569 | 0,05 |
| 300.000 | Hess Midstream Operations LP '144A' 4.250% 15-Feb-2030 | 298.261 | 0,04 |
| 300.000 | Hess Midstream Operations LP '144A' 5.125% 15-Jun-2028 | 312.813 | 0,04 |
| 440.000 | Hess Midstream Operations LP '144A' 5.625% 15-Feb-2026 | 453.695 | 0,06 |
| 375.000 | Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co '144A' 5.750% 01-Feb-2029 | 387.047 | 0,05 |
| 300.000 | Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co '144A' 6.000% 01-Feb-2031 | 310.125 | 0,04 |
| 255.000 | Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co '144A' 6.250% 01-Nov-2028 | 268.427 | 0,04 |
| 240.000 | Holly Energy Partners LP / Holly Energy Finance Corp '144A' 5.000% 01-Feb-2028 | 239.612 | 0,03 |
| 460.000 | Howard Midstream Energy Partners LLC '144A' 6.750% 15-Jan-2027 | 471.928 | 0,07 |
| 200.000 | Independence Energy Finance LLC '144A' 7.250% 01-May-2026 | 208.017 | 0,03 |
| 155.000 | Ithaca Energy North Sea Plc '144A' 9.000% 15-Jul-2026 | 159.036 | 0,02 |
| 505.000 | ITT Holdings LLC '144A' 6.500% 01-Aug-2029 | 500.778 | 0,07 |
| 250.000 | KCA Deutag UK Finance Plc '144A' 9.875% 01-Dec-2025 | 270.408 | 0,04 |
| 200.000 | Laredo Petroleum Inc 9.500% 15-Jan-2025 | 204.208 | 0,03 |
| 150.000 | Laredo Petroleum Inc '144A' 7.750% 31-Jul-2029 | 146.461 | 0,02 |
| 75.000 | Magnolia Oil & Gas Operating LLC / Magnolia Oil & Gas Finance Corp '144A' 6.000% 01-Aug-2026 | 76.971 | 0,01 |
| 150.000 | Martin Midstream Partners LP / Martin Midstream Finance Corp '144A' 11.500% 28-Feb-2025 | 157.993 | 0,02 |
| 615.000 | Matador Resources Co 5.875% 15-Sep-2026 | 634.283 | 0,09 |
| 300.000 | MEG Energy Corp '144A' 5.875% 01-Feb-2029 | 314.931 | 0,04 |
| 214.000 | MEG Energy Corp '144A' 6.500% 15-Jan-2025 | 218.049 | 0,03 |
| 760.000 | MEG Energy Corp '144A' 7.125% 01-Feb-2027 | 810.487 | 0,11 |
| 300.000 | Moss Creek Resources Holdings Inc '144A' 7.500% 15-Jan-2026 | 280.812 | 0,04 |
| 250.000 | Moss Creek Resources Holdings Inc '144A' 10.500% 15-May-2027 | 250.562 | 0,03 |
| 350.000 | Murphy Oil Corp 5.750% 15-Aug-2025 | 359.975 | 0,05 |
| 195.000 | Murphy Oil Corp 5.875% 01-Dec-2027 | 201.405 | 0,03 |
| 110.000 | Murphy Oil Corp 6.375% 15-Jul-2028 | 117.080 | 0,02 |
| 432.000 | Murphy Oil Corp 6.375% 01-Dec-2042 | 432.607 | 0,06 |
| 188.000 | Murphy Oil Corp 6.875% 15-Aug-2024 | 192.189 | 0,03 |
| 90.000 | Murphy Oil Corp 7.050% 01-May-2029 | 99.126 | 0,01 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|------------------------|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Energie Forts. | | | |
| 190.000 | Nabors Industries Inc 5.750% 01-Feb-2025 | 174.941 | 0,02 |
| 100.000 | Nabors Industries Inc '144A' 9.000% 01-Feb-2025 | 103.512 | 0,01 |
| 315.000 | Nabors Industries Ltd '144A' 7.250% 15-Jan-2026 | 291.703 | 0,04 |
| 400.000 | Neptune Energy Bondco Plc '144A' 6.625% 15-May-2025 | 409.256 | 0,06 |
| 1.095.000 | New Fortress Energy Inc '144A' 6.500% 30-Sep-2026 | 1.088.014 | 0,15 |
| 716.000 | New Fortress Energy Inc '144A' 6.750% 15-Sep-2025 | 724.112 | 0,10 |
| 1.340.000 | NGL Energy Operating LLC / NGL Energy Finance Corp '144A' 7.500% 01-Feb-2026 | 1.383.691 | 0,19 |
| 180.000 | NGL Energy Partners LP / NGL Energy Finance Corp 6.125% 01-Mar-2025 | 154.087 | 0,02 |
| 229.000 | NGL Energy Partners LP / NGL Energy Finance Corp 7.500% 01-Nov-2023 | 225.803 | 0,03 |
| 110.000 | NGL Energy Partners LP / NGL Energy Finance Corp 7.500% 15-Apr-2026 | 94.439 | 0,01 |
| 580.000 | Northern Oil and Gas Inc '144A' 8.125% 01-Mar-2028 | 612.724 | 0,08 |
| 290.000 | Northrivers Midstream Finance LP '144A' 5.625% 15-Feb-2026 | 302.150 | 0,04 |
| 160.000 | NuStar Logistics LP 5.625% 28-Apr-2027 | 169.360 | 0,02 |
| 215.000 | NuStar Logistics LP 5.750% 01-Oct-2025 | 231.582 | 0,03 |
| 90.000 | NuStar Logistics LP 6.000% 01-Jun-2026 | 97.744 | 0,01 |
| 275.000 | NuStar Logistics LP 6.375% 01-Oct-2030 | 305.671 | 0,04 |
| 200.000 | Oasis Midstream Partners LP / OMP Finance Corp '144A' 8.000% 01-Apr-2029 | 218.284 | 0,03 |
| 750.000 | Occidental Petroleum Corp 2.900% 15-Aug-2024 | 766.409 | 0,11 |
| 318.000 | Occidental Petroleum Corp 3.400% 15-Apr-2026 | 326.285 | 0,04 |
| 315.000 | Occidental Petroleum Corp 3.500% 15-Jun-2025 | 322.973 | 0,04 |
| 280.000 | Occidental Petroleum Corp 4.100% 15-Feb-2047 | 274.824 | 0,04 |
| 381.000 | Occidental Petroleum Corp 4.200% 15-Mar-2048 | 381.617 | 0,05 |
| 295.000 | Occidental Petroleum Corp 4.300% 15-Aug-2039 | 294.642 | 0,04 |
| 323.000 | Occidental Petroleum Corp 4.400% 15-Apr-2046 | 331.685 | 0,05 |
| 125.000 | Occidental Petroleum Corp 4.400% 15-Aug-2049 | 126.752 | 0,02 |
| 280.000 | Occidental Petroleum Corp 4.500% 15-Jul-2044 | 288.824 | 0,04 |
| 300.000 | Occidental Petroleum Corp 4.625% 15-Jun-2045 | 311.704 | 0,04 |
| 300.000 | Occidental Petroleum Corp 5.500% 01-Dec-2025 | 332.925 | 0,05 |
| 439.000 | Occidental Petroleum Corp 5.550% 15-Mar-2026 | 489.213 | 0,07 |
| 260.000 | Occidental Petroleum Corp 5.875% 01-Sep-2025 | 286.976 | 0,04 |
| 450.000 | Occidental Petroleum Corp 6.125% 01-Jan-2031 | 549.126 | 0,08 |
| 165.000 | Occidental Petroleum Corp 6.200% 15-Mar-2040 | 203.191 | 0,03 |
| 200.000 | Occidental Petroleum Corp 6.375% 01-Sep-2028 | 237.744 | 0,03 |
| 535.000 | Occidental Petroleum Corp 6.450% 15-Sep-2036 | 683.192 | 0,09 |
| 375.000 | Occidental Petroleum Corp 6.600% 15-Mar-2046 | 487.151 | 0,07 |
| 550.000 | Occidental Petroleum Corp 6.625% 01-Sep-2030 | 681.549 | 0,09 |
| 390.000 | Occidental Petroleum Corp 6.950% 01-Jul-2024 | 432.957 | 0,06 |
| 225.000 | Occidental Petroleum Corp 7.150% 15-May-2028 | 264.229 | 0,04 |
| 15.000 | Occidental Petroleum Corp 7.500% 01-May-2031 | 414.868 | 0,06 |
| 205.000 | Occidental Petroleum Corp 7.875% 15-Sep-2031 | 273.958 | 0,04 |
| 100.000 | Occidental Petroleum Corp 7.950% 15-Jun-2039 | 132.140 | 0,02 |
| 445.000 | Occidental Petroleum Corp 8.000% 15-Jul-2025 | 519.982 | 0,07 |
| 170.000 | Occidental Petroleum Corp 8.500% 15-Jul-2027 | 212.245 | 0,03 |
| 250.000 | Occidental Petroleum Corp 8.875% 15-Jul-2030 | 337.930 | 0,05 |
| 545.000 | Oceaneering International Inc 4.650% 15-Nov-2024 | 548.352 | 0,08 |
| 85.000 | Oceaneering International Inc 6.000% 01-Feb-2028 | 83.633 | 0,01 |
| 85.000 | Ovintiv Inc 6.500% 15-Aug-2034 | 109.664 | 0,02 |
| 233.000 | Par Petroleum LLC / Par Petroleum Finance Corp '144A' 7.750% 15-Dec-2025 | 236.403 | 0,03 |
| 481.000 | Parkland Corp '144A' 4.500% 01-Oct-2029 | 482.169 | 0,07 |
| 250.000 | Parkland Corp '144A' 5.875% 15-Jul-2027 | 264.040 | 0,04 |
| 185.000 | Patterson-UTI Energy Inc 5.150% 15-Nov-2029 | 187.979 | 0,03 |
| 361.000 | PBF Holding Co LLC / PBF Finance Corp 6.000% 15-Feb-2028 | 232.468 | 0,03 |
| 760.000 | PBF Holding Co LLC / PBF Finance Corp '144A' 9.250% 15-May-2025 | 723.790 | 0,10 |
| 252.000 | PBF Logistics LP / PBF Logistics Finance Corp 6.875% 15-May-2023 | 245.332 | 0,03 |
| 415.000 | PDC Energy Inc 5.750% 15-May-2026 | 429.012 | 0,06 |
| 83.000 | PDC Energy Inc 6.125% 15-Sep-2024 | 84.127 | 0,01 |
| 28.000 | Precision Drilling Corp '144A' 7.125% 15-Jan-2026 | 28.560 | 0,00 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|------------------------|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Energie Forts. | | | |
| 450.000 | Puma International Financing SA '144A' 5.000% 24-Jan-2026 | 450.871 | 0,06 |
| 300.000 | Puma International Financing SA '144A' 5.125% 06-Oct-2024 | 301.305 | 0,04 |
| 179.000 | Range Resources Corp 4.875% 15-May-2025 | 185.048 | 0,03 |
| 266.000 | Range Resources Corp 5.000% 15-Mar-2023 | 272.267 | 0,04 |
| 200.000 | Range Resources Corp 8.250% 15-Jan-2029 | 223.349 | 0,03 |
| 255.000 | Range Resources Corp 9.250% 01-Feb-2026 | 275.161 | 0,04 |
| 130.000 | Rattler Midstream LP '144A' 5.625% 15-Jul-2025 | 135.330 | 0,02 |
| 200.000 | Renewable Energy Group Inc '144A' 5.875% 01-Jun-2028 | 205.781 | 0,03 |
| 390.000 | Rockcliff Energy II LLC '144A' 5.500% 15-Oct-2029 | 402.349 | 0,06 |
| 295.000 | Rockies Express Pipeline LLC '144A' 3.600% 15-May-2025 | 304.161 | 0,04 |
| 515.000 | Rockies Express Pipeline LLC '144A' 4.800% 15-May-2030 | 537.668 | 0,07 |
| 595.000 | Rockies Express Pipeline LLC '144A' 4.950% 15-Jul-2029 | 635.293 | 0,09 |
| 145.000 | Rockies Express Pipeline LLC '144A' 6.875% 15-Apr-2040 | 164.093 | 0,02 |
| 95.000 | Rockies Express Pipeline LLC '144A' 7.500% 15-Jul-2038 | 107.502 | 0,01 |
| 267.152 | Ruby Pipeline LLC '144A' 8.000% 01-Apr-2022 | 249.653 | 0,03 |
| 238.000 | SM Energy Co 5.625% 01-Jun-2025 | 240.349 | 0,03 |
| 537.000 | SM Energy Co 6.750% 15-Sep-2026 | 552.326 | 0,08 |
| 129.000 | SM Energy Co '144A' 10.000% 15-Jan-2025 | 142.031 | 0,02 |
| 310.000 | Southeast Supply Header LLC '144A' 4.250% 15-Jun-2024 | 319.362 | 0,04 |
| 890.000 | Southwestern Energy Co 4.750% 01-Feb-2032 | 938.643 | 0,13 |
| 214.000 | Southwestern Energy Co 4.950% 23-Jan-2025 | 235.439 | 0,03 |
| 250.000 | Southwestern Energy Co 5.375% 01-Feb-2029 | 264.729 | 0,04 |
| 245.000 | Southwestern Energy Co 5.375% 15-Mar-2030 | 262.944 | 0,04 |
| 100.000 | Southwestern Energy Co 8.375% 15-Sep-2028 | 111.763 | 0,02 |
| 300.000 | Strathcona Resources Ltd '144A' 6.875% 01-Aug-2026 | 295.188 | 0,04 |
| 200.000 | Summit Midstream Holdings LLC / Summit Midstream Finance Corp 5.750% 15-Apr-2025 | 181.208 | 0,03 |
| 300.000 | SunCoke Energy Inc '144A' 4.875% 30-Jun-2029 | 298.951 | 0,04 |
| 200.000 | Sunnova Energy Corp '144A' 5.875% 01-Sep-2026 | 204.208 | 0,03 |
| 385.000 | Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 4.500% 15-May-2029 | 391.630 | 0,05 |
| 145.000 | Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 5.875% 15-Mar-2028 | 153.538 | 0,02 |
| 311.000 | Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 6.000% 15-Apr-2027 | 324.653 | 0,04 |
| 400.000 | Sunoco LP / Sunoco Finance Corp '144A' 4.500% 30-Apr-2030 | 410.572 | 0,06 |
| 320.000 | Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp '144A' 5.500% 15-Jan-2028 | 317.653 | 0,04 |
| 200.000 | Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp '144A' 6.000% 01-Mar-2027 | 208.200 | 0,03 |
| 465.000 | Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp '144A' 6.000% 31-Dec-2030 | 466.674 | 0,06 |
| 810.000 | Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp '144A' 6.000% 01-Sep-2031 | 805.950 | 0,11 |
| 175.000 | Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp '144A' 7.500% 01-Oct-2025 | 189.615 | 0,03 |
| 190.000 | Talos Production Inc 12.000% 15-Jan-2026 | 199.223 | 0,03 |
| 225.000 | Tap Rock Resources LLC '144A' 7.000% 01-Oct-2026 | 234.234 | 0,03 |
| 175.000 | Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 4.875% 01-Feb-2031 | 190.344 | 0,03 |
| 200.000 | Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 5.000% 15-Jan-2028 | 211.063 | 0,03 |
| 189.000 | Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 5.375% 01-Feb-2027 | 195.008 | 0,03 |
| 579.000 | Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 5.500% 01-Mar-2030 | 633.530 | 0,09 |
| 800.000 | Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 5.875% 15-Apr-2026 | 835.784 | 0,12 |
| 270.000 | Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 6.500% 15-Jul-2027 | 289.732 | 0,04 |
| 595.000 | Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 6.875% 15-Jan-2029 | 666.495 | 0,09 |
| 400.000 | Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp '144A' 4.000% 15-Jan-2032 | 418.692 | 0,06 |
| 200.000 | TechnipFMC Plc '144A' 6.500% 01-Feb-2026 | 214.204 | 0,03 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|--|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Energie Forts. | | | |
| 110.000 | Teine Energy Ltd '144A' 6.875% 15-Apr-2029 | 111.869 | 0,02 |
| 395.000 | TerraForm Power Operating LLC '144A' 4.250% 31-Jan-2023 | 404.304 | 0,06 |
| 155.000 | TerraForm Power Operating LLC '144A' 4.750% 15-Jan-2030 | 162.731 | 0,02 |
| 160.000 | TerraForm Power Operating LLC '144A' 5.000% 31-Jan-2028 | 169.700 | 0,02 |
| 239.000 | TransMontaigne Partners LP / TLP Finance Corp 6.125% 15-Feb-2026 | 236.946 | 0,03 |
| 368.499 | Transocean Guardian Ltd '144A' 5.875% 15-Jan-2024 | 349.537 | 0,05 |
| 340.000 | Transocean Inc '144A' 7.250% 01-Nov-2025 | 262.154 | 0,04 |
| 287.500 | Transocean Phoenix 2 Ltd '144A' 7.750% 15-Oct-2024 | 291.085 | 0,04 |
| 224.450 | Transocean Pontus Ltd '144A' 6.125% 01-Aug-2025 | 219.633 | 0,03 |
| 280.000 | Transocean Poseidon Ltd '144A' 6.875% 01-Feb-2027 | 270.841 | 0,04 |
| 179.000 | Transocean Proteus Ltd '144A' 6.250% 01-Dec-2024 | 176.848 | 0,02 |
| 274.942 | Transocean Sentry Ltd '144A' 5.375% 15-May-2023 | 265.304 | 0,04 |
| 280.000 | USA Compression Partners LP / USA Compression Finance Corp 6.875% 01-Apr-2026 | 291.507 | 0,04 |
| 320.000 | USA Compression Partners LP / USA Compression Finance Corp 6.875% 01-Sep-2027 | 338.336 | 0,05 |
| 190.000 | Vantage Drilling International '144A' 9.250% 15-Nov-2023 | 179.540 | 0,02 |
| 305.000 | Venture Global Calcasieu Pass LLC '144A' 3.875% 15-Aug-2029 | 316.945 | 0,04 |
| 800.000 | Venture Global Calcasieu Pass LLC '144A' 3.875% 01-Nov-2033 | 841.392 | 0,12 |
| 375.000 | Venture Global Calcasieu Pass LLC '144A' 4.125% 15-Aug-2031 | 398.149 | 0,05 |
| 390.000 | Vine Energy Holdings LLC '144A' 6.750% 15-Apr-2029 | 423.834 | 0,06 |
| 300.000 | Viper Energy Partners LP '144A' 5.375% 01-Nov-2027 | 310.236 | 0,04 |
| 260.000 | W&T Offshore Inc '144A' 9.750% 01-Nov-2023 | 248.570 | 0,03 |
| 830.000 | Weatherford International Ltd '144A' 8.625% 30-Apr-2030 | 863.038 | 0,12 |
| 85.000 | Weatherford International Ltd '144A' 11.000% 01-Dec-2024 | 87.638 | 0,01 |
| 160.000 | Western Midstream Operating LP 3.950% 01-Jun-2025 | 167.840 | 0,02 |
| 370.000 | Western Midstream Operating LP 4.350% 01-Feb-2025 | 387.116 | 0,05 |
| 115.000 | Western Midstream Operating LP 4.500% 01-Mar-2028 | 125.412 | 0,02 |
| 217.000 | Western Midstream Operating LP 4.650% 01-Jul-2026 | 236.410 | 0,03 |
| 789.000 | Western Midstream Operating LP 5.300% 01-Feb-2030 | 870.271 | 0,12 |
| 298.000 | Western Midstream Operating LP 5.300% 01-Mar-2048 | 359.524 | 0,05 |
| 174.000 | Western Midstream Operating LP 5.450% 01-Apr-2044 | 208.177 | 0,03 |
| 150.000 | Western Midstream Operating LP 5.500% 15-Aug-2048 | 179.615 | 0,02 |
| 746.000 | Western Midstream Operating LP 6.500% 01-Feb-2050 | 883.275 | 0,12 |
| Finanzwerte - 74.165.247 | | | |
| (31. Dezember 2020: 74.106.455) | | 74.165.247 | 10,21 |
| 670.000 | Acrisure LLC / Acrisure Finance Inc '144A' 4.250% 15-Feb-2029 | 652.590 | 0,09 |
| 300.000 | Acrisure LLC / Acrisure Finance Inc '144A' 6.000% 01-Aug-2029 | 296.672 | 0,04 |
| 590.000 | Acrisure LLC / Acrisure Finance Inc '144A' 7.000% 15-Nov-2025 | 590.658 | 0,08 |
| 170.000 | Acrisure LLC / Acrisure Finance Inc '144A' 10.125% 01-Aug-2026 | 187.389 | 0,03 |
| 147.000 | Advisor Group Holdings Inc '144A' 10.750% 01-Aug-2027 | 163.385 | 0,02 |
| 211.000 | AG Issuer LLC '144A' 6.250% 01-Mar-2028 | 219.211 | 0,03 |
| 335.000 | Alliant Holdings Intermediate LLC / Alliant Holdings Co-Issuer '144A' 4.250% 15-Oct-2027 | 335.348 | 0,05 |
| 520.000 | Alliant Holdings Intermediate LLC / Alliant Holdings Co-Issuer '144A' 6.750% 15-Oct-2027 | 540.041 | 0,07 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|---------------------------|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Finanzwerte Forts. | | | |
| 335.000 | Ally Financial Inc 5.750% 20-Nov-2025 | 378.339 | 0,05 |
| 505.000 | American Finance Trust Inc / American Finance Operating Partner LP '144A' 4.500% 30-Sep-2028 | 509.482 | 0,07 |
| 400.000 | AmWINS Group Inc '144A' 4.875% 30-Jun-2029 | 404.686 | 0,06 |
| 450.000 | Apollo Commercial Real Estate Finance Inc '144A' 4.625% 15-Jun-2029 | 436.032 | 0,06 |
| 380.000 | Assurant Inc FRN 7.000% 27-Mar-2048 | 434.625 | 0,06 |
| 300.000 | AssuredPartners Inc '144A' 5.625% 15-Jan-2029 | 292.253 | 0,04 |
| 280.000 | AssuredPartners Inc '144A' 7.000% 15-Aug-2025 | 282.391 | 0,04 |
| 265.000 | BrightSphere Investment Group Inc 4.800% 27-Jul-2026 | 277.122 | 0,04 |
| 390.000 | BroadStreet Partners Inc '144A' 5.875% 15-Apr-2029 | 383.723 | 0,05 |
| 801.000 | Brookfield Property REIT Inc / BPR Cumulus LLC / BPR Nimbus LLC / GGSII Selco LLC '144A' 4.500% 01-Apr-2027 | 786.802 | 0,11 |
| 408.000 | CIT Group Inc 4.750% 16-Feb-2024 | 431.964 | 0,06 |
| 277.000 | CIT Group Inc 5.250% 07-Mar-2025 | 305.471 | 0,04 |
| 155.000 | CIT Group Inc 6.125% 09-Mar-2028 | 187.376 | 0,03 |
| 400.000 | CIT Group Inc FRN 3.929% 19-Jun-2024 | 413.391 | 0,06 |
| 168.000 | CNG Holdings Inc '144A' 12.500% 15-Jun-2024 | 159.247 | 0,02 |
| 200.000 | Cobra AcquisitionCo LLC '144A' 6.375% 01-Nov-2029 | 197.781 | 0,03 |
| 925.000 | Coinbase Global Inc '144A' 3.375% 01-Oct-2028 | 865.643 | 0,12 |
| 410.000 | Commerzbank AG '144A' 8.125% 19-Sep-2023 | 452.001 | 0,06 |
| 442.000 | Compass Group Diversified Holdings LLC '144A' 5.250% 15-Apr-2029 | 463.795 | 0,06 |
| 145.000 | Credit Acceptance Corp 6.625% 15-Mar-2026 | 151.067 | 0,02 |
| 392.000 | Credit Acceptance Corp '144A' 5.125% 31-Dec-2024 | 402.208 | 0,06 |
| 180.000 | CTR Partnership LP / CareTrust Capital Corp '144A' 3.875% 30-Jun-2028 | 183.858 | 0,03 |
| 630.000 | CURO Finance LLC '144A' 7.500% 01-Aug-2028 | 633.938 | 0,09 |
| 400.000 | Curo Group Holdings Corp '144A' 7.500% 01-Aug-2028 | 402.848 | 0,06 |
| 200.000 | Cushman & Wakefield US Borrower LLC '144A' 6.750% 15-May-2028 | 214.285 | 0,03 |
| 535.000 | Deutsche Bank AG 4.500% 01-Apr-2025 | 570.073 | 0,08 |
| 510.000 | Deutsche Bank AG FRN 4.296% 24-May-2028 | 524.167 | 0,07 |
| 355.000 | Deutsche Bank AG/New York NY FRN 3.729% 14-Jan-2032 | 363.732 | 0,05 |
| 360.000 | Deutsche Bank AG/New York NY FRN 4.875% 01-Dec-2032 | 389.547 | 0,05 |
| 70.000 | Diversified Healthcare Trust 4.375% 01-Mar-2031 | 67.331 | 0,01 |
| 70.000 | Diversified Healthcare Trust 4.750% 15-Feb-2028 | 68.702 | 0,01 |
| 315.000 | Diversified Healthcare Trust 9.750% 15-Jun-2025 | 341.213 | 0,05 |
| 290.000 | Dresdner Funding Trust I '144A' 8.151% 30-Jun-2031 | 410.927 | 0,06 |
| 267.000 | Enact Holdings Inc '144A' 6.500% 15-Aug-2025 | 291.966 | 0,04 |
| 70.000 | Enova International Inc '144A' 8.500% 01-Sep-2024 | 71.674 | 0,01 |
| 150.000 | Enova International Inc '144A' 8.500% 15-Sep-2025 | 154.845 | 0,02 |
| 326.000 | Five Point Operating Co LP / Five Point Capital Corp '144A' 7.875% 15-Nov-2025 | 340.390 | 0,05 |
| 300.000 | Freedom Mortgage Corp '144A' 6.625% 15-Jan-2027 | 293.562 | 0,04 |
| 300.000 | Freedom Mortgage Corp '144A' 7.625% 01-May-2026 | 306.690 | 0,04 |
| 535.000 | Freedom Mortgage Corp '144A' 8.125% 15-Nov-2024 | 542.244 | 0,07 |
| 254.000 | Freedom Mortgage Corp '144A' 8.250% 15-Apr-2025 | 260.297 | 0,04 |
| 175.000 | FS Energy and Power Fund '144A' 7.500% 15-Aug-2023 | 182.677 | 0,03 |
| 283.000 | Genworth Holdings Inc 4.800% 15-Feb-2024 | 294.623 | 0,04 |
| 310.000 | Genworth Holdings Inc 6.500% 15-Jun-2034 | 322.364 | 0,04 |
| 100.000 | GEO Group Inc/The 5.125% 01-Apr-2023 | 95.357 | 0,01 |
| 253.000 | GEO Group Inc/The 5.875% 15-Oct-2024 | 223.978 | 0,03 |
| 235.000 | GEO Group Inc/The 6.000% 15-Apr-2026 | 189.842 | 0,03 |
| 943.681 | Global Aircraft Leasing Co Ltd '144A' 6.500% 15-Sep-2024 | 911.704 | 0,13 |
| 400.000 | Global Atlantic Fin Co '144A' FRN 4.700% 15-Oct-2051 | 406.137 | 0,06 |
| 300.000 | Global Net Lease Inc / Global Net Lease Operating Partnership LP '144A' 3.750% 15-Dec-2027 | 293.431 | 0,04 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|---------------------------|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Finanzwerte Forts. | | | |
| 72.000 | goeasy Ltd '144A' 4.375% 01-May-2026 | 73.336 | 0,01 |
| 215.000 | goeasy Ltd '144A' 5.375% 01-Dec-2024 | 221.135 | 0,03 |
| 300.000 | Greystar Real Estate Partners LLC '144A' 5.750% 01-Dec-2025 | 305.644 | 0,04 |
| 265.000 | GTCR AP Finance Inc '144A' 8.000% 15-May-2027 | 275.203 | 0,04 |
| 450.000 | HAT Holdings I LLC / HAT Holdings II LLC '144A' 3.375% 15-Jun-2026 | 455.103 | 0,06 |
| 65.000 | HAT Holdings I LLC / HAT Holdings II LLC '144A' 6.000% 15-Apr-2025 | 67.665 | 0,01 |
| 100.000 | Hightower Holding LLC '144A' 6.750% 15-Apr-2029 | 102.861 | 0,01 |
| 300.000 | Home Point Capital Inc '144A' 5.000% 01-Feb-2026 | 278.575 | 0,04 |
| 190.000 | Howard Hughes Corp/The '144A' 4.125% 01-Feb-2029 | 192.809 | 0,03 |
| 670.000 | Howard Hughes Corp/The '144A' 4.375% 01-Feb-2031 | 677.692 | 0,09 |
| 365.000 | Howard Hughes Corp/The '144A' 5.375% 01-Aug-2028 | 389.258 | 0,05 |
| 800.000 | HUB International Ltd '144A' 7.000% 01-May-2026 | 823.020 | 0,11 |
| 400.000 | Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 4.375% 01-Feb-2029 | 390.606 | 0,05 |
| 415.000 | Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 4.750% 15-Sep-2024 | 431.108 | 0,06 |
| 1.117.000 | Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 5.250% 15-May-2027 | 1.149.175 | 0,16 |
| 600.000 | Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 6.250% 15-May-2026 | 625.683 | 0,09 |
| 400.000 | Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 6.375% 15-Dec-2025 | 407.432 | 0,06 |
| 675.000 | Intesa Sanpaolo SpA '144A' 5.017% 26-Jun-2024 | 723.864 | 0,10 |
| 809.000 | Intesa Sanpaolo SpA '144A' 5.710% 15-Jan-2026 | 895.982 | 0,12 |
| 300.000 | Intesa Sanpaolo SpA '144A' FRN 4.198% 01-Jun-2032 | 303.235 | 0,04 |
| 300.000 | Intesa Sanpaolo SpA '144A' FRN 4.950% 01-Jun-2042 | 309.496 | 0,04 |
| 590.000 | Iron Mountain Inc '144A' 4.500% 15-Feb-2031 | 597.375 | 0,08 |
| 764.000 | Iron Mountain Inc '144A' 4.875% 15-Sep-2027 | 793.406 | 0,11 |
| 535.000 | Iron Mountain Inc '144A' 4.875% 15-Sep-2029 | 554.581 | 0,08 |
| 350.000 | Iron Mountain Inc '144A' 5.000% 15-Jul-2028 | 360.152 | 0,05 |
| 540.000 | Iron Mountain Inc '144A' 5.250% 15-Mar-2028 | 562.529 | 0,08 |
| 750.000 | Iron Mountain Inc '144A' 5.250% 15-Jul-2030 | 791.712 | 0,11 |
| 235.000 | Iron Mountain Inc '144A' 5.625% 15-Jul-2032 | 251.836 | 0,04 |
| 200.000 | iStar Inc 4.250% 01-Aug-2025 | 204.790 | 0,03 |
| 409.000 | iStar Inc 4.750% 01-Oct-2024 | 424.845 | 0,06 |
| 165.000 | iStar Inc 5.500% 15-Feb-2026 | 170.960 | 0,02 |
| 370.000 | Jane Street Group / JSG Finance Inc '144A' 4.500% 15-Nov-2029 | 374.307 | 0,05 |
| 470.000 | Jefferies Finance LLC / JFIN Co-Issuer Corp '144A' 5.000% 15-Aug-2028 | 482.511 | 0,07 |
| 300.000 | Jefferson Capital Holdings LLC '144A' 6.000% 15-Aug-2026 | 304.059 | 0,04 |
| 125.000 | Kennedy-Wilson Inc 4.750% 01-Mar-2029 | 128.002 | 0,02 |
| 300.000 | Kennedy-Wilson Inc 4.750% 01-Feb-2030 | 304.566 | 0,04 |
| 620.000 | Kennedy-Wilson Inc 5.000% 01-Mar-2031 | 639.533 | 0,09 |
| 266.000 | Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp '144A' 4.250% 01-Feb-2027 | 268.040 | 0,04 |
| 300.000 | Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp '144A' 4.750% 15-Jun-2029 | 308.012 | 0,04 |
| 15.000 | Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp '144A' 5.250% 01-Oct-2025 | 15.185 | 0,00 |
| 215.000 | LD Holdings Group LLC '144A' 6.125% 01-Apr-2028 | 202.943 | 0,03 |
| 230.000 | LD Holdings Group LLC '144A' 6.500% 01-Nov-2025 | 227.169 | 0,03 |
| 205.000 | Liberty Mutual Group Inc '144A' 4.300% 01-Feb-2061 | 193.011 | 0,03 |
| 40.000 | Liberty Mutual Group Inc '144A' 7.800% 15-Mar-2037 | 55.529 | 0,01 |
| 300.000 | Liberty Mutual Group Inc '144A' FRN 4.125% 15-Dec-2051 | 299.693 | 0,04 |
| 150.000 | LPL Holdings Inc '144A' 4.000% 15-Mar-2029 | 153.812 | 0,02 |
| 305.000 | LPL Holdings Inc '144A' 4.625% 15-Nov-2027 | 316.113 | 0,04 |
| 500.000 | MGLIC Investment Corp 5.250% 15-Aug-2028 | 525.708 | 0,07 |
| 143.000 | MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc 4.500% 01-Sep-2026 | 154.017 | 0,02 |
| 147.000 | MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc 4.500% 15-Jan-2028 | 159.161 | 0,02 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % |
|---------------------------|--|----------------------------|-----------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Finanzwerte Forts. | | | |
| 425.000 | MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc 5.625% 01-May-2024 | 454.744 | 0,06 |
| 340.000 | MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc 5.750% 01-Feb-2027 | 384.601 | 0,05 |
| 465.000 | MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc '144A' 3.875% 15-Feb-2029 | 488.917 | 0,07 |
| 330.000 | MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc '144A' 4.625% 15-Jun-2025 | 352.501 | 0,05 |
| 775.000 | Midcap Financial Issuer Trust '144A' 6.500% 01-May-2028 | 809.263 | 0,11 |
| 575.000 | MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 3.500% 15-Mar-2031 | 582.354 | 0,08 |
| 364.000 | MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 4.625% 01-Aug-2029 | 384.650 | 0,05 |
| 537.000 | MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 5.000% 15-Oct-2027 | 562.497 | 0,08 |
| 245.000 | Nationstar Mortgage Holdings Inc '144A' 5.125% 15-Dec-2030 | 242.290 | 0,03 |
| 449.000 | Nationstar Mortgage Holdings Inc '144A' 5.500% 15-Aug-2028 | 458.658 | 0,06 |
| 200.000 | Nationstar Mortgage Holdings Inc '144A' 5.750% 15-Nov-2031 | 199.281 | 0,03 |
| 205.000 | Nationstar Mortgage Holdings Inc '144A' 6.000% 15-Jan-2027 | 213.773 | 0,03 |
| 55.000 | Navient Corp 4.875% 15-Mar-2028 | 54.945 | 0,01 |
| 135.000 | Navient Corp 5.000% 15-Mar-2027 | 137.732 | 0,02 |
| 200.000 | Navient Corp 5.500% 25-Jan-2023 | 208.540 | 0,03 |
| 200.000 | Navient Corp 5.500% 15-Mar-2029 | 199.819 | 0,03 |
| 65.000 | Navient Corp 5.875% 25-Oct-2024 | 69.371 | 0,01 |
| 70.000 | Navient Corp 6.750% 25-Jun-2025 | 77.070 | 0,01 |
| 530.000 | Navient Corp 6.750% 15-Jun-2026 | 586.408 | 0,08 |
| 84.000 | Navient Corp 7.250% 25-Sep-2023 | 90.594 | 0,01 |
| 250.000 | Navient Corp 'MTN' 5.625% 01-Aug-2033 | 238.476 | 0,03 |
| 262.000 | Navient Corp 'MTN' 6.125% 25-Mar-2024 | 279.621 | 0,04 |
| 208.000 | New Residential Investment Corp '144A' 6.250% 15-Oct-2025 | 209.138 | 0,03 |
| 115.000 | Newmark Group Inc 6.125% 15-Nov-2023 | 123.165 | 0,02 |
| 200.000 | NFP Corp '144A' 4.875% 15-Aug-2028 | 202.304 | 0,03 |
| 895.000 | NFP Corp '144A' 6.875% 15-Aug-2028 | 898.849 | 0,12 |
| 220.000 | NMI Holdings Inc '144A' 7.375% 01-Jun-2025 | 250.030 | 0,03 |
| 300.000 | OneMain Finance Corp 3.500% 15-Jan-2027 | 296.995 | 0,04 |
| 250.000 | OneMain Finance Corp 3.875% 15-Sep-2028 | 245.379 | 0,03 |
| 230.000 | OneMain Finance Corp 4.000% 15-Sep-2030 | 226.561 | 0,03 |
| 230.000 | OneMain Finance Corp 5.375% 15-Nov-2029 | 250.412 | 0,03 |
| 360.000 | OneMain Finance Corp 5.625% 15-Mar-2023 | 376.427 | 0,05 |
| 510.000 | OneMain Finance Corp 6.125% 15-Mar-2024 | 541.329 | 0,07 |
| 315.000 | OneMain Finance Corp 6.625% 15-Jan-2028 | 353.249 | 0,05 |
| 655.000 | OneMain Finance Corp 6.875% 15-Mar-2025 | 729.516 | 0,10 |
| 582.000 | OneMain Finance Corp 7.125% 15-Mar-2026 | 664.338 | 0,09 |
| 140.000 | OneMain Finance Corp 8.250% 01-Oct-2023 | 154.844 | 0,02 |
| 220.000 | OneMain Finance Corp 8.875% 01-Jun-2025 | 235.661 | 0,03 |
| 555.000 | Park Intermediate Holdings LLC / PK Domestic Property LLC / PK Finance Co-Issuer '144A' 4.875% 15-May-2029 | 568.331 | 0,08 |
| 350.000 | Park Intermediate Holdings LLC / PK Domestic Property LLC / PK Finance Co-Issuer '144A' 5.875% 01-Oct-2028 | 364.516 | 0,05 |
| 340.000 | Park Intermediate Holdings LLC / PK Domestic Property LLC / PK Finance Co-Issuer '144A' 7.500% 01-Jun-2025 | 359.045 | 0,05 |
| 435.000 | PennyMac Financial Services Inc '144A' 4.250% 15-Feb-2029 | 418.868 | 0,06 |
| 300.000 | PennyMac Financial Services Inc '144A' 5.375% 15-Oct-2025 | 308.589 | 0,04 |
| 445.000 | PennyMac Financial Services Inc '144A' 5.750% 15-Sep-2031 | 450.075 | 0,06 |
| 145.000 | PHH Mortgage Corp '144A' 7.875% 15-Mar-2026 | 150.068 | 0,02 |
| 160.000 | PRA Group Inc '144A' 5.000% 01-Oct-2029 | 160.642 | 0,02 |
| 192.000 | Provident Funding Associates LP / PFG Finance Corp '144A' 6.375% 15-Jun-2025 | 195.675 | 0,03 |
| 191.000 | Radian Group Inc 4.500% 01-Oct-2024 | 200.274 | 0,03 |
| 170.000 | Radian Group Inc 4.875% 15-Mar-2027 | 182.591 | 0,03 |
| 225.000 | Radian Group Inc 6.625% 15-Mar-2025 | 248.892 | 0,03 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % |
|---------------------------|---|----------------------------|-----------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Finanzwerte Forts. | | | |
| 145.000 | Realty Group LLC / Realty Co-Issuer Corp '144A' 4.875% 01-Jun-2023 | 148.960 | 0,02 |
| 175.000 | Realty Group LLC / Realty Co-Issuer Corp '144A' 5.750% 15-Jan-2029 | 179.642 | 0,03 |
| 254.000 | Realty Group LLC / Realty Co-Issuer Corp '144A' 7.625% 15-Jun-2025 | 269.494 | 0,04 |
| 260.000 | Realty Group LLC / Realty Co-Issuer Corp '144A' 9.375% 01-Apr-2027 | 281.087 | 0,04 |
| 250.000 | RHP Hotel Properties LP / RHP Finance Corp 4.750% 15-Oct-2027 | 255.250 | 0,04 |
| 120.000 | RHP Hotel Properties LP / RHP Finance Corp '144A' 4.500% 15-Feb-2029 | 120.182 | 0,02 |
| 250.000 | RLJ Lodging Trust LP '144A' 3.750% 01-Jul-2026 | 251.639 | 0,04 |
| 245.000 | RLJ Lodging Trust LP '144A' 4.000% 15-Sep-2029 | 242.745 | 0,03 |
| 520.000 | Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc '144A' 2.875% 15-Oct-2026 | 516.797 | 0,07 |
| 375.000 | Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc '144A' 3.625% 01-Mar-2029 | 376.944 | 0,05 |
| 555.000 | Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc '144A' 3.875% 01-Mar-2031 | 564.180 | 0,08 |
| 390.000 | Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc '144A' 4.000% 15-Oct-2033 | 395.464 | 0,05 |
| 730.000 | SBA Communications Corp 3.875% 15-Feb-2027 | 752.867 | 0,10 |
| 735.000 | SBA Communications Corp '144A' 3.125% 01-Feb-2029 | 706.732 | 0,10 |
| 270.000 | Service Properties Trust 3.950% 15-Jan-2028 | 247.547 | 0,03 |
| 425.000 | Service Properties Trust 4.350% 01-Oct-2024 | 416.961 | 0,06 |
| 660.000 | Service Properties Trust 4.500% 15-Jun-2023 | 660.568 | 0,09 |
| 245.000 | Service Properties Trust 4.500% 15-Mar-2025 | 239.141 | 0,03 |
| 240.000 | Service Properties Trust 4.650% 15-Mar-2024 | 237.260 | 0,03 |
| 148.000 | Service Properties Trust 4.750% 01-Oct-2026 | 144.091 | 0,02 |
| 184.000 | Service Properties Trust 4.950% 15-Feb-2027 | 178.678 | 0,02 |
| 170.000 | Service Properties Trust 5.500% 15-Dec-2027 | 174.713 | 0,02 |
| 220.000 | Service Properties Trust 7.500% 15-Sep-2025 | 238.627 | 0,03 |
| 225.000 | SLM Corp 4.200% 29-Oct-2025 | 235.362 | 0,03 |
| 181.000 | Starwood Property Trust Inc 4.750% 15-Mar-2025 | 188.431 | 0,03 |
| 140.000 | Starwood Property Trust Inc '144A' 5.500% 01-Nov-2023 | 145.041 | 0,02 |
| 65.000 | Synovus Financial Corp FRN 5.900% 07-Feb-2029 | 69.521 | 0,01 |
| 740.000 | UniCredit SpA '144A' FRN 5.459% 30-Jun-2035 | 807.847 | 0,11 |
| 360.000 | UniCredit SpA '144A' FRN 5.861% 19-Jun-2032 | 393.563 | 0,05 |
| 834.000 | UniCredit SpA '144A' FRN 7.296% 02-Apr-2034 | 1.001.343 | 0,14 |
| 464.000 | United Wholesale Mortgage LLC '144A' 5.500% 15-Nov-2025 | 473.203 | 0,07 |
| 450.000 | United Wholesale Mortgage LLC '144A' 5.500% 15-Apr-2029 | 442.195 | 0,06 |
| 790.000 | United Wholesale Mortgage LLC '144A' 5.750% 15-Jun-2027 | 792.765 | 0,11 |
| 678.000 | Uniti Group LP / Uniti Fiber Holdings Inc / CSL Capital LLC '144A' 6.000% 15-Jan-2030 | 653.422 | 0,09 |
| 825.000 | Uniti Group LP / Uniti Fiber Holdings Inc / CSL Capital LLC '144A' 7.875% 15-Feb-2025 | 862.084 | 0,12 |
| 160.000 | Uniti Group LP / Uniti Group Finance Inc / CSL Capital LLC '144A' 4.750% 15-Apr-2028 | 158.919 | 0,02 |
| 550.000 | Uniti Group LP / Uniti Group Finance Inc / CSL Capital LLC '144A' 6.500% 15-Feb-2029 | 548.944 | 0,08 |
| 315.000 | USI Inc/NY '144A' 6.875% 01-May-2025 | 317.707 | 0,04 |
| 305.000 | VICI Properties LP / VICI Note Co Inc '144A' 3.500% 15-Feb-2025 | 309.897 | 0,04 |
| 390.000 | VICI Properties LP / VICI Note Co Inc '144A' 3.750% 15-Feb-2027 | 403.268 | 0,06 |
| 427.000 | VICI Properties LP / VICI Note Co Inc '144A' 4.125% 15-Aug-2030 | 452.291 | 0,06 |
| 743.000 | VICI Properties LP / VICI Note Co Inc '144A' 4.250% 01-Dec-2026 | 774.789 | 0,11 |
| 695.000 | VICI Properties LP / VICI Note Co Inc '144A' 4.625% 01-Dec-2029 | 740.835 | 0,10 |
| 260.000 | VistaJet Malta Finance Plc / XO Management Holding Inc '144A' 10.500% 01-Jun-2024 | 278.470 | 0,04 |
| 235.000 | WeWork Cos Inc '144A' 7.875% 01-May-2025 | 224.789 | 0,03 |
| 165.000 | XHR LP '144A' 4.875% 01-Jun-2029 | 168.170 | 0,02 |
| 194.000 | XHR LP '144A' 6.375% 15-Aug-2025 | 205.420 | 0,03 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % |
|--|---|----------------------------|-----------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Industrie - 64.216.541 | | | |
| (31. Dezember 2020: 74.770.832) | | 64.216.541 | 8,84 |
| 186.000 | Advanced Drainage Systems Inc '144A' 5.000% 30-Sep-2027 | 192.846 | 0,03 |
| 220.000 | AECOM 5.125% 15-Mar-2027 | 239.925 | 0,03 |
| 320.000 | AerCap Global Aviation Trust '144A' FRN 6.500% 15-Jun-2045 | 346.056 | 0,05 |
| 245.000 | Altera Infrastructure LP/Teekay Offshore Finance Corp '144A' 8.500% 15-Jul-2023 | 134.750 | 0,02 |
| 150.000 | Amsted Industries Inc '144A' 4.625% 15-May-2030 | 154.402 | 0,02 |
| 332.000 | Amsted Industries Inc '144A' 5.625% 01-Jul-2027 | 345.612 | 0,05 |
| 535.000 | Arcosa Inc '144A' 4.375% 15-Apr-2029 | 543.148 | 0,07 |
| 465.000 | ARD Finance SA '144A' 6.500% 30-Jun-2027 | 479.434 | 0,07 |
| 270.000 | Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc '144A' 3.250% 01-Sep-2028 | 267.357 | 0,04 |
| 550.000 | Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc '144A' 4.000% 01-Sep-2029 | 544.789 | 0,07 |
| 299.000 | Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 4.125% 15-Aug-2026 | 306.101 | 0,04 |
| 200.000 | Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 5.250% 30-Apr-2025 | 206.707 | 0,03 |
| 285.000 | Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 5.250% 15-Aug-2027 | 287.102 | 0,04 |
| 565.000 | Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 5.250% 15-Aug-2027 | 569.167 | 0,08 |
| 405.000 | Artera Services LLC '144A' 9.033% 04-Dec-2025 | 428.915 | 0,06 |
| 160.000 | Atkore Inc '144A' 4.250% 01-Jun-2031 | 164.230 | 0,02 |
| 975.000 | Ball Corp 2.875% 15-Aug-2030 | 947.437 | 0,13 |
| 410.000 | Ball Corp 3.125% 15-Sep-2031 | 405.476 | 0,06 |
| 490.000 | Ball Corp 4.000% 15-Nov-2023 | 512.050 | 0,07 |
| 415.000 | Ball Corp 4.875% 15-Mar-2026 | 457.558 | 0,06 |
| 290.000 | Ball Corp 5.250% 01-Jul-2025 | 320.048 | 0,04 |
| 341.000 | Berry Global Inc '144A' 4.500% 15-Feb-2026 | 346.560 | 0,05 |
| 213.000 | Berry Global Inc '144A' 5.625% 15-Jul-2027 | 223.067 | 0,03 |
| 300.000 | Bombardier Inc '144A' 6.000% 15-Feb-2028 | 301.335 | 0,04 |
| 830.000 | Bombardier Inc '144A' 7.125% 15-Jun-2026 | 862.125 | 0,12 |
| 200.000 | Bombardier Inc '144A' 7.450% 01-May-2034 | 246.000 | 0,03 |
| 510.000 | Bombardier Inc '144A' 7.500% 01-Dec-2024 | 532.019 | 0,07 |
| 695.000 | Bombardier Inc '144A' 7.500% 15-Mar-2025 | 708.890 | 0,10 |
| 816.000 | Bombardier Inc '144A' 7.875% 15-Apr-2027 | 846.584 | 0,12 |
| 440.000 | Brand Industrial Services Inc '144A' 8.500% 15-Jul-2025 | 440.081 | 0,06 |
| 160.000 | Brightstar Escrow Corp '144A' 9.750% 15-Oct-2025 | 171.766 | 0,02 |
| 400.000 | Builders FirstSource Inc '144A' 4.250% 01-Feb-2032 | 416.724 | 0,06 |
| 235.000 | Builders FirstSource Inc '144A' 5.000% 01-Mar-2030 | 252.372 | 0,03 |
| 218.000 | Builders FirstSource Inc '144A' 6.750% 01-Jun-2027 | 230.225 | 0,03 |
| 170.000 | BWX Technologies Inc '144A' 4.125% 30-Jun-2028 | 172.794 | 0,02 |
| 200.000 | BWX Technologies Inc '144A' 4.125% 15-Apr-2029 | 202.787 | 0,03 |
| 109.000 | Cargo Aircraft Management Inc '144A' 4.750% 01-Feb-2028 | 111.114 | 0,02 |
| 150.000 | Carriage Purchaser Inc '144A' 7.875% 15-Oct-2029 | 144.211 | 0,02 |
| 150.000 | Cascades Inc/Cascades USA Inc '144A' 5.125% 15-Jan-2026 | 156.443 | 0,02 |
| 300.000 | Cascades Inc/Cascades USA Inc '144A' 5.375% 15-Jan-2028 | 307.949 | 0,04 |
| 100.000 | Cellnex Finance Co SA '144A' 3.875% 07-Jul-2041 | 95.784 | 0,01 |
| 100.000 | Clean Harbors Inc '144A' 4.875% 15-Jul-2027 | 103.100 | 0,01 |
| 246.000 | Cleaver-Brooks Inc '144A' 7.875% 01-Mar-2023 | 241.208 | 0,03 |
| 120.000 | Colfax Corp '144A' 6.375% 15-Feb-2026 | 124.173 | 0,02 |
| 65.000 | Covanta Holding Corp 5.000% 01-Sep-2030 | 66.441 | 0,01 |
| 155.000 | CP Atlas Buyer Inc '144A' 7.000% 01-Dec-2028 | 154.443 | 0,02 |
| 350.000 | Crown Americas LLC / Crown Americas Capital Corp V 4.250% 30-Sep-2026 | 374.036 | 0,05 |
| 400.000 | Crown Americas LLC / Crown Americas Capital Corp VI 4.750% 01-Feb-2026 | 410.526 | 0,06 |
| 250.000 | Dycom Industries Inc '144A' 4.500% 15-Apr-2029 | 255.105 | 0,04 |
| 400.000 | Energizer Holdings Inc '144A' 4.375% 31-Mar-2029 | 390.986 | 0,05 |
| 392.000 | Energizer Holdings Inc '144A' 4.750% 15-Jun-2028 | 400.930 | 0,06 |
| 10.000 | EnerSys '144A' 5.000% 30-Apr-2023 | 10.337 | 0,00 |
| 345.000 | EnPro Industries Inc 5.750% 15-Oct-2026 | 361.148 | 0,05 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % |
|-------------------------|---|----------------------------|-----------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Industrie Forts. | | | |
| 345.000 | F-Brasile SpA / F-Brasile US LLC '144A' 7.375% 15-Aug-2026 | 343.634 | 0,05 |
| 265.000 | Flex Acquisition Co Inc '144A' 6.875% 15-Jan-2025 | 265.594 | 0,04 |
| 125.000 | Fluor Corp 4.250% 15-Sep-2028 | 131.297 | 0,02 |
| 110.000 | Forterra Finance LLC / FRTA Finance Corp '144A' 6.500% 15-Jul-2025 | 116.855 | 0,02 |
| 760.000 | Fortress Transportation and Infrastructure Investors LLC '144A' 5.500% 01-May-2028 | 776.013 | 0,11 |
| 750.000 | Fortress Transportation and Infrastructure Investors LLC '144A' 6.500% 01-Oct-2025 | 776.066 | 0,11 |
| 75.000 | Fortress Transportation and Infrastructure Investors LLC '144A' 9.750% 01-Aug-2027 | 84.075 | 0,01 |
| 202.000 | FXI Holdings Inc '144A' 7.875% 01-Nov-2024 | 206.028 | 0,03 |
| 472.000 | FXI Holdings Inc '144A' 12.250% 15-Nov-2026 | 531.614 | 0,07 |
| 295.000 | Gates Global LLC / Gates Corp '144A' 6.250% 15-Jan-2026 | 304.911 | 0,04 |
| 270.000 | GFL Environmental Inc '144A' 3.500% 01-Sep-2028 | 266.389 | 0,04 |
| 200.000 | GFL Environmental Inc '144A' 3.750% 01-Aug-2025 | 202.248 | 0,03 |
| 115.000 | GFL Environmental Inc '144A' 4.000% 01-Aug-2028 | 112.895 | 0,02 |
| 225.000 | GFL Environmental Inc '144A' 4.250% 01-Jun-2025 | 231.750 | 0,03 |
| 380.000 | GFL Environmental Inc '144A' 4.750% 15-Jun-2029 | 383.906 | 0,05 |
| 215.000 | GFL Environmental Inc '144A' 5.125% 15-Dec-2026 | 223.863 | 0,03 |
| 200.000 | Global Infrastructure Solutions Inc '144A' 5.625% 01-Jun-2029 | 205.295 | 0,03 |
| 270.000 | GrafTech Finance Inc '144A' 4.625% 15-Dec-2028 | 274.532 | 0,04 |
| 300.000 | Graham Packaging Co Inc '144A' 7.125% 15-Aug-2028 | 310.950 | 0,04 |
| 94.000 | Graphic Packaging International LLC 4.125% 15-Aug-2024 | 98.799 | 0,01 |
| 185.000 | Graphic Packaging International LLC 4.875% 15-Nov-2022 | 188.432 | 0,03 |
| 400.000 | Graphic Packaging International LLC '144A' 3.500% 15-Mar-2028 | 399.574 | 0,05 |
| 175.000 | Graphic Packaging International LLC '144A' 3.500% 01-Mar-2029 | 173.939 | 0,02 |
| 200.000 | Graphic Packaging International LLC '144A' 3.750% 01-Feb-2030 | 202.427 | 0,03 |
| 165.000 | Great Lakes Dredge & Dock Corp '144A' 5.250% 01-Jun-2029 | 170.198 | 0,02 |
| 180.000 | Greif Inc '144A' 6.500% 01-Mar-2027 | 186.946 | 0,03 |
| 462.000 | Griffon Corp 5.750% 01-Mar-2028 | 480.441 | 0,07 |
| 250.000 | Harsco Corp '144A' 5.750% 31-Jul-2027 | 254.938 | 0,04 |
| 315.000 | Hexcel Corp 4.200% 15-Feb-2027 | 338.657 | 0,05 |
| 271.000 | Hexcel Corp 4.950% 15-Aug-2025 | 295.905 | 0,04 |
| 288.000 | Hillenbrand Inc 5.000% 15-Sep-2026 | 321.422 | 0,04 |
| 400.000 | Howmet Aerospace Inc 3.000% 15-Jan-2029 | 400.960 | 0,06 |
| 320.000 | Howmet Aerospace Inc 5.125% 01-Oct-2024 | 345.216 | 0,05 |
| 285.000 | Howmet Aerospace Inc 5.900% 01-Feb-2027 | 325.898 | 0,04 |
| 570.000 | Howmet Aerospace Inc 5.950% 01-Feb-2037 | 674.857 | 0,09 |
| 605.000 | Howmet Aerospace Inc 6.750% 15-Jan-2028 | 719.312 | 0,10 |
| 371.000 | Howmet Aerospace Inc 6.875% 01-May-2025 | 426.683 | 0,06 |
| 295.000 | Husky III Holding Ltd '144A' 13.000% 15-Feb-2025 | 310.092 | 0,04 |
| 150.000 | IEA Energy Services LLC '144A' 6.625% 15-Aug-2029 | 148.373 | 0,02 |
| 1.215.000 | Imola Merger Corp '144A' 4.750% 15-May-2029 | 1.247.112 | 0,17 |
| 60.000 | INNOVATE Corp '144A' 8.500% 01-Feb-2026 | 60.637 | 0,01 |
| 312.000 | Intelligent Packaging Ltd Finco Inc / Intelligent Packaging Ltd Co-Issuer LLC '144A' 6.000% 15-Sep-2028 | 321.360 | 0,04 |
| 170.000 | Intertape Polymer Group Inc '144A' 4.375% 15-Jun-2029 | 170.258 | 0,02 |
| 200.000 | James Hardie International Finance DAC '144A' 5.000% 15-Jan-2028 | 208.285 | 0,03 |
| 100.000 | JPW Industries Holding Corp '144A' 9.000% 01-Oct-2024 | 104.771 | 0,01 |
| 169.000 | Koppers Inc '144A' 6.000% 15-Feb-2025 | 172.132 | 0,02 |
| 390.000 | LABL Inc '144A' 6.750% 15-Jul-2026 | 402.340 | 0,06 |
| 200.000 | LABL Inc '144A' 8.250% 01-Nov-2029 | 201.485 | 0,03 |
| 75.000 | Leonardo US Holdings Inc '144A' 6.250% 15-Jan-2040 | 88.130 | 0,01 |
| 105.000 | Madison IAQ LLC '144A' 4.125% 30-Jun-2028 | 105.417 | 0,01 |
| 500.000 | Madison IAQ LLC '144A' 5.875% 30-Jun-2029 | 500.765 | 0,07 |
| 230.000 | Manitowoc Co Inc/The '144A' 9.000% 01-Apr-2026 | 242.346 | 0,03 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|-------------------------|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Industrie Forts. | | | |
| 303.000 | Masonite International Corp '144A' 5.375% 01-Feb-2028 | 318.200 | 0,04 |
| 300.000 | MasTec Inc '144A' 4.500% 15-Aug-2028 | 312.055 | 0,04 |
| 149.000 | Matthews International Corp '144A' 5.250% 01-Dec-2025 | 152.818 | 0,02 |
| 735.000 | Mauser Packaging Solutions Holding Co '144A' 5.500% 15-Apr-2024 | 742.695 | 0,10 |
| 603.000 | Mauser Packaging Solutions Holding Co '144A' 7.250% 15-Apr-2025 | 605.201 | 0,08 |
| 312.000 | Maxar Space Robotics LLC '144A' 9.750% 31-Dec-2023 | 336.497 | 0,05 |
| 560.000 | Mueller Water Products Inc '144A' 4.000% 15-Jun-2029 | 566.404 | 0,08 |
| 250.000 | New Enterprise Stone & Lime Co Inc '144A' 5.250% 15-Jul-2028 | 253.876 | 0,03 |
| 100.000 | New Enterprise Stone & Lime Co Inc '144A' 9.750% 15-Jul-2028 | 107.141 | 0,01 |
| 180.000 | OI European Group BV '144A' 4.750% 15-Feb-2030 | 182.702 | 0,03 |
| 115.000 | Owens-Brockway Glass Container Inc '144A' 5.875% 15-Aug-2023 | 120.579 | 0,02 |
| 435.000 | Pactiv Evergreen Group Issuer Inc/Pactiv Evergreen Group Issuer LLC/Reynolds Gro '144A' 4.000% 15-Oct-2027 | 423.612 | 0,06 |
| 300.000 | Pactiv Evergreen Group Issuer LLC / Pactiv Evergreen Group Issuer Inc '144A' 4.375% 15-Oct-2028 | 298.205 | 0,04 |
| 115.000 | Pactiv LLC 7.950% 15-Dec-2025 | 127.524 | 0,02 |
| 390.000 | Pactiv LLC 8.375% 15-Apr-2027 | 434.721 | 0,06 |
| 368.000 | Park-Ohio Industries Inc 6.625% 15-Apr-2027 | 357.512 | 0,05 |
| 100.000 | Patrick Industries Inc '144A' 4.750% 01-May-2029 | 99.151 | 0,01 |
| 180.000 | Patrick Industries Inc '144A' 7.500% 15-Oct-2027 | 192.266 | 0,03 |
| 485.000 | PGT Innovations Inc '144A' 4.375% 01-Oct-2029 | 488.257 | 0,07 |
| 150.000 | Roller Bearing Co of America Inc '144A' 4.375% 15-Oct-2029 | 153.188 | 0,02 |
| 290.000 | Rolls-Royce Plc '144A' 3.625% 14-Oct-2025 | 294.678 | 0,04 |
| 360.000 | Rolls-Royce Plc '144A' 5.750% 15-Oct-2027 | 398.484 | 0,05 |
| 142.000 | Sealed Air Corp '144A' 4.000% 01-Dec-2027 | 148.186 | 0,02 |
| 240.000 | Sealed Air Corp '144A' 5.125% 01-Dec-2024 | 257.316 | 0,04 |
| 154.000 | Sealed Air Corp '144A' 5.250% 01-Apr-2023 | 159.742 | 0,02 |
| 495.000 | Sealed Air Corp '144A' 5.500% 15-Sep-2025 | 548.089 | 0,08 |
| 270.000 | Sealed Air Corp '144A' 6.875% 15-Jul-2033 | 343.621 | 0,05 |
| 250.000 | Seaspan Corp '144A' 5.500% 01-Aug-2029 | 252.851 | 0,03 |
| 340.000 | Sensata Technologies BV '144A' 4.000% 15-Apr-2029 | 347.813 | 0,05 |
| 185.000 | Sensata Technologies BV '144A' 5.000% 01-Oct-2025 | 200.919 | 0,03 |
| 60.000 | Sensata Technologies BV '144A' 5.625% 01-Nov-2024 | 66.115 | 0,01 |
| 250.000 | Sensata Technologies Inc '144A' 3.750% 15-Feb-2031 | 249.734 | 0,03 |
| 185.000 | Sensata Technologies Inc '144A' 4.375% 15-Feb-2030 | 194.515 | 0,03 |
| 61.000 | Silgan Holdings Inc 4.125% 01-Feb-2028 | 62.391 | 0,01 |
| 280.000 | Spirit AeroSystems Inc 3.950% 15-Jun-2023 | 282.509 | 0,04 |
| 670.000 | Spirit AeroSystems Inc 4.600% 15-Jun-2028 | 672.690 | 0,09 |
| 685.000 | Spirit AeroSystems Inc '144A' 7.500% 15-Apr-2025 | 719.240 | 0,10 |
| 650.000 | SRM Escrow Issuer LLC '144A' 6.000% 01-Nov-2028 | 695.620 | 0,10 |
| 663.000 | Standard Industries Inc/NJ '144A' 3.375% 15-Jan-2031 | 639.795 | 0,09 |
| 865.000 | Standard Industries Inc/NJ '144A' 4.375% 15-Jul-2030 | 883.939 | 0,12 |
| 390.000 | Standard Industries Inc/NJ '144A' 4.750% 15-Jan-2028 | 403.383 | 0,06 |
| 495.000 | Standard Industries Inc/NJ '144A' 5.000% 15-Feb-2027 | 510.164 | 0,07 |
| 185.000 | Stericycle Inc '144A' 3.875% 15-Jan-2029 | 182.498 | 0,03 |
| 302.000 | Stericycle Inc '144A' 5.375% 15-Jul-2024 | 308.353 | 0,04 |
| 239.000 | Stevens Holding Co Inc '144A' 6.125% 01-Oct-2026 | 255.073 | 0,04 |
| 170.000 | Summit Materials LLC / Summit Materials Finance Corp '144A' 5.250% 15-Jan-2029 | 178.306 | 0,02 |
| 260.000 | Summit Materials LLC / Summit Materials Finance Corp '144A' 6.500% 15-Mar-2027 | 270.158 | 0,04 |
| 270.000 | Terex Corp '144A' 5.000% 15-May-2029 | 277.835 | 0,04 |
| 365.000 | Tervita Corp '144A' 11.000% 01-Dec-2025 | 421.104 | 0,06 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|--|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Industrie Forts. | | | |
| 235.000 | Titan Acquisition Ltd / Titan Co-Borrower LLC '144A' 7.750% 15-Apr-2026 | 238.769 | 0,03 |
| 960.000 | TK Elevator US Newco Inc '144A' 5.250% 15-Jul-2027 | 1.010.429 | 0,14 |
| 201.000 | TopBuild Corp '144A' 3.625% 15-Mar-2029 | 202.796 | 0,03 |
| 700.000 | TransDigm Inc 4.625% 15-Jan-2029 | 698.943 | 0,10 |
| 240.000 | TransDigm Inc 4.875% 01-May-2029 | 241.393 | 0,03 |
| 1.525.000 | TransDigm Inc 5.500% 15-Nov-2027 | 1.573.457 | 0,22 |
| 573.000 | TransDigm Inc 6.375% 15-Jun-2026 | 589.385 | 0,08 |
| 660.000 | TransDigm Inc 7.500% 15-Mar-2027 | 690.360 | 0,09 |
| 1.968.000 | TransDigm Inc '144A' 6.250% 15-Mar-2026 | 2.047.980 | 0,28 |
| 650.000 | TransDigm Inc '144A' 8.000% 15-Dec-2025 | 686.572 | 0,09 |
| 270.000 | TransDigm UK Holdings Plc 6.875% 15-May-2026 | 282.446 | 0,04 |
| 170.000 | Trident TPI Holdings Inc '144A' 6.625% 01-Nov-2025 | 170.602 | 0,02 |
| 125.000 | Trident TPI Holdings Inc '144A' 9.250% 01-Aug-2024 | 130.770 | 0,02 |
| 214.000 | Trinity Industries Inc 4.550% 01-Oct-2024 | 224.510 | 0,03 |
| 155.000 | Triumph Group Inc 7.750% 15-Aug-2025 | 153.999 | 0,02 |
| 537.000 | Triumph Group Inc '144A' 6.250% 15-Sep-2024 | 540.944 | 0,07 |
| 191.000 | Triumph Group Inc '144A' 8.875% 01-Jun-2024 | 208.392 | 0,03 |
| 305.000 | Trivium Packaging Finance BV '144A' 5.500% 15-Aug-2026 | 317.532 | 0,04 |
| 315.000 | Trivium Packaging Finance BV '144A' 8.500% 15-Aug-2027 | 333.428 | 0,05 |
| 130.000 | TTM Technologies Inc '144A' 4.000% 01-Mar-2029 | 129.384 | 0,02 |
| 283.000 | Tutor Perini Corp '144A' 6.875% 01-May-2025 | 285.496 | 0,04 |
| 250.000 | Victors Merger Corp '144A' 6.375% 15-May-2029 | 235.351 | 0,03 |
| 195.000 | VM Consolidated Inc '144A' 5.500% 15-Apr-2029 | 196.252 | 0,03 |
| 405.000 | Waste Pro USA Inc '144A' 5.500% 15-Feb-2026 | 403.396 | 0,06 |
| 300.000 | Watco Cos LLC / Watco Finance Corp '144A' 6.500% 15-Jun-2027 | 312.300 | 0,04 |
| 400.000 | Weir Group Plc/The '144A' 2.200% 13-May-2026 | 395.025 | 0,05 |
| 20.000 | Werner FinCo LP / Werner FinCo Inc '144A' 8.750% 15-Jul-2025 | 20.972 | 0,00 |
| 660.000 | WESCO Distribution Inc '144A' 7.125% 15-Jun-2025 | 700.442 | 0,10 |
| 450.000 | WESCO Distribution Inc '144A' 7.250% 15-Jun-2028 | 494.073 | 0,07 |
| 129.000 | XPO CNW Inc 6.700% 01-May-2034 | 158.596 | 0,02 |
| 472.000 | XPO Logistics Inc '144A' 6.250% 01-May-2025 | 494.427 | 0,07 |
| Technologie - 29.366.293 | | | |
| (31. Dezember 2020: 32.911.183) | | 29.366.293 | 4,04 |
| 115.000 | ACI Worldwide Inc '144A' 5.750% 15-Aug-2026 | 120.004 | 0,02 |
| 346.000 | Amkor Technology Inc '144A' 6.625% 15-Sep-2027 | 366.040 | 0,05 |
| 520.000 | ams AG '144A' 7.000% 31-Jul-2025 | 552.012 | 0,08 |
| 228.000 | Austin BidCo Inc '144A' 7.125% 15-Dec-2028 | 235.734 | 0,03 |
| 540.000 | Black Knight InfoServ LLC '144A' 3.625% 01-Sep-2028 | 540.124 | 0,07 |
| 350.000 | Booz Allen Hamilton Inc '144A' 3.875% 01-Sep-2028 | 356.627 | 0,05 |
| 200.000 | Booz Allen Hamilton Inc '144A' 4.000% 01-Jul-2029 | 206.787 | 0,03 |
| 120.000 | Boxer Parent Co Inc '144A' 7.125% 02-Oct-2025 | 125.981 | 0,02 |
| 80.000 | Camelot Finance SA '144A' 4.500% 01-Nov-2026 | 82.886 | 0,01 |
| 260.000 | CDK Global Inc 4.875% 01-Jun-2027 | 269.392 | 0,04 |
| 145.000 | CDK Global Inc 5.000% 15-Oct-2024 | 158.275 | 0,02 |
| 320.000 | CDK Global Inc '144A' 5.250% 15-May-2029 | 339.666 | 0,05 |
| 650.000 | Change Healthcare Holdings LLC / Change Healthcare Finance Inc '144A' 5.750% 01-Mar-2025 | 656.363 | 0,09 |
| 180.000 | Clarivate Science Holdings Corp '144A' 3.875% 01-Jul-2028 | 181.263 | 0,02 |
| 375.000 | Clarivate Science Holdings Corp '144A' 4.875% 01-Jul-2029 | 381.469 | 0,05 |
| 125.000 | Conduent Business Services LLC / Conduent State & Local Solutions Inc '144A' 6.000% 01-Nov-2029 | 123.386 | 0,02 |
| 520.000 | Consensus Cloud Solutions Inc '144A' 6.000% 15-Oct-2026 | 541.421 | 0,07 |
| 300.000 | Consensus Cloud Solutions Inc '144A' 6.500% 15-Oct-2028 | 313.926 | 0,04 |
| 300.000 | Crowdstrike Holdings Inc 3.000% 15-Feb-2029 | 296.717 | 0,04 |
| 35.000 | Diebold Nixdorf Inc 8.500% 15-Apr-2024 | 35.036 | 0,00 |
| 85.000 | Diebold Nixdorf Inc '144A' 9.375% 15-Jul-2025 | 91.616 | 0,01 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettöver- mögen % |
|--|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Technologie Forts. | | | |
| 509.000 | Dun & Bradstreet Corp/The '144A' 6.875% 15-Aug-2026 | 529.910 | 0,07 |
| 105.000 | Elastic NV '144A' 4,125% 15-Jul-2029 | 104.057 | 0,01 |
| 530.000 | Entegris Inc '144A' 3,625% 01-May-2029 | 532.086 | 0,07 |
| 113.000 | Entegris Inc '144A' 4,375% 15-Apr-2028 | 116.548 | 0,02 |
| 600.000 | Exela Intermediate LLC / Exela Finance Inc '144A' 10,000% 15-Jul-2023 | 476.541 | 0,07 |
| 147.000 | Fair Isaac Corp '144A' 4,000% 15-Jun-2028 | 151.304 | 0,02 |
| 300.000 | MicroStrategy Inc '144A' 6,125% 15-Jun-2028 | 301.059 | 0,04 |
| 340.000 | MSCI Inc '144A' 3,250% 15-Aug-2033 | 344.354 | 0,05 |
| 555.000 | MSCI Inc '144A' 3,625% 01-Sep-2030 | 568.342 | 0,08 |
| 190.000 | MSCI Inc '144A' 3,625% 01-Nov-2031 | 197.398 | 0,03 |
| 470.000 | MSCI Inc '144A' 3,875% 15-Feb-2031 | 490.114 | 0,07 |
| 290.000 | MSCI Inc '144A' 4,000% 15-Nov-2029 | 303.531 | 0,04 |
| 425.000 | NCR Corp '144A' 5,000% 01-Oct-2028 | 438.396 | 0,06 |
| 430.000 | NCR Corp '144A' 5,125% 15-Apr-2029 | 445.914 | 0,06 |
| 185.000 | NCR Corp '144A' 5,250% 01-Oct-2030 | 190.364 | 0,03 |
| 414.000 | NCR Corp '144A' 5,750% 01-Sep-2027 | 433.044 | 0,06 |
| 45.000 | NCR Corp '144A' 6,125% 01-Sep-2029 | 48.277 | 0,01 |
| 145.000 | Nuance Communications Inc 5,625% 15-Dec-2026 | 149.763 | 0,02 |
| 655.000 | ON Semiconductor Corp '144A' 3,875% 01-Sep-2028 | 672.315 | 0,09 |
| 760.000 | Open Text Corp '144A' 3,875% 15-Feb-2028 | 775.800 | 0,11 |
| 500.000 | Open Text Corp '144A' 3,875% 01-Dec-2029 | 507.080 | 0,07 |
| 650.000 | Open Text Holdings Inc '144A' 4,125% 15-Feb-2030 | 670.501 | 0,09 |
| 110.000 | Pitney Bowes Inc '144A' 6,875% 15-Mar-2027 | 112.860 | 0,02 |
| 460.000 | Pitney Bowes Inc '144A' 7,250% 15-Mar-2029 | 473.296 | 0,06 |
| 165.000 | Playtika Holding Corp '144A' 4,250% 15-Mar-2029 | 161.950 | 0,02 |
| 254.000 | Presidio Holdings Inc '144A' 4,875% 01-Feb-2027 | 261.889 | 0,04 |
| 255.000 | Presidio Holdings Inc '144A' 8,250% 01-Feb-2028 | 271.936 | 0,04 |
| 280.000 | PTC Inc '144A' 3,625% 15-Feb-2025 | 284.145 | 0,04 |
| 35.000 | PTC Inc '144A' 4,000% 15-Feb-2028 | 35.669 | 0,00 |
| 400.000 | Rackspace Technology Global Inc '144A' 3,500% 15-Feb-2028 | 381.394 | 0,05 |
| 425.000 | Rackspace Technology Global Inc '144A' 5,375% 01-Dec-2028 | 414.987 | 0,06 |
| 950.000 | ROBLOX Corp '144A' 3,875% 01-May-2030 | 965.209 | 0,13 |
| 340.000 | Rocket Software Inc '144A' 6,500% 15-Feb-2029 | 332.182 | 0,05 |
| 125.000 | Science Applications International Corp '144A' 4,875% 01-Apr-2028 | 128.315 | 0,02 |
| 342.000 | Seagate HDD Cayman 3,125% 15-Jul-2029 | 334.763 | 0,05 |
| 230.000 | Seagate HDD Cayman 3,375% 15-Jul-2031 | 224.786 | 0,03 |
| 860.000 | Seagate HDD Cayman 4,091% 01-Jun-2029 | 891.334 | 0,12 |
| 865.000 | Seagate HDD Cayman 4,125% 15-Jan-2031 | 901.187 | 0,12 |
| 960.000 | Seagate HDD Cayman 4,750% 01-Jun-2023 | 1.004.419 | 0,14 |
| 765.000 | Seagate HDD Cayman 4,750% 01-Jan-2025 | 819.357 | 0,11 |
| 735.000 | Seagate HDD Cayman 4,875% 01-Mar-2024 | 780.166 | 0,11 |
| 785.000 | Seagate HDD Cayman 4,875% 01-Jun-2027 | 856.435 | 0,12 |
| 460.000 | Seagate HDD Cayman 5,750% 01-Dec-2034 | 530.803 | 0,07 |
| 825.000 | SS&C Technologies Inc '144A' 5,500% 30-Sep-2027 | 863.119 | 0,12 |
| 250.000 | Tempo Acquisition LLC / Tempo Acquisition Finance Corp '144A' 5,750% 01-Jun-2025 | 259.629 | 0,04 |
| 200.000 | Twilio Inc 3,875% 15-Mar-2031 | 202.227 | 0,03 |
| 190.000 | Unisys Corp '144A' 6,875% 01-Nov-2027 | 205.960 | 0,03 |
| 459.000 | Vericast Corp '144A' 11,000% 15-Sep-2026 | 487.114 | 0,07 |
| 635.000 | Veritas US Inc / Veritas Bermuda Ltd '144A' 7,500% 01-Sep-2025 | 658.054 | 0,09 |
| 315.000 | Xerox Corp 4,375% 15-Mar-2023 | 325.789 | 0,04 |
| 135.000 | Xerox Corp 4,800% 01-Mar-2035 | 136.515 | 0,02 |
| 175.000 | Xerox Corp 6,750% 15-Dec-2039 | 195.412 | 0,03 |
| 330.000 | Xerox Holdings Corp '144A' 5,000% 15-Aug-2025 | 350.146 | 0,05 |
| 575.000 | Xerox Holdings Corp '144A' 5,500% 15-Aug-2028 | 606.901 | 0,08 |
| 300.000 | Ziff Davis Inc '144A' 4,625% 15-Oct-2030 | 308.204 | 0,04 |
| 180.000 | ZoomInfo Technologies LLC/ZoomInfo Finance Corp '144A' 3,875% 01-Feb-2029 | 178.718 | 0,02 |
| Versorger - 18.202.400 | | | |
| (31. Dezember 2020: 22.182.877) | | 18.202.400 | 2,51 |
| 115.000 | AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp 5,500% 20-May-2025 | 123.309 | 0,02 |
| 171.000 | AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp 5,625% 20-May-2024 | 185.051 | 0,02 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettöver- mögen % |
|-------------------------|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Versorger Forts. | | | |
| 149.000 | AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp 5,750% 20-May-2027 | 164.980 | 0,02 |
| 70.000 | AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp 5,875% 20-Aug-2026 | 78.366 | 0,01 |
| 350.000 | Calpine Corp '144A' 3,750% 01-Mar-2031 | 340.053 | 0,05 |
| 469.000 | Calpine Corp '144A' 4,500% 15-Feb-2028 | 486.226 | 0,07 |
| 250.000 | Calpine Corp '144A' 4,625% 01-Feb-2029 | 246.941 | 0,03 |
| 350.000 | Calpine Corp '144A' 5,000% 01-Feb-2031 | 350.541 | 0,05 |
| 505.000 | Calpine Corp '144A' 5,125% 15-Mar-2028 | 513.474 | 0,07 |
| 248.000 | Calpine Corp '144A' 5,250% 01-Jun-2026 | 254.749 | 0,03 |
| 265.000 | Clearway Energy Operating LLC '144A' 3,750% 15-Feb-2031 | 264.746 | 0,04 |
| 243.000 | Clearway Energy Operating LLC '144A' 4,750% 15-Mar-2028 | 255.811 | 0,03 |
| 114.000 | DPL Inc 4,350% 15-Apr-2029 | 121.289 | 0,02 |
| 300.000 | Drax Finco Plc '144A' 6,625% 01-Nov-2025 | 310.105 | 0,04 |
| 210.000 | EnfraGen Energia Sur SA / EnfraGen Spain SA / Prime Energia SpA '144A' 5,375% 30-Dec-2030 | 191.927 | 0,03 |
| 55.000 | FirstEnergy Corp 1,600% 15-Jan-2026 | 53.349 | 0,01 |
| 150.000 | FirstEnergy Corp 2,050% 01-Mar-2025 | 149.287 | 0,02 |
| 430.000 | FirstEnergy Corp 2,250% 01-Sep-2030 | 415.030 | 0,06 |
| 495.000 | FirstEnergy Corp 2,650% 01-Mar-2030 | 490.050 | 0,07 |
| 520.000 | FirstEnergy Corp 3,400% 01-Mar-2050 | 510.900 | 0,07 |
| 950.000 | FirstEnergy Corp 4,400% 15-Jul-2027 | 1.024.446 | 0,14 |
| 600.000 | FirstEnergy Corp 4,750% 15-Mar-2023 | 624.750 | 0,09 |
| 640.000 | FirstEnergy Corp 5,350% 15-Jul-2047 | 763.649 | 0,10 |
| 680.000 | FirstEnergy Corp 7,375% 15-Nov-2031 | 919.292 | 0,13 |
| 80.000 | FirstEnergy Transmission LLC '144A' 2,866% 15-Sep-2028 | 80.277 | 0,01 |
| 100.000 | FirstEnergy Transmission LLC '144A' 4,350% 15-Jan-2025 | 106.428 | 0,01 |
| 310.000 | FirstEnergy Transmission LLC '144A' 4,550% 01-Apr-2049 | 355.968 | 0,05 |
| 165.000 | FirstEnergy Transmission LLC '144A' 5,450% 15-Jul-2044 | 209.269 | 0,03 |
| 265.000 | InterGen NV '144A' 7,000% 30-Jun-2023 | 263.012 | 0,04 |
| 130.265 | Midland Cogeneration Venture LP '144A' 6,000% 15-Mar-2025 | 134.263 | 0,02 |
| 235.000 | NextEra Energy Operating Partners LP '144A' 3,875% 15-Oct-2026 | 249.492 | 0,03 |
| 359.000 | NextEra Energy Operating Partners LP '144A' 4,250% 15-Jul-2024 | 373.355 | 0,05 |
| 115.000 | NextEra Energy Operating Partners LP '144A' 4,500% 15-Sep-2027 | 124.315 | 0,02 |
| 288.000 | NRG Energy Inc 5,750% 15-Jan-2028 | 304.883 | 0,04 |
| 367.000 | NRG Energy Inc '144A' 3,375% 15-Feb-2029 | 360.150 | 0,05 |
| 430.000 | NRG Energy Inc '144A' 3,625% 15-Feb-2031 | 419.985 | 0,06 |
| 600.000 | NRG Energy Inc '144A' 3,875% 15-Feb-2032 | 588.951 | 0,08 |
| 211.000 | NRG Energy Inc '144A' 5,250% 15-Jun-2029 | 226.361 | 0,03 |
| 344.000 | Pattern Energy Operations LP / Pattern Energy Operations Inc '144A' 4,500% 15-Aug-2028 | 357.437 | 0,05 |
| 490.000 | PG&E Corp 5,000% 01-Jul-2028 | 516.254 | 0,07 |
| 490.000 | PG&E Corp 5,250% 01-Jul-2030 | 514.743 | 0,07 |
| 300.000 | Pike Corp '144A' 5,500% 01-Sep-2028 | 301.110 | 0,04 |
| 215.000 | Rockpoint Gas Storage Canada Ltd '144A' 7,000% 31-Mar-2023 | 215.738 | 0,03 |
| 330.000 | Solaris Midstream Holdings LLC '144A' 7,625% 01-Apr-2026 | 346.843 | 0,05 |
| 100.000 | Talen Energy Supply LLC 6,500% 01-Jun-2025 | 39.896 | 0,00 |
| 500.000 | Talen Energy Supply LLC '144A' 7,250% 15-May-2027 | 443.000 | 0,06 |
| 520.000 | Talen Energy Supply LLC '144A' 7,625% 01-Jun-2028 | 463.588 | 0,06 |
| 115.000 | Terraform Global Operating LLC '144A' 6,125% 01-Mar-2026 | 117.605 | 0,02 |
| 115.000 | TransAlta Corp 4,500% 15-Nov-2022 | 116.868 | 0,02 |
| 6.000 | TransAlta Corp 6,500% 15-Mar-2040 | 6.966 | 0,00 |
| 790.000 | Vistra Operations Co LLC '144A' 4,375% 01-May-2029 | 792.880 | 0,11 |
| 542.000 | Vistra Operations Co LLC '144A' 5,000% 31-Jul-2027 | 563.170 | 0,08 |
| 337.000 | Vistra Operations Co LLC '144A' 5,500% 01-Sep-2026 | 348.453 | 0,05 |
| 410.000 | Vistra Operations Co LLC '144A' 5,625% 15-Feb-2027 | 422.819 | 0,06 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % |
|---|---|----------------------------|-----------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Versorger Forts. | | | |
| Gesamtanlagen in Anleihen | | 699.100.009 | 96,21 |
| Aktien | | | |
| Energie - 3.934 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | 3.934 | 0,00 |
| 61 | Chesapeake Energy Corp | 3.934 | 0,00 |
| Gesamtanlagen in Aktien | | 3.934 | 0,00 |
| Optionsscheine | | | |
| Energie - 3.742 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | 3.742 | 0,00 |
| 115 | Chesapeake Energy Corp (WTS) 09-Feb-2026 | 3.742 | 0,00 |
| Gesamtanlagen in Optionsscheinen | | 3.742 | 0,00 |
| Credit Default Swaps - 4.353.157 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.986.419) | | | |
| (47.300.000) | CDS CDX North America High Yield Index Series 37 5.000% 20-Dec-2026 | 4.353.157 | 0,60 |
| Credit Default Swaps insgesamt | | 4.353.157 | 0,60 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 10.495.044 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 9.442.896) | | | |
| | | 10.495.044 | 1,44 |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | 713.955.886 | 98,25 |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (4.088.433) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (333.500)) | | | |
| | | (4.088.433) | (0,56) |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | (4.088.433) | (0,56) |
| Nettoumlaufvermögen | | 16.744.250 | 2,31 |
| Summe Nettovermögen | | 726.611.703 | 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 | 95,20 |
| OTC-derivative Finanzinstrumente | 2,02 |
| Sonstiges Umlaufvermögen | 2,78 |
| Gesamtvermögen | 100,00 |

| Devisenterminkontrakte | | | | | | | Nicht realisierter Gewinn/Verlust |
|--|-----------|------------|------------|------------------|-----------------------------|------------|-----------------------------------|
| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | | |
| BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR E (Acc) (Hedged) | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 170.000 | 192.472 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.114 | |
| Euro | US-Dollar | 275.811 | 312.706 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.370 | |
| Euro | US-Dollar | 40.352.121 | 45.665.985 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 284.449 | |
| | | | | | | USD | 286.933 |
| | | | | | | EUR | 252.027 |
| US-Dollar | Euro | 192.426 | 170.000 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1.119) | |
| | | | | | | USD | (1.119) |
| | | | | | | EUR | (983) |
| BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged) | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 93 | 105 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - | |
| Euro | US-Dollar | 14.151 | 16.014 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 100 | |
| | | | | | | USD | 100 |
| | | | | | | EUR | 88 |
| BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR K (Acc) (Hedged) | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 87 | 99 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - | |
| Euro | US-Dollar | 13.151 | 14.883 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 93 | |
| | | | | | | USD | 93 |
| | | | | | | EUR | 82 |
| BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR L (Acc) (Hedged) | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 87.645 | 99.241 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 564 | |
| Euro | US-Dollar | 1.873.927 | 2.121.634 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 12.275 | |
| Euro | US-Dollar | 303.426 | 344.016 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.507 | |
| Euro | US-Dollar | 296.946 | 335.759 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 2.385 | |
| Euro | US-Dollar | 111.785 | 127.002 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 292 | |
| Euro | US-Dollar | 44.441.273 | 50.293.627 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 313.274 | |
| Euro | US-Dollar | 63.526 | 72.060 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 279 | |
| Euro | US-Dollar | 184.019 | 207.766 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.784 | |
| Euro | US-Dollar | 203.634 | 229.815 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 2.070 | |
| Euro | US-Dollar | 112.297 | 126.289 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.588 | |
| Euro | US-Dollar | 41.903 | 47.353 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 363 | |
| Euro | US-Dollar | 74.026 | 83.409 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 887 | |
| Euro | US-Dollar | 67.066 | 75.766 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 604 | |
| Euro | US-Dollar | 98.937 | 112.106 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 557 | |
| | | | | | | USD | 338.429 |
| | | | | | | EUR | 297.258 |
| US-Dollar | Euro | 2.121.129 | 1.873.927 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (12.338) | |
| US-Dollar | Euro | 98.220 | 87.645 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (566) | |
| US-Dollar | Euro | 36.210 | 32.024 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (257) | |
| US-Dollar | Euro | 2.350 | 2.068 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (5) | |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte Forts.

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

BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR L (Acc) (Hedged) Forts.

| | | | | | | |
|-----------|------|---------|---------|-------------|-----------------------------|-----------------|
| US-Dollar | Euro | 441 | 390 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (3) |
| US-Dollar | Euro | 122.844 | 108.737 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (980) |
| US-Dollar | Euro | 10.875 | 9.597 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (54) |
| US-Dollar | Euro | 180.808 | 160.776 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (2.274) |
| US-Dollar | Euro | 225.190 | 199.536 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (2.029) |
| US-Dollar | Euro | 176.122 | 155.263 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (681) |
| US-Dollar | Euro | 296.977 | 261.859 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1.211) |
| | | | | | USD | (20.398) |
| | | | | | EUR | (17.917) |

BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged)

| | | | | | | |
|------|-----------|------------|------------|-------------|-----------------------------|----------------|
| Euro | US-Dollar | 191.767 | 217.420 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 952 |
| Euro | US-Dollar | 28.653.544 | 32.426.853 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 201.984 |
| Euro | US-Dollar | 15.000 | 17.012 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 69 |
| Euro | US-Dollar | 30.000 | 33.871 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 291 |
| | | | | | USD | 203.296 |
| | | | | | EUR | 178.565 |

BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse G (Acc) (Hedged)

| | | | | | | |
|------|-----------|--------|--------|-------------|-----------------------------|------------|
| Euro | US-Dollar | 573 | 650 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 3 |
| Euro | US-Dollar | 63.919 | 72.337 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 451 |
| Euro | US-Dollar | 30.000 | 34.023 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 139 |
| Euro | US-Dollar | 12.495 | 14.175 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 54 |
| | | | | | USD | 647 |
| | | | | | EUR | 568 |

BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling E (Acc) (Hedged)

| | | | | | | |
|----------------|----------------|-------------|-------------|-------------|-----------------------------|--------------------|
| Pfund Sterling | US-Dollar | 171.772.289 | 226.930.014 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 5.573.568 |
| | | | | | USD | 5.573.568 |
| | | | | | GBP | 4.117.741 |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 110.311.645 | 83.397.408 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (2.568.214) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 2.888.685 | 2.185.500 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (69.427) |
| | | | | | USD | (2.637.641) |
| | | | | | GBP | (1.948.684) |

BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling L (Acc) (Hedged)

| | | | | | | |
|----------------|-----------|--------|--------|-------------|-----------------------------|------------|
| Pfund Sterling | US-Dollar | 85 | 115 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 12.099 | 15.983 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 393 |
| | | | | | USD | 393 |
| | | | | | GBP | 290 |

Devisenterminkontrakte Forts.

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

BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling L (Inc) (Hedged)

| | | | | | | |
|----------------|----------------|------------|------------|-------------|-----------------------------|----------------|
| Pfund Sterling | US-Dollar | 156.928 | 212.072 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 332 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 22.592.717 | 29.846.586 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 733.054 |
| | | | | | USD | 733.386 |
| | | | | | GBP | 541.824 |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 51.087 | 38.602 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1.162) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 6.406 | 4.793 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (82) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 60.850 | 45.966 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1.366) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 60.169 | 45.140 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (929) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 60.692 | 45.744 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1.223) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 61.357 | 46.383 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1.424) |

BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling W (Inc) (Hedged)

| | | | | | | |
|----------------|-----------|------------|------------|-------------|-----------------------------|----------------|
| Pfund Sterling | US-Dollar | 100.582 | 135.926 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 213 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 14.876.113 | 19.652.403 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 482.677 |
| | | | | | USD | 482.890 |
| | | | | | GBP | 356.758 |

| | | | | | | |
|-----------|----------------|---------|---------|-------------|-----------------------------|-----------------|
| US-Dollar | Pfund Sterling | 670.659 | 503.142 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (10.353) |
| | | | | | USD | (10.353) |
| | | | | | GBP | (7.649) |

BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling X (Acc) (Hedged)

| | | | | | | |
|----------------|----------------|------------|------------|-------------|-----------------------------|--------------------|
| Pfund Sterling | US-Dollar | 45.070.925 | 59.541.897 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.462.393 |
| | | | | | USD | 1.462.393 |
| | | | | | GBP | 1.080.413 |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 59.574.977 | 45.058.678 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1.412.736) |
| | | | | | USD | (1.412.736) |
| | | | | | GBP | (1.043.727) |

BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Anteilsklasse Sterling X (Inc) (Hedged)

| | | | | | | |
|----------------|-----------|------------|------------|-------------|-----------------------------|------------------|
| Pfund Sterling | US-Dollar | 280.698 | 376.472 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 3.457 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 10.000 | 13.238 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 297 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 45.058.678 | 59.578.552 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.409.162 |
| | | | | | USD | 1.412.916 |
| | | | | | GBP | 1.043.860 |

BNY MELLON EMERGING MARKETS CORPORATE DEBT FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|---|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| Supranational - 28.749.161 | | | |
| (31. Dezember 2020: 7.896.733) | | | |
| 28.749.161 | Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund | 28.749.161 | 5,19 |
| Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen | | 28.749.161 | 5,19 |
| Anleihen | | | |
| Argentinien - 13.407.785 | | | |
| (31. Dezember 2020: 8.600.172) | | | |
| 1.508.000 | Banco Macro SA 'REGS' FRN 6.750% 04-Nov-2026 | 1.258.879 | 0,23 |
| 2.000.000 | Pampa Energia SA 'REGS' 7.500% 24-Jan-2027 | 1.727.100 | 0,31 |
| 3.400.000 | YPF Energia Electrica SA 'REGS' 10.000% 25-Jul-2026 | 2.989.348 | 0,54 |
| 10.657.000 | YPF SA 'REGS' 8.500% 27-Jun-2029 | 7.432.458 | 1,34 |
| Brasilien - 40.166.059 | | | |
| (31. Dezember 2020: 32.075.758) | | | |
| 3.180.000 | Azul Investments LLP 'REGS' 5.875% 26-Oct-2024 | 2.966.336 | 0,54 |
| 3.730.000 | Azul Investments LLP 'REGS' 7.250% 15-Jun-2026 | 3.421.529 | 0,62 |
| 5.000.000 | Banco BTG Pactual SA/Cayman Islands 4.500% 10-Jan-2025 | 5.050.805 | 0,91 |
| 1.500.000 | Braskem Netherlands Finance BV 'REGS' 4.500% 10-Jan-2028 | 1.605.090 | 0,29 |
| 2.000.000 | Braskem Netherlands Finance BV 'REGS' 5.875% 31-Jan-2050 | 2.334.310 | 0,42 |
| 2.300.000 | FS Luxembourg Sarl 'REGS' 10.000% 15-Dec-2025 | 2.532.817 | 0,46 |
| 2.000.000 | Itau Unibanco Holding SA/Cayman Island 'REGS' FRN (Perpetual) 4.625% 27-Feb-2025 | 1.875.530 | 0,34 |
| 4.760.000 | MARB BondCo Plc 'REGS' 3.950% 29-Jan-2031 | 4.559.509 | 0,82 |
| 2.600.000 | Minerva Luxembourg SA 'REGS' 4.375% 18-Mar-2031 | 2.514.291 | 0,45 |
| 2.800.000 | Petrobras Global Finance BV 5.500% 10-Jun-2051 | 2.602.614 | 0,47 |
| 6.530.000 | Rumo Luxembourg Sarl 'REGS' 4.200% 18-Jan-2032 | 6.170.850 | 1,11 |
| 2.910.000 | StoneCo Ltd 'REGS' 3.950% 16-Jun-2028 | 2.572.978 | 0,47 |
| 2.000.000 | Suzano Austria GmbH 3.125% 15-Jan-2032 | 1.959.400 | 0,35 |
| Burkina Faso - 4.974.050 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 5.000.000 | Endeavour Mining Plc 'REGS' 5.000% 14-Oct-2026 | 4.974.050 | 0,90 |
| Burundi - 5.226.034 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 5.250.000 | Eastern & Southern African Trade & Development Bank/The 'EMTN' 4.125% 30-Jun-2028 | 5.226.034 | 0,94 |
| Chile - 31.419.918 | | | |
| (31. Dezember 2020: 9.182.537) | | | |
| 2.105.000 | ATP Tower Holdings LLC / Andean Tower Partners Colombia SAS / Andean Telecom Par 'REGS' 4.050% 27-Apr-2026 | 2.098.895 | 0,38 |
| 3.000.000 | Banco Santander Chile 'REGS' 3.177% 26-Oct-2031 | 3.076.695 | 0,56 |
| 3.040.000 | CAP SA 'REGS' 3.900% 27-Apr-2031 | 2.869.000 | 0,52 |
| 2.000.000 | Colbun SA 'REGS' 3.150% 06-Mar-2030 | 2.008.250 | 0,36 |
| 3.150.000 | Colbun SA 'REGS' 3.150% 19-Jan-2032 | 3.121.445 | 0,56 |
| 1.500.000 | Embotelladora Andina SA 'REGS' 3.950% 21-Jan-2050 | 1.551.840 | 0,28 |
| 4.000.000 | Empresa de los Ferrocarriles del Estado 'REGS' 3.068% 18-Aug-2050 | 3.426.680 | 0,62 |
| 2.940.000 | Empresa Nacional de Telecomunicaciones SA 'REGS' 3.050% 14-Sep-2032 | 2.893.357 | 0,52 |
| 3.580.000 | Kenbourne Invest SA 'REGS' 4.700% 22-Jan-2028 | 3.510.315 | 0,63 |
| 5.400.000 | Sociedad Quimica y Minera de Chile SA 'REGS' 3.500% 10-Sep-2051 | 5.239.053 | 0,95 |
| 1.500.000 | Sociedad Quimica y Minera de Chile SA 'REGS' 4.250% 22-Jan-2050 | 1.624.388 | 0,29 |
| China - 18.487.192 | | | |
| (31. Dezember 2020: 34.920.906) | | | |
| 1.700.000 | CDBL Funding 2 'EMTN' 2.000% 04-Mar-2026 | 1.689.597 | 0,30 |
| 7.400.000 | Fortune Star BVI Ltd 3.950% 02-Oct-2026 | 7.942.251 | 1,43 |
| 1.000.000 | Redsun Properties Group Ltd 7.300% 13-Jan-2025 | 423.350 | 0,08 |
| 2.800.000 | Shimao Group Holdings Ltd 3.450% 11-Jan-2031 | 1.593.452 | 0,29 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|--|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| China Forts. | | | |
| 1.000.000 | Sunac China Holdings Ltd 5.950% 26-Apr-2024 | 642.500 | 0,11 |
| 1.500.000 | Sunac China Holdings Ltd 6.500% 26-Jan-2026 | 933.750 | 0,17 |
| 950.000 | Sunac China Holdings Ltd 6.650% 03-Aug-2024 | 605.625 | 0,11 |
| 2.500.000 | Tencent Holdings Ltd 'REGS' 3.240% 03-Jun-2050 | 2.343.642 | 0,42 |
| 1.400.000 | Yuzhou Group Holdings Co Ltd 6.000% 25-Oct-2023 | 437.850 | 0,08 |
| 1.400.000 | Yuzhou Group Holdings Co Ltd 8.500% 04-Feb-2023 | 472.850 | 0,08 |
| 1.600.000 | Yuzhou Group Holdings Co Ltd 8.500% 26-Feb-2024 | 484.400 | 0,09 |
| 1.110.000 | Zhenro Properties Group Ltd 7.350% 05-Feb-2025 | 713.175 | 0,13 |
| 300.000 | Zhenro Properties Group Ltd 9.150% 06-May-2023 | 204.750 | 0,04 |
| Kolumbien - 26.068.974 | | | |
| (31. Dezember 2020: 17.462.384) | | | |
| 2.000.000 | Al Candelaria Spain SA 'REGS' 5.750% 15-Jun-2033 | 1.937.810 | 0,35 |
| 2.000.000 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria Colombia SA 'REGS' 4.875% 21-Apr-2025 | 2.070.400 | 0,37 |
| 1.000.000 | Banco de Bogota SA 'REGS' 4.375% 03-Aug-2027 | 1.027.260 | 0,19 |
| 2.000.000 | Bancolombia SA FRN 4.625% 18-Dec-2029 | 2.003.030 | 0,36 |
| 7.300.000 | Ecopetrol SA 5.875% 28-May-2045 | 7.002.853 | 1,26 |
| 1.640.000 | Frontera Energy Corp 'REGS' 7.875% 21-Jun-2028 | 1.527.726 | 0,28 |
| 3.200.000 | GCM Mining Corp 'REGS' 6.875% 09-Aug-2026 | 3.211.328 | 0,58 |
| 3.658.000 | Geopark Ltd 'REGS' 5.500% 17-Jan-2027 | 3.574.232 | 0,64 |
| 2.400.000 | Grupo Energia Bogota SA ESP 'REGS' 4.875% 15-May-2030 | 2.589.420 | 0,47 |
| 1.130.000 | Oleoducto Central SA 'REGS' 4.000% 14-Jul-2027 | 1.124.915 | 0,20 |
| Zypern - 4.903.955 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 4.185.000 | Bank of Cyprus Holdings Plc 'EMTN' FRN 6.625% 23-Oct-2031 | 4.903.955 | 0,88 |
| Ägypten - 8.432.010 | | | |
| (31. Dezember 2020: 2.203.053) | | | |
| 1.000.000 | African Export-Import Bank/The 'EMTN' 4.125% 20-Jun-2024 | 1.051.520 | 0,19 |
| 4.000.000 | African Export-Import Bank/The 'REGS' 3.798% 17-May-2031 | 4.085.440 | 0,74 |
| 3.300.000 | Energean Plc 'REGS' 6.500% 30-Apr-2027 | 3.295.050 | 0,59 |
| Ghana - 3.288.800 | | | |
| (31. Dezember 2020: 2.395.264) | | | |
| 4.000.000 | Tullow Oil Plc 'REGS' 7.000% 01-Mar-2025 | 3.288.800 | 0,59 |
| Guatemala - 1.935.396 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 1.800.000 | Investment Energy Resources Ltd 'REGS' 6.250% 26-Apr-2029 | 1.935.396 | 0,35 |
| Hongkong - 1.215.159 | | | |
| (31. Dezember 2020: 2.981.792) | | | |
| 1.200.000 | CK Hutchison International 20 Ltd 'REGS' 2.500% 08-May-2030 | 1.215.159 | 0,22 |
| Indien - 27.028.566 | | | |
| (31. Dezember 2020: 9.141.388) | | | |
| 7.230.000 | Adani Ports & Special Economic Zone Ltd 'REGS' 3.100% 02-Feb-2031 | 6.889.254 | 1,24 |
| 2.500.000 | Bharti Airtel Ltd 'REGS' 4.375% 10-Jun-2025 | 2.665.649 | 0,48 |
| 7.786.000 | HDFC Bank Ltd 'REGS' FRN (Perpetual) 3.700% 25-Aug-2026 | 7.786.000 | 1,40 |
| 2.000.000 | JSW Steel Ltd 'REGS' 5.050% 05-Apr-2032 | 1.970.901 | 0,36 |
| 8.000.000 | UltraTech Cement Ltd 'REGS' 2.800% 16-Feb-2031 | 7.716.762 | 1,39 |
| Indonesien - 29.760.631 | | | |
| (31. Dezember 2020: 13.401.780) | | | |
| 1.500.000 | Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT 'EMTN' 3.750% 30-Mar-2026 | 1.524.789 | 0,28 |
| 1.400.000 | Indika Energy Capital IV Pte Ltd 'REGS' 8.250% 22-Oct-2025 | 1.457.764 | 0,26 |
| 7.000.000 | Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT 3.398% 09-Jun-2031 | 7.077.587 | 1,28 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|--|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Indonesien Forts. | | | |
| 6.400.000 | Medco Laurel Tree Pte Ltd 'REGS' 6.950% 12-Nov-2028 | 6.349.829 | 1,15 |
| 1.100.000 | Medco Platinum Road Pte Ltd 'REGS' 6.750% 30-Jan-2025 | 1.124.607 | 0,20 |
| 5.300.000 | Pertamina Persero PT 'REGS' 2.300% 09-Feb-2031 | 5.067.769 | 0,91 |
| 4.200.000 | Pertamina Persero PT 'REGS' 4.150% 25-Feb-2060 | 4.232.940 | 0,76 |
| 2.900.000 | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 'REGS' 4.375% 05-Feb-2050 | 2.925.346 | 0,53 |
| Israel - 13.449.784 | | | |
| (31. Dezember 2020: 7.828.667) | | | |
| 1.800.000 | Altice Finco SA 'REGS' 4.750% 15-Jan-2028 | 1.943.837 | 0,35 |
| 7.000.000 | Bank Hapoalim BM '144A' FRN 3.255% 21-Jan-2032 | 6.965.000 | 1,26 |
| 1.457.627 | Leviathan Bond Ltd '144A' 6.750% 30-Jun-2030 | 1.570.895 | 0,28 |
| 2.000.000 | Mizrahi Tefahot Bank Ltd '144A' FRN 3.077% 07-Apr-2031 | 1.992.500 | 0,36 |
| 800.000 | Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 6.000% 31-Jan-2025 | 977.552 | 0,17 |
| Jordanien - 1.234.140 | | | |
| (31. Dezember 2020: 3.337.600) | | | |
| 1.200.000 | Hikma Finance USA LLC 3.250% 09-Jul-2025 | 1.234.140 | 0,22 |
| Kasachstan - 1.329.303 | | | |
| (31. Dezember 2020: 817.262) | | | |
| 350.000.000 | Development Bank of Kazakhstan JSC 'REGS' 8.950% 04-May-2023 | 809.478 | 0,15 |
| 500.000 | KazMunayGas National Co JSC 'REGS' 3.500% 14-Apr-2033 | 519.825 | 0,09 |
| Kuwait - 12.843.138 | | | |
| (31. Dezember 2020: 6.743.480) | | | |
| 5.000.000 | Burgan Bank SAK FRN 2.750% 15-Dec-2031 | 4.546.500 | 0,82 |
| 8.500.000 | NBK SPC Ltd 'REGS' FRN 1.625% 15-Sep-2027 | 8.296.638 | 1,50 |
| Litauen - 4.529.608 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 4.200.000 | Akropolis Group Uab 2.875% 02-Jun-2026 | 4.529.608 | 0,82 |
| Luxemburg - 4.426.172 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 1.500.000 | Altice Financing SA 'REGS' 2.250% 15-Jan-2025 | 1.663.633 | 0,30 |
| 2.400.000 | Outlinan Holdco Scsp 'REGS' 4.625% 15-Oct-2026 | 2.762.539 | 0,50 |
| Macau - 12.902.695 | | | |
| (31. Dezember 2020: 8.108.295) | | | |
| 2.500.000 | MGM China Holdings Ltd '144A' 4.750% 01-Feb-2027 | 2.459.787 | 0,45 |
| 5.350.000 | MGM China Holdings Ltd 'REGS' 4.750% 01-Feb-2027 | 5.263.945 | 0,95 |
| 2.000.000 | MGM China Holdings Ltd 'REGS' 5.250% 18-Jun-2025 | 1.987.120 | 0,36 |
| 2.000.000 | Wynn Macau Ltd 'REGS' 5.125% 15-Dec-2029 | 1.793.100 | 0,32 |
| 1.500.000 | Wynn Macau Ltd 'REGS' 5.500% 15-Jan-2026 | 1.398.743 | 0,25 |
| Malaysia - 4.324.533 | | | |
| (31. Dezember 2020: 4.529.273) | | | |
| 4.500.000 | Axiata Spv5 Labuan Ltd 'EMTN' 3.064% 19-Aug-2050 | 4.324.533 | 0,78 |
| Mexiko - 34.627.748 | | | |
| (31. Dezember 2020: 32.039.861) | | | |
| 3.760.000 | Alpek SAB de CV 'REGS' 3.250% 25-Feb-2031 | 3.755.996 | 0,68 |
| 1.800.000 | Alsea SAB de CV 'REGS' 7.750% 14-Dec-2026 | 1.865.115 | 0,34 |
| 2.000.000 | Banco Nacional de Comercio Exterior SNC/ Cayman Islands 'REGS' FRN 2.720% 11-Aug-2031 | 1.985.020 | 0,36 |
| 11.000.000 | Beclé SAB de CV 'REGS' 2.500% 14-Oct-2031 | 10.829.390 | 1,96 |
| 3.650.000 | Braskem Idesa SAPI 'REGS' 6.990% 20-Feb-2032 | 3.669.710 | 0,66 |
| 5.000.000 | Credito Real SAB de CV SOFOM ER 'REGS' 8.000% 21-Jan-2028 | 3.013.400 | 0,54 |
| 5.670.000 | Orbia Advance Corp SAB de CV 'REGS' 2.875% 11-May-2031 | 5.554.133 | 1,00 |
| 2.430.000 | Petroleos Mexicanos 6.950% 28-Jan-2060 | 2.163.854 | 0,39 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|--|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Mexiko Forts. | | | |
| 1.000.000 | Petroleos Mexicanos 7.690% 23-Jan-2050 | 962.225 | 0,17 |
| 1.000.000 | Unifin Financiera SAB de CV 'REGS' 8.375% 27-Jan-2028 | 828.905 | 0,15 |
| Moldawien - 5.487.794 | | | |
| (31. Dezember 2020: 3.281.250) | | | |
| 5.335.000 | Aragvi Finance International DAC 'REGS' 8.450% 29-Apr-2026 | 5.487.794 | 0,99 |
| Marokko - 10.742.232 | | | |
| (31. Dezember 2020: 3.731.231) | | | |
| 4.600.000 | OCP SA 'REGS' 3.750% 23-Jun-2031 | 4.480.538 | 0,81 |
| 5.500.000 | OCP SA 'REGS' 5.125% 23-Jun-2051 | 5.212.944 | 0,94 |
| 1.000.000 | Vivo Energy Investments BV 'REGS' 5.125% 24-Sep-2027 | 1.048.750 | 0,19 |
| Nigeria - 18.229.905 | | | |
| (31. Dezember 2020: 7.267.700) | | | |
| 4.800.000 | Access Bank Plc 'REGS' 6.125% 21-Sep-2026 | 4.791.504 | 0,87 |
| 3.600.000 | Access Bank Plc 'REGS' FRN (Perpetual) 9.125% 07-Oct-2026 | 3.527.676 | 0,64 |
| 3.900.000 | Africa Finance Corp 3.750% 30-Oct-2029 | 4.056.975 | 0,73 |
| 4.000.000 | EBN Finance Co BV 'REGS' 7.125% 16-Feb-2026 | 3.949.000 | 0,71 |
| 1.900.000 | United Bank for Africa Plc 'REGS' 6.750% 19-Nov-2026 | 1.904.750 | 0,34 |
| Panama - 14.060.339 | | | |
| (31. Dezember 2020: 11.768.387) | | | |
| 1.300.000 | AES Panama Generation Holdings SRL 'REGS' 4.375% 31-May-2030 | 1.367.470 | 0,25 |
| 4.500.000 | Banco Nacional de Panama 'REGS' 2.500% 11-Aug-2030 | 4.230.045 | 0,76 |
| 8.016.000 | Banistmo SA 'REGS' 4.250% 31-Jul-2027 | 8.154.356 | 1,47 |
| 300.000 | Cable Onda SA 'REGS' 4.500% 30-Jan-2030 | 308.468 | 0,06 |
| Peru - 21.724.781 | | | |
| (31. Dezember 2020: 12.779.742) | | | |
| 870.000 | Campsol SA 'REGS' 6.000% 03-Feb-2027 | 902.073 | 0,16 |
| 2.070.000 | Consorcio Transmataro SA 'REGS' 4.700% 16-Apr-2034 | 2.277.404 | 0,41 |
| 3.500.000 | Corp Financiera de Desarrollo SA 'REGS' 2.400% 28-Sep-2027 | 3.421.757 | 0,62 |
| 1.000.000 | Corp Financiera de Desarrollo SA 'REGS' FRN 5.250% 15-Jul-2029 | 1.034.555 | 0,19 |
| 2.300.000 | Kallpa Generacion SA 'REGS' 4.125% 16-Aug-2027 | 2.373.600 | 0,43 |
| 3.800.000 | Petroleos del Peru SA 'REGS' 4.750% 19-Jun-2032 | 3.971.684 | 0,72 |
| 5.770.000 | Petroleos del Peru SA 'REGS' 5.625% 19-Jun-2047 | 5.713.108 | 1,03 |
| 2.080.000 | Volcan Cia Minera SAA 'REGS' 4.375% 11-Feb-2026 | 2.030.600 | 0,36 |
| Philippinen - 5.972.267 | | | |
| (31. Dezember 2020: 5.825.496) | | | |
| 5.000.000 | PLDT Inc 2.500% 23-Jan-2031 | 4.968.712 | 0,90 |
| 1.000.000 | PLDT Inc 3.450% 23-Jun-2050 | 1.003.555 | 0,18 |
| Katar - 13.452.839 | | | |
| (31. Dezember 2020: 2.949.283) | | | |
| 2.000.000 | ABQ Finance Ltd 'EMTN' 1.875% 08-Sep-2025 | 1.985.746 | 0,36 |
| 800.000 | ABQ Finance Ltd 'EMTN' 3.125% 24-Sep-2024 | 828.580 | 0,15 |
| 2.000.000 | Doha Finance Ltd 'EMTN' 2.375% 31-Mar-2026 | 2.015.100 | 0,36 |
| 6.620.000 | Qatar Energy 'REGS' 2.250% 12-Jul-2031 | 6.566.265 | 1,19 |
| 2.000.000 | QNB Finance Ltd 'EMTN' 2.625% 12-May-2025 | 2.057.148 | 0,37 |
| Republik Korea - 8.041.048 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.097.510) | | | |
| 2.000.000 | Kookmin Bank 'REGS' 2.500% 04-Nov-2030 | 1.967.107 | 0,36 |
| 500.000 | Shinhan Bank Co Ltd 'REGS' 4.000% 23-Apr-2029 | 552.321 | 0,10 |
| 2.000.000 | Shinhan Financial Group Co Ltd 'REGS' FRN 3.340% 05-Feb-2030 | 2.062.133 | 0,37 |
| 3.500.000 | Shinhan Financial Group Co Ltd 'REGS' FRN (Perpetual) 2.875% 12-May-2026 | 3.459.487 | 0,62 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % |
|--|--|----------------------------|-----------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Russland - 33.981.500 | | | |
| (31. Dezember 2020: 22.957.940) | | 33.981.500 | 6,13 |
| 7.900.000 | Credit Bank of Moscow Via CBOM Finance Plc 'REGS' 3.875% 21-Sep-2026 | 7.482.896 | 1,35 |
| 4.500.000 | Gazprom PJSC via Gaz Finance Plc 'REGS' 3.500% 14-Jul-2031 | 4.351.250 | 0,79 |
| 5.300.000 | Lukoil Capital DAC 'REGS' 3.600% 26-Oct-2031 | 5.180.093 | 0,93 |
| 2.000.000 | Lukoil Securities BV 'REGS' 3.875% 06-May-2030 | 2.040.060 | 0,37 |
| 5.000.000 | MMC Norilsk Nickel OJSC Via MMC Finance DAC 'REGS' 2.800% 27-Oct-2026 | 4.951.625 | 0,89 |
| 1.750.000 | Novolipetsk Steel Via Steel Funding DAC 'REGS' 1.450% 02-Jun-2026 | 1.965.269 | 0,35 |
| 5.000.000 | Polyus Finance Plc 'REGS' 3.250% 14-Oct-2028 | 4.867.890 | 0,88 |
| 275.000.000 | Russian Railways Via RZD Capital Plc 6.598% 02-Mar-2028 | 3.142.417 | 0,57 |
| Saudi-Arabien - 13.257.503 | | | |
| (31. Dezember 2020: 14.999.434) | | 13.257.503 | 2,39 |
| 2.000.000 | Arab National Bank FRN 3.326% 28-Oct-2030 | 2.046.598 | 0,37 |
| 4.000.000 | Riyad Sukuk Ltd FRN 3.174% 25-Feb-2030 | 4.095.840 | 0,74 |
| 5.108.000 | Saudi Arabian Oil Co 'REGS' 2.250% 24-Nov-2030 | 4.974.865 | 0,90 |
| 2.000.000 | Saudi Arabian Oil Co 'REGS' 3.500% 16-Apr-2029 | 2.140.200 | 0,38 |
| Serbien - 1.657.793 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.808.992) | | 1.657.793 | 0,30 |
| 1.500.000 | United Group BV 'REGS' 3.625% 15-Feb-2028 | 1.657.793 | 0,30 |
| Südafrika - 9.524.700 | | | |
| (31. Dezember 2020: 9.020.642) | | 9.524.700 | 1,72 |
| 3.200.000 | Absa Group Ltd FRN (Perpetual) 6.375% 27-May-2026 | 3.265.472 | 0,59 |
| 3.000.000 | AngloGold Ashanti Holdings Plc 3.375% 01-Nov-2028 | 2.975.617 | 0,54 |
| 3.256.000 | AngloGold Ashanti Holdings Plc 3.750% 01-Oct-2030 | 3.283.611 | 0,59 |
| Thailand - 6.337.115 | | | |
| (31. Dezember 2020: 5.596.591) | | 6.337.115 | 1,14 |
| 3.950.000 | GC Treasury Center Co Ltd 'REGS' 2.980% 18-Mar-2031 | 3.999.748 | 0,72 |
| 1.000.000 | PTTEP Treasury Center Co Ltd 'REGS' 2.587% 10-Jun-2027 | 1.020.443 | 0,18 |
| 1.500.000 | Thaioil Treasury Center Co Ltd 'REGS' 3.750% 18-Jun-2050 | 1.316.924 | 0,24 |
| Togo - 2.871.116 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | 2.871.116 | 0,52 |
| 2.900.000 | Ecobank Transnational Inc 'REGS' FRN 8.750% 17-Jun-2031 | 2.871.116 | 0,52 |
| Türkei - 11.179.129 | | | |
| (31. Dezember 2020: 19.818.267) | | 11.179.129 | 2,02 |
| 4.800.000 | Aydem Yenilenebilir Enerji AS 'REGS' 7.750% 02-Feb-2027 | 3.924.000 | 0,71 |
| 4.350.000 | Limak Iskenderun Uluslararası Liman Isletmeciligi AS 'REGS' 9.500% 10-Jul-2036 | 4.033.994 | 0,73 |
| 1.700.000 | Türkiye İhracat Kredi Bankası AS 'REGS' 5.750% 06-Jul-2026 | 1.564.415 | 0,28 |
| 1.800.000 | Türkiye Sınai Kalkınma Bankası AS 'REGS' 5.875% 14-Jan-2026 | 1.656.720 | 0,30 |
| Ukraine - 7.574.597 | | | |
| (31. Dezember 2020: 13.055.307) | | 7.574.597 | 1,37 |
| 3.500.000 | Metinvest BV 'REGS' 7.750% 17-Oct-2029 | 3.463.110 | 0,63 |
| 1.700.000 | NPC Ukrenergo 'REGS' 6.875% 09-Nov-2026 | 1.489.413 | 0,27 |
| 2.800.000 | Ukraine Railways Via Rail Capital Markets Plc 7.875% 15-Jul-2026 | 2.622.074 | 0,47 |
| Vereinigte Arabische Emirate - 12.169.842 | | | |
| (31. Dezember 2020: 26.106.882) | | 12.169.842 | 2,19 |
| 1.300.000 | DAE Sukuk Dife Ltd 'REGS' 3.750% 15-Feb-2026 | 1.344.688 | 0,24 |
| 2.000.000 | DIB Sukuk Ltd 2.950% 20-Feb-2025 | 2.066.350 | 0,37 |
| 1.500.000 | EI Sukuk Co Ltd 1.827% 23-Sep-2025 | 1.500.075 | 0,27 |
| 1.000.000 | First Abu Dhabi Bank PJSC FRN (Perpetual) 4.500% 05-Apr-2026 | 1.049.210 | 0,19 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % |
|--|---|------------------------------|-----------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Vereinigte Arabische Emirate Forts. | | | |
| 2.000.000 | Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd 'REGS' 2.160% 31-Mar-2034 | 1.965.679 | 0,35 |
| 2.277.000 | Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd 'REGS' 2.940% 30-Sep-2040 | 2.269.600 | 0,41 |
| 2.000.000 | National Central Cooling Co PJSC 2.500% 21-Oct-2027 | 1.974.240 | 0,36 |
| Gesamtanlagen in Anleihen | | 502.246.150 | 90,61 |
| Offene Terminkontrakte - 76.471 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| (259) | U.S. 5 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (31.314.719) | 76,471 |
| Offene Terminkontrakte insgesamt | | 76.471 | 0,01 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 1.201.624 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 2.413.093) | | | |
| | | 1.201.624 | 0,21 |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | 532.273.406 | 96,02 |
| Zugrunde liegendes Engagement USD | | | |
| Credit Default Swaps - (82.256) | | | |
| (31. Dezember 2020: 161.211) | | | |
| 10.000.000 | CDS United Mexican States 1.000% 20-Jun-2026 | (82.256) | (0,01) |
| Credit Default Swaps insgesamt | | (82.256) | (0,01) |
| Offene Terminkontrakte - (247.063) | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| (241) | U.S. 10 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (31.427.906) | (247,063) |
| Offene Terminkontrakte insgesamt | | (247.063) | (0,04) |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (10.371) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (1.598.114)) | | | |
| | | (10.371) | (0,00) |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | (339.690) | (0,05) |
| Nettoumlaufvermögen | | 22.332.475 | 4,03 |
| Summe Nettovermögen | | 554.266.191 | 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 | | 95,66 | |
| An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente | | 0,01 | |
| Derivative OTC-Finanzinstrumente | | 0,22 | |
| Sonstiges Umlaufvermögen | | 4,11 | |
| Gesamtvermögen | | 100,00 | |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte

| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) | |
|--|------------------|------------|------------|------------------|----------------------------------|-------------------------------------|----------------|
| BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund | | | | | | | |
| US-Dollar | Russischer Rubel | 207.459 | 15.000.000 | 9. Feb. 22 | Citigroup Global Markets Limited | 8.455 | |
| Euro | US-Dollar | 2.675.000 | 3.006.865 | 14. Feb. 22 | Morgan Stanley | 23.330 | |
| US-Dollar | Euro | 36.205.584 | 31.907.000 | 14. Feb. 22 | Morgan Stanley | 61.882 | |
| | | | | | | USD | 93.667 |
| Euro | US-Dollar | 1.570.000 | 1.778.876 | 14. Feb. 22 | BNP Paribas | (407) | |
| Euro | US-Dollar | 640.000 | 727.322 | 14. Feb. 22 | Morgan Stanley | (2.341) | |
| | | | | | | USD | (2.748) |

BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund Anteilsklasse CHF W (Acc) (Hedged)

| | | | | | | | |
|-------------------|-------------------|------------|------------|-------------|-----------------------------|------------|----------------|
| Schweizer Franken | US-Dollar | 70.151 | 76.418 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 418 | |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 18.186 | 19.876 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 43 | |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 38.890.888 | 42.058.210 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 549.775 | |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 550 | 598 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 4 | |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 12.057 | 13.084 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 125 | |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 5.655 | 6.118 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 77 | |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 5.632 | 6.101 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 70 | |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 2.813.108 | 3.045.652 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 36.325 | |
| | | | | | | USD | 586.837 |
| | | | | | | CHF | 535.782 |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 19.877 | 18.186 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (48) | |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 76.420 | 70.151 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (436) | |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 7.386 | 6.792 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (55) | |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 487 | 449 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (5) | |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 8.266 | 7.629 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (92) | |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 57.328 | 52.983 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (719) | |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 6.516 | 5.982 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (38) | |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 35.086 | 32.407 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (418) | |
| | | | | | | USD | (1.811) |
| | | | | | | CHF | (1.653) |

BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund Anteilsklasse CHF W (Inc) (Hedged)

| | | | | | | | |
|-------------------|-----------|-----------|-----------|-------------|-----------------------------|------------|---------------|
| Schweizer Franken | US-Dollar | 6.942.507 | 7.507.913 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 98.142 | |
| | | | | | | USD | 98.142 |
| | | | | | | CHF | 89.604 |

BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged)

| | | | | | | | |
|-----------|-----------|------------|------------|-------------|-----------------------------|------------|---------------|
| Euro | US-Dollar | 10.504 | 11.876 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 15 | |
| Euro | US-Dollar | 10.999.961 | 12.429.763 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 23.101 | |
| Euro | US-Dollar | 14.988 | 16.917 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 50 | |
| US-Dollar | Euro | 18.158 | 16.020 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 22 | |
| US-Dollar | Euro | 230.866 | 203.785 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 165 | |
| | | | | | | USD | 23.353 |
| | | | | | | EUR | 20.633 |
| US-Dollar | Euro | 11.872 | 10.504 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (16) | |

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. | | | | | | | |
| US-Dollar | Euro | 15.739 | 13.938 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (40) | |
| US-Dollar | Euro | 113.273 | 100.397 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (385) | |
| US-Dollar | Euro | 43.569 | 38.600 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (130) | |
| | | | | | | USD | (571) |
| | | | | | | EUR | (504) |

BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged)

| | | | | | | | |
|-----------|-----------|------------|------------|-------------|-----------------------------|------------|---------------|
| Euro | US-Dollar | 15.330.278 | 17.322.946 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 32.196 | |
| | | | | | | USD | 32.196 |
| | | | | | | EUR | 28.445 |
| US-Dollar | Euro | 64.060 | 56.648 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (71) | |
| | | | | | | USD | (71) |
| | | | | | | EUR | (63) |

BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)

| | | | | | | | |
|-----------|-----------|------------|-------------|-------------|-----------------------------|------------|----------------|
| Euro | US-Dollar | 9.002 | 10.175 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 14 | |
| US-Dollar | Euro | 91.316 | 80.626 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 57 | |
| Euro | US-Dollar | 2.028.511 | 2.293.502 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 2.940 | |
| Euro | US-Dollar | 90.705.125 | 102.495.203 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 190.493 | |
| Euro | US-Dollar | 5.500 | 6.220 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 6 | |
| Euro | US-Dollar | 65.872 | 74.381 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 191 | |
| Euro | US-Dollar | 5.000 | 5.639 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 21 | |
| Euro | US-Dollar | 49.437 | 55.905 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 62 | |
| Euro | US-Dollar | 8.277 | 9.338 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 32 | |
| Euro | US-Dollar | 35.091 | 39.608 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 118 | |
| Euro | US-Dollar | 531.762 | 599.939 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 2.060 | |
| | | | | | | USD | 195.994 |
| | | | | | | EUR | 173.162 |

| | | | | | | |
|-----------|-----------|-----------|-----------|-------------|-----------------------------|---------|
| US-Dollar | Euro | 2.292.814 | 2.028.511 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (3.158) |
| Euro | US-Dollar | 80.626 | 91.336 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (61) |
| Euro | US-Dollar | 1.028.810 | 1.165.492 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (794) |
| Euro | US-Dollar | 18.208 | 18.362 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (13) |
| Euro | US-Dollar | 12.521 | 14.187 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (13) |
| Euro | US-Dollar | 66.190 | 74.994 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (61) |
| US-Dollar | Euro | 10.178 | 9.002 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (13) |
| US-Dollar | Euro | 31.569 | 27.914 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (32) |
| US-Dollar | Euro | 70.062 | 62.047 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (180) |
| US-Dollar | Euro | 24.878 | 22.058 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (94) |
| US-Dollar | Euro | 80.288 | 70.998 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (88) |
| US-Dollar | Euro | 39.929 | 35.390 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (136) |
| US-Dollar | Euro | 22.380 | 19.828 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (67) |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte Forts.

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

BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged) Forts.

| | | | | | | | |
|-----------|------|--------|--------|-------------|-----------------------------|------------|----------------|
| US-Dollar | Euro | 15.025 | 13.318 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (52) | |
| | | | | | | USD | (4.762) |
| | | | | | | EUR | (4.207) |

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

| | | | | | | | |
|------|-----------|------------|------------|-------------|-----------------------------|------------|---------------|
| Euro | US-Dollar | 19.527.235 | 22.065.433 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 41.010 | |
| | | | | | | USD | 41.010 |
| | | | | | | EUR | 36.233 |

BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)

| | | | | | | | |
|----------------|----------------|-----------|-----------|-------------|-----------------------------|------------|----------------|
| US-Dollar | Pfund Sterling | 32 | 24 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 24 | 32 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 4.005 | 5.383 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 14 | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 150 | 201 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1 | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 4.614.128 | 6.087.497 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 130.359 | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 109 | 146 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 2 | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 345 | 457 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 8 | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 1.556 | 2.064 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 32 | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 329 | 435 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 9 | |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 21 | 16 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - | |
| | | | | | | USD | 130.425 |
| | | | | | | GBP | 96.783 |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 5.382 | 4.005 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (15) | |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 9.152 | 6.824 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (44) | |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 839 | 625 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (2) | |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 301 | 227 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (5) | |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 543 | 412 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (11) | |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 13.697 | 10.268 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (139) | |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 12.223 | 9.212 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (190) | |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 90 | 68 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (2) | |
| | | | | | | USD | (408) |
| | | | | | | GBP | (303) |

BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|---------------------------------------|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen | | | |
| Angola - 201.465 | | | |
| (31. Dezember 2020: 192.385) | | 201.465 | 0,61 |
| 200.000 | Angolan Government International Bond 'REGS' 8.250% 09-May-2028 | 201.465 | 0,61 |
| Argentinien - 541.083 | | | |
| (31. Dezember 2020: 607.338) | | 541.083 | 1,63 |
| 6.590 | Argentine Republic Government International Bond 1.000% 09-Jul-2029 | 2.405 | 0,01 |
| 37.037 | Argentine Republic Government International Bond 1.000% 09-Jul-2029 | 13.519 | 0,04 |
| 208.928 | Argentine Republic Government International Bond Step-Up Coupon 0.500% 09-Jul-2030 | 73.649 | 0,22 |
| 54.800 | Argentine Republic Government International Bond Step-Up Coupon 0.500% 09-Jul-2030 | 19.318 | 0,06 |
| 100.399 | Argentine Republic Government International Bond Step-Up Coupon 1.125% 09-Jul-2035 | 32.254 | 0,10 |
| 693.171 | Argentine Republic Government International Bond Step-Up Coupon 1.125% 09-Jul-2035 | 222.688 | 0,67 |
| 500.000 | Argentine Republic Government International Bond Step-Up Coupon 2.500% 09-Jul-2041 | 177.250 | 0,53 |
| Bahrain - 627.724 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.158.382) | | 627.724 | 1,90 |
| 200.000 | Bahrain Government International Bond 'REGS' 5.450% 16-Sep-2032 | 194.675 | 0,59 |
| 200.000 | Bahrain Government International Bond 'REGS' 7.000% 12-Oct-2028 | 217.394 | 0,66 |
| 200.000 | CBB International Sukuk Programme Co WLL 'REGS' 6.250% 14-Nov-2024 | 215.655 | 0,65 |
| Brasilien - 1.282.748 | | | |
| (31. Dezember 2020: 2.119.532) | | 1.282.748 | 3,87 |
| 500.000 | BRF SA 'REGS' 4.875% 24-Jan-2030 | 507.132 | 1,53 |
| 200.000 | Globo Comunicacao e Participacoes SA 'REGS' 4.875% 22-Jan-2030 | 194.542 | 0,59 |
| 200.000 | Hidrovias International Finance S.A. 'REGS' 4.950% 08-Feb-2031 | 182.942 | 0,55 |
| 225.000 | Petrobras Global Finance BV 5.500% 10-Jun-2051 | 209.132 | 0,63 |
| 200.000 | Rumo Luxembourg Sarl 'REGS' 4.200% 18-Jan-2032 | 189.000 | 0,57 |
| Burkina Faso - 198.888 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | 198.888 | 0,60 |
| 200.000 | Endeavour Mining Plc 'REGS' 5.000% 14-Oct-2026 | 198.888 | 0,60 |
| Chile - 620.125 | | | |
| (31. Dezember 2020: 244.853) | | 620.125 | 1,87 |
| 200.000 | Colbun SA 'REGS' 3.150% 19-Jan-2032 | 197.116 | 0,59 |
| 200.000 | Corp Nacional del Cobre de Chile 'REGS' 4.375% 05-Feb-2049 | 228.970 | 0,69 |
| 200.000 | Sociedad Quimica y Minera de Chile SA 'REGS' 3.500% 10-Sep-2051 | 194.039 | 0,59 |
| China - 1.396.258 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.333.848) | | 1.396.258 | 4,21 |
| 200.000 | Lenovo Group Ltd 'REGS' 3.421% 02-Nov-2030 | 202.014 | 0,61 |
| 475.000 | Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd 'REGS' 2.300% 08-Jan-2031 | 468.536 | 1,41 |
| 440.000 | Tencent Holdings Ltd 'REGS' 3.975% 11-Apr-2029 | 479.263 | 1,45 |
| 250.000 | Yili Holding Investment Ltd 1.625% 19-Nov-2025 | 246.445 | 0,74 |
| Kolumbien - 1.001.271 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.470.942) | | 1.001.271 | 3,02 |
| 275.000 | Colombia Government International Bond 3.125% 15-Apr-2031 | 247.357 | 0,75 |
| 200.000 | Colombia Government International Bond 4.125% 15-May-2051 | 163.000 | 0,49 |
| 200.000 | Colombia Government International Bond 5.000% 15-Jun-2045 | 181.250 | 0,55 |
| 406.000 | Millicom International Cellular SA 'REGS' 4.500% 27-Apr-2031 | 409.664 | 1,23 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|--|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Costa Rica - 405.000 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | 405.000 | 1,22 |
| 400.000 | Costa Rica Government International Bond 'REGS' 6.125% 19-Feb-2031 | 405.000 | 1,22 |
| Elfenbeinküste - 883.998 | | | |
| (31. Dezember 2020: 682.045) | | 883.998 | 2,67 |
| 325.000 | Ivory Coast Government International Bond 'REGS' 6.125% 15-Jun-2033 | 343.132 | 1,04 |
| 250.000 | Ivory Coast Government International Bond 'REGS' 6.625% 22-Mar-2048 | 283.306 | 0,85 |
| 255.729 | Ivory Coast Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 5.750% 31-Dec-2032 | 257.560 | 0,78 |
| Dominikanische Republik - 529.094 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.012.984) | | 529.094 | 1,60 |
| 325.000 | Dominican Republic International Bond 'REGS' 4.875% 23-Sep-2032 | 331.094 | 1,00 |
| 200.000 | Dominican Republic International Bond 'REGS' 5.300% 21-Jan-2041 | 198.000 | 0,60 |
| Ecuador - 790.572 | | | |
| (31. Dezember 2020: 704.488) | | 790.572 | 2,39 |
| 64.164 | Ecuador Government International Bond 'REGS' (Zero Coupon) 0.000% 31-Jul-2030 | 36.413 | 0,11 |
| 213.930 | Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 0.500% 31-Jul-2040 | 125.818 | 0,38 |
| 670.065 | Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 1.000% 31-Jul-2035 | 443.080 | 1,34 |
| 222.870 | Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 5.000% 31-Jul-2030 | 185.261 | 0,56 |
| Ägypten - 1.070.723 | | | |
| (31. Dezember 2020: 899.045) | | 1.070.723 | 3,23 |
| 300.000 | Egypt Government International Bond 'REGS' 5.875% 16-Feb-2031 | 266.676 | 0,80 |
| 300.000 | Egypt Government International Bond 'REGS' 7.500% 16-Feb-2061 | 245.725 | 0,74 |
| 400.000 | Egypt Government International Bond 'REGS' 7.625% 29-May-2032 | 380.038 | 1,15 |
| 200.000 | Egypt Government International Bond 'REGS' 8.700% 01-Mar-2049 | 178.284 | 0,54 |
| El Salvador - 66.879 | | | |
| (31. Dezember 2020: 105.312) | | 66.879 | 0,20 |
| 111.000 | El Salvador Government International Bond 'REGS' 6.375% 18-Jan-2027 | 66.879 | 0,20 |
| Georgien - 199.450 | | | |
| (31. Dezember 2020: 550.258) | | 199.450 | 0,60 |
| 200.000 | Georgia Government International Bond 'REGS' 2.750% 22-Apr-2026 | 199.450 | 0,60 |
| Ghana - 736.275 | | | |
| (31. Dezember 2020: 895.258) | | 736.275 | 2,22 |
| 450.000 | Ghana Government International Bond 'REGS' 7.625% 16-May-2029 | 376.436 | 1,14 |
| 200.000 | Ghana Government International Bond 'REGS' 7.875% 11-Feb-2035 | 157.500 | 0,47 |
| 200.000 | Tullow Oil Plc 'REGS' 10.250% 15-May-2026 | 202.339 | 0,61 |
| Indien - 351.796 | | | |
| (31. Dezember 2020: 369.910) | | 351.796 | 1,06 |
| 345.000 | Export-Import Bank of India 'REGS' 3.250% 15-Jan-2030 | 351.796 | 1,06 |
| Indonesien - 2.081.891 | | | |
| (31. Dezember 2020: 2.272.102) | | 2.081.891 | 6,28 |
| 200.000 | Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 'REGS' 6.757% 15-Nov-2048 | 256.292 | 0,77 |
| 200.000 | Medco Laurel Tree Pte Ltd 'REGS' 6.950% 12-Nov-2028 | 198.534 | 0,60 |
| 200.000 | Pertamina Persero PT 'REGS' 4.175% 21-Jan-2050 | 206.356 | 0,62 |
| 200.000 | Pertamina Persero PT 'REGS' 6.500% 27-May-2041 | 259.426 | 0,78 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Nettovermögen % | Summe |
|---------------------------------------|---|----------------------------|-----------------|-------|
| Anleihen Forts. | | | | |
| Indonesien Forts. | | | | |
| 225.000 | Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 'REGS' 2.800% 23-Jun-2030 | 232.222 | 0,70 | |
| 200.000 | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 'REGS' 3.875% 17-Jul-2029 | 212.002 | 0,64 | |
| 250.000 | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 'REGS' 4.875% 17-Jul-2049 | 268.189 | 0,81 | |
| 400.000 | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 'REGS' 5.250% 24-Oct-2042 | 448.870 | 1,36 | |
| Israel - 653.112 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 240.750) | | | | |
| 225.000 | Bank Hapoalim BM '144A' FRN 3.255% 21-Jan-2032 | 223.875 | 0,68 | |
| 200.000 | Energean Israel Finance Ltd '144A' 5.875% 30-Mar-2031 | 196.924 | 0,59 | |
| 225.000 | Leviathan Bond Ltd '144A' 5.750% 30-Jun-2023 | 232.313 | 0,70 | |
| Kasachstan - 854.988 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 485.785) | | | | |
| 200.000 | Development Bank of Kazakhstan JSC 'REGS' 2.950% 06-May-2031 | 198.816 | 0,60 | |
| 200.000 | Fund of National Welfare Samruk-Kazyna JSC 'REGS' 2.000% 28-Oct-2026 | 197.271 | 0,60 | |
| 200.000 | KazMunayGas National Co JSC 'REGS' 5.375% 24-Apr-2030 | 233.625 | 0,70 | |
| 225.000 | Tengizchevroil Finance Co International Ltd 'REGS' 3.250% 15-Aug-2030 | 225.276 | 0,68 | |
| Kenia - 270.188 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 714.343) | | | | |
| 275.000 | Republic of Kenya Government International Bond 'REGS' 6.300% 23-Jan-2034 | 270.188 | 0,82 | |
| Kuwait - 726.820 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 540.559) | | | | |
| 200.000 | Equate Petrochemical BV 'REGS' 2.625% 28-Apr-2028 | 200.750 | 0,61 | |
| 260.000 | Equate Petrochemical BV 'REGS' 4.250% 03-Nov-2026 | 283.195 | 0,85 | |
| 200.000 | MEGlobal Canada ULC 'REGS' 5.875% 18-May-2030 | 242.875 | 0,73 | |
| Macau - 182.000 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 204.605) | | | | |
| 200.000 | Wynn Macau Ltd 'REGS' 5.125% 15-Dec-2029 | 182.000 | 0,55 | |
| Mexiko - 4.055.998 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 4.525.054) | | | | |
| 415.000 | Axtel SAB de CV 'REGS' 6.375% 14-Nov-2024 | 428.710 | 1,29 | |
| 325.000 | Comision Federal de Electricidad 'REGS' 3.348% 09-Feb-2031 | 319.238 | 0,96 | |
| 255.000 | Comision Federal de Electricidad 'REGS' 3.875% 26-Jul-2033 | 251.000 | 0,76 | |
| 200.000 | Comision Federal de Electricidad 'REGS' 5.750% 14-Feb-2042 | 219.500 | 0,66 | |
| 200.000 | Mexico Government International Bond 2.659% 24-May-2031 | 195.602 | 0,59 | |
| 225.000 | Mexico Government International Bond 3.771% 24-May-2061 | 208.919 | 0,63 | |
| 222.000 | Mexico Government International Bond 4.500% 31-Jan-2050 | 235.875 | 0,71 | |
| 405.000 | Mexico Government International Bond 'MTN' 4.750% 08-Mar-2044 | 442.687 | 1,34 | |
| 575.000 | Petroleos Mexicanos 5.950% 28-Jan-2031 | 559.878 | 1,69 | |
| 325.000 | Petroleos Mexicanos 6.490% 23-Jan-2027 | 347.069 | 1,05 | |
| 250.000 | Petroleos Mexicanos 6.500% 23-Jan-2029 | 259.801 | 0,78 | |
| 325.000 | Petroleos Mexicanos 7.690% 23-Jan-2050 | 314.267 | 0,95 | |
| 250.000 | Petroleos Mexicanos 'REGS' 6.875% 16-Oct-2025 | 273.452 | 0,83 | |
| Marokko - 233.174 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 262.640) | | | | |
| 200.000 | OCP SA 'REGS' 6.875% 25-Apr-2044 | 233.174 | 0,70 | |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Nettovermögen % | Summe |
|---------------------------------------|--|----------------------------|-----------------|-------|
| Anleihen Forts. | | | | |
| Niederlande - 195.562 | | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | | |
| 200.000 | VEON Holdings BV 'REGS' 3.375% 25-Nov-2027 | 195.562 | 0,59 | |
| Nigeria - 866.420 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 724.132) | | | | |
| 475.000 | Nigeria Government International Bond 'REGS' 6.500% 28-Nov-2027 | 475.354 | 1,44 | |
| 200.000 | Nigeria Government International Bond 'REGS' 7.625% 28-Nov-2047 | 179.566 | 0,54 | |
| 225.000 | Nigeria Government International Bond 'REGS' 8.250% 28-Sep-2051 | 211.500 | 0,64 | |
| Oman - 840.668 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 671.445) | | | | |
| 200.000 | Oman Government International Bond 'REGS' 6.250% 25-Jan-2031 | 219.033 | 0,66 | |
| 400.000 | Oman Government International Bond 'REGS' 6.750% 17-Jan-2048 | 407.885 | 1,23 | |
| 200.000 | Oman Sovereign Sukuk Co 'REGS' 4.875% 15-Jun-2030 | 213.750 | 0,65 | |
| Pakistan - 202.304 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 418.972) | | | | |
| 200.000 | Pakistan Government International Bond 'REGS' 6.875% 05-Dec-2027 | 202.304 | 0,61 | |
| Panama - 754.565 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 258.500) | | | | |
| 350.000 | Panama Government International Bond 2.252% 29-Sep-2032 | 332.763 | 1,00 | |
| 200.000 | Panama Government International Bond 3.870% 23-Jul-2060 | 200.750 | 0,61 | |
| 200.000 | Panama Government International Bond 4.500% 01-Apr-2056 | 221.052 | 0,67 | |
| Paraguay - 229.250 | | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | | |
| 200.000 | Paraguay Government International Bond 'REGS' 5.400% 30-Mar-2050 | 229.250 | 0,69 | |
| Peru - 199.700 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 924.647) | | | | |
| 200.000 | Peruvian Government International Bond 3.000% 15-Jan-2034 | 199.700 | 0,60 | |
| Katar - 298.954 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 279.091) | | | | |
| 300.000 | CBQ Finance Ltd 'EMTN' 2.000% 12-May-2026 | 298.954 | 0,90 | |
| Republik Serbien - 130.496 | | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | | |
| 125.000 | Serbia International Bond 'REGS' 2.050% 23-Sep-2036 | 130.496 | 0,39 | |
| Rumänien - 118.323 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 256.500) | | | | |
| 100.000 | Romanian Government International Bond 'REGS' 5.125% 15-Jun-2048 | 118.323 | 0,36 | |
| Russland - 1.418.527 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.697.702) | | | | |
| 200.000 | Credit Bank of Moscow Via CBOM Finance Plc 'REGS' 3.875% 21-Sep-2026 | 189.450 | 0,57 | |
| 200.000 | Gazprom PJSC via Gaz Finance Plc 'REGS' 3.500% 14-Jul-2031 | 193.637 | 0,58 | |
| 400.000 | Gazprom PJSC via Gaz Finance Plc 'REGS' FRN (Perpetual) 4.599% 26-Oct-2025 | 409.063 | 1,24 | |
| 200.000 | Lukoil Capital DAC 'REGS' 3.600% 26-Oct-2031 | 195.187 | 0,59 | |
| 200.000 | Polyus Finance Plc 'REGS' 3.250% 14-Oct-2028 | 194.940 | 0,59 | |
| 200.000 | Russian Foreign Bond - Eurobond 'REGS' 5.100% 28-Mar-2035 | 236.250 | 0,71 | |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % |
|---|---|----------------------------|-----------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| | Saudi-Arabien - 617.224 | | |
| | (31. Dezember 2020: 737.850) | 617.224 | 1,86 |
| 400.000 | SA Global Sukuk Ltd 'REGS' 2.694% 17-Jun-2031 | 403.091 | 1,22 |
| 200.000 | Saudi Arabian Oil Co 'REGS' 3.500% 16-Apr-2029 | 214.133 | 0,64 |
| Senegal - 393.360 | | | |
| | (31. Dezember 2020: 943.783) | 393.360 | 1,19 |
| 400.000 | Senegal Government International Bond 'REGS' 6.750% 13-Mar-2048 | 393.360 | 1,19 |
| Südafrika - 409.842 | | | |
| | (31. Dezember 2020: 1.068.393) | 409.842 | 1,24 |
| 200.000 | Republic of South Africa Government International Bond 5.750% 30-Sep-2049 | 192.850 | 0,58 |
| 200.000 | Sasol Financing USA LLC 6.500% 27-Sep-2028 | 216.992 | 0,66 |
| Supranational - 821.367 | | | |
| | (31. Dezember 2020: 852.614) | 821.367 | 2,48 |
| 200.000 | African Export-Import Bank/The 'REGS' 2.634% 17-May-2026 | 201.290 | 0,61 |
| 560.000 | Banque Ouest Africaine de Developpement 'REGS' 5.000% 27-Jul-2027 | 620.077 | 1,87 |
| Tansania - 616.527 | | | |
| | (31. Dezember 2020: -) | 616.527 | 1,86 |
| 200.000 | AngloGold Ashanti Holdings Plc 3.375% 01-Nov-2028 | 198.327 | 0,60 |
| 400.000 | HTA Group Ltd/Mauritius 'REGS' 7.000% 18-Dec-2025 | 418.200 | 1,26 |
| Türkei - 1.187.828 | | | |
| | (31. Dezember 2020: 1.936.635) | 1.187.828 | 3,59 |
| 400.000 | Turk Telekomunikasyon AS 'REGS' 6.875% 28-Feb-2025 | 406.756 | 1,23 |
| 200.000 | Turkey Government International Bond 5.750% 11-May-2047 | 162.119 | 0,49 |
| 375.000 | Turkey Government International Bond 5.950% 15-Jan-2031 | 336.521 | 1,02 |
| 300.000 | Turkey Government International Bond 6.875% 17-Mar-2036 | 282.432 | 0,85 |
| Ukraine - 804.057 | | | |
| | (31. Dezember 2020: 1.439.225) | 804.057 | 2,43 |
| 400.000 | Metinvest BV 'REGS' 8.500% 23-Apr-2026 | 417.952 | 1,26 |
| 200.000 | MHP Lux SA 'REGS' 6.250% 19-Sep-2029 | 189.600 | 0,57 |
| 215.000 | Ukraine Government International Bond 'REGS' FRN 1.258% 31-May-2040 | 196.505 | 0,60 |
| Vereinigte Arabische Emirate - 1.845.311 | | | |
| | (31. Dezember 2020: 2.049.557) | 1.845.311 | 5,57 |
| 200.000 | DAE Funding LLC 'REGS' 3.375% 20-Mar-2028 | 203.000 | 0,61 |
| 275.000 | DP World Ltd/United Arab Emirates 'REGS' 4.700% 30-Sep-2049 | 300.482 | 0,91 |
| 280.000 | DP World Ltd/United Arab Emirates 'REGS' 6.850% 02-Jul-2037 | 369.465 | 1,11 |
| 400.000 | DP World Salaam FRN (Perpetual) 6.000% 01-Oct-2025 | 433.437 | 1,31 |
| 350.000 | Emirate of Dubai Government International Bonds 'EMTN' 3.900% 09-Sep-2050 | 336.437 | 1,02 |
| 200.000 | Sharjah Sukuk Program Ltd 3.234% 23-Oct-2029 | 202.490 | 0,61 |
| Gesamtanlagen in Anleihen | | 31.911.805 | 96,31 |

| Bestände | Beschreibung | Zugrunde liegendes Engagement USD | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % |
|--|---|-----------------------------------|----------------------------|-----------------------|
| Offene Terminkontrakte - 27.476 | | | | |
| | (31. Dezember 2020: 4.093) | | | |
| (1) | Euro-Buxl 30 Year Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (235.374) | 12.454 | 0,04 |
| 4 | U.S. Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2022 | 641.750 | 5.758 | 0,01 |

| Bestände | Beschreibung | Zugrunde liegendes Engagement USD | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % | |
|---|--|-----------------------------------|----------------------------|-----------------------|------|
| Offene Terminkontrakte Forts. | | | | | |
| 8 | U.S. Treasury Ultra Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2022 | 1.577.000 | 9.264 | 0,03 | |
| Offene Terminkontrakte insgesamt | | | 27.476 | 0,08 | |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 9.510 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 17.292) | | | | 9.510 | 0,03 |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | | 31.948.791 | 96,42 | |

| Bestände | Beschreibung | Zugrunde liegendes Engagement USD | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % | |
|---|---|-----------------------------------|----------------------------|-----------------------|--------|
| Offene Terminkontrakte - (40.411) | | | | | |
| | (31. Dezember 2020: (31.711)) | | | | |
| (7) | U.S. 10 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (913.281) | (1.479) | (0,00) | |
| (22) | U.S. 10 Year Ultra Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (3.221.625) | (38.542) | (0,12) | |
| 7 | U.S. 2 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2022 | 1.527.203 | (390) | (0,00) | |
| Offene Terminkontrakte insgesamt | | | (40.411) | (0,12) | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (5.140) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (1.722)) | | | | (5.140) | (0,02) |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | | (45.551) | (0,14) | |
| Nettoumlaufvermögen | | | 1.231.660 | 3,72 | |
| Summe Nettovermögen | | | 33.134.900 | 100,00 | |

Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist Bank of America Merrill Lynch.

| Portfolioanalyse | % des Gesamtvermögens |
|--|-----------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 94,82 |
| An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente | 0,08 |
| Derivative OTC-Finanzinstrumente | 0,03 |
| Sonstiges Umlaufvermögen | 5,07 |
| Gesamtvermögen | 100,00 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Devisenterminkontrakte | | | | | | | Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) |
|---|-----------|------------|------------|------------------|-----------------------------|----------------|--------------------------------------|
| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | | |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund | | | | | | | |
| US-Dollar | Euro | 443.437 | 391.604 | 16. Feb. 22 | JPMorgan Chase Bank | (2.790) | |
| | | | | | USD | (2.790) | |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged) | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 348.625 | 394.614 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 2.295 | |
| Euro | US-Dollar | 1.023.450 | 1.158.226 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 7.215 | |
| | | | | | USD | 9.510 | |
| | | | | | EUR | 8.353 | |
| US-Dollar | Euro | 6.951 | 6.162 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (66) | |
| US-Dollar | Euro | 394.708 | 348.625 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (2.284) | |
| | | | | | USD | (2.350) | |
| | | | | | EUR | (2.064) | |

BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT LOCAL CURRENCY FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % | Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|--|--|----------------------------------|----------------------------------|--|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen | | | | Anleihen Forts. | | | |
| Brasilien - 5.621.646 | | | | Peru - 1.640.323 | | | |
| (31. Dezember 2020: 8.356.784) | | | | (31. Dezember 2020: 2.612.977) | | | |
| 11.200.000 | Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2025 | 1.982.432 | 1,75 | 4.100.000 | Peru Government Bond 5.700% 12-Aug-2024 | 1.062.735 | 0,93 |
| 9.500.000 | Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2027 | 1.673.422 | 1,47 | 2.250.000 | Peru Government Bond 5.940% 12-Feb-2029 | 577.588 | 0,51 |
| 7.800.000 | Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2029 | 1.362.441 | 1,20 | Rumänien - 560.719 | | | |
| 3.500.000 | Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2031 | 603.351 | 0,53 | (31. Dezember 2020: 1.901.867) | | | |
| Chile - 6.559.098 | | | | 550.000 Romania Government Bond 4.750% 24-Feb-2025 | | | |
| (31. Dezember 2020: 9.082.334) | | | | 1.800.000 Romania Government Bond 5.800% 26-Jul-2027 | | | |
| 1.810.000.000 | Bonos de la Tesorería de la Republica en pesos 5.000% 01-Mar-2035 | 1.984.127 | 1,75 | Rusland - 13.666.415 | | | |
| 1.370.000.000 | Bonos de la Tesorería de la Republica en pesos '144A' 2.800% 01-Oct-2033 | 1.208.746 | 1,07 | (31. Dezember 2020: 20.484.938) | | | |
| 1.790.000.000 | Bonos de la Tesorería de la Republica en pesos '144A' 4.700% 01-Sep-2030 | 1.966.774 | 1,73 | 394.000.000 | Russian Federal Bond - OFZ 7.050% 19-Jan-2028 | 4.937.859 | 4,35 |
| 1.225.000.000 | Bonos de la Tesorería de la Republica en pesos '144A' 5.000% 01-Oct-2028 | 1.399.451 | 1,23 | 265.381.000 | Russian Federal Bond - OFZ 7.700% 23-Mar-2033 | 3.404.843 | 3,00 |
| China - 18.025.181 | | | | 401.500.000 Russian Federal Bond - OFZ 8.150% 03-Feb-2027 | | | |
| (31. Dezember 2020: 21.808.769) | | | | 13.666.415 | | | |
| 33.700.000 | China Government Bond 3.120% 05-Dec-2026 | 5.407.196 | 4,76 | 394.000.000 | Russian Federal Bond - OFZ 7.050% 19-Jan-2028 | 4.937.859 | 4,35 |
| 10.400.000 | China Government Bond 3.250% 06-Jun-2026 | 1.676.016 | 1,48 | 265.381.000 | Russian Federal Bond - OFZ 7.700% 23-Mar-2033 | 3.404.843 | 3,00 |
| 67.830.000 | China Government Bond 3.290% 23-May-2029 | 10.941.969 | 9,63 | 401.500.000 | Russian Federal Bond - OFZ 8.150% 03-Feb-2027 | 5.323.713 | 4,68 |
| Kolumbien - 9.692.355 | | | | Südafrika - 13.471.984 | | | |
| (31. Dezember 2020: 15.173.937) | | | | (31. Dezember 2020: 20.850.830) | | | |
| 2.736.000.000 | Colombian TES 7.000% 30-Jun-2032 | 614.504 | 0,54 | 122.000.000 | Republic of South Africa Government Bond 7.000% 28-Feb-2031 | 6.457.729 | 5,69 |
| 2.175.000.000 | Colombian TES 7.250% 26-Oct-2050 | 460.866 | 0,41 | 54.000.000 | Republic of South Africa Government Bond 8.000% 31-Jan-2030 | 3.128.509 | 2,75 |
| 11.057.000.000 | Colombian TES 7.750% 18-Sep-2030 | 2.654.996 | 2,34 | 38.200.000 | Republic of South Africa Government Bond 8.750% 28-Feb-2048 | 1.994.636 | 1,76 |
| 5.100.000.000 | Empresas Publicas de Medellín ESP 'REGS' 7.625% 10-Sep-2024 | 1.234.998 | 1,09 | 27.221.735 | Republic of South Africa Government Bond 10.500% 21-Dec-2026 | 1.891.110 | 1,66 |
| 20.757.000.000 | Empresas Publicas de Medellín ESP 'REGS' 8.375% 08-Nov-2027 | 4.726.991 | 4,16 | Thailand - 4.074.333 | | | |
| Tschechische Republik - 2.825.037 | | | | (31. Dezember 2020: 7.114.098) | | | |
| (31. Dezember 2020: 234.438) | | | | 4.074.333 | | | |
| 8.800.000 | Czech Republic Government Bond 0.950% 15-May-2030 | 343.977 | 0,31 | 26.700.000 | Thailand Government Bond 2.875% 17-Jun-2046 | 809.795 | 0,71 |
| 34.900.000 | Czech Republic Government Bond 1.500% 24-Apr-2040 | 1.309.148 | 1,15 | 77.000.000 | Thailand Government Bond 3.400% 17-Jun-2036 | 2.574.021 | 2,27 |
| 26.100.000 | Czech Republic Government Bond 2.750% 23-Jul-2029 | 1.171.912 | 1,03 | 20.000.000 | Thailand Government Bond 3.650% 20-Jun-2031 | 690.517 | 0,61 |
| Ungarn - 1.892.062 | | | | Uruguay - 118.994 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.440.558) | | | | (31. Dezember 2020: 626.062) | | | |
| 265.000.000 | Hungary Government Bond 2.250% 20-Apr-2033 | 658.995 | 0,58 | 5.500.000 | Uruguay Government International Bond 8.250% 21-May-2031 | 118.994 | 0,11 |
| 44.000.000 | Hungary Government Bond 3.000% 27-Oct-2027 | 125.770 | 0,11 | Gesamtanlagen in Anleihen | | | |
| 105.000.000 | Hungary Government Bond 3.000% 21-Aug-2030 | 289.324 | 0,26 | 103.195.739 | | | |
| 328.000.000 | Hungary Government Bond 3.000% 27-Oct-2038 | 817.973 | 0,72 | 90,87 | | | |
| Indonesien - 8.055.303 | | | | Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 910.828 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 1.165.896) | | | |
| (31. Dezember 2020: 16.700.868) | | | | 104.106.567 | | | |
| 48.000.000.000 | Indonesia Treasury Bond 6.125% 15-May-2028 | 3.431.788 | 3,02 | 91,67 | | | |
| 34.704.000.000 | Indonesia Treasury Bond 7.000% 15-May-2027 | 2.615.043 | 2,30 | Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | | |
| 1.400.000.000 | Indonesia Treasury Bond 7.500% 15-Jun-2035 | 103.066 | 0,09 | 104.106.567 | | | |
| 12.700.000.000 | Indonesia Treasury Bond 8.250% 15-Jun-2032 | 998.491 | 0,88 | 91,67 | | | |
| 11.500.000.000 | Indonesia Treasury Bond 8.375% 15-Mar-2034 | 906.915 | 0,80 | Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (481.453) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (939.928)) | | | |
| Malaysia - 4.213.292 | | | | (481.453) | | | |
| (31. Dezember 2020: 3.895.724) | | | | (0,42) | | | |
| 4.150.000 | Malaysia Government Bond 3.502% 31-May-2027 | 1.009.969 | 0,89 | Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | | |
| 5.350.000 | Malaysia Government Bond 3.828% 05-Jul-2034 | 1.278.899 | 1,13 | (481.453) | | | |
| 7.350.000 | Malaysia Government Bond 4.921% 06-Jul-2048 | 1.924.424 | 1,69 | 0,42 | | | |
| Mexiko - 12.778.997 | | | | Nettoumlaufvermögen | | | |
| (31. Dezember 2020: 27.111.323) | | | | 9.934.616 | | | |
| 108.275.000 | Mexican Bonos 7.500% 03-Jun-2027 | 5.306.644 | 4,67 | 8,75 | | | |
| 40.200.000 | Mexican Bonos 7.750% 13-Nov-2042 | 1.907.210 | 1,68 | Summe Nettovermögen | | | |
| 107.600.000 | Mexican Bonos 8.500% 31-May-2029 | 5.565.143 | 4,90 | 113.559.730 | | | |
| | | | | 100,00 | | | |
| | | | | Portfolioanalyse | | | |
| | | | | % des Gesamtvermögens | | | |
| | | | | An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | |
| | | | | 89,51 | | | |
| | | | | Derivative OTC-Finanzinstrumente | | | |
| | | | | 0,79 | | | |
| | | | | Sonstiges Umlaufvermögen | | | |
| | | | | 9,70 | | | |
| | | | | Gesamtvermögen | | | |
| | | | | 100,00 | | | |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte

| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|---|-----------------------|---------------|----------------|------------------|----------------------------------|-------------------------------------|
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund | | | | | | |
| Ungarischer Forint | US-Dollar | 218.608.040 | 670.546 | 3. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | 3.209 |
| Brasilianischer Real | US-Dollar | 21.135.000 | 3.748.736 | 4. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | 45.698 |
| Brasilianischer Real | US-Dollar | 1.080.000 | 187.614 | 4. Jan. 22 | Citigroup Global Markets Limited | 6.282 |
| Brasilianischer Real | US-Dollar | 21.375.000 | 3.830.302 | 4. Jan. 22 | Goldman Sachs | 7.220 |
| Brasilianischer Real | US-Dollar | 840.000 | 150.524 | 4. Jan. 22 | Citigroup Global Markets Limited | 284 |
| Euro | US-Dollar | 130.000 | 147.503 | 5. Jan. 22 | HSBC Bank plc | 502 |
| US-Dollar | Hongkong-Dollar | 11.931.327 | 92.500.000 | 10. Jan. 22 | Citigroup Global Markets Limited | 68.493 |
| Taiwan-Dollar | US-Dollar | 2.300.000 | 83.003 | 18. Feb. 22 | HSBC Bank plc | 127 |
| Taiwan-Dollar | US-Dollar | 2.720.000 | 98.018 | 18. Feb. 22 | Barclays Bank PLC | 291 |
| US-Dollar | Taiwan-Dollar | 2.643.624 | 72.860.000 | 18. Feb. 22 | HSBC Bank plc | 17.462 |
| Brasilianischer Real | US-Dollar | 21.375.000 | 3.736.627 | 3. Mrz. 22 | Goldman Sachs | 48.817 |
| Chinesischer Yuan | US-Dollar | 3.120.000 | 485.656 | 16. Mrz. 22 | Barclays Bank PLC | 2.858 |
| Tschechische Krone | US-Dollar | 16.840.000 | 746.421 | 16. Mrz. 22 | HSBC Bank plc | 19.096 |
| Ungarischer Forint | US-Dollar | 371.760.000 | 1.125.663 | 16. Mrz. 22 | JPMorgan Chase Bank | 11.942 |
| Ungarischer Forint | US-Dollar | 870.120.000 | 2.654.626 | 16. Mrz. 22 | Citigroup Global Markets Limited | 7.987 |
| Indische Rupie | US-Dollar | 127.930.000 | 1.677.375 | 16. Mrz. 22 | JPMorgan Chase Bank | 25.363 |
| Indonesische Rupiah | US-Dollar | 5.523.340.000 | 380.605 | 16. Mrz. 22 | JPMorgan Chase Bank | 4.775 |
| Malaysischer Ringgit | US-Dollar | 22.910.000 | 5.402.028 | 16. Mrz. 22 | Barclays Bank PLC | 91.320 |
| Mexikanischer Peso | US-Dollar | 6.757.492 | 320.483 | 16. Mrz. 22 | Barclays Bank PLC | 5.451 |
| Mexikanischer Peso | US-Dollar | 122.500.000 | 5.755.295 | 16. Mrz. 22 | Goldman Sachs | 153.237 |
| Polnischer Zloty | US-Dollar | 28.720.000 | 7.017.321 | 16. Mrz. 22 | HSBC Bank plc | 73.000 |
| Polnischer Zloty | US-Dollar | 16.790.000 | 4.105.837 | 16. Mrz. 22 | JPMorgan Chase Bank | 39.236 |
| Rumanischer Leu | US-Dollar | 2.110.000 | 479.306 | 16. Mrz. 22 | Goldman Sachs | 2.857 |
| Rumanischer Leu | US-Dollar | 510.000 | 114.877 | 16. Mrz. 22 | JPMorgan Chase Bank | 1.664 |
| Thailändischer Baht | US-Dollar | 117.200.000 | 3.501.068 | 16. Mrz. 22 | Citigroup Global Markets Limited | 6.401 |
| Thailändischer Baht | US-Dollar | 37.460.000 | 1.111.853 | 16. Mrz. 22 | Citigroup Global Markets Limited | 9.220 |
| Thailändischer Baht | US-Dollar | 93.830.000 | 2.801.899 | 16. Mrz. 22 | JPMorgan Chase Bank | 6.171 |
| Türkische Lira | US-Dollar | 10.500.000 | 724.263 | 16. Mrz. 22 | Citigroup Global Markets Limited | 22.573 |
| US-Dollar | Chilenischer Peso | 2.165.492 | 1.855.870.000 | 16. Mrz. 22 | Citigroup Global Markets Limited | 10.779 |
| US-Dollar | Chinesischer Yuan | 4.137.776 | 26.420.000 | 16. Mrz. 22 | HSBC Bank plc | 1.063 |
| US-Dollar | Chinesischer Yuan | 3.296.266 | 21.050.000 | 16. Mrz. 22 | Barclays Bank PLC | 361 |
| US-Dollar | Kolumbianischer Peso | 3.043.001 | 12.088.320.000 | 16. Mrz. 22 | Citigroup Global Markets Limited | 93.402 |
| US-Dollar | Russischer Rubel | 2.702.337 | 203.540.000 | 16. Mrz. 22 | Barclays Bank PLC | 22.975 |
| US-Dollar | Südafrikanischer Rand | 4.047.479 | 64.480.000 | 16. Mrz. 22 | Citigroup Global Markets Limited | 41.373 |
| USD | | | | | | 851.489 |
| US-Dollar | Brasilianischer Real | 3.787.295 | 21.135.000 | 4. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | (7139) |
| US-Dollar | Brasilianischer Real | 193.531 | 1.080.000 | 4. Jan. 22 | Citigroup Global Markets Limited | (365) |
| US-Dollar | Brasilianischer Real | 3.789.558 | 21.375.000 | 4. Jan. 22 | Goldman Sachs | (47965) |
| US-Dollar | Brasilianischer Real | 147.201 | 840.000 | 4. Jan. 22 | Citigroup Global Markets Limited | (3.607) |
| Hongkong-Dollar | US-Dollar | 20.920.000 | 2.685.149 | 10. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | (2.225) |
| Hongkong-Dollar | US-Dollar | 1.520.000 | 195.248 | 10. Jan. 22 | HSBC Bank plc | (312) |
| Hongkong-Dollar | US-Dollar | 19.900.000 | 2.561.002 | 10. Jan. 22 | Citigroup Global Markets Limited | (8.890) |
| Hongkong-Dollar | US-Dollar | 23.700.000 | 3.045.521 | 10. Jan. 22 | HSBC Bank plc | (6.070) |
| Taiwan-Dollar | US-Dollar | 2.510.000 | 91.273 | 18. Feb. 22 | Barclays Bank PLC | (653) |
| Taiwan-Dollar | US-Dollar | 2.500.000 | 91.508 | 18. Feb. 22 | Barclays Bank PLC | (1.150) |
| Philippinischer Peso | US-Dollar | 7.980.000 | 157.558 | 16. Mrz. 22 | JPMorgan Chase Bank | (3.174) |
| US-Dollar | Ungarischer Forint | 665.611 | 218.610.000 | 16. Mrz. 22 | JPMorgan Chase Bank | (3.347) |
| US-Dollar | Mexikanischer Peso | 8.745.714 | 188.767.492 | 16. Mrz. 22 | Barclays Bank PLC | (359.092) |

Devisenterminkontrakte Forts.

| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|--|------------------------|------------|------------|------------------|-----------------------------|-------------------------------------|
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund Forts. | | | | | | |
| US-Dollar | Peruanischer neuer Sol | 391.727 | 1.610.000 | 16. Mrz. 22 | JPMorgan Chase Bank | (10.128) |
| US-Dollar | Polnischer Zloty | 1.165.124 | 4.820.000 | 16. Mrz. 22 | JPMorgan Chase Bank | (24.826) |
| USD | | | | | | (478.843) |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged) | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 15.962 | 18.068 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 105 |
| Euro | US-Dollar | 32.799 | 3.7116 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 233 |
| Euro | US-Dollar | 4.122.463 | 4.665.339 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 29.060 |
| USD | | | | | | 29.398 |
| EUR | | | | | | 25.822 |
| US-Dollar | Euro | 18.072 | 15.962 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (105) |
| US-Dollar | Euro | 24.033 | 21.191 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (98) |
| US-Dollar | Euro | 15.747 | 13.947 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (135) |
| US-Dollar | Euro | 20.341 | 18.087 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (256) |
| US-Dollar | Euro | 44.943 | 39.887 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (478) |
| US-Dollar | Euro | 45.687 | 40.533 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (469) |
| USD | | | | | | (1.541) |
| EUR | | | | | | (1.354) |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged) | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 2.794 | 3.162 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 18 |
| Euro | US-Dollar | 3.243.229 | 3.670.321 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 22.862 |
| Euro | US-Dollar | 1.553 | 1.762 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 7 |
| Euro | US-Dollar | 27.376 | 30.980 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 195 |
| Euro | US-Dollar | 143.634 | 162.169 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.393 |
| USD | | | | | | 24.475 |
| EUR | | | | | | 21.498 |
| US-Dollar | Euro | 3.163 | 2.794 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (18) |
| US-Dollar | Euro | 4.129 | 3.657 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (35) |
| US-Dollar | Euro | 35.642 | 31.620 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (366) |
| USD | | | | | | (419) |
| EUR | | | | | | (368) |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund Anteilsklasse EUR W (Hedged) | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 656.018 | 742.407 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 4.624 |
| Euro | US-Dollar | 5.073 | 5.741 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 36 |
| USD | | | | | | 4.660 |
| EUR | | | | | | 4.093 |
| US-Dollar | Euro | 66.258 | 58.685 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (569) |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte Forts.

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

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

| | | | | | | |
|-----------|------|-------|-------|-------------|-----------------------------|--------------|
| US-Dollar | Euro | 7.167 | 6.358 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (74) |
| | | | | | USD | (643) |
| | | | | | EUR | (565) |

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

| | | | | | | |
|-----------|-----------|-------|--------|-------------|-----------------------------|------------|
| Euro | US-Dollar | 9.443 | 10.687 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 67 |
| Euro | US-Dollar | 78 | 88 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1 |
| | | | | | USD | 68 |
| | | | | | EUR | 60 |
| US-Dollar | Euro | 103 | 92 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) |
| | | | | | USD | (1) |
| | | | | | EUR | (1) |

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

| | | | | | | |
|----------------|----------------|-------|-------|-------------|-----------------------------|------------|
| Pfund Sterling | US-Dollar | 4.783 | 6.319 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 155 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 40 | 53 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - |
| | | | | | USD | 155 |
| | | | | | GBP | 115 |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 62 | 47 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) |
| | | | | | USD | (1) |
| | | | | | GBP | (1) |

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

| | | | | | | |
|----------------|----------------|--------|--------|-------------|-----------------------------|------------|
| Pfund Sterling | US-Dollar | 8.000 | 10.582 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 246 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 10.335 | 13.654 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 335 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 154 | 207 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 2 |
| | | | | | USD | 583 |
| | | | | | GBP | 431 |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 216 | 163 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (5) |
| | | | | | USD | (5) |
| | | | | | GBP | (4) |

BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT OPPORTUNISTIC FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|---------------------------------------|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen | | | |
| Argentinien - 201.706 | | | |
| (31. Dezember 2020: 281.901) | | 201.706 | 0,72 |
| 21.880 | Argentine Republic Government International Bond 1.000% 09-Jul-2029 | 7.987 | 0,03 |
| 349.200 | Argentine Republic Government International Bond Step-Up Coupon 1.125% 09-Jul-2035 | 112.184 | 0,40 |
| 230.000 | Argentine Republic Government International Bond Step-Up Coupon 2.500% 09-Jul-2041 | 81.535 | 0,29 |
| Bahrain - 215.797 | | | |
| (31. Dezember 2020: 451.451) | | 215.797 | 0,78 |
| 200.000 | Bahrain Government International Bond 'REGS' 6.750% 20-Sep-2029 | 215.797 | 0,78 |
| Brasilien - 1.484.114 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.951.740) | | 1.484.114 | 5,32 |
| 1.450.000 | Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2025 | 256.654 | 0,92 |
| 1.250.000 | Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2027 | 220.187 | 0,79 |
| 1.450.000 | Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2029 | 253.274 | 0,91 |
| 300.000 | Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2031 | 51.716 | 0,18 |
| 200.000 | Hidrovias International Finance SARL 'REGS' 4.950% 08-Feb-2031 | 182.942 | 0,66 |
| 175.000 | Petrobras Global Finance BV 5.500% 10-Jun-2051 | 162.658 | 0,58 |
| 172.000 | Rede D'or Finance Sarl 'REGS' 4.500% 22-Jan-2030 | 167.683 | 0,60 |
| 200.000 | Rumo Luxembourg Sarl 'REGS' 4.200% 18-Jan-2032 | 189.000 | 0,68 |
| Burkina Faso - 198.888 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | 198.888 | 0,71 |
| 200.000 | Endeavour Mining Plc 'REGS' 5.000% 14-Oct-2026 | 198.888 | 0,71 |
| Chile - 1.332.556 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.216.161) | | 1.332.556 | 4,78 |
| 455.000.000 | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 5.000% 01-Mar-2035 | 498.772 | 1,79 |
| 240.000.000 | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos '144A' 2.800% 01-Oct-2033 | 211.751 | 0,76 |
| 275.000.000 | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos '144A' 4.700% 01-Sep-2030 | 302.158 | 1,08 |
| 280.000.000 | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos '144A' 5.000% 01-Oct-2028 | 319.875 | 1,15 |
| China - 1.967.394 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.528.170) | | 1.967.394 | 7,06 |
| 1.600.000 | China Government Bond 3.120% 05-Dec-2026 | 256.721 | 0,92 |
| 8.050.000 | China Government Bond 3.290% 23-May-2029 | 1.298.583 | 4,66 |
| 2.450.000 | China Government Bond 3.810% 14-Sep-2050 | 412.090 | 1,48 |
| Kolumbien - 1.297.225 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.361.287) | | 1.297.225 | 4,65 |
| 300.000 | Colombia Government International Bond 3.125% 15-Apr-2031 | 269.844 | 0,97 |
| 150.000.000 | Colombian TES 7.250% 26-Oct-2050 | 31.784 | 0,11 |
| 346.100.000 | Colombian TES 7.750% 18-Sep-2030 | 83.105 | 0,30 |
| 1.520.000.000 | Empresas Publicas de Medellin ESP 'REGS' 7.625% 10-Sep-2024 | 368.078 | 1,32 |
| 1.530.000.000 | Empresas Publicas de Medellin ESP 'REGS' 8.375% 08-Nov-2027 | 348.427 | 1,25 |
| 180.000 | Millicom International Cellular SA 'REGS' 6.250% 25-Mar-2029 | 195.987 | 0,70 |
| Elfenbeinküste - 445.664 | | | |
| (31. Dezember 2020: 270.877) | | 445.664 | 1,60 |
| 200.000 | Ivory Coast Government International Bond 'REGS' 5.875% 17-Oct-2031 | 234.506 | 0,84 |
| 200.000 | Ivory Coast Government International Bond 'REGS' 6.125% 15-Jun-2033 | 211.158 | 0,76 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|--|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Tschechische Republik - 287.058 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | 287.058 | 1,03 |
| 1.250.000 | Czech Republic Government Bond 0.950% 15-May-2030 | 48.860 | 0,18 |
| 6.350.000 | Czech Republic Government Bond 1.500% 24-Apr-2040 | 238.198 | 0,85 |
| Dominikanische Republik - 173.250 | | | |
| (31. Dezember 2020: 249.752) | | 173.250 | 0,62 |
| 175.000 | Dominican Republic International Bond 'REGS' 5.300% 21-Jan-2041 | 173.250 | 0,62 |
| Ecuador - 341.135 | | | |
| (31. Dezember 2020: 281.083) | | 341.135 | 1,22 |
| 34.728 | Ecuador Government International Bond 'REGS' (Zero Coupon) 0.000% 31-Jul-2030 | 19.708 | 0,07 |
| 118.040 | Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 0.500% 31-Jul-2040 | 69.423 | 0,25 |
| 257.556 | Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 1.000% 31-Jul-2035 | 170.309 | 0,61 |
| 98.280 | Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 5.000% 31-Jul-2030 | 81.695 | 0,29 |
| Ägypten - 512.402 | | | |
| (31. Dezember 2020: 444.845) | | 512.402 | 1,84 |
| 300.000 | Egypt Government International Bond 'REGS' 5.875% 16-Feb-2031 | 266.676 | 0,96 |
| 300.000 | Egypt Government International Bond 'REGS' 7.500% 16-Feb-2061 | 245.726 | 0,88 |
| El Salvador - 16.870 | | | |
| (31. Dezember 2020: 26.565) | | 16.870 | 0,06 |
| 28.000 | El Salvador Government International Bond 'REGS' 6.375% 18-Jan-2027 | 16.870 | 0,06 |
| Ghana - 359.839 | | | |
| (31. Dezember 2020: 419.545) | | 359.839 | 1,29 |
| 200.000 | Ghana Government International Bond 'REGS' 7.875% 11-Feb-2035 | 157.500 | 0,56 |
| 200.000 | Tullow Oil Plc 'REGS' 10.250% 15-May-2026 | 202.339 | 0,73 |
| Ungarn - 268.721 | | | |
| (31. Dezember 2020: 184.654) | | 268.721 | 0,96 |
| 45.000.000 | Hungary Government Bond 2.250% 20-Apr-2033 | 111.905 | 0,40 |
| 37.000.000 | Hungary Government Bond 3.000% 21-Aug-2030 | 101.952 | 0,36 |
| 22.000.000 | Hungary Government Bond 3.000% 27-Oct-2038 | 54.864 | 0,20 |
| Indien - 203.940 | | | |
| (31. Dezember 2020: 214.441) | | 203.940 | 0,73 |
| 200.000 | Export-Import Bank of India 'REGS' 3.250% 15-Jan-2030 | 203.940 | 0,73 |
| Indonesien - 1.824.239 | | | |
| (31. Dezember 2020: 2.573.522) | | 1.824.239 | 6,54 |
| 250.000 | Adaro Indonesia PT 'REGS' 4.250% 31-Oct-2024 | 255.937 | 0,92 |
| 2.294.000.000 | Indonesia Treasury Bond 6.125% 15-May-2028 | 164.011 | 0,59 |
| 5.500.000.000 | Indonesia Treasury Bond 7.000% 15-May-2027 | 414.440 | 1,48 |
| 1.100.000.000 | Indonesia Treasury Bond 8.250% 15-May-2036 | 85.843 | 0,31 |
| 2.230.000.000 | Indonesia Treasury Bond 9.000% 15-Mar-2029 | 181.255 | 0,65 |
| 200.000 | Medco Laurel Tree Pte Ltd 'REGS' 6.950% 12-Nov-2028 | 198.535 | 0,71 |
| 200.000 | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 'REGS' 3.000% 30-Jun-2030 | 198.787 | 0,71 |
| 290.000 | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 'REGS' 5.250% 24-Oct-2042 | 325.431 | 1,17 |
| Israel - 676.862 | | | |
| (31. Dezember 2020: 494.050) | | 676.862 | 2,43 |
| 200.000 | Energean Israel Finance Ltd '144A' 5.875% 30-Mar-2031 | 196.924 | 0,71 |
| 280.000 | ICL Group Ltd '144A' 6.375% 31-May-2038 | 361.200 | 1,29 |
| 115.000 | Leviathan Bond Ltd '144A' 5.750% 30-Jun-2023 | 118.738 | 0,43 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|---------------------------------------|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Kasachstan - 433.870 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 200.000 | KazMunayGas National Co JSC 'REGS' 5.375% 24-Apr-2030 | 233.625 | 0,84 |
| 200.000 | Tengizchevroil Finance Co International Ltd 'REGS' 3.250% 15-Aug-2030 | 200.245 | 0,72 |
| Malaysia - 389.269 | | | |
| (31. Dezember 2020: 279.727) | | | |
| 350.000 | Malaysia Government Bond 3.828% 05-Jul-2034 | 83.666 | 0,30 |
| 450.000 | Malaysia Government Bond 3.885% 15-Aug-2029 | 110.337 | 0,40 |
| 415.000 | Malaysia Government Bond 4.893% 08-Jun-2038 | 108.863 | 0,39 |
| 330.000 | Malaysia Government Bond 4.921% 06-Jul-2048 | 86.403 | 0,31 |
| Mexiko - 3.201.286 | | | |
| (31. Dezember 2020: 3.630.123) | | | |
| 178.000 | Axtel SAB de CV 'REGS' 6.375% 14-Nov-2024 | 183.880 | 0,66 |
| 400.000 | Comision Federal de Electricidad 'REGS' 3.348% 09-Feb-2031 | 392.908 | 1,41 |
| 200.000 | Comision Federal de Electricidad 'REGS' 3.875% 26-Jul-2033 | 196.863 | 0,71 |
| 200.000 | Infraestructura Energetica Nova SAB de CV 'REGS' 4.875% 14-Jan-2048 | 202.374 | 0,72 |
| 3.500.000 | Mexican Bonos 5.500% 04-Mar-2027 | 156.940 | 0,56 |
| 9.000.000 | Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031 | 444.662 | 1,59 |
| 9.500.000 | Mexican Bonos 7.750% 13-Nov-2042 | 450.709 | 1,62 |
| 10.500.000 | Mexican Bonos 8.500% 31-May-2029 | 543.067 | 1,95 |
| 65.000 | Petroleos Mexicanos 6.500% 23-Jan-2029 | 67.548 | 0,24 |
| 2.725.000 | Petroleos Mexicanos 7.470% 12-Nov-2026 | 121.036 | 0,43 |
| 195.000 | Petroleos Mexicanos 7.690% 23-Jan-2050 | 188.560 | 0,68 |
| 250.000 | Petroleos Mexicanos 'REGS' 6.700% 16-Feb-2032 | 252.739 | 0,91 |
| Marokko - 189.453 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 200.000 | OCP SA 'REGS' 5.125% 23-Jun-2051 | 189.453 | 0,68 |
| Nigeria - 585.799 | | | |
| (31. Dezember 2020: 216.005) | | | |
| 200.000 | Nigeria Government International Bond 'REGS' 6.500% 28-Nov-2027 | 200.149 | 0,72 |
| 200.000 | Nigeria Government International Bond 'REGS' 7.875% 16-Feb-2032 | 197.650 | 0,71 |
| 200.000 | Nigeria Government International Bond 'REGS' 8.250% 28-Sep-2051 | 188.000 | 0,67 |
| Oman - 215.745 | | | |
| (31. Dezember 2020: 206.930) | | | |
| 200.000 | Oman Government International Bond 'REGS' 6.000% 01-Aug-2029 | 215.745 | 0,77 |
| Peru - 445.694 | | | |
| (31. Dezember 2020: 616.987) | | | |
| 850.000 | Peru Government Bond 5.700% 12-Aug-2024 | 220.323 | 0,79 |
| 100.000 | Peru Government Bond 5.940% 12-Feb-2029 | 25.671 | 0,09 |
| 200.000 | Peruvian Government International Bond 3.000% 15-Jan-2034 | 199.700 | 0,72 |
| Katar - 297.930 | | | |
| (31. Dezember 2020: 202.975) | | | |
| 300.000 | Qatar Energy 'REGS' 2.250% 12-Jul-2031 | 297.930 | 1,07 |
| Republik Serbien - 104.397 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 100.000 | Serbia International Bond 'REGS' 2.050% 23-Sep-2036 | 104.397 | 0,38 |
| Rumänien - 24.086 | | | |
| (31. Dezember 2020: 54.423) | | | |
| 100.000 | Romania Government Bond 5.800% 26-Jul-2027 | 24.086 | 0,09 |
| Russland - 2.878.000 | | | |
| (31. Dezember 2020: 3.063.148) | | | |
| 200.000 | Credit Bank of Moscow Via CBOM Finance Plc 'REGS' 3.875% 21-Sep-2026 | 189.450 | 0,68 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|---|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Russland Forts. | | | |
| 200.000 | Lukoil Capital DAC 'REGS' 3.600% 26-Oct-2031 | 195.187 | 0,70 |
| 200.000 | Polyus Finance Plc 'REGS' 3.250% 14-Oct-2028 | 194.940 | 0,70 |
| 16.100.000 | Russian Federal Bond - OFZ 6.000% 06-Oct-2027 | 192.089 | 0,69 |
| 94.000.000 | Russian Federal Bond - OFZ 7.050% 19-Jan-2028 | 1.178.068 | 4,22 |
| 8.400.000 | Russian Federal Bond - OFZ 7.650% 10-Apr-2030 | 108.019 | 0,39 |
| 44.473.000 | Russian Federal Bond - OFZ 7.700% 23-Mar-2033 | 570.589 | 2,05 |
| 19.700.000 | Russian Federal Bond - OFZ 7.700% 16-Mar-2039 | 249.658 | 0,89 |
| Senegal - 407.543 | | | |
| (31. Dezember 2020: 444.555) | | | |
| 395.000 | Senegal Government International Bond 'REGS' 6.250% 23-May-2033 | 407.543 | 1,46 |
| Südafrika - 2.080.836 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.619.200) | | | |
| 16.700.000 | Republic of South Africa Government Bond 7.000% 28-Feb-2031 | 883.968 | 3,17 |
| 10.850.000 | Republic of South Africa Government Bond 8.000% 31-Jan-2030 | 628.598 | 2,25 |
| 6.150.000 | Republic of South Africa Government Bond 8.750% 28-Feb-2048 | 321.126 | 1,15 |
| 650.000 | Republic of South Africa Government Bond 10.500% 21-Dec-2026 | 45.156 | 0,16 |
| 200.000 | Sasol Financing USA LLC 5.500% 18-Mar-2031 | 201.988 | 0,73 |
| Supranational - 505.743 | | | |
| (31. Dezember 2020: 721.857) | | | |
| 230.000 | African Export-Import Bank/The 'REGS' 3.994% 21-Sep-2029 | 237.939 | 0,85 |
| 245.000 | Banque Ouest Africaine de Developpement 'REGS' 4.700% 22-Oct-2031 | 267.804 | 0,96 |
| Tansania - 407.427 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 200.000 | AngloGold Ashanti Holdings Plc 3.375% 01-Nov-2028 | 198.327 | 0,71 |
| 200.000 | HTA Group Ltd/Mauritius 'REGS' 7.000% 18-Dec-2025 | 209.100 | 0,75 |
| Thailand - 736.008 | | | |
| (31. Dezember 2020: 980.268) | | | |
| 7.250.000 | Thailand Government Bond 3.400% 17-Jun-2036 | 242.359 | 0,87 |
| 6.000.000 | Thailand Government Bond 3.650% 20-Jun-2031 | 207.155 | 0,74 |
| 7.900.000 | Thailand Government Bond 4.875% 22-Jun-2029 | 286.494 | 1,03 |
| Türkei - 398.348 | | | |
| (31. Dezember 2020: 671.353) | | | |
| 200.000 | Anadolu Efes Biracilik Ve Malt Sanayii AS 'REGS' 3.375% 29-Jun-2028 | 194.970 | 0,70 |
| 200.000 | Türk Telekomunikasyon AS 'REGS' 6.875% 28-Feb-2025 | 203.378 | 0,73 |
| Ukraine - 485.683 | | | |
| (31. Dezember 2020: 668.585) | | | |
| 200.000 | Ukraine Government International Bond 'REGS' 7.375% 25-Sep-2032 | 179.026 | 0,64 |
| 115.000 | Ukraine Government International Bond 'REGS' FRN 1.258% 31-May-2040 | 105.107 | 0,38 |
| 200.000 | VF Ukraine PAT via VFU Funding Plc 'REGS' 6.200% 11-Feb-2025 | 201.550 | 0,72 |
| Vereinigte Arabische Emirate - 897.272 | | | |
| (31. Dezember 2020: 493.043) | | | |
| 200.000 | DAE Funding LLC 'REGS' 3.375% 20-Mar-2028 | 203.000 | 0,73 |
| 200.000 | DP World Crescent Ltd 'EMTN' 3.875% 18-Jul-2029 | 213.650 | 0,76 |
| 200.000 | DP World Ltd/United Arab Emirates 'REGS' 6.850% 02-Jul-2037 | 263.904 | 0,95 |
| 200.000 | DP World Salaam FRN (Perpetual) 6.000% 01-Oct-2025 | 216.718 | 0,78 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Nettovermögen % |
|----------------------------------|---|----------------------------|-----------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| | Uruguay - 39.754 | | |
| | (31. Dezember 2020: 90.923) | 39.754 | 0,14 |
| 600.000 | Uruguay Government International Bond 8.250% 21-May-2031 | 12.981 | 0,05 |
| 1.195.000 | Uruguay Government International Bond 'REGS' 8.500% 15-Mar-2028 | 26.773 | 0,09 |
| Gesamtanlagen in Anleihen | | 26.531.803 | 95,15 |

| Bestände | Beschreibung | Zugrunde liegendes Engagement USD | Beizulegender Zeitwert USD | Nettovermögen % |
|---|--|-----------------------------------|----------------------------|-----------------|
| Offene Terminkontrakte - 3.494 | | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | | |
| (1) | Euro-Bund Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (195.105) | 3.494 | 0,01 |
| Offene Terminkontrakte insgesamt | | | 3.494 | 0,01 |

Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 96.068 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 69.009)

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt **26.631.365** **95,50**

| Bestände | Beschreibung | Zugrunde liegendes Engagement USD | Beizulegender Zeitwert USD | Nettovermögen % |
|---|---|-----------------------------------|----------------------------|-----------------|
| Offene Terminkontrakte - (1.441) | | | | |
| (31. Dezember 2020: (550)) | | | | |
| (13) | U.S. 10 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (1.696.094) | (1.441) | (0,00) |
| Offene Terminkontrakte insgesamt | | | (1.441) | (0,00) |

Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (81.789) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (89.046))

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt **(83.230)** **(0,29)**

Nettoumlaufvermögen **1.335.153** **4,79**

Summe Nettovermögen **27.883.288** **100,00**

Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist Bank of America Merrill Lynch.

Portfolioanalyse **% des Gesamtvermögens**

| | |
|--|---------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 94,44 |
| An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente | 0,01 |
| OTC-Derivate | 0,34 |
| Sonstiges Umlaufvermögen | 5,21 |
| Gesamtvermögen | 100,00 |

| Devisenterminkontrakte | | | | | | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|--|-----------------------|-------------|-----------------------------|-------------|----------------------------------|------------|-------------------------------------|
| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag Abrechnungsdatum (V) | | | | |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund | | | | | | | |
| Ungarischer Forint | US-Dollar | 24.910.000 | 78.378 | 3. Jan. 22 | Citigroup Global Markets Limited | 395 | |
| Ungarischer Forint | US-Dollar | 12.212.120 | 37.459 | 3. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | 179 | |
| Brasilianischer Real | US-Dollar | 90.000 | 16.128 | 4. Jan. 22 | Citigroup Global Markets Limited | 30 | |
| Brasilianischer Real | US-Dollar | 290.000 | 51.967 | 4. Jan. 22 | Citigroup Global Markets Limited | 98 | |
| Brasilianischer Real | US-Dollar | 2.230.000 | 395.537 | 4. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | 4.822 | |
| Brasilianischer Real | US-Dollar | 1.850.000 | 331.512 | 4. Jan. 22 | Goldman Sachs | 625 | |
| US-Dollar | Hongkong-Dollar | 988.043 | 7.660.000 | 10. Jan. 22 | Citigroup Global Markets Limited | 5.672 | |
| Taiwan-Dollar | US-Dollar | 1.840.000 | 66.402 | 18. Feb. 22 | HSBC Bank plc | 101 | |
| US-Dollar | Taiwan-Dollar | 45.754 | 1.250.000 | 18. Feb. 22 | Barclays Bank PLC | 575 | |
| US-Dollar | Taiwan-Dollar | 557.759 | 15.330.000 | 18. Feb. 22 | HSBC Bank plc | 3.684 | |
| Brasilianischer Real | US-Dollar | 1.850.000 | 323.404 | 3. Mrz. 22 | Goldman Sachs | 4.225 | |
| Chinesischer Yuan | US-Dollar | 50.000 | 7.783 | 16. Mrz. 22 | HSBC Bank plc | 46 | |
| Ungarischer Forint | US-Dollar | 24.910.000 | 75.997 | 16. Mrz. 22 | Citigroup Global Markets Limited | 229 | |
| Ungarischer Forint | US-Dollar | 86.090.000 | 260.675 | 16. Mrz. 22 | JPMorgan Chase Bank | 2.765 | |
| Ungarischer Forint | US-Dollar | 86.360.000 | 263.228 | 16. Mrz. 22 | HSBC Bank plc | 1.038 | |
| Indische Rupie | US-Dollar | 28.950.000 | 379.583 | 16. Mrz. 22 | JPMorgan Chase Bank | 5.740 | |
| Indische Rupie | US-Dollar | 2.720.000 | 35.714 | 16. Mrz. 22 | Citigroup Global Markets Limited | 489 | |
| Malaysischer Ringgit | US-Dollar | 2.920.000 | 688.517 | 16. Mrz. 22 | Barclays Bank PLC | 11.639 | |
| Malaysischer Ringgit | US-Dollar | 390.000 | 92.340 | 16. Mrz. 22 | Barclays Bank PLC | 1.174 | |
| Mexikanischer Peso | US-Dollar | 1.030.000 | 48.862 | 16. Mrz. 22 | Citigroup Global Markets Limited | 818 | |
| Mexikanischer Peso | US-Dollar | 14.500.000 | 681.239 | 16. Mrz. 22 | Goldman Sachs | 18.138 | |
| Mexikanischer Peso | US-Dollar | 330.000 | 15.839 | 16. Mrz. 22 | Barclays Bank PLC | 78 | |
| Polnischer Zloty | US-Dollar | 310.000 | 75.318 | 16. Mrz. 22 | JPMorgan Chase Bank | 1.214 | |
| Polnischer Zloty | US-Dollar | 2.600.000 | 635.806 | 16. Mrz. 22 | JPMorgan Chase Bank | 6.076 | |
| Polnischer Zloty | US-Dollar | 3.880.000 | 948.022 | 16. Mrz. 22 | HSBC Bank plc | 9.862 | |
| Thailändischer Baht | US-Dollar | 18.010.000 | 538.005 | 16. Mrz. 22 | Citigroup Global Markets Limited | 984 | |
| Thailändischer Baht | US-Dollar | 2.140.000 | 63.359 | 16. Mrz. 22 | JPMorgan Chase Bank | 685 | |
| Thailändischer Baht | US-Dollar | 5.670.000 | 169.314 | 16. Mrz. 22 | JPMorgan Chase Bank | 373 | |
| Türkische Lira | US-Dollar | 330.000 | 22.763 | 16. Mrz. 22 | Citigroup Global Markets Limited | 709 | |
| US-Dollar | Chilianischer Peso | 300.355 | 257.410.000 | 16. Mrz. 22 | Citigroup Global Markets Limited | 1.495 | |
| US-Dollar | Chinesischer Yuan | 416.597 | 2.660.000 | 16. Mrz. 22 | HSBC Bank plc | 107 | |
| US-Dollar | Russischer Rubel | 390.600 | 29.420.000 | 16. Mrz. 22 | Barclays Bank PLC | 3.321 | |
| US-Dollar | Russischer Rubel | 252.988 | 19.050.000 | 16. Mrz. 22 | Barclays Bank PLC | 2.217 | |
| US-Dollar | Südafrikanischer Rand | 414.289 | 6.600.000 | 16. Mrz. 22 | Citigroup Global Markets Limited | 4.235 | |
| US-Dollar | Südafrikanischer Rand | 129.183 | 2.060.000 | 16. Mrz. 22 | Goldman Sachs | 1.196 | |
| US-Dollar | Südafrikanischer Rand | 216.002 | 3.460.000 | 16. Mrz. 22 | JPMorgan Chase Bank | 1.034 | |
| | | | | | | USD | 96.068 |
| US-Dollar | Brasilianischer Real | 50.378 | 290.000 | 4. Jan. 22 | Citigroup Global Markets Limited | (1.687) | |
| US-Dollar | Brasilianischer Real | 327.985 | 1.850.000 | 4. Jan. 22 | Goldman Sachs | (4.151) | |
| US-Dollar | Brasilianischer Real | 15.771 | 90.000 | 4. Jan. 22 | Citigroup Global Markets Limited | (386) | |
| US-Dollar | Brasilianischer Real | 399.606 | 2.230.000 | 4. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | (753) | |
| US-Dollar | Euro | 358.958 | 317.000 | 16. Feb. 22 | JPMorgan Chase Bank | (2.259) | |
| Taiwan-Dollar | US-Dollar | 500.000 | 18.182 | 18. Feb. 22 | Barclays Bank PLC | (110) | |
| US-Dollar | Taiwan-Dollar | 38.649 | 1.070.000 | 18. Feb. 22 | JPMorgan Chase Bank | (24) | |
| Kolumbianischer Peso | US-Dollar | 755.935.000 | 190.292 | 16. Mrz. 22 | Citigroup Global Markets Limited | (5.841) | |
| Kolumbianischer Peso | US-Dollar | 334.860.000 | 83.030 | 16. Mrz. 22 | Barclays Bank PLC | (1.323) | |
| Philippinischer Peso | US-Dollar | 1.035.000 | 20.435 | 16. Mrz. 22 | JPMorgan Chase Bank | (412) | |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte Forts.

| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungs- datum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) |
|---|---------------------------|---------------|---------------|-----------------------|-------------------------------------|---|
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund Forts. | | | | | | |
| US-Dollar | Chilenischer Peso | 195.561 | 170.860.000 | 16. Mrz. 22 | Citigroup Global Markets Limited | (2.811) |
| US-Dollar | Chinesischer Yuan | 191.825 | 1.230.000 | 16. Mrz. 22 | HSBC Bank plc | (762) |
| US-Dollar | Tschechische Krone | 52.273 | 1.190.000 | 16. Mrz. 22 | JPMorgan Chase Bank | (1.822) |
| US-Dollar | Ungarischer Forint | 75.825 | 24.910.000 | 16. Mrz. 22 | Citigroup Global Markets Limited | (401) |
| US-Dollar | Ungarischer Forint | 371.76 | 12.210.000 | 16. Mrz. 22 | JPMorgan Chase Bank | (187) |
| US-Dollar | Indonesische Rupiah | 206.317 | 2.994.070.000 | 16. Mrz. 22 | JPMorgan Chase Bank | (2.688) |
| US-Dollar | Mexikanischer Peso | 46.956 | 990.000 | 16. Mrz. 22 | JPMorgan Chase Bank | (795) |
| US-Dollar | Mexikanischer Peso | 1.024.370 | 22.110.000 | 16. Mrz. 22 | Barclays Bank PLC | (42.060) |
| US-Dollar | Peruanischer neuer Sol | 231.144 | 950.000 | 16. Mrz. 22 | JPMorgan Chase Bank | (5.976) |
| US-Dollar | Polnischer Zloty | 246.561 | 1.020.000 | 16. Mrz. 22 | JPMorgan Chase Bank | (5.254) |
| US-Dollar | Rumänischer Leu | 150.917 | 670.000 | 16. Mrz. 22 | JPMorgan Chase Bank | (2.187) |
| USD | | | | | | (81.789) |

BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT TOTAL RETURN FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Nettovermögen % | Summe |
|---|--|----------------------------|-----------------|-------|
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | | | |
| Irland - 4.014.000 | | | | |
| | (31. Dezember 2020: 5.770.066) | 4.014.000 | 3,19 | |
| 4.014.000 | Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund | 4.014.000 | 3,19 | |
| Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen | | 4.014.000 | 3,19 | |
| Anleihen | | | | |
| Angola - 687.358 | | | | |
| | (31. Dezember 2020: 1.784.840) | 687.358 | 0,55 | |
| 700.000 | Angolan Government International Bond 'REGS' 9.375% 08-May-2048 | 687.358 | 0,55 | |
| Argentinien - 2.633.357 | | | | |
| | (31. Dezember 2020: 1.669.204) | 2.633.357 | 2,10 | |
| 800.000 | Argentine Republic Government International Bond Step-Up Coupon 0.500% 09-Jul-2030 | 282.008 | 0,22 | |
| 5.148.240 | Argentine Republic Government International Bond Step-Up Coupon 1.125% 09-Jul-2035 | 1.653.924 | 1,32 | |
| 1.000.000 | YPF SA 'REGS' 8.500% 27-Jun-2029 | 697.425 | 0,56 | |
| Bahamas - 1.247.076 | | | | |
| | (31. Dezember 2020: 2.785.875) | 1.247.076 | 0,99 | |
| 1.350.000 | Bahamas Government International Bond 'REGS' 8.950% 15-Oct-2032 | 1.247.076 | 0,99 | |
| Belarus - 956.280 | | | | |
| | (31. Dezember 2020: -) | 956.280 | 0,76 | |
| 1.200.000 | Republic of Belarus International Bond 'REGS' 6.200% 28-Feb-2030 | 956.280 | 0,76 | |
| Brasilien - 8.908.041 | | | | |
| | (31. Dezember 2020: 15.398.092) | 8.908.041 | 7,09 | |
| 1.010.000 | Azul Investments LLP 'REGS' 7.250% 15-Jun-2026 | 926.463 | 0,74 | |
| 300.000 | Braskem Netherlands Finance BV 'REGS' 5.875% 31-Jan-2050 | 346.171 | 0,27 | |
| 35.000.000 | Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2025 | 6.195.099 | 4,93 | |
| 500.000 | Minerva Luxembourg SA 'REGS' 4.375% 18-Mar-2031 | 476.408 | 0,38 | |
| 1.020.000 | Rumo Luxemburg Sarl 'REGS' 4.200% 18-Jan-2032 | 963.900 | 0,77 | |
| Burkina Faso - 596.664 | | | | |
| | (31. Dezember 2020: -) | 596.664 | 0,47 | |
| 600.000 | Endeavour Mining Plc 'REGS' 5.000% 14-Oct-2026 | 596.664 | 0,47 | |
| Chile - 7.701.352 | | | | |
| | (31. Dezember 2020: 1.554.201) | 7.701.352 | 6,13 | |
| 1.200.000.000 | Bonos de la Tesorería de la República en pesos 4.500% 01-Mar-2026 | 1.362.266 | 1,08 | |
| 1.100.000.000 | Bonos de la Tesorería de la República en pesos '144A' 2.300% 01-Oct-2028 | 1.065.722 | 0,85 | |
| 1.350.000.000 | Bonos de la Tesorería de la República en pesos '144A' 5.000% 01-Oct-2028 | 1.536.823 | 1,22 | |
| 540.000 | CAP SA 'REGS' 3.900% 27-Apr-2031 | 509.625 | 0,41 | |
| 1.550.000 | Chile Government International Bond 3.100% 22-Jan-2061 | 1.441.283 | 1,15 | |
| 730.000 | Empresa Nacional de Telecomunicaciones SA 'REGS' 3.050% 14-Sep-2032 | 718.419 | 0,57 | |
| 1.100.000 | Sociedad Química y Minera de Chile SA 'REGS' 3.500% 10-Sep-2051 | 1.067.214 | 0,85 | |
| China - 5.475.441 | | | | |
| | (31. Dezember 2020: 5.121.681) | 5.475.441 | 4,36 | |
| 8.700.000 | China Government Bond 3.020% 27-May-2031 | 1.387.289 | 1,10 | |
| 4.200.000 | China Government Bond 3.720% 12-Apr-2051 | 699.540 | 0,56 | |
| 1.900.000 | Fortune Star BVI Ltd 3.950% 02-Oct-2026 | 2.048.634 | 1,63 | |
| 650.000 | Redsun Properties Group Ltd 7.300% 13-Jan-2025 | 275.178 | 0,22 | |
| 700.000 | Shimao Group Holdings Ltd 3.450% 11-Jan-2031 | 419.300 | 0,33 | |
| 400.000 | Sunac China Holdings Ltd 6.500% 26-Jan-2026 | 250.000 | 0,20 | |
| 400.000 | Yuzhou Group Holdings Co Ltd 6.000% 25-Oct-2023 | 125.000 | 0,10 | |
| 400.000 | Yuzhou Group Holdings Co Ltd 8.500% 04-Feb-2023 | 134.000 | 0,11 | |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Nettovermögen % | Summe |
|--|--|----------------------------|-----------------|-------|
| Anleihen Forts. | | | | |
| China Forts. | | | | |
| 200.000 | Zhenro Properties Group Ltd 9.150% 06-May-2023 | 136.500 | 0,11 | |
| Kolumbien - 7.096.707 | | | | |
| | (31. Dezember 2020: 7.649.530) | 7.096.707 | 5,65 | |
| 1.092.000 | Colombia Government International Bond 4.125% 22-Feb-2042 | 914.550 | 0,73 | |
| 1.600.000 | Colombia Government International Bond 4.125% 15-May-2051 | 1.304.000 | 1,04 | |
| 8.035.100.000 | Colombian TES 6.000% 28-Apr-2028 | 1.787.575 | 1,42 | |
| 4.191.200.000 | Colombian TES 7.250% 18-Oct-2034 | 945.449 | 0,75 | |
| 4.800.000.000 | Colombian TES 7.750% 18-Sep-2030 | 1.152.571 | 0,92 | |
| 400.000 | GCM Mining Corp 'REGS' 6.875% 09-Aug-2026 | 401.416 | 0,32 | |
| 605.000 | Geopark Ltd 'REGS' 5.500% 17-Jan-2027 | 591.146 | 0,47 | |
| Elfenbeinküste - 2.906.380 | | | | |
| | (31. Dezember 2020: 1.778.518) | 2.906.380 | 2,31 | |
| 660.000 | Ivory Coast Government International Bond 'REGS' 4.875% 30-Jan-2032 | 725.070 | 0,58 | |
| 1.250.000 | Ivory Coast Government International Bond 'REGS' 5.875% 17-Oct-2031 | 1.465.663 | 1,16 | |
| 600.000 | Ivory Coast Government International Bond 'REGS' 6.875% 17-Oct-2040 | 715.647 | 0,57 | |
| Tschechische Republik - 431.381 | | | | |
| | (31. Dezember 2020: -) | 431.381 | 0,34 | |
| 11.500.000 | Czech Republic Government Bond 1.500% 24-Apr-2040 | 431.381 | 0,34 | |
| Dominikanische Republik - 1.324.375 | | | | |
| | (31. Dezember 2020: 1.330.761) | 1.324.375 | 1,05 | |
| 1.300.000 | Dominican Republic International Bond 'REGS' 4.875% 23-Sep-2032 | 1.324.375 | 1,05 | |
| Ecuador - 1.492.114 | | | | |
| | (31. Dezember 2020: 1.711.790) | 1.492.114 | 1,19 | |
| 231.321 | Ecuador Government International Bond '144A' (Zero Coupon) 0.000% 31-Jul-2030 | 131.275 | 0,11 | |
| 1.637.100 | Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon '144A' 5.000% 31-Jul-2030 | 1.360.839 | 1,08 | |
| Ägypten - 8.998.338 | | | | |
| | (31. Dezember 2020: 8.171.849) | 8.998.338 | 7,16 | |
| 700.000 | Egypt Government International Bond 'REGS' 7.300% 30-Sep-2033 | 646.506 | 0,52 | |
| 850.000 | Egypt Government International Bond 'REGS' 7.500% 16-Feb-2061 | 696.222 | 0,55 | |
| 700.000 | Egypt Government International Bond 'REGS' 8.750% 30-Sep-2051 | 627.956 | 0,50 | |
| 2.500.000 | Egypt Government International Bond 'REGS' 8.875% 29-May-2050 | 2.277.000 | 1,81 | |
| 26.000.000 | Egypt Treasury Bills (Zero Coupon) 0.000% 18-Jan-2022 | 1.649.698 | 1,31 | |
| 26.000.000 | Egypt Treasury Bills (Zero Coupon) 0.000% 01-Mar-2022 | 1.630.300 | 1,30 | |
| 25.000.000 | Egypt Treasury Bills (Zero Coupon) 0.000% 06-Sep-2022 | 1.470.656 | 1,17 | |
| El Salvador - 224.504 | | | | |
| | (31. Dezember 2020: -) | 224.504 | 0,18 | |
| 400.000 | El Salvador Government International Bond 'REGS' 7.625% 01-Feb-2041 | 224.504 | 0,18 | |
| Ghana - 3.738.840 | | | | |
| | (31. Dezember 2020: 2.156.396) | 3.738.840 | 2,98 | |
| 800.000 | Ghana Government International Bond 'REGS' 6.375% 11-Feb-2027 | 677.156 | 0,54 | |
| 1.350.000 | Ghana Government International Bond 'REGS' 7.750% 07-Apr-2029 | 1.134.333 | 0,90 | |
| 700.000 | Ghana Government International Bond 'REGS' 8.125% 18-Jan-2026 | 648.375 | 0,52 | |
| 820.000 | Ghana Government International Bond 'REGS' 8.625% 07-Apr-2034 | 668.903 | 0,53 | |
| 750.000 | Ghana Government International Bond 'REGS' 8.875% 07-May-2042 | 610.073 | 0,49 | |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % | Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|------------------------|---|----------------------------------|----------------------------------|------------------------|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | | Anleihen Forts. | | | |
| | Ungarn - 623.455 | | | | Peru - 3.146.775 | | |
| | (31. Dezember 2020: -) | 623.455 | 0,50 | | (31. Dezember 2020: 791.154) | 3.146.775 | 2,50 |
| 250.000.000 | Hungary Government Bond 3.000% 27-Oct-2038 | 623.455 | 0,50 | 1.003.000 | Peruvian Government International Bond 1.950% 17-Nov-2036 | 1.128.151 | 0,90 |
| | Indien - 1.500.000 | | | 3.400.000 | Peruvian Government International Bond 'REGS' 6.950% 12-Aug-2031 | 914.353 | 0,73 |
| | (31. Dezember 2020: -) | 1.500.000 | 1,19 | 700.000 | Petroleos del Peru SA 'REGS' 5.625% 19-Jun-2047 | 694.246 | 0,55 |
| 1.500.000 | HDFC Bank Ltd 'REGS' FRN (Perpetual) 3.700% 25-Aug-2026 | 1.500.000 | 1,19 | 420.000 | Volcan Cia Minera SAA 'REGS' 4.375% 11-Feb-2026 | 410.025 | 0,32 |
| | Indonesien - 3.519.028 | | | | Republik Serbien - 1.148.368 | | |
| | (31. Dezember 2020: 14.365.608) | 3.519.028 | 2,80 | | (31. Dezember 2020: -) | 1.148.368 | 0,91 |
| 1.200.000 | Indonesia Government International Bond 3.050% 12-Mar-2051 | 1.187.412 | 0,95 | 1.100.000 | Serbia International Bond 'REGS' 2.050% 23-Sep-2036 | 1.148.368 | 0,91 |
| 10.148.000.000 | Indonesia Treasury Bond 7.500% 15-May-2038 | 743.339 | 0,59 | | Rumänien - 3.790.474 | | |
| 1.600.000 | Medco Laurel Tree Pte Ltd 'REGS' 6.950% 12-Nov-2028 | 1.588.277 | 1,26 | | (31. Dezember 2020: 9.540.818) | 3.790.474 | 3,02 |
| | Kasachstan - 485.905 | | | 590.000 | Romanian Government International Bond 'REGS' 1.750% 13-Jul-2030 | 628.050 | 0,50 |
| | (31. Dezember 2020: 490.753) | 485.905 | 0,39 | 1.900.000 | Romanian Government International Bond 'REGS' 2.750% 14-Apr-2041 | 1.935.664 | 1,54 |
| 210.000.000 | Development Bank of Kazakhstan JSC 'REGS' 8.950% 04-May-2023 | 485.905 | 0,39 | 1.200.000 | Romanian Government International Bond 'REGS' 2.875% 13-Apr-2042 | 1.226.760 | 0,98 |
| | Libanon - 188.676 | | | | Russland - 9.855.452 | | |
| | (31. Dezember 2020: 250.496) | 188.676 | 0,15 | | (31. Dezember 2020: 10.244.824) | 9.855.452 | 7,84 |
| 400.000 | Lebanon Government International Bond (Defaulted) 8.200% 17-May-2033 | 41.360 | 0,03 | 1.450.000 | Credit Bank of Moscow Via CBOM Finance Plc 'REGS' 3.875% 21-Sep-2026 | 1.373.513 | 1,09 |
| 400.000 | Lebanon Government International Bond (Defaulted) 8.250% 17-May-2034 | 41.416 | 0,03 | 2.550.000 | Lukoil Capital DAC 'REGS' 3.600% 26-Oct-2031 | 2.488.634 | 1,98 |
| 600.000 | Lebanon Government International Bond 'GMTN' (Defaulted) 7.000% 20-Mar-2028 | 63.420 | 0,05 | 61.000.000 | Russian Federal Bond - OFZ 6.100% 18-Jul-2035 | 671.491 | 0,53 |
| 400.000 | Lebanon Government International Bond 'GMTN' (Defaulted) 7.150% 20-Nov-2031 | 42.480 | 0,04 | 213.000.000 | Russian Federal Bond - OFZ 7.750% 16-Sep-2026 | 2.783.626 | 2,22 |
| | Macau - 694.124 | | | 193.000.000 | Russian Federal Bond - OFZ 7.950% 07-Oct-2026 | 2.538.188 | 2,02 |
| | (31. Dezember 2020: 1.926.828) | 694.124 | 0,55 | | Südafrika - 7.379.219 | | |
| 700.000 | MGM China Holdings Ltd 'REGS' 4.750% 01-Feb-2027 | 694.124 | 0,55 | | (31. Dezember 2020: 6.382.084) | 7.379.219 | 5,87 |
| | Malaysia - 1.638.184 | | | 17.300.000 | Republic of South Africa Government Bond 8.000% 31-Jan-2030 | 1.002.282 | 0,80 |
| | (31. Dezember 2020: 4.032.922) | 1.638.184 | 1,30 | 24.000.000 | Republic of South Africa Government Bond 8.875% 28-Feb-2035 | 1.352.476 | 1,07 |
| 4.075.000 | Malaysia Government Bond 2.632% 15-Apr-2031 | 904.353 | 0,72 | 72.325.032 | Republic of South Africa Government Bond 10.500% 21-Dec-2026 | 5.024.461 | 4,00 |
| 3.200.000 | Malaysia Government Bond 3.757% 22-May-2040 | 733.831 | 0,58 | | Thailand - 1.349.658 | | |
| | Mexiko - 10.054.509 | | | | (31. Dezember 2020: 3.953.530) | 1.349.658 | 1,07 |
| | (31. Dezember 2020: 16.434.381) | 10.054.509 | 8,00 | 44.500.000 | Thailand Government Bond 2.875% 17-Jun-2046 | 1.349.658 | 1,07 |
| 590.000 | Braskem Idesa SAPI 'REGS' 6.990% 20-Feb-2032 | 593.180 | 0,47 | | Tunesien - 1.200.763 | | |
| 1.000.000 | Credito Real SAB de CV SOFOM ER 'REGS' 8.000% 21-Jan-2028 | 601.430 | 0,48 | | (31. Dezember 2020: 1.634.874) | 1.200.763 | 0,96 |
| 138.307.300 | Mexican Bonos 5.750% 05-Mar-2026 | 6.372.951 | 5,07 | 1.350.000 | Banque Centrale de Tunisie International Bond 5.625% 17-Feb-2024 | 1.200.763 | 0,96 |
| 20.000.000 | Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031 | 988.137 | 0,79 | | Türkei - 2.993.019 | | |
| 1.550.000 | Petroleos Mexicanos 7.690% 23-Jan-2050 | 1.498.811 | 1,19 | | (31. Dezember 2020: 3.556.262) | 2.993.019 | 2,38 |
| | Moldawien - 1.440.096 | | | 900.000 | Aydem Yenilenebilir Enerji AS 'REGS' 7.750% 02-Feb-2027 | 736.713 | 0,59 |
| | (31. Dezember 2020: 1.421.875) | 1.440.096 | 1,15 | 1.000.000 | Istanbul Metropolitan Municipality 'REGS' 6.375% 09-Dec-2025 | 911.750 | 0,72 |
| 1.400.000 | Aragvi Finance International DAC 'REGS' 8.450% 29-Apr-2026 | 1.440.096 | 1,15 | 1.450.000 | Limak Iskenderun Uluslararası Liman İşletmeciliği AS 'REGS' 9.500% 10-Jul-2036 | 1.344.556 | 1,07 |
| | Nigeria - 2.016.084 | | | | Ukraine - 5.205.081 | | |
| | (31. Dezember 2020: 1.767.533) | 2.016.084 | 1,60 | | (31. Dezember 2020: 4.395.457) | 5.205.081 | 4,14 |
| 700.000 | Nigeria Government International Bond 'REGS' 6.500% 28-Nov-2027 | 700.522 | 0,56 | 900.000 | NPC UKrenergo 'REGS' 6.875% 09-Nov-2026 | 790.939 | 0,63 |
| 1.250.000 | Nigeria Government International Bond 'REGS' 8.747% 21-Jan-2031 | 1.315.562 | 1,04 | 618.000 | Ukraine Government International Bond 'REGS' 7.253% 15-Mar-2033 | 547.554 | 0,44 |
| | Pakistan - 348.381 | | | 900.000 | Ukraine Government International Bond 'REGS' 7.375% 25-Sep-2032 | 805.617 | 0,64 |
| | (31. Dezember 2020: -) | 348.381 | 0,28 | 600.000 | Ukraine Government International Bond 'REGS' 7.750% 01-Sep-2022 | 596.106 | 0,47 |
| 350.000 | Pakistan Government International Bond 'REGS' 7.375% 08-Apr-2031 | 348.381 | 0,28 | 1.900.000 | Ukraine Government International Bond 'REGS' 7.750% 01-Sep-2027 | 1.808.321 | 1,44 |
| | Panama - 1.986.469 | | | 700.000 | Ukraine Railways Via Rail Capital Markets Plc 7.875% 15-Jul-2026 | 656.544 | 0,52 |
| | (31. Dezember 2020: 2.182.623) | 1.986.469 | 1,58 | | Gesamtanlagen in Anleihen | 114.981.928 | 91,49 |
| 1.300.000 | Banistmo SA 'REGS' 4.250% 31-Jul-2027 | 1.324.063 | 1,05 | | | | |
| 600.000 | Panama Government International Bond 4.500% 16-Apr-2050 | 662.406 | 0,53 | | | | |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Zugrunde liegendes Engagement USD | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % |
|--|--|-----------------------------------|----------------------------|-----------------------|
| Offene Terminkontrakte - 120.229 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 39.729) | | | | |
| (12) | Euro-Buxl 30 Year Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (2.824.484) | 120.213 | 0,10 |
| (57) | U.S. 5 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (6.895.664) | 16 | 0,00 |
| Offene Terminkontrakte insgesamt | | | 120.229 | 0,10 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 2.094.578 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 3.960.505) | | | | |
| | | | 2.094.578 | 1,67 |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | | 121.210.735 | 96,45 |

| Bestände | Beschreibung | Zugrunde liegendes Engagement USD | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % |
|--|--|-----------------------------------|----------------------------|-----------------------|
| Credit Default Swaps - (35.277) | | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | | |
| 4.300.000 | CDS United Mexican States 1.000% 20-Jun-2026 | | (35.277) | (0,03) |
| Credit Default Swaps insgesamt | | | (35.277) | (0,03) |

| Bestände | Beschreibung | Zugrunde liegendes Engagement USD | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % |
|---|---|-----------------------------------|----------------------------|-----------------------|
| Offene Terminkontrakte - (70.322) | | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | | |
| (59) | U.S. 10 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (7.697.656) | (64.172) | (0,05) |
| (3) | U.S. Treasury Ultra Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (591.375) | (6.150) | (0,01) |
| Offene Terminkontrakte insgesamt | | | (70.322) | (0,06) |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (388.669) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (2.854.632)) | | | | |
| | | | (388.669) | (0,31) |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | | (494.268) | (0,40) |
| Nettoumlaufvermögen | | | 4.960.858 | 3,95 |
| Summe Nettovermögen | | | 125.677.325 | 100,00 |

Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist Goldman Sachs.
Der Kontrahent für Total Return Swaps ist die Bank of America Merrill Lynch.

| Portfolioanalyse | % des Gesamtvermögens |
|--|-----------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 94,17 |
| An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente | 0,10 |
| Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate) | 1,66 |
| Sonstiges Umlaufvermögen | 4,07 |
| Gesamtvermögen | 100,00 |

| Devisenterminkontrakte | | | | | | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) | |
|--|-----------------------|----------------|-----------------------------|-------------|----------------------------------|-------------------------------------|------------------|
| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag Abrechnungsdatum (V) | Kontrahent | | | |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund | | | | | | | |
| US-Dollar | Chilenischer Peso | 1.691.420 | 1.430.000.000 | 12. Jan. 22 | BNP Paribas | 14.907 | |
| US-Dollar | Chilenischer Peso | 1.525.228 | 1.213.700.000 | 12. Jan. 22 | Bank of America Merrill Lynch | 102.302 | |
| Brasilianischer Real | US-Dollar | 2.200.000 | 386.068 | 2. Feb. 22 | JPMorgan Chase Bank | 6.122 | |
| Brasilianischer Real | US-Dollar | 4.300.000 | 753.846 | 2. Feb. 22 | UBS AG | 12.707 | |
| Indonesische Rupie | US-Dollar | 38.000.000 | 500.625 | 9. Feb. 22 | BNP Paribas | 7.459 | |
| Indonesische Rupie | US-Dollar | 103.500.000 | 1.378.401 | 9. Feb. 22 | Morgan Stanley | 5.459 | |
| Indonesische Rupie | US-Dollar | 18.154.263.000 | 1.262.115 | 9. Feb. 22 | Morgan Stanley | 12.260 | |
| Malaysischer Ringgit | US-Dollar | 7.950.000 | 1.904.785 | 9. Feb. 22 | Morgan Stanley | 4.048 | |
| Russischer Rubel | US-Dollar | 28.000.000 | 370.847 | 9. Feb. 22 | UBS AG | 627 | |
| US-Dollar | Kolumbianischer Peso | 2.343.631 | 9.143.675.000 | 9. Feb. 22 | JPMorgan Chase Bank | 104.518 | |
| US-Dollar | Russischer Rubel | 553.984 | 40.055.000 | 9. Feb. 22 | Citigroup Global Markets Limited | 22.578 | |
| US-Dollar | Russischer Rubel | 1.281.862 | 95.800.000 | 9. Feb. 22 | UBS AG | 10.891 | |
| Chinesischer Yuan | US-Dollar | 18.400.000 | 2.866.463 | 14. Feb. 22 | Morgan Stanley | 19.793 | |
| Tschechische Krone | US-Dollar | 98.000 | 4.426 | 14. Feb. 22 | BNP Paribas | 42 | |
| Euro | US-Dollar | 600.000 | 674.437 | 14. Feb. 22 | Morgan Stanley | 9.228 | |
| Euro | US-Dollar | 400.000 | 453.140 | 14. Feb. 22 | HSBC Bank plc | 2.637 | |
| Mexikanischer Peso | US-Dollar | 8.342.000 | 388.215 | 14. Feb. 22 | BNP Paribas | 16.321 | |
| Mexikanischer Peso | US-Dollar | 14.044.000 | 662.626 | 14. Feb. 22 | Morgan Stanley | 18.423 | |
| Polnischer Zloty | US-Dollar | 20.120.000 | 4.943.891 | 14. Feb. 22 | JPMorgan Chase Bank | 35.206 | |
| Thailändischer Baht | US-Dollar | 21.000.000 | 619.317 | 14. Feb. 22 | Morgan Stanley | 9.179 | |
| US-Dollar | Südafrikanischer Rand | 1.439.526 | 22.800.000 | 14. Feb. 22 | UBS AG | 17.042 | |
| US-Dollar | Südafrikanischer Rand | 1.060.362 | 16.347.000 | 14. Feb. 22 | Barclays Bank PLC | 40.478 | |
| US-Dollar | Südafrikanischer Rand | 1.735.961 | 26.664.000 | 14. Feb. 22 | Barclays Bank PLC | 72.403 | |
| | | | | | | USD | 544.630 |
| US-Dollar | Brasilianischer Real | 3.975.678 | 22.588.612 | 2. Feb. 22 | HSBC Bank plc | (51.152) | |
| Russischer Rubel | US-Dollar | 28.000.000 | 374.327 | 9. Feb. 22 | Barclays Bank PLC | (2.853) | |
| US-Dollar | Indonesische Rupie | 391.936 | 5.650.000.000 | 9. Feb. 22 | HSBC Bank plc | (4.677) | |
| Ungarischer Forint | US-Dollar | 553.823.000 | 1.723.914 | 14. Feb. 22 | Morgan Stanley | (23.702) | |
| Ungarischer Forint | US-Dollar | 410.000.000 | 1.261.693 | 14. Feb. 22 | Morgan Stanley | (3.011) | |
| Rumänischer Leu | US-Dollar | 6.236.000 | 1.432.250 | 14. Feb. 22 | Goldman Sachs | (2.877) | |
| Südafrikanischer Rand | US-Dollar | 3.797.000 | 237.054 | 14. Feb. 22 | UBS AG | (161) | |
| Thailändischer Baht | US-Dollar | 150.143.000 | 4.590.266 | 14. Feb. 22 | Goldman Sachs | (96.725) | |
| US-Dollar | Chinesischer Yuan | 937.898 | 6.000.000 | 14. Feb. 22 | BNP Paribas | (3.273) | |
| US-Dollar | Tschechische Krone | 428.946 | 9.651.000 | 14. Feb. 22 | Morgan Stanley | (11.053) | |
| US-Dollar | Euro | 13.081.079 | 11.528.000 | 14. Feb. 22 | Morgan Stanley | (54.412) | |
| US-Dollar | Ungarischer Forint | 639.241 | 209.493.000 | 14. Feb. 22 | Morgan Stanley | (3.893) | |
| US-Dollar | Mexikanischer Peso | 3.149.590 | 65.629.000 | 14. Feb. 22 | BNP Paribas | (33.019) | |
| US-Dollar | Mexikanischer Peso | 955.082 | 20.612.000 | 14. Feb. 22 | BNP Paribas | (44.475) | |
| US-Dollar | Polnischer Zloty | 611.494 | 2.500.000 | 14. Feb. 22 | Morgan Stanley | (7.181) | |
| US-Dollar | Polnischer Zloty | 1.265.408 | 5.200.000 | 14. Feb. 22 | Morgan Stanley | (21.436) | |
| US-Dollar | Thailändischer Baht | 772.109 | 26.000.000 | 14. Feb. 22 | Goldman Sachs | (6.029) | |
| | | | | | | USD | (369.929) |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged) | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 70 | 80 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - | |
| Euro | US-Dollar | 13.602 | 15.393 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 96 | |
| | | | | | | USD | 96 |
| | | | | | | EUR | 84 |
| US-Dollar | Euro | 102 | 90 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) | |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte Forts.

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

**BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)
Forts.**

| | | | | | | | |
|-----------|------|----|----|-------------|-----------------------------|------------|------------|
| US-Dollar | Euro | 84 | 75 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) | |
| | | | | | | USD | (2) |
| | | | | | | EUR | (2) |

BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)

| | | | | | | | |
|-----------|-----------|-------|-------|-------------|-----------------------------|------------|-----------|
| Euro | US-Dollar | 37 | 41 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - | |
| Euro | US-Dollar | 6.907 | 7.817 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 49 | |
| US-Dollar | Euro | 51 | 45 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - | |
| US-Dollar | Euro | 42 | 38 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - | |
| | | | | | | USD | 49 |
| | | | | | | EUR | 43 |

BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund Anteilsklasse Sterling E (Inc) (Hedged)

| | | | | | | | |
|----------------|----------------|------------|------------|-------------|-----------------------------|------------|------------------|
| Pfund Sterling | US-Dollar | 266.207 | 359.752 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 564 | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 47.505.706 | 62.758.416 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.541.393 | |
| | | | | | | USD | 1.541.957 |
| | | | | | | GBP | 1.139.195 |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 468 | 350 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (6) | |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 413.298 | 312.055 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (9.074) | |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 46.884 | 35.173 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (724) | |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 335.048 | 253.323 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (7.829) | |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 50.858 | 38.306 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (990) | |
| | | | | | | USD | (18.623) |
| | | | | | | GBP | (13.759) |

BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)

| | | | | | | | |
|----------------|----------------|---------|---------|-------------|-----------------------------|------------|--------------|
| Pfund Sterling | US-Dollar | 286 | 384 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 4 | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 1.329 | 1.796 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 3 | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 241.592 | 319.160 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 7.839 | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 5 | 7 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 13 | 17 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - | |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 34 | 25 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - | |
| | | | | | | USD | 7.846 |
| | | | | | | GBP | 5.797 |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 384 | 286 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (3) | |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 2.101 | 1.587 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (46) | |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 1.703 | 1.287 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (40) | |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 1.325 | 998 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (26) | |
| | | | | | | USD | (115) |
| | | | | | | GBP | (85) |

BNY MELLON EUROLAND BOND FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert EUR | Summe Nettover- mögen % |
|---|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| Irland - 2.426.564 | | | |
| (31. Dezember 2020: 15.230.642) | | | |
| 2.759.885 | BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund ^ | 2.426.564 | 0,88 |
| Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen | | 2.426.564 | 0,88 |
| Anleihen | | | |
| Österreich - 9.753.280 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 7.150.000 | Republic of Austria Government Bond '144A' 0,000% 20-Feb-2031 | 7.103.704 | 2,57 |
| 2.575.000 | Republic of Austria Government Bond '144A' 0,750% 20-Mar-2051 | 2.649.576 | 0,96 |
| Belgien - 26.211.157 | | | |
| (31. Dezember 2020: 5.523.029) | | | |
| 4.000.000 | Communaute Francaise de Belgique 'EMTN' 0,000% 22-Jun-2029 | 3.958.316 | 1,43 |
| 3.300.000 | Kingdom of Belgium Government Bond '144A' 0,000% 22-Oct-2031 | 3.241.425 | 1,18 |
| 1.500.000 | Kingdom of Belgium Government Bond '144A' 0,400% 22-Jun-2040 | 1.426.545 | 0,52 |
| 16.550.000 | Kingdom of Belgium Government Bond '144A' 1,000% 22-Jun-2026 | 17.584.871 | 6,37 |
| Brasilien - 1.172.615 | | | |
| (31. Dezember 2020: 772.106) | | | |
| 475.000 | Braskem Netherlands Finance BV 'REGS' 5,875% 31-Jan-2050 | 481.427 | 0,17 |
| 550.000 | MARB BondCo Plc 'REGS' 3,950% 29-Jan-2031 | 462.140 | 0,17 |
| 225.000 | Vale Overseas Ltd 6,250% 10-Aug-2026 | 229.048 | 0,08 |
| Chile - 326.591 | | | |
| (31. Dezember 2020: 392.886) | | | |
| 364.000 | VTR Comunicaciones SpA 'REGS' 5,125% 15-Jan-2028 | 326.591 | 0,12 |
| China - 4.302.060 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.965.184) | | | |
| 27.800.000 | China Government Bond 3,810% 14-Sep-2050 | 4.107.121 | 1,49 |
| 225.000 | Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd 'REGS' 2,300% 08-Jan-2031 | 194.939 | 0,07 |
| Kolumbien - 736.758 | | | |
| (31. Dezember 2020: 221.268) | | | |
| 625.000 | Ecopetrol SA 5,875% 02-Nov-2051 | 515.189 | 0,19 |
| 250.000 | Millicom International Cellular SA 'REGS' 4,500% 27-Apr-2031 | 221.569 | 0,08 |
| Elfenbeinküste - 482.472 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.132.596) | | | |
| 500.000 | Ivory Coast Government International Bond 'REGS' 4,875% 30-Jan-2032 | 482.472 | 0,17 |
| Ägypten - 352.883 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.111.352) | | | |
| 435.000 | Egypt Government International Bond 'REGS' 7,300% 30-Sep-2033 | 352.883 | 0,13 |
| Estland - 1.502.350 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.546.751) | | | |
| 1.500.000 | Estonia Government International Bond 0,125% 10-Jun-2030 | 1.502.350 | 0,54 |
| Frankreich - 41.575.704 | | | |
| (31. Dezember 2020: 62.219.065) | | | |
| 9.000.000 | Agence Francaise de Developpement EPIC 'EMTN' 0,000% 28-Oct-2027 | 9.033.519 | 3,27 |
| 900.000 | Airbus SE 'EMTN' 2,375% 09-Jun-2040 | 1.011.489 | 0,37 |
| 1.210.000 | AXA SA 'EMTN' FRN (Perpetual) 3,875% 08-Oct-2025 | 1.349.052 | 0,49 |
| 1.400.000 | Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale 0,000% 25-Nov-2030 | 1.367.260 | 0,50 |
| 600.000 | Credit Agricole SA/London 'EMTN' 1,750% 05-Mar-2029 | 646.074 | 0,23 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert EUR | Summe Nettover- mögen % |
|---|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Frankreich Forts. | | | |
| 1.400.000 | Electricite de France SA FRN (Perpetual) 2,625% 01-Dec-2027 | 1.414.000 | 0,51 |
| 1.300.000 | Engie SA 'EMTN' 1,750% 27-Mar-2028 | 1.404.127 | 0,51 |
| 6.950.000 | French Republic Government Bond OAT 0,000% 25-Nov-2031 | 6.813.380 | 2,47 |
| 1.965.000 | French Republic Government Bond OAT 1,000% 25-May-2027 | 2.102.015 | 0,76 |
| 2.625.000 | French Republic Government Bond OAT '144A' 0,500% 25-May-2040 | 2.567.705 | 0,93 |
| 2.175.000 | French Republic Government Bond OAT '144A' 1,500% 25-May-2050 | 2.522.625 | 0,91 |
| 1.750.000 | French Republic Government Bond OAT '144A' 2,000% 25-May-2048 | 2.250.140 | 0,82 |
| 800.000 | Orange SA 'EMTN' 0,000% 04-Sep-2026 | 792.732 | 0,29 |
| 300.000 | Orano SA 'EMTN' 2,750% 08-Mar-2028 | 313.125 | 0,11 |
| 200.000 | Orano SA 'EMTN' 4,875% 23-Sep-2024 | 221.830 | 0,08 |
| 800.000 | Sanofi 'EMTN' 1,000% 01-Apr-2025 | 827.123 | 0,30 |
| 700.000 | Sanofi 'EMTN' 1,500% 01-Apr-2030 | 762.534 | 0,28 |
| 4.600.000 | Societe Du Grand Paris EPIC 'EMTN' 1,700% 25-May-2050 | 5.332.688 | 1,93 |
| 800.000 | Veolia Environnement SA 'EMTN' 1,250% 15-Apr-2028 | 844.286 | 0,31 |
| Deutschland - 24.310.467 | | | |
| (31. Dezember 2020: 114.823.425) | | | |
| 1.200.000 | Allianz SE 'EMTN' FRN (Perpetual) 4,750% 24-Oct-2023 | 1.296.729 | 0,47 |
| 6.200.000 | Bundesobligation 0,000% 09-Oct-2026 | 6.336.772 | 2,30 |
| 5.250.000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0,000% 15-May-2036 | 5.242.755 | 1,90 |
| 2.025.000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 4,750% 04-Jul-2028 | 2.722.046 | 0,99 |
| 3.700.000 | Bundesschatzanweisungen 0,000% 15-Dec-2023 | 3.744.844 | 1,36 |
| 1.350.000 | Daimler AG 'EMTN' 1,000% 15-Nov-2027 | 1.413.738 | 0,51 |
| 1.870.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 'EMTN' 0,375% 23-Apr-2030 | 1.921.785 | 0,70 |
| 1.200.000 | Siemens Financieringsmaatschappij NV 'EMTN' 0,250% 20-Feb-2029 | 1.202.274 | 0,43 |
| 400.000 | Volkswagen International Finance NV 1,875% 30-Mar-2027 | 429.524 | 0,15 |
| Ungarn - 514.742 | | | |
| (31. Dezember 2020: 4.008.296) | | | |
| 490.000 | Hungary Government International Bond 1,625% 28-Apr-2032 | 514.742 | 0,19 |
| Indonesien - 767.344 | | | |
| (31. Dezember 2020: 2.347.064) | | | |
| 800.000 | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 'REGS' 1,875% 05-Nov-2031 | 767.344 | 0,28 |
| Irland - 11.809.854 | | | |
| (31. Dezember 2020: 7.278.724) | | | |
| 1.530.000 | AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 3,000% 29-Oct-2028 | 1.365.090 | 0,49 |
| 5.675.000 | Ireland Government Bond 0,200% 18-Oct-2030 | 5.712.171 | 2,07 |
| 3.955.000 | Ireland Government Bond 2,400% 15-May-2030 | 4.732.593 | 1,72 |
| Italien - 35.165.976 | | | |
| (31. Dezember 2020: 36.027.994) | | | |
| 750.000 | Assicurazioni Generali SpA 'EMTN' FRN 5,500% 27-Oct-2047 | 913.102 | 0,33 |
| 1.225.000 | Enel Finance International NV 'EMTN' 0,375% 17-Jun-2027 | 1.221.290 | 0,44 |
| 8.850.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,000% 01-Aug-2026 | 8.682.580 | 3,14 |
| 5.450.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,950% 15-Mar-2023 | 5.538.331 | 2,01 |
| 7.030.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 0,950% 01-Dec-2031 | 6.891.087 | 2,50 |
| 6.275.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 1,650% 01-Dec-2030 | 6.601.436 | 2,39 |
| 1.900.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 2,800% 01-Mar-2067 | 2.151.218 | 0,78 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert EUR | Summe Nettover- mögen % |
|--|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Italien Forts. | | | |
| 2.375.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 4,000% 01-Feb-2037 | 3.166.932 | 1,15 |
| Japan - 417.261 | | | |
| (31. Dezember 2020: 438.583) | | 417.261 | 0,15 |
| 385.000 | Takeda Pharmaceutical Co Ltd 2,000% 09-Jul-2040 | 417.261 | 0,15 |
| Kasachstan - 315.069 | | | |
| (31. Dezember 2020: 301.682) | | 315.069 | 0,11 |
| 350.000 | Development Bank of Kazakhstan JSC 'REGS' 4,125% 10-Dec-2022 | 315.069 | 0,11 |
| Kuwait - 462.862 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | 462.862 | 0,17 |
| 525.000 | Equate Petrochemical BV 'REGS' 2,625% 28-Apr-2028 | 462.862 | 0,17 |
| Luxemburg - 1.399.391 | | | |
| (31. Dezember 2020: 3.036.585) | | 1.399.391 | 0,51 |
| 875.000 | Prologis International Funding II SA 'EMTN' 1,750% 15-Mar-2028 | 940.174 | 0,34 |
| 458.443 | Silver Arrow SA '2020-1FR A' FRN 0,107% 20-Nov-2030 | 459.217 | 0,17 |
| Mexiko - 7.714.238 | | | |
| (31. Dezember 2020: 8.276.674) | | 7.714.238 | 2,80 |
| 1.675.000 | Alsea SAB de CV 'REGS' 7,750% 14-Dec-2026 | 1.527.044 | 0,55 |
| 300.000 | Braskem Idesa SAPI 'REGS' 6,990% 20-Feb-2032 | 264.925 | 0,10 |
| 116.000.000 | Mexican Bonos 7,750% 29-May-2031 | 5.033.984 | 1,83 |
| 975.000 | Petroleos Mexicanos 6,840% 23-Jan-2030 | 888.285 | 0,32 |
| Niederlande - 19.608.049 | | | |
| (31. Dezember 2020: 24.340.590) | | 19.608.049 | 7,11 |
| 800.000 | ABN AMRO Bank NV 'EMTN' FRN 2,875% 18-Jan-2028 | 822.531 | 0,30 |
| 700.000 | ING Groep NV 'EMTN' FRN 3,000% 11-Apr-2028 | 725.485 | 0,26 |
| 600.000 | ING Groep NV FRN 2,000% 22-Mar-2030 | 625.284 | 0,23 |
| 4.530.000 | Netherlands Government Bond '144A' 0,000% 15-Jul-2031 | 4.544.541 | 1,65 |
| 2.425.000 | Netherlands Government Bond '144A' 0,750% 15-Jul-2027 | 2.576.077 | 0,93 |
| 9.675.000 | Netherlands Government Bond '144A' 2,000% 15-Jul-2024 | 10.314.131 | 3,74 |
| Norwegen - 17.817.072 | | | |
| (31. Dezember 2020: 410.134) | | 17.817.072 | 6,46 |
| 450.000 | Equinor ASA 3,250% 18-Nov-2049 | 421.363 | 0,15 |
| 175.000.000 | Norway Government Bond '144A' 1,500% 19-Feb-2026 | 17.395.709 | 6,31 |
| Katar - 1.046.744 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | 1.046.744 | 0,38 |
| 1.200.000 | Qatar Energy 'REGS' 2,250% 12-Jul-2031 | 1.046.744 | 0,38 |
| Republik Serbien - 962.819 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.860.674) | | 962.819 | 0,35 |
| 1.050.000 | Serbia International Bond 'REGS' 2,050% 23-Sep-2036 | 962.819 | 0,35 |
| Rumänien - 1.022.439 | | | |
| (31. Dezember 2020: 2.857.843) | | 1.022.439 | 0,37 |
| 475.000 | Romanian Government International Bond 'EMTN' 2,875% 11-Mar-2029 | 505.999 | 0,18 |
| 475.000 | Romanian Government International Bond 'REGS' 3,624% 26-May-2030 | 516.440 | 0,19 |
| Russland - 1.480.784 | | | |
| (31. Dezember 2020: 5.299.048) | | 1.480.784 | 0,54 |
| 131.100.000 | Russian Federal Bond - OFZ 7,650% 10-Apr-2030 | 1.480.784 | 0,54 |
| Spanien - 14.827.911 | | | |
| (31. Dezember 2020: 24.634.995) | | 14.827.911 | 5,37 |
| 400.000 | Adif Alta Velocidad 'EMTN' 0,550% 30-Apr-2030 | 403.254 | 0,15 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert EUR | Summe Nettover- mögen % |
|--|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Spanien Forts. | | | |
| 1.300.000 | Banco Santander SA 'EMTN' 2,500% 18-Mar-2025 | 1.383.819 | 0,50 |
| 900.000 | Iberdrola International BV 'EMTN' 3,000% 31-Jan-2022 | 902.151 | 0,33 |
| 1.000.000 | Lorca Telecom Bondco SA 'REGS' 4,000% 18-Sep-2027 | 1.018.989 | 0,37 |
| 1.200.000 | Repsol International Finance BV 'EMTN' 2,625% 15-Apr-2030 | 1.392.711 | 0,50 |
| 3.800.000 | Spain Government Bond '144A' 0,500% 31-Oct-2031 | 3.777.189 | 1,37 |
| 2.550.000 | Spain Government Bond '144A' 1,200% 31-Oct-2040 | 2.574.148 | 0,93 |
| 2.500.000 | Spain Government Bond '144A' 2,900% 31-Oct-2046 | 3.375.650 | 1,22 |
| Supranational - 2.778.557 | | | |
| (31. Dezember 2020: 3.223.728) | | 2.778.557 | 1,01 |
| 725.000 | Africa Finance Corp 'REGS' 2,875% 28-Apr-2028 | 633.141 | 0,23 |
| 475.000 | African Export-Import Bank/The 'EMTN' 5,250% 11-Oct-2023 | 443.788 | 0,16 |
| 500.000 | Banque Ouest Africaine de Developpement 'REGS' 2,750% 22-Jan-2033 | 527.307 | 0,19 |
| 470.000 | Banque Ouest Africaine de Developpement 'REGS' 5,000% 27-Jul-2027 | 457.111 | 0,17 |
| 750.000 | European Union 0,000% 04-Jul-2035 | 717.210 | 0,26 |
| Schweiz - 688.720 | | | |
| (31. Dezember 2020: 50.446) | | 688.720 | 0,25 |
| 700.000 | UBS Group AG 'EMTN' FRN 0,250% 05-Nov-2028 | 688.720 | 0,25 |
| Vereinigte Arabische Emirate - 480.644 | | | |
| (31. Dezember 2020: 693.404) | | 480.644 | 0,17 |
| 505.000 | DP World Salaam FRN (Perpetual) 6,000% 01-Oct-2025 | 480.644 | 0,17 |
| Vereinigtes Königreich - 6.405.974 | | | |
| (31. Dezember 2020: 9.719.657) | | 6.405.974 | 2,32 |
| 685.000 | Barclays Plc 'EMTN' FRN 2,000% 07-Feb-2028 | 697.684 | 0,25 |
| 800.000 | BP Capital Markets Plc 'EMTN' 1,231% 08-May-2031 | 828.782 | 0,30 |
| 550.000 | BP Capital Markets Plc FRN (Perpetual) 3,625% 22-Mar-2029 | 592.500 | 0,21 |
| 460.198 | Brass No 10 Plc FRN 0,669% 16-Apr-2069 | 402.387 | 0,15 |
| 725.000 | British American Tobacco Plc FRN (Perpetual) 3,000% 27-Sep-2026 | 711.413 | 0,26 |
| 675.000 | CK Hutchison Group Telecom Finance SA 1,125% 17-Oct-2028 | 685.720 | 0,25 |
| 1.450.000 | Hammerson Ireland Finance DAC 1,750% 03-Jun-2027 | 1.428.148 | 0,52 |
| 960.000 | Unilever Finance Netherlands BV 1,750% 25-Mar-2030 | 1.059.340 | 0,38 |
| Vereinigte Staaten von Amerika - 30.849.394 | | | |
| (31. Dezember 2020: 43.535.537) | | 30.849.394 | 11,18 |
| 675.000 | Air Products and Chemicals Inc 'EMTN' 0,500% 05-May-2028 | 682.564 | 0,25 |
| 525.000 | Air Products and Chemicals Inc 'EMTN' 0,800% 05-May-2032 | 529.642 | 0,19 |
| 925.000 | Ally Financial Inc 5,750% 20-Nov-2025 | 917.581 | 0,33 |
| 415.000 | AT&T Inc 1,800% 14-Sep-2039 | 417.733 | 0,15 |
| 1.095.000 | Berkshire Hathaway Inc 0,000% 12-Mar-2025 | 1.093.956 | 0,40 |
| 750.000 | Berry Global Inc 1,570% 15-Jan-2026 | 645.355 | 0,23 |
| 955.000 | Capital One Financial Corp FRN 2,359% 29-Jul-2032 | 795.937 | 0,29 |
| 500.000 | Carrier Global Corp 2,722% 15-Feb-2030 | 449.424 | 0,16 |
| 430.000 | CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 'REGS' 4,500% 15-Aug-2030 | 387.221 | 0,14 |
| 400.000 | Centene Corp 3,375% 15-Feb-2030 | 359.025 | 0,13 |
| 130.000 | Centene Corp 3,375% 15-Feb-2030 | 116.683 | 0,04 |
| 545.000 | CGDB Commercial Mortgage Trust 2019-MOB '2019-MOBX A' FRN 1,060% 15-Nov-2036 | 478.004 | 0,17 |
| 475.000 | Cheniere Energy Inc 4,625% 15-Oct-2028 | 441.883 | 0,16 |
| 1.025.000 | Cheniere Energy Partners LP 4,000% 01-Mar-2031 | 946.614 | 0,34 |
| 475.000 | Crown Americas LLC / Crown Americas Capital Corp VI 4,750% 01-Feb-2026 | 428.194 | 0,16 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert EUR | Summe Nettover- mögen % |
|--|---|-------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika Forts. | | | |
| 400.000 | CyrusOne LP / CyrusOne Finance Corp 1.450% 22-Jan-2027 | 409.274 | 0,15 |
| 325.000 | Danaher Corp 2.500% 30-Mar-2030 | 372.641 | 0,13 |
| 425.000 | DaVita Inc 'REGS' 3.750% 15-Feb-2031 | 363.499 | 0,13 |
| 675.000 | Digital Dutch Finco BV 1.500% 15-Mar-2030 | 701.674 | 0,25 |
| 350.000 | Elanco Animal Health Inc 5.900% 28-Aug-2028 | 357.034 | 0,13 |
| 725.000 | Eli Lilly & Co 1.375% 14-Sep-2061 | 663.476 | 0,24 |
| 975.000 | EQT Corp 'REGS' 3.125% 15-May-2026 | 880.167 | 0,32 |
| 570.000 | Equinix Inc 1.000% 15-Sep-2025 | 486.275 | 0,18 |
| 650.000 | Fidelity National Information Services Inc 1.500% 21-May-2027 | 680.339 | 0,25 |
| 530.000 | Ford Motor Co 3.250% 12-Feb-2032 | 477.628 | 0,17 |
| 455.000 | GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 5.375% 15-Apr-2026 | 445.556 | 0,16 |
| 371.000 | HCA Inc 3.500% 01-Sep-2030 | 345.053 | 0,13 |
| 460.000 | Healthcare Trust of America Holdings LP 3.500% 01-Aug-2026 | 431.467 | 0,16 |
| 575.000 | Hilton Domestic Operating Co Inc 'REGS' 3.625% 15-Feb-2032 | 503.234 | 0,18 |
| 650.000 | JBS Finance Luxembourg Sarl 'REGS' 3.625% 15-Jan-2032 | 574.061 | 0,21 |
| 660.000 | JPMorgan Chase & Co FRN (Perpetual) 5.000% 01-Aug-2024 | 596.014 | 0,22 |
| 465.000 | Lennar Corp 4.750% 29-Nov-2027 | 463.215 | 0,17 |
| 1.050.000 | Level 3 Financing Inc 'REGS' 4.250% 01-Jul-2028 | 914.537 | 0,33 |
| 395.000 | Marsh & McLennan Cos Inc 1.979% 21-Mar-2030 | 432.673 | 0,16 |
| 525.000 | Medtronic Global Holdings SCA 0.750% 15-Oct-2032 | 526.094 | 0,19 |
| 499.000 | MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc 'REGS' 3.875% 15-Feb-2029 | 460.839 | 0,17 |
| 1.400.000 | Morgan Stanley FRN 1.102% 29-Apr-2033 | 1.402.249 | 0,51 |
| 1.400.000 | Mozart Debt Merger Sub Inc 'REGS' 3.875% 01-Apr-2029 | 1.227.806 | 0,44 |
| 625.000 | MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 0.993% 15-Oct-2026 | 621.159 | 0,23 |
| 425.000 | Occidental Petroleum Corp 8.875% 15-Jul-2030 | 504.594 | 0,18 |
| 1.000.000 | PepsiCo Inc 1.050% 09-Oct-2050 | 979.526 | 0,35 |
| 535.000 | Pioneer Natural Resources Co 1.900% 15-Aug-2030 | 445.952 | 0,16 |
| 540.000 | Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc 'REGS' 3.625% 01-Mar-2029 | 476.767 | 0,17 |
| 350.000 | SLM Corp 4.200% 29-Oct-2025 | 321.580 | 0,12 |
| 700.000 | Southern Co/The FRN 1.875% 15-Sep-2081 | 680.050 | 0,25 |
| 264.063 | Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC / Sprint Spectrum Co III LLC '144A' 4.738% 20-Mar-2025 | 242.959 | 0,09 |
| 725.000 | Stellantis Finance US Inc 'REGS' 2.691% 15-Sep-2031 | 627.628 | 0,23 |
| 1.025.000 | Taylor Morrison Communities Inc 'REGS' 5.125% 01-Aug-2030 | 991.463 | 0,36 |
| 100.000 | T-Mobile USA Inc 4.750% 01-Feb-2028 | 92.598 | 0,03 |
| 400.000 | United Rentals North America Inc 4.000% 15-Jul-2030 | 361.505 | 0,13 |
| 536.000 | VICI Properties LP / VICI Note Co Inc 'REGS' 3.500% 15-Feb-2025 | 478.353 | 0,17 |
| 370.000 | Western Midstream Operating LP 5.300% 01-Feb-2030 | 358.464 | 0,13 |
| 1.350.000 | Yum! Brands Inc 4.625% 31-Jan-2032 | 1.262.175 | 0,46 |
| Gesamtanlagen in Anleihen | | 267.262.181 | 96,86 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 411.469 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 596.945) | | 411.469 | 0,15 |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | 270.100.214 | 97,89 |

| Bestände | Beschreibung | Zugrunde liegendes Engagement EUR | Beizulegender Zeitwert EUR | Summe Nettover- mögen % |
|--|---|--------------------------------------|-------------------------------|----------------------------------|
| Offene Terminkontrakte - (261.581) | | | | |
| (31. Dezember 2020: 342.675) | | | | |
| 39 | Euro-Bobl Long Futures Contracts Exp Mar-2022 | 5.196.360 | (38.653) | (0,01) |
| 3 | Euro-Bund Long Futures Contracts Exp Mar-2022 | 514.110 | (9.063) | (0,00) |
| 11 | Euro-Buxl 30 Year Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2022 | 2.274.140 | (113.532) | (0,04) |
| 25 | Euro-Schatz Long Futures Contracts Exp Mar-2022 | 2.800.750 | (4.402) | (0,00) |
| (232) | U.S. 10 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (26.586.496) | (79.990) | (0,03) |
| (16) | U.S. Treasury Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (2.254.719) | (15.941) | (0,01) |
| Offene Terminkontrakte insgesamt | | | (261.581) | (0,09) |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (267.752) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (633.155)) | | | (267.752) | (0,10) |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | | (529.333) | (0,19) |
| Nettoumlaufvermögen | | | 6.351.292 | 2,30 |
| Summe Nettovermögen | | | 275.922.173 | 100,00 |
| ^ Anlage in einem anderen Fonds der Gesellschaft. Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist Bank of America Merrill Lynch. | | | | |
| Portfolioanalyse | | | % des Gesamtvermögens | |
| An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | 95,94 | |
| Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate) | | | 0,15 | |
| Sonstiges Umlaufvermögen | | | 3,91 | |
| Gesamtvermögen | | | 100,00 | |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Devisenterminkontrakte | | | | | | |
|---|--------------------|-------------|-------------|------------------|----------------------------------|-------------------------------------|
| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
| BNY Mellon Euroland Bond Fund | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 10.000.000 | 11.323.600 | 16. Feb. 22 | JPMorgan Chase Bank | 62.527 |
| Euro | US-Dollar | 33.019.534 | 37.390.000 | 16. Feb. 22 | JPMorgan Chase Bank | 206.460 |
| Ungarischer Forint | US-Dollar | 261.560.000 | 797.901 | 16. Mrz. 22 | Barclays Bank PLC | 2.180 |
| Indische Rupie | US-Dollar | 95.540.000 | 1.253.296 | 16. Mrz. 22 | Citigroup Global Markets Limited | 16.080 |
| Mexikanischer Peso | Euro | 2.516.466 | 105.799 | 16. Mrz. 22 | Goldman Sachs | 656 |
| US-Dollar | Chinesischer Yuan | 2.035.699 | 13.000.000 | 16. Mrz. 22 | Barclays Bank PLC | 196 |
| US-Dollar | Chinesischer Yuan | 2.624.873 | 16.760.000 | 16. Mrz. 22 | HSBC Bank plc | 592 |
| US-Dollar | Russischer Rubel | 1.792.353 | 135.000.000 | 16. Mrz. 22 | Barclays Bank PLC | 13.365 |
| US-Dollar | Taiwan-Dollar | 1.303.463 | 35.870.000 | 16. Mrz. 22 | Barclays Bank PLC | 6.098 |
| | | | | | EUR | 308.154 |
| Euro | Norwegische Krone | 182.454 | 1.840.000 | 16. Feb. 22 | Barclays Bank PLC | (762) |
| Euro | Norwegische Krone | 17.505.210 | 176.540.000 | 16. Feb. 22 | Barclays Bank PLC | (73.576) |
| Euro | Pfund Sterling | 142.115 | 120.000 | 16. Feb. 22 | JPMorgan Chase Bank | (407) |
| Euro | Schwedische Krone | 697.256 | 7.180.000 | 16. Feb. 22 | JPMorgan Chase Bank | (292) |
| Euro | Mexikanischer Peso | 5.082.366 | 123.976.466 | 16. Mrz. 22 | Goldman Sachs | (162.310) |
| US-Dollar | Ungarischer Forint | 797.439 | 261.560.000 | 16. Mrz. 22 | Barclays Bank PLC | (2.586) |
| US-Dollar | Indische Rupie | 1.732.649 | 132.513.000 | 16. Mrz. 22 | Citigroup Global Markets Limited | (27.266) |
| | | | | | EUR | (267.199) |
| BNY Mellon Euroland Bond Fund Anteilsklasse CHF H (Hedged) | | | | | | |
| Euro | Schweizer Franken | 24.869 | 25.756 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 40 |
| Schweizer Franken | Euro | 17.517 | 16.833 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 54 |
| Schweizer Franken | Euro | 3.482.079 | 3.330.539 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 26.189 |
| | | | | | EUR | 26.283 |
| | | | | | CHF | 27.266 |
| Euro | Schweizer Franken | 14.721 | 15.334 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (61) |
| Euro | Schweizer Franken | 23.877 | 24.900 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (126) |
| | | | | | EUR | (187) |
| | | | | | CHF | (194) |
| BNY Mellon Euroland Bond Fund Anteilsklasse CHF I (Hedged) | | | | | | |
| Euro | Schweizer Franken | 72.153 | 74.727 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 115 |
| Schweizer Franken | Euro | 52.042 | 50.009 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 160 |
| Schweizer Franken | Euro | 10.205.743 | 9.761.590 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 76.757 |
| | | | | | EUR | 77.032 |
| | | | | | CHF | 79.913 |
| Euro | Schweizer Franken | 69.055 | 72.013 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (366) |
| | | | | | EUR | (366) |
| | | | | | CHF | (380) |

BNY MELLON EUROPEAN CREDIT FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert EUR | Nettovermögen % |
|---|---|-------------------------------|--------------------|
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| Irland - 1.473.494 | | | |
| (31. Dezember 2020: 2.007.896) | | | |
| 2.562 | BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund ^ | 432.807 | 1,06 |
| 919.805 | BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund ^ | 1.040.687 | 2,56 |
| Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen | | 1.473.494 | 3,62 |
| Anleihen | | | |
| Australien - 401.020 | | | |
| (31. Dezember 2020: 709.814) | | | |
| 200.000 | Glencore Capital Finance DAC 'EMTN' 1.250% 01-Mar-2033 | 191.675 | 0,47 |
| 200.000 | Sydney Airport Finance Co Pty Ltd 'EMTN' 1.750% 26-Apr-2028 | 209.345 | 0,51 |
| Österreich - 201.127 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 100.000 | JAB Holdings BV 1.000% 14-Jul-2031 | 97.137 | 0,24 |
| 100.000 | JAB Holdings BV 2.250% 19-Dec-2039 | 103.990 | 0,25 |
| Bermudas - 103.425 | | | |
| (31. Dezember 2020: 216.720) | | | |
| 100.000 | PartnerRe Ireland Finance DAC 1.250% 15-Sep-2026 | 103.425 | 0,25 |
| Zypern - 175.999 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 170.000 | Bank of Cyprus Holdings Plc 'EMTN' FRN 6.625% 23-Oct-2031 | 175.999 | 0,43 |
| Finnland - 238.887 | | | |
| (31. Dezember 2020: 411.427) | | | |
| 228.000 | Sampo Oyj 'EMTN' FRN 2.500% 03-Sep-2052 | 238.887 | 0,59 |
| Frankreich - 5.466.921 | | | |
| (31. Dezember 2020: 7.649.987) | | | |
| 200.000 | Aeroports de Paris 1.000% 05-Jan-2029 | 205.633 | 0,50 |
| 100.000 | Aeroports de Paris 1.500% 02-Jul-2032 | 105.264 | 0,26 |
| 100.000 | Airbus SE 'EMTN' 2.375% 09-Jun-2040 | 112.388 | 0,28 |
| 100.000 | APRR SA 'EMTN' 1.250% 18-Jan-2028 | 105.728 | 0,26 |
| 100.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN' 0.100% 08-Oct-2027 | 98.318 | 0,24 |
| 500.000 | BNP Paribas SA 'EMTN' FRN 0.250% 13-Apr-2037 | 494.641 | 1,21 |
| 200.000 | BPCE SA 0.250% 15-Jan-2026 | 199.756 | 0,49 |
| 200.000 | BPCE SA 0.250% 14-Jan-2031 | 191.246 | 0,47 |
| 200.000 | BPCE SA FRN 1.500% 13-Jan-2042 | 198.820 | 0,49 |
| 200.000 | Credit Agricole SA 'EMTN' 0.375% 20-Apr-2028 | 196.979 | 0,48 |
| 100.000 | Credit Agricole SA/London 'EMTN' 1.875% 20-Dec-2026 | 107.563 | 0,26 |
| 300.000 | Dassault Systemes SE 0.125% 16-Sep-2026 | 299.820 | 0,74 |
| 100.000 | Electricite de France SA 'EMTN' 1.000% 29-Nov-2033 | 99.272 | 0,24 |
| 100.000 | Electricite de France SA 'EMTN' 2.000% 09-Dec-2049 | 106.476 | 0,26 |
| 200.000 | Engie SA 'EMTN' 0.500% 24-Oct-2030 | 198.171 | 0,49 |
| 100.000 | Iliad SA 1.875% 11-Feb-2028 | 95.344 | 0,23 |
| 200.000 | La Banque Postale SA 'EMTN' FRN 0.750% 02-Aug-2032 | 193.755 | 0,48 |
| 100.000 | La Banque Postale SA 'EMTN' FRN 0.875% 26-Jan-2031 | 98.895 | 0,24 |
| 200.000 | MMS USA Holdings Inc 0.625% 13-Jun-2025 | 202.332 | 0,50 |
| 100.000 | Orange SA 1.200% 11-Jul-2034 | 103.211 | 0,25 |
| 100.000 | Orange SA 'EMTN' 0.625% 16-Dec-2033 | 97.418 | 0,24 |
| 200.000 | RCI Banque SA 'EMTN' 2.000% 11-Jul-2024 | 208.237 | 0,51 |
| 200.000 | Societe Generale SA FRN 0.625% 02-Dec-2027 | 199.500 | 0,49 |
| 100.000 | TDF Infrastructure SASU 2.500% 07-Apr-2026 | 106.365 | 0,26 |
| 200.000 | Thales SA 'EMTN' 0.000% 26-Mar-2026 | 197.664 | 0,49 |
| 200.000 | Thales SA 'EMTN' 0.750% 23-Jan-2025 | 203.742 | 0,50 |
| 110.000 | TotalEnergies SE 'EMTN' FRN (Perpetual) 3.369% 06-Oct-2026 | 120.018 | 0,29 |
| 122.000 | TotalEnergies SE 'EMTN' FRN (Perpetual) 3.875% 18-May-2022 | 123.781 | 0,30 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert EUR | Nettovermögen % |
|---------------------------------------|---|-------------------------------|--------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Frankreich Forts. | | | |
| 362.000 | TotalEnergies SE FRN (Perpetual) 2.000% 04-Jun-2030 | 357.565 | 0,88 |
| 100.000 | Unibail-Rodamco-Westfield SE 'EMTN' 0.625% 04-May-2027 | 100.488 | 0,25 |
| 100.000 | Unibail-Rodamco-Westfield SE 'EMTN' 0.750% 25-Oct-2028 | 100.131 | 0,25 |
| 230.000 | Unibail-Rodamco-Westfield SE 'EMTN' 1.125% 28-Apr-2027 | 238.400 | 0,59 |
| Deutschland - 3.992.547 | | | |
| (31. Dezember 2020: 5.653.376) | | | |
| 300.000 | Bayer AG 0.375% 06-Jul-2024 | 303.072 | 0,74 |
| 96.000 | Daimler AG 'EMTN' 1.125% 06-Nov-2031 | 100.676 | 0,25 |
| 300.000 | Deutsche Bank AG FRN 1.375% 17-Feb-2032 | 299.685 | 0,73 |
| 300.000 | Deutsche Telekom AG 'EMTN' 0.500% 05-Jul-2027 | 305.361 | 0,75 |
| 128.000 | Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 1.875% 31-Mar-2028 | 131.952 | 0,32 |
| 200.000 | HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 'EMTN' 1.625% 07-Apr-2026 | 210.728 | 0,52 |
| 200.000 | Infineon Technologies AG 'EMTN' 1.625% 24-Jun-2029 | 213.251 | 0,52 |
| 100.000 | Infineon Technologies AG 'EMTN' 2.000% 24-Jun-2032 | 109.123 | 0,27 |
| 100.000 | Mahle GmbH 'EMTN' 2.375% 14-May-2028 | 97.234 | 0,24 |
| 200.000 | Merck KGaA FRN 2.875% 25-Jun-2079 | 216.144 | 0,53 |
| 292.000 | Roadster Finance DAC 'EMTN' 1.625% 09-Dec-2024 | 299.992 | 0,74 |
| 86.000 | Siemens Financieringsmaatschappij NV 'EMTN' 1.750% 28-Feb-2039 | 99.307 | 0,24 |
| 400.000 | Vantage Towers AG 'EMTN' 0.000% 31-Mar-2025 | 396.074 | 0,97 |
| 248.000 | Volkswagen Financial Services AG 'EMTN' 0.125% 12-Feb-2027 | 242.785 | 0,60 |
| 100.000 | Volkswagen International Finance NV 4.125% 16-Nov-2038 | 138.810 | 0,34 |
| 100.000 | Volkswagen International Finance NV FRN (Perpetual) 3.875% 14-Jun-2027 | 108.870 | 0,27 |
| 100.000 | Volkswagen International Finance NV FRN (Perpetual) 3.875% 17-Jun-2029 | 109.250 | 0,27 |
| 100.000 | Vonovia Finance BV 'EMTN' 0.625% 07-Oct-2027 | 100.158 | 0,25 |
| 100.000 | Vonovia Finance BV 'EMTN' 2.750% 22-Mar-2038 | 115.595 | 0,28 |
| 100.000 | Vonovia SE 1.500% 14-Jun-2041 | 96.855 | 0,24 |
| 200.000 | Wintershall Dea Finance 2 BV FRN (Perpetual) 3.000% 20-Jul-2028 | 194.820 | 0,48 |
| 100.000 | Wintershall Dea Finance BV 1.823% 25-Sep-2031 | 102.805 | 0,25 |
| Hongkong - 100.856 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 102.000 | AIA Group Ltd 'GMTN' FRN 0.880% 09-Sep-2033 | 100.856 | 0,25 |
| Irland - 1.669.132 | | | |
| (31. Dezember 2020: 875.262) | | | |
| 200.000 | AIB Group Plc 'EMTN' 1.250% 28-May-2024 | 205.640 | 0,51 |
| 100.000 | AIB Group Plc 'EMTN' FRN 2.875% 30-May-2031 | 105.555 | 0,26 |
| 200.000 | Bank of Ireland Group Plc 'EMTN' FRN 1.375% 11-Aug-2031 | 197.840 | 0,49 |
| 200.000 | Dell Bank International DAC 1.625% 24-Jun-2024 | 207.010 | 0,51 |
| 238.000 | Dell Bank International DAC 'EMTN' 0.500% 27-Oct-2026 | 236.841 | 0,58 |
| 406.569 | European Residential Loan Securitisation 2019-NPL2 DAC '2019-NPL2 A' FRN 0.857% 24-Feb-2058 | 404.385 | 0,99 |
| 100.000 | Permanent TSB Group Holdings Plc 'EMTN' FRN 2.125% 26-Sep-2024 | 101.663 | 0,25 |
| 110.000 | Permanent TSB Group Holdings Plc 'EMTN' FRN 3.000% 19-Aug-2031 | 111.900 | 0,27 |
| 100.000 | Smurfit Kappa Treasury ULC 0.500% 22-Sep-2029 | 98.298 | 0,24 |
| Italien - 1.611.111 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.249.790) | | | |
| 100.000 | Assicurazioni Generali SpA 'EMTN' FRN 5.000% 08-Jun-2048 | 119.943 | 0,29 |
| 140.000 | Assicurazioni Generali SpA 'EMTN' FRN (Perpetual) 4.596% 21-Nov-2025 | 155.820 | 0,38 |
| 129.000 | Eni SpA FRN (Perpetual) 2.000% 11-Feb-2027 | 128.529 | 0,32 |
| 130.000 | FCA Bank SpA/Ireland 'EMTN' 0.000% 16-Apr-2024 | 129.791 | 0,32 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert EUR | Summe Nettover- mögen % |
|---------------------------------------|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Italien Forts. | | | |
| 230.000 | Iccrea Banca SpA FRN 2.125% 17-Jan-2027 | 228.110 | 0,56 |
| 150.000 | Intesa Sanpaolo SpA 6.625% 13-Sep-2023 | 165.288 | 0,41 |
| 200.000 | Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' 0.750% 04-Dec-2024 | 203.374 | 0,50 |
| 162.000 | Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' 0.750% 16-Mar-2028 | 161.860 | 0,40 |
| 100.000 | Terna - Rete Elettrica Nazionale 'EMTN' 1.000% 10-Apr-2026 | 103.273 | 0,25 |
| 100.000 | UniCredit SpA 'EMTN' 6.950% 31-Oct-2022 | 106.003 | 0,26 |
| 100.000 | UnipolSai Assicurazioni SpA 'EMTN' FRN (Perpetual) 5.750% 18-Jun-2024 | 109.120 | 0,27 |
| Japan - 517.799 | | | |
| (31. Dezember 2020: 589.822) | | 517.799 | 1,27 |
| 200.000 | Asahi Group Holdings Ltd 0.541% 23-Oct-2028 | 199.496 | 0,49 |
| 192.000 | Takeda Pharmaceutical Co Ltd 1.375% 09-Jul-2032 | 199.517 | 0,49 |
| 100.000 | Takeda Pharmaceutical Co Ltd 'REGS' 3.000% 21-Nov-2030 | 118.786 | 0,29 |
| Luxemburg - 841.784 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.867.202) | | 841.784 | 2,07 |
| 306.000 | Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl 'EMTN' 0.500% 12-Sep-2023 | 307.715 | 0,75 |
| 255.000 | Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl 'EMTN' 1.750% 12-Mar-2029 | 259.723 | 0,64 |
| 168.000 | Logicor Financing Sarl 'EMTN' 1.500% 13-Jul-2026 | 173.965 | 0,43 |
| 100.000 | SES SA 'EMTN' 0.875% 04-Nov-2027 | 100.381 | 0,25 |
| Niederlande - 1.766.238 | | | |
| (31. Dezember 2020: 715.328) | | 1.766.238 | 4,34 |
| 235.000 | Athora Netherlands NV FRN 2.250% 15-Jul-2031 | 234.882 | 0,58 |
| 100.000 | Enexis Holding NV 'EMTN' 0.625% 17-Jun-2032 | 100.325 | 0,25 |
| 159.000 | JDE Peet's NV 'EMTN' 0.625% 09-Feb-2028 | 157.718 | 0,39 |
| 406.000 | LeasePlan Corp NV 'EMTN' 0.125% 13-Sep-2023 | 407.297 | 1,00 |
| 146.000 | LeasePlan Corp NV 'EMTN' 0.250% 23-Feb-2026 | 144.974 | 0,36 |
| 290.000 | Nationale-Nederlanden Levensverzekering Maatschappij NV FRN 9.000% 29-Aug-2042 | 307.110 | 0,75 |
| 100.000 | VIA Outlets BV 1.750% 15-Nov-2028 | 99.836 | 0,24 |
| 163.000 | Viterra Finance BV 'EMTN' 0.375% 24-Sep-2025 | 161.948 | 0,40 |
| 150.000 | WP/AP Telecom Holdings IV BV 'REGS' 3.750% 15-Jan-2029 | 152.148 | 0,37 |
| Neuseeland - 172.215 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | 172.215 | 0,42 |
| 174.000 | ANZ New Zealand Int'l Ltd/London 'EMTN' 0.200% 23-Sep-2027 | 172.215 | 0,42 |
| Polen - 98.352 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | 98.352 | 0,24 |
| 100.000 | InPost SA 'REGS' 2.250% 15-Jul-2027 | 98.352 | 0,24 |
| Portugal - 214.956 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | 214.956 | 0,53 |
| 200.000 | Cia de Seguros Fidelidade SA FRN 4.250% 04-Sep-2031 | 214.956 | 0,53 |
| Slowakei - 119.214 | | | |
| (31. Dezember 2020: 124.583) | | 119.214 | 0,29 |
| 113.000 | Zapadoslovenska Energetika AS 1.750% 02-Mar-2028 | 119.214 | 0,29 |
| Südafrika - 353.435 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | 353.435 | 0,87 |
| 190.000 | Anglo American Capital Plc 'EMTN' 1.625% 18-Sep-2025 | 198.058 | 0,49 |
| 150.000 | Anglo American Capital Plc 'EMTN' 1.625% 11-Mar-2026 | 155.377 | 0,38 |
| Spanien - 2.910.545 | | | |
| (31. Dezember 2020: 3.172.696) | | 2.910.545 | 7,14 |
| 200.000 | Abanca Corp Bancaria SA 'EMTN' FRN 0.500% 08-Sep-2027 | 196.484 | 0,48 |
| 100.000 | Abertis Infraestructuras SA 'EMTN' 3.000% 27-Mar-2031 | 114.832 | 0,28 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert EUR | Summe Nettover- mögen % |
|---|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Spanien Forts. | | | |
| 100.000 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 'GMTN' FRN 0.435% 09-Sep-2023 | 101.501 | 0,25 |
| 300.000 | Banco de Sabadell SA 'EMTN' 1.125% 27-Mar-2025 | 302.458 | 0,74 |
| 100.000 | Banco de Sabadell SA 'EMTN' FRN 0.875% 16-Jun-2028 | 96.583 | 0,24 |
| 100.000 | Banco Santander SA 'EMTN' 1.375% 05-Jan-2026 | 103.932 | 0,26 |
| 500.000 | CaixaBank SA 'EMTN' 0.375% 03-Feb-2025 | 502.915 | 1,23 |
| 200.000 | CaixaBank SA 'EMTN' FRN 2.750% 14-Jul-2028 | 206.640 | 0,51 |
| 119.000 | FCC Aqualia SA 2.629% 08-Jun-2027 | 130.551 | 0,32 |
| 100.000 | Iberdrola International BV FRN (Perpetual) 2.250% 28-Jan-2029 | 102.180 | 0,25 |
| 200.000 | Inmobiliaria Colonial Socimi SA 'EMTN' 1.625% 28-Nov-2025 | 209.804 | 0,51 |
| 200.000 | Kutxabank SA FRN 0.500% 14-Oct-2027 | 198.498 | 0,49 |
| 400.000 | Santander Consumer Finance SA 'EMTN' 0.375% 27-Jun-2024 | 403.292 | 0,99 |
| 139.409 | Silverback Finance DAC 3.126% 25-Feb-2037 | 145.535 | 0,36 |
| 100.000 | Telefonica Europe BV FRN (Perpetual) 2.376% 12-Feb-2029 | 95.340 | 0,23 |
| Schweden - 603.520 | | | |
| (31. Dezember 2020: 683.693) | | 603.520 | 1,48 |
| 192.000 | Akelius Residential Property AB 'EMTN' 1.750% 07-Feb-2025 | 200.648 | 0,49 |
| 123.000 | Heimstaden Bostad Treasury BV 'EMTN' 1.000% 13-Apr-2028 | 122.606 | 0,30 |
| 100.000 | Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB FRN (Perpetual) 2.625% 14-Dec-2025 | 97.295 | 0,24 |
| 189.000 | SBB Treasury Oyj 'EMTN' 1.125% 26-Nov-2029 | 182.971 | 0,45 |
| Schweiz - 1.587.650 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.128.012) | | 1.587.650 | 3,90 |
| 100.000 | Adecco International Financial Services BV 'EMTN' 0.500% 21-Sep-2031 | 96.478 | 0,24 |
| 150.000 | Credit Suisse Group AG 'EMTN' FRN 0.650% 14-Jan-2028 | 148.741 | 0,36 |
| 565.000 | Credit Suisse Group AG 'EMTN' FRN 3.250% 02-Apr-2026 | 615.095 | 1,51 |
| 100.000 | Givaudan Finance Europe BV 1.000% 22-Apr-2027 | 104.206 | 0,25 |
| 100.000 | Givaudan Finance Europe BV 1.625% 22-Apr-2032 | 108.554 | 0,27 |
| 104.000 | Holcim Finance Luxembourg SA 0.500% 23-Apr-2031 | 98.870 | 0,24 |
| 130.000 | Holcim Finance Luxembourg SA 'EMTN' 0.500% 03-Sep-2030 | 125.105 | 0,31 |
| 190.000 | Novartis Finance SA 0.000% 23-Sep-2028 | 186.291 | 0,46 |
| 100.000 | Richemont International Holding SA 1.125% 26-May-2032 | 104.310 | 0,26 |
| Vereinigte Arabische Emirate - 106.215 | | | |
| (31. Dezember 2020: 104.718) | | 106.215 | 0,26 |
| 100.000 | DP World Ltd/United Arab Emirates 'REGS' 2.375% 25-Sep-2026 | 106.215 | 0,26 |
| Vereinigtes Königreich - 6.344.247 | | | |
| (31. Dezember 2020: 5.078.462) | | 6.344.247 | 15,57 |
| 270.000 | Barclays Plc 'EMTN' FRN 0.750% 09-Jun-2025 | 274.057 | 0,67 |
| 188.000 | Barclays Plc FRN 0.577% 09-Aug-2029 | 184.026 | 0,45 |
| 110.000 | Barclays Plc FRN 1.106% 12-May-2032 | 109.198 | 0,27 |
| 100.000 | BAT International Finance Plc 'EMTN' 1.250% 13-Mar-2027 | 101.820 | 0,25 |
| 100.000 | BP Capital Markets Plc 2.822% 07-Apr-2032 | 118.257 | 0,29 |
| 300.000 | BP Capital Markets Plc 'EMTN' 2.213% 25-Sep-2026 | 328.226 | 0,80 |
| 165.000 | BP Capital Markets Plc FRN (Perpetual) 3.250% 22-Mar-2026 | 174.908 | 0,43 |
| 334.000 | British American Tobacco Plc FRN (Perpetual) 3.000% 27-Sep-2026 | 327.741 | 0,80 |
| 100.000 | British Telecommunications Plc 'EMTN' 1.125% 12-Sep-2029 | 101.503 | 0,25 |
| 115.000 | British Telecommunications Plc 'EMTN' 1.500% 23-Jun-2027 | 118.660 | 0,29 |
| 100.000 | CK Hutchison Group Telecom Finance SA 1.125% 17-Oct-2028 | 101.574 | 0,25 |
| 302.000 | CNH Industrial Finance Europe SA 0.000% 01-Apr-2024 | 301.606 | 0,74 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert EUR | Nettovermögen % | Summe |
|--|--|----------------------------|-----------------|-------|
| Anleihen Forts. | | | | |
| Vereinigtes Königreich Forts. | | | | |
| 210.000 | CNH Industrial Finance Europe SA 'EMTN' 1.750% 12-Sep-2025 | 219.954 | 0,54 | |
| 316.000 | Hammerson Ireland Finance DAC 1.750% 03-Jun-2027 | 311.282 | 0,76 | |
| 248.000 | Heathrow Funding Ltd 1.500% 12-Oct-2025 | 257.276 | 0,63 | |
| 100.000 | Heathrow Funding Ltd 'EMTN' 1.875% 14-Mar-2034 | 104.408 | 0,26 | |
| 340.000 | HSBC Holdings Plc FRN 0.641% 24-Sep-2029 | 338.198 | 0,83 | |
| 110.000 | Imperial Brands Finance Netherlands BV 'EMTN' 1.750% 18-Mar-2033 | 107.422 | 0,26 | |
| 150.000 | Imperial Brands Finance Plc 'EMTN' 2.125% 12-Feb-2027 | 157.633 | 0,39 | |
| 340.000 | InterContinental Hotels Group Plc 'EMTN' 2.125% 15-May-2027 | 361.090 | 0,89 | |
| 210.000 | NatWest Group Plc 'EMTN' FRN 1.043% 14-Sep-2032 | 206.881 | 0,51 | |
| 185.000 | NatWest Markets Plc 'EMTN' 2.750% 02-Apr-2025 | 200.718 | 0,49 | |
| 230.000 | Phoenix Group Holdings Plc 'EMTN' 4.375% 24-Jan-2029 | 267.231 | 0,66 | |
| 400.000 | Standard Chartered Plc 'EMTN' FRN 1.200% 23-Sep-2031 | 399.152 | 0,98 | |
| 130.000 | Tesco Corporate Treasury Services Plc 'EMTN' 0.375% 27-Jul-2029 | 125.076 | 0,31 | |
| 100.000 | Tesco Corporate Treasury Services Plc 'EMTN' 0.875% 29-May-2026 | 101.841 | 0,25 | |
| 345.000 | Virgin Money UK Plc FRN 2.875% 24-Jun-2025 | 365.835 | 0,90 | |
| 150.000 | Vodafone Group Plc FRN 3.100% 03-Jan-2079 | 155.041 | 0,38 | |
| 206.000 | Yorkshire Building Society 0.625% 21-Sep-2025 | 209.315 | 0,51 | |
| 216.000 | Yorkshire Building Society 'EMTN' 0.500% 01-Jul-2028 | 214.318 | 0,53 | |
| Vereinigte Staaten von Amerika - 8.486.174 (31. Dezember 2020: 7.104.767) | | | | |
| 100.000 | Air Products and Chemicals Inc 'EMTN' 0.500% 05-May-2028 | 101.086 | 0,25 | |
| 100.000 | American International Group Inc 1.875% 21-Jun-2027 | 106.322 | 0,26 | |
| 190.000 | American Tower Corp 1.375% 04-Apr-2025 | 196.531 | 0,48 | |
| 100.000 | AT&T Inc 3.150% 04-Sep-2036 | 119.189 | 0,29 | |
| 100.000 | AT&T Inc 3.550% 17-Dec-2032 | 123.496 | 0,30 | |
| 137.000 | Bank of America Corp 'EMTN' FRN 0.654% 26-Oct-2031 | 133.649 | 0,33 | |
| 149.000 | Bank of America Corp 'EMTN' FRN 1.662% 25-Apr-2028 | 157.473 | 0,39 | |
| 100.000 | Becton Dickinson and Co 0.034% 13-Aug-2025 | 99.394 | 0,24 | |
| 100.000 | Becton Dickinson Euro Finance Sarl 0.334% 13-Aug-2028 | 98.344 | 0,24 | |
| 100.000 | Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.336% 13-Aug-2041 | 95.413 | 0,23 | |
| 110.000 | Berry Global Inc 'REGS' 1.000% 15-Jan-2025 | 111.030 | 0,27 | |
| 110.000 | Berry Global Inc 'REGS' 1.500% 15-Jan-2027 | 112.267 | 0,28 | |
| 290.000 | Celanese US Holdings LLC 1.250% 11-Feb-2025 | 297.417 | 0,73 | |
| 200.000 | Chubb INA Holdings Inc 0.300% 15-Dec-2024 | 201.419 | 0,49 | |
| 100.000 | Chubb INA Holdings Inc 0.875% 15-Dec-2029 | 101.752 | 0,25 | |
| 100.000 | Chubb INA Holdings Inc 2.500% 15-Mar-2038 | 117.642 | 0,29 | |
| 337.000 | Comcast Corp 0.000% 14-Sep-2026 | 332.691 | 0,82 | |
| 111.000 | Comcast Corp 0.750% 20-Feb-2032 | 110.625 | 0,27 | |
| 140.000 | Dow Chemical Co/The 0.500% 15-Mar-2027 | 139.626 | 0,34 | |
| 100.000 | Dresdner Funding Trust I '144A' 8.151% 30-Jun-2031 | 125.295 | 0,31 | |
| 120.000 | Eaton Capital Unlimited Co 0.577% 08-Mar-2030 | 119.182 | 0,29 | |
| 100.000 | Eli Lilly & Co 1.375% 14-Sep-2061 | 91.514 | 0,22 | |
| 120.000 | Exxon Mobil Corp 1.408% 26-Jun-2039 | 115.662 | 0,28 | |
| 260.000 | FedEx Corp 0.950% 04-May-2033 | 251.137 | 0,62 | |
| 100.000 | FedEx Corp 1.300% 05-Aug-2031 | 103.174 | 0,25 | |
| 123.000 | Fidelity National Information Services Inc 0.625% 03-Dec-2025 | 124.711 | 0,31 | |
| 100.000 | Fidelity National Information Services Inc 2.000% 21-May-2030 | 108.700 | 0,27 | |
| 245.000 | General Motors Financial Co Inc 0.600% 20-May-2027 | 242.910 | 0,60 | |
| 330.000 | General Motors Financial Co Inc 'EMTN' 1.694% 26-Mar-2025 | 343.784 | 0,84 | |
| 423.000 | Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 0.250% 26-Jan-2028 | 412.681 | 1,01 | |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert EUR | Nettovermögen % | Summe |
|--|--|----------------------------|-----------------|-------|
| Anleihen Forts. | | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika Forts. | | | | |
| 213.000 | Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 0.750% 23-Mar-2032 | 206.140 | 0,51 | |
| 80.000 | Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 2.000% 22-Mar-2028 | 86.483 | 0,21 | |
| 100.000 | Medtronic Global Holdings SCA 1.500% 02-Jul-2039 | 103.324 | 0,25 | |
| 400.000 | Molson Coors Beverage Co 1.250% 15-Jul-2024 | 409.858 | 1,01 | |
| 400.000 | Morgan Stanley 'EMTN' FRN 1.342% 23-Oct-2026 | 415.442 | 1,02 | |
| 153.000 | Morgan Stanley FRN 1.102% 29-Apr-2033 | 153.237 | 0,38 | |
| 194.000 | Netflix Inc 3.625% 15-May-2027 | 222.862 | 0,55 | |
| 110.000 | Netflix Inc 'REGS' 3.625% 15-Jun-2030 | 131.050 | 0,32 | |
| 200.000 | Stellantis Finance US Inc '144A' 2.691% 15-Sep-2031 | 173.954 | 0,43 | |
| 191.000 | Stellantis NV 'EMTN' 1.250% 20-Jun-2033 | 186.485 | 0,46 | |
| 100.000 | Thermo Fisher Scientific Finance I BV 1.625% 18-Oct-2041 | 101.913 | 0,25 | |
| 135.000 | Thermo Fisher Scientific Inc 2.375% 15-Apr-2032 | 154.889 | 0,38 | |
| 130.000 | Upjohn Finance BV 1.908% 23-Jun-2032 | 136.349 | 0,33 | |
| 200.000 | Utah Acquisition Sub Inc 2.250% 22-Nov-2024 | 211.392 | 0,52 | |
| 200.000 | Verizon Communications Inc 1.125% 19-Sep-2035 | 195.073 | 0,48 | |
| 100.000 | Verizon Communications Inc 2.625% 01-Dec-2031 | 116.863 | 0,29 | |
| 275.000 | Westlake Chemical Corp 1.625% 17-Jul-2029 | 285.160 | 0,70 | |
| 370.000 | Zimmer Biomet Holdings Inc 2.425% 13-Dec-2026 | 401.584 | 0,99 | |
| Gesamtanlagen in Anleihen | | 38.083.369 | 93,48 | |

| Bestände | Beschreibung | Zugrunde liegendes Engagement EUR | Beizulegender Zeitwert EUR | Nettovermögen % | Summe |
|---|---|-----------------------------------|----------------------------|-----------------|-------|
| Offene Terminkontrakte - 37.238 (31. Dezember 2020: 4.113) | | | | | |
| (3) | Euro-Bobl Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (399.720) | 2.234 | 0,01 | |
| (3) | Euro-Bund Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (514.110) | 8.607 | 0,02 | |
| (3) | Euro-Buxl 30 Year Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (620.220) | 26.397 | 0,06 | |
| Offene Terminkontrakte insgesamt | | | 37.238 | 0,09 | |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 3.141 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 87.379) | | | 3.141 | 0,01 | |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | | 39.597.242 | 97,20 | |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert EUR | Nettovermögen % | Summe |
|--|--|----------------------------|------------------|---------------|
| Credit Default Swaps - (111.371) (31. Dezember 2020: (112.022)) | | | | |
| 4.300.000 | CDS iTraxx Europe Series 36 Version 1 Index 1.000% 20-Dec-2026 | (111.371) | (0,27) | |
| Credit Default Swaps insgesamt | | | (111.371) | (0,27) |

| Bestände | Beschreibung | Zugrunde liegendes Engagement EUR | Beizulegender Zeitwert EUR | Nettovermögen % | Summe |
|--|---|-----------------------------------|----------------------------|-----------------|-------|
| Offene Terminkontrakte - (6.997) (31. Dezember 2020: (4.300)) | | | | | |
| 5 | Euro-Schatz Long Futures Contracts Exp Mar-2022 | 560.150 | (945) | (0,00) | |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Zugrunde liegendes Engagement EUR | Beizulegender Zeitwert EUR | Summe Nettovermögen % |
|----------|--|-----------------------------------|----------------------------|-----------------------|
| | Offene Terminkontrakte Forts. | | | |
| (4) | U.S. 10 Year Ultra Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (516.577) | (6.052) | (0,02) |
| | Offene Terminkontrakte insgesamt | | (6.997) | (0,02) |
| | Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (29.711) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (8.081)) | | (29.711) | (0,08) |
| | Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | (148.079) | (0,37) |
| | Nettoumlaufvermögen | | 1.289.046 | 3,17 |
| | Summe Nettovermögen | | 40.738.209 | 100,00 |

^ Anlage in einem anderen Fonds der Gesellschaft.
 Der Kontrahent für die Credit Default Swaps ist Morgan Stanley.
 Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist Goldman Sachs.

| Portfolioanalyse | % des Gesamtvermögens |
|--|-----------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 95,28 |
| An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente | 0,09 |
| Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate) | 0,01 |
| Sonstiges Umlaufvermögen | 4,62 |
| Gesamtvermögen | 100,00 |

| Devisenterminkontrakte | | | | | | | Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) |
|--|-----------|------------|------------|------------------|-------------------------------|-----------------|--------------------------------------|
| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | | |
| BNY Mellon European Credit Fund | | | | | | | |
| US-Dollar | Euro | 79.000 | 69.541 | 21. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | 231 | |
| Pfund Sterling | Euro | 162.000 | 189.877 | 25. Jan. 22 | Morgan Stanley | 2.910 | |
| | | | | | EUR | 3.141 | |
| Euro | US-Dollar | 115.499 | 131.000 | 21. Jan. 22 | Morgan Stanley | (200) | |
| Euro | US-Dollar | 275.628 | 321.000 | 21. Jan. 22 | Morgan Stanley | (7.880) | |
| Euro | US-Dollar | 485.720 | 567.000 | 28. Jan. 22 | Bank of America Merrill Lynch | (14.983) | |
| Euro | US-Dollar | 499.282 | 573.000 | 4. Feb. 22 | Bank of America Merrill Lynch | (6.648) | |
| | | | | | EUR | (29.711) | |

BNY MELLON FUTURE EARTH FUND*

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Summe Beizulegender Zeitwert USD | Nettover- mögen % |
|---|------------------------------------|---|-------------------------|
| Aktien | | | |
| Dänemark - 125.441 | | | |
| 881 | Novozymes A/S | 72.298 | 3,34 |
| 273 | Ørsted AS '144A' | 34.714 | 1,60 |
| 605 | Vestas Wind Systems A/S | 18.429 | 0,85 |
| Frankreich - 98.965 | | | |
| 852 | Legrand SA | 98.965 | 4,57 |
| Deutschland - 59.067 | | | |
| 1.283 | Infineon Technologies AG | 59.067 | 2,73 |
| Hongkong - 14.230 | | | |
| 7.037 | Vitasoy International Holdings Ltd | 14.230 | 0,66 |
| Irland - 59.033 | | | |
| 1.075 | Smurfit Kappa Group Plc | 59.033 | 2,73 |
| Japan - 431.602 | | | |
| 300 | Daikin Industries Ltd | 68.029 | 3,14 |
| 1.200 | Ebara Corp | 66.609 | 3,08 |
| 100 | FANUC Corp | 21.204 | 0,98 |
| 3.000 | Kubota Corp | 66.596 | 3,08 |
| 700 | Kurita Water Industries Ltd | 33.200 | 1,53 |
| 500 | Nidec Corp | 58.765 | 2,72 |
| 200 | Shimano Inc | 53.301 | 2,46 |
| 800 | Toyota Industries Corp | 63.898 | 2,95 |
| Niederlande - 52.692 | | | |
| 235 | Koninklijke DSM NV | 52.692 | 2,43 |
| Norwegen - 111.333 | | | |
| 3.136 | Mowi ASA | 74.146 | 3,42 |
| 520 | TOMRA Systems ASA | 37.187 | 1,72 |
| Republik Korea - 65.619 | | | |
| 119 | Samsung SDI Co Ltd | 65.619 | 3,03 |
| Vereinigtes Königreich - 246.623 | | | |
| 260 | Ashtead Group Plc | 20.889 | 0,96 |
| 6.991 | Genuit Group Plc | 55.537 | 2,57 |
| 1.175 | Johnson Matthey Plc | 32.381 | 1,50 |
| 5.765 | National Grid Plc | 82.786 | 3,82 |
| 1.039 | Unilever Plc | 55.030 | 2,54 |
| Vereinigte Staaten von Amerika - 788.252 | | | |
| 255 | Acuity Brands Inc | 53.931 | 2,49 |
| 251 | Albemarle Corp | 58.856 | 2,72 |
| 116 | Beyond Meat Inc | 7.817 | 0,36 |
| 248 | Deere & Co | 84.832 | 3,92 |
| 314 | Ecolab Inc | 73.490 | 3,39 |
| 960 | Eversource Energy | 87.490 | 4,04 |
| 156 | Hubbell Inc - Class B | 32.350 | 1,49 |
| 170 | Microsoft Corp | 57.689 | 2,66 |
| 474 | TE Connectivity Ltd | 76.141 | 3,52 |
| 250 | Texas Instruments Inc | 47.347 | 2,19 |
| 221 | Trane Technologies Plc | 44.383 | 2,05 |
| 611 | Trimble Inc | 53.444 | 2,47 |
| 2.080 | Weyerhaeuser Co (REIT) | 85.228 | 3,94 |
| 212 | Xylem Inc/NY | 25.254 | 1,17 |
| Gesamtanlagen in Aktien | | 2.052.857 | 94,82 |

| Bestände | Beschreibung | Summe Beizulegender Zeitwert USD | Nettover- mögen % |
|---|-----------------------------|---|-------------------------|
| Kapitalbeteiligungsinstrumente | | | |
| Vereinigtes Königreich - 45.419 | | | |
| 23.971 | Greencoat UK Wind Plc/Funds | 45.419 | 2,10 |
| Gesamtanlagen in Kapitalbeteiligungsinstrumente | | 45.419 | 2,10 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 687 (siehe unten) | | 687 | 0,03 |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | 2.098.963 | 96,95 |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (58) (siehe unten) | | (58) | (0,00) |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | (58) | (0,00) |
| Nettoumlaufvermögen | | 66.032 | 3,05 |
| Summe Nettovermögen | | 2.164.937 | 100,00 |

*Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

| Portfolioanalyse | % des Gesamtvermögens |
|--|-----------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 96,34 |
| Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate) | 0,03 |
| Sonstiges Umlaufvermögen | 3,63 |
| Gesamtvermögen | 100,00 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Devisenterminkontrakte | | | | | | | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) | Devisenterminkontrakte Forts. | | | | | | | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|---|-----------|------------|------------|------------------|-----------------------------|-----|-------------------------------------|--|---------|------------|-------------|-----------------------------|------------|--|-------------------------------------|
| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | | | Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | | |
| BNY Mellon Future Earth Fund Anteilsklasse Euro H (Acc) (Hedged) | | | | | | | | BNY Mellon Absolute Return Bond Fund Anteilsklasse Euro W (Acc) (Hedged) Forts. | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 1.646 | 1.864 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - | US-Dollar | Euro | 1.262 | 1.118 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (4) | | |
| Euro | US-Dollar | 644 | 728 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1 | US-Dollar | Euro | 1.252 | 1.110 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (4) | | |
| Euro | US-Dollar | 107.779 | 121.788 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 227 | US-Dollar | Euro | 1.016 | 901 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (4) | | |
| US-Dollar | Euro | 686 | 606 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - | | | | | | | | | |
| | | | | | | | USD | | | | | | | | (20) |
| | | | | | | | EUR | | | | | | | | (18) |
| Euro | US-Dollar | 1.543 | 1.750 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (3) | | | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 1.537 | 1.741 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) | | | | | | | | | |
| US-Dollar | Euro | 1.243 | 1.102 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (4) | | | | | | | | | |
| US-Dollar | Euro | 1.009 | 895 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (4) | | | | | | | | | |
| US-Dollar | Euro | 2.113 | 1.870 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (3) | | | | | | | | | |
| US-Dollar | Euro | 1.252 | 1.109 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (4) | | | | | | | | | |
| | | | | | | | USD | | | | | | | | (19) |
| | | | | | | | EUR | | | | | | | | (17) |
| BNY Mellon Future Earth Fund Anteilsklasse Euro I (Acc) (Hedged) | | | | | | | | | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 1.664 | 1.884 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - | | | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 658 | 744 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1 | | | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 108.713 | 122.844 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 228 | | | | | | | | | |
| US-Dollar | Euro | 689 | 608 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - | | | | | | | | | |
| | | | | | | | USD | | | | | | | | 229 |
| | | | | | | | EUR | | | | | | | | 202 |
| Euro | US-Dollar | 1.573 | 1.785 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (3) | | | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 1.559 | 1.766 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) | | | | | | | | | |
| US-Dollar | Euro | 2.123 | 1.878 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (3) | | | | | | | | | |
| US-Dollar | Euro | 1.260 | 1.116 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (4) | | | | | | | | | |
| US-Dollar | Euro | 1.251 | 1.108 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (4) | | | | | | | | | |
| US-Dollar | Euro | 1.015 | 900 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (4) | | | | | | | | | |
| | | | | | | | USD | | | | | | | | (19) |
| | | | | | | | EUR | | | | | | | | (17) |
| BNY Mellon Future Earth Fund Anteilsklasse Euro W (Acc) (Hedged) | | | | | | | | | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 1.667 | 1.888 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - | | | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 661 | 747 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1 | | | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 108.914 | 123.071 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 229 | | | | | | | | | |
| US-Dollar | Euro | 690 | 609 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - | | | | | | | | | |
| | | | | | | | USD | | | | | | | | 230 |
| | | | | | | | EUR | | | | | | | | 203 |
| Euro | US-Dollar | 1.580 | 1.792 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (4) | | | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 1.564 | 1.772 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) | | | | | | | | | |
| US-Dollar | Euro | 2.125 | 1.880 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (3) | | | | | | | | | |

BNY MELLON FUTURE FOOD FUND*

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Summe Beizulegender Zeitwert USD | Nettover- mögen % |
|---|---|---|-------------------------|
| Aktien | | | |
| Kanada - 122.961 | | | |
| 1.241 | Nutrien Ltd | 92.634 | 3,35 |
| 4.437 | SunOpta Inc | 30.327 | 1,09 |
| China - 52.382 | | | |
| 7.346 | Health & Happiness H&H International Holdings Ltd | 11.408 | 0,41 |
| 1.417 | Meituan '144A' | 40.974 | 1,48 |
| Dänemark - 133.245 | | | |
| 528 | Chr Hansen Holding A/S | 41.417 | 1,50 |
| 1.119 | Novozymes A/S | 91.828 | 3,32 |
| Frankreich - 64.321 | | | |
| 1.043 | Danone SA | 64.321 | 2,32 |
| Deutschland - 100.043 | | | |
| 896 | Bayer AG | 47.725 | 1,73 |
| 354 | Symrise AG - Class A | 52.318 | 1,89 |
| Hongkong - 14.791 | | | |
| 7.314 | Vitasoy International Holdings Ltd | 14.791 | 0,53 |
| Irland - 84.940 | | | |
| 658 | Kerry Group Plc | 84.940 | 3,07 |
| Japan - 166.994 | | | |
| 3.000 | Kubota Corp | 66.596 | 2,41 |
| 1.500 | Suntory Beverage & Food Ltd | 54.269 | 1,96 |
| 3.200 | Topcon Corp | 46.129 | 1,67 |
| Mexiko - 74.634 | | | |
| 20.000 | Wal-Mart de Mexico SAB de CV | 74.634 | 2,70 |
| Niederlande - 165.943 | | | |
| 2.573 | Koninklijke Ahold Delhaize NV | 88.139 | 3,19 |
| 347 | Koninklijke DSM NV | 77.804 | 2,81 |
| Neuseeland - 18.572 | | | |
| 4.683 | a2 Milk Co Ltd/The | 18.572 | 0,67 |
| Norwegen - 146.573 | | | |
| 2.604 | Grieg Seafood ASA | 24.484 | 0,89 |
| 2.983 | Mowi ASA | 70.528 | 2,55 |
| 721 | TOMRA Systems ASA | 51.561 | 1,86 |
| Saudi-Arabien - 33.444 | | | |
| 302 | Delivery Hero SE '144A' | 33.444 | 1,21 |
| Schweiz - 246.628 | | | |
| 134 | Bucher Industries AG | 66.207 | 2,39 |
| 12 | Givaudan SA | 63.003 | 2,28 |
| 841 | Nestle SA | 117.418 | 4,24 |
| Vereinigtes Königreich - 273.665 | | | |
| 4.097 | CNH Industrial NV | 79.168 | 2,86 |
| 818 | Genus Plc | 54.301 | 1,96 |
| 2.842 | Nomad Foods Ltd | 72.031 | 2,60 |
| 1.287 | Unilever Plc | 68.165 | 2,47 |
| Vereinigte Staaten von Amerika - 998.136 | | | |
| 766 | AGCO Corp | 87.929 | 3,18 |
| 67 | Beyond Meat Inc | 4.515 | 0,16 |
| 2.949 | Brixmor Property Group Inc (REIT) | 74.654 | 2,70 |
| 1.729 | Corteva Inc | 81.479 | 2,95 |
| 163 | Costco Wholesale Corp | 91.930 | 3,32 |
| 271 | Deere & Co | 92.700 | 3,35 |
| 339 | Ecolab Inc | 79.341 | 2,87 |
| 654 | Ingredion Inc | 63.111 | 2,28 |

| Bestände | Beschreibung | Summe Beizulegender Zeitwert USD | Nettover- mögen % |
|--|--|---|-------------------------|
| Aktien Forts. | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika Forts. | | | |
| 442 | International Flavors & Fragrances Inc | 65.666 | 2,37 |
| 1.776 | Mosaic Co/The | 69.628 | 2,52 |
| 483 | PepsiCo Inc | 83.405 | 3,01 |
| 2.790 | Sprouts Farmers Market Inc | 83.379 | 3,01 |
| 1.030 | Trimble Inc | 90.094 | 3,26 |
| 351 | Tyson Foods Inc - Class A | 30.305 | 1,10 |
| Gesamtanlagen in Aktien | | 2.697.272 | 97,49 |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | 2.697.272 | 97,49 |
| Nettoumlaufvermögen | | 69.553 | 2,51 |
| Summe Nettovermögen | | 2.766.825 | 100,00 |

*Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

| Portfolioanalyse | % des Gesamtvermögens |
|--|-----------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 96,93 |
| Sonstiges Umlaufvermögen | 3,07 |
| Gesamtvermögen | 100,00 |

BNY MELLON FUTURE LIFE FUND*

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|---|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Aktien | | | |
| Australien - 33.081 | | | |
| 211 | Cochlear Ltd | 33.081 | 1,41 |
| China - 28.814 | | | |
| 4.000 | Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H' | 28.814 | 1,22 |
| Dänemark - 113.744 | | | |
| 1.012 | Novo Nordisk A/S | 113.744 | 4,84 |
| Frankreich - 74.182 | | | |
| 200 | EssilorLuxottica SA | 42.402 | 1,80 |
| 67 | L'Oreal SA | 31.780 | 1,35 |
| Deutschland - 68.615 | | | |
| 357 | Fresenius Medical Care AG & Co KGaA | 23.141 | 0,99 |
| 608 | Siemens Healthineers AG '144A' | 45.474 | 1,93 |
| Hongkong - 72.592 | | | |
| 7.200 | AIA Group Ltd | 72.592 | 3,09 |
| Italien - 38.553 | | | |
| 718 | Amplifon SpA | 38.553 | 1,64 |
| Japan - 85.302 | | | |
| 400 | M3 Inc | 20.144 | 0,86 |
| 600 | Sugi Holdings Co Ltd | 36.327 | 1,54 |
| 2.000 | Topcon Corp | 28.831 | 1,23 |
| Südafrika - 22.032 | | | |
| 2.458 | Discovery Ltd | 22.032 | 0,94 |
| Schweiz - 327.018 | | | |
| 513 | Alcon Inc | 45.372 | 1,93 |
| 45 | Lonza Group AG | 37.543 | 1,60 |
| 462 | Novartis AG | 40.629 | 1,73 |
| 264 | Roche Holding AG | 109.641 | 4,66 |
| 25 | Straumann Holding AG | 53.032 | 2,25 |
| 93 | Zurich Insurance Group AG | 40.801 | 1,73 |
| Vereinigtes Königreich - 231.348 | | | |
| 621 | AstraZeneca Plc | 72.117 | 3,07 |
| 3.220 | GlaxoSmithKline Plc | 69.611 | 2,96 |
| 3.833 | Prudential Plc | 65.574 | 2,79 |
| 1.387 | Smith & Nephew Plc | 24.046 | 1,02 |
| Vereinigte Staaten von Amerika - 1.203.182 | | | |
| 1.148 | Abbott Laboratories | 161.874 | 6,88 |
| 523 | Acushnet Holdings Corp | 27.784 | 1,18 |
| 11 | Booking Holdings Inc | 26.367 | 1,12 |
| 154 | Cooper Cos Inc/The | 65.325 | 2,78 |
| 223 | Danaher Corp | 73.283 | 3,12 |
| 275 | HCA Healthcare Inc | 71.015 | 3,02 |
| 1.008 | Healthpeak Properties Inc (REIT) | 36.283 | 1,54 |
| 177 | Home Depot Inc/The | 72.571 | 3,09 |
| 144 | Intuitive Surgical Inc | 52.334 | 2,23 |
| 451 | Jackson Financial Inc | 18.804 | 0,80 |
| 521 | Johnson & Johnson | 89.823 | 3,82 |
| 175 | Lowe's Cos Inc | 44.873 | 1,91 |
| 948 | Medtronic Plc | 99.061 | 4,21 |
| 626 | Merck & Co Inc | 48.293 | 2,05 |
| 1.102 | Principal Financial Group Inc | 79.465 | 3,38 |
| 174 | Sherwin-Williams Co/The | 60.970 | 2,59 |
| 63 | Thermo Fisher Scientific Inc | 41.939 | 1,78 |
| 221 | UnitedHealth Group Inc | 111.562 | 4,74 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|--|----------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| Aktien Forts. | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika Forts. | | | |
| 251 | Welltower Inc (REIT) | 21.556 | 0,92 |
| Gesamtanlagen in Aktien | | 2.298.463 | 97,74 |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | 2.298.463 | 97,74 |
| Nettoumlaufvermögen | | 53.113 | 2,26 |
| Summe Nettovermögen | | 2.351.576 | 100,00 |

*Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

| Portfolioanalyse | % des Gesamtvermögens |
|--|-----------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 97,18 |
| Sonstiges Umlaufvermögen | 2,82 |
| Gesamtvermögen | 100,00 |

BNY MELLON GLOBAL BOND FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|---|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| US-Dollar - 22.509.231 | | | |
| (31. Dezember 2020: 16.427.021) | | | |
| 4.512.179 | iShares China CNY Bond UCITS ETF - ETF | 22.509.231 | 5,18 |
| Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen | | 22.509.231 | 5,18 |
| Anleihen | | | |
| Australischer Dollar - 15.223.765 | | | |
| (31. Dezember 2020: 39.662.148) | | | |
| 4.110.000 | Australia Government Bond 1.750% 21-Jun-2051 | 2.589.055 | 0,59 |
| 4.120.000 | Australia Government Bond 3.000% 20-Sep-2025 | 4.463.477 | 1,03 |
| 6.700.000 | Treasury Corp of Victoria 1.000% 20-Nov-2023 | 4.877.940 | 1,12 |
| 4.760.000 | Treasury Corp of Victoria 2.000% 17-Sep-2035 | 3.293.293 | 0,76 |
| Kanadischer Dollar - 19.879.967 | | | |
| (31. Dezember 2020: 22.974.671) | | | |
| 11.295.000 | Canada Housing Trust No 1 '144A' 2.350% 15-Sep-2023 | 9.057.327 | 2,08 |
| 3.800.000 | Canada Housing Trust No 1 FRN 0.323% 15-Mar-2027 | 2.985.634 | 0,69 |
| 6.832.679 | Canadian Government Real Return Bond 4.000% 01-Dec-2031 | 7.837.006 | 1,80 |
| Kolumbianischer Peso - 6.038.346 | | | |
| (31. Dezember 2020: 5.270.743) | | | |
| 8.959.500.000 | Colombia Government International Bond 'REGS' 6.000% 28-Apr-2028 | 1.995.954 | 0,46 |
| 17.841.300.000 | Colombia Government International Bond 'REGS' 7.000% 30-Jun-2032 | 4.042.392 | 0,93 |
| Tschechische Krone - 9.951.584 | | | |
| (31. Dezember 2020: 6.745.774) | | | |
| 123.780.000 | Czech Republic Government Bond 0.450% 25-Oct-2023 | 5.320.729 | 1,22 |
| 104.130.000 | Czech Republic Government Bond 2.750% 23-Jul-2029 | 4.630.855 | 1,07 |
| Dänische Krone - 5.760.251 | | | |
| (31. Dezember 2020: 11.821.549) | | | |
| 36.020.000 | Denmark Government Bond '144A' 0.500% 15-Nov-2029 | 5.760.251 | 1,33 |
| Euro - 101.384.306 | | | |
| (31. Dezember 2020: 138.407.895) | | | |
| 1.645.000 | European Union 0.000% 04-Jul-2031 | 1.849.512 | 0,43 |
| 4.900.000 | FMS Wertmanagement 'EMTN' 0.375% 29-Apr-2030 | 5.642.263 | 1,30 |
| 11.516.974 | French Republic Government Bond OAT 0.100% 01-Mar-2025 | 13.946.021 | 3,21 |
| 2.310.000 | French Republic Government Bond OAT 3.250% 25-May-2045 | 4.035.469 | 0,93 |
| 1.790.000 | Indonesia Government International Bond 1.750% 24-Apr-2025 | 2.107.620 | 0,48 |
| 3.530.000 | Ireland Government Bond 1.000% 15-May-2026 | 4.232.601 | 0,97 |
| 4.010.000 | Ireland Government Bond 1.100% 15-May-2029 | 4.905.267 | 1,13 |
| 1.651.200 | Ireland Government Bond 1.500% 15-May-2050 | 2.153.360 | 0,50 |
| 9.530.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 1.850% 01-Jul-2025 | 11.408.981 | 2,62 |
| 3.730.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 2.450% 01-Sep-2050 | 4.655.465 | 1,07 |
| 3.757.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 5.000% 01-Aug-2034 | 6.049.867 | 1,39 |
| 3.730.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 'EMTN' 1.375% 31-Jul-2035 | 4.799.344 | 1,10 |
| 5.120.000 | Province of British Columbia Canada 'EMTN' 0.875% 08-Oct-2025 | 5.995.410 | 1,38 |
| 3.700.000 | SNCF Reseau 'EMTN' 1.125% 25-May-2030 | 4.490.272 | 1,03 |
| 5.920.000 | Spain Government Bond 5.750% 30-Jul-2032 | 10.301.566 | 2,37 |
| 4.430.000 | Spain Government Bond '144A' 5.150% 31-Oct-2028 | 6.724.857 | 1,55 |
| 1.030.000 | Spain Government Bond '144A' 5.150% 31-Oct-2044 | 2.098.229 | 0,48 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|---|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Euro Forts. | | | |
| 4.140.000 | Spain Government Bond '144A' 5.900% 30-Jul-2026 | 5.988.202 | 1,38 |
| Indische Rupie - 2.219.627 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 160.700.000 | International Finance Corp 'GMTN' 6.300% 25-Nov-2024 | 2.219.627 | 0,51 |
| Indonesische Rupiah - 6.287.191 | | | |
| (31. Dezember 2020: 5.869.377) | | | |
| 30.625.900.000 | European Bank for Reconstruction & Development 'GMTN' 6.450% 13-Dec-2022 | 2.187.777 | 0,51 |
| 55.190.000.000 | Indonesia Treasury Bond 6.500% 15-Jun-2025 | 4.099.414 | 0,94 |
| Japanischer Yen - 32.154.861 | | | |
| (31. Dezember 2020: 53.863.976) | | | |
| 544.250.000 | Japan Government Ten Year Bond 0.100% 20-Dec-2029 | 4.777.931 | 1,10 |
| 1.722.750.000 | Japan Government Thirty Year Bond 0.500% 20-Sep-2046 | 14.698.521 | 3,38 |
| 381.700.000 | Japan Government Twenty Year Bond 0.400% 20-Mar-2040 | 3.301.065 | 0,76 |
| 515.650.000 | Japan Government Twenty Year Bond 1.000% 20-Dec-2035 | 4.937.398 | 1,14 |
| 493.758.657 | Japanese Government CPI Linked Bond 0.100% 10-Mar-2028 | 4.439.946 | 1,02 |
| Malaysischer Ringgit - 4.323.281 | | | |
| (31. Dezember 2020: 8.432.273) | | | |
| 18.150.000 | Malaysia Government Bond 3.828% 05-Jul-2034 | 4.323.281 | 1,00 |
| Mexikanischer neuer Peso - 6.876.991 | | | |
| (31. Dezember 2020: 9.917.537) | | | |
| 62.750.000 | Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031 | 3.105.684 | 0,71 |
| 72.800.000 | Mexican Bonos 8.500% 31-May-2029 | 3.771.307 | 0,87 |
| Neuseeländischer Dollar - 15.385.929 | | | |
| (31. Dezember 2020: 18.644.966) | | | |
| 3.780.000 | Housing New Zealand Ltd 'MTN' 3.360% 12-Jun-2025 | 2.650.237 | 0,61 |
| 3.170.000 | New Zealand Government Bond 2.750% 15-Apr-2037 | 2.202.898 | 0,51 |
| 5.610.000 | New Zealand Government Inflation Linked Bond 3.000% 20-Sep-2030 | 5.364.038 | 1,23 |
| 3.440.000 | New Zealand Local Government Funding Agency Bond 2.000% 15-Apr-2037 | 1.996.656 | 0,46 |
| 4.640.000 | New Zealand Local Government Funding Agency Bond 2.250% 15-Apr-2024 | 3.172.100 | 0,73 |
| Pfund Sterling - 15.219.250 | | | |
| (31. Dezember 2020: 31.726.584) | | | |
| 1.940.000 | Affordable Housing Finance Plc 'EMTN' 3.800% 20-May-2042 | 3.704.135 | 0,85 |
| 3.800.000 | United Kingdom Gilt 1.500% 31-Jul-2053 | 5.661.239 | 1,30 |
| 1.230.000 | United Kingdom Gilt 4.250% 07-Jun-2032 | 2.191.006 | 0,51 |
| 1.930.000 | United Kingdom Gilt 4.500% 07-Sep-2034 | 3.662.870 | 0,84 |
| Schwedische Krone - 4.140.511 | | | |
| (31. Dezember 2020: 7.263.461) | | | |
| 36.610.000 | European Investment Bank 'EMTN' 1.250% 12-May-2025 | 4.140.511 | 0,95 |
| US-Dollar - 156.754.802 | | | |
| (31. Dezember 2020: 208.191.197) | | | |
| 5.400.000 | Agence Francaise de Developpement EPIC 'EMTN' 0.625% 22-Jan-2026 | 5.269.212 | 1,21 |
| 3.257.000 | Asian Infrastructure Investment Bank/The 0.500% 30-Oct-2024 | 3.214.965 | 0,74 |
| 3.350.000 | Colombia Government International Bond 4.500% 15-Mar-2029 | 3.413.482 | 0,79 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % | Bestände | Beschreibung | Zugrunde liegendes Engagement USD | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % |
|---------------------------------------|--|----------------------------|-----------------------|--|--|-----------------------------------|----------------------------|-----------------------|
| Anleihen Forts. | | | | Offene Terminkontrakte - 231.888 | | | | |
| US-Dollar Forts. | | | | (31. Dezember 2020: (13.115)) | | | | |
| 1.920.000 | Colombia Government International Bond 8.125% 21-May-2024 | 2.185.258 | 0,50 | (82) | Euro-Bund Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (15.905.146) | 231.888 | 0,05 |
| 5.610.000 | European Bank for Reconstruction & Development 'GMTN' FRN 0.164% 11-May-2022 | 5.610.126 | 1,29 | Offene Terminkontrakte insgesamt 231.888 0,05 | | | | |
| 5.300.000 | European Bank for Reconstruction & Development 'GMTN' FRN 0.239% 14-Apr-2026 | 5.306.891 | 1,22 | Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 3.640.448 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 2.166.598) 3.640.448 0,84 | | | | |
| 4.940.000 | European Investment Bank 0.375% 24-Jul-2024 | 4.876.217 | 1,12 | Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt 428.178.417 98,51 | | | | |
| 3.841.000 | Inter-American Development Bank 'GMTN' 3.875% 28-Oct-2041 | 4.886.883 | 1,12 | Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (1.982.261) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (3.033.181)) (1.982.261) (0,46) | | | | |
| 3.948.000 | Inter-American Development Bank 'GMTN' FRN 0.250% 10-Feb-2026 | 3.955.376 | 0,91 | Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt (1.982.261) (0,46) | | | | |
| 4.244.000 | Inter-American Development Bank 'GMTN' FRN 0.320% 20-Mar-2028 | 4.246.651 | 0,98 | Nettoumlaufvermögen 8.486.205 1,95 | | | | |
| 4.430.000 | International Bank for Reconstruction & Development FRN 0.340% 22-Nov-2028 | 4.436.131 | 1,02 | Summe Nettovermögen 434.682.361 100,00 | | | | |
| 4.630.000 | International Bank for Reconstruction & Development FRN 0.480% 19-Aug-2027 | 4.682.432 | 1,08 | Der Kontrahent der Optionen auf Futures und Terminkontrakte (Futures) ist die UBS AG. | | | | |
| 3.328.000 | International Finance Facility for Immunisation Co 'GMTN' 1.000% 21-Apr-2026 | 3.280.310 | 0,75 | Portfolioanalyse % des Gesamtvermögens | | | | |
| 2.722.000 | Kommunalbanken AS 'REGS' FRN 1.050% 17-Jun-2026 | 2.817.190 | 0,65 | An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente 96,54 | | | | |
| 4.590.000 | Kommuninvest I Sverige AB 'REGS' 0.500% 29-Nov-2024 | 4.519.703 | 1,04 | An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente 0,10 | | | | |
| 8.610.000 | Province of British Columbia Canada 2.250% 02-Jun-2026 | 8.964.942 | 2,06 | Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate) 0,83 | | | | |
| 1.495.000 | Qatar Government International Bond 'REGS' 3.400% 16-Apr-2025 | 1.587.899 | 0,37 | Sonstiges Umlaufvermögen 2,53 | | | | |
| 3.929.000 | Republic of Italy Government International Bond 0.875% 06-May-2024 | 3.886.222 | 0,89 | Gesamtvermögen 100,00 | | | | |
| 2.998.000 | Republic of Italy Government International Bond 1.250% 17-Feb-2026 | 2.919.467 | 0,67 | | | | | |
| 4.106.126 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15-Jul-2031 | 4.616.259 | 1,06 | | | | | |
| 3.892.149 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.500% 15-Apr-2024 | 4.151.797 | 0,96 | | | | | |
| 4.263.633 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15-Apr-2023 | 4.460.908 | 1,03 | | | | | |
| 3.466.435 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2.125% 15-Feb-2041 | 5.355.973 | 1,23 | | | | | |
| 5.860.000 | United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Aug-2026 | 5.927.756 | 1,36 | | | | | |
| 7.510.000 | United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Feb-2030 | 7.548.137 | 1,74 | | | | | |
| 4.300.000 | United States Treasury Note/Bond 2.000% 15-Feb-2050 | 4.355.933 | 1,00 | | | | | |
| 14.540.000 | United States Treasury Note/Bond 2.375% 15-May-2029 | 15.505.546 | 3,57 | | | | | |
| 6.741.100 | United States Treasury Note/Bond 2.875% 15-May-2043 | 7.809.670 | 1,80 | | | | | |
| 11.494.400 | United States Treasury Note/Bond 3.000% 15-Nov-2045 | 13.768.584 | 3,17 | | | | | |
| 4.900.000 | United States Treasury Strip Principal (Zero Coupon) 0.000% 15-May-2043 | 3.194.882 | 0,73 | | | | | |
| Gesamtanlagen in Anleihen | | 401.600.662 | 92,39 | | | | | |
| Optionen auf Futures - 196.188 | | | | | | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | | | | | | |
| 289 | U.S. 10 Year Treasury Note Future Call 18-Feb-2022 132.000 | 85.797 | 0,02 | | | | | |
| 157 | U.S. Treasury Bond Future Call 18-Feb-2022 164.000 | 110.391 | 0,03 | | | | | |
| Optionen auf Futures insgesamt | | 196.188 | 0,05 | | | | | |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte

| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|------------------------------------|-------------------------|---------------|----------------|------------------|----------------------------------|-------------------------------------|
| BNY Mellon Global Bond Fund | | | | | | |
| Australischer Dollar | US-Dollar | 5.920.715 | 4.223.598 | 18. Feb. 22 | Canadian Imperial Bank | 69.441 |
| Australischer Dollar | US-Dollar | 2.462.054 | 1.754.883 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 30.323 |
| Tschechische Krone | US-Dollar | 11.260.000 | 507.882 | 18. Feb. 22 | UBS AG | 2.594 |
| Euro | US-Dollar | 5.240.000 | 5.886.978 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 49.254 |
| Malaysischer Ringgit | US-Dollar | 4.911.729 | 1.161.495 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 17.465 |
| Mexikanischer Peso | US-Dollar | 5.586.938 | 263.027 | 18. Feb. 22 | Barclays Bank PLC | 8.175 |
| Neuseeländischer Dollar | US-Dollar | 9.377.618 | 6.344.765 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 57.382 |
| Polnischer Zloty | US-Dollar | 18.030.000 | 4.370.115 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 57.812 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 6.829.658 | 9.179.743 | 18. Feb. 22 | Canadian Imperial Bank | 22.394 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 702.979 | 944.874 | 18. Feb. 22 | Canadian Imperial Bank | 2.305 |
| US-Dollar | Australischer Dollar | 4.822.857 | 6.531.364 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 87.044 |
| US-Dollar | Australischer Dollar | 8.874.779 | 12.046.535 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 139.983 |
| US-Dollar | Kanadischer Dollar | 8.048.947 | 10.034.175 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 171.561 |
| US-Dollar | Kanadischer Dollar | 2.984.197 | 3.800.000 | 18. Feb. 22 | Canadian Imperial Bank | 986 |
| US-Dollar | Dänische Krone | 4.049.150 | 26.038.321 | 18. Feb. 22 | HSBC Bank plc | 82.546 |
| US-Dollar | Euro | 314.028 | 271.705 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 6.222 |
| US-Dollar | Euro | 256.471 | 226.185 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 234 |
| US-Dollar | Euro | 18.884.160 | 16.335.044 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 378.702 |
| US-Dollar | Euro | 519.247 | 448.220 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | 11.473 |
| US-Dollar | Euro | 539.070 | 464.491 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 12.863 |
| US-Dollar | Japanischer Yen | 793.896 | 89.900.000 | 18. Feb. 22 | The Bank of New York Mellon | 12.697 |
| US-Dollar | Japanischer Yen | 2.968.519 | 337.506.073 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 35.712 |
| US-Dollar | Japanischer Yen | 5.804.090 | 660.332.633 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 66.035 |
| US-Dollar | Koreanischer Won | 4.303.704 | 5.096.790.000 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 18.511 |
| US-Dollar | Neuseeländischer Dollar | 1.014.598 | 1.438.061 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | 32.827 |
| US-Dollar | Neuseeländischer Dollar | 573.842 | 812.048 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | 19.453 |
| US-Dollar | Neuseeländischer Dollar | 939.057 | 1.343.005 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | 22.181 |
| US-Dollar | Neuseeländischer Dollar | 21.675.418 | 30.631.265 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | 763.299 |
| US-Dollar | Neuseeländischer Dollar | 496.596 | 708.795 | 18. Feb. 22 | UBS AG | 12.699 |
| US-Dollar | Philippinischer Peso | 6.513.040 | 330.458.639 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 98.282 |
| US-Dollar | Südafrikanischer Rand | 6.259.674 | 96.936.760 | 18. Feb. 22 | Citigroup Global Markets Limited | 220.388 |
| US-Dollar | Schwedische Krone | 14.003.066 | 120.079.650 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | 746.129 |
| USD | | | | | | 3.256.972 |
| Euro | US-Dollar | 5.669.068 | 6.423.536 | 18. Feb. 22 | Canadian Imperial Bank | (1.227) |
| Euro | US-Dollar | 4.276.075 | 4.907.934 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | (63.703) |
| Ungarischer Forint | US-Dollar | 2.179.489.980 | 6.955.430 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (313.981) |
| Japanischer Yen | US-Dollar | 6.601.943.658 | 58.029.332 | 18. Feb. 22 | Canadian Imperial Bank | (660.798) |
| Japanischer Yen | US-Dollar | 743.760.563 | 6.597.330 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (134.316) |
| Koreanischer Won | US-Dollar | 5.096.794.000 | 4.289.870 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (4.674) |
| Neuseeländischer Dollar | US-Dollar | 12.597.746 | 8.897.032 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (296.487) |
| Schwedische Krone | US-Dollar | 34.835.299 | 4.061.867 | 18. Feb. 22 | UBS AG | (216.008) |
| Schwedische Krone | US-Dollar | 57.059.002 | 6.369.778 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (70.395) |
| US-Dollar | Tschechische Krone | 10.625.686 | 234.923.923 | 18. Feb. 22 | HSBC Bank plc | (24.686) |
| US-Dollar | Euro | 429.775 | 379.434 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (74) |
| US-Dollar | Euro | 6.378.087 | 5.850.315 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (22.977) |
| US-Dollar | Euro | 5.631.603 | 4.992.348 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (24.071) |
| US-Dollar | Euro | 267.827 | 236.660 | 18. Feb. 22 | The Bank of New York Mellon | (278) |
| US-Dollar | Euro | 517.946 | 457.496 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (337) |
| US-Dollar | Indische Rupie | 2.259.746 | 169.627.865 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (10.781) |
| US-Dollar | Indonesische Rupiah | 6.504.596 | 93.834.650.000 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (75.840) |
| US-Dollar | Malaysischer Ringgit | 5.521.515 | 23.146.189 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (34.255) |
| US-Dollar | Mexikanischer Peso | 1.351.750 | 28.302.644 | 18. Feb. 22 | Canadian Imperial Bank | (22.120) |
| US-Dollar | Südafrikanischer Rand | 484.294 | 7.790.000 | 18. Feb. 22 | Barclays Bank PLC | (1.033) |

Devisenterminkontrakte Forts.

| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|--|----------------------|------------|------------|------------------|-----------------------------|-------------------------------------|
| BNY Mellon Global Bond Fund Forts. | | | | | | |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 799.522 | 594.964 | 18. Feb. 22 | Canadian Imperial Bank | (2.120) |
| | | | | | | USD |
| | | | | | | (1.980.161) |
| BNY Mellon Global Bond Fund Anteilsklasse AUD I (Acc) (Hedged) | | | | | | |
| Australischer Dollar | US-Dollar | 12.868 | 9.197 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 132 |
| US-Dollar | Australischer Dollar | 50 | 70 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - |
| | | | | | | USD |
| | | | | | | 132 |
| | | | | | | AUD |
| | | | | | | 182 |
| BNY Mellon Global Bond Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged) | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 1.732.003 | 1.957.133 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 3.637 |
| | | | | | | USD |
| | | | | | | 3.637 |
| | | | | | | EUR |
| | | | | | | 3.213 |
| US-Dollar | Euro | 11.616 | 10.264 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (4) |
| | | | | | | USD |
| | | | | | | (4) |
| | | | | | | EUR |
| | | | | | | (4) |
| BNY Mellon Global Bond Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged) | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 677.181 | 765.203 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.422 |
| | | | | | | USD |
| | | | | | | 1.422 |
| | | | | | | EUR |
| | | | | | | 1.256 |
| US-Dollar | Euro | 4.385 | 3.875 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (2) |
| | | | | | | USD |
| | | | | | | (2) |
| | | | | | | EUR |
| | | | | | | (2) |
| BNY Mellon Global Bond Fund Anteilsklasse Sterling Z (Acc) (Hedged) | | | | | | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 18.862 | 25.349 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 69 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 2.216 | 2.946 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 41 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 5.673 | 7.568 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 77 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 9.398 | 12.469 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 196 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 1.518 | 2.013 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 33 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 1.775 | 2.355 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 37 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 6.740 | 8.901 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 181 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 1.389 | 1.863 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 9 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 2.595 | 3.423 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 74 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 2.464.946 | 3.252.046 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 69.640 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 3.107 | 4.174 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 12 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 5.516 | 7.347 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 87 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 1.430 | 1.894 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 32 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 528 | 697 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 14 |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 2.868 | 2.127 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 2 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte Forts.

| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|---|----------------|------------|------------|------------------|-----------------------------|-------------------------------------|
| BNY Mellon Global Bond Fund Anteilsklasse Sterling Z (Acc) (Hedged) Forts. | | | | | | |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 114 | 84 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - |
| | | | | | | USD 70.504 |
| | | | | | | GBP 52.318 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 2.127 | 2.868 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (3) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 18.566 | 13.843 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (88) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 17.928 | 13.380 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (103) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 3.327 | 2.522 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (72) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 25.354 | 18.862 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (64) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 75 | 56 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 52 | 40 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 236 | 179 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (5) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 1.243 | 935 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (17) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 50 | 38 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 222 | 167 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (3) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 159 | 120 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (3) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 346 | 261 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (5) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 110 | 83 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (2) |
| | | | | | | USD (366) |
| | | | | | | GBP (273) |

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

| | | | | | | |
|----------------|----------------|------------|------------|-------------|-----------------------------|--------------------|
| Pfund Sterling | US-Dollar | 43.703 | 58.733 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 161 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 14.945 | 20.088 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 50 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 10.618.534 | 14.009.213 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 299.996 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 54.933 | 73.812 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 214 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 6.583 | 8.768 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 104 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 23.317 | 30.891 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 530 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 117.440 | 155.064 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 3.194 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 34.600 | 45.991 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 635 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 97.656 | 130.276 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.322 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 24.589 | 32.623 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 512 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 9.978 | 13.228 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 218 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 12.024 | 15.955 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 248 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 22.171 | 29.280 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 597 |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 42 | 31 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 6 | 4 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - |
| | | | | | | USD 307.781 |
| | | | | | | GBP 228.392 |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 20.084 | 14.945 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (55) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 58.745 | 43.703 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (148) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 78.424 | 58.530 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (448) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 3.851 | 2.872 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (18) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 44.630 | 33.215 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (129) |

Devisenterminkontrakte Forts.

| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|---|----------------|------------|------------|------------------|-----------------------------|-------------------------------------|
| BNY Mellon Global Bond Fund Anteilsklasse Sterling Z (Inc) (Hedged) Forts. | | | | | | |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 32 | 24 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 24.380 | 18.465 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (502) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 25.792 | 19.455 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (424) |
| | | | | | | USD (1.726) |
| | | | | | | GBP (1.281) |

BNY MELLON GLOBAL CREDIT FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|---|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| Supranational - 850.000 | | | |
| (31. Dezember 2020: 14.546.122) | | 850.000 | 0,19 |
| 850.000 | Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund | 850.000 | 0,19 |
| Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen | | 850.000 | 0,19 |
| Anleihen | | | |
| Australien - 14.575.803 | | | |
| (31. Dezember 2020: 25.999.739) | | 14.575.803 | 3,29 |
| 200.000 | Commonwealth Bank of Australia '144A' FRN 3.610% 12-Sep-2034 | 209.510 | 0,05 |
| 2.063.153 | Liberty Series 2018-3 '2018-3 A2' FRN 1.910% 25-Oct-2050 | 1.509.571 | 0,34 |
| 1.739.000 | Liberty Series 2020-3 '2020-3 B' FRN 2.110% 25-Dec-2051 | 1.280.488 | 0,29 |
| 1.480.000 | Metro Finance 2021-1 Trust '2021-1 C' FRN 1.565% 20-Jun-2027 | 1.078.449 | 0,24 |
| 1.500.000 | Pepper I-Prime 2020-1 Trust '2020-1 B' FRN 2.215% 18-Mar-2052 | 1.109.975 | 0,25 |
| 1.300.000 | Pepper I-Prime 2021-1 Trust '2021-1 C' FRN 2.062% 22-Jan-2053 | 964.469 | 0,22 |
| 81.871 | Pepper Residential Securities Trust NO 18 FRN 2.115% 12-Aug-2058 | 59.767 | 0,01 |
| 1.300.000 | Pepper Residential Securities Trust No. 30 FRN 1.815% 15-Jan-2063 | 945.152 | 0,21 |
| 1.600.000 | Pepper SPARKZ Trust No.3 'SPK-3 C' FRN 1.915% 17-Aug-2028 | 1.171.907 | 0,27 |
| 1.035.000 | RESIMAC Premier Series 2020-1 '2020-1X C' FRN 2.909% 07-Feb-2052 | 781.028 | 0,18 |
| 1.357.000 | Ruby Bond Trust '2021-1 B' FRN 1.515% 12-Mar-2053 | 988.209 | 0,22 |
| 2.846.000 | Santos Finance Ltd 'EMTN' 5.250% 13-Mar-2029 | 3.184.955 | 0,72 |
| 1.770.000 | Solaris Trust 2021-1 '2021-1 B' FRN 2.015% 15-Jun-2052 | 1.292.323 | 0,29 |
| Belgien - 6.609.026 | | 6.609.026 | 1,49 |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 2.161.000 | Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN' 1.500% 18-Apr-2030 | 2.620.386 | 0,59 |
| 900.000 | Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN' 2.875% 02-Apr-2032 | 1.223.655 | 0,28 |
| 2.100.000 | Ethias SA 5.000% 14-Jan-2026 | 2.764.985 | 0,62 |
| Bermudas - 632.604 | | 632.604 | 0,14 |
| (31. Dezember 2020: 825.109) | | | |
| 537.000 | PartnerRe Ireland Finance DAC 1.250% 15-Sep-2026 | 632.604 | 0,14 |
| Brasilien - 4.049.820 | | 4.049.820 | 0,91 |
| (31. Dezember 2020: 6.513.458) | | | |
| 898.000 | Braskem Netherlands Finance BV 'REGS' 4.500% 31-Jan-2030 | 956.576 | 0,21 |
| 1.098.000 | Braskem Netherlands Finance BV 'REGS' 5.875% 31-Jan-2050 | 1.266.988 | 0,29 |
| 3.000.000 | Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2027 | 501.519 | 0,11 |
| 1.143.000 | Suzano Austria GmbH 6.000% 15-Jan-2029 | 1.324.737 | 0,30 |
| Kanada - 5.884.941 | | 5.884.941 | 1,33 |
| (31. Dezember 2020: 3.743.615) | | | |
| 86.280 | Air Canada 2015-1 Class A Pass Through Trust '144A' 3.600% 15-Mar-2027 | 87.134 | 0,02 |
| 2.261.581 | Air Canada 2017-1 Class AA Pass Through Trust '144A' 3.300% 15-Jan-2030 | 2.288.300 | 0,52 |
| 333.107 | Air Canada 2020-2 Class A Pass Through Trust '144A' 5.250% 01-Apr-2029 | 363.361 | 0,08 |
| 100.000 | Bell Telephone Co of Canada or Bell Canada/The 4.300% 29-Jul-2049 | 122.130 | 0,03 |
| 20.000 | Canadian Government Bond 2.000% 01-Dec-2051 | 17.028 | 0,00 |
| 1.478.000 | Canadian Pacific Railway Co 3.100% 02-Dec-2051 | 1.516.375 | 0,34 |
| 1.487.000 | Parkland Corp '144A' 4.500% 01-Oct-2029 | 1.490.613 | 0,34 |
| China - 435.404 | | 435.404 | 0,10 |
| (31. Dezember 2020: 3.775.658) | | | |
| 464.000 | Prosus NV 'REGS' 3.832% 08-Feb-2051 | 435.404 | 0,10 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|--|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Kolumbien - 3.500.435 | | | |
| (31. Dezember 2020: 12.384.618) | | 3.500.435 | 0,79 |
| 805.000 | Colombia Government International Bond 5.200% 15-May-2049 | 742.403 | 0,17 |
| 2.614.000 | Ecopetrol SA 5.375% 26-Jun-2026 | 2.758.032 | 0,62 |
| Elfenbeinküste - 1.178.788 | | 1.178.788 | 0,27 |
| (31. Dezember 2020: 1.786.726) | | | |
| 1.073.000 | Ivory Coast Government International Bond 'REGS' 4.875% 30-Jan-2032 | 1.178.788 | 0,27 |
| Dänemark - 7.891.720 | | 7.891.720 | 1,78 |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 2.643.000 | Carlsberg Breweries AS 'EMTN' 2.500% 28-May-2024 | 3.173.575 | 0,72 |
| 4.139.000 | Danske Bank A/S 'EMTN' FRN 0.010% 10-Nov-2024 | 4.718.145 | 1,06 |
| Ägypten - 600.327 | | 600.327 | 0,14 |
| (31. Dezember 2020: 3.273.922) | | | |
| 650.000 | Egypt Government International Bond 'REGS' 7.300% 30-Sep-2033 | 600.327 | 0,14 |
| Frankreich - 15.012.873 | | 15.012.873 | 3,39 |
| (31. Dezember 2020: 59.428.253) | | | |
| 2.646.000 | Airbus SE 'EMTN' 2.375% 09-Jun-2040 | 3.385.648 | 0,77 |
| 200.000 | Danone SA 'EMTN' 1.125% 14-Jan-2025 | 234.978 | 0,05 |
| 1.100.000 | Electricite de France SA 'EMTN' 2.000% 09-Dec-2049 | 1.338.965 | 0,30 |
| 200.000 | Electricite de France SA FRN (Perpetual) 2.875% 15-Dec-2026 | 234.032 | 0,05 |
| 3.100.000 | Orano SA 'EMTN' 2.750% 08-Mar-2028 | 3.683.762 | 0,83 |
| 100.000 | Orano SA 'EMTN' 3.375% 23-Apr-2026 | 122.274 | 0,03 |
| 179.000 | PSA Tresorerie GIE 6.000% 19-Sep-2033 | 296.185 | 0,07 |
| 3.100.000 | Thales SA 'EMTN' 0.875% 19-Apr-2024 | 3.599.305 | 0,81 |
| 1.966.000 | WEA Finance LLC '144A' 4.625% 20-Sep-2048 | 2.117.724 | 0,48 |
| Deutschland - 22.950.045 | | 22.950.045 | 5,18 |
| (31. Dezember 2020: 84.335.975) | | | |
| 419.324 | Bundesobligation 0.000% 10-Oct-2025 | 487.311 | 0,11 |
| 4.225.054 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15-Aug-2030 | 4.919.709 | 1,11 |
| 160.000 | Daimler AG 'EMTN' 1.875% 08-Jul-2024 | 191.436 | 0,04 |
| 3.208.000 | Daimler International Finance BV 'EMTN' 0.250% 06-Nov-2023 | 3.680.029 | 0,83 |
| 3.900.000 | Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0.250% 25-Apr-2023 | 3.885.103 | 0,88 |
| 3.703.000 | Volkswagen Leasing GmbH 'EMTN' 0.000% 19-Jul-2024 | 4.206.172 | 0,95 |
| 3.200.000 | Vonovia Finance BV 0.750% 15-Jan-2024 | 3.701.169 | 0,84 |
| 400.000 | Vonovia SE 1.000% 16-Jun-2033 | 446.493 | 0,10 |
| 1.300.000 | Vonovia SE 1.500% 14-Jun-2041 | 1.432.623 | 0,32 |
| Ghana - 1.323.960 | | 1.323.960 | 0,30 |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 1.100.000 | Ghana Government International Bond 'REGS' 8.125% 18-Jan-2026 | 1.018.875 | 0,23 |
| 374.000 | Ghana Government International Bond 'REGS' 8.625% 07-Apr-2034 | 305.085 | 0,07 |
| Ungarn - 144.040 | | 144.040 | 0,03 |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 130.000 | Hungary Government International Bond 'REGS' 0.125% 21-Sep-2028 | 144.040 | 0,03 |
| Indonesien - 4.001.053 | | 4.001.053 | 0,90 |
| (31. Dezember 2020: 3.560.498) | | | |
| 200.000 | Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT 3.541% 27-Apr-2032 | 201.864 | 0,05 |
| 1.172.000 | Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT 4.745% 09-Jun-2051 | 1.207.162 | 0,27 |
| 2.018.000 | Indonesia Government International Bond 'REGS' 5.250% 08-Jan-2047 | 2.592.027 | 0,58 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|--|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Irland - 15.193.452 | | | |
| (31. Dezember 2020: 21.971.025) | | 15.193.452 | 3,43 |
| 295.816 | Arrow CMBS 2018 DAC '2018-1 C' FRN 2.050% 22-May-2030 | 337.184 | 0,08 |
| 642.733 | European Loan Conduit No 37 DAC FRN 1.728% 02-May-2030 | 869.847 | 0,20 |
| 526.024 | European Loan Conduit No 37 DAC FRN 2.478% 02-May-2030 | 710.284 | 0,16 |
| 1.024.554 | European Residential Loan Securitisation 2019-NPL2 DAC '2019-NPL2 A' FRN 0.857% 24-Feb-2058 | 1.160.226 | 0,26 |
| 275.942 | Last Mile Securities PE 2021 DAC '2021-1X C' FRN 1.600% 17-Aug-2031 | 315.822 | 0,07 |
| 100.000 | Portman Square 2021-NPL1 DAC '2021-NPL1X A' FRN 1.433% 25-Oct-2061 | 112.825 | 0,03 |
| 438.816 | Retiro Mortgage Securities DAC FRN 1.444% 30-Jul-2075 | 497.627 | 0,11 |
| 838.000 | Richmond Park CLO 1 DAC FRN 1.500% 14-Jul-2031 | 951.557 | 0,21 |
| 3.198.000 | Shamrock Residential 2021-1 DAC '2021-1 B' FRN 0.757% 24-Dec-2059 | 3.661.058 | 0,83 |
| 325.608 | Taurus 2021-1 UK DAC '2021-UK1X C' FRN 1.700% 17-May-2031 | 440.866 | 0,10 |
| 605.000 | Taurus 2021-3 DEU DAC '2021-DE3 B' FRN 1.800% 22-Dec-2030 | 687.960 | 0,15 |
| 1.640.419 | Taurus 2021-4 UK DAC '2021-UK4X C' FRN 1.800% 17-Aug-2031 | 2.208.524 | 0,50 |
| 348.000 | Toro European CLO 4 DAC FRN 2.100% 15-Jul-2030 | 395.725 | 0,09 |
| 2.101.000 | Viridis European Loan Conduit No 38 DAC FRN 1.251% 22-Jul-2029 | 2.843.947 | 0,64 |
| Italien - 9.305.892 | | | |
| (31. Dezember 2020: 8.681.226) | | 9.305.892 | 2,10 |
| 4.019.000 | FCA Bank SpA/Ireland 'EMTN' 0.500% 13-Sep-2024 | 4.617.546 | 1,04 |
| 4.124.000 | Leasys SpA 0.000% 22-Jul-2024 | 4.688.346 | 1,06 |
| Japan - 15.378.474 | | | |
| (31. Dezember 2020: 17.645.532) | | 15.378.474 | 3,47 |
| 3.916.000 | Asahi Group Holdings Ltd 0.010% 19-Apr-2024 | 4.462.627 | 1,01 |
| 63.250.000 | Japan Government Twenty Year Bond 0.400% 20-Sep-2040 | 545.327 | 0,12 |
| 4.200.000 | Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 2.696% 16-Jul-2024 | 4.340.713 | 0,98 |
| 1.810.000 | Takeda Pharmaceutical Co Ltd 3.175% 09-Jul-2050 | 1.836.654 | 0,41 |
| 3.961.000 | Takeda Pharmaceutical Co Ltd 4.400% 26-Nov-2023 | 4.193.153 | 0,95 |
| Mexiko - 3.791.442 | | | |
| (31. Dezember 2020: 18.906.494) | | 3.791.442 | 0,86 |
| 200.000 | Mexico Government International Bond 3.250% 16-Apr-2030 | 205.506 | 0,05 |
| 1.663.000 | Mexico Government International Bond 5.000% 27-Apr-2051 | 1.893.442 | 0,43 |
| 3.100.000 | Orbia Advance Corp SAB de CV 'REGS' 5.875% 17-Sep-2044 | 1.692.494 | 0,38 |
| Niederlande - 12.286.106 | | | |
| (31. Dezember 2020: 10.212.496) | | 12.286.106 | 2,77 |
| 200.000 | ABN AMRO Bank NV 'EMTN' 0.500% 15-Apr-2026 | 231.621 | 0,05 |
| 3.397.000 | Athora Netherlands NV FRN 2.250% 15-Jul-2031 | 3.865.554 | 0,87 |
| 3.100.000 | de Volksbank NV 'EMTN' 0.010% 16-Sep-2024 | 3.544.004 | 0,80 |
| 3.958.000 | LeasePlan Corp NV 'EMTN' 1.375% 07-Mar-2024 | 4.644.927 | 1,05 |
| Peru - 3.267.184 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | 3.267.184 | 0,74 |
| 1.120.000 | Consorcio Transmataro SA 'REGS' 4.700% 16-Apr-2034 | 1.232.218 | 0,28 |
| 1.947.000 | Petroleos del Peru SA 'REGS' 4.750% 19-Jun-2032 | 2.034.966 | 0,46 |
| Republik Serbien - 1.304.964 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | 1.304.964 | 0,30 |
| 1.250.000 | Serbia International Bond 'REGS' 2.050% 23-Sep-2036 | 1.304.964 | 0,30 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|---|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Rumänien - 1.507.094 | | | |
| (31. Dezember 2020: 2.413.869) | | 1.507.094 | 0,34 |
| 1.423.000 | Romanian Government International Bond 'REGS' 2.000% 28-Jan-2032 | 1.507.094 | 0,34 |
| Spanien - 5.279.250 | | | |
| (31. Dezember 2020: 15.652.616) | | 5.279.250 | 1,19 |
| 1.800.000 | Banco de Credito Social Cooperativo SA 'EMTN' FRN 5.250% 27-Nov-2031 | 2.133.006 | 0,48 |
| 2.712.000 | Lorca Telecom Bondcoo SA 'REGS' 4.000% 18-Sep-2027 | 3.146.244 | 0,71 |
| Supranational - 3.677.751 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | 3.677.751 | 0,83 |
| 3.700.000 | International Bank for Reconstruction & Development 0.125% 20-Apr-2023 | 3.677.751 | 0,83 |
| Schweden - 3.841.160 | | | |
| (31. Dezember 2020: 6.759.863) | | 3.841.160 | 0,87 |
| 1.435.000 | Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB 'EMTN' 1.000% 12-Aug-2027 | 1.619.481 | 0,37 |
| 2.017.000 | SBB Treasury Oyj 'EMTN' 1.125% 26-Nov-2029 | 2.221.679 | 0,50 |
| Schweiz - 16.576.140 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | 16.576.140 | 3,74 |
| 2.011.000 | Credit Suisse Group AG '144A' 4.282% 09-Jan-2028 | 2.185.829 | 0,49 |
| 2.173.000 | Credit Suisse Group AG 'EMTN' FRN 0.650% 14-Jan-2028 | 2.452.981 | 0,56 |
| 906.000 | Credit Suisse Group AG 'REGS' FRN 3.091% 14-May-2032 | 923.888 | 0,21 |
| 250.000 | Credit Suisse Group AG 'REGS' FRN 4.194% 01-Apr-2031 | 276.273 | 0,06 |
| 4.802.000 | Roche Holdings Inc '144A' 2.076% 13-Dec-2031 | 4.798.644 | 1,08 |
| 2.295.000 | Roche Holdings Inc '144A' 2.607% 13-Dec-2051 | 2.252.489 | 0,51 |
| 3.231.000 | UBS Group AG 'EMTN' FRN 0.250% 29-Jan-2026 | 3.686.036 | 0,83 |
| Tunesien - 373.898 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.918.920) | | 373.898 | 0,08 |
| 430.000 | Banque Centrale de Tunisie International Bond 'REGS' 6.375% 15-Jul-2026 | 373.898 | 0,08 |
| Vereinigte Arabische Emirate - 1.578.811 | | | |
| (31. Dezember 2020: 3.585.351) | | 1.578.811 | 0,36 |
| 1.120.000 | DP World Ltd/United Arab Emirates 'REGS' 5.625% 25-Sep-2048 | 1.379.282 | 0,31 |
| 200.000 | Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd 'REGS' 2.940% 30-Sep-2040 | 199.529 | 0,05 |
| Vereinigtes Königreich - 66.693.139 | | | |
| (31. Dezember 2020: 65.573.357) | | 66.693.139 | 15,06 |
| 1.056.000 | AA Bond Co Ltd 'EMTN' 3.250% 31-Jul-2028 | 1.419.672 | 0,32 |
| 2.102.000 | AA Bond Co Ltd 'EMTN' 4.875% 31-Jul-2024 | 2.992.114 | 0,68 |
| 884.492 | Alba 2007-1 Plc '2007-1 B' FRN 0.462% 17-Mar-2039 | 1.125.057 | 0,25 |
| 620.000 | Atlas Funding 2021-1 PLC '2021-1 B' FRN 1.550% 25-Jul-2058 | 842.673 | 0,19 |
| 800.000 | BAT Capital Corp 5.282% 02-Apr-2050 | 910.699 | 0,21 |
| 2.350.000 | Bellis Acquisition Co Plc 'REGS' 4.500% 16-Feb-2026 | 3.185.520 | 0,72 |
| 1.731.000 | BP Capital Markets Plc FRN (Perpetual) 3.625% 22-Mar-2029 | 2.123.029 | 0,48 |
| 597.978 | British Airways 2018-1 Class AA Pass Through Trust '144A' 3.800% 20-Sep-2031 | 621.493 | 0,14 |
| 298.004 | British Airways 2020-1 Class A Pass Through Trust '144A' 4.250% 15-Nov-2032 | 316.461 | 0,07 |
| 1.849.000 | British American Tobacco Plc FRN (Perpetual) 3.000% 27-Sep-2026 | 2.065.639 | 0,47 |
| 715.000 | British American Tobacco Plc FRN (Perpetual) 3.750% 27-Jun-2029 | 797.939 | 0,18 |
| 963.840 | Canada Square Funding 2019-1 Plc '2019-1 A' FRN 1.150% 17-Oct-2051 | 1.307.588 | 0,29 |
| 526.000 | Canada Square Funding 2021-2 Plc '2021-2 C' FRN 1.649% 17-Jun-2058 | 712.497 | 0,16 |
| 738.000 | Castell 2020-1 Plc '2020-1 C' FRN 2.471% 25-Mar-2053 | 1.011.847 | 0,23 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % |
|--|--|----------------------------|-----------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Vereinigtes Königreich Forts. | | | |
| 2.542.000 | Channel Link Enterprises Finance Plc FRN 1.761% 30-Jun-2050 | 2.893.983 | 0,65 |
| 381.000 | CK Hutchison Europe Finance 18 Ltd 2.000% 13-Apr-2030 | 470.574 | 0,11 |
| 3.412.000 | Hammerson Ireland Finance DAC 1.750% 03-Jun-2027 | 3.826.025 | 0,86 |
| 2.155.000 | Hastings Group Finance Plc 3.000% 24-May-2025 | 3.071.045 | 0,69 |
| 1.123.000 | Hawksmoor Mortgage Funding 2019-1 Plc '2019-1X B' FRN 1.800% 25-May-2053 | 1.529.611 | 0,35 |
| 3.295.000 | HSBC Holdings Plc FRN 3.000% 22-Jul-2028 | 4.666.303 | 1,05 |
| 1.962.000 | Imperial Brands Finance Plc 'EMTN' 2.125% 12-Feb-2027 | 2.347.412 | 0,53 |
| 200.000 | LSEGA Financing Plc '144A' 3.200% 06-Apr-2041 | 209.735 | 0,05 |
| 200.000 | NatWest Markets Plc '144A' 0.800% 12-Aug-2024 | 196.849 | 0,04 |
| 678.000 | Newday Funding Master Issuer Plc - Series 2021-2 '2021-2X C' FRN 1.696% 15-Jul-2029 | 917.153 | 0,21 |
| 826.000 | Newday Partnership Funding 2020-1 Plc '2020-1X B' FRN 2.300% 15-Nov-2028 | 1.123.570 | 0,25 |
| 3.164.000 | Prudential Plc 'EMTN' FRN 2.950% 03-Nov-2033 | 3.139.827 | 0,71 |
| 2.584.000 | RAC Bond Co Plc 'EMTN' 4.870% 06-May-2026 | 3.792.981 | 0,86 |
| 114.808 | Ribbon Finance 2018 Plc '2018-1 D' FRN 1.961% 20-Apr-2028 | 153.320 | 0,03 |
| 756.000 | Ripon Mortgages Plc FRN 1.614% 20-Aug-2056 | 1.024.340 | 0,23 |
| 925.000 | Ripon Mortgages Plc FRN 1.614% 20-Aug-2056 | 1.253.406 | 0,28 |
| 378.000 | Salus European Loan Conduit NO 33 DAC FRN 2.804% 23-Jan-2029 | 511.267 | 0,12 |
| 1.753.000 | Stratton Mortgage Funding 2019-1 Plc '2019-1 D' FRN 2.550% 25-May-2051 | 2.375.715 | 0,54 |
| 2.042.593 | Towd Point Mortgage Funding 2019-Auburn 13 Plc '2019-A13X A1' FRN 0.950% 20-Jul-2045 | 2.769.606 | 0,62 |
| 642.997 | Tower Bridge Funding 2021-2 PLC '2021-2 C' FRN 1.550% 20-Nov-2063 | 876.341 | 0,20 |
| 2.743.000 | United Kingdom Gilt 0.375% 22-Oct-2030 | 3.545.195 | 0,80 |
| 643.000 | United Kingdom Gilt 1.250% 22-Oct-2041 | 878.775 | 0,20 |
| 2.048.000 | Utmost Group Plc 4.000% 15-Dec-2031 | 2.771.961 | 0,63 |
| 2.169.000 | Virgin Media Secured Finance Plc 'REGS' 4.250% 15-Jan-2030 | 2.915.917 | 0,66 |
| Vereinigte Staaten von Amerika - 183.035.456 (31. Dezember 2020: 358.029.952) | | | |
| | | 183.035.456 | 41,32 |
| 1.605.000 | 7-Eleven Inc '144A' 1.800% 10-Feb-2031 | 1.522.236 | 0,34 |
| 200.000 | 7-Eleven Inc 'REGS' 1.800% 10-Feb-2031 | 189.687 | 0,04 |
| 200.000 | AbbVie Inc 4.050% 21-Nov-2039 | 230.996 | 0,05 |
| 2.522.000 | American International Group Inc 3.750% 10-Jul-2025 | 2.701.893 | 0,61 |
| 59.000 | Analog Devices Inc 2.950% 01-Oct-2051 | 60.992 | 0,01 |
| 2.122.000 | AT&T Inc 3.300% 01-Feb-2052 | 2.092.151 | 0,47 |
| 200.000 | AT&T Inc 3.500% 01-Jun-2041 | 206.551 | 0,05 |
| 1.329.000 | AT&T Inc 4.500% 09-Mar-2048 | 1.558.501 | 0,35 |
| 200.000 | Avangrid Inc 3.800% 01-Jun-2029 | 217.849 | 0,05 |
| 3.900.000 | Bank of America Corp FRN 2.299% 21-Jul-2032 | 3.843.191 | 0,87 |
| 3.630.000 | Bank of America Corp 'MTN' FRN 2.496% 13-Feb-2031 | 3.646.734 | 0,82 |
| 300.000 | Bank of America Corp 'MTN' FRN 4.271% 23-Jul-2029 | 334.963 | 0,08 |
| 1.995.000 | Boeing Co/The 4.875% 01-May-2025 | 2.185.237 | 0,49 |
| 2.387.000 | Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 3.700% 01-Apr-2051 | 2.322.327 | 0,53 |
| 4.400.000 | Chubb INA Holdings Inc 0.300% 15-Dec-2024 | 5.044.952 | 1,14 |
| 2.010.000 | Cigna Corp 3.400% 15-Mar-2051 | 2.114.712 | 0,48 |
| 100.000 | Citigroup Inc FRN 5.316% 26-Mar-2041 | 132.739 | 0,03 |
| 100.000 | Commonwealth Edison Co 4.000% 01-Mar-2049 | 119.413 | 0,03 |
| 2.887.000 | Consolidated Edison Co of New York Inc 3.950% 01-Apr-2050 | 3.319.144 | 0,75 |
| 100.000 | Crown Castle International Corp 3.250% 15-Jan-2051 | 98.927 | 0,02 |
| 3.927.000 | Danaher Corp 1.700% 30-Mar-2024 | 4.646.233 | 1,05 |
| 293.000 | Dell International LLC / EMC Corp 8.350% 15-Jul-2046 | 489.493 | 0,11 |
| 942.000 | Dell International LLC / EMC Corp '144A' 3.375% 15-Dec-2041 | 936.427 | 0,21 |
| 2.825.000 | Digital Euro Finco LLC 1.125% 09-Apr-2028 | 3.266.842 | 0,74 |
| 4.000.000 | Duke Energy Corp 3.400% 15-Jun-2029 | 4.250.267 | 0,96 |
| 779.000 | Eli Lilly & Co 1.375% 14-Sep-2061 | 811.631 | 0,18 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % |
|--|---|----------------------------|-----------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika Forts. | | | |
| 1.829.000 | Energy Transfer LP 6.250% 15-Apr-2049 | 2.400.948 | 0,54 |
| 4.900.000 | Entergy Corp 2.800% 15-Jun-2030 | 4.997.435 | 1,13 |
| 300.000 | Eversource Energy 2.550% 15-Mar-2031 | 301.608 | 0,07 |
| 4.500.000 | Exelon Corp 4.050% 15-Apr-2030 | 5.009.843 | 1,13 |
| 3.437.000 | FedEx Corp 4.250% 15-May-2030 | 3.916.182 | 0,88 |
| 4.005.000 | Fidelity National Information Services Inc 1.100% 15-Jul-2024 | 4.665.806 | 1,05 |
| 1.282.000 | FirstEnergy Transmission LLC '144A' 4.550% 01-Apr-2049 | 1.472.099 | 0,33 |
| 480.000 | FirstEnergy Transmission LLC '144A' 5.450% 15-Jul-2044 | 608.782 | 0,14 |
| 100.000 | General Motors Co 5.950% 01-Apr-2049 | 137.632 | 0,03 |
| 4.828.000 | Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 0.750% 23-Mar-2032 | 5.318.782 | 1,20 |
| 5.482.000 | JPMorgan Chase & Co FRN 2.522% 22-Apr-2031 | 5.552.475 | 1,25 |
| 300.000 | JPMorgan Chase & Co FRN 3.702% 06-May-2030 | 328.459 | 0,07 |
| 3.107.000 | Kraft Heinz Foods Co 4.125% 01-Jul-2027 | 4.622.801 | 1,04 |
| 3.132.000 | Kyndryl Holdings Inc '144A' 3.150% 15-Oct-2031 | 3.044.835 | 0,69 |
| 17.000 | Lowe's Cos Inc 1.700% 15-Sep-2028 | 16.686 | 0,00 |
| 15.000 | Lowe's Cos Inc 2.800% 15-Sep-2041 | 14.712 | 0,00 |
| 150.000 | Lowe's Cos Inc 3.650% 05-Apr-2029 | 164.740 | 0,04 |
| 2.252.000 | Marathon Petroleum Corp 5.125% 15-Dec-2026 | 2.566.024 | 0,58 |
| 4.400.000 | McDonald's Corp 'GMTN' 0.625% 29-Jan-2024 | 5.089.915 | 1,15 |
| 100.000 | McDonald's Corp 'MTN' 4.200% 01-Apr-2050 | 121.799 | 0,03 |
| 1.856.000 | Meritage Homes Corp '144A' 3.875% 15-Apr-2029 | 1.951.463 | 0,44 |
| 4.375.000 | Morgan Stanley FRN 1.102% 29-Apr-2033 | 4.988.942 | 1,13 |
| 300.000 | Morgan Stanley FRN 3.591% 22-Jul-2028 | 323.887 | 0,07 |
| 1.724.000 | MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 2.500% 24-Mar-2026 | 2.329.730 | 0,53 |
| 465.000 | MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 3.692% 05-Jun-2028 | 659.059 | 0,15 |
| 100.000 | Oncor Electric Delivery Co LLC 3.700% 15-May-2050 | 115.845 | 0,03 |
| 1.042.000 | ONEOK Inc 7.150% 15-Jan-2051 | 1.511.530 | 0,34 |
| 2.957.000 | Oracle Corp 3.600% 01-Apr-2050 | 2.911.357 | 0,66 |
| 1.897.000 | Phillips 66 3.300% 15-Mar-2052 | 1.905.806 | 0,43 |
| 3.753.000 | Prudential Financial Inc FRN 5.625% 15-Jun-2043 | 3.906.201 | 0,88 |
| 220.000 | Schlumberger Holdings Corp '144A' 3.900% 17-May-2028 | 238.012 | 0,05 |
| 2.851.000 | Southern Co/The FRN 1.875% 15-Sep-2081 | 3.153.359 | 0,71 |
| 1.378.000 | Stellantis Finance US Inc '144A' 2.691% 15-Sep-2031 | 1.358.148 | 0,31 |
| 245.000 | Stryker Corp 2.625% 30-Nov-2030 | 321.133 | 0,07 |
| 1.951.000 | Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp '144A' 4.000% 15-Jan-2032 | 2.042.170 | 0,46 |
| 1.185.000 | Thermo Fisher Scientific Inc 0.750% 12-Sep-2024 | 1.376.100 | 0,31 |
| 2.100.000 | Travelers Cos Inc/The 3.050% 08-Jun-2051 | 2.208.278 | 0,50 |
| 786.600 | United States Treasury Note/Bond 0.125% 30-Jun-2022 | 786.312 | 0,18 |
| 385.100 | United States Treasury Note/Bond 0.125% 30-Nov-2022 | 384.245 | 0,09 |
| 3.502.000 | United States Treasury Note/Bond 0.250% 31-May-2025 | 3.408.157 | 0,77 |
| 2.505.400 | United States Treasury Note/Bond 0.375% 30-Nov-2025 | 2.431.217 | 0,55 |
| 27.810.000 | United States Treasury Note/Bond 0.750% 31-May-2026 | 27.257.059 | 6,15 |
| 8.032.400 | United States Treasury Note/Bond 1.125% 15-May-2040 | 7.065.061 | 1,60 |
| 3.075.200 | United States Treasury Note/Bond 2.750% 15-Feb-2028- | 3.326.982 | 0,75 |
| 5.900.000 | Verizon Communications Inc 2.550% 21-Mar-2031 | 5.965.249 | 1,35 |
| 200.000 | Verizon Communications Inc 3.400% 22-Mar-2041 | 210.341 | 0,05 |
| 1.591.000 | WP Carey Inc 2.450% 01-Feb-2032 | 1.555.788 | 0,35 |
| 950.000 | WPC Eurobond BV 0.950% 01-Jun-2030 | 1.048.695 | 0,24 |
| 1.383.000 | WPC Eurobond BV 1.350% 15-Apr-2028 | 1.599.679 | 0,36 |
| Gesamtanlagen in Anleihen | | 431.881.052 | 97,50 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Nettovermögen % | Summe |
|---|---|----------------------------|-----------------|-------|
| Credit Default Swaps - 5.740.006 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 10.996.179) | | | | |
| (1.750.000) | CDS Altice France SA 5.000% 20-Dec-2026 | 132.408 | 0,03 | |
| (4.156.000) | CDS CDX North America Investment Grade Index Series 37 Version 1 1.000% 20-Dec-2026 | 101.524 | 0,02 | |
| (89.132.000) | CDS CDX North America Investment Grade Index Series 37 Version 1 1.000% 20-Dec-2026 | 2.177.336 | 0,49 | |
| (116.800.000) | CDS iTraxx Europe Senior Financials Series 32 Version 1 1.000% 20-Dec-2026 | 2.981.693 | 0,67 | |
| (850.000) | CDS OI European Group BV 5.000% 20-Dec-2026 | 95.978 | 0,02 | |
| (1.650.000) | CDS Ziggo Bond Co BV 5.000% 20-Dec-2026 | 236.720 | 0,06 | |
| (100.000) | CDS Ziggo Bond Co BV 5.000% 20-Dec-2026 | 14.347 | 0,01 | |

Credit Default Swaps insgesamt 5.740.006 1,30

| | | | | |
|-------------------------------------|--|--------|------|--|
| Währungsoptionen - 51.384 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 124.597) | | | | |
| 1.200.000 | Euro/Chinese yuan Put 11-Feb-2022 7.380 | 24.727 | 0,01 | |
| 1.600.000 | US dollar/Euro Call 17-Jan-2022 1.123 | 1.004 | 0,00 | |
| 1.600.000 | US dollar/Euro Put 17-Jan-2022 1.132 | 12.168 | 0,00 | |
| 1.600.000 | US dollar/Euro Put 21-Jan-2022 1.138 | 8.811 | 0,00 | |
| 1.400.000 | US dollar/Norwegian krone Call 04-Jan-2022 9.190 | 4 | 0,00 | |
| 1.400.000 | US dollar/Norwegian krone Put 04-Jan-2022 8.650 | 110 | 0,00 | |
| 1.400.000 | US dollar/Norwegian krone Put 04-Jan-2022 8.800 | 4.560 | 0,00 | |

Währungsoptionen insgesamt 51.384 0,01

| | | | | |
|---------------------------------------|---|-------|------|--|
| Swaptions - 3.076 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.796.724) | | | | |
| 116.800.000 | iTraxx Europe Senior Financials Index Series 36 Version 1 Put 16-Mar-2022 1.100 | 3.076 | 0,00 | |

Swaptions insgesamt 3.076 0,00

| Bestände | Beschreibung | Zugrunde liegendes Engagement USD | Beizulegender Zeitwert USD | Nettovermögen % | Summe |
|---|--|-----------------------------------|----------------------------|-----------------|-------|
| Offene Terminkontrakte - 554.831 | | | | | |
| (31. Dezember 2020: 235.371) | | | | | |
| 82 | Canadian 10 Year Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2022 | 9.245.298 | 235.082 | 0,05 | |
| (27) | Euro-OAT Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (5.015.153) | 72.210 | 0,02 | |
| (388) | Euro-Schatz Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (49.487.948) | 51.378 | 0,01 | |
| 59 | SFE 10 Year Australian Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2022 | 5.973.823 | 688 | 0,00 | |
| (50) | U.S. 10 Year Ultra Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (7.321.875) | 35.133 | 0,01 | |
| 27 | U.S. 5 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2022 | 3.266.367 | 2.698 | 0,00 | |
| 206 | U.S. Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2022 | 33.050.125 | 60.292 | 0,02 | |
| (77) | UK Long Gilt Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (13.017.505) | 97.350 | 0,02 | |

Offene Terminkontrakte insgesamt 554.831 0,13

Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 1.515.790 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 2.463.873) 1.515.790 0,34

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt 440.596.139 99,47

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Nettovermögen % | Summe |
|---|---------------------------------------|----------------------------|-----------------|-------|
| Credit Default Swaps - (4.948.648) | | | | |
| (31. Dezember 2020: (6.839.835)) | | | | |
| 1.570.000 | CDS Anglo American 5.000% 20-Dec-2026 | (344.865) | (0,08) | |
| 1.283.000 | CDS Borgwarner Inc 1.000% 20-Dec-2026 | (22.623) | (0,01) | |
| 1.750.000 | CDS Borgwarner Inc 1.000% 20-Dec-2026 | (30.441) | (0,01) | |
| 83.000 | CDS Borgwarner Inc 1.000% 20-Dec-2026 | (1.444) | (0,00) | |
| 61.000 | CDS Borgwarner Inc 1.000% 20-Dec-2026 | (1.076) | (0,00) | |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Nettovermögen % | Summe |
|------------------------------------|---|----------------------------|-----------------|-------|
| Credit Default Swaps Forts. | | | | |
| 1.167.000 | CDS Borgwarner Inc 1.000% 20-Dec-2026 | (20.578) | (0,00) | |
| 56.000 | CDS Borgwarner Inc 1.000% 20-Dec-2026 | (987) | (0,00) | |
| 77.500.000 | CDS CDX North America Investment Grade Index Series 36 Version 1 1.000% 20-Dec-2026 | (1.978.435) | (0,45) | |
| 1.570.000 | CDS Glencore Finance Europe SA 5.000% 20-Dec-2026 | (334.018) | (0,08) | |
| 1.570.000 | CDS Heidelbergcement AG 5.000% 20-Dec-2026 | (366.037) | (0,08) | |
| 1.570.000 | CDS Holcim Ltd 1.000% 20-Dec-2026 | (24.167) | (0,01) | |
| 22.800.000 | CDS iTraxx Europe Crossover Series 32 Version 1 1.000% 20-Dec-2026 | (676.274) | (0,15) | |
| 5.800.000 | CDS iTraxx Europe Crossover Series 36 Version 1 Index 5.000% 20-Dec-2026 | (782.806) | (0,18) | |
| 100.000 | CDS iTraxx Europe Crossover Series 36 Version 1 Index 5.000% 20-Dec-2026 | (13.497) | (0,00) | |
| 2.300.000 | CDS iTraxx Europe Series 36 Version 1 Index 1.000% 20-Dec-2026 | (68.221) | (0,02) | |
| 650.000 | CDS Jaguar Land Rover Automotive Plc 5.000% 20-Dec-2026 | (43.607) | (0,01) | |
| 1.100.000 | CDS Jaguar Land Rover Automotive Plc 5.000% 20-Dec-2026 | (73.796) | (0,02) | |
| (1.750.000) | CDS Ladbrokes Coral Group Limited 1.000% 20-Dec-2026 | (63.142) | (0,01) | |
| (1.500.000) | CDS Ladbrokes Coral Group Limited 1.000% 20-Dec-2026 | (54.122) | (0,01) | |
| (17.000) | CDS Newell Brands Inc 1.000% 20-Dec-2026 | (92) | (0,00) | |
| (367.000) | CDS Newell Brands Inc 1.000% 20-Dec-2026 | (1.978) | (0,00) | |
| 410.000 | CDS Pearson Plc 1.000% 20-Dec-2026 | (5.535) | (0,00) | |
| 800.000 | CDS Pearson Plc 1.000% 20-Dec-2026 | (10.801) | (0,00) | |
| 780.000 | CDS Pearson Plc 1.000% 20-Dec-2026 | (10.530) | (0,00) | |
| 50.000 | CDS Pearson Plc 1.000% 20-Dec-2026 | (675) | (0,00) | |
| 800.000 | CDS Pearson Plc 1.000% 20-Dec-2026 | (10.801) | (0,00) | |
| 50.000 | CDS Pearson Plc 1.000% 20-Dec-2026 | (675) | (0,00) | |
| 400.000 | CDS Pearson Plc 1.000% 20-Dec-2026 | (5.400) | (0,00) | |
| 100.000 | CDS Pearson Plc 1.000% 20-Dec-2026 | (1.350) | (0,00) | |
| 50.000 | CDS Pearson Plc 1.000% 20-Dec-2026 | (675) | (0,00) | |

Credit Default Swaps insgesamt (4.948.648) (1,12)

| | | | | |
|--------------------------------------|--|----------|--------|--|
| Währungsoptionen - (22.245) | | | | |
| (31. Dezember 2020: (77.804)) | | | | |
| (1.200.000) | Euro/Chinese yuan Call 11-Feb-2022 7.589 | (439) | (0,00) | |
| (1.200.000) | Euro/Chinese yuan Put 11-Feb-2022 7.280 | (11.314) | (0,01) | |
| (1.600.000) | US dollar/Euro Call 17-Jan-2022 1.105 | (79) | (0,00) | |
| (2.400.000) | US dollar/Euro Call 17-Jan-2022 1.108 | (171) | (0,00) | |
| (1.600.000) | US dollar/Euro Call 21-Jan-2022 1.113 | (562) | (0,00) | |
| (1.600.000) | US dollar/Euro Put 17-Jan-2022 1.150 | (1.580) | (0,00) | |
| (1.600.000) | US dollar/Euro Put 21-Jan-2022 1.148 | (3.426) | (0,00) | |
| (1.400.000) | US dollar/Norwegian krone Call 04-Jan-2022 9.190 | (4) | (0,00) | |
| (1.400.000) | US dollar/Norwegian krone Put 04-Jan-2022 8.650 | (110) | (0,00) | |
| (1.400.000) | US dollar/Norwegian krone Put 04-Jan-2022 8.800 | (4.560) | (0,00) | |

Währungsoptionen insgesamt (22.245) (0,01)

| | | | | |
|---------------------------------------|---|-------------|--------|--|
| Swaptions - (3.645.519) | | | | |
| (31. Dezember 2020: (535.648)) | | | | |
| (4.800.000) | CDX North America Investment Grade Index Series 37 Version 1 Call 16-Feb-2022 0.525 | (10.627) | (0,00) | |
| (45.100.000) | CDX North America Investment Grade Index Series 37 Version 1 Call 16-Feb-2022 0.525 | (99.850) | (0,02) | |
| (46.600.000) | CDX North America Investment Grade Index Series 37 Version 1 Call 17-Feb-2022 0.525 | (103.170) | (0,03) | |
| (4.800.000) | CDX North America Investment Grade Index Series 37 Version 1 Put 16-Feb-2022 0.525 | (5.341) | (0,00) | |
| (45.100.000) | CDX North America Investment Grade Index Series 37 Version 1 Put 16-Feb-2022 0.525 | (50.184) | (0,01) | |
| (46.600.000) | CDX North America Investment Grade Index Series 37 Version 1 Put 17-Feb-2022 0.525 | (51.854) | (0,01) | |
| (116.800.000) | iTraxx Europe Senior Financials Index Series 36 Version 1 Call 16-Mar-2022 1.100 | (3.324.493) | (0,75) | |

Swaptions insgesamt (3.645.519) (0,82)

| Bestände | Beschreibung | Zugrunde liegendes Engagement USD | Beizulegender Zeitwert USD | Nettovermögen % | Summe |
|---|---|-----------------------------------|----------------------------|-----------------|-------|
| Offene Terminkontrakte - (160.987) | | | | | |
| (31. Dezember 2020: (552.754)) | | | | | |
| 50 | Euro-Bobl Long Futures Contracts Exp Mar-2022 | 7.584.693 | (39.205) | (0,01) | |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Zugrunde liegendes Engagement USD | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % |
|---|--|-----------------------------------|----------------------------|-----------------------|
| Offene Terminkontrakte Forts. | | | | |
| 27 | Euro-Bund Long Futures Contracts Exp Mar-2022 | 5.267.832 | (90.620) | (0,02) |
| 68 | U.S. 10 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2022 | 8.871.875 | (7.867) | (0,00) |
| 125 | U.S. 2 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Mar-2022 | 27.271.484 | (16.727) | (0,01) |
| 3 | U.S. Treasury Ultra Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2022 | 591.375 | (6.568) | (0,00) |
| Offene Terminkontrakte insgesamt | | | (160.987) | (0,04) |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (4.236.892) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (2.936.892)) | | | (4.236.892) | (0,95) |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | | (13.014.291) | (2,94) |
| Nettoumlaufvermögen | | | 15.380.106 | 3,47 |
| Summe Nettovermögen | | | 442.961.954 | 100,00 |

– Ein Teil der Beteiligung wird von Citigroup Global Markets Limited als Sicherheit im Zusammenhang mit vom Fonds gehaltenen Währungsoptionen und Devisenterminkontrakten gehalten. Die Kontrahenten für Credit Default Swaps sind Bank of America Merrill Lynch, Barclays Bank PLC, Morgan Stanley, BNP Paribas, Goldman Sachs und JPMorgan Securities Plc. Die Kontrahenten für Währungsoptionen sind Goldman Sachs, Citigroup Global Markets Limited, UBS AG und Morgan Stanley. Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist Goldman Sachs. Die Kontrahenten für Swaptions sind Goldman Sachs, Citigroup Global Markets Limited und BNP Paribas.

| Portfolioanalyse | % des Gesamtvermögens |
|--|-----------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 94,20 |
| An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente | 0,12 |
| Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate) | 1,59 |
| Sonstiges Umlaufvermögen | 4,09 |
| Gesamtvermögen | 100,00 |

| Devisenterminkontrakte | | | | | | | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|--------------------------------------|-------------------------|------------|-------------|------------------|----------------------------------|--------|-------------------------------------|
| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | | |
| BNY Mellon Global Credit Fund | | | | | | | |
| US-Dollar | Japanischer Yen | 38.716 | 4.450.000 | 4. Jan. 22 | HSBC Bank plc | 30 | |
| Euro | US-Dollar | 2.342.000 | 2.652.219 | 12. Jan. 22 | UBS AG | 14.592 | |
| Euro | US-Dollar | 100.000 | 112.778 | 12. Jan. 22 | HSBC Bank plc | 1.090 | |
| Euro | US-Dollar | 437.000 | 493.500 | 12. Jan. 22 | Morgan Stanley | 4.108 | |
| Euro | US-Dollar | 1.145.000 | 1.291.347 | 12. Jan. 22 | Morgan Stanley | 12.453 | |
| Euro | US-Dollar | 70.000 | 79.174 | 12. Jan. 22 | UBS AG | 535 | |
| Euro | US-Dollar | 151.000 | 171.001 | 12. Jan. 22 | UBS AG | 941 | |
| Euro | US-Dollar | 104.000 | 117.957 | 12. Jan. 22 | Morgan Stanley | 467 | |
| Euro | US-Dollar | 177.000 | 199.623 | 12. Jan. 22 | Morgan Stanley | 1.925 | |
| Euro | US-Dollar | 1.000.000 | 1.132.048 | 12. Jan. 22 | Morgan Stanley | 6.641 | |
| Euro | US-Dollar | 5.002.000 | 5.654.911 | 12. Jan. 22 | BNP Paribas | 40.813 | |
| Euro | US-Dollar | 2.799.000 | 3.164.463 | 12. Jan. 22 | UBS AG | 22.729 | |
| Euro | US-Dollar | 2.931.000 | 3.313.979 | 12. Jan. 22 | UBS AG | 23.520 | |
| Euro | US-Dollar | 3.021.000 | 3.421.573 | 12. Jan. 22 | BNP Paribas | 18.407 | |
| Euro | US-Dollar | 169.000 | 191.409 | 12. Jan. 22 | BNP Paribas | 1.030 | |
| Euro | US-Dollar | 98.000 | 110.716 | 12. Jan. 22 | Bank of America Merrill Lynch | 876 | |
| Euro | US-Dollar | 1.629.000 | 1.840.364 | 12. Jan. 22 | Bank of America Merrill Lynch | 14.561 | |
| Euro | US-Dollar | 159.000 | 180.127 | 12. Jan. 22 | Citigroup Global Markets Limited | 924 | |
| Euro | US-Dollar | 57.000 | 64.440 | 12. Jan. 22 | BNP Paribas | 465 | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 405.000 | 536.962 | 12. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | 11.216 | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 530.000 | 704.623 | 12. Jan. 22 | Morgan Stanley | 12.745 | |
| US-Dollar | Japanischer Yen | 20.440 | 2.311.000 | 12. Jan. 22 | HSBC Bank plc | 349 | |
| Australischer Dollar | Neuseeländischer Dollar | 700.000 | 728.453 | 13. Jan. 22 | Citigroup Global Markets Limited | 10.442 | |
| Australischer Dollar | US-Dollar | 1.120.929 | 800.000 | 13. Jan. 22 | Goldman Sachs | 15.556 | |
| Australischer Dollar | US-Dollar | 963.876 | 700.000 | 13. Jan. 22 | BNP Paribas | 1.289 | |
| Australischer Dollar | US-Dollar | 965.596 | 700.000 | 13. Jan. 22 | Bank of America Merrill Lynch | 2.540 | |
| Brasilianischer Real | US-Dollar | 1.400.000 | 242.484 | 13. Jan. 22 | BNP Paribas | 8.312 | |
| Kanadischer Dollar | Euro | 1.020.709 | 700.000 | 13. Jan. 22 | HSBC Bank plc | 9.810 | |
| Chinesischer Yuan | US-Dollar | 1.723.698 | 268.716 | 13. Jan. 22 | BNP Paribas | 2.240 | |
| Euro | US-Dollar | 707.646 | 804.749 | 13. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | 1.056 | |
| Euro | US-Dollar | 1.417.500 | 1.600.000 | 13. Jan. 22 | UBS AG | 14.125 | |
| Indische Rupie | US-Dollar | 29.973.000 | 397.741 | 13. Jan. 22 | HSBC Bank plc | 4.811 | |
| Mexikanischer Peso | US-Dollar | 15.012.449 | 700.000 | 13. Jan. 22 | BNP Paribas | 32.047 | |
| Norwegische Krone | Euro | 6.177.182 | 600.000 | 13. Jan. 22 | Barclays Bank PLC | 18.087 | |
| Norwegische Krone | US-Dollar | 9.202.852 | 1.017.000 | 13. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | 27.829 | |
| Norwegische Krone | US-Dollar | 5.277.491 | 583.000 | 13. Jan. 22 | Citigroup Global Markets Limited | 16.170 | |
| Polnischer Zloty | US-Dollar | 1.024.974 | 252.000 | 13. Jan. 22 | UBS AG | 2.231 | |
| Russischer Rubel | US-Dollar | 3.175.000 | 41.942 | 13. Jan. 22 | Morgan Stanley | 309 | |
| Taiwan-Dollar | US-Dollar | 12.444.000 | 449.540 | 13. Jan. 22 | BNP Paribas | 232 | |
| US-Dollar | Kanadischer Dollar | 57.257 | 72.346 | 13. Jan. 22 | HSBC Bank plc | 65 | |
| US-Dollar | Chilenischer Peso | 16.199 | 13.797.000 | 13. Jan. 22 | BNP Paribas | 25 | |
| US-Dollar | Japanischer Yen | 536.256 | 60.931.650 | 13. Jan. 22 | Bank of America Merrill Lynch | 6.515 | |
| US-Dollar | Japanischer Yen | 6.200.000 | 705.250.186 | 13. Jan. 22 | Barclays Bank PLC | 68.541 | |
| US-Dollar | Koreanischer Won | 237.230 | 279.323.000 | 13. Jan. 22 | Goldman Sachs | 2.344 | |
| US-Dollar | Neuseeländischer Dollar | 248.033 | 353.970 | 13. Jan. 22 | BNP Paribas | 5.628 | |
| US-Dollar | Russischer Rubel | 184.092 | 13.624.000 | 13. Jan. 22 | Barclays Bank PLC | 2.793 | |
| US-Dollar | Schwedische Krone | 682.322 | 6.092.090 | 13. Jan. 22 | HSBC Bank plc | 8.087 | |
| US-Dollar | Taiwan-Dollar | 450.043 | 12.444.000 | 13. Jan. 22 | HSBC Bank plc | 270 | |
| US-Dollar | Türkische Lira | 111.721 | 1.263.810 | 13. Jan. 22 | HSBC Bank plc | 16.950 | |
| Australischer Dollar | US-Dollar | 26.662 | 19.000 | 20. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | 399 | |
| Australischer Dollar | US-Dollar | 226.160 | 162.000 | 20. Jan. 22 | UBS AG | 2.551 | |
| Australischer Dollar | US-Dollar | 39.297 | 28.000 | 20. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | 592 | |
| Australischer Dollar | US-Dollar | 22.365 | 16.000 | 20. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | 273 | |
| Australischer Dollar | US-Dollar | 33.228 | 24.000 | 20. Jan. 22 | BNP Paribas | 177 | |
| Brasilianischer Real | US-Dollar | 122.000 | 21.232 | 20. Jan. 22 | UBS AG | 586 | |
| Brasilianischer Real | US-Dollar | 1.012.000 | 180.415 | 20. Jan. 22 | Morgan Stanley | 567 | |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte Forts.

| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|---|-------------------------|-------------|-------------|------------------|---------------------|-------------------------------------|
| BNY Mellon Global Credit Fund Forts. | | | | | | |
| Brasilianischer Real | US-Dollar | 55.000 | 9.707 | 20. Jan. 22 | BNP Paribas | 129 |
| Chilenischer Peso | US-Dollar | 34.283.000 | 39.368 | 20. Jan. 22 | UBS AG | 779 |
| Euro | US-Dollar | 19.468 | 22.000 | 20. Jan. 22 | BNP Paribas | 172 |
| Euro | US-Dollar | 37.394 | 42.000 | 20. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | 587 |
| Euro | US-Dollar | 606.738 | 685.427 | 20. Jan. 22 | Barclays Bank PLC | 5.574 |
| Indische Rupie | US-Dollar | 6.136.000 | 81.955 | 20. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | 349 |
| Indische Rupie | US-Dollar | 178.000 | 2.377 | 20. Jan. 22 | HSBC Bank plc | 10 |
| Indonesische Rupiah | US-Dollar | 106.800.000 | 7.486 | 20. Jan. 22 | Goldman Sachs | 14 |
| Indonesische Rupiah | US-Dollar | 7.340.000 | 512 | 20. Jan. 22 | Barclays Bank PLC | 4 |
| Indonesische Rupiah | US-Dollar | 69.629.000 | 4.840 | 20. Jan. 22 | BNP Paribas | 50 |
| Indonesische Rupiah | US-Dollar | 72.287.000 | 5.069 | 20. Jan. 22 | UBS AG | 8 |
| Indonesische Rupiah | US-Dollar | 34.319.000 | 2.384 | 20. Jan. 22 | BNP Paribas | 26 |
| Mexikanischer Peso | US-Dollar | 375.723 | 18.000 | 20. Jan. 22 | UBS AG | 299 |
| Neuseeländischer Dollar | US-Dollar | 35.454 | 24.000 | 20. Jan. 22 | Morgan Stanley | 278 |
| Neuseeländischer Dollar | US-Dollar | 8.771 | 6.000 | 20. Jan. 22 | Morgan Stanley | 6 |
| Neuseeländischer Dollar | US-Dollar | 20.785 | 14.000 | 20. Jan. 22 | Morgan Stanley | 233 |
| Norwegische Krone | US-Dollar | 72.862 | 8.000 | 20. Jan. 22 | Morgan Stanley | 271 |
| Norwegische Krone | US-Dollar | 107.517 | 12.000 | 20. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | 205 |
| Norwegische Krone | US-Dollar | 440.394 | 49.000 | 20. Jan. 22 | Morgan Stanley | 993 |
| Norwegische Krone | US-Dollar | 180.866 | 20.000 | 20. Jan. 22 | Morgan Stanley | 532 |
| Südafrikanischer Rand | US-Dollar | 97.841 | 6.000 | 20. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | 126 |
| Südafrikanischer Rand | US-Dollar | 257.124 | 16.000 | 20. Jan. 22 | BNP Paribas | 98 |
| Südafrikanischer Rand | US-Dollar | 192.203 | 12.000 | 20. Jan. 22 | BNP Paribas | 33 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 31.654 | 42.000 | 20. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | 844 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 14.389 | 19.000 | 20. Jan. 22 | Morgan Stanley | 475 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 17.962 | 24.000 | 20. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | 311 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 23.277 | 31.000 | 20. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | 505 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 28.538 | 38.000 | 20. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | 627 |
| Schwedische Krone | US-Dollar | 253.997 | 28.000 | 20. Jan. 22 | BNP Paribas | 112 |
| Schwedische Krone | US-Dollar | 136.150 | 15.000 | 20. Jan. 22 | Morgan Stanley | 69 |
| Schwedische Krone | US-Dollar | 272.563 | 30.000 | 20. Jan. 22 | Barclays Bank PLC | 167 |
| Schwedische Krone | US-Dollar | 154.865 | 17.000 | 20. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | 140 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 8.304 | 9.000 | 20. Jan. 22 | HSBC Bank plc | 117 |
| US-Dollar | Kanadischer Dollar | 185.318 | 234.081 | 20. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | 270 |
| US-Dollar | Kanadischer Dollar | 15.000 | 18.947 | 20. Jan. 22 | Morgan Stanley | 21 |
| US-Dollar | Chilenischer Peso | 132.075 | 110.481.000 | 20. Jan. 22 | Morgan Stanley | 2.695 |
| US-Dollar | Kolumbianischer Peso | 4.739 | 19.029.000 | 20. Jan. 22 | BNP Paribas | 69 |
| US-Dollar | Kolumbianischer Peso | 5.397 | 21.556.000 | 20. Jan. 22 | BNP Paribas | 106 |
| US-Dollar | Kolumbianischer Peso | 9.771 | 39.325.000 | 20. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | 119 |
| US-Dollar | Japanischer Yen | 30.000 | 3.401.524 | 20. Jan. 22 | Morgan Stanley | 425 |
| US-Dollar | Japanischer Yen | 10.000 | 1.142.407 | 20. Jan. 22 | UBS AG | 67 |
| US-Dollar | Japanischer Yen | 35.000 | 3.981.573 | 20. Jan. 22 | BNP Paribas | 382 |
| US-Dollar | Japanischer Yen | 12.000 | 1.379.977 | 20. Jan. 22 | UBS AG | 2 |
| US-Dollar | Japanischer Yen | 12.000 | 1.360.384 | 20. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | 172 |
| US-Dollar | Neuseeländischer Dollar | 13.000 | 18.906 | 20. Jan. 22 | BNP Paribas | 54 |
| US-Dollar | Russischer Rubel | 13.692 | 1.015.000 | 20. Jan. 22 | UBS AG | 193 |
| US-Dollar | Russischer Rubel | 22.983 | 1.710.000 | 20. Jan. 22 | Morgan Stanley | 241 |
| US-Dollar | Russischer Rubel | 58.466 | 4.342.000 | 20. Jan. 22 | UBS AG | 720 |
| US-Dollar | Russischer Rubel | 8.978 | 671.000 | 20. Jan. 22 | BNP Paribas | 54 |

Devisenterminkontrakte Forts.

| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|---|-----------------------|---------------|---------------|------------------|-------------------------------|-------------------------------------|
| BNY Mellon Global Credit Fund Forts. | | | | | | |
| US-Dollar | Südafrikanischer Rand | 309.406 | 4.916.919 | 20. Jan. 22 | Barclays Bank PLC | 1.571 |
| US-Dollar | Türkische Lira | 75.170 | 974.058 | 20. Jan. 22 | HSBC Bank plc | 2.584 |
| | | | | | | USD |
| | | | | | | 497.754 |
| US-Dollar | Australischer Dollar | 569.038 | 808.000 | 12. Jan. 22 | HSBC Bank plc | (18.839) |
| US-Dollar | Australischer Dollar | 10.082.823 | 14.317.000 | 12. Jan. 22 | HSBC Bank plc | (333.785) |
| US-Dollar | Euro | 2.898.054 | 2.555.000 | 12. Jan. 22 | Morgan Stanley | (11.297) |
| US-Dollar | Euro | 1.366.719 | 1.207.000 | 12. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | (7.679) |
| US-Dollar | Euro | 2.094.668 | 1.852.000 | 12. Jan. 22 | Bank of America Merrill Lynch | (14.185) |
| US-Dollar | Euro | 33.842.472 | 30.032.000 | 12. Jan. 22 | Goldman Sachs | (354.648) |
| US-Dollar | Euro | 33.841.839 | 30.033.000 | 12. Jan. 22 | Morgan Stanley | (356.420) |
| US-Dollar | Euro | 1.615.890 | 1.434.000 | 12. Jan. 22 | HSBC Bank plc | (16.990) |
| US-Dollar | Euro | 1.615.946 | 1.434.000 | 12. Jan. 22 | Goldman Sachs | (16.934) |
| US-Dollar | Euro | 33.840.799 | 30.032.000 | 12. Jan. 22 | Bank of America Merrill Lynch | (356.321) |
| US-Dollar | Euro | 10.060.072 | 8.880.000 | 12. Jan. 22 | Bank of America Merrill Lynch | (51.490) |
| US-Dollar | Euro | 33.841.292 | 30.032.000 | 12. Jan. 22 | HSBC Bank plc | (355.828) |
| US-Dollar | Euro | 1.614.736 | 1.433.000 | 12. Jan. 22 | Morgan Stanley | (17.006) |
| US-Dollar | Euro | 1.615.867 | 1.434.000 | 12. Jan. 22 | Bank of America Merrill Lynch | (17.014) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 1.259.872 | 949.000 | 12. Jan. 22 | Goldman Sachs | (24.622) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 26.193.126 | 19.730.000 | 12. Jan. 22 | Goldman Sachs | (511.908) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 26.180.069 | 19.720.000 | 12. Jan. 22 | Morgan Stanley | (511.429) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 1.258.555 | 948.000 | 12. Jan. 22 | Morgan Stanley | (24.586) |
| Chilenischer Peso | US-Dollar | 25.416.000 | 30.083 | 13. Jan. 22 | Goldman Sachs | (29.040) |
| Euro | Norwegische Krone | 600.000 | 6.150.812 | 13. Jan. 22 | Morgan Stanley | (15.094) |
| Ungarischer Forint | US-Dollar | 19.714.102 | 616.000 | 13. Jan. 22 | BNP Paribas | (8.924) |
| Indonesische Rupiah | US-Dollar | 4.372.000.000 | 308.341 | 13. Jan. 22 | UBS AG | (1.436) |
| Japanischer Yen | US-Dollar | 704.940.496 | 6.200.000 | 13. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | (71.234) |
| Koreanischer Won | US-Dollar | 279.323.000 | 235.398 | 13. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | (512) |
| Neuseeländischer Dollar | Australischer Dollar | 728.144 | 700.000 | 13. Jan. 22 | Bank of America Merrill Lynch | (10.654) |
| Russischer Rubel | US-Dollar | 10.415.000 | 140.979 | 13. Jan. 22 | Goldman Sachs | (2.383) |
| Russischer Rubel | US-Dollar | 671.000 | 8.995 | 13. Jan. 22 | BNP Paribas | (66) |
| Schwedische Krone | Euro | 6.071.112 | 600.000 | 13. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | (11.314) |
| Türkische Lira | US-Dollar | 1.263.810 | 97.932 | 13. Jan. 22 | HSBC Bank plc | (3.161) |
| US-Dollar | Australischer Dollar | 800.000 | 1.122.471 | 13. Jan. 22 | Goldman Sachs | (16.678) |
| US-Dollar | Australischer Dollar | 1.757.805 | 2.424.582 | 13. Jan. 22 | Bank of America Merrill Lynch | (6.252) |
| US-Dollar | Brasilianischer Real | 237.985 | 1.338.000 | 13. Jan. 22 | Morgan Stanley | (1.705) |
| US-Dollar | Chilenischer Peso | 13.390 | 11.619.000 | 13. Jan. 22 | UBS AG | (230) |
| US-Dollar | Tschechische Krone | 71.033 | 1.599.306 | 13. Jan. 22 | BNP Paribas | (2.102) |
| US-Dollar | Euro | 1.383.033 | 1.225.383 | 13. Jan. 22 | UBS AG | (12.326) |
| US-Dollar | Euro | 842.091 | 745.000 | 13. Jan. 22 | Morgan Stanley | (6.250) |
| US-Dollar | Euro | 1.400.000 | 1.243.614 | 13. Jan. 22 | Barclays Bank PLC | (16.120) |
| US-Dollar | Euro | 22.112.836 | 19.545.491 | 13. Jan. 22 | Barclays Bank PLC | (143.868) |
| US-Dollar | Ungarischer Forint | 308.000 | 100.658.188 | 13. Jan. 22 | HSBC Bank plc | (1.965) |
| US-Dollar | Ungarischer Forint | 288.120 | 93.896.387 | 13. Jan. 22 | HSBC Bank plc | (1.022) |
| US-Dollar | Indische Rupie | 395.422 | 29.973.000 | 13. Jan. 22 | HSBC Bank plc | (7.129) |
| US-Dollar | Indonesische Rupiah | 303.632 | 4.372.000.000 | 13. Jan. 22 | Goldman Sachs | (3.273) |
| US-Dollar | Mexikanischer Peso | 700.000 | 15.144.712 | 13. Jan. 22 | BNP Paribas | (38.497) |
| US-Dollar | Norwegische Krone | 4.176 | 37.115 | 13. Jan. 22 | Bank of America Merrill Lynch | (38) |
| US-Dollar | Norwegische Krone | 1.392.871 | 12.292.700 | 13. Jan. 22 | Barclays Bank PLC | (2.759) |
| US-Dollar | Polnischer Zloty | 308.447 | 1.283.334 | 13. Jan. 22 | HSBC Bank plc | (9.866) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 8.198.913 | 6.092.010 | 13. Jan. 22 | HSBC Bank plc | (46.751) |
| Chilenischer Peso | US-Dollar | 3.989.000 | 4.673 | 20. Jan. 22 | Morgan Stanley | (2) |
| Chilenischer Peso | US-Dollar | 13.797.000 | 16.185 | 20. Jan. 22 | BNP Paribas | (28) |
| Chilenischer Peso | US-Dollar | 13.279.000 | 16.010 | 20. Jan. 22 | Goldman Sachs | (460) |
| Chilenischer Peso | US-Dollar | 36.173.000 | 44.311 | 20. Jan. 22 | Goldman Sachs | (1.950) |
| Chilenischer Peso | US-Dollar | 14.012.000 | 16.558 | 20. Jan. 22 | Goldman Sachs | (149) |
| Kolumbianischer Peso | US-Dollar | 185.112.000 | 46.763 | 20. Jan. 22 | Bank of America Merrill Lynch | (1.327) |
| Kolumbianischer Peso | US-Dollar | 49.917.000 | 12.770 | 20. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | (517) |
| Kolumbianischer Peso | US-Dollar | 51.580.000 | 12.981 | 20. Jan. 22 | Goldman Sachs | (321) |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte Forts.

| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|---|-------------------------|------------|------------|------------------|----------------------------------|-------------------------------------|
| BNY Mellon Global Credit Fund Forts. | | | | | | |
| Kolumbianischer Peso | US-Dollar | 41.774.000 | 10.437 | 20. Jan. 22 | BNP Paribas | (184) |
| Japanischer Yen | US-Dollar | 26.180.384 | 229.701 | 20. Jan. 22 | Barclays Bank PLC | (2.075) |
| Neuseeländischer Dollar | US-Dollar | 77.723 | 54.385 | 20. Jan. 22 | BNP Paribas | (1.163) |
| Russischer Rubel | US-Dollar | 10.240.000 | 137.633 | 20. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | (1.447) |
| Südafrikanischer Rand | US-Dollar | 4.7644 | 3.000 | 20. Jan. 22 | UBS AG | (17) |
| Südafrikanischer Rand | US-Dollar | 159.004 | 10.000 | 20. Jan. 22 | UBS AG | (45) |
| Südafrikanischer Rand | US-Dollar | 4.011.761 | 252.000 | 20. Jan. 22 | Goldman Sachs | (835) |
| Schwedische Krone | US-Dollar | 921.157 | 102.745 | 20. Jan. 22 | UBS AG | (791) |
| Schwedische Krone | US-Dollar | 207.295 | 23.000 | 20. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | (57) |
| Türkische Lira | US-Dollar | 974.058 | 84.686 | 20. Jan. 22 | Morgan Stanley | (12.100) |
| US-Dollar | Australischer Dollar | 15.000 | 20.831 | 20. Jan. 22 | Barclays Bank PLC | (157) |
| US-Dollar | Australischer Dollar | 338.146 | 465.816 | 20. Jan. 22 | Citigroup Global Markets Limited | (776) |
| US-Dollar | Brasilianischer Real | 14.788 | 84.000 | 20. Jan. 22 | Goldman Sachs | (234) |
| US-Dollar | Brasilianischer Real | 2.090 | 12.000 | 20. Jan. 22 | Goldman Sachs | (56) |
| US-Dollar | Brasilianischer Real | 9.323 | 53.000 | 20. Jan. 22 | Goldman Sachs | (155) |
| US-Dollar | Brasilianischer Real | 7.070 | 40.000 | 20. Jan. 22 | BNP Paribas | (84) |
| US-Dollar | Kanadischer Dollar | 6.000 | 7.723 | 20. Jan. 22 | Morgan Stanley | (105) |
| US-Dollar | Kanadischer Dollar | 132.000 | 170.347 | 20. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | (2.665) |
| US-Dollar | Kanadischer Dollar | 24.000 | 30.595 | 20. Jan. 22 | Morgan Stanley | (186) |
| US-Dollar | Kanadischer Dollar | 21.000 | 26.931 | 20. Jan. 22 | UBS AG | (290) |
| US-Dollar | Kanadischer Dollar | 27.000 | 34.284 | 20. Jan. 22 | Morgan Stanley | (103) |
| US-Dollar | Euro | 16.000 | 14.157 | 20. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | (123) |
| US-Dollar | Euro | 6.000 | 5.289 | 20. Jan. 22 | Morgan Stanley | (24) |
| US-Dollar | Euro | 15.000 | 13.299 | 20. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | (146) |
| US-Dollar | Indische Rupie | 11.523 | 868.000 | 20. Jan. 22 | BNP Paribas | (120) |
| US-Dollar | Indische Rupie | 17.186 | 1.302.000 | 20. Jan. 22 | HSBC Bank plc | (279) |
| US-Dollar | Indische Rupie | 5.151 | 386.000 | 20. Jan. 22 | BNP Paribas | (26) |
| US-Dollar | Indonesische Rupiah | 3.713 | 53.633.000 | 20. Jan. 22 | BNP Paribas | (53) |
| US-Dollar | Japanischer Yen | 2.000 | 230.095 | 20. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | (1) |
| US-Dollar | Mexikanischer Peso | 30.000 | 633.744 | 20. Jan. 22 | UBS AG | (866) |
| US-Dollar | Mexikanischer Peso | 6.000 | 129.453 | 20. Jan. 22 | HSBC Bank plc | (305) |
| US-Dollar | Mexikanischer Peso | 10.000 | 207.181 | 20. Jan. 22 | Goldman Sachs | (90) |
| US-Dollar | Mexikanischer Peso | 13.000 | 282.085 | 20. Jan. 22 | Barclays Bank PLC | (738) |
| US-Dollar | Mexikanischer Peso | 22.000 | 469.901 | 20. Jan. 22 | BNP Paribas | (886) |
| US-Dollar | Mexikanischer Peso | 34.934 | 736.771 | 20. Jan. 22 | Barclays Bank PLC | (949) |
| US-Dollar | Neuseeländischer Dollar | 19.000 | 28.047 | 20. Jan. 22 | Morgan Stanley | (206) |
| US-Dollar | Norwegische Krone | 6.000 | 53.457 | 20. Jan. 22 | Morgan Stanley | (68) |
| US-Dollar | Norwegische Krone | 83.431 | 744.129 | 20. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | (1.042) |
| US-Dollar | Russischer Rubel | 41.879 | 317.500 | 20. Jan. 22 | Morgan Stanley | (346) |
| US-Dollar | Südafrikanischer Rand | 3.000 | 47.953 | 20. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | (2) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 311.889 | 231.858 | 20. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | (1.930) |
| US-Dollar | Schwedische Krone | 35.000 | 319.274 | 20. Jan. 22 | UBS AG | (337) |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 13.000 | 11.942 | 20. Jan. 22 | UBS AG | (111) |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 198.482 | 183.744 | 20. Jan. 22 | BNP Paribas | (3.254) |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 14.000 | 12.928 | 20. Jan. 22 | BNP Paribas | (193) |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 22.000 | 20.194 | 20. Jan. 22 | Morgan Stanley | (171) |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 25.000 | 23.055 | 20. Jan. 22 | UBS AG | (313) |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 7.000 | 6.535 | 20. Jan. 22 | Morgan Stanley | (175) |
| US-Dollar | Brasilianischer Real | 731.823 | 4.158.000 | 2. Feb. 22 | HSBC Bank plc | (9.416) |
| USD | | | | | | (3.493.328) |

Devisenterminkontrakte Forts.

| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|--|-----------------|---------------|-------------|------------------|-----------------------------|-------------------------------------|
| BNY Mellon Global Credit Fund Anteilsklasse CAD X (Acc) (Hedged) | | | | | | |
| Kanadischer Dollar | US-Dollar | 371.446.463 | 292.750.302 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 891.777 |
| USD | | | | | | 891.777 |
| CAD | | | | | | 1.128.053 |
| BNY Mellon Global Credit Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged) | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 22.488 | 25.427 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 181 |
| Euro | US-Dollar | 15.878.757 | 17.969.788 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 111.932 |
| USD | | | | | | 112.113 |
| EUR | | | | | | 98.474 |
| BNY Mellon Global Credit Fund Anteilsklasse JPY X (Acc) (Hedged) | | | | | | |
| US-Dollar | Japanischer Yen | 34.615 | 3.960.000 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 190 |
| USD | | | | | | 190 |
| JPY | | | | | | 21.856 |
| Japanischer Yen | US-Dollar | 41.970.000 | 366.985 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (2.094) |
| Japanischer Yen | US-Dollar | 140.000.000 | 1.227.567 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (10.395) |
| Japanischer Yen | US-Dollar | 80.000 | 701 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (6) |
| Japanischer Yen | US-Dollar | 162.450.000 | 1.430.165 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (17.810) |
| Japanischer Yen | US-Dollar | 150.000.000 | 1.319.713 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (15.600) |
| Japanischer Yen | US-Dollar | 3.500.000.000 | 30.830.944 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (401.629) |
| Japanischer Yen | US-Dollar | 2.280.000 | 20.109 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (287) |
| Japanischer Yen | US-Dollar | 1.680.000 | 14.788 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (182) |
| Japanischer Yen | US-Dollar | 2.473.853.499 | 21.803.067 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (295.162) |
| Japanischer Yen | US-Dollar | 3.960.000 | 34.620 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (191) |
| US-Dollar | Japanischer Yen | 340.033 | 39.132.446 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (188) |
| USD | | | | | | (743.544) |
| JPY | | | | | | (85.529.866) |
| BNY Mellon Global Credit Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged) | | | | | | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 430.112 | 568.208 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 13.956 |
| USD | | | | | | 13.956 |
| GBP | | | | | | 10.311 |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 2.325 | 1.733 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (20) |
| USD | | | | | | (20) |
| GBP | | | | | | (15) |

BNY MELLON GLOBAL DYNAMIC BOND FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % | Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|---|---|----------------------------------|----------------------------------|-------------------------------------|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | | | Anleihen Forts. | | | |
| Pfund Sterling - 6.620.068 | | | | Euro Forts. | | | |
| (31. Dezember 2020: 6.139.869) | | | | (31. Dezember 2020: 712.716) | | | |
| 3.346.151 | BNY Mellon Investment Funds - BNY Mellon Global High Yield Bond Fund | 6.620.068 | 1,53 | 1.063.000 | Cirsa Finance International Sarl 'REGS' 4.750% 22-May-2025 | 1.198.814 | 0,28 |
| US-Dollar - 13.148.875 | | | | 1.480.000 | Clarios Global LP / Clarios US Finance Co 'REGS' 4.375% 15-May-2026 | 1.723.299 | 0,40 |
| (31. Dezember 2020: 20.977.824) | | | | 1.817.000 | Dana Financing Luxembourg Sarl 'REGS' 3.000% 15-Jul-2029 | 2.079.503 | 0,48 |
| 2.635.811 | iShares China CNY Bond UCITS ETF - ETF | 13.148.875 | 3,04 | 1.201.000 | eG Global Finance Plc 'REGS' 4.375% 07-Feb-2025 | 1.366.863 | 0,32 |
| Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen | | | | 6.216.609 | French Republic Government Bond OAT 0.100% 01-Mar-2025 | 7.527.755 | 1,74 |
| 19.768.943 | | | | 362.000 | Graphic Packaging International LLC 'REGS' 2.625% 01-Feb-2029 | 418.936 | 0,10 |
| Anleihen | | | | 579.000 | H&M Finance BV 'EMTN' 0.250% 25-Aug-2029 | 635.914 | 0,15 |
| Australischer Dollar - 11.217.279 | | | | 1.548.000 | Heimstaden Bostad AB FRN (Perpetual) 2.625% 01-Feb-2027 | 1.658.104 | 0,38 |
| (31. Dezember 2020: 35.033.821) | | | | 1.043.000 | Iliad Holding SASU 'REGS' 5.625% 15-Oct-2028 | 1.247.373 | 0,29 |
| 3.990.000 | Australia Government Bond 3.000% 20-Sep-2025 | 4.322.639 | 1,00 | 1.029.000 | INEOS Quattro Finance 2 Plc 'REGS' 2.500% 15-Jan-2026 | 1.161.093 | 0,27 |
| 9.470.000 | Treasury Corp of Victoria 1.000% 20-Nov-2023 | 6.894.640 | 1,59 | 1.300.000 | Infineon Technologies AG 'EMTN' FRN (Perpetual) 2.875% 01-Jan-2025 | 1.530.630 | 0,35 |
| Kanadischer Dollar - 28.568.852 | | | | 500.000 | Infineon Technologies AG FRN (Perpetual) 3.625% 01-Jan-2028 | 618.528 | 0,14 |
| (31. Dezember 2020: 12.331.555) | | | | 1.132.000 | IQVIA Inc 'REGS' 2.875% 15-Jun-2028 | 1.319.564 | 0,30 |
| 21.200.000 | Canada Housing Trust No 1 '144A' 2.350% 15-Sep-2023 | 17.000.030 | 3,93 | 1.259.000 | Kleopatra Finco Sarl 'REGS' 4.250% 01-Mar-2026 | 1.380.967 | 0,32 |
| 5.715.000 | Canada Housing Trust No 1 FRN 0.323% 15-Mar-2027 | 4.490.237 | 1,04 | 1.015.000 | Lloyds Banking Group Plc FRN (Perpetual) 4.947% 27-Jun-2025 | 1.258.817 | 0,29 |
| 6.171.452 | Canadian Government Real Return Bond 4.000% 01-Dec-2031 | 7.078.585 | 1,63 | 1.233.000 | Lorca Telecom Bondco SA 'REGS' 4.000% 18-Sep-2027 | 1.425.283 | 0,33 |
| Kolumbianischer Peso - 5.579.121 | | | | 1.200.000 | Loxam SAS 'REGS' 2.875% 15-Apr-2026 | 1.352.013 | 0,31 |
| (31. Dezember 2020: 4.972.277) | | | | 1.170.000 | Matterhorn Telecom SA 'REGS' 3.125% 15-Sep-2026 | 1.325.324 | 0,31 |
| 8.829.000.000 | Colombia Government International Bond 'REGS' 6.000% 28-Apr-2028 | 1.966.882 | 0,46 | 1.860.000 | Nexi SpA 1.625% 30-Apr-2026 | 2.068.979 | 0,48 |
| 15.942.800.000 | Colombia Government International Bond 'REGS' 7.000% 30-Jun-2032 | 3.612.239 | 0,83 | 1.214.000 | Nobel Bidco BV 'REGS' 3.125% 15-Jun-2028 | 1.346.290 | 0,31 |
| Tschechische Krone - 8.637.981 | | | | 1.713.000 | Nobian Finance BV 'REGS' 3.625% 15-Jul-2026 | 1.922.215 | 0,44 |
| (31. Dezember 2020: 5.233.204) | | | | 810.000 | Nomad Foods Bondco Plc 'REGS' 2.500% 24-Jun-2028 | 921.287 | 0,21 |
| 101.190.000 | Czech Republic Government Bond 0.450% 25-Oct-2023 | 4.349.690 | 1,00 | 1.616.000 | Olympus Water US Holding Corp 'REGS' 3.875% 01-Oct-2028 | 1.840.721 | 0,43 |
| 100.480.000 | Czech Republic Government Bond 1.250% 14-Feb-2025 | 4.288.291 | 0,99 | 1.200.000 | PCF GmbH 'REGS' 4.750% 15-Apr-2026 | 1.408.549 | 0,33 |
| Euro - 86.814.206 | | | | 898.000 | Picard Groupe SAS 'REGS' 3.875% 01-Jul-2026 | 1.032.756 | 0,24 |
| (31. Dezember 2020: 106.255.413) | | | | 300.000 | Prologis International Funding II SA 'EMTN' 1.625% 17-Jun-2032 | 355.158 | 0,08 |
| 800.000 | ADLER Group SA 2.250% 27-Apr-2027 | 765.493 | 0,18 | 3.930.000 | Province of British Columbia Canada 'EMTN' 0.875% 08-Oct-2025 | 4.601.945 | 1,06 |
| 1.100.000 | ADLER Group SA 3.250% 05-Aug-2025 | 1.080.846 | 0,25 | 1.655.000 | Republic of Poland Government International Bond 'EMTN' 0.000% 07-Jul-2023 | 1.878.954 | 0,43 |
| 1.800.000 | AIB Group Plc FRN (Perpetual) 6.250% 23-Jun-2025 | 2.257.831 | 0,52 | 996.000 | Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB FRN (Perpetual) 2.625% 14-Dec-2025 | 1.096.832 | 0,25 |
| 2.092.000 | Akelius Residential Property AB FRN 2.249% 17-May-2081 | 2.315.952 | 0,53 | 315.000 | SELP Finance Sarl 1.250% 25-Oct-2023 | 363.683 | 0,08 |
| 398.000 | Albion Financing 1 SARL / Aggreko Holdings Inc 'REGS' 5.250% 15-Oct-2026 | 456.247 | 0,11 | 1.356.917 | Silverback Finance DAC 3.126% 25-Feb-2037 | 1.603.313 | 0,37 |
| 1.190.000 | Altice France SA/France 'REGS' 4.125% 15-Jan-2029 | 1.341.871 | 0,31 | 1.550.000 | SoftBank Group Corp 2.875% 06-Jan-2027 | 1.667.764 | 0,39 |
| 818.000 | Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc 'REGS' 3.000% 01-Sep-2029 | 908.688 | 0,21 | 1.438.000 | Summer BC Holdco B SARL 'REGS' 5.750% 31-Oct-2026 | 1.700.615 | 0,39 |
| 1.200.000 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN (Perpetual) 5.875% 24-May-2022 | 1.382.804 | 0,32 | 300.000 | Telefonica Europe BV FRN (Perpetual) 3.000% 04-Sep-2023 | 350.879 | 0,08 |
| 1.000.000 | Banco Santander SA FRN (Perpetual) 5.250% 29-Sep-2023 | 1.188.499 | 0,27 | 900.000 | Telefonica Europe BV FRN (Perpetual) 4.375% 14-Dec-2024 | 1.096.950 | 0,25 |
| 1.494.000 | Banijay Entertainment SASU 'REGS' 3.500% 01-Mar-2025 | 1.701.866 | 0,39 | 1.485.000 | TK Elevator Midco GmbH 'REGS' 4.375% 15-Jul-2027 | 1.743.626 | 0,40 |
| 1.730.000 | Bank of Ireland Group Plc FRN (Perpetual) 7.500% 19-May-2025 | 2.269.048 | 0,52 | 1.541.000 | Tritax EuroBox Plc 0.950% 02-Jun-2026 | 1.749.841 | 0,40 |
| 972.000 | BCPV Modular Services Finance II Plc 'REGS' 4.750% 30-Nov-2028 | 1.116.661 | 0,26 | 1.260.000 | UniCredit SpA 'EMTN' FRN (Perpetual) 3.875% 03-Jun-2027 | 1.368.017 | 0,32 |
| 500.000 | CA Immobilien Anlagen AG 0.875% 05-Feb-2027 | 554.816 | 0,13 | 1.240.000 | United Group BV 'REGS' 4.875% 01-Jul-2024 | 1.422.063 | 0,33 |
| 1.370.000 | Carnival Corp 1.875% 07-Nov-2022 | 1.524.073 | 0,35 | 976.000 | Verisure Holding AB 'REGS' 3.250% 15-Feb-2027 | 1.104.542 | 0,26 |
| 1.098.000 | CBRE Global Investors Open-Ended Fund SCA SICAV-SIF Pan European Core Fund 0.500% 27-Jan-2028 | 1.212.914 | 0,28 | 100.000 | Vivion Investments Sarl 3.000% 08-Aug-2024 | 112.302 | 0,03 |
| 408.000 | Cedacri Mergesco SPA 'REGS' FRN 4.625% 15-May-2028 | 466.023 | 0,11 | 305.000 | Volkswagen International Finance NV FRN (Perpetual) 2.500% 20-Mar-2022 | 346.826 | 0,08 |
| 1.000.000 | Cellnex Telecom SA 1.875% 26-Jun-2029 | 1.127.346 | 0,26 | 1.700.000 | Volkswagen International Finance NV FRN (Perpetual) 3.875% 17-Jun-2029 | 2.102.129 | 0,49 |
| 617.000 | Chrome Bidco SASU 'REGS' 3.500% 31-May-2028 | 708.212 | 0,16 | Indische Rupie - 3.117.921 | | | |
| | | | | (31. Dezember 2020: 712.716) | | | |
| | | | | 50.000.000 | Housing Development Finance Corp Ltd 'EMTN' 8.220% 28-Mar-2022 | 676.055 | 0,16 |
| | | | | 176.790.000 | International Finance Corp 'GMTN' 6.300% 25-Nov-2024 | 2.441.866 | 0,56 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Summe Beizulegender Zeitwert USD | Nettover- mögen % |
|---|--|---|-------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Indonesische Rupiah - 5.573.775 | | | |
| (31. Dezember 2020: 4.670.298) | | | |
| 30.750.000.000 | European Bank for Reconstruction & Development 'GMTN' 6.450% 13-Dec-2022 | 2.196.643 | 0,51 |
| 45.466.000.000 | Indonesia Treasury Bond 6.500% 15-Jun-2025 | 3.377.132 | 0,78 |
| Japanischer Yen - 6.696.264 | | | |
| (31. Dezember 2020: 21.164.701) | | | |
| 498.950.000 | Japan Government Two Year Bond 0.005% 01-Nov-2023 | 4.342.755 | 1,00 |
| 261.729.594 | Japanese Government CPI Linked Bond 0.100% 10-Mar-2028 | 2.353.509 | 0,55 |
| Malaysischer Ringgit - 3.260.921 | | | |
| (31. Dezember 2020: 7.193.559) | | | |
| 13.690.000 | Malaysia Government Bond 3.828% 05-Jul-2034 | 3.260.921 | 0,75 |
| Mexikanischer neuer Peso - 7.140.918 | | | |
| (31. Dezember 2020: 8.599.734) | | | |
| 60.850.000 | Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031 | 3.011.647 | 0,70 |
| 79.710.000 | Mexican Bonos 8.500% 31-May-2029 | 4.129.271 | 0,95 |
| Neuseeländischer Dollar - 11.395.641 | | | |
| (31. Dezember 2020: 11.843.063) | | | |
| 3.010.000 | Housing New Zealand Ltd 'MTN' 3.360% 12-Jun-2025 | 2.110.374 | 0,49 |
| 5.100.000 | New Zealand Government Inflation Linked Bond 3.000% 20-Sep-2030 | 4.876.398 | 1,12 |
| 3.220.000 | New Zealand Local Government Funding Agency Bond 2.250% 15-Apr-2024 | 2.201.328 | 0,51 |
| 3.090.000 | New Zealand Local Government Funding Agency Bond 5.500% 15-Apr-2023 | 2.207.541 | 0,51 |
| Pfund Sterling - 42.070.811 | | | |
| (31. Dezember 2020: 38.046.193) | | | |
| 176.000 | Anglian Water Services Financing Plc 'EMTN' 1.625% 10-Aug-2025 | 239.774 | 0,06 |
| 1.627.000 | Bellis Acquisition Co Plc 'REGS' 3.250% 16-Feb-2026 | 2.116.114 | 0,49 |
| 1.633.000 | Coventry Building Society 'EMTN' 1.000% 21-Sep-2025 | 2.160.284 | 0,50 |
| 1.374.000 | Coventry Building Society FRN (Perpetual) 6.875% 18-Sep-2024 | 2.023.099 | 0,47 |
| 1.560.000 | CPUK Finance Ltd 'REGS' 4.875% 28-Aug-2025 | 2.110.141 | 0,49 |
| 1.009.000 | Deuce Finco Plc 'REGS' 5.500% 15-Jun-2027 | 1.355.983 | 0,31 |
| 3.700.000 | Dexia Credit Local SA 0.500% 22-Jul-2023 | 4.958.151 | 1,14 |
| 515.000 | Heathrow Finance Plc 6.250% 03-Mar-2025 | 736.904 | 0,17 |
| 1.055.000 | Iceland Bondco Plc 'REGS' 4.625% 15-Mar-2025 | 1.333.075 | 0,31 |
| 1.068.000 | Investec Plc 'EMTN' FRN (Perpetual) 6.750% 05-Dec-2024 | 1.508.911 | 0,35 |
| 592.000 | Jerrold Finco Plc 'REGS' 4.875% 15-Jan-2026 | 809.435 | 0,19 |
| 950.000 | Jerrold Finco Plc 'REGS' 5.250% 15-Jan-2027 | 1.301.037 | 0,30 |
| 1.830.000 | Lloyds Banking Group Plc FRN (Perpetual) 5.125% 27-Dec-2024 | 2.554.815 | 0,59 |
| 1.107.599 | Mitchells & Butlers Finance Plc 6.013% 15-Dec-2028 | 1.618.913 | 0,37 |
| 1.540.000 | National Express Group Plc 'EMTN' 2.500% 11-Nov-2023 | 2.118.845 | 0,49 |
| 545.000 | National Express Group Plc FRN (Perpetual) 4.250% 26-Nov-2025 | 750.696 | 0,17 |
| 2.200.000 | Nationwide Building Society FRN (Perpetual) 5.875% 20-Dec-2024 | 3.205.635 | 0,74 |
| 1.618.000 | Ocado Group Plc 'REGS' 3.875% 08-Oct-2026 | 2.130.901 | 0,49 |
| 402.000 | Orsted AS FRN 2.500% 18-Feb-3021 | 530.359 | 0,12 |
| 979.000 | Stonegate Pub Co Financing 2019 Plc 'REGS' 8.250% 31-Jul-2025 | 1.341.070 | 0,31 |
| 475.000 | Tritax Big Box REIT Plc 1.500% 27-Nov-2033 | 608.438 | 0,14 |
| 829.000 | Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 'REGS' 4.875% 15-Jul-2028 | 1.119.569 | 0,26 |
| 1.043.000 | Vmed O2 UK Financing I Plc 'REGS' 4.000% 31-Jan-2029 | 1.383.628 | 0,32 |
| 822.000 | Vodafone Group Plc FRN 4.875% 03-Oct-2028 | 1.174.036 | 0,27 |

| Bestände | Beschreibung | Summe Beizulegender Zeitwert USD | Nettover- mögen % |
|---|---|---|-------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Pfund Sterling Forts. | | | |
| 2.120.000 | Yorkshire Building Society FRN 0.739% 19-Nov-2023 | 2.880.998 | 0,67 |
| Schwedische Krone - 1.703.660 | | | |
| (31. Dezember 2020: 2.691.729) | | | |
| 15.000.000 | Stadshypotek AB 1.500% 01-Mar-2024 | 1.703.660 | 0,39 |
| US-Dollar - 151.993.761 | | | |
| (31. Dezember 2020: 173.313.541) | | | |
| 210.000 | Agile Group Holdings Ltd 4.850% 31-Aug-2022 | 136.542 | 0,03 |
| 1.560.000 | Agile Group Holdings Ltd 6.700% 07-Mar-2022 | 1.251.900 | 0,29 |
| 1.108.000 | American Airlines Inc '144A' 11.750% 15-Jul-2025 | 1.375.410 | 0,32 |
| 1.500.000 | Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc '144A' 4.000% 01-Sep-2029 | 1.492.627 | 0,34 |
| 4.770.000 | Asian Development Bank 'GMTN' FRN 1.050% 27-Aug-2026 | 4.953.565 | 1,14 |
| 2.445.000 | Bahrain Government International Bond 'REGS' 4.250% 25-Jan-2028 | 2.390.027 | 0,55 |
| 1.217.000 | Ball Corp 2.875% 15-Aug-2030 | 1.184.470 | 0,27 |
| 2.100.000 | Bank of Montreal 'REGS' 2.100% 15-Jun-2022 | 2.116.751 | 0,49 |
| 1.072.000 | BNP Paribas SA 'REGS' FRN (Perpetual) 7.375% 19-Aug-2025 | 1.218.805 | 0,28 |
| 1.310.000 | Bolivian Government International Bond 'REGS' 4.500% 20-Mar-2028 | 1.205.213 | 0,28 |
| 899.000 | CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.500% 01-May-2026 | 924.788 | 0,21 |
| 1.730.000 | Cemex SAB de CV 'REGS' 3.875% 11-Jul-2031 | 1.726.393 | 0,40 |
| 2.980.000 | Colombia Government International Bond 4.500% 15-Mar-2029 | 3.036.471 | 0,70 |
| 1.397.000 | CommScope Inc '144A' 6.000% 01-Mar-2026 | 1.440.789 | 0,33 |
| 1.720.000 | Credit Suisse Group AG 'REGS' FRN (Perpetual) 7.250% 12-Sep-2025 | 1.890.332 | 0,44 |
| 1.300.000 | Credit Suisse Group AG 'REGS' FRN (Perpetual) 7.500% 11-Dec-2023 | 1.407.292 | 0,33 |
| 2.090.000 | DNB Boligkreditt AS 'REGS' 2.500% 28-Mar-2022 | 2.100.624 | 0,49 |
| 1.480.000 | Dominican Republic International Bond 'REGS' 4.875% 23-Sep-2032 | 1.508.135 | 0,35 |
| 1.685.000 | Drax Finco Plc 'REGS' 6.625% 01-Nov-2025 | 1.739.324 | 0,40 |
| 126.496 | Ecuador Government International Bond 'REGS' (Zero Coupon) 0.000% 31-Jul-2030 | 71.470 | 0,02 |
| 442.650 | Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 0.500% 31-Jul-2040 | 259.227 | 0,06 |
| 965.835 | Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 1.000% 31-Jul-2035 | 636.244 | 0,15 |
| 4.850.000 | European Bank for Reconstruction & Development 'GMTN' FRN 0.239% 14-Apr-2026 | 4.856.305 | 1,12 |
| 1.340.000 | First Quantum Minerals Ltd '144A' 6.875% 01-Mar-2026 | 1.393.493 | 0,32 |
| 2.022.000 | Ford Motor Credit Co LLC 3.370% 17-Nov-2023 | 2.077.403 | 0,48 |
| 983.000 | GMR Hyderabad International Airport Ltd 'REGS' 4.250% 27-Oct-2027 | 952.616 | 0,22 |
| 1.320.000 | Greenland Global Investment Ltd 'EMTN' 6.125% 22-Apr-2023 | 1.003.200 | 0,23 |
| 3.476.000 | HSBC Bank Canada 'REGS' 0.950% 14-May-2023 | 3.483.310 | 0,80 |
| 1.145.000 | HSBC Holdings Plc FRN 0.732% 17-Aug-2024 | 1.134.976 | 0,26 |
| 1.230.000 | IHS Netherlands Holdco BV 'REGS' 8.000% 18-Sep-2027 | 1.307.183 | 0,30 |
| 2.100.000 | ING Groep NV FRN (Perpetual) 6.750% 16-Apr-2024 | 2.269.312 | 0,52 |
| 3.840.000 | Inter-American Development Bank 'GMTN' FRN 0.320% 20-Mar-2028 | 3.842.399 | 0,89 |
| 3.680.000 | International Bank for Reconstruction & Development FRN 0.440% 17-Jun-2024 | 3.706.062 | 0,86 |
| 5.010.000 | International Bank for Reconstruction & Development FRN 0.480% 19-Aug-2027 | 5.066.736 | 1,17 |
| 3.020.000 | International Finance Facility for Immunisation Co 'GMTN' 1.000% 21-Apr-2026 | 2.976.723 | 0,69 |
| 1.909.000 | Iron Mountain Inc '144A' 4.500% 15-Feb-2031 | 1.932.863 | 0,45 |
| 2.700.000 | JPMorgan Chase & Co FRN 2.083% 22-Apr-2026 | 2.739.256 | 0,63 |
| 2.684.000 | Kommunalbanken AS 'REGS' FRN 1.050% 17-Jun-2026 | 2.777.861 | 0,64 |
| 500.000 | KWG Group Holdings Ltd 7.875% 01-Sep-2023 | 385.000 | 0,09 |
| 464.000 | LCPR Senior Secured Financing DAC '144A' 5.125% 15-Jul-2029 | 471.540 | 0,11 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % |
|---------------------------------------|--|----------------------------|-----------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| US-Dollar Forts. | | | |
| 210.000 | Lloyds Banking Group Plc FRN (Perpetual) 6.750% 27-Jun-2026 | 236.824 | 0,05 |
| 1.880.000 | Lumen Technologies Inc 5.800% 15-Mar-2022 | 1.896.478 | 0,44 |
| 1.310.000 | Mausser Packaging Solutions Holding Co '144A' 5.500% 15-Apr-2024 | 1.323.716 | 0,31 |
| 1.135.000 | Millicom International Cellular SA 'REGS' 4.500% 27-Apr-2031 | 1.145.243 | 0,26 |
| 1.740.000 | Mongolia Government International Bond 'REGS' 3.500% 07-Jul-2027 | 1.642.027 | 0,38 |
| 932.000 | Mongolia Government International Bond 'REGS' 8.750% 09-Mar-2024 | 1.029.905 | 0,24 |
| 1.419.000 | Mozart Debt Merger Sub Inc '144A' 3.875% 01-Apr-2029 | 1.414.743 | 0,33 |
| 1.557.000 | NatWest Group Plc FRN (Perpetual) 6.000% 29-Dec-2025 | 1.707.749 | 0,39 |
| 1.000.000 | NatWest Group Plc FRN (Perpetual) 8.000% 10-Aug-2025 | 1.164.220 | 0,27 |
| 1.844.000 | Oman Government International Bond 'REGS' 4.875% 01-Feb-2025 | 1.922.853 | 0,44 |
| 2.070.000 | PG&E Corp 5.000% 01-Jul-2028 | 2.166.793 | 0,50 |
| 1.480.000 | Qatar Government International Bond 'REGS' 3.400% 16-Apr-2025 | 1.571.967 | 0,36 |
| 1.285.000 | Radiate Holdco LLC / Radiate Finance Inc '144A' 4.500% 15-Sep-2026 | 1.302.630 | 0,30 |
| 3.570.000 | Republic of Uzbekistan International Bond 'REGS' 4.750% 20-Feb-2024 | 3.721.264 | 0,86 |
| 600.000 | Republic of Uzbekistan International Bond 'REGS' 5.375% 20-Feb-2029 | 638.467 | 0,15 |
| 3.340.000 | Royal Bank of Canada 'GMTN' FRN 0.620% 27-Apr-2026 | 3.337.844 | 0,77 |
| 504.000 | Shimao Group Holdings Ltd 3.975% 16-Sep-2023 | 334.026 | 0,08 |
| 1.560.000 | Shimao Group Holdings Ltd 4.750% 03-Jul-2022 | 1.115.400 | 0,26 |
| 1.895.000 | Singapore Airlines Ltd 'EMTN' 3.000% 20-Jul-2026 | 1.931.291 | 0,45 |
| 2.150.000 | Societe Generale SA 'REGS' FRN (Perpetual) 7.875% 18-Dec-2023 | 2.340.813 | 0,54 |
| 1.760.000 | Stadshypotek AB 'REGS' 2.500% 05-Apr-2022 | 1.769.948 | 0,41 |
| 1.039.000 | Sunac China Holdings Ltd 7.250% 14-Jun-2022 | 782.367 | 0,18 |
| 1.271.000 | T-Mobile USA Inc 3.375% 15-Apr-2029 | 1.297.640 | 0,30 |
| 2.200.000 | UBS Group AG FRN (Perpetual) 5.000% 31-Jan-2023 | 2.206.105 | 0,51 |
| 600.000 | UniCredit SpA FRN (Perpetual) 8.000% 03-Jun-2024 | 657.363 | 0,15 |
| 13.030.000 | United States Treasury Floating Rate Note - When Issued FRN 0.120% 31-Oct-2023 | 13.033.054 | 3,01 |
| 4.126.760 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15-Jul-2031 | 4.639.456 | 1,07 |
| 4.207.972 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15-Apr-2023 | 4.402.671 | 1,02 |
| 4.360.000 | United States Treasury Note/Bond 0.500% 15-Mar-2023 | 4.362.044 | 1,01 |
| 2.078.000 | Verizon Communications Inc FRN 0.840% 20-Mar-2026 | 2.104.570 | 0,49 |
| 236.000 | Vietnam Government International Bond 'REGS' 4.800% 19-Nov-2024 | 255.925 | 0,06 |
| 990.000 | Vodafone Group Plc FRN 3.250% 04-Jun-2081 | 972.220 | 0,22 |
| 549.000 | Vodafone Group Plc FRN 7.000% 04-Apr-2079 | 664.306 | 0,15 |
| 1.837.000 | VTR Comunicaciones SpA '144A' 4.375% 15-Apr-2029 | 1.821.413 | 0,42 |
| 1.395.000 | Windstream Escrow LLC / Windstream Escrow Finance Corp '144A' 7.750% 15-Aug-2028 | 1.481.462 | 0,34 |
| 1.360.000 | Wynn Macau Ltd 'REGS' 5.500% 15-Jan-2026 | 1.268.193 | 0,29 |
| 1.840.000 | Ziggo BV '144A' 5.500% 15-Jan-2027 | 1.888.134 | 0,44 |
| Gesamtanlagen in Anleihen | | 373.771.111 | 86,32 |
| Optionen auf Futures - 217.313 | | | |
| (31. Dezember 2020: 54.375) | | | |
| 372 | U.S. 10 Year Treasury Note Future Call 18-Feb-2022 132.000 | 110.438 | 0,03 |
| 152 | U.S. Treasury Bond Future Call 18-Feb-2022 164.000 | 106.875 | 0,02 |
| Optionen auf Futures insgesamt | | 217.313 | 0,05 |

| Bestände | Beschreibung | Zugrunde liegendes Engagement USD | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % |
|---|--|-----------------------------------|------------------------------|-----------------------|
| Offene Terminkontrakte - 410.313 | | | | |
| (31. Dezember 2020: (10.800)) | | | | |
| (92) | Euro-BTP Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (15.308.186) | 184.673 | 0,04 |
| (48) | Euro-Bund Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (9.310.330) | 135.740 | 0,03 |
| (147) | U.S. 2 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (32.064.375) | 27.935 | 0,01 |
| (32) | UK Long Gilt Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (5.386.522) | 61.965 | 0,01 |
| Offene Terminkontrakte insgesamt | | | 410.313 | 0,09 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 5.430.962 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 3.068.650) | | | 5.430.962 | 1,25 |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | | 399.598.642 | 92,28 |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (1.874.889) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (5.173.432)) | | | (1.874.889) | (0,43) |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | | (1.874.889) | (0,43) |
| Nettoumlaufvermögen | | | 35.269.740 | 8,15 |
| Summe Nettovermögen | | | 432.993.493 | 100,00 |
| Der Kontrahent für Optionen auf Futures ist die UBS AG. Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist die UBS AG. | | | | |
| Portfolioanalyse | | | % des Gesamtvermögens | |
| An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | 89,69 | |
| An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente | | | 0,14 | |
| Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate) | | | 1,24 | |
| Sonstiges Umlaufvermögen | | | 8,93 | |
| Gesamtvermögen | | | 100,00 | |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte

| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|---|-------------------------|---------------|----------------|------------------|----------------------------------|-------------------------------------|
| BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 545.903 | 613.487 | 18. Feb. 22 | Barclays Bank PLC | 4.949 |
| Euro | US-Dollar | 4.600.000 | 5.167.957 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 43.238 |
| Malaysischer Ringgit | US-Dollar | 9.247.019 | 2.186.677 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 32.881 |
| Mexikanischer Peso | US-Dollar | 5.809.453 | 273.503 | 18. Feb. 22 | Barclays Bank PLC | 8.500 |
| Neuseeländischer Dollar | US-Dollar | 9.142.947 | 6.185.990 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 55.946 |
| Polnischer Zloty | US-Dollar | 18.100.000 | 4.387.081 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 58.036 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 220.715 | 293.431 | 18. Feb. 22 | The Bank of New York Mellon | 3.955 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 587.019 | 790.563 | 18. Feb. 22 | The Bank of New York Mellon | 374 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 1.009.689 | 1.358.863 | 18. Feb. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.571 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 5.959.658 | 7.965.679 | 18. Feb. 22 | Canadian Imperial Bank | 64.238 |
| US-Dollar | Australischer Dollar | 2.895.706 | 3.922.087 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 51.849 |
| US-Dollar | Australischer Dollar | 8.841.726 | 12.001.670 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 139.461 |
| US-Dollar | Kanadischer Dollar | 4.488.076 | 5.715.000 | 18. Feb. 22 | Canadian Imperial Bank | 1.483 |
| US-Dollar | Kanadischer Dollar | 24.781.879 | 30.900.475 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 523.285 |
| US-Dollar | Euro | 419.402 | 369.736 | 18. Feb. 22 | JPMorgan Chase Bank | 540 |
| US-Dollar | Euro | 208.945 | 180.074 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | 4.945 |
| US-Dollar | Euro | 108.022.551 | 93.440.910 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 2.166.281 |
| US-Dollar | Japanischer Yen | 2.395.886 | 272.580.487 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 27.259 |
| US-Dollar | Japanischer Yen | 4.385.856 | 500.283.767 | 18. Feb. 22 | Canadian Imperial Bank | 38.569 |
| US-Dollar | Koreanischer Won | 4.450.687 | 5.270.860.000 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 19.143 |
| US-Dollar | Neuseeländischer Dollar | 20.474.146 | 28.933.446 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | 721.136 |
| US-Dollar | Philippinischer Peso | 6.532.207 | 331.431.100 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 98.571 |
| US-Dollar | Sudafrikanischer Rand | 6.304.955 | 97.839.244 | 18. Feb. 22 | Citigroup Global Markets Limited | 221.903 |
| US-Dollar | Sudafrikanischer Rand | 519.850 | 8.300.000 | 18. Feb. 22 | Barclays Bank PLC | 2.750 |
| US-Dollar | Schwedische Krone | 13.283.635 | 113.910.356 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | 707.795 |
| USD | | | | | | 4.998.658 |
| Euro | US-Dollar | 1.161.848 | 1.318.490 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | (2.268) |
| Euro | US-Dollar | 880.000 | 998.469 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (1.545) |
| Euro | US-Dollar | 957.682 | 1.091.389 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (6.461) |
| Euro | US-Dollar | 6.048.494 | 6.853.458 | 18. Feb. 22 | Canadian Imperial Bank | (1.309) |
| Ungarischer Forint | US-Dollar | 2.165.969.865 | 6.912.283 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (312.033) |
| Japanischer Yen | US-Dollar | 737.002.743 | 6.537.387 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (133.096) |
| Koreanischer Won | US-Dollar | 5.270.857.000 | 4.436.375 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (4.833) |
| Neuseeländischer Dollar | US-Dollar | 12.737.227 | 8.995.539 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (299.770) |
| Schwedische Krone | US-Dollar | 41.897.813 | 4.885.906 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | (260.337) |
| Schwedische Krone | US-Dollar | 58.568.793 | 6.538.323 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (72.258) |
| US-Dollar | Tschechische Krone | 9.040.794 | 199.882.819 | 18. Feb. 22 | HSBC Bank plc | (20.975) |
| US-Dollar | Euro | 6.934.949 | 6.147.748 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (29.842) |
| US-Dollar | Euro | 6.744.972 | 5.975.337 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (24.299) |
| US-Dollar | Indische Rupie | 3.191.080 | 239.538.426 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (15.224) |
| US-Dollar | Indonesische Rupiah | 5.800.771 | 83.681.340.000 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (67.634) |
| US-Dollar | Malaysischer Ringgit | 5.486.258 | 22.998.393 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (34.036) |
| US-Dollar | Mexikanischer Peso | 1.653.315 | 34.616.762 | 18. Feb. 22 | Canadian Imperial Bank | (27.055) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 66.171.754 | 49.231.273 | 18. Feb. 22 | Canadian Imperial Bank | (161.423) |
| USD | | | | | | (1.474.198) |
| BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged) | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 2.887.484 | 3.262.806 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 6.064 |

Devisenterminkontrakte Forts.

| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|--|-----------|------------|------------|------------------|-----------------------------|-------------------------------------|
| BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged) Forts. | | | | | | |
| US-Dollar | Euro | 4.467 | 3.943 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 3 |
| USD | | | | | | 6.067 |
| EUR | | | | | | 5.360 |
| Euro | US-Dollar | 4.988 | 5.650 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (4) |
| US-Dollar | Euro | 13.349 | 11.822 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (34) |
| USD | | | | | | (38) |
| EUR | | | | | | (34) |
| BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse EUR H (Inc) (Hedged) | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 302.868 | 342.235 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 636 |
| USD | | | | | | 636 |
| EUR | | | | | | 562 |
| BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged) | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 7.184.711 | 8.118.597 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 15.089 |
| US-Dollar | Euro | 13.760 | 12.145 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 11 |
| US-Dollar | Euro | 49.368 | 43.577 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 35 |
| US-Dollar | Euro | 2.270 | 2.004 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 2 |
| USD | | | | | | 15.137 |
| EUR | | | | | | 13.374 |
| US-Dollar | Euro | 68.947 | 60.964 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (70) |
| USD | | | | | | (70) |
| EUR | | | | | | (62) |
| BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse EUR I (Inc) (Hedged) | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 1.369.081 | 1.547.038 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 2.875 |
| US-Dollar | Euro | 24.954 | 22.027 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 17 |
| USD | | | | | | 2.892 |
| EUR | | | | | | 2.555 |
| BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse EUR W (Hedged) | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 58.057.234 | 65.603.657 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 121.928 |
| Euro | US-Dollar | 11.552.610 | 13.061.764 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 16.745 |
| US-Dollar | Euro | 28.270 | 24.950 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 25 |
| USD | | | | | | 138.698 |
| EUR | | | | | | 122.541 |
| US-Dollar | Euro | 13.057.843 | 11.552.610 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (17.983) |
| Euro | US-Dollar | 159.500 | 180.696 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (129) |
| US-Dollar | Euro | 2.820 | 2.498 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (8) |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte Forts.

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

BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse EUR W (Hedged) Forts.

| | | | | | | |
|-----------|------|---------|---------|-------------|-----------------------------|---------------------|
| US-Dollar | Euro | 142.372 | 125.900 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (157) |
| | | | | | | USD (18.277) |
| | | | | | | EUR (16.148) |

BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged)

| | | | | | | |
|-----------|-----------|------------|------------|-------------|-----------------------------|-------------------|
| US-Dollar | Euro | 3.989 | 3.522 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 3 |
| Euro | US-Dollar | 2.271 | 2.568 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 3 |
| Euro | US-Dollar | 12.552 | 14.174 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 36 |
| Euro | US-Dollar | 2.510 | 2.832 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 10 |
| Euro | US-Dollar | 378 | 426 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1 |
| Euro | US-Dollar | 10.195.482 | 11.520.716 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 21.412 |
| | | | | | | USD 21.465 |
| | | | | | | EUR 18.965 |
| Euro | US-Dollar | 3.414 | 3.868 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (3) |
| Euro | US-Dollar | 3.522 | 3.990 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (3) |
| US-Dollar | Euro | 6.170 | 5.471 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (23) |
| | | | | | | USD (29) |
| | | | | | | EUR (26) |

BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse JPY X (Acc) (Hedged)

| | | | | | | |
|-----------------|-----------|---------------|------------|-------------|-----------------------------|-------------------------|
| Japanischer Yen | US-Dollar | 2.020.449.147 | 17.809.204 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (256.983) |
| | | | | | | USD (256.983) |
| | | | | | | JPY (29.583.883) |

BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse JPY X (Inc) (Hedged)

| | | | | | | |
|-----------------|-----------------|-------------|-----------|-------------|-----------------------------|-------------------------|
| US-Dollar | Japanischer Yen | 13.067 | 1.485.179 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 164 |
| | | | | | | USD 164 |
| | | | | | | JPY 18.880 |
| Japanischer Yen | US-Dollar | 984.910.965 | 8.681.476 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (125.272) |
| | | | | | | USD (125.272) |
| | | | | | | JPY (14.421.313) |

BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse SGD I (Acc) (Hedged)

| | | | | | | |
|-----------------|-----------|--------|-------|-------------|-----------------------------|----------------|
| Singapur-Dollar | US-Dollar | 10.007 | 7.330 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 83 |
| | | | | | | USD 83 |
| | | | | | | SGD 112 |

BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)

| | | | | | | |
|----------------|----------------|-------|-------|-------------|-----------------------------|---|
| Pfund Sterling | US-Dollar | 2.350 | 3.158 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 9 |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 46 | 34 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 49 | 65 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1 |

Devisenterminkontrakte Forts.

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

BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged) Forts.

| | | | | | | |
|----------------|-----------|-----------|------------|-------------|-----------------------------|--------------------|
| Pfund Sterling | US-Dollar | 94 | 124 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 3 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 34 | 46 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 631 | 848 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 2 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 8.726.183 | 11.512.601 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 246.533 |
| | | | | | | USD 246.548 |
| | | | | | | GBP 182.953 |

| | | | | | | |
|-----------|----------------|-------|-------|-------------|-----------------------------|-----------------|
| US-Dollar | Pfund Sterling | 848 | 631 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (2) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 233 | 173 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 833 | 627 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (11) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 3.159 | 2.350 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (8) |
| | | | | | | USD (22) |
| | | | | | | GBP (16) |

BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse Sterling Z (Acc) (Hedged)

| | | | | | | |
|----------------|-----------|--------|--------|-------------|-----------------------------|----------------|
| Pfund Sterling | US-Dollar | 10.855 | 14.321 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 307 |
| | | | | | | USD 307 |
| | | | | | | GBP 228 |

BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse Sterling Z (Inc) (Hedged)

| | | | | | | |
|----------------|-----------|--------|--------|-------------|-----------------------------|----------------|
| Pfund Sterling | US-Dollar | 10.856 | 14.322 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 307 |
| | | | | | | USD 307 |
| | | | | | | GBP 228 |

BNY MELLON GLOBAL EMERGING MARKETS FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|--|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Aktien | | | |
| Argentinien - 2.751.785 | | | |
| (31. Dezember 2020: 2.538.888) | | | |
| 4.848 | Globant SA | 1.528.817 | 2,88 |
| 902 | MercadoLibre Inc | 1.222.968 | 2,31 |
| Brasilien - 590.098 | | | |
| (31. Dezember 2020: 230.741) | | | |
| 295.049 | B3 SA - Brasil Bolsa Balcão | 590.098 | 1,11 |
| China - 18.389.535 | | | |
| (31. Dezember 2020: 20.093.835) | | | |
| 81.172 | Alibaba Group Holding Ltd | 1.237.094 | 2,33 |
| 10.263 | Autohome Inc ADR | 303.323 | 0,57 |
| 6.871 | Bilibili Inc ADR | 328.159 | 0,62 |
| 351.200 | By-health Co Ltd | 1.485.341 | 2,80 |
| 333.000 | China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd | 443.667 | 0,84 |
| 163.000 | Flat Glass Group Co Ltd 'H' | 827.191 | 1,56 |
| 52.300 | Foshan Haitian Flavouring & Food Co Ltd 'A' | 862.496 | 1,63 |
| 138.000 | Kingdee International Software Group Co Ltd | 424.263 | 0,80 |
| 102.580 | LONGi Green Energy Technology Co Ltd 'A' | 1.387.321 | 2,62 |
| 34.669 | Meituan '144A' | 1.002.502 | 1,89 |
| 166.400 | NARI Technology Co Ltd 'A' | 1.045.262 | 1,97 |
| 41.800 | Pharmaron Beijing Co Ltd 'H' '144A' | 645.357 | 1,22 |
| 163.000 | Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H' | 1.174.162 | 2,21 |
| 136.200 | Shenzhen Inovance Technology Co Ltd | 1.466.105 | 2,76 |
| 9.400 | StarPower Semiconductor Ltd 'A' | 561.904 | 1,06 |
| 34.100 | Sungrow Power Supply Co Ltd | 780.116 | 1,47 |
| 42.248 | Tencent Holdings Ltd | 2.474.198 | 4,66 |
| 104.787 | Tencent Music Entertainment Group ADR | 718.315 | 1,35 |
| 24.815 | Yum China Holdings Inc | 1.222.759 | 2,31 |
| Hongkong - 1.911.597 | | | |
| (31. Dezember 2020: 2.500.173) | | | |
| 189.600 | AIA Group Ltd | 1.911.597 | 3,61 |
| Ungarn - 509.442 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 10.013 | OTP Bank Nyrt | 509.442 | 0,96 |
| Indien - 13.962.309 | | | |
| (31. Dezember 2020: 12.797.858) | | | |
| 29.255 | Asian Paints Ltd | 1.331.930 | 2,51 |
| 70.935 | Godrej Consumer Products Ltd | 923.216 | 1,74 |
| 13.833 | HDFC Asset Management Co Ltd '144A' | 455.637 | 0,86 |
| 48.531 | HDFC Bank Ltd | 966.743 | 1,83 |
| 32.446 | Hindustan Unilever Ltd | 1.030.354 | 1,94 |
| 67.892 | Housing Development Finance Corp Ltd | 2.361.678 | 4,45 |
| 24.313 | Info Edge India Ltd | 1.823.099 | 3,44 |
| 24.058 | Jubilant Foodworks Ltd | 1.161.520 | 2,19 |
| 11.684 | Maruti Suzuki India Ltd | 1.166.425 | 2,20 |
| 43.625 | PB Fintech Ltd | 560.383 | 1,06 |
| 32.086 | Tata Consultancy Services Ltd | 1.613.663 | 3,04 |
| 16.751 | Titan Co Ltd | 567.661 | 1,07 |
| Japan - 1.240.358 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 13.100 | Advantest Corp | 1.240.358 | 2,34 |
| Mexiko - 876.155 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 234.788 | Wal-Mart de Mexico SAB de CV | 876.155 | 1,65 |
| Niederlande - 1.430.921 | | | |
| (31. Dezember 2020: 826.842) | | | |
| 1.784 | ASML Holding NV | 1.430.921 | 2,70 |
| Republik Korea - 2.966.900 | | | |
| (31. Dezember 2020: 4.367.637) | | | |
| 1.389 | LG Chem Ltd | 719.184 | 1,36 |
| 421 | LG Household & Health Care Ltd | 388.329 | 0,73 |
| 3.372 | Samsung SDI Co Ltd | 1.859.387 | 3,50 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|--|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Aktien Forts. | | | |
| Russland - 870.050 | | | |
| (31. Dezember 2020: 396.567) | | | |
| 16.785 | HeadHunter Group Plc ADR | 870.050 | 1,64 |
| Südafrika - 595.960 | | | |
| (31. Dezember 2020: 970.777) | | | |
| 30.089 | Clicks Group Ltd | 595.960 | 1,12 |
| Taiwan - 3.539.433 | | | |
| (31. Dezember 2020: 3.329.481) | | | |
| 40.000 | Elite Material Co Ltd | 402.646 | 0,76 |
| 141.000 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | 3.136.787 | 5,91 |
| Vereinigte Staaten von Amerika - 2.849.029 | | | |
| (31. Dezember 2020: 2.586.230) | | | |
| 2.432 | EPAM Systems Inc | 1.636.906 | 3,09 |
| 48.945 | Livent Corp | 1.212.123 | 2,28 |
| Gesamtanlagen in Aktien | | 52.483.572 | 98,95 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 2.329 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 28.662) | | 2.329 | 0,00 |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | 52.485.901 | 98,95 |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (255) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (2.162)) | | (255) | (0,00) |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | (255) | (0,00) |
| Nettoumlaufvermögen | | 554.036 | 1,05 |
| Summe Nettovermögen | | 53.039.682 | 100,00 |
| Portfolioanalyse | | | |
| | | | % des Gesamtvermögens |
| An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | 98,47 |
| Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate) | | | 0,00 |
| Sonstiges Umlaufvermögen | | | 1,53 |
| Gesamtvermögen | | | 100,00 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Devisenterminkontrakte | | | | | | | Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) |
|---|----------------------|------------|------------|------------------|-----------------------------|--------------|--------------------------------------|
| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | | |
| BNY Mellon Global Emerging Markets Fund | | | | | | | |
| US-Dollar | Brasilianischer Real | 7.886 | 44.096 | 3. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (31) | |
| Euro | US-Dollar | 3.159 | 3.581 | 4. Jan. 22 | State Street Bank | (5) | |
| USD | | | | | | (36) | |
| BNY Mellon Global Emerging Markets Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged) | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 3.152 | 3.568 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - | |
| Euro | US-Dollar | 555.009 | 627.151 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.166 | |
| US-Dollar | Euro | 6.880 | 6.075 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 3 | |
| USD | | | | | | 1.169 | |
| EUR | | | | | | 1.033 | |
| Euro | US-Dollar | 1.190 | 1.348 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) | |
| Euro | US-Dollar | 4.713 | 5.338 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (2) | |
| Euro | US-Dollar | 6.844 | 7.756 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (8) | |
| US-Dollar | Euro | 3.710 | 3.286 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (10) | |
| US-Dollar | Euro | 10.191 | 9.015 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (15) | |
| US-Dollar | Euro | 11.241 | 9.959 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (34) | |
| US-Dollar | Euro | 7.372 | 6.534 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (25) | |
| US-Dollar | Euro | 5.445 | 4.828 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (20) | |
| USD | | | | | | (115) | |
| EUR | | | | | | (102) | |
| BNY Mellon Global Emerging Markets Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged) | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 3.144 | 3.559 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - | |
| Euro | US-Dollar | 550.958 | 622.573 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.157 | |
| US-Dollar | Euro | 6.813 | 6.015 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 3 | |
| USD | | | | | | 1.160 | |
| EUR | | | | | | 1.025 | |
| Euro | US-Dollar | 4.724 | 5.350 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (2) | |
| Euro | US-Dollar | 6.851 | 7.764 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (8) | |
| US-Dollar | Euro | 10.069 | 8.908 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (15) | |
| US-Dollar | Euro | 11.144 | 9.874 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (34) | |
| US-Dollar | Euro | 7.302 | 6.472 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (25) | |
| US-Dollar | Euro | 5.339 | 4.734 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (20) | |
| USD | | | | | | (104) | |
| EUR | | | | | | (92) | |

BNY MELLON GLOBAL EQUITY FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Summe Beizulegender Zeitwert USD | Nettover- mögen % |
|--|---|---|-------------------------|
| Aktien | | | |
| China - 9.597.381 | | | |
| (31. Dezember 2020: 23.105.318) | | | |
| 372.136 | Alibaba Group Holding Ltd | 5.671.503 | 1,12 |
| 545.000 | Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H' | 3.925.878 | 0,78 |
| Dänemark - 6.457.303 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 78.687 | Novozymes A/S | 6.457.303 | 1,28 |
| Frankreich - 9.829.857 | | | |
| (31. Dezember 2020: 15.747.284) | | | |
| 12.221 | L'Oreal SA | 5.796.789 | 1,14 |
| 299.370 | Vivendi SE | 4.033.068 | 0,80 |
| Deutschland - 27.095.077 | | | |
| (31. Dezember 2020: 33.513.913) | | | |
| 70.219 | Bayer AG | 3.740.206 | 0,74 |
| 44.859 | Continental AG | 4.729.568 | 0,93 |
| 67.875 | Deutsche Post AG | 4.329.052 | 0,86 |
| 62.736 | SAP SE | 8.829.106 | 1,75 |
| 27.222 | Volkswagen AG - Preference | 5.467.145 | 1,08 |
| Hongkong - 9.344.239 | | | |
| (31. Dezember 2020: 11.960.555) | | | |
| 926.800 | AIA Group Ltd | 9.344.239 | 1,85 |
| Indien - 4.858.119 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 243.880 | HDFC Bank Ltd | 4.858.119 | 0,96 |
| Japan - 30.805.605 | | | |
| (31. Dezember 2020: 25.621.448) | | | |
| 121.600 | Ebara Corp | 6.749.687 | 1,34 |
| 113.500 | Sony Group Corp | 14.283.628 | 2,82 |
| 62.800 | Sugi Holdings Co Ltd | 3.802.259 | 0,75 |
| 155.000 | Suzuki Motor Corp | 5.970.031 | 1,18 |
| Niederlande - 29.642.398 | | | |
| (31. Dezember 2020: 18.944.103) | | | |
| 354.493 | Relx Plc | 11.429.123 | 2,26 |
| 255.356 | Royal Dutch Shell Plc | 5.576.155 | 1,10 |
| 299.370 | Universal Music Group NV | 8.409.213 | 1,66 |
| 36.222 | Wolters Kluwer NV | 4.227.907 | 0,84 |
| Republik Korea - 10.067.267 | | | |
| (31. Dezember 2020: 12.826.694) | | | |
| 18.257 | Samsung SDI Co Ltd | 10.067.267 | 1,99 |
| Schweden - 8.247.164 | | | |
| (31. Dezember 2020: 7.102.262) | | | |
| 410.165 | Swedbank AB | 8.247.164 | 1,63 |
| Schweiz - 22.483.144 | | | |
| (31. Dezember 2020: 18.670.383) | | | |
| 8.310 | Lonza Group AG | 6.932.888 | 1,37 |
| 61.232 | Novartis AG | 5.384.794 | 1,06 |
| 24.477 | Roche Holding AG | 10.165.462 | 2,01 |
| Taiwan - 10.057.655 | | | |
| (31. Dezember 2020: 9.557.605) | | | |
| 83.518 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR | 10.057.655 | 1,99 |
| Vereinigtes Königreich - 42.158.906 | | | |
| (31. Dezember 2020: 35.044.789) | | | |
| 122.545 | Associated British Foods Plc | 3.306.138 | 0,65 |
| 2.472.817 | Barclays Plc | 6.232.865 | 1,23 |
| 208.498 | Diageo Plc | 11.297.887 | 2,24 |
| 66.982 | Ferguson Plc | 11.817.945 | 2,34 |
| 469.065 | Informa Plc | 3.244.001 | 0,64 |
| 118.117 | Unilever Plc | 6.260.070 | 1,24 |

| Bestände | Beschreibung | Summe Beizulegender Zeitwert USD | Nettover- mögen % |
|--|-----------------------------|---|-------------------------|
| Aktien Forts. | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika - 276.734.432 | | | |
| (31. Dezember 2020: 210.572.063) | | | |
| 107.790 | Abbott Laboratories | 15.198.929 | 3,00 |
| 40.525 | Accenture Plc - Class A | 16.775.526 | 3,32 |
| 25.599 | Albemarle Corp | 6.002.582 | 1,19 |
| 8.449 | Alphabet Inc - Class A | 24.706.566 | 4,88 |
| 108.885 | Altria Group Inc | 5.144.816 | 1,02 |
| 5.746 | Amazon.com Inc | 19.386.257 | 3,83 |
| 164.253 | Apple Inc | 29.274.812 | 5,79 |
| 85.376 | Applied Materials Inc | 13.486.847 | 2,67 |
| 157.943 | Citigroup Inc | 9.543.706 | 1,89 |
| 37.953 | CME Group Inc | 8.676.625 | 1,71 |
| 14.802 | Cooper Cos Inc/The | 6.278.860 | 1,24 |
| 18.118 | Costco Wholesale Corp | 10.218.371 | 2,02 |
| 40.160 | Dollar General Corp | 9.471.535 | 1,87 |
| 21.202 | Ecolab Inc | 4.962.222 | 0,98 |
| 40.303 | Eversource Energy | 3.673.014 | 0,73 |
| 67.242 | General Electric Co | 6.368.826 | 1,26 |
| 20.731 | Goldman Sachs Group Inc/The | 7.991.593 | 1,58 |
| 42.207 | JPMorgan Chase & Co | 6.687.066 | 1,32 |
| 27.792 | Mastercard Inc | 10.036.803 | 1,98 |
| 72.456 | Medtronic Plc | 7.571.290 | 1,50 |
| 89.941 | Microsoft Corp | 30.521.029 | 6,03 |
| 29.657 | Norfolk Southern Corp | 8.741.252 | 1,73 |
| 48.352 | TE Connectivity Ltd | 7.767.024 | 1,54 |
| 43.555 | Texas Instruments Inc | 8.248.881 | 1,63 |
| Gesamtanlagen in Aktien | | 497.378.547 | 98,34 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 1.152 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 398.999) | | 1.152 | 0,00 |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | 497.379.699 | 98,34 |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (92) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (386.114)) | | (92) | (0,00) |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | (92) | (0,00) |
| Nettoumlaufvermögen | | 8.392.549 | 1,66 |
| Summe Nettovermögen | | 505.772.156 | 100,00 |
| Portfolioanalyse | | | |
| % des Gesamtvermögens | | | |
| An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | 98,22 | |
| Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate) | | 0,00 | |
| Sonstiges Umlaufvermögen | | 1,78 | |
| Gesamtvermögen | | 100,00 | |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Devisenterminkontrakte | | | | | | | Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) |
|---|----------------------|------------|------------|------------------|-----------------------------|-------------|--------------------------------------|
| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | | |
| BNY Mellon Global Equity Fund Anteilsklasse AUD I (Acc) (Hedged) | | | | | | | |
| Australischer Dollar | US-Dollar | 279 | 202 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - | |
| Australischer Dollar | US-Dollar | 200 | 144 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - | |
| Australischer Dollar | US-Dollar | 111 | 80 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1 | |
| Australischer Dollar | US-Dollar | 229 | 165 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1 | |
| Australischer Dollar | US-Dollar | 105 | 75 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 2 | |
| Australischer Dollar | US-Dollar | 16.774 | 11.989 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 172 | |
| USD | | | | | | 176 | |
| AUD | | | | | | 243 | |
| US-Dollar | Australischer Dollar | 158 | 221 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (3) | |
| US-Dollar | Australischer Dollar | 102 | 142 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) | |
| US-Dollar | Australischer Dollar | 107 | 150 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (2) | |
| US-Dollar | Australischer Dollar | 121 | 171 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (2) | |
| US-Dollar | Australischer Dollar | 68 | 94 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) | |
| USD | | | | | | (9) | |
| AUD | | | | | | (12) | |
| BNY Mellon Global Equity Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged) | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 2.915 | 3.297 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 3 | |
| Euro | US-Dollar | 462.777 | 522.930 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 972 | |
| US-Dollar | Euro | 2.848 | 2.514 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1 | |
| USD | | | | | | 976 | |
| EUR | | | | | | 862 | |
| Euro | US-Dollar | 7.642 | 8.669 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (17) | |
| Euro | US-Dollar | 5.554 | 6.290 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (3) | |
| Euro | US-Dollar | 3.031 | 3.434 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (3) | |
| Euro | US-Dollar | 6.337 | 7.174 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) | |
| US-Dollar | Euro | 4.708 | 4.173 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (16) | |
| US-Dollar | Euro | 5.360 | 4.752 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (20) | |
| US-Dollar | Euro | 6.925 | 6.126 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (10) | |
| US-Dollar | Euro | 4.442 | 3.935 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (13) | |
| USD | | | | | | (83) | |
| EUR | | | | | | (73) | |

BNY MELLON GLOBAL EQUITY INCOME FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Nettovermögen % | Summe |
|--|---|----------------------------|-----------------|-------|
| Aktien | | | | |
| Australien - 3.774.322 | | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | | |
| 1.217.768 | Insurance Australia Group Ltd | 3.774.322 | 0,92 | |
| Bermudas - 4.311.089 | | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | | |
| 34.446 | Credicorp Ltd | 4.311.089 | 1,05 | |
| China - 4.995.590 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 12.918.477) | | | | |
| 693.500 | Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H' | 4.995.590 | 1,21 | |
| Frankreich - 15.315.030 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 29.114.204) | | | | |
| 86.152 | Sanofi | 8.630.226 | 2,10 | |
| 132.105 | TotalEnergies SE | 6.684.804 | 1,63 | |
| Deutschland - 30.741.852 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 33.404.869) | | | | |
| 138.794 | Bayer AG | 7.392.845 | 1,80 | |
| 59.616 | Continental AG | 6.285.426 | 1,53 | |
| 36.725 | Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen | 10.828.257 | 2,63 | |
| 9.980 | Vitesco Technologies Group AG | 486.005 | 0,12 | |
| 28.627 | Volkswagen AG - Preference | 5.749.319 | 1,40 | |
| Hongkong - 4.748.028 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 10.399.532) | | | | |
| 539.749 | Link REIT (Units) (REIT) | 4.748.028 | 1,15 | |
| Indien - 15.210.395 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 29.586.440) | | | | |
| 598.481 | Infosys Ltd ADR | 15.210.395 | 3,70 | |
| Irland - 6.383.495 | | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | | |
| 61.089 | Medtronic Plc | 6.383.495 | 1,55 | |
| Japan - 4.127.328 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 14.093.351) | | | | |
| 141.200 | KDDI Corp | 4.127.328 | 1,00 | |
| Niederlande - 5.851.801 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 7.717.018) | | | | |
| 267.979 | Royal Dutch Shell Plc | 5.851.801 | 1,42 | |
| Republik Korea - 9.268.104 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 36.913.952) | | | | |
| 154.631 | Samsung Electronics Co Ltd - Preference | 9.268.104 | 2,25 | |
| Spanien - 8.060.079 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 18.748.422) | | | | |
| 249.646 | Industria de Diseno Textil SA | 8.060.079 | 1,96 | |
| Schweden - 7.709.802 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 30.688.608) | | | | |
| 713.137 | Svenska Handelsbanken AB | 7.709.802 | 1,88 | |
| Schweiz - 47.457.512 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 104.829.728) | | | | |
| 59.382 | Cie Financiere Richemont SA | 8.917.056 | 2,17 | |
| 60.997 | Nestle SA | 8.516.197 | 2,07 | |
| 118.999 | Novartis AG | 10.464.874 | 2,54 | |
| 27.022 | Roche Holding AG | 11.222.417 | 2,73 | |
| 19.003 | Zurich Insurance Group AG | 8.336.968 | 2,03 | |
| Vereinigtes Königreich - 79.201.790 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 118.409.189) | | | | |
| 156.276 | Anglo American Plc | 6.364.261 | 1,55 | |
| 1.168.306 | BAE Systems Plc | 8.660.830 | 2,11 | |
| 218.984 | British American Tobacco Plc | 8.026.802 | 1,95 | |
| 77.423 | British American Tobacco Plc ADR | 2.883.620 | 0,70 | |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Nettovermögen % | Summe |
|--|--|----------------------------|-----------------|------------------------------|
| Aktien Forts. | | | | |
| Vereinigtes Königreich Forts. | | | | |
| 155.370 | Bunzl Plc | 6.035.285 | 1,47 | |
| 1.157.057 | Informa Plc | 8.002.076 | 1,95 | |
| 480.696 | RELX Plc | 15.498.288 | 3,77 | |
| 546.567 | Sage Group Plc/The | 6.298.274 | 1,53 | |
| 2.693.440 | Taylor Wimpey Plc | 6.366.462 | 1,55 | |
| 208.932 | Unilever Plc | 11.065.892 | 2,69 | |
| Vereinigte Staaten von Amerika - 158.131.073 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 299.001.064) | | | | |
| 280.335 | Cisco Systems Inc/Delaware | 17.834.913 | 4,34 | |
| 110.400 | Citigroup Inc | 6.670.920 | 1,62 | |
| 33.309 | CME Group Inc | 7.614.937 | 1,85 | |
| 156.811 | CMS Energy Corp | 10.207.612 | 2,48 | |
| 104.643 | Dominion Energy Inc | 8.211.859 | 2,00 | |
| 116.770 | Emerson Electric Co | 10.820.492 | 2,63 | |
| 102.580 | Eversource Energy | 9.348.628 | 2,28 | |
| 16.502 | Hubbell Inc - Class B | 3.422.020 | 0,83 | |
| 70.144 | JPMorgan Chase & Co | 11.113.265 | 2,70 | |
| 101.434 | Merck & Co Inc | 7.825.126 | 1,90 | |
| 120.416 | Organon & Co | 3.699.782 | 0,90 | |
| 38.378 | Paychex Inc | 5.237.638 | 1,28 | |
| 86.019 | PepsiCo Inc | 14.853.761 | 3,61 | |
| 65.397 | Philip Morris International Inc | 6.165.302 | 1,50 | |
| 97.559 | Principal Financial Group Inc | 7.034.979 | 1,71 | |
| 47.217 | Procter & Gamble Co/The | 7.686.219 | 1,87 | |
| 43.636 | QUALCOMM Inc | 7.976.006 | 1,94 | |
| 80.873 | Sysco Corp | 6.308.498 | 1,54 | |
| 32.204 | Texas Instruments Inc | 6.099.116 | 1,49 | |
| Gesamtanlagen in Aktien | | 405.287.290 | 98,58 | |
| Optionsscheine | | | | |
| Schweiz - 566.286 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 139.320) | | | | |
| 522.242 | Cie Financiere Richemont SA (WTS) 22-Nov-2023 | 566.286 | 0,14 | |
| Gesamtanlagen in Optionsscheinen | | 566.286 | 0,14 | |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 33.009 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 375.646) | | 33.009 | 0,01 | |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | 405.886.585 | 98,73 | |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (2.591) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (9.834)) | | (2.591) | (0,00) | |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | (2.591) | (0,00) | |
| Nettoumlaufvermögen | | 5.217.305 | 1,27 | |
| Summe Nettovermögen | | 411.101.299 | 100,00 | |
| Portfolioanalyse | | | | |
| | | | | % des Gesamtvermögens |
| An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | | 98,43 |
| Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate) | | | | 0,01 |
| Sonstiges Umlaufvermögen | | | | 1,56 |
| Gesamtvermögen | | | | 100,00 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Devisenterminkontrakte | | | | | | | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|--|-----------|------------|------------|------------------|-----------------------------|--|-------------------------------------|
| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | | |
| BNY Mellon Global Equity Income Fund | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 433.178 | 490.973 | 4. Jan. 22 | State Street Bank | | (680) |
| | | | | | USD | | (680) |
| BNY Mellon Global Equity Income Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged) | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 5.244.233 | 5.925.892 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 11.014 |
| Euro | US-Dollar | 28.714 | 32.497 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 10 |
| Euro | US-Dollar | 9.988 | 11.294 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 13 |
| | | | | | USD | | 11.037 |
| | | | | | EUR | | 9.751 |
| Euro | US-Dollar | 53.718 | 60.931 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (117) |
| Euro | US-Dollar | 54.197 | 61.380 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (25) |
| Euro | US-Dollar | 49.732 | 56.358 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (57) |
| Euro | US-Dollar | 71.942 | 81.453 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (9) |
| US-Dollar | Euro | 89.993 | 79.611 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (133) |
| US-Dollar | Euro | 45.245 | 40.102 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (153) |
| | | | | | USD | | (494) |
| | | | | | EUR | | (436) |
| BNY Mellon Global Equity Income Fund Anteilsklasse EUR H (Inc) (Hedged) | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 7.752.462 | 8.760.147 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 16.281 |
| Euro | US-Dollar | 41.691 | 47.184 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 14 |
| Euro | US-Dollar | 20.000 | 22.584 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 58 |
| Euro | US-Dollar | 19.188 | 21.699 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 24 |
| US-Dollar | Euro | 61.952 | 54.675 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 55 |
| | | | | | USD | | 16.432 |
| | | | | | EUR | | 14.518 |
| Euro | US-Dollar | 77.999 | 88.472 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (170) |
| Euro | US-Dollar | 78.694 | 89.125 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (36) |
| Euro | US-Dollar | 73.190 | 82.941 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (84) |
| Euro | US-Dollar | 105.601 | 119.561 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (13) |
| US-Dollar | Euro | 121.745 | 107.650 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (123) |
| US-Dollar | Euro | 132.174 | 116.926 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (195) |
| US-Dollar | Euro | 66.441 | 58.888 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (225) |
| | | | | | USD | | (846) |
| | | | | | EUR | | (747) |
| BNY Mellon Global Equity Income Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged) | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 2.516.206 | 2.843.269 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 5.284 |
| Euro | US-Dollar | 13.306 | 15.059 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 5 |
| US-Dollar | Euro | 25.305 | 22.335 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 21 |
| | | | | | USD | | 5.310 |
| | | | | | EUR | | 4.691 |

| Devisenterminkontrakte Forts. | | | | | | | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|---|-----------|------------|------------|------------------|-----------------------------|--|-------------------------------------|
| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | | |
| BNY Mellon Global Equity Income Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged) Forts. | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 10.195 | 11.549 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (8) |
| Euro | US-Dollar | 25.111 | 28.483 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (55) |
| Euro | US-Dollar | 25.274 | 28.624 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (12) |
| Euro | US-Dollar | 23.266 | 26.366 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (27) |
| Euro | US-Dollar | 33.584 | 38.023 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (4) |
| US-Dollar | Euro | 41.526 | 36.735 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (61) |
| US-Dollar | Euro | 20.666 | 18.316 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (70) |
| US-Dollar | Euro | 94.495 | 83.757 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (324) |
| | | | | | USD | | (561) |
| | | | | | EUR | | (496) |
| BNY Mellon Global Equity Income Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged) | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 513 | 581 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | - |
| Euro | US-Dollar | 109.581 | 123.824 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 230 |
| Euro | US-Dollar | 603 | 682 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | - |
| Euro | US-Dollar | 1.507 | 1.707 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | - |
| US-Dollar | Euro | 581 | 513 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | - |
| | | | | | USD | | 230 |
| | | | | | EUR | | 203 |
| Euro | US-Dollar | 1.140 | 1.293 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (2) |
| Euro | US-Dollar | 1.135 | 1.285 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (1) |
| Euro | US-Dollar | 1.045 | 1.184 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (1) |
| US-Dollar | Euro | 1.860 | 1.646 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (3) |
| US-Dollar | Euro | 920 | 816 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (3) |
| | | | | | USD | | (10) |
| | | | | | EUR | | (9) |

BNY MELLON GLOBAL HIGH YIELD BOND FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|---------------------------------------|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen | | | |
| Australien - 263.557 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 250.000 | FMG Resources August 2006 Pty Ltd '144A' 4.375% 01-Apr-2031 | 263.557 | 0,16 |
| Belgien - 374.079 | | | |
| (31. Dezember 2020: 142.831) | | | |
| 325.000 | House of Finance NV/The 'REGS' 4.375% 15-Jul-2026 | 374.079 | 0,22 |
| Bermudas - 327.302 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 119.000 | NCL Corp Ltd '144A' 5.875% 15-Mar-2026 | 118.263 | 0,07 |
| 210.000 | NCL Finance Ltd '144A' 6.125% 15-Mar-2028 | 209.039 | 0,13 |
| Kanada - 2.959.724 | | | |
| (31. Dezember 2020: 5.015.480) | | | |
| 267.000 | Bausch Health Cos Inc '144A' 4.875% 01-Jun-2028 | 274.174 | 0,17 |
| 235.000 | Bausch Health Cos Inc '144A' 5.250% 30-Jan-2030 | 207.164 | 0,12 |
| 100.000 | Bausch Health Cos Inc '144A' 6.250% 15-Feb-2029 | 95.950 | 0,06 |
| 180.000 | Bausch Health Cos Inc '144A' 7.250% 30-May-2029 | 178.825 | 0,11 |
| 277.000 | Bombardier Inc '144A' 6.000% 15-Feb-2028 | 278.233 | 0,17 |
| 400.000 | Hudbay Minerals Inc '144A' 4.500% 01-Apr-2026 | 399.460 | 0,24 |
| 304.000 | Hudbay Minerals Inc '144A' 6.125% 01-Apr-2029 | 322.932 | 0,19 |
| 520.000 | Husky III Holding Ltd '144A' 13.000% 15-Feb-2025 | 549.385 | 0,33 |
| 650.000 | NOVA Chemicals Corp '144A' 4.250% 15-May-2029 | 653.601 | 0,39 |
| Dänemark - 464.011 | | | |
| (31. Dezember 2020: 583.839) | | | |
| 415.000 | Norican A/S 4.500% 15-May-2023 | 464.011 | 0,28 |
| Finnland - 619.534 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 420.000 | Ahlstrom-Munksjo Holding 3 Oy '144A' 4.875% 04-Feb-2028 | 414.954 | 0,25 |
| 180.000 | Ahlstrom-Munksjo Holding 3 Oy 'REGS' 3.625% 04-Feb-2028 | 204.580 | 0,12 |
| Frankreich - 5.229.963 | | | |
| (31. Dezember 2020: 3.729.354) | | | |
| 415.000 | Altice France SA/France '144A' 5.125% 15-Jul-2029 | 404.791 | 0,24 |
| 585.000 | Altice France SA/France '144A' 5.500% 15-Oct-2029 | 577.222 | 0,35 |
| 430.000 | CAB SELAS 'REGS' 3.375% 01-Feb-2028 | 488.010 | 0,29 |
| 290.000 | Chrome Holdco SASU 'REGS' 5.000% 31-May-2029 | 331.389 | 0,20 |
| 600.000 | Electricite de France SA FRN (Perpetual) 3.375% 15-Jun-2030 | 702.370 | 0,42 |
| 570.000 | Faurecia SE 2.750% 15-Feb-2027 | 639.916 | 0,39 |
| 325.000 | Kapla Holding SAS 'REGS' 3.375% 15-Dec-2026 | 367.682 | 0,22 |
| 180.000 | La Financiere Atalian SASU 'REGS' 4.000% 15-May-2024 | 200.797 | 0,12 |
| 280.000 | La Financiere Atalian SASU 'REGS' 5.125% 15-May-2025 | 315.521 | 0,19 |
| 355.000 | Picard Groupe SAS 'REGS' 3.875% 01-Jul-2026 | 408.272 | 0,25 |
| 400.000 | Renault SA 'EMTN' 2.500% 02-Jun-2027 | 455.341 | 0,27 |
| 300.000 | Renault SA 'EMTN' 2.500% 01-Apr-2028 | 338.652 | 0,20 |
| Deutschland - 4.789.218 | | | |
| (31. Dezember 2020: 3.262.230) | | | |
| 355.000 | Cheplapharm Arzneimittel GmbH '144A' 5.500% 15-Jan-2028 | 359.942 | 0,22 |
| 385.000 | Cheplapharm Arzneimittel GmbH 'REGS' 4.375% 15-Jan-2028 | 455.718 | 0,27 |
| 205.000 | IHO Verwaltungs GmbH '144A' 6.375% 15-May-2029 | 220.775 | 0,13 |
| 635.000 | Nidda BondCo GmbH 'REGS' 5.000% 30-Sep-2025 | 716.317 | 0,43 |
| 265.000 | Nidda Healthcare Holding GmbH 'REGS' 3.500% 30-Sep-2024 | 300.627 | 0,18 |
| 215.000 | Novelis Sheet Ingot GmbH 'REGS' 3.375% 15-Apr-2029 | 251.867 | 0,15 |
| 700.000 | PCF GmbH 'REGS' 4.750% 15-Apr-2026 | 821.654 | 0,49 |
| 285.000 | Standard Profil Automotive GmbH 'REGS' 6.250% 30-Apr-2026 | 262.841 | 0,16 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|---------------------------------------|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Deutschland Forts. | | | |
| 375.000 | Tele Columbus AG 'REGS' 3.875% 02-May-2025 | 419.992 | 0,25 |
| 621.000 | TUI Cruises GmbH 'REGS' 6.500% 15-May-2026 | 699.565 | 0,42 |
| 260.000 | WEPA Hygieneerzeugnisse GmbH 'REGS' 2.875% 15-Dec-2027 | 279.920 | 0,17 |
| Irland - 2.184.552 | | | |
| (31. Dezember 2020: 2.948.116) | | | |
| 255.000 | Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 4.125% 15-Aug-2026 | 261.056 | 0,16 |
| 500.000 | Carlyle Euro CLO 2019-1 DAC '2019-1X D' FRN 6.120% 15-Mar-2032 | 558.184 | 0,33 |
| 500.000 | Grand Harbour CLO 2019-1 DAC '2019-1X D' FRN 4.100% 15-Mar-2032 | 565.455 | 0,34 |
| 300.000 | Harvest CLO XXI DAC FRN 6.190% 15-Jul-2031 | 333.933 | 0,20 |
| 345.000 | Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 'REGS' 4.875% 15-Jul-2028 | 465.924 | 0,28 |
| Italien - 4.392.880 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.499.568) | | | |
| 410.000 | Brunello Bidco SpA 'REGS' 3.500% 15-Feb-2028 | 460.861 | 0,28 |
| 537.931 | Fabric BC SpA 'REGS' FRN 4.125% 30-Nov-2024 | 610.249 | 0,36 |
| 220.000 | Gamma Bidco SpA 'REGS' 5.125% 15-Jul-2025 | 250.891 | 0,15 |
| 500.000 | IMA Industria Macchine Automatiche SpA 'REGS' 3.750% 15-Jan-2028 | 562.711 | 0,34 |
| 775.000 | Italmatch Chemicals SpA 'REGS' FRN 4.750% 30-Sep-2024 | 848.947 | 0,51 |
| 566.000 | Shiba Bidco SpA 'REGS' 4.500% 31-Oct-2028 | 649.984 | 0,39 |
| 168.000 | Verde Bidco SpA 'REGS' 4.625% 01-Oct-2026 | 194.882 | 0,12 |
| 712.000 | Zoncolan Bidco SpA 'REGS' 4.875% 21-Oct-2028 | 814.355 | 0,49 |
| Jersey - 743.610 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 300.000 | AA Bond Co Ltd 'REGS' 6.500% 31-Jan-2026 | 411.719 | 0,25 |
| 245.000 | CPUK Finance Ltd 4.500% 28-Aug-2027 | 331.891 | 0,20 |
| Liberia - 1.172.080 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 288.000 | Royal Caribbean Cruises Ltd 3.700% 15-Mar-2028 | 267.540 | 0,16 |
| 440.000 | Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 5.500% 31-Aug-2026 | 446.525 | 0,27 |
| 450.000 | Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 5.500% 01-Apr-2028 | 458.015 | 0,27 |
| Luxemburg - 12.190.256 | | | |
| (31. Dezember 2020: 8.704.471) | | | |
| 370.000 | Albion Financing 1 SARL / Aggreko Holdings Inc 'REGS' 5.250% 15-Oct-2026 | 424.149 | 0,25 |
| 570.000 | Altice Financing SA '144A' 5.750% 15-Aug-2029 | 564.442 | 0,34 |
| 600.000 | Altice Finco SA 'REGS' 4.750% 15-Jan-2028 | 647.946 | 0,39 |
| 415.000 | Altice France Holding SA '144A' 6.000% 15-Feb-2028 | 398.072 | 0,24 |
| 615.000 | Altice France Holding SA 'REGS' 4.000% 15-Feb-2028 | 666.518 | 0,40 |
| 235.000 | ARD Finance SA '144A' 6.500% 30-Jun-2027 | 242.294 | 0,15 |
| 110.000 | ARD Finance SA 'REGS' 5.000% 30-Jun-2027 | 128.267 | 0,08 |
| 260.000 | B&M European Value Retail SA 4.000% 15-Nov-2028 | 352.831 | 0,21 |
| 607.000 | Cidron Aida Finco Sarl 'REGS' 6.250% 01-Apr-2028 | 813.315 | 0,49 |
| 960.000 | Connect Finco SARL / Connect US Finco LLC '144A' 6.750% 01-Oct-2026 | 1.008.096 | 0,60 |
| 429.000 | Consolidated Energy Finance SA '144A' 5.625% 15-Oct-2028 | 423.168 | 0,25 |
| 410.000 | Crystal Almond SARL 'REGS' 4.250% 15-Oct-2024 | 474.500 | 0,28 |
| 851.000 | Flamingo Lux II SCA 'REGS' 5.000% 31-Mar-2029 | 941.691 | 0,56 |
| 405.000 | Garfunkelux Holdco 3 SA 'REGS' 6.750% 01-Nov-2025 | 476.227 | 0,29 |
| 625.000 | Garfunkelux Holdco 3 SA 'REGS' 7.750% 01-Nov-2025 | 876.033 | 0,53 |
| 430.000 | Herens Midco Sarl 'REGS' 5.250% 15-May-2029 | 461.981 | 0,28 |
| 870.000 | Matthorn Telecom SA 'REGS' 4.000% 15-Nov-2027 | 1.008.924 | 0,60 |
| 510.000 | Motion Finco Sarl 'REGS' 7.000% 15-May-2025 | 605.350 | 0,36 |
| 403.000 | PLT VII Finance Sarl 'REGS' 4.625% 05-Jan-2026 | 467.092 | 0,28 |
| 310.000 | Summer BC Holdco B SARL 'REGS' 5.750% 31-Oct-2026 | 366.614 | 0,22 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % | Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|---|---|----------------------------------|----------------------------------|--|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | | Anleihen Forts. | | | |
| Luxemburg Forts. | | | | Vereinigtes Königreich Forts. | | | |
| 825.000 | Trinseo Materials Operating SCA / Trinseo Materials Finance Inc '144A' 5.125% 01-Apr-2029 | 842.746 | 0,51 | 150.000 | Victoria Plc 3.625% 24-Aug-2026 | 172.857 | 0,10 |
| Niederlande - 7.371.092 | | | | 210.000 | Victoria Plc 3.750% 15-Mar-2028 | 241.677 | 0,15 |
| (31. Dezember 2020: 6.700.461) | | | | 270.000 | Virgin Media Finance Plc 'REGS' 3.750% 15-Jul-2030 | 306.354 | 0,18 |
| 360.000 | Clear Channel International BV '144A' 6.625% 01-Aug-2025 | 374.762 | 0,22 | 215.000 | Virgin Media Secured Finance Plc 'REGS' 4.250% 15-Jan-2030 | 287.729 | 0,17 |
| 355.000 | Energizer Gamma Acquisition BV 'REGS' 3.500% 30-Jun-2029 | 390.008 | 0,23 | 360.000 | Vmed O2 UK Financing I Plc '144A' 4.250% 31-Jan-2031 | 355.972 | 0,21 |
| 420.000 | Nobel Bidco BV 'REGS' 3.125% 15-Jun-2028 | 465.767 | 0,28 | 265.000 | Vodafone Group Plc FRN 3.000% 27-Aug-2080 | 303.252 | 0,18 |
| 370.000 | Nobian Finance BV 'REGS' 3.625% 15-Jul-2026 | 415.189 | 0,25 | Vereinigte Staaten von Amerika - 96.020.449 | | | |
| 560.000 | Promontoria Holding 264 BV 'REGS' 6.750% 15-Aug-2023 | 638.159 | 0,38 | (31. Dezember 2020: 98.707.044) | | | |
| 235.969 | Summer BidCo BV 'REGS' 9.000% 15-Nov-2025 | 273.959 | 0,16 | 360.000 | ADT Security Corp/The '144A' 4.875% 15-Jul-2032 | 365.042 | 0,22 |
| 292.642 | Summer BidCo BV 'REGS' 9.000% 15-Nov-2025 | 338.788 | 0,20 | 741.000 | Adtalem Global Education Inc '144A' 5.500% 01-Mar-2028 | 723.520 | 0,43 |
| 300.000 | Telefonica Europe BV FRN (Perpetual) 2.376% 12-Feb-2029 | 323.732 | 0,19 | 790.000 | Advantage Sales & Marketing Inc '144A' 6.500% 15-Nov-2028 | 828.840 | 0,50 |
| 500.000 | Telefonica Europe BV FRN (Perpetual) 2.875% 24-Jun-2027 | 571.466 | 0,34 | 473.000 | Air Methods Corp '144A' 8.000% 15-May-2025 | 403.724 | 0,24 |
| 510.000 | Titan Holdings II BV 'REGS' 5.125% 15-Jul-2029 | 575.665 | 0,35 | 240.000 | Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A' 5.875% 15-Feb-2028 | 254.131 | 0,15 |
| 220.000 | United Group BV 'REGS' 3.625% 15-Feb-2028 | 243.143 | 0,15 | 803.000 | Allen Media LLC / Allen Media Co-Issuer Inc '144A' 10.500% 15-Feb-2028 | 844.286 | 0,51 |
| 250.000 | United Group BV 'REGS' 4.000% 15-Nov-2027 | 281.119 | 0,17 | 535.000 | Alliant Holdings Intermediate LLC / Alliant Holdings Co-Issuer '144A' 4.250% 15-Oct-2027 | 536.894 | 0,32 |
| 690.000 | UPC Broadband Finco BV '144A' 4.875% 15-Jul-2031 | 708.364 | 0,43 | 305.000 | Alliant Holdings Intermediate LLC / Alliant Holdings Co-Issuer '144A' 6.750% 15-Oct-2027 | 315.611 | 0,19 |
| 283.000 | VZ Vendor Financing II BV 'REGS' 2.875% 15-Jan-2029 | 310.779 | 0,19 | 210.000 | American Airlines Group Inc '144A' 3.750% 01-Mar-2025 | 196.055 | 0,12 |
| 225.000 | Wp/ap Telecom Holdings III BV 'REGS' 5.500% 15-Jan-2030 | 259.816 | 0,16 | 193.000 | American Airlines Inc '144A' 11.750% 15-Jul-2025 | 239.580 | 0,14 |
| 400.000 | ZF Europe Finance BV 3.000% 23-Oct-2029 | 468.781 | 0,28 | 270.000 | AMN Healthcare Inc '144A' 4.000% 15-Apr-2029 | 274.100 | 0,16 |
| 660.000 | Ziggo Bond Co BV 'REGS' 3.375% 28-Feb-2030 | 731.595 | 0,44 | 390.000 | AMN Healthcare Inc '144A' 4.625% 01-Oct-2027 | 402.577 | 0,24 |
| Panama - 1.788.647 | | | | 810.000 | AmWINS Group Inc '144A' 4.875% 30-Jun-2029 | 819.489 | 0,49 |
| (31. Dezember 2020: 1.068.334) | | | | 345.000 | Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp '144A' 5.750% 01-Mar-2027 | 356.557 | 0,21 |
| 720.000 | Carnival Corp '144A' 5.750% 01-Mar-2027 | 719.496 | 0,43 | 250.000 | Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp '144A' 7.875% 15-May-2026 | 274.626 | 0,16 |
| 271.000 | Carnival Corp '144A' 6.000% 01-May-2029 | 270.858 | 0,16 | 265.000 | Antero Resources Corp '144A' 5.375% 01-Mar-2030 | 284.212 | 0,17 |
| 460.000 | Carnival Corp '144A' 7.625% 01-Mar-2026 | 476.700 | 0,29 | 211.000 | Antero Resources Corp '144A' 7.625% 01-Feb-2029 | 234.544 | 0,14 |
| 270.000 | Carnival Corp 'REGS' 7.625% 01-Mar-2026 | 321.593 | 0,19 | 131.000 | Antero Resources Corp '144A' 8.375% 15-Jul-2026 | 149.318 | 0,09 |
| Polen - 562.215 | | | | 504.000 | APX Group Inc '144A' 5.750% 15-Jul-2029 | 499.671 | 0,30 |
| (31. Dezember 2020: -) | | | | 198.000 | APX Group Inc '144A' 6.750% 15-Feb-2027 | 210.375 | 0,13 |
| 575.000 | Canpack SA / Canpack US LLC '144A' 3.875% 15-Nov-2029 | 562.215 | 0,34 | 400.000 | Archrock Partners LP / Archrock Partners Finance Corp '144A' 6.250% 01-Apr-2028 | 417.568 | 0,25 |
| Spanien - 1.399.739 | | | | 705.000 | Arconic Corp '144A' 6.125% 15-Feb-2028 | 751.939 | 0,45 |
| (31. Dezember 2020: 291.109) | | | | 330.000 | Asbury Automotive Group Inc 4.750% 01-Mar-2030 | 336.687 | 0,20 |
| 544.000 | Grifols Escrow Issuer SA '144A' 4.750% 15-Oct-2028 | 555.897 | 0,33 | 174.000 | Asbury Automotive Group Inc '144A' 4.625% 15-Nov-2029 | 177.731 | 0,11 |
| 730.000 | Lorca Telecom Bondco SA 'REGS' 4.000% 18-Sep-2027 | 843.842 | 0,51 | 548.000 | Ashton Woods USA LLC / Ashton Woods Finance Co '144A' 4.625% 01-Aug-2029 | 541.980 | 0,33 |
| Schweden - 864.789 | | | | 205.000 | Ashton Woods USA LLC / Ashton Woods Finance Co '144A' 6.625% 15-Jan-2028 | 216.997 | 0,13 |
| (31. Dezember 2020: 920.915) | | | | 250.000 | AssuredPartners Inc '144A' 5.625% 15-Jan-2029 | 244.583 | 0,15 |
| 110.000 | Verisure Holding AB 'REGS' FRN 5.000% 15-Apr-2025 | 126.572 | 0,08 | 395.000 | Banff Merger Sub Inc 'REGS' 8.375% 01-Sep-2026 | 469.994 | 0,28 |
| 640.000 | Verisure Midholding AB 'REGS' 5.250% 15-Feb-2029 | 738.217 | 0,44 | 865.000 | BCPE Ulysses Intermediate Inc '144A' 7.750% 01-Apr-2027 | 855.052 | 0,51 |
| Vereinigtes Königreich - 8.212.245 | | | | 590.000 | Block Communications Inc '144A' 4.875% 01-Mar-2028 | 590.888 | 0,35 |
| (31. Dezember 2020: 8.406.263) | | | | 395.000 | Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp '144A' 6.625% 15-Jul-2026 | 408.035 | 0,25 |
| 255.000 | Deuce Finco Plc 'REGS' 5.500% 15-Jun-2027 | 342.691 | 0,21 | 225.000 | Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp '144A' 7.625% 15-Dec-2025 | 238.734 | 0,14 |
| 850.000 | Energia Group NI FinanceCo Plc/Energia Group ROI Holdings DAC 'REGS' 4.750% 15-Sep-2024 | 1.149.676 | 0,69 | 170.000 | Boxer Parent Co Inc '144A' 6.500% 02-Oct-2025 | 202.986 | 0,12 |
| 490.000 | International Game Technology Plc '144A' 5.250% 15-Jan-2029 | 520.745 | 0,31 | 205.000 | Boxer Parent Co Inc 'REGS' 6.500% 02-Oct-2025 | 244.777 | 0,15 |
| 478.000 | Maison Finco Plc 'REGS' 6.000% 31-Oct-2027 | 659.645 | 0,40 | 535.000 | Boyd Gaming Corp '144A' 4.750% 15-Jun-2031 | 549.988 | 0,33 |
| 490.000 | Pinewood Finance Co Ltd 'REGS' 3.625% 15-Nov-2027 | 659.958 | 0,40 | 340.000 | Brookfield Property REIT Inc / BPR Cumulus LLC / BPR Nimbus LLC / GGS Sellco LLC '144A' 4.500% 01-Apr-2027 | 336.160 | 0,20 |
| 573.000 | RAC Bond Co Plc 'REGS' 5.250% 04-Nov-2027 | 752.933 | 0,45 | 415.000 | Cable One Inc '144A' 4.000% 15-Nov-2030 | 409.404 | 0,25 |
| 555.000 | TalkTalk Telecom Group Ltd 3.875% 20-Feb-2025 | 713.858 | 0,43 | 339.000 | Caesars Entertainment Inc '144A' 4.625% 15-Oct-2029 | 340.832 | 0,20 |
| 525.000 | Titan Acquisition Ltd / Titan Co-Borrower LLC '144A' 7.750% 15-Apr-2026 | 535.453 | 0,32 | 145.000 | Caesars Entertainment Inc '144A' 6.250% 01-Jul-2025 | 152.254 | 0,09 |
| 690.000 | Venator Finance Sarl / Venator Materials LLC '144A' 5.750% 15-Jul-2025 | 663.118 | 0,40 | 320.000 | Calpine Corp '144A' 4.500% 15-Feb-2028 | 330.154 | 0,20 |
| 406.000 | Very Group Funding Plc/The 'REGS' 6.500% 01-Aug-2026 | 546.327 | 0,33 | 273.000 | Calpine Corp '144A' 5.000% 01-Feb-2031 | 275.810 | 0,17 |
| | | | | 170.000 | Calpine Corp '144A' 5.125% 15-Mar-2028 | 172.853 | 0,10 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|--|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika Forts. | | | |
| 290.000 | CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.500% 15-Aug-2030 | 297.541 | 0,18 |
| 550.000 | CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.750% 01-Mar-2030 | 572.976 | 0,34 |
| 120.000 | CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.125% 01-May-2027 | 123.747 | 0,07 |
| 230.000 | CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.375% 01-Jun-2029 | 247.955 | 0,15 |
| 465.000 | Cheniere Energy Inc 4.625% 15-Oct-2028 | 495.430 | 0,30 |
| 480.000 | Cheniere Energy Partners LP 4.000% 01-Mar-2031 | 504.689 | 0,30 |
| 320.000 | Cheniere Energy Partners LP 4.500% 01-Oct-2029 | 339.754 | 0,20 |
| 400.000 | CHS/Community Health Systems Inc '144A' 4.750% 15-Feb-2031 | 403.648 | 0,24 |
| 485.000 | CHS/Community Health Systems Inc '144A' 6.125% 01-Apr-2030 | 480.885 | 0,29 |
| 495.000 | CHS/Community Health Systems Inc '144A' 6.875% 15-Apr-2029 | 505.039 | 0,30 |
| 345.000 | Cinemark USA Inc '144A' 5.875% 15-Mar-2026 | 349.744 | 0,21 |
| 310.000 | Clear Channel Outdoor Holdings Inc '144A' 7.750% 15-Apr-2028 | 334.499 | 0,20 |
| 400.000 | Colgate Energy Partners III LLC '144A' 5.875% 01-Jul-2029 | 413.568 | 0,25 |
| 260.000 | CommScope Inc '144A' 4.750% 01-Sep-2029 | 257.854 | 0,15 |
| 450.000 | CommScope Inc '144A' 7.125% 01-Jul-2028 | 443.887 | 0,27 |
| 125.000 | CommScope Inc '144A' 8.250% 01-Mar-2027 | 128.122 | 0,08 |
| 350.000 | CommScope Inc 'REGS' 6.000% 01-Mar-2026 | 360.971 | 0,22 |
| 124.000 | Compass Group Diversified Holdings LLC '144A' 5.000% 15-Jan-2032 | 127.287 | 0,08 |
| 590.000 | Compass Group Diversified Holdings LLC '144A' 5.250% 15-Apr-2029 | 616.143 | 0,37 |
| 390.000 | Cornerstone Building Brands Inc '144A' 6.125% 15-Jan-2029 | 418.817 | 0,25 |
| 595.000 | Covanta Holding Corp 6.000% 01-Jan-2027 | 615.046 | 0,37 |
| 155.000 | Covert Mergerco Inc '144A' 4.875% 01-Dec-2029 | 157.561 | 0,09 |
| 757.000 | CP Atlas Buyer Inc '144A' 7.000% 01-Dec-2028 | 754.279 | 0,45 |
| 281.000 | Crestwood Midstream Partners LP / Crestwood Midstream Finance Corp '144A' 6.000% 01-Feb-2029 | 292.282 | 0,18 |
| 480.000 | CrownRock LP / CrownRock Finance Inc '144A' 5.000% 01-May-2029 | 499.930 | 0,30 |
| 310.000 | CrownRock LP / CrownRock Finance Inc '144A' 5.625% 15-Oct-2025 | 317.338 | 0,19 |
| 505.000 | CSC Holdings LLC '144A' 4.625% 01-Dec-2030 | 478.078 | 0,29 |
| 200.000 | CSC Holdings LLC '144A' 7.500% 01-Apr-2028 | 214.817 | 0,13 |
| 325.000 | CSC Holdings LLC 'REGS' 6.500% 01-Feb-2029 | 349.222 | 0,21 |
| 800.000 | Dealer Tire LLC / DT Issuer LLC '144A' 8.000% 01-Feb-2028 | 833.868 | 0,50 |
| 288.000 | DISH DBS Corp '144A' 5.250% 01-Dec-2026 | 293.584 | 0,18 |
| 288.000 | DISH DBS Corp '144A' 5.750% 01-Dec-2028 | 290.340 | 0,17 |
| 607.000 | Dycom Industries Inc '144A' 4.500% 15-Apr-2029 | 619.395 | 0,37 |
| 450.000 | Embarq Corp 7.995% 01-Jun-2036 | 509.238 | 0,31 |
| 570.000 | Encompass Health Corp 4.750% 01-Feb-2030 | 587.941 | 0,35 |
| 665.000 | Encore Capital Group Inc 'REGS' 5.375% 15-Feb-2026 | 929.344 | 0,56 |
| 530.000 | Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc '144A' 5.750% 30-Jan-2028 | 562.269 | 0,34 |
| 655.000 | Endure Digital Inc '144A' 6.000% 15-Feb-2029 | 611.708 | 0,37 |
| 210.000 | Energizer Holdings Inc '144A' 4.375% 31-Mar-2029 | 206.690 | 0,12 |
| 340.000 | Energizer Holdings Inc '144A' 4.750% 15-Jun-2028 | 347.745 | 0,21 |
| 410.000 | EnLink Midstream Partners LP 4.150% 01-Jun-2025 | 425.808 | 0,26 |
| 145.000 | EnLink Midstream Partners LP 4.850% 15-Jul-2026 | 152.408 | 0,09 |
| 180.000 | EQM Midstream Partners LP 5.500% 15-Jul-2028 | 196.905 | 0,12 |
| 305.000 | EQM Midstream Partners LP '144A' 4.750% 15-Jan-2031 | 323.105 | 0,19 |
| 115.000 | EQM Midstream Partners LP '144A' 6.000% 01-Jul-2025 | 124.329 | 0,07 |
| 145.000 | EQM Midstream Partners LP '144A' 6.500% 01-Jul-2027 | 162.583 | 0,10 |
| 795.000 | Everi Holdings Inc '144A' 5.000% 15-Jul-2029 | 806.245 | 0,48 |
| 556.000 | Fair Isaac Corp '144A' 4.000% 15-Jun-2028 | 573.086 | 0,34 |
| 551.000 | First Student Bidco Inc / First Transit Parent Inc '144A' 4.000% 31-Jul-2029 | 536.407 | 0,32 |
| 216.000 | Ford Motor Co 3.250% 12-Feb-2032 | 221.832 | 0,13 |
| 210.000 | Ford Motor Co 5.291% 08-Dec-2046 | 247.131 | 0,15 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|--|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika Forts. | | | |
| 200.000 | Ford Motor Credit Co LLC 3.815% 02-Nov-2027 | 211.749 | 0,13 |
| 404.000 | Ford Motor Credit Co LLC 4.125% 17-Aug-2027 | 437.023 | 0,26 |
| 200.000 | Ford Motor Credit Co LLC 4.271% 09-Jan-2027 | 215.226 | 0,13 |
| 365.000 | Ford Motor Credit Co LLC 5.113% 03-May-2029 | 415.357 | 0,25 |
| 200.000 | Foundation Building Materials Inc '144A' 6.000% 01-Mar-2029 | 196.781 | 0,12 |
| 355.000 | Freeport-McMoRan Inc 5.450% 15-Mar-2043 | 447.548 | 0,27 |
| 420.000 | Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp 8.000% 15-Jan-2027 | 429.920 | 0,26 |
| 285.000 | Golden Nugget Inc '144A' 6.750% 15-Oct-2024 | 285.370 | 0,17 |
| 675.000 | Graham Packaging Co Inc '144A' 7.125% 15-Aug-2028 | 698.827 | 0,42 |
| 450.000 | Griffon Corp 5.750% 01-Mar-2028 | 468.799 | 0,28 |
| 455.000 | Harsco Corp '144A' 5.750% 31-Jul-2027 | 464.555 | 0,28 |
| 820.000 | HealthEquity Inc '144A' 4.500% 01-Oct-2029 | 812.825 | 0,49 |
| 487.000 | Hertz Corp/The '144A' 4.625% 01-Dec-2026 | 490.694 | 0,29 |
| 116.000 | Hertz Corp/The '144A' 5.000% 01-Dec-2029 | 116.309 | 0,07 |
| 895.000 | Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 5.250% 15-May-2027 | 923.251 | 0,55 |
| 290.000 | Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 6.250% 15-May-2026 | 302.776 | 0,18 |
| 234.000 | Innophos Holdings Inc '144A' 9.375% 15-Feb-2028 | 254.642 | 0,15 |
| 233.000 | Intrado Corp '144A' 8.500% 15-Oct-2025 | 232.408 | 0,14 |
| 306.000 | Iris Holdings Inc '144A' 8.750% 15-Feb-2026 | 309.817 | 0,19 |
| 131.000 | Kobe US Midco 2 Inc '144A' 9.250% 01-Nov-2026 | 133.631 | 0,08 |
| 565.000 | Kraton Polymers LLC / Kraton Polymers Capital Corp '144A' 4.250% 15-Dec-2025 | 585.368 | 0,35 |
| 442.000 | Kronos Acquisition Holdings Inc / KIK Custom Products Inc '144A' 5.000% 31-Dec-2026 | 437.100 | 0,26 |
| 420.000 | LABL Inc '144A' 5.875% 01-Nov-2028 | 429.712 | 0,26 |
| 931.000 | LABL Inc '144A' 8.250% 01-Nov-2029 | 914.126 | 0,55 |
| 62.000 | LABL Inc '144A' 10.500% 15-Jul-2027 | 65.084 | 0,04 |
| 325.000 | Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp '144A' 4.750% 15-Jun-2029 | 331.242 | 0,20 |
| 645.000 | Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp '144A' 5.250% 01-Oct-2025 | 654.588 | 0,39 |
| 400.000 | LBM Acquisition LLC '144A' 6.250% 15-Jan-2029 | 398.564 | 0,24 |
| 515.000 | Level 3 Financing Inc '144A' 3.625% 15-Jan-2029 | 491.336 | 0,29 |
| 440.000 | Level 3 Financing Inc '144A' 3.750% 15-Jul-2029 | 422.013 | 0,25 |
| 90.000 | Lions Gate Capital Holdings LLC '144A' 5.500% 15-Apr-2029 | 91.960 | 0,06 |
| 435.000 | Macy's Retail Holdings LLC 4.500% 15-Dec-2034 | 432.396 | 0,26 |
| 120.000 | Matador Resources Co 5.875% 15-Sep-2026 | 123.373 | 0,07 |
| 315.000 | Match Group Holdings II LLC '144A' 3.625% 01-Oct-2031 | 306.015 | 0,18 |
| 930.000 | Mauser Packaging Solutions Holding Co '144A' 7.250% 15-Apr-2025 | 933.394 | 0,56 |
| 279.000 | Mauser Packaging Solutions Holding Co '144A' 8.500% 15-Apr-2024 | 289.933 | 0,17 |
| 530.000 | Mauser Packaging Solutions Holding Co 'REGS' 4.750% 15-Apr-2024 | 601.476 | 0,36 |
| 400.000 | Michaels Cos Inc/The '144A' 5.250% 01-May-2028 | 400.662 | 0,24 |
| 490.000 | Michaels Cos Inc/The '144A' 7.875% 01-May-2029 | 483.569 | 0,29 |
| 210.256 | Mitchell International, Inc. 0.000% 01-Oct-2029 | 211.965 | 0,13 |
| 387.000 | Mozart Debt Merger Sub Inc '144A' 3.875% 01-Apr-2029 | 385.839 | 0,23 |
| 641.000 | Mozart Debt Merger Sub Inc '144A' 5.250% 01-Oct-2029 | 648.743 | 0,39 |
| 630.000 | Nationstar Mortgage Holdings Inc '144A' 5.500% 15-Aug-2028 | 643.551 | 0,39 |
| 205.000 | Nationstar Mortgage Holdings Inc '144A' 6.000% 15-Jan-2027 | 214.193 | 0,13 |
| 293.000 | Navient Corp 5.500% 15-Mar-2029 | 293.467 | 0,18 |
| 505.000 | Navient Corp 6.750% 15-Jun-2026 | 558.747 | 0,34 |
| 270.000 | New Albertsons LP 8.000% 01-May-2031 | 330.862 | 0,20 |
| 685.000 | Nexstar Media Inc '144A' 4.750% 01-Nov-2028 | 699.950 | 0,42 |
| 370.000 | Northwest Fiber LLC / Northwest Fiber Finance Sub Inc '144A' 4.750% 30-Apr-2027 | 367.780 | 0,22 |
| 575.000 | Northwest Fiber LLC / Northwest Fiber Finance Sub Inc '144A' 6.000% 15-Feb-2028 | 566.901 | 0,34 |
| 230.000 | Novelis Corp '144A' 4.750% 30-Jan-2030 | 241.898 | 0,15 |
| 230.000 | Occidental Petroleum Corp 3.500% 15-Aug-2029 | 236.148 | 0,14 |
| 280.000 | Occidental Petroleum Corp 6.125% 01-Jan-2031 | 340.670 | 0,20 |
| 184.000 | Occidental Petroleum Corp 6.375% 01-Sep-2028 | 217.374 | 0,13 |
| 285.000 | Occidental Petroleum Corp 6.450% 15-Sep-2036 | 363.944 | 0,22 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Nettovermögen % | Summe |
|--|--|----------------------------|-----------------|-------|
| Anleihen Forts. | | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika Forts. | | | | |
| 230.000 | Occidental Petroleum Corp 8.875% 15-Jul-2030 | 310.896 | 0,19 | |
| 663.000 | Olympus Water US Holding Corp '144A' 4.250% 01-Oct-2028 | 650.393 | 0,39 | |
| 245.000 | Olympus Water US Holding Corp '144A' 6.250% 01-Oct-2029 | 239.219 | 0,14 | |
| 200.000 | Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer BV '144A' 4.125% 30-Apr-2028 | 203.596 | 0,12 | |
| 775.000 | Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer BV '144A' 5.125% 30-Apr-2031 | 809.329 | 0,49 | |
| 354.000 | Ortho-Clinical Diagnostics Inc / Ortho-Clinical Diagnostics SA '144A' 7.250% 01-Feb-2028 | 381.070 | 0,23 | |
| 555.000 | Park Intermediate Holdings LLC / PK Domestic Property LLC / PK Finance Co-Issuer '144A' 4.875% 15-May-2029 | 571.106 | 0,34 | |
| 213.000 | Park River Holdings Inc '144A' 5.625% 01-Feb-2029 | 203.714 | 0,12 | |
| 480.000 | Park River Holdings Inc '144A' 6.750% 01-Aug-2029 | 472.274 | 0,28 | |
| 490.000 | Pattern Energy Operations LP / Pattern Energy Operations Inc '144A' 4.500% 15-Aug-2028 | 509.688 | 0,31 | |
| 770.000 | Paysafe Finance Plc / Paysafe Holdings US Corp 'REGS' 3.000% 15-Jun-2029 | 824.811 | 0,49 | |
| 440.000 | PECF USS Intermediate Holding III Corp '144A' 8.000% 15-Nov-2029 | 456.078 | 0,27 | |
| 493.000 | PennyMac Financial Services Inc '144A' 5.375% 15-Oct-2025 | 507.115 | 0,30 | |
| 285.000 | PennyMac Financial Services Inc '144A' 5.750% 15-Sep-2031 | 287.538 | 0,17 | |
| 480.000 | PGT Innovations Inc '144A' 4.375% 01-Oct-2029 | 483.223 | 0,29 | |
| 335.000 | Pike Corp '144A' 5.500% 01-Sep-2028 | 336.313 | 0,20 | |
| 253.000 | Polar US Borrower LLC / Schenectady International Group Inc '144A' 6.750% 15-May-2026 | 248.836 | 0,15 | |
| 329.000 | Post Holdings Inc '144A' 4.500% 15-Sep-2031 | 326.328 | 0,20 | |
| 435.000 | Post Holdings Inc '144A' 4.625% 15-Apr-2030 | 443.835 | 0,27 | |
| 250.000 | Post Holdings Inc '144A' 5.500% 15-Dec-2029 | 263.540 | 0,16 | |
| 380.000 | Post Holdings Inc '144A' 5.750% 01-Mar-2027 | 393.283 | 0,24 | |
| 510.000 | Prime Healthcare Services Inc '144A' 7.250% 01-Nov-2025 | 542.474 | 0,33 | |
| 490.000 | Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc '144A' 6.250% 15-Jan-2028 | 512.307 | 0,31 | |
| 290.000 | Radiate Holdco LLC / Radiate Finance Inc '144A' 4.500% 15-Sep-2026 | 293.979 | 0,18 | |
| 805.000 | Radiate Holdco LLC / Radiate Finance Inc '144A' 6.500% 15-Sep-2028 | 802.195 | 0,48 | |
| 77.000 | Ritchie Bros Holdings Inc '144A' 4.750% 15-Dec-2031 | 80.422 | 0,05 | |
| 494.000 | RLJ Lodging Trust LP '144A' 4.000% 15-Sep-2029 | 489.453 | 0,29 | |
| 717.000 | Rockcliff Energy II LLC '144A' 5.500% 15-Oct-2029 | 736.119 | 0,44 | |
| 547.000 | Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc '144A' 3.875% 01-Mar-2031 | 554.680 | 0,33 | |
| 420.000 | Scientific Games International Inc '144A' 7.250% 15-Nov-2029 | 471.805 | 0,28 | |
| 275.000 | Scientific Games International Inc 'REGS' 5.500% 15-Feb-2026 | 319.221 | 0,19 | |
| 270.000 | SCIL IV LLC / SCIL USA Holdings LLC '144A' 5.375% 01-Nov-2026 | 278.100 | 0,17 | |
| 660.000 | Scripps Escrow II Inc '144A' 5.375% 15-Jan-2031 | 673.863 | 0,40 | |
| 540.000 | Scripps Escrow Inc '144A' 5.875% 15-Jul-2027 | 567.844 | 0,34 | |
| 270.000 | Sirius XM Radio Inc '144A' 3.875% 01-Sep-2031 | 266.429 | 0,16 | |
| 290.000 | Sirius XM Radio Inc '144A' 4.000% 15-Jul-2028 | 291.952 | 0,18 | |
| 245.000 | Sirius XM Radio Inc '144A' 4.125% 01-Jul-2030 | 246.028 | 0,15 | |
| 145.000 | Sirius XM Radio Inc '144A' 5.500% 01-Jul-2029 | 156.481 | 0,09 | |
| 482.000 | Sonic Automotive Inc '144A' 4.625% 15-Nov-2029 | 487.396 | 0,29 | |
| 361.000 | Southwestern Energy Co 5.375% 01-Feb-2029 | 382.268 | 0,23 | |
| 180.000 | Southwestern Energy Co 5.375% 15-Mar-2030 | 192.917 | 0,12 | |
| 110.000 | Southwestern Energy Co 8.375% 15-Sep-2028 | 122.939 | 0,07 | |
| 560.000 | Sprint Capital Corp 6.875% 15-Nov-2028 | 709.341 | 0,43 | |
| 655.000 | Sprint Corp 7.625% 01-Mar-2026 | 787.222 | 0,47 | |
| 230.000 | Staples Inc '144A' 7.500% 15-Apr-2026 | 235.474 | 0,14 | |
| 645.000 | Staples Inc '144A' 10.750% 15-Apr-2027 | 607.777 | 0,36 | |
| 210.000 | Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 5.000% 15-Jan-2028 | 220.839 | 0,13 | |
| 285.000 | Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 6.500% 15-Jul-2027 | 304.545 | 0,18 | |
| 375.000 | Taylor Morrison Communities Inc '144A' 5.125% 01-Aug-2030 | 410.218 | 0,25 | |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Nettovermögen % | Summe |
|--|---|----------------------------|-----------------|-------|
| Anleihen Forts. | | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika Forts. | | | | |
| 1.004.000 | Team Health Holdings Inc '144A' 6.375% 01-Feb-2025 | 948.780 | 0,57 | |
| 458.000 | TEGNA Inc 5.000% 15-Sep-2029 | 470.682 | 0,28 | |
| 476.000 | Tempur Sealy International Inc '144A' 4.000% 15-Apr-2029 | 484.418 | 0,29 | |
| 400.000 | Tenet Healthcare Corp '144A' 4.625% 15-Jun-2028 | 411.578 | 0,25 | |
| 645.000 | Tenet Healthcare Corp '144A' 6.250% 01-Feb-2027 | 668.449 | 0,40 | |
| 65.000 | Tenet Healthcare Corp '144A' 7.500% 01-Apr-2025 | 68.487 | 0,04 | |
| 20.000 | Tenet Healthcare Corp 'REGS' 6.250% 01-Feb-2027 | 20.727 | 0,01 | |
| 560.000 | TerraForm Power Operating LLC '144A' 4.750% 15-Jan-2030 | 578.348 | 0,35 | |
| 550.000 | Terrier Media Buyer Inc '144A' 8.875% 15-Dec-2027 | 595.529 | 0,36 | |
| 390.000 | TK Elevator US Newco Inc '144A' 5.250% 15-Jul-2027 | 410.487 | 0,25 | |
| 230.000 | TKC Holdings Inc '144A' 6.875% 15-May-2028 | 236.502 | 0,14 | |
| 240.000 | T-Mobile USA Inc 2.250% 15-Feb-2026 | 240.966 | 0,14 | |
| 230.000 | T-Mobile USA Inc 4.750% 01-Feb-2028 | 242.473 | 0,15 | |
| 390.000 | T-Mobile USA Inc '144A' 3.500% 15-Apr-2031 | 404.812 | 0,24 | |
| 289.000 | TransDigm Inc 4.625% 15-Jan-2029 | 287.356 | 0,17 | |
| 339.000 | TransDigm Inc 4.875% 01-May-2029 | 340.968 | 0,20 | |
| 310.000 | TransDigm Inc 5.500% 15-Nov-2027 | 319.075 | 0,19 | |
| 575.000 | TTM Technologies Inc '144A' 4.000% 01-Mar-2029 | 574.434 | 0,34 | |
| 410.000 | Uber Technologies Inc '144A' 4.500% 15-Aug-2029 | 417.944 | 0,25 | |
| 500.000 | UGI International LLC 'REGS' 2.500% 01-Dec-2029 | 560.422 | 0,34 | |
| 310.000 | Unifrax Escrow Issuer Corp '144A' 5.250% 30-Sep-2028 | 313.704 | 0,19 | |
| 164.000 | Unifrax Escrow Issuer Corp '144A' 7.500% 30-Sep-2029 | 165.873 | 0,10 | |
| 250.000 | United Airlines Inc '144A' 4.375% 15-Apr-2026 | 259.704 | 0,16 | |
| 195.000 | United Airlines Inc '144A' 4.625% 15-Apr-2029 | 202.231 | 0,12 | |
| 525.000 | United Natural Foods Inc '144A' 6.750% 15-Oct-2028 | 562.944 | 0,34 | |
| 400.000 | United Rentals North America Inc 4.000% 15-Jul-2030 | 412.926 | 0,25 | |
| 315.000 | United Rentals North America Inc 5.500% 15-May-2027 | 327.975 | 0,20 | |
| 298.000 | USA Compression Partners LP / USA Compression Finance Corp 6.875% 01-Apr-2026 | 310.994 | 0,19 | |
| 230.000 | USA Compression Partners LP / USA Compression Finance Corp 6.875% 01-Sep-2027 | 243.466 | 0,15 | |
| 480.000 | Vertiv Group Corp '144A' 4.125% 15-Nov-2028 | 485.623 | 0,29 | |
| 240.000 | VICI Properties LP / VICI Note Co Inc '144A' 4.125% 15-Aug-2030 | 254.590 | 0,15 | |
| 420.000 | VICI Properties LP / VICI Note Co Inc '144A' 4.625% 01-Dec-2029 | 450.150 | 0,27 | |
| 59.000 | Vistra Corp '144A' FRN (Perpetual) 7.000% 15-Dec-2026 | 60.019 | 0,04 | |
| 445.000 | Vistra Operations Co LLC '144A' 4.375% 01-May-2029 | 446.622 | 0,27 | |
| 631.000 | VM Consolidated Inc '144A' 5.500% 15-Apr-2029 | 635.051 | 0,38 | |
| 300.000 | Western Midstream Operating LP 4.500% 01-Mar-2028 | 327.162 | 0,20 | |
| 280.000 | White Cap Buyer LLC '144A' 6.875% 15-Oct-2028 | 292.298 | 0,18 | |
| 666.000 | White Cap Parent LLC '144A' 8.250% 15-Mar-2026 | 684.285 | 0,41 | |
| 157.000 | WW International Inc '144A' 4.500% 15-Apr-2029 | 150.199 | 0,09 | |
| 535.000 | XHR LP '144A' 4.875% 01-Jun-2029 | 545.277 | 0,33 | |
| 240.000 | Zayo Group Holdings Inc '144A' 6.125% 01-Mar-2028 | 237.367 | 0,14 | |
| Gesamtanlagen in Anleihen | | 151.929.942 | 91,15 | |
| Aktien | | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika - 69.741 | | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | | |
| 4.200 | Altice USA Inc | 69.741 | 0,04 | |
| Gesamtanlagen in Aktien | | 69.741 | 0,04 | |
| Fremdfinanzierte Darlehen (Leveraged Loans) | | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika - 7136.922 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 6.429.236) | | | | |
| 483.753 | Amynta Agency Borrower Inc Term Loan 0.000% 31-Jan-2025 | 483.149 | 0,29 | |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % |
|---|--|----------------------------|-----------------------|
| Fremdfinanzierte Darlehen (Leveraged Loans) Forts. | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika Forts. | | | |
| 401.893 | AP Gaming I LLC Term Loan 4.500% 15-Feb-2024 | 400.303 | 0,24 |
| 110.104 | Asurion LLC Term Loan 0.000% 15-Jan-2029 | 109.897 | 0,07 |
| 620.000 | Asurion LLC Term Loan 5.337% 03-Feb-2028 | 618.837 | 0,37 |
| 1.020 | Autokiniton US Holdings, Inc. Term Loan 5.000% 06-Apr-2028 | 1.023 | 0,00 |
| 410.850 | Caesars Resort Collection LLC Term Loan 3.587% 20-Jul-2025 | 412.134 | 0,25 |
| 398.000 | CT Technologies Intermediate Holdings Inc Term Loan 5.000% 10-Dec-2025 | 399.036 | 0,24 |
| 89.354 | Cubic Corp Term Loan 5.000% 29-Apr-2028 | 89.789 | 0,05 |
| 439.321 | Cubic Corp Term Loan 5.000% 25-May-2028 | 441.463 | 0,27 |
| 970.000 | DirecTV Financing LLC Term Loan 5.750% 22-Jul-2027 | 971.213 | 0,58 |
| 500.000 | Flexsys Holdings Inc 0.000% 12-Aug-2028 | 502.500 | 0,30 |
| 547.860 | Great Outdoors Group LLC Term Loan 5.000% 26-Feb-2028 | 549.401 | 0,33 |
| 471.438 | Greeneden US Holdings II LLC Term Loan 4.750% 01-Dec-2027 | 473.697 | 0,28 |
| 541.812 | Ivanti Software Inc Term Loan 5.750% 01-Dec-2027 | 541.812 | 0,33 |
| 802.988 | One Call Corporation Term Loan 6.250% 07-Apr-2027 | 805.330 | 0,48 |
| 42 | Pathway Vet Alliance LLC Term Loan 0.000% 31-Mar-2027 | 42 | 0,00 |
| 336.538 | PECF USS Intermediate Holding Term Loan 0.000% 04-Nov-2028 | 337.296 | 0,20 |
| Gesamtanlagen in fremdfinanzierten Darlehen (Leveraged Loans) | | 7.136.922 | 4,28 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 102.431 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 550.506) | | 102.431 | 0,06 |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | 159.239.036 | 95,53 |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (163.678) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (122.171)) | | (163.678) | (0,10) |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | (163.678) | (0,10) |
| Nettoumlaufvermögen | | 7.618.337 | 4,57 |
| Summe Nettovermögen | | 166.693.695 | 100,00 |

| Portfolioanalyse | % des Gesamtvermögens |
|--|-----------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 90,35 |
| Nicht an einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 4,24 |
| Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate) | 0,06 |
| Sonstiges Umlaufvermögen | 5,35 |
| Gesamtvermögen | 100,00 |

| Devisenterminkontrakte | | | | | | | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) | |
|---|----------------|------------|------------|------------------|-----------------------------|--|-------------------------------------|------------------|
| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | | | |
| BNY Mellon Global High Yield Bond Fund | | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 2.000.000 | 2.261.172 | 31. Jan. 22 | Citibank N.A. | | 3.783 | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 395.000 | 527.393 | 31. Jan. 22 | Goldman Sachs | | 4.875 | |
| US-Dollar | Euro | 657.291 | 580.000 | 31. Jan. 22 | Goldman Sachs | | 454 | |
| | | | | | | | USD | 9.112 |
| Euro | US-Dollar | 850.000 | 963.560 | 31. Jan. 22 | Goldman Sachs | | (954) | |
| US-Dollar | Euro | 36.580.882 | 32.350.000 | 31. Jan. 22 | Goldman Sachs | | (54.762) | |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 9.189.203 | 6.890.000 | 31. Jan. 22 | Goldman Sachs | | (95.176) | |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 653.276 | 490.000 | 31. Jan. 22 | Goldman Sachs | | (7.006) | |
| | | | | | | | USD | (157.898) |
| BNY Mellon Global High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged) | | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 1.341.305 | 1.515.651 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 2.817 | |
| US-Dollar | Euro | 73.121 | 64.546 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 50 | |
| | | | | | | | USD | 2.867 |
| | | | | | | | EUR | 2.533 |
| Euro | US-Dollar | 7.872 | 8.929 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (17) | |
| US-Dollar | Euro | 5.629 | 4.989 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (19) | |
| | | | | | | | USD | (36) |
| | | | | | | | EUR | (32) |
| BNY Mellon Global High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged) | | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 10.935.734 | 12.357.187 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 22.967 | |
| | | | | | | | USD | 22.967 |
| | | | | | | | EUR | 20.292 |
| Euro | US-Dollar | 69.310 | 78.616 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (152) | |
| | | | | | | | USD | (152) |
| | | | | | | | EUR | (134) |
| BNY Mellon Global High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR X (Inc) (Hedged) | | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 18.901.778 | 21.358.677 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 39.696 | |
| | | | | | | | USD | 39.696 |
| | | | | | | | EUR | 35.072 |
| Euro | US-Dollar | 125.876 | 142.777 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (275) | |
| US-Dollar | Euro | 790.105 | 700.000 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (2.353) | |
| | | | | | | | USD | (2.628) |
| | | | | | | | EUR | (2.322) |
| BNY Mellon Global High Yield Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged) | | | | | | | | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 886.267 | 1.169.267 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 25.039 | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 108.898 | 146.379 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 368 | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 21.553 | 28.704 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 340 | |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte Forts.

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

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

| | | | | | | |
|----------------|----------------|---------|---------|-------------|-----------------------------|----------------|
| Pfund Sterling | US-Dollar | 98.043 | 130.077 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 2.042 |
| | | | | | | USD |
| | | | | | | 27.789 |
| | | | | | | GBP |
| | | | | | | 20.621 |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 146.350 | 108.898 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (401) |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 5.966 | 8.041 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 13.980 | 10.404 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (41) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 30.029 | 22.548 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (356) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 5.002 | 3.749 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (51) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 134.669 | 101.503 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (2.114) |
| | | | | | | USD |
| | | | | | | (2.964) |
| | | | | | | GBP |
| | | | | | | (2.199) |

BNY MELLON GLOBAL INFRASTRUCTURE INCOME FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|--|---------------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| Aktien | | | |
| Belgien - 9.397.066 | | | |
| (31. Dezember 2020: 6.056.729) | | | |
| 480.716 | Proximus SADP | 9.397.066 | 4,13 |
| Kanada - 17.686.339 | | | |
| (31. Dezember 2020: 12.561.171) | | | |
| 452.698 | Enbridge Inc | 17.686.339 | 7,77 |
| China - 5.599.449 | | | |
| (31. Dezember 2020: 2.809.108) | | | |
| 5.468.000 | Jiangsu Expressway Co Ltd 'H' | 5.599.449 | 2,46 |
| Frankreich - 25.294.919 | | | |
| (31. Dezember 2020: 10.571.722) | | | |
| 81.416 | Bouygues SA | 2.916.560 | 1,28 |
| 809.705 | Engie SA | 11.995.111 | 5,27 |
| 968.987 | Orange SA | 10.383.248 | 4,56 |
| Deutschland - 1.794.787 | | | |
| (31. Dezember 2020: 6.698.787) | | | |
| 27.976 | Deutsche Post AG | 1.794.787 | 0,79 |
| Italien - 19.939.937 | | | |
| (31. Dezember 2020: 14.716.689) | | | |
| 273.921 | Atlantia SpA | 5.444.284 | 2,39 |
| 632.237 | Enel SpA | 5.071.368 | 2,23 |
| 1.368.458 | Italgas SpA | 9.424.285 | 4,14 |
| Norwegen - 1.591.995 | | | |
| (31. Dezember 2020: 3.451.024) | | | |
| 195.217 | SFL Corp Ltd | 1.591.995 | 0,70 |
| Spanien - 43.327.016 | | | |
| (31. Dezember 2020: 27.843.456) | | | |
| 602.797 | Enagas SA | 14.007.076 | 6,15 |
| 227.381 | Endesa SA | 5.227.950 | 2,30 |
| 340.061 | Naturgy Energy Group SA | 11.099.870 | 4,87 |
| 600.058 | Red Electrica Corp SA | 12.992.120 | 5,71 |
| Vereinigtes Königreich - 10.921.833 | | | |
| (31. Dezember 2020: 6.791.935) | | | |
| 383.343 | Drax Group Plc | 3.145.675 | 1,38 |
| 348.499 | SSE Plc | 7.776.158 | 3,41 |
| Vereinigte Staaten von Amerika - 87.930.381 | | | |
| (31. Dezember 2020: 48.833.242) | | | |
| 1.412.769 | Antero Midstream Corp | 13.668.540 | 6,00 |
| 163.751 | Clearway Energy Inc | 5.900.767 | 2,59 |
| 192.892 | Exelon Corp | 11.149.158 | 4,90 |
| 503.289 | Medical Properties Trust Inc (REIT) | 11.890.203 | 5,22 |
| 352.916 | Omega Healthcare Investors Inc (REIT) | 10.444.549 | 4,59 |
| 73.376 | ONEOK Inc | 4.311.941 | 1,89 |
| 176.635 | PPL Corp | 5.308.765 | 2,33 |
| 34.913 | Public Service Enterprise Group Inc | 2.329.919 | 1,02 |
| 179.544 | Verizon Communications Inc | 9.330.004 | 4,10 |
| 325.584 | Vistra Corp | 7.415.175 | 3,26 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|--|----------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| Aktien Forts. | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika Forts. | | | |
| 237.425 | Williams Cos Inc/The | 6.181.360 | 2,71 |
| Gesamtanlagen in Aktien | | 223.483.722 | 98,15 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 1.813.323 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 1.816.466) | | 1.813.323 | 0,80 |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | 225.297.045 | 98,95 |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (48.500) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (72.634)) | | (48.500) | (0,02) |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | (48.500) | (0,02) |
| Nettoumlaufvermögen | | 2.459.039 | 1,07 |
| Summe Nettovermögen | | 227.707.584 | 100,00 |
| Portfolioanalyse | | | |
| | | % des Gesamtvermögens | |
| An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | 97,56 | |
| Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate) | | 0,79 | |
| Sonstiges Umlaufvermögen | | 1,65 | |
| Gesamtvermögen | | 100,00 | |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| 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 | 15.288 | 17.305 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 101 | |
| Euro | US-Dollar | 5.848 | 6.627 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 33 | |
| Euro | US-Dollar | 8.585 | 9.715 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 61 | |
| Euro | US-Dollar | 5.667 | 6.413 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 40 | |
| Euro | US-Dollar | 4.919 | 5.579 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 22 | |
| Euro | US-Dollar | 9.322 | 10.569 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 46 | |
| Euro | US-Dollar | 661.064 | 748.118 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 4.660 | |
| | | | | | | | USD 4.963 |
| | | | | | | | EUR 4.359 |
| US-Dollar | Euro | 7.002 | 6.207 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (66) | |
| US-Dollar | Euro | 5.630 | 4.963 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (21) | |
| US-Dollar | Euro | 7.370 | 6.539 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (76) | |
| US-Dollar | Euro | 17.309 | 15.288 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (100) | |
| US-Dollar | Euro | 6.659 | 5.893 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (52) | |
| | | | | | | | USD (315) |
| | | | | | | | EUR (277) |
| BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund Anteilsklasse EUR H (Inc) (Hedged) | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 7.614 | 8.628 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 43 | |
| Euro | US-Dollar | 2.500 | 2.836 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 11 | |
| Euro | US-Dollar | 11.162 | 12.632 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 79 | |
| Euro | US-Dollar | 7.313 | 8.275 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 52 | |
| Euro | US-Dollar | 6.348 | 7.200 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 29 | |
| Euro | US-Dollar | 1.000 | 1.132 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 7 | |
| Euro | US-Dollar | 12.157 | 13.783 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 60 | |
| Euro | US-Dollar | 853.090 | 965.431 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 6.014 | |
| | | | | | | | USD 6.295 |
| | | | | | | | EUR 5.529 |
| US-Dollar | Euro | 1.132 | 1.000 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (7) | |
| US-Dollar | Euro | 8.593 | 7.605 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (67) | |
| US-Dollar | Euro | 9.104 | 8.070 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (86) | |
| US-Dollar | Euro | 9.511 | 8.438 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (97) | |
| | | | | | | | USD (257) |
| | | | | | | | EUR (226) |
| BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged) | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 866 | 982 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 5 | |
| Euro | US-Dollar | 1.266 | 1.432 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 9 | |
| Euro | US-Dollar | 830 | 939 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 6 | |
| Euro | US-Dollar | 721 | 818 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 3 | |
| Euro | US-Dollar | 1.390 | 1.576 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 7 | |

| Devisenterminkontrakte Forts. | | | | | | | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|---|-----------------|------------|------------|------------------|-----------------------------|---------|-------------------------------------|
| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | | |
| BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged) Forts. | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 96.458 | 109.160 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 680 | |
| | | | | | | | USD 710 |
| | | | | | | | EUR 624 |
| US-Dollar | Euro | 1.016 | 900 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (10) | |
| US-Dollar | Euro | 1.058 | 939 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (11) | |
| US-Dollar | Euro | 968 | 857 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (7) | |
| | | | | | | | USD (28) |
| | | | | | | | EUR (25) |
| BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged) | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 139.303 | 157.847 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 782 | |
| Euro | US-Dollar | 203.502 | 230.289 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.446 | |
| Euro | US-Dollar | 133.461 | 151.032 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 946 | |
| Euro | US-Dollar | 115.915 | 131.471 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 526 | |
| Euro | US-Dollar | 223.488 | 253.384 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.110 | |
| Euro | US-Dollar | 15.509.252 | 17.551.624 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 109.327 | |
| | | | | | | | USD 114.137 |
| | | | | | | | EUR 100.252 |
| US-Dollar | Euro | 163.323 | 144.782 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1.545) | |
| US-Dollar | Euro | 170.149 | 150.952 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1.745) | |
| US-Dollar | Euro | 155.655 | 137.755 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1.211) | |
| | | | | | | | USD (4.501) |
| | | | | | | | EUR (3.953) |
| BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund Anteilsklasse SGD J (Acc) (Hedged) | | | | | | | |
| Singapur-Dollar | US-Dollar | 14.187 | 10.458 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 68 | |
| Singapur-Dollar | US-Dollar | 20.572 | 15.077 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 187 | |
| Singapur-Dollar | US-Dollar | 1.984 | 1.450 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 22 | |
| Singapur-Dollar | US-Dollar | 13.746 | 10.071 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 129 | |
| Singapur-Dollar | US-Dollar | 11.728 | 8.597 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 106 | |
| Singapur-Dollar | US-Dollar | 9.918 | 7.273 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 87 | |
| Singapur-Dollar | US-Dollar | 22.380 | 16.549 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 57 | |
| Singapur-Dollar | US-Dollar | 1.548.134 | 1.134.368 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 14.364 | |
| | | | | | | | USD 15.020 |
| | | | | | | | SGD 20.241 |
| US-Dollar | Singapur-Dollar | 9.932 | 13.559 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (129) | |
| US-Dollar | Singapur-Dollar | 10.477 | 14.304 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (137) | |
| US-Dollar | Singapur-Dollar | 11.264 | 15.425 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (182) | |
| | | | | | | | USD (448) |
| | | | | | | | SGD (604) |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Devisenterminkontrakte Forts. | | | | | | |
|---|-----------------|------------|------------|------------------|-----------------------------|-------------------------------------|
| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
| BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund Anteilsklasse SGD J (Inc) (Hedged) | | | | | | |
| Singapur-Dollar | US-Dollar | 1.265 | 931 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 8 |
| Singapur-Dollar | US-Dollar | 992 | 730 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 6 |
| Singapur-Dollar | US-Dollar | 78.542 | 57.901 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 378 |
| Singapur-Dollar | US-Dollar | 113.876 | 83.460 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.037 |
| Singapur-Dollar | US-Dollar | 198.300 | 144.980 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 2.161 |
| Singapur-Dollar | US-Dollar | 490.000 | 358.347 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 5.238 |
| Singapur-Dollar | US-Dollar | 70.083 | 51.345 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 657 |
| Singapur-Dollar | US-Dollar | 59.794 | 43.830 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 538 |
| Singapur-Dollar | US-Dollar | 100.000 | 73.065 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.136 |
| Singapur-Dollar | US-Dollar | 1.984 | 1.459 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 13 |
| Singapur-Dollar | US-Dollar | 123.918 | 91.631 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 317 |
| Singapur-Dollar | US-Dollar | 19.836 | 14.533 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 185 |
| Singapur-Dollar | US-Dollar | 7.822.694 | 5.731.941 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 72.579 |
| | | | | | USD | 84.253 |
| | | | | | SGD | 113.539 |
| US-Dollar | Singapur-Dollar | 1.459 | 1.984 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (13) |
| US-Dollar | Singapur-Dollar | 50.188 | 68.515 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (650) |
| US-Dollar | Singapur-Dollar | 55.437 | 75.688 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (725) |
| US-Dollar | Singapur-Dollar | 571.35 | 78.243 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (922) |
| US-Dollar | Singapur-Dollar | 931 | 1.265 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (8) |
| | | | | | USD | (2.318) |
| | | | | | SGD | (3.124) |
| BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund Anteilsklasse Sterling E (Inc) (Hedged) | | | | | | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 431.967 | 579.355 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 5.320 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 629.796 | 839.494 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 12.946 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 410.980 | 546.053 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 10.216 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 358.174 | 477.668 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 7126 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 691.871 | 934.993 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.466 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 47.797.814 | 63.144.311 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.550.871 |
| | | | | | USD | 1.587.945 |
| | | | | | GBP | 1.173.171 |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 554.892 | 419.841 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (13.370) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 591.744 | 446.788 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (12.992) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 610.732 | 461.762 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (14.271) |
| | | | | | USD | (40.633) |
| | | | | | GBP | (30.020) |

BNY MELLON GLOBAL LEADERS FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % |
|--|---|----------------------------|-----------------------|
| Aktien | | | |
| Australien - 2.430.773 | | | |
| | (31. Dezember 2020: 1.180.185) | 2.430.773 | 3,72 |
| 11.500 | CSL Ltd | 2.430.773 | 3,72 |
| Kaiman-Inseln - 1.897.658 | | | |
| | (31. Dezember 2020: -) | 1.897.658 | 2,90 |
| 32.400 | Tencent Holdings Ltd | 1.897.658 | 2,90 |
| Dänemark - 3.086.481 | | | |
| | (31. Dezember 2020: 977.978) | 3.086.481 | 4,72 |
| 27.300 | Novo Nordisk A/S | 3.086.481 | 4,72 |
| Frankreich - 5.959.341 | | | |
| | (31. Dezember 2020: 3.461.994) | 5.959.341 | 9,12 |
| 8.300 | Air Liquide SA | 1.448.239 | 2,22 |
| 4.100 | L'Oreal SA | 1.946.145 | 2,98 |
| 3.100 | LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE | 2.564.957 | 3,92 |
| Hongkong - 2.438.141 | | | |
| | (31. Dezember 2020: 1.923.046) | 2.438.141 | 3,73 |
| 241.800 | AIA Group Ltd | 2.438.141 | 3,73 |
| Japan - 3.893.124 | | | |
| | (31. Dezember 2020: 3.345.736) | 3.893.124 | 5,96 |
| 5.900 | FANUC Corp | 1.252.013 | 1,92 |
| 4.200 | Keyence Corp | 2.641.111 | 4,04 |
| Niederlande - 2.574.834 | | | |
| | (31. Dezember 2020: 1.603.508) | 2.574.834 | 3,94 |
| 3.200 | ASML Holding NV | 2.574.834 | 3,94 |
| Spanien - 1.302.277 | | | |
| | (31. Dezember 2020: 1.464.367) | 1.302.277 | 1,99 |
| 40.100 | Industria de Diseno Textil SA | 1.302.277 | 1,99 |
| Schweiz - 2.788.051 | | | |
| | (31. Dezember 2020: 1.151.999) | 2.788.051 | 4,27 |
| 6.700 | Roche Holding AG | 2.788.051 | 4,27 |
| Taiwan - 2.707.087 | | | |
| | (31. Dezember 2020: 2.028.051) | 2.707.087 | 4,14 |
| 22.500 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR | 2.707.087 | 4,14 |
| Vereinigte Staaten von Amerika - 35.415.551 | | | |
| | (31. Dezember 2020: 21.089.087) | 35.415.551 | 54,19 |
| 4.700 | Adobe Inc | 2.666.028 | 4,08 |
| 640 | Alphabet Inc | 1.852.413 | 2,84 |
| 275 | Alphabet Inc | 795.959 | 1,22 |
| 33.800 | Amphenol Corp - Class A | 2.955.472 | 4,52 |
| 11.800 | Automatic Data Processing Inc | 2.910.411 | 4,45 |
| 5.950 | Ecolab Inc | 1.395.513 | 2,14 |
| 26.300 | Edwards Lifesciences Corp | 3.405.850 | 5,21 |
| 7.300 | Illumina Inc | 2.778.927 | 4,25 |
| 8.620 | Intuitive Surgical Inc | 3.096.088 | 4,74 |
| 5.400 | Mastercard Inc | 1.940.490 | 2,97 |
| 2.600 | Mastercard Inc | 934.310 | 1,43 |
| 8.200 | Microsoft Corp | 2.757.373 | 4,22 |
| 8.400 | NIKE Inc | 1.400.196 | 2,14 |
| 8.200 | NIKE Inc | 1.366.858 | 2,09 |
| 11.900 | Texas Instruments Inc | 2.243.567 | 3,43 |
| 15.700 | TJX Cos Inc/The | 1.192.258 | 1,82 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % |
|--|-----------------|----------------------------|-----------------------|
| Aktien Forts. | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika Forts. | | | |
| 22.700 | TJX Cos Inc/The | 1.723.838 | 2,64 |
| Gesamtanlagen in Aktien | | 64.493.318 | 98,68 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 7178 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 18.265) | | 7178 | 0,01 |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | 64.500.496 | 98,69 |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (562) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (933)) | | (562) | (0,00) |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | (562) | (0,00) |
| Nettoumlaufvermögen | | 857.126 | 1,31 |
| Summe Nettovermögen | | 65.357.060 | 100,00 |
| Portfolioanalyse % des Gesamtvermögens | | | |
| An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | 98,58 |
| Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate) | | | 0,01 |
| Sonstiges Umlaufvermögen | | | 1,41 |
| Gesamtvermögen | | | 100,00 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

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 | 167.372 | 25.464 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 165 |
| Dänische Krone | US-Dollar | 1.102 | 168 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1 |
| Dänische Krone | US-Dollar | 1.067 | 163 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1 |
| Dänische Krone | US-Dollar | 2.353 | 358 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 2 |
| Dänische Krone | US-Dollar | 3.529 | 537 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 4 |
| Dänische Krone | US-Dollar | 1.745 | 266 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1 |
| Dänische Krone | US-Dollar | 1.024 | 156 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1 |
| USD | | | | | | 175 |
| DKK | | | | | | 1.143 |
| US-Dollar | Dänische Krone | 176 | 1.158 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) |
| US-Dollar | Dänische Krone | 437 | 2.884 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (4) |
| US-Dollar | Dänische Krone | 235 | 1.545 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (2) |
| US-Dollar | Dänische Krone | 198 | 1.301 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) |
| US-Dollar | Dänische Krone | 408 | 2.694 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (4) |
| US-Dollar | Dänische Krone | 154 | 1.013 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) |
| USD | | | | | | (13) |
| DKK | | | | | | (85) |
| BNY Mellon Global Leaders Fund Anteilsklasse DKK W (Acc) (Hedged) | | | | | | |
| Dänische Krone | US-Dollar | 169.935 | 25.854 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 167 |
| Dänische Krone | US-Dollar | 1.154 | 176 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1 |
| Dänische Krone | US-Dollar | 1.090 | 166 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1 |
| Dänische Krone | US-Dollar | 2.395 | 364 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 2 |
| Dänische Krone | US-Dollar | 3.591 | 546 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 4 |
| Dänische Krone | US-Dollar | 1.778 | 271 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1 |
| Dänische Krone | US-Dollar | 1.045 | 159 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1 |
| USD | | | | | | 177 |
| DKK | | | | | | 1.156 |
| US-Dollar | Dänische Krone | 178 | 1.170 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) |
| US-Dollar | Dänische Krone | 442 | 2.912 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (4) |
| US-Dollar | Dänische Krone | 238 | 1.563 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (2) |
| US-Dollar | Dänische Krone | 200 | 1.316 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) |
| US-Dollar | Dänische Krone | 414 | 2.730 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (4) |
| US-Dollar | Dänische Krone | 154 | 1.011 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) |
| USD | | | | | | (13) |
| DKK | | | | | | (85) |
| BNY Mellon Global Leaders Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged) | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 249.366 | 282.204 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.758 |
| Euro | US-Dollar | 1.619 | 1.835 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 8 |
| Euro | US-Dollar | 1.580 | 1.790 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 9 |
| Euro | US-Dollar | 3.521 | 3.985 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 25 |
| Euro | US-Dollar | 5.242 | 5.933 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 37 |

Devisenterminkontrakte Forts.

| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|---|-------------------|------------|------------|------------------|-----------------------------|-------------------------------------|
| BNY Mellon Global Leaders Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged) Forts. | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 2.581 | 2.927 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 12 |
| Euro | US-Dollar | 1.539 | 1.739 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 13 |
| USD | | | | | | 1.862 |
| EUR | | | | | | 1.635 |
| US-Dollar | Euro | 1.960 | 1.735 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (15) |
| US-Dollar | Euro | 4.830 | 4.282 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (46) |
| US-Dollar | Euro | 2.576 | 2.278 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (18) |
| US-Dollar | Euro | 2.212 | 1.955 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (14) |
| US-Dollar | Euro | 4.543 | 4.030 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (47) |
| US-Dollar | Euro | 1.715 | 1.516 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (11) |
| USD | | | | | | (151) |
| EUR | | | | | | (133) |
| BNY Mellon Global Leaders Fund Anteilsklasse NOK H (Acc) (Hedged) | | | | | | |
| Norwegische Krone | US-Dollar | 1.747.119 | 194.092 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 4.260 |
| Norwegische Krone | US-Dollar | 1.111,3 | 1.257 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 4 |
| Norwegische Krone | US-Dollar | 24.454 | 2.761 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 16 |
| Norwegische Krone | US-Dollar | 36.624 | 4.122 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 37 |
| Norwegische Krone | US-Dollar | 17.921 | 1.996 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 39 |
| Norwegische Krone | US-Dollar | 10.652 | 1.181 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 28 |
| USD | | | | | | 4.384 |
| NOK | | | | | | 38.608 |
| Norwegische Krone | US-Dollar | 11.698 | 1.329 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) |
| US-Dollar | Norwegische Krone | 1.365 | 12.270 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (28) |
| US-Dollar | Norwegische Krone | 3.365 | 30.222 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (67) |
| US-Dollar | Norwegische Krone | 1.737 | 15.725 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (48) |
| US-Dollar | Norwegische Krone | 1.505 | 13.545 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (33) |
| US-Dollar | Norwegische Krone | 3.104 | 28.301 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (109) |
| US-Dollar | Norwegische Krone | 1.175 | 10.660 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (35) |
| USD | | | | | | (321) |
| NOK | | | | | | (2.827) |
| BNY Mellon Global Leaders Fund Anteilsklasse NOK W (Acc) (Hedged) | | | | | | |
| Norwegische Krone | US-Dollar | 198.088 | 22.006 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 483 |
| Norwegische Krone | US-Dollar | 1.367 | 155 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - |
| Norwegische Krone | US-Dollar | 1.267 | 143 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1 |
| Norwegische Krone | US-Dollar | 2.780 | 314 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 2 |
| Norwegische Krone | US-Dollar | 4.161 | 468 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 4 |
| Norwegische Krone | US-Dollar | 2.039 | 227 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 4 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte Forts.

| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|---|-------------------|------------|------------|------------------|-----------------------------|-------------------------------------|
| BNY Mellon Global Leaders Fund Anteilsklasse NOK W (Acc) (Hedged) Forts. | | | | | | |
| Norwegische Krone | US-Dollar | 1.214 | 135 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 3 |
| | | | | | | USD |
| | | | | | | 497 |
| | | | | | | NOK |
| | | | | | | 4.377 |
| US-Dollar | Norwegische Krone | 154 | 1.384 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (3) |
| US-Dollar | Norwegische Krone | 379 | 3.408 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (8) |
| US-Dollar | Norwegische Krone | 196 | 1.777 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (5) |
| US-Dollar | Norwegische Krone | 170 | 1.529 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (4) |
| US-Dollar | Norwegische Krone | 351 | 3.202 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (12) |
| US-Dollar | Norwegische Krone | 131 | 1.188 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (4) |
| | | | | | | USD |
| | | | | | | (36) |
| | | | | | | NOK |
| | | | | | | (317) |

BNY Mellon Global Leaders Fund Anteilsklasse SEK H (Acc) (Hedged)

| | | | | | | |
|-------------------|-------------------|---------|--------|-------------|-----------------------------|--------------|
| Schwedische Krone | US-Dollar | 190.719 | 21.073 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 35 |
| Schwedische Krone | US-Dollar | 1.198 | 133 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - |
| Schwedische Krone | US-Dollar | 1.213 | 133 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1 |
| Schwedische Krone | US-Dollar | 2.683 | 295 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 2 |
| Schwedische Krone | US-Dollar | 4.022 | 442 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 3 |
| Schwedische Krone | US-Dollar | 1.188 | 131 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - |
| | | | | | | USD |
| | | | | | | 41 |
| | | | | | | SEK |
| | | | | | | 370 |
| Schwedische Krone | US-Dollar | 1.981 | 220 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) |
| US-Dollar | Schwedische Krone | 149 | 1.354 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) |
| US-Dollar | Schwedische Krone | 361 | 3.303 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (5) |
| US-Dollar | Schwedische Krone | 198 | 1.809 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (2) |
| US-Dollar | Schwedische Krone | 166 | 1.507 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) |
| US-Dollar | Schwedische Krone | 337 | 3.070 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (3) |
| US-Dollar | Schwedische Krone | 127 | 1.156 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) |
| | | | | | | USD |
| | | | | | | (14) |
| | | | | | | SEK |
| | | | | | | (127) |

BNY Mellon Global Leaders Fund Anteilsklasse SEK W (Acc) (Hedged)

| | | | | | | |
|-------------------|-----------|---------|--------|-------------|-----------------------------|------------|
| Schwedische Krone | US-Dollar | 194.044 | 21.440 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 35 |
| Schwedische Krone | US-Dollar | 1.258 | 139 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - |
| Schwedische Krone | US-Dollar | 1.242 | 136 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1 |
| Schwedische Krone | US-Dollar | 2.737 | 301 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 2 |
| Schwedische Krone | US-Dollar | 4.099 | 450 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 3 |
| Schwedische Krone | US-Dollar | 1.215 | 134 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1 |
| | | | | | | USD |
| | | | | | | 42 |
| | | | | | | SEK |
| | | | | | | 380 |
| Schwedische Krone | US-Dollar | 2.023 | 224 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) |

Devisenterminkontrakte Forts.

| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|---|-------------------|------------|------------|------------------|-----------------------------|-------------------------------------|
| BNY Mellon Global Leaders Fund Anteilsklasse SEK W (Acc) (Hedged) Forts. | | | | | | |
| US-Dollar | Schwedische Krone | 151 | 1.371 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) |
| US-Dollar | Schwedische Krone | 365 | 3.342 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (5) |
| US-Dollar | Schwedische Krone | 201 | 1.835 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (2) |
| US-Dollar | Schwedische Krone | 168 | 1.527 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) |
| US-Dollar | Schwedische Krone | 342 | 3.118 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (3) |
| US-Dollar | Schwedische Krone | 127 | 1.156 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) |
| | | | | | | USD |
| | | | | | | (14) |
| | | | | | | SEK |
| | | | | | | (127) |

BNY MELLON GLOBAL OPPORTUNITIES FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|--|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Aktien | | | |
| China - 291.740 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.586.593) | | | |
| 40.500 | Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H' | 291.740 | 0,78 |
| Dänemark - 531.933 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 6.482 | Novozymes A/S | 531.933 | 1,43 |
| Frankreich - 374.463 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.033.439) | | | |
| 27.796 | Vivendi SE | 374.463 | 1,01 |
| Deutschland - 1.435.011 | | | |
| (31. Dezember 2020: 3.249.526) | | | |
| 7.899 | Bayer AG | 420.739 | 1,13 |
| 7.207 | SAP SE | 1.014.272 | 2,73 |
| Hongkong - 762.219 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.063.433) | | | |
| 75.600 | AIA Group Ltd | 762.219 | 2,05 |
| Indien - 645.133 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 32.386 | HDFC Bank Ltd | 645.133 | 1,73 |
| Japan - 2.700.132 | | | |
| (31. Dezember 2020: 2.407.963) | | | |
| 15.000 | Ebara Corp | 832.609 | 2,24 |
| 9.300 | Sony Group Corp | 1.170.377 | 3,15 |
| 18.100 | Suzuki Motor Corp | 697.146 | 1,87 |
| Niederlande - 2.615.990 | | | |
| (31. Dezember 2020: 2.097.197) | | | |
| 31.844 | Relx Plc | 1.026.675 | 2,76 |
| 27.796 | Universal Music Group NV | 780.781 | 2,10 |
| 6.927 | Wolters Kluwer NV | 808.534 | 2,17 |
| Republik Korea - 773.642 | | | |
| (31. Dezember 2020: 966.407) | | | |
| 1.403 | Samsung SDI Co Ltd | 773.642 | 2,08 |
| Schweden - 689.990 | | | |
| (31. Dezember 2020: 697.906) | | | |
| 34.316 | Swedbank AB | 689.990 | 1,86 |
| Schweiz - 1.829.076 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.748.240) | | | |
| 697 | Lonza Group AG | 581.495 | 1,56 |
| 3.004 | Roche Holding AG | 1.247.581 | 3,36 |
| Taiwan - 575.993 | | | |
| (31. Dezember 2020: 763.790) | | | |
| 4.783 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR | 575.993 | 1,55 |
| Vereinigtes Königreich - 3.913.520 | | | |
| (31. Dezember 2020: 4.523.479) | | | |
| 279.331 | Barclays Plc | 704.069 | 1,89 |
| 20.569 | Diageo Plc | 1.114.573 | 3,00 |
| 5.647 | Ferguson Plc | 996.326 | 2,68 |
| 55.604 | Informa Plc | 384.551 | 1,03 |
| 13.472 | Unilever Plc | 714.001 | 1,92 |
| Vereinigte Staaten von Amerika - 19.393.143 | | | |
| (31. Dezember 2020: 14.321.637) | | | |
| 71.17 | Abbott Laboratories | 1.003.533 | 2,70 |
| 2.987 | Accenture Plc - Class A | 1.236.484 | 3,32 |
| 667 | Alphabet Inc - Class A | 1.950.441 | 5,24 |
| 399 | Amazon.com Inc | 1.346.174 | 3,62 |
| 8.232 | Apple Inc | 1.467.189 | 3,94 |
| 5.510 | Applied Materials Inc | 870.415 | 2,34 |
| 9.556 | Citigroup Inc | 577.421 | 1,55 |
| 4.097 | CME Group Inc | 936.636 | 2,52 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|--|-----------------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| Aktien Forts. | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika Forts. | | | |
| 1.639 | Cooper Cos Inc/The | 695.247 | 1,87 |
| 1.155 | Costco Wholesale Corp | 651.408 | 1,75 |
| 3.419 | Ecolab Inc | 800.200 | 2,15 |
| 7.104 | Eversource Energy | 647.423 | 1,74 |
| 2.863 | Goldman Sachs Group Inc/The | 1.103.658 | 2,97 |
| 2.791 | Mastercard Inc | 1.007.942 | 2,71 |
| 9.223 | Medtronic Plc | 963.757 | 2,59 |
| 7.160 | Microsoft Corp | 2.429.710 | 6,53 |
| 6.038 | TE Connectivity Ltd | 969.914 | 2,61 |
| 3.884 | Texas Instruments Inc | 735.591 | 1,98 |
| Gesamtanlagen in Aktien | | 36.531.985 | 98,21 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 608 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 7.872) | | 608 | 0,00 |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | 36.532.593 | 98,21 |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (51) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (149)) | | (51) | (0,00) |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | (51) | (0,00) |
| Nettoumlaufvermögen | | 665.908 | 1,79 |
| Summe Nettovermögen | | 37.198.450 | 100,00 |

| Portfolioanalyse | % des Gesamtvermögens |
|--|-----------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 97,90 |
| Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate) | 0,00 |
| Sonstiges Umlaufvermögen | 2,10 |
| Gesamtvermögen | 100,00 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Devisenterminkontrakte | | | | | | |
|--|-----------|---------------|---------------|-----------------------|-----------------------------|---|
| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungs- datum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) |
| BNY Mellon Global Opportunities Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged) | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 256.584 | 289.935 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 539 |
| Euro | US-Dollar | 3.454 | 3.911 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - |
| Euro | US-Dollar | 1.520 | 1.719 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1 |
| US-Dollar | Euro | 1.471 | 1.299 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1 |
| | | | | | USD | 541 |
| | | | | | EUR | 478 |
| Euro | US-Dollar | 3.167 | 3.587 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) |
| Euro | US-Dollar | 1.670 | 1.893 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (2) |
| Euro | US-Dollar | 4.446 | 5.043 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (10) |
| US-Dollar | Euro | 4.148 | 3.669 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (6) |
| US-Dollar | Euro | 2.163 | 1.917 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (7) |
| US-Dollar | Euro | 2.824 | 2.503 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (10) |
| US-Dollar | Euro | 2.625 | 2.328 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (10) |
| | | | | | USD | (46) |
| | | | | | EUR | (41) |
| BNY Mellon Global Opportunities Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged) | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 31.882 | 36.026 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 67 |
| Euro | US-Dollar | 395 | 447 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - |
| Euro | US-Dollar | 209 | 237 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - |
| Euro | US-Dollar | 430 | 487 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - |
| Euro | US-Dollar | 191 | 217 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - |
| US-Dollar | Euro | 182 | 161 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - |
| | | | | | USD | 67 |
| | | | | | EUR | 59 |
| Euro | US-Dollar | 558 | 633 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) |
| US-Dollar | Euro | 513 | 453 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) |
| US-Dollar | Euro | 268 | 237 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) |
| US-Dollar | Euro | 350 | 310 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) |
| US-Dollar | Euro | 325 | 288 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) |
| | | | | | USD | (5) |
| | | | | | EUR | (4) |

BNY MELLON GLOBAL REAL RETURN FUND (EUR)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert EUR | Summe Nettover- mögen % |
|---|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| Guernsey - 13.681.925 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 3.757.699 | Cordiant Digital Infrastructure Ltd/Fund | 4.630.572 | 0,15 |
| 6.727.641 | Cordiant Digital Infrastructure Ltd/Fund | 9.051.353 | 0,29 |
| Irland - 14.947.842 | | | |
| (31. Dezember 2020: 119.941.755) | | | |
| 169.730 | DMS UCITS Platform ICAV - FVC Equity Dispersion UCITS Fund | 14.947.842 | 0,48 |
| Jersey - 117.419.475 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 696.569 | WisdomTree Copper - ETF | 24.136.968 | 0,77 |
| 14.626.056 | WisdomTree WTI Crude Oil - ETF | 93.282.507 | 2,99 |
| Vereinigtes Königreich - 4.710.306 | | | |
| (31. Dezember 2020: 3.407.634) | | | |
| 6.128.002 | Riverstone Credit Opportunities Income Plc/The Fund | 4.710.306 | 0,15 |
| Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen | | 150.759.548 | 4,83 |
| Anleihen | | | |
| Frankreich - 19.129.345 | | | |
| (31. Dezember 2020: 38.650.840) | | | |
| 2.192.000 | Altice France SA/France 'REGS' 3.375% 15-Jan-2028 | 2.141.650 | 0,07 |
| 3.450.000 | Altice France SA/France 'REGS' 4.000% 15-Jul-2029 | 3.413.775 | 0,11 |
| 5.797.000 | Altice France SA/France 'REGS' 4.125% 15-Jan-2029 | 5.775.348 | 0,18 |
| 1.987.000 | Banjay Entertainment SASU 'REGS' 3.500% 01-Mar-2025 | 1.999.786 | 0,06 |
| 5.488.000 | Iliad Holding SASU 'REGS' 5.625% 15-Oct-2028 | 5.798.786 | 0,19 |
| Deutschland - 4.508.453 | | | |
| (31. Dezember 2020: 17.977.468) | | | |
| 4.346.000 | TK Elevator Midco GmbH 'REGS' 4.375% 15-Jul-2027 | 4.508.453 | 0,14 |
| Indien - 4.295.303 | | | |
| (31. Dezember 2020: 4.040.109) | | | |
| 360.000.000 | National Highways Authority of India 7.300% 18-May-2022 | 4.295.303 | 0,14 |
| Irland - 8.666.890 | | | |
| (31. Dezember 2020: 8.628.304) | | | |
| 8.175.000 | AIB Group Plc FRN (Perpetual) 5.250% 09-Oct-2024 | 8.666.890 | 0,28 |
| Italien - 26.437.519 | | | |
| (31. Dezember 2020: 24.647.191) | | | |
| 11.036.000 | Intesa Sanpaolo SpA '144A' FRN (Perpetual) 7.700% 17-Sep-2025 | 10.976.811 | 0,35 |
| 9.962.000 | UniCredit SpA 'EMTN' FRN (Perpetual) 3.875% 03-Jun-2027 | 9.556.049 | 0,31 |
| 6.100.000 | UniCredit SpA FRN (Perpetual) 8.000% 03-Jun-2024 | 5.904.659 | 0,19 |
| Luxemburg - 6.582.618 | | | |
| (31. Dezember 2020: 6.680.709) | | | |
| 6.300.000 | Summer BC Holdco B SARL 'REGS' 5.750% 31-Oct-2026 | 6.582.618 | 0,21 |
| Spanien - 30.494.158 | | | |
| (31. Dezember 2020: 30.134.958) | | | |
| 6.600.000 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN (Perpetual) 5.875% 24-Sep-2023 | 7.052.034 | 0,23 |
| 8.600.000 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN (Perpetual) 6.000% 29-Mar-2024 | 9.274.928 | 0,30 |
| 8.400.000 | Banco Santander SA FRN (Perpetual) 4.750% 19-Mar-2025 | 8.706.936 | 0,28 |
| 5.200.000 | Banco Santander SA FRN (Perpetual) 5.250% 29-Sep-2023 | 5.460.260 | 0,17 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert EUR | Summe Nettover- mögen % |
|--|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Vereinigtes Königreich - 32.595.690 | | | |
| (31. Dezember 2020: 65.018.037) | | | |
| 20.000.000 | Lloyds Banking Group Plc FRN (Perpetual) 4.947% 27-Jun-2025 | 21.914.800 | 0,70 |
| 9.113.000 | Vmed O2 UK Financing I Plc 'REGS' 4.000% 31-Jan-2029 | 10.680.890 | 0,34 |
| Vereinigte Staaten von Amerika - 49.700.321 | | | |
| (31. Dezember 2020: 70.527.187) | | | |
| 10.411.000 | American Airlines Inc '144A' 11.750% 15-Jul-2025 | 11.418.154 | 0,37 |
| 7.726.000 | Ball Corp 2.875% 15-Aug-2030 | 6.643.532 | 0,21 |
| 3.648.000 | CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.500% 01-May-2026 | 3.315.494 | 0,11 |
| 8.048.419 | Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd '144A' 4.750% 20-Oct-2028 | 7.777.099 | 0,25 |
| 7.991.669 | Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd '144A' 6.500% 20-Jun-2027 | 7.556.762 | 0,24 |
| 5.512.000 | Sprint Capital Corp 8.750% 15-Mar-2032 | 7.313.034 | 0,23 |
| 4.493.000 | Sprint Corp 7.125% 15-Jun-2024 | 4.450.980 | 0,14 |
| 1.335.000 | United Airlines Inc '144A' 4.375% 15-Apr-2026 | 1.225.266 | 0,04 |
| Gesamtanlagen in Anleihen | | 182.410.297 | 5,84 |
| Aktien | | | |
| Australien - 16.182.426 | | | |
| (31. Dezember 2020: 11.362.441) | | | |
| 6.883.801 | Star Entertainment Grp Ltd/The | 16.182.426 | 0,52 |
| Kaiman-Inseln - 29.943.052 | | | |
| (31. Dezember 2020: 84.076.771) | | | |
| 780.449 | Alibaba Group Holding Ltd | 10.508.772 | 0,34 |
| 234.868 | Tencent Holdings Ltd | 12.152.430 | 0,39 |
| 1.202.329 | Tencent Music Entertainment Group ADR | 7.281.850 | 0,23 |
| China - 23.970.995 | | | |
| (31. Dezember 2020: 18.166.339) | | | |
| 1.597.000 | Flat Glass Group Co Ltd 'H' | 7.160.348 | 0,23 |
| 697.340 | Foshan Haitian Flavouring & Food Co Ltd 'A' | 10.160.408 | 0,33 |
| 556.560 | LONGi Green Energy Technology Co Ltd 'A' | 6.650.239 | 0,21 |
| Dänemark - 33.236.724 | | | |
| (31. Dezember 2020: 32.600.372) | | | |
| 198.338 | Novozymes A/S | 14.380.205 | 0,46 |
| 167.844 | Orsted AS '144A' | 18.856.519 | 0,61 |
| Finnland - 13.233.865 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 305.632 | Neste Oyj | 13.233.865 | 0,42 |
| Frankreich - 103.992.905 | | | |
| (31. Dezember 2020: 114.570.064) | | | |
| 99.873 | Air Liquide SA | 15.286.561 | 0,49 |
| 600.134 | Bureau Veritas SA | 17.490.905 | 0,56 |
| 151.068 | Legrand SA | 15.503.354 | 0,50 |
| 71.149 | L'Oreal SA | 29.816.767 | 0,95 |
| 35.730 | LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE | 25.895.318 | 0,83 |
| Deutschland - 116.690.913 | | | |
| (31. Dezember 2020: 130.032.769) | | | |
| 560.246 | Bayer AG | 26.365.177 | 0,84 |
| 256.861 | Continental AG | 23.926.602 | 0,77 |
| 650.237 | RWE AG | 23.161.442 | 0,74 |
| 243.675 | Volkswagen AG - Preference | 43.237.692 | 1,39 |
| Guernsey - 2.020.415 | | | |
| (31. Dezember 2020: 2.793.238) | | | |
| 5.954.200 | Amedeo Air Four Plus Ltd | 2.020.415 | 0,07 |
| Hongkong - 46.297.470 | | | |
| (31. Dezember 2020: 57.929.251) | | | |
| 3.307.600 | AIA Group Ltd | 29.463.334 | 0,94 |
| 2.166.000 | Link REIT (Units) (REIT) | 16.834.136 | 0,54 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert EUR | Nettovermögen % | Summe |
|---|--------------------------------------|-------------------------------|--------------------|-------|
| Aktien Forts. | | | | |
| Indien - 22.615.910 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 16.254.853) | | | | |
| 735.870 | Housing Development Finance Corp Ltd | 22.615.910 | 0,72 | |
| Irland - 175.729.128 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 149.211.335) | | | | |
| 76.996 | Accenture Plc - Class A | 28.159.976 | 0,90 | |
| 6.596.602 | Greencoat Renewables Plc | 7.355.211 | 0,24 | |
| 4.555 | Kerry Group Plc | 519.498 | 0,02 | |
| 160.225 | Linde Plc | 48.748.388 | 1,56 | |
| 454.592 | Medtronic Plc | 41.968.967 | 1,34 | |
| 315.067 | Ryanair Holdings Plc ADR | 28.446.071 | 0,91 | |
| 115.710 | Trane Technologies Plc | 20.531.017 | 0,66 | |
| Japan - 81.860.778 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 29.958.552) | | | | |
| 283.400 | Advantest Corp | 23.707.544 | 0,76 | |
| 360.200 | Sony Group Corp | 40.049.526 | 1,28 | |
| 532.000 | Suzuki Motor Corp | 18.103.708 | 0,58 | |
| Jersey - 17.000.914 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 16.268.214) | | | | |
| 109.063 | Ferguson Plc | 17.000.914 | 0,54 | |
| Niederlande - 58.603.997 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 26.725.046) | | | | |
| 61.483 | ASML Holding NV | 43.569.928 | 1,40 | |
| 605.785 | Universal Music Group NV | 15.034.069 | 0,48 | |
| Norwegen - 11.209.716 | | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | | |
| 177.417 | TOMRA Systems ASA | 11.209.716 | 0,36 | |
| Republik Korea - 23.691.757 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 27.181.274) | | | | |
| 48.630 | Samsung SDI Co Ltd | 23.691.757 | 0,76 | |
| Schweiz - 133.202.817 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 115.881.669) | | | | |
| 413.201 | Alcon Inc | 32.288.219 | 1,04 | |
| 137.711 | Chubb Ltd | 23.498.525 | 0,75 | |
| 25.423 | Lonza Group AG | 18.739.196 | 0,60 | |
| 127.890 | Nestle SA | 15.775.560 | 0,51 | |
| 302.287 | TE Connectivity Ltd | 42.901.317 | 1,37 | |
| Vereinigtes Königreich - 343.171.805 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 243.239.383) | | | | |
| 859.556 | 3i Group Plc | 14.887.946 | 0,48 | |
| 896.758 | Associated British Foods Plc | 21.375.269 | 0,68 | |
| 480.719 | AstraZeneca Plc | 49.322.471 | 1,58 | |
| 1.835.589 | BAE Systems Plc | 12.022.349 | 0,38 | |
| 2.485.400 | Barratt Developments Plc | 22.104.930 | 0,71 | |
| 723.882 | Diageo Plc | 34.655.654 | 1,11 | |
| 5.347.406 | Impact Healthcare Reit Plc (REIT) | 7.589.124 | 0,24 | |
| 1.947.683 | Informa Plc | 11.900.828 | 0,38 | |
| 8.876.289 | Melrose Industries Plc | 16.740.132 | 0,54 | |
| 585.543 | Persimmon Plc | 19.949.168 | 0,64 | |
| 2.412.156 | Prudential Plc | 36.459.470 | 1,17 | |
| 1.126.650 | Relx Plc | 32.092.625 | 1,03 | |
| 9.563.858 | Taylor Wimpey Plc | 19.972.616 | 0,64 | |
| 881.366 | Travis Perkins Plc | 16.506.586 | 0,53 | |
| 525.725 | Unilever Plc | 24.617.073 | 0,79 | |
| 1.053.172 | Wickes Group Plc | 2.975.564 | 0,09 | |
| Vereinigte Staaten von Amerika - 720.241.563 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 521.763.297) | | | | |
| 220.643 | Abbott Laboratories | 27.487.525 | 0,88 | |
| 18.174 | Alphabet Inc - Class A | 46.953.565 | 1,50 | |
| 9.881 | Amazon.com Inc | 29.453.725 | 0,94 | |
| 27.608 | American Tower Corp (REIT) | 7.102.438 | 0,23 | |
| 693.619 | Bank of America Corp | 27.285.749 | 0,87 | |
| 233.773 | CME Group Inc | 47.218.268 | 1,51 | |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert EUR | Nettovermögen % | Summe |
|---|--|-------------------------------|--------------------|-------|
| Aktien Forts. | | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika Forts. | | | | |
| 554.484 | ConocoPhillips | 35.414.264 | 1,13 | |
| 181.533 | Dominion Energy Inc | 12.586.294 | 0,40 | |
| 179.091 | Ecolab Inc | 37.032.592 | 1,19 | |
| 453.038 | Elanco Animal Health Inc | 11.485.551 | 0,37 | |
| 41.620 | Eli Lilly & Co | 10.197.696 | 0,33 | |
| 129.803 | Eversource Energy | 10.451.555 | 0,34 | |
| 110.515 | Fidelity National Information Services Inc | 10.740.998 | 0,34 | |
| 71.916 | Goldman Sachs Group Inc/The | 24.493.431 | 0,79 | |
| 86.297 | Hubbell Inc - Class B | 15.810.755 | 0,51 | |
| 31.592 | IDEXX Laboratories Inc | 18.467.156 | 0,59 | |
| 308.847 | JPMorgan Chase & Co | 43.232.017 | 1,39 | |
| 36.771 | Lockheed Martin Corp | 11.490.670 | 0,37 | |
| 76.055 | Mastercard Inc | 24.266.902 | 0,78 | |
| 147.923 | Microsoft Corp | 44.349.440 | 1,42 | |
| 178.247 | Morgan Stanley | 15.558.516 | 0,50 | |
| 264.485 | NIKE Inc | 39.141.710 | 1,25 | |
| 135.785 | Norfolk Southern Corp | 35.359.753 | 1,13 | |
| 380.713 | Otis Worldwide Corp | 29.056.749 | 0,93 | |
| 87.628 | salesforce.com Inc | 19.766.133 | 0,63 | |
| 54.350 | Sherwin-Williams Co/The | 16.825.998 | 0,54 | |
| 64.264 | Thermo Fisher Scientific Inc | 37.796.712 | 1,21 | |
| 278.741 | Yum China Holdings Inc | 12.134.963 | 0,39 | |
| 88.110 | Zoetis Inc | 19.080.438 | 0,61 | |
| Gesamtanlagen in Aktien | | 1.972.897.150 | 63,20 | |
| Kapitalbeteiligungsinstrumente | | | | |
| Guernsey - 119.250.810 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 105.213.933) | | | | |
| 6.549.058 | Bluefield Solar Income Fund Ltd | 9.684.399 | 0,31 | |
| 14.081.036 | Hipgnosis Songs Fund Ltd/The Fund | 21.006.705 | 0,67 | |
| 17.589.278 | International Public Partnerships Ltd | 35.538.746 | 1,14 | |
| 6.816.822 | JLEN Environmental Assets Group Ltd Foresight Group Holdings | 8.546.387 | 0,27 | |
| 27.855.487 | Renewables Infrastructure Group Ltd/The | 44.474.573 | 1,43 | |
| Luxemburg - 13.353.511 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 12.379.424) | | | | |
| 6.379.760 | BBGI Global Infrastructure SA | 13.353.511 | 0,43 | |
| Vereinigtes Königreich - 77.385.503 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 66.132.581) | | | | |
| 23.468.108 | BioPharma Credit Plc/The Fund | 20.091.522 | 0,64 | |
| 25.091.832 | Greencoat UK Wind Plc/Funds | 42.003.931 | 1,35 | |
| 10.952.766 | Sdcl Energy Efficiency Income Trust Plc | 15.290.050 | 0,49 | |
| Gesamtanlagen in Kapitalbeteiligungsinstrumenten | | 209.989.824 | 6,73 | |
| Optionsscheine | | | | |
| Luxemburg - 44.051.853 | | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | | |
| 318.018 | Ensemble Investment Corporation SA (WTS) 27-Oct-2022 | 44.051.853 | 1,41 | |
| Vereinigtes Königreich - 139.975.593 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 88.559.036) | | | | |
| 768.117 | Barclays Bank Plc (WTS) 12-Aug-2022 | 70.922.926 | 2,27 | |
| 768.117 | Barclays Bank Plc (WTS) 15-Aug-2022 | 69.052.667 | 2,21 | |
| Gesamtanlagen in Optionsscheinen | | 184.027.446 | 5,89 | |
| Indexoptionen - 26.754.878 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 23.915.389) | | | | |
| 743 | CBOE S&P 500 Index Put 17-Mar-2022 4,450.000 | 3.971.506 | 0,13 | |
| 799 | CBOE S&P 500 Index Put 17-Nov-2022 4,500.000 | 18.798.748 | 0,60 | |
| 7434 | EURO STOXX 50 Index Put 18-Mar-2022 3,950.000 | 3.984.624 | 0,13 | |
| Indexoptionen insgesamt | | 26.754.878 | 0,86 | |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Zugrunde liegendes Engagement EUR | Beizulegender Zeitwert EUR | Nettovermögen % |
|---|--|-----------------------------------|----------------------------|-----------------|
| Offene Terminkontrakte - 1.619.234 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 3.967.462) | | | | |
| 413 | FTSE 250 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2022 | 23.078.622 | 405.794 | 0,01 |
| 367 | Nikkei 225 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2022 | 81.061.955 | 1.213.440 | 0,04 |

Offene Terminkontrakte insgesamt 1.619.234 0,05

Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 2.678.463 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 65.016.516) 2.678.463 0,09

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt 2.731.136.840 87,49

| Bestände | Beschreibung | Zugrunde liegendes Engagement EUR | Beizulegender Zeitwert EUR | Nettovermögen % |
|---|-------------------------------------|-----------------------------------|----------------------------|-----------------|
| Indexoptionen - (18.691.421) | | | | |
| (31. Dezember 2020: (8.313.488)) | | | | |
| (743) | CBOE S&P 500 Index Put 17-Mar-2022 | 4.250.000 | (2.533.886) | (0,08) |
| (799) | CBOE S&P 500 Index Put 17-Nov-2022 | 4.200.000 | (13.629.975) | (0,44) |
| (7.434) | EURO STOXX 50 Index Put 18-Mar-2022 | 3.750.000 | (2.527.560) | (0,08) |

Indexoptionen insgesamt (18.691.421) (0,60)

| Bestände | Beschreibung | Zugrunde liegendes Engagement EUR | Beizulegender Zeitwert EUR | Nettovermögen % |
|---|---|-----------------------------------|----------------------------|-----------------|
| Offene Terminkontrakte - (2.277.516) | | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | | |
| (550) | E-mini S&P 500 Index Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (115.948.960) | (2.277.516) | (0,07) |

Offene Terminkontrakte insgesamt (2.277.516) (0,07)

Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (44.019.460) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (16.084.605)) (44.019.460) (1,41)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt (64.988.397) (2,08)

Nettoumlaufvermögen 455.580.316 14,59

Summe Nettovermögen 3.121.728.759 100,00

Der Kontrahent für Indexoptionen ist die UBS AG.
Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist die UBS AG.

Portfolioanalyse % des Gesamtvermögens

| | |
|--|---------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 84,58 |
| An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente | 0,89 |
| Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate) | 0,08 |
| Sonstiges Umlaufvermögen | 14,45 |
| Gesamtvermögen | 100,00 |

Devisenterminkontrakte

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

BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)

| | | | | | | |
|----------------------|-------------------|---------------|----------------|-------------|-----------------------------|----------------------|
| Euro | Schwedische Krone | 12.149.098 | 120.421.827 | 14. Jan. 22 | State Street Bank | 408.666 |
| Indische Rupie | US-Dollar | 4.225.986.219 | 56.154.808 | 14. Jan. 22 | State Street Bank | 556.382 |
| Pfund Sterling | Euro | 4.095.263 | 4.810.950 | 14. Jan. 22 | Royal Bank of Scotland | 63.827 |
| Pfund Sterling | Euro | 16.533.770 | 19.400.494 | 14. Jan. 22 | Canadian Imperial Bank | 280.399 |
| Euro | Japanischer Yen | 1.822.359 | 234.099.230 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 26.706 |
| Euro | Japanischer Yen | 1.055.350 | 135.494.118 | 18. Feb. 22 | HSBC Bank plc | 16.045 |
| Euro | Japanischer Yen | 16.780.244 | 2.167.523.478 | 18. Feb. 22 | Canadian Imperial Bank | 154.304 |
| Hongkong-Dollar | Euro | 25.870.602 | 2.925.080 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | 3.518 |
| Schweizer Franken | Euro | 4.838.719 | 4.590.993 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 92.604 |
| Schweizer Franken | Euro | 1.658.451 | 1.583.941 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 21.342 |
| Schweizer Franken | Euro | 3.921.514 | 3.737.904 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 57.893 |
| Schweizer Franken | Euro | 2.564.353 | 2.446.673 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | 35.471 |
| Schweizer Franken | Euro | 4.127.016 | 3.941.068 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | 53.642 |
| Schweizer Franken | Euro | 7.234.992 | 6.912.014 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 91.036 |
| Schweizer Franken | Euro | 5.760.513 | 5.482.513 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 93.327 |
| Schweizer Franken | Euro | 2.801.830 | 2.661.037 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 50.971 |
| Schweizer Franken | Euro | 2.462.053 | 2.332.307 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 50.816 |
| Schweizer Franken | Euro | 2.845.949 | 2.703.093 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | 51.619 |
| Schweizer Franken | Euro | 2.897.188 | 2.745.618 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 58.691 |
| Schweizer Franken | Euro | 3.381.158 | 3.207.419 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | 65.345 |
| Schweizer Franken | Euro | 2.867.990 | 2.711.438 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 64.608 |
| Schweizer Franken | Euro | 2.899.494 | 2.740.281 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 66.260 |
| Schweizer Franken | Euro | 4.382.105 | 4.194.592 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 47.029 |
| US-Dollar | Euro | 11.291.050 | 9.909.743 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 57.036 |
| US-Dollar | Euro | 11.643.894 | 10.220.307 | 18. Feb. 22 | Canadian Imperial Bank | 57.933 |
| US-Dollar | Euro | 10.938.201 | 9.591.547 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 63.767 |
| Australischer Dollar | Euro | 1.621.691 | 1.022.851 | 16. Mrz. 22 | The Bank of New York Mellon | 14.606 |
| | | | | | | EUR 2.603.843 |
| Euro | Pfund Sterling | 436.824 | 370.339 | 14. Jan. 22 | Canadian Imperial Bank | (4.007) |
| Euro | Pfund Sterling | 675.431 | 571.592 | 14. Jan. 22 | State Street Bank | (4.960) |
| Euro | Pfund Sterling | 614.464 | 522.445 | 14. Jan. 22 | State Street Bank | (7.428) |
| Euro | Pfund Sterling | 3.132.351 | 2.667.183 | 14. Jan. 22 | State Street Bank | (42.517) |
| Euro | Pfund Sterling | 526.801 | 448.569 | 14. Jan. 22 | State Street Bank | (7.151) |
| Euro | Pfund Sterling | 1.264.114 | 1.076.896 | 14. Jan. 22 | Canadian Imperial Bank | (17.764) |
| Euro | Pfund Sterling | 420.413 | 358.737 | 14. Jan. 22 | Royal Bank of Scotland | (6.608) |
| Euro | Pfund Sterling | 482.569.709 | 411.861.183 | 14. Jan. 22 | Royal Bank of Scotland | (7.687.253) |
| Euro | Pfund Sterling | 1.415.645 | 1.190.274 | 14. Jan. 22 | State Street Bank | (1.192) |
| Euro | Pfund Sterling | 398.655 | 334.218 | 14. Jan. 22 | Canadian Imperial Bank | (1.179) |
| Euro | Pfund Sterling | 482.343 | 408.621 | 14. Jan. 22 | Canadian Imperial Bank | (4.057) |
| Russischer Rubel | US-Dollar | 1.312.442.395 | 18.194.076 | 14. Jan. 22 | State Street Bank | (643.366) |
| Russischer Rubel | US-Dollar | 661.697.430 | 9.174.251 | 14. Jan. 22 | State Street Bank | (325.513) |
| Schwedische Krone | Euro | 549.752.645 | 54.208.555 | 14. Jan. 22 | Royal Bank of Scotland | (610.853) |
| US-Dollar | Indische Rupie | 10.818.420 | 817.991.564 | 14. Jan. 22 | State Street Bank | (152.773) |
| US-Dollar | Indische Rupie | 44.774.873 | 3.407.994.655 | 14. Jan. 22 | State Street Bank | (899.610) |
| Australischer Dollar | US-Dollar | 65.013.781 | 48.158.666 | 18. Feb. 22 | Canadian Imperial Bank | (898.575) |
| Euro | Hongkong-Dollar | 63.828.875 | 576.099.954 | 18. Feb. 22 | The Bank of New York Mellon | (1.386.645) |
| Euro | Japanischer Yen | 79.638.072 | 10.458.246.869 | 18. Feb. 22 | The Bank of New York Mellon | (581.676) |
| Euro | Schweizer Franken | 98.324.462 | 104.026.642 | 18. Feb. 22 | JPMorgan Chase Bank | (2.367.249) |
| Euro | Schweizer Franken | 7.021.288 | 7.305.406 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (49.919) |
| Euro | Schweizer Franken | 5.260.472 | 5.469.075 | 18. Feb. 22 | HSBC Bank plc | (33.274) |
| Euro | US-Dollar | 378.065 | 429.930 | 18. Feb. 22 | Canadian Imperial Bank | (1.441) |
| Euro | US-Dollar | 3.380.901 | 3.879.976 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | (44.012) |
| Euro | US-Dollar | 1.064.246.344 | 1.235.478.260 | 18. Feb. 22 | Barclays Bank PLC | (26.328.848) |
| Euro | US-Dollar | 183.653 | 209.294 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (1.094) |
| Euro | US-Dollar | 6.690.073 | 7.607.790 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | (25.438) |
| Euro | US-Dollar | 1.068.931 | 1.211.590 | 18. Feb. 22 | JPMorgan Chase Bank | (557) |
| Euro | US-Dollar | 6.604.166 | 7.575.427 | 18. Feb. 22 | Canadian Imperial Bank | (82.777) |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte Forts.

| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|--|----------------------|----------------|------------|------------------|------------------------|-------------------------------------|
| BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) Forts. | | | | | | |
| Hongkong-Dollar | Euro | 6.555.659 | 745.298 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | (3.186) |
| Hongkong-Dollar | Euro | 5.413.313 | 613.027 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | (230) |
| Hongkong-Dollar | Euro | 3.572.920 | 404.523 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | (62) |
| Hongkong-Dollar | Euro | 13.841.765 | 1.568.873 | 18. Feb. 22 | Canadian Imperial Bank | (1.961) |
| Ungarischer Forint | Euro | 22.616.747.582 | 62.436.154 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (1.600.446) |
| Japanischer Yen | Euro | 669.724.311 | 5.226.376 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (89.271) |
| Euro | Australischer Dollar | 7.215.749 | 11.430.266 | 16. Mrz. 22 | Royal Bank of Scotland | (96.626) |
| | | | | | | EUR (44.009.516) |

BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) Anteilsklasse CHF W (Acc) (Hedged)

| | | | | | | |
|-------------------|-------------------|---------|---------|-------------|-----------------------------|------------------|
| Schweizer Franken | Euro | 903.299 | 864.759 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 9.412 |
| Schweizer Franken | Euro | 4.952 | 4.763 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 29 |
| Schweizer Franken | Euro | 7.651 | 7.345 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 59 |
| Schweizer Franken | Euro | 8.441 | 8.139 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 30 |
| | | | | | | EUR 9.530 |
| | | | | | | CHF 9.848 |
| Euro | Schweizer Franken | 11.559 | 12.013 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (67) |
| Euro | Schweizer Franken | 6.327 | 6.585 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (45) |
| | | | | | | EUR (112) |
| | | | | | | CHF (116) |

BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) Anteilsklasse SGD H (Acc) (Hedged)

| | | | | | | |
|-----------------|-----------------|-----------|-----------|-------------|-----------------------------|--------------------|
| Singapur-Dollar | Euro | 26.469 | 17.194 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 126 |
| Singapur-Dollar | Euro | 40.889 | 26.482 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 274 |
| Singapur-Dollar | Euro | 4.774.044 | 3.093.338 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 30.542 |
| Singapur-Dollar | Euro | 44.879 | 29.262 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 105 |
| | | | | | | EUR 31.047 |
| | | | | | | SGD 47.434 |
| Euro | Singapur-Dollar | 39.617 | 61.223 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (444) |
| Euro | Singapur-Dollar | 23.371 | 36.126 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (268) |
| | | | | | | EUR (712) |
| | | | | | | SGD (1.088) |

BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) Anteilsklasse Sterling H (Acc) (Hedged)

| | | | | | | |
|----------------|----------------|-----------|-----------|-------------|-----------------------------|-------------------|
| Pfund Sterling | Euro | 8.367 | 9.907 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 52 |
| Pfund Sterling | Euro | 12.842 | 15.125 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 161 |
| Pfund Sterling | Euro | 14.374 | 17.081 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 29 |
| Pfund Sterling | Euro | 1.526.478 | 1.783.557 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 33.479 |
| | | | | | | EUR 33.721 |
| | | | | | | GBP 28.322 |
| Euro | Pfund Sterling | 23.743 | 20.303 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (424) |

Devisenterminkontrakte Forts.

| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|--|----------------|------------|------------|------------------|-----------------------------|-------------------------------------|
| BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) Anteilsklasse Sterling H (Acc) (Hedged) Forts. | | | | | | |
| Euro | Pfund Sterling | 13.428 | 11.447 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (199) |
| | | | | | | EUR (623) |
| | | | | | | GBP (523) |

BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) Anteilsklasse USD H (Acc) (Hedged)

| | | | | | | |
|-----------|-----------|-----------|-----------|-------------|-----------------------------|--------------------|
| Euro | US-Dollar | 50.291 | 56.856 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 68 |
| Euro | US-Dollar | 28.923 | 32.626 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 104 |
| US-Dollar | Euro | 24.631 | 21.750 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 7 |
| US-Dollar | Euro | 37.894 | 33.443 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 30 |
| US-Dollar | Euro | 59.480 | 52.494 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 47 |
| US-Dollar | Euro | 41.835 | 36.889 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 66 |
| | | | | | | EUR 322 |
| | | | | | | USD 364 |
| US-Dollar | Euro | 4.366.774 | 3.865.790 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (8.497) |
| | | | | | | EUR (8.497) |
| | | | | | | USD (9.617) |

BNY MELLON GLOBAL REAL RETURN FUND (GBP)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert GBP | Summe Nettover- mögen % |
|---|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| Guernsey - 280.659 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | 280.659 | 0,42 |
| 87.936 | Cordiant Digital Infrastructure Ltd/Fund | 91.014 | 0,14 |
| 167.828 | Cordiant Digital Infrastructure Ltd/Fund | 189.645 | 0,28 |
| Irland - 313.692 | | | |
| (31. Dezember 2020: 2.120.819) | | 313.692 | 0,48 |
| 4.241 | DMS UCITS Platform ICAV - FVC Equity Dispersion UCITS Fund | 313.692 | 0,48 |
| Jersey - 2.288.129 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | 2.288.129 | 3,47 |
| 16.423 | WisdomTree Copper - ETF | 477.968 | 0,72 |
| 337.922 | WisdomTree WTI Crude Oil - ETF | 1.810.161 | 2,75 |
| Vereinigtes Königreich - 209.528 | | | |
| (31. Dezember 2020: 197.469) | | 209.528 | 0,32 |
| 160.866 | Gresham House Energy Storage Fund Plc/The Fund | 209.528 | 0,32 |
| Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen | | 3.092.008 | 4,69 |
| Anleihen | | | |
| Frankreich - 239.363 | | | |
| (31. Dezember 2020: 853.353) | | 239.363 | 0,36 |
| 145.000 | Altice France SA/France 'REGS' 4,125% 15-Jan-2029 | 121.330 | 0,18 |
| 133.000 | Iliad Holding SASU 'REGS' 5,625% 15-Oct-2028 | 118.033 | 0,18 |
| Deutschland - 87.130 | | | |
| (31. Dezember 2020: 285.977) | | 87.130 | 0,13 |
| 100.000 | TK Elevator Midco GmbH 'REGS' 4,375% 15-Jul-2027 | 87.130 | 0,13 |
| Indien - 100.212 | | | |
| (31. Dezember 2020: 100.923) | | 100.212 | 0,15 |
| 10.000.000 | National Highways Authority of India 7,300% 18-May-2022 | 100.212 | 0,15 |
| Irland - 178.087 | | | |
| (31. Dezember 2020: 189.831) | | 178.087 | 0,27 |
| 200.000 | AlB Group Plc FRN (Perpetual) 5,250% 09-Oct-2024 | 178.087 | 0,27 |
| Italien - 558.492 | | | |
| (31. Dezember 2020: 556.598) | | 558.492 | 0,85 |
| 200.000 | Intesa Sanpaolo SpA '144A' FRN (Perpetual) 7,700% 17-Sep-2025 | 167.079 | 0,25 |
| 284.000 | UniCredit SpA 'EMTN' FRN (Perpetual) 3,875% 03-Jun-2027 | 228.812 | 0,35 |
| 200.000 | UniCredit SpA FRN (Perpetual) 8,000% 03-Jun-2024 | 162.601 | 0,25 |
| Luxemburg - 174.638 | | | |
| (31. Dezember 2020: 189.773) | | 174.638 | 0,27 |
| 199.000 | Summer BC Holdco B SARL 'REGS' 5,750% 31-Oct-2026 | 174.638 | 0,27 |
| Spanien - 534.766 | | | |
| (31. Dezember 2020: 564.255) | | 534.766 | 0,81 |
| 200.000 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN (Perpetual) 5,875% 24-Sep-2023 | 179.485 | 0,27 |
| 200.000 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN (Perpetual) 6,000% 29-Mar-2024 | 181.163 | 0,28 |
| 200.000 | Banco Santander SA FRN (Perpetual) 4,750% 19-Mar-2025 | 174.118 | 0,26 |
| Vereinigtes Königreich - 4.025.858 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.208.107) | | 4.025.858 | 6,11 |
| 276.000 | Lloyds Banking Group Plc FRN (Perpetual) 4,947% 27-Jun-2025 | 254.006 | 0,39 |
| 3.600.000 | United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0,000% 19-Apr-2022 | 3.598.596 | 5,46 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert GBP | Summe Nettover- mögen % |
|---|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Vereinigtes Königreich Forts. | | | |
| 176.000 | Vmed 02 UK Financing I Plc 'REGS' 4,000% 31-Jan-2029 | 173.256 | 0,26 |
| Vereinigte Staaten von Amerika - 1.149.862 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.707.324) | | 1.149.862 | 1,75 |
| 250.000 | American Airlines Inc '144A' 11,750% 15-Jul-2025 | 230.288 | 0,35 |
| 186.000 | Ball Corp 2,875% 15-Aug-2030 | 134.334 | 0,20 |
| 200.944 | Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd '144A' 4,750% 20-Oct-2028 | 163.083 | 0,25 |
| 200.000 | Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd '144A' 6,500% 20-Jun-2027 | 158.839 | 0,24 |
| 215.000 | Radiate Holdco LLC / Radiate Finance Inc '144A' 4,500% 15-Sep-2026 | 161.732 | 0,25 |
| 150.000 | Sprint Capital Corp 8,750% 15-Mar-2032 | 167.150 | 0,25 |
| 131.000 | Sprint Corp 7,125% 15-Jun-2024 | 108.998 | 0,17 |
| 33.000 | United Airlines Inc '144A' 4,375% 15-Apr-2026 | 25.438 | 0,04 |
| Gesamtanlagen in Anleihen | | 7.048.408 | 10,70 |
| Aktien | | | |
| Kaiman-Inseln - 500.150 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.532.719) | | 500.150 | 0,76 |
| 16.223 | Alibaba Group Holding Ltd | 183.471 | 0,28 |
| 4.280 | Tencent Holdings Ltd | 185.999 | 0,28 |
| 25.690 | Tencent Music Entertainment Group ADR | 130.680 | 0,20 |
| China - 476.898 | | | |
| (31. Dezember 2020: 363.539) | | 476.898 | 0,72 |
| 40.000 | Flat Glass Group Co Ltd 'H' | 150.632 | 0,23 |
| 16.000 | Foshan Haitian Flavouring & Food Co Ltd 'A' | 195.801 | 0,29 |
| 13.000 | LONGi Green Energy Technology Co Ltd 'A' | 130.465 | 0,20 |
| Dänemark - 722.170 | | | |
| (31. Dezember 2020: 725.086) | | 722.170 | 1,10 |
| 5.159 | Novozymes A/S | 314.161 | 0,48 |
| 4.324 | Orsted AS '144A' | 408.009 | 0,62 |
| Finnland - 271.121 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | 271.121 | 0,41 |
| 7.455 | Neste Oyj | 271.121 | 0,41 |
| Frankreich - 2.243.887 | | | |
| (31. Dezember 2020: 2.410.013) | | 2.243.887 | 3,40 |
| 2.615 | Air Liquide SA | 336.172 | 0,51 |
| 16.546 | Bureau Veritas SA | 405.028 | 0,61 |
| 3.805 | Legrand SA | 327.971 | 0,50 |
| 1.800 | L'Oreal SA | 633.566 | 0,96 |
| 889 | LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE | 541.150 | 0,82 |
| Deutschland - 2.326.830 | | | |
| (31. Dezember 2020: 2.687.947) | | 2.326.830 | 3,53 |
| 13.441 | Bayer AG | 531.265 | 0,80 |
| 6.219 | Continental AG | 486.554 | 0,74 |
| 16.700 | RWE AG | 499.618 | 0,76 |
| 5.431 | Volkswagen AG - Preference | 809.393 | 1,23 |
| Guernsey - 35.653 | | | |
| (31. Dezember 2020: 52.776) | | 35.653 | 0,05 |
| 125.098 | Amedeo Air Four Plus Ltd | 35.653 | 0,05 |
| Hongkong - 902.209 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.222.401) | | 902.209 | 1,37 |
| 82.200 | AlA Group Ltd | 614.990 | 0,93 |
| 44.000 | Link REIT (Units) (REIT) | 287.219 | 0,44 |
| Indien - 492.928 | | | |
| (31. Dezember 2020: 366.223) | | 492.928 | 0,75 |
| 19.096 | Housing Development Finance Corp Ltd | 492.928 | 0,75 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert GBP | Summe Nettover- mögen % |
|--|-----------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| Aktien Forts. | | | |
| Irland - 3.403.783 | | | |
| (31. Dezember 2020: 3.134.009) | | 3.403.783 | 5,17 |
| 2.081 | Accenture Plc - Class A | 639.240 | 0,97 |
| 139.441 | Greencoat Renewables Plc | 130.585 | 0,20 |
| 118 | Kerry Group Plc | 11.303 | 0,02 |
| 3.751 | Linde Plc | 958.528 | 1,45 |
| 9.410 | Medtronic Plc | 729.666 | 1,11 |
| 6.492 | Ryanair Holdings Plc ADR | 492.295 | 0,75 |
| 2.967 | Trane Technologies Plc | 442.166 | 0,67 |
| Japan - 1.682.065 | | | |
| (31. Dezember 2020: 536.633) | | 1.682.065 | 2,55 |
| 7.300 | Advantest Corp | 512.906 | 0,78 |
| 9.000 | Sony Group Corp | 840.473 | 1,27 |
| 11.500 | Suzuki Motor Corp | 328.686 | 0,50 |
| Jersey - 412.676 | | | |
| (31. Dezember 2020: 364.202) | | 412.676 | 0,63 |
| 3.152 | Ferguson Plc | 412.676 | 0,63 |
| Niederlande - 1.180.298 | | | |
| (31. Dezember 2020: 562.920) | | 1.180.298 | 1,79 |
| 1.464 | ASML Holding NV | 871.366 | 1,32 |
| 14.821 | Universal Music Group NV | 308.932 | 0,47 |
| Norwegen - 224.899 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | 224.899 | 0,34 |
| 4.238 | TOMRA Systems ASA | 224.899 | 0,34 |
| Republik Korea - 491.842 | | | |
| (31. Dezember 2020: 615.402) | | 491.842 | 0,75 |
| 1.202 | Samsung SDI Co Ltd | 491.842 | 0,75 |
| Schweiz - 2.872.366 | | | |
| (31. Dezember 2020: 2.499.997) | | 2.872.366 | 4,36 |
| 10.386 | Alcon Inc | 681.646 | 1,04 |
| 3.531 | Chubb Ltd | 506.054 | 0,77 |
| 662 | Lonza Group AG | 409.836 | 0,62 |
| 3.196 | Nestle SA | 331.118 | 0,50 |
| 7.917 | TE Connectivity Ltd | 943.712 | 1,43 |
| Vereinigtes Königreich - 6.818.158 | | | |
| (31. Dezember 2020: 4.872.869) | | 6.818.158 | 10,35 |
| 21.574 | 3i Group Plc | 313.848 | 0,48 |
| 13.447 | Associated British Foods Plc | 269.209 | 0,41 |
| 12.309 | AstraZeneca Plc | 1.060.728 | 1,61 |
| 50.186 | BAE Systems Plc | 276.073 | 0,42 |
| 54.354 | Barratt Developments Plc | 406.024 | 0,61 |
| 18.229 | Diageo Plc | 732.988 | 1,11 |
| 249.180 | Impact Healthcare Reit Plc (REIT) | 297.022 | 0,45 |
| 54.907 | Informa Plc | 281.783 | 0,43 |
| 14.346 | Persimmon Plc | 410.511 | 0,62 |
| 60.311 | Prudential Plc | 765.648 | 1,16 |
| 29.654 | Relx Plc | 709.459 | 1,08 |
| 220.849 | Taylor Wimpey Plc | 387.369 | 0,59 |
| 22.242 | Travis Perkins Plc | 349.867 | 0,53 |
| 12.675 | Unilever Plc | 498.487 | 0,76 |
| 24.923 | Wickes Group Plc | 59.142 | 0,09 |
| Vereinigte Staaten von Amerika - 15.012.880 | | | |
| (31. Dezember 2020: 10.903.927) | | 15.012.880 | 22,78 |
| 874 | Abbott Laboratories | 91.450 | 0,14 |
| 4.632 | Abbott Laboratories | 484.665 | 0,74 |
| 442 | Alphabet Inc - Class A | 959.109 | 1,46 |
| 256 | Amazon.com Inc | 640.925 | 0,97 |
| 668 | American Tower Corp (REIT) | 144.337 | 0,22 |
| 16.548 | Bank of America Corp | 546.749 | 0,83 |
| 5.816 | CME Group Inc | 986.661 | 1,50 |
| 13.279 | ConocoPhillips | 712.332 | 1,08 |
| 4.806 | Dominion Energy Inc | 279.868 | 0,42 |
| 2.546 | Ecolab Inc | 442.177 | 0,67 |
| 1.510 | Ecolab Inc | 262.250 | 0,40 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert GBP | Summe Nettover- mögen % |
|--|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Aktien Forts. | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika Forts. | | | |
| 10.860 | Elanco Animal Health Inc | 231.246 | 0,35 |
| 1.031 | Eli Lilly & Co | 212.171 | 0,32 |
| 333 | Eversource Energy | 22.520 | 0,03 |
| 3.842 | Eversource Energy | 259.825 | 0,39 |
| 2.797 | Fidelity National Information Services Inc | 228.320 | 0,35 |
| 1.804 | Goldman Sachs Group Inc/The | 516.046 | 0,78 |
| 2.228 | Hubbell Inc - Class B | 342.847 | 0,52 |
| 782 | IDEXX Laboratories Inc | 383.935 | 0,58 |
| 7.280 | JPMorgan Chase & Co | 855.896 | 1,30 |
| 1.073 | Lockheed Martin Corp | 281.622 | 0,43 |
| 1.936 | Mastercard Inc | 518.824 | 0,79 |
| 3.647 | Microsoft Corp | 918.366 | 1,39 |
| 64 | Microsoft Corp | 16.116 | 0,02 |
| 4.390 | Morgan Stanley | 321.839 | 0,49 |
| 5.921 | NIKE Inc | 735.972 | 1,12 |
| 3.328 | Norfolk Southern Corp | 727.895 | 1,10 |
| 10.336 | Otis Worldwide Corp | 662.567 | 1,01 |
| 2.072 | salesforce.com Inc | 392.551 | 0,60 |
| 1.512 | Sherwin-Williams Co/The | 393.152 | 0,60 |
| 1.618 | Thermo Fisher Scientific Inc | 799.268 | 1,21 |
| 6.304 | Yum China Holdings Inc | 230.506 | 0,35 |
| 2.259 | Zoetis Inc | 410.873 | 0,62 |
| Gesamtanlagen in Aktien | | 40.070.813 | 60,81 |
| Kapitalbeteiligungsinstrumente | | | |
| Guernsey - 2.230.900 | | | |
| (31. Dezember 2020: 2.209.747) | | 2.230.900 | 3,39 |
| 131.949 | Bluefield Solar Income Fund Ltd | 163.881 | 0,25 |
| 332.581 | Hipgnosis Songs Fund Ltd/The Fund | 416.724 | 0,63 |
| 359.692 | International Public Partnerships Ltd | 610.397 | 0,93 |
| 147.586 | JLEN Environmental Assets Group Ltd Foresight Group Holdings | 155.408 | 0,24 |
| 659.575 | Renewables Infrastructure Group Ltd/The | 884.490 | 1,34 |
| Luxemburg - 246.440 | | | |
| (31. Dezember 2020: 266.913) | | 246.440 | 0,37 |
| 140.182 | BBGI Global Infrastructure SA | 246.440 | 0,37 |
| Vereinigtes Königreich - 1.762.163 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.692.944) | | 1.762.163 | 2,67 |
| 646.769 | BioPharma Credit Plc/The Fund | 465.063 | 0,70 |
| 458.355 | Greencoat UK Wind Plc/Funds | 644.447 | 0,98 |
| 556.634 | Sdcl Energy Efficiency Income Trust Plc | 652.653 | 0,99 |
| Gesamtanlagen in Kapitalbeteiligungsinstrumente | | 4.239.503 | 6,43 |
| Optionsscheine | | | |
| Luxemburg - 890.024 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 7.650 | Ensemble Investment Corporation SA (WTS) 27-Oct-2022 | 890.024 | 1,35 |
| Vereinigtes Königreich - 2.795.889 | | | |
| (31. Dezember 2020: 2.057.163) | | | |
| 18.267 | Barclays Bank Plc (WTS) 12-Aug-2022 | 1.416.623 | 2,15 |
| 18.267 | Barclays Bank Plc (WTS) 15-Aug-2022 | 1.379.266 | 2,09 |
| Gesamtanlagen in Optionsscheinen | | 3.685.913 | 5,59 |
| Indexoptionen - 540.005 | | | |
| (31. Dezember 2020: 532.999) | | | |
| 18 | CBOE S&P 500 Index Put 17-Mar-2022 4,450.000 | 80.810 | 0,12 |
| 19 | CBOE S&P 500 Index Put 17-Nov-2022 4,500.000 | 375.460 | 0,57 |
| 186 | EURO STOXX 50 Index Put 18-Mar-2022 3,950.000 | 83.735 | 0,13 |
| Indexoptionen insgesamt | | 540.005 | 0,82 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Zugrunde liegendes Engagement GBP | Beizulegender Zeitwert GBP | Nettovermögen % |
|--|--|-----------------------------------|----------------------------|-----------------|
| Offene Terminkontrakte - 29.700 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 91.828) | | | | |
| 10 | FTSE 250 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2022 | 469.340 | 8.230 | 0,01 |
| 8 | Nikkei 225 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2022 | 1.484.119 | 21.470 | 0,03 |
| Offene Terminkontrakte insgesamt | | | 29.700 | 0,04 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 208.957 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 1.814.858) | | | | |
| | | | 208.957 | 0,32 |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | | 58.915.307 | 89,40 |

| Bestände | Beschreibung | Zugrunde liegendes Engagement GBP | Beizulegender Zeitwert GBP | Nettovermögen % |
|---------------------------------------|---|-----------------------------------|----------------------------|-----------------|
| Indexoptionen - (376.900) | | | | |
| (31. Dezember 2020: (185.509)) | | | | |
| (18) | CBOE S&P 500 Index Put 17-Mar-2022 4,250.000 | | (51.558) | (0,08) |
| (19) | CBOE S&P 500 Index Put 17-Nov-2022 4,200.000 | | (272.226) | (0,41) |
| (186) | EURO STOXX 50 Index Put 18-Mar-2022 3,750.000 | | (53.116) | (0,08) |
| Indexoptionen insgesamt | | | (376.900) | (0,57) |

| Bestände | Beschreibung | Zugrunde liegendes Engagement GBP | Beizulegender Zeitwert GBP | Nettovermögen % |
|---|---|-----------------------------------|----------------------------|-----------------|
| Offene Terminkontrakte - (46.560) | | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | | |
| (13) | E-mini S&P 500 Index Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (2.301.841) | (46.560) | (0,07) |
| Offene Terminkontrakte insgesamt | | | (46.560) | (0,07) |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (180.785) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (257.658)) | | | | |
| | | | (180.785) | (0,28) |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | | (604.245) | (0,92) |
| Nettoumlaufvermögen | | | 7.585.983 | 11,52 |
| Summe Nettovermögen | | | 65.897.045 | 100,00 |

Der Kontrahent für Indexoptionen ist die UBS AG.
Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist die UBS AG.

| Portfolioanalyse | % des Gesamtvermögens |
|--|-----------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 87,35 |
| An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente | 0,86 |
| Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate) | 0,31 |
| Sonstiges Umlaufvermögen | 11,48 |
| Gesamtvermögen | 100,00 |

| Devisenterminkontrakte | | | | | | | |
|---|-------------------|-------------|-------------|------------------|-----------------------------|-------------------------------------|----------------|
| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) | |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP) | | | | | | | |
| Euro | Pfund Sterling | 1 | 1 | 14. Jan. 22 | HSBC Bank plc | - | |
| Indische Rupie | US-Dollar | 100.992.856 | 1.341.991 | 14. Jan. 22 | State Street Bank | 11.170 | |
| Pfund Sterling | Euro | 601.448 | 705.654 | 14. Jan. 22 | Canadian Imperial Bank | 8.633 | |
| Pfund Sterling | Euro | 145.850 | 172.689 | 14. Jan. 22 | Royal Bank of Scotland | 775 | |
| Pfund Sterling | Euro | 52.752 | 61.922 | 14. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | 732 | |
| Pfund Sterling | Euro | 78.135 | 91.573 | 14. Jan. 22 | Canadian Imperial Bank | 1.206 | |
| Pfund Sterling | Euro | 8.398.940 | 9.842.074 | 14. Jan. 22 | Royal Bank of Scotland | 130.688 | |
| Pfund Sterling | Euro | 60.821 | 71.399 | 14. Jan. 22 | State Street Bank | 839 | |
| Pfund Sterling | Euro | 125.894 | 147.481 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.996 | |
| Pfund Sterling | Japanischer Yen | 1.553.106 | 237.789.913 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 19.529 | |
| Pfund Sterling | Japanischer Yen | 19.586 | 2.948.263 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | 572 | |
| Pfund Sterling | Japanischer Yen | 33.850 | 5.109.625 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 897 | |
| Pfund Sterling | Japanischer Yen | 244.492 | 37.520.217 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 2.513 | |
| Pfund Sterling | Schweizer Franken | 150.192 | 182.749 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 1.463 | |
| Pfund Sterling | Schweizer Franken | 182.716 | 222.635 | 18. Feb. 22 | HSBC Bank plc | 1.527 | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 70.077 | 94.166 | 18. Feb. 22 | HSBC Bank plc | 188 | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 15.422 | 20.658 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 90 | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 136.302 | 182.718 | 18. Feb. 22 | JPMorgan Chase Bank | 692 | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 24.262 | 32.675 | 18. Feb. 22 | The Bank of New York Mellon | 11 | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 134.587 | 180.836 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 374 | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 3.865 | 5.201 | 18. Feb. 22 | HSBC Bank plc | 5 | |
| Schweizer Franken | Pfund Sterling | 36.545 | 29.454 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 289 | |
| Schweizer Franken | Pfund Sterling | 85.686 | 68.682 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 1.053 | |
| Schweizer Franken | Pfund Sterling | 56.515 | 45.512 | 18. Feb. 22 | HSBC Bank plc | 482 | |
| Schweizer Franken | Pfund Sterling | 93.117 | 74.817 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | 965 | |
| Schweizer Franken | Pfund Sterling | 62.778 | 50.961 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 131 | |
| Schweizer Franken | Pfund Sterling | 135.014 | 108.199 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 1.681 | |
| Schweizer Franken | Pfund Sterling | 61.627 | 49.372 | 18. Feb. 22 | HSBC Bank plc | 783 | |
| Schweizer Franken | Pfund Sterling | 54.107 | 43.887 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 147 | |
| Schweizer Franken | Pfund Sterling | 114.739 | 92.181 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 1.198 | |
| Schweizer Franken | Pfund Sterling | 74.347 | 60.502 | 18. Feb. 22 | HSBC Bank plc | 5 | |
| Schweizer Franken | Pfund Sterling | 64.218 | 52.168 | 18. Feb. 22 | HSBC Bank plc | 96 | |
| Schweizer Franken | Pfund Sterling | 63.680 | 51.715 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 110 | |
| Schweizer Franken | Pfund Sterling | 169.655 | 136.632 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 1.440 | |
| Schweizer Franken | Pfund Sterling | 63.195 | 51.062 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 368 | |
| Pfund Sterling | Dänische Krone | 779.801 | 6.748.078 | 16. Mrz. 22 | Barclays Bank PLC | 16.309 | |
| | | | | | | GBP | 208.957 |
| Euro | Pfund Sterling | 54.242 | 46.228 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (660) | |
| Euro | Pfund Sterling | 38.261 | 32.248 | 14. Jan. 22 | HSBC Bank plc | (105) | |
| Euro | Pfund Sterling | 44.466 | 37.865 | 14. Jan. 22 | Barclays Bank PLC | (509) | |
| Euro | Pfund Sterling | 69.425 | 58.725 | 14. Jan. 22 | Barclays Bank PLC | (402) | |
| Euro | Pfund Sterling | 38.364 | 32.415 | 14. Jan. 22 | Royal Bank of Scotland | (186) | |
| Euro | Pfund Sterling | 69.944 | 59.900 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1.140) | |
| Euro | Pfund Sterling | 101.452 | 85.254 | 14. Jan. 22 | Royal Bank of Scotland | (25) | |
| Euro | Pfund Sterling | 442.961 | 375.245 | 14. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | (3.117) | |
| Russischer Rubel | US-Dollar | 31.571.589 | 437.669 | 14. Jan. 22 | State Street Bank | (13.002) | |
| Russischer Rubel | US-Dollar | 16.053.669 | 222.580 | 14. Jan. 22 | State Street Bank | (6.635) | |
| Pfund Sterling | Koreanischer Won | 550.507 | 883.563.821 | 14. Jan. 22 | State Street Bank | (1.020) | |
| US-Dollar | Indische Rupie | 1.133.173 | 86.250.297 | 14. Jan. 22 | State Street Bank | (19.127) | |
| US-Dollar | Indische Rupie | 194.979 | 14.742.559 | 14. Jan. 22 | State Street Bank | (2.313) | |
| Australischer Dollar | US-Dollar | 1.547.368 | 1.146.206 | 18. Feb. 22 | Canadian Imperial Bank | (17.982) | |
| Hongkong-Dollar | Pfund Sterling | 274.774 | 26.660 | 18. Feb. 22 | HSBC Bank plc | (507) | |
| Hongkong-Dollar | Pfund Sterling | 98.334 | 9.512 | 18. Feb. 22 | HSBC Bank plc | (152) | |
| Hongkong-Dollar | Pfund Sterling | 102.137 | 9.855 | 18. Feb. 22 | Canadian Imperial Bank | (133) | |
| Hongkong-Dollar | Pfund Sterling | 66.164 | 6.388 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | (91) | |
| Ungarischer Forint | Pfund Sterling | 240.888.460 | 571.065 | 18. Feb. 22 | HSBC Bank plc | (26.721) | |
| Pfund Sterling | Hongkong-Dollar | 1.536.555 | 16.169.627 | 18. Feb. 22 | Canadian Imperial Bank | (2.461) | |
| Pfund Sterling | Schweizer Franken | 1.713.481 | 2.111.048 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (4.574) | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 15.685 | 21.200 | 18. Feb. 22 | The Bank of New York Mellon | (49) | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 21.791.471 | 29.467.408 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (78.701) | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 6.799 | 9.180 | 18. Feb. 22 | Canadian Imperial Bank | (14) | |
| Schweizer Franken | Pfund Sterling | 102.740 | 83.893 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | (279) | |
| Dänische Krone | Pfund Sterling | 168.253 | 19.257 | 16. Mrz. 22 | The Bank of New York Mellon | (221) | |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte Forts.

| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrech- nungs- datum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) |
|------|---------|---------------|---------------|----------------------------|------------|---|
|------|---------|---------------|---------------|----------------------------|------------|---|

BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP) Forts.

| | | | | | | |
|----------------|----------------|---------|--------|-------------|--------------------------------|------------------|
| Dänische Krone | Pfund Sterling | 401.335 | 46.067 | 16. Mrz. 22 | The Bank of New York Mellon | (659) |
| GBP | | | | | | (180.785) |

BNY MELLON GLOBAL REAL RETURN FUND (USD)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|---|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| Guernsey - 1.419.211 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 374.368 | Cordiant Digital Infrastructure Ltd/Fund | 522.156 | 0,12 |
| 589.087 | Cordiant Digital Infrastructure Ltd/Fund | 897.055 | 0,21 |
| Irland - 2.104.475 | | | |
| (31. Dezember 2020: 11.199.041) | | | |
| 2.104.475 | DMS UCITS Platform ICAV - FVC Equity Dispersion UCITS Fund | 2.104.475 | 0,48 |
| Jersey - 13.835.809 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 71.244 | WisdomTree Copper - ETF | 2.794.190 | 0,64 |
| 1.529.575 | WisdomTree WTI Crude Oil - ETF | 11.041.619 | 2,52 |
| Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen | | 17.359.495 | 3,97 |
| Anleihen | | | |
| Frankreich - 1.903.546 | | | |
| (31. Dezember 2020: 6.018.200) | | | |
| 346.000 | Altice France SA/France 'REGS' 4.000% 15-Jul-2029 | 387.508 | 0,09 |
| 505.000 | Altice France SA/France 'REGS' 4.125% 15-Jan-2029 | 569.450 | 0,13 |
| 179.000 | Banjay Entertainment SASU 'REGS' 3.500% 01-Mar-2025 | 203.905 | 0,04 |
| 621.000 | Iliad Holding SASU 'REGS' 5.625% 15-Oct-2028 | 742.683 | 0,17 |
| Deutschland - 486.102 | | | |
| (31. Dezember 2020: 2.498.334) | | | |
| 414.000 | TK Elevator Midco GmbH 'REGS' 4.375% 15-Jul-2027 | 486.102 | 0,11 |
| Indien - 405.137 | | | |
| (31. Dezember 2020: 413.219) | | | |
| 30.000.000 | National Highways Authority of India 7,300% 18-May-2022 | 405.137 | 0,09 |
| Irland - 1.222.753 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.320.020) | | | |
| 1.019.000 | AIB Group Plc FRN (Perpetual) 5.250% 09-Oct-2024 | 1.222.753 | 0,28 |
| Italien - 2.941.634 | | | |
| (31. Dezember 2020: 2.967.572) | | | |
| 945.000 | Intesa Sanpaolo SpA '144A' FRN (Perpetual) 7,700% 17-Sep-2025 | 1.063.862 | 0,24 |
| 897.000 | UniCredit SpA 'EMTN' FRN (Perpetual) 3.875% 03-Jun-2027 | 973.898 | 0,22 |
| 825.000 | UniCredit SpA FRN (Perpetual) 8,000% 03-Jun-2024 | 903.874 | 0,21 |
| Luxemburg - 684.740 | | | |
| (31. Dezember 2020: 753.580) | | | |
| 579.000 | Summer BC Holdco B SARL 'REGS' 5,750% 31-Oct-2026 | 684.740 | 0,16 |
| Spanien - 4.298.514 | | | |
| (31. Dezember 2020: 4.605.526) | | | |
| 600.000 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN (Perpetual) 5,875% 24-Sep-2023 | 725.622 | 0,17 |
| 800.000 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN (Perpetual) 6,000% 29-Mar-2024 | 976.542 | 0,22 |
| 1.200.000 | Banco Santander SA FRN (Perpetual) 4,750% 19-Mar-2025 | 1.407.850 | 0,32 |
| 1.000.000 | Banco Santander SA FRN (Perpetual) 5,250% 29-Sep-2023 | 1.188.500 | 0,27 |
| Vereinigtes Königreich - 1.173.322 | | | |
| (31. Dezember 2020: 4.684.560) | | | |
| 62.000 | Tesco Plc 'EMTN' 6,125% 24-Feb-2022 | 84.196 | 0,02 |
| 821.000 | Vmed O2 UK Financing I Plc 'REGS' 4,000% 31-Jan-2029 | 1.089.126 | 0,25 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|--|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika - 30.746.845 | | | |
| (31. Dezember 2020: 5.700.797) | | | |
| 659.000 | Ball Corp 2,875% 15-Aug-2030 | 641.385 | 0,15 |
| 465.000 | CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5,500% 01-May-2026 | 478.339 | 0,11 |
| 114.000 | Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd '144A' 4,750% 20-Oct-2028 | 124.681 | 0,03 |
| 513.000 | Sprint Capital Corp 8,750% 15-Mar-2032 | 770.362 | 0,18 |
| 468.000 | Sprint Corp 7,125% 15-Jun-2024 | 524.752 | 0,12 |
| 134.000 | United Airlines Inc '144A' 4,375% 15-Apr-2026 | 139.201 | 0,03 |
| 28.000.000 | United States Treasury Note/Bond 2,000% 15-Feb-2022 | 28.068.125 | 6,41 |
| Gesamtanlagen in Anleihen | | 43.862.593 | 10,02 |
| Aktien | | | |
| Australien - 1.236.276 | | | |
| (31. Dezember 2020: 2.298.063) | | | |
| 464.634 | Star Entertainment Grp Ltd/The | 1.236.276 | 0,28 |
| Kaiman-Inseln - 3.200.520 | | | |
| (31. Dezember 2020: 7.432.465) | | | |
| 77.890 | Alibaba Group Holding Ltd | 1.187.075 | 0,27 |
| 20.420 | Tencent Holdings Ltd | 1.195.870 | 0,27 |
| 119.267 | Tencent Music Entertainment Group ADR | 817.575 | 0,19 |
| China - 3.092.822 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.708.988) | | | |
| 199.000 | Flat Glass Group Co Ltd 'H' | 1.009.884 | 0,23 |
| 77.100 | Foshan Haitian Flavouring & Food Co Ltd 'A' | 1.271.481 | 0,29 |
| 60.000 | LONGi Green Energy Technology Co Ltd 'A' | 811.457 | 0,19 |
| Dänemark - 5.344.629 | | | |
| (31. Dezember 2020: 3.517.062) | | | |
| 25.129 | Novozymes A/S | 2.062.165 | 0,47 |
| 25.814 | Orsted AS '144A' | 3.282.464 | 0,75 |
| Finnland - 1.818.287 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 37.101 | Neste Oyj | 1.818.287 | 0,42 |
| Frankreich - 14.541.771 | | | |
| (31. Dezember 2020: 12.282.451) | | | |
| 11.373 | Air Liquide SA | 1.970.270 | 0,45 |
| 71.894 | Bureau Veritas SA | 2.371.623 | 0,54 |
| 24.617 | Legrand SA | 2.859.416 | 0,65 |
| 7.828 | L'Oreal SA | 3.713.057 | 0,85 |
| 4.422 | LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE | 3.627.405 | 0,83 |
| Deutschland - 16.099.000 | | | |
| (31. Dezember 2020: 12.906.397) | | | |
| 59.683 | Bayer AG | 3.179.008 | 0,73 |
| 29.305 | Continental AG | 3.089.681 | 0,70 |
| 114.629 | RWE AG | 4.621.441 | 1,06 |
| 25.936 | Volkswagen AG - Preference | 5.208.870 | 1,19 |
| Guernsey - 204.450 | | | |
| (31. Dezember 2020: 306.503) | | | |
| 532.330 | Amedeo Air Four Plus Ltd | 204.450 | 0,05 |
| Hongkong - 5.719.117 | | | |
| (31. Dezember 2020: 6.348.448) | | | |
| 395.800 | Alia Group Ltd | 3.990.559 | 0,91 |
| 196.500 | Link REIT (Units) (REIT) | 1.728.558 | 0,40 |
| Indien - 3.019.964 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.689.630) | | | |
| 86.816 | Housing Development Finance Corp Ltd | 3.019.964 | 0,69 |
| Irland - 24.209.117 | | | |
| (31. Dezember 2020: 14.519.767) | | | |
| 9.845 | Accenture Plc - Class A | 4.075.387 | 0,93 |
| 650.381 | Greencoat Renewables Plc | 820.789 | 0,19 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|---|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Aktien Forts. | | | |
| Irland Forts. | | | |
| 483 | Kerry Group Plc | 62.349 | 0,01 |
| 23.723 | Linde Plc | 8.169.371 | 1,87 |
| 43.307 | Medtronic Plc | 4.525.365 | 1,03 |
| 35.392 | Ryanair Holdings Plc ADR | 3.616.709 | 0,83 |
| 14.635 | Trane Technologies Plc | 2.939.147 | 0,67 |
| Japan - 10.885.248 | | | |
| (31. Dezember 2020: 2.664.503) | | 10.885.248 | 2,49 |
| 35.400 | Advantest Corp | 3.351.807 | 0,77 |
| 44.100 | Sony Group Corp | 5.549.850 | 1,27 |
| 51.500 | Suzuki Motor Corp | 1.983.591 | 0,45 |
| Jersey - 2.121.979 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.707.427) | | 2.121.979 | 0,48 |
| 12.027 | Ferguson Plc | 2.121.979 | 0,48 |
| Niederlande - 7.565.565 | | | |
| (31. Dezember 2020: 2.645.401) | | 7.565.565 | 1,73 |
| 6.776 | ASML Holding NV | 5.434.933 | 1,24 |
| 75.851 | Universal Music Group NV | 2.130.632 | 0,49 |
| Norwegen - 1.508.650 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | 1.508.650 | 0,34 |
| 21.096 | TOMRA Systems ASA | 1.508.650 | 0,34 |
| Republik Korea - 3.316.789 | | | |
| (31. Dezember 2020: 2.858.785) | | 3.316.789 | 0,76 |
| 6.015 | Samsung SDI Co Ltd | 3.316.789 | 0,76 |
| Schweiz - 19.246.384 | | | |
| (31. Dezember 2020: 12.173.973) | | 19.246.384 | 4,40 |
| 50.881 | Alcon Inc | 4.500.154 | 1,03 |
| 17.417 | Chubb Ltd | 3.363.832 | 0,77 |
| 3.953 | Lonza Group AG | 3.297.919 | 0,75 |
| 15.910 | Nestle SA | 2.221.301 | 0,51 |
| 36.500 | TE Connectivity Ltd | 5.863.178 | 1,34 |
| Vereinigtes Königreich - 41.881.840 | | | |
| (31. Dezember 2020: 23.649.907) | | 41.881.840 | 9,57 |
| 107.603 | 3i Group Plc | 2.109.473 | 0,48 |
| 59.472 | Associated British Foods Plc | 1.604.493 | 0,37 |
| 54.550 | AstraZeneca Plc | 6.334.864 | 1,45 |
| 234.934 | BAE Systems Plc | 1.741.601 | 0,40 |
| 236.555 | Barratt Developments Plc | 2.381.299 | 0,54 |
| 90.697 | Diageo Plc | 4.914.601 | 1,12 |
| 1.015.840 | Impact Healthcare Reit Plc (REIT) | 1.631.785 | 0,37 |
| 219.732 | Informa Plc | 1.519.642 | 0,35 |
| 63.106 | Persimmon Plc | 2.433.468 | 0,56 |
| 286.249 | Prudential Plc | 4.897.089 | 1,12 |
| 132.518 | Relx Plc | 4.272.481 | 0,98 |
| 1.096.981 | Taylor Wimpey Plc | 2.592.925 | 0,59 |
| 99.406 | Travis Perkins Plc | 2.107.185 | 0,48 |
| 57.211 | Unilever Plc | 3.032.120 | 0,69 |
| 96.569 | Wickes Group Plc | 308.814 | 0,07 |
| Vereinigte Staaten von Amerika - 106.426.720 | | | |
| (31. Dezember 2020: 52.622.959) | | 106.426.720 | 24,32 |
| 27.037 | Abbott Laboratories | 3.812.352 | 0,87 |
| 2.096 | Alphabet Inc - Class A | 6.129.123 | 1,40 |
| 1.217 | Amazon.com Inc | 4.106.000 | 0,94 |
| 3.108 | American Tower Corp (REIT) | 904.987 | 0,21 |
| 73.944 | Bank of America Corp | 3.292.357 | 0,75 |
| 25.469 | CME Group Inc | 5.822.595 | 1,33 |
| 76.158 | ConocoPhillips | 5.505.462 | 1,26 |
| 5.336 | Cooper Cos Inc/The | 2.263.478 | 0,52 |
| 27.419 | Dominion Energy Inc | 2.151.706 | 0,49 |
| 20.141 | Ecolab Inc | 4.713.900 | 1,08 |
| 56.577 | Elanco Animal Health Inc | 1.623.477 | 0,37 |
| 5.183 | Eli Lilly & Co | 1.437.376 | 0,33 |
| 20.001 | Eversource Energy | 1.822.791 | 0,42 |
| 12.111 | Fidelity National Information Services Inc | 1.332.271 | 0,30 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|--|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Aktien Forts. | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika Forts. | | | |
| 8.825 | Goldman Sachs Group Inc/The | 3.401.949 | 0,78 |
| 10.734 | Hubbell Inc - Class B | 2.225.910 | 0,51 |
| 4.073 | IDEXX Laboratories Inc | 2.694.799 | 0,61 |
| 44.302 | JPMorgan Chase & Co | 7.018.987 | 1,60 |
| 4.907 | Lockheed Martin Corp | 1.735.581 | 0,40 |
| 8.834 | Mastercard Inc | 3.190.311 | 0,73 |
| 17.977 | Microsoft Corp | 6.100.405 | 1,39 |
| 22.410 | Morgan Stanley | 2.213.996 | 0,50 |
| 30.833 | NIKE Inc | 5.164.682 | 1,18 |
| 23.150 | Norfolk Southern Corp | 6.823.347 | 1,56 |
| 57.089 | Otis Worldwide Corp | 4.931.633 | 1,13 |
| 12.478 | salesforce.com Inc | 3.185.758 | 0,73 |
| 8.836 | Sherwin-Williams Co/The | 3.096.179 | 0,71 |
| 8.052 | Thermo Fisher Scientific Inc | 5.360.176 | 1,22 |
| 31.105 | Yum China Holdings Inc | 1.532.699 | 0,35 |
| 11.556 | Zoetis Inc | 2.832.433 | 0,65 |
| Gesamtanlagen in Aktien | | 271.439.128 | 62,03 |
| Kapitalbeteiligungsinstrumente | | | |
| Guernsey - 14.071.017 | | | |
| (31. Dezember 2020: 12.195.198) | | 14.071.017 | 3,21 |
| 662.365 | Bluefield Solar Income Fund Ltd | 1.108.614 | 0,25 |
| 1.398.833 | Hipgnosis Songs Fund Ltd/The Fund | 2.361.991 | 0,54 |
| 1.726.944 | International Public Partnerships Ltd | 3.949.311 | 0,90 |
| 611.390 | JLEN Environmental Assets Group Ltd Foresight Group Holdings | 867.577 | 0,20 |
| 3.200.387 | Renewables Infrastructure Group Ltd/The | 5.783.524 | 1,32 |
| Luxemburg - 1.571.801 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.417.270) | | 1.571.801 | 0,36 |
| 663.464 | BBGI Global Infrastructure SA | 1.571.801 | 0,36 |
| Vereinigtes Königreich - 11.149.726 | | | |
| (31. Dezember 2020: 9.143.652) | | 11.149.726 | 2,55 |
| 2.754.663 | BioPharma Credit Plc/The Fund | 2.669.268 | 0,61 |
| 2.162.070 | Greencoat UK Wind Plc/Funds | 4.096.532 | 0,94 |
| 2.774.528 | Sdcl Energy Efficiency Income Trust Plc | 4.383.926 | 1,00 |
| Gesamtanlagen in Aktienindex-Swaps | | 26.792.544 | 6,12 |
| Optionsscheine | | | |
| Luxemburg - 5.660.056 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 36.101 | Ensemble Investment Corporation SA (WTS) 27-Oct-2022 | 5.660.056 | 1,29 |
| Vereinigtes Königreich - 16.322.758 | | | |
| (31. Dezember 2020: 9.224.705) | | | |
| 79.137 | Barclays Bank Plc (WTS) 12-Aug-2022 | 8.270.426 | 1,89 |
| 79.137 | Barclays Bank Plc (WTS) 15-Aug-2022 | 8.052.332 | 1,84 |
| Gesamtanlagen in Optionsscheinen | | 21.982.814 | 5,02 |
| Indexoptionen - 3.645.801 | | | |
| (31. Dezember 2020: 2.524.275) | | | |
| 92 | CBOE S&P 500 Index Put 17-Mar-2022 4,450.000 | 556.600 | 0,12 |
| 95 | CBOE S&P 500 Index Put 17-Nov-2022 4,500.000 | 2.529.850 | 0,58 |
| 922 | EURO STOXX 50 Index Put 18-Mar-2022 3,950.000 | 559.351 | 0,13 |
| Indexoptionen insgesamt | | 3.645.801 | 0,83 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Zugrunde liegendes Engagement USD | Beizulegender Zeitwert USD | Nettovermögen % |
|---|--|-----------------------------------|----------------------------|-----------------|
| Offene Terminkontrakte - 189.596 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 413.365) | | | | |
| 40 | FTSE 250 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2022 | 2.529.932 | 44.363 | 0,01 |
| 38 | Nikkei 225 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2022 | 9.500.000 | 145.233 | 0,03 |

Offene Terminkontrakte insgesamt 189.596 0,04

Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 3.191.163 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 660.975) 3.191.163 0,73

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt 388.463.134 88,76

| Bestände | Beschreibung | Zugrunde liegendes Engagement USD | Beizulegender Zeitwert USD | Nettovermögen % |
|---------------------------------------|---|-----------------------------------|----------------------------|-----------------|
| Indexoptionen - (2.544.192) | | | | |
| (31. Dezember 2020: (891.632)) | | | | |
| (92) | CBOE S&P 500 Index Put 17-Mar-2022 4,250.000 | | (355.120) | (0,08) |
| (95) | CBOE S&P 500 Index Put 17-Nov-2022 4,200.000 | | (1.834.260) | (0,42) |
| (922) | EURO STOXX 50 Index Put 18-Mar-2022 3,750.000 | | (354.812) | (0,08) |

Indexoptionen insgesamt (2.544.192) (0,58)

| Bestände | Beschreibung | Zugrunde liegendes Engagement USD | Beizulegender Zeitwert USD | Nettovermögen % |
|---|---|-----------------------------------|----------------------------|-----------------|
| Offene Terminkontrakte - (316.381) | | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | | |
| (67) | E-mini S&P 500 Index Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (15.987.038) | (316.381) | (0,07) |

Offene Terminkontrakte insgesamt (316.381) (0,07)

Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (362.098) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (4.790.803)) (362.098) (0,08)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt (3.222.671) (0,73)

Nettoumlaufvermögen 52.368.872 11,97

Summe Nettovermögen 437.609.335 100,00

Der Kontrahent für Indexoptionen ist die UBS AG.
Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist die UBS AG.

Portfolioanalyse % des Gesamtvermögens

| | |
|--|---------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 85,94 |
| An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente | 0,86 |
| Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate) | 0,72 |
| Sonstiges Umlaufvermögen | 12,48 |
| Gesamtvermögen | 100,00 |

Devisenterminkontrakte

| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|---|-------------------|-------------|---------------|------------------|----------------------------------|-------------------------------------|
| BNY Mellon Global Real Return Fund (USD) | | | | | | |
| US-Dollar | Euro | 727.755 | 628.654 | 14. Jan. 22 | Canadian Imperial Bank | 16.067 |
| US-Dollar | Euro | 61.116.748 | 52.559.137 | 14. Jan. 22 | State Street Bank | 1.615.462 |
| US-Dollar | Euro | 492.020 | 423.181 | 14. Jan. 22 | State Street Bank | 12.944 |
| US-Dollar | Euro | 316.490 | 273.636 | 14. Jan. 22 | Royal Bank of Scotland | 6.711 |
| US-Dollar | Euro | 344.692 | 298.039 | 14. Jan. 22 | HSBC Bank plc | 7.288 |
| US-Dollar | Euro | 4.287.876 | 3.686.973 | 14. Jan. 22 | State Street Bank | 113.918 |
| US-Dollar | Euro | 768.862 | 661.809 | 14. Jan. 22 | Royal Bank of Scotland | 19.639 |
| US-Dollar | Euro | 3.996.537 | 3.442.073 | 14. Jan. 22 | State Street Bank | 99.826 |
| US-Dollar | Euro | 4.440.339 | 3.917.013 | 14. Jan. 22 | Barclays Bank PLC | 5.957 |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 894.305 | 654.495 | 14. Jan. 22 | HSBC Bank plc | 2.328 |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 571.554.61 | 41.986.184 | 14. Jan. 22 | Barclays Bank PLC | 576.178 |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 47.970 | 35.206 | 14. Jan. 22 | Royal Bank of Scotland | 528 |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 482.715 | 355.585 | 14. Jan. 22 | UBS AG | 3.540 |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 59.897 | 44.022 | 14. Jan. 22 | Barclays Bank PLC | 575 |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 4.261.351 | 3.089.991 | 14. Jan. 22 | Canadian Imperial Bank | 97.374 |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 4.254.653 | 3.099.613 | 14. Jan. 22 | State Street Bank | 77.710 |
| Hongkong-Dollar | US-Dollar | 374.506 | 48.007 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | 20 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 242.077 | 263.094 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 2.356 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 163.263 | 175.424 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | 3.602 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 252.354 | 271.661 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 5.058 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 421.595 | 455.494 | 18. Feb. 22 | Citigroup Global Markets Limited | 6.806 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 780.938 | 844.952 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 11.387 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 622.411 | 673.484 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 9.020 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 565.477 | 611.062 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 9.012 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 385.587 | 413.100 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 9.716 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 275.511 | 296.855 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 5.256 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 332.519 | 362.477 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | 2.147 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 284.904 | 312.233 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 179 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 601.553 | 651.638 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 7.995 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 280.088 | 305.285 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | 1.845 |
| US-Dollar | Euro | 10.884.953 | 9.376.346 | 18. Feb. 22 | Barclays Bank PLC | 262.786 |
| US-Dollar | Hongkong-Dollar | 8.458.163 | 65.862.232 | 18. Feb. 22 | Citigroup Global Markets Limited | 11.812 |
| US-Dollar | Hongkong-Dollar | 293.803 | 2.288.185 | 18. Feb. 22 | UBS AG | 360 |
| US-Dollar | Japanischer Yen | 4.308.007 | 490.237.645 | 18. Feb. 22 | HSBC Bank plc | 48.017 |
| US-Dollar | Japanischer Yen | 216.983 | 24.559.553 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 3.549 |
| US-Dollar | Japanischer Yen | 8.916.608 | 1.016.713.247 | 18. Feb. 22 | Canadian Imperial Bank | 81.733 |
| US-Dollar | Japanischer Yen | 89.909 | 10.190.975 | 18. Feb. 22 | JPMorgan Chase Bank | 1.353 |
| US-Dollar | Japanischer Yen | 188.676 | 21.281.025 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | 3.752 |
| US-Dollar | Japanischer Yen | 2.975.533 | 337.072.596 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 46.493 |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 39.673 | 36.140 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | 43 |
| Dänische Krone | US-Dollar | 2.052.421 | 312.511 | 16. Mrz. 22 | The Bank of New York Mellon | 323 |
| Dänische Krone | US-Dollar | 856.894 | 130.112 | 16. Mrz. 22 | The Bank of New York Mellon | 498 |
| USD | | | | | | 3.191.163 |
| Euro | US-Dollar | 2.022.000 | 2.351.521 | 14. Jan. 22 | Canadian Imperial Bank | (62.450) |
| Euro | US-Dollar | 191.326 | 216.791 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (195) |
| Euro | US-Dollar | 178.251 | 206.510 | 14. Jan. 22 | Barclays Bank PLC | (4.715) |
| Euro | US-Dollar | 323.068 | 375.839 | 14. Jan. 22 | Canadian Imperial Bank | (10.099) |
| Euro | US-Dollar | 180.764 | 210.897 | 14. Jan. 22 | Canadian Imperial Bank | (6.258) |
| Russischer Rubel | US-Dollar | 148.988.834 | 2.065.397 | 14. Jan. 22 | State Street Bank | (82.682) |
| Russischer Rubel | US-Dollar | 74.594.076 | 1.034.226 | 14. Jan. 22 | State Street Bank | (41.542) |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 439.098 | 599.569 | 14. Jan. 22 | State Street Bank | (7.855) |
| US-Dollar | Chinesischer Yuan | 2.087.257 | 13.448.196 | 14. Jan. 22 | State Street Bank | (23.180) |
| US-Dollar | Euro | 1.497.651 | 1.325.389 | 14. Jan. 22 | Royal Bank of Scotland | (2.799) |
| US-Dollar | Euro | 400.017 | 355.186 | 14. Jan. 22 | State Street Bank | (2.082) |
| US-Dollar | Euro | 939.826 | 832.367 | 14. Jan. 22 | State Street Bank | (2.482) |
| US-Dollar | Indische Rupie | 3.636.946 | 275.578.667 | 14. Jan. 22 | State Street Bank | (66.011) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 117.713 | 88.319 | 14. Jan. 22 | Barclays Bank PLC | (1.303) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 103.385 | 77.062 | 14. Jan. 22 | Barclays Bank PLC | (461) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 73.998 | 55.360 | 14. Jan. 22 | Canadian Imperial Bank | (603) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 346.352 | 259.489 | 14. Jan. 22 | Barclays Bank PLC | (3.327) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 76.611 | 57.549 | 14. Jan. 22 | HSBC Bank plc | (940) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 84.405 | 63.258 | 14. Jan. 22 | Canadian Imperial Bank | (840) |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte Forts.

| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrech- nungs- datum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) |
|--|-------------------|---------------|---------------|----------------------------|--------------------------------|---|
| BNY Mellon Global Real Return Fund (USD) Forts. | | | | | | |
| Hongkong-Dollar | US-Dollar | 231.578 | 29.713 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | (15) |
| Hongkong-Dollar | US-Dollar | 426.117 | 54.656 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | (10) |
| Hongkong-Dollar | US-Dollar | 893.017 | 114.523 | 18. Feb. 22 | HSBC Bank plc | (1) |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 281.916 | 309.774 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | (639) |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 1.209.538 | 1.109.239 | 18. Feb. 22 | HSBC Bank plc | (6.799) |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 985.515 | 908.803 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (11.034) |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 13.543.986 | 12.356.178 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (5.189) |
| US-Dollar | Dänische Krone | 4.196.623 | 27.637.429 | 16. Mrz. 22 | The Bank of New York Mellon | (15.937) |
| US-Dollar | Dänische Krone | 861.974 | 5.672.554 | 16. Mrz. 22 | Royal Bank of Scotland | (2.650) |
| USD | | | | | | (362.098) |

BNY MELLON GLOBAL SHORT-DATED HIGH YIELD BOND FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % | Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % |
|---|--|----------------------------|-----------------------|---|---|----------------------------|-----------------------|
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | | | Anleihen Forts. | | | |
| Supranational - 73.536.026 | | | | Griechenland - 6.976.005 | | | |
| (31. Dezember 2020: 37.621.950) | | | | (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 73.536.026 | Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund | 73.536.026 | 9,28 | 6.000.000 | Crystal Almond SARL 'REGS' 4.250% 15-Oct-2024 | 6.976.005 | 0,88 |
| Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen 73.536.026 9,28 | | | | Israel - 6.045.000 | | | |
| | | | | (31. Dezember 2020: 8.560.000) | | | |
| | | | | 6.045.000 0,76 | | | |
| | | | | (31. Dezember 2020: -) | | | |
| | | | | 6.000.000 0,76 | | | |
| | | | | 6.000.000 Energean Israel Finance Ltd '144A' 4.500% 30-Mar-2024 | | | |
| | | | | 6.045.000 0,76 | | | |
| | | | | 6.000.000 Energean Israel Finance Ltd '144A' 4.500% 30-Mar-2024 | | | |
| | | | | 6.045.000 0,76 | | | |
| Anleihen | | | | Italien - 22.662.909 | | | |
| Australien - 17.487.860 | | | | (31. Dezember 2020: 14.335.384) | | | |
| (31. Dezember 2020: 7.909.954) | | | | 22.662.909 2,86 | | | |
| 13.550.000 | Emeco Pty Ltd 'MTN' 6.250% 10-Jul-2026 | 9.795.180 | 1,24 | 10.925.000 | Fabric BC SpA 'REGS' FRN 4.125% 31-Aug-2026 | 12.470.773 | 1,57 |
| 7.420.000 | Perenti Finance Pty Ltd 'REGS' 6.500% 07-Oct-2025 | 7.692.680 | 0,97 | 9.250.000 | Italmatch Chemicals SpA 'REGS' FRN 4.750% 30-Sep-2024 | 10.192.136 | 1,29 |
| Belgien - 7.207.194 | | | | Luxemburg - 57.493.354 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | | (31. Dezember 2020: 76.733.286) | | | |
| 6.000.000 0,91 | | | | 57.493.354 7,25 | | | |
| 6.000.000 House of HR 'REGS' 7.500% 15-Jan-2027 | | | | 10.000.000 Altice Financing SA 'REGS' 2.250% 15-Jan-2025 | | | |
| 7.207.194 0,91 | | | | 11.156.057 1,41 | | | |
| | | | | 14.000.000 Altice France Holding SA '144A' 8.000% 15-May-2027 | | | |
| | | | | 16.888.006 2,13 | | | |
| | | | | 3.000.000 Garfunkelux Holdco 3 SA 'REGS' 7.750% 01-Nov-2025 | | | |
| | | | | 4.224.033 0,53 | | | |
| | | | | 5.000.000 Kleopatra Holdings 2 SCA 'REGS' 6.500% 01-Sep-2026 | | | |
| | | | | 5.241.167 0,66 | | | |
| | | | | 6.382.000 Monitchem HoldCo 2 SA 'REGS' 9.500% 15-Sep-2026 | | | |
| | | | | 7.829.021 0,99 | | | |
| | | | | 2.000.000 Monitchem HoldCo 3 SA 'REGS' FRN 5.250% 15-Mar-2025 | | | |
| | | | | 2.286.110 0,29 | | | |
| | | | | 8.019.368 Summer BC Holdco A Sarl 'REGS' 9.250% 31-Oct-2027 | | | |
| | | | | 9.868.960 1,24 | | | |
| Brasilien - 17.710.970 | | | | Mexiko - 9.084.510 | | | |
| (31. Dezember 2020: 16.112.282) | | | | (31. Dezember 2020: 10.390.000) | | | |
| 17.710.970 2,24 | | | | 9.084.510 1,15 | | | |
| 11.354.000 | FS Luxembourg Sarl 'REGS' 10.000% 15-Dec-2025 | 12.460.845 | 1,57 | 8.794.000 | Axtel SAB de CV 'REGS' 6.375% 14-Nov-2024 | 9.084.510 | 1,15 |
| 5.000.000 | NBM US Holdings Inc 'REGS' 7.000% 14-May-2026 | 5.250.125 | 0,67 | | | | |
| Chile - 9.372.825 | | | | Niederlande - 73.377.816 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | | (31. Dezember 2020: 53.925.890) | | | |
| 9.000.000 1,18 | | | | 73.377.816 9,26 | | | |
| 9.000.000 Kenbourne Invest SA 'REGS' 6.875% 26-Nov-2024 | | | | 2.052.000 Lincoln Financing SARL 'REGS' 3.625% 01-Apr-2024 | | | |
| 9.372.825 1,18 | | | | 2.356.373 0,30 | | | |
| | | | | 7.350.000 Lincoln Financing SARL 'REGS' FRN 3.875% 01-Apr-2024 | | | |
| | | | | 8.383.303 1,06 | | | |
| | | | | 10.346.000 Promontoria Holding 264 BV 'REGS' 6.750% 15-Aug-2023 | | | |
| | | | | 11.786.292 1,48 | | | |
| | | | | 1.000.000 Promontoria Holding 264 BV 'REGS' FRN 6.250% 15-Aug-2023 | | | |
| | | | | 1.133.662 0,14 | | | |
| | | | | 4.195.000 Summer BidCo BV 'REGS' 9.000% 15-Nov-2025 | | | |
| | | | | 4.898.994 0,62 | | | |
| | | | | 6.879.644 Summer BidCo BV 'REGS' 9.000% 15-Nov-2025 | | | |
| | | | | 8.017.101 1,01 | | | |
| | | | | 8.400.000 Sunshine Mid BV 'REGS' 6.500% 15-May-2026 | | | |
| | | | | 9.832.379 1,24 | | | |
| | | | | 10.605.000 Trivium Packaging Finance BV 'REGS' 3.750% 15-Aug-2026 | | | |
| | | | | 12.265.425 1,55 | | | |
| | | | | 2.000.000 Trivium Packaging Finance BV 'REGS' FRN 3.750% 15-Aug-2026 | | | |
| | | | | 2.276.982 0,29 | | | |
| | | | | 7.000.000 UPC Holding BV '144A' 5.500% 15-Jan-2028 | | | |
| | | | | 7.272.230 0,92 | | | |
| | | | | 5.000.000 Ziggo Bond Co BV '144A' 6.000% 15-Jan-2027 | | | |
| | | | | 5.155.075 0,65 | | | |
| Dänemark - 16.363.104 | | | | Nigeria - 5.307.550 | | | |
| (31. Dezember 2020: 12.939.810) | | | | (31. Dezember 2020: 6.315.000) | | | |
| 16.363.104 2,06 | | | | 5.307.550 0,67 | | | |
| 7.000.000 | DKT Finance ApS '144A' 9.375% 17-Jun-2023 | 7.107.737 | 0,89 | 5.000.000 | IHS Netherlands Holdco BV '144A' 8.000% 18-Sep-2027 | 5.307.550 | 0,67 |
| 8.000.000 | DKT Finance ApS 'REGS' 7.000% 17-Jun-2023 | 9.255.367 | 1,17 | | | | |
| Ägypten - 1.695.121 | | | | Norwegen - 10.402.719 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | | (31. Dezember 2020: 10.005.160) | | | |
| 1.700.000 0,21 | | | | 10.402.719 1,31 | | | |
| 1.700.000 Energean Plc 'REGS' 6.500% 30-Apr-2027 | | | | 6.000.000 DNO ASA '144A' 7.875% 09-Sep-2026 | | | |
| | | | | 6.180.000 0,78 | | | |
| | | | | 4.075.000 DNO ASA '144A' 8.375% 29-May-2024 | | | |
| | | | | 4.222.719 0,53 | | | |
| Finnland - 8.168.377 | | | | Spanien - 8.041.306 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | | (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 8.168.377 1,03 | | | | 8.041.306 1,02 | | | |
| 7.000.000 | PHM Group Holding Oy '144A' 4.750% 18-Jun-2026 | 8.168.377 | 1,03 | 7.000.000 | Gestamp Automocion SA 'REGS' 3.250% 30-Apr-2026 | 8.041.306 | 1,02 |
| Frankreich - 48.614.912 | | | | Schweden - 14.584.806 | | | |
| (31. Dezember 2020: 63.220.246) | | | | (31. Dezember 2020: 8.431.232) | | | |
| 48.614.912 6,13 | | | | 14.584.806 1,84 | | | |
| 5.000.000 | Altice France SA/France 'REGS' 2.125% 15-Feb-2025 | 5.552.026 | 0,70 | 5.760.000 | Unilabs Subholding AB 'REGS' 5.750% 15-May-2025 | 6.660.563 | 0,84 |
| 5.000.000 | Altice France SA/France 'REGS' 5.875% 01-Feb-2027 | 5.969.900 | 0,75 | 2.850.000 | Verisure Holding AB 'REGS' 3.500% 15-May-2023 | 3.273.733 | 0,41 |
| 3.200.000 | Banijay Group SAS 'REGS' 6.500% 01-Mar-2026 | 3.798.152 | 0,48 | | | | |
| 8.000.000 | Casino Guichard Perrachon SA 'EMTN' 4.561% 25-Jan-2023 | 9.182.381 | 1,16 | | | | |
| 6.000.000 | IPD 3 BV 'REGS' 5.500% 01-Dec-2025 | 7.040.253 | 0,89 | | | | |
| 2.000.000 | Lion/Polaris Lux 4 SA 'REGS' FRN 4.000% 01-Jul-2026 | 2.298.487 | 0,29 | | | | |
| 8.000.000 | Parts Europe SA 'REGS' 6.500% 16-Jul-2025 | 9.452.344 | 1,19 | | | | |
| 4.600.000 | Picard Groupe SAS 'REGS' 3.875% 01-Jul-2026 | 5.321.369 | 0,67 | | | | |
| Deutschland - 57.210.930 | | | | | | | |
| (31. Dezember 2020: 47.756.921) | | | | | | | |
| 57.210.930 7,22 | | | | | | | |
| 8.000.000 | CeramTec BondCo GmbH 'REGS' 5.250% 15-Dec-2025 | 9.248.423 | 1,17 | | | | |
| 12.100.000 | Nidda BondCo GmbH 'REGS' 5.000% 30-Sep-2025 | 13.717.837 | 1,73 | | | | |
| 1.000.000 | Nidda BondCo GmbH 'REGS' 7.250% 30-Sep-2025 | 1.160.895 | 0,15 | | | | |
| 12.550.000 | Renk AG/Frankfurt am Main 'REGS' 5.750% 15-Jul-2025 | 14.869.056 | 1,87 | | | | |
| 7.473.182 | Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 'REGS' 6.000% 30-Jul-2026 | 8.776.668 | 1,11 | | | | |
| 8.000.000 | TK Elevator Midco GmbH 'REGS' 4.375% 15-Jul-2027 | 9.438.051 | 1,19 | | | | |
| Ghana - 2.456.685 | | | | | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | | | | | |
| 2.456.685 0,31 | | | | | | | |
| 3.000.000 | Tullow Oil Plc '144A' 7.000% 01-Mar-2025 | 2.456.685 | 0,31 | | | | |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|---|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Schweden Forts. | | | |
| 4.000.000 | Verisure Holding AB 'REGS' 3.875% 15-Jul-2026 | 4.650.510 | 0,59 |
| Tansania - 9.879.975 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 9.450.000 | HTA Group Ltd/Mauritius 'REGS' 7.000% 18-Dec-2025 | 9.879.975 | 1,25 |
| Vereinigtes Königreich - 115.263.612 | | | |
| (31. Dezember 2020: 82.555.364) | | | |
| 4.050.000 | Bellis Acquisition Co Plc 'REGS' 4.500% 16-Feb-2026 | 5.489.939 | 0,69 |
| 2.500.000 | Connect Finco SARL / Connect US Finco LLC '144A' 6.750% 01-Oct-2026 | 2.631.500 | 0,33 |
| 1.250.000 | CPUK Finance Ltd 4.500% 28-Aug-2027 | 1.700.035 | 0,22 |
| 6.475.000 | CPUK Finance Ltd 6.500% 28-Aug-2026 | 9.121.341 | 1,15 |
| 3.000.000 | CPUK Finance Ltd 'REGS' 4.875% 28-Aug-2025 | 4.076.956 | 0,52 |
| 6.000.000 | Deuce Finco Plc 'REGS' 5.500% 15-Jun-2027 | 8.097.226 | 1,02 |
| 6.677.104 | EnQuest Plc '144A' 'EMTN' 7.000% 15-Oct-2023 | 6.212.511 | 0,79 |
| 2.203.390 | EnQuest Plc 'EMTN' 7.000% 15-Oct-2023 | 2.857.975 | 0,36 |
| 4.015.000 | esure Group Plc 6.750% 19-Dec-2024 | 6.126.781 | 0,77 |
| 1.000.000 | Greene King Finance Plc FRN 1.898% 15-Dec-2034 | 1.111.604 | 0,14 |
| 5.050.000 | Harbour Energy Plc 'REGS' 5.500% 15-Oct-2026 | 5.017.327 | 0,63 |
| 9.595.000 | INEOS Quattro Finance 1 Plc 'REGS' 3.750% 15-Jul-2026 | 11.025.709 | 1,39 |
| 20.000.000 | Ithaca Energy North Sea Plc 'REGS' 9.000% 15-Jul-2026 | 20.520.798 | 2,59 |
| 3.250.000 | Marston's Issuer Plc FRN 2.684% 16-Jul-2035 | 3.409.428 | 0,43 |
| 6.000.000 | Pinnacle Bidco Plc 'REGS' 5.500% 15-Feb-2025 | 6.999.959 | 0,88 |
| 4.000.000 | Pinnacle Bidco Plc 'REGS' 6.375% 15-Feb-2025 | 5.492.926 | 0,69 |
| 4.100.000 | Punch Finance Plc 'REGS' 6.125% 30-Jun-2026 | 5.567.733 | 0,70 |
| 2.685.000 | Stonegate Pub Co Financing 2019 Plc 'REGS' FRN 5.750% 31-Jul-2025 | 3.023.995 | 0,38 |
| 5.000.000 | Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 'REGS' 4.875% 15-Jul-2028 | 6.779.869 | 0,86 |
| Vereinigte Staaten von Amerika - 140.595.550 | | | |
| (31. Dezember 2020: 160.059.990) | | | |
| 5.300.000 | Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 5.250% 30-Apr-2025 | 5.477.736 | 0,69 |
| 6.000.000 | Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 5.250% 15-Aug-2027 | 6.044.250 | 0,76 |
| 5.000.000 | Avantor Funding Inc '144A' 4.625% 15-Jul-2028 | 5.220.825 | 0,66 |
| 10.264.000 | Clarios Global LP / Clarios US Finance Co '144A' 8.500% 15-May-2027 | 10.893.029 | 1,37 |
| 5.000.000 | Clear Channel Worldwide Holdings Inc '144A' 5.125% 15-Aug-2027 | 5.180.000 | 0,65 |
| 7.000.000 | Cleveland-Cliffs Inc 5.875% 01-Jun-2027 | 7.295.750 | 0,92 |
| 10.000.000 | Cogent Communications Group Inc 'REGS' 4.375% 30-Jun-2024 | 11.581.600 | 1,46 |
| 5.000.000 | Fresh Market Inc/The '144A' 9.750% 01-May-2023 | 5.149.750 | 0,65 |
| 4.000.000 | Global Partners LP / GLP Finance Corp 7.000% 01-Aug-2027 | 4.154.000 | 0,52 |
| 8.000.000 | Kraton Polymers LLC / Kraton Polymers Capital Corp '144A' 4.250% 15-Dec-2025 | 8.290.920 | 1,05 |
| 8.000.000 | LABEL Inc '144A' 10.500% 15-Jul-2027 | 8.398.000 | 1,06 |
| 9.000.000 | MEDNAX Inc '144A' 6.250% 15-Jan-2027 | 9.427.140 | 1,19 |
| 5.000.000 | Owens-Brockway Glass Container Inc '144A' 5.875% 15-Aug-2023 | 5.242.575 | 0,66 |
| 7.000.000 | SCIL IV LLC / SCIL USA Holdings LLC 'REGS' 4.375% 01-Nov-2026 | 8.133.160 | 1,03 |
| 1.000.000 | SCIL IV LLC / SCIL USA Holdings LLC 'REGS' FRN 4.375% 01-Nov-2026 | 1.153.558 | 0,15 |
| 7.000.000 | SRM Escrow Issuer LLC '144A' 6.000% 01-Nov-2028 | 7.491.295 | 0,95 |
| 2.571.000 | Summer BC Bidco B LLC '144A' 5.500% 31-Oct-2026 | 2.635.275 | 0,33 |
| 9.000.000 | Surgery Center Holdings Inc '144A' 10.000% 15-Apr-2027 | 9.571.500 | 1,21 |
| 11.000.000 | Trinseo Materials Operating SCA / Trinseo Materials Finance Inc '144A' 5.375% 01-Sep-2025 | 11.213.125 | 1,42 |
| 7.500.000 | United Natural Foods Inc '144A' 6.750% 15-Oct-2028 | 8.042.062 | 1,01 |
| Gesamtanlagen in Anleihen | | 666.003.090 | 84,03 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|--|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Fremdfinanzierte Darlehen (Leveraged Loans) | | | |
| Niederlande - 5.713.852 | | | |
| (31. Dezember 2020: 2.752.462) | | | |
| 5.000.000 | Kraton Polymers Holdings B.V. Term Loan 0.000% 18-Nov-2028 | 5.713.852 | 0,72 |
| Norwegen - 8.929.100 | | | |
| (31. Dezember 2020: 7.824.673) | | | |
| 8.571.429 | INEOS Rafnes AS 2.100% 08-Nov-2024 | 8.929.100 | 1,13 |
| Vereinigtes Königreich - 19.924.007 | | | |
| (31. Dezember 2020: 11.707.392) | | | |
| 3.500.000 | Constellation Automotive Group Limited Term Loan 7.551% 15-Jul-2029 | 4.809.958 | 0,61 |
| 4.005.668 | INEOS Enterprises Holdings II Ltd 2.750% 03-Sep-2024 | 4.537.655 | 0,57 |
| 5.000.000 | Parkdean Resorts Richmond UK Holdco Limited Term Loan 4.333% 03-Mar-2024 | 6.702.885 | 0,84 |
| 2.887.000 | Zephyr Bidco Limited Term Loan 4.813% 06-Jun-2025 | 3.873.509 | 0,49 |
| Gesamtanlagen in fremdfinanzierten Darlehen (Leveraged Loans) | | 34.566.959 | 4,36 |
| Credit Default Swaps - 116.058 | | | |
| (31. Dezember 2020: 8.126) | | | |
| (3.000.000) | CDS Casino Guichard-Perrachon 5.000% 20-Dec-2022 | 85.214 | 0,01 |
| (1.800.000) | CDS Iceland Bondco Plc 5.000% 20-Jun-2022 | 30.844 | 0,00 |
| Credit Default Swaps insgesamt | | 116.058 | 0,01 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 11.959.722 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 5.863.263) | | 11.959.722 | 1,51 |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | 786.181.855 | 99,19 |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (1.769.339) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (1.621.219)) | | (1.769.339) | (0,22) |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | (1.769.339) | (0,22) |
| Nettoumlaufvermögen | | 8.160.856 | 1,03 |
| Summe Nettovermögen | | 792.573.372 | 100,00 |
| Die Kontrahenten für Credit Default Swaps sind Goldman Sachs und Morgan Stanley. | | | |
| Portfolioanalyse | | % des Gesamtvermögens | |
| An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | 91,62 | |
| Nicht an einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | 4,28 | |
| Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate) | | 1,50 | |
| Sonstiges Umlaufvermögen | | 2,60 | |
| Gesamtvermögen | | 100,00 | |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

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 | 10.373.000 | 11.733.388 | 11. Jan. 22 | UBS AG | 77.993 |
| Euro | US-Dollar | 2.679.000 | 3.022.251 | 11. Jan. 22 | Morgan Stanley | 28.234 |
| US-Dollar | Euro | 61.238.748 | 52.584.000 | 11. Jan. 22 | Morgan Stanley | 1.363.143 |
| US-Dollar | Euro | 61.243.270 | 52.584.000 | 11. Jan. 22 | Barclays Bank PLC | 1.367.665 |
| US-Dollar | Australischer Dollar | 1.492.720 | 2.048.000 | 19. Jan. 22 | Bank of America Merrill Lynch | 2.625 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 214.000 | 282.716 | 25. Jan. 22 | HSBC Bank plc | 6.929 |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 68.343.329 | 50.438.000 | 25. Jan. 22 | Barclays Bank PLC | 76.455 |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 4.084.011 | 2.997.000 | 25. Jan. 22 | Morgan Stanley | 27.628 |
| Euro | US-Dollar | 16.906.000 | 19.108.412 | 1. Feb. 22 | UBS AG | 150.238 |
| Euro | US-Dollar | 1.560.000 | 1.769.689 | 1. Feb. 22 | HSBC Bank plc | 7.401 |
| US-Dollar | Euro | 114.354.601 | 98.977.000 | 1. Feb. 22 | Toronto Dominion Bank | 1.603.898 |
| Euro | US-Dollar | 1.333.000 | 1.506.513 | 18. Feb. 22 | Morgan Stanley | 12.477 |
| Euro | US-Dollar | 641.000 | 726.215 | 18. Feb. 22 | UBS AG | 4.223 |

USD 4.728.909

| | | | | | | |
|-----------|----------------------|-------------|------------|-------------|----------------------------------|-----------|
| Euro | US-Dollar | 8.402.000 | 9.751.916 | 11. Jan. 22 | Morgan Stanley | (184.845) |
| Euro | US-Dollar | 371.000 | 431.239 | 11. Jan. 22 | Bank of America Merrill Lynch | (8.794) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 2.629.480 | 1.968.000 | 25. Jan. 22 | Morgan Stanley | (34.170) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 5.573.261 | 4.132.000 | 25. Jan. 22 | Morgan Stanley | (19.222) |
| US-Dollar | Australischer Dollar | 8.259.005 | 11.550.000 | 7. Feb. 22 | Morgan Stanley | (145.063) |
| US-Dollar | Euro | 2.572.478 | 2.280.000 | 8. Feb. 22 | Bank of America Merrill Lynch | (20.159) |
| US-Dollar | Euro | 7.584.676 | 6.689.000 | 8. Feb. 22 | Morgan Stanley | (36.198) |
| US-Dollar | Euro | 35.719.147 | 31.356.000 | 8. Feb. 22 | Morgan Stanley | (5.194) |
| US-Dollar | Euro | 2.713.754 | 2.395.000 | 8. Feb. 22 | Morgan Stanley | (14.904) |
| US-Dollar | Euro | 1.996.193 | 1.769.000 | 8. Feb. 22 | UBS AG | (19.254) |
| US-Dollar | Euro | 1.544.556 | 1.363.000 | 8. Feb. 22 | Barclays Bank PLC | (8.330) |
| US-Dollar | Euro | 5.698.581 | 5.034.000 | 8. Feb. 22 | Barclays Bank PLC | (36.727) |
| US-Dollar | Euro | 2.377.248 | 2.102.000 | 8. Feb. 22 | Morgan Stanley | (17.591) |
| US-Dollar | Euro | 2.135.264 | 1.888.000 | 8. Feb. 22 | Morgan Stanley | (15.762) |
| US-Dollar | Euro | 4.449.756 | 3.916.000 | 18. Feb. 22 | Citigroup Global Markets Limited | (12.634) |
| US-Dollar | Euro | 103.655.625 | 91.614.000 | 18. Feb. 22 | Toronto Dominion Bank | (741.051) |

USD (1.319.898)

BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse CHF W (Acc) (Hedged)

| | | | | | | |
|-------------------|-----------|---------|---------|-------------|-----------------------------|--------|
| Schweizer Franken | US-Dollar | 9.073 | 9.879 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 81 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 25.685 | 27.900 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 296 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 7.882 | 8.535 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 117 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 73.383 | 79.925 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 631 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 18.234 | 19.745 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 272 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 3.387 | 3.685 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 33 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 902.133 | 976.712 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 13.598 |

USD 15.028

CHF 13.694

BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)

| | | | | | | |
|------|-----------|---------|---------|-------------|-----------------------------|-------|
| Euro | US-Dollar | 463.833 | 525.020 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 3.054 |
| Euro | US-Dollar | 17.014 | 19.261 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 110 |
| Euro | US-Dollar | 155.067 | 175.864 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 717 |
| Euro | US-Dollar | 35.000 | 39.702 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 154 |
| Euro | US-Dollar | 739.106 | 834.482 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 7.165 |
| Euro | US-Dollar | 640.487 | 722.833 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 6.512 |
| Euro | US-Dollar | 56.845 | 63.927 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 804 |
| Euro | US-Dollar | 87.650 | 99.432 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 378 |
| Euro | US-Dollar | 211.099 | 238.555 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.830 |
| Euro | US-Dollar | 108.291 | 122.017 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.298 |

Devisenterminkontrakte Forts.

| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|---|-----------|------------|------------|------------------|-----------------------------|-------------------------------------|
| BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged) Forts. | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 15.979 | 18.051 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 144 |
| Euro | US-Dollar | 69.300 | 78.525 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 390 |
| Euro | US-Dollar | 160.092 | 181.254 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.049 |
| Euro | US-Dollar | 26.470 | 30.016 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 126 |
| Euro | US-Dollar | 85.906.251 | 97.219.018 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 605.568 |
| Euro | US-Dollar | 70.437 | 79.756 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 453 |

USD 629.752

EUR 553.141

| | | | | | | |
|-----------|------|---------|---------|-------------|-----------------------------|---------|
| US-Dollar | Euro | 181.211 | 160.092 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1.054) |
| US-Dollar | Euro | 79.739 | 70.437 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (455) |
| US-Dollar | Euro | 22.134 | 19.516 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (90) |
| US-Dollar | Euro | 433.630 | 382.272 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1.678) |
| US-Dollar | Euro | 74.324 | 65.829 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (638) |
| US-Dollar | Euro | 100.128 | 89.035 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1.259) |
| US-Dollar | Euro | 22.160 | 19.534 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (84) |
| US-Dollar | Euro | 221.499 | 196.005 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1.699) |
| US-Dollar | Euro | 2.254 | 2.001 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (24) |
| US-Dollar | Euro | 82.755 | 73.034 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (411) |
| US-Dollar | Euro | 11.313 | 10.006 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (80) |
| US-Dollar | Euro | 219.778 | 193.445 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (505) |
| US-Dollar | Euro | 19.265 | 17.014 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (109) |
| US-Dollar | Euro | 525.145 | 463.833 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (3.038) |
| US-Dollar | Euro | 731.640 | 645.204 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (3.076) |

BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR H (Inc) (Hedged)

| | | | | | | |
|-----------|-----------|-----------|-----------|-------------|-----------------------------|--------|
| Euro | US-Dollar | 8 | 9 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - |
| Euro | US-Dollar | 95 | 108 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1 |
| Euro | US-Dollar | 1.812.743 | 2.051.458 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 12.778 |
| Euro | US-Dollar | 238 | 270 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 2 |
| Euro | US-Dollar | 250.000 | 283.492 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.192 |
| US-Dollar | Euro | 9 | 8 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - |
| US-Dollar | Euro | 145 | 127 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - |

USD 13.973

EUR 12.273

| | | | | | | |
|-----------------|------|-------|-------|-------------|-----------------------------|------|
| US-Dollar | Euro | 270 | 238 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (2) |
| US-Dollar | Euro | 1.202 | 1.065 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (11) |
| USD (13) | | | | | | |
| EUR (11) | | | | | | |

BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR I (Acc) (Hedged)

| | | | | | | |
|------|-----------|-------|-------|-------------|-----------------------------|----|
| Euro | US-Dollar | 4.903 | 5.514 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 69 |
|------|-----------|-------|-------|-------------|-----------------------------|----|

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte Forts.

| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|---|-----------|------------|------------|------------------|-----------------------------|-------------------------------------|
| BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR I (Acc) (Hedged) Forts. | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 2.101 | 2.383 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 9 |
| Euro | US-Dollar | 10.301.860 | 11.658.485 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 72.620 |
| | | | | | | USD 72.698 |
| | | | | | | EUR 63.854 |
| US-Dollar | Euro | 16.977 | 15.036 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (146) |
| | | | | | | USD (146) |
| | | | | | | EUR (128) |

BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR I (Inc) (Hedged)

| | | | | | | |
|-----------|-----------|-----------|-----------|-------------|-----------------------------|-------------------|
| Euro | US-Dollar | 2.688.470 | 3.042.508 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 18.951 |
| | | | | | | USD 18.951 |
| | | | | | | EUR 16.646 |
| US-Dollar | Euro | 33.076 | 29.159 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (128) |
| | | | | | | USD (128) |
| | | | | | | EUR (112) |

BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)

| | | | | | | |
|-----------|-----------|-------------|-------------|-------------|-----------------------------|--------------------|
| Euro | US-Dollar | 43.139 | 48.829 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 284 |
| Euro | US-Dollar | 6.613 | 7.487 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 43 |
| Euro | US-Dollar | 46.848 | 53.131 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 217 |
| Euro | US-Dollar | 1.316.457 | 1.490.474 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 8.623 |
| Euro | US-Dollar | 21.408 | 24.241 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 138 |
| Euro | US-Dollar | 104.265.714 | 117.996.190 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 734.987 |
| Euro | US-Dollar | 35.217 | 40.010 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 92 |
| Euro | US-Dollar | 18.995 | 21.523 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 107 |
| Euro | US-Dollar | 50.761 | 57.346 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 457 |
| Euro | US-Dollar | 67.769 | 76.583 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 588 |
| Euro | US-Dollar | 33.353 | 37.836 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 144 |
| Euro | US-Dollar | 24.015 | 27.007 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 340 |
| Euro | US-Dollar | 24.276 | 27.397 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 247 |
| Euro | US-Dollar | 135.250 | 152.702 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.311 |
| Euro | US-Dollar | 25.369 | 28.777 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 111 |
| Euro | US-Dollar | 1.537.915 | 1.732.850 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 18.430 |
| Euro | US-Dollar | 7.984 | 9.054 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 38 |
| | | | | | | USD 766.157 |
| | | | | | | EUR 672.952 |
| US-Dollar | Euro | 1.490.119 | 1.316.457 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (8.668) |
| US-Dollar | Euro | 24.235 | 21.408 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (138) |
| US-Dollar | Euro | 7.488 | 6.613 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (43) |
| US-Dollar | Euro | 24.050 | 21.169 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (55) |
| US-Dollar | Euro | 22.639 | 20.022 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (161) |

Devisenterminkontrakte Forts.

| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|---|---------|------------|------------|------------------|-----------------------------|-------------------------------------|
| BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged) Forts. | | | | | | |
| US-Dollar | Euro | 26.286 | 23.198 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (131) |
| US-Dollar | Euro | 248.367 | 219.847 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1.981) |
| US-Dollar | Euro | 6.381 | 5.663 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (68) |
| US-Dollar | Euro | 12.861 | 11.380 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (99) |
| US-Dollar | Euro | 61.572 | 54.276 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (234) |
| US-Dollar | Euro | 18.179 | 16.108 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (164) |
| US-Dollar | Euro | 219.886 | 194.754 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1.888) |
| US-Dollar | Euro | 36.531 | 32.204 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (141) |
| US-Dollar | Euro | 132.915 | 117.198 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (542) |
| US-Dollar | Euro | 48.841 | 43.139 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (283) |
| US-Dollar | Euro | 83.507 | 74.255 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1.050) |
| US-Dollar | Euro | 221.426 | 195.267 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (931) |
| | | | | | | USD (16.577) |
| | | | | | | EUR (14.560) |

BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged)

| | | | | | | |
|------|-----------|---------|---------|-------------|-----------------------------|------------------|
| Euro | US-Dollar | 795.982 | 900.803 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 5.611 |
| | | | | | | USD 5.611 |
| | | | | | | EUR 4.928 |

BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)

| | | | | | | |
|----------------|----------------|------------|------------|-------------|-----------------------------|----------------------|
| Pfund Sterling | US-Dollar | 11.435 | 15.337 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 141 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 3.255 | 4.392 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 13 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 50.534 | 67.821 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 577 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 25.193 | 34.002 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 98 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 43.749.236 | 57.795.851 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.419.509 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 22.987 | 30.421 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 692 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 22.658 | 29.970 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 698 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 28.639 | 38.023 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 740 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 30.456 | 40.256 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 967 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 17.004 | 22.493 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 522 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 29.268 | 38.832 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 783 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 22.723 | 30.289 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 468 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 85.614 | 113.337 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 2.543 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 39.201 | 51.776 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.283 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 31.144 | 41.333 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 820 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 23.933 | 31.985 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 408 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 17.225 | 23.104 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 211 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 62.121 | 83.383 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 698 |
| | | | | | | USD 1.431.171 |
| | | | | | | GBP 1.057.346 |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 23.103 | 17.225 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (213) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 34.001 | 25.193 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (99) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 174.002 | 129.850 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1.482) |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte Forts.

| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|--|----------------|------------|------------|------------------|-----------------------------|-------------------------------------|
| BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged) Forts. | | | | | | |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 15.337 | 11.435 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (140) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 4.393 | 3.255 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (13) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 9.167 | 6.926 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (208) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 8.469 | 6.408 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (204) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 13.535 | 10.233 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (315) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 14.653 | 11.037 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (285) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 18.250 | 13.807 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (439) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 1.490.924 | 1.123.716 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (30.046) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 388.589 | 291.527 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (5.999) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 114.798 | 86.718 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (2.576) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 21.041 | 15.931 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (521) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 24.875 | 18.742 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (494) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 22.883 | 17.122 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (292) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 5.723.439 | 4.326.672 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (132.789) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 17.500 | 13.037 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (147) |
| USD | | | | | | (176.262) |
| GBP | | | | | | (130.222) |

BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Inc) (Hedged)

| | | | | | | |
|----------------|----------------|-----------|-----------|-------------|-----------------------------|----------------|
| Pfund Sterling | US-Dollar | 981 | 1.316 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 11 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 17.894 | 23.915 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 305 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 2.501 | 3.319 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 66 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 54.907 | 72.521 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.797 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 313 | 415 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 9 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 5.372 | 7.161 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 111 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 1.006 | 1.331 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 31 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 5.870 | 7.758 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 186 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 4.127 | 5.479 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 107 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 2.972 | 3.932 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 92 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 1.110 | 1.469 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 33 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 3.648.550 | 4.817.352 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 118.318 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 2.743 | 3.702 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 11 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 27.530 | 36.952 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 309 |
| USD | | | | | | 121.386 |
| GBP | | | | | | 89.680 |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 3.702 | 2.743 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (11) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 10.785 | 8.035 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (90) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 469 | 354 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (9) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 4.866 | 3.684 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (121) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 551 | 416 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (12) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 47.581 | 35.696 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (735) |

Devisenterminkontrakte Forts.

| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|--|----------------|------------|------------|------------------|-----------------------------|-------------------------------------|
| BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Inc) (Hedged) Forts. | | | | | | |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 28.804 | 21.775 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (668) |
| USD | | | | | | (1.646) |
| GBP | | | | | | (1.216) |
| BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse Sterling X (Acc) (Hedged) Forts. | | | | | | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 25.096.283 | 33.153.974 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 814.286 |
| USD | | | | | | 814.286 |
| GBP | | | | | | 601.593 |
| BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse Sterling Y (Acc) (Hedged) Forts. | | | | | | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 8.858.476 | 11.702.676 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 287.426 |
| USD | | | | | | 287.426 |
| GBP | | | | | | 212.350 |

BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse Sterling Z (Acc) (Hedged)

| | | | | | | |
|----------------|----------------|-----------|-----------|-------------|-----------------------------|---------------|
| Pfund Sterling | US-Dollar | 4.051 | 5.468 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 16 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 11.324 | 15.029 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 298 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 15.743 | 20.888 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 421 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 4.355 | 5.761 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 134 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 6.408 | 8.470 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 203 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 2.807.272 | 3.708.606 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 91.086 |
| USD | | | | | | 92.158 |
| GBP | | | | | | 68.086 |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 5.468 | 4.051 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (16) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 8.618 | 6.420 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (72) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 6.356 | 4.791 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (128) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 22.534 | 17.035 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (523) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 215 | 162 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (4) |
| USD | | | | | | (743) |
| GBP | | | | | | (549) |

BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse Sterling Z (Inc) (Hedged)

| | | | | | | |
|----------------|-----------|------------|-------------|-------------|-----------------------------|-----------|
| Pfund Sterling | US-Dollar | 22.825 | 30.613 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 282 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 25.402 | 34.282 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 100 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 49.936 | 67.019 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 571 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 23.172 | 31.080 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 284 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 9.478 | 12.792 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 37 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 90.617.487 | 119.712.144 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 2.940.218 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 111.217 | 147.188 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 3.347 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 63.660 | 84.204 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.960 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 58.691 | 77.923 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.517 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 37.787 | 49.946 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.200 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte Forts.

| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungs- datum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) |
|---|----------------|---------------|---------------|-----------------------|-----------------------------|---|
| BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Anteilsklasse Sterling Z (Inc) (Hedged) | | | | | | |
| Forts. | | | | | | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 32.730 | 43.426 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 875 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 78.108 | 104.113 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.607 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 36.939 | 48.900 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.097 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 57.078 | 75.388 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.868 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 72.135 | 95.736 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.900 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 43.900 | 58.671 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 748 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 139.381 | 184.377 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 4.278 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 29.065 | 39.014 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 327 |
| USD | | | | | | 2.962.216 |
| GBP | | | | | | 2.188.479 |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 31.079 | 23.172 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (286) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 12.792 | 9.478 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (37) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 60.475 | 45.550 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1.177) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 1.219.367 | 922.540 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (29.307) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 7.376.409 | 5.576.246 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (171.139) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 1.061.924 | 800.377 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (21.400) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 83.648 | 62.754 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1.291) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 178.211 | 134.620 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (3.999) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 165.660 | 125.425 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (4.105) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 95.340 | 71.837 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1.892) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 103.905 | 77.746 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1.325) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 121.522 | 90.547 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1.035) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 34.283 | 25.402 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (99) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 85.608 | 63.779 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (717) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 30.615 | 22.825 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (280) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 22.143 | 16.740 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (516) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 49.286 | 37.241 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1.121) |
| USD | | | | | | (239.726) |
| GBP | | | | | | (177.109) |

BNY MELLON GLOBAL UNCONSTRAINED FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|---|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| Norwegen - 203.942 | | | |
| (31. Dezember 2020: 230.907) | | | |
| 176.652 | Aquila European Renewables Income Fund Plc/ The Fund | 203.942 | 0,63 |
| Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen | | | |
| | | 203.942 | 0,63 |
| Anleihen | | | |
| Australien - 535.292 | | | |
| (31. Dezember 2020: 619.570) | | | |
| 280.000 | Australia Government Bond 3.000% 21-Mar-2047 | 227.080 | 0,70 |
| 380.000 | Australia Government Bond 3.250% 21-Apr-2029 | 308.212 | 0,94 |
| Österreich - 339.714 | | | |
| (31. Dezember 2020: 539.886) | | | |
| 190.000 | Republic of Austria Government Bond '144A' 3.150% 20-Jun-2044 | 339.714 | 1,04 |
| Kaiman-Inseln - 185.294 | | | |
| (31. Dezember 2020: 207.958) | | | |
| 200.000 | Meituan 'REGS' 3.050% 28-Oct-2030 | 185.294 | 0,57 |
| Kolumbien - 148.726 | | | |
| (31. Dezember 2020: 205.357) | | | |
| 608.000.000 | Colombia Government International Bond 'REGS' 7.500% 26-Aug-2026 | 148.726 | 0,46 |
| Deutschland - 241.446 | | | |
| (31. Dezember 2020: 260.659) | | | |
| 100.000 | Infineon Technologies AG 'EMTN' FRN (Perpetual) 2.875% 01-Jan-2025 | 117.741 | 0,36 |
| 100.000 | Infineon Technologies AG FRN (Perpetual) 3.625% 01-Jan-2028 | 123.705 | 0,38 |
| Japan - 103.912 | | | |
| (31. Dezember 2020: 111.651) | | | |
| 11.555.838 | Japanese Government CPI Linked Bond 0.100% 10-Mar-2028 | 103.912 | 0,32 |
| Mexiko - 298.010 | | | |
| (31. Dezember 2020: 360.299) | | | |
| 3.790.000 | Mexican Bonos 8.000% 07-Nov-2047 | 184.042 | 0,57 |
| 2.200.000 | Mexican Bonos 8.500% 31-May-2029 | 113.968 | 0,35 |
| Neuseeland - 305.970 | | | |
| (31. Dezember 2020: 339.817) | | | |
| 320.000 | New Zealand Government Inflation Linked Bond 3.000% 20-Sep-2030 | 305.970 | 0,94 |
| Spanien - 197.344 | | | |
| (31. Dezember 2020: 226.204) | | | |
| 130.000 | Spain Government Bond '144A' 5.150% 31-Oct-2028 | 197.344 | 0,61 |
| Vereinigte Staaten von Amerika - 3.079.027 | | | |
| (31. Dezember 2020: 2.819.641) | | | |
| 100.000 | American Airlines Inc '144A' 11.750% 15-Jul-2025 | 124.135 | 0,38 |
| 20.000 | Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd '144A' 4.750% 20-Oct-2028 | 21.874 | 0,07 |
| 149.000 | T-Mobile USA Inc 3.375% 15-Apr-2029 | 152.123 | 0,47 |
| 47.000 | T-Mobile USA Inc 3.875% 15-Apr-2030 | 51.429 | 0,16 |
| 404.564 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.500% 15-Apr-2024 | 431.553 | 1,32 |
| 487.756 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 3.375% 15-Apr-2032 | 725.334 | 2,23 |
| 100.000 | United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Aug-2026 | 101.156 | 0,31 |
| 280.000 | United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Feb-2030 | 281.422 | 0,86 |
| 625.900 | United States Treasury Note/Bond 2.000% 15-Feb-2025 | 644.799 | 1,98 |
| 332.000 | United States Treasury Note/Bond 2.375% 15-May-2029 | 354.047 | 1,09 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|--|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika Forts. | | | |
| 165.000 | United States Treasury Note/Bond 2.875% 15-May-2043 | 191.155 | 0,59 |
| Gesamtanlagen in Anleihen | | 5.434.735 | 16,70 |
| Aktien | | | |
| Australien - 177.681 | | | |
| (31. Dezember 2020: 208.783) | | | |
| 57.328 | Insurance Australia Group Ltd | 177.681 | 0,55 |
| Kaiman-Inseln - 252.991 | | | |
| (31. Dezember 2020: 375.653) | | | |
| 16.600 | Alibaba Group Holding Ltd | 252.991 | 0,78 |
| China - 169.281 | | | |
| (31. Dezember 2020: 394.018) | | | |
| 23.500 | Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H' | 169.281 | 0,52 |
| Dänemark - 199.331 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 2.429 | Novozymes A/S | 199.331 | 0,61 |
| Frankreich - 756.311 | | | |
| (31. Dezember 2020: 771.966) | | | |
| 6.586 | Bureau Veritas SA | 217.257 | 0,66 |
| 3.638 | Legrand SA | 422.576 | 1,30 |
| 8.646 | Vivendi SE | 116.478 | 0,36 |
| Deutschland - 678.022 | | | |
| (31. Dezember 2020: 845.494) | | | |
| 2.138 | Fresenius Medical Care AG & Co KGaA | 138.587 | 0,42 |
| 3.833 | SAP SE | 539.435 | 1,66 |
| Hongkong - 502.097 | | | |
| (31. Dezember 2020: 611.536) | | | |
| 49.800 | AIA Group Ltd | 502.097 | 1,54 |
| Indien - 277.455 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 4.288 | HDFC Bank Ltd ADR | 277.455 | 0,85 |
| Irland - 421.255 | | | |
| (31. Dezember 2020: 181.475) | | | |
| 126.106 | Greencoat Renewables Plc | 159.147 | 0,49 |
| 4.773 | Smurfit Kappa Group Plc | 262.108 | 0,81 |
| Japan - 1.909.502 | | | |
| (31. Dezember 2020: 2.053.902) | | | |
| 3.900 | M3 Inc | 196.406 | 0,60 |
| 6.300 | Recruit Holdings Co Ltd | 382.011 | 1,18 |
| 6.100 | Sony Group Corp | 767.666 | 2,36 |
| 9.800 | Suzuki Motor Corp | 377.460 | 1,16 |
| 12.900 | Topcon Corp | 185.959 | 0,57 |
| Niederlande - 319.324 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 11.368 | Universal Music Group NV | 319.324 | 0,98 |
| Neuseeland - 142.631 | | | |
| (31. Dezember 2020: 157.202) | | | |
| 67.133 | SKYCITY Entertainment Group Ltd | 142.631 | 0,44 |
| Republik Korea - 431.210 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.037.043) | | | |
| 782 | Samsung SDI Co Ltd | 431.210 | 1,33 |
| Schweiz - 1.081.752 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.190.104) | | | |
| 3.521 | Alcon Inc | 311.414 | 0,96 |
| 1.239 | Roche Holding AG | 514.565 | 1,58 |
| 583 | Zurich Insurance Group AG | 255.773 | 0,78 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % |
|--|--|----------------------------|-----------------------|
| Aktien Forts. | | | |
| Taiwan - 172.930 | | | |
| (31. Dezember 2020: 156.373) | | | |
| 1.436 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR | 172.930 | 0,53 |
| Thailand - 121.785 | | | |
| (31. Dezember 2020: 108.008) | | | |
| 28.700 | Kasikornbank PCL (Foreign Market) | 121.785 | 0,37 |
| Vereinigtes Königreich - 3.971.896 | | | |
| (31. Dezember 2020: 2.961.874) | | | |
| 7.500 | Associated British Foods Plc | 202.342 | 0,62 |
| 2.908 | AstraZeneca Plc | 337.705 | 1,04 |
| 59.772 | Barclays Plc | 150.658 | 0,46 |
| 5.346 | CRH Plc | 282.083 | 0,87 |
| 2.712 | Ferguson Plc | 478.491 | 1,47 |
| 12.386 | GlaxoSmithKline Plc | 267.763 | 0,82 |
| 103.266 | Hays Plc | 204.776 | 0,63 |
| 28.107 | Informa Plc | 194.385 | 0,60 |
| 1.332 | Linde Plc | 458.694 | 1,41 |
| 12.419 | National Grid Plc | 178.337 | 0,55 |
| 25.479 | Prudential Plc | 435.889 | 1,34 |
| 8.608 | RELX Plc | 277.534 | 0,85 |
| 10.633 | Travis Perkins Plc | 225.396 | 0,69 |
| 2.337 | Unilever Plc | 123.777 | 0,38 |
| 107.147 | VH Global Sustainable Energy Opportunities Plc | 154.066 | 0,47 |
| Vereinigte Staaten von Amerika - 9.580.897 | | | |
| (31. Dezember 2020: 8.080.502) | | | |
| 4.544 | Abbott Laboratories | 640.727 | 1,97 |
| 1.559 | Accenture Plc - Class A | 645.356 | 1,98 |
| 1.465 | Albemarle Corp | 343.520 | 1,05 |
| 324 | Alphabet Inc - Class A | 947.441 | 2,91 |
| 126 | Amazon.com Inc | 425.108 | 1,31 |
| 5.757 | Apple Inc | 1.026.070 | 3,15 |
| 3.953 | Applied Materials Inc | 624.455 | 1,92 |
| 7.625 | Citigroup Inc | 460.741 | 1,42 |
| 2.382 | CME Group Inc | 544.561 | 1,67 |
| 1.834 | Ecolab Inc | 429.238 | 1,32 |
| 868 | Goldman Sachs Group Inc/The | 334.605 | 1,03 |
| 31.050 | Laureate Education Inc - Class A | 375.705 | 1,15 |
| 1.634 | Mastercard Inc | 590.103 | 1,81 |
| 3.179 | Medtronic Plc | 332.189 | 1,02 |
| 3.182 | Microsoft Corp | 1.079.796 | 3,32 |
| 4.321 | Otis Worldwide Corp | 373.270 | 1,15 |
| 935 | Texas Instruments Inc | 177.080 | 0,54 |
| 3.217 | Toll Brothers Inc | 230.932 | 0,71 |
| Gesamtanlagen in Aktien | | 21.166.351 | 65,02 |
| Kapitalbeteiligungsinstrumente | | | |
| Guernsey - 166.788 | | | |
| (31. Dezember 2020: 146.003) | | | |
| 92.294 | Renewables Infrastructure Group Ltd/The | 166.788 | 0,51 |
| Vereinigtes Königreich - 1.241.232 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.056.564) | | | |
| 219.434 | Greencoat UK Wind Plc/Funds | 415.767 | 1,28 |
| 488.862 | Hipgnosis Songs Fund Ltd/The Fund | 825.465 | 2,53 |
| Gesamtanlagen in Kapitalbeteiligungsinstrumente | | 1.408.020 | 4,32 |
| Börsengehandelte Rohstoffe | | | |
| Irland - 1.499.596 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.563.620) | | | |
| 42.260 | iShares Physical Gold ETC | 1.499.596 | 4,61 |
| Gesamtanlagen in börsengehandelte Rohstoffe | | 1.499.596 | 4,61 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % |
|---|--------------|----------------------------|-----------------------|
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 45.467 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 129.353) | | 45.467 | 0,14 |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | 29.758.111 | 91,42 |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (136.007) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (128.731)) | | (136.007) | (0,42) |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | (136.007) | (0,42) |
| Nettoumlaufvermögen | | 2.928.997 | 9,00 |
| Summe Nettovermögen | | 32.551.101 | 100,00 |

| Portfolioanalyse | % des Gesamtvermögens |
|--|-----------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 90,89 |
| Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate) | 0,14 |
| Sonstiges Umlaufvermögen | 8,97 |
| Gesamtvermögen | 100,00 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Devisenterminkontrakte | | | | | | | Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) |
|--|-------------------------|------------|------------|------------------|-----------------------------|------------------|--------------------------------------|
| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | | |
| BNY Mellon Global Unconstrained Fund | | | | | | | |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 1.038.118 | 761.000 | 14. Jan. 22 | Barclays Bank PLC | 10.618 | |
| US-Dollar | Euro | 530.310 | 456.811 | 18. Feb. 22 | Barclays Bank PLC | 12.803 | |
| US-Dollar | Neuseeländischer Dollar | 292.092 | 409.232 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | 12.707 | |
| US-Dollar | Japanischer Yen | 211.055 | 23.970.889 | 16. Mrz. 22 | The Bank of New York Mellon | 2.705 | |
| | | | | | USD | 38.833 | |
| US-Dollar | Australischer Dollar | 498.928 | 703.304 | 16. Mrz. 22 | State Street Bank | (11.065) | |
| | | | | | USD | (11.065) | |
| BNY Mellon Global Unconstrained Fund Anteilsklasse CAD X (Acc) (Hedged) | | | | | | | |
| Kanadischer Dollar | US-Dollar | 406.796 | 317.615 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.762 | |
| Kanadischer Dollar | US-Dollar | 276.276 | 215.117 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.789 | |
| Kanadischer Dollar | US-Dollar | 364.822 | 285.687 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 736 | |
| Kanadischer Dollar | US-Dollar | 417.968 | 326.271 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.877 | |
| US-Dollar | Kanadischer Dollar | 190.931 | 242.594 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 470 | |
| | | | | | USD | 6.634 | |
| | | | | | CAD | 8.450 | |
| Kanadischer Dollar | US-Dollar | 41.208.879 | 32.468.305 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (115.094) | |
| US-Dollar | Kanadischer Dollar | 431.303 | 558.204 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (6.944) | |
| US-Dollar | Kanadischer Dollar | 280.625 | 361.135 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (2.904) | |
| | | | | | USD | (124.942) | |
| | | | | | CAD | (159.139) | |

BNY MELLON JAPAN SMALL CAP EQUITY FOCUS FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert JPY | Summe Nettover- mögen % |
|---|-------------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| Aktien | | | |
| Kommunikationsdienstleistungen - 2.614.136.450 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.904.433.200) | | | |
| 222.600 | Atrac Inc | 541.697.100 | 2,57 |
| 347.200 | Direct Marketing MiX Inc | 579.303.200 | 2,74 |
| 251.300 | Fibergate Inc/Japan | 320.030.550 | 1,52 |
| 520.800 | Vector Inc | 613.762.800 | 2,91 |
| 482.400 | Vision Inc/Tokyo Japan | 559.342.800 | 2,65 |
| Nicht-Basiskonsumgüter - 2.379.315.850 | | | |
| (31. Dezember 2020: 2.070.457.500) | | | |
| 33.000 | Arata Corp | 145.447.500 | 0,69 |
| 234.400 | Nifco Inc/Japan | 846.184.000 | 4,01 |
| 397.100 | Resorttrust Inc | 745.952.350 | 3,53 |
| 728.000 | Yonex Co Ltd | 641.732.000 | 3,04 |
| Basiskonsumgüter - 771.730.000 | | | |
| (31. Dezember 2020: 486.668.000) | | | |
| 134.800 | Ain Holdings Inc | 771.730.000 | 3,66 |
| Finanzwerte - 2.239.146.500 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.501.076.650) | | | |
| 917.100 | Anicom Holdings Inc | 761.193.000 | 3,61 |
| 230.600 | Premium Group Co Ltd | 872.244.500 | 4,13 |
| 120.900 | Zenkoku Hoshu Co Ltd | 605.709.000 | 2,87 |
| Gesundheitswesen - 532.681.200 | | | |
| (31. Dezember 2020: 407.575.650) | | | |
| 284.400 | Japan Medical Dynamic Marketing Inc | 532.681.200 | 2,52 |
| Industrie - 3.042.274.100 | | | |
| (31. Dezember 2020: 2.292.191.500) | | | |
| 327.800 | Aida Engineering Ltd | 351.073.800 | 1,66 |
| 212.900 | Insource Co Ltd | 600.803.800 | 2,85 |
| 230.800 | Takeuchi Manufacturing Co Ltd | 630.314.800 | 2,99 |
| 252.000 | Totetsu Kogyo Co Ltd | 632.268.000 | 3,00 |
| 466.900 | TRE Holdings Corp | 827.813.700 | 3,92 |
| Informationstechnologie - 6.697.386.850 | | | |
| (31. Dezember 2020: 4.601.586.300) | | | |
| 314.900 | Anritsu Corp | 559.577.300 | 2,65 |
| 204.600 | BrainPad Inc | 312.321.900 | 1,48 |
| 771.800 | MCJ Co Ltd | 837.017.100 | 3,97 |
| 859.200 | m-up Holdings Inc | 886.694.400 | 4,20 |
| 357.600 | Optorun Co Ltd | 849.657.600 | 4,03 |
| 149.600 | RS Technologies Co Ltd | 1.018.028.000 | 4,82 |
| 108.200 | Sanken Electric Co Ltd | 683.824.000 | 3,24 |
| 441.700 | TechMatrix Corp | 842.984.450 | 4,00 |
| 771.300 | Wacom Co Ltd | 707.282.100 | 3,35 |
| Grundstoffe - 1.532.297.200 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.214.171.300) | | | |
| 170.000 | Dowa Holdings Co Ltd | 821.950.000 | 3,89 |
| 713.200 | Sakata INX Corp | 710.347.200 | 3,37 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert JPY | Summe Nettover- mögen % |
|---|-------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| Aktien Forts. | | | |
| Versorger - 700.434.000 | | | |
| (31. Dezember 2020: 526.300.000) | | | |
| 459.000 | Nippon Gas Co Ltd | 700.434.000 | 3,32 |
| Gesamtanlagen in Aktien | | 20.509.402.150 | 97,19 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 149.024.725 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 7.683.437) | | 149.024.725 | 0,71 |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | 20.658.426.875 | 97,90 |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (10.069.632) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (41.410.420)) | | (10.069.632) | (0,05) |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | (10.069.632) | (0,05) |
| Nettoumlaufvermögen | | 454.211.108 | 2,15 |
| Summe Nettovermögen | | 21.102.568.351 | 100,00 |
| Portfolioanalyse | | | |
| | | % des Gesamtvermögens | |
| An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | 96,90 | |
| Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate) | | 0,70 | |
| Sonstiges Umlaufvermögen | | 2,40 | |
| Gesamtvermögen | | 100,00 | |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte

| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|-------------------|-----------------|------------|------------|------------------|-----------------------------|-------------------------------------|
| Schweizer Franken | Japanischer Yen | 2.183.048 | 267763.441 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 6.969.847 |
| Schweizer Franken | Japanischer Yen | 18.574 | 2.314.495 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 23.007 |
| Schweizer Franken | Japanischer Yen | 15.004 | 1.863.715 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 24.551 |
| Schweizer Franken | Japanischer Yen | 28.429 | 3.512.087 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 65.667 |
| Schweizer Franken | Japanischer Yen | 19.025 | 2.348.030 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 46.198 |
| Schweizer Franken | Japanischer Yen | 21.058 | 2.647.594 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 2.511 |
| JPY | | | | | | 7.131.781 |
| CHF | | | | | | 56.683 |

| | | | | | | |
|-----------------|-------------------|-----------|--------|-------------|-----------------------------|------------------|
| Japanischer Yen | Schweizer Franken | 6.437.903 | 52.184 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (129.374) |
| Japanischer Yen | Schweizer Franken | 5.822.178 | 47.291 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (129.360) |
| Japanischer Yen | Schweizer Franken | 2.432.335 | 19.760 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (54.370) |
| Japanischer Yen | Schweizer Franken | 3.859.101 | 31.319 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (82.375) |
| JPY | | | | | | (395.479) |
| CHF | | | | | | (3.143) |

BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse EUR G (Acc) (Hedged)

| | | | | | | |
|------------|-----------------|-----------|-------------|-------------|-----------------------------|------------------|
| Euro | Japanischer Yen | 1.794.642 | 230.017.254 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 4.029.336 |
| Euro | Japanischer Yen | 15.233 | 1.973.551 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 13.069 |
| Euro | Japanischer Yen | 12.281 | 1.589.089 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 12.491 |
| Euro | Japanischer Yen | 23.257 | 2.992.432 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 40.597 |
| Euro | Japanischer Yen | 15.611 | 2.008.166 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 27.781 |
| Euro | Japanischer Yen | 17.423 | 2.272.116 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 140 |
| JPY | | | | | | 4.123.414 |
| EUR | | | | | | 31.622 |

| | | | | | | |
|-----------------|------|-----------|--------|-------------|-----------------------------|------------------|
| Japanischer Yen | Euro | 5.509.232 | 42.971 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (94.794) |
| Japanischer Yen | Euro | 4.984.825 | 38.910 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (89.595) |
| Japanischer Yen | Euro | 2.120.943 | 16.557 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (38.381) |
| Japanischer Yen | Euro | 3.297.904 | 25.701 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (53.877) |
| JPY | | | | | | (276.647) |
| EUR | | | | | | (2.122) |

BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged)

| | | | | | | |
|------|-----------------|-----------|-------------|-------------|-----------------------------|------------|
| Euro | Japanischer Yen | 1.986 | 255.212 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 3.790 |
| Euro | Japanischer Yen | 5.108.475 | 654.747.402 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 11.469.564 |
| Euro | Japanischer Yen | 29.086 | 3.765.515 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 27.681 |
| Euro | Japanischer Yen | 43.025 | 5.574.168 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 36.911 |
| Euro | Japanischer Yen | 34.841 | 4.508.306 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 35.436 |
| Euro | Japanischer Yen | 66.102 | 8.505.223 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 115.386 |
| Euro | Japanischer Yen | 44.191 | 5.684.532 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 78.643 |
| Euro | Japanischer Yen | 1.986 | 255.376 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 3.626 |
| Euro | Japanischer Yen | 5.986 | 777.499 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 3.160 |

Devisenterminkontrakte Forts.

| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|-----------------|-----------------|------------|------------|------------------|-----------------------------|-------------------------------------|
| Euro | Japanischer Yen | 48.842 | 6.369.298 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 393 |
| JPY | | | | | | 11.774.590 |
| EUR | | | | | | 90.299 |
| Japanischer Yen | Euro | 777.283 | 5.986 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (3.288) |
| Japanischer Yen | Euro | 3.194.697 | 24.740 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (31.688) |
| Japanischer Yen | Euro | 15.743.061 | 122.793 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (270.883) |
| Japanischer Yen | Euro | 14.215.657 | 110.963 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (255.506) |
| Japanischer Yen | Euro | 6.109.490 | 47.695 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (110.558) |
| Japanischer Yen | Euro | 9.409.210 | 73.327 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (153.715) |

| | | | | | | |
|------------|--|--|--|--|--|------------------|
| JPY | | | | | | (825.638) |
| EUR | | | | | | (6.332) |

BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged)

| | | | | | | |
|------|-----------------|-----------|-------------|-------------|-----------------------------|------------|
| Euro | Japanischer Yen | 6.004.533 | 769.594.160 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 13.481.397 |
| Euro | Japanischer Yen | 50.901 | 6.594.589 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 43.668 |
| Euro | Japanischer Yen | 41.036 | 5.309.918 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 41.736 |
| Euro | Japanischer Yen | 77.688 | 9.996.023 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 135.612 |
| Euro | Japanischer Yen | 1.798 | 230.790 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 3.722 |
| Euro | Japanischer Yen | 52.148 | 6.708.009 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 92.801 |
| Euro | Japanischer Yen | 58.220 | 7.592.242 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 468 |

| | | | | | | |
|------------|--|--|--|--|--|-------------------|
| JPY | | | | | | 13.799.404 |
| EUR | | | | | | 105.828 |

| | | | | | | |
|-----------------|------|------------|---------|-------------|-----------------------------|------------------|
| Japanischer Yen | Euro | 18.403.202 | 143.542 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (316.655) |
| Japanischer Yen | Euro | 16.651.465 | 129.976 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (299.285) |
| Japanischer Yen | Euro | 1.212.295 | 9.428 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (17.214) |
| Japanischer Yen | Euro | 7.096.259 | 55.398 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (128.415) |
| Japanischer Yen | Euro | 11.034.162 | 85.991 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (180.262) |
| JPY | | | | | | (941.831) |
| EUR | | | | | | (7.223) |

BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)

| | | | | | | |
|------|-----------------|---------|------------|-------------|-----------------------------|-----------|
| Euro | Japanischer Yen | 762.665 | 97.749.950 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.712.338 |
| Euro | Japanischer Yen | 6.486 | 840.282 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 5.564 |
| Euro | Japanischer Yen | 5.224 | 676.005 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 5.313 |
| Euro | Japanischer Yen | 744 | 96.070 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 953 |
| Euro | Japanischer Yen | 9.889 | 1.272.418 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 17.282 |
| Euro | Japanischer Yen | 6.645 | 854.757 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 11.825 |
| Euro | Japanischer Yen | 7.443 | 970.607 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 60 |

| | | | | | | |
|-----------------|------|-----------|--------|-------------|-----------------------------|------------------|
| JPY | | | | | | 1.763.315 |
| EUR | | | | | | 13.446 |
| Japanischer Yen | Euro | 2.339.437 | 18.247 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (40.253) |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte Forts.

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

BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged) Forts.

| | | | | | | |
|-----------------|------|-----------|--------|-------------|-----------------------------|------------------|
| Japanischer Yen | Euro | 2.117.824 | 16.531 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (38.065) |
| Japanischer Yen | Euro | 898.724 | 7.016 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (16.264) |
| Japanischer Yen | Euro | 1.400.831 | 10.917 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (22.885) |
| | | | | | JPY | (117.467) |
| | | | | | EUR | (901) |

BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse NOK H (Acc) (Hedged)

| | | | | | | |
|-------------------|-------------------|--------|---------|-------------|-----------------------------|----------------|
| Norwegische Krone | Japanischer Yen | 77.350 | 974.693 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 35.427 |
| Norwegische Krone | Japanischer Yen | 660 | 8.541 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 73 |
| Norwegische Krone | Japanischer Yen | 521 | 6.697 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 108 |
| Norwegische Krone | Japanischer Yen | 991 | 12.618 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 328 |
| Norwegische Krone | Japanischer Yen | 666 | 8.419 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 285 |
| | | | | | JPY | 36.221 |
| | | | | | NOK | 2.773 |
| Japanischer Yen | Norwegische Krone | 23.078 | 1.842 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (981) |
| Japanischer Yen | Norwegische Krone | 21.214 | 1.684 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (782) |
| Japanischer Yen | Norwegische Krone | 9.029 | 725 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (437) |
| Japanischer Yen | Norwegische Krone | 14.222 | 1.124 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (459) |
| Norwegische Krone | Japanischer Yen | 753 | 9.833 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (6) |
| | | | | | JPY | (2.665) |
| | | | | | NOK | (204) |

BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse NOK W (Acc) (Hedged)

| | | | | | | |
|-------------------|-------------------|--------|-----------|-------------|-----------------------------|----------------|
| Norwegische Krone | Japanischer Yen | 79.560 | 1.002.534 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 36.439 |
| Norwegische Krone | Japanischer Yen | 681 | 8.822 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 74 |
| Norwegische Krone | Japanischer Yen | 539 | 6.923 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 111 |
| Norwegische Krone | Japanischer Yen | 1.023 | 13.016 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 338 |
| Norwegische Krone | Japanischer Yen | 691 | 8.727 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 295 |
| | | | | | JPY | 37.257 |
| | | | | | NOK | 2.852 |
| Japanischer Yen | Norwegische Krone | 23.645 | 1.888 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1.005) |
| Japanischer Yen | Norwegische Krone | 21.786 | 1.730 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (804) |
| Japanischer Yen | Norwegische Krone | 9.149 | 735 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (443) |
| Japanischer Yen | Norwegische Krone | 14.595 | 1.154 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (471) |
| Norwegische Krone | Japanischer Yen | 791 | 10.332 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (7) |
| | | | | | JPY | (2.730) |
| | | | | | NOK | (209) |

BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse SEK H (Acc) (Hedged)

| | | | | | | |
|-------------------|-----------------|--------|-----------|-------------|-----------------------------|--------|
| Schwedische Krone | Japanischer Yen | 80.980 | 1.012.812 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 17.887 |
| Schwedische Krone | Japanischer Yen | 689 | 8.672 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 97 |
| Schwedische Krone | Japanischer Yen | 549 | 6.906 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 88 |

Devisenterminkontrakte Forts.

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

BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse SEK H (Acc) (Hedged) Forts.

| | | | | | | |
|-------------------|-------------------|--------|--------|-------------|-----------------------------|----------------|
| Schwedische Krone | Japanischer Yen | 1.047 | 13.066 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 261 |
| Schwedische Krone | Japanischer Yen | 700 | 8.798 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 111 |
| Schwedische Krone | Japanischer Yen | 752 | 9.555 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 15 |
| | | | | | JPY | 18.459 |
| | | | | | SEK | 1.450 |
| Japanischer Yen | Schwedische Krone | 24.218 | 1.951 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (612) |
| Japanischer Yen | Schwedische Krone | 22.327 | 1.788 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (432) |
| Japanischer Yen | Schwedische Krone | 9.338 | 751 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (221) |
| Japanischer Yen | Schwedische Krone | 14.542 | 1.161 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (231) |
| | | | | | JPY | (1.496) |
| | | | | | SEK | (118) |

BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse SEK W (Acc) (Hedged)

| | | | | | | |
|-------------------|-------------------|--------|-----------|-------------|-----------------------------|----------------|
| Schwedische Krone | Japanischer Yen | 83.130 | 1.039.697 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 18.362 |
| Schwedische Krone | Japanischer Yen | 710 | 8.940 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 100 |
| Schwedische Krone | Japanischer Yen | 567 | 7.128 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 91 |
| Schwedische Krone | Japanischer Yen | 1.078 | 13.448 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 269 |
| Schwedische Krone | Japanischer Yen | 724 | 9.103 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 115 |
| Schwedische Krone | Japanischer Yen | 789 | 10.023 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 16 |
| | | | | | JPY | 18.953 |
| | | | | | SEK | 1.489 |
| Japanischer Yen | Schwedische Krone | 24.765 | 1.995 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (626) |
| Japanischer Yen | Schwedische Krone | 22.888 | 1.833 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (443) |
| Japanischer Yen | Schwedische Krone | 9.445 | 760 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (224) |
| Japanischer Yen | Schwedische Krone | 14.894 | 1.189 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (236) |
| | | | | | JPY | (1.529) |
| | | | | | SEK | (120) |

BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse SGD H (Acc) (Hedged)

| | | | | | | |
|-----------------|-----------------|---------|------------|-------------|-----------------------------|----------------|
| Singapur-Dollar | Japanischer Yen | 463.604 | 38.509.469 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 937.662 |
| Singapur-Dollar | Japanischer Yen | 3.937 | 331.332 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 3.683 |
| Singapur-Dollar | Japanischer Yen | 3.179 | 266.409 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 4.106 |
| Singapur-Dollar | Japanischer Yen | 5.986 | 500.053 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 9.270 |
| Singapur-Dollar | Japanischer Yen | 4.100 | 341.563 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 7.270 |
| Singapur-Dollar | Japanischer Yen | 4.420 | 375.781 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 306 |
| | | | | | JPY | 962.297 |
| | | | | | SGD | 11.308 |
| Japanischer Yen | Singapur-Dollar | 908.088 | 10.945 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (23.187) |
| Japanischer Yen | Singapur-Dollar | 831.032 | 9.990 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (18.975) |
| Japanischer Yen | Singapur-Dollar | 361.063 | 4.357 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (9.645) |
| Japanischer Yen | Singapur-Dollar | 215.274 | 2.587 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (4.827) |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte Forts.

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

BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse SGD H (Acc) (Hedged) Forts.

| | | | | | | |
|-----------------|-----------------|---------|-------|-------------|-----------------------------|-----------------|
| Japanischer Yen | Singapur-Dollar | 551.317 | 6.635 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (13.251) |
| | | | | | JPY | (69.885) |
| | | | | | SGD | (821) |

BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse USD E (Acc) (Hedged)

| | | | | | | |
|-----------|-----------------|------------|---------------|-------------|-----------------------------|------------|
| US-Dollar | Japanischer Yen | 36.981.750 | 4.195.890.465 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 61.604.913 |
| US-Dollar | Japanischer Yen | 318.524 | 36.438.257 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 231.528 |
| US-Dollar | Japanischer Yen | 255.609 | 29.187.349 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 239.403 |
| US-Dollar | Japanischer Yen | 482.870 | 55.095.515 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 494.504 |
| US-Dollar | Japanischer Yen | 330.656 | 37.568.453 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 498.106 |
| US-Dollar | Japanischer Yen | 364.941 | 41.958.253 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 55.301 |

JPY 63.123.755

USD 548.230

| | | | | | | |
|-----------------|-----------|------------|---------|-------------|-----------------------------|-------------|
| Japanischer Yen | US-Dollar | 98.979.156 | 872.729 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1.493.047) |
| Japanischer Yen | US-Dollar | 90.752.965 | 799.559 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1.295.633) |
| Japanischer Yen | US-Dollar | 39.052.781 | 343.878 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (535.924) |
| Japanischer Yen | US-Dollar | 59.561.761 | 525.737 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (963.269) |

JPY (4.287.873)

USD (37.240)

BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse USD H (Hedged)

| | | | | | | |
|-----------|-----------------|---------|------------|-------------|-----------------------------|-----------|
| US-Dollar | Japanischer Yen | 611.947 | 69.430.553 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.019.394 |
| US-Dollar | Japanischer Yen | 5.245 | 599.975 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 3.812 |
| US-Dollar | Japanischer Yen | 4.205 | 480.113 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 3.938 |
| US-Dollar | Japanischer Yen | 7.964 | 908.657 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 8.156 |
| US-Dollar | Japanischer Yen | 5.423 | 616.144 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 8.169 |
| US-Dollar | Japanischer Yen | 5.895 | 677.734 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 893 |

JPY 1.044.362

USD 9.070

| | | | | | | |
|-----------------|-----------|-----------|--------|-------------|-----------------------------|----------|
| Japanischer Yen | US-Dollar | 1.645.266 | 14.507 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (24.818) |
| Japanischer Yen | US-Dollar | 1.504.055 | 13.251 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (21.472) |
| Japanischer Yen | US-Dollar | 657.029 | 5.785 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (9.016) |
| Japanischer Yen | US-Dollar | 988.334 | 8.724 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (15.984) |

JPY (71.290)

USD (619)

BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse USD I (Hedged)

| | | | | | | |
|-----------|-----------------|------------|---------------|-------------|-----------------------------|------------|
| US-Dollar | Japanischer Yen | 26.482.751 | 3.004.690.715 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 44.115.477 |
| US-Dollar | Japanischer Yen | 2.277.46 | 26.053.505 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 165.544 |
| US-Dollar | Japanischer Yen | 182.706 | 20.862.794 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 171.123 |
| US-Dollar | Japanischer Yen | 345.428 | 39.413.431 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 353.751 |
| US-Dollar | Japanischer Yen | 236.132 | 26.828.855 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 355.714 |

Devisenterminkontrakte Forts.

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

BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse USD I (Hedged) Forts.

| | | | | | | |
|-----------|-----------------|---------|------------|-------------|-----------------------------|-------------------|
| US-Dollar | Japanischer Yen | 259.400 | 29.823.912 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 39.308 |
| | | | | | JPY | 45.200.917 |
| | | | | | USD | 392.570 |

JPY 45.200.917

USD 392.570

| | | | | | | |
|-----------------|-----------|------------|---------|-------------|-----------------------------|-------------|
| Japanischer Yen | US-Dollar | 70.979.090 | 625.844 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1.070.681) |
| Japanischer Yen | US-Dollar | 65.019.897 | 572.843 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (928.255) |
| Japanischer Yen | US-Dollar | 28.111.034 | 247.531 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (385.769) |
| Japanischer Yen | US-Dollar | 42.689.265 | 376.807 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (690.397) |

JPY (3.075.102)

USD (26.707)

BNY MELLON LONG-TERM GLOBAL EQUITY FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert EUR | Summe Nettover- mögen % |
|---|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Aktien | | | |
| Australien - 31.626.986 | | | |
| (31. Dezember 2020: 30.770.731) | | | |
| 170.351 | CSL Ltd | 31.626.986 | 1,98 |
| Kanada - 55.033.648 | | | |
| (31. Dezember 2020: 44.974.227) | | | |
| 972.135 | Alimentation Couche-Tard Inc | 35.783.073 | 2,24 |
| 178.534 | Canadian National Railway Co | 19.250.575 | 1,20 |
| Dänemark - 48.942.571 | | | |
| (31. Dezember 2020: 36.016.968) | | | |
| 492.855 | Novo Nordisk A/S | 48.942.571 | 3,06 |
| Finnland - 20.904.778 | | | |
| (31. Dezember 2020: 25.722.648) | | | |
| 331.296 | Kone Oyj - Class B | 20.904.778 | 1,31 |
| Frankreich - 94.660.281 | | | |
| (31. Dezember 2020: 80.243.745) | | | |
| 455.443 | Dassault Systemes SE | 23.821.946 | 1,49 |
| 83.624 | L'Oreal SA | 34.864.936 | 2,18 |
| 49.499 | LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE | 35.973.399 | 2,24 |
| Hongkong - 48.098.811 | | | |
| (31. Dezember 2020: 73.331.586) | | | |
| 3.092.200 | AIA Group Ltd | 27.386.510 | 1,71 |
| 428.200 | Jardine Matheson Holdings Ltd | 20.712.301 | 1,29 |
| Japan - 126.833.203 | | | |
| (31. Dezember 2020: 140.699.748) | | | |
| 109.600 | FANUC Corp | 20.428.376 | 1,27 |
| 99.300 | Keyence Corp | 54.847.047 | 3,43 |
| 208.600 | Shin-Etsu Chemical Co Ltd | 31.749.112 | 1,98 |
| 33.400 | SMC Corp | 19.808.668 | 1,24 |
| Spanien - 21.162.698 | | | |
| (31. Dezember 2020: 31.311.885) | | | |
| 741.900 | Industria de Diseno Textil SA | 21.162.698 | 1,32 |
| Schweiz - 92.625.483 | | | |
| (31. Dezember 2020: 125.538.351) | | | |
| 262.602 | Nestle SA | 32.267.024 | 2,02 |
| 105.130 | Roche Holding AG | 38.425.477 | 2,40 |
| 7.465 | SGS SA | 21.932.982 | 1,37 |
| Taiwan - 47.044.026 | | | |
| (31. Dezember 2020: 54.187.855) | | | |
| 445.162 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR | 47.044.026 | 2,94 |
| Vereinigtes Königreich - 131.463.563 | | | |
| (31. Dezember 2020: 111.867.866) | | | |
| 1.721.081 | Compass Group Plc | 33.777.213 | 2,11 |
| 699.471 | Experian Plc | 30.207.622 | 1,89 |
| 132.301 | Linde Plc | 40.252.126 | 2,51 |
| 1.796.500 | Prudential Plc | 27.226.602 | 1,70 |
| Vereinigte Staaten von Amerika - 854.936.136 | | | |
| (31. Dezember 2020: 780.633.656) | | | |
| 87.010 | Adobe Inc | 43.351.351 | 2,71 |
| 19.018 | Alphabet Inc | 48.349.196 | 3,02 |
| 560.894 | Amphenol Corp - Class A | 43.078.201 | 2,69 |
| 185.817 | Automatic Data Processing Inc | 40.255.421 | 2,51 |
| 12.452 | Booking Holdings Inc | 26.253.520 | 1,64 |
| 601.968 | Cisco Systems Inc/Delaware | 33.508.732 | 2,09 |
| 233.951 | Cognex Corp | 15.979.960 | 1,00 |
| 419.943 | Cognizant Technology Solutions Corp | 32.724.913 | 2,04 |
| 233.211 | Colgate-Palmolive Co | 17.480.057 | 1,09 |
| 396.890 | Edwards Lifesciences Corp | 45.144.676 | 2,82 |
| 659.669 | Fastenal Co | 37.126.269 | 2,32 |
| 94.466 | Fortinet Inc | 29.830.820 | 1,86 |
| 57.473 | Illumina Inc | 19.216.967 | 1,20 |
| 127.116 | Intuitive Surgical Inc | 40.102.637 | 2,51 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert EUR | Summe Nettover- mögen % |
|--|-----------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| Aktien Forts. | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika Forts. | | | |
| 153.762 | Johnson & Johnson | 23.099.396 | 1,44 |
| 112.765 | Mastercard Inc | 35.592.508 | 2,22 |
| 237.719 | Microsoft Corp | 70.212.135 | 4,39 |
| 296.060 | NIKE Inc | 43.346.686 | 2,71 |
| 403.073 | Oracle Corp | 30.873.915 | 1,93 |
| 179.867 | Paychex Inc | 21.569.014 | 1,35 |
| 126.016 | Stryker Corp | 29.603.498 | 1,85 |
| 203.779 | Texas Instruments Inc | 33.745.668 | 2,11 |
| 561.287 | TJX Cos Inc/The | 37.438.824 | 2,34 |
| 192.587 | Walt Disney Co/The | 26.203.483 | 1,64 |
| 94.260 | Waters Corp | 30.848.289 | 1,93 |
| Gesamtanlagen in Aktien | | 1.573.332.184 | 98,29 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 40.171 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 2.227) | | 40.171 | 0,00 |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | 1.573.372.355 | 98,29 |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (76.616) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (42.170)) | | (76.616) | (0,00) |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | (76.616) | (0,00) |
| Nettoumlaufvermögen | | 27.488.308 | 1,71 |
| Summe Nettovermögen | | 1.600.784.047 | 100,00 |
| Portfolioanalyse | | | |
| | | % des Gesamtvermögens | |
| An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | 98,11 | |
| Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate) | | 0,00 | |
| Sonstiges Umlaufvermögen | | 1,89 | |
| Gesamtvermögen | | 100,00 | |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Devisenterminkontrakte | | | | | | | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|---|-----------------|------------|------------|------------------|-----------------------------|--|-------------------------------------|
| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | | |
| BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 118.780 | 135.275 | 3. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (38) |
| | | | | | | | EUR (38) |
| BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund Anteilsklasse JPY J (Acc) (Hedged) | | | | | | | |
| Euro | Japanischer Yen | 162 | 20.860 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 3 |
| Euro | Japanischer Yen | 61 | 7.789 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 1 |
| Euro | Japanischer Yen | 116 | 14.890 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 2 |
| Japanischer Yen | Euro | 9.801 | 75 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | - |
| | | | | | | | EUR 6 |
| | | | | | | | JPY 786 |
| Japanischer Yen | Euro | 7.235 | 56 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (1) |
| Japanischer Yen | Euro | 9.311 | 72 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (1) |
| Japanischer Yen | Euro | 20.510 | 159 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (2) |
| Japanischer Yen | Euro | 9.401 | 73 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (1) |
| Japanischer Yen | Euro | 7.667 | 60 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (1) |
| Japanischer Yen | Euro | 1.058.420 | 8.244 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (163) |
| | | | | | | | EUR (169) |
| | | | | | | | JPY (22.133) |
| BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund Anteilsklasse SGD J (Acc) (Hedged) | | | | | | | |
| Singapur-Dollar | Euro | 50.198 | 32.662 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 47 |
| Singapur-Dollar | Euro | 64.396 | 41.853 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 108 |
| Singapur-Dollar | Euro | 141.758 | 91.815 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 556 |
| Singapur-Dollar | Euro | 64.875 | 41.930 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 343 |
| Singapur-Dollar | Euro | 53.091 | 34.357 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 238 |
| Singapur-Dollar | Euro | 7.329.640 | 4.743.826 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 32.230 |
| | | | | | | | EUR 33.522 |
| | | | | | | | SGD 51.431 |
| Euro | Singapur-Dollar | 93.097 | 143.396 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (341) |
| Euro | Singapur-Dollar | 34.131 | 52.729 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (228) |
| Euro | Singapur-Dollar | 66.943 | 103.341 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (395) |
| Singapur-Dollar | Euro | 68.047 | 44.385 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (45) |
| | | | | | | | EUR (1.009) |
| | | | | | | | SGD (1.548) |
| BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund Anteilsklasse SGD W (Acc) (Hedged) | | | | | | | |
| Singapur-Dollar | Euro | 3.886 | 2.528 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 4 |
| Singapur-Dollar | Euro | 4.981 | 3.238 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 8 |
| Singapur-Dollar | Euro | 10.951 | 7.093 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 43 |
| Singapur-Dollar | Euro | 5.017 | 3.243 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 27 |
| Singapur-Dollar | Euro | 4.120 | 2.666 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 18 |

| Devisenterminkontrakte Forts. | | | | | | | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|--|-----------------|------------|------------|------------------|-----------------------------|--|-------------------------------------|
| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | | |
| BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund Anteilsklasse SGD W (Acc) (Hedged) Forts. | | | | | | | |
| Singapur-Dollar | Euro | 565.506 | 366.002 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 2.487 |
| | | | | | | | EUR 2.587 |
| | | | | | | | SGD 3.969 |
| Euro | Singapur-Dollar | 7.154 | 11.019 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (26) |
| Euro | Singapur-Dollar | 2.626 | 4.057 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (18) |
| Euro | Singapur-Dollar | 5.135 | 7.927 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (30) |
| Singapur-Dollar | Euro | 5.322 | 3.471 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (4) |
| | | | | | | | EUR (78) |
| | | | | | | | SGD (120) |
| BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund Anteilsklasse USD W (Hedged) | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 215.769 | 243.430 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 1.997 |
| Euro | US-Dollar | 80.205 | 90.767 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 497 |
| Euro | US-Dollar | 155.407 | 175.189 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 1.562 |
| | | | | | | | EUR 4.056 |
| | | | | | | | USD 4.618 |
| US-Dollar | Euro | 121.970 | 107.592 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (482) |
| US-Dollar | Euro | 90.776 | 80.334 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (617) |
| US-Dollar | Euro | 150.000 | 132.384 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (659) |
| US-Dollar | Euro | 12.370.985 | 10.932.754 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (68.971) |
| US-Dollar | Euro | 88.415 | 78.039 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (396) |
| US-Dollar | Euro | 200.000 | 176.313 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (680) |
| US-Dollar | Euro | 111.757 | 98.768 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (627) |
| US-Dollar | Euro | 245.463 | 216.934 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (1.376) |
| US-Dollar | Euro | 140.000 | 124.058 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (1.115) |
| US-Dollar | Euro | 110.998 | 97.874 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (399) |
| | | | | | | | EUR (75.322) |
| | | | | | | | USD (85.754) |

BNY MELLON MOBILITY INNOVATION FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Summe Beizulegender Zeitwert USD | Nettover- mögen % |
|---|--|---|-------------------------|
| Aktien | | | |
| Kanada - 19.407.454 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 239.761 | Magna International Inc (Units) | 19.407.454 | 1,95 |
| China - 54.781.649 | | | |
| (31. Dezember 2020: 23.640.802) | | | |
| 6.296.000 | Geely Automobile Holdings Ltd | 17.178.139 | 1,73 |
| 48.068 | NXP Semiconductors NV | 10.952.775 | 1,10 |
| 1.065.770 | Wuxi Lead Intelligent Equipment Co Ltd | 12.466.533 | 1,25 |
| 281.852 | XPeng Inc ADR - Class A | 14.184.202 | 1,43 |
| Frankreich - 19.247.064 | | | |
| (31. Dezember 2020: 10.022.230) | | | |
| 388.702 | Alstom SA | 13.807.173 | 1,39 |
| 209.108 | Cie Plastic Omnium SA | 5.439.891 | 0,55 |
| Deutschland - 68.096.501 | | | |
| (31. Dezember 2020: 30.594.133) | | | |
| 222.958 | Daimler AG | 17.181.017 | 1,73 |
| 111.795 | Daimler Truck Holding AG | 4.112.375 | 0,41 |
| 443.549 | Infineon Technologies AG | 20.540.100 | 2,07 |
| 100.726 | KION Group AG | 11.046.801 | 1,11 |
| 87.836 | Siemens AG | 15.216.208 | 1,53 |
| Japan - 61.659.728 | | | |
| (31. Dezember 2020: 28.444.156) | | | |
| 376.200 | Anritsu Corp | 5.811.592 | 0,59 |
| 294.300 | Denso Corp | 24.396.224 | 2,46 |
| 204.100 | East Japan Railway Co | 12.552.425 | 1,26 |
| 328.400 | Taiyo Yuden Co Ltd | 18.899.487 | 1,90 |
| Niederlande - 11.419.845 | | | |
| (31. Dezember 2020: 5.495.101) | | | |
| 113.887 | Alfen Beheer BV '144A' | 11.419.845 | 1,15 |
| Republik Korea - 30.201.896 | | | |
| (31. Dezember 2020: 32.206.841) | | | |
| 978.856 | Hanon Systems | 11.095.760 | 1,12 |
| 34.649 | Samsung SDI Co Ltd | 19.106.136 | 1,92 |
| Singapur - 23.356.036 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 472.853 | STMicroelectronics NV | 23.356.036 | 2,35 |
| Schweiz - 19.421.610 | | | |
| (31. Dezember 2020: 24.063.596) | | | |
| 269.036 | ABB Ltd | 10.305.862 | 1,03 |
| 134.297 | Landis+Gyr Group AG | 9.115.748 | 0,92 |
| Taiwan - 28.628.420 | | | |
| (31. Dezember 2020: 15.190.494) | | | |
| 667.000 | MediaTek Inc | 28.628.420 | 2,88 |
| Vereinigtes Königreich - 28.094.875 | | | |
| (31. Dezember 2020: 10.332.120) | | | |
| 1.446.698 | CNH Industrial NV | 28.094.875 | 2,83 |
| Vereinigte Staaten von Amerika - 605.883.321 | | | |
| (31. Dezember 2020: 276.162.501) | | | |
| 12.480 | Alphabet Inc | 36.122.050 | 3,64 |
| 105.721 | Amphenol Corp - Class A | 9.244.244 | 0,93 |
| 90.518 | ANSYS Inc | 36.295.455 | 3,65 |
| 121.601 | Aptiv Plc | 20.056.869 | 2,02 |
| 36.112 | CrowdStrike Holdings Inc | 7.395.015 | 0,74 |
| 187.999 | Diodes Inc | 20.663.910 | 2,08 |
| 110.478 | Eaton Corp Plc | 19.097.780 | 1,92 |
| 183.876 | Everbridge Inc | 12.397.839 | 1,25 |
| 170.970 | General Motors Co | 10.022.261 | 1,01 |
| 82.496 | Hubbell Inc - Class B | 17.186.804 | 1,73 |
| 203.909 | Lumentum Holdings Inc | 21.558.279 | 2,17 |
| 330.987 | Lyft Inc | 14.139.765 | 1,42 |
| 368.433 | Marvell Technology Inc | 32.248.941 | 3,25 |

| Bestände | Beschreibung | Summe Beizulegender Zeitwert USD | Nettover- mögen % |
|---|-------------------------|---|-------------------------|
| Aktien Forts. | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika Forts. | | | |
| 792.831 | MP Materials Corp | 36.006.420 | 3,62 |
| 137.114 | NVIDIA Corp | 40.334.825 | 4,06 |
| 262.582 | ON Semiconductor Corp | 17.839.821 | 1,80 |
| 551.598 | Plug Power Inc | 15.568.854 | 1,57 |
| 88.559 | QUALCOMM Inc | 16.201.426 | 1,63 |
| 55.550 | Rockwell Automation Inc | 19.383.062 | 1,95 |
| 34.422 | Roper Technologies Inc | 16.930.977 | 1,70 |
| 135.467 | Schneider Electric SE | 26.596.843 | 2,68 |
| 333.961 | Semtech Corp | 29.682.454 | 2,99 |
| 84.547 | Skyworks Solutions Inc | 13.119.158 | 1,32 |
| 140.996 | Splunk Inc | 16.318.172 | 1,64 |
| 56.966 | TE Connectivity Ltd | 9.191.749 | 0,92 |
| 11.752 | Tesla Inc | 12.422.628 | 1,25 |
| 91.670 | Twilio Inc - Class A | 24.146.336 | 2,43 |
| 326.564 | Uber Technologies Inc | 13.696.094 | 1,38 |
| 148.593 | Visteon Corp | 16.526.514 | 1,66 |
| 108.135 | Wolfspeed Inc | 12.092.196 | 1,22 |
| 717.738 | Zuora Inc | 13.396.580 | 1,35 |
| Gesamtanlagen in Aktien | | 970.198.399 | 97,64 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 2.775.355 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 1.244.388) | | 2.775.355 | 0,28 |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | 972.973.754 | 97,92 |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (284.872) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (55.097)) | | (284.872) | (0,03) |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | (284.872) | (0,03) |
| Nettoumlaufvermögen | | 20.921.207 | 2,11 |
| Summe Nettovermögen | | 993.610.089 | 100,00 |
| Portfolioanalyse | | | |
| % des Gesamtvermögens | | | |
| An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | 97,34 | |
| Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate) | | 0,28 | |
| Sonstiges Umlaufvermögen | | 2,38 | |
| Gesamtvermögen | | 100,00 | |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

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 | 1.633 | 1.776 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 15 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 33.125.990 | 35.864.511 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 499.318 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 282.929 | 308.118 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 2.465 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 23.060 | 25.109 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 205 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 284.866 | 310.191 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 2.519 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 751.179 | 815.288 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 9.314 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 15.500 | 16.784 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 231 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 20.000 | 21.783 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 172 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 561.617 | 610.578 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 5.933 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 25.000 | 27.083 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 361 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 113.178 | 123.027 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.214 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 25.000 | 27.211 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 232 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 286.532 | 313.782 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 756 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 20.000 | 21.883 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 72 |
| | | | | | USD | 522.807 |
| | | | | | CHF | 476.382 |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 27.199 | 25.000 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (237) |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 21.876 | 20.000 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (73) |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 531.648 | 489.844 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (6.075) |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 49.537 | 45.525 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (437) |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 1.777 | 1.633 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (15) |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 562.149 | 519.081 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (7.668) |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 177.646 | 163.557 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1.898) |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 534.786 | 491.861 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (5.151) |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 14.851 | 13.715 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (204) |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 5.573 | 5.145 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (74) |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 442.255 | 409.028 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (6.752) |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 9.789 | 9.020 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (113) |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 583.677 | 536.984 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (5.793) |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 238.706 | 219.869 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (2.853) |
| | | | | | USD | (37.143) |
| | | | | | CHF | (33.845) |
| BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse CHF H (Acc) (Hedged) | | | | | | |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 121.245 | 131.268 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.828 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 1.026 | 1.118 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 9 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 1.034 | 1.126 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 9 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 2.735 | 2.968 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 34 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 2.045 | 2.224 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 22 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 1.016 | 1.113 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 3 |
| | | | | | USD | 1.905 |
| | | | | | CHF | 1.736 |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 1.954 | 1.800 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (22) |

Devisenterminkontrakte Forts.

| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|--|-------------------|------------|------------|------------------|-----------------------------|-------------------------------------|
| BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse CHF H (Acc) (Hedged) Forts. | | | | | | |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 2.065 | 1.907 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (28) |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 653 | 601 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (7) |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 1.958 | 1.801 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (19) |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 1.620 | 1.498 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (25) |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 2.155 | 1.982 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (21) |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 880 | 811 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (10) |
| | | | | | USD | (132) |
| | | | | | CHF | (120) |
| BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse CHF K (Acc) (Hedged) | | | | | | |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 12.000 | 13.084 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 89 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 48.279 | 52.577 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 421 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 48.649 | 52.974 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 430 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 128.531 | 139.500 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.594 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 96.140 | 104.522 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.016 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 15.348 | 16.793 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 55 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 1.000 | 1.088 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 9 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 48.238 | 52.825 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 127 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 5.823.158 | 6.304.557 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 87.774 |
| | | | | | USD | 91.515 |
| | | | | | CHF | 83.388 |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 1.088 | 1.000 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (9) |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 16.788 | 15.348 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (56) |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 96.783 | 89.368 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1.320) |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 30.612 | 28.184 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (327) |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 91.887 | 84.512 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (885) |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 75.814 | 70.118 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1.157) |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 123.019 | 113.178 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1.221) |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 11.526 | 10.620 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (133) |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 103.249 | 94.990 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1.025) |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 42.188 | 38.859 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (469) |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 93.759 | 86.386 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1.071) |
| | | | | | USD | (7.673) |
| | | | | | CHF | (6.992) |
| BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse CHF K (Inc) (Hedged) | | | | | | |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 295 | 320 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 4 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 299 | 326 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 3 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 4.629 | 5.041 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 40 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 4.665 | 5.079 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 41 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 12.324 | 13.376 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 153 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 9.219 | 10.022 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 97 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 4.298 | 4.707 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 11 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte Forts.

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

BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse CHF K (Inc) (Hedged) Forts.

| | | | | | | | |
|-------------------|-------------------|---------|---------|-------------|-----------------------------|------------|--------------|
| Schweizer Franken | US-Dollar | 545,446 | 590,538 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 8,222 | |
| | | | | | | USD | 8,571 |
| | | | | | | CHF | 7,810 |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 34,823 | 31,984 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (287) | |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 9,280 | 8,569 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (127) | |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 2,935 | 2,703 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (31) | |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 8,811 | 8,104 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (85) | |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 7,288 | 6,740 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (111) | |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 9,682 | 8,907 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (96) | |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 3,956 | 3,644 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (44) | |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 8,787 | 8,096 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (100) | |
| | | | | | | USD | (881) |
| | | | | | | CHF | (803) |

BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse CHF W (Acc) (Hedged)

| | | | | | | | |
|-------------------|-------------------|---------|---------|-------------|-----------------------------|------------|----------------|
| Schweizer Franken | US-Dollar | 668,004 | 723,228 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 10,069 | |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 9,789 | 10,661 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 85 | |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 9,864 | 10,741 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 87 | |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 26,025 | 28,246 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 323 | |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 19,470 | 21,167 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 206 | |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 465,580 | 505,270 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 5,817 | |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 9,868 | 10,806 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 26 | |
| | | | | | | USD | 16,613 |
| | | | | | | CHF | 15,138 |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 10,741 | 9,897 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (123) | |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 19,512 | 18,017 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (266) | |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 6,170 | 5,681 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (66) | |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 18,566 | 17,075 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (179) | |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 15,323 | 14,172 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (234) | |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 11,804 | 10,859 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (117) | |
| US-Dollar | Schweizer Franken | 4,826 | 4,445 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (54) | |
| | | | | | | USD | (1,039) |
| | | | | | | CHF | (947) |

BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR E (Acc) (Hedged)

| | | | | | | |
|------|-----------|-----------|-----------|-------------|-----------------------------|-------|
| Euro | US-Dollar | 198,769 | 224,990 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1,309 |
| Euro | US-Dollar | 166,972 | 189,022 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1,079 |
| Euro | US-Dollar | 503,112 | 570,087 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 2,825 |
| Euro | US-Dollar | 499,227 | 564,939 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 3,548 |
| Euro | US-Dollar | 209,816 | 236,891 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 2,034 |
| Euro | US-Dollar | 1,316,132 | 1,489,373 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 9,354 |
| Euro | US-Dollar | 31,061 | 34,931 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 439 |
| Euro | US-Dollar | 249,296 | 282,807 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1,075 |

Devisenterminkontrakte Forts.

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

BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR E (Acc) (Hedged) Forts.

| | | | | | | | |
|-----------|-----------|------------|------------|-------------|-----------------------------|------------|-----------------|
| Euro | US-Dollar | 992,027 | 1,125,153 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 4,505 | |
| Euro | US-Dollar | 39,227 | 44,199 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 470 | |
| Euro | US-Dollar | 83,808 | 94,886 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 549 | |
| Euro | US-Dollar | 512,058 | 580,556 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 2,543 | |
| Euro | US-Dollar | 10,760 | 12,225 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 28 | |
| Euro | US-Dollar | 59,047,495 | 66,823,303 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 416,236 | |
| | | | | | | USD | 445,994 |
| | | | | | | EUR | 391,738 |
| US-Dollar | Euro | 94,864 | 83,808 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (552) | |
| US-Dollar | Euro | 16,177 | 14,328 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (139) | |
| US-Dollar | Euro | 225,043 | 198,769 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1,302) | |
| US-Dollar | Euro | 189,063 | 166,972 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1,074) | |
| US-Dollar | Euro | 445,405 | 394,167 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (3,448) | |
| US-Dollar | Euro | 15,630 | 13,794 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (78) | |
| US-Dollar | Euro | 1,088,970 | 962,619 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (7,199) | |
| US-Dollar | Euro | 216,760 | 191,869 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1,729) | |
| US-Dollar | Euro | 49,536 | 43,684 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (208) | |
| US-Dollar | Euro | 820,220 | 727,677 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (8,412) | |
| US-Dollar | Euro | 56,715 | 50,187 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (435) | |
| US-Dollar | Euro | 982,853 | 868,564 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (6,213) | |
| US-Dollar | Euro | 29,320 | 25,846 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (112) | |
| US-Dollar | Euro | 328,602 | 290,638 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (2,359) | |
| US-Dollar | Euro | 90,099 | 80,117 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1,133) | |
| US-Dollar | Euro | 1,038,863 | 920,927 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (9,831) | |
| US-Dollar | Euro | 724,129 | 641,634 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (6,524) | |
| US-Dollar | Euro | 26,257 | 23,303 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (279) | |
| US-Dollar | Euro | 989,679 | 875,865 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (7,701) | |
| | | | | | | USD | (58,728) |
| | | | | | | EUR | (51,584) |

BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR G (Acc) (Hedged)

| | | | | | | | |
|-----------|-----------|---------|---------|-------------|-----------------------------|------------|--------------|
| Euro | US-Dollar | 99,992 | 113,222 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 643 | |
| Euro | US-Dollar | 4,558 | 5,168 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 23 | |
| Euro | US-Dollar | 4,537 | 5,141 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 25 | |
| Euro | US-Dollar | 4,502 | 5,095 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 32 | |
| Euro | US-Dollar | 9,670 | 10,918 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 94 | |
| Euro | US-Dollar | 11,694 | 13,233 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 83 | |
| Euro | US-Dollar | 8,729 | 9,901 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 40 | |
| Euro | US-Dollar | 518,400 | 586,667 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 3,654 | |
| | | | | | | USD | 4,594 |
| | | | | | | EUR | 4,035 |
| US-Dollar | Euro | 113,197 | 99,992 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (646) | |
| US-Dollar | Euro | 8,695 | 7,695 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (68) | |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte Forts.

| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|--|---------|------------|------------|------------------|-----------------------------|-------------------------------------|
| BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR G (Acc) (Hedged) Forts. | | | | | | |
| US-Dollar | Euro | 9.150 | 8.112 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (87) |
| US-Dollar | Euro | 2.893 | 2.559 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (21) |
| US-Dollar | Euro | 8.671 | 7.662 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (55) |
| US-Dollar | Euro | 7.233 | 6.417 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (74) |
| US-Dollar | Euro | 9.584 | 8.472 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (63) |
| US-Dollar | Euro | 3.918 | 3.467 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (30) |
| USD | | | | | | (1.044) |
| EUR | | | | | | (917) |

BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)

| | | | | | | |
|------------|-----------|-------------|-------------|-------------|-----------------------------|----------------|
| Euro | US-Dollar | 23.874 | 27.024 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 157 |
| Euro | US-Dollar | 10.162 | 11.504 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 66 |
| Euro | US-Dollar | 4.200 | 4.763 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 19 |
| Euro | US-Dollar | 21.871 | 24.730 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 176 |
| Euro | US-Dollar | 22.100 | 25.061 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 105 |
| Euro | US-Dollar | 322.003 | 365.077 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.599 |
| Euro | US-Dollar | 281.790 | 319.038 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.846 |
| Euro | US-Dollar | 26.988 | 30.558 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 174 |
| Euro | US-Dollar | 400 | 453 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 2 |
| Euro | US-Dollar | 77.036 | 87.029 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 694 |
| Euro | US-Dollar | 990 | 1.125 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 3 |
| Euro | US-Dollar | 900 | 1.014 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 11 |
| Euro | US-Dollar | 65.387 | 73.892 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 567 |
| Euro | US-Dollar | 95.491 | 108.328 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 412 |
| Euro | US-Dollar | 40.975 | 46.080 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 579 |
| Euro | US-Dollar | 17.375 | 19.609 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 177 |
| Euro | US-Dollar | 855.293 | 967.874 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 6.079 |
| Euro | US-Dollar | 34.573 | 39.035 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 335 |
| Euro | US-Dollar | 322.577 | 365.038 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 2.293 |
| Euro | US-Dollar | 37.411 | 42.437 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 164 |
| Euro | US-Dollar | 325.110 | 368.389 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.826 |
| Euro | US-Dollar | 635.530 | 720.815 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 2.886 |
| Euro | US-Dollar | 377.568.222 | 427.288.918 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 266.154 |
| USD | | | | | | 286.324 |
| EUR | | | | | | 251.492 |

| | | | | | | |
|-----------|------|---------|---------|-------------|-----------------------------|---------|
| US-Dollar | Euro | 318.962 | 281.790 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1.855) |
| US-Dollar | Euro | 30.552 | 26.988 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (174) |
| US-Dollar | Euro | 286.584 | 253.617 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (2.219) |
| US-Dollar | Euro | 701.741 | 620.320 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (4.639) |
| US-Dollar | Euro | 39.096 | 34.607 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (312) |
| US-Dollar | Euro | 528.733 | 469.078 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (5.423) |
| US-Dollar | Euro | 24.627 | 21.856 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (262) |
| US-Dollar | Euro | 634.345 | 560.582 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (4.010) |
| US-Dollar | Euro | 7.659 | 6.752 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (29) |

Devisenterminkontrakte Forts.

| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|--|---------|------------|------------|------------------|-----------------------------|-------------------------------------|
| BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged) Forts. | | | | | | |
| US-Dollar | Euro | 212.856 | 188.264 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1.528) |
| US-Dollar | Euro | 59.839 | 53.210 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (753) |
| US-Dollar | Euro | 672.868 | 596.481 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (6.367) |
| US-Dollar | Euro | 13.479 | 11.938 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (116) |
| US-Dollar | Euro | 36.044 | 31.775 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (139) |
| US-Dollar | Euro | 27.030 | 23.874 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (156) |
| US-Dollar | Euro | 11.507 | 10.162 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (65) |
| US-Dollar | Euro | 104 | 92 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) |
| US-Dollar | Euro | 634.445 | 561.483 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (4.937) |
| USD | | | | | | (32.985) |
| EUR | | | | | | (28.972) |

BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR H (Inc) (Hedged)

| | | | | | | |
|------------|-----------|---------|-----------|-------------|-----------------------------|--------------|
| Euro | US-Dollar | 7.970 | 9.031 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 45 |
| Euro | US-Dollar | 7.909 | 8.950 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 56 |
| Euro | US-Dollar | 20.984 | 23.746 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 149 |
| Euro | US-Dollar | 15.661 | 17.763 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 71 |
| Euro | US-Dollar | 4.785 | 5.422 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 27 |
| Euro | US-Dollar | 7.889 | 8.944 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 39 |
| Euro | US-Dollar | 947.975 | 1.072.811 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 6.682 |
| USD | | | | | | 7.069 |
| EUR | | | | | | 6.209 |
| US-Dollar | Euro | 16.516 | 14.641 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (156) |
| US-Dollar | Euro | 5.223 | 4.620 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (38) |
| US-Dollar | Euro | 15.604 | 13.790 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (99) |
| US-Dollar | Euro | 22.810 | 20.244 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (243) |
| US-Dollar | Euro | 13.320 | 11.817 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (137) |
| US-Dollar | Euro | 17.699 | 15.645 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (117) |
| US-Dollar | Euro | 7.191 | 6.364 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (56) |
| US-Dollar | Euro | 15.929 | 14.097 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (124) |
| USD | | | | | | (970) |
| EUR | | | | | | (652) |

BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR J (Acc) (Hedged)

| | | | | | | |
|------------|-----------|-----------|-----------|-------------|-----------------------------|--------------|
| Euro | US-Dollar | 10.535 | 11.945 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 52 |
| Euro | US-Dollar | 10.569 | 11.976 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 59 |
| Euro | US-Dollar | 10.488 | 11.869 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 75 |
| Euro | US-Dollar | 27.802 | 31.461 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 198 |
| Euro | US-Dollar | 20.752 | 23.536 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 94 |
| Euro | US-Dollar | 1.233.393 | 1.395.816 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 8.694 |
| USD | | | | | | 9.172 |
| EUR | | | | | | 8.056 |
| US-Dollar | Euro | 20.707 | 18.326 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (161) |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte Forts.

| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|--|---------|------------|------------|------------------|-----------------------------|-------------------------------------|
| BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR J (Acc) (Hedged) Forts. | | | | | | |
| US-Dollar | Euro | 21.822 | 19.345 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (207) |
| US-Dollar | Euro | 6.900 | 6.103 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (50) |
| US-Dollar | Euro | 20.646 | 18.245 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (131) |
| US-Dollar | Euro | 17.226 | 15.282 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (177) |
| US-Dollar | Euro | 22.859 | 20.207 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (151) |
| US-Dollar | Euro | 9.339 | 8.265 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (72) |
| | | | | | | USD (949) |
| | | | | | | EUR (834) |

BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR K (Acc) (Hedged)

| | | | | | | |
|-----------|-----------|------------|------------|-------------|-----------------------------|---------------------|
| Euro | US-Dollar | 394.505 | 446.547 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 2.597 |
| Euro | US-Dollar | 257.826 | 292.148 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.448 |
| Euro | US-Dollar | 69.315 | 78.627 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 304 |
| Euro | US-Dollar | 255.237 | 288.834 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.814 |
| Euro | US-Dollar | 676.574 | 765.631 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 4.808 |
| Euro | US-Dollar | 24.985 | 28.098 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 353 |
| Euro | US-Dollar | 14.985 | 16.934 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 130 |
| Euro | US-Dollar | 508.159 | 576.352 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 2.307 |
| Euro | US-Dollar | 128.484 | 145.152 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.158 |
| Euro | US-Dollar | 112.329 | 127.281 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 632 |
| Euro | US-Dollar | 87.799 | 99.404 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 575 |
| Euro | US-Dollar | 257.419 | 291.855 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.278 |
| Euro | US-Dollar | 51.172 | 58.027 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 244 |
| Euro | US-Dollar | 149.985 | 170.402 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 392 |
| Euro | US-Dollar | 29.901.906 | 33.839.610 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 210.784 |
| | | | | | | USD 228.824 |
| | | | | | | EUR 200.987 |
| US-Dollar | Euro | 99.381 | 87.799 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (578) |
| US-Dollar | Euro | 446.653 | 394.505 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (2.584) |
| US-Dollar | Euro | 531.053 | 470.766 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (5.025) |
| US-Dollar | Euro | 167.781 | 148.397 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1.204) |
| US-Dollar | Euro | 505.388 | 446.620 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (3.195) |
| US-Dollar | Euro | 219.637 | 193.611 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (835) |
| US-Dollar | Euro | 28.393 | 25.125 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (218) |
| US-Dollar | Euro | 421.812 | 374.220 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (4.326) |
| US-Dollar | Euro | 557.290 | 492.629 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (3.684) |
| US-Dollar | Euro | 226.817 | 200.725 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1.756) |
| US-Dollar | Euro | 502.892 | 445.059 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (3.913) |
| US-Dollar | Euro | 110.580 | 97.331 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (254) |
| | | | | | | USD (27.572) |
| | | | | | | EUR (24.218) |

BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR K (Inc) (Hedged)

| | | | | | | |
|------|-----------|-------|-------|-------------|-----------------------------|----|
| Euro | US-Dollar | 6.952 | 7.878 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 39 |
|------|-----------|-------|-------|-------------|-----------------------------|----|

Devisenterminkontrakte Forts.

| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|--|-----------|------------|------------|------------------|-----------------------------|-------------------------------------|
| BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR K (Inc) (Hedged) Forts. | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 6.899 | 7.807 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 49 |
| Euro | US-Dollar | 18.288 | 20.695 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 130 |
| Euro | US-Dollar | 13.650 | 15.482 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 62 |
| Euro | US-Dollar | 4.563 | 5.141 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 55 |
| Euro | US-Dollar | 499.985 | 566.076 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 3.275 |
| Euro | US-Dollar | 6.930 | 7.857 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 34 |
| Euro | US-Dollar | 806.509 | 912.716 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 5.685 |
| | | | | | | USD 9.329 |
| | | | | | | EUR 8.194 |

| | | | | | | |
|-----------|------|---------|---------|-------------|-----------------------------|--------------------|
| US-Dollar | Euro | 565.941 | 499.985 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (3.292) |
| US-Dollar | Euro | 14.354 | 12.725 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (136) |
| US-Dollar | Euro | 4.539 | 4.014 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (33) |
| US-Dollar | Euro | 13.580 | 12.001 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (86) |
| US-Dollar | Euro | 11.264 | 9.993 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (116) |
| US-Dollar | Euro | 14.947 | 13.213 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (99) |
| US-Dollar | Euro | 6.107 | 5.404 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (47) |
| US-Dollar | Euro | 13.540 | 11.983 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (105) |
| | | | | | | USD (3.914) |
| | | | | | | EUR (3.438) |

BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)

| | | | | | | |
|------|-----------|-----------|-----------|-------------|-----------------------------|--------|
| Euro | US-Dollar | 17.499 | 19.807 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 115 |
| Euro | US-Dollar | 17.191 | 19.461 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 111 |
| Euro | US-Dollar | 169.145 | 191.830 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 782 |
| Euro | US-Dollar | 4.705 | 5.320 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 38 |
| Euro | US-Dollar | 170.000 | 192.775 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 811 |
| Euro | US-Dollar | 694.264 | 787.136 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 3.447 |
| Euro | US-Dollar | 171.933 | 194.661 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.126 |
| Euro | US-Dollar | 46.538 | 52.695 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 299 |
| Euro | US-Dollar | 109.456 | 124.025 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 616 |
| Euro | US-Dollar | 46.303 | 52.310 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 417 |
| Euro | US-Dollar | 44.249 | 50.272 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 116 |
| Euro | US-Dollar | 101.660 | 114.546 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.218 |
| Euro | US-Dollar | 111.606 | 126.123 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 968 |
| Euro | US-Dollar | 78.220 | 88.734 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 337 |
| Euro | US-Dollar | 94.478 | 106.249 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.336 |
| Euro | US-Dollar | 941.776 | 1.062.859 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 9.576 |
| Euro | US-Dollar | 1.802.466 | 2.039.724 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 12.810 |
| Euro | US-Dollar | 101.467 | 114.561 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 984 |
| Euro | US-Dollar | 20.385 | 23.124 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 89 |
| Euro | US-Dollar | 680.792 | 770.404 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 4.839 |
| Euro | US-Dollar | 686.122 | 777.459 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 3.853 |
| Euro | US-Dollar | 1.324.504 | 1.502.246 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 6.014 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte Forts.

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

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

| Euro | US-Dollar | 78.652.680 | 89.010.244 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 554.436 | |
|-----------|-----------|------------|------------|-------------|-----------------------------|------------|-----------------|
| | | | | | | USD | 604.338 |
| | | | | | | EUR | 530.819 |
| US-Dollar | Euro | 194.614 | 171.933 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1.132) | |
| US-Dollar | Euro | 52.684 | 46.538 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (301) | |
| US-Dollar | Euro | 19.465 | 17.191 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (111) | |
| US-Dollar | Euro | 593.333 | 525.079 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (4.593) | |
| US-Dollar | Euro | 156.088 | 137.752 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (775) | |
| US-Dollar | Euro | 1.450.835 | 1.282.497 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (9.592) | |
| US-Dollar | Euro | 80.319 | 71.096 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (641) | |
| US-Dollar | Euro | 1.095.152 | 971.588 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (11.232) | |
| US-Dollar | Euro | 1.353 | 1.200 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (14) | |
| US-Dollar | Euro | 2.596 | 2.297 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (20) | |
| US-Dollar | Euro | 21.927 | 19.329 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (83) | |
| US-Dollar | Euro | 25.871 | 23.005 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (325) | |
| US-Dollar | Euro | 137.786 | 121.858 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (979) | |
| US-Dollar | Euro | 439.266 | 388.518 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (3.153) | |
| US-Dollar | Euro | 1.391.012 | 1.233.099 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (13.163) | |
| US-Dollar | Euro | 9.794 | 8.678 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (98) | |
| US-Dollar | Euro | 127.875 | 113.260 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1.098) | |
| US-Dollar | Euro | 17.593 | 15.509 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (68) | |
| US-Dollar | Euro | 3.622 | 3.193 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (15) | |
| US-Dollar | Euro | 19.812 | 17.499 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (115) | |
| US-Dollar | Euro | 1.316.582 | 1.163.486 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (8.322) | |
| US-Dollar | Euro | 1.319.507 | 1.167.764 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (10.268) | |
| | | | | | | USD | (66.088) |
| | | | | | | EUR | (58.048) |

BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged)

| Euro | US-Dollar | 524 | 594 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 3 | |
|-----------|-----------|--------|--------|-------------|-----------------------------|------------|------------|
| Euro | US-Dollar | 520 | 589 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 4 | |
| Euro | US-Dollar | 1.377 | 1.558 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 10 | |
| Euro | US-Dollar | 1.028 | 1.166 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 5 | |
| Euro | US-Dollar | 528 | 599 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 3 | |
| Euro | US-Dollar | 61.031 | 69.068 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 430 | |
| | | | | | | USD | 455 |
| | | | | | | EUR | 400 |
| US-Dollar | Euro | 1.076 | 954 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (10) | |
| US-Dollar | Euro | 340 | 301 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (2) | |
| US-Dollar | Euro | 1.020 | 902 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (6) | |
| US-Dollar | Euro | 851 | 755 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (9) | |
| US-Dollar | Euro | 1.127 | 997 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (7) | |
| US-Dollar | Euro | 461 | 408 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (4) | |

Devisenterminkontrakte Forts.

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

BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged) Forts.

| US-Dollar | Euro | 1.023 | 906 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (8) | |
|-----------|------|-------|-----|-------------|-----------------------------|------------|-------------|
| | | | | | | USD | (46) |
| | | | | | | EUR | (40) |

BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse SGD K (Acc) (Hedged)

| Singapur-Dollar | US-Dollar | 17.412 | 12.875 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 45 | |
|-----------------|-----------------|-----------|-----------|-------------|-----------------------------|------------|----------------|
| Singapur-Dollar | US-Dollar | 17.437 | 12.855 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 84 | |
| Singapur-Dollar | US-Dollar | 17.444 | 12.828 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 115 | |
| Singapur-Dollar | US-Dollar | 45.804 | 33.570 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 417 | |
| Singapur-Dollar | US-Dollar | 34.210 | 25.077 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 308 | |
| Singapur-Dollar | US-Dollar | 2.024.665 | 1.483.537 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 18.785 | |
| | | | | | | USD | 19.754 |
| | | | | | | SGD | 26.620 |
| US-Dollar | Singapur-Dollar | 23.214 | 31.695 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (303) | |
| US-Dollar | Singapur-Dollar | 7.072 | 9.665 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (100) | |
| US-Dollar | Singapur-Dollar | 21.638 | 29.536 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (278) | |
| US-Dollar | Singapur-Dollar | 18.250 | 24.992 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (294) | |
| US-Dollar | Singapur-Dollar | 24.338 | 33.310 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (378) | |
| US-Dollar | Singapur-Dollar | 10.036 | 13.725 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (148) | |
| US-Dollar | Singapur-Dollar | 21.812 | 29.776 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (283) | |
| | | | | | | USD | (1.784) |
| | | | | | | SGD | (2.404) |

BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse SGD K (Inc) (Hedged)

| Singapur-Dollar | US-Dollar | 25.629 | 18.955 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 63 | |
|-----------------|-----------------|---------|---------|-------------|-----------------------------|------------|---------------|
| Singapur-Dollar | US-Dollar | 6.666 | 4.929 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 17 | |
| Singapur-Dollar | US-Dollar | 6.676 | 4.922 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 32 | |
| Singapur-Dollar | US-Dollar | 6.679 | 4.912 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 44 | |
| Singapur-Dollar | US-Dollar | 17.537 | 12.853 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 160 | |
| Singapur-Dollar | US-Dollar | 14.030 | 10.284 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 126 | |
| Singapur-Dollar | US-Dollar | 830.319 | 608.402 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 7.704 | |
| | | | | | | USD | 8.146 |
| | | | | | | SGD | 10.978 |
| US-Dollar | Singapur-Dollar | 8.945 | 12.211 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (116) | |
| US-Dollar | Singapur-Dollar | 8.874 | 12.113 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (114) | |
| US-Dollar | Singapur-Dollar | 7.484 | 10.249 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (121) | |
| US-Dollar | Singapur-Dollar | 9.981 | 13.660 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (155) | |
| US-Dollar | Singapur-Dollar | 4.116 | 5.629 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (61) | |
| US-Dollar | Singapur-Dollar | 18.953 | 25.629 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (64) | |
| US-Dollar | Singapur-Dollar | 8.888 | 12.135 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (116) | |
| US-Dollar | Singapur-Dollar | 2.712 | 3.706 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (38) | |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Devisenterminkontrakte Forts. | | | | | | | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|--|-----------------|------------|------------|------------------|-----------------------------|--|-------------------------------------|
| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | | |
| BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse SGD K (Inc) (Hedged) Forts. | | | | | | | |
| US-Dollar | Singapur-Dollar | 38.491 | 52.482 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (451) |
| | | | | | | | USD (1.236) |
| | | | | | | | SGD (1.666) |
| BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse Sterling E (Acc) (Hedged) | | | | | | | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 108.504 | 146.632 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 230 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 106.241 | 142.491 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 1.309 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 4.305 | 5.753 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 73 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 105.929 | 142.047 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 1.330 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 280.494 | 373.887 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 5.766 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 15.566 | 20.652 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 416 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 209.081 | 278.834 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 4.160 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 19.795 | 26.164 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 629 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 283.500 | 376.397 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 7.326 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 12.086.870 | 15.967.615 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 392.178 |
| | | | | | | | USD 413.415 |
| | | | | | | | GBP 305.430 |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 259.171 | 195.683 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (5.690) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 80.408 | 60.796 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (1.881) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 243.813 | 183.514 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (4.576) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 201.472 | 152.329 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (4.708) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 267.514 | 201.942 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (5.817) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 107.111 | 80.717 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (2.141) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 235.189 | 177.948 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (5.667) |
| | | | | | | | USD (30.480) |
| | | | | | | | GBP (22.519) |
| BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse Sterling K (Acc) (Hedged) | | | | | | | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 22.944 | 31.006 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 49 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 22.813 | 30.596 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 281 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 22.755 | 30.513 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 286 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 60.371 | 80.472 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 1.241 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 45.047 | 60.076 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 896 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 2.890.205 | 3.818.167 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 93.777 |
| | | | | | | | USD 96.530 |
| | | | | | | | GBP 71.316 |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 56.125 | 42.376 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (1.232) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 17.421 | 13.172 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (407) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 52.636 | 39.618 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (988) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 43.569 | 32.941 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (1.018) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 58.094 | 43.854 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (1.263) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 278.865 | 210.040 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (5.428) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 25.715 | 19.378 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (514) |

| Devisenterminkontrakte Forts. | | | | | | | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|---|----------------|------------|------------|------------------|-----------------------------|--|-------------------------------------|
| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | | |
| BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse Sterling K (Acc) (Hedged) Forts. | | | | | | | |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 56.343 | 42.630 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (1.358) |
| | | | | | | | USD (12.208) |
| | | | | | | | GBP (9.019) |

BNY MELLON SMALL CAP EUROLAND FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert EUR | Summe Nettover- mögen % |
|--|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Aktien | | | |
| Österreich - 977.395 | | | |
| (31. Dezember 2020: 817.709) | | | |
| 8.623 | Schoeller-Bleckmann Oilfield Equipment AG | 267.960 | 0,33 |
| 92.858 | Telekom Austria AG - Class A | 709.435 | 0,87 |
| Belgien - 1.560.866 | | | |
| (31. Dezember 2020: 2.812.212) | | | |
| 22.801 | Bekaert SA | 892.887 | 1,10 |
| 2.323 | Cofinimmo SA (REIT) | 326.962 | 0,40 |
| 1.996 | D'ieteren Group | 341.017 | 0,42 |
| Dänemark - 463.318 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.165.443) | | | |
| 8.347 | GN Store Nord AS | 463.318 | 0,57 |
| Finnland - 3.660.707 | | | |
| (31. Dezember 2020: 4.292.258) | | | |
| 156.191 | Outokumpu Oyj | 859.832 | 1,06 |
| 55.644 | TietoEVRY Oyj | 1.527.984 | 1,88 |
| 33.867 | Valmet Oyj | 1.272.891 | 1,57 |
| Frankreich - 24.258.807 | | | |
| (31. Dezember 2020: 15.128.444) | | | |
| 5.329 | Alten SA | 837.186 | 1,03 |
| 8.153 | Arkema SA | 1.014.845 | 1,25 |
| 22.111 | Cie Plastic Omnium SA | 502.362 | 0,62 |
| 19.797 | Covivio (REIT) | 1.427.364 | 1,76 |
| 29.845 | Edenred | 1.205.439 | 1,48 |
| 31.732 | Eiffage SA | 2.859.688 | 3,52 |
| 44.905 | Elis SA | 681.658 | 0,84 |
| 10.634 | Eramet SA | 760.863 | 0,94 |
| 105.254 | Klepierre SA (REIT) | 2.193.493 | 2,70 |
| 40.796 | Korian SA | 1.133.721 | 1,40 |
| 46.614 | Maisons du Monde SA '144A' | 949.993 | 1,17 |
| 58.199 | Metropole Television SA | 999.277 | 1,23 |
| 25.654 | Nexity SA | 1.058.484 | 1,30 |
| 36.004 | Publicis Groupe SA | 2.129.637 | 2,62 |
| 68.032 | Rexel SA | 1.232.059 | 1,52 |
| 8.758 | Sopra Steria Group SACA | 1.384.202 | 1,71 |
| 1.661 | Teleperformance | 651.444 | 0,80 |
| 4.616 | Trigano SA | 792.798 | 0,98 |
| 18.891 | Ubisoft Entertainment SA | 811.085 | 1,00 |
| 26.593 | Unibail-Rodamco-Westfield (REIT) | 1.633.209 | 2,01 |
| Deutschland - 21.216.856 | | | |
| (31. Dezember 2020: 14.506.319) | | | |
| 22.957 | AURELIUS Equity Opportunities SE & Co KGaA | 620.528 | 0,76 |
| 16.587 | Bechtle AG | 1.045.147 | 1,29 |
| 27.764 | Brenntag SE | 2.209.737 | 2,72 |
| 5.477 | Cewe Stiftung & Co KGAA | 699.413 | 0,86 |
| 24.274 | Covestro AG '144A' | 1.315.894 | 1,62 |
| 7.049 | Dermapharm Holding SE | 627.537 | 0,77 |
| 36.998 | Deutsche EuroShop AG | 539.616 | 0,66 |
| 122.891 | Deutsche Pfandbriefbank AG '144A' | 1.295.886 | 1,60 |
| 100.320 | Deutz AG | 655.842 | 0,81 |
| 30.620 | DWS Group GmbH & Co KGaA '144A' | 1.086.398 | 1,34 |
| 20.564 | flatexDEGIRO AG | 416.832 | 0,51 |
| 12.206 | GFT Technologies SE | 559.035 | 0,69 |
| 166.205 | Heidelberger Druckmaschinen AG | 436.288 | 0,54 |
| 6.360 | Hella GmbH & Co KGaA | 396.991 | 0,49 |
| 5.776 | HelloFresh SE | 392.710 | 0,48 |
| 19.949 | HUGO BOSS AG | 1.069.266 | 1,32 |
| 10.065 | KION Group AG | 969.561 | 1,19 |
| 14.007 | Krones AG | 1.346.423 | 1,66 |
| 12.117 | Rheinmetall AG | 1.007.407 | 1,24 |
| 1.260 | Sartorius AG - Preference | 753.228 | 0,93 |
| 146.869 | Schaeffler AG - Preference | 1.066.269 | 1,31 |
| 6.966 | Siltronic AG | 986.386 | 1,22 |
| 6.520 | Sixt SE | 1.014.512 | 1,25 |
| 289.918 | Telefonica Deutschland Holding AG | 705.950 | 0,87 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert EUR | Summe Nettover- mögen % |
|---------------------------------------|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Aktien Forts. | | | |
| Irland - 1.156.726 | | | |
| (31. Dezember 2020: 981.984) | | | |
| 454 | ICON Plc | 124.120 | 0,15 |
| 3.777 | ICON Plc | 1.032.606 | 1,27 |
| Italien - 9.324.949 | | | |
| (31. Dezember 2020: 5.526.183) | | | |
| 339.914 | Anima Holding SpA '144A' | 1.526.214 | 1,88 |
| 63.294 | Banca IFIS SpA | 1.082.327 | 1,33 |
| 356.956 | BPER Banca | 650.820 | 0,80 |
| 16.423 | Buzzi Unicem SpA | 311.380 | 0,38 |
| 207.087 | Immobiliare Grande Distribuzione SIIQ SpA (REIT) | 799.356 | 0,99 |
| 537.756 | Iren SpA | 1.425.054 | 1,76 |
| 356.264 | Italgas SpA | 2.155.041 | 2,66 |
| 288.058 | Unipol Gruppo SpA | 1.374.757 | 1,69 |
| Luxemburg - 1.979.440 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.323.288) | | | |
| 19.180 | Corestate Capital Holding SA | 215.104 | 0,27 |
| 15.990 | Eurofins Scientific SE | 1.764.336 | 2,17 |
| Malta - 462.917 | | | |
| (31. Dezember 2020: 676.871) | | | |
| 44.318 | Kindred Group Plc SDR | 462.917 | 0,57 |
| Niederlande - 8.864.172 | | | |
| (31. Dezember 2020: 7.448.342) | | | |
| 17.868 | Aalberts NV | 1.040.632 | 1,28 |
| 428.164 | Aegon NV | 1.880.068 | 2,32 |
| 15.676 | Arcadis NV | 663.252 | 0,82 |
| 23.661 | BE Semiconductor Industries NV | 1.757.776 | 2,17 |
| 20.008 | OCI NV | 462.785 | 0,57 |
| 29.471 | SBM Offshore NV | 385.112 | 0,47 |
| 38.016 | Signify NV '144A' | 1.559.796 | 1,92 |
| 20.398 | TKH Group NV Dutch Cert | 1.114.751 | 1,37 |
| Spanien - 4.311.762 | | | |
| (31. Dezember 2020: 4.171.213) | | | |
| 13.533 | Acciona SA | 2.275.574 | 2,80 |
| 71.844 | Almirall SA | 811.478 | 1,00 |
| 186.632 | Gestamp Automocion SA '144A' | 830.886 | 1,02 |
| 95.891 | Mediaset Espana Comunicacion SA | 393.824 | 0,49 |
| Schweden - 1.637.818 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 99.709 | Nobina AB '144A' | 1.040.767 | 1,28 |
| 168.197 | Scandic Hotels Group AB '144A' | 597.051 | 0,74 |

Gesamtanlagen in Aktien **79.875.733** **98,38**

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt **79.875.733** **98,38**

Nettoumlaufvermögen **1.317.142** **1,62**

Summe Nettovermögen **81.192.875** **100,00**

Portfolioanalyse **% des Gesamtvermögens**

An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente 98,10
Sonstiges Umlaufvermögen 1,90

Gesamtvermögen **100,00**

BNY MELLON SMART CURES INNOVATION FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % |
|---|---------------------------------------|----------------------------|-----------------------|
| Aktien | | | |
| Deutschland - 389.077 | | | |
| (31. Dezember 2020: 281.841) | | 389.077 | 7,82 |
| 997 | Merck KGaA | 259.083 | 5,21 |
| 191 | Sartorius AG - Preference | 129.994 | 2,61 |
| Irland - 151.499 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | 151.499 | 3,04 |
| 489 | ICON Plc | 151.499 | 3,04 |
| Niederlande - 107.485 | | | |
| (31. Dezember 2020: 130.827) | | 107.485 | 2,16 |
| 5.175 | uniQure NV | 107.485 | 2,16 |
| Schweiz - 395.884 | | | |
| (31. Dezember 2020: 628.792) | | 395.884 | 7,96 |
| 1.400 | CRISPR Therapeutics AG | 106.043 | 2,13 |
| 172 | Lonza Group AG | 143.780 | 2,89 |
| 351 | Roche Holding AG | 146.061 | 2,94 |
| Vereinigtes Königreich - 225.121 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | 225.121 | 4,52 |
| 1.917 | AstraZeneca Plc | 225.121 | 4,52 |
| Vereinigte Staaten von Amerika - 3.687.724 | | | |
| (31. Dezember 2020: 3.873.934) | | 3.687.724 | 74,10 |
| 783 | 10X Genomics Inc (Units) | 116.675 | 2,35 |
| 3.525 | Adaptive Biotechnologies Corp | 98.876 | 1,99 |
| 683 | Alnylam Pharmaceuticals Inc | 115.943 | 2,33 |
| 4.117 | Avantor Inc | 173.511 | 3,49 |
| 1.639 | Beam Therapeutics Inc | 130.571 | 2,62 |
| 2.146 | BioMarin Pharmaceutical Inc | 189.717 | 3,81 |
| 310 | Bio-Techne Corp | 160.472 | 3,23 |
| 1.658 | Catalent Inc | 212.299 | 4,27 |
| 396 | Danaher Corp | 130.306 | 2,62 |
| 2.692 | Denali Therapeutics Inc | 119.969 | 2,41 |
| 871 | Eli Lilly & Co | 240.487 | 4,83 |
| 1.855 | Fate Therapeutics Inc | 108.647 | 2,18 |
| 6.341 | Generation Bio Co | 44.989 | 0,90 |
| 1.710 | Guardant Health Inc | 171.145 | 3,44 |
| 195 | Illumina Inc | 74.232 | 1,49 |
| 1.317 | Intellia Therapeutics Inc | 155.795 | 3,13 |
| 2.750 | Kymera Therapeutics Inc | 174.763 | 3,51 |
| 7.236 | MeiraGTx Holdings plc | 171.638 | 3,45 |
| 267 | Moderna Inc | 67.839 | 1,36 |
| 1.732 | NanoString Technologies Inc | 73.177 | 1,47 |
| 1.056 | Natera Inc | 98.689 | 1,98 |
| 4.280 | Pacific Biosciences of California Inc | 87.483 | 1,76 |
| 2.718 | PTC Therapeutics Inc | 108.326 | 2,18 |
| 2.346 | Quanterix Corp | 99.517 | 2,00 |
| 2.043 | REGENXBIO Inc | 66.867 | 1,34 |
| 508 | Repligen Corp | 134.584 | 2,70 |
| 1.785 | Sarepta Therapeutics Inc | 160.784 | 3,23 |
| 901 | Twist Bioscience Corp | 69.760 | 1,40 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % |
|--|-------------------------------|------------------------------|-----------------------|
| Aktien Forts. | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika Forts. | | | |
| 1.552 | Ultragenyx Pharmaceutical Inc | 130.663 | 2,63 |
| Gesamtanlagen in Aktien | | 4.956.790 | 99,60 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 6.800 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 6.080) | | 6.800 | 0,13 |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | 4.963.590 | 99,73 |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (656) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (74)) | | (656) | (0,01) |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | (656) | (0,01) |
| Nettoumlaufvermögen | | 13.616 | 0,28 |
| Summe Nettovermögen | | 4.976.550 | 100,00 |
| Portfolioanalyse | | | |
| | | % des Gesamtvermögens | |
| An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | 99,30 | |
| Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate) | | 0,14 | |
| Sonstiges Umlaufvermögen | | 0,56 | |
| Gesamtvermögen | | 100,00 | |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| 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 | 97.379 | 110.202 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 686 | |
| Euro | US-Dollar | 865 | 980 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 5 | |
| Euro | US-Dollar | 2.023 | 2.289 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 14 | |
| Euro | US-Dollar | 3.335 | 3.771 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 27 | |
| Euro | US-Dollar | 3.400 | 3.856 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 15 | |
| Euro | US-Dollar | 992 | 1.122 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 7 | |
| Euro | US-Dollar | 1.178 | 1.336 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 5 | |
| | | | | | USD | 759 | |
| | | | | | EUR | 667 | |
| US-Dollar | Euro | 3.148 | 2.786 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (24) | |
| US-Dollar | Euro | 2.246 | 1.981 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (10) | |
| US-Dollar | Euro | 800 | 709 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (8) | |
| US-Dollar | Euro | 3.405 | 3.009 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (21) | |
| US-Dollar | Euro | 2.265 | 2.010 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (23) | |
| US-Dollar | Euro | 863 | 764 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (7) | |
| | | | | | USD | (93) | |
| | | | | | EUR | (82) | |
| BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund Anteilsklasse EUR I (Acc) (Hedged) | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 98.294 | 111.238 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 693 | |
| Euro | US-Dollar | 1.192 | 1.352 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 5 | |
| Euro | US-Dollar | 879 | 996 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 5 | |
| Euro | US-Dollar | 2.045 | 2.314 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 15 | |
| Euro | US-Dollar | 3.370 | 3.810 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 27 | |
| Euro | US-Dollar | 3.435 | 3.896 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 16 | |
| Euro | US-Dollar | 1.008 | 1.141 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 7 | |
| | | | | | USD | 768 | |
| | | | | | EUR | 675 | |
| US-Dollar | Euro | 3.175 | 2.810 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (25) | |
| US-Dollar | Euro | 2.250 | 1.985 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (10) | |
| US-Dollar | Euro | 799 | 708 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (8) | |
| US-Dollar | Euro | 3.435 | 3.036 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (22) | |
| US-Dollar | Euro | 2.284 | 2.026 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (23) | |
| US-Dollar | Euro | 869 | 769 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (7) | |
| | | | | | USD | (95) | |
| | | | | | EUR | (83) | |
| BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged) | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 98.487 | 111.457 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 694 | |
| Euro | US-Dollar | 1.195 | 1.356 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 5 | |
| Euro | US-Dollar | 882 | 999 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 5 | |
| Euro | US-Dollar | 2.050 | 2.320 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 15 | |
| Euro | US-Dollar | 3.377 | 3.819 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 27 | |

| Devisenterminkontrakte Forts. | | | | | | | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|---|-----------------|------------|------------|------------------|-----------------------------|--------------|-------------------------------------|
| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | | |
| BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged) Forts. | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 3.442 | 3.904 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 16 | |
| Euro | US-Dollar | 1.012 | 1.145 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 8 | |
| | | | | | USD | 770 | |
| | | | | | EUR | 676 | |
| US-Dollar | Euro | 3.180 | 2.815 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (25) | |
| US-Dollar | Euro | 2.251 | 1.986 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (10) | |
| US-Dollar | Euro | 799 | 708 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (7) | |
| US-Dollar | Euro | 3.441 | 3.041 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (22) | |
| US-Dollar | Euro | 2.288 | 2.030 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (23) | |
| US-Dollar | Euro | 870 | 770 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (7) | |
| | | | | | USD | (94) | |
| | | | | | EUR | (83) | |
| BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund Anteilsklasse SGD J (Acc) (Hedged) | | | | | | | |
| Singapur-Dollar | US-Dollar | 98.614 | 72.258 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 915 | |
| Singapur-Dollar | US-Dollar | 1.217 | 902 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1 | |
| Singapur-Dollar | US-Dollar | 896 | 660 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 4 | |
| Singapur-Dollar | US-Dollar | 2.057 | 1.508 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 19 | |
| Singapur-Dollar | US-Dollar | 3.379 | 2.473 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 35 | |
| Singapur-Dollar | US-Dollar | 3.452 | 2.530 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 31 | |
| Singapur-Dollar | US-Dollar | 1.003 | 733 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 11 | |
| | | | | | USD | 1.016 | |
| | | | | | SGD | 1.369 | |
| US-Dollar | Singapur-Dollar | 2.053 | 2.803 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (27) | |
| US-Dollar | Singapur-Dollar | 1.472 | 1.991 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (5) | |
| US-Dollar | Singapur-Dollar | 505 | 689 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (7) | |
| US-Dollar | Singapur-Dollar | 2.217 | 3.026 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (28) | |
| US-Dollar | Singapur-Dollar | 1.479 | 2.025 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (24) | |
| US-Dollar | Singapur-Dollar | 570 | 780 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (8) | |
| | | | | | USD | (99) | |
| | | | | | SGD | (133) | |
| BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund Anteilsklasse Sterling E (Acc) (Hedged) | | | | | | | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 99.471 | 131.408 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 3.227 | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 1.222 | 1.652 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 2 | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 895 | 1.200 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 11 | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 2.072 | 2.762 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 43 | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 3.407 | 4.506 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 105 | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 3.479 | 4.639 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 69 | |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte Forts.

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

BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund Anteilsklasse Sterling E (Acc) (Hedged) Forts.

| | | | | | | | |
|----------------|----------------|-------|-------|-------------|-----------------------------|------------|--------------|
| Pfund Sterling | US-Dollar | 1.028 | 1.362 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 30 | |
| | | | | | | USD | 3.487 |
| | | | | | | GBP | 2.576 |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 3.736 | 2.827 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (90) | |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 925 | 699 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (20) | |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 2.686 | 1.987 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (4) | |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 4.085 | 3.074 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (77) | |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 2.700 | 2.041 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (63) | |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 1.031 | 777 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (21) | |
| | | | | | | USD | (275) |
| | | | | | | GBP | (203) |

BNY MELLON SUSTAINABLE GLOBAL DYNAMIC BOND FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert EUR | Nettovermögen % | Summe | Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert EUR | Nettovermögen % | Summe |
|---|---|----------------------------|-----------------|--|--|--------------|--|------------------|-------------|
| Anleihen | | | | | Anleihen Forts. | | | | |
| Australischer Dollar - 14.135.342 | | | | | Euro Forts. | | | | |
| (31. Dezember 2020: 16.502.504) | | | | 14.135.342 | 4,30 | 1.146.000 | Lloyds Banking Group Plc FRN (Perpetual) 4.947% 27-Jun-2025 | 1.255.718 | 0,38 |
| 3.340.000 | Australia Government Bond 3.000% 20-Sep-2025 | 3.196.933 | 0,97 | 1.115.000 | Lorca Telecom Bondco SA 'REGS' 4.000% 18-Sep-2027 | 1.138.738 | 0,35 | | |
| 9.440.000 | Australia Government Bond 5.500% 21-Apr-2023 | 6.448.598 | 1,96 | 1.885.000 | Loxam SAS 'REGS' 2.875% 15-Apr-2026 | 1.876.386 | 0,57 | | |
| 6.980.000 | Treasury Corp of Victoria 1.000% 20-Nov-2023 | 4.489.811 | 1,37 | 985.000 | Motability Operations Group Plc 'EMTN' 0.375% 03-Jan-2026 | 991.959 | 0,30 | | |
| Kanadischer Dollar - 21.638.320 | | | | 21.638.320 | 6,58 | 1.070.000 | Motability Operations Group Plc 'EMTN' 1.625% 09-Jun-2023 | 1.098.895 | 0,33 |
| 18.020.000 | Canada Housing Trust No 1 '144A' 2.350% 15-Sep-2023 | 12.766.727 | 3,88 | 1.220.000 | Nationwide Building Society 'EMTN' 0.500% 23-Feb-2024 | 1.240.121 | 0,38 | | |
| 4.920.000 | Canada Housing Trust No 1 FRN 0.323% 15-Mar-2027 | 3.415.302 | 1,04 | 2.350.000 | Nexi SpA 1.625% 30-Apr-2026 | 2.309.521 | 0,70 | | |
| 5.384.277 | Canadian Government Real Return Bond 4.000% 01-Dec-2031 | 5.456.291 | 1,66 | 1.609.000 | Nobel Bidco BV 'REGS' 3.125% 15-Jun-2028 | 1.576.474 | 0,48 | | |
| Kolumbianischer Peso - 5.782.363 | | | | 5.782.363 | 1,76 | 1.656.000 | Nobian Finance BV 'REGS' 3.625% 15-Jul-2026 | 1.641.783 | 0,50 |
| 14.798.500.000 | Colombia Government International Bond 'REGS' 6.000% 28-Apr-2028 | 2.912.693 | 0,89 | 985.000 | Nomad Foods Bondco Plc 'REGS' 2.500% 24-Jun-2028 | 989.822 | 0,30 | | |
| 14.335.400.000 | Colombia Government International Bond 'REGS' 7.000% 30-Jun-2032 | 2.869.670 | 0,87 | 1.638.000 | Olympus Water US Holding Corp 'REGS' 3.875% 01-Oct-2028 | 1.648.434 | 0,50 | | |
| Tschechische Krone - 7.971.697 | | | | 7.971.697 | 2,43 | 1.050.000 | Orsted AS 1.500% 26-Nov-2029 | 1.132.546 | 0,35 |
| 125.640.000 | Czech Republic Government Bond 0.450% 25-Oct-2023 | 4.771.551 | 1,45 | 1.296.000 | PCF GmbH 'REGS' 4.750% 15-Apr-2026 | 1.344.023 | 0,41 | | |
| 84.870.000 | Czech Republic Government Bond 1.250% 14-Feb-2025 | 3.200.146 | 0,98 | 1.621.000 | Picard Groupe SAS 'REGS' 3.875% 01-Jul-2026 | 1.647.082 | 0,50 | | |
| Euro - 78.202.419 | | | | 78.202.419 | 23,80 | 700.000 | Prologis International Funding II SA 'EMTN' 1.625% 17-Jun-2032 | 732.165 | 0,22 |
| 2.180.000 | AIB Group Plc FRN (Perpetual) 6.250% 23-Jun-2025 | 2.415.941 | 0,74 | 2.580.000 | Province of British Columbia Canada 'EMTN' 0.875% 08-Oct-2025 | 2.669.191 | 0,81 | | |
| 2.189.000 | Akelius Residential Property AB FRN 2.249% 17-May-2081 | 2.141.039 | 0,65 | 1.553.000 | Republic of Poland Government International Bond 'EMTN' 0.000% 07-Jul-2023 | 1.557.760 | 0,47 | | |
| 831.000 | Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc 'REGS' 3.000% 01-Sep-2029 | 815.593 | 0,25 | 1.660.000 | Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB FRN (Perpetual) 2.625% 14-Dec-2025 | 1.615.102 | 0,49 | | |
| 2.000.000 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN (Perpetual) 5.875% 24-May-2022 | 2.036.200 | 0,62 | 1.128.000 | Sani/kos Financial Holdings 1 Sarl 'REGS' 5.625% 15-Dec-2026 | 1.144.796 | 0,35 | | |
| 2.200.000 | Banco Santander SA FRN (Perpetual) 5.250% 29-Sep-2023 | 2.310.110 | 0,70 | 325.000 | SELP Finance Sarl 1.250% 25-Oct-2023 | 331.518 | 0,10 | | |
| 2.171.000 | Banijay Entertainment SASU 'REGS' 3.500% 01-Mar-2025 | 2.184.970 | 0,67 | 2.098.000 | Summer BC Holdco B SARL 'REGS' 5.750% 31-Oct-2026 | 2.192.116 | 0,67 | | |
| 753.000 | BCPV Modular Services Finance II Plc 'REGS' 4.750% 30-Nov-2028 | 764.295 | 0,23 | 700.000 | Telefonica Europe BV FRN (Perpetual) 4.375% 14-Dec-2024 | 753.795 | 0,23 | | |
| 722.000 | CBRE Global Investors Open-Ended Fund SCA SICAV-SIF Pan European Core Fund 0.500% 27-Jan-2028 | 704.654 | 0,21 | 452.000 | Tesco Corporate Treasury Services Plc 'EMTN' 0.375% 27-Jul-2029 | 434.878 | 0,13 | | |
| 534.000 | Cedacri Mergerco SPA 'REGS' FRN 4.625% 15-May-2028 | 538.889 | 0,16 | 1.259.000 | Tritax EuroBox Plc 0.950% 02-Jun-2026 | 1.263.085 | 0,38 | | |
| 2.100.000 | Cellnex Telecom SA 1.875% 26-Jun-2029 | 2.091.642 | 0,64 | 1.775.000 | UniCredit SpA 'EMTN' FRN (Perpetual) 3.875% 03-Jun-2027 | 1.702.669 | 0,52 | | |
| 2.271.000 | Chrome Bidco SASU 'REGS' 3.500% 31-May-2028 | 2.303.067 | 0,70 | 570.000 | Vodafone Group Plc FRN 3.100% 03-Jan-2079 | 589.158 | 0,18 | | |
| 2.429.000 | Clarios Global LP / Clarios US Finance Co 'REGS' 4.375% 15-May-2026 | 2.498.834 | 0,76 | 1.400.000 | Volkswagen International Finance NV FRN (Perpetual) 3.875% 17-Jun-2029 | 1.529.500 | 0,47 | | |
| 1.945.000 | Dana Financing Luxembourg Sarl 'REGS' 3.000% 15-Jul-2029 | 1.966.687 | 0,60 | 1.445.000 | Ziggo BV 'REGS' 2.875% 15-Jan-2030 | 1.443.931 | 0,44 | | |
| 890.000 | Ecolab Inc 2.625% 08-Jul-2025 | 963.872 | 0,29 | Indische Rupie - 3.086.932 | | | | | |
| 5.422.886 | French Republic Government Bond OAT 0.100% 01-Mar-2025 | 5.801.675 | 1,77 | (31. Dezember 2020: -) | | | | 3.086.932 | 0,94 |
| 750.000 | Fresenius Medical Care AG & Co KGaA 'EMTN' 1.000% 29-May-2026 | 773.831 | 0,24 | 252.960.000 | International Finance Corp 'GMTN' 6.300% 25-Nov-2024 | 3.086.932 | 0,94 | | |
| 445.000 | Graphic Packaging International LLC 'REGS' 2.625% 01-Feb-2029 | 454.999 | 0,14 | Indonesische Rupiah - 4.819.858 | | | | | |
| 382.000 | H&M Finance BV 'EMTN' 0.250% 25-Aug-2029 | 370.676 | 0,11 | (31. Dezember 2020: 3.141.286) | | | | 4.819.858 | 1,47 |
| 2.219.000 | Heimstaden Bostad AB FRN (Perpetual) 2.625% 01-Feb-2027 | 2.099.951 | 0,64 | 20.155.000.000 | European Bank for Reconstruction & Development 'GMTN' 6.450% 13-Dec-2022 | 1.272.066 | 0,39 | | |
| 1.200.000 | Infineon Technologies AG 'EMTN' FRN (Perpetual) 2.875% 01-Jan-2025 | 1.248.300 | 0,38 | 54.061.000.000 | Indonesia Treasury Bond 6.500% 15-Jun-2025 | 3.547.792 | 1,08 | | |
| 1.100.000 | Infineon Technologies AG FRN (Perpetual) 3.625% 01-Jan-2028 | 1.202.245 | 0,37 | Japanischer Yen - 6.401.776 | | | | | |
| 1.273.000 | IQVIA Inc 'REGS' 2.875% 15-Jun-2028 | 1.311.063 | 0,40 | (31. Dezember 2020: 14.344.499) | | | | 6.401.776 | 1,95 |
| 1.263.000 | Kleopatra Finco Sarl 'REGS' 4.250% 01-Mar-2026 | 1.223.973 | 0,37 | 379.800.000 | Japan Government Two Year Bond 0.100% 01-Apr-2022 | 2.916.271 | 0,89 | | |
| 1.100.000 | Linde Finance BV 0.250% 19-May-2027 | 1.105.456 | 0,34 | 267.750.000 | Japan Government Two Year Bond 0.100% 01-Dec-2022 | 2.058.471 | 0,63 | | |
| 970.000 | Lloyds Bank Plc 'EMTN' 4.875% 13-Jan-2023 | 1.023.291 | 0,31 | 179.622.324 | Japanese Government CPI Linked Bond 0.100% 10-Mar-2028 | 1.427.034 | 0,43 | | |
| Malaysischer Ringgit - 3.276.698 | | | | | Malaysischer Ringgit - 3.276.698 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 3.950.587) | | | | 3.276.698 | 1,00 | 15.570.000 | Malaysia Government Bond 3.828% 05-Jul-2034 | 3.276.698 | 1,00 |
| Mexikanischer neuer Peso - 5.322.496 | | | | | Mexikanischer neuer Peso - 5.322.496 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 3.878.558) | | | | 5.322.496 | 1,62 | 52.900.000 | Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031 | 2.313.184 | 0,70 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert EUR | Summe Nettover- mögen % |
|--|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Mexikanischer neuer Peso Forts. | | | |
| 65.750.000 | Mexican Bonos 8.500% 31-May-2029 | 3.009.312 | 0,92 |
| Neuseeländischer Dollar - 8.464.480 | | | |
| (31. Dezember 2020: 6.133.593) | | 8.464.480 | 2,57 |
| 2.480.000 | Housing New Zealand Ltd 'MTN' 3.360% 12-Jun-2025 | 1.536.227 | 0,47 |
| 4.490.000 | New Zealand Government Inflation Linked Bond 3.000% 20-Sep-2030 | 3.793.030 | 1,15 |
| 2.620.000 | New Zealand Local Government Funding Agency Bond 2.250% 15-Apr-2024 | 1.582.491 | 0,48 |
| 2.460.000 | New Zealand Local Government Funding Agency Bond 5.500% 15-Apr-2023 | 1.552.732 | 0,47 |
| Norwegische Krone - 4.182.119 | | | |
| (31. Dezember 2020: 6.481.349) | | 4.182.119 | 1,27 |
| 32.520.000 | European Investment Bank 'EMTN' 1.500% 12-May-2022 | 3.262.608 | 0,99 |
| 9.000.000 | SpareBank 1 Boligkreditt AS 5.000% 15-Jul-2022 | 919.511 | 0,28 |
| Pfund Sterling - 40.858.584 | | | |
| (31. Dezember 2020: 29.668.149) | | 40.858.584 | 12,43 |
| 116.000 | Anglian Water Services Financing Plc 'EMTN' 1.625% 10-Aug-2025 | 139.623 | 0,04 |
| 1.463.000 | Bellis Acquisition Co Plc 'REGS' 3.250% 16-Feb-2026 | 1.681.152 | 0,51 |
| 565.000 | Clarion Funding Plc 'EMTN' 2.625% 18-Jan-2029 | 717.834 | 0,22 |
| 740.000 | Close Brothers Finance Plc 'EMTN' 2.750% 19-Oct-2026 | 934.308 | 0,28 |
| 2.213.000 | Coventry Building Society 'EMTN' 1.000% 21-Sep-2025 | 2.586.527 | 0,79 |
| 1.800.000 | Coventry Building Society FRN (Perpetual) 6.875% 18-Sep-2024 | 2.341.606 | 0,71 |
| 525.000 | CPUK Finance Ltd 6.500% 28-Aug-2026 | 650.846 | 0,20 |
| 1.292.000 | CPUK Finance Ltd 'REGS' 4.875% 28-Aug-2025 | 1.544.046 | 0,47 |
| 1.624.000 | Deuce Finco Plc 'REGS' 5.500% 15-Jun-2027 | 1.928.236 | 0,59 |
| 1.135.000 | European Investment Bank 'EMTN' 0.750% 15-Nov-2024 | 1.341.067 | 0,41 |
| 1.271.503 | Gwyn t y Mor OFTO Plc 2.778% 17-Feb-2034 | 1.572.935 | 0,48 |
| 1.495.000 | Iceland Bondco Plc 'REGS' 4.625% 15-Mar-2025 | 1.668.992 | 0,51 |
| 990.000 | Informa Plc 'EMTN' 3.125% 05-Jul-2026 | 1.227.080 | 0,37 |
| 2.300.000 | International Bank for Reconstruction & Development 'GMTN' 0.500% 24-Jul-2023 | 2.726.946 | 0,83 |
| 1.400.000 | Investec Plc 'EMTN' FRN (Perpetual) 6.750% 05-Dec-2024 | 1.747.557 | 0,53 |
| 1.340.000 | Lloyds Banking Group Plc FRN (Perpetual) 5.125% 27-Dec-2024 | 1.652.815 | 0,50 |
| 517.000 | Motability Operations Group Plc 'EMTN' 1.500% 20-Jan-2041 | 566.167 | 0,17 |
| 370.000 | National Express Group Plc 2.375% 20-Nov-2028 | 446.657 | 0,14 |
| 800.000 | National Express Group Plc 'EMTN' 2.500% 11-Nov-2023 | 972.477 | 0,30 |
| 1.282.000 | National Express Group Plc FRN (Perpetual) 4.250% 26-Nov-2025 | 1.560.150 | 0,47 |
| 1.920.000 | Nationwide Building Society FRN (Perpetual) 5.875% 20-Dec-2024 | 2.471.745 | 0,75 |
| 1.700.000 | Ocado Group Plc 'REGS' 3.875% 08-Oct-2026 | 1.978.084 | 0,60 |
| 542.000 | Orsted AS 'EMTN' 4.875% 12-Jan-2032 | 832.565 | 0,25 |
| 262.000 | Orsted AS FRN 2.500% 18-Feb-3021 | 305.391 | 0,09 |
| 268.000 | Travis Perkins Plc 3.750% 17-Feb-2026 | 330.488 | 0,10 |
| 316.000 | Tritax Big Box REIT Plc 1.500% 27-Nov-2033 | 357.619 | 0,11 |
| 1.259.000 | Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 'REGS' 4.875% 15-Jul-2028 | 1.502.218 | 0,46 |
| 883.000 | Vmed O2 UK Financing I Plc 'REGS' 4.000% 31-Jan-2029 | 1.034.920 | 0,31 |
| 630.000 | Vmed O2 UK Financing I Plc 'REGS' 4.500% 15-Jul-2031 | 749.740 | 0,23 |
| 1.317.000 | Vodafone Group Plc FRN 4.875% 03-Oct-2078 | 1.661.906 | 0,51 |
| 1.355.000 | Yorkshire Building Society FRN 0.739% 19-Nov-2023 | 1.626.887 | 0,50 |
| Schwedische Krone - 2.207.625 | | | |
| (31. Dezember 2020: 2.297.555) | | 2.207.625 | 0,67 |
| 22.000.000 | Stadshypotek AB 1.500% 01-Mar-2024 | 2.207.625 | 0,67 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert EUR | Summe Nettover- mögen % |
|--|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| US-Dollar - 96.676.356 | | | |
| (31. Dezember 2020: 94.554.933) | | 96.676.356 | 29,42 |
| 568.000 | Apple Inc 1.125% 11-May-2025 | 500.643 | 0,15 |
| 1.872.000 | Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc '144A' 4.000% 01-Sep-2029 | 1.645.800 | 0,50 |
| 3.780.000 | Asian Development Bank 'GMTN' FRN 1.050% 27-Aug-2026 | 3.468.185 | 1,06 |
| 1.020.000 | Bolivian Government International Bond 'REGS' 4.500% 20-Mar-2028 | 829.094 | 0,25 |
| 920.000 | CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.750% 01-Mar-2030 | 846.784 | 0,26 |
| 1.282.000 | CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5.500% 01-May-2026 | 1.165.149 | 0,35 |
| 2.920.000 | Colombia Government International Bond 4.500% 15-Mar-2029 | 2.628.734 | 0,80 |
| 1.827.000 | CommScope Inc '144A' 6.000% 01-Mar-2026 | 1.664.767 | 0,51 |
| 1.400.000 | Credit Suisse Group AG 'REGS' FRN (Perpetual) 7.250% 12-Sep-2025 | 1.359.404 | 0,41 |
| 1.000.000 | Credit Suisse Group AG 'REGS' FRN (Perpetual) 7.500% 11-Dec-2023 | 956.427 | 0,29 |
| 1.140.000 | DNB Boligkreditt AS 'REGS' 2.500% 28-Mar-2022 | 1.012.320 | 0,31 |
| 1.850.000 | Dominican Republic International Bond 'REGS' 4.875% 23-Sep-2032 | 1.665.563 | 0,51 |
| 770.000 | Dominican Republic International Bond 'REGS' 7.450% 30-Apr-2044 | 805.716 | 0,24 |
| 1.427.000 | Drax Finco Plc 'REGS' 6.625% 01-Nov-2025 | 1.301.414 | 0,40 |
| 81.087 | Ecuador Government International Bond 'REGS' (Zero Coupon) 0.000% 31-Jul-2030 | 40.477 | 0,01 |
| 283.750 | Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 0.500% 31-Jul-2040 | 146.814 | 0,04 |
| 619.125 | Ecuador Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 1.000% 31-Jul-2035 | 360.338 | 0,11 |
| 1.440.000 | European Bank for Reconstruction & Development 'GMTN' 2.750% 07-Mar-2023 | 1.305.018 | 0,40 |
| 3.300.000 | European Bank for Reconstruction & Development 'GMTN' FRN 0.239% 14-Apr-2026 | 2.919.370 | 0,89 |
| 1.640.000 | Guatemala Government Bond 'REGS' 4.875% 13-Feb-2028 | 1.562.712 | 0,48 |
| 2.290.000 | HSBC Bank Canada 'REGS' 0.950% 14-May-2023 | 2.027.490 | 0,62 |
| 904.000 | HSBC Holdings Plc FRN 0.732% 17-Aug-2024 | 791.700 | 0,24 |
| 1.760.000 | IHS Netherlands Holdco BV 'REGS' 8.000% 18-Sep-2027 | 1.652.551 | 0,50 |
| 3.020.000 | Indonesia Government International Bond 'REGS' 5.875% 15-Jan-2024 | 2.927.066 | 0,89 |
| 3.252.000 | Inter-American Development Bank 'GMTN' FRN 0.320% 20-Mar-2028 | 2.874.966 | 0,87 |
| 2.070.000 | International Bank for Reconstruction & Development 1.625% 15-Jan-2025 | 1.860.337 | 0,57 |
| 2.790.000 | International Bank for Reconstruction & Development FRN 0.440% 17-Jun-2024 | 2.482.448 | 0,76 |
| 3.350.000 | International Bank for Reconstruction & Development FRN 0.480% 19-Aug-2027 | 2.993.273 | 0,91 |
| 2.248.000 | International Finance Facility for Immunisation Co 'GMTN' 1.000% 21-Apr-2026 | 1.957.667 | 0,60 |
| 1.476.000 | Iron Mountain Inc '144A' 4.500% 15-Feb-2031 | 1.320.360 | 0,40 |
| 2.500.000 | JPMorgan Chase & Co FRN 2.083% 22-Apr-2026 | 2.240.886 | 0,68 |
| 2.346.000 | Kommunalbanken AS 'REGS' FRN 1.050% 17-Jun-2026 | 2.145.196 | 0,65 |
| 316.000 | LCPR Senior Secured Financing DAC '144A' 5.125% 15-Jul-2029 | 283.726 | 0,09 |
| 2.195.000 | Lumen Technologies Inc 5.800% 15-Mar-2022 | 1.956.300 | 0,59 |
| 1.785.000 | Mauser Packaging Solutions Holding Co '144A' 5.500% 15-Apr-2024 | 1.593.575 | 0,48 |
| 1.643.000 | Mexico Government International Bond 4.500% 22-Apr-2029 | 1.617.734 | 0,49 |
| 1.452.000 | Millicom International Cellular SA 'REGS' 4.500% 27-Apr-2031 | 1.294.433 | 0,39 |
| 1.880.000 | Mongolia Government International Bond 'REGS' 3.500% 07-Jul-2027 | 1.567.472 | 0,48 |
| 636.000 | Mongolia Government International Bond 'REGS' 8.750% 09-Mar-2024 | 620.940 | 0,19 |
| 1.891.000 | Mozart Debt Merger Sub Inc '144A' 3.875% 01-Apr-2029 | 1.665.703 | 0,51 |
| 2.022.000 | NatWest Group Plc FRN (Perpetual) 6.000% 29-Dec-2025 | 1.959.420 | 0,60 |
| 350.000 | NatWest Group Plc FRN (Perpetual) 8.000% 10-Aug-2025 | 360.010 | 0,11 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert EUR | Summe Nettover- mögen % | |
|---|--|--------------------------------------|--|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | | |
| US-Dollar Forts. | | | | |
| 2.653.000 | Sable International Finance Ltd '144A' 5.750% 07-Sep-2027 | 2.401.962 | 0,73 | |
| 2.420.000 | Societe Generale SA 'REGS' FRN (Perpetual) 7.875% 18-Dec-2023 | 2.327.847 | 0,71 | |
| 1.270.000 | Sprint Capital Corp 8.750% 15-Mar-2032 | 1.684.970 | 0,51 | |
| 1.405.000 | Sprint Corp 7.875% 15-Sep-2023 | 1.369.920 | 0,42 | |
| 2.390.000 | Telecom Italia SpA/Milano '144A' 5.303% 30-May-2024 | 2.222.360 | 0,68 | |
| 1.466.000 | T-Mobile USA Inc 3.375% 15-Apr-2029 | 1.322.372 | 0,40 | |
| 2.480.000 | UBS Group AG FRN (Perpetual) 5.000% 31-Jan-2023 | 2.197.183 | 0,67 | |
| 640.000 | UniCredit SpA FRN (Perpetual) 8.000% 03-Jun-2024 | 619.505 | 0,19 | |
| 5.630.000 | United States Treasury Floating Rate Note - When Issued FRN 0.120% 31-Oct-2023 | 4.975.322 | 1,51 | |
| 3.518.063 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15-Jul-2031 | 3.494.398 | 1,06 | |
| 3.695.890 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15-Apr-2023 | 3.416.438 | 1,04 | |
| 1.412.000 | Verizon Communications Inc FRN 0.840% 20-Mar-2026 | 1.263.466 | 0,38 | |
| 226.000 | Vietnam Government International Bond 'REGS' 4.800% 19-Nov-2024 | 216.531 | 0,07 | |
| 950.000 | Vodafone Group Plc FRN 7.000% 04-Apr-2079 | 1.015.619 | 0,31 | |
| 1.888.000 | VTR Comunicaciones SpA '144A' 4.375% 15-Apr-2029 | 1.653.911 | 0,50 | |
| 1.420.000 | Windstream Escrow LLC / Windstream Escrow Finance Corp '144A' 7.750% 15-Aug-2028 | 1.332.342 | 0,41 | |
| 865.000 | Ziggo BV '144A' 5.500% 15-Jan-2027 | 784.228 | 0,24 | |
| Gesamtanlagen in Anleihen | | 303.027.065 | 92,21 | |
| Optionen auf Futures - 167.604 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 28.720) | | | | |
| 324 | U.S. 10 Year Treasury Note Future Call 18-Feb-2022 132.000 | 84.982 | 0,03 | |
| 133 | U.S. Treasury Bond Future Call 18-Feb-2022 164.000 | 82.622 | 0,02 | |
| Optionen auf Futures insgesamt | | 167.604 | 0,05 | |
| Bestände | Beschreibung | Zugrunde liegendes Engagement EUR | Summe Beizulegender Zeitwert EUR | Summe Nettover- mögen % |
| Offene Terminkontrakte - 311.972 | | | | |
| (31. Dezember 2020: (5.487)) | | | | |
| (78) | Euro-BTP Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (11.466.780) | 138.331 | 0,04 |
| (41) | Euro-Bund Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (7.026.170) | 102.438 | 0,03 |
| (124) | U.S. 2 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (23.896.709) | 21.596 | 0,01 |
| (29) | UK Long Gilt Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (4.312.881) | 49.607 | 0,01 |
| Offene Terminkontrakte insgesamt | | | 311.972 | 0,09 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 1.546.746 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 4.971.038) | | | 1.546.746 | 0,47 |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | | 305.053.387 | 92,82 |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (4.219.461) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (2.744.706)) | | | (4.219.461) | (1,28) |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | | (4.219.461) | (1,28) |
| Nettoumlaufvermögen | | | 27.788.917 | 8,46 |
| Summe Nettovermögen | | | 328.622.843 | 100,00 |

| Portfolioanalyse | % des Gesamtvermögens |
|--|-----------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 90,87 |
| An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente | 0,14 |
| Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate) | 0,46 |
| Sonstiges Umlaufvermögen | 8,53 |
| Gesamtvermögen | 100,00 |

Der Kontrahent für Optionen auf Futures ist die UBS AG.
Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist die UBS AG.

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte

| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|--|-------------------------|---------------|----------------|------------------|------------------------|-------------------------------------|
| BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund | | | | | | |
| Euro | Australischer Dollar | 6.472.286 | 10.084.028 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 18.045 |
| Euro | Kanadischer Dollar | 3.424.209 | 4.920.000 | 18. Feb. 22 | Canadian Imperial Bank | 14.746 |
| Euro | Kanadischer Dollar | 18.357.226 | 26.487.301 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 2.046 |
| Euro | Neuseeländischer Dollar | 15.126.156 | 24.763.543 | 18. Feb. 22 | Barclays Bank PLC | 202.805 |
| Euro | Norwegische Krone | 4.220.475 | 4.1944.042 | 18. Feb. 22 | Canadian Imperial Bank | 28.473 |
| Euro | Sudafrikanischer Rand | 343.335 | 6.220.000 | 18. Feb. 22 | HSBC Bank plc | 1.270 |
| Euro | Sudafrikanischer Rand | 4.710.936 | 84.303.810 | 18. Feb. 22 | Barclays Bank PLC | 74.708 |
| Euro | Schwedische Krone | 7.247.909 | 71.957.139 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | 235.485 |
| Euro | US-Dollar | 4.352.590 | 4.890.000 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 36.114 |
| Euro | US-Dollar | 208.656 | 236.000 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 335 |
| Euro | US-Dollar | 1.225.706 | 1.385.763 | 18. Feb. 22 | Canadian Imperial Bank | 2.473 |
| Ungarischer Forint | Euro | 122.078.917 | 327.875 | 18. Feb. 22 | HSBC Bank plc | 500 |
| Malaysischer Ringgit | US-Dollar | 6.313.830 | 1.493.055 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 19.818 |
| Mexikanischer Peso | Euro | 4.898.075 | 203.413 | 18. Feb. 22 | UBS AG | 6.464 |
| Neuseeländischer Dollar | Euro | 8.064.183 | 4.833.544 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 26.207 |
| Polnischer Zloty | Euro | 15.560.000 | 3.320.901 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 52.341 |
| Pfund Sterling | Euro | 222.779 | 261.221 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 3.741 |
| Pfund Sterling | Euro | 534.124 | 630.761 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | 4.500 |
| Pfund Sterling | Euro | 393.302 | 467.306 | 18. Feb. 22 | Canadian Imperial Bank | 468 |
| Pfund Sterling | Euro | 8.362.861 | 9.929.111 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 12.270 |
| Pfund Sterling | Euro | 834.691 | 999.744 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 2.997 |
| Pfund Sterling | Euro | 643.969 | 755.064 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | 10.842 |
| US-Dollar | Kolumbianischer Peso | 1.807.692 | 7080.547.701 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 68.045 |
| US-Dollar | Euro | 4.318.333 | 3.793.777 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 18.080 |
| US-Dollar | Euro | 2.393.532 | 2.102.217 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 10.590 |
| US-Dollar | Euro | 1.984.659 | 1.750.476 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 1.413 |
| US-Dollar | Euro | 587.392 | 517.825 | 18. Feb. 22 | Barclays Bank PLC | 675 |
| US-Dollar | Koreanischer Won | 3.431.089 | 4.063.370.000 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 13.027 |
| US-Dollar | Philippinischer Peso | 5.547.252 | 281.456.457 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 73.891 |
| | | | | | | EUR 947.369 |
| Euro | Australischer Dollar | 7.710.647 | 12.090.641 | 18. Feb. 22 | Canadian Imperial Bank | (27.918) |
| Euro | Tschechische Krone | 8.107.030 | 207.270.404 | 18. Feb. 22 | HSBC Bank plc | (187.567) |
| Euro | Japanischer Yen | 6.329.323 | 832.556.567 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | (56.784) |
| Euro | Mexikanischer Peso | 1.495.814 | 36.231.454 | 18. Feb. 22 | Canadian Imperial Bank | (56.662) |
| Euro | Pfund Sterling | 58.022.474 | 49.943.135 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (1.377.465) |
| Euro | US-Dollar | 3.357.100 | 3.803.539 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (241) |
| Euro | US-Dollar | 4.944.652 | 5.628.987 | 18. Feb. 22 | Canadian Imperial Bank | (24.139) |
| Euro | US-Dollar | 3.073.024 | 3.490.000 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (7.851) |
| Euro | US-Dollar | 4.749.112 | 5.381.147 | 18. Feb. 22 | Canadian Imperial Bank | (908) |
| Euro | US-Dollar | 774.615 | 882.763 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (4.613) |
| Euro | US-Dollar | 93.019.023 | 107.534.828 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (1.903.582) |
| Euro | US-Dollar | 979.120 | 1.136.132 | 18. Feb. 22 | Canadian Imperial Bank | (23.761) |
| Ungarischer Forint | Euro | 1.710.680.774 | 4.721.248 | 18. Feb. 22 | HSBC Bank plc | (119.769) |
| Japanischer Yen | US-Dollar | 634.781.063 | 5.630.656 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (101.191) |
| Koreanischer Won | US-Dollar | 4.063.372.000 | 3.420.059 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (3.289) |
| Neuseeländischer Dollar | Euro | 10.816.119 | 6.655.152 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (136.991) |
| Schwedische Krone | Euro | 48.945.823 | 4.835.609 | 18. Feb. 22 | HSBC Bank plc | (65.702) |
| US-Dollar | Euro | 559.853 | 496.698 | 18. Feb. 22 | Barclays Bank PLC | (2.507) |
| US-Dollar | Indische Rupie | 3.571.103 | 268.064.824 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (15.039) |
| US-Dollar | Indonesische Rupiah | 4.872.941 | 70.296.560.000 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (50.152) |
| US-Dollar | Indonesische Rupiah | 735.759 | 10.646.429.000 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (9.581) |

Devisenterminkontrakte Forts.

| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|---|----------------------|------------|------------|------------------|-----------------------------|-------------------------------------|
| BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund Forts. | | | | | | |
| US-Dollar | Malaysischer Ringgit | 5.226.681 | 21.910.247 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (28.622) |
| | | | | | | EUR (4.204.234) |
| BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse CHF E (Acc) (Hedged) | | | | | | |
| Schweizer Franken | Euro | 3.025 | 2.915 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 12 |
| Schweizer Franken | Euro | 4.150 | 3.994 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 22 |
| Schweizer Franken | Euro | 5.749 | 5.508 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 56 |
| Schweizer Franken | Euro | 13.464.366 | 12.889.896 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 140.299 |
| Schweizer Franken | Euro | 60.592 | 58.175 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 464 |
| | | | | | | EUR 140.853 |
| | | | | | | CHF 145.555 |
| Euro | Schweizer Franken | 2.915 | 3.025 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (13) |
| Euro | Schweizer Franken | 3.763 | 3.927 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (38) |
| Euro | Schweizer Franken | 1.420 | 1.478 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (10) |
| Euro | Schweizer Franken | 13.530 | 14.100 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (115) |
| | | | | | | EUR (176) |
| | | | | | | CHF (182) |
| BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse CHF H (Acc) (Hedged) | | | | | | |
| Schweizer Franken | Euro | 720.262 | 689.532 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 7.505 |
| | | | | | | EUR 7.505 |
| | | | | | | CHF 7.756 |
| BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse CHF W (Acc) (Hedged) | | | | | | |
| Schweizer Franken | Euro | 1.950 | 1.879 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 8 |
| Schweizer Franken | Euro | 687 | 663 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 2 |
| Schweizer Franken | Euro | 403 | 388 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1 |
| Schweizer Franken | Euro | 1.673 | 1.612 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 7 |
| Schweizer Franken | Euro | 446 | 429 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 2 |
| Schweizer Franken | Euro | 4.974 | 4.766 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 48 |
| Schweizer Franken | Euro | 41.155.284 | 39.399.354 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 428.841 |
| Schweizer Franken | Euro | 49.060 | 47.098 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 380 |
| Schweizer Franken | Euro | 10.087 | 9.674 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 88 |
| Schweizer Franken | Euro | 1.552 | 1.492 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 10 |
| Schweizer Franken | Euro | 20.211 | 19.419 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 140 |
| Schweizer Franken | Euro | 366 | 350 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 4 |
| Schweizer Franken | Euro | 36.279 | 34.832 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 278 |
| Schweizer Franken | Euro | 6.987 | 6.716 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 46 |
| Schweizer Franken | Euro | 17.541 | 16.834 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 141 |
| Schweizer Franken | Euro | 90.274 | 86.629 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 734 |
| | | | | | | EUR 430.730 |
| | | | | | | CHF 445.107 |
| Euro | Schweizer Franken | 1.612 | 1.673 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (7) |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte Forts.

| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) | |
|--|-------------------|------------|------------|------------------|-----------------------------|-------------------------------------|----------------|
| BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse CHF W (Acc) (Hedged) Forts. | | | | | | | |
| Euro | Schweizer Franken | 388 | 403 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) | |
| Euro | Schweizer Franken | 663 | 687 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (2) | |
| Euro | Schweizer Franken | 1.878 | 1.950 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (8) | |
| Euro | Schweizer Franken | 1.424 | 1.480 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (8) | |
| Euro | Schweizer Franken | 13.490 | 14.080 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (136) | |
| Euro | Schweizer Franken | 795 | 828 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (7) | |
| Euro | Schweizer Franken | 1.540 | 1.606 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (14) | |
| Euro | Schweizer Franken | 19.064 | 19.838 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (134) | |
| Euro | Schweizer Franken | 1.768 | 1.840 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (13) | |
| Euro | Schweizer Franken | 2.906 | 3.024 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (21) | |
| Euro | Schweizer Franken | 49.366 | 51.595 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (565) | |
| Euro | Schweizer Franken | 25.523 | 26.584 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (203) | |
| Euro | Schweizer Franken | 46.584 | 48.464 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (318) | |
| Euro | Schweizer Franken | 4.896 | 5.102 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (41) | |
| Euro | Schweizer Franken | 3.569 | 3.719 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (30) | |
| | | | | | | EUR | (1.508) |
| | | | | | | CHF | (1.558) |

BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)

| Pfund Sterling | Euro | 516.335 | 603.292 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 11.324 | |
|----------------|------|---------|---------|-------------|-----------------------------|------------|---------------|
| | | | | | | EUR | 11.324 |
| | | | | | | GBP | 9.511 |

BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Inc) (Hedged)

| Euro | Pfund Sterling | 40 | 34 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - | |
|----------------|----------------|---------|---------|-------------|-----------------------------|------------|--------------|
| Pfund Sterling | Euro | 34 | 40 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - | |
| Pfund Sterling | Euro | 396.179 | 462.901 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 8.689 | |
| Pfund Sterling | Euro | 200 | 234 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 4 | |
| | | | | | | EUR | 8.693 |
| | | | | | | GBP | 7.301 |

BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse USD W (Acc) (Hedged)

| Euro | US-Dollar | 29.687 | 33.558 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 38 |
|-----------|-----------|--------|--------|-------------|-----------------------------|-----|
| Euro | US-Dollar | 249 | 282 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - |
| Euro | US-Dollar | 3.889 | 4.397 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 5 |
| Euro | US-Dollar | 7.072 | 7.998 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 7 |
| Euro | US-Dollar | 79.402 | 89.659 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 204 |
| Euro | US-Dollar | 1.684 | 1.904 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 2 |
| Euro | US-Dollar | 43 | 49 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - |
| US-Dollar | Euro | 282 | 249 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - |
| US-Dollar | Euro | 569 | 502 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1 |
| US-Dollar | Euro | 1.463 | 1.291 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1 |
| US-Dollar | Euro | 391 | 346 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - |
| US-Dollar | Euro | 20.842 | 18.397 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 13 |

Devisenterminkontrakte Forts.

| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) | |
|--|-----------|------------|------------|------------------|-----------------------------|-------------------------------------|-----------------|
| BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse USD W (Acc) (Hedged) Forts. | | | | | | | |
| US-Dollar | Euro | 1.155 | 1.019 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1 | |
| | | | | | | EUR | 272 |
| | | | | | | USD | 308 |
| US-Dollar | Euro | 4.397 | 3.890 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (5) | |
| Euro | US-Dollar | 1.042 | 1.180 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) | |
| US-Dollar | Euro | 33.558 | 29.683 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (41) | |
| US-Dollar | Euro | 2.938 | 2.602 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (7) | |
| US-Dollar | Euro | 2.742 | 2.431 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (9) | |
| US-Dollar | Euro | 5.597 | 4.949 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (6) | |
| US-Dollar | Euro | 969 | 859 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (3) | |
| US-Dollar | Euro | 13.566 | 12.019 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (36) | |
| US-Dollar | Euro | 6.414 | 5.685 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (20) | |
| US-Dollar | Euro | 6.168.172 | 5.460.520 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (12.002) | |
| | | | | | | EUR | (12.130) |
| | | | | | | USD | (13.729) |

BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund Anteilsklasse USD Z (Inc) (Hedged)

| US-Dollar | Euro | 726.108 | 642.804 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1.413) | |
|-----------|------|---------|---------|-------------|-----------------------------|------------|----------------|
| | | | | | | EUR | (1.413) |
| | | | | | | USD | (1.599) |

BNY MELLON SUSTAINABLE GLOBAL REAL RETURN FUND (EUR)

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert EUR | Nettovermögen % | Summe | Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert EUR | Nettovermögen % | Summe | |
|--|---|----------------------------|-----------------|-------|----------------------|--|----------------------------|-----------------|-------|--|
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | | | | Aktien Forts. | | | | | |
| | Guernsey - 256.829 | | | | | Kaiman-Inseln - 804.697 | | | | |
| | (31. Dezember 2020: -) | 256.829 | 0,33 | | | (31. Dezember 2020: 1.192.566) | 804.697 | 1,03 | | |
| 72.541 | Cordiant Digital Infrastructure Ltd/Fund | 89.392 | 0,12 | | 15.030 | Alibaba Group Holding Ltd | 202.380 | 0,26 | | |
| 124.452 | Cordiant Digital Infrastructure Ltd/Fund | 167.437 | 0,21 | | 8.020 | Tencent Holdings Ltd | 414.967 | 0,53 | | |
| | | | | | 30.934 | Tencent Music Entertainment Group ADR | 187.350 | 0,24 | | |
| | Irland - 357.694 | | | | | China - 1.490.124 | | | | |
| | (31. Dezember 2020: -) | 357.694 | 0,46 | | | (31. Dezember 2020: 674.348) | 1.490.124 | 1,90 | | |
| 4.062 | DMS UCITS Platform ICAV - FVC Equity Dispersion UCITS Fund | 357.694 | 0,46 | | 91.000 | Flat Glass Group Co Ltd 'H' | 408.010 | 0,52 | | |
| | | | | | 31.000 | LONGi Green Energy Technology Co Ltd 'A' | 370.414 | 0,47 | | |
| | Jersey - 1.638.289 | | | | 23.100 | Sungrow Power Supply Co Ltd | 466.904 | 0,60 | | |
| | (31. Dezember 2020: -) | 1.638.289 | 2,09 | | 6.900 | Wuhan DR Laser Technology Corp Ltd | 244.796 | 0,31 | | |
| 31.606 | Wisdomtree Carbon | 866.953 | 1,11 | | | Zypern - 515.030 | | | | |
| 22.260 | WisdomTree Copper - ETF | 771.336 | 0,98 | | | (31. Dezember 2020: -) | 515.030 | 0,66 | | |
| | Vereinigtes Königreich - 827.999 | | | | 11.246 | HeadHunter Group Plc ADR | 515.030 | 0,66 | | |
| | (31. Dezember 2020: 474.230) | 827.999 | 1,05 | | | Dänemark - 870.000 | | | | |
| 150.703 | Aquila European Renewables Income Fund Plc/The Fund | 153.717 | 0,19 | | | (31. Dezember 2020: 420.125) | 870.000 | 1,11 | | |
| 185.427 | Gresham House Energy Storage Fund Plc/The Fund | 287.556 | 0,37 | | 1.077 | Chr Hansen Holding A/S | 74.640 | 0,10 | | |
| 456.429 | US Solar Fund Plc/Fund | 386.726 | 0,49 | | 4.541 | Novozymes A/S | 329.239 | 0,42 | | |
| | | | | | 4.149 | Orsted AS '144A' | 466.121 | 0,59 | | |
| | Gesamtanlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen | 3.080.811 | 3,93 | | | Finnland - 301.801 | | | | |
| | Anleihen | | | | | (31. Dezember 2020: -) | 301.801 | 0,38 | | |
| | Kaiman-Inseln - 181.075 | | | | 6.970 | Neste Oyj | 301.801 | 0,38 | | |
| | (31. Dezember 2020: 173.921) | 181.075 | 0,23 | | | Frankreich - 2.343.317 | | | | |
| 200.000 | Sable International Finance Ltd '144A' 5.750% 07-Sep-2027 | 181.075 | 0,23 | | | (31. Dezember 2020: 1.276.277) | 2.343.317 | 2,99 | | |
| | Frankreich - 199.086 | | | | 24.042 | Bureau Veritas SA | 700.704 | 0,89 | | |
| | (31. Dezember 2020: 99.239) | 199.086 | 0,25 | | 3.696 | Legrand SA | 379.302 | 0,49 | | |
| 200.000 | Loxam SAS 'REGS' 2.875% 15-Apr-2026 | 199.086 | 0,25 | | 1.631 | L'oreal SA | 683.511 | 0,87 | | |
| | Irland - 569.989 | | | | 800 | LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE | 579.800 | 0,74 | | |
| | (31. Dezember 2020: 438.760) | 569.989 | 0,73 | | | Deutschland - 1.615.206 | | | | |
| 200.000 | AIB Group Plc FRN (Perpetual) 5.250% 09-Oct-2024 | 212.034 | 0,27 | | | (31. Dezember 2020: 410.737) | 1.615.206 | 2,06 | | |
| 300.000 | Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 'REGS' 4.875% 15-Jul-2028 | 357.955 | 0,46 | | 8.084 | Continental AG | 753.025 | 0,96 | | |
| | Luxemburg - 208.972 | | | | 4.859 | Volkswagen AG - Preference | 862.181 | 1,10 | | |
| | (31. Dezember 2020: 212.086) | 208.972 | 0,27 | | | Hongkong - 1.065.040 | | | | |
| 200.000 | Summer BC Holdco B SARL 'REGS' 5.750% 31-Oct-2026 | 208.972 | 0,27 | | | (31. Dezember 2020: 695.802) | 1.065.040 | 1,36 | | |
| | Spanien - 425.706 | | | | 76.200 | AIA Group Ltd | 678.772 | 0,87 | | |
| | (31. Dezember 2020: 215.574) | 425.706 | 0,54 | | 49.700 | Link REIT (Units) (REIT) | 386.268 | 0,49 | | |
| 200.000 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN (Perpetual) 6.000% 29-Mar-2024 | 215.696 | 0,27 | | | Ungarn - 99.207 | | | | |
| 200.000 | Banco Santander SA FRN (Perpetual) 5.250% 29-Sep-2023 | 210.010 | 0,27 | | | (31. Dezember 2020: -) | 99.207 | 0,13 | | |
| | Vereinigtes Königreich - 701.771 | | | | 2.207 | OTP Bank Nyrt | 99.207 | 0,13 | | |
| | (31. Dezember 2020: 765.579) | 701.771 | 0,90 | | | Indien - 711.563 | | | | |
| 300.000 | Iceland Bondco Plc 'REGS' 4.625% 15-Mar-2025 | 334.915 | 0,43 | | | (31. Dezember 2020: 341.511) | 711.563 | 0,91 | | |
| 200.000 | Investec Plc 'EMTN' FRN (Perpetual) 6.750% 05-Dec-2024 | 249.651 | 0,32 | | 12.447 | HDFC Bank Ltd ADR | 711.563 | 0,91 | | |
| 100.000 | Vmed O2 UK Financing I Plc 'REGS' 4.000% 31-Jan-2029 | 117.205 | 0,15 | | | Indonesien - 125.927 | | | | |
| | Vereinigte Staaten von Amerika - 41.129 | | | | | (31. Dezember 2020: -) | 125.927 | 0,16 | | |
| | (31. Dezember 2020: 105.433) | 41.129 | 0,05 | | 277.800 | Bank Central Asia Tbk PT | 125.927 | 0,16 | | |
| 31.000 | Sprint Capital Corp 8.750% 15-Mar-2032 | 41.129 | 0,05 | | | Irland - 3.499.984 | | | | |
| | Gesamtanlagen in Anleihen | 2.327.728 | 2,97 | | | (31. Dezember 2020: 1.588.135) | 3.499.984 | 4,46 | | |
| | Aktien | | | | | 1.659 | Accenture Plc - Class A | 606.751 | 0,77 | |
| | Bermudas - 137.998 | | | | | 173 | Kerry Group Plc | 19.730 | 0,02 | |
| | (31. Dezember 2020: -) | 137.998 | 0,18 | | | 4.943 | Linde Plc | 1.503.906 | 1,92 | |
| 1.248 | Credicorp Ltd | 137.998 | 0,18 | | | 9.690 | Medtronic Plc | 894.603 | 1,14 | |
| | | | | | | 2.677 | Trane Technologies Plc | 474.994 | 0,61 | |
| | Gesamtanlagen in Aktien | 137.998 | 0,18 | | | Japan - 2.262.105 | | | | |
| | | | | | | (31. Dezember 2020: 822.611) | 2.262.105 | 2,88 | | |
| | | | | | 6.400 | Advantest Corp | 535.385 | 0,68 | | |
| | | | | | 3.900 | Ebara Corp | 191.261 | 0,24 | | |
| | | | | | 8.300 | Sony Group Corp | 922.851 | 1,18 | | |
| | | | | | 48.100 | Topcon Corp | 612.608 | 0,78 | | |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert EUR | Summe Nettover- mögen % |
|--|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Aktien Forts. | | | |
| Jersey - 390.172 | | | |
| (31. Dezember 2020: 177.863) | | | |
| 2.503 | Ferguson Plc | 390.172 | 0,50 |
| Niederlande - 1.304.677 | | | |
| (31. Dezember 2020: 275.888) | | | |
| 1.347 | ASML Holding NV | 954.552 | 1,22 |
| 14.108 | Universal Music Group NV | 350.125 | 0,44 |
| Norwegen - 286.471 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 4.534 | TOMRA Systems ASA | 286.471 | 0,36 |
| Republik Korea - 532.005 | | | |
| (31. Dezember 2020: 306.391) | | | |
| 1.092 | Samsung SDI Co Ltd | 532.005 | 0,68 |
| Südafrika - 69.404 | | | |
| (31. Dezember 2020: 186.087) | | | |
| 506 | Naspers Ltd | 69.404 | 0,09 |
| Schweiz - 3.626.931 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.598.984) | | | |
| 9.479 | Alcon Inc | 740.705 | 0,95 |
| 3.186 | Chubb Ltd | 543.648 | 0,69 |
| 595 | Lonza Group AG | 438.572 | 0,56 |
| 6.062 | Nestle SA | 747.763 | 0,95 |
| 8.147 | TE Connectivity Ltd | 1.156.243 | 1,48 |
| Taiwan - 637.875 | | | |
| (31. Dezember 2020: 414.313) | | | |
| 55.000 | Elite Material Co Ltd | 489.144 | 0,62 |
| 3.000 | Voltronic Power Technology Corp | 148.731 | 0,19 |
| Vereinigtes Königreich - 11.898.698 | | | |
| (31. Dezember 2020: 3.387.454) | | | |
| 19.799 | 3i Group Plc | 342.929 | 0,44 |
| 28.539 | Ascential Plc | 137.173 | 0,17 |
| 7.646 | ASOS Plc | 218.529 | 0,28 |
| 11.060 | AstraZeneca Plc | 1.134.772 | 1,45 |
| 136.036 | Atrato Onsite Energy Plc | 177.354 | 0,23 |
| 85.265 | Barratt Developments Plc | 758.339 | 0,97 |
| 19.824 | Bodycote Plc | 205.167 | 0,26 |
| 439.288 | Harmony Energy Income Trust Plc | 520.409 | 0,66 |
| 239.323 | Hays Plc | 419.292 | 0,53 |
| 391.350 | Home Reit Plc (REIT) | 599.908 | 0,77 |
| 13.673 | IMI Plc | 283.911 | 0,36 |
| 336.687 | Impact Healthcare Reit Plc (REIT) | 477.832 | 0,61 |
| 54.812 | Informa Plc | 334.915 | 0,43 |
| 194.840 | National Express Group Plc | 594.100 | 0,76 |
| 22.284 | National Grid Plc | 282.722 | 0,36 |
| 284.580 | Pantheon Infrastructure Plc | 355.767 | 0,45 |
| 16.783 | Persimmon Plc | 571.789 | 0,73 |
| 54.771 | Prudential Plc | 827.858 | 1,06 |
| 29.897 | Relx Plc | 851.616 | 1,09 |
| 150.711 | Schroder Bsc Social Impact Trust Plc | 187.514 | 0,24 |
| 59.552 | Shaftesbury Plc (REIT) | 434.639 | 0,55 |
| 199.464 | Taylor Wimpey Plc | 416.549 | 0,53 |
| 23.764 | Travis Perkins Plc | 445.062 | 0,57 |
| 12.848 | Unilever Plc | 601.608 | 0,77 |
| 160.450 | Urban Logistics REIT Plc (REIT) | 355.324 | 0,45 |
| 229.117 | VH Global Sustainable Energy Opportunities Plc | 291.068 | 0,37 |
| 25.679 | Wickes Group Plc | 72.552 | 0,09 |
| Vereinigte Staaten von Amerika - 15.760.326 | | | |
| (31. Dezember 2020: 5.291.191) | | | |
| 5.703 | Abbott Laboratories | 710.475 | 0,91 |
| 443 | Alphabet Inc - Class A | 1.144.516 | 1,46 |
| 226 | Amazon.com Inc | 673.671 | 0,86 |
| 622 | American Tower Corp (REIT) | 160.016 | 0,20 |
| 16.004 | Brixmor Property Group Inc (REIT) | 357.946 | 0,46 |
| 6.514 | CME Group Inc | 1.315.720 | 1,68 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert EUR | Summe Nettover- mögen % |
|--|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Aktien Forts. | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika Forts. | | | |
| 2.770 | Comerica Inc | 212.978 | 0,27 |
| 3.714 | Ecolab Inc | 767.984 | 0,98 |
| 10.251 | Elanco Animal Health Inc | 259.886 | 0,33 |
| 930 | Eli Lilly & Co | 227.868 | 0,29 |
| 3.789 | Eversource Energy | 305.085 | 0,39 |
| 2.560 | Fidelity National Information Services Inc | 248.807 | 0,32 |
| 14.320 | First Horizon Corp | 207.174 | 0,26 |
| 1.993 | Hubbell Inc - Class B | 365.144 | 0,47 |
| 739 | IDEXX Laboratories Inc | 431.984 | 0,55 |
| 8.822 | JPMorgan Chase & Co | 1.234.893 | 1,57 |
| 10.268 | KeyCorp | 210.422 | 0,27 |
| 17.070 | Laureate Education Inc - Class A | 182.486 | 0,23 |
| 1.815 | Mastercard Inc | 579.113 | 0,74 |
| 3.417 | Microsoft Corp | 1.024.466 | 1,31 |
| 6.501 | Morgan Stanley | 567.448 | 0,72 |
| 5.591 | NIKE Inc | 827.424 | 1,05 |
| 2.930 | Norfolk Southern Corp | 763.001 | 0,97 |
| 11.368 | Otis Worldwide Corp | 867.628 | 1,11 |
| 1.798 | salesforce.com Inc | 405.572 | 0,52 |
| 1.283 | Sherwin-Williams Co/The | 397.199 | 0,51 |
| 1.479 | Thermo Fisher Scientific Inc | 869.870 | 1,11 |
| 2.039 | Zoetis Inc | 441.550 | 0,56 |
| Gesamtanlagen in Aktien | | 50.348.558 | 64,22 |
| Kapitalbeteiligungsinstrumente | | | |
| Guernsey - 2.469.415 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.356.101) | | | |
| 442.654 | Hipgnosis Songs Fund Ltd/The Fund | 660.371 | 0,84 |
| 310.388 | International Public Partnerships Ltd | 627.132 | 0,80 |
| 171.119 | JLEN Environmental Assets Group Ltd Foresight Group Holdings | 214.535 | 0,27 |
| 605.891 | Renewables Infrastructure Group Ltd/The | 967.377 | 1,24 |
| Luxemburg - 350.668 | | | |
| (31. Dezember 2020: 176.730) | | | |
| 167.535 | BBGI Global Infrastructure SA | 350.668 | 0,45 |
| Vereinigtes Königreich - 2.598.672 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.098.050) | | | |
| 642.240 | BioPharma Credit Plc/The Fund | 549.835 | 0,70 |
| 894.933 | Greencoat UK Wind Plc/Funds | 1.498.125 | 1,91 |
| 394.493 | Sdcl Energy Efficiency Income Trust Plc | 550.712 | 0,70 |
| Gesamtanlagen in Kapitalbeteiligungsinstrumente | | 5.418.755 | 6,91 |
| Optionsscheine | | | |
| Luxemburg - 1.002.608 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | |
| 7.238 | Ensemble Investment Corporation SA (WTS) 27-Oct-2022 | 1.002.608 | 1,28 |
| Vereinigtes Königreich - 2.765.737 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.031.439) | | | |
| 15.177 | Barclays Bank Plc (WTS) 12-Aug-2022 | 1.401.345 | 1,79 |
| 15.177 | Barclays Bank Plc (WTS) 15-Aug-2022 | 1.364.392 | 1,74 |
| Gesamtanlagen in Optionsscheinen | | 3.768.345 | 4,81 |
| Indexoptionen - 618.875 | | | |
| (31. Dezember 2020: 196.328) | | | |
| 18 | CBOE S&P 500 Index Put 17-Mar-2022 4,450.000 | 96.214 | 0,12 |
| 18 | CBOE S&P 500 Index Put 17-Nov-2022 4,500.000 | 423.501 | 0,54 |
| 185 | EURO STOXX 50 Index Put 18-Mar-2022 3,950.000 | 99.160 | 0,13 |
| Indexoptionen insgesamt | | 618.875 | 0,79 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Zugrunde liegendes Engagement EUR | Beizulegender Zeitwert EUR | Summe Nettovermögen % |
|--|--|-----------------------------------|----------------------------|-----------------------|
| Offene Terminkontrakte - 25.814 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 3.603) | | | | |
| 7 | Nikkei 225 Index Long Futures Contracts Exp Mar-2022 | 1.546,141 | 25.814 | 0,03 |

Offene Terminkontrakte insgesamt 25.814 0,03

Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 53.265 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 678.689) 53.265 0,07

Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt 65.642.151 83,73

| Bestände | Beschreibung | Zugrunde liegendes Engagement EUR | Beizulegender Zeitwert EUR | Summe Nettovermögen % |
|--------------------------------------|---|-----------------------------------|----------------------------|-----------------------|
| Indexoptionen - (431.344) | | | | |
| (31. Dezember 2020: (91.148)) | | | | |
| (18) | CBOE S&P 500 Index Put 17-Mar-2022 4,250.000 | | (61.386) | (0,08) |
| (18) | CBOE S&P 500 Index Put 17-Nov-2022 4,200.000 | | (307.058) | (0,39) |
| (185) | EURO STOXX 50 Index Put 18-Mar-2022 3,750.000 | | (62.900) | (0,08) |

Indexoptionen insgesamt (431.344) (0,55)

| Bestände | Beschreibung | Zugrunde liegendes Engagement EUR | Beizulegender Zeitwert EUR | Summe Nettovermögen % |
|--|---|-----------------------------------|----------------------------|-----------------------|
| Offene Terminkontrakte - (53.523) | | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | | |
| (13) | E-mini S&P 500 Index Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (2.740.612) | (53.523) | (0,07) |

Offene Terminkontrakte insgesamt (53.523) (0,07)

Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (993.467) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (204.318)) (993.467) (1,27)

Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt (1.478.334) (1,89)

Nettoumlaufvermögen 14.232.986 18,16

Summe Nettovermögen 78.396.803 100,00

Der Kontrahent für Indexoptionen ist die UBS AG.
Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist die UBS AG.

Portfolioanalyse % des Gesamtvermögens

| | |
|--|---------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 81,22 |
| An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente | 0,81 |
| Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate) | 0,07 |
| Sonstiges Umlaufvermögen | 17,90 |
| Gesamtvermögen | 100,00 |

Devisenterminkontrakte

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

BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund

| | | | | | | |
|-------------------|-----------------|------------|------------|-------------|------------------------|--------|
| Euro | Pfund Sterling | 300.216 | 252.194 | 14. Jan. 22 | UBS AG | 18 |
| Euro | Pfund Sterling | 6.423 | 5.395 | 14. Jan. 22 | Royal Bank of Scotland | 1 |
| Indische Rupie | US-Dollar | 79.469.294 | 1.055.986 | 14. Jan. 22 | State Street Bank | 10.463 |
| Pfund Sterling | Euro | 404.774 | 475.023 | 14. Jan. 22 | Canadian Imperial Bank | 6.798 |
| Pfund Sterling | Euro | 87.971 | 103.354 | 14. Jan. 22 | Royal Bank of Scotland | 1.361 |
| Euro | Japanischer Yen | 37.891 | 4.867.500 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 555 |
| Euro | Japanischer Yen | 9.860 | 1.265.985 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | 149 |
| Euro | Japanischer Yen | 552.994 | 71.428.046 | 18. Feb. 22 | Canadian Imperial Bank | 5.106 |
| Euro | US-Dollar | 17.871 | 20.193 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 47 |
| Euro | US-Dollar | 102.863 | 116.315 | 18. Feb. 22 | Canadian Imperial Bank | 190 |
| Hongkong-Dollar | Euro | 960.613 | 108.612 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | 131 |
| Schweizer Franken | Euro | 34.559 | 33.007 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 445 |
| Schweizer Franken | Euro | 81.756 | 77.928 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 1.207 |
| Schweizer Franken | Euro | 53.375 | 50.931 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | 733 |
| Schweizer Franken | Euro | 87.596 | 83.649 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | 1.139 |
| Schweizer Franken | Euro | 158.133 | 151.074 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 1.990 |
| Schweizer Franken | Euro | 58.405 | 55.470 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 1.063 |
| Schweizer Franken | Euro | 105.424 | 100.027 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 2.018 |
| Schweizer Franken | Euro | 59.156 | 56.187 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | 1.073 |
| Schweizer Franken | Euro | 51.301 | 48.599 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 1.057 |
| Schweizer Franken | Euro | 70.671 | 67.036 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | 1.369 |
| Schweizer Franken | Euro | 60.536 | 57.369 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 1.226 |
| Schweizer Franken | Euro | 59.912 | 56.644 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 1.348 |
| Schweizer Franken | Euro | 60.372 | 57.063 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | 1.374 |
| Schweizer Franken | Euro | 125.650 | 119.587 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 2.036 |
| Schweizer Franken | Euro | 103.485 | 99.057 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 1.111 |
| US-Dollar | Euro | 332.063 | 291.176 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | 1.941 |

EUR 45.949

| | | | | | | |
|----------------------|-------------------|------------|-------------|-------------|----------------------------------|-----------|
| Euro | Pfund Sterling | 139.845 | 119.073 | 14. Jan. 22 | Barclays Bank PLC | (1.893) |
| Euro | Pfund Sterling | 297.864 | 254.166 | 14. Jan. 22 | Royal Bank of Scotland | (4.681) |
| Euro | Pfund Sterling | 87.908 | 74.743 | 14. Jan. 22 | State Street Bank | (1.062) |
| Euro | Pfund Sterling | 227.670 | 193.887 | 14. Jan. 22 | Canadian Imperial Bank | (3.123) |
| Euro | Pfund Sterling | 14.253 | 12.113 | 14. Jan. 22 | Barclays Bank PLC | (165) |
| Euro | Pfund Sterling | 13.280 | 11.301 | 14. Jan. 22 | Barclays Bank PLC | (172) |
| Euro | Pfund Sterling | 7.223 | 6.143 | 14. Jan. 22 | Barclays Bank PLC | (89) |
| Euro | Pfund Sterling | 14.658.225 | 12.510.429 | 14. Jan. 22 | Royal Bank of Scotland | (233.503) |
| Euro | Pfund Sterling | 57.857 | 48.621 | 14. Jan. 22 | Royal Bank of Scotland | (18) |
| Euro | Pfund Sterling | 79.432 | 66.787 | 14. Jan. 22 | State Street Bank | (67) |
| Euro | Pfund Sterling | 12.243 | 10.315 | 14. Jan. 22 | Canadian Imperial Bank | (36) |
| Euro | Pfund Sterling | 16.443 | 13.930 | 14. Jan. 22 | Canadian Imperial Bank | (138) |
| Euro | Pfund Sterling | 45.531 | 38.601 | 14. Jan. 22 | Canadian Imperial Bank | (418) |
| Euro | Pfund Sterling | 56.796 | 48.361 | 14. Jan. 22 | Royal Bank of Scotland | (770) |
| Euro | Pfund Sterling | 315.948 | 269.390 | 14. Jan. 22 | State Street Bank | (4.719) |
| Euro | Pfund Sterling | 34.761 | 29.307 | 14. Jan. 22 | State Street Bank | (124) |
| Euro | Pfund Sterling | 495.240 | 424.827 | 14. Jan. 22 | Royal Bank of Scotland | (10.451) |
| Schwedische Krone | Euro | 9.925.008 | 978.654 | 14. Jan. 22 | Royal Bank of Scotland | (11.023) |
| US-Dollar | Indische Rupie | 209.729 | 15.963.334 | 14. Jan. 22 | State Street Bank | (4.214) |
| US-Dollar | Indische Rupie | 839.904 | 63.505.960 | 14. Jan. 22 | State Street Bank | (11.861) |
| Australischer Dollar | US-Dollar | 1.283.366 | 950.647 | 18. Feb. 22 | Canadian Imperial Bank | (17.738) |
| Euro | Hongkong-Dollar | 2.223.662 | 20.069.646 | 18. Feb. 22 | Citigroup Global Markets Limited | (48.257) |
| Euro | Japanischer Yen | 2.101.138 | 275.910.236 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (15.225) |
| Euro | Schweizer Franken | 169.064 | 175.906 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (1.202) |
| Euro | Schweizer Franken | 130.974 | 136.163 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (823) |
| Euro | Schweizer Franken | 2.503.560 | 2.648.819 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | (60.342) |
| Euro | US-Dollar | 164.455 | 187.214 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | (802) |
| Euro | US-Dollar | 6.727 | 7.650 | 18. Feb. 22 | Canadian Imperial Bank | (26) |
| Euro | US-Dollar | 25.210 | 28.574 | 18. Feb. 22 | Canadian Imperial Bank | (13) |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte Forts.

| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|--|-----------|-------------|------------|------------------|------------------------|-------------------------------------|
| BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund Forts. | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 153.548 | 174.610 | 18. Feb. 22 | Canadian Imperial Bank | (584) |
| Euro | US-Dollar | 79.344 | 91.054 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | (1.031) |
| Euro | US-Dollar | 150.788 | 172.963 | 18. Feb. 22 | Canadian Imperial Bank | (1.889) |
| Euro | US-Dollar | 15.753 | 18.080 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | (207) |
| Euro | US-Dollar | 21.162 | 24.555 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (514) |
| Euro | US-Dollar | 20.798.968 | 24.145.418 | 18. Feb. 22 | Barclays Bank PLC | (514.555) |
| Euro | US-Dollar | 45.367 | 51.438 | 18. Feb. 22 | UBS AG | (39) |
| Hongkong-Dollar | Euro | 165.413 | 18.728 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | (3) |
| Hongkong-Dollar | Euro | 238.322 | 26.989 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | (10) |
| Hongkong-Dollar | Euro | 262.226 | 29.812 | 18. Feb. 22 | Royal Bank of Scotland | (127) |
| Hongkong-Dollar | Euro | 583.896 | 66.181 | 18. Feb. 22 | Canadian Imperial Bank | (83) |
| Ungarischer Forint | Euro | 507.885.652 | 1.402.120 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (35.982) |
| Japanischer Yen | Euro | 15.686.208 | 122.412 | 18. Feb. 22 | State Street Bank | (2.091) |
| | | | | | | EUR (990.070) |

BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)

| | | | | | | |
|----------------|----------------|---------|---------|-------------|-----------------------------|------------------|
| Pfund Sterling | Euro | 2.432 | 2.890 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 5 |
| Pfund Sterling | Euro | 1.759 | 2.084 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 9 |
| Pfund Sterling | Euro | 312.568 | 365.209 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 6.855 |
| Pfund Sterling | Euro | 2.233 | 2.630 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 28 |
| | | | | | | EUR 6.897 |
| | | | | | | GBP 5.793 |
| Euro | Pfund Sterling | 4.178 | 3.572 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (74) |
| Euro | Pfund Sterling | 3.116 | 2.657 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (46) |
| | | | | | | EUR (120) |
| | | | | | | GBP (101) |

BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund Anteilsklasse Sterling W (Inc) (Hedged)

| | | | | | | |
|----------------|----------------|--------|--------|-------------|-----------------------------|----------------|
| Pfund Sterling | Euro | 103 | 123 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - |
| Pfund Sterling | Euro | 75 | 89 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - |
| Pfund Sterling | Euro | 13.278 | 15.514 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 291 |
| Pfund Sterling | Euro | 95 | 112 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1 |
| | | | | | | EUR 292 |
| | | | | | | GBP 245 |
| Euro | Pfund Sterling | 177 | 152 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (3) |
| Euro | Pfund Sterling | 132 | 113 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (2) |
| | | | | | | EUR (5) |
| | | | | | | GBP (4) |

BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund Anteilsklasse USD E (Acc) (Hedged)

| | | | | | | |
|-----------|-----------|--------|--------|-------------|-----------------------------|----|
| Euro | US-Dollar | 15.274 | 12.268 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 21 |
| Euro | US-Dollar | 11.818 | 13.331 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 42 |
| US-Dollar | Euro | 12.419 | 10.951 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 19 |

Devisenterminkontrakte Forts.

| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|---|---------|------------|------------|------------------|-----------------------------|-------------------------------------|
| BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund Anteilsklasse USD E (Acc) (Hedged) Forts. | | | | | | |
| US-Dollar | Euro | 11.530 | 10.176 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 9 |
| | | | | | | EUR 91 |
| | | | | | | USD 103 |
| US-Dollar | Euro | 9.003 | 7.956 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (3) |
| US-Dollar | Euro | 1.579.650 | 1.398.422 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (3.074) |
| | | | | | | EUR (3.077) |
| | | | | | | USD (3.483) |

BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund Anteilsklasse USD W (Acc) (Hedged)

| | | | | | | |
|-----------|-----------|--------|--------|-------------|-----------------------------|------------------|
| Euro | US-Dollar | 21.663 | 24.487 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 28 |
| Euro | US-Dollar | 695 | 786 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1 |
| Euro | US-Dollar | 487 | 550 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 2 |
| US-Dollar | Euro | 681 | 600 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1 |
| US-Dollar | Euro | 494 | 437 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - |
| US-Dollar | Euro | 7.280 | 6.426 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 4 |
| US-Dollar | Euro | 613 | 541 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | - |
| | | | | | | EUR 36 |
| | | | | | | USD 41 |
| US-Dollar | Euro | 24.487 | 21.660 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (30) |
| US-Dollar | Euro | 57.550 | 50.948 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (112) |
| US-Dollar | Euro | 8.442 | 7.477 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (19) |
| US-Dollar | Euro | 8.670 | 7.688 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (29) |
| US-Dollar | Euro | 4.707 | 4.162 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (5) |
| | | | | | | EUR (195) |
| | | | | | | USD (221) |

BNY MELLON TARGETED RETURN BOND FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Nettovermögen % | Summe |
|--|--|----------------------------|-----------------|-------|
| Anleihen | | | | |
| Belgien - 150.744 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 388.766) | | | | |
| 100.000 | Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN' 3.700% 02-Apr-2040 | 150.744 | 0,16 | |
| Brasilien - 756.534 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 663.809) | | | | |
| 200.000 | Braskem Netherlands Finance BV 'REGS' 5.875% 31-Jan-2050 | 233.431 | 0,26 | |
| 200.000 | MARB BondCo Plc 'REGS' 3.950% 29-Jan-2031 | 191.576 | 0,21 | |
| 300.000 | MARB BondCo Plc 'REGS' 3.950% 29-Jan-2031 | 287.364 | 0,31 | |
| 38.000 | Vale Overseas Ltd 6.250% 10-Aug-2026 | 44.163 | 0,05 | |
| Kanada - 879.265 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 493.810) | | | | |
| 140.000 | Canadian Government Bond 1.250% 01-Jun-2030 | 108.913 | 0,12 | |
| 280.000 | Canadian Imperial Bank of Commerce 0.450% 22-Jun-2023 | 278.215 | 0,30 | |
| 65.000 | Nutrien Ltd 1.900% 13-May-2023 | 65.851 | 0,07 | |
| 425.000 | Toronto-Dominion Bank/The 'MTN' FRN 0.530% 27-Jan-2023 | 426.286 | 0,47 | |
| Kaiman-Inseln - 2.850.497 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.550.000) | | | | |
| 475.000 | AIMCO CLO Series 2017-A '2017-AXAR' FRN 1.182% 20-Apr-2034 | 475.356 | 0,52 | |
| 450.000 | Allegro CLO XII Ltd '2020-1X B' FRN 1.830% 21-Jan-2032 | 450.355 | 0,49 | |
| 450.000 | Bain Capital Credit CLO 2020-5 Ltd '2020-5X B1' FRN 1.682% 20-Jan-2032 | 449.063 | 0,49 | |
| 475.000 | Invesco CLO Ltd '2021-1X A1' FRN 1.124% 15-Apr-2034 | 475.063 | 0,52 | |
| 250.000 | Neuberger Berman Loan Advisers Clo 40 Ltd '2021-40X A' FRN 1.182% 16-Apr-2033 | 250.348 | 0,27 | |
| 350.000 | RIN IV Ltd '2021-1X A' FRN 1.432% 20-Apr-2033 | 349.685 | 0,38 | |
| 400.000 | Symphony CLO XXIV Ltd '2020-24X A' FRN 1.324% 23-Jan-2032 | 400.627 | 0,44 | |
| Chile - 207.364 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 469.449) | | | | |
| 203.000 | VTR Comunicaciones SpA 'REGS' 5.125% 15-Jan-2028 | 207.364 | 0,23 | |
| China - 221.938 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 884.468) | | | | |
| 225.000 | Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd 'REGS' 2.300% 08-Jan-2031 | 221.938 | 0,24 | |
| Kolumbien - 354.011 | | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | | |
| 375.000 | Ecopetrol SA 5.875% 02-Nov-2051 | 354.011 | 0,39 | |
| Elfenbeinküste - 147.434 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 676.544) | | | | |
| 135.000 | Ivory Coast Government International Bond 'REGS' 4.875% 30-Jan-2032 | 147.434 | 0,16 | |
| Ägypten - 207.501 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 697.477) | | | | |
| 225.000 | Egypt Government International Bond 'REGS' 7.300% 30-Sep-2033 | 207.501 | 0,23 | |
| Frankreich - 2.920.424 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.823.201) | | | | |
| 250.000 | Airbus SE 'EMTN' 2.375% 09-Jun-2040 | 318.015 | 0,35 | |
| 475.000 | BNP Paribas SA 'REGS' FRN 4.375% 01-Mar-2033 | 515.662 | 0,56 | |
| 250.000 | Credit Agricole SA 'REGS' 3.250% 14-Jan-2030 | 259.151 | 0,28 | |
| 400.000 | Electricité de France SA FRN (Perpetual) 2.625% 01-Dec-2027 | 457.268 | 0,50 | |
| 100.000 | Engie SA 'EMTN' 1.750% 27-Mar-2028 | 122.183 | 0,13 | |
| 100.000 | Orange SA 'EMTN' 1.625% 07-Apr-2032 | 123.520 | 0,13 | |
| 100.000 | Orano SA 'EMTN' 4.875% 23-Sep-2024 | 125.886 | 0,14 | |
| 500.000 | Sanofi 'EMTN' 1.500% 01-Apr-2030 | 617.784 | 0,68 | |
| Anleihen Forts. | | | | |
| Frankreich Forts. | | | | |
| 300.000 | TotalEnergies Capital International SA 'EMTN' 1.994% 08-Apr-2032 | 380.955 | 0,42 | |
| Deutschland - 12.647.302 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 10.037.598) | | | | |
| 4.225.000 | Bundessobligation 0.000% 05-Apr-2024 | 4.857.146 | 5,31 | |
| 750.000 | Bundessobligation 0.000% 10-Oct-2025 | 868.158 | 0,95 | |
| 3.550.000 | Bundessobligation 0.000% 10-Apr-2026 | 4.105.140 | 4,48 | |
| 2.250.000 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15-Aug-2031 | 2.590.122 | 2,83 | |
| 200.000 | Siemens Financieringsmaatschappij NV 'EMTN' 0.250% 20-Feb-2029 | 226.736 | 0,25 | |
| Ghana - 183.429 | | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | | |
| 225.000 | Ghana Government International Bond 'REGS' 8.625% 07-Apr-2034 | 183.429 | 0,20 | |
| Ungarn - 348.077 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 777.993) | | | | |
| 225.000 | Hungary Government International Bond 1.625% 28-Apr-2032 | 266.198 | 0,29 | |
| 50.000 | Hungary Government International Bond 7.625% 29-Mar-2041 | 81.879 | 0,09 | |
| Indonesien - 434.327 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 484.752) | | | | |
| 400.000 | Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 'REGS' 1.875% 05-Nov-2031 | 434.327 | 0,47 | |
| Irland - 578.681 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 362.735) | | | | |
| 570.000 | AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 3.000% 29-Oct-2028 | 578.681 | 0,63 | |
| Italien - 3.752.041 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 6.547.029) | | | | |
| 400.000 | Enel Finance International NV 'EMTN' 0.375% 17-Jun-2027 | 451.137 | 0,49 | |
| 2.900.000 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.350% 15-Apr-2022 | 3.300.904 | 3,61 | |
| Japan - 1.509.401 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 174.711) | | | | |
| 167.500.000 | Japan Government Thirty Year Bond 0.400% 20-Mar-2050 | 1.356.223 | 1,48 | |
| 125.000 | Takeda Pharmaceutical Co Ltd 2.000% 09-Jul-2040 | 153.178 | 0,17 | |
| Kuwait - 200.754 | | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | | | |
| 200.000 | Equate Petrochemical BV 'REGS' 2.625% 28-Apr-2028 | 200.754 | 0,22 | |
| Mexiko - 4.465.671 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.709.248) | | | | |
| 700.000 | Alsea SAB de CV 'REGS' 7.750% 14-Dec-2026 | 725.322 | 0,79 | |
| 150.000 | Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand 'REGS' 5.375% 17-Apr-2025 | 164.160 | 0,18 | |
| 200.000 | Braskem Idesa SAPI 'REGS' 6.990% 20-Feb-2032 | 201.080 | 0,22 | |
| 57.500.000 | Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031 | 2.845.846 | 3,11 | |
| 523.000 | Petroleos Mexicanos 6.700% 16-Feb-2032 | 529.263 | 0,58 | |
| Niederlande - 639.784 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 828.181) | | | | |
| 200.000 | ING Groep NV 'EMTN' FRN 3.000% 11-Apr-2028 | 234.463 | 0,26 | |
| 325.000 | Shell International Finance BV 'EMTN' 1.875% 07-Apr-2032 | 405.321 | 0,44 | |
| Philippinen - 591.658 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.109.890) | | | | |
| 350.000 | Philippine Government International Bond 0.000% 03-Feb-2023 | 395.450 | 0,43 | |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|---|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Philippinen Forts. | | | |
| 175.000 | Philippine Government International Bond 0.700% 03-Feb-2029 | 196.208 | 0,22 |
| Katar - 471.144 | | | |
| (31. Dezember 2020: 530.249) | | 471.144 | 0,51 |
| 475.000 | Qatar Energy 'REGS' 2.250% 12-Jul-2031 | 471.144 | 0,51 |
| Republik Korea - 1.031.512 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | 1.031.512 | 1,13 |
| 1.349.400.000 | Korea Treasury Bond 1.875% 10-Mar-2051 | 1.031.512 | 1,13 |
| Republik Serbien - 496.912 | | | |
| (31. Dezember 2020: 716.795) | | 496.912 | 0,54 |
| 275.000 | Serbia International Bond 'REGS' 2.050% 23-Sep-2036 | 285.448 | 0,31 |
| 175.000 | Serbia International Bond 'REGS' 3.125% 15-May-2027 | 211.464 | 0,23 |
| Rumänien - 285.433 | | | |
| (31. Dezember 2020: 638.292) | | 285.433 | 0,31 |
| 100.000 | Romanian Government International Bond 'REGS' 2.750% 14-Apr-2041 | 101.242 | 0,11 |
| 150.000 | Romanian Government International Bond 'REGS' 3.624% 26-May-2030 | 184.191 | 0,20 |
| Russland - 1.451.277 | | | |
| (31. Dezember 2020: 2.385.813) | | 1.451.277 | 1,59 |
| 113.000.000 | Russian Federal Bond - OFZ 7.650% 10-Apr-2030 | 1.451.277 | 1,59 |
| Senegal - 268.829 | | | |
| (31. Dezember 2020: 224.595) | | 268.829 | 0,29 |
| 250.000 | Senegal Government International Bond 'REGS' 5.375% 08-Jun-2037 | 268.829 | 0,29 |
| Südafrika - 205.174 | | | |
| (31. Dezember 2020: 1.769.294) | | 205.174 | 0,22 |
| 175.000 | Anglo American Capital Plc 'EMTN' 1.625% 11-Mar-2026 | 205.174 | 0,22 |
| Spanien - 1.306.577 | | | |
| (31. Dezember 2020: 2.124.063) | | 1.306.577 | 1,43 |
| 100.000 | Adif Alta Velocidad 'EMTN' 0.550% 30-Apr-2030 | 114.139 | 0,13 |
| 300.000 | Iberdrola Finanzas SA 'EMTN' 0.875% 16-Jun-2025 | 349.419 | 0,38 |
| 275.000 | Lorca Telecom Bondco SA 'REGS' 4.000% 18-Sep-2027 | 317.886 | 0,35 |
| 400.000 | Repsol International Finance BV 'EMTN' 2.625% 15-Apr-2030 | 525.133 | 0,57 |
| Supranational - 658.342 | | | |
| (31. Dezember 2020: -) | | 658.342 | 0,72 |
| 200.000 | Africa Finance Corp 'REGS' 2.875% 28-Apr-2028 | 198.730 | 0,22 |
| 450.000 | African Export-Import Bank/The 'REGS' 3.798% 17-May-2031 | 459.612 | 0,50 |
| Vereinigte Arabische Emirate - 421.836 | | | |
| (31. Dezember 2020: 428.718) | | 421.836 | 0,46 |
| 200.000 | Abu Dhabi Government International Bond 'REGS' 2.125% 30-Sep-2024 | 204.935 | 0,22 |
| 200.000 | DP World Salaam FRN (Perpetual) 6.000% 01-Oct-2025 | 216.901 | 0,24 |
| Vereinigtes Königreich - 5.834.577 | | | |
| (31. Dezember 2020: 3.659.763) | | 5.834.577 | 6,38 |
| 80.000 | Astrazeneca Finance LLC 2.250% 28-May-2031 | 80.648 | 0,09 |
| 150.000 | AstraZeneca Plc 3.000% 28-May-2051 | 157.175 | 0,17 |
| 375.000 | BAT International Finance Plc 'EMTN' 2.250% 16-Jan-2030 | 442.851 | 0,48 |
| 375.000 | BP Capital Markets Plc 2.822% 07-Apr-2032 | 501.935 | 0,55 |
| 325.000 | BP Capital Markets Plc FRN (Perpetual) 3.625% 22-Mar-2029 | 396.084 | 0,43 |
| 241.056 | Brass No 10 Plc FRN 0.669% 16-Apr-2069 | 239.927 | 0,26 |
| 400.000 | British American Tobacco Plc FRN (Perpetual) 3.000% 27-Sep-2026 | 444.256 | 0,49 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|--|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Vereinigtes Königreich Forts. | | | |
| 352.150 | Gemgarto 2021-1 Plc '2021-1X A' FRN 0.639% 16-Dec-2067 | 475.178 | 0,52 |
| 400.000 | Hammerson Ireland Finance DAC 1.750% 03-Jun-2027 | 445.981 | 0,49 |
| 180.000 | Unilever Finance Netherlands BV 1.750% 25-Mar-2030 | 224.770 | 0,25 |
| 1.925.000 | United Kingdom Gilt 0.250% 31-Jul-2031 | 2.425.772 | 2,65 |
| Vereinigte Staaten von Amerika - 44.439.072 | | | |
| (31. Dezember 2020: 40.207.176) | | 44.439.072 | 48,56 |
| 400.000 | 7-Eleven Inc 'REGS' 2.800% 10-Feb-2051 | 370.863 | 0,41 |
| 225.000 | Air Lease Corp 3.375% 01-Jul-2025 | 234.973 | 0,26 |
| 130.000 | Air Lease Corp 'MTN' 2.875% 15-Jan-2026 | 134.211 | 0,15 |
| 120.000 | Ally Financial Inc 5.750% 20-Nov-2025 | 135.474 | 0,15 |
| 300.000 | Ally Financial Inc FRN (Perpetual) 4.700% 15-May-2026 | 312.187 | 0,34 |
| 100.000 | AT&T Inc 2.050% 19-May-2032 | 123.155 | 0,13 |
| 100.000 | AT&T Inc 2.350% 05-Sep-2029 | 126.073 | 0,14 |
| 425.000 | AT&T Inc 2.750% 01-Jun-2031 | 433.130 | 0,47 |
| 175.000 | Bank of America Corp FRN 3.366% 23-Jan-2026 | 184.234 | 0,20 |
| 135.000 | Bank of America Corp FRN (Perpetual) 5.125% 20-Jun-2024 | 141.328 | 0,15 |
| 140.000 | Bank of America Corp FRN (Perpetual) 6.250% 05-Sep-2024 | 150.762 | 0,16 |
| 200.000 | Berkshire Hathaway Inc 0.000% 12-Mar-2025 | 226.119 | 0,25 |
| 125.000 | Berry Global Inc 1.570% 15-Jan-2026 | 122.329 | 0,13 |
| 225.000 | Cameron LNG LLC 'REGS' 2.902% 15-Jul-2031 | 234.543 | 0,26 |
| 475.000 | Capital One Financial Corp FRN 2.359% 29-Jul-2032 | 450.188 | 0,49 |
| 155.000 | Carrier Global Corp 2.493% 15-Feb-2027 | 159.352 | 0,17 |
| 50.000 | Carrier Global Corp 2.722% 15-Feb-2030 | 51.118 | 0,06 |
| 375.000 | CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 4.500% 15-Aug-2030 | 386.719 | 0,42 |
| 79.000 | CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 'REGS' 4.500% 15-Aug-2030 | 81.054 | 0,09 |
| 135.000 | Centene Corp 3.000% 15-Oct-2030 | 137.259 | 0,15 |
| 85.000 | Centene Corp 3.375% 15-Feb-2030 | 87.054 | 0,10 |
| 40.000 | Centene Corp 3.375% 15-Feb-2030 | 40.967 | 0,04 |
| 125.000 | Cheniere Energy Inc 4.625% 15-Oct-2028 | 133.180 | 0,15 |
| 170.000 | Cheniere Energy Partners LP 4.000% 01-Mar-2031 | 178.744 | 0,20 |
| 200.000 | CIT Group Inc 6.125% 09-Mar-2028 | 241.776 | 0,26 |
| 400.000 | Citigroup Inc FRN (Perpetual) 4.000% 10-Dec-2025 | 404.000 | 0,44 |
| 150.000 | Comcast Corp 0.750% 20-Feb-2032 | 169.205 | 0,19 |
| 135.000 | Crown Americas LLC / Crown Americas Capital Corp VI 4.750% 01-Feb-2026 | 138.553 | 0,15 |
| 225.000 | CVS Health Corp 2.625% 15-Aug-2024 | 233.102 | 0,25 |
| 315.000 | CyrusOne LP / CyrusOne Finance Corp 1.450% 22-Jan-2027 | 362.926 | 0,40 |
| 100.000 | Danaher Corp 2.500% 30-Mar-2030 | 129.758 | 0,14 |
| 200.000 | DataBank Issuer '2021-1X A2' 2.060% 27-Feb-2051 | 196.659 | 0,21 |
| 490.000 | DaVita Inc 'REGS' 3.750% 15-Feb-2031 | 476.525 | 0,52 |
| 200.000 | Dell International LLC / EMC Corp 6.020% 15-Jun-2026 | 231.247 | 0,25 |
| 250.000 | Diamondback Energy Inc 3.125% 24-Mar-2031 | 257.882 | 0,28 |
| 225.000 | Diamondback Energy Inc 3.250% 01-Dec-2026 | 237.385 | 0,26 |
| 200.000 | Digital Dutch Finco BV 1.500% 15-Mar-2030 | 235.014 | 0,26 |
| 425.000 | Edison International 3.550% 15-Nov-2024 | 446.440 | 0,49 |
| 365.000 | Elanco Animal Health Inc 5.900% 28-Aug-2028 | 426.338 | 0,47 |
| 175.000 | Eli Lilly & Co 1.375% 14-Sep-2061 | 181.265 | 0,20 |
| 175.000 | Energy Transfer LP 4.000% 01-Oct-2027 | 188.189 | 0,21 |
| 65.000 | Energy Transfer LP 6.250% 15-Apr-2049 | 84.415 | 0,09 |
| 225.000 | Energy Transfer LP FRN (Perpetual) 6.250% 15-Feb-2023 | 196.045 | 0,21 |
| 175.000 | Enterprise Products Operating LLC 2.800% 31-Jan-2030 | 182.820 | 0,20 |
| 235.000 | EQT Corp 3.000% 01-Oct-2022 | 237.382 | 0,26 |
| 475.000 | EQT Corp 'REGS' 3.125% 15-May-2026 | 488.188 | 0,53 |
| 180.000 | Exelon Generation Co LLC 3.250% 01-Jun-2025 | 189.036 | 0,21 |
| 70.000 | Exxon Mobil Corp 4.227% 19-Mar-2040 | 82.555 | 0,09 |
| 1.350.000 | Fannie Mae or Freddie Mac '2.0 1/2' TBA 2.000% 31-Dec-2049 | 1.380.533 | 1,51 |
| 1.875.000 | Fannie Mae or Freddie Mac '2.0 1/2' TBA 2.000% 31-Dec-2049 | 1.865.405 | 2,04 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % |
|--|--|----------------------------|-----------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika Forts. | | | |
| 2.250.000 | Fannie Mae or Freddie Mac '2.5 1/22' TBA 2.500% 31-Dec-2049 | 2.292.187 | 2,50 |
| 1.600.000 | Fannie Mae or Freddie Mac '3.0 1/22' TBA 3.000% 31-Dec-2049 | 1.654.687 | 1,81 |
| 406.861 | Fannie Mae Pool 'BQ7549' 2.000% 01-Nov-2050 | 405.533 | 0,44 |
| 250.000 | First Republic Bank/CA 'BKNT' FRN 1.912% 12-Feb-2024 | 253.082 | 0,28 |
| 225.000 | Florida Power & Light Co 2.850% 01-Apr-2025 | 235.503 | 0,26 |
| 425.000 | Ford Credit Auto Lease Trust 2020-A '2020-A B' 2.050% 15-Jun-2023 | 428.167 | 0,47 |
| 150.000 | Ford Motor Co 3.250% 12-Feb-2032 | 154.050 | 0,17 |
| 175.000 | Ford Motor Co 4.750% 15-Jan-2043 | 193.686 | 0,21 |
| 382.981 | Freddie Mac Pool 'QB6059' 2.000% 01-Dec-2050 | 381.480 | 0,42 |
| 685.723 | Freddie Mac Pool 'RA3605' 2.500% 01-Oct-2050 | 700.204 | 0,77 |
| 281.190 | Freddie Mac REMICS 4.000% 15-Mar-2036 | 297.205 | 0,32 |
| 225.000 | General Electric Co FRN (Perpetual) 3.533% 15-Mar-2022 | 223.875 | 0,24 |
| 200.000 | General Motors Co 5.400% 02-Oct-2023 | 214.172 | 0,23 |
| 200.000 | GLP Capital LP / GLP Financing III Inc 5.375% 15-Apr-2026 | 222.974 | 0,24 |
| 225.000 | Goldman Sachs Group Inc/The 3.500% 16-Nov-2026 | 239.978 | 0,26 |
| 128.000 | HCA Inc 3.500% 01-Sep-2030 | 134.932 | 0,15 |
| 275.000 | HCA Inc 5.875% 01-Feb-2029 | 328.119 | 0,36 |
| 225.000 | Healthcare Trust of America Holdings LP 3.500% 01-Aug-2026 | 240.155 | 0,26 |
| 225.000 | Hewlett Packard Enterprise Co 2.250% 01-Apr-2023 | 228.482 | 0,25 |
| 325.000 | Hilton Domestic Operating Co Inc 'REGS' 3.625% 15-Feb-2032 | 323.680 | 0,35 |
| 475.000 | JBS Finance Luxembourg Sarl 'REGS' 3.625% 15-Jan-2032 | 477.608 | 0,52 |
| 350.000 | John Deere Cash Management SARL 'EMTN' 2.200% 02-Apr-2032 | 458.414 | 0,50 |
| 144.000 | JPMorgan Chase & Co FRN (Perpetual) 5.000% 01-Aug-2024 | 147.690 | 0,16 |
| 250.000 | Keurig Dr Pepper Inc 0.750% 15-Mar-2024 | 248.223 | 0,27 |
| 225.000 | KeyCorp 'MTN' 2.250% 06-Apr-2027 | 228.664 | 0,25 |
| 55.000 | Kraft Heinz Foods Co 3.875% 15-May-2027 | 59.556 | 0,07 |
| 40.000 | Kraft Heinz Foods Co 4.875% 01-Oct-2049 | 50.131 | 0,05 |
| 200.000 | Kraft Heinz Foods Co 4.875% 01-Oct-2049 | 250.654 | 0,27 |
| 155.000 | Lennar Corp 4.750% 29-Nov-2027 | 175.841 | 0,19 |
| 45.000 | Lennar Corp 5.250% 01-Jun-2026 | 50.519 | 0,06 |
| 35.000 | Level 3 Financing Inc 'REGS' 3.750% 15-Jul-2029 | 33.569 | 0,04 |
| 410.000 | Level 3 Financing Inc 'REGS' 4.250% 01-Jul-2028 | 409.738 | 0,45 |
| 200.000 | Marathon Petroleum Corp 3.625% 15-Sep-2024 | 210.602 | 0,23 |
| 14.000 | Marriott International Inc/MD 5.750% 01-May-2025 | 15.754 | 0,02 |
| 325.000 | Marsh & McLennan Cos Inc 3.750% 14-Mar-2026 | 353.017 | 0,39 |
| 50.000 | Mastercard Inc 3.300% 26-Mar-2027 | 54.069 | 0,06 |
| 100.000 | Mastercard Inc 3.350% 26-Mar-2030 | 110.121 | 0,12 |
| 100.000 | Medtronic Global Holdings SCA 0.750% 15-Oct-2032 | 113.322 | 0,12 |
| 365.000 | MetLife Inc 6.400% 15-Dec-2036 | 449.680 | 0,49 |
| 100.000 | MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc 5.625% 01-May-2024 | 106.998 | 0,12 |
| 200.000 | MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc 5.750% 01-Feb-2027 | 225.736 | 0,25 |
| 134.000 | MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc 'REGS' 3.875% 15-Feb-2029 | 141.412 | 0,15 |
| 425.000 | Morgan Stanley FRN 1.102% 29-Apr-2033 | 481.782 | 0,53 |
| 425.000 | Morgan Stanley 'GMTN' FRN 0.749% 20-Jan-2023 | 425.075 | 0,46 |
| 625.000 | Mozart Debt Merger Sub Inc 'REGS' 3.875% 01-Apr-2029 | 623.125 | 0,68 |
| 325.000 | MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 0.993% 15-Oct-2026 | 366.540 | 0,40 |
| 475.000 | NRG Energy Inc 'REGS' 3.625% 15-Feb-2031 | 463.937 | 0,51 |
| 350.000 | Occidental Petroleum Corp 5.500% 01-Dec-2025 | 387.329 | 0,42 |
| 75.000 | Occidental Petroleum Corp 8.875% 15-Jul-2030 | 101.379 | 0,11 |
| 120.000 | Pioneer Natural Resources Co 0.550% 15-May-2023 | 119.572 | 0,13 |
| 90.000 | Pioneer Natural Resources Co 1.900% 15-Aug-2030 | 85.579 | 0,09 |
| 115.000 | Prologis LP 2.250% 15-Apr-2030 | 115.710 | 0,13 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % |
|--|---|----------------------------|-----------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika Forts. | | | |
| 425.000 | Prudential Financial Inc FRN 5.625% 15-Jun-2043 | 442.324 | 0,48 |
| 180.000 | Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc 'REGS' 3.625% 01-Mar-2029 | 180.708 | 0,20 |
| 465.000 | Santander Drive Auto Receivables Trust 2021-3 '2021-3 C' 0.950% 15-Sep-2027 | 460.871 | 0,50 |
| 55.000 | SLM Corp 4.200% 29-Oct-2025 | 57.739 | 0,06 |
| 170.000 | Southern Co/The FRN 1.875% 15-Sep-2081 | 186.931 | 0,20 |
| 125.000 | Spirit Realty LP 3.200% 15-Feb-2031 | 129.352 | 0,14 |
| 75.000 | Spirit Realty LP 4.000% 15-Jul-2029 | 82.472 | 0,09 |
| 162.500 | Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC / Sprint Spectrum Co III LLC 'REGS' 4.738% 20-Mar-2025 | 170.229 | 0,19 |
| 200.000 | Stellantis Finance US Inc 'REGS' 2.691% 15-Sep-2031 | 196.890 | 0,22 |
| 235.000 | Taylor Morrison Communities Inc 'REGS' 5.125% 01-Aug-2030 | 261.174 | 0,29 |
| 175.000 | T-Mobile USA Inc 3.500% 15-Apr-2025 | 185.645 | 0,20 |
| 115.000 | T-Mobile USA Inc 3.750% 15-Apr-2027 | 124.553 | 0,14 |
| 130.000 | T-Mobile USA Inc 4.750% 01-Feb-2028 | 137.050 | 0,15 |
| 400.000 | United Rentals North America Inc 4.000% 15-Jul-2030 | 412.926 | 0,45 |
| 2.900.000 | United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 21-Apr-2022 | 2.899.430 | 3,17 |
| 4.300.000 | United States Treasury Note/Bond 0.250% 30-Sep-2023 | 4.270.102 | 4,67 |
| 1.100.000 | United States Treasury Note/Bond 2.000% 15-Aug-2051- | 1.117.961 | 1,22 |
| 500.000 | Verizon Communications Inc 2.100% 22-Mar-2028 | 501.450 | 0,55 |
| 100.000 | Verizon Communications Inc 3.150% 22-Mar-2030 | 105.907 | 0,12 |
| 50.000 | Verizon Communications Inc 4.016% 03-Dec-2029 | 56.000 | 0,06 |
| 129.000 | VICI Properties LP / VICI Note Co Inc 'REGS' 3.500% 15-Feb-2025 | 131.701 | 0,14 |
| 325.000 | VICI Properties LP / VICI Note Co Inc 'REGS' 4.250% 01-Dec-2026 | 338.691 | 0,37 |
| 175.000 | Visa Inc 1.900% 15-Apr-2027 | 177.387 | 0,19 |
| 90.000 | Western Midstream Operating LP 5.300% 01-Dec-2030 | 99.270 | 0,11 |
| 450.000 | World Omni Automobile Lease Securitization Trust 2021-A '2021-A B' 0.750% 16-Nov-2026 | 444.983 | 0,49 |
| 300.000 | WPC Eurobond BV 2.250% 19-Jul-2024 | 356.837 | 0,39 |
| 300.000 | Yum! Brands Inc 4.625% 31-Jan-2032 | 319.333 | 0,35 |

Gesamtanlagen in Anleihen 90.917.522 99,34

| Bestände | Beschreibung | Zugrunde liegendes Engagement USD | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % |
|--|---|-----------------------------------|----------------------------|-----------------------|
| Offene Terminkontrakte - 470.392 | | | | |
| (31. Dezember 2020: 151.689) | | | | |
| (60) | Euro-Bobl Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (9.048.465) | 64.441 | 0,07 |
| (15) | Euro-Buxl 30 Year Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (3.509.981) | 185.724 | 0,20 |
| (39) | Euro-Schatz Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (4.945.247) | 7.251 | 0,01 |
| (4) | Japanese 10 Year Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (5.267.199) | 14.927 | 0,02 |
| 195 | SFE 3 Year Australian Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2022 | 16.137.982 | 22.636 | 0,02 |
| (5) | U.S. 2 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (1.090.625) | 757 | 0,00 |
| (7) | U.S. Treasury Ultra Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (1.368.938) | 4.538 | 0,00 |
| (80) | UK Long Gilt Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (13.466.306) | 170.118 | 0,19 |
| Offene Terminkontrakte insgesamt | | | 470.392 | 0,51 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 1.951.732 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 1.763.033) | | | 1.951.732 | 2,13 |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | | 93.339.646 | 101,98 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Zugrunde liegendes Engagement USD | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % |
|---|--|-----------------------------------|----------------------------|-----------------------|
| Offene Terminkontrakte - (122.825) | | | | |
| (31. Dezember 2020: (48.837)) | | | | |
| (1) | Canadian 10 Year Treasury Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (111.777) | (2.671) | (0,00) |
| 5 | Euro-Bund Long Futures Contracts Exp Mar-2022 | 969.826 | (5.673) | (0,01) |
| 22 | SFE 10 Year Australian Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Mar-2022 | 2.219.720 | (5.381) | (0,01) |
| (94) | U.S. 10 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (12.258.187) | (31.023) | (0,03) |
| (117) | U.S. 5 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (14.146.031) | (48.914) | (0,05) |
| (51) | U.S. Treasury Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (8.153.625) | (29.163) | (0,03) |
| Offene Terminkontrakte insgesamt | | | (122.825) | (0,13) |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (162.053) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (332.738)) | | | (162.053) | (0,17) |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | | (284.878) | (0,30) |
| Kurzfristige Nettoverbindlichkeiten | | | (1.531.655) | (1,68) |
| Summe Nettovermögen | | | 91.523.113 | 100,00 |

- Ein Teil der Beteiligung wird von Goldman Sachs als Sicherheit in Zusammenhang mit vom Fonds gehaltenen Devisenterminkontrakten gehalten. Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist Bank of America Merrill Lynch.

| Portfolioanalyse | % des Gesamtvermögens |
|--|-----------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 91,28 |
| An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente | 0,47 |
| Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate) | 1,96 |
| Sonstiges Umlaufvermögen | 6,29 |
| Gesamtvermögen | 100,00 |

| Devisenterminkontrakte | | | | | | | Nicht realisierter Gewinn/Verlust |
|---|--------------------|------------|---------------|------------------|----------------------------------|--|-----------------------------------|
| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | | |
| BNY Mellon Targeted Return Bond Fund | | | | | | | |
| Australischer Dollar | US-Dollar | 60.000 | 43.444 | 16. Feb. 22 | Barclays Bank PLC | | 61 |
| Kanadischer Dollar | US-Dollar | 140.000 | 109.106 | 16. Feb. 22 | JPMorgan Chase Bank | | 802 |
| US-Dollar | Japanischer Yen | 1.381.391 | 158.509.752 | 16. Feb. 22 | JPMorgan Chase Bank | | 4.018 |
| Indische Rupie | US-Dollar | 28.030.000 | 367.698 | 16. Mrz. 22 | Citigroup Global Markets Limited | | 6.148 |
| Mexikanischer Peso | US-Dollar | 1.693.801 | 80.331 | 16. Mrz. 22 | Barclays Bank PLC | | 1.505 |
| US-Dollar | Ungarischer Forint | 220.793 | 72.420.000 | 16. Mrz. 22 | Barclays Bank PLC | | 733 |
| US-Dollar | Koreanischer Won | 1.050.105 | 1.235.690.000 | 16. Mrz. 22 | Barclays Bank PLC | | 11.804 |
| US-Dollar | Koreanischer Won | 35.964 | 42.790.000 | 16. Mrz. 22 | Goldman Sachs | | 9 |
| US-Dollar | Russischer Rubel | 1.483.404 | 111.730.000 | 16. Mrz. 22 | Barclays Bank PLC | | 12.612 |
| US-Dollar | Taiwan-Dollar | 381.918 | 10.510.000 | 16. Mrz. 22 | Barclays Bank PLC | | 369 |
| USD | | | | | | | 38.061 |
| US-Dollar | Euro | 33.676.386 | 29.740.000 | 16. Feb. 22 | JPMorgan Chase Bank | | (13.850) |
| US-Dollar | Euro | 237.618 | 210.000 | 16. Feb. 22 | Barclays Bank PLC | | (276) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 3.038.352 | 2.265.000 | 16. Feb. 22 | Barclays Bank PLC | | (13.500) |
| US-Dollar | Schwedische Krone | 217.822 | 1.980.000 | 16. Feb. 22 | Barclays Bank PLC | | (769) |
| Ungarischer Forint | US-Dollar | 72.420.000 | 220.921 | 16. Mrz. 22 | Barclays Bank PLC | | (861) |
| US-Dollar | Indische Rupie | 504.184 | 38.560.000 | 16. Mrz. 22 | Citigroup Global Markets Limited | | (10.104) |
| US-Dollar | Mexikanischer Peso | 2.865.261 | 61.843.801 | 16. Mrz. 22 | Barclays Bank PLC | | (122.693) |
| USD | | | | | | | (162.053) |

| BNY Mellon Targeted Return Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged) | | | | | | | |
|--|-----------|------------|------------|-------------|-----------------------------|--|------------------|
| Pfund Sterling | US-Dollar | 67.735.570 | 89.364.687 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 1.913.671 |
| USD | | | | | | | 1.913.671 |
| GBP | | | | | | | 1.420.059 |

BNY MELLON U.S. EQUITY INCOME FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Summe Beizulegender Zeitwert USD | Nettover- mögen % |
|---|-------------------------------------|---|-------------------------|
| Aktien | | | |
| Irland - 6.783.855 | | | |
| (31. Dezember 2020: 7.874.711) | | | |
| 65.573 | Medtronic Plc | 6.783.855 | 2,28 |
| Schweiz - 5.483.006 | | | |
| (31. Dezember 2020: 5.608.112) | | | |
| 28.366 | Chubb Ltd | 5.483.006 | 1,84 |
| Vereinigtes Königreich - 9.364.482 | | | |
| (31. Dezember 2020: 5.536.118) | | | |
| 319.759 | Vodafone Group Plc ADR | 4.772.403 | 1,61 |
| 19.331 | Willis Towers Watson Plc | 4.592.079 | 1,54 |
| Vereinigte Staaten von Amerika - 259.142.915 | | | |
| (31. Dezember 2020: 200.224.743) | | | |
| 104.167 | AbbVie Inc | 14.104.733 | 4,74 |
| 163.161 | AES Corp/The | 3.965.628 | 1,33 |
| 16.935 | Ameriprise Financial Inc | 5.108.527 | 1,72 |
| 20.598 | Applied Materials Inc | 3.240.992 | 1,09 |
| 43.643 | Assurant Inc | 6.802.416 | 2,28 |
| 126.440 | Bank of America Corp | 5.624.683 | 1,89 |
| 105.689 | CF Industries Holdings Inc | 7.480.139 | 2,51 |
| 64.351 | Charles Schwab Corp/The | 5.409.989 | 1,82 |
| 172.411 | Cisco Systems Inc/Delaware | 10.926.547 | 3,67 |
| 136.747 | Clearway Energy Inc | 4.927.678 | 1,66 |
| 12.906 | CME Group Inc | 2.949.086 | 0,99 |
| 94.698 | Comcast Corp | 4.768.044 | 1,60 |
| 51.492 | Comerica Inc | 4.478.774 | 1,50 |
| 29.448 | ConocoPhillips | 2.125.704 | 0,71 |
| 74.094 | Corning Inc | 2.758.890 | 0,93 |
| 98.664 | CVS Health Corp | 10.176.698 | 3,42 |
| 165.588 | Devon Energy Corp | 7.293.323 | 2,45 |
| 20.168 | Eaton Corp Plc | 3.486.341 | 1,17 |
| 13.520 | Eli Lilly & Co | 3.732.940 | 1,25 |
| 140.746 | EQT Corp | 3.071.781 | 1,03 |
| 218.313 | Exelon Corp | 12.618.491 | 4,24 |
| 84.113 | Exxon Mobil Corp | 5.146.454 | 1,73 |
| 122.628 | Freeport-McMoRan Inc | 5.116.653 | 1,72 |
| 70.288 | General Motors Co | 4.120.283 | 1,38 |
| 38.626 | Hess Corp | 2.859.483 | 0,96 |
| 25.282 | Hubbell Inc - Class B | 5.267.125 | 1,77 |
| 119.928 | International Game Technology Plc | 3.467.718 | 1,16 |
| 65.268 | JPMorgan Chase & Co | 10.334.209 | 3,47 |
| 24.287 | L3Harris Technologies Inc | 5.179.081 | 1,74 |
| 120.453 | Marathon Petroleum Corp | 7.707.185 | 2,59 |
| 213.287 | Medical Properties Trust Inc (REIT) | 5.038.905 | 1,69 |
| 50.328 | Merck & Co Inc | 3.857.390 | 1,30 |
| 92.375 | Morgan Stanley | 9.065.683 | 3,04 |
| 95.779 | Newell Brands Inc | 2.091.335 | 0,70 |
| 67.765 | NextEra Energy Partners LP (Units) | 5.720.383 | 1,92 |
| 14.293 | Norfolk Southern Corp | 4.255.312 | 1,43 |
| 14.143 | Northrop Grumman Corp | 5.474.897 | 1,84 |
| 114.339 | Organon & Co | 3.481.623 | 1,17 |
| 13.328 | PepsiCo Inc | 2.315.340 | 0,78 |
| 26.114 | Philip Morris International Inc | 2.480.961 | 0,83 |
| 37.706 | QUALCOMM Inc | 6.898.124 | 2,32 |
| 44.774 | State Street Corp | 4.163.758 | 1,40 |
| 19.309 | UnitedHealth Group Inc | 9.696.787 | 3,26 |
| 202.766 | US Bancorp | 11.388.352 | 3,82 |
| 190.917 | Vistra Corp | 4.348.135 | 1,46 |
| 69.586 | Voya Financial Inc | 4.616.335 | 1,55 |
| Gesamtanlagen in Aktien | | 280.774.258 | 94,30 |

| Bestände | Beschreibung | Summe Beizulegender Zeitwert USD | Nettover- mögen % |
|--|--|---|-------------------------|
| Vorzugsanleihen | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika - 3.992.998 | | | |
| (31. Dezember 2020: 4.225.889) | | | |
| 75.711 | Becton Dickinson and Co - Preferred Stock 6.000% 01-Jun-2023 | 3.992.998 | 1,34 |
| Gesamtanlagen in Vorzugsanleihen | | 3.992.998 | 1,34 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 53.880 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 36.670) | | 53.880 | 0,02 |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | 284.821.136 | 95,66 |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (1.338) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (10.554)) | | (1.338) | (0,00) |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | (1.338) | (0,00) |
| Nettoumlaufvermögen | | 12.932.671 | 4,34 |
| Summe Nettovermögen | | 297.752.469 | 100,00 |

| Portfolioanalyse | % des Gesamtvermögens |
|--|-----------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 95,56 |
| Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate) | 0,02 |
| Sonstiges Umlaufvermögen | 4,42 |
| Gesamtvermögen | 100,00 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Devisenterminkontrakte | | | | | | |
|---|----------------|---------------|---------------|-----------------------|-----------------------------|---|
| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungs- datum | Kontrahent | Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) |
| BNY Mellon U.S. Equity Income Fund Anteilsklasse Sterling E (Inc) (Hedged) | | | | | | |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 22.778 | 30.782 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 48 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 1.623.145 | 2.144.289 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 52.665 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 8.439 | 11.318 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 104 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 13.117 | 17.590 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 165 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 31.390 | 41.842 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 645 |
| Pfund Sterling | US-Dollar | 12.697 | 16.933 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 253 |
| USD | | | | | | 53.880 |
| GBP | | | | | | 39.806 |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 27.079 | 20.446 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (595) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 21.739 | 16.437 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (508) |
| US-Dollar | Pfund Sterling | 10.799 | 8.152 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (235) |
| USD | | | | | | (1.338) |
| GBP | | | | | | (989) |

BNY MELLON U.S. MUNICIPAL INFRASTRUCTURE DEBT FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|--|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen | | | |
| Fördermittel - 35.496.142 | | | |
| (31. Dezember 2020: 21.168.688) | | | |
| 7.240.000 | Massachusetts School Building Authority 2.866% 15-Oct-2031 | 7.591.502 | 0,75 |
| 11.450.000 | Massachusetts School Building Authority 3.395 % 15-Oct-2040 | 11.990.726 | 1,19 |
| 2.110.000 | New Jersey Economic Development Authority 3.620% 15-Jun-2028 | 2.274.717 | 0,23 |
| 3.500.000 | Pasco County School Board 5.000% 01-Aug-2035 | 4.511.622 | 0,45 |
| 7.395.000 | Providence Public Building Authority 5.000% 15-Sep-2039 | 9.127.575 | 0,91 |
| Anleihebank - 28.433.730 | | | |
| (31. Dezember 2020: 8.975.967) | | | |
| 9.890.000 | Indiana Finance Authority 2.672% 01-Jul-2034 | 10.102.585 | 1,00 |
| 8.000.000 | Indianapolis Local Public Improvement Bond Bank 4,000% 01-Jun-2040 | 9.542.200 | 0,95 |
| 1.000.000 | Low Income Investment Fund 3.711% 01-Jul-2029 | 1.065.190 | 0,11 |
| 3.000.000 | Michigan Finance Authority 2.366% 01-Sep-2049 | 3.054.510 | 0,30 |
| 4.500.000 | Michigan Finance Authority 2.988% 01-Sep-2049 | 4.669.245 | 0,46 |
| Dedicated Tax - 163.839.058 | | | |
| (31. Dezember 2020: 80.021.955) | | | |
| 4.000.000 | Alabama Federal Aid Highway Finance Authority 1.856% 01-Sep-2029 | 4.006.160 | 0,40 |
| 1.000.000 | Atlanta & Fulton County Recreation Authority 3.379% 15-Dec-2027 | 1.091.155 | 0,11 |
| 1.330.000 | Brentwood Infrastructure Financing Authority 3.478% 02-Sep-2025 | 1.421.384 | 0,14 |
| 8.750.000 | California Community Choice Financing Authority 4,000% 01-Feb-2052 | 10.637.594 | 1,06 |
| 3.000.000 | Camden County Improvement Authority/The 5,000% 01-Jul-2033 | 3.886.710 | 0,39 |
| 1.000.000 | City of Fort Worth TX 3.755% 01-Mar-2030 | 1.043.925 | 0,10 |
| 2.740.000 | District of Columbia 4.996% 01-Dec-2026 | 3.190.415 | 0,32 |
| 5.000.000 | Inland Valley Development Agency 5.500% 01-Mar-2033 | 5.436.725 | 0,54 |
| 1.000.000 | Kentucky Economic Development Finance Authority 4.021% 01-Dec-2029 | 1.092.140 | 0,11 |
| 1.250.000 | Kentucky Economic Development Finance Authority 4.121% 01-Dec-2030 | 1.371.356 | 0,14 |
| 1.840.000 | Kentucky Economic Development Finance Authority 4.171% 01-Dec-2031 | 2.023.154 | 0,20 |
| 750.000 | Maryland Economic Development Corp 4.580% 01-Jun-2033 | 771.109 | 0,08 |
| 1.000.000 | Maryland Economic Development Corp 4.790% 01-Jun-2038 | 1.031.740 | 0,10 |
| 1.000.000 | Maryland Economic Development Corp 5.050% 01-Jun-2043 | 1.032.600 | 0,10 |
| 1.000.000 | Metropolitan Transportation Authority 5.989% 15-Nov-2030 | 1.245.365 | 0,12 |
| 2.825.000 | Missouri Highway & Transportation Commission 5.445% 01-May-2033 | 3.553.695 | 0,35 |
| 2.000.000 | Nassau County Interim Finance Authority 1.459% 15-Nov-2029 | 1.950.100 | 0,19 |
| 5.000.000 | New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 2.400% 01-Aug-2025 | 5.179.825 | 0,51 |
| 1.000.000 | New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 3.080% 01-Feb-2026 | 1.063.355 | 0,11 |
| 3.235.000 | New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 4.000% 01-Feb-2040 | 3.865.210 | 0,38 |
| 2.000.000 | New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 4.000% 01-Feb-2041 | 2.384.100 | 0,24 |
| 1.470.000 | New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 4.000% 01-Feb-2042 | 1.747.911 | 0,17 |
| 6.000.000 | New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 4.000% 01-May-2043 | 7.017.270 | 0,70 |
| 10.000.000 | New York State Urban Development Corp 2.840% 15-Mar-2032 | 10.370.250 | 1,03 |
| 5.000.000 | New York State Urban Development Corp 2.970% 15-Mar-2034 | 5.193.675 | 0,52 |
| 3.500.000 | New York State Urban Development Corp 3.270% 15-Mar-2028 | 3.771.495 | 0,37 |
| 9.510.000 | New York State Urban Development Corp 4.000% 15-Mar-2046 | 11.074.918 | 1,10 |
| 1.750.000 | New York State Urban Development Corp 5.000% 15-Mar-2036 | 2.274.825 | 0,23 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettover- mögen % |
|--|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Dedicated Tax Forts. | | | |
| 2.685.000 | Pomona Redevelopment Agency Successor Agency 4.506% 01-Feb-2041 | 2.953.661 | 0,29 |
| 1.365.000 | Riverside County Redevelopment Successor Agency 3.000% 01-Oct-2025 | 1.434.506 | 0,14 |
| 1.445.000 | Riverside County Redevelopment Successor Agency 3.125% 01-Oct-2026 | 1.533.066 | 0,15 |
| 1.500.000 | Riverside County Transportation Commission 4.000% 01-Jun-2038 | 1.803.285 | 0,18 |
| 2.000.000 | Sales Tax Securitization Corp 2.225% 01-Jan-2024 | 2.038.600 | 0,20 |
| 3.500.000 | Sales Tax Securitization Corp 4.787% 01-Jan-2048 | 4.465.597 | 0,44 |
| 4.900.000 | San Diego County Regional Transportation Commission 2.063% 01-Apr-2032 | 4.850.755 | 0,48 |
| 2.450.000 | San Diego Redevelopment Agency Successor Agency 3.750% 01-Sep-2031 | 2.710.864 | 0,27 |
| 1.000.000 | San Francisco City & County Redevelopment Agency Successor Agency 3.250% 01-Aug-2029 | 1.067.735 | 0,11 |
| 3.750.000 | San Jose Redevelopment Agency Successor Agency 3.250% 01-Aug-2029 | 3.981.562 | 0,40 |
| 10.000.000 | San Jose Redevelopment Agency Successor Agency 3.375% 01-Aug-2034 | 10.505.350 | 1,04 |
| 5.000.000 | State Board of Administration Finance Corp 1.258% 01-Jul-2025 | 4.977.300 | 0,49 |
| 4.750.000 | State Board of Administration Finance Corp 1.705% 01-Jul-2027 | 4.740.595 | 0,47 |
| 5.000.000 | State Board of Administration Finance Corp 2.154% 01-Jul-2030 | 4.992.050 | 0,50 |
| 1.000.000 | State of Connecticut Special Tax Revenue 5.459% 01-Nov-2030 | 1.183.500 | 0,12 |
| 5.000.000 | State of Illinois Sales Tax Revenue 3.750% 15-Jun-2032 | 5.388.500 | 0,54 |
| 5.675.000 | Village Center Community Development District 4.756% 01-Nov-2029 | 6.483.971 | 0,64 |
| Bildung - 123.768.896 | | | |
| (31. Dezember 2020: 94.564.563) | | | |
| 500.000 | Brazos Higher Education Authority Inc 1.789% 01-Apr-2022 | 501.257 | 0,05 |
| 750.000 | Brazos Higher Education Authority Inc 1.870% 01-Apr-2023 | 756.379 | 0,08 |
| 500.000 | Brazos Higher Education Authority Inc 1.931% 01-Apr-2024 | 504.280 | 0,05 |
| 1.370.000 | California Educational Facilities Authority 3.414% 01-Apr-2031 | 1.454.269 | 0,14 |
| 1.635.000 | California Educational Facilities Authority 3.431% 01-Apr-2030 | 1.706.866 | 0,17 |
| 2.500.000 | Delaware County Authority 5.000% 01-Jul-2042 | 2.731.700 | 0,27 |
| 2.500.000 | Florida Higher Educational Facilities Financial Authority 5.000% 01-Mar-2037 | 2.919.825 | 0,29 |
| 3.000.000 | Harris County Cultural Education Facilities Finance Corp 3.344% 15-Nov-2037 | 3.161.400 | 0,31 |
| 8.500.000 | Illinois Finance Authority 4.000% 01-Apr-2050 | 9.829.315 | 0,98 |
| 1.000.000 | Illinois Finance Authority 5.450% 01-Aug-2038 | 1.166.630 | 0,12 |
| 1.000.000 | Kent State University 2.797% 01-May-2032 | 1.030.945 | 0,10 |
| 1.000.000 | Kentucky Higher Education Student Loan Corp 3.860% 01-Jun-2025 | 1.069.245 | 0,11 |
| 1.000.000 | Kentucky Higher Education Student Loan Corp 3.942% 01-Jun-2026 | 1.082.560 | 0,11 |
| 2.075.000 | Louisiana Public Facilities Authority 5.000% 01-Jul-2042 | 2.403.078 | 0,24 |
| 3.350.000 | Massachusetts Educational Financing Authority 2.305% 01-Jul-2029 | 3.335.059 | 0,33 |
| 2.730.000 | Massachusetts Educational Financing Authority 3.455% 01-Jul-2028 | 2.946.025 | 0,29 |
| 2.110.000 | Massachusetts Educational Financing Authority 3.505% 01-Jul-2029 | 2.294.941 | 0,23 |
| 1.250.000 | Metropolitan Government Nashville & Davidson County Health & Educational Facs Bd 4.409% 01-Oct-2034 | 1.323.975 | 0,13 |
| 5.500.000 | New Jersey Educational Facilities Authority 3.736% 01-Sep-2030 | 5.920.475 | 0,59 |
| 5.000.000 | New York State Dormitory Authority 2.412% 01-Jul-2031 | 5.060.625 | 0,50 |
| 2.385.000 | New York State Dormitory Authority 4.000% 15-Feb-2038 | 2.821.133 | 0,28 |
| 10.000.000 | New York State Dormitory Authority 4.000% 15-Mar-2044 | 11.789.700 | 1,17 |
| 3.370.000 | New York State Dormitory Authority 4.850% 01-Jul-2048 | 3.858.364 | 0,38 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % |
|---|--|----------------------------|-----------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Bildung Forts. | | | |
| 775.000 | Northern Illinois University 4.000% 01-Apr-2037 | 906.630 | 0,09 |
| 1.250.000 | Northern Illinois University 4.000% 01-Apr-2039 | 1.457.144 | 0,14 |
| 2.870.000 | Onondaga Civic Development Corp 5.000% 01-Dec-2029 | 3.743.499 | 0,37 |
| 4.965.000 | Pennsylvania Higher Educational Facilities Authority 4.000% 15-Aug-2044 | 5.808.007 | 0,58 |
| 2.000.000 | Red River Education Finance Corp 2.802% 15-Mar-2033 | 2.074.740 | 0,21 |
| 1.775.000 | Red River Education Finance Corp 2.892% 15-Mar-2034 | 1.840.240 | 0,18 |
| 2.000.000 | Rutgers The State University of New Jersey 2.013% 01-May-2032 | 1.961.100 | 0,19 |
| 4.185.000 | Salvation Army/United States 3.801% 01-Sep-2027 | 4.585.420 | 0,46 |
| 9.500.000 | Santa Monica-Malibu Unified School District 2.944% 01-Aug-2036 | 9.919.235 | 0,98 |
| 2.000.000 | University of California 1.614% 15-May-2030 | 1.941.970 | 0,19 |
| 10.000.000 | University of California 1.997% 15-May-2031 | 9.906.500 | 0,98 |
| 1.100.000 | University of California 3.063% 01-Jul-2025 | 1.169.960 | 0,12 |
| 2.000.000 | University of California 3.349% 01-Jul-2029 | 2.198.810 | 0,22 |
| 1.000.000 | University of Oklahoma/The 3.466% 01-Jul-2028 | 1.099.230 | 0,11 |
| 2.515.000 | University of Pittsburgh-of the Commonwealth System of Higher Education 3.646% 15-Sep-2036 | 2.918.834 | 0,29 |
| 2.500.000 | University of Southern California 3.226% 01-Oct-2120 | 2.569.531 | 0,26 |
| Gesundheitswesen - 103.212.683 (31. Dezember 2020: 88.050.098) | | | |
| 2.750.000 | Adventist Health System/West 2.433% 01-Sep-2024 | 2.792.389 | 0,28 |
| 4.500.000 | Adventist Health System/West 2.952% 01-Mar-2029 | 4.713.408 | 0,47 |
| 1.500.000 | Advocate Health & Hospitals Corp 3.829% 15-Aug-2028 | 1.677.880 | 0,17 |
| 7.600.000 | Ascension Health 3.106% 15-Nov-2039 | 8.110.519 | 0,81 |
| 5.000.000 | Baylor Scott & White Holdings 1.777% 15-Nov-2030 | 4.836.066 | 0,48 |
| 5.000.000 | California Health Facilities Financing Authority 1.979% 01-Jun-2030 | 4.937.150 | 0,49 |
| 5.000.000 | California Health Facilities Financing Authority 2.864% 01-Jun-2031 | 5.233.400 | 0,52 |
| 5.000.000 | City of Chillicothe OH 5.000% 01-Dec-2047 | 5.978.875 | 0,59 |
| 400.000 | City of Tampa FL 4.000% 01-Jul-2038 | 469.392 | 0,05 |
| 2.270.000 | Development Authority for Fulton County 5.000% 01-Apr-2047 | 2.706.612 | 0,27 |
| 1.000.000 | Dignity Health 3.125% 01-Nov-2022 | 1.017.945 | 0,10 |
| 3.500.000 | Geisinger Authority 5.000% 01-Apr-2043 | 4.167.272 | 0,41 |
| 3.775.000 | Illinois Finance Authority 5.000% 15-Nov-2045 | 4.330.001 | 0,43 |
| 1.000.000 | Louisiana Public Facilities Authority 5.000% 15-May-2046 | 1.182.045 | 0,12 |
| 2.000.000 | Maricopa County Special Health Care District 4.000% 01-Jul-2035 | 2.425.410 | 0,24 |
| 1.095.000 | Massachusetts Development Finance Agency 3.995% 01-Jun-2024 | 1.118.669 | 0,11 |
| 4.740.000 | Massachusetts Development Finance Agency 4.740% 01-Jul-2038 | 5.284.199 | 0,52 |
| 4.000.000 | Mercy Health/OH 4.302% 01-Jul-2028 | 4.502.428 | 0,45 |
| 2.000.000 | Monroe County Hospital Authority/PA 5.000% 01-Jul-2041 | 2.316.490 | 0,23 |
| 1.185.000 | Montana Facility Finance Authority 4.368% 15-Aug-2038 | 1.409.007 | 0,14 |
| 2.500.000 | Montefiore Obligated Group 4.287% 01-Sep-2050 | 2.462.763 | 0,24 |
| 2.000.000 | New Hampshire Health and Education Facilities Authority Act 5.000% 01-Jul-2044 | 2.315.040 | 0,23 |
| 5.925.000 | Oklahoma Development Finance Authority 5.450% 15-Aug-2028 | 6.642.044 | 0,66 |
| 2.000.000 | Providence St Joseph Health Obligated Group 2.532% 01-Oct-2029 | 2.067.174 | 0,21 |
| 3.075.000 | SSM Health Care Corp 3.688% 01-Jun-2023 | 3.165.743 | 0,31 |
| 6.360.000 | SSM Health Care Corp 3.823% 01-Jun-2027 | 6.985.060 | 0,69 |
| 5.000.000 | Sutter Health 2.294% 15-Aug-2030 | 5.003.829 | 0,50 |
| 3.000.000 | Trinity Health Corp 2.632% 01-Dec-2040 | 2.955.693 | 0,29 |
| 2.000.000 | Washington Health Care Facilities Authority 5.000% 01-Jul-2042 | 2.406.180 | 0,24 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % |
|---|--|----------------------------|-----------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Wohnungsbau - 12.393.566 (31. Dezember 2020: 12.574.384) | | | |
| 1.107.078 | Arizona Industrial Development Authority '2019-2 A' FRN 3.625% 20-May-2033 | 1.240.779 | 0,12 |
| 1.400.000 | California Statewide Communities Development Authority 1.877% 01-Feb-2031 | 1.373.911 | 0,13 |
| 1.000.000 | California Statewide Communities Development Authority 2.177% 01-Feb-2033 | 988.485 | 0,10 |
| 4.000.000 | Chicago Housing Authority 4.322% 01-Jan-2033 | 4.712.360 | 0,47 |
| 500.000 | Industrial Development Authority of the City of Phoenix/The 4.125% 01-Jul-2023 | 512.443 | 0,05 |
| 2.250.000 | Philadelphia Authority for Industrial Development 2.016% 15-Apr-2027 | 2.289.094 | 0,23 |
| 1.250.000 | Philadelphia Authority for Industrial Development 2.216% 15-Apr-2028 | 1.276.494 | 0,13 |
| Wohnungsbaufinanzierung - 6.548.282 (31. Dezember 2020: 6.160.000) | | | |
| 2.967.804 | California Housing Finance Agency '2021-1 A' 3.500% 20-Nov-2035 | 3.388.282 | 0,34 |
| 3.160.000 | Industrial Development Authority of the City of Phoenix/The 0.010% 15-Nov-2052 | 3.160.000 | 0,31 |
| Leasing - 11.118.768 (31. Dezember 2020: 11.400.213) | | | |
| 5.000.000 | Commonwealth Financing Authority 4.014% 01-Jun-2033 | 5.700.750 | 0,57 |
| 1.840.000 | New Jersey Transportation Trust Fund Authority 5.754% 15-Dec-2028 | 2.155.293 | 0,21 |
| 3.000.000 | Oklahoma City Economic Development Trust 3.313% 01-Aug-2027 | 3.262.725 | 0,32 |
| Kommunalverwaltung - 125.999.684 (31. Dezember 2020: 66.919.913) | | | |
| 2.615.000 | City of Glendale AZ 2.062% 01-Jul-2029 | 2.576.446 | 0,26 |
| 3.000.000 | City of New Haven CT 4.834% 01-Aug-2033 | 3.411.975 | 0,34 |
| 1.000.000 | City of New Haven CT 5.000% 01-Aug-2031 | 1.260.735 | 0,13 |
| 10.000.000 | City of New York NY 2.173% 01-Aug-2034 | 9.533.150 | 0,95 |
| 2.380.000 | City of New York NY 3.450% 01-Dec-2027 | 2.604.220 | 0,26 |
| 1.665.000 | City of New York NY 3.750% 01-Jun-2028 | 1.799.590 | 0,18 |
| 1.000.000 | City of New York NY 4.000% 01-Mar-2038 | 1.200.025 | 0,12 |
| 2.750.000 | City of New York NY 4.000% 01-Mar-2040 | 3.285.109 | 0,33 |
| 1.400.000 | City of New York NY 4.000% 01-Mar-2047 | 1.648.304 | 0,16 |
| 11.000.000 | City of New York NY 4.000% 01-Mar-2050 | 12.722.215 | 1,26 |
| 2.500.000 | City of Philadelphia PA 2.864% 15-Jul-2031 | 2.607.563 | 0,26 |
| 11.000.000 | City of Philadelphia PA 5.000% 01-May-2033 | 14.386.405 | 1,43 |
| 6.500.000 | Clackamas County School District No 12 North Clackamas 0.000% 15-Jun-2039 | 3.461.770 | 0,34 |
| 1.000.000 | Clark County School District 5.000% 15-Jun-2035 | 1.287.930 | 0,13 |
| 5.450.000 | Contra Costa Community College District 2.926% 01-Aug-2038 | 5.640.777 | 0,56 |
| 2.350.000 | County of Cook IL 5.000% 15-Nov-2033 | 3.064.564 | 0,31 |
| 10.000.000 | County of Miami-Dade Seaport Department 1.862% 01-Oct-2029 | 9.790.700 | 0,97 |
| 5.125.000 | County of New Castle DE 1.810% 15-Jul-2030 | 5.143.040 | 0,51 |
| 2.500.000 | County of Tulare CA 3.859% 01-Jun-2026 | 2.757.750 | 0,27 |
| 1.000.000 | Detroit City School District 6.645% 01-May-2029 | 1.306.945 | 0,13 |
| 3.000.000 | El Paso Independent School District 1.872% 15-Aug-2031 | 2.977.320 | 0,30 |
| 2.500.000 | Los Angeles Unified School District/CA 4.000% 01-Jul-2044 | 2.959.300 | 0,29 |
| 6.145.000 | Palomar Community College District 1.986% 01-Aug-2030 | 6.164.265 | 0,61 |
| 4.880.000 | San Juan Unified School District 1.666% 01-Aug-2028 | 4.870.020 | 0,48 |
| 5.435.000 | School District of Philadelphia/The 4.000% 01-Sep-2038 | 6.470.014 | 0,64 |
| 1.750.000 | School District of Philadelphia/The 4.000% 01-Sep-2038 | 2.043.484 | 0,20 |
| 800.000 | Southwestern Community College District 2.294% 01-Aug-2032 | 804.320 | 0,08 |
| 1.000.000 | Southwestern Community College District 2.394% 01-Aug-2033 | 1.007.020 | 0,10 |
| 1.000.000 | Southwestern Community College District 2.494% 01-Aug-2034 | 1.009.625 | 0,10 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Nettovermögen % | Summe |
|---|---|----------------------------|-----------------|-------|
| Anleihen Forts. | | | | |
| Kommunalverwaltung Forts. | | | | |
| 4.080.000 | Sycamore Community City School District 4.000% 01-Dec-2029 | 4.945.633 | 0,49 | |
| 3.000.000 | Town of Hamden CT 3.881% 15-Aug-2026 | 3.259.470 | 0,32 | |
| Gemeinnützige Organisationen - 4.789.850 | | 4.789.850 | 0,48 | |
| (31. Dezember 2020: 2.709.392) | | | | |
| 2.500.000 | Conservation Fund A Nonprofit Corp/The 3.474% 15-Dec-2029 | 2.643.694 | 0,26 | |
| 2.000.000 | Jackson Laboratory/The 3.468% 01-Jul-2051 | 2.146.156 | 0,22 | |
| Energie - 37.904.970 | | 37.904.970 | 3,76 | |
| (31. Dezember 2020: 15.169.231) | | | | |
| 1.500.000 | American Municipal Power Inc 6.973% 15-Feb-2024 | 1.680.622 | 0,17 | |
| 1.100.000 | American Municipal Power Inc 7.334% 15-Feb-2028 | 1.364.413 | 0,13 | |
| 3.500.000 | City of Austin TX Electric Utility Revenue 2.837% 15-Nov-2027 | 3.725.138 | 0,37 | |
| 1.500.000 | City of Lubbock TX Electric Light & Power System Revenue 4.000% 15-Apr-2034 | 1.793.580 | 0,18 | |
| 3.750.000 | Municipal Electric Authority of Georgia 2.257% 01-Jan-2029 | 3.745.594 | 0,37 | |
| 1.300.000 | Municipal Electric Authority of Georgia 4.000% 01-Jan-2051 | 1.474.752 | 0,15 | |
| 1.250.000 | Oklahoma Municipal Power Authority 1.951% 01-Jan-2029 | 1.250.463 | 0,12 | |
| 8.700.000 | Piedmont Municipal Power Agency 5.000% 01-Jan-2030 | 11.106.768 | 1,10 | |
| 4.000.000 | South Carolina Public Service Authority 4.000% 01-Dec-2036 | 4.841.380 | 0,48 | |
| 2.000.000 | South Carolina Public Service Authority 4.000% 01-Dec-2042 | 2.357.220 | 0,23 | |
| 1.935.000 | South Carolina Public Service Authority 5.125% 01-Dec-2043 | 2.103.480 | 0,21 | |
| 1.000.000 | South Carolina Public Service Authority 5.784% 01-Dec-2041 | 1.383.140 | 0,14 | |
| 1.000.000 | Southern California Public Power Authority 4.208% 01-Jul-2028 | 1.078.420 | 0,11 | |
| Prepaid Gas - 1.311.612 | | 1.311.612 | 0,13 | |
| (31. Dezember 2020: 8.009.444) | | | | |
| 1.160.000 | Kentucky Public Energy Authority 4.000% 01-Dec-2050 | 1.311.612 | 0,13 | |
| Pre-Refunded - 9.978.047 | | 9.978.047 | 0,99 | |
| (31. Dezember 2020: 5.015.403) | | | | |
| 3.975.000 | City of Chicago IL 7.045% 01-Jan-2029 | 4.565.586 | 0,45 | |
| 5.485.000 | City of New York NY 1.723% 01-Aug-2029 | 5.412.461 | 0,54 | |
| Renten - 9.089.362 | | 9.089.362 | 0,90 | |
| (31. Dezember 2020: 9.225.230) | | | | |
| 725.000 | Berks County Industrial Development Authority 3.950% 15-May-2024 | 740.424 | 0,07 | |
| 1.000.000 | Montgomery County Industrial Development Authority/PA 5.000% 15-Nov-2036 | 1.171.255 | 0,11 | |
| 1.000.000 | North Carolina Medical Care Commission 5.000% 01-Oct-2042 | 1.111.170 | 0,11 | |
| 1.000.000 | North Carolina Medical Care Commission 5.000% 01-Oct-2047 | 1.111.170 | 0,11 | |
| 1.000.000 | Sarasota County Health Facilities Authority 5.000% 01-Jan-2037 | 1.077.235 | 0,11 | |
| 1.000.000 | Sarasota County Health Facilities Authority 5.000% 01-Jan-2042 | 1.074.170 | 0,11 | |
| 2.500.000 | St Louis County Industrial Development Authority 5.000% 01-Sep-2048 | 2.803.938 | 0,28 | |
| Regierung Bundesstaaten - 25.274.063 | | 25.274.063 | 2,51 | |
| (31. Dezember 2020: 7.213.525) | | | | |
| 5.000.000 | State of California 5.250% 01-Aug-2032 | 6.941.450 | 0,69 | |
| 10.000.000 | State of New York 3.110% 15-Feb-2037 | 10.479.400 | 1,04 | |
| 7.500.000 | State of New York 3.170% 15-Feb-2038 | 7.853.213 | 0,78 | |
| Transport - 217.211.637 | | 217.211.637 | 21,57 | |
| (31. Dezember 2020: 117.687.806) | | | | |
| 2.000.000 | Central Texas Regional Mobility Authority 2.174% 01-Jan-2029 | 2.023.220 | 0,20 | |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Nettovermögen % | Summe |
|-------------------------|--|----------------------------|-----------------|-------|
| Anleihen Forts. | | | | |
| Transport Forts. | | | | |
| 2.250.000 | Central Texas Regional Mobility Authority 2.274% 01-Jan-2030 | 2.278.001 | 0,23 | |
| 2.750.000 | Central Texas Regional Mobility Authority 2.354% 01-Jan-2031 | 2.759.254 | 0,27 | |
| 4.000.000 | Central Texas Turnpike System 3.029% 15-Aug-2041 | 4.003.640 | 0,40 | |
| 1.250.000 | Chicago Midway International Airport 3.655% 01-Jan-2025 | 1.322.062 | 0,13 | |
| 1.500.000 | Chicago Midway International Airport 3.697% 01-Jan-2026 | 1.600.155 | 0,16 | |
| 1.200.000 | Chicago Midway International Airport 3.747% 01-Jan-2027 | 1.290.342 | 0,13 | |
| 900.000 | Chicago Midway International Airport 3.797% 01-Jan-2028 | 973.332 | 0,10 | |
| 5.000.000 | Chicago O'Hare International Airport 4.472% 01-Jan-2049 | 6.590.875 | 0,65 | |
| 8.250.000 | City & County of Denver CO Airport System Revenue 2.037% 15-Nov-2028 | 8.387.445 | 0,83 | |
| 1.500.000 | City & County of Denver CO Airport System Revenue 5.000% 01-Dec-2036 | 2.099.827 | 0,21 | |
| 2.150.000 | City of Houston TX Airport System Revenue 1.716% 01-Jul-2026 | 2.159.148 | 0,21 | |
| 4.000.000 | City of Los Angeles Department of Airports 5.000% 15-May-2035 | 4.995.900 | 0,50 | |
| 5.110.000 | City of Los Angeles Department of Airports 5.000% 15-May-2036 | 6.370.228 | 0,63 | |
| 4.500.000 | City of Los Angeles Department of Airports 5.000% 15-May-2040 | 5.799.847 | 0,58 | |
| 1.500.000 | City of Phoenix Civic Improvement Corp 5.000% 01-Jul-2029 | 1.898.258 | 0,19 | |
| 5.000.000 | Colorado Bridge Enterprise 2.543% 31-Dec-2032 | 5.099.900 | 0,51 | |
| 2.000.000 | Colorado High Performance Transportation Enterprise 5.000% 31-Dec-2047 | 2.252.070 | 0,22 | |
| 10.000.000 | County of Broward FL Airport System Revenue 2.384% 01-Oct-2026 | 10.287.800 | 1,02 | |
| 1.000.000 | County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 3.354% 01-Oct-2029 | 1.069.890 | 0,11 | |
| 4.400.000 | County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 3.505% 01-Oct-2025 | 4.712.730 | 0,47 | |
| 3.000.000 | Dallas Area Rapid Transit 2.078% 01-Dec-2031 | 3.013.905 | 0,30 | |
| 2.500.000 | Dallas Fort Worth International Airport 4.000% 01-Nov-2034 | 3.027.375 | 0,30 | |
| 1.500.000 | Foothill-Eastern Transportation Corridor Agency 2.962% 15-Jan-2046 | 1.490.093 | 0,15 | |
| 2.500.000 | Grand Parkway Transportation Corp 4.000% 01-Oct-2049 | 2.899.625 | 0,29 | |
| 2.470.000 | Illinois State Toll Highway Authority 5.000% 01-Jan-2031 | 3.185.435 | 0,32 | |
| 1.260.000 | Illinois State Toll Highway Authority 5.000% 01-Jan-2040 | 1.616.624 | 0,16 | |
| 2.500.000 | Illinois State Toll Highway Authority 5.000% 01-Jan-2045 | 3.172.650 | 0,31 | |
| 2.000.000 | Kenton County Airport Board 4.689% 01-Jan-2049 | 2.197.470 | 0,22 | |
| 1.750.000 | Maryland Economic Development Corp 4.750% 01-Jun-2042 | 1.855.385 | 0,18 | |
| 5.000.000 | Massachusetts Port Authority 1.879% 01-Jul-2033 | 4.784.200 | 0,48 | |
| 3.350.000 | Metropolitan Atlanta Rapid Transit Authority 2.411% 01-Jul-2033 | 3.356.583 | 0,33 | |
| 2.000.000 | Metropolitan Nashville Airport Authority/The 5.000% 01-Jul-2049 | 2.470.740 | 0,25 | |
| 5.000.000 | Metropolitan Washington Airports Authority Aviation Revenue 5.000% 01-Oct-2044 | 6.171.425 | 0,61 | |
| 3.500.000 | Metropolitan Washington Airports Authority Dulles Toll Road Revenue 4.000% 01-Oct-2049 | 3.965.955 | 0,39 | |
| 10.000.000 | New Jersey Turnpike Authority 1.483% 01-Jan-2028 | 9.691.800 | 0,96 | |
| 4.300.000 | New Jersey Turnpike Authority 1.813% 01-Jan-2030 | 4.162.035 | 0,41 | |
| 1.000.000 | New Jersey Turnpike Authority 7.414% 01-Jan-2040 | 1.611.525 | 0,16 | |
| 3.000.000 | New York State Thruway Authority 2.900% 01-Jan-2035 | 3.134.175 | 0,31 | |
| 5.000.000 | New York State Thruway Authority 4.000% 01-Jan-2045 | 5.774.050 | 0,57 | |
| 2.500.000 | New York Transportation Development Corp 5.250% 01-Jan-2050 | 2.759.688 | 0,27 | |
| 1.000.000 | Norman Y Mineta San Jose International Airport SJC 1.882% 01-Mar-2028 | 992.250 | 0,10 | |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % |
|--|---|----------------------------|-----------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Transport Forts. | | | |
| 1.150.000 | Norman Y Mineta San Jose International Airport SJC 2.210% 01-Mar-2029 | 1.156.549 | 0,11 |
| 1.375.000 | Norman Y Mineta San Jose International Airport SJC 2.310% 01-Mar-2030 | 1.387.464 | 0,14 |
| 7.000.000 | North Texas Tollway Authority 2.327% 01-Jan-2033 | 6.969.200 | 0,69 |
| 4.500.000 | Pennsylvania Turnpike Commission 2.890% 01-Dec-2035 | 4.614.638 | 0,46 |
| 8.245.000 | Pennsylvania Turnpike Commission 3.043% 01-Dec-2033 | 8.628.351 | 0,86 |
| 9.000.000 | Pennsylvania Turnpike Commission 3.416% 01-Dec-2041 | 9.445.770 | 0,94 |
| 2.385.000 | Pennsylvania Turnpike Commission 5.000% 01-Jun-2042 | 2.841.787 | 0,28 |
| 1.000.000 | Port Authority of New York & New Jersey 4.000% 15-Jul-2051 | 1.158.695 | 0,12 |
| 1.500.000 | Port Authority of New York & New Jersey 4.823% 01-Jun-2045 | 1.650.015 | 0,16 |
| 1.295.000 | Port Authority of New York & New Jersey 5.310% 01-Aug-2046 | 1.417.695 | 0,14 |
| 1.080.000 | Port of Corpus Christi Authority of Nueces County 3.699% 01-Dec-2026 | 1.174.943 | 0,12 |
| 1.135.000 | Port of Corpus Christi Authority of Nueces County 3.799% 01-Dec-2028 | 1.259.895 | 0,13 |
| 500.000 | Port of Oakland 2.099% 01-May-2030 | 498.005 | 0,05 |
| 10.000.000 | San Francisco City & County Airport Comm-San Francisco International Airport 5.000% 01-May-2049 | 12.243.800 | 1,22 |
| 1.250.000 | State of Connecticut Bradley International Airport CFC Revenue 3.174% 01-Jul-2026 | 1.301.394 | 0,13 |
| 750.000 | State of Connecticut Bradley International Airport CFC Revenue 3.431% 01-Jul-2028 | 793.778 | 0,08 |
| 2.290.000 | State of Ohio 5.000% 31-Dec-2039 | 2.542.266 | 0,25 |
| 5.000.000 | State of Oregon Department of Transportation 2.851% 15-Nov-2032 | 5.267.475 | 0,52 |
| 3.000.000 | Virginia Small Business Financing Authority 5.000% 31-Dec-2052 | 3.553.005 | 0,35 |
| Wasser - 73.296.801 | | 73.296.801 | 7,28 |
| (31. Dezember 2020: 33.581.124) | | | |
| 1.650.000 | City & County Honolulu HI Wastewater System Revenue 2.316% 01-Jul-2025 | 1.708.097 | 0,17 |
| 1.000.000 | City of Chicago IL Wastewater Transmission Revenue 5.000% 01-Jan-2039 | 1.080.455 | 0,11 |
| 1.120.000 | City of Corpus Christi TX Utility System Revenue 5.000% 15-Jul-2034 | 1.458.117 | 0,14 |
| 5.800.000 | City of Houston TX Combined Utility System Revenue 2.984% 15-Nov-2042 | 5.920.379 | 0,59 |
| 2.940.000 | City of San Francisco CA Public Utilities Commission Water Revenue 2.825% 01-Nov-2041 | 2.882.376 | 0,29 |
| 21.635.000 | City of San Francisco CA Public Utilities Commission Water Revenue 3.303% 01-Nov-2039 | 22.383.787 | 2,22 |
| 3.040.000 | City of Springfield MO Public Utility Revenue 2.300% 01-Nov-2032 | 3.072.665 | 0,30 |
| 3.690.000 | County of Fairfax VA Sewer Revenue 3.000% 15-Jul-2037 | 4.167.449 | 0,41 |
| 5.000.000 | County of Miami-Dade FL Water & Sewer System Revenue 2.911% 01-Oct-2032 | 5.249.725 | 0,52 |
| 4.000.000 | East Baton Rouge Sewerage Commission 2.437% 01-Feb-2039 | 3.915.700 | 0,39 |
| 3.000.000 | Florida Water Pollution Control Financing Corp 2.550% 15-Jan-2029 | 3.179.055 | 0,32 |
| 3.000.000 | Great Lakes Water Authority Sewage Disposal System Revenue 3.056% 01-Jul-2039 | 3.169.665 | 0,31 |
| 3.000.000 | Irvine Ranch Water District 6.622% 01-May-2040 | 4.522.065 | 0,45 |
| 5.000.000 | Metropolitan Water Reclamation District of Greater Chicago 2.534% 01-Dec-2032 | 5.052.372 | 0,50 |
| 1.810.000 | Metropolitan Water Reclamation District of Greater Chicago 5.720% 01-Dec-2038 | 2.495.646 | 0,25 |
| 2.250.000 | Ohio Water Development Authority 4.817% 01-Dec-2030 | 2.683.305 | 0,27 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert USD | Summe Nettovermögen % |
|--|--|----------------------------|-----------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Wasser Forts. | | | |
| 330.000 | State of California Department of Water Resources 3.127% 01-Dec-2029 | 355.943 | 0,04 |
| Gesamtanlagen in Anleihen | | 989.667.151 | 98,27 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten - 3.695.769 (siehe unten) (31. Dezember 2020: 2.183.004) | | 3.695.769 | 0,36 |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | 993.362.920 | 98,63 |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten - (29.655) (siehe unten) (31. Dezember 2020: (77.833)) | | (29.655) | (0,00) |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | (29.655) | (0,00) |
| Nettoumlaufvermögen | | 13.749.459 | 1,37 |
| Summe Nettovermögen | | 1.007.082.724 | 100,00 |
| Portfolioanalyse % des Gesamtvermögens | | | |
| An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | | | 98,06 |
| Außerbörsliche derivative Finanzinstrumente (OTC-Derivate) | | | 0,37 |
| Sonstiges Umlaufvermögen | | | 1,57 |
| Gesamtvermögen | | | 100,00 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Devisenterminkontrakte | | | | | | | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|--|-----------|------------|------------|------------------|-----------------------------|------------|-------------------------------------|
| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | | |
| BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse AUD P (Acc) (Hedged) | | | | | | | |
| Australischer Dollar | US-Dollar | 9.939 | 7.109 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 122 |
| | | | | | | USD | 122 |
| | | | | | | AUD | 168 |
| BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse AUD P (Inc) (Hedged) | | | | | | | |
| Australischer Dollar | US-Dollar | 9.939 | 7.109 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 122 |
| | | | | | | USD | 122 |
| | | | | | | AUD | 168 |
| BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse CHF E (Acc) (Hedged) | | | | | | | |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 4.971.986 | 5.383.019 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 74.944 |
| | | | | | | USD | 74.944 |
| | | | | | | CHF | 68.289 |
| BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse CHF H (Acc) (Hedged) | | | | | | | |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 14.675 | 15.888 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 221 |
| | | | | | | USD | 221 |
| | | | | | | CHF | 201 |
| BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse CHF W (Acc) (Hedged) | | | | | | | |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 1.960.875 | 2.132.216 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 20.321 |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 30.591.899 | 33.120.928 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 461.121 |
| | | | | | | USD | 481.442 |
| | | | | | | CHF | 438.690 |
| BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse CHF W (Inc) (Hedged) | | | | | | | |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 7.206.499 | 7.802.259 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 108.626 |
| | | | | | | USD | 108.626 |
| | | | | | | CHF | 98.980 |
| BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse CHF Z (Acc) (Hedged) | | | | | | | |
| Schweizer Franken | US-Dollar | 9.962 | 10.786 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 150 |
| | | | | | | USD | 150 |
| | | | | | | CHF | 137 |
| BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse EUR E (Acc) (Hedged) | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 7.580.825 | 8.579.124 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 53.439 |
| | | | | | | USD | 53.439 |
| | | | | | | EUR | 46.938 |

| Devisenterminkontrakte Forts. | | | | | | | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|--|-----------|------------|------------|------------------|-----------------------------|------------|-------------------------------------|
| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | | |
| BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse EUR E (Inc) (Hedged) | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 8.412.656 | 9.520.496 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 59.302 |
| | | | | | | USD | 59.302 |
| | | | | | | EUR | 52.088 |
| BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged) | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 856.335 | 969.300 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 5.638 |
| Euro | US-Dollar | 2.809 | 3.186 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 13 |
| Euro | US-Dollar | 15.000 | 17.015 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 66 |
| Euro | US-Dollar | 45.000 | 50.607 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 636 |
| Euro | US-Dollar | 5.000 | 5.672 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 22 |
| Euro | US-Dollar | 22.903 | 25.882 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 199 |
| Euro | US-Dollar | 12.000 | 13.521 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 144 |
| Euro | US-Dollar | 500.000 | 564.864 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 4.505 |
| Euro | US-Dollar | 10.500 | 11.898 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 59 |
| Euro | US-Dollar | 382.707 | 433.296 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 2.507 |
| Euro | US-Dollar | 24.842.081 | 28.113.469 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 175.116 |
| | | | | | | USD | 188.905 |
| | | | | | | EUR | 165.924 |
| US-Dollar | Euro | 433.193 | 382.707 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (2.520) |
| US-Dollar | Euro | 244.480 | 215.569 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (997) |
| US-Dollar | Euro | 1.896 | 1.495 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (6) |
| US-Dollar | Euro | 228.742 | 203.400 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (2.877) |
| US-Dollar | Euro | 96.935 | 85.778 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (744) |
| US-Dollar | Euro | 1.936 | 1.718 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (21) |
| US-Dollar | Euro | 16.930 | 14.941 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (84) |
| US-Dollar | Euro | 969.531 | 856.335 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (5.609) |
| US-Dollar | Euro | 39.678 | 35.092 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | (282) |
| | | | | | | USD | (13.140) |
| | | | | | | EUR | (11.541) |
| BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse EUR H (Inc) (Hedged) | | | | | | | |
| Euro | US-Dollar | 75 | 85 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 1 |
| Euro | US-Dollar | 76 | 86 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | - |
| Euro | US-Dollar | 150 | 170 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 1 |
| Euro | US-Dollar | 562.282 | 636.328 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 3.964 |
| Euro | US-Dollar | 75 | 85 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | - |
| Euro | US-Dollar | 75 | 85 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 1 |
| Euro | US-Dollar | 75 | 84 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 1 |
| Euro | US-Dollar | 274 | 310 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | 2 |
| Euro | US-Dollar | 75 | 85 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | | - |
| | | | | | | USD | 3.970 |
| | | | | | | EUR | 3.487 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte Forts.

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

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse EUR H (Inc) (Hedged) Forts.

| | | | | | | | |
|-----------|------|-----|-----|------------|-----------------------------|------------|------------|
| US-Dollar | Euro | 170 | 150 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1) | |
| | | | | | | USD | (1) |
| | | | | | | EUR | (1) |

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse EUR P (Acc) (Hedged)

| | | | | | | | |
|------|-----------|-------|--------|-------------|-----------------------------|------------|-----------|
| Euro | US-Dollar | 9.911 | 11.216 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 70 | |
| | | | | | | USD | 70 |
| | | | | | | EUR | 61 |

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse EUR P (Inc) (Hedged)

| | | | | | | | |
|------|-----------|-------|--------|-------------|-----------------------------|------------|-----------|
| Euro | US-Dollar | 9.911 | 11.216 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 70 | |
| | | | | | | USD | 70 |
| | | | | | | EUR | 61 |

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)

| | | | | | | | |
|-----------|-----------|-------------|-------------|-------------|-----------------------------|------------|------------------|
| Euro | US-Dollar | 160.698 | 181.897 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.058 | |
| Euro | US-Dollar | 59.898 | 67.809 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 387 | |
| Euro | US-Dollar | 261.121 | 296.140 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.207 | |
| Euro | US-Dollar | 847.708 | 958.508 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 6.808 | |
| Euro | US-Dollar | 1.376.975 | 1.560.264 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 7.748 | |
| Euro | US-Dollar | 42.171 | 47.751 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 271 | |
| Euro | US-Dollar | 3.259 | 3.696 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 16 | |
| Euro | US-Dollar | 661.467 | 748.904 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 4.333 | |
| Euro | US-Dollar | 32.985 | 37.264 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 297 | |
| Euro | US-Dollar | 79.713 | 89.817 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 955 | |
| Euro | US-Dollar | 12.819 | 14.487 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 111 | |
| Euro | US-Dollar | 79.486 | 90.170 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 343 | |
| Euro | US-Dollar | 52.409 | 58.939 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 741 | |
| Euro | US-Dollar | 100.561 | 113.490 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.023 | |
| Euro | US-Dollar | 128.839 | 145.465 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.249 | |
| Euro | US-Dollar | 21.152 | 23.993 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 93 | |
| Euro | US-Dollar | 13.617 | 15.470 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 36 | |
| Euro | US-Dollar | 204.537.636 | 231.472.657 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.441.821 | |
| | | | | | | USD | 1.468.497 |
| | | | | | | EUR | 1.289.851 |
| US-Dollar | Euro | 748.726 | 661.467 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (4.355) | |
| US-Dollar | Euro | 477.41 | 42.171 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (272) | |
| US-Dollar | Euro | 94.870 | 83.651 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (387) | |
| US-Dollar | Euro | 67.823 | 59.898 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (385) | |
| US-Dollar | Euro | 19.265 | 16.989 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (81) | |
| US-Dollar | Euro | 181.940 | 160.698 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (1.053) | |
| US-Dollar | Euro | 114.131 | 100.724 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (567) | |
| US-Dollar | Euro | 37.056 | 32.772 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (263) | |

Devisenterminkontrakte Forts.

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

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged) Forts.

| | | | | | | | |
|-----------|------|---------|---------|-------------|-----------------------------|------------|-----------------|
| US-Dollar | Euro | 98.756 | 87.416 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (787) | |
| US-Dollar | Euro | 72.105 | 63.806 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (553) | |
| US-Dollar | Euro | 90.737 | 79.985 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (345) | |
| US-Dollar | Euro | 49.539 | 44.051 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (623) | |
| US-Dollar | Euro | 61.348 | 54.359 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (553) | |
| US-Dollar | Euro | 299.432 | 265.209 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (2.571) | |
| US-Dollar | Euro | 48.404 | 42.671 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (187) | |
| US-Dollar | Euro | 29.793 | 26.442 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (317) | |
| US-Dollar | Euro | 24.605 | 21.657 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (57) | |
| | | | | | | USD | (13.356) |
| | | | | | | EUR | (11.731) |

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged)

| | | | | | | | |
|-----------|-----------|-------------|-------------|-------------|-----------------------------|------------|------------------|
| Euro | US-Dollar | 5.477 | 6.199 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 36 | |
| Euro | US-Dollar | 37.414 | 42.431 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 173 | |
| Euro | US-Dollar | 10.000 | 11.343 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 44 | |
| Euro | US-Dollar | 21.131 | 23.858 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 205 | |
| Euro | US-Dollar | 621.985 | 701.953 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 6.324 | |
| Euro | US-Dollar | 40.124 | 45.123 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 567 | |
| Euro | US-Dollar | 27.552 | 31.256 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 119 | |
| Euro | US-Dollar | 65.169 | 73.429 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 781 | |
| Euro | US-Dollar | 23.512 | 26.641 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 132 | |
| Euro | US-Dollar | 87.014 | 98.527 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 560 | |
| Euro | US-Dollar | 98.983 | 112.067 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 648 | |
| Euro | US-Dollar | 23.505 | 26.577 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 189 | |
| Euro | US-Dollar | 175.537.579 | 198.653.659 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 1.237.395 | |
| | | | | | | USD | 1.247.173 |
| | | | | | | EUR | 1.095.452 |
| US-Dollar | Euro | 112.040 | 98.983 | 4. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (652) | |
| US-Dollar | Euro | 98.506 | 87.014 | 5. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (562) | |
| US-Dollar | Euro | 3.395 | 2.993 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (14) | |
| US-Dollar | Euro | 6.324 | 5.575 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (24) | |
| US-Dollar | Euro | 57.529 | 50.954 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (494) | |
| US-Dollar | Euro | 8.461 | 7.523 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (106) | |
| US-Dollar | Euro | 79.865 | 70.673 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (613) | |
| US-Dollar | Euro | 13.556 | 12.031 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (144) | |
| US-Dollar | Euro | 567 | 502 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (4) | |
| US-Dollar | Euro | 27.775 | 24.512 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (138) | |
| US-Dollar | Euro | 6.201 | 5.477 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (36) | |
| US-Dollar | Euro | 47.556 | 42.058 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (338) | |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

Devisenterminkontrakte Forts.

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

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged) Forts.

| | | | | | | |
|-----------|------|--------|--------|-------------|-----------------------------|----------------|
| US-Dollar | Euro | 14.193 | 12.493 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | (33) |
| | | | | | | |
| | | | | | USD | (3.158) |
| | | | | | EUR | (2.774) |

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse EUR Z (Acc) (Hedged)

| | | | | | | |
|------|-----------|---------|---------|-------------|-----------------------------|--------------|
| Euro | US-Dollar | 508.019 | 574.918 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 3.581 |
| | | | | | | |
| | | | | | USD | 3.581 |
| | | | | | EUR | 3.145 |

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse Sterling G (Inc) (Hedged)

| | | | | | | |
|----------------|-----------|--------|--------|-------------|-----------------------------|------------|
| Pfund Sterling | US-Dollar | 10.303 | 13.612 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 334 |
| | | | | | | |
| | | | | | USD | 334 |
| | | | | | GBP | 247 |

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse Sterling H (Acc) (Hedged)

| | | | | | | |
|----------------|-----------|--------|--------|-------------|-----------------------------|------------|
| Pfund Sterling | US-Dollar | 12.296 | 16.244 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 399 |
| | | | | | | |
| | | | | | USD | 399 |
| | | | | | GBP | 295 |

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)

| | | | | | | |
|----------------|-----------|---------|---------|-------------|-----------------------------|--------------|
| Pfund Sterling | US-Dollar | 125.624 | 165.958 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 4.076 |
| | | | | | | |
| | | | | | USD | 4.076 |
| | | | | | GBP | 3.011 |

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Anteilsklasse Sterling Z (Acc) (Hedged)

| | | | | | | |
|----------------|-----------|--------|--------|-------------|-----------------------------|------------|
| Pfund Sterling | US-Dollar | 10.050 | 13.277 | 14. Jan. 22 | The Bank of New York Mellon | 326 |
| | | | | | | |
| | | | | | USD | 326 |
| | | | | | GBP | 241 |

RESPONSIBLE HORIZONS EURO CORPORATE BOND FUND*

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert EUR | Summe Nettover- mögen % |
|---------------------------------|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen | | | |
| Australien - 14.444.187 | | | |
| 1.142.000 | Scentre Group Trust 1 / Scentre Group Trust 2 'REGS' 3.625% 28-Jan-2026 | 1.078.019 | 0,11 |
| 2.292.000 | Scentre Group Trust 2 'REGS' FRN 4,750% 24-Sep-2080 | 2.117.849 | 0,22 |
| 3.767.000 | Scentre Group Trust 2 'REGS' FRN 5,125% 24-Sep-2080 | 3.577.792 | 0,36 |
| 4.255.000 | Sydney Airport Finance Co Pty Ltd 'EMTN' 1,750% 26-Apr-2028 | 4.453.805 | 0,45 |
| 2.530.000 | Sydney Airport Finance Co Pty Ltd 'EMTN' 2,750% 23-Apr-2024 | 2.665.674 | 0,27 |
| 521.000 | Telstra Corp Ltd 'EMTN' 1,375% 26-Mar-2029 | 551.048 | 0,06 |
| Österreich - 4.420.418 | | | |
| 4.400.000 | Raiffeisen Bank International AG 'EMTN' 0,375% 25-Sep-2026 | 4.420.418 | 0,45 |
| Belgien - 20.889.913 | | | |
| 2.300.000 | Belfius Bank SA 'EMTN' 0,000% 28-Aug-2026 | 2.272.020 | 0,23 |
| 1.800.000 | Elia Transmission Belgium SA 'EMTN' 0,875% 28-Apr-2030 | 1.839.631 | 0,19 |
| 1.500.000 | FLUVIUS System Operator CVBA 'EMTN' 2,750% 30-Nov-2022 | 1.542.342 | 0,16 |
| 2.800.000 | Groupe Bruxelles Lambert SA 0,125% 28-Jan-2031 | 2.678.328 | 0,27 |
| 2.100.000 | Groupe Bruxelles Lambert SA 1,875% 19-Jun-2025 | 2.229.299 | 0,23 |
| 3.900.000 | KBC Group NV 'EMTN' 0,750% 18-Oct-2023 | 3.969.069 | 0,40 |
| 2.900.000 | KBC Group NV 'EMTN' 1,125% 25-Jan-2024 | 2.975.491 | 0,30 |
| 1.600.000 | KBC Group NV 'EMTN' FRN 0,125% 10-Sep-2026 | 1.589.358 | 0,16 |
| 1.800.000 | KBC Group NV 'EMTN' FRN 0,250% 01-Mar-2027 | 1.794.375 | 0,18 |
| Bermudas - 3.159.541 | | | |
| 648.000 | PartnerRe Ireland Finance DAC 1,250% 15-Sep-2026 | 670.194 | 0,07 |
| 2.267.000 | XLIT Ltd FRN 3,250% 29-Jun-2047 | 2.489.347 | 0,25 |
| Kanada - 2.028.173 | | | |
| 2.000.000 | Toronto-Dominion Bank/The 'EMTN' 0,625% 20-Jul-2023 | 2.028.173 | 0,21 |
| Dänemark - 4.548.936 | | | |
| 2.907.000 | Nykredit Realkredit AS 'EMTN' 0,125% 10-Jul-2024 | 2.911.416 | 0,29 |
| 1.600.000 | Nykredit Realkredit AS 'EMTN' FRN 2,750% 17-Nov-2027 | 1.637.520 | 0,17 |
| Finnland - 12.033.707 | | | |
| 6.242.000 | OP Corporate Bank plc 'EMTN' 0,125% 01-Jul-2024 | 6.282.332 | 0,64 |
| 2.161.000 | OP Corporate Bank plc 'EMTN' 0,375% 26-Feb-2024 | 2.186.929 | 0,22 |
| 3.402.000 | Sampo Oyj 'EMTN' FRN 2,500% 03-Sep-2052 | 3.564.446 | 0,36 |
| Frankreich - 167.753.787 | | | |
| 1.500.000 | Aeroports de Paris 2,750% 02-Apr-2030 | 1.743.096 | 0,18 |
| 2.900.000 | ALD SA 'EMTN' 0,875% 18-Jul-2022 | 2.918.705 | 0,30 |
| 3.100.000 | APRR SA 'EMTN' 1,250% 18-Jan-2028 | 3.277.552 | 0,33 |
| 1.200.000 | Arkema SA 'EMTN' 0,125% 14-Oct-2026 | 1.202.562 | 0,12 |
| 1.339.000 | AXA SA 'EMTN' FRN 3,250% 28-May-2049 | 1.503.923 | 0,15 |
| 1.740.000 | AXA SA 'EMTN' FRN (Perpetual) 3,941% 07-Nov-2024 | 1.907.982 | 0,19 |
| 1.000.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA 1,250% 03-Jun-2030 | 1.039.117 | 0,11 |
| 3.000.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN' 0,100% 08-Oct-2027 | 2.949.555 | 0,30 |
| 5.100.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN' 0,125% 05-Feb-2024 | 5.125.508 | 0,52 |
| 1.100.000 | Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN' 1,250% 26-May-2027 | 1.151.841 | 0,12 |
| 2.600.000 | BNP Paribas Cardif SA 'EMTN' 1,000% 29-Nov-2024 | 2.653.216 | 0,27 |
| 100.000 | BNP Paribas Cardif SA FRN (Perpetual) 4,032% | 112.076 | 0,01 |
| 2.500.000 | BNP Paribas SA 'EMTN' 1,125% 11-Jun-2026 | 2.591.797 | 0,26 |
| 1.900.000 | BNP Paribas SA 'EMTN' FRN 0,500% 15-Jul-2025 | 1.920.572 | 0,20 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert EUR | Summe Nettover- mögen % |
|--------------------------|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Frankreich Forts. | | | |
| 3.800.000 | BNP Paribas SA 'EMTN' FRN 0,500% 19-Feb-2028 | 3.778.153 | 0,38 |
| 2.800.000 | BNP Paribas SA 'EMTN' FRN 0,500% 19-Jan-2030 | 2.737.600 | 0,28 |
| 1.200.000 | BNP Paribas SA 'EMTN' FRN 2,125% 23-Jan-2027 | 1.280.483 | 0,13 |
| 3.900.000 | BNP Paribas SA FRN 0,500% 01-Sep-2028 | 3.859.356 | 0,39 |
| 1.000.000 | BPCE SA 0,125% 04-Dec-2024 | 1.005.864 | 0,10 |
| 3.200.000 | BPCE SA 0,250% 15-Jan-2026 | 3.196.096 | 0,33 |
| 4.700.000 | BPCE SA 0,250% 14-Jan-2031 | 4.494.281 | 0,46 |
| 1.500.000 | BPCE SA 'EMTN' 1,000% 01-Apr-2025 | 1.541.165 | 0,16 |
| 1.500.000 | BPCE SA 'EMTN' 1,375% 23-Mar-2026 | 1.566.678 | 0,16 |
| 900.000 | BPCE SA 'EMTN' FRN 2,750% 30-Nov-2027 | 922.957 | 0,09 |
| 3.600.000 | BPCE SA FRN 1,500% 13-Jan-2042 | 3.578.760 | 0,36 |
| 1.500.000 | Carrefour SA 'EMTN' 0,750% 26-Apr-2024 | 1.523.168 | 0,16 |
| 1.200.000 | Carrefour SA 'EMTN' 0,875% 12-Jun-2023 | 1.215.306 | 0,12 |
| 2.700.000 | Carrefour SA 'EMTN' 2,625% 15-Dec-2027 | 3.021.696 | 0,31 |
| 1.300.000 | Cie de Saint-Gobain 'EMTN' 0,875% 21-Sep-2023 | 1.325.665 | 0,13 |
| 2.900.000 | Cie Generale des Etablissements Michelin SCA 0,250% 02-Nov-2032 | 2.781.898 | 0,28 |
| 2.300.000 | CNP Assurances 1,875% 20-Oct-2022 | 2.334.638 | 0,24 |
| 2.300.000 | Credit Agricole Assurances SA 2,000% 17-Jul-2030 | 2.381.003 | 0,24 |
| 1.500.000 | Credit Agricole SA 'EMTN' 0,375% 21-Oct-2025 | 1.512.330 | 0,15 |
| 3.100.000 | Credit Agricole SA 'EMTN' 0,375% 20-Apr-2028 | 3.053.175 | 0,31 |
| 700.000 | Credit Agricole SA/London 'EMTN' 1,750% 05-Mar-2029 | 753.753 | 0,08 |
| 1.300.000 | Credit Agricole SA/London 'EMTN' 1,875% 20-Dec-2026 | 1.398.322 | 0,14 |
| 3.000.000 | Credit Mutuel Arkea SA 'EMTN' 0,875% 07-May-2027 | 3.075.982 | 0,31 |
| 3.200.000 | Danone SA 'EMTN' 1,000% 26-Mar-2025 | 3.300.928 | 0,34 |
| 2.000.000 | Danone SA 'EMTN' 1,125% 14-Jan-2025 | 2.063.926 | 0,21 |
| 1.800.000 | Dassault Systemes SE 0,000% 16-Sep-2022 | 1.804.005 | 0,18 |
| 3.100.000 | Dassault Systemes SE 0,125% 16-Sep-2026 | 3.099.070 | 0,32 |
| 1.300.000 | Electricite de France SA 'EMTN' 1,000% 29-Nov-2033 | 1.290.543 | 0,13 |
| 1.500.000 | Electricite de France SA 'EMTN' 2,000% 09-Dec-2049 | 1.597.140 | 0,16 |
| 1.600.000 | Engie SA 'EMTN' 1,750% 27-Mar-2028 | 1.728.157 | 0,18 |
| 800.000 | Engie SA 'EMTN' 2,125% 30-Mar-2032 | 905.190 | 0,09 |
| 490.000 | Faurecia SE 2,375% 15-Jun-2029 | 495.400 | 0,05 |
| 2.520.000 | Faurecia SE 3,750% 15-Jun-2028 | 2.642.195 | 0,27 |
| 2.900.000 | Iliad SA 1,875% 11-Feb-2028 | 2.764.976 | 0,28 |
| 3.000.000 | La Banque Postale SA 'EMTN' FRN 0,875% 26-Jan-2031 | 2.966.850 | 0,30 |
| 1.500.000 | MMS USA Holdings Inc 'EMTN' 1,250% 13-Jun-2028 | 1.558.636 | 0,16 |
| 2.500.000 | Mutuelle Assurance Des Commerçants et Industriels de France et Des Cadres et Sal FRN 2,125% 21-Jun-2052 | 2.513.250 | 0,26 |
| 3.300.000 | Orange SA 1,200% 11-Jul-2034 | 3.405.947 | 0,35 |
| 1.400.000 | Orange SA 9,000% 01-Mar-2031 | 1.897.316 | 0,19 |
| 1.900.000 | Orange SA 'EMTN' 0,625% 16-Dec-2033 | 1.850.933 | 0,19 |
| 500.000 | Orange SA 'EMTN' FRN (Perpetual) 1,750% 15-Jul-2028 | 508.153 | 0,05 |
| 3.500.000 | RCI Banque SA 'EMTN' 0,250% 08-Mar-2023 | 3.510.238 | 0,36 |
| 2.091.000 | RCI Banque SA 'EMTN' 0,750% 26-Sep-2022 | 2.101.340 | 0,21 |
| 1.100.000 | RCI Banque SA 'EMTN' 1,625% 11-Apr-2025 | 1.137.928 | 0,12 |
| 800.000 | RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 'EMTN' 1,000% 19-Oct-2026 | 828.876 | 0,08 |
| 1.300.000 | Societe Fonciere Lyonnaise SA 1,500% 29-May-2025 | 1.355.348 | 0,14 |
| 900.000 | Societe Generale SA 0,750% 25-Jan-2027 | 907.300 | 0,09 |
| 5.000.000 | Societe Generale SA 'EMTN' 0,125% 18-Feb-2028 | 4.898.384 | 0,50 |
| 3.900.000 | Societe Generale SA FRN 0,625% 02-Dec-2027 | 3.890.250 | 0,40 |
| 370.000 | Sodexo SA 2,500% 24-Jun-2026 | 407.921 | 0,04 |
| 1.800.000 | TDF Infrastructure SASU 2,500% 07-Apr-2026 | 1.914.565 | 0,19 |
| 2.100.000 | Terega SA 0,875% 17-Sep-2030 | 2.091.531 | 0,21 |
| 3.872.000 | TotalEnergies SE 'EMTN' FRN (Perpetual) 1,750% 04-Apr-2024 | 3.953.495 | 0,40 |
| 395.000 | TotalEnergies SE 'EMTN' FRN (Perpetual) 3,369% 06-Oct-2026 | 430.975 | 0,04 |
| 1.660.000 | TotalEnergies SE 'EMTN' FRN (Perpetual) 3,875% 18-May-2022 | 1.684.236 | 0,17 |
| 4.383.000 | TotalEnergies SE FRN (Perpetual) 1,625% 25-Oct-2027 | 4.351.004 | 0,44 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert EUR | Summe Nettöver- mögen % |
|--------------------------|--|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Frankreich Forts. | | | |
| 1.800.000 | TotalEnergies SE FRN (Perpetual) 2.000% 04-Jun-2030 | 1.777.950 | 0,18 |
| 3.600.000 | Unibail-Rodamco-Westfield SE 'EMTN' 0.625% 04-May-2027 | 3.617.586 | 0,37 |
| 2.400.000 | Unibail-Rodamco-Westfield SE 'EMTN' 1.375% 04-Dec-2031 | 2.460.060 | 0,25 |
| 886.000 | Unibail-Rodamco-Westfield SE 'EMTN' 1.500% 22-Feb-2028 | 929.197 | 0,09 |
| 400.000 | Unibail-Rodamco-Westfield SE 'EMTN' 2.250% 14-May-2038 | 425.480 | 0,04 |
| 1.000.000 | Unibail-Rodamco-Westfield SE FRN (Perpetual) 2.125% 25-Jul-2023 | 991.400 | 0,10 |
| 1.900.000 | Valeo 'EMTN' 1.000% 03-Aug-2028 | 1.850.971 | 0,19 |
| 2.300.000 | Veolia Environnement SA FRN (Perpetual) 2.250% 20-Jan-2026 | 2.343.700 | 0,24 |
| 1.165.000 | WEA Finance LLC '1444A' 3.500% 15-Jun-2029 | 1.065.606 | 0,11 |
| | Deutschland - 99.148.552 | 99.148.552 | 10,07 |
| 4.800.000 | adidas AG 0.000% 09-Sep-2024 | 4.816.048 | 0,49 |
| 1.200.000 | adidas AG 0.000% 05-Oct-2028 | 1.190.059 | 0,12 |
| 1.100.000 | Allianz Finance II BV 'EMTN' 0.250% 06-Jun-2023 | 1.107.742 | 0,11 |
| 4.800.000 | Allianz SE 'EMTN' FRN (Perpetual) 4.750% 24-Oct-2023 | 5.186.916 | 0,53 |
| 1.600.000 | Allianz SE FRN 5.625% 17-Oct-2042 | 1.668.440 | 0,17 |
| 2.400.000 | Allianz SE FRN (Perpetual) 3.375% 18-Sep-2024 | 2.582.140 | 0,26 |
| 1.700.000 | BMW Finance NV 'EMTN' 0.000% 11-Jan-2026 | 1.698.016 | 0,17 |
| 739.000 | BMW Finance NV 'EMTN' 0.200% 11-Jan-2033 | 707.613 | 0,07 |
| 2.284.000 | Commerzbank AG 'EMTN' 0.500% 28-Aug-2023 | 2.308.147 | 0,23 |
| 1.500.000 | Commerzbank AG 'EMTN' 0.875% 22-Jan-2027 | 1.511.195 | 0,15 |
| 1.400.000 | Commerzbank AG 'EMTN' 1.875% 28-Feb-2028 | 1.490.461 | 0,15 |
| 700.000 | Commerzbank AG 'EMTN' FRN 0.750% 24-Mar-2026 | 710.662 | 0,07 |
| 1.500.000 | Commerzbank AG 'EMTN' FRN 4.000% 05-Dec-2030 | 1.638.945 | 0,17 |
| 2.377.000 | Continental AG 'EMTN' 2.500% 27-Aug-2026 | 2.605.367 | 0,26 |
| 2.016.000 | Daimler AG 'EMTN' 0.750% 11-Mar-2033 | 2.028.983 | 0,21 |
| 1.000.000 | Daimler AG 'EMTN' 1.625% 22-Aug-2023 | 1.031.276 | 0,11 |
| 956.000 | Daimler International Finance BV 'EMTN' 1.375% 26-Jun-2026 | 1.013.693 | 0,10 |
| 1.892.000 | Daimler International Finance BV 'EMTN' 2.000% 22-Aug-2026 | 2.056.538 | 0,21 |
| 1.121.000 | Deutsche Bahn Finance GMBH 'EMTN' 0.625% 08-Dec-2050 | 974.259 | 0,10 |
| 4.200.000 | Deutsche Bahn Finance GMBH FRN (Perpetual) 0.950% 22-Jan-2025 | 4.194.522 | 0,43 |
| 2.800.000 | Deutsche Bank AG 'EMTN' FRN 1.000% 19-Nov-2025 | 2.850.305 | 0,29 |
| 764.000 | Deutsche Bank AG 'EMTN' FRN 1.375% 10-Jun-2026 | 794.981 | 0,08 |
| 2.300.000 | Deutsche Bank AG FRN 1.375% 17-Feb-2032 | 2.297.585 | 0,23 |
| 1.500.000 | Deutsche Boerse AG 0.000% 22-Feb-2026 | 1.497.584 | 0,15 |
| 1.100.000 | Deutsche Boerse AG FRN 1.250% 16-Jun-2047 | 1.125.401 | 0,11 |
| 481.000 | Deutsche Telekom AG 'EMTN' 1.375% 05-Jul-2034 | 510.108 | 0,05 |
| 2.500.000 | Deutsche Telekom International Finance BV 'EMTN' 0.625% 01-Dec-2022 | 2.523.201 | 0,26 |
| 3.100.000 | Deutsche Telekom International Finance BV 'EMTN' 0.875% 30-Jan-2024 | 3.166.303 | 0,32 |
| 297.000 | E.ON International Finance BV 'EMTN' 5.750% 14-Feb-2033 | 449.067 | 0,05 |
| 3.100.000 | Eurogrid GmbH 'EMTN' 1.113% 15-May-2032 | 3.225.669 | 0,33 |
| 600.000 | Eurogrid GmbH 'EMTN' 1.500% 18-Apr-2028 | 638.775 | 0,07 |
| 100.000 | Eurogrid GmbH 'EMTN' 1.625% 03-Nov-2023 | 102.875 | 0,01 |
| 800.000 | Eurogrid GmbH 'EMTN' 1.875% 10-Jun-2025 | 844.826 | 0,09 |
| 5.500.000 | Grand City Properties SA 'EMTN' 0.125% 11-Jan-2028 | 5.280.732 | 0,54 |
| 1.400.000 | Infineon Technologies AG 'EMTN' 0.750% 24-Jun-2023 | 1.417.277 | 0,14 |
| 1.400.000 | Infineon Technologies AG 'EMTN' 1.125% 24-Jun-2026 | 1.450.373 | 0,15 |
| 2.000.000 | Infineon Technologies AG 'EMTN' 1.625% 24-Jun-2029 | 2.132.510 | 0,22 |
| 800.000 | Infineon Technologies AG 'EMTN' 2.000% 24-Jun-2032 | 872.984 | 0,09 |
| 1.000.000 | Merck Financial Services GmbH 'EMTN' 0.005% 15-Dec-2023 | 1.004.865 | 0,10 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert EUR | Summe Nettöver- mögen % |
|---------------------------|---|----------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Deutschland Forts. | | | |
| 2.000.000 | Merck Financial Services GmbH 'EMTN' 0.125% 16-Jul-2025 | 2.011.073 | 0,20 |
| 700.000 | Merck KGaA FRN 1.625% 25-Jun-2079 | 720.488 | 0,07 |
| 2.200.000 | Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen FRN 3.250% 26-May-2049 | 2.492.320 | 0,25 |
| 2.000.000 | SAP SE 1.250% 10-Mar-2028 | 2.126.058 | 0,22 |
| 900.000 | Schaeffler AG 'EMTN' 2.750% 12-Oct-2025 | 956.709 | 0,10 |
| 1.500.000 | Siemens Finanzierungsmaatschappij NV 'EMTN' 0.250% 20-Feb-2029 | 1.502.423 | 0,15 |
| 2.800.000 | Vonovia Finance BV 1.800% 29-Jun-2025 | 2.943.200 | 0,30 |
| 1.000.000 | Vonovia Finance BV 2.250% 07-Apr-2030 | 1.111.165 | 0,11 |
| 700.000 | Vonovia Finance BV 'EMTN' 0.625% 07-Oct-2027 | 700.913 | 0,07 |
| 2.300.000 | Vonovia Finance BV 'EMTN' 0.875% 03-Jul-2023 | 2.328.279 | 0,24 |
| 2.800.000 | Vonovia Finance BV 'EMTN' 1.625% 07-Apr-2024 | 2.892.943 | 0,29 |
| 1.400.000 | Vonovia Finance BV 'EMTN' 1.625% 07-Oct-2039 | 1.389.080 | 0,14 |
| 500.000 | Vonovia Finance BV 'EMTN' 1.750% 25-Jan-2027 | 532.262 | 0,05 |
| 800.000 | Vonovia Finance BV 'EMTN' 2.250% 15-Dec-2023 | 837.097 | 0,09 |
| 2.100.000 | Vonovia SE 1.500% 14-Jun-2041 | 2.033.944 | 0,21 |
| 1.100.000 | ZF Finance GmbH 'EMTN' 2.750% 25-May-2027 | 1.131.003 | 0,12 |
| 700.000 | ZF Finance GmbH 'EMTN' 3.000% 21-Sep-2025 | 733.152 | 0,07 |
| | Hongkong - 2.095.235 | 2.095.235 | 0,21 |
| 2.119.000 | AIA Group Ltd 'GMTN' FRN 0.880% 09-Sep-2033 | 2.095.235 | 0,21 |
| | Irland - 14.190.312 | 14.190.312 | 1,44 |
| 3.657.000 | Bank of Ireland Group Plc 'EMTN' FRN 1.375% 11-Aug-2031 | 3.617.504 | 0,37 |
| 811.000 | CRH Funding BV 1.625% 05-May-2030 | 870.221 | 0,09 |
| 4.027.000 | Dell Bank International DAC 'EMTN' 0.500% 27-Oct-2026 | 4.007.389 | 0,40 |
| 975.000 | Permanent TSB Group Holdings Plc 'EMTN' FRN 2.125% 26-Sep-2024 | 991.214 | 0,10 |
| 2.592.000 | Permanent TSB Group Holdings Plc 'EMTN' FRN 3.000% 19-Aug-2031 | 2.636.777 | 0,27 |
| 2.103.000 | Smurfit Kappa Treasury ULC 0.500% 22-Sep-2029 | 2.067.207 | 0,21 |
| | Italien - 49.389.055 | 49.389.055 | 5,02 |
| 1.380.000 | Assicurazioni Generali SpA 'EMTN' 2.124% 01-Oct-2030 | 1.449.718 | 0,15 |
| 3.957.000 | Enel Finance International NV 'EMTN' 0.375% 28-May-2029 | 3.892.382 | 0,40 |
| 3.306.000 | Enel SpA FRN (Perpetual) 1.875% 08-Jun-2030 | 3.211.779 | 0,33 |
| 2.713.000 | Eni SpA FRN (Perpetual) 2.000% 11-Feb-2027 | 2.703.098 | 0,27 |
| 1.007.000 | FCA Bank SpA/Ireland 'EMTN' 0.000% 16-Apr-2024 | 1.005.384 | 0,10 |
| 1.900.000 | FCA Bank SpA/Ireland 'EMTN' 0.125% 16-Nov-2023 | 1.903.460 | 0,19 |
| 873.000 | FCA Bank SpA/Ireland 'EMTN' 1.000% 21-Feb-2022 | 873.834 | 0,09 |
| 2.820.000 | Iccrea Banca SpA 'EMTN' FRN 4.750% 18-Jan-2032 | 2.844.675 | 0,29 |
| 1.120.000 | Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' 0.750% 04-Dec-2024 | 1.138.895 | 0,12 |
| 3.075.000 | Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' 0.750% 16-Mar-2028 | 3.072.340 | 0,31 |
| 1.667.000 | Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' 0.875% 27-Jun-2022 | 1.677.485 | 0,17 |
| 2.920.000 | Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' 1.000% 22-Jul-2022 | 2.941.681 | 0,30 |
| 2.200.000 | Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' 1.000% 04-Jul-2024 | 2.246.987 | 0,23 |
| 1.200.000 | Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' 2.125% 30-Aug-2023 | 1.245.011 | 0,13 |
| 2.515.000 | Intesa Sanpaolo Vita SpA 2.375% 22-Dec-2030 | 2.461.481 | 0,25 |
| 1.315.000 | Leasys SpA 0.000% 22-Jul-2024 | 1.313.521 | 0,13 |
| 2.602.000 | Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA 'EMTN' FRN 0.750% 02-Nov-2028 | 2.558.013 | 0,26 |
| 1.551.000 | Terna - Rete Elettrica Nazionale 0.750% 24-Jul-2032 | 1.546.009 | 0,16 |
| 1.692.000 | Terna - Rete Elettrica Nazionale 'EMTN' 0.125% 25-Jul-2025 | 1.693.337 | 0,17 |
| 1.368.000 | Terna - Rete Elettrica Nazionale 'EMTN' 1.000% 10-Apr-2026 | 1.412.772 | 0,14 |
| 1.500.000 | Terna - Rete Elettrica Nazionale 'EMTN' 1.375% 26-Jul-2027 | 1.579.205 | 0,16 |
| 1.000.000 | UniCredit SpA 1.800% 20-Jan-2030 | 1.027.598 | 0,10 |
| 2.505.000 | UniCredit SpA 'EMTN' FRN 0.800% 05-Jul-2029 | 2.503.960 | 0,25 |
| 2.070.000 | UniCredit SpA 'EMTN' FRN 1.250% 25-Jun-2025 | 2.120.769 | 0,22 |
| 957.000 | UniCredit SpA 'EMTN' FRN 2.000% 23-Sep-2029 | 965.661 | 0,10 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert EUR | Summe Nettover- mögen % |
|---------------------------------|--|-------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Japan - 7.934.700 | | | |
| 3.516.000 | Takeda Pharmaceutical Co Ltd 1.375% 09-Jul-2032 | 3.653.644 | 0,37 |
| 3.604.000 | Takeda Pharmaceutical Co Ltd 'REGS' 3.000% 21-Nov-2030 | 4.281.056 | 0,44 |
| Luxemburg - 19.127.141 | | | |
| 8.311.000 | Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl 'EMTN' 1.000% 04-May-2028 | 8.115.484 | 0,82 |
| 3.809.000 | Logicor Financing Sarl 'EMTN' 0.875% 14-Jan-2031 | 3.622.549 | 0,37 |
| 1.984.000 | Logicor Financing Sarl 'EMTN' 1.500% 13-Jul-2026 | 2.054.442 | 0,21 |
| 2.142.000 | Logicor Financing Sarl 'EMTN' 1.625% 15-Jul-2027 | 2.222.272 | 0,22 |
| 3.000.000 | SELP Finance Sarl 1.500% 20-Dec-2026 | 3.112.394 | 0,32 |
| Niederlande - 78.119.661 | | | |
| 1.800.000 | ABN AMRO Bank NV 0.600% 15-Jan-2027 | 1.819.141 | 0,18 |
| 3.584.000 | ABN AMRO Bank NV 'EMTN' 0.500% 17-Jul-2023 | 3.625.063 | 0,37 |
| 2.202.000 | ABN AMRO Bank NV 'EMTN' 0.500% 15-Apr-2026 | 2.239.921 | 0,23 |
| 1.400.000 | ABN AMRO Bank NV 'EMTN' 1.250% 28-May-2025 | 1.451.405 | 0,15 |
| 1.700.000 | ABN AMRO Bank NV 'EMTN' FRN 2.875% 18-Jan-2028 | 1.747.879 | 0,18 |
| 1.700.000 | ABN AMRO Bank NV FRN (Perpetual) 4.375% 22-Sep-2025 | 1.825.800 | 0,18 |
| 2.718.000 | Achmea BV 'EMTN' FRN 6.000% 04-Apr-2043 | 2.916.819 | 0,30 |
| 1.295.000 | Aegon Bank NV 0.625% 21-Jun-2024 | 1.316.844 | 0,13 |
| 1.300.000 | ASML Holding NV 0.625% 07-May-2029 | 1.328.689 | 0,13 |
| 495.000 | ASR Nederland NV FRN 3.375% 02-May-2049 | 546.139 | 0,05 |
| 3.305.000 | Athora Netherlands NV FRN 2.250% 15-Jul-2031 | 3.303.348 | 0,34 |
| 1.000.000 | Cooperatieve Rabobank UA 'GMTN' 0.750% 29-Aug-2023 | 1.016.100 | 0,10 |
| 1.800.000 | de Volksbank NV 'EMTN' 0.010% 16-Sep-2024 | 1.807.472 | 0,18 |
| 2.500.000 | de Volksbank NV 'EMTN' 0.750% 25-Jun-2023 | 2.535.113 | 0,26 |
| 2.251.000 | Enexis Holding NV 'EMTN' 0.375% 14-Apr-2033 | 2.169.570 | 0,22 |
| 1.832.000 | Enexis Holding NV 'EMTN' 0.625% 17-Jun-2032 | 1.837.958 | 0,19 |
| 1.115.000 | Enexis Holding NV 'EMTN' 0.750% 02-Jul-2031 | 1.138.702 | 0,12 |
| 1.701.000 | Euronext NV 1.000% 18-Apr-2025 | 1.748.585 | 0,18 |
| 2.460.000 | Euronext NV 1.500% 17-May-2041 | 2.436.901 | 0,25 |
| 5.700.000 | ING Groep NV 'EMTN' 1.000% 20-Sep-2023 | 5.817.128 | 0,59 |
| 900.000 | ING Groep NV 'EMTN' FRN 1.625% 26-Sep-2029 | 924.888 | 0,09 |
| 3.000.000 | ING Groep NV FRN 0.375% 29-Sep-2028 | 2.949.750 | 0,30 |
| 3.600.000 | ING Groep NV FRN 1.000% 13-Nov-2030 | 3.618.153 | 0,37 |
| 3.736.000 | JDE Peet's NV 'EMTN' 0.625% 09-Feb-2028 | 3.705.869 | 0,38 |
| 1.200.000 | Koninklijke KPN NV 'EMTN' 0.875% 14-Dec-2032 | 1.180.199 | 0,12 |
| 2.323.000 | LeasePlan Corp NV 'EMTN' 0.250% 23-Feb-2026 | 2.306.669 | 0,23 |
| 933.000 | LeasePlan Corp NV 'EMTN' 1.375% 07-Mar-2024 | 961.726 | 0,10 |
| 2.800.000 | Nationale-Nederlanden Bank NV/The Netherlands 0.375% 26-Feb-2025 | 2.832.237 | 0,29 |
| 1.590.000 | Nationale-Nederlanden Levensverzekering Maatschappij NV FRN 9.000% 29-Aug-2042 | 1.683.810 | 0,17 |
| 1.728.000 | NN Group NV 'EMTN' 0.875% 13-Jan-2023 | 1.744.780 | 0,18 |
| 284.000 | NN Group NV 'EMTN' 1.625% 01-Jun-2027 | 303.008 | 0,03 |
| 1.854.000 | TenneT Holding BV 'EMTN' 0.125% 30-Nov-2032 | 1.743.271 | 0,18 |
| 1.822.000 | TenneT Holding BV 'EMTN' 0.875% 03-Jun-2030 | 1.876.666 | 0,19 |
| 2.560.000 | Vesteda Finance BV 'EMTN' 0.750% 18-Oct-2031 | 2.533.581 | 0,26 |
| 1.698.000 | Vesteda Finance BV 'EMTN' 1.500% 24-May-2027 | 1.794.163 | 0,18 |
| 1.400.000 | Vesteda Finance BV 'EMTN' 2.000% 10-Jul-2026 | 1.500.249 | 0,15 |
| 892.000 | VIA Outlets BV 1.750% 15-Nov-2028 | 890.537 | 0,09 |
| 2.900.000 | WP/AP Telecom Holdings IV BV 'REGS' 3.750% 15-Jan-2029 | 2.941.528 | 0,30 |
| Neuseeland - 3.708.335 | | | |
| 2.500.000 | BNZ International Funding Ltd/London 'GMTN' 0.375% 14-Sep-2024 | 2.521.863 | 0,26 |
| 1.161.000 | Chorus Ltd 'EMTN' 1.125% 18-Oct-2023 | 1.186.472 | 0,12 |
| Norwegen - 2.689.852 | | | |
| 2.676.000 | DNB Bank ASA 'EMTN' 0.050% 14-Nov-2023 | 2.689.852 | 0,27 |
| Polen - 1.956.211 | | | |
| 1.989.000 | InPost SA 'REGS' 2.250% 15-Jul-2027 | 1.956.211 | 0,20 |

| Bestände | Beschreibung | Beizulegender Zeitwert EUR | Summe Nettover- mögen % |
|---------------------------------|--|-------------------------------|----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Portugal - 6.251.225 | | | |
| 4.900.000 | Cia de Seguros Fidelidade SA FRN 4.250% 04-Sep-2031 | 5.266.422 | 0,54 |
| 918.000 | Ren Finance BV 'EMTN' 1.750% 18-Jan-2028 | 984.803 | 0,10 |
| Republik Korea - 784.811 | | | |
| 780.000 | LG Chem Ltd 'REGS' 0.500% 15-Apr-2023 | 784.811 | 0,08 |
| Spanien - 73.504.699 | | | |
| 6.700.000 | Abanca Corp Bancaria SA 'EMTN' FRN 0.500% 08-Sep-2027 | 6.582.214 | 0,67 |
| 2.300.000 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 'GMTN' 0.750% 04-Jun-2025 | 2.344.591 | 0,24 |
| 500.000 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 'GMTN' FRN 3.104% 15-Jul-2031 | 608.136 | 0,06 |
| 1.200.000 | Banco de Sabadell SA 'EMTN' 0.875% 05-Mar-2023 | 1.212.808 | 0,12 |
| 1.800.000 | Banco de Sabadell SA 'EMTN' 1.625% 07-Mar-2024 | 1.853.072 | 0,19 |
| 2.600.000 | Banco de Sabadell SA 'EMTN' FRN 0.875% 16-Jun-2028 | 2.511.158 | 0,26 |
| 2.000.000 | Banco Santander SA 'EMTN' 0.200% 11-Feb-2028 | 1.966.118 | 0,20 |
| 1.500.000 | Banco Santander SA 'EMTN' 0.300% 04-Oct-2026 | 1.501.042 | 0,15 |
| 1.900.000 | Bankinter SA 0.625% 06-Oct-2027 | 1.896.570 | 0,19 |
| 1.000.000 | Bankinter SA 0.875% 05-Mar-2024 | 1.019.071 | 0,10 |
| 6.200.000 | CaixaBank SA 'EMTN' 0.375% 03-Feb-2025 | 6.236.146 | 0,63 |
| 900.000 | CaixaBank SA 'EMTN' 1.000% 25-Jun-2024 | 919.816 | 0,09 |
| 2.300.000 | CaixaBank SA 'EMTN' 1.750% 24-Oct-2023 | 2.371.946 | 0,24 |
| 3.500.000 | CaixaBank SA 'EMTN' FRN 0.375% 18-Nov-2026 | 3.485.895 | 0,35 |
| 3.400.000 | CaixaBank SA 'EMTN' FRN 1.250% 18-Jun-2031 | 3.406.188 | 0,35 |
| 1.900.000 | CaixaBank SA FRN 3.375% 15-Mar-2027 | 1.913.072 | 0,19 |
| 1.500.000 | Cellnex Finance Co SA 'EMTN' 2.000% 15-Feb-2033 | 1.428.458 | 0,15 |
| 2.000.000 | Cellnex Telecom SA 'EMTN' 1.750% 23-Oct-2030 | 1.923.890 | 0,20 |
| 2.609.000 | FCC Aqualia SA 2.629% 08-Jun-2027 | 2.862.243 | 0,29 |
| 2.700.000 | Iberdrola Finanzas SA FRN (Perpetual) 1.575% 16-Nov-2027 | 2.706.750 | 0,28 |
| 2.900.000 | Iberdrola International BV FRN (Perpetual) 1.450% 09-Nov-2026 | 2.908.159 | 0,30 |
| 1.400.000 | Iberdrola International BV FRN (Perpetual) 1.874% 28-Jan-2026 | 1.429.680 | 0,15 |
| 1.800.000 | Iberdrola International BV FRN (Perpetual) 1.875% 22-Feb-2023 | 1.839.435 | 0,19 |
| 2.100.000 | Iberdrola International BV FRN (Perpetual) 2.250% 28-Jan-2029 | 2.145.780 | 0,22 |
| 500.000 | Iberdrola International BV FRN (Perpetual) 3.250% 12-Nov-2024 | 537.938 | 0,05 |
| 1.800.000 | Inmobiliaria Colonial Socimi SA 'EMTN' 1.350% 14-Oct-2028 | 1.859.294 | 0,19 |
| 600.000 | Inmobiliaria Colonial Socimi SA 'EMTN' 1.625% 28-Nov-2025 | 629.412 | 0,06 |
| 1.200.000 | Inmobiliaria Colonial Socimi SA 'EMTN' 2.000% 17-Apr-2026 | 1.273.740 | 0,13 |
| 2.600.000 | Kutxabank SA FRN 0.500% 14-Oct-2027 | 2.580.474 | 0,26 |
| 1.500.000 | Red Electrica Financiaciones SAU 'EMTN' 0.375% 24-Jul-2028 | 1.519.568 | 0,15 |
| 400.000 | Red Electrica Financiaciones SAU 'EMTN' 1.000% 21-Apr-2026 | 416.628 | 0,04 |
| 2.400.000 | Santander Consumer Finance SA 'EMTN' 0.375% 27-Jun-2024 | 2.419.752 | 0,25 |
| 2.400.000 | Telefonica Europe BV FRN (Perpetual) 2.376% 12-Feb-2029 | 2.288.160 | 0,23 |
| 2.700.000 | Telefonica Europe BV FRN (Perpetual) 4.375% 14-Dec-2024 | 2.907.495 | 0,30 |
| Schweden - 1.771.399 | | | |
| 4.483.000 | Heimstaden Bostad Treasury BV 'EMTN' 1.000% 13-Apr-2028 | 4.468.632 | 0,46 |
| 1.500.000 | Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB 'EMTN' 1.000% 12-Aug-2027 | 1.486.900 | 0,15 |
| 2.714.000 | Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB FRN (Perpetual) 2.625% 14-Dec-2025 | 2.640.594 | 0,27 |
| 1.545.000 | SBB Treasury Oyj 'EMTN' 0.750% 14-Dec-2028 | 1.478.707 | 0,15 |
| 3.562.000 | SBB Treasury Oyj 'EMTN' 1.125% 26-Nov-2029 | 3.448.372 | 0,35 |
| 1.590.000 | Skandinaviska Enskilda Banken AB 'GMTN' 0.300% 17-Feb-2022 | 1.591.447 | 0,16 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Summe Beizulegender Nettowert Zeitwert EUR | Summe Nettowert- mögen % |
|---|--|---|-----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Schweden Forts. | | | |
| 2.540.000 | Swedbank AB 'EMTN' 0.750% 05-May-2025 | 2.597.747 | 0,26 |
| Schweiz - 30.574.033 | | | |
| 2.044.000 | Adecco International Financial Services BV 'EMTN' 0.500% 21-Sep-2031 | 1.972.000 | 0,20 |
| 3.100.000 | Argentum Netherlands BV for Givaudan SA 1.125% 17-Sep-2025 | 3.203.274 | 0,33 |
| 4.016.000 | Credit Suisse AG/London 'EMTN' 0.250% 05-Jan-2026 | 4.005.659 | 0,41 |
| 480.000 | Credit Suisse Group AG 'EMTN' FRN 0.650% 14-Jan-2028 | 475.970 | 0,05 |
| 6.803.000 | Credit Suisse Group AG 'EMTN' FRN 3.250% 02-Apr-2026 | 7.406.177 | 0,75 |
| 900.000 | Givaudan Finance Europe BV 1.000% 22-Apr-2027 | 937.850 | 0,10 |
| 604.000 | Givaudan Finance Europe BV 1.625% 22-Apr-2032 | 655.669 | 0,07 |
| 1.380.000 | Nestle Finance International Ltd 0.000% 03-Dec-2025 | 1.379.043 | 0,14 |
| 1.840.000 | Richemont International Holding SA 1.125% 26-May-2032 | 1.919.307 | 0,19 |
| 1.363.000 | Swisscom Finance BV 0.375% 14-Nov-2028 | 1.375.519 | 0,14 |
| 2.776.000 | UBS Group AG 0.875% 03-Nov-2031 | 2.771.225 | 0,28 |
| 4.340.000 | UBS Group AG 1.500% 30-Nov-2024 | 4.472.340 | 0,45 |
| Vereinigtes Königreich - 134.957.479 | | | |
| 2.400.000 | Annington Funding Plc 'EMTN' 1.650% 12-Jul-2024 | 2.483.466 | 0,25 |
| 625.000 | Aviva Plc 'EMTN' FRN 3.875% 03-Jul-2044 | 676.251 | 0,07 |
| 1.794.000 | Barclays Plc 'EMTN' FRN 2.000% 07-Feb-2028 | 1.827.220 | 0,19 |
| 3.893.000 | Barclays Plc FRN 0.577% 09-Aug-2029 | 3.810.702 | 0,39 |
| 2.701.000 | Barclays Plc FRN 1.106% 12-May-2032 | 2.681.310 | 0,27 |
| 4.080.000 | BP Capital Markets BV 1.467% 21-Sep-2041 | 3.975.776 | 0,40 |
| 1.778.000 | BP Capital Markets Plc FRN (Perpetual) 3.250% 22-Mar-2026 | 1.884.769 | 0,19 |
| 1.895.000 | BP Capital Markets Plc FRN (Perpetual) 3.625% 22-Mar-2029 | 2.040.441 | 0,21 |
| 2.900.000 | British Telecommunications Plc 'EMTN' 0.500% 12-Sep-2025 | 2.917.328 | 0,30 |
| 1.720.000 | British Telecommunications Plc 'EMTN' 1.000% 21-Nov-2024 | 1.751.876 | 0,18 |
| 1.278.000 | Cadent Finance Plc 'EMTN' 0.750% 11-Mar-2032 | 1.242.954 | 0,13 |
| 6.112.000 | CCEP Finance Ireland DAC 0.875% 06-May-2033 | 6.010.938 | 0,61 |
| 2.999.000 | CNH Industrial Finance Europe SA 0.000% 01-Apr-2024 | 2.993.061 | 0,30 |
| 4.984.000 | CNH Industrial Finance Europe SA 'EMTN' 1.625% 03-Jul-2029 | 5.240.601 | 0,53 |
| 4.949.000 | Coca-Cola Europacific Partners Plc 0.750% 24-Feb-2022 | 4.952.984 | 0,50 |
| 2.233.000 | Coca-Cola Europacific Partners Plc 1.125% 26-May-2024 | 2.289.750 | 0,23 |
| 2.862.000 | Coca-Cola Europacific Partners Plc 1.750% 27-Mar-2026 | 3.033.838 | 0,31 |
| 4.170.000 | GlaxoSmithKline Capital Plc 'EMTN' 1.250% 21-May-2026 | 4.381.053 | 0,45 |
| 652.000 | GlaxoSmithKline Capital Plc 'EMTN' 1.750% 21-May-2030 | 719.309 | 0,07 |
| 4.718.000 | Hammerson Ireland Finance DAC 1.750% 03-Jun-2027 | 4.647.560 | 0,47 |
| 4.404.000 | Heathrow Funding Ltd 1.500% 12-Oct-2025 | 4.568.732 | 0,46 |
| 1.400.000 | Heathrow Funding Ltd 'EMTN' 1.125% 08-Oct-2030 | 1.386.546 | 0,14 |
| 2.232.000 | Heathrow Funding Ltd 'EMTN' 1.875% 23-May-2022 | 2.250.503 | 0,23 |
| 900.000 | HSBC Holdings Plc FRN 0.309% 13-Nov-2026 | 898.830 | 0,09 |
| 1.455.000 | HSBC Holdings Plc FRN 0.641% 24-Sep-2029 | 1.447.289 | 0,15 |
| 4.800.000 | HSBC Holdings Plc FRN 3.000% 22-Jul-2028 | 5.976.866 | 0,61 |
| 1.093.000 | InterContinental Hotels Group Plc 'EMTN' 1.625% 08-Oct-2024 | 1.130.862 | 0,11 |
| 2.675.000 | InterContinental Hotels Group Plc 'EMTN' 2.125% 15-May-2027 | 2.836.987 | 0,29 |
| 2.162.000 | London Stock Exchange Group Plc 'EMTN' 1.750% 06-Dec-2027 | 2.324.322 | 0,24 |
| 1.256.000 | National Grid Electricity Transmission Plc 0.190% 20-Jan-2025 | 1.260.131 | 0,13 |
| 2.582.000 | National Grid Electricity Transmission Plc 'EMTN' 0.823% 07-Jul-2032 | 2.571.750 | 0,26 |
| 1.467.000 | NatWest Group Plc 'EMTN' FRN 0.780% 26-Feb-2030 | 1.449.359 | 0,15 |

| Bestände | Beschreibung | Summe Beizulegender Nettowert Zeitwert EUR | Summe Nettowert- mögen % |
|---|---|---|-----------------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Vereinigtes Königreich Forts. | | | |
| 4.691.000 | NatWest Group Plc 'EMTN' FRN 1.043% 14-Sep-2032 | 4.621.339 | 0,47 |
| 3.289.000 | NatWest Markets Plc 'EMTN' 0.125% 12-Nov-2025 | 3.274.940 | 0,33 |
| 500.000 | NatWest Markets Plc 'EMTN' 1.000% 28-May-2024 | 512.459 | 0,05 |
| 1.533.000 | Phoenix Group Holdings Plc 'EMTN' 4.375% 24-Jan-2029 | 1.781.154 | 0,18 |
| 5.361.000 | RELX Finance BV 0.000% 18-Mar-2024 | 5.373.070 | 0,55 |
| 1.433.000 | RELX Finance BV 0.500% 10-Mar-2028 | 1.438.277 | 0,15 |
| 3.599.000 | Standard Chartered Plc 'EMTN' FRN 1.200% 23-Sep-2031 | 3.591.370 | 0,36 |
| 2.505.000 | Standard Chartered Plc FRN 2.500% 09-Sep-2030 | 2.626.872 | 0,27 |
| 2.496.000 | Tesco Corporate Treasury Services Plc 'EMTN' 0.375% 27-Jul-2029 | 2.401.452 | 0,24 |
| 3.180.000 | Tesco Corporate Treasury Services Plc 'EMTN' 1.375% 24-Oct-2023 | 3.253.092 | 0,33 |
| 990.000 | Unilever Finance Netherlands BV 1.750% 25-Mar-2030 | 1.092.444 | 0,11 |
| 1.165.000 | Virgin Money UK Plc FRN 2.875% 24-Jun-2025 | 1.235.354 | 0,13 |
| 1.464.000 | Virgin Money UK Plc 'GMTN' FRN 0.375% 27-May-2024 | 1.471.122 | 0,15 |
| 3.140.000 | Vmed O2 UK Financing I Plc 'REGS' 4.500% 15-Jul-2031 | 3.736.800 | 0,38 |
| 635.000 | Vodafone Group Plc 'EMTN' 2.200% 25-Aug-2026 | 693.056 | 0,07 |
| 956.000 | Vodafone Group Plc 'EMTN' 2.500% 24-May-2039 | 1.083.518 | 0,11 |
| 860.000 | Vodafone Group Plc FRN 3.000% 27-Aug-2080 | 869.494 | 0,09 |
| 3.570.000 | Vodafone Group Plc FRN 3.100% 03-Jan-2079 | 3.689.988 | 0,37 |
| 4.584.000 | Yorkshire Building Society 'EMTN' 0.500% 01-Jul-2028 | 4.548.314 | 0,46 |
| Vereinigte Staaten von Amerika - 178.049.187 | | | |
| 1.096.000 | Abbott Ireland Financing DAC 1.500% 27-Sep-2026 | 1.164.544 | 0,12 |
| 1.002.000 | AbbVie Inc 0.750% 18-Nov-2027 | 1.019.037 | 0,10 |
| 1.970.000 | American International Group Inc 1.875% 21-Jun-2027 | 2.094.545 | 0,21 |
| 2.140.000 | Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc 'REGS' 2.000% 01-Sep-2028 | 2.119.017 | 0,22 |
| 2.123.000 | AT&T Inc 0.250% 04-Mar-2026 | 2.118.552 | 0,21 |
| 2.853.000 | AT&T Inc 1.950% 15-Sep-2023 | 2.942.222 | 0,30 |
| 7.325.000 | AT&T Inc 3.150% 04-Sep-2036 | 8.730.604 | 0,89 |
| 1.145.000 | Bank of America Corp 'EMTN' FRN 0.580% 08-Aug-2029 | 1.136.575 | 0,12 |
| 3.132.000 | Bank of America Corp 'EMTN' FRN 0.808% 09-May-2026 | 3.190.315 | 0,32 |
| 1.280.000 | Bank of America Corp 'EMTN' FRN 1.379% 07-Feb-2025 | 1.316.683 | 0,13 |
| 400.000 | Bank of America Corp 'EMTN' FRN 1.381% 09-May-2030 | 417.844 | 0,04 |
| 2.298.000 | Bank of America Corp 'EMTN' FRN 1.667% 02-Jun-2029 | 2.703.343 | 0,27 |
| 3.580.000 | Becton Dickinson and Co 1.000% 15-Dec-2022 | 3.619.865 | 0,37 |
| 2.400.000 | Becton Dickinson and Co 1.401% 24-May-2023 | 2.448.276 | 0,25 |
| 1.387.000 | Becton Dickinson Euro Finance Sarl 0.334% 13-Aug-2028 | 1.364.031 | 0,14 |
| 1.289.000 | Becton Dickinson Euro Finance Sarl 0.632% 04-Jun-2023 | 1.301.748 | 0,13 |
| 1.504.000 | Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.208% 04-Jun-2026 | 1.556.927 | 0,16 |
| 776.000 | Becton Dickinson Euro Finance Sarl 1.213% 12-Feb-2036 | 760.831 | 0,08 |
| 1.630.000 | Berry Global Inc 'REGS' 1.500% 15-Jan-2027 | 1.663.594 | 0,17 |
| 916.000 | Chubb INA Holdings Inc 0.875% 15-Jun-2027 | 938.151 | 0,10 |
| 1.580.000 | Chubb INA Holdings Inc 0.875% 15-Dec-2029 | 1.607.690 | 0,16 |
| 828.000 | Chubb INA Holdings Inc 1.400% 15-Jun-2031 | 872.233 | 0,09 |
| 1.935.000 | Chubb INA Holdings Inc 1.550% 15-Mar-2028 | 2.052.168 | 0,21 |
| 1.247.000 | Citigroup Inc 'EMTN' FRN 0.500% 08-Oct-2027 | 1.248.291 | 0,13 |
| 5.941.000 | Coca-Cola Co/The 0.800% 15-Mar-2040 | 5.617.598 | 0,57 |
| 1.150.000 | Colgate-Palmolive Co 'EMTN' 0.875% 12-Nov-2039 | 1.144.410 | 0,12 |
| 7.034.000 | Comcast Corp 0.000% 14-Sep-2026 | 6.944.070 | 0,71 |
| 2.335.000 | Comcast Corp 0.750% 20-Feb-2032 | 2.327.119 | 0,24 |
| 640.000 | Danaher Corp 1.700% 30-Mar-2024 | 665.100 | 0,07 |
| 1.793.000 | Danaher Corp 2.500% 30-Mar-2030 | 2.055.531 | 0,21 |
| 1.200.000 | DH Europe Finance II Sarl 0.750% 18-Sep-2031 | 1.197.093 | 0,12 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Bestände | Beschreibung | Summe Beizulegender Nettowert Zeitwert EUR | Nettover- mögen % |
|--|--|---|-------------------------|
| Anleihen Forts. | | | |
| Vereinigte Staaten von Amerika Forts. | | | |
| 870.000 | DH Europe Finance II Sarl 1.350% 18-Sep-2039 | 871.124 | 0,09 |
| 588.000 | Dow Chemical Co/The 1.125% 15-Mar-2032 | 588.812 | 0,06 |
| 2.248.000 | Ecolab Inc 1.000% 15-Jan-2024 | 2.293.825 | 0,23 |
| 2.089.000 | Eli Lilly & Co 1.375% 14-Sep-2061 | 1.911.727 | 0,19 |
| 3.225.000 | FedEx Corp 0.450% 04-May-2029 | 3.176.948 | 0,32 |
| 1.220.000 | FedEx Corp 1.300% 05-Aug-2031 | 1.258.729 | 0,13 |
| 736.000 | Fidelity National Information Services Inc 1.000% 03-Dec-2028 | 749.451 | 0,08 |
| 1.961.000 | Fidelity National Information Services Inc 1.500% 21-May-2027 | 2.051.414 | 0,21 |
| 1.266.000 | Fidelity National Information Services Inc 2.000% 21-May-2030 | 1.376.137 | 0,14 |
| 2.970.000 | Goldman Sachs Group Inc/The 3.375% 27-Mar-2025 | 3.275.895 | 0,33 |
| 4.073.000 | Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 0.250% 26-Jan-2028 | 3.973.639 | 0,40 |
| 4.385.000 | Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 0.750% 23-Mar-2032 | 4.243.781 | 0,43 |
| 900.000 | Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 2.000% 01-Nov-2028 | 979.097 | 0,10 |
| 6.041.000 | Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' FRN 0.010% 30-Apr-2024 | 6.049.759 | 0,61 |
| 2.961.000 | International Flavors & Fragrances Inc 1.800% 25-Sep-2026 | 3.138.761 | 0,32 |
| 4.303.000 | JPMorgan Chase & Co 'EMTN' FRN 0.389% 24-Feb-2028 | 4.275.569 | 0,43 |
| 2.962.000 | JPMorgan Chase & Co 'EMTN' FRN 0.597% 17-Feb-2033 | 2.859.041 | 0,29 |
| 1.990.000 | JPMorgan Chase & Co 'EMTN' FRN 1.090% 11-Mar-2027 | 2.049.994 | 0,21 |
| 1.300.000 | McDonald's Corp 1.600% 15-Mar-2031 | 1.392.604 | 0,14 |
| 1.059.000 | Medtronic Global Holdings SCA 0.750% 15-Oct-2032 | 1.060.281 | 0,11 |
| 1.270.000 | Medtronic Global Holdings SCA 1.125% 07-Mar-2027 | 1.325.888 | 0,13 |
| 3.920.000 | Medtronic Global Holdings SCA 1.375% 15-Oct-2040 | 3.926.836 | 0,40 |
| 1.720.000 | Medtronic Global Holdings SCA 1.500% 02-Jul-2039 | 1.777.170 | 0,18 |
| 865.000 | Mondelez International Inc 0.750% 17-Mar-2033 | 833.735 | 0,08 |
| 2.585.000 | Morgan Stanley 'EMTN' FRN 0.637% 26-Jul-2024 | 2.615.792 | 0,27 |
| 2.771.000 | Morgan Stanley FRN 0.495% 26-Oct-2029 | 2.724.572 | 0,28 |
| 5.326.000 | Morgan Stanley FRN 0.497% 07-Feb-2031 | 5.163.717 | 0,52 |
| 2.723.000 | Morgan Stanley FRN 1.102% 29-Apr-2033 | 2.727.221 | 0,28 |
| 760.000 | Nasdaq Inc 1.750% 28-Mar-2029 | 813.515 | 0,08 |
| 4.082.000 | Nestle Holdings Inc 'EMTN' 0.875% 18-Jul-2025 | 4.206.052 | 0,43 |
| 1.880.000 | Organon & Co / Organon Foreign Debt Co-Issuer BV 'REGS' 2.875% 30-Apr-2028 | 1.899.138 | 0,19 |
| 1.290.000 | PepsiCo Inc 0.750% 18-Mar-2027 | 1.326.889 | 0,13 |
| 500.000 | PepsiCo Inc 0.875% 16-Oct-2039 | 490.130 | 0,05 |
| 2.718.000 | PepsiCo Inc 'EMTN' 0.500% 06-May-2028 | 2.749.554 | 0,28 |
| 1.070.000 | Prologis Euro Finance LLC 0.500% 16-Feb-2032 | 1.021.002 | 0,10 |
| 1.243.000 | Prologis Euro Finance LLC 1.000% 06-Feb-2035 | 1.208.918 | 0,12 |
| 2.307.000 | Simon International Finance SCA 1.125% 19-Mar-2033 | 2.271.034 | 0,23 |
| 1.945.000 | Stellantis Finance US Inc '144A' 2.691% 15-Sep-2031 | 1.691.703 | 0,17 |
| 1.100.000 | Stellantis NV 2.750% 15-May-2026 | 1.202.588 | 0,12 |
| 2.170.000 | Stellantis NV 3.875% 05-Jan-2026 | 2.446.770 | 0,25 |
| 781.000 | Stellantis NV 'EMTN' 0.625% 30-Mar-2027 | 777.630 | 0,08 |
| 2.776.000 | Stellantis NV 'EMTN' 1.250% 20-Jun-2033 | 2.710.375 | 0,28 |
| 1.100.000 | Stellantis NV 'EMTN' 2.000% 23-Mar-2024 | 1.145.942 | 0,12 |
| 3.155.000 | Thermo Fisher Scientific Finance I BV 1.625% 18-Oct-2041 | 3.215.371 | 0,33 |
| 2.050.000 | Thermo Fisher Scientific Inc 2.375% 15-Apr-2032 | 2.352.027 | 0,24 |
| 2.688.000 | Trinity Acquisition Plc 2.125% 26-May-2022 | 2.696.534 | 0,27 |
| 3.050.000 | Verizon Communications Inc 1.850% 18-May-2040 | 3.209.131 | 0,33 |
| 3.005.000 | Verizon Communications Inc 2.875% 15-Jan-2038 | 3.605.358 | 0,37 |
| Gesamtanlagen in Anleihen | | 949.471.549 | 96,47 |

| Bestände | Beschreibung | Zugrunde liegendes Engagement EUR | Summe Beizulegender Nettowert Zeitwert EUR | Nettover- mögen % |
|--|---|--------------------------------------|---|-------------------------|
| Offene Terminkontrakte - 1.162.238 | | | | |
| (173) | Euro-Bund Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (29.647.010) | 449.189 | 0,05 |
| (77) | Euro-Buxl 30 Year Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (15.918.980) | 677.529 | 0,07 |
| (61) | UK Long Gilt Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (9.071.922) | 35.520 | 0,00 |
| Offene Terminkontrakte insgesamt | | | 1.162.238 | 0,12 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisenterminkontrakten – 34.951 (siehe unten) | | | 34.951 | 0,00 |
| Finanzielle Vermögenswerte, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | | 950.668.738 | 96,59 |

| Bestände | Beschreibung | Summe Beizulegender Nettowert Zeitwert EUR | Nettover- mögen % |
|---|--|---|----------------------------------|
| Credit Default Swaps - (1.295.007) | | | |
| 50.000.000 | CDS iTraxx Europe Series 36 Version 1 Index 1.000% 20-Dec-2026 | (1.295.007) | (0,13) |
| Credit Default Swaps insgesamt | | | (1.295.007) (0,13) |

| Bestände | Beschreibung | Zugrunde liegendes Engagement EUR | Summe Beizulegender Nettowert Zeitwert EUR | Nettover- mögen % |
|---|---|--------------------------------------|---|-------------------------|
| Offene Terminkontrakte - (206.623) | | | | |
| 131 | Euro-Bobl Long Futures Contracts Exp Mar-2022 | 17.454.440 | (104.960) | (0,01) |
| 45 | Euro-Schatz Long Futures Contracts Exp Mar-2022 | 5.041.350 | (5.329) | (0,00) |
| (15) | U.S. 10 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (1.728.226) | (13.586) | (0,00) |
| (52) | U.S. 10 Year Ultra Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (6.715.497) | (78.684) | (0,01) |
| (13) | U.S. 5 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (1.388.683) | (3.439) | (0,00) |
| (1) | U.S. Treasury Bond Short Futures Contracts Exp Mar-2022 | (141.251) | (625) | (0,00) |
| Offene Terminkontrakte insgesamt | | | (206.623) | (0,02) |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten – (605.016) (siehe unten) | | | (605.016) | (0,06) |
| Finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet, insgesamt | | | (2.106.646) | (0,21) |
| Nettoumlaufvermögen | | | 35.673.712 | 3,62 |
| Summe Nettovermögen | | | 984.235.804 | 100,00 |

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.
Der Kontrahent für Credit Default Swaps ist Credit Suisse AG.
Der Kontrahent für Terminkontrakte (Futures) ist Morgan Stanley.

| Portfolioanalyse | % des Gesamtvermögens |
|--|-----------------------|
| An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem regulierten Markt gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente | 96,16 |
| An einem regulierten Markt gehandelte derivative Finanzinstrumente | 0,12 |
| OTC-derivative Finanzinstrumente | 0,00 |
| Sonstiges Umlaufvermögen | 3,72 |
| Gesamtvermögen | 100,00 |

Aufstellung der Wertpapierbestände zum 31. Dezember 2021

| Devisenterminkontrakte | | | | | | | Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) |
|---|----------------|------------|------------|------------------|---------------------|------------|--------------------------------------|
| Kauf | Verkauf | Betrag (K) | Betrag (V) | Abrechnungsdatum | Kontrahent | | |
| BNY Mellon Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund | | | | | | | |
| US-Dollar | Euro | 1.373.000 | 1.185.993 | 7. Jan. 22 | Barclays Bank PLC | 26.990 | |
| US-Dollar | Euro | 2.718.000 | 2.392.579 | 21. Jan. 22 | JPMorgan Chase Bank | 7.961 | |
| | | | | | | EUR | 34.951 |
| Euro | US-Dollar | 13.624.526 | 15.854.000 | 7. Jan. 22 | Barclays Bank PLC | (381.764) | |
| US-Dollar | Euro | 648.000 | 573.623 | 7. Jan. 22 | UBS AG | (1.144) | |
| Euro | US-Dollar | 1.198.460 | 1.389.000 | 21. Jan. 22 | RBC Capital Markets | (28.306) | |
| Euro | Pfund Sterling | 13.041.887 | 11.122.000 | 25. Jan. 22 | Morgan Stanley | (193.802) | |
| | | | | | | EUR | (605.016) |

GESAMTERGEBNISRECHNUNG

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| | | BNY Mellon Absolute Return Bond Fund | BNY Mellon Absolute Return Equity Fund | BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund |
|---|--------------------|---|---|--|
| | Erläute- rungen | EUR | GBP | EUR |
| 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 geschlossen Fonds entstehen Gewinne und Verluste ausschließlich aus laufender Geschäftstätigkeit. Außer den in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesenen gab es keine Gewinne oder Verluste.

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

| BNY Mellon Asian Equity Fund | BNY Mellon Asian Income Fund | BNY Mellon Blockchain Innovation Fund | BNY Mellon Brazil Equity Fund | BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund* | BNY Mellon Dynamic Total Return Fund* | BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund | BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund | BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund |
|------------------------------------|------------------------------------|--|-------------------------------------|--|---|---|--|--|
| USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD |
| 580 | 338 | 65 | 10.952 | - | 61 | 2.358 | 1.004 | 25 |
| 556.713 | 755.561 | 253.412 | 3.963.629 | - | 2.227 | 6.767.494 | - | - |
| 672 | 10 | 292.675 | - | - | 168 | 24.015 | 6.798 | 182 |
| 11.258.202 | 4.008.339 | 2.006.670 | 2.004.602 | (528.312) | 144.181 | 64.340.044 | (1.792.483) | 2.355.013 |
| (17.060.147) | (2.510.940) | (7.116.744) | (10.367.733) | 300.243 | (88.626) | 78.747.912 | (2.179.677) | (2.945.647) |
| (5.243.980) | 2.253.308 | (4.563.922) | (4.388.550) | (228.069) | 58.011 | 149.881.823 | (3.964.358) | (590.427) |
| 1.243.097 | 170.485 | 568.046 | 835.772 | 15.975 | 9.260 | 1.828.453 | 193.685 | 14.631 |
| - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 105.042 | 51.937 | 23.228 | 43.897 | 1.927 | 3.862 | 134.738 | 74.784 | 32.169 |
| 110.988 | 27.970 | 64.366 | 62.184 | 6.781 | 3.757 | 514.651 | 162.630 | 42.696 |
| - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| - | (60.224) | (23.900) | - | (3.704) | (8.335) | (176.064) | (106.619) | (57.406) |
| 1.459.127 | 190.168 | 631.740 | 941.853 | 20.979 | 8.544 | 2.301.778 | 324.480 | 32.090 |
| (6.703.107) | 2.063.140 | (5.195.662) | (5.330.403) | (249.048) | 49.467 | 147.580.045 | (4.288.838) | (622.517) |
| 427 | 279 | 901 | 7.555 | 30 | 13 | 935 | 1.679 | 41 |
| - | 721.118 | 25.893 | 62.302 | - | 11.623 | 3.166.605 | 5.403.906 | 482.922 |
| (6.703.534) | 1.341.743 | (5.222.456) | (5.400.260) | (249.078) | 37.831 | 144.412.505 | (9.694.423) | (1.105.480) |
| (225.264) | (79.531) | (104.620) | (2.640.898) | - | 12.149 | (1.919.294) | (21.849) | 1.847 |
| (6.928.798) | 1.262.212 | (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 |
|--|--------------------|--|---|---|
| | Erläute- rungen | 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) |

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

| BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund | BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund | BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund | BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund | BNY Mellon Euroland Bond Fund | BNY Mellon European Credit Fund | BNY Mellon Future Earth Fund* | BNY Mellon Future Food Fund* | BNY Mellon Future Life Fund* |
|--|---|---|--|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|
| USD | USD | USD | USD | EUR | EUR | USD | USD | USD |
| 41 | 869 | 202 | 1.616 | 1.178 | 1 | 876 | 18 | 17 |
| - | - | - | 4.405 | 111.544 | - | 33.131 | 40.992 | 38.636 |
| 4.532 | 3.325 | 1.221 | 20.215 | 41.463 | 3.854 | - | - | - |
| 2.222.494 | (4.836.747) | 1.276.899 | 9.136.300 | 11.463.665 | 985.228 | 9.672 | 31.033 | 1.911 |
| (2.720.210) | (8.024.218) | (2.549.506) | (20.163.922) | (20.660.147) | (802.918) | 142.307 | 211.645 | 330.904 |
| (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 |
|--|--------------------|-----------------------------------|-------------------------------------|--|
| | Erläute- rungen | 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) |

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

| BNY Mellon Global Emerging Markets Fund | BNY Mellon Global Equity Fund | BNY Mellon Global Equity Income Fund | BNY Mellon Global High Yield Bond Fund | BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund | BNY Mellon Global Leaders Fund | BNY Mellon Global Multi- Asset Income Fund* | BNY Mellon Global Opportunities Fund | BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) |
|--|-------------------------------------|--|---|---|--------------------------------------|--|---|---|
| USD | USD | USD | USD | USD | USD | EUR | USD | EUR |
| 593 | 4.237 | 7.417 | 4.873 | 1.309 | 57 | 37.331 | 390 | 1.499 |
| 558.347 | 7.925.249 | 21.734.782 | - | 11.287.863 | 493.952 | 126.866 | 659.034 | 48.493.424 |
| 371 | 12.175 | 82.525 | 33.846 | 67.785 | 775 | 58 | 1.134 | 143.577 |
| 10.216.313 | 46.520.818 | 122.376.150 | 13.640.540 | 9.152.146 | 1.255.585 | 887.555 | 4.604.624 | 91.975.060 |
| (14.720.450) | 29.915.266 | (53.700.848) | (8.575.049) | 9.457.103 | 7.982.863 | 475 | 2.017.334 | 109.893.452 |
| (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 |
|--|--------------------|---|---|---|
| | Erläute- rungen | 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 Geschäftsjahr | | 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) |

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

| BNY Mellon Global Unconstrained Fund | BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund | BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund | BNY Mellon Mobility Innovation Fund | BNY Mellon S&P 500® Index Tracker* | BNY Mellon Small Cap Euroland Fund | BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund | BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund | BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR) |
|---|---|--|--|--|--|---|---|--|
| USD | JPY | EUR | USD | USD | EUR | USD | EUR | EUR |
| 670 | 11.216 | 2.793 | 1.734 | 36 | 181 | 9 | 81 | 2 |
| 428.841 | 256.778.554 | 19.518.216 | 5.237.693 | 24.171 | 1.952.115 | 15.189 | - | 866.355 |
| 1.738 | 13.123.162 | 64.771 | 261.471 | 52 | 24.625 | - | - | - |
| 1.215.515 | 1.566.639.963 | 206.902.326 | 23.461.452 | 15.228.968 | 9.363.098 | 224.527 | (1.865.156) | (913.707) |
| 1.015.376 | 1.040.431.984 | 167.357.917 | 77.933.487 | (14.876.015) | 3.787.892 | (218.916) | 2.606.111 | 4.936.401 |
| 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 |
|---|--------------------|---|---|--|
| | Erläute- rungen | 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 |

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

^ Der Gesamtbetrag für die Gesellschaft wurde zum 31. Dezember 2021 berichtigt und berücksichtigt Überkreuzinvestitionen durch den BNY Mellon Absolute Return Bond Fund, den BNY Mellon Euroland Bond Fund und den BNY Mellon European Credit Fund.

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

| BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund | Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund* | Gesamt 31. Dezember 2021^ |
|---|---|--|
| USD | EUR | USD |
| 1.716 | 1 | 137.217 |
| - | - | 168.392.043 |
| - | - | 2.556.661 |
| (10.240.833) | 4.197.924 | 1.070.709.345 |
| (7.572.511) | (5.469.039) | 153.219.198 |
| (17.811.628) | (1.271.114) | 1.395.014.464 |
| 3.832.087 | 2.414.349 | 112.390.537 |
| - | - | 115.463 |
| 102.257 | 108.272 | 4.911.071 |
| 949.683 | 617.148 | 16.097.435 |
| - | - | 5.557.602 |
| - | - | 2.163.809 |
| - | (79.105) | (1.595.729) |
| 4.884.027 | 3.060.664 | 139.640.188 |
| (22.695.655) | (4.331.778) | 1.255.374.276 |
| 11.599 | 82.995 | 1.619.010 |
| 22.040.535 | 1.174.328 | 284.782.598 |
| (44.747.789) | (5.589.101) | 968.972.668 |
| - | (135.769) | (28.996.546) |
| (44.747.789) | (5.724.870) | 939.976.122 |

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020

| | | BNY Mellon Absolute Return Bond Fund | BNY Mellon Absolute Return Equity Fund | BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund |
|--|--------------------|---|---|--|
| | Erläute- rungen | EUR | GBP | EUR |
| Erträge | | | | |
| Erträge aus Bankzinsen | | 5.686 | 4.792 | 638 |
| Dividendenerträge | | – | 4.279.177 | 217.693 |
| Erträge aus Wertpapierleihgeschäften | 14 | 29.252 | 14.979 | – |
| Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten | | | | |
| Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten | | (4.464.261) | 13.813.017 | 1.529.345 |
| Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne/(Verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten | | 327.230 | (266.433) | 1.413.219 |
| Gesamtertrag | | (4.102.093) | 17.845.532 | 3.160.895 |
| Aufwendungen | | | | |
| Managementgebühr | 3 | 1.104.103 | 2.047.186 | 170.026 |
| Performancegebühr | 3 | 19.018 | – | 328.341 |
| Verwahrstellengebühr | 5 | 197.876 | 90.503 | 19.343 |
| Betriebliche Aufwendungen | 7 | 233.986 | 306.055 | 36.194 |
| Dividendenaufwand | | – | 3.366.266 | 85.852 |
| Finanzierungskosten für Swaps | | – | 806.506 | 343.088 |
| Ausgabenobergrenze (von der)/für die Verwaltungsgesellschaft | 6 | – | – | (15.768) |
| Gesamtaufwendungen | | 1.554.983 | 6.616.516 | 967.076 |
| Nettoerträge/(-aufwendungen) | | (5.657.076) | 11.229.016 | 2.193.819 |
| Finanzierungskosten | | | | |
| Bankzinsen | | 127.898 | 3.831 | 15.459 |
| Ausschüttungen | | 1.938.423 | 460.734 | – |
| Gewinn/(Verlust) im Geschäftsjahr | | (7.723.397) | 10.764.451 | 2.178.360 |
| Quellensteuern auf Dividenden und andere Anlageerträge | | (203.744) | 215.998 | (17) |
| Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit | | (7.927.141) | 10.980.449 | 2.178.343 |

Außer bei den im Geschäftsjahr geschlossen Fonds entstehen Gewinne und Verluste ausschließlich aus laufender Geschäftstätigkeit.
Außer den in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesenen gab es keine Gewinne oder Verluste.

* Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr aufgelegt.

** Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr geschlossen.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020 (Forts.)

| BNY Mellon Asia Rising Stars Fund** | BNY Mellon Asian Equity Fund | BNY Mellon Asian Income Fund | BNY Mellon Blockchain Innovation Fund | BNY Mellon Brazil Equity Fund | BNY Mellon Dynamic Total Return Fund | BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund | BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund* | BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund* |
|---|------------------------------------|------------------------------------|--|-------------------------------------|--|---|---|---|
| USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD |
| 236 | – | 23 | 98 | 46.373 | 1.064 | 11.506 | 51 | 42 |
| 114.573 | 300.155 | 1.135.433 | 177.953 | 1.476.270 | 66.960 | 5.910.616 | – | – |
| 10.616 | 12.083 | – | 1.734 | – | 244 | 11.913 | 16 | 10 |
| (481.300) | 9.245.020 | 159.574 | 373.229 | (3.425.440) | (113.183) | 14.631.419 | 495.961 | 5.184.361 |
| 98.306 | 14.069.279 | 1.674.181 | 4.569.998 | (15.245.843) | 77.567 | 75.290.078 | 857.707 | 3.662.888 |
| (257.569) | 23.626.537 | 2.969.211 | 5.123.012 | (17.148.640) | 32.652 | 95.855.532 | 1.353.735 | 8.847.301 |
| 42.322 | 764.979 | 231.173 | 116.054 | 992.710 | 139.603 | 1.279.503 | 14.856 | 35.755 |
| – | – | – | – | – | – | – | – | – |
| 22.571 | 91.969 | 79.931 | 20.828 | 156.816 | 18.541 | 181.761 | 5.191 | 62.036 |
| 32.589 | 70.496 | 35.916 | 38.398 | 85.700 | 21.468 | 339.757 | 11.532 | 43.189 |
| – | – | – | – | – | – | – | – | – |
| – | – | – | – | – | – | – | – | – |
| (20.834) | – | (88.362) | (43.921) | – | (421) | (184.495) | (9.662) | (63.115) |
| 76.648 | 927.444 | 258.658 | 131.359 | 1.235.226 | 179.191 | 1.616.526 | 21.917 | 77.865 |
| (334.217) | 22.699.093 | 2.710.553 | 4.991.653 | (18.383.866) | (146.539) | 94.239.006 | 1.331.818 | 8.769.436 |
| 198 | 36 | 16 | 94 | 5.759 | 84 | 612 | 113 | 411 |
| 68.126 | – | 1.035.599 | 78.793 | 189.073 | 303.463 | 1.754.527 | 43.563 | 545.303 |
| (402.541) | 22.699.057 | 1.674.938 | 4.912.766 | (18.578.698) | (450.086) | 92.483.867 | 1.288.142 | 8.223.722 |
| (12.405) | (496.482) | (107.468) | (38.594) | (4.236.523) | (19.607) | (1.821.087) | (1.282) | (3.142) |
| (414.946) | 22.202.575 | 1.567.470 | 4.874.172 | (22.815.221) | (469.693) | 90.662.780 | 1.286.860 | 8.220.580 |

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020 (Forts.)

| | | BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund* | BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund | BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund |
|---|--------------------|---|---|---|
| | Erläute- rungen | USD | USD | USD |
| Erträge | | | | |
| Erträge aus Bankzinsen | | 150 | 6.289 | 1.923 |
| Dividendenerträge | | – | 238.422 | 177.285 |
| Erträge aus Wertpapierleihgeschäften | 14 | 11.175 | 69.827 | 83.999 |
| Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten | | | | |
| Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten | | 22.450.761 | 10.615.934 | 19.385.963 |
| Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne/ (Verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten | | 65.731.841 | 39.525.263 | 8.387.752 |
| Gesamtertrag | | 88.193.927 | 50.455.735 | 28.036.922 |
| Aufwendungen | | | | |
| Managementgebühr | 3 | 10.822 | 705.332 | 1.897.975 |
| Performancegebühr | 3 | – | – | – |
| Verwahrstellengebühr | 5 | 3.401 | 175.162 | 77.778 |
| Betriebliche Aufwendungen | 7 | 130.528 | 692.879 | 314.097 |
| Dividendenaufwand | | – | – | – |
| Finanzierungskosten für Swaps | | – | – | – |
| Ausgabenobergrenze (von der)/für die Verwaltungsgesellschaft | 6 | (8.184) | (245.181) | – |
| Gesamtaufwendungen | | 136.567 | 1.328.192 | 2.289.850 |
| Nettoerträge/(-aufwendungen) | | 88.057.360 | 49.127.543 | 25.747.072 |
| Finanzierungskosten | | | | |
| Bankzinsen | | – | 1.247 | 27.736 |
| Ausschüttungen | | 178.586 | 43.738.714 | 8.812.544 |
| Gewinn/(Verlust) im Geschäftsjahr | | 87.878.774 | 5.387.582 | 16.906.792 |
| Quellensteuern auf Dividenden und andere Anlageerträge | | (204.591) | (119.978) | (5.245) |
| Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit | | 87.674.183 | 5.267.604 | 16.901.547 |

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020 (Forts.)

| BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund | BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund | BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund | BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund | BNY Mellon Euroland Bond Fund | BNY Mellon European Credit Fund | BNY Mellon Global Bond Fund | BNY Mellon Global Credit Fund | BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund |
|--|---|---|--|-------------------------------------|---------------------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------|--|
| USD | USD | USD | USD | EUR | EUR | USD | USD | USD |
| 812 | 9.829 | 441 | 2.782 | 6.118 | 18 | 68.434 | 10.082 | 70.225 |
| - | - | - | 52.778 | 165.842 | - | 355.312 | 147.506 | 367.430 |
| 3.340 | 3.644 | 1.221 | 11.916 | 84.493 | 4.578 | 137.310 | 36.738 | 74.883 |
| 189.827 | (72.083.968) | (36.330) | 16.330.990 | 39.751.082 | 2.263.271 | 25.678.006 | 65.936.827 | 6.966.209 |
| 1.552.646 | 46.951.263 | 1.128.245 | 8.528.468 | (26.295.085) | (76.461) | 36.264.191 | 16.999.775 | 21.932.412 |
| 1.746.625 | (25.119.232) | 1.093.577 | 24.926.934 | 13.712.450 | 2.191.406 | 62.503.253 | 83.130.928 | 29.411.159 |
| 407.196 | 2.446.657 | 5.314 | 807.415 | 4.475.785 | 43.611 | 3.435.768 | 131.927 | 2.567.391 |
| - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 14.046 | 236.145 | 46.748 | 161.251 | 190.338 | 27.876 | 182.383 | 168.198 | 168.499 |
| 40.664 | 278.261 | 14.607 | 178.691 | 546.084 | 31.433 | 592.966 | 297.014 | 442.139 |
| - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| - | - | - | (55.570) | - | - | - | 167 | - |
| 461.906 | 2.961.063 | 66.669 | 1.091.787 | 5.212.207 | 102.920 | 4.211.117 | 597.306 | 3.178.029 |
| 1.284.719 | (28.080.295) | 1.026.908 | 23.835.147 | 8.500.243 | 2.088.486 | 58.292.136 | 82.533.622 | 26.233.130 |
| 353 | 5.130 | 604 | 3.577 | 108.339 | 17.421 | 6.128 | 11.853 | 2.476 |
| 297.623 | 7.329.113 | 1.587.070 | 9.520.036 | 2.251.467 | 710.667 | 2.427.634 | 12.036.255 | 4.457.698 |
| 986.743 | (35.414.538) | (560.766) | 14.311.534 | 6.140.437 | 1.360.398 | 55.858.374 | 70.485.514 | 21.772.956 |
| 697 | (987.863) | (58.780) | (516.128) | 209.406 | 5.984 | (141.754) | (63.940) | (117.432) |
| 987.440 | (36.402.401) | (619.546) | 13.795.406 | 6.349.843 | 1.366.382 | 55.716.620 | 70.421.574 | 21.655.524 |

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020 (Forts.)

| | | BNY Mellon Global Emerging Markets Fund | BNY Mellon Global Equity Fund | BNY Mellon Global Equity Income Fund |
|--|--------------------|--|-------------------------------------|--|
| | Erläute- rungen | USD | USD | USD |
| Erträge | | | | |
| Erträge aus Bankzinsen | | 14 | 43 | 613 |
| Dividendenerträge | | 225.178 | 7.104.931 | 39.737.229 |
| Erträge aus Wertpapierleihgeschäften | 14 | 2.645 | 40.224 | 246.312 |
| Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten | | | | |
| Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten | | 4.303.472 | 16.276.369 | 9.222.625 |
| Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne/(Verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten | | 12.858.352 | 46.792.204 | (116.758.360) |
| Gesamtertrag | | 17.389.661 | 70.213.771 | (67.551.581) |
| Aufwendungen | | | | |
| Managementgebühr | 3 | 322.075 | 3.417.528 | 11.205.665 |
| Performancegebühr | 3 | – | – | – |
| Verwahrstellengebühr | 5 | 85.605 | 106.597 | 275.758 |
| Betriebliche Aufwendungen | 7 | 66.800 | 419.314 | 1.317.473 |
| Dividendenaufwand | | – | – | – |
| Finanzierungskosten für Swaps | | – | – | – |
| Ausgabenobergrenze (von der)/für die Verwaltungsgesellschaft | 6 | (58.653) | – | – |
| Gesamtaufwendungen | | 415.827 | 3.943.439 | 12.798.896 |
| Nettoerträge/(-aufwendungen) | | 16.973.834 | 66.270.332 | (80.350.477) |
| Finanzierungskosten | | | | |
| Bankzinsen | | 206 | 559 | 5.554 |
| Ausschüttungen | | 9.279 | 2.733.382 | 29.382.209 |
| Gewinn/(Verlust) im Geschäftsjahr | | 16.964.349 | 63.536.391 | (109.738.240) |
| Quellensteuern auf Dividenden und andere Anlageerträge | | (150.629) | (1.476.657) | (8.944.575) |
| Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit | | 16.813.720 | 62.059.734 | (118.682.815) |

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020 (Forts.)

| BNY Mellon Global High Yield Bond Fund | BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund | BNY Mellon Global Leaders Fund | BNY Mellon Global Multi- Asset Income Fund | BNY Mellon Global Opportunities Fund | BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) | BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP) | BNY Mellon Global Real Return Fund (USD) | BNY Mellon Global Short- Dated High Yield Bond Fund |
|---|---|--------------------------------------|---|---|---|---|---|---|
| USD | USD | USD | EUR | USD | EUR | GBP | USD | USD |
| 17.454 | 1.494 | 982 | 10 | 36 | 1.523 | 1.400 | 8.579 | 10.518 |
| – | 6.371.034 | 904.303 | 712.169 | 741.403 | 41.154.994 | 909.157 | 4.301.382 | 480.101 |
| 13.566 | 1 | 3.689 | 3 | 4.545 | 371.524 | 5.024 | 22.278 | 423.900 |
| 3.957.217 | 5.048.676 | 19.141.779 | 690.131 | 845.320 | 139.597.038 | 1.559.764 | 6.788.033 | 3.824.702 |
| 5.849.378 | 7.838.138 | (8.693.700) | (1.369.726) | 1.068.705 | 9.999.181 | 1.516.250 | 16.150.180 | 24.378.397 |
| 9.837.615 | 19.259.343 | 11.357.053 | 32.587 | 2.660.009 | 191.124.260 | 3.991.595 | 27.270.452 | 29.117.618 |
| 819.743 | 589.266 | 548.347 | 134.185 | 705.785 | 21.085.514 | 269.528 | 2.135.026 | 2.905.179 |
| – | – | – | – | – | – | – | – | – |
| 48.229 | 58.991 | 19.596 | 25.528 | 60.027 | 842.193 | 80.954 | 157.035 | 131.235 |
| 106.650 | 131.771 | 66.955 | 28.488 | 47.360 | 2.325.609 | 84.647 | 250.716 | 590.856 |
| – | – | – | – | – | – | – | – | – |
| – | – | – | – | – | – | – | – | – |
| – | (40.917) | (484) | (29.124) | – | – | – | – | (10.524) |
| 974.622 | 739.111 | 634.414 | 159.077 | 813.172 | 24.253.316 | 435.129 | 2.542.777 | 3.616.746 |
| 8.862.993 | 18.520.232 | 10.722.639 | (126.490) | 1.846.837 | 166.870.944 | 3.556.466 | 24.727.675 | 25.500.872 |
| 5.074 | 2.213 | 37 | 573 | 430 | 613.242 | 299 | 622 | 20.984 |
| 2.695.653 | 4.937.545 | 378.972 | 836.860 | 10.453 | 26.779.139 | 1.161.646 | 2.001.869 | 34.225.861 |
| 6.162.266 | 13.580.474 | 10.343.630 | (963.923) | 1.835.954 | 139.478.563 | 2.394.521 | 22.725.184 | (8.745.973) |
| (7.813) | (1.344.383) | (191.153) | (42.130) | (146.859) | (3.459.799) | (79.773) | (341.643) | 14.639 |
| 6.154.453 | 12.236.091 | 10.152.477 | (1.006.053) | 1.689.095 | 136.018.764 | 2.314.748 | 22.383.541 | (8.731.334) |

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020 (Forts.)

| | | BNY Mellon Global Unconstrained Fund | BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund | BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund |
|--|--------------------|---|---|--|
| | Erläute- rungen | USD | JPY | EUR |
| Erträge | | | | |
| Erträge aus Bankzinsen | | 119 | 108.321 | 152.889 |
| Dividendenerträge | | 316.608 | 185.533.502 | 23.101.046 |
| Erträge aus Wertpapierleihgeschäften | 14 | 1.748 | 51.797.199 | 137.030 |
| Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten | | | | |
| Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten | | 1.165.662 | (25.086.198) | 3.747.943 |
| Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne/(Verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten | | 3.416.695 | 1.358.617.819 | 81.383.405 |
| Gesamtertrag | | 4.900.832 | 1.570.970.643 | 108.522.313 |
| Aufwendungen | | | | |
| Managementgebühr | 3 | 44 | 101.360.517 | 14.399.976 |
| Performancegebühr | 3 | - | - | 319.072 |
| Verwahrstellengebühr | 5 | 21.376 | 4.336.167 | 206.615 |
| Betriebliche Aufwendungen | 7 | 26.074 | 16.689.129 | 1.317.124 |
| Dividendenaufwand | | - | - | - |
| Finanzierungskosten für Swaps | | - | - | - |
| Ausgabenobergrenze (von der)/für die Verwaltungsgesellschaft | 6 | (10.432) | (1.067.025) | - |
| Gesamtaufwendungen | | 37.062 | 121.318.788 | 16.242.787 |
| Nettoerträge/(-aufwendungen) | | 4.863.770 | 1.449.651.855 | 92.279.526 |
| Finanzierungskosten | | | | |
| Bankzinsen | | 2 | 1.100.996 | 13.790 |
| Ausschüttungen | | 480.699 | 63.226.899 | 2.319.581 |
| Gewinn/(Verlust) im Geschäftsjahr | | 4.383.069 | 1.385.323.960 | 89.946.155 |
| Quellensteuern auf Dividenden und andere Anlageerträge | | (46.648) | (27.497.048) | (4.893.756) |
| Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit | | 4.336.421 | 1.357.826.912 | 85.052.399 |

* Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr aufgelegt.

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020 (Forts.)

| BNY Mellon Mobility Innovation Fund | BNY Mellon S&P 500® Index Tracker | BNY Mellon Small Cap Euroland Fund | BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund* | BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund | BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)* | BNY Mellon Targeted Return Bond Fund | BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund | BNY Mellon U.S. Equity Income Fund |
|--|---|--|--|---|---|---|--|--|
| USD | USD | EUR | USD | EUR | EUR | USD | USD | USD |
| 1.617 | 167 | 43 | – | 90 | 5 | 4.193 | 68 | 31.276 |
| 1.834.091 | 697.766 | 990.657 | 1.681 | – | 320.143 | – | 565.690 | 9.234.489 |
| 31.542 | 1.785 | 41.880 | – | – | – | – | 1.569 | 13.599 |
| 20.716.552 | 6.928.420 | 1.135.636 | 51.460 | 7.373.715 | 126.743 | 1.606.584 | 2.489.817 | (29.245.422) |
| 108.899.832 | (2.854.991) | (1.651.540) | (47.841) | (694.218) | 1.572.238 | 7.186.777 | (2.293.407) | (21.626.167) |
| 131.483.634 | 4.773.147 | 516.676 | 5.300 | 6.679.587 | 2.019.129 | 8.797.554 | 763.737 | (41.592.225) |
| 1.954.153 | 257.607 | 663.539 | 1.745 | 470.658 | 157.336 | 547.178 | 278.923 | 1.463.082 |
| – | – | – | – | – | – | – | – | – |
| 106.586 | 97.810 | 43.364 | 462 | 110.229 | 71.089 | 44.821 | 27.271 | 62.278 |
| 256.288 | 58.785 | 46.961 | 806 | 168.910 | 30.482 | 86.853 | 27.114 | 284.818 |
| – | – | – | – | – | – | – | – | – |
| – | – | – | – | – | – | – | – | – |
| (61.857) | (43.243) | – | (960) | (92.298) | (64.881) | – | (56) | – |
| 2.255.170 | 370.959 | 753.864 | 2.053 | 657.499 | 194.026 | 678.852 | 333.252 | 1.810.178 |
| 129.228.464 | 4.402.188 | (237.188) | 3.247 | 6.022.088 | 1.825.103 | 8.118.702 | 430.485 | (43.402.403) |
| 10.630 | 155 | 4.906 | – | 66.800 | 4.793 | 774 | 14 | 3.099 |
| 557.890 | 19 | 112.861 | – | 3.239.808 | – | 845.873 | 40 | 7.504.516 |
| 128.659.944 | 4.402.014 | (354.955) | 3.247 | 2.715.480 | 1.820.310 | 7.272.055 | 430.431 | (50.910.018) |
| (390.487) | (194.137) | (163.550) | (504) | (125.743) | (37.683) | (5.966) | (148.963) | (2.315.525) |
| 128.269.457 | 4.207.877 | (518.505) | 2.743 | 2.589.737 | 1.782.627 | 7.266.089 | 281.468 | (53.225.543) |

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020 (Forts.)

| | | BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund | Gesamt 31. Dezember 2020^ |
|--|---------------|---|---------------------------------|
| | Erläuterungen | USD | USD |
| Erträge | | | |
| Erträge aus Bankzinsen | | 3.460 | 510.331 |
| Dividendenerträge | | – | 167.414.453 |
| Erträge aus Wertpapierleihgeschäften | 14 | – | 2.551.127 |
| Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten | | | |
| Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten | | 34.222.431 | 465.654.966 |
| Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne/(Verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehaltenen finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten | | 21.112.272 | 525.691.040 |
| Gesamtertrag | | 55.338.163 | 1.161.821.917 |
| Aufwendungen | | | |
| Managementgebühr | 3 | 2.202.117 | 97.984.524 |
| Performancegebühr | 3 | – | 759.654 |
| Verwahrstellengebühr | 5 | 75.755 | 5.490.220 |
| Betriebliche Aufwendungen | 7 | 533.248 | 14.021.904 |
| Dividendenaufwand | | – | 4.414.266 |
| Finanzierungskosten für Swaps | | – | 1.425.225 |
| Ausgabenobergrenze (von der)/für die Verwaltungsgesellschaft | 6 | (98) | (1.187.133) |
| Gesamtaufwendungen | | 2.811.022 | 122.908.660 |
| Nettoerträge/(-aufwendungen) | | 52.527.141 | 1.038.913.257 |
| Finanzierungskosten | | | |
| Bankzinsen | | 11.146 | 1.252.892 |
| Ausschüttungen | | 16.084.232 | 242.455.445 |
| Gewinn/(Verlust) im Geschäftsjahr | | 36.431.763 | 795.204.920 |
| Quellensteuern auf Dividenden und andere Anlageerträge | | 9.398 | (34.645.915) |
| Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit | | 36.441.161 | 760.559.005 |

Der Gesamtbetrag für die Gesellschaft wurde zum 31. Dezember 2020 berichtigt und berücksichtigt Überkreuzinvestitionen durch den BNY Mellon Euroland Bond Fund und den BNY Mellon European Credit Fund.

BILANZ

Zum 31. Dezember 2021

| | | BNY Mellon Absolute Return Bond Fund | BNY Mellon Absolute Return Equity Fund | BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund | BNY Mellon Asian Equity Fund |
|--|---------------|---|---|--|------------------------------------|
| | Erläuterungen | EUR | GBP | EUR | USD |
| Vermögenswerte (Fälligkeit innerhalb eines Jahres) | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte | 16 | 393.892.842 | 127.934.704 | 105.690.359 | 58.137.558 |
| Barmittel und Bargegenwerte | 9 | 28.685.756 | 735.906 | 1.156.742 | 1.144.551 |
| Forderungen aus Erträgen | | 1.939.741 | 102.985 | 234.973 | 35.469 |
| Forderungen aus veräußerten Anlagen | | – | – | 448.507 | – |
| Ausgabenobergrenze (Rückzahlungen von der Verwaltungsgesellschaft) | 6 | – | – | 37 | – |
| Margen auf Derivatkontrakte | 9 | 24.088.305 | 1.714.385 | 1.060.741 | – |
| Vom Makler erhaltene Barsicherheiten | | – | 2.530.000 | 770.000 | – |
| Forderungen aus Zeichnungen | | 9.247 | 36.472 | 80.101 | – |
| Sonstige Forderungen | | 126 | 74 | 1.096 | 7.836 |
| | | 448.616.017 | 133.054.526 | 109.442.556 | 59.325.414 |
| Verbindlichkeiten (Fälligkeit innerhalb eines Jahres) | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 16 | 21.587.074 | 6.230.259 | 12.168.583 | 61 |
| Banküberziehung | 9 | 247.049 | – | – | 47.055 |
| Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Anlagen | | 2.179.664 | – | 439.174 | – |
| Verbindlichkeiten aus Rücknahmen | | 100.642 | 318.666 | – | 17.201 |
| Zahlbare Aufwendungen | | 184.320 | 216.901 | 60.658 | 124.766 |
| Zahlbare Performancegebühren | 3 | – | 1.516 | 90.533 | – |
| Margen auf Derivatkontrakte | 9 | 3.329.865 | 26.275 | 705.341 | – |
| An den Makler zu zahlende Barsicherheiten | | – | 2.530.000 | 770.000 | – |
| Auf Swaps zu zahlende Erträge | | 154.174 | 5.832 | 10.423 | – |
| Finanzierungskosten für Swaps | | – | 19.206 | 49.680 | – |
| Zahlbare Steuern | 10 | – | – | – | 311.766 |
| | | 27.782.788 | 9.348.655 | 14.294.392 | 500.849 |
| Inhabern einlösbarer, partizipierender Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen | | 420.833.229 | 123.705.871 | 95.148.164 | 58.824.565 |

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Für den Verwaltungsrat

Verwaltungsratsmitglied - **David Dillon**

Verwaltungsratsmitglied - **Claire Cawley**

14. April 2022

Zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

| BNY Mellon Asian Income Fund | BNY Mellon Blockchain Innovation Fund | BNY Mellon Brazil Equity Fund | BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund* | BNY Mellon Dynamic Total Return Fund* | BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund | BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund | BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund | BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund |
|------------------------------------|--|-------------------------------------|--|---|---|--|--|--|
| USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD |
| 14.651.276 | 93.027.940 | 42.075.648 | 22.671.147 | – | 610.316.339 | 187.835.232 | 20.164.373 | 1.885.955.846 |
| 322.520 | 1.192.077 | 3.756.949 | 2.368.625 | – | 40.040.201 | 511.757 | 218.419 | 11.424.672 |
| 28.376 | 3.587 | 167.102 | 13.635 | – | 231.495 | 2.714.359 | 183.522 | 24.916.282 |
| – | – | – | 1.649 | – | – | 186.739 | – | – |
| 3.596 | 3.677 | – | 2.616 | 2.533 | 7.777 | 7.668 | 2.168 | 24.234 |
| – | – | – | 924.226 | – | 4.903.000 | 536.577 | 208.819 | 2.872.146 |
| – | – | – | – | – | – | – | – | – |
| – | 1.359.758 | 4.508 | – | – | 5.969 | 99.192 | – | 99.557 |
| 1.100 | 356 | – | – | – | 28 | 3.021 | 2.589 | – |
| 15.006.868 | 95.587.395 | 46.004.207 | 25.981.898 | 2.533 | 655.504.809 | 191.894.545 | 20.779.890 | 1.925.292.737 |
| 1 | 51.332 | 1.787 | 308.461 | – | 37 | 363.707 | 60.949 | 3.192.954 |
| 327 | – | – | 189 | – | – | – | – | – |
| – | – | 2.255.055 | – | – | – | – | – | – |
| – | 281.236 | 503 | – | – | 6.185.614 | 46.268 | – | 415.080 |
| 26.794 | 129.474 | 89.296 | 19.149 | 2.533 | 307.090 | 80.450 | 22.835 | 376.531 |
| – | – | – | – | – | – | – | – | – |
| – | – | – | 903.094 | – | 3.087.954 | 102.127 | 4.801 | – |
| – | – | – | – | – | – | – | – | – |
| – | – | – | – | – | – | 3.333 | – | – |
| – | – | – | – | – | – | – | – | – |
| – | – | 1.041.327 | – | – | – | – | – | – |
| 27.122 | 462.042 | 3.387.968 | 1.230.893 | 2.533 | 9.580.695 | 595.885 | 88.585 | 3.984.565 |
| 14.979.746 | 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 |
|--|----------------------|---|--|--|---|
| | Erläuterungen | 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 |

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

| BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund | BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund | BNY Mellon Euroland Bond Fund | BNY Mellon European Credit Fund | BNY Mellon Future Earth Fund* | BNY Mellon Future Food Fund* | BNY Mellon Future Life Fund* | BNY Mellon Global Bond Fund | BNY Mellon Global Credit Fund |
|---|--|-------------------------------------|---------------------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|------------------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------|
| USD | USD | EUR | EUR | USD | USD | USD | USD | USD |
| 26.631.365 | 121.210.735 | 270.100.214 | 39.597.242 | 2.098.963 | 2.697.272 | 2.298.463 | 428.178.417 | 440.596.139 |
| 1.028.474 | 2.766.010 | 4.325.469 | 1.036.134 | 70.717 | 78.202 | 60.233 | 6.370.439 | 3.640.662 |
| 403.532 | 2.064.756 | 1.661.913 | 251.041 | 3.480 | 2.254 | 1.649 | 1.916.459 | 2.867.087 |
| - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| - | 2.722 | - | - | - | - | - | - | 10.059 |
| 30.257 | 275.214 | 4.982.507 | 630.660 | - | - | - | 503.154 | 12.238.567 |
| - | 49.000 | - | - | - | - | - | 2.010.000 | - |
| - | 387 | 27.979 | - | - | - | - | 311.237 | 34.426 |
| - | - | - | - | 4.908 | 4.908 | 4.908 | - | 5.068 |
| 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 Fund | BNY Mellon Global Equity Fund | BNY Mellon Global Equity Income Fund |
|--|---------------|--|--|-------------------------------------|--|
| | Erläuterungen | USD | USD | USD | USD |
| Vermögenswerte (Fälligkeit innerhalb eines Jahres) | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte | 16 | 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 |

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

| BNY Mellon Global High Yield Bond Fund | BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund | BNY Mellon Global Leaders Fund | BNY Mellon Global Multi- Asset Income Fund* | BNY Mellon Global Opportunities Fund | BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) | BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP) | BNY Mellon Global Real Return Fund (USD) | BNY Mellon Global Short- Dated High Yield Bond Fund |
|---|---|--------------------------------------|--|---|---|---|---|---|
| USD | USD | USD | EUR | USD | EUR | GBP | USD | USD |
| 159.239.036 | 225.297.045 | 64.500.496 | – | 36.532.593 | 2.731.136.840 | 58.915.307 | 388.463.134 | 786.181.855 |
| 5.521.790 | 3.481.228 | 898.708 | 13.372 | 754.531 | 397.401.682 | 6.793.574 | 50.536.285 | 4.463.781 |
| 2.194.358 | 282.252 | 24.262 | – | 26.944 | 3.398.526 | 65.148 | 520.536 | 9.656.627 |
| 792.770 | – | – | – | – | 321.087 | 7.059 | 38.565 | – |
| – | 3.022 | – | – | – | – | – | – | 1.545 |
| – | – | – | – | – | 50.734.594 | 591.125 | 1.513.097 | – |
| – | – | – | – | – | – | – | 2.480.000 | 4.849.000 |
| 485.859 | 6.720 | 358 | – | – | 9.182.878 | 186.336 | 277.193 | 1.991.210 |
| – | 863 | – | – | – | – | – | – | 1.854 |
| 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 | |
|--|--|---|---|--|--|--------------------|
| | Erläuterungen | 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 |

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

| BNY Mellon S&P 500® Index Tracker* | BNY Mellon Small Cap Euroland Fund | BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund | BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund | BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR) | BNY Mellon Targeted Return Bond Fund | BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund* | BNY Mellon U.S. Equity Income Fund | BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund |
|--|--|---|---|--|---|---|--|---|
| USD | EUR | USD | EUR | EUR | USD | USD | USD | USD |
| – | 79.875.733 | 4.963.590 | 305.053.387 | 65.642.151 | 93.339.646 | – | 284.821.136 | 993.362.920 |
| 49.241 | 1.485.511 | 22.726 | 22.038.050 | 13.218.317 | 4.603.483 | 10.286 | 12.723.129 | 5.645.506 |
| – | – | 58 | 2.530.636 | 67.472 | 528.594 | – | 458.641 | 8.717.971 |
| – | – | – | – | 12.153 | – | – | – | – |
| – | – | – | 3.606 | 75 | – | – | – | – |
| – | – | – | 3.234.182 | 660.451 | 1.129.078 | – | – | – |
| – | – | – | 430.000 | – | – | – | – | – |
| – | 61.627 | – | 160.512 | 356.409 | – | – | 85 | 1.530.197 |
| – | 87 | 5.127 | 5.478 | 1.272 | 1.368 | – | – | 318 |
| 49.241 | 81.422.958 | 4.991.501 | 333.455.851 | 79.958.300 | 99.602.169 | 10.286 | 298.002.991 | 1.009.256.912 |
| – | – | 656 | 4.219.461 | 1.478.334 | 284.878 | – | 1.338 | 29.655 |
| – | – | – | – | – | – | – | – | – |
| – | – | – | – | – | 7.209.299 | – | – | – |
| 36.082 | 123.828 | – | 9.722 | – | – | – | 619 | 1.525.357 |
| 13.159 | 106.255 | 14.295 | 161.814 | 83.163 | 83.654 | 10.286 | 248.565 | 619.176 |
| – | – | – | – | – | – | – | – | – |
| – | – | – | 12.011 | – | 501.225 | – | – | – |
| – | – | – | 430.000 | – | – | – | – | – |
| – | – | – | – | – | – | – | – | – |
| – | – | – | – | – | – | – | – | – |
| – | – | – | – | – | – | – | – | – |
| 49.241 | 230.083 | 14.951 | 4.833.008 | 1.561.497 | 8.079.056 | 10.286 | 250.522 | 2.174.188 |
| – | 81.192.875 | 4.976.550 | 328.622.843 | 78.396.803 | 91.523.113 | – | 297.752.469 | 1.007.082.724 |

Zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

| | | Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund* | Gesamt 31. Dezember 2021^ |
|--|--------------------|--|---------------------------------|
| | Erläute- rungen | EUR | USD |
| Vermögenswerte (Fälligkeit innerhalb eines Jahres) | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte | | | |
| | 16 | 950.668.738 | 18.548.681.008 |
| Barmittel und Bargegenwerte | 9 | 27.180.236 | 855.591.361 |
| Forderungen aus Erträgen | | 6.012.461 | 99.499.032 |
| Forderungen aus veräußerten Anlagen | | – | 4.087.391 |
| Ausgabenobergrenze (Rückzahlungen von der Verwaltungsgesellschaft) | | | |
| | 6 | 7.836 | 93.622 |
| Margen auf Derivatkontrakte Vom Makler erhaltene Barsicherheiten | 9 | 2.078.380 | 132.975.391 |
| Forderungen aus Zeichnungen | | – | 17.970.685 |
| Sonstige Forderungen | | 1.406.858 | 45.978.876 |
| | | – | 94.765 |
| | | 987.354.509 | 19.704.972.131 |
| Verbindlichkeiten (Fälligkeit innerhalb eines Jahres) | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | | | |
| | 16 | 2.106.646 | 163.830.966 |
| Banküberziehung | 9 | – | 995.933 |
| Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Anlagen | | – | 21.542.420 |
| Verbindlichkeiten aus Rücknahmen | | 377.670 | 18.863.705 |
| Zahlbare Aufwendungen | | 489.448 | 15.014.563 |
| Zahlbare Performancegebühren | 3 | – | 105.124 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 9 | 128.275 | 21.398.617 |
| An den Makler zu zahlende Barsicherheiten | | – | 17.970.685 |
| Auf Swaps zu zahlende Erträge | | 16.666 | 289.628 |
| Finanzierungskosten für Swaps | | – | 82.557 |
| Zahlbare Steuern | 10 | – | 1.538.141 |
| | | 3.118.705 | 261.632.339 |
| Inhabern einlösbarer, partizipierender Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen | | | |
| | | 984.235.804 | 19.443.339.792 |

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

^ Der Gesamtbetrag für die Gesellschaft wurde zum 31. Dezember 2021 berichtet und berücksichtigt Überkreuzinvestitionen durch den BNY Mellon Absolute Return Bond Fund, den BNY Mellon Euroland Bond Fund und den BNY Mellon European Credit Fund.

Zum 31. Dezember 2020

| | | BNY Mellon Absolute Return Bond Fund | BNY Mellon Absolute Return Equity Fund | BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund | BNY Mellon Asia Rising Stars Fund** |
|--|---------------|---|---|--|---|
| | Erläuterungen | EUR | GBP | EUR | USD |
| Vermögenswerte (Fälligkeit innerhalb eines Jahres) | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte | 16 | 386.731.425 | 218.924.012 | 39.270.231 | – |
| Barmittel und Bargegenwerte | 9 | 41.679.035 | 31.868.987 | 218.390 | 4.243 |
| Forderungen aus Erträgen | | 1.794.279 | 234.445 | 86.682 | 70 |
| Forderungen aus veräußerten Anlagen | | 1.164.368 | – | – | – |
| Ausgabenobergrenze (Rückzahlungen von der Verwaltungsgesellschaft) | 6 | – | – | 4.082 | – |
| Margen auf Derivatkontrakte | 9 | 8.566.338 | 5.188.797 | 628.917 | – |
| Vom Makler erhaltene Barsicherheiten | | 7.350.000 | 8.289.000 | 550.000 | – |
| Forderungen aus Zeichnungen | | 198.060 | 16.825 | – | – |
| Sonstige Forderungen | | 1.954 | 14.210 | – | – |
| | | 447.485.459 | 264.536.276 | 40.758.302 | 4.313 |
| Verbindlichkeiten (Fälligkeit innerhalb eines Jahres) | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 16 | 18.485.690 | 14.065.251 | 6.071.205 | – |
| Banküberziehung | 9 | 60 | 1 | 2.129 | – |
| Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Anlagen | | – | – | – | – |
| Verbindlichkeiten aus Rücknahmen | | 82.399 | 356.836 | – | – |
| Zahlbare Aufwendungen | | 277.806 | 282.242 | 42.682 | 4.313 |
| Zahlbare Performancegebühren | 3 | 17.901 | – | 325.808 | – |
| Margen auf Derivatkontrakte | 9 | 454.563 | – | 522.478 | – |
| An den Makler zu zahlende Barsicherheiten | | 7.350.000 | 8.289.000 | 550.000 | – |
| Auf Swaps zu zahlende Erträge | | 219.864 | – | 4.148 | – |
| Finanzierungskosten für Swaps | | – | 34.554 | 16.832 | – |
| Zahlbare Steuern | 10 | – | – | – | – |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | – | 168.814 | – | – |
| | | 26.888.283 | 23.196.698 | 7.535.282 | 4.313 |
| Inhabern einlösbarer, partizipierender Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen | | 420.597.176 | 241.339.578 | 33.223.020 | – |

** Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr geschlossen.

* Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr aufgelegt.

Die beigegefügtten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

Zum 31. Dezember 2020 (Forts.)

| BNY Mellon Asian Equity Fund | BNY Mellon Asian Income Fund | BNY Mellon Blockchain Innovation Fund | BNY Mellon Brazil Equity Fund | BNY Mellon Dynamic Total Return Fund | BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund | BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund* | BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund* | BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund* |
|------------------------------------|------------------------------------|--|-------------------------------------|--|---|---|---|---|
| USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD |
| 64.928.334 | 34.740.584 | 15.711.563 | 69.182.970 | 15.145.449 | 506.827.874 | 25.411.872 | 43.214.523 | 1.177.246.749 |
| 1.744.720 | 1.420.384 | 166.581 | 4.118.480 | 2.044.645 | 31.795.217 | 500.737 | 706.906 | 16.666.631 |
| 21.963 | 112.448 | 4.215 | 401.961 | - | 243.040 | 372.195 | 376.211 | 16.440.755 |
| 819.115 | 205.690 | - | - | - | - | - | - | 41.702.038 |
| - | 13.021 | 11.924 | - | - | 12.205 | 5.857 | 11.263 | 5.933 |
| - | - | - | - | 116.070 | - | 287.943 | 283.703 | - |
| - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 460.941 | - | 6.157 | 130.523 | - | 156.517 | - | - | - |
| - | - | - | - | 1 | - | - | 4.465 | - |
| 67.975.073 | 36.492.127 | 15.900.440 | 73.833.934 | 17.306.165 | 539.034.853 | 26.578.604 | 44.597.071 | 1.252.062.106 |
| - | 84 | 322 | 4.186 | 267.381 | 1.006.480 | 43.183 | 389.738 | 446.047 |
| 312.982 | 5.009 | - | - | 517.446 | - | - | - | - |
| 689.106 | - | - | 119.621 | - | - | 108.950 | - | 47.944.793 |
| 18.316 | - | - | 762.486 | - | 1.432.762 | - | - | - |
| 132.527 | 46.037 | 35.294 | 209.284 | 17.569 | 311.909 | 19.462 | 38.584 | 128.514 |
| - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| - | - | - | - | 137.699 | 70.860 | 71.397 | 660 | 191.842 |
| - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 461.455 | - | - | 2.540.087 | - | - | - | - | - |
| - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 1.614.386 | 51.130 | 35.616 | 3.635.664 | 940.095 | 2.822.011 | 242.992 | 428.982 | 48.711.196 |
| 66.360.687 | 36.440.997 | 15.864.824 | 70.198.270 | 16.366.070 | 536.212.842 | 26.335.612 | 44.168.089 | 1.203.350.910 |

Zum 31. Dezember 2020 (Forts.)

| | | BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund | BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund | BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund | BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund | |
|--|---|---|---|--|---|--------------------|
| | Erläuterungen | USD | USD | USD | USD | |
| Vermögenswerte (Fälligkeit innerhalb eines Jahres) | | | | | | |
| | Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte | 16 | 744.989.879 | 380.027.423 | 37.810.015 | 164.979.734 |
| | Barmittel und Bargegenwerte | 9 | 14.680.942 | 7.524.437 | 1.055.348 | 1.440.472 |
| | Forderungen aus Erträgen | | 10.919.552 | 5.392.648 | 467.836 | 2.420.216 |
| | Forderungen aus veräußerten Anlagen | | 376.111 | – | – | – |
| | Ausgabenobergrenze (Rückzahlungen von der Verwaltungsgesellschaft) | 6 | 10.964 | – | – | – |
| | Margen auf Derivatkontrakte | 9 | 2.412.368 | 1.380.000 | 56.220 | 503.000 |
| | Vom Makler erhaltene Barsicherheiten | | – | – | – | 700.000 |
| | Forderungen aus Zeichnungen | | 3.662.082 | 442.134 | – | 305.413 |
| | Sonstige Forderungen | | 4.169 | – | – | 2.095 |
| | | | 777.056.067 | 394.766.642 | 39.389.419 | 170.350.930 |
| Verbindlichkeiten (Fälligkeit innerhalb eines Jahres) | | | | | | |
| | Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 16 | 333.500 | 1.826.208 | 33.433 | 939.928 |
| | Banküberziehung | 9 | – | – | – | 1.076 |
| | Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Anlagen | | 5.585.751 | – | – | – |
| | Verbindlichkeiten aus Rücknahmen | | 5.903 | 194.126 | – | 2.711.856 |
| | Zahlbare Aufwendungen | | 313.167 | 273.928 | 58.181 | 321.343 |
| | Zahlbare Performancegebühren | 3 | – | – | – | – |
| | Margen auf Derivatkontrakte | 9 | 134.822 | – | 23.417 | – |
| | An den Makler zu zahlende Barsicherheiten | | – | – | – | 700.000 |
| | Auf Swaps zu zahlende Erträge | | 6.111 | 14.445 | – | – |
| | Finanzierungskosten für Swaps | | – | – | – | – |
| | Zahlbare Steuern | 10 | – | – | – | – |
| | Sonstige Verbindlichkeiten | | – | – | – | 1.008.086 |
| | | | 6.379.254 | 2.308.707 | 115.031 | 5.682.289 |
| Inhabern einlösbarer, partizipierender Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen | | | | | | |
| | | | 770.676.813 | 392.457.935 | 39.274.388 | 164.668.641 |

Zum 31. Dezember 2020 (Forts.)

| BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund | BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund | BNY Mellon Euroland Bond Fund | BNY Mellon European Credit Fund | BNY Mellon Global Bond Fund | BNY Mellon Global Credit Fund | BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund | BNY Mellon Global Emerging Markets Fund | BNY Mellon Global Equity Fund |
|---|--|-------------------------------------|---------------------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------|--|--|-------------------------------------|
| USD | USD | EUR | EUR | USD | USD | USD | USD | USD |
| 27.809.949 | 163.736.320 | 431.779.517 | 40.340.290 | 604.570.353 | 791.111.717 | 485.058.819 | 53.284.789 | 433.928.601 |
| 883.156 | 1.378.019 | 12.518.692 | 1.339.272 | 9.973.908 | 18.869.816 | 12.334.176 | 1.485.035 | 8.057.397 |
| 395.423 | 2.267.507 | 3.972.849 | 289.106 | 3.579.214 | 4.987.629 | 3.824.775 | 17.867 | 202.318 |
| 181.886 | - | 35.761 | - | - | - | - | 6.245 | - |
| - | 7.004 | - | - | - | 520 | - | 6.138 | - |
| 78.989 | 1.231.209 | 1.476.820 | 867.954 | 1.237.172 | 7.218.304 | 4.106.192 | - | - |
| - | 520.000 | 771.088 | - | 480.000 | 890.000 | - | - | - |
| - | 2.772 | 671.006 | - | 481.246 | 61.083 | 300.292 | 154.949 | 5.447 |
| 2.583 | - | 68 | 186 | - | - | - | 2.787 | 12.931 |
| 29.351.986 | 169.142.831 | 451.225.801 | 42.836.808 | 620.321.893 | 823.139.069 | 505.624.254 | 54.957.810 | 442.206.694 |
| 89.596 | 2.857.770 | 786.318 | 124.403 | 3.046.296 | 10.942.933 | 5.184.232 | 2.162 | 386.114 |
| - | 448 | 22 | - | 1.196.446 | 793.393 | 1.645.000 | - | 1.676.710 |
| - | - | - | - | - | - | - | 595.734 | 465.656 |
| 970.000 | 2.345 | 1.528.047 | 1.500.000 | 228.359 | 1.837 | 270.538 | 9.148 | 1.363 |
| 20.021 | 166.328 | 508.891 | 16.371 | 487.494 | 151.664 | 390.371 | 81.286 | 468.260 |
| - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 8.378 | - | 4.723.319 | 613.805 | - | 6.872.987 | - | - | - |
| - | 520.000 | 771.088 | - | 480.000 | 890.000 | - | - | - |
| - | - | - | 1.433 | - | 104.451 | - | - | - |
| - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| - | - | - | - | - | - | - | 73.652 | - |
| - | - | - | 82.057 | - | - | - | - | - |
| 1.087.995 | 3.546.891 | 8.317.685 | 2.338.069 | 5.438.595 | 19.757.265 | 7.490.141 | 761.982 | 2.998.103 |
| 28.263.991 | 165.595.940 | 442.908.116 | 40.498.739 | 614.883.298 | 803.381.804 | 498.134.113 | 54.195.828 | 439.208.591 |

Zum 31. Dezember 2020 (Forts.)

| | | BNY Mellon Global Equity Income Fund | BNY Mellon Global High Yield Bond Fund | BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund | BNY Mellon Global Leaders Fund |
|--|---------------|--|---|---|--------------------------------------|
| | Erläuterungen | USD | USD | USD | USD |
| Vermögenswerte (Fälligkeit innerhalb eines Jahres) | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte | 16 | 757.868.354 | 148.993.364 | 142.150.329 | 38.566.476 |
| Barmittel und Bargegenwerte | 9 | 13.149.252 | 3.903.316 | 3.354.389 | 1.482.977 |
| Forderungen aus Erträgen | | 1.333.118 | 2.284.036 | 311.973 | 13.291 |
| Forderungen aus veräußerten Anlagen | | – | 360.689 | 429.351 | – |
| Ausgabenobergrenze (Rückzahlungen von der Verwaltungsgesellschaft) | 6 | – | – | 11.574 | 481 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 9 | – | – | – | – |
| Vom Makler erhaltene Barsicherheiten | | – | – | – | – |
| Forderungen aus Zeichnungen | | 33.255 | 257.076 | 666.371 | 61.275 |
| Sonstige Forderungen | | – | – | – | – |
| | | 772.383.979 | 155.798.481 | 146.923.987 | 40.124.500 |
| Verbindlichkeiten (Fälligkeit innerhalb eines Jahres) | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 16 | 9.834 | 122.171 | 72.634 | 933 |
| Banküberziehung | 9 | 596.791 | – | – | – |
| Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Anlagen | | – | 2.116.206 | 253.492 | 992.252 |
| Verbindlichkeiten aus Rücknahmen | | 1.112.953 | 5.017 | 38.861 | – |
| Zahlbare Aufwendungen | | 1.033.511 | 130.794 | 119.973 | 40.412 |
| Zahlbare Performancegebühren | 3 | – | – | – | – |
| Margen auf Derivatkontrakte | 9 | – | – | – | – |
| An den Makler zu zahlende Barsicherheiten | | – | – | – | – |
| Auf Swaps zu zahlende Erträge | | – | – | – | – |
| Finanzierungskosten für Swaps | | – | – | – | – |
| Zahlbare Steuern | 10 | – | – | – | – |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | 400.208 | – | – | – |
| | | 3.153.297 | 2.374.188 | 484.960 | 1.033.597 |
| Inhabern einlösbarer, partizipierender Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen | | 769.230.682 | 153.424.293 | 146.439.027 | 39.090.903 |

Zum 31. Dezember 2020 (Forts.)

| BNY Mellon Global Multi- Asset Income Fund | BNY Mellon Global Opportunities Fund | BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) | BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP) | BNY Mellon Global Real Return Fund (USD) | BNY Mellon Global Short- Dated High Yield Bond Fund | BNY Mellon Global Unconstrained Fund | BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund | BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund |
|---|---|---|---|---|---|---|---|--|
| EUR | USD | EUR | GBP | USD | USD | USD | JPY | EUR |
| 20.379.343 | 35.635.863 | 2.881.434.650 | 60.974.434 | 291.344.971 | 691.323.576 | 28.609.152 | 15.012.143.537 | 1.535.301.493 |
| 446.608 | 363.754 | 91.403.260 | 2.075.704 | 11.167.248 | 194.717 | 1.459.778 | 352.444.863 | 37.616.602 |
| 64.062 | 19.222 | 4.578.565 | 99.969 | 492.019 | 8.266.238 | 59.904 | 8.393.325 | 481.110 |
| - | 558.184 | 301.442 | 6.310 | 36.439 | 1.806.941 | - | - | - |
| 4.118 | - | - | - | - | 3.092 | 3.483 | 428.064 | - |
| - | - | 10.064.465 | 198.144 | 4.085.613 | 13.596.505 | - | - | - |
| - | - | 56.380.000 | 970.000 | - | 90.000 | - | - | - |
| 10 | 10.185 | 3.340.294 | 105.013 | 6.862 | 703.058 | - | 641.268 | 1.767.459 |
| 4.328 | - | - | - | 897 | 5.458 | - | 7.124 | 6.776 |
| 20.898.469 | 36.587.208 | 3.047.502.676 | 64.429.574 | 307.134.049 | 715.989.585 | 30.132.317 | 15.374.058.181 | 1.575.173.440 |
| 126.199 | 149 | 24.398.093 | 443.167 | 5.682.435 | 11.668.207 | 128.731 | 41.410.420 | 42.170 |
| - | 9.156 | 1.203.141 | 898 | 11 | - | - | - | - |
| - | 58.247 | - | - | - | 1.155.768 | - | - | 1.202.311 |
| - | 444.662 | 33.220.822 | 112.690 | 64.658 | 641.638 | - | 1.664.661 | 755.467 |
| 27.545 | 97.305 | 2.610.143 | 74.899 | 292.462 | 390.383 | 13.427 | 13.573.776 | 1.791.169 |
| - | - | - | - | - | - | - | - | 269.498 |
| - | - | 2.809.531 | 65.415 | 271.606 | 327.110 | - | - | - |
| - | - | 56.380.000 | 970.000 | - | 90.000 | - | - | - |
| - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 153.744 | 609.519 | 120.621.730 | 1.667.069 | 6.311.172 | 14.273.106 | 142.158 | 56.648.857 | 4.060.615 |
| 20.744.725 | 35.977.689 | 2.926.880.946 | 62.762.505 | 300.822.877 | 701.716.479 | 29.990.159 | 15.317.409.324 | 1.571.112.825 |

Zum 31. Dezember 2020 (Forts.)

| | | BNY Mellon Mobility Innovation Fund | BNY Mellon S&P 500® Index Tracker | BNY Mellon Small Cap Euroland Fund | BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund* | |
|--|--|--|---|--|--|------------------|
| | Erläuterungen | USD | USD | EUR | USD | |
| Vermögenswerte (Fälligkeit innerhalb eines Jahres) | | | | | | |
| | Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte | 16 | 468.893.961 | 36.579.643 | 60.172.780 | 4.921.474 |
| | Barmittel und Bargegenwerte | 9 | 4.823.898 | 462.850 | 565.140 | 83.403 |
| | Forderungen aus Erträgen | | 89.010 | 19.286 | – | 1.177 |
| | Forderungen aus veräußerten Anlagen | | – | 210.311 | – | – |
| | Ausgabenobergrenze (Rückzahlungen von der Verwaltungsgesellschaft) | 6 | 10.006 | 13.293 | – | 961 |
| | Margen auf Derivatkontrakte | 9 | – | – | – | – |
| | Vom Makler erhaltene Barsicherheiten | | – | – | – | – |
| | Forderungen aus Zeichnungen | | 2.471.175 | 274.521 | 57.851 | – |
| | Sonstige Forderungen | | – | – | – | – |
| | | | 476.288.050 | 37.559.904 | 60.795.771 | 5.007.015 |
| Verbindlichkeiten (Fälligkeit innerhalb eines Jahres) | | | | | | |
| | Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 16 | 55.097 | 3 | – | 74 |
| | Banküberziehung | 9 | – | – | – | – |
| | Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Anlagen | | 1.473.433 | 320.971 | – | – |
| | Verbindlichkeiten aus Rücknahmen | | 115.922 | 295.896 | 40.529 | – |
| | Zahlbare Aufwendungen | | 446.284 | 70.463 | 93.498 | 3.013 |
| | Zahlbare Performancegebühren | 3 | – | – | – | – |
| | Margen auf Derivatkontrakte | 9 | – | 6.995 | – | – |
| | An den Makler zu zahlende Barsicherheiten | | – | – | – | – |
| | Auf Swaps zu zahlende Erträge | | – | – | – | – |
| | Finanzierungskosten für Swaps | | – | – | – | – |
| | Zahlbare Steuern | 10 | – | – | – | – |
| | Sonstige Verbindlichkeiten | | – | – | – | – |
| | | | 2.090.736 | 694.328 | 134.027 | 3.087 |
| | Inhabern einlösbarer, partizipierender Anteile zuzuschreibendes Nettovermögen | | 474.197.314 | 36.865.576 | 60.661.744 | 5.003.928 |

* Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr aufgelegt.

^ Der Gesamtbetrag für die Gesellschaft wurde zum 31. Dezember 2020 berichtigt und berücksichtigt Überkreuzinvestitionen durch den BNY Mellon Euroland Bond Fund und den BNY Mellon European Credit Fund.

Zum 31. Dezember 2020 (Forts.)

| BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund | BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)* | BNY Mellon Targeted Return Bond Fund | BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund | BNY Mellon U.S. Equity Income Fund | BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund | Gesamt 31. Dezember 2020^ |
|---|---|---|--|--|---|---------------------------------|
| EUR | EUR | USD | USD | USD | USD | USD |
| 265.414.925 | 33.238.280 | 92.147.131 | 3.705.294 | 223.506.243 | 590.629.940 | 16.857.829.443 |
| 6.404.396 | 835.974 | 2.518.429 | 17.497 | 5.709.371 | 25.882.480 | 497.069.391 |
| 2.239.327 | 67.837 | 607.623 | 3.030 | 400.676 | 5.433.575 | 88.903.085 |
| - | 3.105 | - | - | 1.323.527 | - | 49.863.345 |
| 17.328 | 11.635 | - | 56 | - | - | 177.321 |
| 291.146 | 89.561 | 83 | - | - | - | 70.818.256 |
| 4.090.000 | - | - | - | - | - | 99.807.957 |
| 1.155 | 349.936 | - | - | - | 2.459.061 | 21.086.401 |
| - | 1.866 | - | - | - | - | 73.429 |
| 278.458.277 | 34.598.194 | 95.273.266 | 3.725.877 | 230.939.817 | 624.405.056 | 17.685.628.628 |
| 2.750.193 | 295.466 | 381.575 | - | 10.554 | 77.833 | 131.096.051 |
| - | - | - | - | - | - | 8.228.217 |
| - | - | 1.740.943 | - | 463.554 | 10.000.000 | 75.553.281 |
| 169.495 | 5.360 | - | - | - | 26.892 | 55.583.902 |
| 126.705 | 49.992 | 95.645 | 21.570 | 198.430 | 384.049 | 14.406.918 |
| - | - | - | - | - | - | 749.125 |
| - | - | 102.845 | - | - | - | 19.456.044 |
| 4.090.000 | - | - | - | - | - | 99.807.957 |
| - | - | - | - | - | - | 400.422 |
| - | - | - | - | - | - | 67.816 |
| - | - | - | - | - | - | 3.075.194 |
| - | - | - | - | - | - | 1.739.392 |
| 7.136.393 | 350.818 | 2.321.008 | 21.570 | 672.538 | 10.488.774 | 410.164.319 |
| 271.321.884 | 34.247.376 | 92.952.258 | 3.704.307 | 230.267.279 | 613.916.282 | 17.275.464.309 |

AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES INHABERN EINLÖSBARER, PARTIZIPIERENDER ANTEILE ZUZUSCHREIBENDEN NETTOVERMÖGENS

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| | BNY Mellon Absolute Return Bond Fund | BNY Mellon Absolute Return Equity Fund | BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund | BNY Mellon Asian Equity Fund | BNY Mellon Asian Income Fund |
|---|---|---|--|------------------------------------|------------------------------------|
| | EUR | GBP | EUR | USD | USD |
| Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zu Beginn des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen | 420.597.176 | 241.339.578 | 33.223.020 | 66.360.687 | 36.440.997 |
| Nominelle Wechselkursbereinigung (Erläuterung 1) | – | – | – | – | – |
| Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit | 17.149.901 | (4.131.036) | 3.401.406 | (6.928.798) | 1.262.212 |
| Erlöse aus ausgegebenen einlösbaren, partizipierenden Anteilen | 53.636.457 | 16.156.714 | 104.038.240 | 31.363.694 | 12.339.657 |
| Kosten aus zurückgenommenen einlösbaren, partizipierenden Anteilen | (70.550.305) | (129.659.385) | (45.514.502) | (31.971.018) | (35.063.120) |
| Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus Anteilsgeschäften | (16.913.848) | (113.502.671) | 58.523.738 | (607.324) | (22.723.463) |
| Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen am Ende des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen | 420.833.229 | 123.705.871 | 95.148.164 | 58.824.565 | 14.979.746 |

| | BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund | BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund | BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund | BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund | BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund |
|---|---|---|--|---|---|
| | USD | USD | USD | USD | USD |
| Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zu Beginn des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen | 770.676.813 | 392.457.935 | 39.274.388 | 164.668.641 | 28.263.991 |
| Nominelle Wechselkursbereinigung (Erläuterung 1) | – | – | – | – | – |
| Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit | (28.236.130) | (35.306.357) | (1.156.424) | (14.847.989) | (2.834.881) |
| Erlöse aus ausgegebenen einlösbaren, partizipierenden Anteilen | 702.548.910 | 324.285.728 | 3.840.724 | 10.329.323 | 7.284.178 |
| Kosten aus zurückgenommenen einlösbaren, partizipierenden Anteilen | (718.377.890) | (127.171.115) | (8.823.788) | (46.590.245) | (4.830.000) |
| Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus Anteilsgeschäften | (15.828.980) | 197.114.613 | (4.983.064) | (36.260.922) | 2.454.178 |
| Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen am Ende des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen | 726.611.703 | 554.266.191 | 33.134.900 | 113.559.730 | 27.883.288 |

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

BNY MELLON GLOBAL FUNDS, PLC

 AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES INHABERN EINLÖSBARER,
 PARTIZIPIERENDER ANTEILE ZUZUSCHREIBENDEN NETTOVERMÖGENS

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 NETTOVERMÖGENS

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

| | BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund | BNY Mellon Global Emerging Markets Fund | BNY Mellon Global Equity Fund | BNY Mellon Global Equity Income Fund | BNY Mellon Global High Yield Bond Fund |
|--|--|--|-------------------------------------|--|---|
| | USD | USD | USD | USD | USD |
| Inhabern von einlösaren, partizipierenden Anteilen zu Beginn des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen | 498.134.113 | 54.195.828 | 439.208.591 | 769.230.682 | 153.424.293 |
| Nominelle Wechselkursbereinigung (Erläuterung 1) | – | – | – | – | – |
| Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit | (23.480.130) | (4.761.159) | 76.156.244 | 63.307.656 | 431.372 |
| Erlöse aus ausgegebenen einlösaren, partizipierenden Anteilen | 102.301.016 | 63.086.911 | 170.891.213 | 124.222.479 | 42.864.484 |
| Kosten aus zurückgenommenen einlösaren, partizipierenden Anteilen | (143.961.506) | (59.481.898) | (180.483.892) | (645.659.518) | (30.026.454) |
| Nettozunahme/(-abnahme) 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/(-abnahme) 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 | – |

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES INHABERN EINLÖSBARER,
 PARTIZIPIERENDER ANTEILE ZUZUSCHREIBENDEN NETTOVERMÖGENS

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

| BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund | BNY Mellon Global Leaders Fund | BNY Mellon Global Multi- Asset Income Fund* | BNY Mellon Global Opportunities Fund | BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) | BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP) | BNY Mellon Global Real Return Fund (USD) | BNY Mellon Global Short- Dated High Yield Bond Fund |
|---|---|---|--|---|---|---|---|
| USD | USD | EUR | USD | EUR | GBP | USD | USD |
| 146.439.027 | 39.090.903 | 20.744.725 | 35.977.689 | 2.926.880.946 | 62.762.505 | 300.822.877 | 701.716.479 |
| - | - | - | - | - | - | - | - |
| 17.425.692 | 9.068.723 | 813.913 | 6.382.037 | 205.358.249 | 3.603.582 | 23.621.801 | (15.882.499) |
| 131.963.408 | 28.318.194 | 247.309 | 11.027.018 | 1.076.774.053 | 20.898.782 | 174.051.367 | 317.764.226 |
| (68.120.543) | (11.120.760) | (21.805.947) | (16.188.294) | (1.087.284.489) | (21.367.824) | (60.886.710) | (211.024.834) |
| 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 NETTOVERMÖGENS

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 (Forts.)

| | 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) | – | (554.868.192) |
| Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit | (5.724.870) | 939.976.122 |
| Erlöse aus ausgegebenen einlösbaren, partizipierenden Anteilen | 1.271.182.451 | 9.840.192.989 |
| Kosten aus zurückgenommenen einlösbaren, partizipierenden Anteilen | (281.221.777) | (8.057.425.440) |
| Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus Anteilsgeschäften | 989.960.674 | 1.782.767.549 |
| Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen am Ende des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen Anteile | 984.235.804 | 19.443.339.788 |

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

^ Der Gesamtbetrag für die Gesellschaft wurde zum 31. Dezember 2021 berichtigt und berücksichtigt Überkreuzinvestitionen durch den BNY Mellon Absolute Return Bond Fund, den BNY Mellon Euroland Bond Fund und den BNY Mellon European Credit Fund.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES INHABERN EINLÖSBARER, PARTIZIPIERENDER ANTEILE ZUZUSCHREIBENDEN NETTOVERMÖGENS

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020

| | BNY Mellon Absolute Return Bond Fund | BNY Mellon Absolute Return Equity Fund | BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund | | BNY Mellon Asian Equity Fund |
|--|---|---|--|--------------------|------------------------------------|
| | EUR | GBP | EUR | USD | USD |
| Inhabern von einlösaren, partizipierenden Anteilen zu Beginn des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen | 397.342.232 | 371.503.339 | 28.390.201 | 8.283.563 | 38.173.739 |
| Nominelle Wechselkursbereinigung (Erläuterung 1) | – | – | – | – | – |
| Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit | (7.927.141) | 10.980.449 | 2.178.343 | (414.946) | 22.202.575 |
| Erlöse aus ausgegebenen einlösaren, partizipierenden Anteilen | 121.672.312 | 19.471.495 | 3.885.541 | 90.288 | 26.357.457 |
| Kosten aus zurückgenommenen einlösaren, partizipierenden Anteilen | (90.490.227) | (160.615.705) | (1.231.065) | (7.958.905) | (20.373.084) |
| Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus Anteilsgeschäften | 31.182.085 | (141.144.210) | 2.654.476 | (7.868.617) | 5.984.373 |
| Inhabern von einlösaren, partizipierenden Anteilen am Ende des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen | 420.597.176 | 241.339.578 | 33.223.020 | – | 66.360.687 |

| | 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 | 716.491.768 | 360.120.657 | 52.672.790 | 464.566.692 | 29.585.251 |
| Nominelle Wechselkursbereinigung (Erläuterung 1) | – | – | – | – | – |
| Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit | 5.267.604 | 16.901.547 | 987.440 | (36.402.401) | (619.546) |
| Erlöse aus ausgegebenen einlösaren, partizipierenden Anteilen | 886.648.787 | 221.635.860 | 15.261.303 | 21.934.651 | 5.460.296 |
| Kosten aus zurückgenommenen einlösaren, partizipierenden Anteilen | (837.731.346) | (206.200.129) | (29.647.145) | (285.430.301) | (6.162.010) |
| Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus Anteilsgeschäften | 48.917.441 | 15.435.731 | (14.385.842) | (263.495.650) | (701.714) |
| Inhabern von einlösaren, partizipierenden Anteilen am Ende des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen | 770.676.813 | 392.457.935 | 39.274.388 | 164.668.641 | 28.263.991 |

* Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr aufgelegt.
Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES INHABERN EINLÖSBARER,
 PARTIZIPIERENDER ANTEILE ZUZUSCHREIBENDEN NETTOVERMÖGENS

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020 (Forts.)

| BNY Mellon Asian Income Fund | BNY Mellon Blockchain Innovation Fund | BNY Mellon Brazil Equity Fund | BNY Mellon Dynamic Total Return Fund | BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund | BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund* | BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund* | BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund* |
|--|--|--|--|---|---|---|---|
| USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD |
| 31.031.538 | 11.112.189 | 105.594.026 | 26.474.856 | 181.632.588 | – | – | – |
| – | – | – | – | – | – | – | – |
| 1.567.470 | 4.874.172 | (22.815.221) | (469.693) | 90.662.780 | 1.286.860 | 8.220.580 | 87.674.183 |
| 7.931.906 | 1.712.181 | 44.539.941 | 3.986.050 | 343.348.393 | 25.049.855 | 62.125.673 | 1.116.131.292 |
| (4.089.917) | (1.833.718) | (57.120.476) | (13.625.143) | (79.430.919) | (1.103) | (26.178.164) | (454.565) |
| 3.841.989 | (121.537) | (12.580.535) | (9.639.093) | 263.917.474 | 25.048.752 | 35.947.509 | 1.115.676.727 |
| 36.440.997 | 15.864.824 | 70.198.270 | 16.366.070 | 536.212.842 | 26.335.612 | 44.168.089 | 1.203.350.910 |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund | BNY Mellon Euroland Bond Fund | BNY Mellon European Credit Fund | BNY Mellon Global Bond Fund | BNY Mellon Global Credit Fund | BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund | BNY Mellon Global Emerging Markets Fund | BNY Mellon Global Equity Fund |
| USD | EUR | EUR | USD | USD | USD | USD | USD |
| 151.635.419 | 890.225.293 | 82.434.065 | 585.157.899 | 462.784.533 | 496.274.784 | 33.193.624 | 371.812.812 |
| – | – | – | – | – | – | – | – |
| 13.795.406 | 6.349.843 | 1.366.382 | 55.716.620 | 70.421.574 | 21.655.524 | 16.813.720 | 62.059.734 |
| 70.804.936 | 122.877.785 | 7.399.348 | 215.457.375 | 289.453.259 | 168.871.588 | 23.387.014 | 174.673.630 |
| (70.639.821) | (576.544.805) | (50.701.056) | (241.448.596) | (19.277.562) | (188.667.783) | (19.198.530) | (169.337.585) |
| 165.115 | (453.667.020) | (43.301.708) | (25.991.221) | 270.175.697 | (19.796.195) | 4.188.484 | 5.336.045 |
| 165.595.940 | 442.908.116 | 40.498.739 | 614.883.298 | 803.381.804 | 498.134.113 | 54.195.828 | 439.208.591 |

AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES INHABERN EINLÖSBARER, PARTIZIPIERENDER ANTEILE ZUZUSCHREIBENDEN NETTOVERMÖGENS

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020 (Forts.)

| | BNY Mellon Global Equity Income Fund | BNY Mellon Global High Yield Bond Fund | BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund | BNY Mellon Global Leaders Fund | BNY Mellon Global Multi- Asset Income Fund |
|--|--|---|---|--------------------------------------|---|
| | USD | USD | USD | USD | EUR |
| Inhabern von einlösaren, partizipierenden Anteilen zu Beginn des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen | 1.842.135.041 | 121.548.316 | 91.053.076 | 86.118.374 | 23.691.394 |
| Nominelle Wechselkursbereinigung (Erläuterung 1) | – | – | – | – | – |
| Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit | (118.682.815) | 6.154.453 | 12.236.091 | 10.152.477 | (1.006.053) |
| Erlöse aus ausgegebenen einlösaren, partizipierenden Anteilen | 343.422.433 | 68.552.332 | 131.634.363 | 23.577.424 | 3.295.326 |
| Kosten aus zurückgenommenen einlösaren, partizipierenden Anteilen | (1.297.643.977) | (42.830.808) | (88.484.503) | (80.757.372) | (5.235.942) |
| Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus Anteilsgeschäften | (954.221.544) | 25.721.524 | 43.149.860 | (57.179.948) | (1.940.616) |
| Inhabern von einlösaren, partizipierenden Anteilen am Ende des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen | 769.230.682 | 153.424.293 | 146.439.027 | 39.090.903 | 20.744.725 |

| | BNY Mellon Mobility Innovation Fund | BNY Mellon S&P 500® Index Tracker | BNY Mellon Small Cap Euroland Fund | BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund* | BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund |
|--|--|---|--|--|---|
| | USD | USD | EUR | USD | EUR |
| Inhabern von einlösaren, partizipierenden Anteilen zu Beginn des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen | 154.707.836 | 50.804.733 | 74.850.283 | – | 180.183.426 |
| Nominelle Wechselkursbereinigung (Erläuterung 1) | – | – | – | – | – |
| Anstieg/(Rückgang) des Inhabern von einlösaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus der Geschäftstätigkeit | 128.269.457 | 4.207.877 | (518.505) | 2.743 | 2.589.737 |
| Erlöse aus ausgegebenen einlösaren, partizipierenden Anteilen | 272.164.452 | 5.481.019 | 19.347.392 | 5.001.185 | 120.728.201 |
| Kosten aus zurückgenommenen einlösaren, partizipierenden Anteilen | (80.944.431) | (23.628.053) | (33.017.426) | – | (32.179.480) |
| Nettozunahme/(-abnahme) des Nettovermögens aus Anteilsgeschäften | 191.220.021 | (18.147.034) | (13.670.034) | 5.001.185 | 88.548.721 |
| Inhabern von einlösaren, partizipierenden Anteilen am Ende des Geschäftsjahres zuzuschreibendes Nettovermögen | 474.197.314 | 36.865.576 | 60.661.744 | 5.003.928 | 271.321.884 |

* Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr aufgelegt.

^ Der Gesamtbetrag für die Gesellschaft wurde zum 31. Dezember 2020 berichtigt und berücksichtigt Überkreuzinvestitionen durch den BNY Mellon Euroland Bond Fund und den BNY Mellon European Credit Fund.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

AUFSTELLUNG DER VERÄNDERUNGEN DES INHABERN EINLÖSBARER,
 PARTIZIPIERENDER ANTEILE ZUZUSCHREIBENDEN NETTOVERMÖGENS

Für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020 (Forts.)

| BNY Mellon Global Opportunities Fund | BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) | BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP) | BNY Mellon Global Real Return Fund (USD) | BNY Mellon Global Short- Dated High Yield Bond Fund | BNY Mellon Global Unconstrained Fund | BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund | BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund |
|--|---|---|---|---|---|---|--|
| USD | EUR | GBP | USD | USD | USD | JPY | EUR |
| 48.327.216 | 3.409.751.582 | 70.966.738 | 322.386.292 | 725.167.880 | 25.173.039 | 15.534.711.210 | 1.485.354.765 |
| - | - | - | - | - | - | - | - |
| 1.689.095 | 136.018.764 | 2.314.748 | 22.383.541 | (8.731.334) | 4.336.421 | 1.357.826.912 | 85.052.399 |
| 15.332.903 | 1.097.360.630 | 23.914.629 | 42.586.975 | 322.102.130 | 480.699 | 3.194.780.657 | 675.224.522 |
| (29.371.525) | (1.716.250.030) | (34.433.610) | (86.533.931) | (336.822.197) | - | (4.769.909.455) | (674.518.861) |
| (14.038.622) | (618.889.400) | (10.518.981) | (43.946.956) | (14.720.067) | 480.699 | (1.575.128.798) | 705.661 |
| 35.977.689 | 2.926.880.946 | 62.762.505 | 300.822.877 | 701.716.479 | 29.990.159 | 15.317.409.324 | 1.571.112.825 |
| BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)* | BNY Mellon Targeted Return Bond Fund | BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund | BNY Mellon U.S. Equity Income Fund | BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund | Gesamt 31. Dezember 2020^ | | |
| EUR | USD | USD | USD | USD | USD | | |
| - | 84.505.101 | 28.865.549 | 419.124.854 | 438.605.770 | 16.628.689.066 | | |
| - | - | - | - | - | 608.296.876 | | |
| 1.782.627 | 7.266.089 | 281.468 | (53.225.543) | 36.441.161 | 760.559.005 | | |
| 38.877.226 | 1.181.068 | 7.822.077 | 43.530.353 | 297.120.098 | 7.908.342.141 | | |
| (6.412.477) | - | (33.264.787) | (179.162.385) | (158.250.747) | (8.630.422.779) | | |
| 32.464.749 | 1.181.068 | (25.442.710) | (135.632.032) | 138.869.351 | (722.080.638) | | |
| 34.247.376 | 92.952.258 | 3.704.307 | 230.267.279 | 613.916.282 | 17.275.464.309 | | |

BNY MELLON GLOBAL FUNDS, PLC

ERLÄUTERUNGEN ZUM ABSCHLUSS

1. ZUSAMMENFASSUNG DER WICHTIGSTEN BILANZIERUNGS- UND BEWERTUNGSMETHODEN

Die wichtigsten Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden und Schätztechniken, die bei der Erstellung dieses Abschlusses angewandt wurden, sind im Folgenden aufgeführt:

ENTSPRECHENSERKLÄRUNG

Der Jahresabschluss für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 wurde gemäß dem Financial Reporting Standard („FRS“) 102: „Im Vereinigten Königreich und der Republik Irland anzuwendender Finanzberichterstattungsstandard“ („Financial Reporting Standard, FRS 102“) und der irischen Gesetzgebung unter Einbeziehung des Companies Act 2014, in der jeweils gültigen Fassung, der Vorschriften der Europäischen Gemeinschaften (über Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren) von 2011 (in der jeweils gültigen Fassung) (die „OGAW-Vorschriften“) sowie den Vorschriften der Central Bank Zentralbank (Supervision and Enforcement) Act 2013 (Section 48(1)) (Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren) von 2019 (die „OGAW-Vorschriften der Zentralbank“) erstellt.

GRUNDLAGE FÜR DIE ABSCHLUSSERSTELLUNG

Der Jahresabschluss wurde auf Basis des Fortführungsprinzips der Gesellschaft gemäß dem Anschaffungskostenprinzip erstellt, modifiziert durch die Neubewertung von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten.

Das Format und bestimmte Formulierungen des Abschlusses wurden an den Companies Act 2014, in der jeweils gültigen Fassung, so angepasst, dass sie nach Ansicht des Verwaltungsrats die Tätigkeit der Gesellschaft als Investmentfonds angemessener darstellen.

Die Gesellschaft nimmt die nach Abschnitt 7 „Darstellung der Zahlungsströme“ des FRS 102 offenen Investmentfonds gewährte Ausnahmeregelung in Anspruch, keine Kapitalflussrechnung auf der Grundlage zu erstellen, dass im Wesentlichen alle Anlagen der Gesellschaft hochliquide sind und zum beizulegenden Zeitwert getätigt werden. Die Gesellschaft stellt eine Aufstellung der Veränderungen des Inhabern einlösbarer, partizipierender Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens bereit.

WESENTLICHE BILANZIELLE SCHÄTZUNGEN UND ERMESSENSENTSCHEIDUNGEN

Bei der Erstellung des Abschlusses muss auf bestimmte wichtige bilanzielle Schätzungen zurückgegriffen werden. Außerdem muss der Verwaltungsrat bei der Anwendung der Bilanzierungs- und Bewertungsmethoden der Gesellschaft sein Ermessen ausüben. Die Geschäftsführung nimmt Schätzungen und Annahmen hinsichtlich der Entwicklung in der Zukunft vor. Die Schätzungen und Annahmen, die ein erhebliches Risiko bezüglich einer wesentlichen Anpassung bei den Buchwerten der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten beinhalten, werden nachstehend unter „Finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet – Schätzung des beizulegenden Zeitwerts“ erörtert. Die Annahmen und Schätzungen der Gesellschaft basieren auf Parametern, die zum Zeitpunkt der Erstellung des Jahresabschlusses zur Verfügung standen. Bestehende Umstände und Annahmen über künftige Entwicklungen können aufgrund von Marktbewegungen oder dem Eintreten von Umständen, die außerhalb der Kontrolle der Fonds liegen, Änderungen unterliegen. Diese Änderungen werden in den Annahmen wiedergegeben, wenn sie eintreten und zukünftig erkannt werden.

WECHSELKURSUMRECHNUNG – FUNKTIONALE UND DARSTELLUNGSWÄHRUNG

Die in den Abschlüssen der Gesellschaft enthaltenen Positionen sind in der Währung des primären wirtschaftlichen Umfelds ausgewiesen, in dem der jeweilige Fonds tätig ist (die „funktionale Währung“). Die funktionale Währung der einzelnen Fonds wurde vom Verwaltungsrat auf der Grundlage derjenigen Währung festgelegt, welche die wirtschaftlichen Auswirkungen der zugrunde liegenden Transaktionen, Ereignisse, Anlegerbasis und Bedingungen am besten widerspiegelt. Der Abschluss der Gesellschaft wird in US-Dollar ausgewiesen, der Darstellungswährung der Gesellschaft.

Die funktionalen Währungen und Darstellungswährungen der Fonds sind US-Dollar, Euro, Pfund Sterling oder japanischer Yen, wie in der Bilanz angegeben.

Vermögenswerte und Verbindlichkeiten in Fremdwährungen, einschließlich des Anteilsinhabern einlösbarer, partizipierender Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens, werden zu dem am Ende des Geschäftsjahres geltenden Schlusskurs in die funktionale Währung umgerechnet. Die in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesenen Erträge und Aufwendungen in Fremdwährungen werden zu den Wechselkursen, die an den Transaktionsdaten maßgeblich sind, in die funktionale Währung umgerechnet. Die Erlöse aus ausgegebenen einlösbaren, partizipierenden Anteilen und die Kosten der zurückgenommenen einlösbaren, partizipierenden Anteile werden ebenfalls zu den Wechselkursen, die an den Transaktionsdaten maßgeblich sind, in die funktionale Währung umgerechnet. Aus Transaktionen und Umrechnungen resultierende Fremdwährungsgewinne und -verluste sind in der Gesamtergebnisrechnung unter „Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten“ ausgewiesen.

Zur Ermittlung von Gesamtsummen für die Gesellschaft werden alle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten zusammen mit Erträgen und Aufwendungen sämtlicher Anteilsklassen unter Anwendung des Schlusskurses für Vermögenswerte und Verbindlichkeiten und dem durchschnittlichen Kurs für Erträge und Aufwendungen, einschließlich Zeichnungen und Rücknahmen, in US-Dollar umgerechnet, da dies die Währung des primären wirtschaftlichen Umfelds ist, in dem die Gesellschaft tätig ist. Ein Währungsausgleich wird erforderlich, wenn das Eröffnungsnettovermögen zu dem am Ende des Geschäftsjahres geltenden Umrechnungskursen erneut umgerechnet wird, wie in der Aufstellung der Veränderungen des Inhabern einlösbarer, partizipierender Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens angegeben. Diese Zuweisungsmethode wirkt sich nicht auf den Wert des Nettovermögens aus, das den einzelnen Fonds zugewiesen wird.

1. ZUSAMMENFASSUNG DER WICHTIGSTEN BILANZIERUNGS- UND BEWERTUNGSMETHODEN Forts.

ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN – KLASSIFIZIERUNG

Diese Kategorie hat zwei Unterkategorien: finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die zu Handelszwecken gehalten werden, und solche, die zu Beginn als erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet eingestuft werden.

Finanzielle Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten werden als zu Handelszwecken gehalten eingestuft, wenn sie gekauft oder eingegangen werden, um sie kurzfristig zu verkaufen oder zurückzukaufen, oder wenn sie beim erstmaligen Ansatz Teil eines aus identifizierbaren, gemeinsam verwalteten Finanzinstrumenten bestehenden Portfolios sind, bei dem sich derzeit ein Vorgehensmuster abzeichnet, das auf kurzfristige Gewinnmitnahmen abzielt. Derivate werden ebenfalls als zu Handelszwecken gehalten eingestuft.

Finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die bei der Erstbewertung erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert ausgewiesen werden, sind Finanzinstrumente, die nicht als zu Handelszwecken gehalten eingestuft aber verwaltet werden und deren Wertentwicklung auf der Grundlage ihres beizulegenden Zeitwerts gemäß der im Prospekt genannten Anlagestrategie der Fonds bewertet wird.

ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN – ANSATZ, AUSBUCHUNG UND BEWERTUNG

Reguläre Käufe und Verkäufe von Anlagen werden am Handelstag ausgewiesen, d. h. zu dem Datum, an dem die Gesellschaft sich verpflichtet, die Anlage zu kaufen oder zu verkaufen. Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten werden anfänglich zum beizulegenden Zeitwert ausgewiesen. Die Transaktionskosten werden als Aufwendung in der Gesamtergebnisrechnung verbucht.

Finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten werden ausgebucht, wenn die Rechte auf den Erhalt von Cashflows aus den bzw. auf Zahlung von Cashflows für die Anlagen erloschen sind oder die Gesellschaft im Wesentlichen alle mit dem Eigentum verbundenen Risiken und Chancen übertragen hat.

Die Folgebewertung aller erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert angesetzten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten erfolgt zum beizulegenden Zeitwert. Gewinne und Verluste aus Veränderungen des beizulegenden Zeitwerts der Kategorie „Finanzielle Vermögenswerte oder finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet“ werden unter „Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte/Verbindlichkeiten“ in der Gesamtergebnisrechnung im Geschäftsjahr ihres Entstehens anhand der Durchschnittskostenmethode verbucht.

Bei Devisenterminkontrakten auf der Ebene abgesicherter Anteilsklassen werden die realisierten und nicht realisierten Gewinne oder Verluste ausschließlich den entsprechenden Anteilsklassen zugewiesen. Die nicht realisierten Gewinne oder Verluste aus Absicherungstätigkeiten werden in der Kategorie „Finanzielle Vermögenswerte oder finanzielle Verbindlichkeiten, erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet“ in der Bilanz ausgewiesen.

ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN – BEWERTUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS

Der beizulegende Zeitwert von finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, die an aktiven Märkten gehandelt werden (wie börsengehandelte Derivate und Wertpapiere), basiert auf den angegebenen Marktkursen am Ende des Geschäftsjahres. In Übereinstimmung mit FRS 102 hat die Gesellschaft die Bestimmungen zu Ansatz und Bewertung der International Accounting Standards („IAS“) 39 „Finanzinstrumente: Ansatz und Bewertung“, die zur Verwendung in der Europäischen Union verabschiedet wurden, angewendet. Dementsprechend ist der angegebene Marktpreis für gehaltene finanzielle Vermögenswerte der Mittelkurs. Wenn die Gesellschaft Derivate zum Ausgleich von Marktrisiken einsetzt, wendet sie Mittelkurse als Grundlage an, um beizulegende Zeitwerte zum Ausgleich von risikobehafteten Positionen festzulegen und diesen Mittelkurs jeweils auf die offene Nettoposition anzuwenden.

Kommt es nach dem Bewertungszeitpunkt der Fonds am Ende des Geschäftsjahres zu einer bedeutenden Veränderung des beizulegenden Zeitwerts, wird der beizulegende Zeitwert anhand von Bewertungsmethoden ermittelt. Ein Ereignis ist dann bedeutend, wenn es nach dem letzten Marktkurs eines Wertpapiers, nach Börsenschluss oder Devisenmarktschluss, jedoch vor dem Bewertungszeitpunkt der Fonds eintritt und sich wesentlich auf die Richtigkeit der Schlusskurse eines Wertpapiers, eines Instruments, einer Währung oder von Wertpapieren auswirkt, die von diesem Ereignis betroffen sind, und diese daher nicht als verfügbare Marktnotierungen gelten können.

Der beizulegende Zeitwert von finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, die nicht an einem aktiven Markt gehandelt werden (z. B. außerbörslich gehandelte OTC-Derivate), wird unter Anwendung von Bewertungsmethoden ermittelt. Die Gesellschaft verwendet eine Vielzahl von Methoden und trifft Annahmen, die auf den zum jeweiligen Bilanzstichtag bestehenden Marktbedingungen beruhen. Zu den verwendeten Bewertungsmethoden gehören die Verwendung vergleichbarer, kürzlich getätigter Transaktionen zu marktüblichen Bedingungen, die Bezugnahme auf andere, im Wesentlichen identische Instrumente, die Analyse diskontierter Cashflows, Optionspreismodelle und andere Bewertungstechniken, die von Marktteilnehmern üblicherweise verwendet werden, wobei so weit wie möglich auf Marktdaten zurückgegriffen und so wenig wie möglich unternehmensspezifische Daten verwendet werden.

Die Buchwerte abzüglich der Wertberichtigung sonstiger Forderungen und Verbindlichkeiten entsprechen in etwa ihrem beizulegenden Zeitwert.

1. ZUSAMMENFASSUNG DER WICHTIGSTEN BILANZIERUNGS- UND BEWERTUNGSMETHODEN Forts.

ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN – BEWERTUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Nachfolgend eine Auflistung der wichtigsten Bewertungsmethoden der Gesellschaft:

- (a) Finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die an einer anerkannten Börse notiert und regelmäßig gehandelt werden und für die Marktnotierungen ohne Weiteres verfügbar sind oder die an außerbörslichen Märkten gehandelt werden, werden zu dem Mittelkurs der Hauptbörse des Markts für die betreffende Anlage bewertet.
- (b) Sind die finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten an mehreren anerkannten Börsen notiert, so wird der Kurs der anerkannten Börse verwendet, die nach Meinung des Verwaltungsrats nach Rücksprache mit dem jeweiligen Anlageverwalter den Hauptmarkt für diese Vermögenswerte darstellt.
- (c) Wenn für bestimmte finanzielle Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten der Mittelkurs gemäß (a) oder (b) oben nicht verfügbar ist oder nach Ansicht des Verwaltungsrats nach Rücksprache mit dem entsprechenden Anlageverwalter, keinen fairen oder angemessenen Wert reflektiert, ist der Wert unter Einsatz anderer Methoden mit angemessener Sorgfalt und in gutem Glauben vom Verwaltungsrat angemessen zu berechnen und von The Bank of New York Mellon SA/NV, Niederlassung Dublin (die „Verwahrstelle“) zu diesem Zweck zu genehmigen, unter Rücksprache mit dem entsprechenden Anlageverwalter, um den wahrscheinlichen Veräußerungswert solcher Anlagen zu bestimmen.
- (d) Für den Fall, dass finanzielle Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten nicht an einer anerkannten Börse notiert sind oder gehandelt werden, werden diese Vermögenswerte vom Verwaltungsrat mit Sorgfalt und nach Treu und Glauben und in Absprache mit dem jeweiligen Anlageverwalter zum wahrscheinlichen Veräußerungswert bewertet. Dieser wahrscheinliche Veräußerungswert kann anhand von Kursinformationen eines Maklers festgelegt werden.
- (e) Barmittel und andere liquide Mittel werden zu ihrem Nennwert bewertet, gegebenenfalls mit aufgelaufenen Zinsen.
- (f) Anteile an Organismen für gemeinsame Anlagen (außer solchen, die gemäß (a) oder (b) oben bewertet wurden) werden zum letzten verfügbaren Nettoinventarwert des entsprechenden Organismus für gemeinsame Anlagen als beste Schätzung des beizulegenden Zeitwerts bewertet.
- (g) An einem Markt gehandelte derivative Instrumente werden zum Abrechnungspreis dieser Instrumente an einem solchen Markt bewertet. Wenn diese derivativen Instrumente nicht an einem Markt gehandelt werden entspricht ihr Wert dem Tageskurs eines unabhängigen Kursdienstes oder unabhängiger Marktmacher.
- (h) Der Marktwert von Devisenterminkontrakten wird von einer unabhängigen Preisquelle bestimmt, wobei der Preis herangezogen wird, zu dem ein neuer Forward-Kontrakt derselben Höhe und Fälligkeit abgeschlossen werden könnte.
- (i) Einschusszahlungen erfolgen beim Abschluss von Terminkontrakten (Futures) und werden im Allgemeinen in Form von Barmitteln oder Bargegenwerten geleistet. Der beizulegende Zeitwert von Terminkontrakten wird auf der Basis ihres täglichen Abrechnungskurses bestimmt. Wertänderungen offener Terminkontrakte werden als nicht realisierte Gewinne oder Verluste aus Terminkontrakten erfasst, bis die Kontrakte beendet werden, wobei zu diesem Zeitpunkt die realisierten Gewinne und Verluste erfasst werden. Nicht realisierte Gewinne oder Verluste aus Terminkontrakten sind in der Aufstellung der Wertpapierbestände aufgeführt. Nachschussforderungen/-verbindlichkeiten zum Bilanzstichtag werden als Forderung bzw. Verbindlichkeit in der Bilanz ausgewiesen.
- (j) Die Optionsprämie für ausgeübte gekaufte Put-Optionen wird zur Feststellung des realisierten Gewinns bzw. Verlusts vom Erlös aus dem Verkauf des zugrunde liegenden Wertpapiers oder der Währung abgezogen. Die Optionsprämie für ausgeübte gekaufte Call-Optionen wird zu den Kosten der gekauften Wertpapiere bzw. Währungen hinzuaddiert. Prämien, die für den Kauf von Optionen, welche ohne Ausübung verfallen, gezahlt werden, werden als realisierte Verluste behandelt. Die Optionsprämie auf verkaufte Call-Optionen, die ausgeübt wurden, wird zur Feststellung des realisierten Gewinns bzw. Verlusts zum Erlös aus dem Verkauf des zugrunde liegenden Wertpapiers bzw. der Währung hinzuaddiert. Die Optionsprämie auf verkaufte Put-Optionen, die ausgeübt wurden, wird von den Kosten der gekauften Wertpapiere bzw. Fremdwährungen abgezogen. Prämien, die beim Verkauf von Optionen, die ohne Ausübung verfallen, vereinnahmt werden, werden als realisierte Gewinne behandelt.
- (k) Zinsswap-, Credit Default Swap- und Total Return Swap-Kontrakte werden auf Basis der Notierungen eines unabhängigen Kursdienstes oder von Marktmachern täglich bewertet, und eine etwaige Änderung wird als nicht realisierte Gewinne oder Verluste ausgewiesen. Zahlungen, die aufgrund einer Vertragskündigung vereinnahmt oder entrichtet wurden, werden abzüglich von Vorauszahlungen als realisierte Gewinne oder Verluste ausgewiesen. Erträge aus (im Freiverkehr gehandelten) OTC-Derivaten fallen den Fonds zu und unterliegen keinen Vereinbarungen über die Aufteilung von Erträgen mit der BNY Mellon Fund Management (Luxembourg) S.A (die „Verwaltungsgesellschaft“) oder anderen Parteien.
- (l) Commercial Paper und Termineinlagen werden zu den fortgeführten Anschaffungskosten als beste Schätzung des beizulegenden Zeitwerts bewertet. Die Gesellschaft darf in Finanzinstrumenten anlegen, die nicht an einem aktiven Markt gehandelt werden, wobei der beizulegende Zeitwert anhand von Bewertungsmethoden, wie der diskontierten Cashflow-Analyse, und anderen von Marktteilnehmern verwendeten Bewertungsmethoden ermittelt werden kann.
- (m) Börsengehandelte Fonds werden zum beizulegenden Zeitwert auf der Grundlage von Notierungen des Nettoinventarwerts je Anteil aus unabhängigen Preisquellen als beste Schätzung des beizulegenden Zeitwerts bewertet.

1. ZUSAMMENFASSUNG DER WICHTIGSTEN BILANZIERUNGS- UND BEWERTUNGSMETHODEN Forts.

ERFOLGSWIRKSAM ZUM BEIZULEGENDEN ZEITWERT BEWERTETE FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN – BEWERTUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

- (n) Bestimmte Fonds können „TBA“-Kaufverpflichtungen (To Be Announced) eingehen, um Wertpapiere zu einem festen Anteilspreis zu einem zukünftigen Zeitpunkt außerhalb der üblichen Abrechnungszeit zu kaufen. Obwohl der Anteilspreis feststeht, ist der Kapitalwert noch nicht endgültig festgelegt. Die Fonds halten bis zum Abrechnungstermin Barmittel oder erstklassige Schuldverschreibungen in einer Höhe, die ausreicht, um den Kaufpreis zu erfüllen, oder die Fonds schließen gegenläufige Kontrakte für den Terminverkauf anderer Wertpapiere, die sie besitzen, ab. Die Erträge aus den Wertpapieren werden erst am Abrechnungstag erzielt. TBA-Kaufverpflichtungen können als Wertpapiere an sich betrachtet werden und bergen ein Verlustrisiko, wenn der Wert des zu kaufenden Wertpapiers vor dem Abrechnungstermin sinkt, was zusätzlich zu dem Risiko eines Wertverlusts der anderen Vermögenswerte der Fonds besteht. Nicht abgewickelte TBA-Kaufverpflichtungen werden zum aktuellen Marktwert der zugrunde liegenden Wertpapiere bewertet. Obwohl die Fonds TBA-Kaufverpflichtungen mit der Absicht eingehen können, Wertpapiere für ihre Portfolios zu erwerben oder gemäß von ihnen geschlossenen Optionskontrakten zu liefern, können die Fonds eine TBA-Kaufzusage vor dem Abrechnungstermin veräußern, wenn der Anlageverwalter dies für angemessen hält.
- (o) Aktien-Swaps werden entsprechend der Preisgrundlage für die zugrunde liegenden Aktienpositionen bewertet. Finanzierungskosten für Aktien-Swaps laufen täglich auf, werden monatlich angepasst und werden durch den Verkauf von Aktien-Swaps abgerechnet. Erträge aus Aktien-Swaps fallen den Fonds zu und unterliegen keinen Vereinbarungen über die Aufteilung von Erträgen mit der Verwaltungsgesellschaft oder anderen Parteien.
- (p) Darlehen werden zum beizulegenden Zeitwert bewertet, der vom Daten- und Informationsdienstleister Markt bereitgestellt wird. Eingenommene oder gezahlte Gebühren sowie der Erhalt von Kapitalzahlungen werden unter „Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten“ in der Gesamtergebnisrechnung erfasst. In Fällen, in denen Markt keinen Wert für ein Darlehen stellen kann, wird das Darlehen zum beizulegenden Zeitwert auf der Grundlage einer von einem Finanzinstitut vorgenommenen Bewertung bewertet. Offene Darlehen werden auf Grundlage des vereinbarten Kaufpreises zum beizulegenden Zeitwert bewertet, bis eine Bewertung von einem Preisdienst zur Verfügung steht.
- (q) Einige Fonds können Genussscheine (Participatory Notes, P-Notes) nutzen, die an zulässigen Märkten notiert sind oder gehandelt werden. Über diese Genussscheine erhalten die Fonds wirtschaftlichen Zugang zu bestimmten Aktien in beschränkt zugänglichen oder Schwellenmärkten wie z. B. Indien, Sri Lanka, Vietnam, Bangladesch, China und Brasilien, wo das Halten lokaler Aktien oder aktienbezogener Wertpapiere möglicherweise weniger effizient ist als die Verwendung von Genussscheinen, was zu einer Verringerung der Kosten führt. Genussscheine werden anhand des Mittelkurses des zugrunde liegenden Wertpapiers bewertet.

DARLEHEN

Bestimmte Fonds der Gesellschaft können in direkte Schuldinstrumente investieren, die Ansprüche an den Beträgen sind, die von kreditnehmenden Unternehmen und staatlichen Institutionen oder von sonstigen Kreditnehmern gegenüber Kreditgebern oder Syndikatsführern geschuldet werden. Die Anlagen eines Fonds in Darlehen können in Form von Beteiligungen an Darlehen oder Übertragungen aller oder eines Teils von Darlehen von Dritten erfolgen. Ein Darlehen wird häufig von einer Bank oder einem anderen Finanzinstitut (der „Kreditgeber“) verwaltet, die/das als Vertreter für alle Inhaber handelt. Der Vertreter verwaltet die Darlehensbedingungen gemäß den Bestimmungen im Darlehensvertrag. Ein Fonds kann in mehrere Serien oder Tranchen von Darlehen investieren, die unterschiedliche Bestimmungen enthalten und mit unterschiedlichen Risiken verbunden sind. Ein Fonds ist in der Regel nicht berechtigt, die Erfüllung der Bestimmungen des Darlehensvertrags mit dem Kreditnehmer durchzusetzen. Daher kann ein Fonds dem Kreditrisiko sowohl des Kreditnehmers als auch des Kreditgebers unterliegen, der den Darlehensvertrag verkauft.

Erwirbt ein Fonds Übertragungen von Kreditgebern, erwirbt er direkte Ansprüche gegenüber dem Kreditnehmer des Darlehens. Bei einer Anlage in ein Darlehen ist ein Fonds berechtigt, Kapitalzahlungen, Zinsen und Gebühren zu erhalten, auf die er ausschließlich Anspruch gegenüber dem Kreditgeber hat, der den Darlehensvertrag verkauft, und zwar ausschließlich, wenn der Kreditgeber Zahlungen vom Kreditnehmer erhält.

FORDERUNGEN

Forderungen umfassen Barmittel und Bargegenwerte, Forderungen aus Erträgen, Forderungen aus veräußerten Anlagen, Rückzahlungen von der Verwaltungsgesellschaft, Margen auf Derivatkontrakte, Forderungen aus Zeichnungen und sonstige Forderungen. Diese Beträge werden beim Erstansatz zum beizulegenden Zeitwert erfasst und danach zu fortgeführten Anschaffungskosten bewertet.

FINANZIELLE VERBINDLICHKEITEN ZU FORTGEFÜHRTEN ANSCHAFFUNGSKOSTEN

Finanzielle Verbindlichkeiten zu fortgeführten Anschaffungskosten umfassen Banküberziehungen, Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Anlagen, Verbindlichkeiten aus Rücknahmen, zahlbare Aufwendungen, Verbindlichkeiten aus Performancegebühren, Margen auf Derivatkontrakte, an den Makler zu zahlende Barsicherheiten, auf Swaps zu zahlende Erträge, Finanzierungskosten für Swaps, Steuerverbindlichkeiten und sonstige Verbindlichkeiten. Diese Beträge werden beim Erstansatz zum beizulegenden Zeitwert erfasst und danach zu fortgeführten Anschaffungskosten bewertet.

1. ZUSAMMENFASSUNG DER WICHTIGSTEN BILANZIERUNGS- UND BEWERTUNGSMETHODEN Forts.

SALDIERUNG VON FINANZINSTRUMENTEN

Es erfolgt eine Saldierung von finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten und der Nettobetrag wird in der Bilanz ausgewiesen, sofern die Saldierung der erfassten Beträge rechtlich durchsetzbar ist und beabsichtigt wird, die Abwicklung auf Nettobasis vorzunehmen oder den Vermögenswert zu realisieren und gleichzeitig die Verbindlichkeit abzulösen.

ÜBERKREUZINVESTITIONEN

Zum 31. Dezember 2021 investieren der BNY Mellon Absolute Return Bond Fund, der BNY Mellon Euroland Bond Fund und der BNY Mellon European Credit Fund in andere Fonds der Gesellschaft (31. Dezember 2020: BNY Mellon Euroland Bond Fund und BNY Mellon European Credit Fund). Die Überkreuzinvestitionen wurden aus dem Jahresabschluss der Gesellschaft herausgenommen. Investiert ein Fonds in einen oder mehrere Fonds der Gesellschaft, werden diese Überkreuzinvestitionen bei der Berechnung der zu zahlenden Managementgebühren vom Gesamt Nettoinventarwert abgezogen. Die realisierten Gewinne und Verluste, einschließlich der Veränderungen bei nicht realisierten Gewinnen und Verlusten, aus Überkreuzinvestitionen wurden aus den Gesamtbeträgen der Gesellschaft, die in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesen werden, herausgenommen.

BARMITTEL UND BARGEGENWERTE SOWIE BANKÜBERZIEHUNGEN

Barmittel und Bargegenwerte werden zum Nennwert und gegebenenfalls mit den aufgelaufenen Zinsen zum Bewertungszeitpunkt am relevanten Geschäftstag angesetzt. Bargegenwerte umfassen Sichteinlagen bei Banken sowie sonstige kurzfristige Anlagen in einem aktiven Markt mit ursprünglichen Fälligkeiten von bis zu drei Monaten. Banküberziehungen werden in der Bilanz getrennt ausgewiesen.

SICHERHEITEN

Von den Fonds gestellte Barsicherheiten werden in der Bilanz als „Margen auf Derivatkontrakte“ erfasst und sind nicht als Bestandteil von Barmitteln und Bargegenwerten enthalten. Von den Fonds erhaltene Barsicherheiten werden in der Bilanz als „Vom Makler erhaltene Barsicherheiten“ erfasst. Die Verpflichtung zur Rückzahlung der Barsicherheiten wird in der Bilanz als „An den Makler zu zahlende Barsicherheiten“ erfasst. Erhaltene Barsicherheiten sind nicht Bestandteil der Barmittel und Bargegenwerte der Fonds. Bei anderen Sicherheiten als Barmitteln, wenn die Partei, der die Sicherheit übergeben wird, vertraglich oder eigentümlich das Recht hat, die Sicherheit zu verkaufen oder zu verpfänden, klassifizieren die Fonds diesen Vermögenswert in ihrer Bilanz getrennt von anderen Vermögenswerten und erfassen den Vermögenswert als verpfändete Sicherheit. Hat die Partei, der die Sicherheit übergeben wird, nicht das Recht, die Sicherheit zu verkaufen oder zu verpfänden, wird die übergebene Sicherheit in der Aufstellung der Wertpapierbestände offen gelegt, wenn ein „*“ angegeben ist.

TRANSAKTIONSKOSTEN

Transaktionskosten sind Kosten, die für den Erwerb von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten oder Verbindlichkeiten entstehen. Sie beinhalten die an Vertreter, Berater, Makler und Händler gezahlten Gebühren und Provisionen. Im Hinblick auf Aktien und derivative Finanzinstrumente werden entstandene Transaktionskosten in der Gesamtergebnisrechnung sofort als Aufwand ausgewiesen und sind unter „Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten“ enthalten. Bei allen anderen Wertpapieren ist die Spanne zwischen Geld- und Briefkurs im Kauf- und Verkaufspreis der Wertpapiere enthalten und kann nicht getrennt geprüft oder offen gelegt werden.

DIVIDENDENERTRÄGE

Dividenden aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten werden in der Gesamtergebnisrechnung als „Dividendenertrag“ ausgewiesen, sofern das Recht der Fonds auf den Erhalt dieser Zahlungen begründet ist. Dividendenerträge werden vor Abzug jeglicher nicht erstattungsfähiger Quellensteuern ausgewiesen.

DIVIDENDENAUFWAND

Zinsen auf kurzfristige Aktien-Swaps werden in der Gesamtergebnisrechnung als „Dividendenaufwand“ ausgewiesen. Dieser kann je nach der periodischen Fortschreibung und/oder abschließenden Veräußerung der zugrunde liegenden Swap-Instrumente Änderungen unterliegen.

ZINSERTRÄGE

Zinserträge für zinstragende Finanzinstrumente werden als Teil der „Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten“ ausgewiesen. Erträge aus Bankzinsen werden bei Zahlungseingang erfasst.

BESTEUERUNG

Gemäß den geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Praktiken sind von den Fonds keine Einkommen-, Kapitalertrag- oder sonstigen Steuern zu zahlen. Den Fonds entstehen derzeit Quellensteuern, die von bestimmten Ländern auf ihre Anlageerträge und Veräußerungsgewinne erhoben werden. Quellensteuern werden in der Gesamtergebnisrechnung gesondert und nach Abzug von Steuergutschriften ausgewiesen.

Bestimmte Fonds grenzen die Kapitalertragsteuer auf die realisierten und nicht realisierten Nettoanlageerträge periodengerecht ab. Die Kapitalertragsteuer wird in Übereinstimmung mit den Steuervorschriften des jeweiligen Landes und den Steuersätzen für irische Anleger ausgewiesen. Die Kapitalertragsteuer und die am Ende des Geschäftsjahres fälligen Beträge sind in den Posten „Quellensteuern auf Dividenden und andere Anlageerträge“ und „Zu zahlende Steuern“ in der Gesamtergebnisrechnung bzw. in der Bilanz aufgeführt.

1. ZUSAMMENFASSUNG DER WICHTIGSTEN BILANZIERUNGS- UND BEWERTUNGSMETHODEN Forts.

AUFWENDUNGEN

Aufwendungen werden periodengerecht abgegrenzt. Kosten in Verbindung mit der Auflösung eines Fonds werden von der Verwaltungsgesellschaft gezahlt.

WERTPAPIERLEIHE

Die Gesellschaft hat mit The Bank of New York Mellon, Niederlassung London, und der Verwahrstelle eine Wertpapierleihvereinbarung (in der geänderten, abgetretenen, erneuerten und angenommenen Fassung) geschlossen. Die Gesellschaft kann Wertpapiere in Höhe von bis zu 100 % einer beliebigen Wertpapierlinie an Schuldner verleihen, die von The Bank of New York Mellon genehmigt wurden. Die Gesellschaft erhält als Sicherheit für die entliehenen Wertpapiere Wertpapiere, Finanzinstrumente oder sonstige Vermögenswerte. Die Gesellschaft akzeptiert Barmittel als Sicherheiten, tätigt jedoch keine Wiederanlage von Barsicherheiten. Gehaltene (und ausstehende) Sicherheiten entsprechen mindestens 102 % des Werts der entliehenen Wertpapiere. Erträge aus der Wertpapierleihe werden bei Zahlungseingang erfasst. Einzelheiten zu der Wertpapierleihposition am Ende des Geschäftsjahres sind in Erläuterung 14 zum Abschluss enthalten.

AUSSCHÜTTUNGEN AN DIE INHABER EINLÖSBARER, PARTIZIPIERENDER ANTEILE

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

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE

Die Gesellschaft gibt innerhalb jedes Fonds mehrere Klassen einlösbarer, partizipierender Anteile aus, die nach Ermessen des Inhabers rückzahlbar sind und keine identischen Rechte haben. Diese Anteile werden als finanzielle Verbindlichkeiten erfasst.

Einlösbare, partizipierende Anteile können jederzeit gegen einen Barbetrag an den Fonds zurückgegeben werden, der dem der Anteilsklasse zuzuweisenden proportionalen Anteil am Nettoinventarwert des Fonds entspricht. Die einlösbaren, partizipierenden Anteile werden zu dem Rücknahmebetrag ausgewiesen, der zum Ende des Geschäftsjahres zahlbar ist, wenn der Inhaber das Recht ausübt, den Anteil an den Fonds zurückzugeben.

Einlösbare, partizipierende Anteile werden nach Wahl des Inhabers zu Preisen ausgegeben und zurückgenommen, die auf dem Nettoinventarwert je Anteil des Fonds zum Zeitpunkt der Ausgabe oder Rücknahme basieren. Der Nettoinventarwert des Fonds je Anteil wird berechnet, indem das Nettovermögen, das den Inhabern der einzelnen Klassen einlösbarer, partizipierender Anteile zuzuweisen ist, in Übereinstimmung mit den im Prospekt zur Bestimmung des Nettoinventarwerts je Anteil für Zeichnungen und Rücknahmen enthaltenen Bestimmungen durch die Summe aller in Umlauf befindlichen einlösbaren, partizipierenden Anteile geteilt wird.

VERWÄSSERUNGS AUSGLEICH

Um die Auswirkungen einer Verwässerung abzuschwächen, kann der Verwaltungsrat nach eigenem Ermessen einen Verwässerungsausgleich in Bezug auf den Nettoinventarwert je Anteil vornehmen. Unter welchen Umständen ein solcher Verwässerungsausgleich erfolgt, liegt allein im Ermessen des Verwaltungsrats.

Die Entscheidung, einen Verwässerungsausgleich vorzunehmen, hängt vom Volumen der Zeichnungen oder Rücknahmen von Anteilen des Fonds ab. Der Verwaltungsrat kann nach eigenem Ermessen einen Verwässerungsausgleich vornehmen, wenn nach seiner Auffassung die bestehenden Anteilsinhaber im Falle von Zeichnungen oder die verbleibenden Anteilsinhaber im Falle von Rücknahmen anderweitig nachteilig betroffen sein könnten. Insbesondere kann unter folgenden Umständen ein Verwässerungsausgleich erfolgen:

- wenn sich ein Fonds in einer anhaltenden Schrumpfung befindet (d. h. einen Nettoabfluss von Rücknahmen erfährt);
- falls der Fonds im Verhältnis zu seiner Größe hohe Nettozeichnungen oder Nettorücknahmen verzeichnet; und
- unter allen anderen Umständen, in denen der Verwaltungsrat der Ansicht ist, dass es im Interesse der Anteilsinhaber ist, einen Verwässerungsausgleich vorzunehmen.

Der Verwässerungsausgleich besteht darin, dass zum Nettoinventarwert je Anteil, sofern sich der Fonds in einer Nettozeichnungsposition befindet, ein Betrag addiert und vom Nettoinventarwert je Anteil, sofern sich der Fonds in einer Nettorücknahmeposition befindet, ein Betrag abgezogen wird, den der Verwaltungsrat für angemessen erachtet, um die Transaktionskosten zu decken, insbesondere Marktspreads, Maklergebühren und Steuern, um den Wert der zugrunde liegenden Vermögenswerte des betreffenden Fonds zu erhalten, und unter allen anderen Umständen, in denen der Verwaltungsrat der Ansicht ist, dass dies im Interesse der Anteilsinhaber ist. Der sich daraus ergebende Betrag ist der Preis, der auf die vom Verwaltungsrat für angemessen erachtete Anzahl von Dezimalstellen gerundet wird.

1. ZUSAMMENFASSUNG DER WICHTIGSTEN BILANZIERUNGS- UND BEWERTUNGSMETHODEN Forts.

VERWÄSSERUNGS AUSGLEICH Forts.

Wird ein Verwässerungsausgleich vorgenommen, steigt der Preis, zu dem die Anteile ausgegeben werden, sofern es sich um Nettozeichnungen handelt, und fällt der Preis, zu dem die Anteile zurückgenommen werden, wenn es sich um Nettorücknahmen handelt. Der Preis, zu dem die einzelnen Anteilsklassen ausgegeben bzw. zurückgenommen werden, wird getrennt berechnet. Allerdings wird jeder Verwässerungsausgleich den Preis der einzelnen Anteilsklassen prozentual auf die gleiche Weise beeinflussen. Ein solcher Verwässerungsausgleich beträgt höchstens 2 % des Nettoinventarwerts des Fonds. Da eine Verwässerung direkt mit den Zu- und Abflüssen bei einem Fonds zusammenhängt, ist es nicht möglich, exakt vorherzusagen, ob eine Verwässerung zu einem beliebigen späteren Zeitpunkt eintreten wird. Folglich ist es ebenfalls nicht möglich, genau vorherzusagen, wie häufig ein Verwässerungsausgleich vorgenommen wird.

2. ANTEILSKAPITAL

GENEHMIGTES KAPITAL

Das ursprüngliche genehmigte 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 38.902 Zeichneranteile zu je 1,00 EUR wurden alle als voll eingezahlt ausgegeben und werden von der Verwaltungsgesellschaft gehalten. Die Zeichneranteile berechtigen die Inhaber zu keinerlei Ausschüttungen, sie berechtigen den Inhaber bei Liquidierung zum Empfang des eingezahlten Betrags, jedoch nicht zur anderweitigen Beteiligung am Gesellschaftsvermögen. Die Zeichneranteile sind nicht Teil des Nettoinventarwerts der Gesellschaft und werden somit in den Abschlüssen nur in dieser Erläuterung ausgewiesen. Nach Meinung des Verwaltungsrats geben diese Ausführungen die Art des Anlagegeschäfts der Gesellschaft wieder.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE

Einlösbar, partizipierende Anteile verleihen den Anspruch auf einen anteilmäßigen Anteil an den Vermögenswerten der Fonds und berechtigen den Anteilinhaber zu einer Stimme je Anteil bei einer Abstimmung. Anteile werden von den Anteilinhabern zu Preisen eingelöst, die auf dem Nettoinventarwert der entsprechenden Anteilsklasse basieren.

Die Aktivitäten bei einlösbaren, partizipierenden Anteilen für das Geschäftsjahr bis zum 31. Dezember 2021 waren wie folgt:

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | Anteile des Geschäftsjahres umlaufende Anteile | Anteile des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile | Anteile des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile | Anteile des Geschäftsjahres umlaufende Anteile |
|---|---------------------------|---------|--|--|--|--|
| 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. ANTEILS KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile | Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile | Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile | Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile |
|---|----------------------------|---------|---|--|---|---|
| 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 Equity 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 |

2. ANTEILS KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile | Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile | Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile | Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile |
|--|----------------------------|---------|---|--|---|---|
| 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 |
| 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. ANTEILS KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile | Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile | Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile | Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile |
|---|----------------------------|---------|---|--|---|---|
| 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. ANTEILS KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile | Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile | Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile | Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile |
|---|----------------------------|---------|---|--|---|---|
| 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. ANTEILS KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

| Fonds | Anteilkategorie | Währung | Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile | Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile | Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile | Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile |
|--|----------------------------|---------|---|--|---|---|
| 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) | – |
| | Sterling X (Inc) (Hedged)^ | GBP | – | 45.068.678 | – | 45.068.678 |
| | Klasse X (Inc)^ | USD | 5.127 | 457 | (5.584) | – |

2. ANTEILS KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile | Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile | Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile | Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile |
|--|----------------------------|---------|---|--|---|---|
| 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. ANTEILS KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile | Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile | Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile | Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile |
|---|---------------------------|---------|---|--|---|---|
| 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. ANTEILS KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile | Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile | Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile | Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile |
|--|--------------------------|---------|---|--|---|---|
| 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 S | EUR | 14.014.449 | 5.499.932 | (5.711.428) | 13.802.953 |
| | Klasse W (Acc) | EUR | 60.883.193 | 17.816.240 | (17.781.729) | 60.917.704 |
| 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. ANTEILS KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile | Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile | Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile | Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile |
|--------------------------------------|---------------------------|---------|---|--|---|---|
| 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. ANTEILS KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile | Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile | Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile | Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile |
|--|----------------------------|---------|---|--|---|---|
| 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. ANTEILS KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

| Fonds | Anteilkategorie | Währung | Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile | Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile | Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile | Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile |
|--|--------------------------|---------|---|--|---|---|
| BNY Mellon Global Emerging Markets 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. ANTEILS KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile | Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile | Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile | Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile |
|---|---------------------------|---------|---|--|---|---|
| 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. ANTEILS KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile | Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile | Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile | Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile |
|---|---------------------------|---------|---|--|---|---|
| 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. ANTEILS KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile | Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile | Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile | Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile |
|---|---------------------------|---------|---|--|---|---|
| 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. ANTEILS KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile | Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile | Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile | Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile |
|---|---------------------------|---------|---|--|---|---|
| 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. ANTEILS KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile | Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile | Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile | Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile |
|---|-------------------------|---------|---|--|---|---|
| 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. ANTEILS KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

| Fonds | Anteilkategorie | Währung | Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile | Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile | Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile | Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile |
|--|--------------------------|---------|---|--|---|---|
| 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. ANTEILS KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

| Fonds | Anteilkategorie | Währung | Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile | Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile | Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile | Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile |
|---|----------------------------|---------|---|--|---|---|
| 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. ANTEILS KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

| Fonds | Anteilstklasse | Währung | Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile | Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile | Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile | Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile |
|--|---------------------------|---------|---|--|---|---|
| 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. ANTEILS KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

| Fonds | Anteilkategorie | Währung | Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile | Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile | Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile | Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile |
|---|---------------------------|---------|---|--|---|---|
| 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. ANTEILS KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile | Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile | Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile | Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile |
|---|----------------------------|---------|---|--|---|---|
| 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 |

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

^ Diese Anteilsklasse wurde im Geschäftsjahr aufgelegt oder geschlossen.

2. ANTEILS KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Die Aktivitäten bei einlösbaren, partizipierenden Anteilen für das Geschäftsjahr bis zum 31. Dezember 2020 waren wie folgt:

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | Anteile des Geschäftsjahres umlaufende Anteile | Anteile des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile | Anteile des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile | Anteile des Geschäftsjahres umlaufende Anteile |
|---|---------------------------|---------|--|--|--|--|
| BNY Mellon Absolute Return Bond Fund | | | | | | |
| | Klasse C | EUR | 3.649 | – | (550) | 3.099 |
| | Klasse C (Inc) | EUR | 2.085 | 1.985 | (2.000) | 2.070 |
| | Klasse D (Acc) | EUR | 50 | – | (50) | – |
| | Klasse R | EUR | 83.841 | 3.083 | (31.944) | 54.980 |
| | Klasse R (Hedged) | USD | 53.073 | 172 | (41.211) | 12.034 |
| | Klasse R (Inc) | EUR | 16.160 | 257 | (9.009) | 7.408 |
| | Klasse S | EUR | 471.511 | 12.888 | (412.564) | 71.835 |
| | Klasse S (Inc) | EUR | 53 | – | (53) | – |
| | Klasse T (Hedged) | CHF | 343 | – | – | 343 |
| | Klasse T (Hedged) | USD | 71.235 | 17.310 | (9.844) | 78.701 |
| | Sterling T (Acc) (Hedged) | GBP | 77.650 | 22.133 | (1.769) | 98.014 |
| | Klasse W (Acc) | EUR | 2.527 | – | (1.289) | 1.238 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | USD | 33.918 | 833 | (9.457) | 25.294 |
| | Klasse W (Inc) (Hedged) | USD | 1.036 | 6 | (1.042) | – |
| | Sterling W (Acc) (Hedged) | GBP | 933.165 | 107.320 | (79.255) | 961.230 |
| | Sterling W (Inc) (Hedged) | GBP | 1.951 | – | – | 1.951 |
| | Klasse X | EUR | 1.708.506 | 7.027 | (280.701) | 1.434.832 |
| | Klasse X (Acc) (Hedged) | USD | 1.000 | – | (1.000) | – |
| | Sterling X (Acc) (Hedged) | GBP | 86.677 | 779.865 | – | 866.542 |
| BNY Mellon Absolute Return Equity Fund | | | | | | |
| | Klasse D (Acc) (Hedged) | EUR | 212.885 | – | – | 212.885 |
| | Klasse R (Hedged) | CHF | 50.805 | – | (33.779) | 17.026 |
| | Klasse R (Hedged) | EUR | 83.599.873 | 2.167.386 | (36.370.824) | 49.396.435 |
| | Klasse R (Hedged) | USD | 6.922.055 | 249.393 | (1.151.998) | 6.019.450 |
| | Klasse R (Inc) (Hedged) | EUR | 4.941.271 | 2.980 | (1.620.985) | 3.323.266 |
| | Sterling R (Acc) | GBP | 736.190 | 169.099 | (169.198) | 736.091 |
| | Sterling S (Acc) | GBP | 325.042 | 147.124 | (232.660) | 239.506 |
| | Klasse T (Hedged) | EUR | 61.142.372 | 10.924.250 | (40.814.635) | 31.251.987 |
| | Klasse T (Hedged) | USD | 7.632.464 | – | (7.043.602) | 588.862 |
| | Klasse U (Hedged) | EUR | 87.518.455 | 2.255.502 | (24.532.504) | 65.241.453 |
| | Klasse U (Hedged) | USD | 3.149.480 | 167.889 | (1.098.215) | 2.219.154 |
| | Klasse U (Inc) (Hedged) | EUR | 105.616 | – | (105.597) | 19 |
| | Sterling U (Acc) | GBP | 6.185.440 | 310.379 | (2.958.439) | 3.537.380 |
| | Sterling X (Acc) | GBP | 108.311.163 | 2.663.002 | (41.799.752) | 69.174.413 |
| BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund | | | | | | |
| | Klasse F (Acc) | EUR | – | 503.305 | – | 503.305 |
| | Klasse F (Acc) (Hedged) | USD | 3.272.563 | 354.407 | (1.018.881) | 2.608.089 |
| | Sterling F (Acc) (Hedged) | GBP | 100.000 | 1.957.015 | – | 2.057.015 |
| | Klasse U (Acc) | EUR | 19.881.737 | – | (86.600) | 19.795.137 |
| | Klasse U (Acc) (Hedged) | USD | – | 844.568 | (98.796) | 745.772 |
| | Sterling U (Acc) (Hedged) | GBP | 100.000 | – | (100.000) | – |
| | Klasse X (Acc) | EUR | 4.936.321 | – | – | 4.936.321 |

2. ANTEILS KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

| Fonds | Anteilstklasse | Währung | Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile | Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile | Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile | Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile |
|--|-------------------------|---------|---|--|---|---|
| BNY Mellon Asia Rising Stars Fund** | | | | | | |
| | Klasse A (Acc) | USD | 30.994 | – | (30.994) | – |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | SGD | 1.620.654 | 11.172 | (1.631.826) | – |
| | Klasse W (Acc) | USD | 5.000.000 | – | (5.000.000) | – |
| | Klasse X (Acc) | USD | 239.058 | 12.942 | (252.000) | – |
| BNY Mellon Asian Equity Fund | | | | | | |
| | Klasse A | USD | 4.679.916 | 3.023.877 | (3.661.295) | 4.042.498 |
| | Klasse A | EUR | 2.457.055 | 2.302.687 | (1.001.313) | 3.758.429 |
| | Klasse B | USD | 2.629.078 | 81.170 | (188.852) | 2.521.396 |
| | Klasse B | EUR | 22.291 | 29.176 | – | 51.467 |
| | Klasse C | USD | 249.935 | 591.225 | (135.223) | 705.937 |
| | Klasse C | EUR | 315.694 | 246.181 | (167.468) | 394.407 |
| | Sterling C (Inc) | GBP | 8.315 | – | – | 8.315 |
| | Klasse W | USD | 504.566 | 156.183 | – | 660.749 |
| BNY Mellon Asian Income Fund | | | | | | |
| | Klasse A (Acc) | EUR | 43.352 | – | (27.375) | 15.977 |
| | Klasse A (Inc) | EUR | 40.398 | 14.560 | – | 54.958 |
| | Klasse B (Acc) | USD | 107.267 | 424.440 | (424.440) | 107.267 |
| | Klasse C (Acc) | USD | 4.589 | – | – | 4.589 |
| | Klasse W (Inc) | EUR | 20.879.700 | 3.617.964 | (2.850.653) | 21.647.011 |
| | Klasse W (Inc) | USD | 729.476 | 2.953.341 | (136.817) | 3.546.000 |
| | Sterling W (Inc) | GBP | 197.066 | 37.887 | (17.500) | 217.453 |
| BNY Mellon Blockchain Innovation Fund | | | | | | |
| | Klasse A (Acc) | USD | 5.000 | 48.920 | – | 53.920 |
| | Klasse E (Acc) | USD | 196.450 | – | – | 196.450 |
| | Klasse E (Acc) | EUR | 616.338 | – | (300.638) | 315.700 |
| | Klasse E (Inc) | USD | 588.955 | – | (588.955) | – |
| | Klasse G (Acc) | USD | – | 5.000 | – | 5.000 |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | EUR | 431.066 | 159.745 | (109.600) | 481.211 |
| | Klasse K (Acc) | USD | 1.200.119 | 338.105 | (138.520) | 1.399.704 |
| | Klasse K (Acc) | EUR | 1.664.235 | 682.621 | (362.952) | 1.983.904 |
| | Klasse W (Acc) | USD | 4.978.700 | – | – | 4.978.700 |

2. ANTEILS KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

| Fonds | Anteilkategorie | Währung | Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile | Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile | Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile | Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile |
|---|-------------------------|---------|---|--|---|---|
| BNY Mellon Brazil Equity Fund | | | | | | |
| | Klasse A | USD | 14.615.128 | 2.034.000 | (5.437.865) | 11.211.263 |
| | Klasse A | EUR | 17.472.768 | 8.892.867 | (11.685.398) | 14.680.237 |
| | Klasse B | USD | 1.503.886 | 1.332.690 | (218.080) | 2.618.496 |
| | Klasse B | EUR | 80.698 | 24.700 | – | 105.398 |
| | Sterling B (Acc) | GBP | 270.930 | 711 | (76.510) | 195.131 |
| | Klasse C | USD | 9.502.741 | 10.490.744 | (13.734.237) | 6.259.248 |
| | Klasse C | EUR | 6.598.761 | 653.237 | (1.332.242) | 5.919.756 |
| | Sterling C (Inc) | GBP | 50.261 | 22.254 | (41.175) | 31.340 |
| | Klasse G (Acc) | USD | 4.566 | 780.000 | (784.566) | – |
| | Klasse G (Acc) | EUR | 17.311 | 1.656.989 | (21.144) | 1.653.156 |
| | Klasse G (Acc) (Hedged) | EUR | 187.036 | 85.099 | (272.135) | – |
| | Klasse H (Hedged) | EUR | 2.735.579 | 1.227.532 | (2.603.880) | 1.359.231 |
| | Klasse I (Acc) (Hedged) | EUR | 4.166.415 | 1.011.151 | (171.138) | 5.006.428 |
| | Klasse W (Acc) | USD | 4.219.930 | 633.575 | (3.860.118) | 993.387 |
| | Klasse W (Acc) | EUR | 2.214.629 | 1.717.690 | (3.371.239) | 561.080 |
| | Sterling W (Acc) | GBP | 2.914.804 | 3.542.428 | (3.121.553) | 3.335.679 |
| BNY Mellon Dynamic Total Return Fund | | | | | | |
| | Klasse A (Acc) | USD | 11.806 | – | – | 11.806 |
| | Klasse C (Acc) | USD | 11.922.329 | 521.125 | (12.132.705) | 310.749 |
| | Klasse E (Acc) | USD | 12.546.652 | 2.911.575 | (938.614) | 14.519.613 |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | EUR | 114.342 | 40.222 | (5.946) | 148.618 |
| | Klasse W (Acc) | USD | 5.000 | – | – | 5.000 |
| | Klasse X (Acc) | USD | 50.205 | – | – | 50.205 |
| BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund | | | | | | |
| | Klasse A (Acc) | EUR | 5.000 | 16.967.969 | (16.972.913) | 56 |
| | Klasse A (Inc) | USD | 5.127 | 75.291 | (142) | 80.276 |
| | Klasse C (Acc) | USD | 49.811.680 | 36.728.961 | (6.793.176) | 79.747.465 |
| | Klasse E (Acc) | USD | 10.306.250 | 4.819.400 | (15.125.650) | – |
| | Klasse G (Acc) | USD | 5.000 | 1.245.056 | (226.066) | 1.023.990 |
| | Klasse G (Acc) | EUR | 5.000 | 2.074.436 | (1.949.177) | 130.259 |
| | Klasse G (Acc) (Hedged) | EUR | – | 15.545.373 | (1.060.892) | 14.484.481 |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | EUR | 100.000 | 3.439.804 | (42.437) | 3.497.367 |
| | Klasse W (Acc) | USD | 276.778 | 45.940.519 | (5.466.217) | 40.751.080 |
| | Klasse W (Acc) | EUR | 5.000 | 54.533.344 | (904.686) | 53.633.658 |
| | Klasse W (Inc) | EUR | – | 84.414.559 | (12.472.262) | 71.942.297 |
| | Klasse X (Acc) | USD | 76.219.552 | 13.953.489 | (72.602) | 90.100.439 |

2. ANTEILS KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile | Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile | Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile | Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile |
|--|---------------------------|---------|---|--|---|---|
| BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund* | | | | | | |
| | Klasse A (Acc) | USD | – | 5.000 | – | 5.000 |
| | Klasse A (Inc) | USD | – | 5.017 | (8) | 5.009 |
| | Klasse C (Acc) | USD | – | 5.000 | – | 5.000 |
| | Klasse C (Inc) | USD | – | 5.017 | (8) | 5.009 |
| | Klasse E (Acc) | USD | – | 5.000 | – | 5.000 |
| | Klasse E (Acc) (Hedged) | EUR | – | 100.000 | – | 100.000 |
| | Sterling E (Acc) (Hedged) | GBP | – | 100.000 | – | 100.000 |
| | Klasse E (Inc) | USD | – | 5.017 | (8) | 5.009 |
| | Klasse E (Inc) (Hedged) | EUR | – | 100.341 | (170) | 100.171 |
| | Sterling E (Inc) (Hedged) | GBP | – | 100.340 | (170) | 100.170 |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | EUR | – | 100.000 | – | 100.000 |
| | Klasse H (Inc) (Hedged) | EUR | – | 100.342 | (171) | 100.171 |
| | Klasse W (Acc) | USD | – | 23.355.282 | – | 23.355.282 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | DKK | – | 100.000 | – | 100.000 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | EUR | – | 100.000 | – | 100.000 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | NOK | – | 100.000 | – | 100.000 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | SEK | – | 100.000 | – | 100.000 |
| | Sterling W (Acc) (Hedged) | GBP | – | 100.000 | – | 100.000 |
| | Klasse W (Inc) | USD | – | 5.017 | (8) | 5.009 |
| | Klasse W (Inc) (Hedged) | EUR | – | 100.342 | (171) | 100.171 |
| | Sterling W (Inc) (Hedged) | GBP | – | 100.340 | (170) | 100.170 |
| | Klasse X (Acc) | USD | – | 5.000 | – | 5.000 |
| BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund* | | | | | | |
| | Klasse A (Acc) | USD | – | 5.000 | – | 5.000 |
| | Sterling L (Acc) (Hedged) | GBP | – | 49.611.221 | (19.127.466) | 30.483.755 |
| | Klasse W (Acc) | USD | – | 5.000 | – | 5.000 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | EUR | – | 100.000 | – | 100.000 |
| | Sterling W (Acc) (Hedged) | GBP | – | 100.000 | – | 100.000 |
| | Klasse X (Acc) | USD | – | 5.000 | – | 5.000 |
| BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund* | | | | | | |
| | Klasse A (Acc) | USD | – | 72.000 | – | 72.000 |
| | Klasse C (Acc) | USD | – | 339.875 | – | 339.875 |
| | Klasse W (Acc) | USD | – | 48.046.390 | – | 48.046.390 |
| | Klasse W (Inc) (Hedged) | EUR | – | 8.642.877 | (94) | 8.642.783 |
| | Klasse X (Acc) | USD | – | 214.308.117 | – | 214.308.117 |
| | Sterling X (Acc) (Hedged) | GBP | – | 209.012.698 | (214.775) | 208.797.923 |
| | Klasse X (Inc) | USD | – | 549.342.227 | (139.272) | 549.202.955 |
| | Sterling X (Inc) (Hedged) | GBP | – | 100.088 | (44) | 100.044 |

2. ANTEILS KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile | Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile | Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile | Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile |
|--|---------------------------|---------|---|--|---|---|
| BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund | | | | | | |
| | Klasse A (Inc) | USD | 34.017 | 90.000 | (90.000) | 34.017 |
| | Klasse A (Inc) | EUR | 13.788 | 805.766 | (209.977) | 609.577 |
| | Klasse C (Acc) | USD | 5.000 | 188.437 | (5.000) | 188.437 |
| | Klasse C (Inc) | USD | – | 5.278 | (139) | 5.139 |
| | Klasse E (Acc) (Hedged) | EUR | 41.805.204 | 19.641.925 | (22.869.495) | 38.577.634 |
| | Sterling E (Acc) (Hedged) | GBP | 383.049.420 | 66.480.608 | (191.630.035) | 257.899.993 |
| | Sterling E (Inc) (Hedged) | GBP | 22.617.767 | 2.275.772 | (24.791.415) | 102.124 |
| | Klasse G (Acc) (Hedged) | EUR | – | 100.000 | – | 100.000 |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | EUR | 1.932.893 | 17.079.474 | (18.999.336) | 13.031 |
| | Klasse K (Acc) | USD | 47.587 | 265.846 | – | 313.433 |
| | Klasse K (Acc) (Hedged) | EUR | 100.000 | – | – | 100.000 |
| | Klasse L (Acc) | USD | 5.000 | 72.604.896 | (6.966.079) | 65.643.817 |
| | Klasse L (Acc) (Hedged) | EUR | 100.000 | 62.043.995 | (4.249.956) | 57.894.039 |
| | Sterling L (Acc) (Hedged) | GBP | 100.000 | – | – | 100.000 |
| | Sterling L (Inc) (Hedged) | GBP | 38.762.752 | 3.947.138 | (25.612.683) | 17.097.207 |
| | Klasse W (Acc) | USD | 13.893.024 | 62.983.675 | (13.777.446) | 63.099.253 |
| | Sterling W (Acc) (Hedged) | GBP | 101.072 | – | (1.072) | 100.000 |
| | Klasse W (Inc) | USD | – | 5.174 | (87) | 5.087 |
| | Klasse W (Inc) (Hedged) | EUR | 113.300 | 26.032.151 | (124.443) | 26.021.008 |
| | Sterling W (Inc) (hedged) | GBP | – | 103.480 | (1.740) | 101.740 |
| | Klasse X (Acc) | USD | 10.052.088 | – | (4.964.750) | 5.087.338 |
| | Sterling X (Acc) (Hedged) | GBP | – | 31.691.659 | (10.071.416) | 21.620.243 |
| | Klasse X (Inc) | USD | – | 417.228.767 | (417.223.640) | 5.127 |
| BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund | | | | | | |
| | Klasse A | USD | 22.690 | 18.802 | (12.329) | 29.163 |
| | Klasse A | EUR | 74.406 | 62.735 | (47.042) | 90.099 |
| | Klasse A (Inc) | USD | – | 51 | – | 51 |
| | Klasse A (Inc) (M) | HKD | – | 346 | (19) | 327 |
| | Klasse B | USD | 5.310 | 298 | (3.436) | 2.172 |
| | Klasse C | USD | 452.623 | 64.435 | (422.940) | 94.118 |
| | Klasse C | EUR | 64.171 | 60.784 | (66.107) | 58.848 |
| | Klasse G (Inc) | USD | 17.748 | 4.168 | (4.206) | 17.710 |
| | Klasse H (Hedged) | EUR | 118.970 | 246.406 | (240.515) | 124.861 |
| | Klasse I (Hedged) | EUR | 111.075 | 158.138 | (138.632) | 130.581 |
| | Klasse W | USD | 274.155 | 182.128 | (200.652) | 255.631 |
| | Klasse W | EUR | 27.862 | 26.738 | (47.594) | 7.006 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | CHF | 109.822 | 46.433 | (21.086) | 135.169 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | EUR | 35.047 | 261.247 | (52.889) | 243.405 |
| | Klasse W (Inc) (Hedged) | CHF | 66.660 | – | (8.500) | 58.160 |
| | Klasse W (Inc) (Hedged) | EUR | 102.100 | 110.550 | – | 212.650 |
| | Sterling W (Acc) (Hedged) | GBP | 28.576 | 22.819 | (23.465) | 27.930 |
| | Sterling W (Inc) (Hedged) | GBP | 1.000 | 22 | (1.022) | – |
| | Klasse X | USD | 583.150 | 157.602 | (66.777) | 673.975 |
| | Sterling X (Acc) (Hedged) | GBP | 173.939 | – | – | 173.939 |

2. ANTEILS KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile | Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile | Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile | Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile |
|---|---------------------------|---------|---|--|---|---|
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund | | | | | | |
| | Klasse A | USD | 1.077.184 | 71.933 | (616.972) | 532.145 |
| | Klasse A | EUR | 5.067.485 | 1.129.718 | (1.916.860) | 4.280.343 |
| | Klasse C | USD | 7.249.256 | 4.272.502 | (6.428.325) | 5.093.433 |
| | Klasse C | EUR | 3.514.568 | 68.401 | (580.948) | 3.002.021 |
| | Klasse C (Inc) | USD | 469.373 | 329.755 | (1.078) | 798.050 |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | EUR | 2.902.391 | 532.918 | (2.096.025) | 1.339.284 |
| | Klasse W | USD | 5.000 | – | – | 5.000 |
| | Klasse X (Inc) | USD | 5.603.913 | 179.967 | (3.153.561) | 2.630.319 |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund | | | | | | |
| | Klasse A | USD | 11.802.086 | 649.156 | (4.359.139) | 8.092.103 |
| | Klasse A | EUR | 24.984.973 | 1.922.374 | (13.260.825) | 13.646.522 |
| | Klasse A (Inc) | USD | 152.704 | 39 | (100.020) | 52.723 |
| | Klasse A (Inc) | EUR | 1.833.714 | 239.868 | (184.724) | 1.888.858 |
| | Sterling A (Acc) | GBP | 154.941 | 73.142 | (224) | 227.859 |
| | Sterling B (Acc) | GBP | 2.045 | – | – | 2.045 |
| | Klasse C | USD | 17.422.386 | 2.403.720 | (18.356.968) | 1.469.138 |
| | Klasse C | EUR | 963.211 | 3.441 | (345.614) | 621.038 |
| | Klasse C (Inc) | USD | 151.500 | 177.141 | (518) | 328.123 |
| | Klasse C (Inc) | EUR | 53.809.499 | 5.000 | (38.326.838) | 15.487.661 |
| | Sterling C (Acc) | GBP | 1.615 | – | – | 1.615 |
| | Sterling C (Inc) | GBP | 237.890 | 8 | (84.549) | 153.349 |
| | Klasse H (Hedged) | EUR | 38.295.447 | 988.854 | (27.623.778) | 11.660.523 |
| | Klasse I (Hedged) | EUR | 2.061.752 | 1.103.872 | (632.520) | 2.533.104 |
| | Sterling J (Inc) (Hedged) | GBP | 11.000 | – | – | 11.000 |
| | Klasse W | USD | 94.092.016 | 454.871 | (8.005.087) | 86.541.800 |
| | Klasse W | EUR | 12.896.313 | 1.765.679 | (9.957.933) | 4.704.059 |
| | Klasse W (Hedged) | EUR | 43.764.703 | 7.344.548 | (42.126.645) | 8.982.606 |
| | Klasse W (Inc) | EUR | 767.287 | – | – | 767.287 |
| | Klasse W (Inc) (Hedged) | EUR | 87.265.050 | – | (86.777.100) | 487.950 |
| | Sterling W (Inc) | GBP | 30.533.663 | 2.397.436 | (25.628.965) | 7.302.134 |
| | Sterling W (Inc) (Hedged) | GBP | 58.536 | 524 | (21.979) | 37.081 |
| | Klasse X | USD | 24.543.479 | – | (24.543.479) | – |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund | | | | | | |
| | Klasse A | EUR | 423.504 | – | (400.000) | 23.504 |
| | Klasse C | USD | 256.500 | – | – | 256.500 |
| | Klasse W (Acc) | USD | 5.000 | – | – | 5.000 |
| | Klasse X (Inc) | USD | 27.764.843 | 5.392.326 | (6.002.120) | 27.155.049 |

2. ANTEILS KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile | Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile | Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile | Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile |
|---|---------------------------|---------|---|--|---|---|
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund | | | | | | |
| | Klasse A (Acc) | USD | 5.000 | – | – | 5.000 |
| | Klasse E (Inc) | USD | 5.438 | 178 | (5.616) | – |
| | Sterling E (Inc) (Hedged) | GBP | 61.093.837 | 63.211.885 | (57.876.681) | 66.429.041 |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | EUR | 100.000 | – | – | 100.000 |
| | Klasse W (Acc) | USD | 64.610.852 | – | – | 64.610.852 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | EUR | 13.618 | – | (6.269) | 7.349 |
| | Sterling W (Acc) (Hedged) | GBP | 304.625 | 102.677 | (196.291) | 211.011 |
| | Klasse X (Acc) | USD | 5.000 | – | – | 5.000 |
| BNY Mellon Euroland Bond Fund | | | | | | |
| | Klasse A | EUR | 231.900.850 | 39.237.742 | (155.646.683) | 115.491.909 |
| | Klasse A (Inc) | EUR | 8.863.753 | 648.213 | (1.423.503) | 8.088.463 |
| | Klasse B | EUR | 47.258 | 28.500 | (12.808) | 62.950 |
| | Klasse B (Inc) | EUR | 51.547 | – | (34.907) | 16.640 |
| | Klasse C | EUR | 55.328.003 | 7.409.550 | (20.064.914) | 42.672.639 |
| | Klasse C (Inc) | EUR | 92.244.036 | 134.923 | (89.756.405) | 2.622.554 |
| | Klasse G (Acc) | EUR | 512.630 | 1.144.479 | (78.411) | 1.578.698 |
| | Klasse H (Hedged) | CHF | 5.091.303 | 17.800 | (2.082.563) | 3.026.540 |
| | Klasse I (Hedged) | CHF | 1.317.815 | 90.000 | (199.300) | 1.208.515 |
| | Klasse S | EUR | 32.892.612 | 2.567.862 | (21.446.025) | 14.014.449 |
| | Klasse W (Acc) | EUR | 123.506.634 | 20.322.464 | (82.945.905) | 60.883.193 |
| BNY Mellon European Credit Fund | | | | | | |
| | Klasse A | EUR | 12.672 | 1.111 | (5.368) | 8.415 |
| | Klasse C | EUR | 49.536 | 7.669 | (16.824) | 40.381 |
| | Klasse W (Acc) | EUR | 8.347 | – | (7.500) | 847 |
| | Klasse X | EUR | 553.309 | 41.881 | (347.964) | 247.226 |
| BNY Mellon Global Bond Fund | | | | | | |
| | Klasse A | USD | 28.076.999 | 18.969.813 | (4.801.358) | 42.245.454 |
| | Klasse A | EUR | 19.557.312 | 8.700.153 | (6.642.161) | 21.615.304 |
| | Klasse B | USD | 809.520 | 18.539 | (77.321) | 750.738 |
| | Klasse C | USD | 101.399.907 | 9.972.458 | (48.961.289) | 62.411.076 |
| | Klasse C | EUR | 69.614.867 | 40.357.293 | (28.880.984) | 81.091.176 |
| | Klasse C (Inc) | USD | 717.856 | 42.750 | (206.673) | 553.933 |
| | Sterling C (Inc) | GBP | 3.115.325 | 788.683 | (668.596) | 3.235.412 |
| | Klasse H (Hedged) | EUR | 1.606.915 | 2.374.427 | (1.972.203) | 2.009.139 |
| | Klasse I (Hedged) | EUR | 569.671 | 7.334.105 | (2.666.767) | 5.237.009 |
| | Klasse W (Acc) | USD | 25.980.034 | 1.536.688 | (8.778.635) | 18.738.087 |
| | Klasse W (Acc) | EUR | 4.546 | – | – | 4.546 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | EUR | 99.147 | – | (99.147) | – |
| | Sterling W (Acc) (Hedged) | GBP | – | 100.000 | (100.000) | – |
| | Sterling W (Inc) (Hedged) | GBP | – | 100.000 | (100.000) | – |
| | Klasse X | USD | 9.562.811 | – | – | 9.562.811 |
| | Sterling Z (Acc) (Hedged) | GBP | – | 1.733.767 | (324.390) | 1.409.377 |
| | Sterling Z (Inc) (Hedged) | GBP | – | 4.327.922 | (108.058) | 4.219.864 |

2. ANTEILS KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

| Fonds | Anteilkategorie | Währung | Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile | Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile | Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile | Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile |
|--|---------------------------|---------|---|--|---|---|
| BNY Mellon Global Credit Fund | | | | | | |
| | Klasse A (Acc) | USD | – | 5.000 | – | 5.000 |
| | Klasse A (Inc) (Q) | USD | – | 5.024 | (12) | 5.012 |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | EUR | 7.905.494 | 4.577.641 | (2.194.033) | 10.289.102 |
| | Klasse W (Acc) | USD | 526.950 | 7.804.598 | (1.477.483) | 6.854.065 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | EUR | – | 100.000 | – | 100.000 |
| | Sterling W (Acc) (Hedged) | GBP | 100.933 | 468.853 | (176.310) | 393.476 |
| | Klasse X (Acc) | USD | 5.000 | 198.781.267 | – | 198.786.267 |
| | Klasse X (Acc) (Hedged) | CAD | 479.804.141 | – | (16.331.863) | 463.472.278 |
| BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund | | | | | | |
| | Klasse A | USD | 4.574.656 | 730.304 | (1.915.118) | 3.389.842 |
| | Klasse A | EUR | 1.847.701 | 710.028 | (923.079) | 1.634.650 |
| | Klasse A (Inc) | USD | 184.772 | 600 | (7.269) | 178.103 |
| | Klasse C | USD | 100.134.674 | 47.146.378 | (37.072.325) | 110.208.727 |
| | Klasse G (Acc) | EUR | 71.517 | – | (4.397) | 67.120 |
| | Klasse H (Hedged) | EUR | 3.923.592 | 2.487.210 | (1.136.540) | 5.274.262 |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | NOK | 88.000 | – | – | 88.000 |
| | Klasse H (Inc) (Hedged) | EUR | 895.823 | 149.551 | (405.961) | 639.413 |
| | Klasse I (Hedged) | EUR | 50.866.259 | 559.955 | (40.831.132) | 10.595.082 |
| | Klasse I (Inc) (Hedged) | EUR | 5.417.820 | 156.636 | (4.233.975) | 1.340.481 |
| | Klasse W | USD | 140.198.900 | 33.741.044 | (45.508.442) | 128.431.502 |
| | Klasse W (Hedged) | EUR | 66.520.694 | 23.168.964 | (15.170.540) | 74.519.118 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | CHF | 2.069.915 | 311.967 | (2.242.100) | 139.782 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | NOK | 88.000 | – | – | 88.000 |
| | Klasse W (Inc) (Hedged) | EUR | 8.279.992 | 1.412.181 | (13.159) | 9.679.014 |
| | Sterling W (Acc) (Hedged) | GBP | 10.629.004 | 3.191.292 | (5.254.943) | 8.565.353 |
| | Sterling W (Inc) (Hedged) | GBP | – | 101.759 | (879) | 100.880 |
| | Klasse X (Acc) (Hedged) | JPY | 9.978.715 | 9.738.487 | (28.174) | 19.689.028 |
| | Klasse X (Inc) (Hedged) | JPY | – | 10.042.286 | (4.279) | 10.038.007 |
| | Klasse Z (Acc) | USD | – | 5.000 | – | 5.000 |
| | Klasse Z (Inc) | USD | – | 5.000 | – | 5.000 |
| | Sterling Z (Acc) | GBP | 2.923.683 | 788.909 | (501.723) | 3.210.869 |
| | Sterling Z (Inc) | GBP | 49.000 | 15.572 | (5.022) | 59.550 |
| | Sterling Z (Acc) (Hedged) | GBP | – | 100.000 | – | 100.000 |
| | Sterling Z (Inc) (Hedged) | GBP | – | 101.718 | (859) | 100.859 |

2. ANTEILS KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile | Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile | Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile | Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile |
|--|-------------------------|---------|---|--|---|---|
| BNY Mellon Global Emerging Markets Fund | | | | | | |
| | Klasse A | USD | 285.175 | 2.991.402 | (3.002.689) | 273.888 |
| | Klasse A | EUR | 172.282 | 1.135.757 | (263.884) | 1.044.155 |
| | Klasse A (Inc) | EUR | 108.732 | 57.213 | (78.528) | 87.417 |
| | Klasse B (Acc) | USD | – | 5.000 | – | 5.000 |
| | Klasse B (Acc) | EUR | – | 5.000 | – | 5.000 |
| | Klasse B (Inc) | USD | 36.014 | 5.170 | (36.014) | 5.170 |
| | Klasse B (Inc) | EUR | 33.600 | 80.092 | (19.350) | 94.342 |
| | Klasse C | USD | 145.200 | – | (10.200) | 135.000 |
| | Klasse C (Acc) | USD | 19.042.116 | 6.017.143 | (5.664.710) | 19.394.549 |
| | Klasse C (Acc) | EUR | – | 5.000 | – | 5.000 |
| | Klasse C (Inc) | USD | 14.524 | 741.411 | (703.259) | 52.676 |
| | Sterling C (Inc) | GBP | – | 5.000 | – | 5.000 |
| | Klasse E (Acc) | USD | 2.031.546 | 809.623 | (444.279) | 2.396.890 |
| | Klasse E (Acc) | CHF | 2.314.483 | 335.788 | (1.775.807) | 874.464 |
| | Klasse G (Acc) (Hedged) | EUR | 120.831 | – | (120.831) | – |
| | Klasse H (Hedged) | EUR | 82.490 | 193.694 | (95.756) | 180.428 |
| | Klasse I (Hedged) | EUR | 261.228 | 1.947.333 | (1.189.747) | 1.018.814 |
| | Klasse W (Acc) | USD | 491.436 | 112.032 | (413.363) | 190.105 |
| | Klasse W (Acc) | EUR | 200.000 | 1.043.335 | – | 1.243.335 |
| | Klasse W (Inc) | USD | 802.450 | 299.244 | (865.496) | 236.198 |
| | Klasse W (Inc) | EUR | 58.242 | 7.969 | – | 66.211 |
| BNY Mellon Global Equity Fund | | | | | | |
| | Klasse A | USD | 10.631.456 | 28.201.838 | (26.663.505) | 12.169.789 |
| | Klasse A | EUR | 842.452 | 14.125.024 | (13.583.823) | 1.383.653 |
| | Klasse B | USD | 3.419.993 | – | (146.359) | 3.273.634 |
| | Klasse B | EUR | 16.994 | – | – | 16.994 |
| | Klasse C | USD | 11.002.868 | 3.743.388 | (6.608.619) | 8.137.637 |
| | Klasse C | EUR | 2.456 | – | (2.456) | – |
| | Klasse I (Hedged) | EUR | 1.617.511 | – | (1.373.906) | 243.605 |
| | Klasse W (Acc) | USD | 17.769.421 | 9.880.671 | (6.461.963) | 21.188.129 |
| | Klasse W (Acc) | EUR | 174.639.288 | 28.300.445 | (25.933.415) | 177.006.318 |

2. ANTEILS KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

| Fonds | Anteilkategorie | Währung | Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile | Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile | Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile | Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile |
|---|-------------------------|---------|---|--|---|---|
| BNY Mellon Global Equity Income Fund | | | | | | |
| | Klasse A | USD | 11.331.359 | 17.963.536 | (19.209.783) | 10.085.112 |
| | Klasse A | EUR | 32.322.901 | 19.706.259 | (29.481.139) | 22.548.021 |
| | Klasse A (Inc) | USD | 4.263.198 | 1.544.500 | (2.908.417) | 2.899.281 |
| | Klasse A (Inc) | EUR | 6.431.195 | 1.880.771 | (2.281.178) | 6.030.788 |
| | Sterling A (Acc) | GBP | 215.865 | 232.852 | (155.648) | 293.069 |
| | Klasse B | USD | 10.852.644 | 2.001.020 | (7.464.995) | 5.388.669 |
| | Klasse B | EUR | 2.148.358 | 594.150 | (1.423.912) | 1.318.596 |
| | Klasse B (Inc) | USD | 4.887.512 | 2.211.979 | (3.374.304) | 3.725.187 |
| | Klasse B (Inc) | EUR | 607.167 | 1.335.880 | (356.154) | 1.586.893 |
| | Sterling B (Inc) | GBP | 2.209.438 | 305.189 | (1.479.732) | 1.034.895 |
| | Klasse C | USD | 44.369.694 | 14.549.099 | (21.134.515) | 37.784.278 |
| | Klasse C | EUR | 7.219.977 | 1.765.016 | (3.415.782) | 5.569.211 |
| | Klasse C (Inc) | USD | 5.156.783 | 6.347.391 | (4.303.637) | 7.200.537 |
| | Klasse C (Inc) | EUR | 25.442.311 | 10.635.393 | (17.095.820) | 18.981.884 |
| | Sterling C (Inc) | GBP | 1.702.260 | 35.909 | (994.447) | 743.722 |
| | Klasse G (Acc) | EUR | 5.923.161 | 877.944 | (5.675.024) | 1.126.081 |
| | Klasse H (Hedged) | EUR | 12.848.456 | 3.604.477 | (11.359.116) | 5.093.817 |
| | Klasse H (Inc) (Hedged) | EUR | 8.403.991 | 727.133 | (2.242.446) | 6.888.678 |
| | Klasse I (Hedged) | EUR | 11.958.462 | 489.310 | (9.754.074) | 2.693.698 |
| | Klasse I (Inc) (Hedged) | EUR | 1.726.498 | 1.248.553 | (2.975.051) | - |
| | Klasse W | USD | 63.581.327 | 18.071.442 | (75.572.460) | 6.080.309 |
| | Klasse W | EUR | 75.985.225 | 17.071.796 | (77.296.701) | 15.760.320 |
| | Klasse W (Acc) | CHF | 5.000 | - | (5.000) | - |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | EUR | 1.404.490 | 7.768.481 | (8.963.014) | 209.957 |
| | Klasse W (Inc) | USD | 23.459.085 | 5.014.107 | (12.530.535) | 15.942.657 |
| | Klasse W (Inc) | EUR | 492.560.083 | 37.375.058 | (378.075.458) | 151.859.683 |
| | Sterling W (Acc) | GBP | 4.143.453 | 1.487.634 | (3.612.181) | 2.018.906 |
| | Sterling W (Inc) | GBP | 28.164.167 | 6.226.540 | (8.770.191) | 25.620.516 |
| | Klasse Z (Acc) | USD | 14.720.039 | 2.552.080 | (15.160.555) | 2.111.564 |
| | Klasse Z (Acc) | EUR | 4.104.633 | 571.328 | (4.637.841) | 38.120 |
| | Klasse Z (Inc) | USD | 4.352.535 | 2.547.478 | (3.768.786) | 3.131.227 |
| | Klasse Z (Inc) | EUR | 1.712.067 | 123.482 | (1.358.699) | 476.850 |
| | Sterling Z (Acc) | GBP | 5.000 | - | - | 5.000 |
| | Sterling Z (Inc) | GBP | 4.253.594 | 557.361 | (1.675.837) | 3.135.118 |

2. ANTEILS KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile | Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile | Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile | Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile |
|---|---------------------------|---------|---|--|---|---|
| BNY Mellon Global High Yield Bond Fund | | | | | | |
| | Klasse A | EUR | 6.450.814 | 1.942.028 | (2.481.911) | 5.910.931 |
| | Klasse C | USD | 26.990.244 | 31.192.014 | (17.366.539) | 40.815.719 |
| | Klasse C | EUR | 735.094 | 15.552 | (738.451) | 12.195 |
| | Klasse C (Inc) | USD | 398.288 | – | – | 398.288 |
| | Klasse H (Hedged) | EUR | 802.962 | 659.570 | (293.872) | 1.168.660 |
| | Klasse I (Hedged) | EUR | 7.396.352 | 718.344 | (468.294) | 7.646.402 |
| | Klasse W (Acc) | USD | 403.386 | 14.027.242 | (294.222) | 14.136.406 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | EUR | 100.000 | – | (100.000) | – |
| | Sterling W (Acc) (Hedged) | GBP | 980.220 | 219.210 | (231.230) | 968.200 |
| | Klasse X (Inc) | USD | 26.105.970 | 1.103.420 | (5.913.136) | 21.296.254 |
| | Klasse X (Inc) (Hedged) | EUR | 20.735.587 | 617.965 | (1.816.011) | 19.537.541 |
| BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund | | | | | | |
| | Klasse A (Acc) | USD | 195.925 | – | – | 195.925 |
| | Klasse A (Inc) | USD | 1.327.381 | 1.500 | (611.888) | 716.993 |
| | Klasse A (Inc) | EUR | 5.381 | 1.525 | (1.361) | 5.545 |
| | Klasse B (Acc) | SGD | – | 8.061.974 | (176.437) | 7.885.537 |
| | Klasse B (Acc) | USD | 5.000 | 1.413.601 | (106.769) | 1.311.832 |
| | Klasse B (Inc) | USD | 5.239 | 6.617.883 | (131.964) | 6.491.158 |
| | Klasse B (Inc) | SGD | – | 4.513.887 | (84.243) | 4.429.644 |
| | Klasse E (Acc) | USD | 3.334.753 | – | (3.334.753) | – |
| | Klasse E (Inc) | USD | 24.894.194 | 865.252 | (24.882.995) | 876.451 |
| | Klasse E (Inc) | EUR | 1.645.390 | 2.428.517 | (1.364.447) | 2.709.460 |
| | Sterling E (Inc) (Hedged) | GBP | 37.440.985 | 92.748.269 | (50.371.704) | 79.817.550 |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | EUR | 134.591 | 198.954 | (9.846) | 323.699 |
| | Klasse H (Inc) (Hedged) | EUR | 330.792 | 740.756 | – | 1.071.548 |
| | Klasse J (Acc) (Hedged) | SGD | – | 714.582 | (44.809) | 669.773 |
| | Klasse J (Inc) (Hedged) | SGD | – | 2.328.081 | (392.678) | 1.935.403 |
| | Klasse W (Acc) | USD | 4.361.369 | 11.300.577 | (4.544.302) | 11.117.644 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | EUR | 158.000 | 22.000 | – | 180.000 |
| | Klasse W (Inc) | USD | 5.238 | 2.302.752 | (125.764) | 2.182.226 |
| | Klasse W (Inc) (Hedged) | EUR | 104.822 | 17.903.988 | (108.810) | 17.900.000 |

2. ANTEILS KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

| Fonds | Anteilstklasse | Währung | Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile | Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile | Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile | Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile |
|--|-------------------------|---------|---|--|---|---|
| BNY Mellon Global Leaders Fund | | | | | | |
| | Klasse A (Acc) | USD | 1.302.287 | 55.243 | (495.881) | 861.649 |
| | Klasse A (Acc) | EUR | 5.000 | – | – | 5.000 |
| | Klasse A (Inc) | EUR | 5.000 | – | – | 5.000 |
| | Klasse B (Acc) | USD | 5.000 | – | – | 5.000 |
| | Klasse C (Acc) | USD | 27.617.195 | 520.725 | (24.970.387) | 3.167.533 |
| | Klasse E (Acc) | USD | 359.181 | 10.321.035 | (17.073) | 10.663.143 |
| | Klasse E (Acc) | EUR | – | 991.680 | – | 991.680 |
| | Sterling E (Acc) | GBP | 14.933.384 | 1.628.119 | (13.635.467) | 2.926.036 |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | DKK | 67.000 | – | – | 67.000 |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | EUR | 88.020 | 3.725 | (11.584) | 80.161 |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | NOK | 88.000 | – | – | 88.000 |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | SEK | 97.000 | – | – | 97.000 |
| | Klasse W (Acc) | USD | 630.731 | 498.591 | (380.000) | 749.322 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | DKK | 67.000 | – | – | 67.000 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | NOK | 88.000 | – | – | 88.000 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | SEK | 97.000 | – | – | 97.000 |
| | Sterling W (Acc) | GBP | 5.264.676 | 847.582 | (5.118.485) | 993.773 |
| BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund | | | | | | |
| | Klasse A (Acc) | EUR | 5.000 | – | – | 5.000 |
| | Klasse A (Inc) | EUR | 1.931.237 | 871.502 | (358.852) | 2.443.887 |
| | Klasse A (Inc) | USD | – | 5.098 | (49) | 5.049 |
| | Klasse C (Acc) | EUR | 297.855 | 5.930 | (297.855) | 5.930 |
| | Klasse E (Inc) | EUR | 9.118.379 | 2.019.450 | (4.970.545) | 6.167.284 |
| | Klasse W (Acc) | EUR | 10.635.492 | – | – | 10.635.492 |
| | Klasse W (Inc) | EUR | 5.257 | 215 | (5.472) | – |
| BNY Mellon Global Opportunities Fund | | | | | | |
| | Klasse A | USD | 3.194.801 | 2.663.530 | (3.820.778) | 2.037.553 |
| | Klasse A | EUR | 9.461.771 | 2.542.866 | (4.548.395) | 7.456.242 |
| | Klasse B | USD | 788.184 | – | (22.656) | 765.528 |
| | Klasse C | USD | 318.452 | 11.064 | (71.285) | 258.231 |
| | Klasse C | EUR | 1.716.199 | 43.267 | (1.707.050) | 52.416 |
| | Klasse H (Hedged) | EUR | 305.681 | 78.452 | (141.688) | 242.445 |
| | Klasse I (Hedged) | EUR | 14.931 | – | – | 14.931 |
| | Klasse W (Acc) | USD | 693.988 | 220.410 | (910.798) | 3.600 |
| | Klasse W (Acc) | EUR | 4.816 | – | (4.816) | – |

2. ANTEILS KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile | Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile | Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile | Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile |
|---|---------------------------|---------|---|--|---|---|
| BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) | | | | | | |
| | Klasse A | EUR | 610.174.469 | 289.451.874 | (342.660.736) | 556.965.607 |
| | Klasse A (Inc) | EUR | 16.066.802 | 4.628.376 | (3.172.422) | 17.522.756 |
| | Klasse C | EUR | 173.479.728 | 102.804.573 | (138.397.587) | 137.886.714 |
| | Klasse C (Inc) | EUR | 9.822.944 | 2.610.699 | (8.005.348) | 4.428.295 |
| | Klasse G (Acc) | EUR | 6.956.341 | 5.124.003 | (2.315.459) | 9.764.885 |
| | Klasse G (Inc) | EUR | 3.882.942 | 927.271 | (518.519) | 4.291.694 |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | SGD | 4.047.620 | 909.258 | (435.284) | 4.521.594 |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | USD | 1.807.533 | 1.627.159 | (939.749) | 2.494.943 |
| | Sterling H (Acc) (Hedged) | GBP | 911.717 | 490.791 | (154.406) | 1.248.102 |
| | Klasse W | EUR | 830.859.336 | 323.295.069 | (617.619.909) | 536.534.496 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | CHF | 2.808.037 | 390.362 | (2.678.037) | 520.362 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | USD | 100.000 | 2.273.147 | (2.373.147) | - |
| | Klasse W (Inc) | EUR | 996.936 | 47.833 | (5.052) | 1.039.717 |
| | Klasse X | EUR | 773.846.007 | 54.369.704 | (172.671.468) | 655.544.243 |
| | Klasse Z (Acc) | EUR | 68.493.755 | 1.497.040 | - | 69.990.795 |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP) | | | | | | |
| | Sterling B (Acc) | GBP | 1.074.324 | 198.578 | (313.506) | 959.396 |
| | Sterling B (Inc) | GBP | 402.024 | - | - | 402.024 |
| | Sterling C (Inc) | GBP | 524.357 | 193 | (262.184) | 262.366 |
| | Sterling W (Acc) | GBP | 13.210.743 | 9.029.399 | (10.689.535) | 11.550.607 |
| | Sterling W (Inc) | GBP | 17.900.675 | 2.296.922 | (10.417.620) | 9.779.977 |
| | Sterling X (Acc) | GBP | 23.697.167 | 6.793.661 | (6.846.419) | 23.644.409 |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (USD) | | | | | | |
| | Klasse A | USD | 63.818.868 | 11.122.119 | (13.108.583) | 61.832.404 |
| | Klasse C | USD | 28.480.624 | 6.300.114 | (8.641.997) | 26.138.741 |
| | Klasse C (Inc) | USD | 679.894 | - | (670.901) | 8.993 |
| | Klasse G (Acc) | USD | 8.500 | - | (4.250) | 4.250 |
| | Klasse W | USD | 16.138.800 | 4.219.626 | (7.309.984) | 13.048.442 |
| | Klasse W (Inc) | USD | 19.660.559 | 2.960.541 | (13.161.536) | 9.459.564 |
| | Klasse X | USD | 74.532.954 | 2.653.942 | (15.321.134) | 61.865.762 |

2. ANTEILS KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile | Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile | Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile | Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile |
|---|---------------------------|---------|---|--|---|---|
| BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund | | | | | | |
| | Klasse A (Acc) | USD | 8.360.338 | 2.547.626 | (7.428.036) | 3.479.928 |
| | Klasse A (Inc) | USD | 788.187 | 60.399 | (743.718) | 104.868 |
| | Klasse C (Acc) | USD | 17.364.400 | 6.835.478 | (15.422.319) | 8.777.559 |
| | Klasse G (Acc) | USD | 40.858 | 193.143 | (63.451) | 170.550 |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | EUR | 95.677.185 | 17.650.297 | (52.167.967) | 61.159.515 |
| | Klasse H (Inc) (Hedged) | EUR | 2.547.350 | 306.164 | (777.980) | 2.075.534 |
| | Klasse I (Acc) (Hedged) | EUR | 15.645.968 | 5.066.418 | (8.337.308) | 12.375.078 |
| | Klasse I (Inc) (Hedged) | EUR | 2.110.936 | 600.000 | (2.000.000) | 710.936 |
| | Klasse W (Acc) | USD | 53.095.238 | 29.814.474 | (33.895.169) | 49.014.543 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | CHF | 21.474.800 | 4.342.650 | (25.695.550) | 121.900 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | EUR | 78.653.487 | 39.443.958 | (65.640.140) | 52.457.305 |
| | Klasse W (Inc) | USD | 30.450.000 | 73.325 | (450.000) | 30.073.325 |
| | Klasse W (Inc) (Hedged) | EUR | 3.158.511 | 108.444 | (2.003.955) | 1.263.000 |
| | Sterling W (Acc) (Hedged) | GBP | 6.643.996 | 42.615.560 | (18.428.424) | 30.831.132 |
| | Sterling W (Inc) (Hedged) | GBP | 2.898.078 | 321.969 | (609.762) | 2.610.285 |
| | Klasse X (Acc) | USD | 10.749.954 | 4.363 | (10.749.954) | 4.363 |
| | Sterling X (Acc) (Hedged) | GBP | 12.447.669 | 47.357.300 | (8.920.000) | 50.884.969 |
| | Klasse Y (Acc) | USD | 169.466.042 | – | (13.650.605) | 155.815.437 |
| | Sterling Y (Acc) (Hedged) | GBP | 21.084.481 | 700.525 | (14.396.420) | 7.388.586 |
| | Sterling Z (Acc) (Hedged) | GBP | 1.168.654 | 1.894.037 | (561.750) | 2.500.941 |
| | Sterling Z (Inc) (Hedged) | GBP | 49.447.095 | 43.499.802 | (12.057.094) | 80.889.803 |
| 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. ANTEILS KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile | Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile | Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile | Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile |
|---|-------------------------|---------|---|--|---|---|
| BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund | | | | | | |
| | Klasse A (Acc) | EUR | 25.001 | 644.449 | (532.623) | 136.827 |
| | Klasse C | JPY | 1.202.391 | 853.026 | (1.354.716) | 700.701 |
| | Klasse E (Acc) | EUR | 27.386 | – | (27.386) | – |
| | Klasse E (Acc) (Hedged) | CHF | 3.943.013 | 831.873 | (779.891) | 3.994.995 |
| | Klasse E (Acc) (Hedged) | USD | 25.597.224 | – | – | 25.597.224 |
| | Klasse G (Acc) | EUR | – | 5.000 | – | 5.000 |
| | Klasse G (Acc) (Hedged) | EUR | 998.978 | 211.139 | (126.730) | 1.083.387 |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | SGD | 1.111.376 | 308.871 | (930.513) | 489.734 |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | NOK | 88.000 | – | – | 88.000 |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | SEK | 97.000 | – | – | 97.000 |
| | Klasse H (Hedged) | EUR | 2.358.545 | 277.055 | (1.320.209) | 1.315.391 |
| | Klasse H (Hedged) | USD | 260.357 | 56.931 | (63.976) | 253.312 |
| | Klasse I (Hedged) | EUR | 7.918.537 | 6.256.937 | (11.652.166) | 2.523.308 |
| | Klasse I (Hedged) | USD | 525.729 | – | (60.120) | 465.609 |
| | Klasse W | JPY | 18.583.198 | 1.589.816 | (1.283.677) | 18.889.337 |
| | Klasse W (Acc) | EUR | 25.473.131 | – | (290.421) | 25.182.710 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | EUR | 697.680 | 44.000 | (111.377) | 630.303 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | NOK | 88.000 | – | – | 88.000 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | SEK | 97.000 | – | – | 97.000 |
| | Sterling W (Acc) | GBP | 3.726.016 | 852.557 | (3.524.094) | 1.054.479 |
| | Sterling W (Inc) | GBP | 1.489.425 | 4.154.363 | (327.410) | 5.316.378 |

2. ANTEILS KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

| Fonds | Anteilkategorie | Währung | Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile | Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile | Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile | Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile |
|--|-------------------------|---------|---|--|---|---|
| BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund | | | | | | |
| | Klasse A | EUR | 82.971.610 | 40.210.525 | (38.675.878) | 84.506.257 |
| | Klasse A | USD | 29.632.521 | 14.748.288 | (12.469.461) | 31.911.348 |
| | Klasse A (Inc) | EUR | 2.773.686 | 1.333.094 | (1.398.435) | 2.708.345 |
| | Sterling A (Acc) | GBP | 1.177.509 | 137.608 | (515.621) | 799.496 |
| | Klasse B | EUR | 1.454.363 | 889.036 | (1.008.088) | 1.335.311 |
| | Klasse B | USD | 7.197.878 | 19.418.061 | (15.521.641) | 11.094.298 |
| | Klasse B (Acc) | SGD | 11.640.390 | 15.881.783 | (19.194.248) | 8.327.925 |
| | Klasse B (Inc) | SGD | 5.000 | – | (5.000) | – |
| | Sterling B (Inc) | GBP | 337.375 | 255.641 | (307.077) | 285.939 |
| | Klasse C | EUR | 70.722.755 | 24.998.043 | (47.513.397) | 48.207.401 |
| | Klasse C | USD | 132.499.568 | 26.203.619 | (63.470.426) | 95.232.761 |
| | Klasse G (Acc) | EUR | 2.396.806 | 3.104.864 | (2.979.442) | 2.522.228 |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | USD | 100.000 | – | – | 100.000 |
| | Klasse I (Acc) (Hedged) | USD | – | 100.000 | – | 100.000 |
| | Klasse J (Acc) (Hedged) | SGD | 350.806 | 376.225 | (82.955) | 644.076 |
| | Klasse S | EUR | 60.385.404 | 7.974.684 | (27.249.461) | 41.110.627 |
| | Klasse S (Acc) 1 | USD | 31.667.725 | – | – | 31.667.725 |
| | Klasse W | EUR | 78.408.878 | 67.603.912 | (48.744.771) | 97.268.019 |
| | Klasse W | USD | 31.583.576 | 12.045.256 | (3.537.162) | 40.091.670 |
| | Klasse W (Hedged) | USD | 1.672.704 | 4.353.838 | (3.850.394) | 2.176.148 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | SGD | 100.000 | 176.929 | – | 276.929 |
| | Klasse W (Inc) | EUR | – | 115.014.198 | (4.733.254) | 110.280.944 |
| | Klasse W (Inc) | USD | 16.570.366 | 2.451.002 | (5.564.200) | 13.457.168 |
| | Sterling W (Acc) | GBP | 9.213.718 | 5.068.439 | (4.553.188) | 9.728.969 |
| | Sterling W (Inc) | GBP | 1.930.348 | 2.435.447 | (418.768) | 3.947.027 |
| | Klasse X (Acc) | USD | 96.371.579 | – | – | 96.371.579 |
| | Sterling X | GBP | 7.181.908 | – | (38.868) | 7.143.040 |

2. ANTEILS KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile | Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile | Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile | Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile |
|--|---------------------------|---------|---|--|---|---|
| BNY Mellon Mobility Innovation Fund | | | | | | |
| | Klasse A (Acc) | USD | 5.978.528 | 18.064.133 | (8.650.542) | 15.392.119 |
| | Klasse A (Acc) | EUR | 2.842.218 | 12.815.839 | (2.054.277) | 13.603.780 |
| | Klasse A (Inc) | USD | 218.952 | 490.682 | (145.514) | 564.120 |
| | Klasse A (Inc) | EUR | 1.591.852 | 2.662.353 | (1.001.061) | 3.253.144 |
| | Klasse B (Acc) | USD | 14.122.797 | 834.869 | (3.695.119) | 11.262.547 |
| | Klasse C (Acc) | USD | 5.000 | 100.000 | – | 105.000 |
| | Klasse C (Acc) | EUR | 5.000 | 8.955.292 | (465.584) | 8.494.708 |
| | Klasse C (Inc) | EUR | 1.510.100 | 405.000 | (832.100) | 1.083.000 |
| | Klasse E (Acc) | USD | 26.175.805 | 36.353.405 | (5.866.424) | 56.662.786 |
| | Klasse E (Acc) | CHF | 8.209.932 | 7.284.831 | (1.329.980) | 14.164.783 |
| | Klasse E (Acc) | EUR | 5.055.509 | 2.364.814 | (1.776.912) | 5.643.411 |
| | Klasse E (Acc) (Hedged) | CHF | 12.055.197 | 6.698.926 | (3.531.488) | 15.222.635 |
| | Klasse E (Acc) (Hedged) | EUR | 11.092.883 | 8.745.074 | (4.400.514) | 15.437.443 |
| | Klasse E (Acc) (Hedged) | SGD | 199.706 | 30.000 | (229.706) | – |
| | Sterling E (Acc) (Hedged) | GBP | 1.736.535 | 2.382.208 | (609.094) | 3.509.649 |
| | Klasse G (Acc) | USD | – | 5.000 | – | 5.000 |
| | Klasse G (Acc) | CHF | – | 379.270 | (15.000) | 364.270 |
| | Klasse G (Acc) | EUR | – | 13.130 | – | 13.130 |
| | Klasse G (Acc) (Hedged) | EUR | – | 100.000 | – | 100.000 |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | EUR | 2.876.157 | 16.100.129 | (7.095.862) | 11.880.424 |
| | Klasse H (Inc) (Hedged) | EUR | 116.167 | 165.563 | (24.076) | 257.654 |
| | Klasse J (Acc) (Hedged) | EUR | 615.969 | – | – | 615.969 |
| | Klasse K (Acc) | USD | 5.281.336 | 6.400.765 | (3.439.894) | 8.242.207 |
| | Klasse K (Acc) (Hedged) | CHF | 1.851.419 | 1.135.040 | (428.331) | 2.558.128 |
| | Klasse K (Acc) (Hedged) | EUR | 3.777.563 | 4.468.706 | (680.770) | 7.565.499 |
| | Klasse K (Inc) | USD | 363.156 | 648.451 | (27.900) | 983.707 |
| | Klasse K (Inc) (Hedged) | CHF | 156.161 | 58.338 | (44.461) | 170.038 |
| | Klasse K (Inc) (Hedged) | EUR | 139.571 | 345.890 | (94.750) | 390.711 |
| | Klasse K (Inc) (Hedged) | SGD | 127.171 | – | – | 127.171 |
| | Sterling K (Acc) (Hedged) | GBP | 197.511 | 526.159 | (34.453) | 689.217 |
| | Klasse W (Acc) | USD | 21.314.192 | 38.165.482 | (14.403.681) | 45.075.993 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | CHF | – | 383.064 | – | 383.064 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | EUR | 10.663.383 | 28.473.156 | (6.431.078) | 32.705.461 |
| | Klasse W (Inc) | USD | 5.004 | 41.288 | (16) | 46.276 |
| | Klasse W (Inc) (Hedged) | EUR | 100.080 | 170.253 | (267.928) | 2.405 |
| BNY Mellon S&P 500® Index Tracker | | | | | | |
| | Klasse A | USD | 6.553.151 | 759.102 | (2.558.361) | 4.753.892 |
| | Klasse A | EUR | 1.615.040 | 1.128.580 | (1.007.543) | 1.736.077 |
| | Klasse C | USD | 6.291.236 | 341 | (2.737.877) | 3.553.700 |
| | Klasse C | EUR | 1.829.874 | 7.532 | (1.630.638) | 206.768 |
| | Klasse G (Acc) | EUR | 5.000 | – | (5.000) | – |

2. ANTEILS KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile | Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile | Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile | Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile |
|--|---------------------------|---------|---|--|---|---|
| BNY Mellon Small Cap Euroland Fund | | | | | | |
| | Klasse A | EUR | 3.896.276 | 284.771 | (1.621.443) | 2.559.604 |
| | Klasse A | USD | 119.230 | 5.939 | (5.939) | 119.230 |
| | Klasse B | EUR | 53.912 | – | – | 53.912 |
| | Klasse C | EUR | 7.068.545 | 404.099 | (3.641.979) | 3.830.665 |
| | Klasse C | USD | 19.787 | 8.702.409 | (19.787) | 8.702.409 |
| | Klasse W (Acc) | EUR | 6.040.065 | 3.617.051 | (3.055.168) | 6.601.948 |
| | Sterling W (Acc) | GBP | 17.713 | 2.842 | (17.713) | 2.842 |
| 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 | – | 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 | 5.000 | 7.000.331 | (5.000) | 7.000.331 |
| | Klasse A (Acc) | USD | – | 533.306 | – | 533.306 |
| | Klasse A (Inc) | EUR | 5.029 | 40 | (20) | 5.049 |
| | Klasse C (Acc) | EUR | 5.000 | 13.859 | (13.858) | 5.001 |
| | Klasse E (Acc) | EUR | 47.562.993 | 37.671.598 | (3.788) | 85.230.803 |
| | Klasse E (Acc) (Hedged) | CHF | 11.504.332 | 1.776.001 | (896.668) | 12.383.665 |
| | Klasse G (Acc) | EUR | 191.825 | 2.251.000 | (90.000) | 2.352.825 |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | CHF | – | 613.571 | (119.279) | 494.292 |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | NOK | 88.000 | – | – | 88.000 |
| | Klasse W (Acc) | EUR | 1.794.555 | 24.377.018 | (211.980) | 25.959.593 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | CHF | – | 31.543.233 | (825.855) | 30.717.378 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | NOK | 88.000 | – | – | 88.000 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | USD | – | 2.466.516 | (199.760) | 2.266.756 |
| | Sterling W (Acc) (Hedged) | GBP | – | 304.908 | (100.000) | 204.908 |
| | Klasse W (Inc) | EUR | – | 5.000 | – | 5.000 |
| | Sterling W (Inc) (Hedged) | GBP | 100.090 | 469.671 | (300.005) | 269.756 |
| | Klasse X (Acc) | EUR | 113.498.518 | 7.668.168 | (28.560.000) | 92.606.686 |
| | Klasse Z (Acc) (Hedged) | USD | – | 100.000 | – | 100.000 |
| | Klasse Z (Inc) (Hedged) | USD | – | 100.000 | – | 100.000 |

2. ANTEILS KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

| Fonds | Anteilkategorie | Währung | Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile | Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile | Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile | Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile |
|--|---------------------------|---------|---|--|---|---|
| BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)* | | | | | | |
| | Klasse A (Acc) | EUR | – | 183.775 | (5.000) | 178.775 |
| | Klasse A (Inc) | EUR | – | 5.000 | – | 5.000 |
| | Klasse E (Acc) | EUR | – | 19.657.748 | (6.703.413) | 12.954.335 |
| | Klasse E (Acc) (Hedged) | USD | – | 1.439.319 | (115.000) | 1.324.319 |
| | Klasse E (Inc) | EUR | – | 5.000 | – | 5.000 |
| | Klasse G (Acc) | EUR | – | 5.000 | – | 5.000 |
| | Klasse W (Acc) | EUR | – | 17.175.274 | – | 17.175.274 |
| | Sterling W (Acc) (Hedged) | GBP | – | 100.000 | – | 100.000 |
| | Klasse W (Inc) | EUR | – | 5.000 | – | 5.000 |
| | Sterling W (Inc) (Hedged) | GBP | – | 100.000 | – | 100.000 |
| BNY Mellon Targeted Return Bond Fund | | | | | | |
| | Klasse A (Acc) | USD | 5.000 | – | – | 5.000 |
| | Sterling W (Acc) (Hedged) | GBP | 65.852.584 | 263.313 | – | 66.115.897 |
| BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund | | | | | | |
| | Klasse A | USD | 706.599 | 18.506 | (176.764) | 548.341 |
| | Klasse A | EUR | 492.090 | 107.180 | (163.306) | 435.964 |
| | Klasse B | USD | 94.858 | – | – | 94.858 |
| | Klasse C | USD | 6.608.970 | 2.666.488 | (9.226.595) | 48.863 |
| | Klasse C | EUR | 583 | – | – | 583 |
| | Klasse W (Acc) | USD | 5.000 | – | (5.000) | – |
| BNY Mellon U.S. Equity Income Fund | | | | | | |
| | Klasse A (Acc) | EUR | 4.677 | – | – | 4.677 |
| | Klasse B (Inc) | USD | 5.030 | 252 | (126) | 5.156 |
| | Klasse C (Inc) | USD | 908.914 | – | – | 908.914 |
| | Klasse E (Acc) | EUR | 479.295 | 121.432 | (367.439) | 233.288 |
| | Klasse E (Inc) | USD | 5.069.996 | – | (1.057.739) | 4.012.257 |
| | Klasse E (Inc) | EUR | 337.310 | – | (244.220) | 93.090 |
| | Sterling E (Acc) | GBP | 62.820.458 | 5.737.189 | (42.445.129) | 26.112.518 |
| | Sterling E (Inc) | GBP | 138.802.914 | 12.888.379 | (75.718.578) | 75.972.715 |
| | Sterling E (Inc) (Hedged) | GBP | 2.437.935 | 389.360 | (1.632.595) | 1.194.700 |
| | Klasse W (Acc) | USD | 19.594.548 | 782.055 | (492.124) | 19.884.479 |
| | Klasse W (Acc) | EUR | 9.444.727 | 14.448.803 | (7.865.863) | 16.027.667 |
| | Klasse W (Inc) | USD | 6.319.049 | – | (744.049) | 5.575.000 |
| | Sterling W (Inc) | GBP | 31.207.152 | 329.635 | (17.376.780) | 14.160.007 |

2. ANTEILS KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE, PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | Zu Beginn des Geschäftsjahres umlaufende Anteile | Während des Geschäftsjahres ausgegebene Anteile | Während des Geschäftsjahres zurück- genommene Anteile | Am Ende des Geschäftsjahres umlaufende Anteile |
|---|-------------------------|---------|---|--|---|---|
| BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund | | | | | | |
| | Klasse A (Acc) | USD | – | 154.164 | – | 154.164 |
| | Klasse C (Acc) | USD | 117.766.628 | 55.240.166 | (42.935.306) | 130.071.488 |
| | Klasse E (Acc) | USD | 27.716.258 | 2.170.000 | (8.484.000) | 21.402.258 |
| | Klasse E (Acc) (Hedged) | CHF | 3.400.000 | 200.000 | (50.000) | 3.550.000 |
| | Klasse E (Acc) (Hedged) | EUR | 2.244.788 | 7.710.212 | (5.130.000) | 4.825.000 |
| | Klasse E (Inc) (Hedged) | EUR | 5.170.252 | 3.306.024 | (228.012) | 8.248.264 |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | EUR | 538.026 | 21.663.693 | (18.839.986) | 3.361.733 |
| | Klasse H (Inc) (Hedged) | EUR | 133.496 | 76.463 | (42.029) | 167.930 |
| | Klasse W (Acc) | USD | 16.903.757 | 27.119.568 | (3.714.874) | 40.308.451 |
| | Klasse W (Acc) | EUR | 30.005.000 | 7.620.463 | (37.620.372) | 5.091 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | CHF | 18.916.551 | 11.362.500 | (3.035.000) | 27.244.051 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | EUR | 9.019.000 | 25.716.820 | (1.710.975) | 33.024.845 |
| | Klasse W (Inc) | USD | 640.000 | 65.242.344 | (2.921.873) | 62.960.471 |
| | Klasse W (Inc) (Hedged) | CHF | 6.574.781 | – | – | 6.574.781 |
| | Klasse W (Inc) (Hedged) | EUR | 130.370.454 | 12.958.418 | – | 143.328.872 |
| | Klasse X (Acc) | USD | 15.000.000 | – | (7.023.088) | 7.976.912 |

* Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr aufgelegt.

** Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr geschlossen.

3. MANAGEMENT- UND PERFORMANCEGEBÜHREN

MANAGEMENTGEBÜHREN

Die Verwaltungsgesellschaft hat Anspruch auf den Erhalt einer jährlichen Managementgebühr für jede Anteilsklasse, die täglich aufläuft und monatlich nachträglich zahlbar ist und auf einem vereinbarten Jahressatz beruht, der im entsprechenden Nachtrag zum Prospekt festgelegt ist. Nachstehende Tabelle führt die Bandbreite der Sätze für die jährliche Managementgebühr für jede Anteilsklasse auf:

| Anteilsklasse | Satz | Anteilsklasse | Satz |
|---------------|-----------------|---------------|-----------------|
| Klasse A | 0,40 % - 2,00 % | Klasse L | 0,16 % |
| Klasse B | 0,75 % - 1,50 % | Klasse N | 0,90 % |
| Klasse C | 0,30 % - 1,00 % | Klasse P | 1,10 % |
| Klasse D | 0,50 % - 1,00 % | Klasse R | 0,60 % - 1,50 % |
| Klasse E | 0,08 % - 2,00 % | Klasse S | 0,40 % - 1,00 % |
| Klasse F | 0,10 % - 0,45 % | Klasse T | 0,40 % - 1,00 % |
| Klasse G | 0,30 % - 1,00 % | Klasse U | 0,20 % - 0,85 % |
| Klasse H | 0,40 % - 2,00 % | Klasse W | 0,20 % - 0,80 % |
| Klasse I | 0,30 % - 1,00 % | Klasse X | Keine |
| Klasse J | 1,25 % - 1,50 % | Klasse Y | Keine |
| Klasse K | 0,30 % - 1,40 % | Klasse Z | 0,25 % - 0,65 % |

Die zugunsten der Verwaltungsgesellschaft aufgelaufenen Managementgebühren und die zum Ende des Geschäftsjahres fälligen Beträge sind unter den Posten „Managementgebühr“ und „Zahlbare Aufwendungen“ in der Gesamtergebnisrechnung bzw. in der Bilanz ausgewiesen.

3. MANAGEMENT- UND PERFORMANCEGEBÜHREN Forts.

PERFORMANCEGEBÜHREN

Neben der jährlichen Managementgebühr hat die Verwaltungsgesellschaft bei bestimmten Anteilsklassen der folgenden Fonds Anspruch auf eine jährliche Performancegebühr (die „Performancegebühr“), wie in dem betreffenden Nachtrag zum Prospekt erläutert. Nachstehende Tabelle führt die Sätze für die Performancegebühr und die Referenzwerte der jeweiligen Anteilsklasse auf:

| Fonds | Referenzwert | Satz |
|---|---|---------------------------------------|
| BNY Mellon Absolute Return Bond Fund | 3-Monats-EURIBOR/USD LIBOR/GBP LIBOR/CHF LIBOR/JPY LIBOR | Klassen D, R, S und T – 10,00 % |
| BNY Mellon Absolute Return Equity Fund | 1-Monats-EURIBOR/USD LIBOR/GBP LIBOR/CHF LIBOR | Klassen D, R, S, T und U – 15,00 % |
| BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund | 1-Monats-EURIBOR/GBP LIBOR/USD LIBOR/CHF LIBOR/JPY LIBOR | 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 2021 und 31. Dezember 2020 aufgeführt, aufgeschlüsselt nach Anteilsklassen der Fonds:

| Fonds | Währung der Anteilsklasse | Basiswährung des Fonds | Performancegebühr Basiswährung 31. Dezember 2021 | Performancegebühr Basiswährung 31. Dezember 2020 |
|---|----------------------------|------------------------|--|--|
| BNY Mellon Absolute Return Bond Fund | | Summe | 160 | 19.018 |
| | Klasse D (Acc) | EUR | EUR | – |
| | Klasse R | EUR | EUR | – |
| | Klasse R (Hedged) | USD | EUR | 160 |
| | Klasse R (Inc) | EUR | EUR | – |
| | Klasse S | EUR | EUR | – |
| | Klasse S (Inc) | EUR | EUR | – |
| | Klasse T (Hedged) | CHF | EUR | – |
| | Klasse T (Hedged) | USD | EUR | – |
| | Klasse T (Hedged) | USD | EUR | 16.015 |
| | Sterling T (Acc) (Hedged) | GBP | EUR | – |
| BNY Mellon Absolute Return Equity Fund | | Summe | 4.569 | – |
| | Klasse D (Acc) (Hedged) | EUR | GBP | – |
| | Klasse R (Hedged) | CHF | GBP | – |
| | Klasse R (Hedged) | EUR | GBP | – |
| | Klasse R (Hedged) | USD | GBP | 425 |
| | Klasse R (Inc) (Hedged) | EUR | GBP | – |
| | Sterling R (Acc) | GBP | GBP | – |
| | Sterling S (Acc) | GBP | GBP | – |
| | Klasse T (Hedged) | EUR | GBP | – |
| | Klasse T (Hedged) | USD | GBP | 1.050 |
| | Klasse U (Hedged) | EUR | GBP | – |
| | Klasse U (Hedged) | USD | GBP | 3.093 |
| | Klasse U (Inc) (Hedged) | EUR | GBP | – |
| | Sterling U (Acc) | GBP | GBP | 1 |
| BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund | | Summe | 92.174 | 328.341 |
| | Klasse F (Acc) | EUR | EUR | 6.709 |
| | Klasse F (Acc) (Hedged)^ | CHF | EUR | 1.993 |
| | Klasse F (Acc) (Hedged) | USD | EUR | 10.501 |
| | Sterling F (Acc) (Hedged) | GBP | EUR | 33.373 |
| | Klasse R (Acc)^ | EUR | EUR | 69 |
| | Klasse U (Acc) | EUR | EUR | 34.689 |
| | Klasse U (Acc) (Hedged)^ | CHF | EUR | 3.016 |
| | Klasse U (Acc) (Hedged) | USD | EUR | 1.739 |
| | Sterling U (Acc) (Hedged)^ | GBP | EUR | 85 |
| BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund | | Summe | – | 319.072 |
| | Klasse S (Acc) | USD | EUR | – |
| | Klasse S (Acc) 1 | USD | EUR | – |

^ Diese Anteilsklasse wurde im Geschäftsjahr aufgelegt oder geschlossen.

4. VERWALTUNGSGEBÜHREN

Die Verwaltungsgesellschaft zahlt an die BNY Mellon Fund Services (Ireland) Designated Activity Company (der „Administrator“) aus dem Vermögen jedes Fonds eine Jahresgebühr, die täglich aufläuft und, wie im Prospekt angegeben, monatlich rückwirkend zu zahlen ist. Die zugunsten des Administrators aufgelaufene jährliche Gebühr wird allen Anteilsklassen zugewiesen und stellt einen Abzug vom Nettoinventarwert des Fonds und somit jeder Klasse dar. Die zugunsten des Administrators aufgelaufenen Gebühren und die zum Ende des Geschäftsjahres fälligen Beträge sind unter den Posten „Betriebliche Aufwendungen“ und „Zahlbare Aufwendungen“ in der Gesamtergebnisrechnung bzw. in der Bilanz ausgewiesen.

5. VERWAHRSTELLENGEBÜHREN

Die Gesellschaft zahlt an die Verwahrstelle aus dem Vermögen jedes Fonds eine Jahresgebühr, die täglich aufläuft und, wie im Prospekt angegeben, monatlich rückwirkend zu zahlen ist. Die zugunsten der Verwahrstelle aufgelaufene jährliche Gebühr wird allen Anteilsklassen zugewiesen und stellt einen Abzug vom Nettoinventarwert des Fonds und somit jeder Klasse dar. Die zugunsten der Verwahrstelle aufgelaufenen Gebühren und die zum Ende des Geschäftsjahres fälligen Beträge sind unter den Posten „Verwahrstellengebühr“ und „Zahlbare Aufwendungen“ in der Gesamtergebnisrechnung bzw. in der Bilanz ausgewiesen.

6. AUSGABENBERGRENZE

Von Zeit zu Zeit wird für bestimmte Fonds eine Ausgabenobergrenze eingeführt, wobei Ausgaben, die eine vereinbarte Höhe des Nettoinventarwerts des betreffenden Fonds überschreiten, von der Verwaltungsgesellschaft oder ihrer Tochtergesellschaft getragen werden. Die Ausgabenobergrenze wird dann so lange auf den betreffenden Fonds angewendet, bis der Verwaltungsrat einer Änderung der entsprechenden Ausgabenobergrenze zustimmt. Jede Änderung einer Ausgabenobergrenze, die zu einer Erhöhung der Ausgaben führt, wird den betroffenen Anteilsinhabern mitgeteilt. Zum Datum dieses Abschlusses gelten die folgenden Ausgabenobergrenzen:

6. AUSGABENBEREICH FORTS.

Fonds

BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund

BNY Mellon Asia Rising Stars Fund (mit Höchstgrenze bis zum Schließungstermin am 2. September 2020)

BNY Mellon Asian Income Fund

BNY Mellon Blockchain Innovation Fund

BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund*

BNY Mellon Dynamic Total Return Fund* (mit Höchstgrenze bis zum Schließungstermin am 26. Februar 2021)

BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund

BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund (mit Höchstgrenze ab dem Auflegungsdatum am 15. September 2020)

BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund (mit Höchstgrenze ab dem Auflegungsdatum am 10. März 2020)

BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund⁽¹¹⁾ (mit Höchstgrenze ab dem Auflegungsdatum am 21. September 2020)

BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund

BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund

BNY Mellon Future Earth Fund* (mit Höchstgrenze ab dem Auflegungsdatum am 12. Januar 2021)

BNY Mellon Future Food Fund* (mit Höchstgrenze ab dem Auflegungsdatum am 12. Januar 2021)

BNY Mellon Future Life Fund* (mit Höchstgrenze ab dem Auflegungsdatum am 12. Januar 2021)

BNY Mellon Global Credit Fund⁽⁹⁾

BNY Mellon Global Emerging Markets Fund

BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund

BNY Mellon Global Leaders Fund

BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund* (mit Höchstgrenze bis zum Schließungstermin am 18. März 2021)

BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund

BNY Mellon Global Unconstrained Fund

BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund

BNY Mellon Mobility Innovation Fund

BNY Mellon S&P 500[®] Index Tracker* (mit Höchstgrenze ab dem 24. Juni 2020 bis zum Schließungstermin am 15. Januar 2021)

BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund (mit Höchstgrenze ab dem Auflegungsdatum am 14. Dezember 2020)

BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund

BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR) (mit Höchstgrenze ab dem Auflegungsdatum am 6. Februar 2020)

BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund* (mit Höchstgrenze ab dem 5. November 2020 bis zum Schließungstermin am 5. März 2021)

BNY Mellon U.S. Equity Income Fund

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund

Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund*

Vereinbarte Grenze für die Gesamtkostenquote („TER“)

TER-Grenze der jährlichen Verwaltungsgebühr („JVG“) plus 15 Basispunkte
TER-Grenze der JVG plus 50 Basispunkte

TER-Grenze der JVG plus 9 Basispunkte

TER-Grenze der JVG plus 13 Basispunkte

TER-Grenze der JVG plus 10 Basispunkte⁽¹⁾

TER-Grenze der JVG plus 22 Basispunkte⁽²⁾

TER-Grenze der JVG plus 10 Basispunkte⁽³⁾

TER-Grenze der JVG plus 9,5 Basispunkte⁽⁴⁾

TER-Grenze der JVG plus 9,5 Basispunkte⁽⁵⁾

TER-Grenze der JVG plus 9,5 Basispunkte⁽⁶⁾

TER-Grenze der JVG plus 9,5 Basispunkte⁽⁷⁾

TER-Grenze der JVG plus 17 Basispunkte⁽⁸⁾

TER-Grenze der JVG plus 13 Basispunkte

TER-Grenze der JVG plus 13 Basispunkte

TER-Grenze der JVG plus 13 Basispunkte

TER-Grenze der JVG plus 30 Basispunkte

TER-Grenze der JVG plus 13 Basispunkte

TER-Grenze der JVG plus 15 Basispunkte

TER-Grenze der JVG plus 12 Basispunkte

TER-Grenze der JVG plus 6 Basispunkte⁽¹⁰⁾

TER-Grenze der JVG plus 15 Basispunkte⁽¹¹⁾

TER-Grenze der JVG plus 17 Basispunkte

TER-Grenze der JVG plus 13 Basispunkte

TER-Grenze der JVG plus 10 Basispunkte

TER-Grenze der JVG plus 13 Basispunkte

TER-Grenze der JVG plus 13 Basispunkte⁽¹²⁾

TER-Grenze der JVG plus 15 Basispunkte

TER-Grenze der JVG plus 24 Basispunkte

TER-Grenze der JVG plus 15 Basispunkte

TER-Grenze der JVG plus 15 Basispunkte

TER-Grenze der JVG plus 9 Basispunkte⁽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 6 Basispunkte und Anteilsklasse Sterling W (Acc) mit einer TER-Grenze der JVG plus 13 Basispunkte.

⁽⁴⁾ Mit Ausnahme der Anteilsklasse USD X (Acc) mit einer TER-Grenze der JVG plus 5,8 Basispunkte.

⁽⁵⁾ Mit Ausnahme der Anteilsklasse USD X (Acc) mit einer TER-Grenze der JVG plus 5,8 Basispunkte. In Bezug auf die Anteilsklasse Sterling L (Acc) (Hedged) wurde die TER-Grenze der JVG plus 9,5 Basispunkte mit Wirkung vom 1. Oktober 2021 in eine TER-Grenze ohne JVG plus 8 Basispunkte geändert. Dies führte zu einem Managementgebührenverzicht für die Klasse Sterling L (Acc) (Hedged) in Höhe von 4.147 USD für den Zeitraum vom 1. Oktober 2021 bis zum 31. Dezember 2021.

⁽⁶⁾ 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.

⁽⁷⁾ Mit Ausnahme der Anteilsklassen USD L (Acc), EUR L (Acc) (Hedged), Sterling L (Acc) (Hedged), Sterling L (Inc) (Hedged), Sterling X (Acc) (Hedged), USD X (Acc) und USD X (Inc) mit einer TER-Grenze der JVG plus 5,8 Basispunkte.

⁽⁸⁾ Mit Ausnahme der Anteilsklasse USD X (Acc) mit einer TER-Grenze der JVG plus 13 Basispunkte.

⁽⁹⁾ Anteilsklasse CAD X (Acc) (Hedged) mit einer TER-Grenze der JVG plus 10 Basispunkte und Anteilsklasse USD X (Acc) mit einer TER-Grenze der

6. AUSGABENBEREICH FORTS.

JVG plus 7 Basispunkte.

⁽¹⁰⁾ Anzuwenden auf die Anteilsklassen Sterling Y (Acc) (Hedged) und USD Y (Acc).

⁽¹¹⁾ Anzuwenden auf die Anteilsklasse CAD X (Acc) (Hedged).

⁽¹²⁾ Mit Ausnahme der Anteilsklassen CHF E (Acc) Hedged und EUR E (Acc) mit einer TER-Grenze der JVG plus 5 Basispunkte; und der Anteilsklassen EUR A (Acc), EUR A (Inc), EUR C (Acc), EUR G (Acc), EUR W (Acc) und EUR X (Acc) mit einer TER-Grenze der JVG plus 12,5 Basispunkte.

⁽¹³⁾ Mit Ausnahme der Anteilsklasse EUR X (Acc) mit einer TER-Grenze der JVG plus 6 Basispunkte.

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Die über die Obergrenze hinausgehenden Gesamtkosten, die der Gesellschaft während des Geschäftsjahres zum 31. Dezember 2021 in Rechnung gestellt wurden, betragen 1.595.729 USD (31. Dezember 2020: 1.187.133 USD).

7. BETRIEBLICHE AUFWENDUNGEN

Die in der Gesamtergebnisrechnung enthaltenen betrieblichen Aufwendungen beinhalten:

| Aufwendungen | 31. Dezember 2021 | 31. Dezember 2020 |
|--|-------------------|-------------------|
| | USD | USD |
| Verwaltungsgebühr | 12.290.441 | 8.988.627 |
| Prüfungsgebühr | 835.924 | 697.919 |
| Verwaltungsratshonorare | 108.786 | 82.642 |
| Sonstige Aufwendungen | 2.862.284 | 4.252.716 |
| Betriebliche Aufwendungen insgesamt | 16.097.435 | 14.021.904 |

Die für das Geschäftsjahr berechneten Honorare und Auslagen für die Leistungen der Abschlussprüfer Ernst & Young stellen sich wie folgt dar:

| | 31. Dezember 2021 | 31. Dezember 2020 |
|--|-------------------|-------------------|
| | USD | USD |
| Abschlussprüfung des Jahresabschlusses (Irland) | 586.172 | 519.691 |
| Sonstige prüfungsunabhängige Leistungen – Steuerbericht für Anleger (Vereinigtes Königreich) | 160.690 | 178.228 |
| Sonstige prüfungsunabhängige Leistungen – Steuerbericht für Anleger (Österreich) | 89.062 | – |
| Summe | 835.924 | 697.919 |

8. TRANSAKTIONSKOSTEN

Transaktionskosten sind Kosten, die entstehen, um erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten zu erwerben. Sie umfassen die Spanne zwischen Geld- und Briefkurs sowie die an Bevollmächtigte, Berater, Makler und Händler gezahlten Gebühren und Provisionen.

Die Transaktionskosten für den Kauf und Verkauf von Aktien und derivativen Finanzinstrumenten sind unter „Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/ Verbindlichkeiten“ in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesen und in nachstehender Tabelle angegeben. Bei allen anderen Wertpapieren ist die Spanne zwischen Geld- und Briefkurs im Kauf- und Verkaufspreis der Wertpapiere enthalten und kann nicht getrennt geprüft oder offen gelegt werden.

| Fonds | Basiswährung | 31. Dezember 2021 | 31. Dezember 2020 |
|---|--------------|-------------------|-------------------|
| BNY Mellon Absolute Return Bond Fund > | EUR | 135.107 | 18.742 |
| BNY Mellon Absolute Return Equity Fund | GBP | 712.251 | 825.225 |
| BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund > | EUR | 992.374 | 351.943 |
| BNY Mellon Asian Equity Fund | USD | 136.887 | 86.559 |
| BNY Mellon Asian Income Fund | USD | 62.558 | k. A. |
| BNY Mellon Blockchain Innovation Fund | USD | 70.984 | 8.584 |
| BNY Mellon Brazil Equity Fund | USD | 111.398 | 135.961 |
| BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund * | USD | 9.459 | k. A. |

8. TRANSAKTIONSKOSTEN Forts.

| Fonds | Basiswahrung | 31. Dezember 2021 | 31. Dezember 2020 |
|---|---------------|-------------------|-------------------|
| BNY Mellon Dynamic Total Return Fund* | USD | 2.327 | 26.021 |
| BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund | USD | 34.261 | 38.217 |
| BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund> | USD | 652 | 1.085 |
| BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund> | USD | 31.657 | 4.885 |
| BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund> | USD | 3 | 6.106 |
| BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund> | USD | 5.301 | k. A. |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund> | USD | 1.029 | 1.853 |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund> | USD | 101 | 13 |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund> | USD | 2.434 | 11 |
| BNY Mellon Euroland Bond Fund> | EUR | 40.423 | 373.666 |
| BNY Mellon European Credit Fund> | EUR | 4.177 | 6.411 |
| BNY Mellon Future Earth Fund* | USD | 3.028 | k. A. |
| BNY Mellon Future Food Fund* | USD | 2.579 | k. A. |
| BNY Mellon Future Life Fund* | USD | 2.221 | k. A. |
| BNY Mellon Global Bond Fund> | USD | 18.499 | 8.126 |
| BNY Mellon Global Credit Fund> | USD | 42.510 | 7.516 |
| BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund> | USD | 38.020 | 42.911 |
| BNY Mellon Global Emerging Markets Fund | USD | 175.682 | 65.395 |
| BNY Mellon Global Equity Fund | USD | 180.830 | 173.598 |
| BNY Mellon Global Equity Income Fund | USD | 605.809 | 835.414 |
| BNY Mellon Global High Yield Bond Fund> | USD | 84 | 23.760 |
| BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund | USD | 363.151 | 572.301 |
| BNY Mellon Global Leaders Fund | USD | 23.041 | 47.648 |
| BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund* | EUR | 11.011 | 10.948 |
| BNY Mellon Global Opportunities Fund | USD | 17.639 | 25.578 |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)> | EUR | 2.196.358 | 3.190.081 |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)> | GBP | 41.911 | 68.892 |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)> | USD | 298.791 | 281.952 |
| BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund> | USD | 3.234 | k. A. |
| BNY Mellon Global Unconstrained Fund> | USD | 14.326 | 11.491 |
| BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund | JPY | 8.632.704 | k. A. |
| BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund | EUR | 489.111 | 401.144 |
| BNY Mellon Mobility Innovation Fund | USD | 631.663 | 298.338 |
| BNY Mellon S&P 500® Index Tracker* | USD | 1.692 | 1.327 |
| BNY Mellon Small Cap Euroland Fund | EUR | 95.927 | 47.177 |
| BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund | USD | 2.982 | 1.038 |
| BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund> | EUR | 16.808 | k. A. |
| BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)> | EUR | 80.897 | 49.695 |
| BNY Mellon Targeted Return Bond Fund> | USD | 5.369 | 807 |
| BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund* | USD | 1.556 | 29.150 |
| BNY Mellon U.S. Equity Income Fund | USD | 170.009 | 269.655 |
| Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund* | EUR | 13.741 | k. A. |

* Siehe Erluterung 19 zum Abschluss.

> Die Transaktionskosten fur den Kauf und Verkauf von Anleihen sind im Kauf- und Verkaufspreis der Anlage enthalten. Sie konnen jedoch weder zweckmaig noch zuverlassig zusammengestellt noch getrennt uberpruft oder offen gelegt werden.

9. BARMITTEL UND BARGEGENWERTE

Die Barmittel der Gesellschaft sind bei The Bank of New York Mellon SA/NV, Niederlassung Dublin, hinterlegt und werden von den Kontrahenten (Bank of America Merrill Lynch, Barclays Bank PLC, BNP Paribas, Canadian Imperial Bank of Commerce, Citigroup Global Markets Limited, Credit Suisse AG, Goldman Sachs, HSBC Bank plc, JPMorgan Chase Bank, Morgan Stanley, Royal Bank of Canada, Royal Bank of Scotland, State Street Bank, Toronto Dominion Bank und UBS AG) in Bezug auf die erforderlichen Sicherheiten und Margenanforderungen gehalten. Barguthaben umfassen taglich in kurzfristige Anlageinstrumente investierte Barmittel.

Kassakontovereinbarungen wurden fur die Fonds infolge neuer Anforderungen fur die Sammelkonten fur Zeichnungs- und Rucknahmebetrage gema dem (Supervision and Enforcement) Act 2013 der (Section 48(1)) Investor Money Regulations 2015 fur Fonds-Dienstleister (Fund Service Providers) („Vorschriften fur Anlegergelder“ – „Investor Money Regulations“) getroffen.

9. BARMITTEL UND BARGEGENWERTE Forts.

Diese Kassakonten, die bei der Verwahrstelle für den Einzug von Zeichnungen und Rücknahmezahlungen sowie für Ausschüttungen der Fonds gehalten werden, gelten als Vermögenswerte der Fonds. Die Guthaben auf diesen Kassakonten am 31. Dezember 2021 und 31. Dezember 2020 werden in Bezug auf den jeweiligen Fonds, dem sie zustehen, als unwesentlich betrachtet, mit Ausnahme von Barmittelguthaben in Höhe von 21.942 EUR (31. Dezember 2020: 20.492 EUR) für den BNY Mellon Pan European Fund (geschlossen am 9. März 2017) und in Höhe von 36.082 USD (31. Dezember 2020: null USD) für den BNY Mellon S&P 500® Index Tracker (geschlossen am 15. Januar 2021).

10. BESTEUERUNG

Nach geltendem Recht und gängiger Praxis ist die Gesellschaft ein Anlageorganismus im Sinne der Definition in Section 739B des Tax Consolidation Acts von 1997 in der jeweils gültigen Fassung. Auf dieser Grundlage unterliegen ihre Erträge und Kapitalgewinne nicht der irischen Steuer.

Allerdings kann eine irische Steuer erhoben werden, wenn ein „steuerpflichtiges Ereignis“ eintritt. Zu den steuerpflichtigen Ereignissen gehören alle Ausschüttungen an Anteilhaber oder Einlösungen, Rücknahmen, Annullierungen oder Übertragungen von Anteilen und das Halten von Anteilen am Ende jedes Achtjahreszeitraums ab dem Erwerb der Anteile.

Die Gesellschaft ist in Irland in Bezug auf steuerpflichtige Ereignisse, die sich auf folgende Arten von Anteilhabern beziehen, nicht steuerpflichtig:

- (a) Anteilhaber, die zu steuerlichen Zwecken zum Zeitpunkt des steuerpflichtigen Ereignisses weder in Irland ansässig sind noch ihren ständigen Wohnsitz in Irland haben, sofern die entsprechenden gültigen Erklärungen im Sinne des Taxes Consolidation Act von 1997 in der jeweils gültigen Fassung bei der Gesellschaft vorliegen; oder die Gesellschaft von der irischen Steuerbehörde die Genehmigung erhalten hat, Bruttzahlungen zu leisten, sofern keine entsprechenden Erklärungen vorliegen; und
- (b) bestimmte in Irland ansässige, ausgenommene Anleger, die der Gesellschaft die unterzeichneten gesetzlich vorgeschriebenen Erklärungen vorgelegt haben.

Es ist möglich, dass Ausschüttungen, Zinsen und etwaige Kapitalgewinne aus Anlagegeschäften der Gesellschaft der Quellensteuer in dem Land unterliegen, aus dem diese Anlageerträge/-gewinne erhalten werden. Diese Steuern werden der Gesellschaft oder den Anteilhabern unter Umständen nicht zurückerstattet.

Bestimmte Fonds grenzen die Kapitalertragsteuer in Brasilien und Indien auf die realisierten und nicht realisierten Nettoanlageerträge periodengerecht ab. Zum 31. Dezember 2021 wurde für den BNY Mellon Asian Equity Fund eine offene Kapitalertragsteuer in Höhe von 311.766 USD (31. Dezember 2020: 461.455 USD), 1.041.327 USD für den BNY Mellon Brazil Equity Fund (31. Dezember 2020: 2.540.087 USD) und 185.048 USD für den BNY Mellon Global Emerging Markets Fund (31. Dezember 2020: 44.734 USD) in der Bilanz ausgewiesen. Für das abgelaufene Geschäftsjahr wurde ein Kapitalertragsteueraufwand von 149.689 USD für den BNY Mellon Asian Equity Fund (31. Dezember 2020: 461.455 USD), 2.418.087 USD für den BNY Mellon Brazil Equity Fund (31. Dezember 2020: 3.989.039 USD) und 111.396 USD für den BNY Mellon Global Emerging Markets Fund (31. Dezember 2020: 118.386 USD) in der Gesamtergebnisrechnung unter „Quellensteuern auf Dividenden und andere Anlageerträge“ ausgewiesen.

11. NAHESTEHENDE UNTERNEHMEN UND PERSONEN

Nach Ansicht des Verwaltungsrats gelten die Verwaltungsgesellschaft, die Anlageverwalter (Mellon Investments Corporation*, Newton Investment Management Limited, Walter Scott & Partners Limited, Newton Investment Management North America LLC*, ARX Investimentos Ltda, Insight Investment Management (Global) Limited*, Alcentra NY, LLC, BNY Mellon Asset Management Japan Limited, Alcentra Limited, Insight North America LLC*), die Untereinlageverwalter (Insight North America LLC und Maybank Asset Management Singapore Pte. LTD) und die Vertriebsgesellschaften als der Gesellschaft nahestehende Unternehmen.

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Die Verwaltungsgesellschaft zahlt von den von ihr erhaltenen Gebühren die Gebühren der Anlageverwalter und der Vertriebsgesellschaften in Höhe eines zwischen den Parteien vereinbarten jährlichen Satzes. Die im Zusammenhang mit allen sonstigen wesentlichen Transaktionen mit nahestehenden Unternehmen und Personen im Geschäftsjahr gezahlten Gebühren sind in der Gesamtergebnisrechnung sowie in der Erläuterung 3 „Management- und Performancegebühren“, der Erläuterung 4 „Verwaltungsgebühren“, der Erläuterung 5 „Verwahrstellengebühren“, der Erläuterung 6 „Ausgabenobergrenze“ und der Erläuterung 7 „Betriebliche Aufwendungen“ zum Abschluss vollständig ausgewiesen.

Die Verwaltungsratsmitglieder sind der Gesellschaft nahestehende Personen.

11. NAHESTEHENDE UNTERNEHMEN UND PERSONEN Forts.

Die folgenden Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft sind auch Mitglieder des Verwaltungsrats der BNY Mellon Fund Management (Luxembourg) S.A. (die Verwaltungsgesellschaft) und der BNY Mellon Investment Management EMEA Limited:

- Greg Brisk
- Gerald Rehn

Greg Brisk und Gerald Rehn haben auf ihr Recht verzichtet, eine Vergütung für ihre Dienste als Verwaltungsratsmitglieder zu beziehen. Die im Geschäftsjahr angefallenen Honorare der Verwaltungsratsmitglieder werden in Erläuterung 7 zum Abschluss offen gelegt.

Greg Brisk ist zudem ein Verwaltungsratsmitglied bei den folgenden Anlageverwaltern der Fonds:

- Alcentra Limited,
- Alcentra NY, LLC,
- Newton Investment Management Limited,
- Insight Investment Management (Global) Limited und
- Insight North America LLC

Greg Brisk ist außerdem Verwaltungsratsmitglied der Insight Global Funds II plc und der Insight Liquidity Funds plc, in die einige Fonds der Gesellschaft investiert haben, sowie der BNY Mellon Investment Management Seed Capital Limited, einem der Gesellschaft nahestehenden Unternehmen. BNY Mellon Investment Management Seed Capital Limited hielt am 31. Dezember 2021 und 31. Dezember 2020 ein erhebliches wirtschaftliches Eigentum an den Anteilklassen der nachstehend aufgeführten Fonds

| Name des Anlegers Fonds | Basis- währung | 31. Dezember 2021 | 31. Dezember 2020 |
|--|-------------------|-------------------|-------------------|
| BNY Mellon Investment Management Seed Capital Limited | | | |
| BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund | EUR | 21.827.261 | 21.753.567 |
| BNY Mellon Blockchain Innovation Fund | USD | 4.474.114 | 8.123.954 |
| BNY Mellon Dynamic Total Return Fund* | USD | k. A. | 166.854 |
| BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund | USD | 153.309 | 26.336.487 |
| BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund | USD | 26.014 | 287.561 |
| BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund | USD | 67.771 | 1.015.640 |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund | USD | 25.655 | 141.236 |
| BNY Mellon Future Earth Fund* | USD | 2.167.175 | k. A. |
| BNY Mellon Future Food Fund* | USD | 2.222.200 | k. A. |
| BNY Mellon Future Life Fund* | USD | 2.351.704 | k. A. |
| BNY Mellon Global Emerging Markets Fund | USD | Null | 49.420 |
| BNY Mellon Global Leaders Fund | USD | 148.816 | 901.073 |
| BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund* | EUR | k. A. | 11.862.378 |
| BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund | JPY | 4.611.416 | 60.670.703 |
| BNY Mellon Mobility Innovation Fund | USD | 150.138 | 807.120 |
| BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund | USD | 4.976.694 | 5.004.058 |
| BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR) | EUR | 17.298.255 | 16.355.491 |
| BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund | USD | 148.628 | 148.784 |

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Die umseitig aufgeführten Fonds investieren in Organismen für gemeinsame Anlagen, die von ihren eigenen Anlageverwaltern verwaltet werden, sowie in andere Fonds der Gesellschaft.

11. NAHESTEHENDE UNTERNEHMEN UND PERSONEN Forts.

| Fonds | Organismus für gemeinsame Anlagen (OGA) | Währung | 31. Dezember 2021 | 31. Dezember 2020 |
|---|--|---------|-------------------|-------------------|
| BNY Mellon Absolute Return Bond Fund | | | | |
| | BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund | EUR | 38.545.235 | – |
| | Insight Liquidity Funds Plc - ILF EUR Cash Fund | EUR | – | 7.123.756 |
| BNY Mellon Absolute Return Equity Fund | | | | |
| | Insight Liquidity Funds Plc - ILF GBP Liquidity Fund | GBP | 12.006.736 | 23.076.810 |
| BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund | | | | |
| | Insight Liquidity Funds Plc - ILF EUR Cash Fund | EUR | 6.876.198 | 2.887.304 |
| BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund | | | | |
| | Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund | USD | 28.749.161 | 7.896.733 |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund | | | | |
| | Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund | USD | 4.014.000 | 5.770.066 |
| BNY Mellon Euroland Bond Fund | | | | |
| | BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund | EUR | – | 4.951.369 |
| | BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund | EUR | 2.426.564 | 2.285.716 |
| | BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund | EUR | – | 7.993.557 |
| BNY Mellon European Credit Fund | | | | |
| | BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund | EUR | 432.807 | 753.744 |
| | BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund | EUR | 1.040.687 | 1.254.152 |
| BNY Mellon Global Credit Fund | | | | |
| | Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund | USD | 850.000 | 14.546.122 |
| BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund | | | | |
| | BNY Mellon Investment Funds - BNY Mellon Global High Yield Bond Fund | USD | 6.620.068 | 6.139.869 |
| BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund | | | | |
| | Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund | USD | 73.536.026 | 37.621.950 |

Im Geschäftsjahr wurden von den Anlageverwaltern der Verwahrstelle und den Anlageverwaltern nahestehenden Unternehmen zur Ausführung der Anlage- und Devisengeschäfte sowie zur Annahme von Einlagen im Auftrag der Anlageverwalter ausgewählt. The Bank of New York Mellon, New York, und The Bank of New York Mellon, London, waren Kontrahenten bei am Ende des Geschäftsjahres offenen Devisenterminkontrakten, die in der Aufstellung der Wertpapierbestände ausgewiesen sind. Die Kontrahenten wurden von den Anlageverwaltern ausgewählt und die Bedingungen dieser Geschäfte wurden von den Anlageverwaltern mit den entsprechenden Unternehmen ausgehandelt.

Die Verwaltungsgesellschaft besitzt 38.092 (31. Dezember 2020:38.092) Zeichneranteile, wie in Erläuterung 2 zum Abschluss erläutert. Es gab keine oberste beherrschende Partei der Gesellschaft in den Geschäftsjahren zum 31. Dezember 2021 und 31. Dezember 2020..

12. VERRECHNUNGSPROVISION (SOFT COMMISSION) UND MAKLERDIENSTLEISTUNGSVEREINBARUNGEN

Im Geschäftsjahr trafen die Mellon Investments Corporation und ARX Investimentos Ltda (die „Anlageverwalter“) Soft-Commission-Vereinbarungen (auch „Soft-Dollar-Vereinbarungen“ genannt) mit Maklern, und in diesem Zusammenhang wurden bestimmte Waren und Dienstleistungen zur Unterstützung des Anlageprozesses entgegengenommen. Die Anlageverwalter leisten für diese Dienstleistungen keine direkte Zahlung, sondern vergüten die Makler entweder über Provisionen auf Transaktionen oder sorgen dafür, dass die ausführenden Kontrahenten die ihnen zugeteilte Researchprovision ganz oder teilweise an andere Makler oder Researchanbieter zahlen, die keine Maklerfunktion innehaben. Die für die Gesellschaft eingesetzten Waren und Dienstleistungen umfassen wirtschaftliche und politische Analysen, branchen- oder unternehmensspezifische anlagebezogene Recherchen und die aktive Orderverwaltung durch Makler. Die Anlageverwalter sind der Ansicht, dass die Anleger Vorteile aus diesen Vereinbarungen ziehen, und dass die Maklergebühren nicht die üblichen Maklergebühren für den umfassenden institutionellen Anlegerservice überschreiten.

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

13. WECHSELKURSE

Der Jahresabschluss wird in US-Dollar (USD) erstellt. Folgende Wechselkurse wurden für die Umrechnung der auf Fremdwährungen lautenden Vermögenswerte und Verbindlichkeiten in US-Dollar verwendet:

| Währung | 31. Dezember 2021 | 31. Dezember 2020 |
|-------------------------|-------------------|-------------------|
| Argentinischer Peso | 102,6909 | 84,0839 |
| Australischer Dollar | 1,3745 | 1,2971 |
| Brasilianischer Real | 5,5700 | 5,1942 |
| Kanadischer Dollar | 1,2650 | 1,2729 |
| Chilenischer Peso | 852,0000 | 710,5000 |
| Chinesischer Yuan | 6,3575 | 6,5029 |
| Kolumbianischer Peso | 4.066,0000 | 3.415,5000 |
| Tschechische Krone | 21,8494 | 21,4775 |
| Dänische Krone | 6,5321 | 6,0924 |
| Dominikanischer Peso | k. A. | 58,2500 |
| Ägyptisches Pfund | 15,7100 | 15,7300 |
| Euro | 0,8783 | 0,8186 |
| Hongkong-Dollar | 7,7976 | 7,7525 |
| Ungarischer Forint | 324,4621 | 296,8486 |
| Indische Rupie | 74,3357 | 73,0675 |
| Indonesische Rupiah | 14.252,5000 | 14.050,0000 |
| Israelischer Schekel | 3,1090 | 3,2135 |
| Japanischer Yen | 115,0300 | 103,2550 |
| Kasachischer Tenge | 434,8050 | 421,1550 |
| Koreanischer Won | 1.188,7500 | 1.086,3000 |
| Malaysischer Ringgit | 4,1660 | 4,0225 |
| Mexikanischer Peso | 20,4755 | 19,8995 |
| Neuseeländischer Dollar | 1,4601 | 1,3899 |
| Norwegische Krone | 8,8066 | 8,5743 |
| Peruanischer neuer Sol | 3,9915 | 3,6200 |
| Philippinischer Peso | 50,9925 | 48,0235 |
| Polnischer Zloty | 4,0292 | 3,7357 |
| Rumänischer Leu | 4,3468 | 3,9838 |
| Russischer Rubel | 75,0888 | 73,9463 |
| Singapur-Dollar | 1,3476 | 1,3216 |
| Südafrikanischer Rand | 15,9350 | 14,6950 |
| Pfund Sterling | 0,7388 | 0,7313 |
| Schwedische Krone | 9,0362 | 8,2276 |
| Schweizer Franken | 0,9112 | 0,8853 |
| Taiwan-Dollar | 27,6670 | 28,0980 |
| Thailändischer Baht | 33,4050 | 29,9600 |
| Türkische Lira | 13,2290 | 7,4330 |
| Ukrainische Hrywnja | k. A. | 28,3350 |
| Uruguayischer Peso | 44,7000 | 42,4750 |

13. WECHSELKURSE Forts.

Bei der Erstellung der Bilanz wurden für die Konsolidierung der Abschlüsse der Fonds folgende Wechselkurse gegenüber dem US-Dollar verwendet:

| | 31. Dezember 2021 | | 31. Dezember 2020 | |
|-----------------|-------------------|------------|-------------------|------------|
| | Schlusskurs | Mittelkurs | Schlusskurs | Mittelkurs |
| Euro | 0,8783 | 0,8457 | 0,8186 | 0,8773 |
| Japanischer Yen | 115,0300 | 109,8126 | 103,2550 | 106,7768 |
| Pfund Sterling | 0,7388 | 0,7271 | 0,7313 | 0,7799 |

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG

Die Gesellschaft und jeder Fonds können für Anlagezwecke in derivative Finanzinstrumente („FDI“) investieren, sofern dies im jeweiligen Nachtrag zum Prospekt angegeben ist. Ferner kann jeder Fonds gemäß den von der Zentralbank festgelegten Bedingungen und Grenzen, Techniken und Instrumente für die Zwecke der effizienten Portfolioverwaltung oder zur Absicherung gegen Wechselkursrisiken einsetzen.

Zu solchen Anlagetechniken und -instrumenten zählen u. a. Terminkontrakte (Futures), Optionen, Swaps, Optionsscheine, Wertpapierleihvereinbarungen, Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte, Devisenterminkontrakte und „When issued“- und/oder „Delayed Delivery“-Wertpapiere.

Geschäfte mit dem Vermögen eines Fonds dürfen für die Zwecke einer effizienten Portfolioverwaltung abgeschlossen werden, um eines der folgenden Ziele zu erreichen: eine Risikominderung, eine Kostensenkung ohne Erhöhung oder mit minimaler Erhöhung des Risikos oder Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder Einkommens ohne bzw. mit annehmbar geringem Risikoniveau (im Verhältnis zum erwarteten Ertrag). Die Gesellschaft legt derzeit in die in der jeweiligen Aufstellung der Wertpapierbestände ausgewiesenen Terminkontrakte (Futures), Optionen, Swaps, Devisenterminkontrakte und Genussscheine (P-Notes) an. Einzelheiten zu den am Ende des Geschäftsjahres offenen Transaktionen enthält die Aufstellung der Wertpapierbestände.

Die Gesellschaft hat mit The Bank of New York Mellon, Niederlassung London, und der Verwahrstelle eine Wertpapierleihvereinbarung (in der geänderten, abgetretenen, erneuerten und angenommenen Fassung) geschlossen. Die Erträge aus der Wertpapierleihe werden zurzeit im Verhältnis 80 % zu 20 % zwischen der Gesellschaft und The Bank of New York Mellon, Niederlassung London, aufgeteilt.

Wertpapierleihgeschäfte und die damit verbundenen Sicherheiten werden in Übereinstimmung mit den dreiseitigen (Tri-Party) und bilateralen Vereinbarungen abgewickelt und abgerechnet.

Die Gesellschaft vereinnahmte im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 die in der nachfolgenden Tabelle aufgeführten Erträge aus Wertpapierleihgeschäften:

| Fonds | Basiswährung | Bruttoerträge | Direkte Kosten (die an The Bank of New York Mellon SA/NV gezahlt wurden) (20 %) | Nettoerträge für die Gesellschaft (80 %)^ |
|---|--------------|---------------|---|---|
| BNY Mellon Absolute Return Bond Fund | EUR | 67.351 | (13.470) | 53.881 |
| BNY Mellon Absolute Return Equity Fund | GBP | 5.526 | (1.105) | 4.421 |
| BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund | EUR | 8.964 | (1.793) | 7.171 |
| BNY Mellon Asian Equity Fund | USD | 840 | (168) | 672 |
| BNY Mellon Asian Income Fund | USD | 12 | (2) | 10 |
| BNY Mellon Blockchain Innovation Fund | USD | 365.844 | (73.169) | 292.675 |
| BNY Mellon Dynamic Total Return Fund* | USD | 210 | (42) | 168 |
| BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund | USD | 30.019 | (6.004) | 24.015 |
| BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund | USD | 8.497 | (1.699) | 6.798 |
| BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund | USD | 228 | (46) | 182 |
| BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund | USD | 377.816 | (75.564) | 302.252 |
| BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund | USD | 88.914 | (17.783) | 71.131 |
| BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund | USD | 256.496 | (51.299) | 205.197 |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund | USD | 5.665 | (1.133) | 4.532 |

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

| Fonds | Basiswährung | Bruttoerträge | Direkte Kosten (die an The Bank of New York Mellon SA/NV gezahlt wurden) (20 %) | Nettoerträge für die Gesellschaft (80 %)^ |
|--|--------------|---------------|---|---|
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund | USD | 4.156 | (831) | 3.325 |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund | USD | 1.526 | (305) | 1.221 |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund | USD | 25.268 | (5.053) | 20.215 |
| BNY Mellon Euroland Bond Fund | EUR | 51.829 | (10.366) | 41.463 |
| BNY Mellon European Credit Fund | EUR | 4.817 | (963) | 3.854 |
| BNY Mellon Global Bond Fund | USD | 153.458 | (30.692) | 122.766 |
| BNY Mellon Global Credit Fund | USD | 145.779 | (29.156) | 116.623 |
| BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund | USD | 51.056 | (10.211) | 40.845 |
| BNY Mellon Global Emerging Markets Fund | USD | 464 | (93) | 371 |
| BNY Mellon Global Equity Fund | USD | 15.218 | (3.043) | 12.175 |
| BNY Mellon Global Equity Income Fund | USD | 103.156 | (20.631) | 82.525 |
| BNY Mellon Global High Yield Bond Fund | USD | 42.307 | (8.461) | 33.846 |
| BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund | USD | 84.731 | (16.946) | 67.785 |
| BNY Mellon Global Leaders Fund | USD | 969 | (194) | 775 |
| BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund* | EUR | 72 | (14) | 58 |
| BNY Mellon Global Opportunities Fund | USD | 1.418 | (284) | 1.134 |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) | EUR | 179.471 | (35.894) | 143.577 |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP) | GBP | 1.512 | (302) | 1.210 |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (USD) | USD | 8.955 | (1.791) | 7.164 |
| BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund | USD | 409.280 | (81.856) | 327.424 |
| BNY Mellon Global Unconstrained Fund | USD | 2.172 | (434) | 1.738 |
| BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund | JPY | 16.403.953 | (3.280.791) | 13.123.162 |
| BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund | EUR | 80.964 | (16.193) | 64.771 |
| BNY Mellon Mobility Innovation Fund | USD | 326.838 | (65.367) | 261.471 |
| BNY Mellon S&P 500® Index Tracker* | USD | 65 | (13) | 52 |
| BNY Mellon Small Cap Euroland Fund | EUR | 30.781 | (6.156) | 24.625 |
| BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund* | USD | 5 | (1) | 4 |
| BNY Mellon U.S. Equity Income Fund | USD | 23.752 | (4.751) | 19.001 |

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

* Ausgewiesen als „Erträge aus Wertpapierleihgeschäften“ in der Gesamtergebnisrechnung.

Die Gesellschaft vereinnahmte im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020 die in der nachfolgenden Tabelle aufgeführten Erträge aus Wertpapierleihgeschäften:

| Fonds | Basiswährung | Bruttoerträge | Direkte Kosten (die an The Bank of New York Mellon SA/NV gezahlt wurden) (20 %) | Nettoerträge für die Gesellschaft (80 %)^ |
|--|--------------|---------------|---|---|
| BNY Mellon Absolute Return Bond Fund | EUR | 36.565 | (7.313) | 29.252 |
| BNY Mellon Absolute Return Equity Fund | GBP | 18.723 | (3.744) | 14.979 |
| BNY Mellon Asia Rising Stars Fund | USD | 13.270 | (2.654) | 10.616 |
| BNY Mellon Asian Equity Fund | USD | 15.104 | (3.021) | 12.083 |
| BNY Mellon Blockchain Innovation Fund | USD | 2.168 | (434) | 1.734 |
| BNY Mellon Dynamic Total Return Fund | USD | 305 | (61) | 244 |
| BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund | USD | 14.891 | (2.978) | 11.913 |
| BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund | USD | 20 | (4) | 16 |
| BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund | USD | 12 | (2) | 10 |
| BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund | USD | 13.969 | (2.794) | 11.175 |
| BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund | USD | 87.284 | (17.457) | 69.827 |

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

| Fonds | Basiswährung | Bruttoerträge | Direkte Kosten (die an The Bank of New York Mellon SA/NV gezahlt wurden) (20 %) | Nettoerträge für die Gesellschaft (80 %)^ |
|--|--------------|---------------|---|---|
| BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund | USD | 104.999 | (21.000) | 83.999 |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund | USD | 4.175 | (835) | 3.340 |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund | USD | 4.555 | (911) | 3.644 |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund | USD | 1.526 | (305) | 1.221 |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund | USD | 14.895 | (2.979) | 11.916 |
| BNY Mellon Euroland Bond Fund | EUR | 105.617 | (21.124) | 84.493 |
| BNY Mellon European Credit Fund | EUR | 5.722 | (1.144) | 4.578 |
| BNY Mellon Global Bond Fund | USD | 171.638 | (34.328) | 137.310 |
| BNY Mellon Global Credit Fund | USD | 45.923 | (9.185) | 36.738 |
| BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund | USD | 93.603 | (18.720) | 74.883 |
| BNY Mellon Global Emerging Markets Fund | USD | 3.307 | (662) | 2.645 |
| BNY Mellon Global Equity Fund | USD | 50.280 | (10.056) | 40.224 |
| BNY Mellon Global Equity Income Fund | USD | 307.890 | (61.578) | 246.312 |
| BNY Mellon Global High Yield Bond Fund | USD | 16.958 | (3.392) | 13.566 |
| BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund | USD | 1 | – | 1 |
| BNY Mellon Global Leaders Fund | USD | 4.611 | (922) | 3.689 |
| BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund | EUR | 4 | (1) | 3 |
| BNY Mellon Global Opportunities Fund | USD | 5.682 | (1.137) | 4.545 |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) | EUR | 464.405 | (92.881) | 371.524 |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP) | GBP | 6.280 | (1.256) | 5.024 |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (USD) | USD | 27.848 | (5.570) | 22.278 |
| BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund | USD | 529.875 | (105.975) | 423.900 |
| BNY Mellon Global Unconstrained Fund | USD | 2.186 | (438) | 1.748 |
| BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund | JPY | 64.746.499 | (12.949.300) | 51.797.199 |
| BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund | EUR | 171.287 | (34.257) | 137.030 |
| BNY Mellon Mobility Innovation Fund | USD | 39.427 | (7.885) | 31.542 |
| BNY Mellon S&P 500® Index Tracker | USD | 2.231 | (446) | 1.785 |
| BNY Mellon Small Cap Euroland Fund | EUR | 52.350 | (10.470) | 41.880 |
| BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund | USD | 1.961 | (392) | 1.569 |
| BNY Mellon U.S. Equity Income Fund | USD | 16.998 | (3.399) | 13.599 |

^ Ausgewiesen als „Erträge aus Wertpapierleihgeschäften“ in der Gesamtergebnisrechnung.

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

Der Wert der entliehenen Wertpapiere nach Kontrahenten sowie Wert und Art der von der Gesellschaft in Bezug auf diese Wertpapiere gehaltenen Sicherheiten stellte sich zum 31. Dezember 2021 wie folgt dar:

| Fonds | Kontrahent | Gründungsland | Art der Sicherheit | Gesamtwert der verliehenen Wertpapiere am 31. Dezember 2021 | Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten am 31. Dezember 2021 | Wert der Sicherheiten als % der verliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2021 |
|---|--|--------------------------------|---|---|---|---|
| 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 (Euroclear TriParty) | 300.079 | 315.130 | 105,02 % |
| | Morgan Stanley & Co. International PLC | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 1.056.393 | 1.165.800 | 110,36 % |
| | Deutsche Bank AG | Deutschland | G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty) | 829.741 | 846.399 | 102,01 % |
| | BNP Paribas | Frankreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 384.177 | 391.936 | 102,02 % |
| | Merrill Lynch International | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 375.150 | 393.887 | 104,99 % |
| | Societe Generale | Frankreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 100.026 | 102.044 | 102,02 % |
| | | | | 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 | 148 | 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 % |

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 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 (Euroclear TriParty) | 167.437 | 176.096 | 105,17 % |
| MUFG Securities EMEA plc | Vereinigtes Königreich | Aktienindizes (TriParty) | 4.161.413 | 4.578.147 | 110,01 % |
| Barclays Capital Inc | Vereinigte Staaten von Amerika | US-Staatsanleihen (Bilateral) | 2.212.603 | 2.260.050 | 102,14 % |
| J.P. Morgan Securities LLC | Vereinigte Staaten von Amerika | US-Staatsanleihen (Bilateral) | 510.247 | 520.521 | 102,01 % |
| Merrill Lynch International | Vereinigtes Königreich | G10-Schuldtitel (TriParty) | 208.342 | 218.800 | 105,02 % |
| The Bank of Nova Scotia | Kanada | Aktienindizes (TriParty) | 188.622 | 207.634 | 110,08 % |
| | | | 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 % |
| 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 % |

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 U.S. High Yield Beta Fund Forts. | | | USD | USD | % |
| 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 % |
| Barclays Capital Inc | Vereinigte Staaten von Amerika | US-Staatsanleihen (Bilateral) | 3.295.353 | 3.366.018 | 102,14 % |
| Citigroup Global Markets Inc | Vereinigtes Königreich | US-Staatsanleihen (Bilateral) | 3.184.458 | 3.334.406 | 104,71 % |
| Morgan Stanley & Co. International PLC | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 2.432.594 | 2.670.630 | 109,79 % |
| Goldman Sachs International | Vereinigte Staaten von Amerika | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 1.195.552 | 1.255.519 | 105,02 % |
| Goldman Sachs International | Vereinigte Staaten von Amerika | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 866.822 | 910.934 | 105,09 % |
| Merrill Lynch International | Vereinigtes Königreich | G10-Schuldtitel (TriParty) | 1.775.664 | 1.864.801 | 105,02 % |
| Nomura Securities International Inc. | Vereinigte Staaten von Amerika | US-Staatsanleihen (Bilateral) | 1.768.492 | 1.948.493 | 110,18 % |
| J.P. Morgan Securities plc | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 1.097.531 | 1.152.554 | 105,01 % |
| J.P. Morgan Securities plc | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 494.400 | 545.120 | 110,26 % |
| Morgan Stanley & Co. LLC | Vereinigte Staaten von Amerika | US-Staatsanleihen (Bilateral) | 1.324.163 | 1.356.032 | 102,41 % |
| Credit Suisse Securities (USA) LLC | Vereinigte Staaten von Amerika | US-Staatsanleihen (Bilateral) | 1.234.215 | 1.261.953 | 102,25 % |
| BNP Paribas Securities Corp | Vereinigte Staaten von Amerika | US-Staatsanleihen (Bilateral) | 617.920 | 630.907 | 102,10 % |

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

| Fonds Kontrahent | Gründungsland | Art der Sicherheit | Gesamt- wert der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2021 | Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2021 | Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2021 |
|---|-----------------------------------|---|---|---|--|
| BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund Forts. | | | USD | USD | % |
| 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 % |
| 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 % |

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

| Fonds Kontrahent | Gründungsland | Art der Sicherheit | Gesamt- wert der entlehnten Wertpapiere zum 31. Dezember 2021 | Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2021 | Wert der Sicherheiten als % der entlehnten Wertpapiere zum 31. Dezember 2021 |
|---|--------------------------------|---|--|---|---|
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund Forts. | | | USD | USD | % |
| 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 % |
| 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 % |

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 Forts. | | | EUR | EUR | % |
| Deutsche Bank AG | Deutschland | G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty) | 740.329 | 755.192 | 102,01 % |
| BNP Paribas | Frankreich | G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty) | 1.211.714 | 1.262.165 | 104,16 % |
| UBS AG | Schweiz | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 351.396 | 358.476 | 102,01 % |
| | | | 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 | 468.023 | 102,01 % |
| Citigroup Global Markets Limited | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 317.163 | 323.509 | 102,00 % |
| BNP Paribas | Frankreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 110.369 | 112.598 | 102,02 % |
| | | | 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 % |
| 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 % |

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

| Fonds Kontrahent | Gründungsland | Art der Sicherheit | Gesamt- wert der entlehnten Wertpapiere zum 31. Dezember 2021 | Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2021 | Wert der Sicherheiten als % der entlehnten Wertpapiere zum 31. Dezember 2021 |
|---|-----------------------------------|---|--|---|---|
| BNY Mellon Global Credit Fund Forts. | | | USD | USD | % |
| Deutsche Bank AG | Deutschland | G10-Länder ohne Belgien (Euroclear Triparty) | 8.962.298 | 9.176.713 | 102,39 % |
| Toronto Dominion Bank | Kanada | Euroclear Triparty - UK Gilts | 5.598.780 | 5.877.031 | 104,97 % |
| Toronto Dominion Bank | Kanada | Britische Gilts (Euroclear TriParty) | 2.956.651 | 3.015.592 | 101,99 % |
| Citigroup Global Markets Limited | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 5.056.444 | 5.188.377 | 102,61 % |
| Citigroup Global Markets Limited | Vereinigtes Königreich | Britische Gilts (Euroclear TriParty) | 542.611 | 553.343 | 101,98 % |
| HSBC Bank plc | Vereinigtes Königreich | Aktienindizes | 4.121.519 | 4.533.679 | 110,00 % |
| UBS AG | Schweiz | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 2.757.014 | 3.032.463 | 109,99 % |
| J.P. Morgan Securities plc | Vereinigtes Königreich | G10-Länder ohne Belgien (Euroclear Triparty) | 480.066 | 499.637 | 104,08 % |
| | | | 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 % |
| 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 % |

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 High Yield Bond Fund Forts. | | | USD | USD | % |
| Goldman Sachs International | Vereinigte Staaten von Amerika | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 695.413 | 730.293 | 105,02 % |
| Citigroup Global Markets Limited | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 652.114 | 665.159 | 102,00 % |
| UBS AG | Schweiz | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 455.311 | 464.482 | 102,01 % |
| Merrill Lynch International | Vereinigtes Königreich | G10-Schuldtitel (TriParty) | 424.663 | 445.981 | 105,02 % |
| Barclays Capital Inc | Vereinigte Staaten von Amerika | US-Staatsanleihen (Bilateral) | 408.068 | 416.818 | 102,14 % |
| Goldman Sachs & Company | Vereinigte Staaten von Amerika | US-Staatsanleihen (Bilateral) | 196.684 | 280.179 | 142,45 % |
| | | | 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 % |
| 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 (Euroclear TriParty) | 2.328.459 | 2.561.092 | 109,99 % |

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

| Fonds Kontrahent | Gründungsland | Art der Sicherheit | Gesamt- wert der entlehnten Wertpapiere zum 31. Dezember 2021 | Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2021 | Wert der Sicherheiten als % der entlehnten Wertpapiere zum 31. Dezember 2021 |
|---|-----------------------------------|---|--|---|---|
| BNY MELLON GLOBAL HORT-DATED HIGH YIELD BOND FUND Forts. | | | USD | USD | % |
| 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 % |
| 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) | 115.834 | 135.275 | 116,78 % |
| | | | 465.167.861 | 510.505.441 | 109,75 % |

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

| Fonds Kontrahent | Gründungsland | Art der Sicherheit | Gesamt- wert der entlehnten Wertpapiere zum 31. Dezember 2021 | Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2021 | Wert der Sicherheiten als % der entlehnten Wertpapiere zum 31. Dezember 2021 |
|--|-----------------------------------|---|--|---|---|
| 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 (Euroclear TriParty) | 218.051 | 228.988 | 105,02 % |
| UBS AG | Schweiz | G10-Schuldtitel (TriParty) | 1.152.562 | 1.252.517 | 108,67 % |
| UBS AG | Schweiz | Aktienindizes (TriParty) | 29.267 | 33.437 | 114,25 % |
| The Bank of Nova Scotia | Kanada | Aktienindizes (TriParty) | 1.157.691 | 1.274.375 | 110,08 % |
| Barclays Capital Securities Ltd. | Vereinigtes Königreich | Aktienindizes (TriParty) | 1.062.033 | 1.177.771 | 110,90 % |
| Citigroup Global Markets Limited | Vereinigtes Königreich | G10-Schuldtitel (TriParty) | 183.226 | 192.443 | 105,03 % |
| Citigroup Global Markets Limited | Vereinigtes Königreich | Aktienindizes (TriParty) | 870.702 | 957.798 | 110,00 % |
| HSBC Bank plc | Vereinigtes Königreich | Aktienindizes (TriParty) | 566.851 | 632.832 | 111,64 % |
| Societe Generale | Frankreich | Aktienindizes (TriParty) | 513.095 | 566.078 | 110,33 % |
| | | | 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 % |

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 U.S. Equity Income Fund Forts. | | | USD | USD | % |
| Barclays Bank PLC | Vereinigtes Königreich | US-Staatsanleihen (Bilateral) | 9.938 | 10.147 | 102,10 % |
| | | | 15.845.066 | 17.024.242 | 107,44 % |

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Der Wert der entliehenen Wertpapiere nach Kontrahenten sowie Wert und Art der von der Gesellschaft in Bezug auf diese Wertpapiere gehaltenen Sicherheiten stellte sich zum Donnerstag, 31. Dezember 2020 wie folgt dar:

| Fonds Kontrahent | Gründungsland | Art der Sicherheit | Gesamtwert der verlie- henen Wert- papiere am 31. Dezember 2020 | Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten am 31. Dezember 2020 | Wert der Sicherheiten als % der verliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020 |
|---|-----------------------------------|---|--|---|--|
| BNY Mellon Absolute Return Bond Fund | | | EUR | EUR | % |
| Societe Generale | Frankreich | Aktien/FTSE/S&P/NIKKEI | 15.624.834 | 17.187.478 | 110,00 % |
| Societe Generale | Frankreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 745.048 | 760.017 | 102,01 % |
| J.P. Morgan Securities plc | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 2.556.308 | 2.693.126 | 105,35 % |
| Barclays Bank PLC | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 2.192.308 | 2.274.901 | 103,77 % |
| Morgan Stanley & Co. International PLC | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 1.581.251 | 1.725.732 | 109,14 % |
| Deutsche Bank AG | Deutschland | G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty) | 1.319.321 | 1.372.572 | 104,04 % |
| Credit Suisse Securities (Europe) Limited | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 603.992 | 616.718 | 102,11 % |
| Credit Suisse Securities (Europe) Limited | Vereinigtes Königreich | G10-Schuldtitel (TriParty) | 571.977 | 600.699 | 105,02 % |
| UBS AG | Schweiz | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 805.323 | 848.675 | 105,38 % |
| Merrill Lynch International | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 319.306 | 325.898 | 102,06 % |
| Goldman Sachs International | Vereinigte Staaten von Amerika | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 210.444 | 223.366 | 106,14 % |
| BNP Paribas | Frankreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 185.498 | 195.957 | 105,64 % |
| | | | 26.715.610 | 28.825.139 | 107,90 % |

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

| Fonds Kontrahent | Gründungsland | Art der Sicherheit | Gesamt- wert der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020 | Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2020 | Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020 |
|--|--------------------------------|---|---|---|--|
| BNY Mellon Absolute Return Equity Fund | | | GBP | GBP | % |
| Citigroup Global Markets Limited | Vereinigtes Königreich | Britische Gilts (Euroclear TriParty) | 3.559.891 | 3.628.293 | 101,92 % |
| Citigroup Global Markets Limited | Vereinigtes Königreich | Aktienindizes (TriParty) | 160.720 | 176.904 | 110,07 % |
| Morgan Stanley & Co. International PLC | Vereinigtes Königreich | G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty) | 1.403.900 | 1.474.211 | 105,01 % |
| Morgan Stanley & Co. International PLC | Vereinigtes Königreich | G10-Schuldtitel (TriParty) | 62.856 | 66.301 | 105,48 % |
| | | | 5.187.367 | 5.345.709 | 103,05 % |
| BNY Mellon Absolute Return Global Convertibles Fund | | | EUR | EUR | % |
| Citigroup Global Markets Limited | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 1.995.276 | 2.035.188 | 102,00 % |
| | | | 1.995.276 | 2.035.188 | 102,00 % |
| BNY Mellon Asian Equity Fund | | | USD | USD | % |
| Citigroup Global Markets Inc | Vereinigtes Königreich | US-Staatsanleihen (Bilateral) | 1.735.568 | 1.789.343 | 103,10 % |
| Goldman Sachs International | Vereinigte Staaten von Amerika | G10-Schuldtitel (TriParty) | 1.478.452 | 1.556.859 | 105,30 % |
| | | | 3.214.020 | 3.346.202 | 104,11 % |
| BNY Mellon Blockchain Innovation Fund | | | USD | USD | % |
| Credit Suisse Securities (USA) LLC | Vereinigte Staaten von Amerika | US-Staatsanleihen (Bilateral) | 2.194.856 | 2.241.016 | 102,10 % |
| Merrill Lynch International | Vereinigtes Königreich | G10-Schuldtitel (TriParty) | 295.724 | 316.075 | 106,88 % |
| | | | 2.490.580 | 2.557.091 | 102,67 % |
| BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund | | | USD | USD | % |
| MUFG Securities EMEA plc | Vereinigtes Königreich | Aktienindizes (TriParty) | 4.964.031 | 5.460.531 | 110,00 % |
| J.P. Morgan Securities LLC | Vereinigte Staaten von Amerika | US-Staatsanleihen (Bilateral) | 982.469 | 1.002.436 | 102,03 % |
| ING Bank NV | Niederlande | Aktienindizes (TriParty) | 727.576 | 801.818 | 110,20 % |
| Citigroup Global Markets Limited | Vereinigtes Königreich | Aktienindizes (TriParty) | 483.377 | 532.050 | 110,07 % |
| Merrill Lynch International | Vereinigtes Königreich | G10-Schuldtitel (TriParty) | 431.506 | 461.202 | 106,88 % |
| Credit Suisse Securities (USA) LLC | Vereinigte Staaten von Amerika | US-Staatsanleihen (Bilateral) | 360.180 | 367.755 | 102,10 % |
| Barclays Bank PLC | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 217.000 | 228.295 | 105,21 % |
| Citigroup Global Markets Inc | Vereinigtes Königreich | US-Staatsanleihen (Bilateral) | 64.497 | 66.495 | 103,10 % |
| | | | 8.230.636 | 8.920.582 | 108,38 % |

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

| Fonds Kontrahent | Gründungsland | Art der Sicherheit | Gesamt- wert der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020 | Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2020 | Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020 |
|---|--------------------------------|---|---|---|--|
| BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund | | | USD | USD | % |
| Credit Suisse Securities (USA) LLC | Vereinigte Staaten von Amerika | US-Staatsanleihen (Bilateral) | 205.119 | 209.433 | 102,10 % |
| | | | 205.119 | 209.433 | 102,10 % |
| BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund | | | USD | USD | % |
| Credit Suisse Securities (USA) LLC | Vereinigte Staaten von Amerika | US-Staatsanleihen (Bilateral) | 104.544 | 106.742 | 102,10 % |
| | | | 104.544 | 106.742 | 102,10 % |
| BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund | | | USD | USD | % |
| Credit Suisse Securities (USA) LLC | Vereinigte Staaten von Amerika | US-Staatsanleihen (Bilateral) | 6.888.205 | 7.033.072 | 102,10 % |
| Goldman Sachs & Company | Vereinigte Staaten von Amerika | US-Staatsanleihen (Bilateral) | 3.872.670 | 3.952.166 | 102,05 % |
| | | | 10.760.875 | 10.985.238 | 102,08 % |
| BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund | | | USD | USD | % |
| Barclays Bank PLC | Vereinigtes Königreich | US-Staatsanleihen (Bilateral) | 9.971.457 | 10.190.468 | 102,20 % |
| Credit Suisse Securities (USA) LLC | Vereinigte Staaten von Amerika | US-Staatsanleihen (Bilateral) | 4.233.894 | 4.322.937 | 102,10 % |
| J.P. Morgan Securities LLC | Vereinigte Staaten von Amerika | US-Staatsanleihen (Bilateral) | 2.016.015 | 2.059.957 | 102,18 % |
| BNP Paribas Securities Corp. | Vereinigte Staaten von Amerika | US-Staatsanleihen (Bilateral) | 469.248 | 480.813 | 102,46 % |
| | | | 16.690.614 | 17.054.175 | 102,18 % |
| BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund | | | USD | USD | % |
| Credit Suisse Securities (Europe) Limited | Vereinigtes Königreich | G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty) | 2.465.442 | 2.590.824 | 105,09 % |
| Credit Suisse Securities (Europe) Limited | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 2.439.348 | 2.619.535 | 107,39 % |
| Citigroup Global Markets Limited | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 4.542.287 | 4.769.510 | 105,00 % |
| Morgan Stanley & Co. International PLC | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 4.447.970 | 4.904.164 | 110,26 % |
| Barclays Bank PLC | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 3.920.121 | 4.121.215 | 105,13 % |
| Barclays Bank PLC | Vereinigtes Königreich | US-Staatsanleihen (Bilateral) | 512.113 | 523.361 | 102,20 % |
| Deutsche Bank AG | Deutschland | G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty) | 2.962.046 | 3.110.414 | 105,01 % |
| BNP Paribas | Frankreich | G10-Schuldtitel (TriParty) | 1.841.688 | 1.933.791 | 105,00 % |

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

| Fonds Kontrahent | Gründungsland | Art der Sicherheit | Gesamt- wert der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020 | Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2020 | Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020 |
|---|--------------------------------|---|---|---|--|
| BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund Forts. | | | USD | USD | % |
| BNP Paribas | Frankreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 843.634 | 891.200 | 105,64 % |
| UBS AG | Schweiz | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 2.434.557 | 2.561.851 | 105,23 % |
| Goldman Sachs International | Vereinigte Staaten von Amerika | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 1.527.215 | 1.620.991 | 106,14 % |
| J.P. Morgan Securities plc | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 866.642 | 1.012.911 | 116,88 % |
| J.P. Morgan Securities plc | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 295.172 | 319.765 | 108,33 % |
| Credit Suisse Securities (USA) LLC | Vereinigte Staaten von Amerika | US-Staatsanleihen (Bilateral) | 836.746 | 854.344 | 102,10 % |
| Societe Generale | Frankreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 434.718 | 463.560 | 106,63 % |
| | | | 30.369.699 | 32.297.436 | 106,35 % |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund | | | USD | USD | % |
| Morgan Stanley & Co. International PLC | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 618.977 | 682.461 | 110,26 % |
| Credit Suisse Securities (Europe) Limited | Vereinigtes Königreich | G10-Schuldtitel (TriParty) | 457.104 | 480.059 | 105,02 % |
| Nomura International PLC | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 316.793 | 332.829 | 105,06 % |
| Credit Suisse Securities (USA) LLC | Vereinigte Staaten von Amerika | US-Staatsanleihen (Bilateral) | 213.319 | 217.806 | 102,10 % |
| | | | 1.606.193 | 1.713.155 | 106,66 % |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund | | | USD | USD | % |
| Deutsche Bank AG | Deutschland | G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty) | 665.963 | 699.321 | 105,01 % |
| J.P. Morgan Securities plc | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 245.436 | 265.885 | 108,33 % |
| | | | 911.399 | 965.206 | 105,90 % |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund | | | USD | USD | % |
| BNP Paribas | Frankreich | G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty) | 1.792.727 | 1.882.557 | 105,01 % |
| BNP Paribas | Frankreich | G10-Schuldtitel (TriParty) | 718.209 | 754.127 | 105,00 % |
| Barclays Bank PLC | Vereinigtes Königreich | G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty) | 1.013.833 | 1.064.249 | 104,97 % |
| Barclays Bank PLC | Vereinigtes Königreich | US-Staatsanleihen (Bilateral) | 448.759 | 458.615 | 102,20 % |

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

| Fonds Kontrahent | Gründungsland | Art der Sicherheit | Gesamt- wert der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020 | Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2020 | Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020 |
|--|-----------------------------------|---|---|---|--|
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund Forts. | | | USD | USD | % |
| Citigroup Global Markets Limited | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 609.989 | 640.503 | 105,00 % |
| | | | 4.583.517 | 4.800.051 | 104,72 % |
| BNY Mellon Euroland Bond Fund | | | EUR | EUR | % |
| Nomura International PLC | Vereinigtes Königreich | G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty) | 23.380.734 | 23.975.089 | 102,54 % |
| Nomura International PLC | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 2.197.198 | 2.241.286 | 102,01 % |
| BNP Paribas | Frankreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 5.577.965 | 5.689.776 | 102,00 % |
| BNP Paribas | Frankreich | G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty) | 1.498.449 | 1.561.204 | 104,19 % |
| Goldman Sachs International | Vereinigte Staaten von Amerika | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 5.908.957 | 6.028.727 | 102,03 % |
| Citigroup Global Markets Limited | Vereinigtes Königreich | G10-Schuldtitel (TriParty) | 5.018.776 | 5.119.721 | 102,01 % |
| Deutsche Bank AG | Deutschland | G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty) | 3.706.246 | 3.780.748 | 102,01 % |
| Morgan Stanley & Co. International PLC | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 2.318.028 | 2.555.770 | 110,26 % |
| J.P. Morgan Securities plc | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 1.219.092 | 1.268.373 | 104,04 % |
| J.P. Morgan Securities plc | Vereinigtes Königreich | G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty) | 650.557 | 676.972 | 104,06 % |
| J.P. Morgan Securities plc | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 304.833 | 356.283 | 116,88 % |
| RBC Europe Limited | Vereinigtes Königreich | G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty) | 1.739.702 | 1.826.899 | 105,01 % |
| UBS AG | Schweiz | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 1.475.473 | 1.554.901 | 105,38 % |
| Credit Suisse Securities (Europe) Limited | Vereinigtes Königreich | G10-Schuldtitel (TriParty) | 1.106.408 | 1.161.969 | 105,02 % |
| Credit Suisse Securities (USA) LLC | Vereinigte Staaten von Amerika | US-Staatsanleihen (Bilateral) | 969.650 | 990.043 | 102,10 % |
| Barclays Bank PLC | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 413.510 | 434.722 | 105,13 % |
| Societe Generale | Frankreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 313.541 | 319.841 | 102,01 % |
| | | | 57.799.119 | 59.542.324 | 103,02 % |

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

| Fonds Kontrahent | Gründungsland | Art der Sicherheit | Gesamt- wert der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020 | Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2020 | Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020 |
|---|--------------------------------|---|---|---|--|
| BNY Mellon European Credit Fund | | | EUR | EUR | % |
| Credit Suisse Securities (Europe) Limited | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 239.256 | 244.296 | 102,11 % |
| BNP Paribas | Frankreich | G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty) | 217.097 | 227.975 | 105,01 % |
| J.P. Morgan Securities plc | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 202.063 | 210.231 | 104,04 % |
| UBS AG | Schweiz | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 183.951 | 193.140 | 105,00 % |
| Citigroup Global Markets Limited | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 176.138 | 179.661 | 102,00 % |
| Deutsche Bank AG | Deutschland | G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty) | 106.584 | 108.727 | 102,01 % |
| Merrill Lynch International | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 106.435 | 108.633 | 102,06 % |
| | | | 1.231.524 | 1.272.663 | 103,34 % |
| BNY Mellon Global Bond Fund | | | USD | USD | % |
| HSBC Bank plc | Vereinigtes Königreich | Aktienindizes | 41.264.903 | 45.391.626 | 110,00 % |
| UBS AG | Schweiz | Aktienindizes | 23.473.371 | 25.824.760 | 110,02 % |
| BNP Paribas | Frankreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 6.050.749 | 6.172.038 | 102,00 % |
| BNP Paribas | Frankreich | G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty) | 5.757.476 | 5.996.616 | 104,15 % |
| Citigroup Global Markets Limited | Vereinigtes Königreich | Aktienindizes | 5.100.312 | 5.611.136 | 110,02 % |
| Citigroup Global Markets Limited | Vereinigtes Königreich | G10-Schuldtitel (TriParty) | 2.272.407 | 2.386.043 | 105,00 % |
| Deutsche Bank AG | Deutschland | G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty) | 6.737.736 | 6.951.080 | 103,17 % |
| Merrill Lynch International | Vereinigtes Königreich | Euroclear Triparty - Britische GILTS (set 11) | 1.134.541 | 1.190.309 | 104,92 % |
| | | | 91.791.495 | 99.523.608 | 108,42 % |
| BNY Mellon Global Credit Fund | | | USD | USD | % |
| J.P. Morgan Securities plc | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 39.166.013 | 40.749.280 | 104,04 % |
| UBS AG | Schweiz | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 2.974.776 | 3.134.914 | 105,38 % |
| UBS AG | Schweiz | Aktienindizes | 769.176 | 846.227 | 110,02 % |
| Morgan Stanley & Co. International PLC | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 3.723.244 | 4.105.109 | 110,26 % |
| Credit Suisse Securities (USA) LLC | Vereinigte Staaten von Amerika | US-Staatsanleihen (Bilateral) | 1.793.316 | 1.831.031 | 102,10 % |

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

| Fonds Kontrahent | Gründungsland | Art der Sicherheit | Gesamt- wert der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020 | Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2020 | Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020 |
|--|-----------------------------------|---|---|---|--|
| BNY Mellon Global Credit Fund Forts. | | | USD | USD | % |
| Deutsche Bank AG | Deutschland | G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty) | 1.287.700 | 1.352.201 | 105,01 % |
| Societe Generale | Frankreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 650.135 | 663.197 | 102,01 % |
| | | | 50.364.360 | 52.681.959 | 104,60 % |
| BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund | | | USD | USD | % |
| Citigroup Global Markets Limited | Vereinigtes Königreich | G10-Schuldtitel (TriParty) | 4.052.297 | 4.254.939 | 105,00 % |
| HSBC Bank plc | Vereinigtes Königreich | Aktienindizes | 4.031.025 | 4.434.150 | 110,00 % |
| Barclays Bank PLC | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 255.227 | 268.320 | 105,13 % |
| UBS AG | Schweiz | Aktienindizes | 20.180 | 22.202 | 110,02 % |
| | | | 8.358.729 | 8.979.611 | 107,43 % |
| BNY Mellon Global Emerging Markets Fund | | | USD | USD | % |
| Citigroup Global Markets Inc | Vereinigtes Königreich | US-Staatsanleihen (Bilateral) | 732.156 | 754.841 | 103,10 % |
| The Bank of Nova Scotia | Kanada | Aktienindizes (TriParty) | 441.661 | 485.895 | 110,02 % |
| J.P. Morgan Securities LLC | Vereinigte Staaten von Amerika | US-Staatsanleihen (Bilateral) | 345.698 | 352.724 | 102,03 % |
| | | | 1.519.515 | 1.593.460 | 104,87 % |
| BNY Mellon Global Equity Fund | | | USD | USD | % |
| BNP Paribas Arbitrage | Niederlande | Aktienindizes (TriParty) | 1.243.829 | 1.400.760 | 112,62 % |
| Barclays Capital Inc | Vereinigte Staaten von Amerika | US-Staatsanleihen (Bilateral) | 892.903 | 912.293 | 102,17 % |
| UBS AG | Schweiz | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 632.243 | 664.165 | 105,05 % |
| Morgan Stanley & Co. International PLC | Vereinigtes Königreich | Aktienindizes (TriParty) | 120.044 | 134.754 | 112,25 % |
| J.P. Morgan Securities LLC | Vereinigte Staaten von Amerika | US-Staatsanleihen (Bilateral) | 14.630 | 14.928 | 102,04 % |
| | | | 2.903.649 | 3.126.900 | 107,69 % |
| BNY Mellon Global Equity Income Fund | | | USD | USD | % |
| Barclays Bank PLC | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 4.433.307 | 4.664.077 | 105,21 % |
| Barclays Capital Securities Ltd. | Vereinigtes Königreich | G10-Schuldtitel (TriParty) | 772.074 | 895.598 | 116,00 % |
| | | | 5.205.381 | 5.559.675 | 106,81 % |
| BNY Mellon Global High Yield Bond Fund | | | USD | USD | % |
| Credit Suisse Securities (USA) LLC | Vereinigte Staaten von Amerika | US-Staatsanleihen (Bilateral) | 1.993.802 | 2.035.734 | 102,10 % |

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

| Fonds Kontrahent | Gründungsland | Art der Sicherheit | Gesamt- wert der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020 | Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2020 | Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020 |
|--|-----------------------------------|---|---|---|--|
| BNY Mellon Global High Yield Bond Fund Forts. | | | USD | USD | % |
| Barclays Bank PLC | Vereinigtes Königreich | US-Staatsanleihen (Bilateral) | 1.194.831 | 1.221.074 | 102,20 % |
| Barclays Bank PLC | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 529.601 | 556.769 | 105,13 % |
| Morgan Stanley & Co. International PLC | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 1.071.253 | 1.181.123 | 110,26 % |
| Credit Suisse Securities (Europe) Limited | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 941.643 | 992.077 | 105,36 % |
| RBC Europe Limited | Vereinigtes Königreich | G10-Länder ohne Belgien (Euroclear TriParty) | 652.828 | 685.549 | 105,01 % |
| Morgan Stanley & Co. LLC | Vereinigte Staaten von Amerika | US-Staatsanleihen (Bilateral) | 237.268 | 244.136 | 102,89 % |
| Goldman Sachs International | Vereinigte Staaten von Amerika | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 131.680 | 139.766 | 106,14 % |
| | | | 6.752.906 | 7.056.228 | 104,49 % |
| BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund | | | USD | USD | % |
| Citigroup Global Markets Limited | Vereinigtes Königreich | Aktienindizes (TriParty) | 9.553.228 | 10.515.181 | 110,07 % |
| | | | 9.553.228 | 10.515.181 | 110,07 % |
| BNY Mellon Global Opportunities Fund | | | USD | USD | % |
| Morgan Stanley & Co. International PLC | Vereinigtes Königreich | Aktienindizes (TriParty) | 8.750 | 9.822 | 112,25 % |
| | | | 8.750 | 9.822 | 112,25 % |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) | | | EUR | EUR | % |
| Barclays Capital Securities Ltd. | Vereinigtes Königreich | G10-Schuldtitel (TriParty) | 7.307.190 | 8.476.272 | 116,00 % |
| BNP Paribas Arbitrage | Niederlande | Aktienindizes (TriParty) | 988.041 | 1.112.700 | 112,62 % |
| HSBC Bank plc | Vereinigtes Königreich | Aktienindizes (TriParty) | 282.406 | 311.564 | 110,33 % |
| Morgan Stanley & Co. International PLC | Vereinigtes Königreich | Aktienindizes (TriParty) | 9.167 | 10.291 | 112,26 % |
| | | | 8.586.804 | 9.910.827 | 115,42 % |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP) | | | GBP | GBP | % |
| Barclays Capital Securities Ltd. | Vereinigtes Königreich | G10-Schuldtitel (TriParty) | 358.262 | 415.581 | 116,00 % |
| Morgan Stanley & Co. International PLC | Vereinigtes Königreich | Aktienindizes (TriParty) | 23.289 | 26.143 | 112,26 % |
| | | | 381.551 | 441.724 | 115,77 % |

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

| Fonds Kontrahent | Gründungsland | Art der Sicherheit | Gesamt- wert der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020 | Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2020 | Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020 |
|---|--------------------------------|---|---|---|--|
| BNY Mellon Global Real Return Fund (USD) | | | USD | USD | % |
| Morgan Stanley & Co. International PLC | Vereinigtes Königreich | Aktienindizes (TriParty) | 1.420.231 | 1.594.258 | 112,25 % |
| | | | 1.420.231 | 1.594.258 | 112,25 % |
| BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund | | | USD | USD | % |
| Morgan Stanley & Co. International PLC | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 10.804.701 | 11.673.906 | 108,04 % |
| Barclays Bank PLC | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 9.730.616 | 9.992.218 | 102,69 % |
| UBS AG | Schweiz | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 3.614.377 | 3.808.946 | 105,38 % |
| UBS AG | Schweiz | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 1.505.630 | 1.581.650 | 105,05 % |
| J.P. Morgan Securities plc | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 3.001.992 | 3.508.659 | 116,88 % |
| J.P. Morgan Securities plc | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 1.920.817 | 1.998.465 | 104,04 % |
| BNP Paribas | Frankreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 1.425.540 | 1.454.115 | 102,00 % |
| Credit Suisse Securities (Europe) Limited | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 665.265 | 679.282 | 102,11 % |
| Societe Generale | Frankreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 599.486 | 611.530 | 102,01 % |
| Citigroup Global Markets Limited | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 430.919 | 452.476 | 105,00 % |
| | | | 33.699.343 | 35.761.247 | 106,12 % |
| BNY Mellon Global Unconstrained Fund | | | USD | USD | % |
| J.P. Morgan Securities plc | Vereinigtes Königreich | Aktienindizes (TriParty) | 411.694 | 455.085 | 110,54 % |
| J.P. Morgan Securities LLC | Vereinigte Staaten von Amerika | US-Staatsanleihen (Bilateral) | 327.990 | 334.656 | 102,03 % |
| The Bank of Nova Scotia | Kanada | Aktienindizes (TriParty) | 203.366 | 223.734 | 110,02 % |
| Barclays Bank PLC | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 143.993 | 151.488 | 105,21 % |
| | | | 1.087.043 | 1.164.963 | 107,17 % |
| BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund | | | JPY | JPY | % |
| J.P. Morgan Securities plc | Vereinigtes Königreich | Aktienindizes (TriParty) | 406.278.481 | 449.098.123 | 110,54 % |
| Citigroup Global Markets Limited | Vereinigtes Königreich | G10-Schuldtitel (TriParty) | 19.589.229 | 20.574.591 | 105,03 % |
| Citigroup Global Markets Limited | Vereinigtes Königreich | Aktienindizes (TriParty) | 7.188.716 | 7.910.056 | 110,03 % |

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

| Fonds Kontrahent | Gründungsland | Art der Sicherheit | Gesamt- wert der entlehnten Wertpapiere zum 31. Dezember 2020 | Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2020 | Wert der Sicherheiten als % der entlehnten Wertpapiere zum 31. Dezember 2020 |
|--|--------------------------------|-------------------------------|--|---|---|
| BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Forts. | | | JPY | JPY | % |
| UBS AG | Schweiz | G10-Schuldtitel (TriParty) | 16.129.567 | 17.124.635 | 106,17 % |
| UBS AG | Schweiz | Aktienindizes (TriParty) | 8.486.838 | 9.548.300 | 112,51 % |
| The Bank of Nova Scotia | Kanada | Aktienindizes (TriParty) | 9.188.766 | 10.109.078 | 110,02 % |
| Merrill Lynch International | Vereinigtes Königreich | G10-Schuldtitel (TriParty) | 16.129.567 | 17.239.558 | 106,88 % |
| Deutsche Bank AG | Deutschland | Aktienindizes (TriParty) | 681.276 | 769.456 | 112,94 % |
| | | | 483.672.440 | 532.373.797 | 110,07 % |
| BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund | | | EUR | EUR | % |
| Morgan Stanley & Co. International PLC | Vereinigtes Königreich | Aktienindizes (TriParty) | 21.590.555 | 24.236.138 | 112,25 % |
| Citigroup Global Markets Limited | Vereinigtes Königreich | Aktienindizes (TriParty) | 8.976.869 | 9.880.786 | 110,07 % |
| HSBC Bank plc | Vereinigtes Königreich | G10-Schuldtitel (TriParty) | 232.692 | 244.654 | 105,14 % |
| Credit Suisse Securities (USA) LLC | Vereinigte Staaten von Amerika | US-Staatsanleihen (Bilateral) | 20.302 | 20.729 | 102,10 % |
| | | | 30.820.418 | 34.382.307 | 111,56 % |
| BNY Mellon Mobility Innovation Fund | | | USD | USD | % |
| UBS AG | Schweiz | Aktienindizes (TriParty) | 21.816.738 | 24.545.414 | 112,51 % |
| Credit Suisse Securities (USA) LLC | Vereinigte Staaten von Amerika | US-Staatsanleihen (Bilateral) | 16.756.515 | 17.108.924 | 102,10 % |
| ING Bank NV | Niederlande | Aktienindizes (TriParty) | 2.457.750 | 2.708.542 | 110,20 % |
| Merrill Lynch International | Vereinigtes Königreich | G10-Schuldtitel (TriParty) | 1.115.793 | 1.192.581 | 106,88 % |
| | | | 42.146.796 | 45.555.461 | 108,09 % |
| BNY Mellon Small Cap Euroland Fund | | | EUR | EUR | % |
| Citigroup Global Markets Limited | Vereinigtes Königreich | Aktienindizes (TriParty) | 2.221.324 | 2.444.783 | 110,06 % |
| Citigroup Global Markets Limited | Vereinigtes Königreich | G10-Schuldtitel (TriParty) | 205.374 | 215.705 | 105,03 % |
| Goldman Sachs International | Vereinigte Staaten von Amerika | G10-Schuldtitel (TriParty) | 1.369.786 | 1.442.429 | 105,30 % |
| Goldman Sachs International | Vereinigte Staaten von Amerika | Aktienindizes (TriParty) | 230.005 | 260.708 | 113,35 % |
| HSBC Bank plc | Vereinigtes Königreich | Aktienindizes (TriParty) | 1.202.177 | 1.326.305 | 110,33 % |
| HSBC Bank plc | Vereinigtes Königreich | G10-Schuldtitel (TriParty) | 185.350 | 194.879 | 105,14 % |
| The Bank of Nova Scotia | Kanada | Aktienindizes (TriParty) | 1.273.991 | 1.401.585 | 110,02 % |
| Morgan Stanley & Co. International PLC | Vereinigtes Königreich | Aktienindizes (TriParty) | 691.093 | 775.776 | 112,25 % |
| Morgan Stanley & Co. International PLC | Vereinigtes Königreich | G10-Schuldtitel (TriParty) | 20.845 | 21.987 | 105,48 % |
| Barclays Capital Securities Ltd. | Vereinigtes Königreich | Aktienindizes (TriParty) | 634.813 | 777.123 | 122,42 % |

14. EFFIZIENTE PORTFOLIOVERWALTUNG Forts.

| Fonds Kontrahent | Gründungsland | Art der Sicherheit | Gesamt- wert der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020 | Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2020 | Wert der Sicherheiten als % der entliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2020 |
|--|--------------------------------|---|---|---|--|
| BNY Mellon Small Cap Euroland Fund Forts. | | | EUR | EUR | % |
| BNP Paribas Arbitrage | Niederlande | Aktienindizes (TriParty) | 452.451 | 509.536 | 112,62 % |
| UBS AG | Schweiz | Aktienindizes (TriParty) | 238.092 | 267.870 | 112,51 % |
| Credit Suisse Securities (Europe) Limited | Vereinigtes Königreich | Aktienindizes (TriParty) | 188.397 | 224.553 | 119,19 % |
| Societe Generale | Frankreich | Aktienindizes (TriParty) | 101.008 | 111.125 | 110,02 % |
| Barclays Bank PLC | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 55.421 | 58.306 | 105,20 % |
| | | | 9.070.127 | 10.032.670 | 110,61 % |
| BNY Mellon U.S. Equity Income Fund | | | USD | USD | % |
| Citigroup Global Markets Inc | Vereinigtes Königreich | US-Staatsanleihen (Bilateral) | 4.182.733 | 4.312.331 | 103,10 % |
| Barclays Bank PLC | Vereinigtes Königreich | Staatsanleihen & Supranationale Anleihen (Euroclear TriParty) | 3.519.529 | 3.702.733 | 105,21 % |
| HSBC Bank plc | Vereinigtes Königreich | Aktienindizes (TriParty) | 3.046.768 | 3.361.354 | 110,33 % |
| UBS AG | Schweiz | Aktienindizes (TriParty) | 425.544 | 478.768 | 112,51 % |
| J.P. Morgan Securities LLC | Vereinigte Staaten von Amerika | US-Staatsanleihen (Bilateral) | 165.901 | 169.272 | 102,03 % |
| | | | 11.340.475 | 12.024.458 | 106,03 % |

15. NETTOINVENTARWERT

Der Nettoinventarwert jeder Anteilsklasse einlösbarer, partizipierender Anteile wird errechnet, indem das Nettovermögen der Anteilsklasse durch die Anzahl der einlösbaren, partizipierenden Anteile geteilt wird, die zum Ende des Geschäftsjahres im Umlauf sind.

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

Der veröffentlichte Nettoinventarwert jeder Klasse einlösbarer, partizipierender Anteile beträgt wie folgt:

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | 31. Dezember 2021 | 31. Dezember 2020 | 31. Dezember 2019 |
|---|---------------------------|------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| BNY Mellon Absolute Return Bond Fund | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | EUR | 420.833.229 | 420.597.176 | 397.342.232 |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse C | EUR | 99,4418 | 99,9810 | 99,6501 |
| | Klasse C (Inc)^ | EUR | – | 94,1383 | 94,9534 |
| | Klasse D (Acc) | EUR | – | – | 100,3946 |
| | Klasse R | EUR | 97,3616 | 98,2325 | 98,2485 |
| | Klasse R (Hedged) | USD | 107,0876 | 107,2566 | 105,9570 |
| | Klasse R (Inc) | EUR | 94,0972 | 95,0959 | 95,9159 |
| | Klasse S | EUR | 104,8799 | 105,2903 | 104,7596 |
| | Klasse S (Inc) | EUR | – | – | 95,5533 |
| | Klasse T (Hedged) | CHF | 93,8644 | 94,4961 | 94,4518 |
| | Klasse T (Hedged) | USD | 118,0047 | 117,6139 | 115,6893 |
| | Sterling T (Acc) (Hedged) | GBP | 112,1818 | 112,0080 | 111,0150 |
| | Klasse W (Acc) | EUR | 94,7722 | 95,3816 | 95,2036 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | USD | 103,5767 | 103,4283 | 101,7687 |
| | Klasse W (Inc) (Hedged) | USD | – | – | 99,7297 |
| | Sterling W (Acc) (Hedged) | GBP | 100,4564 | 100,5486 | 99,9024 |
| | Sterling W (Inc) (Hedged) | GBP | 96,0752 | 96,4175 | 96,8591 |
| | Klasse X | EUR | 112,3488 | 112,1810 | 111,0339 |
| | Klasse X (Acc) (Hedged) | USD | – | – | 105,1359 |
| | Sterling X (Acc) (Hedged) | GBP | 119,8551 | 119,0334 | 117,3278 |
| BNY Mellon Absolute Return Equity Fund | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | GBP | 123.705.871 | 241.339.578 | 371.503.339 |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse D (Acc) (Hedged) | EUR | 0,9387 | 0,9205 | 0,9195 |
| | Klasse R (Hedged) | CHF | 0,8867 | 0,8758 | 0,8828 |
| | Klasse R (Hedged) | EUR | 1,0555 | 1,0402 | 1,0442 |
| | Klasse R (Hedged) | USD | 1,0745 | 1,0506 | 1,0406 |
| | Klasse R (Inc) (Hedged) | EUR | 0,9199 | 0,9066 | 0,9101 |
| | Sterling R (Acc) | GBP | 1,1419 | 1,1177 | 1,1129 |
| | Sterling S (Acc) | GBP | 1,2044 | 1,1730 | 1,1621 |
| | Klasse T (Hedged) | EUR | 1,1119 | 1,0903 | 1,0892 |
| | Klasse T (Hedged) | USD | 1,1187 | 1,0907 | 1,0739 |
| | Klasse U (Hedged) | EUR | 0,9916 | 0,9709 | 0,9684 |
| | Klasse U (Hedged) | USD | 1,1077 | 1,0786 | 1,0614 |
| | Klasse U (Inc) (Hedged) | EUR | 0,9601 | 0,9400 | 0,9186 |
| | Sterling U (Acc) | GBP | 1,2177 | 1,1842 | 1,1714 |
| | Sterling X (Acc) | GBP | 1,3874 | 1,3369 | 1,3103 |

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | 31. Dezember 2021 | 31. Dezember 2020 | 31. Dezember 2019 |
|---|----------------------------|------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | EUR | 95.148.164 | 33.223.020 | 28.390.201 |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse F (Acc) | EUR | 1,0308 | 1,0218 | – |
| | Klasse F (Acc) (Hedged)^ | CHF | 1,0102 | – | – |
| | Klasse F (Acc) (Hedged) | USD | 1,1225 | 1,1040 | 1,0097 |
| | Sterling F (Acc) (Hedged) | GBP | 1,1083 | 1,0923 | 1,0038 |
| | Klasse R (Acc)^ | EUR | 1,0071 | – | – |
| | Klasse U (Acc) | EUR | 1,1024 | 1,0925 | 1,0142 |
| | Klasse U (Acc) (Hedged)^ | CHF | 1,0078 | – | – |
| | Klasse U (Acc) (Hedged) | USD | 1,1074 | 1,0911 | – |
| | Sterling U (Acc) (Hedged)^ | GBP | 1,0046 | – | 1,0208 |
| | Klasse X (Acc) | EUR | 1,1442 | 1,1231 | 1,0213 |
| | Sterling X (Acc) (Hedged)^ | GBP | 1,0019 | – | – |
| BNY Mellon Asia Rising Stars Fund** | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | USD | – | – | 8.283.563 |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse A (Acc) | USD | – | – | 1,2700 |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | SGD | – | – | 1,2346 |
| | Klasse W (Acc) | USD | – | – | 1,2997 |
| | Klasse X (Acc) | USD | – | – | 1,0953 |
| BNY Mellon Asian Equity Fund | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | USD | 58.824.565 | 66.360.687 | 38.173.739 |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse A | USD | 5,1788 | 5,7230 | 3,6442 |
| | Klasse A | EUR | 4,0312 | 4,1082 | 2,8596 |
| | Klasse B | USD | 5,6561 | 6,2193 | 3,9405 |
| | Klasse B | EUR | 2,1310 | 2,1609 | 1,4966 |
| | Klasse C | USD | 6,4812 | 7,0910 | 4,4703 |
| | Klasse C | EUR | 4,2687 | 4,3069 | 2,9682 |
| | Sterling C (Inc) | GBP | 4,2823 | 4,6261 | 3,0133 |
| | Klasse W | USD | 1,8220 | 1,9885 | 1,2505 |
| BNY Mellon Asian Income Fund | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | USD | 14.979.746 | 36.440.997 | 31.031.538 |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse A (Acc) | EUR | 1,5058 | 1,3413 | 1,3783 |
| | Klasse A (Inc)^ | USD | 0,9637 | – | – |
| | Klasse A (Inc) | EUR | 1,1907 | 1,0963 | 1,1674 |
| | Klasse B (Acc) | USD | 1,2888 | 1,2390 | 1,1590 |
| | Klasse C (Acc) | USD | 1,3974 | 1,3367 | 1,2440 |
| | Klasse W (Acc)^ | EUR | 1,0801 | – | – |
| | Klasse W (Inc) | EUR | 1,3241 | 1,2041 | 1,2661 |
| | Klasse W (Inc) | USD | 1,0915 | 1,0761 | 1,0352 |
| | Sterling W (Inc) | GBP | 1,3676 | 1,3314 | 1,3233 |

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | 31. Dezember 2021 | 31. Dezember 2020 | 31. Dezember 2019 |
|--|----------------------------|------------|-------------------|-------------------|--------------------|
| BNY Mellon Blockchain Innovation Fund | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | USD | 95.125.353 | 15.864.824 | 11.112.189 |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse A (Acc) | USD | 1,7039 | 1,5763 | 1,0907 |
| | Klasse A (Acc)^ | EUR | 0,8290 | – | – |
| | Klasse B (Acc)^ | USD | 0,9389 | – | – |
| | Klasse B (Inc)^ | SGD | 0,9412 | – | – |
| | Klasse C (Acc)^ | USD | 1,0015 | – | – |
| | Klasse E (Acc) | USD | 1,7913 | 1,6349 | 1,1161 |
| | Klasse E (Acc) | EUR | 1,7848 | 1,5181 | 1,1287 |
| | Sterling E (Acc) (Hedged)^ | GBP | 0,9637 | – | – |
| | Klasse E (Inc) | USD | – | – | 1,0566 |
| | Klasse G (Acc) | USD | 1,3680 | 1,2536 | – |
| | Klasse G (Acc)^ | EUR | 1,0042 | – | – |
| | Klasse G (Acc) (Hedged)^ | EUR | 0,8894 | – | – |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | EUR | 1,6116 | 1,5088 | 1,0686 |
| | Klasse I (Acc) (Hedged)^ | EUR | 0,9957 | – | – |
| | Klasse K (Acc) | USD | 1,7460 | 1,6080 | 1,1076 |
| | Klasse K (Acc) | EUR | 1,7399 | 1,4933 | 1,1203 |
| | Klasse W (Acc) | USD | 1,7812 | 1,6289 | 1,1142 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged)^ | EUR | 0,9984 | – | – |
| BNY Mellon Brazil Equity Fund | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | USD | 42.616.239 | 70.198.270 | 105.594.026 |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse A | USD | 0,9326 | 1,0597 | 1,3152 |
| | Klasse A | EUR | 1,1441 | 1,1974 | 1,6321 |
| | Klasse B | USD | 0,8054 | 0,9107 | 1,1248 |
| | Klasse B | EUR | 1,0070 | 1,0486 | 1,4216 |
| | Sterling B (Acc) | GBP | 0,8891 | 0,9966 | 1,2788 |
| | Klasse C | USD | 1,0753 | 1,2096 | 1,4872 |
| | Klasse C | EUR | 1,3220 | 1,3697 | 1,8476 |
| | Sterling C (Inc) | GBP | 1,0464 | 1,1714 | 1,5174 |
| | Klasse G (Acc) | USD | – | – | 1,2899 |
| | Klasse G (Acc) | EUR | 0,9304 | 0,9640 | 1,3014 |
| | Klasse G (Acc) (Hedged) | EUR | – | – | 1,2167 |
| | Klasse H (Hedged) | EUR | 0,7899 | 0,9092 | 1,1666 |
| | Klasse I (Acc) (Hedged) | EUR | 0,7683 | 0,8756 | 1,1116 |
| | Klasse W (Acc) | USD | 0,9372 | 1,0517 | 1,2895 |
| | Klasse W (Acc) | EUR | 1,0821 | 1,1184 | 1,5059 |
| | Sterling W (Acc) | GBP | 1,1199 | 1,2458 | 1,5866 |

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

| Fonds | Anteilstklasse | Währung | 31. Dezember 2021 | 31. Dezember 2020 | 31. Dezember 2019 |
|---|----------------------------|------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund* | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | USD | 24.751.005 | – | – |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse A (Acc)^ | USD | 0,9885 | – | – |
| | Klasse C (Acc)^ | USD | 0,9898 | – | – |
| | Klasse E (Acc)^ | USD | 0,9904 | – | – |
| | Klasse E (Acc) (Hedged)^ | EUR | 0,9891 | – | – |
| | Sterling E (Acc) (Hedged)^ | GBP | 0,9896 | – | – |
| | Klasse W (Acc)^ | USD | 0,9900 | – | – |
| | Klasse W (Acc) (Hedged)^ | EUR | 0,9888 | – | – |
| | Sterling W (Acc) (Hedged)^ | GBP | 0,9893 | – | – |
| | Klasse X (Acc)^ | USD | 0,9907 | – | – |
| | Klasse X (Acc) (Hedged)^ | EUR | 0,9895 | – | – |
| | Sterling X (Acc) (Hedged)^ | GBP | 0,9900 | – | – |
| BNY Mellon Dynamic Total Return Fund* | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | USD | – | 16.366.070 | 26.474.856 |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse A (Acc)^ | USD | – | 1,0238 | 1,0261 |
| | Klasse C (Acc)^ | USD | – | 1,0833 | 1,0748 |
| | Klasse E (Acc)^ | USD | – | 1,0872 | 1,0732 |
| | Klasse H (Acc) (Hedged)^ | EUR | – | 0,9305 | 0,9481 |
| | Klasse W (Acc)^ | USD | – | 1,0977 | 1,0865 |
| | Klasse X (Acc)^ | USD | – | 1,1489 | 1,1279 |
| BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | USD | 645.924.114 | 536.212.842 | 181.632.588 |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse A (Acc) | EUR | 1,1191 | 1,0962 | 1,0095 |
| | Klasse A (Inc) | USD | 1,9816 | 1,5338 | 1,3057 |
| | Klasse C (Acc) | USD | 2,0205 | 1,5572 | 1,3172 |
| | Klasse E (Acc) | USD | – | – | 1,3273 |
| | Klasse G (Acc) | USD | 1,5627 | 1,2045 | 1,0188 |
| | Klasse G (Acc) | EUR | 1,5263 | 1,0964 | 1,0096 |
| | Klasse G (Acc) (Hedged) | EUR | 1,4319 | 1,1154 | – |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | EUR | 1,6630 | 1,2975 | 1,1249 |
| | Klasse W (Acc) | USD | 2,0359 | 1,5660 | 1,3220 |
| | Klasse W (Acc) | EUR | 1,8063 | 1,2948 | 1,1905 |
| | Klasse W (Inc) | EUR | 1,4741 | 1,0623 | – |
| | Sterling W (Acc)^ | GBP | 1,0756 | – | 1,3060 |
| | Klasse X (Acc) | USD | 2,0752 | 1,5893 | 1,3357 |

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

| Fonds | Anteilstklasse | Währung | 31. Dezember 2021 | 31. Dezember 2020 | 31. Dezember 2019 |
|---|----------------------------|------------|--------------------|-------------------|-------------------|
| BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund** | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | USD | 191.298.660 | 26.335.612 | – |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse A (Acc) | USD | 1,0806 | 1,0498 | – |
| | Klasse A (Inc) | USD | 1,0315 | 1,0479 | – |
| | Klasse C (Acc) | USD | 1,0820 | 1,0501 | – |
| | Klasse C (Inc) | USD | 1,0327 | 1,0483 | – |
| | Klasse E (Acc) | USD | 1,0848 | 1,0507 | – |
| | Klasse E (Acc) (Hedged) | EUR | 1,0719 | 1,0471 | – |
| | Sterling E (Acc) (Hedged) | GBP | 1,0804 | 1,0488 | – |
| | Klasse E (Inc) | USD | 1,0354 | 1,0488 | – |
| | Klasse E (Inc) (Hedged) | EUR | 1,0225 | 1,0453 | – |
| | Sterling E (Inc) (Hedged) | GBP | 1,0316 | 1,0470 | – |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | EUR | 1,0672 | 1,0462 | – |
| | Klasse H (Inc) (Hedged) | EUR | 1,0186 | 1,0444 | – |
| | Klasse W (Acc) | USD | 1,0834 | 1,0504 | – |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | DKK | 10,6971 | 10,4666 | – |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | EUR | 1,0700 | 1,0468 | – |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | NOK | 10,7907 | 10,4793 | – |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | SEK | 10,7387 | 10,4696 | – |
| | Sterling W (Acc) (Hedged) | GBP | 1,0790 | 1,0485 | – |
| | Klasse W (Inc) | USD | 1,0341 | 1,0485 | – |
| | Klasse W (Inc) (Hedged) | EUR | 1,0211 | 1,0450 | – |
| | Sterling W (Inc) (Hedged) | GBP | 1,0303 | 1,0467 | – |
| | Klasse X (Acc) | USD | 1,0867 | 1,0511 | – |
| BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund** | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | USD | 20.691.305 | 44.168.089 | – |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse A (Acc) | USD | 1,0507 | 1,0608 | – |
| | Sterling L (Acc) (Hedged) | GBP | 1,0441 | 1,0526 | – |
| | Klasse W (Acc) | USD | 1,0543 | 1,0621 | – |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | EUR | 1,0315 | 1,0488 | – |
| | Sterling W (Acc) (Hedged)^ | GBP | – | 1,0512 | – |
| | Klasse X (Acc)^ | USD | – | 1,0137 | – |

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | 31. Dezember 2021 | 31. Dezember 2020 | 31. Dezember 2019 |
|--|----------------------------|------------|----------------------|----------------------|--------------------|
| BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund** | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | USD | 1.921.308.172 | 1.203.350.910 | – |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse A (Acc) | USD | 1,1395 | 1,0849 | – |
| | Klasse C (Acc) | USD | 1,1417 | 1,0853 | – |
| | Klasse C (Inc)^ | USD | 1,0187 | – | – |
| | Klasse E (Acc) (Hedged)^ | EUR | 1,0424 | – | – |
| | Klasse I (Acc) (Hedged)^ | EUR | 1,0400 | – | – |
| | Klasse N (Acc)^ | USD | 1,0068 | – | – |
| | Klasse N (Acc) (Hedged)^ | EUR | 1,0033 | – | – |
| | Klasse N (Inc) (M)^ | USD | 0,9956 | – | – |
| | Klasse W (Acc) | USD | 1,1439 | 1,0858 | – |
| | Klasse W (Acc) (Hedged)^ | EUR | 1,0413 | – | – |
| | Klasse W (Inc)^ | USD | 1,0264 | – | – |
| | Klasse W (Inc) (Hedged) | EUR | 1,0830 | 1,0817 | – |
| | Klasse X (Acc) | USD | 1,1488 | 1,0868 | – |
| | Sterling X (Acc) (Hedged) | GBP | 1,1434 | 1,0846 | – |
| | Klasse X (Inc) | USD | 1,1008 | 1,0863 | – |
| | Sterling X (Inc) (Hedged) | GBP | 1,0072 | 1,0840 | – |
| BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | USD | 726.611.703 | 770.676.813 | 716.491.768 |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse A (Inc) | USD | 0,9625 | 0,9716 | 0,9923 |
| | Klasse A (Inc) | EUR | 0,9988 | 0,9396 | 1,0451 |
| | Klasse C (Acc) | USD | 1,2401 | 1,1813 | 1,1279 |
| | Klasse C (Inc)^ | USD | – | 1,1172 | – |
| | Klasse E (Acc) (Hedged) | EUR | 1,1418 | 1,0946 | 1,0638 |
| | Sterling E (Acc) (Hedged) | GBP | 1,1828 | 1,1267 | 1,0927 |
| | Sterling E (Inc) (Hedged)^ | GBP | – | 0,9812 | 1,0276 |
| | Klasse G (Acc) (Hedged) | EUR | 1,1134 | 1,0701 | – |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | EUR | 1,0927 | 1,0510 | 1,0327 |
| | Klasse K (Acc) | USD | 1,2108 | 1,1532 | 1,1013 |
| | Klasse K (Acc) (Hedged) | EUR | 1,1293 | 1,0851 | 1,0565 |
| | Klasse L (Acc) | USD | 1,2184 | 1,1584 | 1,1042 |
| | Klasse L (Acc) (Hedged) | EUR | 1,1360 | 1,0895 | 1,0587 |
| | Sterling L (Acc) (Hedged) | GBP | 1,1033 | 1,0517 | 1,0197 |
| | Sterling L (Inc) (Hedged) | GBP | 0,9558 | 0,9643 | 0,9995 |
| | Klasse W (Acc) | USD | 1,2448 | 1,1843 | 1,1298 |
| | Sterling W (Acc) (Hedged)^ | GBP | – | 1,0606 | 1,0291 |
| | Klasse W (Inc) | USD | 1,0726 | 1,0806 | – |
| | Klasse W (Inc) (Hedged) | EUR | 0,8855 | 0,9001 | 0,9355 |
| | Sterling W (Inc) (hedged) | GBP | 1,0672 | 1,0775 | – |
| | Klasse X (Acc) | USD | 1,0172 | 1,1897 | 1,1323 |
| | Sterling X (Acc) (Hedged)^ | GBP | – | 1,1673 | – |
| | Sterling X (Inc) (Hedged)^ | GBP | 1,0086 | – | – |
| | Klasse X (Inc)^ | USD | – | 1,1420 | – |

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | 31. Dezember 2021 | 31. Dezember 2020 | 31. Dezember 2019 |
|--|----------------------------|------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | USD | 554.266.191 | 392.457.935 | 360.120.657 |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse A | USD | 148,8118 | 152,7282 | 142,4403 |
| | Klasse A | EUR | 167,0360 | 158,0924 | 161,1662 |
| | Klasse A (Inc)^ | USD | – | 110,4029 | – |
| | Klasse A (Inc) (M) | HKD | 1.032,1792 | 1.083,0567 | – |
| | Klasse B | USD | 164,9561 | 168,8745 | 157,0770 |
| | Klasse C | USD | 170,0873 | 173,4325 | 160,7062 |
| | Klasse C | EUR | 189,8492 | 178,4712 | 180,9051 |
| | Klasse G (Inc) | USD | 99,8756 | 105,5549 | 102,4094 |
| | Klasse H (Hedged) | EUR | 132,9036 | 137,5639 | 130,9446 |
| | Klasse I (Hedged) | EUR | 140,4363 | 144,4120 | 136,5029 |
| | Klasse W | USD | 173,3326 | 176,3701 | 163,1225 |
| | Klasse W | EUR | 202,8604 | 190,3746 | 192,4222 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | CHF | 112,3116 | 115,5095 | 109,3395 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | EUR | 108,2557 | 111,0868 | 104,7770 |
| | Klasse W (Inc) (Hedged) | CHF | 99,0615 | 105,8527 | 105,1012 |
| | Klasse W (Inc) (Hedged) | EUR | 92,2053 | 98,2949 | 97,2623 |
| | Sterling W (Acc) (Hedged) | GBP | 156,0680 | 159,1680 | 149,8278 |
| | Sterling W (Inc) (Hedged) | GBP | – | – | 103,2061 |
| | Klasse X | USD | 191,2988 | 193,3003 | 177,5334 |
| | Sterling X (Acc) (Hedged)^ | GBP | – | 118,6679 | 110,9318 |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | USD | 33.134.900 | 39.274.388 | 52.672.790 |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse A | USD | 2,4303 | 2,4936 | 2,3965 |
| | Klasse A | EUR | 2,1347 | 2,0411 | 2,1365 |
| | Klasse C | USD | 2,6399 | 2,6951 | 2,5787 |
| | Klasse C | EUR | 2,3139 | 2,2015 | 2,2929 |
| | Klasse C (Inc) | USD | 0,8047 | 0,8531 | 0,8483 |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | EUR | 1,1753 | 1,2169 | 1,1938 |
| | Klasse W | USD | 1,3378 | 1,3624 | 1,2998 |
| | Klasse X (Inc) | USD | 1,0020 | 1,0624 | 1,0569 |

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | 31. Dezember 2021 | 31. Dezember 2020 | 31. Dezember 2019 |
|---|---------------------------|------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | USD | 113.559.730 | 164.668.641 | 464.566.692 |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse A | USD | 1,0262 | 1,1322 | 1,1309 |
| | Klasse A | EUR | 1,1221 | 1,1537 | 1,2551 |
| | Klasse A (Inc) | USD | 0,4827 | 0,5573 | 0,5824 |
| | Klasse A (Inc) | EUR | 0,6896 | 0,7420 | 0,8446 |
| | Sterling A (Acc) | GBP | 0,9902 | 1,0813 | 1,1152 |
| | Sterling B (Acc) | GBP | 1,0276 | 1,1199 | 1,1521 |
| | Klasse C | USD | 1,3751 | 1,5096 | 1,5015 |
| | Klasse C | EUR | 1,2097 | 1,2376 | 1,3397 |
| | Klasse C (Inc) | USD | 0,5179 | 0,5980 | 0,6252 |
| | Klasse C (Inc) | EUR | 0,6487 | 0,6980 | 0,7946 |
| | Sterling C (Acc) | GBP | 1,5068 | 1,6378 | 1,6807 |
| | Sterling C (Inc) | GBP | 0,7591 | 0,8675 | 0,9362 |
| | Klasse H (Hedged) | EUR | 0,8395 | 0,9363 | 0,9567 |
| | Klasse I (Hedged) | EUR | 0,8606 | 0,9552 | 0,9709 |
| | Sterling J (Inc) (Hedged) | GBP | 0,4342 | 0,5036 | 0,5360 |
| | Klasse W | USD | 0,8298 | 0,9076 | 0,8990 |
| | Klasse W | EUR | 0,9420 | 0,9603 | 1,0359 |
| | Klasse W (Hedged) | EUR | 0,7627 | 0,8433 | 0,8540 |
| | Klasse W (Inc) | EUR | 0,5684 | 0,6116 | 0,6964 |
| | Klasse W (Inc) (Hedged) | EUR | 0,6570 | 0,7674 | 0,8229 |
| | Sterling W (Inc) | GBP | 0,5926 | 0,6773 | 0,7311 |
| | Sterling W (Inc) (Hedged) | GBP | 0,4854 | 0,5631 | 0,5997 |
| | Klasse X | USD | – | – | 1,7284 |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | USD | 27.883.288 | 28.263.991 | 29.585.251 |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse A | EUR | 1,2650 | 1,2572 | 1,3204 |
| | Klasse C | USD | 1,1138 | 1,1819 | 1,1341 |
| | Klasse W (Acc) | USD | 1,0609 | 1,1217 | 1,0727 |
| | Klasse X (Inc) | USD | 0,9274 | 1,0281 | 1,0323 |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | USD | 125.677.325 | 165.595.940 | 151.635.419 |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse A (Acc) | USD | 1,0075 | 1,0989 | 1,0325 |
| | Klasse E (Inc) | USD | – | – | 0,9452 |
| | Sterling E (Inc) (Hedged) | GBP | 0,8887 | 1,0255 | 1,0349 |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | EUR | 0,9663 | 1,0647 | 1,0225 |
| | Klasse W (Acc) | USD | 1,0262 | 1,1142 | 1,0423 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | EUR | 0,9327 | 1,0226 | 0,9778 |
| | Sterling W (Acc) (Hedged) | GBP | 0,9451 | 1,0295 | 0,9813 |
| | Klasse X (Acc) | USD | 1,0508 | 1,1344 | 1,0553 |

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | 31. Dezember 2021 | 31. Dezember 2020 | 31. Dezember 2019 |
|--|--------------------------|------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| BNY Mellon Euroland Bond Fund | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | EUR | 275.922.173 | 442.908.116 | 890.225.293 |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse A | EUR | 1,9885 | 2,0677 | 1,9753 |
| | Klasse A (Inc) | EUR | 1,2026 | 1,2534 | 1,2057 |
| | Klasse B | EUR | 1,4026 | 1,4550 | 1,3866 |
| | Klasse B (Inc) | EUR | 1,2096 | 1,2606 | 1,2126 |
| | Klasse C | EUR | 2,1781 | 2,2535 | 2,1420 |
| | Klasse C (Inc) | EUR | 1,3140 | 1,3693 | 1,3172 |
| | Klasse G (Acc) | EUR | 1,0600 | 1,0968 | 1,0428 |
| | Klasse H (Hedged) | CHF | 1,2629 | 1,3170 | 1,2627 |
| | Klasse I (Hedged) | CHF | 1,3490 | 1,3998 | 1,3354 |
| | Klasse S | EUR | 1,2188 | 1,2599 | 1,1964 |
| | Klasse W (Acc) | EUR | 1,1034 | 1,1410 | 1,0840 |
| BNY Mellon European Credit Fund | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | EUR | 40.738.209 | 40.498.739 | 82.434.065 |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse A | EUR | 125,9258 | 126,7630 | 123,8809 |
| | Klasse C | EUR | 131,6104 | 131,8246 | 128,1852 |
| | Klasse W (Acc) | EUR | 109,3006 | 109,3689 | 106,2977 |
| | Klasse X | EUR | 138,1121 | 137,5919 | 133,0672 |
| BNY Mellon Future Earth Fund* | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | USD | 2.164.937 | – | – |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse A (Acc)^ | USD | 1,0853 | – | – |
| | Klasse B (Acc)^ | USD | 1,0900 | – | – |
| | Klasse C (Acc)^ | USD | 1,0953 | – | – |
| | Klasse E (Acc)^ | EUR | 1,1994 | – | – |
| | Klasse H (Acc) (Hedged)^ | EUR | 1,0732 | – | – |
| | Klasse I (Acc) (Hedged)^ | EUR | 1,0832 | – | – |
| | Klasse W (Acc)^ | USD | 1,0975 | – | – |
| | Klasse W (Acc) (Hedged)^ | EUR | 1,0853 | – | – |
| BNY Mellon Future Food Fund* | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | USD | 2.766.825 | – | – |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse E (Acc)^ | EUR | 1,2030 | – | – |
| | Klasse W (Acc)^ | USD | 1,1111 | – | – |
| BNY Mellon Future Life Fund* | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | USD | 2.351.576 | – | – |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse E (Acc)^ | EUR | 1,2831 | – | – |
| | Klasse W (Acc)^ | USD | 1,1722 | – | – |

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | 31. Dezember 2021 | 31. Dezember 2020 | 31. Dezember 2019 |
|--------------------------------------|---------------------------|------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| BNY Mellon Global Bond Fund | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | USD | 434.682.361 | 614.883.298 | 585.157.899 |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse A | USD | 2,3579 | 2,5588 | 2,3299 |
| | Klasse A | EUR | 1,8584 | 1,8599 | 1,8513 |
| | Klasse B | USD | 2,4208 | 2,6233 | 2,3850 |
| | Klasse C | USD | 2,5813 | 2,7872 | 2,5251 |
| | Klasse C | EUR | 2,0471 | 2,0384 | 2,0189 |
| | Klasse C (Inc) | USD | 0,9813 | 1,0657 | 0,9738 |
| | Sterling C (Inc) | GBP | 1,4532 | 1,5595 | 1,4735 |
| | Klasse H (Hedged) | EUR | 1,2109 | 1,3274 | 1,2316 |
| | Klasse I (Hedged) | EUR | 1,2892 | 1,4063 | 1,2981 |
| | Klasse I (Acc) (Hedged)^ | AUD | 0,9330 | – | – |
| | Klasse W (Acc) | USD | 1,1011 | 1,1878 | 1,0751 |
| | Klasse W (Acc) | EUR | 1,0196 | 1,1005 | 1,0889 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | EUR | – | – | 0,9887 |
| | Klasse X | USD | 2,7510 | 2,9542 | 2,6617 |
| | Sterling Z (Acc) (Hedged) | GBP | 1,0071 | 1,0891 | – |
| | Sterling Z (Inc) (Hedged) | GBP | 0,9953 | 1,0852 | – |
| BNY Mellon Global Credit Fund | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | USD | 442.961.954 | 803.381.804 | 462.784.533 |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse A (Acc) | USD | 1,0380 | 1,0487 | – |
| | Klasse A (Inc) (Q)^ | USD | – | 1,0415 | – |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | EUR | 1,1815 | 1,2044 | 1,0985 |
| | Klasse W (Acc) | USD | 1,3782 | 1,3844 | 1,2310 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged)^ | EUR | – | 1,0421 | – |
| | Sterling W (Acc) (Hedged) | GBP | 1,2914 | 1,2999 | 1,1740 |
| | Klasse X (Acc) | USD | 1,3996 | 1,3991 | 1,2385 |
| | Klasse X (Acc)^ | JPY | 103,6889 | – | – |
| | Klasse X (Acc) (Hedged) | CAD | 1,3715 | 1,3727 | 1,2239 |
| | Klasse X (Acc) (Hedged)^ | JPY | 99,1545 | – | – |

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

| Fonds | Anteilstklasse | Währung | 31. Dezember 2021 | 31. Dezember 2020 | 31. Dezember 2019 |
|--|----------------------------|------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | USD | 432.993.493 | 498.134.113 | 496.274.784 |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse A | USD | 1,2881 | 1,3073 | 1,2631 |
| | Klasse A | EUR | 1,3242 | 1,2393 | 1,3090 |
| | Klasse A (Inc) | USD | 1,0732 | 1,0968 | 1,0664 |
| | Klasse C | USD | 1,3850 | 1,3984 | 1,3445 |
| | Klasse G (Acc) | EUR | 1,1554 | 1,0759 | 1,1308 |
| | Klasse H (Hedged) | EUR | 1,0271 | 1,0512 | 1,0312 |
| | Klasse H (Acc) (Hedged)^ | NOK | – | 10,3633 | 10,1020 |
| | Klasse H (Inc) (Hedged) | EUR | 0,9274 | 0,9560 | 0,9437 |
| | Klasse I (Hedged) | EUR | 1,0769 | 1,0968 | 1,0715 |
| | Klasse I (Acc) (Hedged)^ | SGD | 1,0000 | – | – |
| | Klasse I (Inc) (Hedged) | EUR | 0,9283 | 0,9569 | 0,9461 |
| | Klasse W | USD | 1,1950 | 1,2035 | 1,1542 |
| | Klasse W (Hedged) | EUR | 1,0633 | 1,0800 | 1,0514 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged)^ | CHF | – | 1,0442 | 1,0201 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged)^ | NOK | – | 10,4829 | 10,1423 |
| | Klasse W (Inc) (Hedged) | EUR | 0,9654 | 0,9951 | 0,9823 |
| | Sterling W (Acc) (Hedged) | GBP | 1,1334 | 1,1441 | 1,1076 |
| | Sterling W (Inc) (Hedged)^ | GBP | – | 1,0179 | – |
| | Klasse X (Acc) (Hedged) | JPY | 102,8088 | 103,4345 | 99,9375 |
| | Klasse X (Inc) (Hedged) | JPY | 99,1286 | 101,7894 | – |
| | Klasse Z (Acc)^ | USD | – | 1,0017 | – |
| | Klasse Z (Inc)^ | USD | – | 1,0017 | – |
| | Sterling Z (Acc) | GBP | 0,9917 | 0,9849 | 0,9745 |
| | Sterling Z (Inc) | GBP | 0,9630 | 0,9718 | 0,9745 |
| | Sterling Z (Acc) (Hedged) | GBP | 1,0191 | 1,0270 | – |
| | Sterling Z (Inc) (Hedged) | GBP | 0,9940 | 1,0182 | – |

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

| Fonds | Anteilstklasse | Währung | 31. Dezember 2021 | 31. Dezember 2020 | 31. Dezember 2019 |
|--|--------------------------|------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| BNY Mellon Global Emerging Markets Fund | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | USD | 53.039.682 | 54.195.828 | 33.193.624 |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse A | USD | 1,4299 | 1,5287 | 0,9898 |
| | Klasse A | EUR | 1,7384 | 1,7136 | 1,2113 |
| | Klasse A (Inc) | EUR | 1,5395 | 1,5175 | 1,0726 |
| | Klasse B (Acc)^ | USD | – | 1,8762 | – |
| | Klasse B (Acc)^ | EUR | – | 1,6827 | – |
| | Klasse B (Inc) | USD | 1,4397 | 1,5313 | 0,9850 |
| | Klasse B (Inc) | EUR | 1,6172 | 1,5861 | 1,1155 |
| | Klasse C | USD | 1,7221 | 1,8224 | 1,1667 |
| | Klasse C (Acc) | USD | 1,8993 | 2,0099 | 1,2867 |
| | Klasse C (Acc)^ | EUR | – | 1,6891 | – |
| | Klasse C (Inc) | USD | 1,5052 | 1,5929 | 1,0193 |
| | Sterling C (Inc)^ | GBP | – | 1,6859 | – |
| | Klasse E (Acc) | USD | 1,9021 | 2,0024 | 1,2767 |
| | Klasse E (Acc) | CHF | 1,6632 | 1,6893 | 1,1810 |
| | Klasse G (Acc) (Hedged) | EUR | – | – | 0,8871 |
| | Klasse H (Hedged) | EUR | 1,2765 | 1,3794 | 0,9104 |
| | Klasse I (Hedged) | EUR | 1,3978 | 1,4956 | 0,9771 |
| | Klasse W (Acc) | USD | 2,2167 | 2,3400 | 1,4996 |
| | Klasse W (Acc) | EUR | 1,5235 | 1,4830 | 1,0353 |
| | Klasse W (Inc) | USD | 1,5257 | 1,6105 | 1,0293 |
| | Klasse W (Inc) | EUR | 1,6836 | 1,6389 | 1,1448 |
| BNY Mellon Global Equity Fund | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | USD | 505.772.156 | 439.208.591 | 371.812.812 |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse A | USD | 3,5434 | 3,0414 | 2,6195 |
| | Klasse A | EUR | 2,8236 | 2,2352 | 2,1046 |
| | Klasse B | USD | 3,8553 | 3,2929 | 2,8220 |
| | Klasse B | EUR | 3,3752 | 2,6586 | 2,4906 |
| | Klasse C | USD | 4,2305 | 3,5947 | 3,0650 |
| | Klasse C | EUR | – | – | 2,4330 |
| | Klasse I (Hedged) | EUR | 1,9105 | 1,6416 | 1,4290 |
| | Klasse I (Acc) (Hedged)^ | AUD | 1,1335 | – | – |
| | Klasse W (Acc) | USD | 1,9167 | 1,6249 | 1,3821 |
| | Klasse W (Acc) | EUR | 1,9032 | 1,4886 | 1,3841 |

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

| Fonds | Anteilstklasse | Währung | 31. Dezember 2021 | 31. Dezember 2020 | 31. Dezember 2019 |
|---|---------------------------|------------|--------------------|--------------------|----------------------|
| BNY Mellon Global Equity Income Fund | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | USD | 411.101.299 | 769.230.682 | 1.842.135.041 |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse A | USD | 2,1617 | 1,9119 | 1,8451 |
| | Klasse A | EUR | 2,8359 | 2,3131 | 2,4403 |
| | Klasse A (Inc) | USD | 1,5387 | 1,3964 | 1,3859 |
| | Klasse A (Inc) | EUR | 1,3903 | 1,1635 | 1,2619 |
| | Sterling A (Acc) | GBP | 1,9185 | 1,6755 | 1,6706 |
| | Klasse B | USD | 2,6559 | 2,3373 | 2,2446 |
| | Klasse B | EUR | 2,8269 | 2,2942 | 2,4084 |
| | Klasse B (Inc) | USD | 1,8857 | 1,7027 | 1,6814 |
| | Klasse B (Inc) | EUR | 2,1619 | 1,8002 | 1,9434 |
| | Sterling B (Inc) | GBP | 2,1891 | 1,9518 | 1,9914 |
| | Klasse C | USD | 2,5238 | 2,2098 | 2,1114 |
| | Klasse C | EUR | 3,0880 | 2,4937 | 2,6047 |
| | Klasse C (Inc) | USD | 1,9854 | 1,7838 | 1,7527 |
| | Klasse C (Inc) | EUR | 2,1683 | 1,7965 | 1,9295 |
| | Sterling C (Inc) | GBP | 2,3004 | 2,0408 | 2,0718 |
| | Klasse G (Acc) | EUR | 1,4076 | 1,1367 | 1,1873 |
| | Klasse H (Hedged) | EUR | 1,6471 | 1,4722 | 1,4511 |
| | Klasse H (Inc) (Hedged) | EUR | 1,2693 | 1,1644 | 1,1799 |
| | Klasse I (Hedged) | EUR | 1,8024 | 1,5950 | 1,5564 |
| | Klasse I (Inc) (Hedged) | EUR | – | – | 1,2523 |
| | Klasse W | USD | 2,2310 | 1,9477 | 1,8558 |
| | Klasse W | EUR | 2,5763 | 2,0753 | 2,1617 |
| | Klasse W (Acc) | CHF | – | – | 1,0487 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | EUR | 1,2869 | 1,1366 | 1,1066 |
| | Klasse W (Inc) | USD | 1,6937 | 1,5179 | 1,4876 |
| | Klasse W (Inc) | EUR | 1,9637 | 1,6221 | 1,7381 |
| | Sterling W (Acc) | GBP | 2,6653 | 2,2988 | 2,2637 |
| | Sterling W (Inc) | GBP | 2,0252 | 1,7921 | 1,8148 |
| | Klasse Z (Acc) | USD | 1,8725 | 1,6339 | 1,5555 |
| | Klasse Z (Acc) | EUR | 2,0628 | 1,6599 | 1,7277 |
| | Klasse Z (Inc) | USD | 1,3290 | 1,1898 | 1,1650 |
| | Klasse Z (Inc) | EUR | 1,3390 | 1,1055 | 1,1832 |
| | Sterling Z (Acc)^ | GBP | – | 1,0379 | 1,0210 |
| | Sterling Z (Inc) | GBP | 1,2632 | 1,1167 | 1,1297 |
| BNY Mellon Global High Yield Bond Fund | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | USD | 166.693.695 | 153.424.293 | 121.548.316 |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse A | EUR | 2,7968 | 2,4840 | 2,6193 |
| | Klasse C | USD | 1,5163 | 1,4567 | 1,4011 |
| | Klasse C | EUR | 2,9209 | 2,5877 | 2,7224 |
| | Klasse C (Inc) | USD | 0,9611 | 0,9706 | 0,9888 |
| | Klasse H (Hedged) | EUR | 1,3164 | 1,2787 | 1,2556 |
| | Klasse I (Hedged) | EUR | 1,3529 | 1,3109 | 1,2841 |
| | Klasse W (Acc) | USD | 1,2255 | 1,1715 | 1,1212 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | EUR | – | – | 1,0149 |
| | Sterling W (Acc) (Hedged) | GBP | 1,1107 | 1,0641 | 1,0347 |
| | Klasse X (Inc) | USD | 1,0103 | 1,0094 | 1,0176 |
| | Klasse X (Inc) (Hedged) | EUR | 0,9069 | 0,9143 | 0,9386 |

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | 31. Dezember 2021 | 31. Dezember 2020 | 31. Dezember 2019 | |
|---|---------------------------|---------|-------------------|--------------------|--------------------|-------------------|
| BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund | | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | | USD | 227.707.584 | 146.439.027 | 91.053.076 |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | | |
| | Klasse A (Acc) | USD | 1,0657 | 0,9355 | 1,0949 | |
| | Klasse A (Inc) | USD | 0,9299 | 0,8534 | 1,0438 | |
| | Klasse A (Inc) | EUR | 0,9311 | 0,7964 | 1,0608 | |
| | Klasse B (Acc) | SGD | 1,2991 | 1,1133 | – | |
| | Klasse B (Acc) | USD | 1,0816 | 0,9451 | 1,1012 | |
| | Klasse B (Inc) | USD | 0,9440 | 0,8625 | 1,0502 | |
| | Klasse B (Inc) | SGD | 1,2135 | 1,0872 | – | |
| | Klasse B (Inc) (M)^ | USD | 1,0890 | – | – | |
| | Klasse B (Inc) (M)^ | SGD | 1,1326 | – | – | |
| | Klasse E (Acc) | USD | – | – | 1,1281 | |
| | Klasse E (Inc) | USD | 0,9764 | 0,8835 | 1,0651 | |
| | Klasse E (Inc) | EUR | 0,9781 | 0,8244 | 1,0823 | |
| | Sterling E (Inc) (Hedged) | GBP | 0,9130 | 0,8303 | 1,0377 | |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | EUR | 0,9807 | 0,8699 | 1,0494 | |
| | Klasse H (Inc) (Hedged) | EUR | 0,8551 | 0,7934 | 1,0006 | |
| | Klasse J (Acc) (Hedged) | SGD | 1,3614 | 1,1915 | – | |
| | Klasse J (Inc) (Hedged) | SGD | 1,2715 | 1,1635 | – | |
| | Klasse W (Acc) | USD | 1,1084 | 0,9616 | 1,1124 | |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | EUR | 1,0207 | 0,8949 | 1,0666 | |
| | Klasse W (Inc) | USD | 0,9674 | 0,8775 | 1,0608 | |
| | Klasse W (Inc) (Hedged) | EUR | 0,8919 | 0,8179 | 1,0169 | |
| BNY Mellon Global Leaders Fund | | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | | USD | 65.357.060 | 39.090.903 | 86.118.374 |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | | |
| | Klasse A (Acc) | USD | 2,1514 | 1,8243 | 1,4853 | |
| | Klasse A (Acc) | EUR | 1,7810 | 1,4075 | 1,2479 | |
| | Klasse A (Inc)^ | EUR | – | 1,4075 | 1,2479 | |
| | Klasse B (Acc) | USD | 1,6658 | 1,4055 | 1,1386 | |
| | Klasse C (Acc) | USD | 2,2636 | 1,9003 | 1,5318 | |
| | Klasse E (Acc) | USD | 2,0290 | 1,6949 | 1,3594 | |
| | Klasse E (Acc) | EUR | 1,4415 | 1,1221 | – | |
| | Sterling E (Acc) | GBP | 2,1659 | 1,7907 | 1,4829 | |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | DKK | 15,1216 | 12,9634 | 10,8284 | |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | EUR | 1,9141 | 1,6408 | 1,3678 | |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | NOK | 15,0354 | 12,8721 | 10,9288 | |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | SEK | 15,0543 | 12,9082 | 10,8404 | |
| | Klasse W (Acc) | USD | 2,2928 | 1,9199 | 1,5438 | |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | DKK | 16,4629 | 13,9381 | 11,4980 | |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | NOK | 15,5284 | 13,1283 | 11,0081 | |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | SEK | 15,5378 | 13,1574 | 10,9126 | |
| | Sterling W (Acc) | GBP | 2,1385 | 1,7725 | 1,4714 | |

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | 31. Dezember 2021 | 31. Dezember 2020 | 31. Dezember 2019 |
|---|---------------------------|------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund* | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | EUR | – | 20.744.725 | 23.691.394 |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse A (Acc)^ | EUR | – | 1,0933 | 1,0856 |
| | Klasse A (Inc)^ | EUR | – | 1,0024 | 1,0368 |
| | Klasse A (Inc)^ | USD | – | 1,2234 | – |
| | Klasse C (Acc)^ | EUR | – | 1,0870 | 1,0739 |
| | Klasse E (Inc)^ | EUR | – | 1,0341 | 1,0562 |
| | Klasse W (Acc)^ | EUR | – | 1,1190 | 1,1027 |
| | Klasse W (Inc)^ | EUR | – | – | 1,0482 |
| BNY Mellon Global Opportunities Fund | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | USD | 37.198.450 | 35.977.689 | 48.327.216 |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse A | USD | 4,2183 | 3,5794 | 3,2022 |
| | Klasse A | EUR | 3,3366 | 2,6109 | 2,5521 |
| | Klasse B | USD | 4,6003 | 3,8841 | 3,4560 |
| | Klasse C | USD | 4,9678 | 4,1735 | 3,6943 |
| | Klasse C | EUR | 3,9193 | 3,0365 | 2,9379 |
| | Klasse H (Hedged) | EUR | 1,9813 | 1,6999 | 1,5498 |
| | Klasse I (Hedged) | EUR | 2,1481 | 1,8247 | 1,6468 |
| | Klasse W (Acc) | USD | 1,6705 | 1,4002 | 1,2362 |
| | Klasse W (Acc) | EUR | – | – | 1,1667 |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | EUR | 3.121.728.759 | 2.926.880.946 | 3.409.751.582 |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse A | EUR | 1,5477 | 1,4507 | 1,3636 |
| | Klasse A (Inc) | EUR | 1,2551 | 1,1807 | 1,1181 |
| | Klasse C | EUR | 1,6420 | 1,5316 | 1,4323 |
| | Klasse C (Inc) | EUR | 1,3244 | 1,2456 | 1,1792 |
| | Klasse G (Acc) | EUR | 1,2610 | 1,1762 | 1,1001 |
| | Klasse G (Inc) | EUR | 1,2184 | 1,1458 | 1,0848 |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | SGD | 1,1938 | 1,1107 | 1,0351 |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | USD | 1,1876 | 1,1037 | 1,0233 |
| | Sterling H (Acc) (Hedged) | GBP | 1,1639 | 1,0858 | 1,0196 |
| | Klasse W | EUR | 1,5063 | 1,4014 | 1,3076 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | CHF | 1,2141 | 1,1325 | 1,0609 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | USD | – | – | 1,0212 |
| | Klasse W (Inc) | EUR | 1,1620 | 1,0926 | 1,0247 |
| | Klasse X | EUR | 1,6892 | 1,5594 | 1,4433 |
| | Klasse Z (Acc) | EUR | 1,2675 | 1,1781 | 1,0980 |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP) | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | GBP | 65.897.045 | 62.762.505 | 70.966.738 |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Sterling B (Acc) | GBP | 1,3974 | 1,3192 | 1,2467 |
| | Sterling B (Inc) | GBP | 1,2987 | 1,2283 | 1,1680 |
| | Sterling C (Inc) | GBP | 1,3256 | 1,2531 | 1,1916 |
| | Sterling W (Acc) | GBP | 1,4577 | 1,3659 | 1,2818 |
| | Sterling W (Inc) | GBP | 1,3031 | 1,2314 | 1,1711 |
| | Sterling X (Acc) | GBP | 1,4953 | 1,3895 | 1,2928 |

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

| Fonds | Anteilstklasse | Währung | 31. Dezember 2021 | 31. Dezember 2020 | 31. Dezember 2019 |
|---|---------------------------|------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| BNY Mellon Global Real Return Fund (USD) | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | USD | 437.609.335 | 300.822.877 | 322.386.292 |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse A | USD | 1,7533 | 1,6528 | 1,5262 |
| | Klasse C | USD | 1,8660 | 1,7503 | 1,6081 |
| | Klasse C (Inc) | USD | 1,4416 | 1,3639 | 1,2722 |
| | Klasse G (Acc) | USD | 1,3531 | 1,2691 | 1,1659 |
| | Klasse W | USD | 1,5326 | 1,4339 | 1,3142 |
| | Klasse W (Inc) | USD | 1,3483 | 1,2760 | 1,1892 |
| | Klasse X | USD | 2,1261 | 1,9733 | 1,7941 |
| BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | USD | 792.573.372 | 701.716.479 | 725.167.880 |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse A (Acc) | USD | 1,1990 | 1,1502 | 1,1434 |
| | Klasse A (Inc) | USD | 0,9727 | 0,9685 | 1,0033 |
| | Klasse C (Acc) | USD | 1,2296 | 1,1736 | 1,1613 |
| | Klasse G (Acc) | USD | 1,1031 | 1,0529 | 1,0418 |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | EUR | 1,0804 | 1,0451 | 1,0579 |
| | Klasse H (Inc) (Hedged) | EUR | 0,8824 | 0,8859 | 0,9344 |
| | Klasse I (Acc) (Hedged) | EUR | 1,1075 | 1,0658 | 1,0732 |
| | Klasse I (Inc) (Hedged) | EUR | 0,8827 | 0,8862 | 0,9355 |
| | Klasse W (Acc) | USD | 1,2452 | 1,1856 | 1,1702 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | CHF | 1,0815 | 1,0402 | 1,0487 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | EUR | 1,0989 | 1,0548 | 1,0600 |
| | Klasse W (Inc) | USD | 0,9770 | 0,9727 | 1,0078 |
| | Klasse W (Inc) (Hedged) | EUR | 0,8839 | 0,8875 | 0,9361 |
| | Sterling W (Acc) (Hedged) | GBP | 1,1699 | 1,1164 | 1,1174 |
| | Sterling W (Inc) (Hedged) | GBP | 0,9300 | 0,9276 | 0,9749 |
| | Klasse X (Acc) | USD | 1,2805 | 1,2125 | 1,1902 |
| | Sterling X (Acc) (Hedged) | GBP | 1,1145 | 1,0574 | 1,0524 |
| | Klasse Y (Acc) | USD | 1,2813 | 1,2130 | 1,1907 |
| | Sterling Y (Acc) (Hedged) | GBP | 1,2032 | 1,1414 | 1,1365 |
| | Klasse Z (Acc)^ | USD | 1,0417 | – | – |
| | Klasse Z (Inc)^ | USD | 1,0118 | – | – |
| | Sterling Z (Acc) (Hedged) | GBP | 1,0811 | 1,0304 | 1,0302 |
| | Sterling Z (Inc) (Hedged) | GBP | 0,9554 | 0,9529 | 1,0014 |
| BNY Mellon Global Unconstrained Fund | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | USD | 32.551.101 | 29.990.159 | 25.173.039 |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse W (Acc) | USD | 1,4588 | 1,3478 | 1,1515 |
| | Klasse X (Acc) (Hedged) | CAD | 1,4548 | 1,3399 | 1,1502 |

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | 31. Dezember 2021 | 31. Dezember 2020 | 31. Dezember 2019 |
|---|-------------------------|------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | JPY | 21.102.568.351 | 15.317.409.324 | 15.534.711.210 |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse A (Acc) | EUR | 1,3006 | 1,2114 | 1,0989 |
| | Klasse C | JPY | 271,9886 | 243,5126 | 211,0813 |
| | Klasse C^ | USD | 1,0105 | – | – |
| | Klasse E (Acc) | EUR | – | – | 1,1275 |
| | Klasse E (Acc) (Hedged) | CHF | 1,3082 | 1,1775 | 1,0297 |
| | Klasse E (Acc) (Hedged) | USD | 1,4094 | 1,2554 | 1,0802 |
| | Klasse G (Acc)^ | EUR | – | 1,1785 | – |
| | Klasse G (Acc) (Hedged) | EUR | 1,1741 | 1,0599 | 0,9289 |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | SGD | 1,9785 | 1,7902 | 1,5727 |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | NOK | 14,4586 | 13,1526 | 11,7303 |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | SEK | 14,3794 | 13,0993 | 11,6353 |
| | Klasse H (Hedged) | EUR | 2,3468 | 2,1399 | 1,8939 |
| | Klasse H (Hedged) | USD | 2,6434 | 2,3889 | 2,0855 |
| | Klasse I (Hedged) | EUR | 2,5782 | 2,3278 | 2,0399 |
| | Klasse I (Hedged) | USD | 2,8475 | 2,5489 | 2,2033 |
| | Klasse W | JPY | 277,7341 | 248,0364 | 214,4722 |
| | Klasse W (Acc) | EUR | 1,2366 | 1,1378 | 1,0192 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | EUR | 1,2478 | 1,1236 | 0,9821 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | NOK | 14,7049 | 13,2103 | 11,6384 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | SEK | 14,6493 | 13,1792 | 11,5413 |
| | Sterling W (Acc) | GBP | 2,9885 | 2,9525 | 2,5019 |
| | Sterling W (Inc) | GBP | 1,1682 | 1,1606 | 0,9904 |

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

| Fonds | Anteilstklasse | Währung | 31. Dezember 2021 | 31. Dezember 2020 | 31. Dezember 2019 |
|--|--------------------------|------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | EUR | 1.600.784.047 | 1.571.112.825 | 1.485.354.765 |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse A | EUR | 3,8035 | 3,0344 | 2,8565 |
| | Klasse A | USD | 2,7292 | 2,3363 | 2,0194 |
| | Klasse A (Inc) | EUR | 2,4411 | 1,9475 | 1,8335 |
| | Sterling A (Acc) | GBP | 3,7502 | 3,1776 | 2,8354 |
| | Klasse B | EUR | 3,5968 | 2,8552 | 2,6741 |
| | Klasse B | USD | 2,8927 | 2,4640 | 2,1190 |
| | Klasse B (Acc) | SGD | 1,6580 | 1,3851 | 1,2122 |
| | Klasse B (Inc) | SGD | – | – | 1,2122 |
| | Sterling B (Inc) | GBP | 3,2384 | 2,7303 | 2,4246 |
| | Klasse C | EUR | 4,3601 | 3,4438 | 3,2106 |
| | Klasse C | USD | 3,1313 | 2,6535 | 2,2707 |
| | Klasse G (Acc) | EUR | 1,5947 | 1,2596 | 1,1747 |
| | Klasse H (Acc) (Hedged)^ | USD | – | 1,1535 | 1,0709 |
| | Klasse I (Acc) (Hedged)^ | USD | – | 1,1826 | – |
| | Klasse J (Acc) (Hedged)^ | JPY | 107,1911 | – | – |
| | Klasse J (Acc) (Hedged) | SGD | 1,7471 | 1,3784 | 1,2839 |
| | Klasse S | EUR | 4,4543 | 3,5007 | 3,2559 |
| | Klasse S (Acc) 1 | USD | 1,5682 | 1,3225 | 1,1297 |
| | Klasse W | EUR | 3,2180 | 2,5354 | 2,3573 |
| | Klasse W | USD | 2,8244 | 2,3879 | 2,0384 |
| | Klasse W (Hedged) | USD | 3,3500 | 2,6227 | 2,4048 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | SGD | 1,5824 | 1,2390 | 1,1452 |
| | Klasse W (Inc)^ | EUR | – | 1,1300 | – |
| | Klasse W (Inc) | USD | 2,6723 | 2,2681 | 1,9465 |
| | Sterling W (Acc) | GBP | 3,3500 | 2,8033 | 2,4706 |
| | Sterling W (Inc) | GBP | 3,1691 | 2,6620 | 2,3589 |
| | Klasse X (Acc)^ | USD | – | 1,4517 | 1,2295 |
| | Sterling X | GBP | 3,0239 | 2,5108 | 2,1954 |

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

| Fonds | Anteilstklasse | Wahrung | 31. Dezember 2021 | 31. Dezember 2020 | 31. Dezember 2019 |
|---|---------------------------|------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| BNY Mellon Mobility Innovation Fund | | | | | |
| Summe Nettovermogen | | USD | 993.610.089 | 474.197.314 | 154.707.836 |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse A (Acc) | USD | 1,7836 | 1,5100 | 1,0113 |
| | Klasse A (Acc) | EUR | 1,9841 | 1,5654 | 1,1418 |
| | Klasse A (Inc) | USD | 1,7832 | 1,5097 | 1,0111 |
| | Klasse A (Inc) | EUR | 1,8270 | 1,4415 | 1,0514 |
| | Klasse B (Acc) | USD | 1,8111 | 1,5265 | 1,0177 |
| | Klasse B (Acc)^ | SGD | 1,0734 | – | – |
| | Klasse C (Acc) | USD | 1,8667 | 1,5655 | 1,0385 |
| | Klasse C (Acc) | EUR | 1,8133 | 1,4172 | 1,0240 |
| | Klasse C (Inc) | EUR | 1,8836 | 1,4722 | 1,0655 |
| | Klasse E (Acc) | USD | 1,8741 | 1,5638 | 1,0323 |
| | Klasse E (Acc) | CHF | 1,9835 | 1,6081 | 1,1604 |
| | Klasse E (Acc) | EUR | 1,9195 | 1,4927 | 1,0731 |
| | Klasse E (Acc) (Hedged) | CHF | 2,0412 | 1,7264 | 1,1688 |
| | Klasse E (Acc) (Hedged) | EUR | 2,0257 | 1,7105 | 1,1588 |
| | Klasse E (Acc) (Hedged) | SGD | – | – | 1,1877 |
| | Sterling E (Acc) (Hedged) | GBP | 1,7531 | 1,4732 | 1,0011 |
| | Klasse G (Acc) | USD | 1,5287 | 1,2819 | – |
| | Klasse G (Acc) | CHF | 1,5340 | 1,2499 | – |
| | Klasse G (Acc) | EUR | 1,6923 | 1,3230 | – |
| | Klasse G (Acc) (Hedged) | EUR | 1,5026 | 1,2756 | – |
| | Klasse H (Acc) (Hedged)^ | CHF | 1,0839 | – | – |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | EUR | 1,6405 | 1,4056 | 0,9659 |
| | Klasse H (Inc) (Hedged) | EUR | 1,6391 | 1,4044 | 0,9654 |
| | Klasse J (Acc) (Hedged) | EUR | 1,9610 | 1,6727 | 1,1445 |
| | Klasse K (Acc) | USD | 2,1133 | 1,7812 | 1,1876 |
| | Klasse K (Acc) (Hedged) | CHF | 1,9568 | 1,6716 | 1,1431 |
| | Klasse K (Acc) (Hedged) | EUR | 1,9629 | 1,6743 | 1,1456 |
| | Klasse K (Acc) (Hedged)^ | SGD | 1,0541 | – | – |
| | Klasse K (Inc) | USD | 2,1134 | 1,7813 | 1,1876 |
| | Klasse K (Inc) (Hedged) | CHF | 1,9549 | 1,6702 | 1,1421 |
| | Klasse K (Inc) (Hedged) | EUR | 1,9606 | 1,6723 | 1,1442 |
| | Klasse K (Inc) (Hedged) | SGD | 2,0521 | 1,7361 | 1,1743 |
| | Sterling K (Acc) (Hedged) | GBP | 1,9893 | 1,6885 | 1,1591 |
| | Klasse W (Acc) | USD | 1,8548 | 1,5524 | 1,0278 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | CHF | 1,3528 | 1,1475 | – |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | EUR | 1,7062 | 1,4452 | 0,9817 |
| | Sterling W (Acc)^ | GBP | 1,0527 | – | – |
| | Klasse W (Inc) | USD | 1,8471 | 1,5460 | 1,0269 |
| | Klasse W (Inc) (Hedged) | EUR | 1,6939 | 1,4347 | 0,9797 |
| BNY Mellon S&P 500® Index Tracker* | | | | | |
| Summe Nettovermogen | | USD | – | 36.865.576 | 50.804.733 |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse A^ | USD | – | 3,4193 | 2,9378 |
| | Klasse A ^ | EUR | – | 2,7978 | 2,6179 |
| | Klasse C^ | USD | – | 3,9141 | 3,3395 |
| | Klasse C ^ | EUR | – | 3,0387 | 2,8231 |
| | Klasse G (Acc) | EUR | – | – | 1,1090 |

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

| Fonds | Anteilstklasse | Währung | 31. Dezember 2021 | 31. Dezember 2020 | 31. Dezember 2019 |
|--|---------------------------|------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| BNY Mellon Small Cap Euroland Fund | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | EUR | 81.192.875 | 60.661.744 | 74.850.283 |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse A | EUR | 7,0496 | 5,8158 | 5,6223 |
| | Klasse A | USD | 1,7092 | 1,5291 | 1,3523 |
| | Klasse B | EUR | 3,6036 | 2,9581 | 2,8456 |
| | Klasse C | EUR | 8,3551 | 6,8243 | 6,5314 |
| | Klasse C | USD | 1,9065 | 1,6886 | 1,4785 |
| | Klasse W (Acc) | EUR | 1,3659 | 1,1129 | 1,0625 |
| | Sterling W (Acc)^ | GBP | – | 1,9206 | 1,7332 |
| BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund** | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | USD | 4.976.550 | 5.003.928 | – |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse A (Acc) | USD | 0,9887 | 0,9988 | – |
| | Klasse B (Acc) | USD | 0,9934 | 0,9990 | – |
| | Klasse B (Acc) | SGD | 1,0028 | 0,9892 | – |
| | Klasse C (Acc) | USD | 0,9986 | 0,9993 | – |
| | Klasse E (Acc) | USD | 1,0038 | 0,9995 | – |
| | Sterling E (Acc) | GBP | 0,9886 | 0,9741 | – |
| | Sterling E (Acc) (Hedged) | GBP | 0,9991 | 0,9992 | – |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | EUR | 0,9766 | 0,9983 | – |
| | Klasse I (Acc) (Hedged) | EUR | 0,9864 | 0,9987 | – |
| | Klasse J (Acc) (Hedged) | SGD | 0,9905 | 0,9991 | – |
| | Klasse W (Acc) | USD | 1,0008 | 0,9994 | – |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | EUR | 0,9884 | 0,9988 | – |
| BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | EUR | 328.622.843 | 271.321.884 | 180.183.426 |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse A (Acc) | EUR | 1,0203 | 1,0424 | 1,0259 |
| | Klasse A (Acc) | USD | 1,0168 | 1,1265 | – |
| | Klasse A (Inc) | EUR | 1,0042 | 1,0321 | 1,0199 |
| | Klasse C (Acc) | EUR | 1,0347 | 1,0517 | 1,0300 |
| | Klasse E (Acc) | EUR | 1,0524 | 1,0643 | 1,0368 |
| | Klasse E (Acc) (Hedged) | CHF | 1,0084 | 1,0226 | 1,0001 |
| | Klasse G (Acc) | EUR | 1,0347 | 1,0518 | 1,0300 |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | CHF | 0,9850 | 1,0091 | – |
| | Klasse H (Acc) (Hedged)^ | NOK | – | 10,3364 | 10,1131 |
| | Klasse W (Acc) | EUR | 1,0445 | 1,0592 | 1,0346 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | CHF | 0,9993 | 1,0161 | – |
| | Klasse W (Acc) (Hedged)^ | NOK | – | 10,4554 | 10,1533 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | USD | 1,0257 | 1,0322 | – |
| | Sterling W (Acc) (Hedged) | GBP | 1,0161 | 1,0242 | – |
| | Klasse W (Inc) | EUR | 0,9759 | 1,0008 | – |
| | Sterling W (Inc) (Hedged) | GBP | 0,9961 | 1,0178 | 1,0007 |
| | Klasse X (Acc) | EUR | 1,0600 | 1,0692 | 1,0388 |
| | Klasse Z (Acc)^ | EUR | 0,9892 | – | – |
| | Klasse Z (Acc) (Hedged)^ | USD | – | 1,0016 | – |
| | Klasse Z (Inc)^ | EUR | 0,9793 | – | – |
| | Klasse Z (Inc) (Hedged) | USD | 0,9847 | 1,0016 | – |

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

| Fonds | Anteilstklasse | Währung | 31. Dezember 2021 | 31. Dezember 2020 | 31. Dezember 2019 |
|---|---------------------------|------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)** | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | EUR | 78.396.803 | 34.247.376 | – |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse A (Acc) | EUR | 1,1430 | 1,0735 | – |
| | Klasse A (Inc) | EUR | 1,1421 | 1,0740 | – |
| | Klasse E (Acc) | EUR | 1,1657 | 1,0841 | – |
| | Klasse E (Acc) (Hedged) | USD | 1,1875 | 1,0950 | – |
| | Klasse E (Inc)^ | EUR | – | 1,0837 | – |
| | Klasse G (Acc) | EUR | 1,2315 | 1,1510 | – |
| | Klasse W (Acc) | EUR | 1,1597 | 1,0812 | – |
| | Klasse W (Acc) (Hedged)^ | USD | 1,0588 | – | – |
| | Sterling W (Acc) (Hedged) | GBP | 1,1574 | 1,0736 | – |
| | Klasse W (Inc) | EUR | 1,1514 | 1,0813 | – |
| | Sterling W (Inc) (Hedged) | GBP | 1,1498 | 1,0736 | – |
| BNY Mellon Targeted Return Bond Fund | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | USD | 91.523.113 | 92.952.258 | 84.505.101 |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse A (Acc) | USD | 1,0365 | 1,0503 | 0,9897 |
| | Sterling W (Acc) (Hedged) | GBP | 1,0230 | 1,0301 | 0,9714 |
| BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund* | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | USD | – | 3.704.307 | 28.865.549 |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse A^ | USD | – | 3,3533 | 3,2641 |
| | Klasse A ^ | EUR | – | 2,7020 | 2,8645 |
| | Klasse B^ | USD | – | 2,4704 | 2,3927 |
| | Klasse C^ | USD | – | 3,8823 | 3,7438 |
| | Klasse C ^ | EUR | – | 3,3708 | 3,5342 |
| | Klasse W (Acc) | USD | – | – | 1,1876 |
| BNY Mellon U.S. Equity Income Fund | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | USD | 297.752.469 | 230.267.279 | 419.124.854 |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse A (Acc) | EUR | 1,4158 | 1,0314 | 1,1773 |
| | Klasse B (Inc) | USD | 1,3070 | 1,0382 | 1,1123 |
| | Klasse C (Acc)^ | USD | 1,0280 | – | – |
| | Klasse C (Inc) | USD | 1,4388 | 1,1374 | 1,2123 |
| | Klasse E (Acc)^ | EUR | – | 1,0743 | 1,2073 |
| | Klasse E (Inc) | USD | 1,4670 | 1,1531 | 1,2223 |
| | Klasse E (Inc) | EUR | 1,4099 | 1,0328 | 1,1923 |
| | Sterling E (Acc) | GBP | 1,5112 | 1,1514 | 1,2265 |
| | Sterling E (Inc) | GBP | 1,3549 | 1,0541 | 1,1535 |
| | Sterling E (Inc) (Hedged) | GBP | 1,3467 | 1,0655 | 1,1704 |
| | Klasse W (Acc) | USD | 1,6250 | 1,2548 | 1,2985 |
| | Klasse W (Acc) | EUR | 1,4391 | 1,0357 | 1,1673 |
| | Klasse W (Inc) | USD | 1,4568 | 1,1485 | 1,2211 |
| | Sterling W (Inc) | GBP | 1,3347 | 1,0417 | 1,1434 |

15. NETTOINVENTARWERT Forts.

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | 31. Dezember 2021 | 31. Dezember 2020 | 31. Dezember 2019 |
|---|----------------------------|------------|----------------------|--------------------|--------------------|
| BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | USD | 1.007.082.724 | 613.916.282 | 438.605.770 |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse A (Acc) | USD | 1,0355 | 1,0299 | – |
| | Klasse A (Inc)^ | USD | 1,0029 | – | – |
| | Klasse A (Inc) (M)^ | USD | 0,9809 | – | – |
| | Klasse C (Acc) | USD | 1,2713 | 1,2580 | 1,1713 |
| | Klasse E (Acc) | USD | 1,2229 | 1,2078 | 1,1223 |
| | Klasse E (Acc) (Hedged) | CHF | 1,1003 | 1,0988 | 1,0431 |
| | Klasse E (Acc) (Hedged) | EUR | 1,1611 | 1,1565 | 1,0941 |
| | Klasse E (Inc) (Hedged) | EUR | 1,0031 | 1,0285 | 1,0079 |
| | Klasse G (Acc)^ | USD | 0,9978 | – | – |
| | Sterling G (Inc) (Hedged)^ | GBP | 1,0205 | – | – |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | EUR | 1,1228 | 1,1261 | 1,0730 |
| | Klasse H (Acc) (Hedged)^ | CHF | 0,9977 | – | – |
| | Sterling H (Acc) (Hedged)^ | GBP | 1,0075 | – | – |
| | Klasse H (Inc) (Hedged) | EUR | 0,9699 | 1,0015 | 0,9887 |
| | Klasse P (Acc)^ | USD | 1,0006 | – | – |
| | Klasse P (Acc) (Hedged)^ | AUD | 0,9920 | – | – |
| | Klasse P (Acc) (Hedged)^ | EUR | 0,9886 | – | – |
| | Klasse P (Inc)^ | USD | 0,9893 | – | – |
| | Klasse P (Inc) (Hedged)^ | AUD | 0,9920 | – | – |
| | Klasse P (Inc) (Hedged)^ | EUR | 0,9886 | – | – |
| | Klasse W (Acc) | USD | 1,2773 | 1,2627 | 1,1745 |
| | Klasse W (Acc) | EUR | 1,0575 | 0,9743 | 0,9871 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | CHF | 1,1170 | 1,1166 | 1,0610 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | EUR | 1,1562 | 1,1527 | 1,0916 |
| | Klasse W (Inc) | USD | 1,0796 | 1,0991 | 1,0591 |
| | Klasse W (Inc) (Hedged) | CHF | 1,0273 | 1,0573 | 1,0405 |
| | Klasse W (Inc) (Hedged) | EUR | 0,9975 | 1,0238 | 1,0044 |
| | Sterling W (Acc) (Hedged)^ | GBP | 1,0034 | – | – |
| | Klasse X (Acc)^ | USD | – | 1,2249 | 1,1342 |
| | Klasse Z (Acc)^ | USD | 1,0097 | – | – |
| | Klasse Z (Acc) (Hedged)^ | CHF | 0,9942 | – | – |
| | Klasse Z (Acc) (Hedged)^ | EUR | 0,9980 | – | – |
| | Sterling Z (Acc) (Hedged)^ | GBP | 1,0035 | – | – |
| Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund* | | | | | |
| Summe Nettovermögen | | EUR | 984.235.804 | – | – |
| Nettoinventarwert zum: | | | | | |
| | Klasse A (Acc)^ | EUR | 0,9909 | – | – |
| | Klasse G (Acc)^ | EUR | 0,9947 | – | – |
| | Klasse W (Acc)^ | EUR | 0,9956 | – | – |
| | Klasse W (Inc)^ | EUR | 0,9964 | – | – |
| | Klasse X (Acc)^ | EUR | 0,9991 | – | – |
| | Klasse Z (Acc)^ | EUR | 0,9961 | – | – |

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

** Dieser Fonds wurde im vergangenen Geschäftsjahr aufgelegt oder geschlossen.

^ Der BNY Mellon Digital Assets Fund wurde mit Wirkung vom 8. Dezember 2020 in BNY Mellon Blockchain Innovation Fund umbenannt. Die Vergleichsangaben vom 31. Dezember geben dies nun wieder.

^ Diese Anteilsklasse wurde im Geschäftsjahr aufgelegt oder geschlossen.

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS

STRATEGIE BEIM EINSATZ VON FINANZINSTRUMENTEN

Durch ihre Anlagetätigkeit ist die Gesellschaft verschiedenen Risikotypen ausgesetzt, die mit den Finanzinstrumenten und den Märkten verbunden sind, in die sie investiert. Hierzu zählen das Marktrisiko (einschließlich Marktpreisrisiko, Zinsrisiko und Währungsrisiko), das Kreditrisiko und das Liquiditätsrisiko. Die Gesellschaft hat Risikomanagementprogramme etabliert, um die möglichen negativen Einflüsse dieser Risiken auf die Wertentwicklung der Fonds zu begrenzen.

Die Vermögenswerte jedes Fonds werden separat in Übereinstimmung mit den Anlagezielen und der Anlagepolitik des betreffenden Fonds angelegt, die in den jeweiligen Nachträgen zum Prospekt aufgeführt sind. Enthält der Name eines Fonds eine bestimmte Währung, ein Land, eine Region, eine Branche oder eine Wertpapierart, werden mindestens drei Viertel der Vermögenswerte des betreffenden Fonds aus Anlagen bestehen, die dieser Währung, diesem Land, dieser Region, dieser Branche oder dieser Wertpapierart entsprechen.

Die Fonds dürfen zur effizienten Portfolioverwaltung oder zur Absicherung gegen Wechselkursrisiken FDI verwenden. Einige Fonds können gemäß den OGAW-Vorschriften der Zentralbank FDI zu Anlagezwecken einsetzen. In dem Risikomanagementprozess („RMP“) wird erklärt, ob die einzelnen Fonds den Commitment-Ansatz oder Value at Risk („VaR“) für die Berechnung des Gesamtengagements anwendet. Der Commitment-Ansatz misst den durch den Einsatz von Derivaten erzielten Hebeleffekt, der durch Umrechnung aller Derivat-Positionen, die entweder im Rahmen der allgemeinen Anlagepolitik des Fonds, zur Risikominderung oder für eine effiziente Portfolioverwaltung verwendet werden, auf der Grundlage des Marktwerts der zugrunde liegenden Vermögenswerte oder Kontrakte berechnet wird. Der VaR für einen zuvor festgelegten Zeithorizont misst die Wertverlustschwelle eines Portfolios mit Finanzinstrumenten, die mit einer vorgegebenen Wahrscheinlichkeit (entweder Absolut [1] oder Relativ [2]) überschritten werden kann. Die Qualität der Prognosen nach dem VaR-Modell wird anhand von Rückvergleichen belegt. Ergänzend zum VaR wird ein Stresstest verwendet, um die mögliche Auswirkung extremer, wenngleich plausibler Ereignisse oder Entwicklungen bei einer Reihe von Finanzkennzahlen auf die Portfoliowerte zu beurteilen.

Für eine ausführliche Erörterung steht der RMP für jeden Fonds auf Anfrage zur Verfügung.

^[1] Definiert als der VaR des Fonds, dessen Höchstgrenze einem Prozentsatz des NIW entspricht.

^[2] Definiert als der VaR des Fonds, geteilt durch den VaR eines Referenzwerts oder eines Referenzportfolios.

PROZESS DES FINANZIELLEN RISIKOMANAGEMENTS

Um ihre Anlageziele zu erreichen, kauft, verkauft und hält die Gesellschaft finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten. Dadurch ist sie möglicherweise dem Marktpreisrisiko, Zinsrisiko, Währungsrisiko, Kreditrisiko und Liquiditätsrisiko ausgesetzt, die mit den von ihr gehaltenen Finanzinstrumenten verbunden sind. Das umfassende Risikomanagementprogramm der Gesellschaft richtet sich auf die Unvorhersehbarkeit der Finanzmärkte und versucht, mögliche negative Einflüsse dieser Risiken auf die Wertentwicklung der Gesellschaft zu minimieren. Die Gesellschaft setzt FDI zur Verringerung bestimmter Risiken ein.

Die von der Gesellschaft beim Umgang mit diesen Risiken eingesetzten Strategien werden nachfolgend erläutert.

ANLAGERISIKO

Durch die Aktivitäten der einzelnen Fonds ist die Gesellschaft verschiedenen finanziellen Risiken ausgesetzt. Hierzu zählen das Marktrisiko (einschließlich Marktpreisrisiko, Zinsrisiko und Währungsrisiko), das Kreditrisiko und das Liquiditätsrisiko.

MARKTRISIKO

Das Marktrisiko bezeichnet das Risiko, dass der beizulegende Zeitwert eines Finanzinstruments aufgrund von Veränderungen der Marktpreise schwanken könnte. Das Marktrisiko umfasst folgende drei Risikoarten: Marktpreisrisiko, Zinsrisiko und Fremdwährungsrisiko.

MARKTPREISRISIKO

Das Marktpreisrisiko bezeichnet das Risiko, dass der angemessene Wert eines Finanzinstruments aufgrund von Veränderungen der Marktpreise (die nicht auf das Zinsrisiko und das Währungsrisiko zurückzuführen sind) schwanken kann, ganz gleich, ob diese Veränderungen durch spezielle Faktoren einzelner Finanzinstrumente oder ihrer Emittenten verursacht werden oder durch andere Faktoren, die ähnliche am Markt gehandelte Finanzinstrumente betreffen.

Ein Großteil der Fonds handelt mit Finanzinstrumenten und hält Positionen in Wertpapieren, die an Aktienmärkten oder Märkten für Aktienderivate gehandelt werden. Die Anlagen der Fonds unterliegen Marktschwankungen. Daher kann nicht garantiert werden, dass der Wert der Anlagen steigen wird. Somit besteht das Risiko eines Kapitalverlusts.

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

MARKTPREISRISIKO Forts.

Die Anlageverwalter steuern das Marktpreisrisiko durch die Zusammenstellung diversifizierter Anlageportfolios, die sich über verschiedene, für die Fonds angemessene Branchen und/oder geografische Regionen erstrecken, und mit den OGAW-Vorschriften der Zentralbank sowie den Anlagezielen der Fonds übereinstimmen. Eine Analyse des Marktpreisrisikos der einzelnen Fonds enthält die Aufstellung der Wertpapierbestände. Sämtliche Marktpositionen der Fonds werden auf täglicher Basis von den Anlageverwaltern überwacht und auf monatlicher Basis vom Anlagekomitee (Investment Management Oversight Committee) sowie auf vierteljährlicher Basis vom Verwaltungsrat geprüft.

Die Marktrisikostrategie der Gesellschaft wird durch das Anlagerisiko und die Renditeziele der Gesellschaft bestimmt. Der Verwaltungsrat hat die Anlageverwalter angewiesen, sämtliche Risiken in Übereinstimmung mit einem eingeführten Risikomanagementsystem zu verwalten.

Die nachfolgende Tabelle zeigt beispielhaft den wahrscheinlichen Anstieg des Nettoinventarwerts, der durch einen 5%-igen Anstieg des mit den Fonds verbundenen Marktindex ausgelöst würde (ein 5%-iger Rückgang hätte ähnliche negative Auswirkungen). Bitte beachten Sie, dass die Tabelle keine Anleihefonds enthält, da diese, wie unten erläutert, vor allem einem Zinsrisiko ausgesetzt sind. Der nachfolgende Kommentar enthält detaillierte Angaben zur Marktsensitivität dieser Fonds. Im Interesse konsistenter Vergleiche zwischen den Fonds geht die Tabelle von einer Veränderung um 5 % aus. Zu beachten ist, dass künftige Marktbedingungen erheblich abweichen können und die Tabelle nur der Veranschaulichung dient.

Für die in der umseitigen Tabelle aufgeführten Fonds wird der Anstieg oder Rückgang des den Inhabern einlösbarer, partizipierender Anteile zuzuschreibenden Nettovermögens für die Geschäftsjahre zum 31. Dezember 2021 und 31. Dezember 2020 bei einem Anstieg oder Rückgang des Marktwerts um 5 % bei ansonsten konstanten Variablen gezeigt.

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

MARKTPREISRISIKO Forts.

| Fonds | Referenzindex | Währung | Volatilität | | Anstieg/(Rückgang) der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten | |
|---|--|---------|-------------|--------|---|-------------|
| | | | 2021 | 2020 | 2021 | 2020 |
| BNY Mellon Asian Equity Fund | MSCI All-Country Asia Pacific ex Japan Index TR | USD | 5,00 % | 5,00 % | 3.081.287 | 3.571.058 |
| BNY Mellon Asian Income Fund | FTSE Asia Pacific ex Japan Index TR | USD | 5,00 % | 5,00 % | 717.912 | 1.615.433 |
| BNY Mellon Blockchain Innovation Fund[^] | MSCI All-Country World Index NR | USD | 5,00 % | 5,00 % | 4.648.830 | 785.562 |
| BNY Mellon Brazil Equity Fund | MSCI Brazil 10/40 Index NR | USD | 5,00 % | 5,00 % | 1.956.434 | 3.216.813 |
| BNY Mellon Future Earth Fund^{**} | MSCI AC World NR Index | USD | 5,00 % | 5,00 % | 104.945 | k. A. |
| BNY Mellon Future Food Fund^{**} | MSCI AC World NR Index | USD | 5,00 % | 5,00 % | 134.864 | k. A. |
| BNY Mellon Future Life Fund^{**} | MSCI AC World NR Index | USD | 5,00 % | 5,00 % | 114.923 | k. A. |
| BNY Mellon Global Emerging Markets Fund | MSCI Emerging Markets Index NR | USD | 5,00 % | 5,00 % | 2.676.768 | 2.797.338 |
| BNY Mellon Global Equity Fund | MSCI All-Country World Index NR | USD | 5,00 % | 5,00 % | 21.636.013 | 19.292.641 |
| BNY Mellon Global Equity Income Fund | FTSE World Index TR | USD | 5,00 % | 5,00 % | 18.061.838 | 32.966.846 |
| BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund | S&P Global Infrastructure Index NR | USD | 5,00 % | 5,00 % | 12.163.421 | 7.103.885 |
| BNY Mellon Global Leaders Fund | MSCI World Index NR | USD | 5,00 % | 5,00 % | 2.902.497 | 1.774.015 |
| BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund^{*>} | 60 % MSCI All-Country World Index NR und 40 % ICE Bank of America Merrill Lynch Global Broad Market Index TR EUR | EUR | 5,00 % | 5,00 % | k. A. | 1.012.657 |
| BNY Mellon Global Opportunities Fund | MSCI All-Country World Index NR | USD | 5,00 % | 5,00 % | 1.826.627 | 1.763.968 |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)^{>} | 1-Monats-EURIBOR + 4 % p.a. | EUR | 5,00 % | 5,00 % | k. A. | 142.851.828 |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)^{>} | SONIA (30 Tage aufgezinst) + 4 % p.a. / (2020 - 1-Monats-GBP-LIBOR + 4 % p.a.) | GBP | 5,00 % | 5,00 % | k. A. | 3.026.563 |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)^{>} | SOFR (30 Tage aufgezinst) + 4 % p.a. / (2020 - 1-Monats-USD-LIBOR + 4 % p.a.) | USD | 5,00 % | 5,00 % | k. A. | 14.283.127 |
| 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 % | 1.718.082 | 1.637.624 |
| BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund | Russell Nomura Small Cap Index | JPY | 5,00 % | 5,00 % | 1.259.549.792 | 995.553.752 |
| BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund | MSCI World Index NR | EUR | 5,00 % | 5,00 % | 69.225.013 | 68.319.040 |
| BNY Mellon Mobility Innovation Fund | MSCI All-Country World Mid Cap Index NR | USD | 5,00 % | 5,00 % | 50.579.822 | 23.441.943 |
| BNY Mellon S&P 500[®] Index Tracker[*] | S&P 500 Index NR | USD | 5,00 % | 5,00 % | k. A. | 1.828.982 |
| BNY Mellon Small Cap Euroland Fund | S&P EuroZone Small Cap Index TR | EUR | 5,00 % | 5,00 % | 4.393.165 | 3.279.417 |
| BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund[^] | MSCI All-Country World Index NR | USD | 5,00 % | 5,00 % | 248.147 | 246.070 |
| BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)^{^>} | 1-Monats-EURIBOR + 4 % p.a. | EUR | 5,00 % | 5,00 % | k. A. | 1.647.141 |
| BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund[*] | Russell 1000 Value Index TR | USD | 5,00 % | 5,00 % | k. A. | 209.349 |
| BNY Mellon U.S. Equity Income Fund | S&P 500 Index NR | USD | 5,00 % | 5,00 % | 17.374.008 | 13.186.246 |

^{*} Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

[>] Mit Wirkung vom 22. Januar 2021 änderte sich die Methode zum Gesamtengagement und Leverage für diese Fonds vom Commitment-Ansatz zur Absolute VaR-Methode.

[^] Da der Fonds seit weniger als drei Jahren besteht, ist kein statistisch signifikantes Beta verfügbar. Daher wird zur Angabe der Marktpreissensitivität bei der effektiven Berechnung für diese Fonds ein fiktives Beta von 1 angewendet.

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

MARKTPREISRISIKO Forts.

Für die Anleihefonds ist die Wahrscheinlichkeit eines Rückgangs des Nettoinventarwerts als Folge eines Abwärtstrends der Marktpreise umseitig angegeben.

Zum 31. Dezember 2021 und 31. Dezember 2020 wäre für Anleihefonds unter Verwendung des VaR-Risikomodells der Anlageverwalter (bei denen der VaR auf Wahrscheinlichkeit basiert) mit einem maximalen Verlust in Höhe des nachfolgend angegebenen Prozentsatzes gemäß nachstehender Tabelle (regulatorische Grenze) in jeder beliebigen Woche oder an jedem beliebigen Tag zu rechnen, d. h. der Fonds würde voraussichtlich in einer von hundert Wochen oder an einem von hundert Tagen den in der nachstehenden VaR-Tabelle angegebenen Prozentsatz seines Nettoinventarwerts verlieren. Nachstehende Tabelle zeigt ferner den VaR jedes Fonds zum 31. Dezember 2021 und 31. Dezember 2020, der mit einem 99%-igen Konfidenzniveau über die Haltedauer gemessen wird.

| Fonds | Konfidenzniveau | VaR-Typ | Bestand Berichts- zeitraum 2021 | Bestand Berichts- zeitraum 2020 | Regula- torische Grenze 2021 | Regula- torische Grenze 2020 | VaR 2021 | VaR 2020 |
|---|-----------------|---------|--|--|---------------------------------------|---------------------------------------|-------------|-------------|
| BNY Mellon Absolute Return Bond Fund | 99 % | Absolut | Fünf Tage | Fünf Tage | 5,00 % | 5,00% | 1.29% | 0,55 % |
| BNY Mellon Absolute Return Equity Fund | 99 % | Absolut | Fünf Tage | Fünf Tage | 10,00 % | 10,00% | 1.05% | 2,04 % |
| BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund | 99 % | Absolut | Fünf Tage | Fünf Tage | 6,00 % | 6,00% | 1.15% | 1,06 % |
| BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund* | 99 % | Absolut | Zwanzig Tage | k. A. | 20,00 % | k. A. | 5.70% | k. A. |
| BNY Mellon Dynamic Total Return Fund* | 99 % | Absolut | Fünf Tage | Fünf Tage | 10,00 % | 10,00% | k. A. | 4,03 % |
| BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund | 99 % | Relativ | Fünf Tage | Fünf Tage | 200,00 % | 200,00% | 113.36% | 98,58 % |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund | 99 % | Relativ | Zwanzig Tage | Zwanzig Tage | 200,00 % | 200,00% | 124.25% | 118,49 % |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund | 99 % | Relativ | Zwanzig Tage | Zwanzig Tage | 200,00 % | 200,00% | 112.61% | 123,74 % |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund | 99 % | Relativ | Zwanzig Tage | Zwanzig Tage | 200,00 % | 200,00% | 134.40% | 143,36 % |
| BNY Mellon Euroland Bond Fund | 99 % | Relativ | Zwanzig Tage | Zwanzig Tage | 200,00 % | 200,00% | 100.66% | 121,82 % |
| BNY Mellon European Credit Fund | 99 % | Relativ | Fünf Tage | Fünf Tage | 200,00 % | 200,00% | 98.00% | 108,00 % |
| BNY Mellon Global Credit Fund | 99 % | Relativ | Zwanzig Tage | Zwanzig Tage | 200,00 % | 200,00% | 92.00% | 96,00 % |
| BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund> | 99 % | Absolut | Zwanzig Tage | k. A. | 20,00 % | k. A. | 2.37% | k. A. |
| BNY Mellon Global High Yield Bond Fund | 99 % | Relativ | Ein Tag | Ein Tag | 200,00 % | 200,00% | 98.23% | 116,10 % |
| BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund*> | 99 % | Absolut | Zwanzig Tage | k. A. | 20,00 % | k. A. | k. A. | k. A. |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)> | 99 % | Absolut | Zwanzig Tage | k. A. | 20,00 % | k. A. | 9.41% | k. A. |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)> | 99 % | Absolut | Zwanzig Tage | k. A. | 20,00 % | k. A. | 8.75% | k. A. |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)> | 99 % | Absolut | Zwanzig Tage | k. A. | 20,00 % | k. A. | 8.88% | k. A. |
| BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund> | 99 % | Absolut | Zwanzig Tage | k. A. | 20,00 % | k. A. | 2.41% | k. A. |
| BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)> | 99 % | Absolut | Zwanzig Tage | k. A. | 20,00 % | k. A. | 8.98% | k. A. |
| BNY Mellon Targeted Return Bond Fund | 99 % | Absolut | Zwanzig Tage | Zwanzig Tage | 20,00 % | 20,00% | 1.63% | 1,81 % |
| BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund | 99 % | Absolut | Zwanzig Tage | Zwanzig Tage | 20,00 % | 20,00% | 3.12% | 3,35 % |

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

> Mit Wirkung vom 22. Januar 2021 änderte sich die Methode zum Gesamtengagement und Leverage für diese Fonds vom Commitment-Ansatz zur Absolute VaR-Methode.

Der VaR ist die Risikobewertungsmethode, die verwendet wird, um Leverage und Marktrisikovolatilität der Fonds zu beurteilen. Wird der VaR als Prozentsatz des Nettoinventarwerts der Fonds berechnet (absoluter oder relativer VaR), darf er die im Prospekt angegebenen regulatorischen Höchstgrenzen nicht übersteigen. Der VaR wird täglich auf der Grundlage eines einseitigen Konfidenzniveaus von 99 % und einer im Voraus festgelegten Haltefrist entweder auf einer absoluten Basis (bei der der Wert mit dem Nettoinventarwert des Fonds verglichen wird) oder auf einer relativen Basis (bei der der VaR mit dem Referenzwert oder dem Referenzportfolio verglichen wird) berechnet. Der historische Beobachtungszeitraum darf nicht weniger als ein Jahr betragen, sofern kein kürzerer Zeitraum gerechtfertigt ist.

Nachfolgend eine Auflistung der Nachteile der VaR-Analyse:

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

MARKTPREISRISIKO Forts.

- die Modelle basieren auf historischen Daten und können nicht die Tatsache berücksichtigen, dass künftige Veränderungen des Marktpreises, Korrelationen zwischen Märkten und dem Niveau der Marktliquidität in Situationen von Marktstress möglicherweise nicht mit historischen Mustern zusammenhängen;
- die Angaben zum Marktpreisrisiko sind eher eine relative Risikoschätzung als eine präzise und genaue Zahl;
- die Angaben zum Marktpreis stellen ein hypothetisches Ergebnis dar und sind nicht als Prognose zu werten.

Die im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 berechnete niedrigste, durchschnittliche und höchste Ausnutzung der regulatorischen Grenzen war wie folgt:

| Fonds | Mindestausnutzung | Durchschnittliche Ausnutzung | Höchstaussnutzung |
|---|-------------------|------------------------------|-------------------|
| BNY Mellon Absolute Return Bond Fund | 7,60 % | 14,46 % | 25,80 % |
| BNY Mellon Absolute Return Equity Fund | 7,70 % | 11,95 % | 26,80 % |
| BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund | 9,68 % | 14,22 % | 21,03 % |
| BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund* | 20,53 % | 27,56 % | 31,67 % |
| BNY Mellon Dynamic Total Return Fund* | 0,00 % | 42,59 % | 48,56 % |
| BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund | 49,34 % | 56,48 % | 59,66 % |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund | 57,83 % | 60,40 % | 63,94 % |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund | 56,01 % | 59,50 % | 62,62 % |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund | 64,68 % | 70,01 % | 76,52 % |
| BNY Mellon Euroland Bond Fund | 47,59 % | 54,19 % | 61,56 % |
| BNY Mellon European Credit Fund | 44,50 % | 52,65 % | 58,00 % |
| BNY Mellon Global Credit Fund | 39,50 % | 46,34 % | 50,00 % |
| BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund> | 9,21 % | 11,13 % | 13,38 % |
| BNY Mellon Global High Yield Bond Fund | 49,12 % | 58,52 % | 71,15 % |
| BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund*^> | 10,35 % | 54,31 % | 67,18 % |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)> | 33,45 % | 47,35 % | 66,28 % |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)> | 26,40 % | 44,46 % | 62,40 % |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)> | 18,44 % | 44,40 % | 61,61 % |
| BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund> | 8,08 % | 10,33 % | 12,46 % |
| BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)> | 29,70 % | 46,69 % | 67,40 % |
| BNY Mellon Targeted Return Bond Fund | 5,18 % | 7,13 % | 9,76 % |
| BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund | 31,23 % | 35,28 % | 40,76 % |

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

> Mit Wirkung vom 22. Januar 2021 änderte sich die Methode zum Gesamtengagement und Leverage für diese Fonds vom Commitment-Ansatz zur Absolute VaR-Methode.

^ Die Ermittlung des durchschnittlichen Leverage-Niveaus basiert auf Daten für den Berichtszeitraum vom 22. Januar 2021, dem Datum des Inkrafttretens der VaR-Übernahme, bis zum 17. März 2021. Der Fonds wurde anschließend am 26. März 2021 geschlossen.

Die im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020 berechnete niedrigste, durchschnittliche und höchste Ausnutzung der regulatorischen Grenzen war wie folgt:

| Fonds | Mindestausnutzung | Durchschnittliche Ausnutzung | Höchstaussnutzung |
|--|-------------------|------------------------------|-------------------|
| BNY Mellon Absolute Return Bond Fund | 10,60 % | 25,00 % | 50,00 % |
| BNY Mellon Absolute Return Equity Fund | 0,70 % | 14,10 % | 20,50 % |
| BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund | 4,91 % | 12,69 % | 23,83 % |
| BNY Mellon Dynamic Total Return Fund | 11,84 % | 39,48 % | 58,00 % |
| BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund | 60,64 % | 100,61 % | 114,48 % |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund | 45,45 % | 60,47 % | 64,77 % |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund | 54,41 % | 58,63 % | 62,05 % |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund | 56,00 % | 66,91 % | 71,97 % |
| BNY Mellon Euroland Bond Fund | 48,42 % | 76,44 % | 97,42 % |
| BNY Mellon European Credit Fund | 34,50 % | 55,00 % | 63,00 % |
| BNY Mellon Global Credit Fund | 43,50 % | 50,50 % | 73,50 % |
| BNY Mellon Global High Yield Bond Fund | 44,85 % | 51,98 % | 68,37 % |
| BNY Mellon Targeted Return Bond Fund | 1,85 % | 13,72 % | 20,59 % |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

MARKTPREISRISIKO Forts.

| Fonds | Mindestausnutzung | Durchschnittliche Ausnutzung | Höchstausnutzung |
|--|-------------------|------------------------------|------------------|
| BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund | 14,03 % | 17,17 % | 19,64 % |

Leverage wird als Summe der Nennwerte der eingesetzten Derivate berechnet. (Dies kann durch eine Berechnung des Leverage auf der Basis eines Commitment-Ansatzes ergänzt werden. Die Einrichtung eines gehebelten Engagements in einem Index mittels FDI oder die Berücksichtigung eines Leverage-Merkmals in einem Index muss bei der Einhaltung der Offenlegungsbestimmungen des Prospekts ebenfalls berücksichtigt werden.)

Das durchschnittliche Leveragesniveau, das im Verlauf des Geschäftsjahres zum 31. Dezember 2021 und zum 31. Dezember 2020 angewendet wurde, gestaltet sich wie folgt:

| Fonds | Durchschnittliches Leverage-Niveau 2021 | Durchschnittliches Leverage-Niveau 2020 |
|---|---|---|
| BNY Mellon Absolute Return Bond Fund | 382,97 % | 551,05 % |
| BNY Mellon Absolute Return Equity Fund | 167,00 % | 124,83 % |
| BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund | 221,00 % | 258,55 % |
| BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund* | 566,25 % | k. A. |
| BNY Mellon Dynamic Total Return Fund* | 558,22 % | 473,40 % |
| BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund | 39,10 % | 31,82 % |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund | 24,62 % | 36,20 % |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund | 91,87 % | 68,30 % |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund | 50,42 % | 51,42 % |
| BNY Mellon Euroland Bond Fund | 106,52 % | 144,79 % |
| BNY Mellon European Credit Fund | 23,50 % | 28,08 % |
| BNY Mellon Global Credit Fund | 188,60 % | 210,32 % |
| BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund> | 108,46 % | k. A. |
| BNY Mellon Global High Yield Bond Fund | 89,01 % | 41,01 % |
| BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund*^> | 51,83 % | k. A. |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)> | 122,91 % | k. A. |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)> | 108,10 % | k. A. |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)> | 67,99 % | k. A. |
| BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund> | 131,87 % | k. A. |
| BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)> | 116,85 % | k. A. |
| BNY Mellon Targeted Return Bond Fund | 145,39 % | 119,59 % |
| BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund | k. A. | k. A. |

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

^ Mit Wirkung vom 22. Januar 2021 änderte sich die Methode zum Gesamtengagement und Leverage für diese Fonds vom Commitment-Ansatz zur Absolute VaR-Methode.

> Die Ermittlung des durchschnittlichen Leverage-Niveaus basiert auf Daten für den Berichtszeitraum vom 22. Januar 2021, dem Datum des Inkrafttretens der VaR-Übernahme, bis zum 17. März 2021. Der Fonds wurde anschließend am 26. März 2021 geschlossen.

ZINSRISIKO

Das Zinsrisiko wird definiert als Risiko, dass der beizulegende Zeitwert eines Finanzinstruments aufgrund von Veränderungen der Marktzinsen schwanken könnte. Dieses Risiko betrifft Finanzinstrumente, bei denen sich Zinsänderungen negativ auf den beizulegenden Zeitwert auswirken.

Die Mehrzahl der finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Gesellschaft, d. h. jene Fonds, die vorwiegend Aktien oder Aktienderivate halten, sind nicht zinstragend. Demzufolge unterliegen diese Vermögenswerte keinem hohen Risiko von Schwankungen der jeweils vorherrschenden Marktzinsen. Alle überschüssigen Barmittel und Bargewerte werden kurzfristig am Markt angelegt.

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

Die nachfolgende Tabelle fasst das Zinsrisiko für die Gesellschaft zum 31. Dezember 2021 zusammen. Sie enthält die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Gesellschaft zum beizulegenden Zeitwert, kategorisiert nach vertraglicher Zinsanpassung oder Fälligkeitsterminen, und zwar dem jeweils früheren von beiden:

| BNY Mellon Absolute Return Bond Fund | Weniger als | | Über | Unver- zinslich | Summe 2021 |
|--|--------------------|-------------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| | 1 Jahr EUR | 1-6 Jahre EUR | 6 Jahre EUR | | |
| 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 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 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 | Weniger als | | Über | Unver- zinslich | Summe 2021 |
| | 1 Monat GBP | 1-3 Monate GBP | 3 Monate 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 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 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

| | Weniger als 1 Monat EUR | 1-3 Monate EUR | Über 3 Monate EUR | Unver- zinslich EUR | Summe 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 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 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*

| | Weniger als 1 Monat USD | 1-3 Monate USD | Über 3 Monate USD | Unver- zinslich USD | Summe 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 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 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 | Weniger als 1 Jahr USD | 1-6 Jahre USD | Über 6 Jahre USD | Unver- zinslich USD | Summe 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 | 655.504.809 |
| 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 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 3.087.954 | – | – | 6.492.741 | 9.580.695 |
| Zinssensitivitätslücke insgesamt | 99.163.922 | – | – | | |
| BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund | Weniger als 1 Jahr USD | 1-6 Jahre USD | Über 6 Jahre USD | Unver- zinslich USD | Summe 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 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 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

| | Weniger als 1 Jahr USD | 1-6 Jahre USD | Über 6 Jahre USD | Unver- zinslich USD | Summe 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 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 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

| | Weniger als 1 Jahr USD | 1-6 Jahre USD | Über 6 Jahre USD | Unver- zinslich USD | Summe 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 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 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

| | Weniger als | | Über | Unver- | Summe |
|--|-------------------|--------------------|--------------------|-------------------|--------------------|
| | 1 Jahr | 1-6 Jahre | 6 Jahre | zinslich | 2021 |
| | USD | USD | USD | USD | 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 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 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

| | Weniger als | | Über | Unver- | Summe |
|--|-------------------|--------------------|--------------------|-------------------|--------------------|
| | 1 Jahr | 1-6 Jahre | 6 Jahre | zinslich | 2021 |
| | USD | USD | USD | USD | 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 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 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 | Weniger als | | Über | Unver- zinslich | Summe |
|--|------------------|-------------------|-------------------|--------------------|--------------------|
| | 1 Jahr | 1-6 Jahre | 6 Jahre | | |
| | USD | USD | USD | USD | 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 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 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 | | | | | |
| | Weniger als | | Über | Unver- zinslich | Summe |
| | 1 Jahr | 1-6 Jahre | 6 Jahre | | |
| | USD | USD | USD | USD | 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 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 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

| | Weniger als 1 Jahr USD | 1-6 Jahre USD | Über 6 Jahre USD | Unver- zinslich USD | Summe 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 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 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

| | Weniger als 1 Jahr USD | 1-6 Jahre USD | Über 6 Jahre USD | Unver- zinslich USD | Summe 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 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 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 | Weniger als | | Über | Unver- zinslich | Summe 2021 |
|---|-------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| | 1 Jahr | 1-6 Jahre | 6 Jahre | | |
| | EUR | EUR | EUR | EUR | 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 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 4.278.379 | – | – | 897.530 | 5.175.909 |
| Zinssensitivitätslücke insgesamt | 6.246.817 | 109.096.315 | 156.948.646 | | |
| BNY Mellon European Credit Fund | | | | | |
| | Weniger als | | Über | Unver- zinslich | Summe 2021 |
| | 1 Jahr | 1-6 Jahre | 6 Jahre | | |
| | EUR | EUR | EUR | EUR | 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 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 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 | Weniger als | | Über 6 Jahre USD | Unver- zinslich USD | Summe 2021 USD |
|---|-------------------|--------------------|------------------------|---------------------------|----------------------|
| | 1 Jahr USD | 1-6 Jahre 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 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 754 | – | – | 4.606.591 | 4.607.345 |
| Zinssensitivitätslücke insgesamt | 15.098.818 | 158.672.376 | 235.130.383 | | |
| BNY Mellon Global Credit Fund | | | | | |
| BNY Mellon Global Credit Fund | Weniger als | | Über 6 Jahre USD | Unver- zinslich USD | Summe 2021 USD |
| | 1 Jahr USD | 1-6 Jahre 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 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 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 | Weniger als | | Über | Unver- zinslich | Summe 2021 |
|--|-------------------|--------------------|-------------------|--------------------|--------------------|
| | 1 Jahr | 1-6 Jahre | 6 Jahre | | |
| | USD | USD | USD | USD | 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 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 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 | | | | | |
| | Weniger als | | Über | Unver- zinslich | Summe 2021 |
| | 1 Jahr | 1-6 Jahre | 6 Jahre | | |
| | USD | USD | USD | USD | 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 |
| Gesamtverbindlichkeiten | – | – | – | 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) | Weniger als | | Über 6 Jahre EUR | Unver- zinslich EUR | Summe 2021 EUR |
|--|--------------------|--------------------|------------------------|---------------------------|----------------------|
| | 1 Jahr EUR | 1-6 Jahre 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 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 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) | Weniger als | | Über 6 Jahre GBP | Unver- zinslich GBP | Summe 2021 GBP |
|--|---------------|------------------|------------------------|---------------------------|----------------------|
| | 1 Jahr GBP | 1-6 Jahre 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 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 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) | Weniger als | | Über | Unver- zinslich | Summe |
|---|-------------------|-------------------|------------------|--------------------|--------------------|
| | 1 Jahr | 1-6 Jahre | 6 Jahre | | |
| | USD | USD | USD | USD | 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 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 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 | Weniger als | | Über | Unver- zinslich | Summe |
|---|------------------|--------------------|-------------------|--------------------|--------------------|
| | 1 Jahr | 1-6 Jahre | 6 Jahre | | |
| | USD | USD | USD | USD | 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 |
| Gesamtverbindlichkeiten | – | – | – | 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 | Weniger als | | Über | Unver- zinslich | Summe |
|--|------------------|------------------|------------------|--------------------|-------------------|
| | 1 Jahr | 1-6 Jahre | 6 Jahre | | |
| | USD | USD | USD | USD | 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 |
| Gesamtverbindlichkeiten | – | – | – | 141.284 | 141.284 |

Zinssensitivitätslücke insgesamt

2.876.300 1.568.110 3.866.625

BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund

| | Weniger als | | Über | Unver- zinslich | Summe |
|--|-------------------|--------------------|-------------------|--------------------|--------------------|
| | 1 Jahr | 1-6 Jahre | 6 Jahre | | |
| | EUR | EUR | EUR | EUR | 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 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 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)

| | Weniger als 1 Jahr EUR | 1-6 Jahre EUR | Über 6 Jahre EUR | Unver- zinslich EUR | Summe 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 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 484.867 | – | – | 1.076.630 | 1.561.497 |

Zinssensitivitätslücke insgesamt

| | | |
|-------------------|------------------|----------------|
| 14.038.590 | 1.811.439 | 516.289 |
|-------------------|------------------|----------------|

BNY Mellon Targeted Return Bond Fund

| | Weniger als 1 Jahr USD | 1-6 Jahre USD | Über 6 Jahre USD | Unver- zinslich USD | Summe 2021 USD |
|--|------------------------------|-------------------|------------------------|---------------------------|----------------------|
| 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 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 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

| | Weniger als 1 Jahr USD | 1-6 Jahre USD | Über 6 Jahre USD | Unver- zinslich USD | Summe 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 |
| Gesamtverbindlichkeiten | – | – | – | 2.174.188 | 2.174.188 |

Zinssensitivitätslücke insgesamt

7.164.708 96.288.463 891.859.486

Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund*

| | Weniger als 1 Jahr EUR | 1-6 Jahre EUR | Über 6 Jahre EUR | Unver- zinslich EUR | Summe 2021 EUR |
|--|------------------------------|--------------------|------------------------|---------------------------|----------------------|
| 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 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 334.898 | 1.295.007 | – | 1.488.800 | 3.118.705 |

Zinssensitivitätslücke insgesamt

65.598.756 454.986.101 457.677.641

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

Die nachfolgende Tabelle fasst das Zinsrisiko für die Gesellschaft zum 31. Dezember 2020 zusammen. Sie enthält die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Gesellschaft zum beizulegenden Zeitwert, kategorisiert nach vertraglicher Zinsanpassung oder Fälligkeitsterminen, und zwar dem jeweils früheren von beiden:

| BNY Mellon Absolute Return Bond Fund | Weniger als | | Über | Unver- zinslich | Summe 2020 |
|--|--------------------|-------------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| | 1 Jahr EUR | 1-6 Jahre EUR | 6 Jahre EUR | | |
| Vermögenswerte | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle | | | | | |
| Vermögenswerte | 152.491.698 | 92.273.911 | 127.192.776 | 14.773.040 | 386.731.425 |
| Barmittel und Bargegenwerte | 41.679.035 | – | – | – | 41.679.035 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 8.566.338 | – | – | – | 8.566.338 |
| Forderungen | – | – | – | 10.508.661 | 10.508.661 |
| Gesamtvermögen | 202.737.071 | 92.273.911 | 127.192.776 | 25.281.701 | 447.485.459 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle | | | | | |
| Verbindlichkeiten | 1.419.338 | 14.055.434 | 375.984 | 2.634.934 | 18.485.690 |
| Banküberziehung | 60 | – | – | – | 60 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 454.563 | – | – | – | 454.563 |
| Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge) | – | – | – | 7.947.970 | 7.947.970 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 1.873.961 | 14.055.434 | 375.984 | 10.582.904 | 26.888.283 |
| Zinssensitivitätslücke insgesamt | 200.863.110 | 78.218.477 | 126.816.792 | | |
| | | | | | |
| BNY Mellon Absolute Return Equity Fund | Weniger als | | Über | Unver- zinslich | Summe 2020 |
| | 1 Monat GBP | 1-3 Monate GBP | 3 Monate GBP | | |
| Vermögenswerte | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle | | | | | |
| Vermögenswerte | 26.004.349 | 38.499.077 | 86.054.551 | 68.366.035 | 218.924.012 |
| Barmittel und Bargegenwerte | 31.868.987 | – | – | – | 31.868.987 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 5.188.797 | – | – | – | 5.188.797 |
| Forderungen | – | – | – | 8.554.480 | 8.554.480 |
| Gesamtvermögen | 63.062.133 | 38.499.077 | 86.054.551 | 76.920.515 | 264.536.276 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle | | | | | |
| Verbindlichkeiten | 20.405 | 444.453 | – | 13.600.393 | 14.065.251 |
| Banküberziehung | 1 | – | – | – | 1 |
| Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge) | – | – | – | 9.131.446 | 9.131.446 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 20.406 | 444.453 | – | 22.731.839 | 23.196.698 |
| Zinssensitivitätslücke insgesamt | 63.041.727 | 38.054.624 | 86.054.551 | | |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund

| | Weniger als 1 Monat EUR | 1-3 Monate EUR | Über 3 Monate EUR | Unver- zinslich EUR | Summe 2020 EUR |
|---|-------------------------------|-------------------|-------------------------|---------------------------|----------------------|
| Vermögenswerte | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte | 4.210.890 | 9.720.646 | 22.117.060 | 3.221.635 | 39.270.231 |
| Barmittel und Bargegenwerte | 218.390 | – | – | – | 218.390 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 628.917 | – | – | – | 628.917 |
| Forderungen | – | – | – | 640.764 | 640.764 |
| Gesamtvermögen | 5.058.197 | 9.720.646 | 22.117.060 | 3.862.399 | 40.758.302 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 1.878 | 18.373 | 260.829 | 5.790.125 | 6.071.205 |
| Banküberziehung | 2.129 | – | – | – | 2.129 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 522.478 | – | – | – | 522.478 |
| Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge) | – | – | – | 939.470 | 939.470 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 526.485 | 18.373 | 260.829 | 6.729.595 | 7.535.282 |
| Zinssensitivitätslücke insgesamt | 4.531.712 | 9.702.273 | 21.856.231 | | |

BNY Mellon Dynamic Total Return Fund

| | Weniger als 1 Jahr USD | 1-6 Jahre USD | Über 6 Jahre USD | Unver- zinslich USD | Summe 2020 USD |
|---|------------------------------|------------------|------------------------|---------------------------|----------------------|
| Vermögenswerte | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte | 13.441.216 | – | – | 1.704.233 | 15.145.449 |
| Barmittel und Bargegenwerte | 2.044.645 | – | – | – | 2.044.645 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 116.070 | – | – | – | 116.070 |
| Forderungen | – | – | – | 1 | 1 |
| Gesamtvermögen | 15.601.931 | – | – | 1.704.234 | 17.306.165 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 123.086 | – | – | 144.295 | 267.381 |
| Banküberziehung | 517.446 | – | – | – | 517.446 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 137.699 | – | – | – | 137.699 |
| Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge) | – | – | – | 17.569 | 17.569 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 778.231 | – | – | 161.864 | 940.095 |
| Zinssensitivitätslücke insgesamt | 14.823.700 | – | – | | |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

| BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund | Weniger als | | Über 6 Jahre USD | Unver- zinslich USD | Summe 2020 USD |
|---|-------------------|-------------------|------------------------|---------------------------|----------------------|
| | 1 Jahr USD | 1-6 Jahre USD | | | |
| Vermögenswerte | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte | 43.763.960 | – | – | 463.063.914 | 506.827.874 |
| Barmittel und Bargegenwerte | 31.795.217 | – | – | – | 31.795.217 |
| Forderungen | – | – | – | 411.762 | 411.762 |
| Gesamtvermögen | 75.559.177 | – | – | 463.475.676 | 539.034.853 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 998.353 | – | – | 8.127 | 1.006.480 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 70.860 | – | – | – | 70.860 |
| Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge) | – | – | – | 1.744.671 | 1.744.671 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 1.069.213 | – | – | 1.752.798 | 2.822.011 |
| Zinssensitivitätslücke insgesamt | 74.489.964 | – | – | | |
| BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund | | | | | |
| BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund | Weniger als | | Über 6 Jahre USD | Unver- zinslich USD | Summe 2020 USD |
| | 1 Jahr USD | 1-6 Jahre USD | | | |
| Vermögenswerte | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte | – | 13.904.028 | 11.482.975 | 24.869 | 25.411.872 |
| Barmittel und Bargegenwerte | 500.737 | – | – | – | 500.737 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 287.943 | – | – | – | 287.943 |
| Forderungen | – | – | – | 378.052 | 378.052 |
| Gesamtvermögen | 788.680 | 13.904.028 | 11.482.975 | 402.921 | 26.578.604 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | – | – | – | 43.183 | 43.183 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 71.397 | – | – | – | 71.397 |
| Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge) | – | – | – | 128.412 | 128.412 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 71.397 | – | – | 171.595 | 242.992 |
| Zinssensitivitätslücke insgesamt | 717.283 | 13.904.028 | 11.482.975 | | |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund

| | Weniger als 1 Jahr USD | 1-6 Jahre USD | Über 6 Jahre USD | Unver- zinslich USD | Summe 2020 USD |
|--|------------------------------|-------------------|------------------------|---------------------------|----------------------|
| Vermögenswerte | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte | 41.386 | 20.849.075 | 21.331.754 | 992.308 | 43.214.523 |
| Barmittel und Bargegenwerte | 706.906 | – | – | – | 706.906 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 283.703 | – | – | – | 283.703 |
| Forderungen | – | – | – | 391.939 | 391.939 |
| Gesamtvermögen | 1.031.995 | 20.849.075 | 21.331.754 | 1.384.247 | 44.597.071 |

Verbindlichkeiten

| | | | | | |
|---|---------------|----------|----------|----------------|----------------|
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 44.678 | – | – | 345.060 | 389.738 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 660 | – | – | – | 660 |
| Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge) | – | – | – | 38.584 | 38.584 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 45.338 | – | – | 383.644 | 428.982 |

Zinssensitivitätslücke insgesamt

986.657 20.849.075 21.331.754

BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund

| | Weniger als 1 Jahr USD | 1-6 Jahre USD | Über 6 Jahre USD | Unver- zinslich USD | Summe 2020 USD |
|--|------------------------------|--------------------|------------------------|---------------------------|----------------------|
| Vermögenswerte | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte | 2.034.553 | 532.145.136 | 637.728.138 | 5.338.922 | 1.177.246.749 |
| Barmittel und Bargegenwerte | 16.666.631 | – | – | – | 16.666.631 |
| Forderungen | – | – | – | 58.148.726 | 58.148.726 |
| Gesamtvermögen | 18.701.184 | 532.145.136 | 637.728.138 | 63.487.648 | 1.252.062.106 |

Verbindlichkeiten

| | | | | | |
|---|----------------|----------|----------|-------------------|-------------------|
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 396.547 | – | – | 49.500 | 446.047 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 191.842 | – | – | – | 191.842 |
| Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge) | – | – | – | 48.073.307 | 48.073.307 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 588.389 | – | – | 48.122.807 | 48.711.196 |

Zinssensitivitätslücke insgesamt

18.112.795 532.145.136 637.728.138

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund

| | Weniger als | | Über | Unver- | Summe |
|--|-------------------|--------------------|--------------------|-------------------|--------------------|
| | 1 Jahr | 1-6 Jahre | 6 Jahre | zinslich | 2020 |
| | USD | USD | USD | USD | USD |
| Vermögenswerte | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte | | | | | |
| Vermögenswerte | 54.862 | 401.082.033 | 334.410.088 | 9.442.896 | 744.989.879 |
| Barmittel und Bargegenwerte | 14.680.942 | – | – | – | 14.680.942 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 2.412.368 | – | – | – | 2.412.368 |
| Forderungen | – | – | – | 14.972.878 | 14.972.878 |
| Gesamtvermögen | 17.148.172 | 401.082.033 | 334.410.088 | 24.415.774 | 777.056.067 |

Verbindlichkeiten

| | | | | | |
|---|----------------|----------|----------|------------------|------------------|
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | | | | | |
| Verbindlichkeiten | – | – | – | 333.500 | 333.500 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 134.822 | – | – | – | 134.822 |
| Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge) | – | – | – | 5.910.932 | 5.910.932 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 134.822 | – | – | 6.244.432 | 6.379.254 |

Zinssensitivitätslücke insgesamt

17.013.350 401.082.033 334.410.088

BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund

| | Weniger als | | Über | Unver- | Summe |
|--|------------------|--------------------|--------------------|-------------------|--------------------|
| | 1 Jahr | 1-6 Jahre | 6 Jahre | zinslich | 2020 |
| | USD | USD | USD | USD | USD |
| Vermögenswerte | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte | | | | | |
| Vermögenswerte | – | 130.961.678 | 238.755.919 | 10.309.826 | 380.027.423 |
| Barmittel und Bargegenwerte | 7.524.437 | – | – | – | 7.524.437 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 1.380.000 | – | – | – | 1.380.000 |
| Forderungen | – | – | – | 5.834.782 | 5.834.782 |
| Gesamtvermögen | 8.904.437 | 130.961.678 | 238.755.919 | 16.144.608 | 394.766.642 |

Verbindlichkeiten

| | | | | | |
|---|----------|----------------|----------|------------------|------------------|
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | | | | | |
| Verbindlichkeiten | – | 228.094 | – | 1.598.114 | 1.826.208 |
| Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge) | – | – | – | 482.499 | 482.499 |
| Gesamtverbindlichkeiten | – | 228.094 | – | 2.080.613 | 2.308.707 |

Zinssensitivitätslücke insgesamt

8.904.437 130.733.584 238.755.919

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

| BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund | Weniger als | | Über | Unver- zinslich | Summe |
|--|------------------|------------------|-------------------|--------------------|-------------------|
| | 1 Jahr | 1-6 Jahre | 6 Jahre | | |
| | USD | USD | USD | USD | USD |
| Vermögenswerte | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle | | | | | |
| Vermögenswerte | 435.256 | 8.310.648 | 29.046.819 | 17.292 | 37.810.015 |
| Barmittel und Bargegenwerte | 1.055.348 | – | – | – | 1.055.348 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 56.220 | – | – | – | 56.220 |
| Forderungen | – | – | – | 467.836 | 467.836 |
| Gesamtvermögen | 1.546.824 | 8.310.648 | 29.046.819 | 485.128 | 39.389.419 |

Verbindlichkeiten

| | | | | | |
|--|---------------|----------|----------|---------------|----------------|
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle | | | | | |
| Verbindlichkeiten | 31.711 | – | – | 1.722 | 33.433 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 23.417 | – | – | – | 23.417 |
| Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge) | – | – | – | 58.181 | 58.181 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 55.128 | – | – | 59.903 | 115.031 |

Zinssensitivitätslücke insgesamt

| | | |
|------------------|------------------|-------------------|
| 1.491.696 | 8.310.648 | 29.046.819 |
|------------------|------------------|-------------------|

BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund

| | Weniger als | | Über | Unver- zinslich | Summe |
|--|------------------|-------------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| | 1 Jahr | 1-6 Jahre | 6 Jahre | | |
| | USD | USD | USD | USD | USD |
| Vermögenswerte | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle | | | | | |
| Vermögenswerte | – | 37.550.830 | 126.263.008 | 1.165.896 | 164.979.734 |
| Barmittel und Bargegenwerte | 1.440.472 | – | – | – | 1.440.472 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 503.000 | – | – | – | 503.000 |
| Forderungen | – | – | – | 3.427.724 | 3.427.724 |
| Gesamtvermögen | 1.943.472 | 37.550.830 | 126.263.008 | 4.593.620 | 170.350.930 |

Verbindlichkeiten

| | | | | | |
|--|--------------|----------|----------|------------------|------------------|
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle | | | | | |
| Verbindlichkeiten | – | – | – | 939.928 | 939.928 |
| Banküberziehung | 1.076 | – | – | – | 1.076 |
| Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge) | – | – | – | 4.741.285 | 4.741.285 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 1.076 | – | – | 5.681.213 | 5.682.289 |

Zinssensitivitätslücke insgesamt

| | | |
|------------------|-------------------|--------------------|
| 1.942.396 | 37.550.830 | 126.263.008 |
|------------------|-------------------|--------------------|

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund

| | Weniger als 1 Jahr USD | 1-6 Jahre USD | Über 6 Jahre USD | Unver- zinslich USD | Summe 2020 USD |
|--|------------------------------|------------------|------------------------|---------------------------|----------------------|
| Vermögenswerte | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte | 20.000 | 7.656.624 | 20.064.316 | 69.009 | 27.809.949 |
| Barmittel und Bargegenwerte | 883.156 | – | – | – | 883.156 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 78.989 | – | – | – | 78.989 |
| Forderungen | – | – | – | 579.892 | 579.892 |
| Gesamtvermögen | 982.145 | 7.656.624 | 20.064.316 | 648.901 | 29.351.986 |

Verbindlichkeiten

| | | | | | |
|---|--------------|----------|----------|------------------|------------------|
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 550 | – | – | 89.046 | 89.596 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 8.378 | – | – | – | 8.378 |
| Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge) | – | – | – | 990.021 | 990.021 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 8.928 | – | – | 1.079.067 | 1.087.995 |

Zinssensitivitätslücke insgesamt

| | | |
|----------------|------------------|-------------------|
| 973.217 | 7.656.624 | 20.064.316 |
|----------------|------------------|-------------------|

BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund

| | Weniger als 1 Jahr USD | 1-6 Jahre USD | Über 6 Jahre USD | Unver- zinslich USD | Summe 2020 USD |
|--|------------------------------|-------------------|------------------------|---------------------------|----------------------|
| Vermögenswerte | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte | 5.736.978 | 48.962.924 | 99.266.772 | 9.769.646 | 163.736.320 |
| Barmittel und Bargegenwerte | 1.378.019 | – | – | – | 1.378.019 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 1.231.209 | – | – | – | 1.231.209 |
| Forderungen | – | – | – | 2.797.283 | 2.797.283 |
| Gesamtvermögen | 8.346.206 | 48.962.924 | 99.266.772 | 12.566.929 | 169.142.831 |

Verbindlichkeiten

| | | | | | |
|---|------------|----------|----------|------------------|------------------|
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | – | – | – | 2.857.770 | 2.857.770 |
| Banküberziehung | 448 | – | – | – | 448 |
| Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge) | – | – | – | 688.673 | 688.673 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 448 | – | – | 3.546.443 | 3.546.891 |

Zinssensitivitätslücke insgesamt

| | | |
|------------------|-------------------|-------------------|
| 8.345.758 | 48.962.924 | 99.266.772 |
|------------------|-------------------|-------------------|

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

| BNY Mellon Euroland Bond Fund | Weniger als | | Über 6 Jahre EUR | Unver- zinslich EUR | Summe 2020 EUR |
|--|-------------------|-------------------|------------------------|---------------------------|----------------------|
| | 1 Jahr EUR | 1-6 Jahre EUR | | | |
| Vermögenswerte | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle | | | | | |
| Vermögenswerte | 18.984.608 | 82.156.246 | 314.811.076 | 15.827.587 | 431.779.517 |
| Barmittel und Bargegenwerte | 12.518.692 | – | – | – | 12.518.692 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 1.476.820 | – | – | – | 1.476.820 |
| Forderungen | – | – | – | 5.450.772 | 5.450.772 |
| Gesamtvermögen | 32.980.120 | 82.156.246 | 314.811.076 | 21.278.359 | 451.225.801 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle | | | | | |
| Verbindlichkeiten | 153.163 | – | – | 633.155 | 786.318 |
| Banküberziehung | 22 | – | – | – | 22 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 4.723.319 | – | – | – | 4.723.319 |
| Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge) | – | – | – | 2.808.026 | 2.808.026 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 4.876.504 | – | – | 3.441.181 | 8.317.685 |
| Zinssensitivitätslücke insgesamt | 28.103.616 | 82.156.246 | 314.811.076 | | |
| BNY Mellon European Credit Fund | | | | | |
| BNY Mellon European Credit Fund | Weniger als | | Über 6 Jahre EUR | Unver- zinslich EUR | Summe 2020 EUR |
| | 1 Jahr EUR | 1-6 Jahre EUR | | | |
| Vermögenswerte | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle | | | | | |
| Vermögenswerte | 767.372 | 17.945.309 | 19.532.334 | 2.095.275 | 40.340.290 |
| Barmittel und Bargegenwerte | 1.339.272 | – | – | – | 1.339.272 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 867.954 | – | – | – | 867.954 |
| Forderungen | – | – | – | 289.292 | 289.292 |
| Gesamtvermögen | 2.974.598 | 17.945.309 | 19.532.334 | 2.384.567 | 42.836.808 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle | | | | | |
| Verbindlichkeiten | 4.300 | 112.022 | – | 8.081 | 124.403 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 613.805 | – | – | – | 613.805 |
| Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge) | – | – | – | 1.599.861 | 1.599.861 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 618.105 | 112.022 | – | 1.607.942 | 2.338.069 |
| Zinssensitivitätslücke insgesamt | 2.356.493 | 17.833.287 | 19.532.334 | | |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

| BNY Mellon Global Bond Fund | Weniger als | | Über 6 Jahre USD | Unver- zinslich USD | Summe 2020 USD |
|---|-------------------|--------------------|------------------------|---------------------------|----------------------|
| | 1 Jahr USD | 1-6 Jahre USD | | | |
| Vermögenswerte | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte | 25.608.647 | 191.621.397 | 368.746.690 | 18.593.619 | 604.570.353 |
| Barmittel und Bargegenwerte | 9.973.908 | – | – | – | 9.973.908 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 1.237.172 | – | – | – | 1.237.172 |
| Forderungen | – | – | – | 4.540.460 | 4.540.460 |
| Gesamtvermögen | 36.819.727 | 191.621.397 | 368.746.690 | 23.134.079 | 620.321.893 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 13.115 | – | – | 3.033.181 | 3.046.296 |
| Banküberziehung | 1.196.446 | – | – | – | 1.196.446 |
| Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge) | – | – | – | 1.195.853 | 1.195.853 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 1.209.561 | – | – | 4.229.034 | 5.438.595 |
| Zinssensitivitätslücke insgesamt | 35.610.166 | 191.621.397 | 368.746.690 | | |
| BNY Mellon Global Credit Fund | | | | | |
| BNY Mellon Global Credit Fund | Weniger als | | Über 6 Jahre USD | Unver- zinslich USD | Summe 2020 USD |
| | 1 Jahr USD | 1-6 Jahre USD | | | |
| Vermögenswerte | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte | 13.477.412 | 357.991.136 | 402.508.577 | 17.134.592 | 791.111.717 |
| Barmittel und Bargegenwerte | 18.869.816 | – | – | – | 18.869.816 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 7.218.304 | – | – | – | 7.218.304 |
| Forderungen | – | – | – | 5.939.232 | 5.939.232 |
| Gesamtvermögen | 39.565.532 | 357.991.136 | 402.508.577 | 23.073.824 | 823.139.069 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 1.105.231 | 6.823.006 | – | 3.014.696 | 10.942.933 |
| Banküberziehung | 793.393 | – | – | – | 793.393 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 6.872.987 | – | – | – | 6.872.987 |
| Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge) | – | – | – | 1.147.952 | 1.147.952 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 8.771.611 | 6.823.006 | – | 4.162.648 | 19.757.265 |
| Zinssensitivitätslücke insgesamt | 30.793.921 | 351.168.130 | 402.508.577 | | |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

| BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund | Weniger als | | Über | Unver- zinslich | Summe 2020 |
|--|-------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| | 1 Jahr | 1-6 Jahre | 6 Jahre | | |
| | USD | USD | USD | USD | USD |
| Vermögenswerte | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte | 22.535.184 | 249.152.358 | 183.184.934 | 30.186.343 | 485.058.819 |
| Barmittel und Bargegenwerte | 12.334.176 | – | – | – | 12.334.176 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 4.106.192 | – | – | – | 4.106.192 |
| Forderungen | – | – | – | 4.125.067 | 4.125.067 |
| Gesamtvermögen | 38.975.552 | 249.152.358 | 183.184.934 | 34.311.410 | 505.624.254 |

Verbindlichkeiten

| | | | | | |
|---|------------------|----------|----------|------------------|------------------|
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 10.800 | – | – | 5.173.432 | 5.184.232 |
| Banküberziehung | 1.645.000 | – | – | – | 1.645.000 |
| Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge) | – | – | – | 660.909 | 660.909 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 1.655.800 | – | – | 5.834.341 | 7.490.141 |

Zinssensitivitätslücke insgesamt

37.319.752 249.152.358 183.184.934

| BNY Mellon Global High Yield Bond Fund | Weniger als | | Über | Unver- zinslich | Summe 2020 |
|--|------------------|-------------------|-------------------|--------------------|--------------------|
| | 1 Jahr | 1-6 Jahre | 6 Jahre | | |
| | USD | USD | USD | USD | USD |
| Vermögenswerte | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte | – | 67.083.025 | 81.359.833 | 550.506 | 148.993.364 |
| Barmittel und Bargegenwerte | 3.903.316 | – | – | – | 3.903.316 |
| Forderungen | – | – | – | 2.901.801 | 2.901.801 |
| Gesamtvermögen | 3.903.316 | 67.083.025 | 81.359.833 | 3.452.307 | 155.798.481 |

Verbindlichkeiten

| | | | | | |
|---|----------|----------|----------|------------------|------------------|
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | – | – | – | 122.171 | 122.171 |
| Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge) | – | – | – | 2.252.017 | 2.252.017 |
| Gesamtverbindlichkeiten | – | – | – | 2.374.188 | 2.374.188 |

Zinssensitivitätslücke insgesamt

3.903.316 67.083.025 81.359.833

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund

| | Weniger als 1 Jahr EUR | 1-6 Jahre EUR | Über 6 Jahre EUR | Unver- zinslich EUR | Summe 2020 EUR |
|--|------------------------------|------------------|------------------------|---------------------------|----------------------|
| Vermögenswerte | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte | 102.928 | 1.269.608 | 2.248.547 | 16.758.260 | 20.379.343 |
| Barmittel und Bargegenwerte | 446.608 | – | – | – | 446.608 |
| Forderungen | – | – | – | 72.518 | 72.518 |
| Gesamtvermögen | 549.536 | 1.269.608 | 2.248.547 | 16.830.778 | 20.898.469 |

Verbindlichkeiten

| | | | | | |
|---|----------|----------|----------|----------------|----------------|
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | – | – | – | 126.199 | 126.199 |
| Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge) | – | – | – | 27.545 | 27.545 |
| Gesamtverbindlichkeiten | – | – | – | 153.744 | 153.744 |

Zinssensitivitätslücke insgesamt

| | | |
|----------------|------------------|------------------|
| 549.536 | 1.269.608 | 2.248.547 |
|----------------|------------------|------------------|

BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)

| | Weniger als 1 Jahr EUR | 1-6 Jahre EUR | Über 6 Jahre EUR | Unver- zinslich EUR | Summe 2020 EUR |
|--|------------------------------|--------------------|------------------------|---------------------------|----------------------|
| Vermögenswerte | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte | 86.220.107 | 207.268.996 | 177.045.396 | 2.410.900.151 | 2.881.434.650 |
| Barmittel und Bargegenwerte | 91.403.260 | – | – | – | 91.403.260 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 10.064.465 | – | – | – | 10.064.465 |
| Forderungen | – | – | – | 64.600.301 | 64.600.301 |
| Gesamtvermögen | 187.687.832 | 207.268.996 | 177.045.396 | 2.475.500.452 | 3.047.502.676 |

Verbindlichkeiten

| | | | | | |
|---|-------------------|----------|----------|--------------------|--------------------|
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 8.313.488 | – | – | 16.084.605 | 24.398.093 |
| Banküberziehung | 1.203.141 | – | – | – | 1.203.141 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 2.809.531 | – | – | – | 2.809.531 |
| Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge) | – | – | – | 92.210.965 | 92.210.965 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 12.326.160 | – | – | 108.295.570 | 120.621.730 |

Zinssensitivitätslücke insgesamt

| | | |
|--------------------|--------------------|--------------------|
| 175.361.672 | 207.268.996 | 177.045.396 |
|--------------------|--------------------|--------------------|

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

| BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP) | Weniger als | | Über 6 Jahre GBP | Unver- zinslich GBP | Summe 2020 GBP |
|--|------------------|------------------|------------------------|---------------------------|----------------------|
| | 1 Jahr GBP | 1-6 Jahre GBP | | | |
| Vermögenswerte | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte | 1.977.958 | 4.353.966 | 3.955.028 | 50.687.482 | 60.974.434 |
| Barmittel und Bargegenwerte | 2.075.704 | – | – | – | 2.075.704 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 198.144 | – | – | – | 198.144 |
| Forderungen | – | – | – | 1.181.292 | 1.181.292 |
| Gesamtvermögen | 4.251.806 | 4.353.966 | 3.955.028 | 51.868.774 | 64.429.574 |

Verbindlichkeiten

| | | | | | |
|---|----------------|----------|----------|------------------|------------------|
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 185.509 | – | – | 257.658 | 443.167 |
| Banküberziehung | 898 | – | – | – | 898 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 65.415 | – | – | – | 65.415 |
| Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge) | – | – | – | 1.157.589 | 1.157.589 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 251.822 | – | – | 1.415.247 | 1.667.069 |

Zinssensitivitätslücke insgesamt

| | | |
|------------------|------------------|------------------|
| 3.999.984 | 4.353.966 | 3.955.028 |
|------------------|------------------|------------------|

| BNY Mellon Global Real Return Fund (USD) | Weniger als | | Über 6 Jahre USD | Unver- zinslich USD | Summe 2020 USD |
|--|---------------|------------------|------------------------|---------------------------|----------------------|
| | 1 Jahr USD | 1-6 Jahre USD | | | |

Vermögenswerte

| | | | | | |
|--|-------------------|-------------------|-------------------|--------------------|--------------------|
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte | 9.025.840 | 23.486.652 | 17.487.887 | 241.344.592 | 291.344.971 |
| Barmittel und Bargegenwerte | 11.167.248 | – | – | – | 11.167.248 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 4.085.613 | – | – | – | 4.085.613 |
| Forderungen | – | – | – | 536.217 | 536.217 |
| Gesamtvermögen | 24.278.701 | 23.486.652 | 17.487.887 | 241.880.809 | 307.134.049 |

Verbindlichkeiten

| | | | | | |
|---|------------------|----------|----------|------------------|------------------|
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 891.632 | – | – | 4.790.803 | 5.682.435 |
| Banküberziehung | 11 | – | – | – | 11 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 271.606 | – | – | – | 271.606 |
| Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge) | – | – | – | 357.120 | 357.120 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 1.163.249 | – | – | 5.147.923 | 6.311.172 |

Zinssensitivitätslücke insgesamt

| | | |
|-------------------|-------------------|-------------------|
| 23.115.452 | 23.486.652 | 17.487.887 |
|-------------------|-------------------|-------------------|

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund

| | Weniger als | | Über | Unver- | Summe |
|--|-------------------|--------------------|-------------------|-------------------|--------------------|
| | 1 Jahr | 1-6 Jahre | 6 Jahre | zinslich | 2020 |
| | USD | USD | USD | USD | USD |
| Vermögenswerte | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte | | | | | |
| Vermögenswerte | 13.565.001 | 542.173.803 | 92.099.559 | 43.485.213 | 691.323.576 |
| Barmittel und Bargegenwerte | 194.717 | – | – | – | 194.717 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 13.596.505 | – | – | – | 13.596.505 |
| Forderungen | – | – | – | 10.874.787 | 10.874.787 |
| Gesamtvermögen | 27.356.223 | 542.173.803 | 92.099.559 | 54.360.000 | 715.989.585 |

Verbindlichkeiten

| | | | | | |
|---|----------------|---------------|----------|-------------------|-------------------|
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | | | | | |
| Verbindlichkeiten | – | 46.988 | – | 11.621.219 | 11.668.207 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 327.110 | – | – | – | 327.110 |
| Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge) | – | – | – | 2.277.789 | 2.277.789 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 327.110 | 46.988 | – | 13.899.008 | 14.273.106 |

Zinssensitivitätslücke insgesamt

27.029.113 542.126.815 92.099.559

BNY Mellon Global Unconstrained Fund

| | Weniger als | | Über | Unver- | Summe |
|--|------------------|------------------|------------------|-------------------|-------------------|
| | 1 Jahr | 1-6 Jahre | 6 Jahre | zinslich | 2020 |
| | USD | USD | USD | USD | USD |
| Vermögenswerte | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte | | | | | |
| Vermögenswerte | 60.184 | 1.763.363 | 4.050.430 | 22.735.175 | 28.609.152 |
| Barmittel und Bargegenwerte | 1.459.778 | – | – | – | 1.459.778 |
| Forderungen | – | – | – | 63.387 | 63.387 |
| Gesamtvermögen | 1.519.962 | 1.763.363 | 4.050.430 | 22.798.562 | 30.132.317 |

Verbindlichkeiten

| | | | | | |
|---|----------|----------|----------|----------------|----------------|
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | | | | | |
| Verbindlichkeiten | – | – | – | 128.731 | 128.731 |
| Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge) | – | – | – | 13.427 | 13.427 |
| Gesamtverbindlichkeiten | – | – | – | 142.158 | 142.158 |

Zinssensitivitätslücke insgesamt

1.519.962 1.763.363 4.050.430

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund

| | Weniger als 1 Jahr EUR | 1-6 Jahre EUR | Über 6 Jahre EUR | Unver- zinslich EUR | Summe 2020 EUR |
|--|------------------------------|--------------------|------------------------|---------------------------|----------------------|
| Vermögenswerte | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte | 8.756.867 | 146.211.066 | 105.475.954 | 4.971.038 | 265.414.925 |
| Barmittel und Bargegenwerte | 6.404.396 | – | – | – | 6.404.396 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 291.146 | – | – | – | 291.146 |
| Forderungen | – | – | – | 6.347.810 | 6.347.810 |
| Gesamtvermögen | 15.452.409 | 146.211.066 | 105.475.954 | 11.318.848 | 278.458.277 |

Verbindlichkeiten

| | | | | | |
|---|--------------|----------|----------|------------------|------------------|
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 5.487 | – | – | 2.744.706 | 2.750.193 |
| Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge) | – | – | – | 4.386.200 | 4.386.200 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 5.487 | – | – | 7.130.906 | 7.136.393 |

Zinssensitivitätslücke insgesamt

| | | |
|-------------------|--------------------|--------------------|
| 15.446.922 | 146.211.066 | 105.475.954 |
|-------------------|--------------------|--------------------|

BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)

| | Weniger als 1 Jahr EUR | 1-6 Jahre EUR | Über 6 Jahre EUR | Unver- zinslich EUR | Summe 2020 EUR |
|--|------------------------------|------------------|------------------------|---------------------------|----------------------|
| Vermögenswerte | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte | 850.575 | 1.868.519 | 2.688.138 | 27.831.048 | 33.238.280 |
| Barmittel und Bargegenwerte | 835.974 | – | – | – | 835.974 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 89.561 | – | – | – | 89.561 |
| Forderungen | – | – | – | 434.379 | 434.379 |
| Gesamtvermögen | 1.776.110 | 1.868.519 | 2.688.138 | 28.265.427 | 34.598.194 |

Verbindlichkeiten

| | | | | | |
|---|---------------|----------|----------|----------------|----------------|
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 91.148 | – | – | 204.318 | 295.466 |
| Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge) | – | – | – | 55.352 | 55.352 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 91.148 | – | – | 259.670 | 350.818 |

Zinssensitivitätslücke insgesamt

| | | |
|------------------|------------------|------------------|
| 1.684.962 | 1.868.519 | 2.688.138 |
|------------------|------------------|------------------|

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

| BNY Mellon Targeted Return Bond Fund | Weniger als | | Über | Unver- zinslich | Summe 2020 |
|---|-------------------|-------------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| | 1 Jahr USD | 1-6 Jahre USD | 6 Jahre USD | | |
| Vermögenswerte | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte | 6.713.169 | 32.091.138 | 51.579.791 | 1.763.033 | 92.147.131 |
| Barmittel und Bargegenwerte | 2.518.429 | – | – | – | 2.518.429 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 83 | – | – | – | 83 |
| Forderungen | – | – | – | 607.623 | 607.623 |
| Gesamtvermögen | 9.231.681 | 32.091.138 | 51.579.791 | 2.370.656 | 95.273.266 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 48.837 | – | – | 332.738 | 381.575 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 102.845 | – | – | – | 102.845 |
| Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge) | – | – | – | 1.836.588 | 1.836.588 |
| Gesamtverbindlichkeiten | 151.682 | – | – | 2.169.326 | 2.321.008 |
| Zinssensitivitätslücke insgesamt | 9.079.999 | 32.091.138 | 51.579.791 | | |
| BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund | | | | | |
| | Weniger als | | Über | Unver- zinslich | Summe 2020 |
| | 1 Jahr USD | 1-6 Jahre USD | 6 Jahre USD | | |
| Vermögenswerte | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte | 1.739.222 | 62.604.894 | 524.102.820 | 2.183.004 | 590.629.940 |
| Barmittel und Bargegenwerte | 25.882.480 | – | – | – | 25.882.480 |
| Forderungen | – | – | – | 7.892.636 | 7.892.636 |
| Gesamtvermögen | 27.621.702 | 62.604.894 | 524.102.820 | 10.075.640 | 624.405.056 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | – | – | – | 77.833 | 77.833 |
| Kreditoren (innerhalb eines Jahres fällige Beträge) | – | – | – | 10.410.941 | 10.410.941 |
| Gesamtverbindlichkeiten | – | – | – | 10.488.774 | 10.488.774 |
| Zinssensitivitätslücke insgesamt | 27.621.702 | 62.604.894 | 524.102.820 | | |

Bei jenen Fonds, die vorwiegend zinstragende Wertpapiere halten und damit dem Risiko von Schwankungen der jeweils herrschenden Marktzinsen ausgesetzt sind, überwachen die Anlageverwalter täglich das Risiko von Zinsschwankungen, dem die Fonds ausgesetzt sind. Obgleich es sich vorwiegend um eine Anlageentscheidung handelt, verwenden die Anlageverwalter eigene Systeme und Verfahren, um die Fonds optimal zu positionieren und vom Risiko von Schwankungen der vorherrschenden Marktzinsen zu profitieren bzw. dies zu begrenzen.

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

Die Anlageverwalter werden sich bemühen, an liquiden Märkten zinstragende Wertpapiere zu erwerben. Jedoch werden nicht alle Wertpapiere, in denen die Fonds anlegen, an einer Börse notiert oder von einer Ratingagentur eingestuft sein, weshalb ihre Liquidität möglicherweise gering ist. Überdies können der Erwerb und die Veräußerung einiger Wertpapierbeteiligungen zeitaufwändig sein und müssen unter Umständen zu ungünstigen Kursen erfolgen. Möglicherweise können die Fonds ihre Anlagen aufgrund von widrigen Marktbedingungen und einer dadurch bedingten eingeschränkten Liquidität nicht zu einem angemessenen Preis veräußern. Die Finanzmärkte von Schwellenländern weisen in der Regel eine geringere Liquidität auf als die Finanzmärkte höher entwickelter Länder. Der Erwerb und die Veräußerung von Anlagen können unter Umständen länger dauern, als normalerweise an einem Aktienmarkt in einem Industrieland zu erwarten wäre. Zudem müssen Transaktionen möglicherweise zu ungünstigen Kursen durchgeführt werden.

Die nachfolgende Tabelle veranschaulicht die Auswirkungen eines Anstiegs der Marktzinsen um 25 Basispunkte („Bp.“) an den Hauptmärkten, an denen die aufgeführten Fonds investiert waren.

Bei einem angenommenen Anstieg der Zinsen um 25 Bp. bei ansonsten konstanten Variablen hätte sich der Gesamtertrag der Fonds zum 31. Dezember 2021 und 31. Dezember 2020 umgehend wie nachfolgend aufgeführt verändert (ein Rückgang um 25 Bp. hätte analoge, aber entgegengesetzte Auswirkungen auf die Gesamterträge der Fonds).

| Fonds | Funktionale Währung | Gesamtertrag der Fonds (%) – Umgehende Veränderung 2021 | Gesamtertrag der Fonds (%) – Umgehende Veränderung 2020 |
|---|---------------------|---|---|
| BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund | USD | 0,928 | 0,920 |
| BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund | USD | 1,588 | 1,638 |
| BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund | USD | 1,508 | 1,618 |
| BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund | USD | 0,973 | 0,915 |
| BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund | USD | 1,300 | 1,300 |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund | USD | 1,200 | 1,650 |
| BNY Mellon Global Bond Fund | USD | 1,933 | 2,165 |
| BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund > | USD | k. A. | 1,053 |
| BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund *> | EUR | k. A. | 0,040 |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) > | EUR | k. A. | 0,287 |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP) > | GBP | k. A. | 0,291 |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (USD) > | USD | k. A. | 0,292 |
| BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund | USD | 0,265 | 0,415 |
| BNY Mellon Global Unconstrained Fund | USD | 0,052 | 0,079 |
| BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund > | EUR | k. A. | 1,033 |
| BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR) > | EUR | k. A. | 0,262 |
| Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund * | EUR | 1,148 | k. A. |

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

> Mit Wirkung vom 22. Januar 2021 änderte sich die Methode zum Gesamtengagement und Leverage für diese Fonds vom Commitment-Ansatz zur Absolute VaR-Methode.

Zu beachten ist, dass künftige Marktbedingungen erheblich abweichen können und die Tabelle nur der Veranschaulichung dient.

Bei Fonds, die den VaR-Ansatz verwenden, wurde die Analyse der Zinsrisikosensitivität bei der Berechnung des Marktpreisrisikos berücksichtigt.

WÄHRUNGSRISIKO

Das Währungsrisiko wird als das Risiko definiert, dass der beizulegende Zeitwert eines Finanzinstruments aufgrund von Wechselkursveränderungen schwankt. Das Risiko betrifft Finanzinstrumente, die auf eine andere als die funktionale Währung lauten, in der sie bewertet werden.

Die Anlageverwalter überwachen die Währungsposition der Gesellschaft auf täglicher Basis, und dürfen durch Verwendung von FDI, wie z. B. Devisenterminkontrakte oder Optionen, eingreifen, um das Währungsrisiko der Gesellschaft zu steuern. Die Anlageverwalter von abgesicherten Anteilsklassen, bei denen es sich nicht um die Basisanteilsklasse handelt, dürfen ebenfalls Derivate wie Devisenterminkontrakte oder Optionen als Schlüsselkomponente ihrer Betriebsstrategie verwenden. Aus Finanzinstrumenten, die auf die funktionale Währung lauten, darf kein Währungsrisiko entstehen.

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSIKO Forts.

Die nachfolgenden Tabellen geben Auskunft über das wesentliche Fremdwährungsrisiko, dem die Gesellschaft am 31. Dezember 2021 ausgesetzt war:

| Fonds | Währung | Netto- engagement 31. Dezember 2021 | Monetäre Vermögenswerte | Monetäre Verbind- lichkeiten | Nicht-monetäre Vermögenswerte | Hedging (Absicherung) |
|---|-------------------------|--|----------------------------|------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|
| 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 | – | – | – |
| | 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) | – | – |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSIKO Forts.

| Fonds | Währung | Netto- engagement 31. Dezember 2021 | Monetäre Vermögenswerte | Monetäre Verbind- lichkeiten | Nicht-monetäre Vermögenswerte | Hedging (Absicherung) |
|--|---------|--|----------------------------|------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|
| BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund Forts. | | | | | | |
| | | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR |
| Pfund Sterling | | 54.386 | 111.916 | (57.530) | – | – |
| Schwedische Krone | | 4.860 | 4.860 | – | – | – |
| Schweizer Franken | | 159.552 | 1.790.306 | (1.630.754) | – | – |
| US-Dollar | | 1.884.955 | 12.343.169 | (9.581.011) | – | (877.203) |
| | | 2.472.400 | 14.837.201 | (11.487.598) | – | (877.203) |

BNY Mellon Asian Equity Fund

| | | | | | | |
|----------------------|--|-------------------|----------------|------------------|-------------------|---------------|
| | | USD | USD | USD | USD | USD |
| Australischer Dollar | | 3.209.365 | – | – | 3.209.365 | – |
| Chinesischer Yuan | | 9.460.697 | – | – | 9.460.697 | – |
| Euro | | 1.700.678 | – | (47.055) | 1.703.630 | 44.103 |
| Hongkong-Dollar | | 12.405.687 | – | – | 12.405.687 | – |
| Indische Rupie | | 16.928.641 | 7.075 | (311.766) | 17.233.332 | – |
| Indonesische Rupiah | | 903.771 | – | – | 903.771 | – |
| Koreanischer Won | | 4.117.514 | – | – | 4.117.514 | – |
| Philippinischer Peso | | 11 | – | – | 11 | – |
| Taiwan-Dollar | | 6.511.683 | 539.902 | – | 5.971.781 | – |
| | | 55.238.047 | 546.977 | (358.821) | 55.005.788 | 44.103 |

BNY Mellon Asian Income Fund

| | | | | | | |
|-------------------------|--|-------------------|---------------|--------------|-------------------|-----------------|
| | | USD | USD | USD | USD | USD |
| Australischer Dollar | | 1.273.553 | – | – | 1.273.553 | – |
| Chinesischer Yuan | | 209.001 | – | – | 209.001 | – |
| Euro | | 6.700 | 17.268 | – | – | (10.568) |
| Hongkong-Dollar | | 2.584.477 | 14.468 | – | 2.570.009 | – |
| Indonesische Rupiah | | 762.735 | – | – | 762.735 | – |
| Koreanischer Won | | 1.631.246 | – | – | 1.631.246 | – |
| Neuseeländischer Dollar | | 705.032 | – | – | 705.032 | – |
| Singapur-Dollar | | 2.587.372 | – | – | 2.587.372 | – |
| Pfund Sterling | | 612.953 | – | (327) | 612.953 | 327 |
| Taiwan-Dollar | | 2.633.758 | 5.926 | – | 2.627.832 | – |
| Thailändischer Baht | | 519.217 | – | – | 519.217 | – |
| | | 13.526.044 | 37.662 | (327) | 13.498.950 | (10.241) |

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 | – | – | – |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSIKO Forts.

| Fonds | Währung | Netto- engagement 31. Dezember 2021 | Monetäre Vermögenswerte | Monetäre Verbind- lichkeiten | Nicht-monetäre Vermögenswerte | Hedging (Absicherung) |
|---|---------|--|----------------------------|------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|
| BNY Mellon Brazil Equity Fund Forts. | | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD | USD |
| 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) |
| 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) |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSKO Forts.

| Fonds | Währung | Netto- engagement 31. Dezember 2021 | Monetäre Vermögenswerte | Monetäre Verbind- lichkeiten | Nicht-monetäre Vermögenswerte | Hedging (Absicherung) |
|---|---------|--|----------------------------|------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|
| 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) |
| 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 | - | - | - |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSIKO Forts.

| Fonds | Währung | Netto- engagement 31. Dezember 2021 | Monetäre Vermögenswerte | Monetäre Verbind- lichkeiten | Nicht-monetäre Vermögenswerte | Hedging (Absicherung) |
|---|------------------------|--|----------------------------|------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund Forts. | | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD | USD |
| | Brasilianischer Real | 1.191.310 | 863.681 | - | - | 327.629 |
| | Chilenischer Peso | 835.323 | 1.332.556 | - | - | (497.233) |
| | Chinesischer Yuan | 1.366.146 | 1.967.394 | - | - | (601.248) |
| | Kolumbianischer Peso | 1.097.552 | 831.394 | - | - | 266.158 |
| | Tschechische Krone | 232.963 | 287.058 | - | - | (54.095) |
| | Euro | (4.350) | 356.867 | - | - | (361.217) |
| | Hongkong-Dollar | (982.371) | - | - | - | (982.371) |
| | Ungarischer Forint | 873.475 | 268.721 | - | - | 604.754 |
| | Indische Rupie | 421.525 | - | - | - | 421.525 |
| | Indonesische Rupiah | 636.645 | 845.550 | - | - | (208.905) |
| | Malaysischer Ringgit | 1.185.376 | 391.706 | - | - | 793.670 |
| | Mexikanischer Peso | 1.367.220 | 1.716.426 | - | - | (349.206) |
| | Peruanischer neuer Sol | 8.874 | 245.994 | - | - | (237.120) |
| | Philippinischer Peso | 20.023 | - | - | - | 20.023 |
| | Polnischer Zloty | 1.424.483 | - | - | - | 1.424.483 |
| | Rumänischer Leu | (129.018) | 24.086 | - | - | (153.104) |
| | Russischer Rubel | 1.660.374 | 2.298.424 | - | - | (638.050) |
| | Südafrikanischer Rand | 1.125.840 | 1.878.849 | - | - | (753.009) |
| | Pfund Sterling | 421 | 421 | - | - | - |
| | Taiwan-Dollar | (553.352) | - | - | - | (553.352) |
| | Thailändischer Baht | 1.521.496 | 748.775 | - | - | 772.721 |
| | Türkische Lira | 23.472 | - | - | - | 23.472 |
| | Uruguayischer Peso | 39.755 | 39.755 | - | - | - |
| | | 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 Schekel | 250 | 250 | - | - | - |
| | Kasachischer Tenge | 485.905 | 485.905 | - | - | - |
| | Malaysischer Ringgit | 3.546.826 | 1.638.184 | (191) | - | 1.908.833 |
| | Mexikanischer Peso | 4.264.529 | 7.361.110 | - | - | (3.096.581) |
| | Peruanischer neuer Sol | 914.353 | 914.353 | - | - | - |
| | Polnischer Zloty | 3.073.612 | 34 | - | - | 3.073.578 |
| | Rumänischer Leu | 1.429.540 | 167 | - | - | 1.429.373 |
| | Russischer Rubel | 4.935.063 | 5.994.493 | - | - | (1.059.430) |
| | Südafrikanischer Rand | 3.510.235 | 7.379.268 | - | - | (3.869.033) |
| | Pfund Sterling | 488 | 488 | - | - | - |
| | Thailändischer Baht | 5.693.585 | 1.349.687 | - | - | 4.343.898 |
| | Türkische Lira | 739 | 739 | - | - | - |
| | | 50.213.429 | 61.090.650 | (191) | - | (10.877.030) |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISIKO Forts.

| Fonds | Währung | Netto- engagement 31. Dezember | Monetäre Vermögenswerte | Monetäre Verbind- lichkeiten | Nicht-monetäre Vermögenswerte | Hedging (Absicherung) |
|--|---------|--------------------------------------|----------------------------|------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|
| | | 2021 | EUR | EUR | EUR | EUR |
| BNY Mellon Euroland Bond Fund | | | | | | |
| Chinesischer Yuan | | 20.246 | 4.107.121 | - | - | (4.086.875) |
| Indische Rupie | | (431.615) | - | - | - | (431.615) |
| Japanischer Yen | | 1.959 | 1.959 | - | - | - |
| Mexikanischer Peso | | (104.236) | 5.033.984 | - | - | (5.138.220) |
| Norwegische Krone | | (366.294) | 17.395.709 | - | - | (17.762.003) |
| Russischer Rubel | | (77.876) | 1.480.784 | - | - | (1.558.660) |
| Pfund Sterling | | (94.668) | 47.854 | - | - | (142.522) |
| Schwedische Krone | | (697.549) | - | - | - | (697.549) |
| Schweizer Franken | | 3.588 | 3.588 | - | - | - |
| Taiwan-Dollar | | (1.137.134) | - | - | - | (1.137.134) |
| US-Dollar | | 215.125 | 33.412.096 | (95.931) | 2.426.564 | (35.527.604) |
| | | (2.668.454) | 61.483.095 | (95.931) | 2.426.564 | (66.482.182) |
| BNY Mellon European Credit Fund | | | | | | |
| 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* | | | | | | |
| 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* | | | | | | |
| 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* | | | | | | |
| Australischer Dollar | | 33.081 | - | - | 33.081 | - |
| Dänische Krone | | 113.744 | - | - | 113.744 | - |
| Euro | | 181.349 | - | - | 181.349 | - |
| Hongkong-Dollar | | 101.406 | - | - | 101.406 | - |
| Japanischer Yen | | 85.303 | - | - | 85.303 | - |
| Südafrikanischer Rand | | 22.032 | - | - | 22.032 | - |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSIKO Forts.

| Fonds | Währung | Netto- engagement 31. Dezember 2021 | Monetäre Vermögenswerte | Monetäre Verbind- lichkeiten | Nicht-monetäre Vermögenswerte | Hedging (Absicherung) |
|-------------------------------------|---------|--|----------------------------|------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|
| | | USD | USD | USD | USD | USD |
| BNY Mellon Future Life Fund* Forts. | | | | | | |
| Pfund Sterling | | 231.347 | – | – | 231.347 | – |
| Schweizer Franken | | 327.017 | – | – | 327.017 | – |
| | | 1.095.279 | – | – | 1.095.279 | – |

BNY Mellon Global Bond Fund

| | USD | USD | USD | USD | USD |
|-------------------------|--------------------|--------------------|--------------|----------|---------------------|
| Australischer Dollar | 7.857.473 | 15.249.838 | – | – | (7.392.365) |
| Kanadischer Dollar | 9.019.659 | 19.880.257 | – | – | (10.860.598) |
| Kolumbianischer Peso | 6.038.346 | 6.038.346 | – | – | – |
| Tschechische Krone | (189.065) | 9.951.584 | (754) | – | (10.139.895) |
| Dänische Krone | 1.793.647 | 5.760.251 | – | – | (3.966.604) |
| Euro | 85.578.388 | 101.752.074 | – | – | (16.173.686) |
| Ungarischer Forint | 6.641.449 | – | – | – | 6.641.449 |
| Indische Rupie | (50.900) | 2.219.627 | – | – | (2.270.527) |
| Indonesische Rupiah | (293.244) | 6.287.192 | – | – | (6.580.436) |
| Japanischer Yen | 86.559.107 | 32.179.621 | – | – | 54.379.486 |
| Koreanischer Won | 3 | – | – | – | 3 |
| Malaysischer Ringgit | (53.528) | 4.323.281 | – | – | (4.376.809) |
| Mexikanischer Peso | 5.774.323 | 6.876.991 | – | – | (1.102.668) |
| Neuseeländischer Dollar | 6.614.435 | 15.460.797 | – | – | (8.846.362) |
| Philippinischer Peso | (6.414.759) | – | – | – | (6.414.759) |
| Polnischer Zloty | 4.427.926 | – | – | – | 4.427.926 |
| Südafrikanischer Rand | (6.524.614) | – | – | – | (6.524.614) |
| Pfund Sterling | 24.585.475 | 15.237.801 | – | – | 9.347.674 |
| Schwedische Krone | 1.028.815 | 4.140.511 | – | – | (3.111.696) |
| | 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) |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISIKO Forts.

| Fonds | Währung | Netto- engagement 31. Dezember 2021 | Monetäre Vermögenswerte | Monetäre Verbind- lichkeiten | Nicht-monetäre Vermögenswerte | Hedging (Absicherung) |
|-------|-------------------------|--|----------------------------|------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|
| | | USD | USD | USD | USD | USD |
| | Australischer Dollar | (301.050) | 11.245.072 | - | - | (11.546.122) |
| | Kanadischer Dollar | (175.901) | 28.569.286 | - | - | (28.745.187) |
| | Kolumbianischer Peso | 5.579.121 | 5.579.121 | - | - | - |
| | Tschechische Krone | (423.788) | 8.637.981 | - | - | (9.061.769) |
| | Euro | (16.415.959) | 87.717.181 | - | - | (104.133.140) |
| | Ungarischer Forint | 6.600.250 | - | - | - | 6.600.250 |
| | Indische Rupie | (88.382) | 3.117.922 | - | - | (3.206.304) |
| | Indonesische Rupiah | (294.629) | 5.573.776 | - | - | (5.868.405) |
| | Japanischer Yen | 6.384.640 | 6.696.264 | - | - | (311.624) |
| | Koreanischer Won | (3) | - | - | - | (3) |
| | Malaysischer Ringgit | (39.815) | 3.260.921 | - | - | (3.300.736) |
| | Mexikanischer Peso | 5.742.551 | 7.140.918 | - | - | (1.398.367) |
| | Neuseeländischer Dollar | 6.644.275 | 11.459.580 | - | - | (4.815.305) |
| | Philippinischer Peso | (6.433.636) | - | - | - | (6.433.636) |
| | Polnischer Zloty | 4.445.117 | - | - | - | 4.445.117 |
| | Südafrikanischer Rand | (6.600.153) | - | - | - | (6.600.153) |
| | Pfund Sterling | (6.670.303) | 42.564.131 | - | 6.620.068 | (55.854.502) |
| | Schwedische Krone | 219.454 | 1.703.660 | - | - | (1.484.206) |
| | Schweizer Franken | (1) | - | (1) | - | - |
| | | (1.828.212) | 223.265.813 | (1) | 6.620.068 | (231.714.092) |

BNY Mellon Global Emerging Markets Fund

| | USD | USD | USD | USD | USD |
|-----------------------|-------------------|----------------|------------------|-------------------|----------------|
| Brasilianischer Real | 590.098 | 7.917 | - | 590.098 | (7.917) |
| Chinesischer Yuan | 7.588.545 | - | - | 7.588.545 | - |
| Euro | 1.430.921 | - | (3.576) | 1.430.921 | 3.576 |
| Hongkong-Dollar | 10.140.030 | - | - | 10.140.030 | - |
| Ungarischer Forint | 509.439 | - | (3) | 509.442 | - |
| Indische Rupie | 13.846.778 | 69.516 | (185.048) | 13.962.310 | - |
| Japanischer Yen | 1.240.358 | - | - | 1.240.358 | - |
| Koreanischer Won | 2.966.899 | - | - | 2.966.899 | - |
| Malaysischer Ringgit | 409 | 409 | - | - | - |
| Mexikanischer Peso | 884.631 | 8.476 | - | 876.155 | - |
| Südafrikanischer Rand | 595.960 | - | - | 595.960 | - |
| Taiwan-Dollar | 3.832.177 | 292.743 | - | 3.539.434 | - |
| | 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 | - |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSIKO Forts.

| Fonds | Währung | Netto- engagement 31. Dezember 2021 | Monetäre Vermögenswerte | Monetäre Verbind- lichkeiten | Nicht-monetäre Vermögenswerte | Hedging (Absicherung) |
|---|----------------------|--|----------------------------|------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|
| 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 | – |
| | 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 | – | – | – |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISIKO Forts.

| Fonds | Währung | Netto- engagement 31. Dezember 2021 | Monetäre Vermögenswerte | Monetäre Verbind- lichkeiten | Nicht-monetäre Vermögenswerte | Hedging (Absicherung) |
|--|---------|--|----------------------------|------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|
| BNY Mellon Global Opportunities Fund Forts. | | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD | USD |
| Pfund Sterling | | 3.199.519 | – | – | 3.199.519 | – |
| Schwedische Krone | | 689.990 | – | – | 689.990 | – |
| Schweizer Franken | | 1.829.076 | – | – | 1.829.076 | – |
| | | 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 |
| 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 | – |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSIKO Forts.

| Fonds | Währung | Netto- engagement 31. Dezember 2021 | Monetäre Vermögenswerte | Monetäre Verbind- lichkeiten | Nicht-monetäre Vermögenswerte | Hedging (Absicherung) |
|--|---------|--|----------------------------|------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|
| BNY Mellon Global Real Return Fund (USD) Forts. | | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD | USD |
| Russischer Rubel | | 2.975.399 | – | – | – | 2.975.399 |
| Pfund Sterling | | (2.084.971) | 2.075.217 | – | 62.446.156 | (66.606.344) |
| Schweizer Franken | | 237.958 | – | – | 10.019.374 | (9.781.416) |
| | | (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) |
| 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) |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISIKO Forts.

| Fonds | Währung | Netto- engagement 31. Dezember 2021 | Monetäre Vermögenswerte | Monetäre Verbind- lichkeiten | Nicht-monetäre Vermögenswerte | Hedging (Absicherung) |
|--|---------|--|----------------------------|------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|
| 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 | - | - | - |
| 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) |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSIKO Forts.

| Fonds | Währung | Netto- engagement 31. Dezember 2021 | Monetäre Vermögenswerte | Monetäre Verbind- lichkeiten | Nicht-monetäre Vermögenswerte | Hedging (Absicherung) |
|---|---------|--|----------------------------|------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|
| 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 |
| 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 | – | – | – |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISIKO Forts.

| Fonds | Währung | Netto- engagement 31. Dezember 2021 | Monetäre Vermögenswerte | Monetäre Verbind- lichkeiten | Nicht-monetäre Vermögenswerte | Hedging (Absicherung) |
|--|---------|--|----------------------------|------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|
| Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund* | | | | | | |
| | | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR |
| Pfund Sterling | | (173.922) | 13.061.767 | – | – | (13.235.689) |
| US-Dollar | | 303.383 | 11.446.771 | (96.334) | – | (11.047.054) |
| | | 129.461 | 24.508.538 | (96.334) | – | (24.282.743) |

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Die nachfolgenden Tabellen geben Auskunft über das wesentliche Fremdwährungsrisiko, dem die Gesellschaft am 31. Dezember 2020 ausgesetzt war:

| Fonds | Währung | Netto- engagement 31. Dezember 2020 | Monetäre Vermögenswerte | Monetäre Verbind- lichkeiten | Nicht-monetäre Vermögenswerte | Hedging (Absicherung) |
|--------------------------------------|---------|--|----------------------------|------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|
| BNY Mellon Absolute Return Bond Fund | | | | | | |
| | | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR |
| Australischer Dollar | | 1.336.734 | 16.381.732 | – | – | (15.044.998) |
| Brasilianischer Real | | 625.405 | 3.277.496 | – | – | (2.652.091) |
| Kanadischer Dollar | | 69.517 | 69.517 | – | – | – |
| Chinesischer Yuan | | 3.095.142 | – | – | – | 3.095.142 |
| Kolumbianischer Peso | | (138.793) | 2.532.308 | – | – | (2.671.101) |
| Ägyptisches Pfund | | 2.128.251 | 2.128.251 | – | – | – |
| Hongkong-Dollar | | 36 | 36 | – | – | – |
| Indische Rupie | | 2.720.383 | – | – | – | 2.720.383 |
| Indonesische Rupiah | | 1.137.272 | 3.622.277 | (60) | – | (2.484.945) |
| Japanischer Yen | | 1.469.882 | 11.264.391 | – | – | (9.794.509) |
| Koreanischer Won | | 1.604.199 | – | – | – | 1.604.199 |
| Malaysischer Ringgit | | 1.368.164 | 1.368.164 | – | – | – |
| Mexikanischer Peso | | 1.465.632 | 2.280.595 | – | – | (814.963) |
| Neuseeländischer Dollar | | 32.191 | 21.822 | – | – | 10.369 |
| Norwegische Krone | | 59 | 59 | – | – | – |
| Polnischer Zloty | | 75 | 75 | – | – | – |
| Rumänischer Leu | | (17.936) | 1.727.109 | – | – | (1.745.045) |
| Russischer Rubel | | (18.191) | 2.640.342 | – | – | (2.658.533) |
| Südafrikanischer Rand | | 4.060 | 228.062 | – | – | (224.002) |
| Pfund Sterling | | 322.316 | 34.333.066 | (97.513) | – | (33.913.237) |
| Schwedische Krone | | 472 | 472 | – | – | – |
| Thailändischer Baht | | 128 | 128 | – | – | – |
| Türkische Lira | | 593.360 | – | – | – | 593.360 |
| Ukrainische Hrywnja | | 78.900 | 78.900 | – | – | – |
| US-Dollar | | (18.448.328) | 94.185.129 | (5.360.812) | – | (107.272.645) |
| | | (571.070) | 176.139.931 | (5.458.385) | – | (171.252.616) |

BNY Mellon Absolute Return Equity Fund

| | GBP | GBP | GBP | GBP | GBP |
|-------------------|------------------|-------------------|--------------------|-------------------|---------------------|
| Dänische Krone | (45.919) | 534.095 | (96.471) | – | (483.543) |
| Euro | (8.738.670) | 8.526.789 | (4.994.576) | – | (12.270.883) |
| Norwegische Krone | (1) | – | (1) | – | – |
| Schwedische Krone | (391.894) | 364.079 | (397.146) | – | (358.827) |
| Schweizer Franken | 2.227.379 | 1.270.472 | (753.963) | 2.542.827 | (831.957) |
| US-Dollar | 8.434.850 | – | – | 8.434.850 | – |
| | 1.485.745 | 10.695.435 | (6.242.157) | 10.977.677 | (13.945.210) |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSKO Forts.

| Fonds | Währung | Netto- engagement 31. Dezember 2020 | Monetäre Vermögenswerte | Monetäre Verbind- lichkeiten | Nicht-monetäre Vermögenswerte | Hedging (Absicherung) |
|---|-------------------|--|----------------------------|------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|
| BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund | | | | | | |
| | | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR |
| | Dänische Krone | (59.367) | 1.186 | (60.553) | – | – |
| | Hongkong-Dollar | 18.229 | 108.521 | (90.292) | – | – |
| | Japanischer Yen | 23.200 | 222.097 | (198.897) | – | – |
| | Pfund Sterling | 82.445 | 82.445 | – | – | – |
| | Schweizer Franken | 78.144 | 125.100 | (46.956) | – | – |
| | US-Dollar | 1.626.974 | 8.488.494 | (5.062.067) | – | (1.799.453) |
| | | 1.769.625 | 9.027.843 | (5.458.765) | – | (1.799.453) |

BNY Mellon Asian Equity Fund

| | | | | | | |
|--|----------------------|-------------------|----------------|----------|-------------------|------------------|
| | | USD | USD | USD | USD | USD |
| | Australischer Dollar | 4.752.406 | – | – | 4.693.043 | 59.363 |
| | Euro | 753.452 | 2.092 | – | 1.027.154 | (275.794) |
| | Hongkong-Dollar | 17.613.584 | – | – | 17.595.504 | 18.080 |
| | Indische Rupie | 18.251.853 | 233.408 | – | 18.018.445 | – |
| | Indonesische Rupiah | 1.223.612 | – | – | 1.223.612 | – |
| | Koreanischer Won | 5.491.493 | – | – | 5.491.493 | – |
| | Taiwan-Dollar | 3.843.121 | 44.799 | – | 3.798.322 | – |
| | | 51.929.521 | 280.299 | – | 51.847.573 | (198.351) |

BNY Mellon Asian Income Fund

| | | | | | | |
|--|-------------------------|-------------------|----------------|----------|-------------------|-----------------|
| | | USD | USD | USD | USD | USD |
| | Australischer Dollar | 4.159.415 | – | – | 4.159.415 | – |
| | Euro | (4.153) | 14.236 | – | – | (18.389) |
| | Hongkong-Dollar | 6.091.921 | 30.148 | – | 6.091.921 | (30.148) |
| | Indonesische Rupiah | 1.056.407 | – | – | 1.056.407 | – |
| | Koreanischer Won | 4.980.687 | – | – | 4.980.687 | – |
| | Neuseeländischer Dollar | 2.345.052 | – | – | 2.345.052 | – |
| | Singapur-Dollar | 7.776.190 | 11.674 | – | 7.801.117 | (36.601) |
| | Pfund Sterling | 1.020.085 | – | – | 1.020.085 | – |
| | Taiwan-Dollar | 5.106.938 | 99.465 | – | 5.007.473 | – |
| | Thailändischer Baht | 1.335.382 | – | – | 1.335.382 | – |
| | | 33.867.924 | 155.523 | – | 33.797.539 | (85.138) |

BNY Mellon Blockchain Innovation Fund

| | | | | | | |
|--|----------------------|------------------|---------------|----------|------------------|----------|
| | | USD | USD | USD | USD | USD |
| | Australischer Dollar | 266.207 | 4.615 | – | 261.592 | – |
| | Kanadischer Dollar | 895 | 895 | – | – | – |
| | Dänische Krone | 420.782 | 2.500 | – | 418.282 | – |
| | Euro | 1.292.945 | 9.190 | – | 1.283.755 | – |
| | Hongkong-Dollar | 509.997 | 513 | – | 509.484 | – |
| | Japanischer Yen | 119.292 | 847 | – | 118.445 | – |
| | Koreanischer Won | 2.738 | 2.738 | – | – | – |
| | Singapur-Dollar | 207.074 | 3.707 | – | 203.367 | – |
| | Pfund Sterling | 66 | 66 | – | – | – |
| | Schweizer Franken | 659.857 | 3.310 | – | 656.547 | – |
| | | 3.479.853 | 28.381 | – | 3.451.472 | – |

BNY Mellon Brazil Equity Fund

| | | | | | | |
|--|----------------------|------------|-----------|-----|------------|-----|
| | | USD | USD | USD | USD | USD |
| | Brasilianischer Real | 51.256.484 | 641.426 | – | 50.615.058 | – |
| | Euro | 2.012.914 | 2.012.914 | – | – | – |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSIKO Forts.

| Fonds | Währung | Netto- engagement 31. Dezember 2020 | Monetäre Vermögenswerte | Monetäre Verbind- lichkeiten | Nicht-monetäre Vermögenswerte | Hedging (Absicherung) |
|---|---------|--|----------------------------|------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|
| BNY Mellon Brazil Equity Fund Forts. | | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD | USD |
| Pfund Sterling | | 931.765 | 931.765 | - | - | - |
| | | 54.201.163 | 3.586.105 | - | 50.615.058 | - |
| BNY Mellon Dynamic Total Return Fund | | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD | USD |
| Australischer Dollar | | (673.606) | 7.399 | (7.103) | - | (673.902) |
| Kanadischer Dollar | | (594.335) | 1.179 | (15.117) | - | (580.397) |
| Euro | | (1.656.444) | 556.529 | (524.469) | - | (1.688.504) |
| Hongkong-Dollar | | (31.886) | 12 | (31.898) | - | - |
| Japanischer Yen | | 24.420 | 2 | (14.417) | - | 38.835 |
| Neuseeländischer Dollar | | (165.077) | - | - | - | (165.077) |
| Norwegische Krone | | (417.187) | - | - | - | (417.187) |
| Pfund Sterling | | 2.297.111 | 548 | (47.514) | - | 2.344.077 |
| Schwedische Krone | | (507.252) | - | - | - | (507.252) |
| Schweizer Franken | | (64.074) | 13.251 | (14) | - | (73.311) |
| | | (1.788.330) | 578.920 | (640.532) | - | (1.726.718) |
| BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund | | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD | USD |
| Euro | | 111.552 | 111.552 | - | - | - |
| Pfund Sterling | | 1 | 1 | - | - | - |
| | | 111.553 | 111.553 | - | - | - |
| BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund | | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD | USD |
| Euro | | 15.576 | 5.422.820 | - | - | (5.407.244) |
| Pfund Sterling | | (4.069) | 309.116 | - | - | (313.185) |
| | | 11.507 | 5.731.936 | - | - | (5.720.429) |
| BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund | | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD | USD |
| Australischer Dollar | | 254 | 254 | - | - | - |
| Kanadischer Dollar | | 1.279 | 1.703.311 | (1.899) | - | (1.700.133) |
| Euro | | (59.539) | 10.472.796 | (26) | - | (10.532.309) |
| Japanischer Yen | | (449) | - | (449) | - | - |
| Pfund Sterling | | 8.854 | 2.074.510 | - | - | (2.065.656) |
| | | (49.601) | 14.250.871 | (2.374) | - | (14.298.098) |
| BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund | | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD | USD |
| Euro | | 265.276 | 265.276 | - | - | - |
| Pfund Sterling | | 341 | 341 | - | - | - |
| | | 265.617 | 265.617 | - | - | - |
| BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund | | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD | USD |
| Kolumbianischer Peso | | (54.554) | 5.272.388 | - | - | (5.326.942) |
| Euro | | 2.692.637 | 36.134.827 | - | - | (33.442.190) |
| Hongkong-Dollar | | 44.836 | 44.836 | - | - | - |
| Kasachischer Tenge | | 817.262 | 817.262 | - | - | - |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSIKO Forts.

| Fonds | Währung | Netto- engagement 31. Dezember 2020 | Monetäre Vermögenswerte | Monetäre Verbind- lichkeiten | Nicht-monetäre Vermögenswerte | Hedging (Absicherung) |
|---|---------|--|----------------------------|------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|
| BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund Forts. | | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD | USD |
| Russischer Rubel | | (16.609) | 3.654.595 | – | – | (3.671.204) |
| Pfund Sterling | | 1.790 | 1.790 | – | – | – |
| Schweizer Franken | | 89.255 | 89.255 | – | – | – |
| | | 3.574.617 | 46.014.953 | – | – | (42.440.336) |

BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund

| | USD | USD | USD | USD | USD |
|----------------|---------------|----------------|--------------|----------|------------------|
| Euro | 17.334 | 545.116 | (183) | – | (527.599) |
| Pfund Sterling | 404 | 404 | – | – | – |
| | 17.738 | 545.520 | (183) | – | (527.599) |

BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund

| | USD | USD | USD | USD | USD |
|------------------------|--------------------|--------------------|----------------|----------|-------------------|
| Argentinischer Peso | 642 | 642 | – | – | – |
| Brasilianischer Real | 15.142.530 | 8.766.329 | – | – | 6.376.201 |
| Chilenischer Peso | 8.058.769 | 9.082.334 | – | – | (1.023.565) |
| Chinesischer Yuan | 15.432.896 | 22.162.154 | – | – | (6.729.258) |
| Kolumbianischer Peso | 12.984.494 | 15.173.998 | – | – | (2.189.504) |
| Tschechische Krone | 11.329.865 | 234.438 | – | – | 11.095.427 |
| Dominikanischer Peso | 259.330 | 259.330 | – | – | – |
| Euro | (2.922.524) | 6.729 | – | – | (2.929.253) |
| Hongkong-Dollar | (11.932.220) | – | – | – | (11.932.220) |
| Ungarischer Forint | 6.712.424 | 1.440.558 | – | – | 5.271.866 |
| Indische Rupie | 1.745.119 | 2.911.257 | – | – | (1.166.138) |
| Indonesische Rupiah | 15.902.939 | 16.771.781 | – | – | (868.842) |
| Malaysischer Ringgit | 12.280.021 | 3.895.724 | (1.076) | – | 8.385.373 |
| Mexikanischer Peso | 19.468.213 | 27.328.492 | – | – | (7.860.279) |
| Peruanischer neuer Sol | 4.585.890 | 2.612.987 | – | – | 1.972.903 |
| Philippinischer Peso | (3.134.430) | – | – | – | (3.134.430) |
| Polnischer Zloty | 18.990.293 | 3.247.743 | – | – | 15.742.550 |
| Rumänischer Leu | 2.581.984 | 1.901.868 | – | – | 680.116 |
| Russischer Rubel | 20.067.662 | 20.484.938 | – | – | (417.276) |
| Südafrikanischer Rand | 12.938.110 | 20.850.831 | – | – | (7.912.721) |
| Pfund Sterling | 6.469 | 6.469 | – | – | – |
| Schweizer Franken | 38 | 38 | – | – | – |
| Taiwan-Dollar | (3.488.560) | – | – | – | (3.488.560) |
| Thailändischer Baht | 17.984.911 | 7.213.536 | – | – | 10.771.375 |
| Türkische Lira | 2.863.576 | – | – | – | 2.863.576 |
| Uruguayischer Peso | 626.063 | 626.063 | – | – | – |
| | 178.484.504 | 164.978.239 | (1.076) | – | 13.507.341 |

BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund

| | USD | USD | USD | USD | USD |
|----------------------|-----------|-----------|-------|-----|-----------|
| Argentinischer Peso | 999 | 999 | – | – | – |
| Brasilianischer Real | 1.301.094 | 918.387 | – | – | 382.707 |
| Chilenischer Peso | 929.087 | 1.002.842 | – | – | (73.755) |
| Chinesischer Yuan | 1.262.632 | 1.584.020 | – | – | (321.388) |
| Kolumbianischer Peso | 1.249.032 | 1.135.823 | – | – | 113.209 |
| Tschechische Krone | 1.374.993 | – | – | – | 1.374.993 |
| Euro | (711.387) | 285.424 | (550) | – | (996.261) |
| Hongkong-Dollar | (988.117) | – | – | – | (988.117) |
| Ungarischer Forint | 453.432 | 184.654 | – | – | 268.778 |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSIKO Forts.

| Fonds | Währung | Netto- engagement 31. Dezember 2020 | Monetäre Vermögenswerte | Monetäre Verbind- lichkeiten | Nicht-monetäre Vermögenswerte | Hedging (Absicherung) |
|---|---------|--|----------------------------|------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund Forts. | | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD | USD |
| Indische Rupie | | 293.015 | 208.758 | - | - | 84.257 |
| Indonesische Rupiah | | 1.312.222 | 1.777.443 | - | - | (465.221) |
| Malaysischer Ringgit | | 998.952 | 282.061 | - | - | 716.891 |
| Mexikanischer Peso | | 1.830.582 | 2.474.557 | - | - | (643.975) |
| Peruanischer neuer Sol | | 321.841 | 194.735 | - | - | 127.106 |
| Philippinischer Peso | | (410.918) | - | - | - | (410.918) |
| Polnischer Zloty | | 1.791.421 | - | - | - | 1.791.421 |
| Rumänischer Leu | | 111.933 | 54.423 | - | - | 57.510 |
| Russischer Rubel | | 2.347.331 | 2.182.458 | - | - | 164.873 |
| Südafrikanischer Rand | | 1.038.820 | 1.619.200 | - | - | (580.380) |
| Pfund Sterling | | 425 | 425 | - | - | - |
| Taiwan-Dollar | | (600.887) | - | - | - | (600.887) |
| Thailändischer Baht | | 1.508.830 | 784.440 | - | - | 724.390 |
| Türkische Lira | | 184.451 | - | - | - | 184.451 |
| Uruguayischer Peso | | 90.922 | 90.922 | - | - | - |
| | | 15.690.705 | 14.781.571 | (550) | - | 909.684 |

BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund

| | | | | | | |
|------------------------|--|-------------------|-------------------|--------------|----------|---------------------|
| | | USD | USD | USD | USD | USD |
| Brasilianischer Real | | 6.686.837 | 10.691.355 | - | - | (4.004.518) |
| Chilenischer Peso | | 1.505.855 | - | - | - | 1.505.855 |
| Chinesischer Yuan | | 4.917.306 | - | - | - | 4.917.306 |
| Kolumbianischer Peso | | 3.093.939 | 7.650.910 | - | - | (4.556.971) |
| Tschechische Krone | | 1.561.658 | 32 | - | - | 1.561.626 |
| Ägyptisches Pfund | | 5.376.527 | 5.376.527 | - | - | - |
| Euro | | 861.053 | 10.667.048 | - | - | (9.805.995) |
| Ungarischer Forint | | 2.349.307 | 3 | - | - | 2.349.304 |
| Indonesische Rupiah | | 6.983.773 | 13.125.634 | (258) | - | (6.141.603) |
| Israelischer Schekel | | 242 | 242 | - | - | - |
| Kasachischer Tenge | | 490.753 | 490.753 | - | - | - |
| Koreanischer Won | | 2.115.400 | - | - | - | 2.115.400 |
| Malaysischer Ringgit | | 4.032.732 | 4.032.922 | (190) | - | - |
| Mexikanischer Peso | | 9.780.737 | 8.833.871 | - | - | 946.866 |
| Peruanischer neuer Sol | | 1.565.815 | 791.154 | - | - | 774.661 |
| Polnischer Zloty | | 4.568.101 | 238 | - | - | 4.567.863 |
| Rumänischer Leu | | 151.637 | 4.926.365 | - | - | (4.774.728) |
| Russischer Rubel | | 4.172.812 | 7.715.639 | - | - | (3.542.827) |
| Südafrikanischer Rand | | 4.223.822 | 5.828.638 | - | - | (1.604.816) |
| Pfund Sterling | | 865 | 865 | - | - | - |
| Thailändischer Baht | | 4.912.344 | 2.400.212 | - | - | 2.512.132 |
| Türkische Lira | | 2.925.617 | - | - | - | 2.925.617 |
| Ukrainische Hrywnja | | 324.004 | 324.004 | - | - | - |
| | | 72.601.136 | 82.856.412 | (448) | - | (10.254.828) |

BNY Mellon Euroland Bond Fund

| | | | | | | |
|----------------------|--|-------------|------------|------|-----|--------------|
| | | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR |
| Australischer Dollar | | (1.673.645) | 11.338.147 | - | - | (13.011.792) |
| Kanadischer Dollar | | (1.025.185) | - | (22) | - | (1.025.163) |
| Chilenischer Peso | | 2.277.540 | - | - | - | 2.277.540 |
| Tschechische Krone | | 2.209.273 | - | - | - | 2.209.273 |
| Indische Rupie | | 4.393.455 | - | - | - | 4.393.455 |
| Japanischer Yen | | (129.347) | 248.762 | - | - | (378.109) |
| Koreanischer Won | | (281.954) | 287.417 | - | - | (569.371) |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSKO Forts.

| Fonds | Währung | Netto- engagement 31. Dezember 2020 | Monetäre Vermögenswerte | Monetäre Verbind- lichkeiten | Nicht-monetäre Vermögenswerte | Hedging (Absicherung) |
|---|---------|--|----------------------------|------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|
| BNY Mellon Euroland Bond Fund Forts. | | | | | | |
| | | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR |
| Mexikanischer Peso | | 2.334.310 | 6.714.994 | – | – | (4.380.684) |
| Neuseeländischer Dollar | | (1.756.708) | 9.359 | – | – | (1.766.067) |
| Norwegische Krone | | (1.816.227) | 4.119 | – | – | (1.820.346) |
| Polnischer Zloty | | 2.172.995 | – | – | – | 2.172.995 |
| Russischer Rubel | | 8.874.189 | 3.320.386 | – | – | 5.553.803 |
| Südafrikanischer Rand | | 156.733 | 4.043.648 | – | – | (3.886.915) |
| Pfund Sterling | | 6.136.691 | 525.349 | – | – | 5.611.342 |
| Schwedische Krone | | (2.170.456) | 238 | – | – | (2.170.694) |
| Schweizer Franken | | 1.718.924 | 3.441 | – | – | 1.715.483 |
| Thailändischer Baht | | 389.291 | – | – | – | 389.291 |
| US-Dollar | | (17.319.251) | 55.556.882 | (79.973) | 15.230.641 | (88.026.801) |
| | | 4.490.628 | 82.052.742 | (79.995) | 15.230.641 | (92.712.760) |

BNY Mellon European Credit Fund

| | | | | | | |
|----------------|--|----------------|----------------|----------|------------------|--------------------|
| | | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR |
| Pfund Sterling | | 178.659 | 465.397 | – | – | (286.738) |
| US-Dollar | | 472.817 | 512.058 | – | 2.007.896 | (2.047.137) |
| | | 651.476 | 977.455 | – | 2.007.896 | (2.333.875) |

BNY Mellon Global Bond Fund

| | | | | | | |
|-------------------------|--|--------------------|--------------------|--------------------|----------|-------------------|
| | | USD | USD | USD | USD | USD |
| Australischer Dollar | | 11.263.118 | 39.662.148 | – | – | (28.399.030) |
| Kanadischer Dollar | | 10.218.517 | 22.974.670 | – | – | (12.756.153) |
| Kolumbianischer Peso | | 5.270.743 | 5.270.743 | – | – | – |
| Tschechische Krone | | (156.743) | 6.745.774 | – | – | (6.902.517) |
| Dänische Krone | | 2.262.954 | 11.821.549 | – | – | (9.558.595) |
| Euro | | 152.339.419 | 138.407.896 | (1.209.560) | – | 15.141.083 |
| Indische Rupie | | 6.070.572 | – | – | – | 6.070.572 |
| Indonesische Rupiah | | 5.869.377 | 5.869.377 | – | – | – |
| Japanischer Yen | | 129.728.882 | 53.863.977 | – | – | 75.864.905 |
| Malaysischer Ringgit | | 4.293.537 | 8.432.273 | – | – | (4.138.736) |
| Mexikanischer Peso | | 9.917.537 | 9.917.537 | – | – | – |
| Neuseeländischer Dollar | | (81.074) | 18.644.966 | – | – | (18.726.040) |
| Norwegische Krone | | 51.415 | 6.820.313 | – | – | (6.768.898) |
| Peruanischer neuer Sol | | 4.350.439 | 4.350.439 | – | – | – |
| Philippinischer Peso | | 150.937 | 6.013.831 | – | – | (5.862.894) |
| Pfund Sterling | | 47.202.917 | 31.726.584 | – | – | 15.476.333 |
| Schwedische Krone | | 1.518.902 | 7.263.461 | – | – | (5.744.559) |
| | | 390.271.449 | 377.785.538 | (1.209.560) | – | 13.695.471 |

BNY Mellon Global Credit Fund

| | | | | | | |
|----------------------|--|-----------|-------------|-------------|-----|---------------|
| | | USD | USD | USD | USD | USD |
| Australischer Dollar | | 1.661.414 | 8.602.512 | – | – | (6.941.098) |
| Brasilianischer Real | | (45.509) | 754.694 | – | – | (800.203) |
| Kanadischer Dollar | | 62.859 | 62.859 | – | – | – |
| Chinesischer Yuan | | 2.781.420 | – | – | – | 2.781.420 |
| Euro | | 94.591 | 212.906.852 | (5.259.335) | – | (207.552.926) |
| Indische Rupie | | 2.785.007 | – | – | – | 2.785.007 |
| Indonesische Rupiah | | 214.718 | 165.906 | – | – | 48.812 |
| Japanischer Yen | | 1.410.812 | 2.630.389 | (2.518) | – | (1.217.059) |
| Koreanischer Won | | 1.663.397 | – | – | – | 1.663.397 |
| Mexikanischer Peso | | 342.283 | 1.516.611 | – | – | (1.174.328) |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSKO Forts.

| Fonds | Währung | Netto- engagement 31. Dezember 2020 | Monetäre Vermögenswerte | Monetäre Verbind- lichkeiten | Nicht-monetäre Vermögenswerte | Hedging (Absicherung) |
|---|-------------------------|--|----------------------------|------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|
| | | USD | USD | USD | USD | USD |
| BNY Mellon Global Credit Fund Forts. | | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD | USD |
| | Neuseeländischer Dollar | 23.981 | 20.706 | - | - | 3.275 |
| | Polnischer Zloty | 100 | 100 | - | - | - |
| | Südafrikanischer Rand | 63 | 63 | - | - | - |
| | Pfund Sterling | 2.282.661 | 79.712.574 | (16.829) | - | (77.413.084) |
| | Schwedische Krone | 21.401 | 21.401 | - | - | - |
| | Schweizer Franken | 140 | 140 | - | - | - |
| | | 13.299.338 | 306.394.807 | (5.278.682) | - | (287.816.787) |

BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund

| | USD | USD | USD | USD | USD |
|-------------------------|-------------------|--------------------|-----------------|------------------|----------------------|
| Australischer Dollar | (84.681) | 35.033.822 | - | - | (35.118.503) |
| Kanadischer Dollar | (212.549) | 12.331.555 | - | - | (12.544.104) |
| Kolumbianischer Peso | 4.972.277 | 4.972.277 | - | - | - |
| Tschechische Krone | (132.381) | 5.233.204 | - | - | (5.365.585) |
| Dänische Krone | (104.656) | 2.385.651 | - | - | (2.490.307) |
| Euro | (11.640.613) | 106.278.087 | (10.800) | - | (117.907.900) |
| Indische Rupie | 4.873.608 | 712.716 | - | - | 4.160.892 |
| Indonesische Rupiah | 4.670.298 | 4.670.298 | - | - | - |
| Japanischer Yen | 8.330.202 | 21.164.701 | - | - | (12.834.499) |
| Malaysischer Ringgit | 3.815.288 | 7.193.559 | - | - | (3.378.271) |
| Mexikanischer Peso | 8.599.734 | 8.599.734 | - | - | - |
| Neuseeländischer Dollar | (46.844) | 11.843.062 | - | - | (11.889.906) |
| Norwegische Krone | (364.790) | 12.118.679 | - | - | (12.483.469) |
| Peruanischer neuer Sol | 3.689.750 | 3.689.750 | - | - | - |
| Philippinischer Peso | 70.005 | 4.562.216 | - | - | (4.492.211) |
| Pfund Sterling | 662.230 | 38.099.587 | - | 6.139.869 | (43.577.226) |
| Schwedische Krone | 26.520 | 2.691.729 | - | - | (2.665.209) |
| Schweizer Franken | (1) | - | (1) | - | - |
| Türkische Lira | 2.522.717 | - | - | - | 2.522.717 |
| | 29.646.114 | 281.580.627 | (10.801) | 6.139.869 | (258.063.581) |

BNY Mellon Global Emerging Markets Fund

| | USD | USD | USD | USD | USD |
|-----------------------|-------------------|---------------|----------|-------------------|----------------|
| Australischer Dollar | 1.186.270 | - | - | 1.186.270 | - |
| Euro | 2.156.430 | 689 | - | 2.304.003 | (148.262) |
| Hongkong-Dollar | 13.232.020 | - | - | 12.802.271 | 429.749 |
| Indische Rupie | 12.849.089 | 51.232 | - | 12.797.857 | - |
| Indonesische Rupiah | 701.952 | - | - | 675.924 | 26.028 |
| Koreanischer Won | 4.472.258 | - | - | 4.367.637 | 104.621 |
| Malaysischer Ringgit | 424 | 424 | - | - | - |
| Südafrikanischer Rand | 1.006.115 | - | - | 970.778 | 35.337 |
| Taiwan-Dollar | 3.335.324 | 5.844 | - | 3.329.480 | - |
| | 38.939.882 | 58.189 | - | 38.434.220 | 447.473 |

BNY Mellon Global Equity Fund

| | USD | USD | USD | USD | USD |
|--------------------|------------|--------|-----|------------|----------|
| Kanadischer Dollar | 5.853.036 | 23.961 | - | 5.853.036 | (23.961) |
| Euro | 75.686.058 | - | - | 75.686.058 | - |
| Hongkong-Dollar | 23.393.193 | - | - | 23.393.193 | - |
| Indische Rupie | 229 | 229 | - | - | - |
| Japanischer Yen | 25.621.447 | - | - | 25.621.447 | - |
| Koreanischer Won | 12.826.694 | - | - | 12.826.694 | - |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISIKO Forts.

| Fonds | Währung | Netto- engagement 31. Dezember 2020 | Monetäre Vermögenswerte | Monetäre Verbind- lichkeiten | Nicht-monetäre Vermögenswerte | Hedging (Absicherung) |
|---|---------|--|----------------------------|------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|
| BNY Mellon Global Equity Fund Forts. | | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD | USD |
| Pfund Sterling | | 28.029.688 | – | – | 27.564.032 | 465.656 |
| Schwedische Krone | | 7.102.263 | – | – | 7.102.263 | – |
| Schweizer Franken | | 18.670.382 | – | – | 18.670.382 | – |
| Thailändischer Baht | | 5.010.149 | – | – | 5.010.149 | – |
| | | 202.193.139 | 24.190 | – | 201.727.254 | 441.695 |
| BNY Mellon Global Equity Income Fund | | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD | USD |
| Euro | | 89.036.313 | – | (567.918) | 88.984.514 | 619.717 |
| Hongkong-Dollar | | 23.318.009 | – | – | 23.318.009 | – |
| Japanischer Yen | | 14.093.351 | – | – | 14.093.351 | – |
| Koreanischer Won | | 45.284.836 | – | – | 45.284.836 | – |
| Neuseeländischer Dollar | | 3.157.650 | – | – | 3.157.650 | – |
| Pfund Sterling | | 112.237.681 | – | (28.873) | 112.237.682 | 28.872 |
| Schwedische Krone | | 30.688.607 | – | – | 30.688.607 | – |
| Schweizer Franken | | 104.969.047 | – | – | 104.969.047 | – |
| Taiwan-Dollar | | 1.785 | 1.785 | – | – | – |
| | | 422.787.279 | 1.785 | (596.791) | 422.733.696 | 648.589 |
| BNY Mellon Global High Yield Bond Fund | | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD | USD |
| Euro | | (214.520) | 26.650.560 | – | – | (26.865.080) |
| Pfund Sterling | | (57.567) | 7.600.470 | – | – | (7.658.037) |
| | | (272.087) | 34.251.030 | – | – | (34.523.117) |
| BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund | | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD | USD |
| Kanadischer Dollar | | 12.583.573 | 22.402 | – | 12.561.171 | – |
| Euro | | 66.161.734 | 20.857 | – | 65.887.383 | 253.494 |
| Hongkong-Dollar | | 2.809.119 | 11 | – | 2.809.108 | – |
| Israelischer Schekel | | 1.543 | 1.543 | – | – | – |
| Norwegische Krone | | 886 | 886 | – | – | – |
| Singapur-Dollar | | 940.181 | 940.181 | – | – | – |
| Pfund Sterling | | 6.376.453 | 13.869 | – | 6.791.935 | (429.351) |
| | | 88.873.489 | 999.749 | – | 88.049.597 | (175.857) |
| BNY Mellon Global Leaders Fund | | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD | USD |
| Australischer Dollar | | 1.180.185 | – | – | 1.180.185 | – |
| Dänische Krone | | 977.978 | – | – | 977.978 | – |
| Euro | | 6.529.869 | – | – | 6.529.869 | – |
| Hongkong-Dollar | | 2.281.466 | – | – | 1.923.046 | 358.420 |
| Japanischer Yen | | 3.979.570 | – | – | 3.345.737 | 633.833 |
| Pfund Sterling | | 324.393 | 2.133 | – | 322.260 | – |
| Schweizer Franken | | 1.151.999 | – | – | 1.151.999 | – |
| | | 16.425.460 | 2.133 | – | 15.431.074 | 992.253 |
| BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund | | | | | | |
| | | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR |
| Australischer Dollar | | 352.739 | 264.443 | – | 366.575 | (278.279) |
| Kanadischer Dollar | | 63.313 | – | – | 63.313 | – |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSIKO Forts.

| Fonds | Währung | Netto- engagement 31. Dezember 2020 | Monetäre Vermögenswerte | Monetäre Verbind- lichkeiten | Nicht-monetäre Vermögenswerte | Hedging (Absicherung) |
|-------|-------------------------|--|----------------------------|------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|
| | | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR |
| | Kolumbianischer Peso | 167.648 | 167.648 | - | - | - |
| | Hongkong-Dollar | 1.655.707 | - | - | 1.655.707 | - |
| | Indonesische Rupiah | 190.482 | 97.997 | - | 92.485 | - |
| | Japanischer Yen | 200.379 | - | - | 200.379 | - |
| | Koreanischer Won | 615.742 | - | - | 615.742 | - |
| | Mexikanischer Peso | 700.312 | 405.333 | - | 294.979 | - |
| | Neuseeländischer Dollar | 391.394 | - | - | 391.394 | - |
| | Peruanischer neuer Sol | 160.638 | 160.638 | - | - | - |
| | Singapur-Dollar | 108.149 | - | - | 108.149 | - |
| | Pfund Sterling | 4.292.950 | 233.869 | - | 8.070.969 | (4.011.888) |
| | Schweizer Franken | 390.526 | - | - | 390.526 | - |
| | Taiwan-Dollar | 328.910 | 98.600 | - | 230.310 | - |
| | Thailändischer Baht | 95.973 | - | - | 95.973 | - |
| | US-Dollar | 1.231.024 | 1.596.152 | - | 2.289.520 | (2.654.648) |
| | | 10.945.886 | 3.024.680 | - | 14.866.021 | (6.944.815) |

BNY Mellon Global Opportunities Fund

| | USD | USD | USD | USD | USD |
|----------------------|-------------------|--------------|----------------|-------------------|------------------|
| Kanadischer Dollar | 623.510 | 2.769 | - | 636.243 | (15.502) |
| Euro | 7.295.578 | - | (2.006) | 7.309.764 | (12.180) |
| Hongkong-Dollar | 1.604.575 | - | - | 1.639.221 | (34.646) |
| Japanischer Yen | 2.407.964 | - | - | 2.407.964 | - |
| Koreanischer Won | 966.407 | - | - | 966.407 | - |
| Malaysischer Ringgit | 1 | 1 | - | - | - |
| Pfund Sterling | 3.590.779 | - | - | 3.593.876 | (3.097) |
| Schwedische Krone | 697.906 | - | - | 697.906 | - |
| Schweizer Franken | 1.713.397 | - | - | 1.748.241 | (34.844) |
| Thailändischer Baht | 532.138 | - | - | 532.138 | - |
| | 19.432.255 | 2.770 | (2.006) | 19.531.760 | (100.269) |

BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)

| | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR |
|-------------------------|--------------------|--------------------|--------------------|----------------------|------------------------|
| Australischer Dollar | 3.726.250 | 13.919.834 | - | 11.362.441 | (21.556.025) |
| Kanadischer Dollar | 5.434.530 | - | - | 2.368.575 | 3.065.955 |
| Dänische Krone | 32.600.372 | - | - | 32.600.372 | - |
| Hongkong-Dollar | 20.026.488 | - | - | 105.823.459 | (85.796.971) |
| Ungarischer Forint | 29.184.141 | 7.595.386 | - | - | 21.588.755 |
| Indische Rupie | 20.294.962 | 4.040.109 | - | 16.254.853 | - |
| Indonesische Rupiah | 4.177.665 | 4.177.665 | - | - | - |
| Japanischer Yen | (1.443.225) | 3.105.531 | - | 29.958.552 | (34.507.308) |
| Koreanischer Won | 12.786.813 | - | - | 27.181.274 | (14.394.461) |
| Mexikanischer Peso | 30.108.891 | 30.108.891 | - | - | - |
| Neuseeländischer Dollar | 5.568.980 | 10.751.181 | - | - | (5.182.201) |
| Norwegische Krone | 36.156.218 | - | - | - | 36.156.218 |
| Pfund Sterling | 133.546.360 | 31.388.390 | - | 409.031.967 | (306.873.997) |
| Schweizer Franken | 1.673.947 | - | - | 97.914.271 | (96.240.324) |
| US-Dollar | (51.778.572) | 239.072.263 | (3.753.868) | 1.275.887.475 | (1.562.984.442) |
| | 282.063.821 | 344.159.250 | (3.753.868) | 2.008.383.240 | (2.066.724.801) |

BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)

| | GBP | GBP | GBP | GBP | GBP |
|----------------------|--------|---------|-----|---------|-----------|
| Australischer Dollar | 80.343 | 326.330 | - | 133.846 | (379.833) |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSKO Forts.

| Fonds | Währung | Netto- engagement 31. Dezember 2020 | Monetäre Vermögenswerte | Monetäre Verbind- lichkeiten | Nicht-monetäre Vermögenswerte | Hedging (Absicherung) |
|--|---------|--|----------------------------|------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|
| BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP) Forts. | | | | | | |
| | | GBP | GBP | GBP | GBP | GBP |
| Kanadischer Dollar | | 36.178 | – | – | 75.546 | (39.368) |
| Dänische Krone | | 99.825 | – | – | 725.086 | (625.261) |
| Euro | | 402.462 | 2.374.984 | (95.395) | 7.144.133 | (9.021.260) |
| Hongkong-Dollar | | 55.548 | – | – | 2.026.644 | (1.971.096) |
| Ungarischer Forint | | 828.371 | 158.219 | – | – | 670.152 |
| Indische Rupie | | 468.107 | 101.884 | – | 366.223 | – |
| Indonesische Rupiah | | 147.205 | 147.205 | – | – | – |
| Japanischer Yen | | (23.892) | 69.386 | – | 536.633 | (629.911) |
| Koreanischer Won | | 405.734 | – | – | 615.402 | (209.668) |
| Mexikanischer Peso | | 895.607 | 895.607 | – | – | – |
| Neuseeländischer Dollar | | 114.071 | 207.038 | – | – | (92.967) |
| Schweizer Franken | | 46.638 | – | – | 2.099.515 | (2.052.877) |
| US-Dollar | | 18.951 | 5.269.062 | (91.012) | 26.461.385 | (31.620.484) |
| | | 3.575.148 | 9.549.715 | (186.407) | 40.184.413 | (45.972.573) |

BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)

| | | | | | | |
|-------------------------|--|-------------------|-------------------|------------------|--------------------|----------------------|
| | | USD | USD | USD | USD | USD |
| Australischer Dollar | | 797.126 | 1.461.000 | – | 2.298.064 | (2.961.938) |
| Kanadischer Dollar | | 146.902 | – | – | 297.744 | (150.842) |
| Dänische Krone | | 1.041.460 | – | – | 3.517.062 | (2.475.602) |
| Euro | | 7.173.184 | 13.664.345 | (463.595) | 34.812.050 | (40.839.616) |
| Hongkong-Dollar | | 2.109.184 | – | – | 10.121.693 | (8.012.509) |
| Ungarischer Forint | | 2.207.146 | 927.410 | – | – | 1.279.736 |
| Indische Rupie | | 730.935 | 413.321 | – | 1.689.630 | (1.372.016) |
| Indonesische Rupiah | | 61.262 | 562.070 | – | – | (500.808) |
| Japanischer Yen | | 2.984.107 | 319.604 | – | 2.664.503 | – |
| Koreanischer Won | | 2.858.784 | – | – | 2.858.784 | – |
| Mexikanischer Peso | | 4.573.964 | 4.573.964 | – | – | – |
| Neuseeländischer Dollar | | 171.618 | – | – | – | 171.618 |
| Pfund Sterling | | 7.655.581 | 3.793.909 | – | 43.204.867 | (39.343.195) |
| Schweizer Franken | | 409.608 | – | (11) | 10.330.842 | (9.921.223) |
| | | 32.920.861 | 25.715.623 | (463.606) | 111.795.239 | (104.126.395) |

BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund

| | | | | | | |
|-------------------|--|--------------------|--------------------|-----------------|------------|----------------------|
| | | USD | USD | USD | USD | USD |
| Euro | | (1.894.143) | 318.704.176 | (46.988) | – | (320.551.331) |
| Norwegische Krone | | 42.423 | 42.423 | – | – | – |
| Pfund Sterling | | (116.245) | 47.754.138 | – | – | (47.870.383) |
| Schwedische Krone | | 105 | 105 | – | – | – |
| Schweizer Franken | | 496 | 496 | – | – | – |
| | | (1.967.364) | 366.501.338 | (46.988) | – | (368.421.714) |

BNY Mellon Global Unconstrained Fund

| | | | | | | |
|-------------------------|--|------------|------------|------------|------------|------------|
| | | USD | USD | USD | USD | USD |
| Australischer Dollar | | 283.648 | 619.569 | – | 208.783 | (544.704) |
| Kolumbianischer Peso | | 205.357 | 205.357 | – | – | – |
| Euro | | 2.569.066 | 1.026.749 | – | 2.233.972 | (691.655) |
| Hongkong-Dollar | | 801.423 | – | – | 801.423 | – |
| Japanischer Yen | | 1.932.779 | 111.651 | – | 2.053.901 | (232.773) |
| Koreanischer Won | | 1.037.043 | – | – | 1.037.043 | – |
| Mexikanischer Peso | | 360.299 | 360.299 | – | – | – |
| Neuseeländischer Dollar | | 200.725 | 339.817 | – | 157.202 | (296.294) |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSIKO Forts.

| Fonds | Währung | Netto- engagement 31. Dezember 2020 | Monetäre Vermögenswerte | Monetäre Verbind- lichkeiten | Nicht-monetäre Vermögenswerte | Hedging (Absicherung) |
|---|---------|--|----------------------------|------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|
| BNY Mellon Global Unconstrained Fund Forts. | | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD | USD |
| Peruanischer neuer Sol | | 122.751 | 122.751 | - | - | - |
| Südafrikanischer Rand | | 368.518 | - | - | 368.518 | - |
| Pfund Sterling | | 2.776.941 | - | - | 3.815.644 | (1.038.703) |
| Schweizer Franken | | 1.190.103 | - | - | 1.190.103 | - |
| Thailändischer Baht | | 108.008 | - | - | 108.008 | - |
| | | 11.956.661 | 2.786.193 | - | 11.974.597 | (2.804.129) |
| BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund | | | | | | |
| | | JPY | JPY | JPY | JPY | JPY |
| Euro | | 44.062.710 | 44.062.710 | - | - | - |
| Pfund Sterling | | 100.442.507 | 100.442.507 | - | - | - |
| US-Dollar | | 75.333.011 | 75.333.011 | - | - | - |
| | | 219.838.228 | 219.838.228 | - | - | - |
| BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund | | | | | | |
| | | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR |
| Australischer Dollar | | 30.770.732 | 1 | - | 30.770.731 | - |
| Kanadischer Dollar | | 44.976.862 | 2.635 | - | 44.974.227 | - |
| Dänische Krone | | 36.016.968 | - | - | 36.016.968 | - |
| Hongkong-Dollar | | 51.232.211 | - | - | 51.232.211 | - |
| Japanischer Yen | | 140.699.749 | - | - | 140.699.749 | - |
| Singapur-Dollar | | 946.739 | 946.739 | - | - | - |
| Pfund Sterling | | 89.219.241 | 7.557.516 | - | 81.661.725 | - |
| Schweizer Franken | | 125.538.352 | - | - | 125.538.352 | - |
| US-Dollar | | 913.782.341 | 26.789.119 | - | 887.127.027 | (133.805) |
| | | 1.433.183.195 | 35.296.010 | - | 1.398.020.990 | (133.805) |
| BNY Mellon Mobility Innovation Fund | | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD | USD |
| Australischer Dollar | | 2 | 2 | - | - | - |
| Euro | | 55.485.772 | 1.110.130 | - | 53.913.058 | 462.584 |
| Hongkong-Dollar | | 19.842.304 | 2.854 | - | 19.595.146 | 244.304 |
| Japanischer Yen | | 28.938.405 | 244.857 | - | 28.444.157 | 249.391 |
| Koreanischer Won | | 32.313.706 | 106.864 | - | 32.206.842 | - |
| Singapur-Dollar | | 7 | 7 | - | - | - |
| Pfund Sterling | | 54 | 54 | - | - | - |
| Schweizer Franken | | 11.899.500 | 1.040.495 | - | 10.766.902 | 92.103 |
| Taiwan-Dollar | | 15.532.789 | 342.295 | - | 15.190.494 | - |
| | | 164.012.539 | 2.847.558 | - | 160.116.599 | 1.048.382 |
| BNY Mellon S&P 500® Index Tracker | | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD | USD |
| Euro | | 113.804 | 48.446 | - | - | 65.358 |
| | | 113.804 | 48.446 | - | - | 65.358 |
| BNY Mellon Small Cap Euroland Fund | | | | | | |
| | | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR |
| Dänische Krone | | 1.165.479 | 36 | - | 1.165.443 | - |
| Norwegische Krone | | 545.967 | 17 | - | 545.950 | - |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSKO Forts.

| Fonds | Währung | Netto- engagement 31. Dezember 2020 | Monetäre Vermögenswerte | Monetäre Verbind- lichkeiten | Nicht-monetäre Vermögenswerte | Hedging (Absicherung) |
|--|---------|--|----------------------------|------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|
| | | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR |
| BNY Mellon Small Cap Euroland Fund Forts. | | | | | | |
| Pfund Sterling | | 351.587 | 4.138 | – | 347.449 | – |
| Schwedische Krone | | 1.045.718 | 2.494 | – | 1.043.224 | – |
| Schweizer Franken | | 3.747 | 3.747 | – | – | – |
| US-Dollar | | 642.194 | 7.659 | – | 634.535 | – |
| | | 3.754.692 | 18.091 | – | 3.736.601 | – |

BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund

| | USD | USD | USD | USD | USD |
|-------------------|----------------|---------------|----------|----------------|----------|
| Euro | 281.842 | 1 | – | 281.841 | – |
| Singapur-Dollar | 3.783 | 3.783 | – | – | – |
| Pfund Sterling | 6.838 | 6.838 | – | – | – |
| Schweizer Franken | 566.900 | – | – | 566.900 | – |
| | 859.363 | 10.622 | – | 848.741 | – |

BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund

| | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR |
|-------------------------|------------------|--------------------|------------|----------|----------------------|
| Australischer Dollar | (32.835) | 16.502.505 | – | – | (16.535.340) |
| Kanadischer Dollar | (89.102) | 7.363.521 | – | – | (7.452.623) |
| Kolumbianischer Peso | 3.257.266 | 5.058.653 | – | – | (1.801.387) |
| Tschechische Krone | (64.277) | 2.584.228 | – | – | (2.648.505) |
| Indische Rupie | 2.642.583 | – | – | – | 2.642.583 |
| Indonesische Rupiah | 2.520.075 | 3.141.286 | – | – | (621.211) |
| Japanischer Yen | 4.279.908 | 14.344.498 | – | – | (10.064.590) |
| Malaysischer Ringgit | 2.499.457 | 3.950.587 | (1) | – | (1.451.129) |
| Mexikanischer Peso | 3.878.558 | 3.878.558 | – | – | – |
| Neuseeländischer Dollar | (84.668) | 6.133.594 | – | – | (6.218.262) |
| Norwegische Krone | (125.006) | 6.481.349 | – | – | (6.606.355) |
| Peruanischer neuer Sol | 2.497.383 | 2.497.383 | – | – | – |
| Philippinischer Peso | 51.259 | 2.027.523 | – | – | (1.976.264) |
| Singapur-Dollar | 1.693.605 | – | – | – | 1.693.605 |
| Pfund Sterling | (53.536) | 29.690.905 | – | – | (29.744.441) |
| Schwedische Krone | 22.342 | 2.297.555 | – | – | (2.275.213) |
| US-Dollar | (18.650.616) | 94.618.991 | – | – | (113.269.607) |
| | 4.242.396 | 200.571.136 | (1) | – | (196.328.739) |

BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)

| | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR |
|-------------------------|---------|---------|-----|-----------|-------------|
| Kanadischer Dollar | 4.946 | – | – | – | 4.946 |
| Kolumbianischer Peso | 328.742 | 399.395 | – | – | (70.653) |
| Dänische Krone | 420.125 | – | – | 420.125 | – |
| Hongkong-Dollar | 342.986 | 4.317 | – | 1.780.075 | (1.441.406) |
| Ungarischer Forint | 287.375 | 53.514 | – | – | 233.861 |
| Indonesische Rupiah | 301.832 | 301.832 | – | – | – |
| Japanischer Yen | (6.763) | – | – | 822.611 | (829.374) |
| Koreanischer Won | 306.391 | – | – | 306.391 | – |
| Malaysischer Ringgit | 304.939 | 304.939 | – | – | – |
| Mexikanischer Peso | 467.814 | 467.814 | – | – | – |
| Neuseeländischer Dollar | 81.584 | 114.650 | – | – | (33.066) |
| Norwegische Krone | 379.160 | – | – | – | 379.160 |
| Peruanischer neuer Sol | 196.496 | 196.496 | – | – | – |
| Südafrikanischer Rand | 186.087 | – | – | 186.087 | – |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISSIKO Forts.

| Fonds | Währung | Netto- engagement 31. Dezember 2020 | Monetäre Vermögenswerte | Monetäre Verbind- lichkeiten | Nicht-monetäre Vermögenswerte | Hedging (Absicherung) |
|--|---------|--|----------------------------|------------------------------------|----------------------------------|--------------------------|
| | | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR |
| BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR) Forts. | | | | | | |
| Pfund Sterling | | 1.610.059 | 1.015.014 | – | 5.675.870 | (5.080.825) |
| Schweizer Franken | | 20.539 | – | – | 1.181.271 | (1.160.732) |
| Taiwan-Dollar | | 209.585 | 4.393 | – | 205.192 | – |
| US-Dollar | | (1.178.576) | 1.384.026 | (39.318) | 13.580.066 | (16.103.350) |
| | | 4.263.321 | 4.246.390 | (39.318) | 24.157.688 | (24.101.439) |

BNY Mellon Targeted Return Bond Fund

| | USD | USD | USD | USD | USD |
|-------------------------|------------------|-------------------|-----------------|----------|---------------------|
| Australischer Dollar | (2.839) | 4.231.448 | – | – | (4.234.287) |
| Kanadischer Dollar | 86.397 | – | – | – | 86.397 |
| Chilenischer Peso | 464.488 | – | – | – | 464.488 |
| Euro | 2.305.178 | 30.974.414 | (34.329) | – | (28.634.907) |
| Japanischer Yen | 33.017 | 33.017 | – | – | – |
| Koreanischer Won | 4.059 | 22.431 | – | – | (18.372) |
| Mexikanischer Peso | 63.996 | 1.353.021 | – | – | (1.289.025) |
| Neuseeländischer Dollar | 4.984 | 4.984 | – | – | – |
| Norwegische Krone | 417 | 417 | – | – | – |
| Russischer Rubel | (21.288) | 1.973.261 | – | – | (1.994.549) |
| Singapur-Dollar | 10.429 | 10.429 | – | – | – |
| Südafrikanischer Rand | 1.404 | 1.559.521 | – | – | (1.558.117) |
| Pfund Sterling | 122.856 | – | – | – | 122.856 |
| | 3.073.098 | 40.162.943 | (34.329) | – | (37.055.516) |

BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund

| | USD | USD | USD | USD | USD |
|----------------|--------------|--------------|----------|----------|----------|
| Euro | 8.726 | 8.726 | – | – | – |
| Pfund Sterling | 1 | 1 | – | – | – |
| | 8.727 | 8.727 | – | – | – |

BNY Mellon U.S. Equity Income Fund

| | USD | USD | USD | USD | USD |
|----------------|----------------|----------------|----------|----------|----------|
| Euro | 103.787 | 103.787 | – | – | – |
| Pfund Sterling | 97.737 | 97.737 | – | – | – |
| | 201.524 | 201.524 | – | – | – |

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund

| | USD | USD | USD | USD | USD |
|----------------|------------------|------------------|----------|----------|----------|
| Euro | 2.016.696 | 2.016.696 | – | – | – |
| Pfund Sterling | 9.588 | 9.588 | – | – | – |
| | 2.026.284 | 2.026.284 | – | – | – |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

WÄHRUNGSRISIKO Forts.

Die folgende Tabelle veranschaulicht die Auswirkung einer Veränderung der Landeswährungen gegenüber der funktionalen Währung der Fonds auf das den Inhabern einlösbarer, partizipierender Anteile zuzuschreibende Nettovermögen. Im Interesse konsistenter Vergleiche zwischen den Fonds geht die Tabelle von einem Anstieg des Werts der Landeswährungen um 5 % aus (ein Rückgang um 5 % hätte ähnliche negative Folgen).

Die nachfolgende Tabelle gibt Auskunft darüber, wie sich per 31. Dezember 2021 und 31. Dezember 2020 ein Anstieg bzw. Rückgang des Wechselkurses zwischen den vom Fonds gehaltenen Landeswährungen und seiner funktionalen Währung um 5 % bei ansonsten konstanten Variablen wertmäßig auf das Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibende Nettovermögen ausgewirkt hätte.

| Fonds | Funktionale Währung | Anstieg/(Rückgang) des Nettoinventarwerts 2021 | Anstieg/(Rückgang) des Nettoinventarwerts 2020 |
|---|---------------------|--|--|
| BNY Mellon Asian Equity Fund | USD | 2.761.902 | 2.596.476 |
| BNY Mellon Asian Income Fund | USD | 676.302 | 1.693.396 |
| BNY Mellon Blockchain Innovation Fund | USD | 1.500.162 | 173.993 |
| BNY Mellon Brazil Equity Fund | USD | 1.687.719 | 2.710.058 |
| BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund | USD | (17.336) | 575 |
| BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund | USD | (2.409) | (2.480) |
| BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund | USD | 6.564 | 13.281 |
| BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund | USD | 235.091 | 178.731 |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund | USD | 2.510.671 | 3.630.057 |
| BNY Mellon Global Bond Fund | USD | 11.619.647 | 19.513.572 |
| BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund> | USD | k. A. | 1.482.306 |
| BNY Mellon Global Emerging Markets Fund | USD | 2.181.312 | 1.946.994 |
| BNY Mellon Global Equity Fund | USD | 10.537.986 | 10.109.657 |
| BNY Mellon Global Equity Income Fund | USD | 10.956.315 | 21.139.364 |
| BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund | USD | 6.720.342 | 4.443.674 |
| BNY Mellon Global Leaders Fund | USD | 1.336.993 | 821.273 |
| BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund*> | EUR | k. A. | 547.294 |
| BNY Mellon Global Opportunities Fund | USD | 832.113 | 971.613 |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)> | EUR | k. A. | 14.103.191 |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)> | GBP | k. A. | 178.757 |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)> | USD | k. A. | 1.646.043 |
| BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund | USD | 110.847 | (98.368) |
| BNY Mellon Global Unconstrained Fund | USD | 596.100 | 597.833 |
| BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund | JPY | 11.214.733 | 10.991.911 |
| BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund | EUR | 73.198.339 | 71.659.160 |
| BNY Mellon Mobility Innovation Fund | USD | 16.218.907 | 8.200.627 |
| BNY Mellon S&P 500® Index Tracker* | USD | k. A. | 5.690 |
| BNY Mellon Small Cap Euroland Fund | EUR | 216.553 | 187.735 |
| BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund | USD | 45.421 | 42.968 |
| BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund> | EUR | k. A. | 212.120 |
| BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)> | EUR | k. A. | 213.166 |
| BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund* | USD | k. A. | 436 |
| BNY Mellon U.S. Equity Income Fund | USD | 87.604 | 10.076 |

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

> Mit Wirkung vom 22. Januar 2021 änderte sich die Methode zum Gesamtengagement und Leverage für diese Fonds vom Commitment-Ansatz zur Absolute VaR-Methode.

Der BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund war zum 31. Dezember 2021 und zum 31. Dezember 2020 keinem Fremdwährungsrisiko ausgesetzt.

Bei Fonds, die den VaR-Ansatz verwenden, wurde die Analyse der Währungsrisikosensitivität bei der Berechnung des Marktpreisrisikos berücksichtigt.

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

KREDITRISIKO

Das Kreditrisiko besteht darin, dass eine Partei eines Finanzinstruments der anderen Partei einen finanziellen Verlust verursacht, indem sie einer Verpflichtung nicht nachkommt. Dies schließt das Kontrahenten- und das Emittentenrisiko ein. Finanzielle Vermögenswerte, die die Gesellschaft einem potenziellen Kreditrisiko aussetzen, bestehen vorwiegend aus zinstragenden Wertpapieren wie Anleihen, Derivate und Anlagen in Barguthaben sowie Einlagen und Forderungen im Zusammenhang mit Maklern.

Der Umfang des Kreditrisikos, dem die Gesellschaft im Zusammenhang mit diesen finanziellen Vermögenswerten ausgesetzt ist, entspricht in etwa ihren Buchwerten, zu denen sie in der Bilanz ausgewiesen sind.

Die Anlageverwalter steuern das Emittentenrisiko, indem sie diversifizierte Portfolios mit einer begrenzten Konzentration des Risikos (10 %) auf einen Emittenten in Übereinstimmung mit den OGAW-Vorschriften der Zentralbank und den Anlagezielen der Fonds aufbauen. Daneben nehmen die Anlageverwalter bei Bedarf nur solche Schuldinstrumente in das Portfolio auf, deren Bonität mindestens den in den jeweiligen Anlagezielen der Fonds enthaltenen Angaben entspricht oder besser ist.

Im Wesentlichen werden alle Vermögenswerte der Gesellschaft von der Verwahrstelle verwahrt. Der Konkurs oder die Insolvenz der Verwahrstelle kann zu Verzögerungen oder Einschränkungen der Rechte der Gesellschaft an den Wertpapieren und anderen von der Verwahrstelle verwahrten Positionen führen.

Die Gesellschaft tätigt nur mit solchen Verwahrstellen Geschäfte, bei denen es sich um regulierte Institute handelt, die einer besonderen Aufsicht unterliegen oder denen von internationalen Ratingagenturen eine hohe Bonität bescheinigt wird. Im Interesse einer Risikobegrenzung kontrolliert der Verwaltungsrat vierteljährlich die Bonität der Verwahrstelle, The Bank of New York Mellon SA/NV, Niederlassung Dublin. Die Bewertung ihrer langfristigen vorrangigen Verbindlichkeiten und der langfristigen Einlagen durch Standard & Poor's beträgt AA- (31. Dezember 2020: AA) zum Ende des Geschäftsjahres.

Die Wertpapiere und sonstigen Positionen der Gesellschaft werden getrennt vom Vermögen der Verwahrstelle oder ihrer Beauftragten verwahrt. Im Falle der Insolvenz oder des Konkurses der Verwahrstelle werden die Wertpapiere und sonstigen Positionen der Gesellschaft somit von denen der Verwahrstelle oder ihren Beauftragten getrennt. Gleichwohl unterliegt die Gesellschaft jedoch mit Blick auf die von der Verwahrstelle gehaltenen Barmittel der Gesellschaft und in Bezug auf die von der globalen Unterdepotbank gehaltenen Sammelkonten für Zeichnungs- und Rücknahmebeträge dem Kreditrisiko der Verwahrstelle oder einer von ihr hinzugezogenen Depotbank. Im Falle der Insolvenz oder des Konkurses der Verwahrstelle wird die Gesellschaft mit Blick auf die Barmittelbestände der Gesellschaft als nicht bevorrechtigter Gläubiger der Verwahrstelle behandelt.

Das Kontrahenten-/Emittentenrisiko wird wie folgt überwacht:

- Jeder Anlageverwalter führt eine Liste mit zugelassenen Maklern, die einer laufenden Überwachung unterliegt. Das Handelssystem erlaubt ausschließlich den Handel mit zugelassenen Maklern. Es werden neue Makler hinzugefügt, die einem formellen Überprüfungsprozess unterzogen werden, der eine Überprüfung der Kreditwürdigkeit sowie der Finanzkraft des Maklers vorsieht.
- Die Bewertung und Überprüfung des Kontrahenten- oder Emittentenhandelsrisikos wird täglich durchgeführt und beinhaltet eine Überprüfung sämtlicher gehaltenen offenen Positionen.

Durch die ständige Risikofunktion der Gesellschaft wird dieser Prozess kontrolliert, und es werden unabhängige Kontrollen durchgeführt.

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

KREDITRISIKO Forts.

Die Bewertung der langfristigen vorrangigen Verbindlichkeiten und der langfristigen Einlagen der Kontrahenten, mit denen die Fonds am 31. Dezember 2021 Geschäfte abgeschlossen haben, durch Standard & Poor's ist in nachstehender Tabelle aufgeführt (Bewertung für 31. Dezember 2020 ist identisch, sofern nicht anders angegeben):

| Kontrahent | Rating | Kontrahent | Rating |
|-------------------------------------|------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| Bank of America Merrill Lynch | A- | J.P. Morgan AG | A+ |
| Bank of Montreal | A+ | Lloyds Bank Plc | A+ |
| Bank of New York Mellon Corporation | A | Morgan Stanley & Co. LLC | A+ |
| Barclays Bank Plc | A | Nomura Holdings Inc | BBB+ |
| BNP Paribas | A+ | RBC Capital Markets LLC | AA- |
| Canadian Imperial Bank of Commerce | A+ | Royal Bank of Canada | AA- |
| Citibank N.A. | A+ | Royal Bank of Scotland Plc | A |
| Commonwealth Bank of Australia. | AA- | Skandinaviska Enskilda Banken AB | A+ |
| Credit Suisse AG | BBB+ | Societe Generale | A |
| Deutsche Bank AG | A- (31. Dezember 2020: BBB+) | Standard Chartered Bank | A+ (31. Dezember 2020: A) |
| Goldman Sachs & Co. | BBB+ | State Street Corp | A |
| HSBC Bank plc | A+ | Toronto Dominion Bank | AA- |
| ING Bank NV | A+ | UBS AG | A+ |
| | | Westpac Banking Corp | AA- |

Bei Fonds, die das Cash Sweep-Management verwenden, werden die Barguthaben automatisch in kurzfristige Anlageinstrumente investiert. Der Baranlage-Auto-Sweep ist Teil des täglichen Liquiditätssteuerungsverfahrens. Sämtliche Geldmarktfonds, die mittels des Cash Sweep-Managements verfügbar sind, weisen ein AAA-Rating durch Standard & Poor's und Moody's auf und zeichnen sich durch einen stabilen Nettoinventarwert aus. Je nach Wohnsitz des Anlegers und den steuerlichen Auswirkungen stehen Prime- und 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 2021 und 31. Dezember 2020.:

| Fonds | Basiswährung | 31. Dezember 2021 | 31. Dezember 2020 |
|---|--------------|-------------------|-------------------|
| BNY Mellon Asian Equity Fund | USD | 597.574 | 1.464.421 |
| BNY Mellon Asian Income Fund | USD | 284.859 | 1.264.861 |
| BNY Mellon Brazil Equity Fund | USD | 995.795 | 526.106 |
| BNY Mellon Future Earth Fund* | USD | 70.255 | k. A. |
| BNY Mellon Future Food Fund* | USD | 77.480 | k. A. |
| BNY Mellon Future Life Fund* | USD | 60.233 | k. A. |
| BNY Mellon Global Bond Fund | USD | 5.851.615 | 9.896.705 |
| BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund | USD | 18.035.656 | 12.258.109 |
| BNY Mellon Global Emerging Markets Fund | USD | 398.423 | k. A. |
| BNY Mellon Global Equity Fund | USD | 8.333.721 | 8.033.206 |
| BNY Mellon Global Equity Income Fund | USD | 4.351.444 | 12.577.522 |
| BNY Mellon Global High Yield Bond Fund | USD | 2.000.000 | 2.000.000 |
| BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund* | EUR | k. A. | 329.925 |
| BNY Mellon Global Opportunities Fund | USD | 672.122 | 360.985 |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) | EUR | 262.947.898 | 90.124.140 |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP) | GBP | 2.945.355 | 997.664 |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (USD) | USD | 36.943.574 | 10.969.805 |
| BNY Mellon Global Unconstrained Fund | USD | 1.624.422 | 1.383.272 |
| BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR) | EUR | 3.507.852 | 816.903 |
| BNY Mellon U.S. Equity Income Fund | USD | 10.968.835 | 5.485.135 |

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

KREDITRISIKO Forts.

Einzelheiten zu den Ratings von Standard & Poor's zu allen Anlagen in verzinslichen Wertpapieren wie Anleihen und ähnlichen Finanzinstrumenten in bestimmten Fonds zum 31. Dezember 2021 und 31. Dezember 2020 sind in der folgenden Tabelle aufgeführt.

| Fonds | Rating | 31. Dezember 2021 | 31. Dezember 2020 |
|--|------------------|-------------------|-------------------|
| | | % | % |
| BNY Mellon Absolute Return Bond Fund^ | AAA | 2,66 | 35,03 |
| | AA | 8,78 | 6,39 |
| | A | 5,11 | 11,43 |
| | BBB | 1,66 | 17,75 |
| | BB | 4,37 | 11,46 |
| | B | 4,65 | 2,94 |
| | CCC | 0,57 | 0,06 |
| | Ohne Rating | 52,35 | 0,55 |
| BNY Mellon Absolute Return Equity Fund^ | AAA | 4,21 | 7,30 |
| | AA+ | k. A. | 3,32 |
| | AA | 5,28 | 21,92 |
| | AA- | 8,42 | 25,94 |
| | A+ | 11,63 | 12,63 |
| | A | 24,17 | 5,31 |
| | Ohne Rating | 46,29 | 23,58 |
| BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund^ | AAA | k. A. | 6,75 |
| | AA+ | 7,92 | k. A. |
| | AA | k. A. | 46,88 |
| | A- | 1,32 | 5,15 |
| | BBB | 2,49 | k. A. |
| | Ohne Rating | 88,27 | 41,22 |
| BNY Mellon Dynamic Total Return Fund* | AA+ | k. A. | 71,13 |
| BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund | AA+ | 5,42 | 7,65 |
| BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund | BBB | 2,48 | k. A. |
| | BB | 53,25 | 65,06 |
| | B | 29,95 | 28,45 |
| | CCC | 7,70 | 5,59 |
| | CC und niedriger | k. A. | 0,07 |
| | Sonstiges | k. A. | 0,83 |
| | Ohne Rating | 6,62 | k. A. |
| BNY Mellon Efficient IG Corporate Beta Fund | AAA | 0,57 | 0,46 |
| | AA | 4,42 | 6,70 |
| | A | 27,90 | 31,02 |
| | BBB | 61,36 | 60,89 |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

KREDITRISIKO Forts.

| Fonds | Rating | 31. Dezember 2021 % | 31. Dezember 2020 % |
|---|-------------------|------------------------|------------------------|
| BNY Mellon Efficient IG Corporate Beta Fund Forts. | BB und niedriger | 2,28 | 0,93 |
| | Ohne Rating | 3,47 | k. A. |
| BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund | BBB | 0,48 | 0,13 |
| | BB | 88,09 | 93,45 |
| | B | 9,03 | 5,98 |
| | CCC | 1,32 | 0,44 |
| | CC und niedriger | k. A. | k. A. |
| | Ohne Rating | 1,08 | k. A. |
| BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund | BBB | 2,15 | k. A. |
| | BB | 55,32 | 55,24 |
| | B | 31,82 | 32,60 |
| | CCC | 8,87 | 11,45 |
| | CC und niedriger | k. A. | 0,71 |
| | Ohne Rating | 1,84 | k. A. |
| BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund^ | AA | 1,03 | k. A. |
| | A | 3,65 | 8,68 |
| | BBB | 27,63 | 33,37 |
| | BB | 15,71 | 18,73 |
| | B | 13,27 | 27,24 |
| | CCC und niedriger | 6,20 | 10,67 |
| | Ohne Rating | 32,51 | 1,31 |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Fonds | AAA | k. A. | 3,23 |
| | AA | k. A. | 2,51 |
| | A | 4,45 | 5,39 |
| | BBB | 29,07 | 34,23 |
| | BB | 20,37 | 32,22 |
| | B | 26,47 | 20,88 |
| | CCC | 2,33 | 1,54 |
| | Ohne Rating | 17,31 | k. A. |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund | AAA | k. A. | 1,65 |
| | AA | 2,73 | 0,14 |
| | AA- | k. A. | 5,54 |
| | A+ | 23,82 | 13,30 |
| | A | 4,08 | 3,83 |
| | A- | 5,54 | 6,42 |
| | BBB+ | 12,38 | 16,55 |
| | BBB | 23,00 | 26,50 |
| | BBB- | 4,17 | 7,59 |
| | BB | 13,05 | 17,92 |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

KREDITRISIKO Forts.

| Fonds | Rating | 31. Dezember 2021 % | 31. Dezember 2020 % |
|--|-------------|------------------------|------------------------|
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund Forts. | BB- | 5,45 | 0,16 |
| | Sonstiges | k. A. | 0,40 |
| | Ohne Rating | 5,78 | k. A. |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund | AAA | k. A. | 1,65 |
| | AA | 2,21 | 4,31 |
| | A | 17,61 | 9,90 |
| | BBB | 30,49 | 43,02 |
| | BB | 22,17 | 28,75 |
| | B | 13,37 | 11,25 |
| | CCC | 0,76 | 1,00 |
| | Ohne Rating | 13,39 | 0,13 |
| | Sonstiges | k. A. | 1,65 |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund^ | AA | k. A. | 1,68 |
| | AA- | 3,44 | 1,66 |
| | A+ | k. A. | 1,34 |
| | A | 1,26 | 0,54 |
| | A- | 0,80 | 1,01 |
| | BBB+ | 6,40 | 5,71 |
| | BBB | 4,49 | 9,58 |
| | BBB- | 11,82 | 26,61 |
| | BB+ | 3,74 | 3,35 |
| | BB | 9,39 | k. A. |
| | BB- | 9,79 | 19,21 |
| | B+ | 4,45 | 4,53 |
| | B | 12,57 | 14,36 |
| | B- | 7,76 | 6,40 |
| | CCC+ | 3,52 | 2,53 |
| | CCC | k. A. | 1,09 |
| CCC- | k. A. | 0,24 | |
| Ohne Rating | 20,57 | 0,16 | |
| BNY Mellon Euroland Bond Fund | AAA | 20,70 | 33,78 |
| | AA | 27,73 | 10,90 |
| | A | 10,32 | 15,10 |
| | BBB | 25,82 | 27,83 |
| | BB | 6,51 | 6,54 |
| | B | 1,33 | 1,72 |
| | Ohne Rating | 7,59 | k. A. |
| | Sonstiges | k. A. | 4,13 |
| BNY Mellon European Credit Fund^ | AAA | 0,28 | 0,47 |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

KREDITRISIKO Forts.

| Fonds | Rating | 31. Dezember 2021 % | 31. Dezember 2020 % |
|---|-----------------------------|------------------------|------------------------|
| BNY Mellon European Credit Fund^ cont'd | AA | 13,06 | 1,67 |
| | A | 29,05 | 42,65 |
| | BBB | 33,08 | 44,13 |
| | BB und niedriger | 3,53 | 2,63 |
| | Ohne Rating | 14,48 | k. A. |
| | Insight EMD Fund | 1,06 | 1,78 |
| | Insight Short Dated HY Fund | 2,56 | 2,96 |
| BNY Mellon Global Bond Fund | AAA | 29,09 | 43,58 |
| | AA | 42,22 | 19,73 |
| | A | 15,35 | 15,95 |
| | BBB | 11,94 | 20,74 |
| | BB | 1,40 | k. A. |
| BNY Mellon Global Credit Fund^ | AAA | 3,39 | 28,85 |
| | AA | 9,25 | 4,94 |
| | A | 27,61 | 17,09 |
| | BBB | 23,76 | 25,54 |
| | Below BBB | 7,82 | 13,10 |
| | Ohne Rating | 25,67 | 8,07 |
| BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund | AAA | 20,40 | 25,56 |
| | AA | 17,01 | 18,91 |
| | A | 5,68 | 10,31 |
| | BBB | 6,36 | 17,16 |
| | BB | 19,08 | 19,88 |
| | B | 19,26 | 8,18 |
| | Ohne Rating | 12,21 | k. A. |
| BNY Mellon Global High Yield Bond Fund | BBB | k. A. | 3,10 |
| | BB | 29,51 | 36,49 |
| | B | 46,30 | 42,00 |
| | CCC und niedriger | 17,35 | 16,65 |
| | Ohne Rating | 6,84 | k. A. |
| BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund* | AAA | k. A. | 25,03 |
| | A- | k. A. | 5,10 |
| | BBB+ | k. A. | 2,12 |
| | BBB | k. A. | 13,86 |
| | BBB- | k. A. | 11,57 |
| | BB+ | k. A. | 6,76 |
| | BB | k. A. | 7,27 |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

KREDITRISIKO Forts.

| Fonds | Rating | 31. Dezember 2021 % | 31. Dezember 2020 % |
|--|-----------------|------------------------|------------------------|
| BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund* Forts. | BB- | k. A. | 3,78 |
| | B+ | k. A. | 10,48 |
| | B | k. A. | 8,93 |
| | B- | k. A. | 2,41 |
| | D | k. A. | 2,69 |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) | AAA | k. A. | 2,70 |
| | AA | k. A. | 3,57 |
| | BBB | k. A. | 22,64 |
| | BB | 36,30 | 57,55 |
| | B und niedriger | 22,77 | 13,54 |
| | Ohne Rating | 40,93 | k. A. |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP) | AAA | k. A. | 3,11 |
| | AA | k. A. | 3,71 |
| | BBB | k. A. | 25,66 |
| | BB | 14,55 | 53,41 |
| | B und niedriger | 12,69 | 14,11 |
| | Ohne Rating | 72,76 | k. A. |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (USD) | AAA | k. A. | 2,80 |
| | AA | k. A. | 1,60 |
| | BBB | 0,20 | 25,30 |
| | BB | 10,78 | 55,10 |
| | B und niedriger | 6,98 | 15,20 |
| | Ohne Rating | 82,04 | k. A. |
| BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund^ | BBB | k. A. | 0,74 |
| | BB | 10,31 | 27,56 |
| | B | 46,59 | 54,46 |
| | CCC | 16,31 | 12,37 |
| | Ohne Rating | 15,18 | k. A. |
| BNY Mellon Global Unconstrained Fund | AAA | 15,45 | 55,91 |
| | AA+ | 56,41 | 12,84 |
| | A+ | 1,92 | 1,91 |
| | A | 3,65 | k. A. |
| | A- | k. A. | 3,92 |
| | BBB+ | 5,51 | 2,11 |
| | BBB | k. A. | 6,55 |
| | BBB- | 7,13 | 8,05 |
| | BB+ | 2,81 | k. A. |
| | BB | 4,43 | 4,49 |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

KREDITRISIKO Forts.

| Fonds | Rating | 31. Dezember 2021 % | 31. Dezember 2020 % |
|---|-------------|------------------------|------------------------|
| BNY Mellon Global Unconstrained Fund Forts. | BB- | k. A. | 2,27 |
| | B+ | k. A. | 1,95 |
| | Ohne Rating | 2,69 | k. A. |
| BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund | AAA | 24,34 | 26,57 |
| | AA | 11,65 | 16,15 |
| | A | 6,78 | 12,61 |
| | BBB | 9,06 | 19,86 |
| | BB | 19,32 | 17,41 |
| | B | 16,23 | 7,40 |
| | Ohne Rating | 12,62 | k. A. |
| BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR) | AA | k. A. | 3,90 |
| | A | k. A. | 6,70 |
| | BBB | k. A. | 31,20 |
| | BB | 14,48 | 41,00 |
| | B | 47,47 | 17,20 |
| | Ohne Rating | 38,05 | k. A. |
| BNY Mellon Targeted Return Bond Fund | AAA | 15,02 | 42,84 |
| | AA | 26,21 | 4,35 |
| | A | 7,88 | 10,71 |
| | BBB | 29,59 | 30,05 |
| | BB | 12,04 | 9,53 |
| | B | 2,74 | 2,72 |
| | Ohne Rating | 6,52 | k. A. |
| BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund | AAA | 6,68 | 8,51 |
| | AA | 50,50 | 54,06 |
| | A | 26,25 | 26,97 |
| | BBB | 3,55 | 9,51 |
| | BB | 0,96 | 0,95 |
| | Ohne Rating | 12,06 | k. A. |
| Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund^{^*} | AAA | 0,91 | k. A. |
| | AA | 14,77 | k. A. |
| | A | 39,40 | k. A. |
| | BBB | 25,47 | k. A. |
| | BB | 4,17 | k. A. |
| | B | 0,29 | k. A. |
| | Ohne Rating | 11,46 | k. A. |

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

[^] Die Qualitätsaufschlüsselung der Kreditratings von Standard & Poor's zum 31. Dezember 2021 wurde den Daten des Administrators entnommen,

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

KREDITRISIKO Forts.

für das Vorjahr wurden sie vom Anlageverwalter geliefert.

Alle Transaktionen mit börsennotierten Wertpapieren werden bei Lieferung über anerkannte Makler abgewickelt bzw. bezahlt. Das Risiko eines Zahlungsausfalls des Maklers gilt als äußerst gering, da die verkauften Wertpapiere erst ausgehändigt werden, wenn die Zahlung beim Makler eingegangen ist. Bei einem Kauf werden die Wertpapiere erst bezahlt, wenn sie beim Makler eingegangen sind.

Credit Default Swaps bieten ein Maß an Schutz gegen Zahlungsausfälle von Emittenten von Schuldverschreibungen. Der Einsatz von Credit Default Swaps gewährleistet jedoch nicht, dass ihr Einsatz effektiv sein oder das gewünschte Ergebnis erzielen wird. Die Kreditereignisse werden im Vertrag festgehalten und dienen dazu, den Eintritt einer erheblichen Verschlechterung der Kreditwürdigkeit des Referenzvermögenswerts zu identifizieren. Als ein Sicherungsgeber im Rahmen von Credit Default Swaps erhalten die Fonds vom Sicherungsnehmer in der Regel einen festverzinslichen Ertrag während der Laufzeit des Swaps, sofern kein Kreditereignis eintritt. Als der Sicherungsgeber würden die Fonds ihren Portfolios effektiv Hebelwirkung hinzufügen, da die Fonds neben ihrem Gesamtvermögen dem Anlagerisiko auf die Nennbeträge der Swaps unterliegen würden.

Der höchstmögliche Betrag künftiger Zahlungen (nicht diskontiert), zu deren Leistung ein Fonds als Sicherungsgeber im Rahmen eines Credit Default Swaps aufgefordert werden könnte, entspricht dem Nennbetrag des Vertrags. Diese potenziellen Beträge würden zum Teil durch den Restwert der jeweiligen Verpflichtungen, durch Vorauszahlungen, die bei Vertragsabschluss geleistet wurden, oder durch Nettobeträge aus der Verrechnung des Kaufs von Schutz im Rahmen des eingegangenen Credit Default Swaps, von den Fonds für dasselbe Referenzunternehmen oder dieselben Referenzunternehmen ausgeglichen werden.

Das Höchstengagement für die Fonds als ein Sicherungsgeber ist nachstehend aufgeführt.

| Fonds | Basis- Währung | 31. Dezember 2021 Maximales Engagement | 31. Dezember 2020 Maximales Engagement |
|---|-------------------|---|---|
| BNY Mellon Absolute Return Bond Fund | EUR | 288.191.277 | 423.891.915 |
| BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund* | USD | 18.663.407 | k. A. |
| BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund | USD | 4.796.951 | 1.055.155 |
| BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund | USD | 1.800.000 | 4.000.000 |
| BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund | USD | 47.300.000 | 21.300.000 |
| BNY Mellon Global Credit Fund | USD | 235.301.515 | 491.443.566 |
| BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund | USD | 5.464.805 | 5.863.920 |

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Sofern möglich begrenzt die Gesellschaft ihr Risiko von Zahlungsausfällen beim Handel mit von ihr gehaltenen derivativen Instrumenten durch Abschluss von bilateralen Globalverrechnungsverträgen zwischen den Fonds und den Kontrahenten (zugelassenen Maklern), mit denen die Fonds ein erhebliches Volumen an OTC-Derivatgeschäften (darunter Total Return Swaps) abwickeln. Derivate werden bei den Kontrahenten auf nicht getrennter Basis gehalten. Globalverrechnungsverträge führen nicht zu einer Aufrechnung der in der Bilanz enthaltenen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, da die Transaktionen üblicherweise auf Bruttobasis abgewickelt werden. Das mit günstigen Kontrakten verbundene Kreditrisiko verringert sich durch Globalverrechnungsverträge jedoch, sofern im Falle eines Ausfalls alle Beträge des Kontrahenten gekündigt und auf Nettobasis reguliert werden. Das Gesamtkreditrisiko der Gesellschaft im Zusammenhang mit einem Globalverrechnungsvertrag unterliegenden derivativen Instrumenten kann sich innerhalb kurzer Zeit erheblich ändern, da sich jede Transaktion im Rahmen des Vertrags darauf auswirkt.

Bestimmte außerbörsliche (OTC-) Derivate werden über zentrale Clearingstellen abgewickelt. Bei dieser Vereinbarung werden mit Kontrahenten abgeschlossene außerbörsliche Transaktionen an Clearingstellen übergeben, die nach der Annahme den Kontrahenten in Bezug auf die Risiken der Transaktion wirksam ersetzen.

Die Gesellschaft setzt ein Risikomanagementverfahren ein, das es ihr ermöglicht, die mit Positionen in derivativen Finanzinstrumenten verbundenen Risiken zu bewerten, zu überwachen und zu verwalten; nähere Angaben zu diesem Verfahren wurden der Zentralbank mitgeteilt.

Zur Bereitstellung von Einschuss- bzw. Sicherheitsleistungen für Transaktionen mit derivativen Finanzinstrumenten sind die Fonds der Gesellschaft berechtigt, alle Anlagen oder liquiden Mittel, die Bestandteil des Vermögens der betreffenden Fonds sind, zu übertragen und hypothekarisch oder anderweitig zu belasten. Zudem können die Fonds einem Kreditrisiko in Verbindung mit den Kontrahenten ausgesetzt sein, mit denen sie Transaktionen tätigen oder bei denen sie Einschuss- bzw. Sicherheitsleistungen im Zusammenhang mit Transaktionen in derivativen Finanzinstrumenten hinterlegen, und tragen gegebenenfalls das Ausfallrisiko von Kontrahenten.

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

KREDITRISIKO Forts.

Die Fonds können Barmittel und zulässige Sachsicherheiten im Zusammenhang mit dem Handel mit derivativen Finanzinstrumenten zur Verringerung des Kontrahentenrisikos annehmen. Barsicherheiten, die jeder Fonds erhalten hat, werden in der Bilanz als ein Vermögenswert ausgewiesen, dem eine entsprechende Verbindlichkeit gegenübersteht.

Zum 31. Dezember 2021, wurden die folgenden Sachsicherheiten für Transaktionen in derivativen Finanzinstrumenten entgegengenommen:

| Fonds | Kontrahent | Währung | Beizulegender Zeitwert |
|--------------------------------------|----------------------------------|---------|------------------------|
| BNY Mellon Euroland Bond Fund | Goldman Sachs International | EUR | 318.743 |
| BNY Mellon Global Credit Fund | Citigroup Global Markets Limited | USD | 19.526 |

Zum 31. Dezember 2020 waren keine Sachsicherheiten für Transaktionen in derivativen Finanzinstrumenten entgegengenommen worden.

Fonds, die Wertpapierleihgeschäfte abschließen, unterliegen ebenfalls dem Kontrahentenrisiko. Um dieses Risiko zu minimieren, werden Sicherheiten gehalten, deren Wert den Betrag der entliehenen Wertpapiere übersteigt. Einzelheiten dazu sind in Erläuterung 14 zum Abschluss enthalten.

Einige Fonds besitzen Anlagen in fremdfinanzierten Darlehen, die bei den kreditabwickelnden Banken nicht separat gehalten werden. Diese Darlehen werden nicht von der Verwahrstelle gehalten. Entsprechend sind die Fonds dem Kreditrisiko des Schuldners ausgesetzt. Zudem gehen die Fonds das Kreditrisiko der kreditabwickelnden Banken ein.

LIQUIDITÄTSRISIKO

Das Liquiditätsrisiko bezeichnet das Risiko, dass die Gesellschaft nicht ausreichende Barmittel aufbringen kann, um ihre Verpflichtungen bei Fälligkeit in vollem Umfang zu begleichen oder dies nur zu äußerst ungünstigen Bedingungen tun kann.

Die Gesellschaft muss täglich Einschussforderungen auf Derivate und Barrücknahmen einlösbarer, partizipierender Anteile abwickeln. Daher investiert jeder Fonds den Großteil seines Vermögens in Anlagen, die an einem aktiven Markt gehandelt werden und schnell verkauft werden können. Nur ein geringer Teil seines Vermögens wird in Anlagen investiert, die nicht aktiv an einer Börse gehandelt werden. Die börsennotierten Wertpapiere jedes Fonds gelten als rasch verwertbar, da sie an einer regulierten Börse gehandelt werden.

Die Anlageverwalter verwenden gegebenenfalls derivative Instrumente und Schuldtitel wie börsengehandelte Index-Futures, um ein Engagement an Märkten zu ermöglichen und zugleich eine ausreichende Liquidität aufrecht zu erhalten.

Erwirbt ein Fonds Wertpapiere an Freiverkehrsmärkten, kann aufgrund der oftmals begrenzten Liquidität und der vergleichsweise starken Kursschwankungen dieser Märkte nicht garantiert werden, dass der Fonds den Marktwert für diese Wertpapiere erzielt.

Um die Abrechnung sicherzustellen, kann die Gesellschaft kurzfristige Kredite aufnehmen. Ein Überziehungskreditlinie existiert und wurde zu Abrechnungszwecken in Anspruch genommen. Die Verwahrstelle ist berechtigt, verfügbare Barmittel des Fonds zu verwenden und vorhandene Wertpapiere zu verwerten, wenn dies erforderlich ist, um die Verpflichtungen des Fonds im Zusammenhang mit der Bereitstellung eines Überziehungskredits für den Fonds und/oder unbezahlter Beträge zu erfüllen.

Die finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Gesellschaft werden zu Handelszwecken gehalten und vorwiegend zum Zweck der kurzfristigen Veräußerung erworben. Da diese Wertpapiere erwartungsgemäß nicht bis zur Fälligkeit oder Kündigung gehalten werden, repräsentiert der aktuelle Marktwert den geschätzten Cashflow, der für die Veräußerung der Wertpapiere ggf. erforderlich ist. Künftige Cashflows der Fonds sowie realisierte Verbindlichkeiten können aufgrund veränderter Marktbedingungen von den aktuellen Verbindlichkeiten abweichen.

Alle finanziellen Verbindlichkeiten sind mit Ausnahme der in den Tabellen dieser Erläuterung aufgeführten Verbindlichkeiten innerhalb von drei Monaten verwertbar.

Swaps und andere derivative Instruments sind in den nachfolgenden Tabellen basierend auf ihren vertraglichen Fälligkeits-/Abrechnungsterminen offen zu legen, die „Über 1 Jahr“ sein können. Da Swaps und sonstige derivative Instrumente jedoch zu Handelszwecken gehalten werden, können die jeweiligen Anlageverwalter je nach Marktbedingungen eine frühere Abrechnung wählen.

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

In der nachfolgenden Tabelle sind die finanziellen Verbindlichkeiten der Fonds, die in Derivate investieren, bezüglich der relevanten Fälligkeitsgruppen auf der Basis der zum 31. Dezember 2021 verbleibenden Zeit bis zur vertraglichen Fälligkeit zusammengefasst. Die Tabellen wurden auf der Basis der nicht diskontierten Brutto-Mittelabflüsse in Bezug auf ihre finanziellen Verbindlichkeiten erstellt:

| Fonds | Weniger als 1 Monat | 1-3 Monate | 3 Monate bis 1 Jahr | Über 1 Jahr | Summe 31. Dezember 2021 |
|--|------------------------|--------------------|------------------------|------------------|----------------------------|
| BNY Mellon Absolute Return Bond Fund | | | | | |
| | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR |
| Terminkontrakte (Futures) | – | 1.976.470 | – | – | 1.976.470 |
| Optionen | 19.519 | 4.546.691 | 98.098 | – | 4.664.308 |
| Swaps | – | – | 12.209 | 9.289.532 | 9.301.741 |
| Terminkontrakte (Forwards) | 257.814.349 | 123.606.806 | – | – | 381.421.155 |
| 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 |
| Terminkontrakte (Futures) | 37.152 | 254.653 | – | – | 291.805 |
| Swaps | 912.697 | – | 2.764.140 | – | 3.676.837 |
| Terminkontrakte (Forwards) | 117.649.619 | – | – | – | 117.649.619 |
| 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 |
| Terminkontrakte (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 Equity 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 |
| 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 |

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 |
| Terminkontrakte (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 |
| Terminkontrakte (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 |
| Terminkontrakte (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 |
| Terminkontrakte (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 |
| Terminkontrakte (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 |
| Terminkontrakte (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 |
| Terminkontrakte (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 |
|--|----------------|-------------------|----------|----------|-------------------|
| Terminkontrakte (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 |
|--|----------------|----------------|----------|----------------|------------------|
| Terminkontrakte (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 |
| Terminkontrakte (Futures) | – | 160.987 | – | – | 160.987 |
| Optionen | 10.492 | 3.657.272 | – | – | 3.667.764 |
| Swaps | – | – | – | 4.948.648 | 4.948.648 |
| Terminkontrakte (Forwards) | 337.211.217 | 741.239 | – | – | 337.952.456 |
| 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 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 |
| Terminkontrakte (Futures) | – | 2.277.516 | – | – | 2.277.516 |
| Optionen | – | 5.061.446 | 13.629.975 | – | 18.691.421 |
| Terminkontrakte (Forwards) | 632.247.393 | 1.488.345.232 | – | – | 2.120.592.625 |
| 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 |
| Terminkontrakte (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 |
| Terminkontrakte (Futures) | – | 316.381 | – | – | 316.381 |
| Optionen | – | 709.932 | 1.834.260 | – | 2.544.192 |
| Terminkontrakte (Forwards) | 16.528.942 | 21.347.911 | – | – | 37.876.853 |
| 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 | Gesamt 31. Dezember 2021 |
|--|------------------------|--------------------|------------------------|----------------|-----------------------------|
| 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 |
| Terminkontrakte (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 |
| Terminkontrakte (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 31. Dezember 2021 | Gesamt |
|--|------------------------|----------------|------------------------|----------------------------------|----------------------|
| 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 |
| Terminkontrakte (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.

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

In der nachfolgenden Tabelle sind die finanziellen Verbindlichkeiten der Fonds, die in Derivate investieren, bezüglich der relevanten Fälligkeitsgruppen auf der Basis der zum 31. Dezember 2020 verbleibenden Zeit bis zur vertraglichen Fälligkeit zusammengefasst. Die Tabellen wurden auf der Basis der nicht diskontierten Brutto-Mittelabflüsse in Bezug auf ihre finanziellen Verbindlichkeiten erstellt:

| Fonds | Weniger als 1 Monat | 1-3 Monate | 3 Monate bis 1 Jahr | Über 1 Jahr 31. Dezember 2020 | Summe |
|--|------------------------|------------------|------------------------|----------------------------------|--------------------|
| BNY Mellon Absolute Return Bond Fund | | | | | |
| | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR |
| Terminkontrakte (Futures) | – | 767.997 | – | – | 767.997 |
| Optionen | 271.457 | 303.868 | 39.989 | 806 | 616.120 |
| Swaps | – | – | 127.307 | 14.430.612 | 14.557.919 |
| Terminkontrakte (Forwards) | 115.217.376 | 3.357.782 | – | – | 118.575.158 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 115.488.833 | 4.429.647 | 167.296 | 14.431.418 | 134.517.194 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Banküberziehung | 60 | – | – | – | 60 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 454.563 | – | – | – | 454.563 |
| Antizipative Passiva | 277.806 | – | – | – | 277.806 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 7.670.164 | – | – | – | 7.670.164 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 420.597.176 | – | – | – | 420.597.176 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 544.488.602 | 4.429.647 | 167.296 | 14.431.418 | 563.516.963 |
| BNY Mellon Absolute Return Equity Fund | | | | | |
| | GBP | GBP | GBP | GBP | GBP |
| Terminkontrakte (Futures) | 20.405 | 444.453 | – | – | 464.858 |
| Swaps | 6.397.118 | – | 6.453.841 | – | 12.850.959 |
| Terminkontrakte (Forwards) | 168.938.460 | – | – | – | 168.938.460 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 175.355.983 | 444.453 | 6.453.841 | – | 182.254.277 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Banküberziehung | 1 | – | – | – | 1 |
| Antizipative Passiva | 282.242 | – | – | – | 282.242 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 8.849.204 | – | – | – | 8.849.204 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 241.339.578 | – | – | – | 241.339.578 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 425.827.008 | 444.453 | 6.453.841 | – | 432.725.302 |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

| Fonds | Weniger als 1 Monat | 1-3 Monate | 3 Monate bis 1 Jahr | Über 1 Jahr | Gesamt 31. Dezember 2020 |
|--|------------------------|---------------|------------------------|----------------|-----------------------------|
| BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund | | | | | |
| | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR |
| Terminkontrakte (Futures) | 1.878 | 22.258 | – | – | 24.136 |
| Swaps | – | – | 5.763.799 | 256.944 | 6.020.743 |
| Terminkontrakte (Forwards) | 3.067.540 | – | – | – | 3.067.540 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 3.069.418 | 22.258 | 5.763.799 | 256.944 | 9.112.419 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Banküberziehung | 2.129 | – | – | – | 2.129 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 522.478 | – | – | – | 522.478 |
| Antizipative Passiva | 42.682 | – | – | – | 42.682 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 896.788 | – | – | – | 896.788 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 33.223.020 | – | – | – | 33.223.020 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 37.756.515 | 22.258 | 5.763.799 | 256.944 | 43.799.516 |
| BNY Mellon Asian Equity Fund | | | | | |
| | USD | USD | USD | USD | USD |
| Terminkontrakte (Forwards) | 18.080 | – | – | – | 18.080 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 18.080 | – | – | – | 18.080 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Banküberziehung | 312.982 | – | – | – | 312.982 |
| Antizipative Passiva | 132.527 | – | – | – | 132.527 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 1.168.877 | – | – | – | 1.168.877 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 66.360.687 | – | – | – | 66.360.687 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 67.993.153 | – | – | – | 67.993.153 |
| BNY Mellon Asian Income Fund | | | | | |
| | USD | USD | USD | USD | USD |
| Terminkontrakte (Forwards) | 66.749 | – | – | – | 66.749 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 66.749 | – | – | – | 66.749 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Banküberziehung | 5.009 | – | – | – | 5.009 |
| Antizipative Passiva | 46.037 | – | – | – | 46.037 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 36.440.997 | – | – | – | 36.440.997 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 36.558.792 | – | – | – | 36.558.792 |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

| Fonds | Weniger als 1 Monat | 1-3 Monate | 3 Monate bis 1 Jahr | Über 1 Jahr | Gesamt 31. Dezember 2020 |
|--|------------------------|-------------------|------------------------|----------------|-----------------------------|
| BNY Mellon Blockchain Innovation Fund | | | | | |
| | USD | USD | USD | USD | USD |
| Terminkontrakte (Forwards) | 101.835 | – | – | – | 101.835 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 101.835 | – | – | – | 101.835 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Antizipative Passiva | 35.294 | – | – | – | 35.294 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 15.864.824 | – | – | – | 15.864.824 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 16.001.953 | – | – | – | 16.001.953 |
| BNY Mellon Brazil Equity Fund | | | | | |
| | USD | USD | USD | USD | USD |
| Terminkontrakte (Forwards) | 572.272 | – | – | – | 572.272 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 572.272 | – | – | – | 572.272 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Antizipative Passiva | 209.284 | – | – | – | 209.284 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 3.422.194 | – | – | – | 3.422.194 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 70.198.270 | – | – | – | 70.198.270 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 74.402.020 | – | – | – | 74.402.020 |
| BNY Mellon Dynamic Total Return Fund | | | | | |
| | USD | USD | USD | USD | USD |
| Terminkontrakte (Futures) | 32.443 | 90.643 | – | – | 123.086 |
| Terminkontrakte (Forwards) | 1.135 | 11.747.906 | – | – | 11.749.041 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 33.578 | 11.838.549 | – | – | 11.872.127 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Banküberziehung | 517.446 | – | – | – | 517.446 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 137.699 | – | – | – | 137.699 |
| Antizipative Passiva | 17.569 | – | – | – | 17.569 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 16.366.070 | – | – | – | 16.366.070 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 17.072.362 | 11.838.549 | – | – | 28.910.911 |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

| Fonds | Weniger als 1 Monat | 1-3 Monate | 3 Monate bis 1 Jahr | Über 1 Jahr | Gesamt 31. Dezember 2020 |
|--|------------------------|----------------|------------------------|----------------|-----------------------------|
| | USD | USD | USD | USD | USD |
| BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund | | | | | |
| Terminkontrakte (Futures) | – | 998.353 | – | – | 998.353 |
| Terminkontrakte (Forwards) | 2.185.762 | – | – | – | 2.185.762 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 2.185.762 | 998.353 | – | – | 3.184.115 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Margen auf Derivatkontrakte | 70.860 | – | – | – | 70.860 |
| Antizipative Passiva | 311.909 | – | – | – | 311.909 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 1.432.762 | – | – | – | 1.432.762 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 536.212.842 | – | – | – | 536.212.842 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 540.214.135 | 998.353 | – | – | 541.212.488 |
| BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund | | | | | |
| Terminkontrakte (Forwards) | 5.871.302 | – | – | – | 5.871.302 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 5.871.302 | – | – | – | 5.871.302 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Margen auf Derivatkontrakte | 71.397 | – | – | – | 71.397 |
| Antizipative Passiva | 19.462 | – | – | – | 19.462 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 108.950 | – | – | – | 108.950 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 26.335.612 | – | – | – | 26.335.612 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 32.406.723 | – | – | – | 32.406.723 |
| BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund | | | | | |
| Terminkontrakte (Futures) | – | 44.678 | – | – | 44.678 |
| Terminkontrakte (Forwards) | 29.759.006 | – | – | – | 29.759.006 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 29.759.006 | 44.678 | – | – | 29.803.684 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Margen auf Derivatkontrakte | 660 | – | – | – | 660 |
| Antizipative Passiva | 38.584 | – | – | – | 38.584 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 44.168.089 | – | – | – | 44.168.089 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 73.966.339 | 44.678 | – | – | 74.011.017 |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

| Fonds | Weniger als 1 Monat | 1-3 Monate | 3 Monate bis 1 Jahr | Über 1 Jahr | Gesamt 31. Dezember 2020 |
|--|------------------------|----------------|------------------------|----------------|-----------------------------|
| BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund | | | | | |
| | USD | USD | USD | USD | USD |
| Terminkontrakte (Futures) | – | 396.547 | – | – | 396.547 |
| Terminkontrakte (Forwards) | 3.414.118 | – | – | – | 3.414.118 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 3.414.118 | 396.547 | – | – | 3.810.665 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Margen auf Derivatkontrakte | 191.842 | – | – | – | 191.842 |
| Antizipative Passiva | 128.514 | – | – | – | 128.514 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 47.944.793 | – | – | – | 47.944.793 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 1.203.350.910 | – | – | – | 1.203.350.910 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 1.255.030.177 | 396.547 | – | – | 1.255.426.724 |
| BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund | | | | | |
| | USD | USD | USD | USD | USD |
| Terminkontrakte (Forwards) | 20.387.229 | – | – | – | 20.387.229 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 20.387.229 | – | – | – | 20.387.229 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Margen auf Derivatkontrakte | 134.822 | – | – | – | 134.822 |
| Antizipative Passiva | 313.167 | – | – | – | 313.167 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 5.597.765 | – | – | – | 5.597.765 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 770.676.813 | – | – | – | 770.676.813 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 797.109.796 | – | – | – | 797.109.796 |
| BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund | | | | | |
| | USD | USD | USD | USD | USD |
| Swaps | – | – | – | 228.094 | 228.094 |
| Terminkontrakte (Forwards) | 45.102.102 | – | – | – | 45.102.102 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 45.102.102 | – | – | 228.094 | 45.330.196 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Antizipative Passiva | 273.928 | – | – | – | 273.928 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 208.571 | – | – | – | 208.571 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 392.457.935 | – | – | – | 392.457.935 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 438.042.536 | – | – | 228.094 | 438.270.630 |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

| Fonds | Weniger als 1 Monat | 1-3 Monate | 3 Monate bis 1 Jahr | Über 1 Jahr | Gesamt 31. Dezember 2020 |
|--|------------------------|-------------------|------------------------|----------------|-----------------------------|
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund | | | | | |
| | USD | USD | USD | USD | USD |
| Terminkontrakte (Futures) | – | 31.711 | – | – | 31.711 |
| Terminkontrakte (Forwards) | 578.438 | – | – | – | 578.438 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 578.438 | 31.711 | – | – | 610.149 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Margen auf Derivatkontrakte | 23.417 | – | – | – | 23.417 |
| Antizipative Passiva | 58.181 | – | – | – | 58.181 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 39.274.388 | – | – | – | 39.274.388 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 39.934.424 | 31.711 | – | – | 39.966.135 |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund | | | | | |
| | USD | USD | USD | USD | USD |
| Terminkontrakte (Forwards) | 23.608.072 | 52.338.080 | – | – | 75.946.152 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 23.608.072 | 52.338.080 | – | – | 75.946.152 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Banküberziehung | 1.076 | – | – | – | 1.076 |
| Antizipative Passiva | 321.343 | – | – | – | 321.343 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 4.419.942 | – | – | – | 4.419.942 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 164.668.641 | – | – | – | 164.668.641 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 193.019.074 | 52.338.080 | – | – | 245.357.154 |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund | | | | | |
| | USD | USD | USD | USD | USD |
| Terminkontrakte (Futures) | – | 550 | – | – | 550 |
| Terminkontrakte (Forwards) | 2.031.562 | 4.711.848 | – | – | 6.743.410 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 2.031.562 | 4.712.398 | – | – | 6.743.960 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Margen auf Derivatkontrakte | 8.378 | – | – | – | 8.378 |
| Antizipative Passiva | 20.021 | – | – | – | 20.021 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 970.000 | – | – | – | 970.000 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 28.263.991 | – | – | – | 28.263.991 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 31.293.952 | 4.712.398 | – | – | 36.006.350 |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

| Fonds | Weniger als 1 Monat | 1-3 Monate | 3 Monate bis 1 Jahr | Über 1 Jahr 31. Dezember 2020 | Gesamt |
|--|------------------------|-------------------|------------------------|----------------------------------|--------------------|
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund | | | | | |
| | USD | USD | USD | USD | USD |
| Optionen | 3.138 | – | – | – | 3.138 |
| Terminkontrakte (Forwards) | 72.076.091 | 2.483.348 | – | – | 74.559.439 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 72.079.229 | 2.483.348 | – | – | 74.562.577 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Banküberziehung | 448 | – | – | – | 448 |
| Antizipative Passiva | 166.328 | – | – | – | 166.328 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 522.345 | – | – | – | 522.345 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 165.595.940 | – | – | – | 165.595.940 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 238.364.290 | 2.483.348 | – | – | 240.847.638 |
| BNY Mellon Euroland Bond Fund | | | | | |
| | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR |
| Terminkontrakte (Futures) | – | 153.163 | – | – | 153.163 |
| Terminkontrakte (Forwards) | 39.438.121 | 11.723.810 | – | – | 51.161.931 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 39.438.121 | 11.876.973 | – | – | 51.315.094 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Banküberziehung | 22 | – | – | – | 22 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 4.723.319 | – | – | – | 4.723.319 |
| Antizipative Passiva | 508.891 | – | – | – | 508.891 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 2.299.135 | – | – | – | 2.299.135 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 442.908.116 | – | – | – | 442.908.116 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 489.877.604 | 11.876.973 | – | – | 501.754.577 |
| BNY Mellon European Credit Fund | | | | | |
| | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR |
| Terminkontrakte (Futures) | – | 4.300 | – | – | 4.300 |
| Swaps | – | – | – | 112.022 | 112.022 |
| Terminkontrakte (Forwards) | 256.515 | – | – | – | 256.515 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 256.515 | 4.300 | – | 112.022 | 372.837 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Margen auf Derivatkontrakte | 613.805 | – | – | – | 613.805 |
| Antizipative Passiva | 16.371 | – | – | – | 16.371 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 1.583.490 | – | – | – | 1.583.490 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 40.498.739 | – | – | – | 40.498.739 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 42.968.920 | 4.300 | – | 112.022 | 43.085.242 |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

| Fonds | Weniger als 1 Monat | 1-3 Monate | 3 Monate bis 1 Jahr | Über 1 Jahr | Gesamt 31. Dezember 2020 |
|--|------------------------|--------------------|------------------------|------------------|-----------------------------|
| | USD | USD | USD | USD | USD |
| BNY Mellon Global Bond Fund | | | | | |
| Terminkontrakte (Futures) | – | 13.115 | – | – | 13.115 |
| Terminkontrakte (Forwards) | 1.981.583 | 136.873.733 | – | – | 138.855.316 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 1.981.583 | 136.886.848 | – | – | 138.868.431 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Banküberziehung | 1.196.446 | – | – | – | 1.196.446 |
| Antizipative Passiva | 487.494 | – | – | – | 487.494 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 708.359 | – | – | – | 708.359 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 614.883.298 | – | – | – | 614.883.298 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 619.257.180 | 136.886.848 | – | – | 756.144.028 |
| BNY Mellon Global Credit Fund | | | | | |
| Terminkontrakte (Futures) | – | 552.754 | – | – | 552.754 |
| Optionen | 413.524 | 199.928 | – | – | 613.452 |
| Swaps | – | – | 16.829 | 6.823.006 | 6.839.835 |
| Terminkontrakte (Forwards) | 339.593.017 | – | – | – | 339.593.017 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 340.006.541 | 752.682 | 16.829 | 6.823.006 | 347.599.058 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Banküberziehung | 793.393 | – | – | – | 793.393 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 6.872.987 | – | – | – | 6.872.987 |
| Antizipative Passiva | 151.664 | – | – | – | 151.664 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 996.288 | – | – | – | 996.288 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 803.381.804 | – | – | – | 803.381.804 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 1.152.202.677 | 752.682 | 16.829 | 6.823.006 | 1.159.795.194 |
| BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund | | | | | |
| Terminkontrakte (Futures) | – | 10.800 | – | – | 10.800 |
| Terminkontrakte (Forwards) | 1.293.650 | 292.018.146 | – | – | 293.311.796 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 1.293.650 | 292.028.946 | – | – | 293.322.596 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Banküberziehung | 1.645.000 | – | – | – | 1.645.000 |
| Antizipative Passiva | 390.371 | – | – | – | 390.371 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 270.538 | – | – | – | 270.538 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 498.134.113 | – | – | – | 498.134.113 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 501.733.672 | 292.028.946 | – | – | 793.762.618 |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

| Fonds | Weniger als 1 Monat | 1-3 Monate | 3 Monate bis 1 Jahr | Über 1 Jahr 31. Dezember 2020 | Gesamt |
|--|------------------------|-------------------|------------------------|----------------------------------|--------------------|
| BNY Mellon Global Emerging Markets Fund | | | | | |
| | USD | USD | USD | USD | USD |
| Terminkontrakte (Forwards) | 440.318 | – | – | – | 440.318 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 440.318 | – | – | – | 440.318 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Antizipative Passiva | 81.286 | – | – | – | 81.286 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 678.534 | – | – | – | 678.534 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 54.195.828 | – | – | – | 54.195.828 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 55.395.966 | – | – | – | 55.395.966 |
| BNY Mellon Global Equity Fund | | | | | |
| | USD | USD | USD | USD | USD |
| Terminkontrakte (Forwards) | 502.280 | 12.137.707 | – | – | 12.639.987 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 502.280 | 12.137.707 | – | – | 12.639.987 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Banküberziehung | 1.676.710 | – | – | – | 1.676.710 |
| Antizipative Passiva | 468.260 | – | – | – | 468.260 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 467.019 | – | – | – | 467.019 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 439.208.591 | – | – | – | 439.208.591 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 442.322.860 | 12.137.707 | – | – | 454.460.567 |
| BNY Mellon Global Equity Income Fund | | | | | |
| | USD | USD | USD | USD | USD |
| Terminkontrakte (Forwards) | 2.560.093 | – | – | – | 2.560.093 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 2.560.093 | – | – | – | 2.560.093 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Banküberziehung | 596.791 | – | – | – | 596.791 |
| Antizipative Passiva | 1.033.511 | – | – | – | 1.033.511 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 1.513.161 | – | – | – | 1.513.161 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 769.230.682 | – | – | – | 769.230.682 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 774.934.238 | – | – | – | 774.934.238 |
| BNY Mellon Global High Yield Bond Fund | | | | | |
| | USD | USD | USD | USD | USD |
| Terminkontrakte (Forwards) | 34.539.571 | – | – | – | 34.539.571 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 34.539.571 | – | – | – | 34.539.571 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Antizipative Passiva | 130.794 | – | – | – | 130.794 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 2.121.223 | – | – | – | 2.121.223 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 153.424.293 | – | – | – | 153.424.293 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 190.215.881 | – | – | – | 190.215.881 |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

| Fonds | Weniger als 1 Monat | 1-3 Monate | 3 Monate bis 1 Jahr | Über 1 Jahr 31. Dezember 2020 | Gesamt |
|--|------------------------|------------|------------------------|----------------------------------|--------------------|
| BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund | | | | | |
| | USD | USD | USD | USD | USD |
| Terminkontrakte (Forwards) | 3.888.311 | – | – | – | 3.888.311 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 3.888.311 | – | – | – | 3.888.311 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Antizipative Passiva | 119.973 | – | – | – | 119.973 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 292.353 | – | – | – | 292.353 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 146.439.027 | – | – | – | 146.439.027 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 150.739.664 | – | – | – | 150.739.664 |
| BNY Mellon Global Leaders Fund | | | | | |
| | USD | USD | USD | USD | USD |
| Terminkontrakte (Forwards) | 1.025.763 | – | – | – | 1.025.763 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 1.025.763 | – | – | – | 1.025.763 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Antizipative Passiva | 40.412 | – | – | – | 40.412 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 992.252 | – | – | – | 992.252 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 39.090.903 | – | – | – | 39.090.903 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 41.149.330 | – | – | – | 41.149.330 |
| BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund | | | | | |
| | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR |
| Terminkontrakte (Forwards) | 6.143.521 | – | – | – | 6.143.521 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 6.143.521 | – | – | – | 6.143.521 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Antizipative Passiva | 27.545 | – | – | – | 27.545 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 20.744.725 | – | – | – | 20.744.725 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 26.915.791 | – | – | – | 26.915.791 |
| BNY Mellon Global Opportunities Fund | | | | | |
| | USD | USD | USD | USD | USD |
| Terminkontrakte (Forwards) | 64.976 | – | – | – | 64.976 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 64.976 | – | – | – | 64.976 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Banküberziehung | 9.156 | – | – | – | 9.156 |
| Antizipative Passiva | 97.305 | – | – | – | 97.305 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 502.909 | – | – | – | 502.909 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 35.977.689 | – | – | – | 35.977.689 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 36.652.035 | – | – | – | 36.652.035 |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

| Fonds | Weniger als 1 Monat | 1-3 Monate | 3 Monate bis 1 Jahr | Über 1 Jahr | Gesamt 31. Dezember 2020 |
|--|------------------------|--------------------|------------------------|----------------|-----------------------------|
| BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) | | | | | |
| | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR |
| Optionen | 690.536 | 4.559.620 | 3.063.332 | – | 8.313.488 |
| Terminkontrakte (Forwards) | 315.648.661 | 504.682.316 | – | – | 820.330.977 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 316.339.197 | 509.241.936 | 3.063.332 | – | 828.644.465 |

Verbindlichkeiten

| | | | | | |
|--|----------------------|--------------------|------------------|----------|----------------------|
| Banküberziehung | 1.203.141 | – | – | – | 1.203.141 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 2.809.531 | – | – | – | 2.809.531 |
| Antizipative Passiva | 2.610.143 | – | – | – | 2.610.143 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 89.600.822 | – | – | – | 89.600.822 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 2.926.880.946 | – | – | – | 2.926.880.946 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 3.339.443.780 | 509.241.936 | 3.063.332 | – | 3.851.749.048 |

BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)

| | GBP | GBP | GBP | GBP | GBP |
|--|------------------|------------------|---------------|----------|-------------------|
| Optionen | 16.068 | 94.497 | 74.944 | – | 185.509 |
| Terminkontrakte (Forwards) | 3.686.696 | 8.876.305 | – | – | 12.563.001 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 3.702.764 | 8.970.802 | 74.944 | – | 12.748.510 |

Verbindlichkeiten

| | | | | | |
|--|-------------------|------------------|---------------|----------|-------------------|
| Banküberziehung | 898 | – | – | – | 898 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 65.415 | – | – | – | 65.415 |
| Antizipative Passiva | 74.899 | – | – | – | 74.899 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 1.082.690 | – | – | – | 1.082.690 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 62.762.505 | – | – | – | 62.762.505 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 67.689.171 | 8.970.802 | 74.944 | – | 76.734.917 |

BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)

| | USD | USD | USD | USD | USD |
|--|-------------------|-------------------|----------------|----------|--------------------|
| Optionen | 71.810 | 463.595 | 356.227 | – | 891.632 |
| Terminkontrakte (Forwards) | 94.044.676 | 30.434.192 | – | – | 124.478.868 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 94.116.486 | 30.897.787 | 356.227 | – | 125.370.500 |

Verbindlichkeiten

| | | | | | |
|--|--------------------|-------------------|----------------|----------|--------------------|
| Banküberziehung | 11 | – | – | – | 11 |
| Margen auf Derivatkontrakte | 271.606 | – | – | – | 271.606 |
| Antizipative Passiva | 292.462 | – | – | – | 292.462 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 64.658 | – | – | – | 64.658 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 300.822.877 | – | – | – | 300.822.877 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 395.568.100 | 30.897.787 | 356.227 | – | 426.822.114 |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

| Fonds | Weniger als 1 Monat | 1-3 Monate | 3 Monate bis 1 Jahr | Über 1 Jahr | Gesamt 31. Dezember 2020 |
|--|------------------------|--------------------|------------------------|----------------|-----------------------------|
| BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund | | | | | |
| | USD | USD | USD | USD | USD |
| Swaps | – | – | – | 46.988 | 46.988 |
| Terminkontrakte (Forwards) | 90.151.334 | 301.617.883 | – | – | 391.769.217 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 90.151.334 | 301.617.883 | – | 46.988 | 391.816.205 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Margen auf Derivatkontrakte | 327.110 | – | – | – | 327.110 |
| Antizipative Passiva | 390.383 | – | – | – | 390.383 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 1.887.406 | – | – | – | 1.887.406 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 701.716.479 | – | – | – | 701.716.479 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 794.472.712 | 301.617.883 | – | 46.988 | 1.096.137.583 |
| BNY Mellon Global Unconstrained Fund | | | | | |
| | USD | USD | USD | USD | USD |
| Terminkontrakte (Forwards) | 1.353.136 | 1.765.425 | – | – | 3.118.561 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 1.353.136 | 1.765.425 | – | – | 3.118.561 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Antizipative Passiva | 13.427 | – | – | – | 13.427 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 29.990.159 | – | – | – | 29.990.159 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 31.356.722 | 1.765.425 | – | – | 33.122.147 |
| BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund | | | | | |
| | JPY | JPY | JPY | JPY | JPY |
| Terminkontrakte (Forwards) | 4.436.363.139 | – | – | – | 4.436.363.139 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 4.436.363.139 | – | – | – | 4.436.363.139 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Antizipative Passiva | 13.573.776 | – | – | – | 13.573.776 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 1.664.661 | – | – | – | 1.664.661 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 15.317.409.324 | – | – | – | 15.317.409.324 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 19.769.010.900 | – | – | – | 19.769.010.900 |
| BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund | | | | | |
| | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR |
| Terminkontrakte (Forwards) | 5.086.757 | – | – | – | 5.086.757 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 5.086.757 | – | – | – | 5.086.757 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Antizipative Passiva | 1.791.169 | – | – | – | 1.791.169 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 2.227.276 | – | – | – | 2.227.276 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 1.571.112.825 | – | – | – | 1.571.112.825 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 1.580.218.027 | – | – | – | 1.580.218.027 |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

| Fonds | Weniger als 1 Monat | 1-3 Monate | 3 Monate bis 1 Jahr | Über 1 Jahr 31. Dezember 2020 | Gesamt |
|--|------------------------|------------|------------------------|----------------------------------|--------------------|
| BNY Mellon Mobility Innovation Fund | | | | | |
| | USD | USD | USD | USD | USD |
| Terminkontrakte (Forwards) | 14.824.184 | – | – | – | 14.824.184 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 14.824.184 | – | – | – | 14.824.184 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Antizipative Passiva | 446.284 | – | – | – | 446.284 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 1.589.355 | – | – | – | 1.589.355 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 474.197.314 | – | – | – | 474.197.314 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 491.057.137 | – | – | – | 491.057.137 |
| BNY Mellon S&P 500® Index Tracker | | | | | |
| | USD | USD | USD | USD | USD |
| Terminkontrakte (Forwards) | 109.951 | – | – | – | 109.951 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 109.951 | – | – | – | 109.951 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Margen auf Derivatkontrakte | 6.995 | – | – | – | 6.995 |
| Antizipative Passiva | 70.463 | – | – | – | 70.463 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 616.867 | – | – | – | 616.867 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 36.865.576 | – | – | – | 36.865.576 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 37.669.852 | – | – | – | 37.669.852 |
| BNY Mellon Small Cap Euroland Fund | | | | | |
| | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Antizipative Passiva | 93.498 | – | – | – | 93.498 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 40.529 | – | – | – | 40.529 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 60.661.744 | – | – | – | 60.661.744 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 60.795.771 | – | – | – | 60.795.771 |
| BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund | | | | | |
| | USD | USD | USD | USD | USD |
| Terminkontrakte (Forwards) | 20.319 | – | – | – | 20.319 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 20.319 | – | – | – | 20.319 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Antizipative Passiva | 3.013 | – | – | – | 3.013 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 5.003.928 | – | – | – | 5.003.928 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 5.027.260 | – | – | – | 5.027.260 |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

| Fonds | Weniger als 1 Monat | 1-3 Monate | 3 Monate bis 1 Jahr | Über 1 Jahr | Gesamt 31. Dezember 2020 |
|--|------------------------|--------------------|------------------------|----------------|-----------------------------|
| BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund | | | | | |
| | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR |
| Terminkontrakte (Futures) | – | 5.487 | – | – | 5.487 |
| Terminkontrakte (Forwards) | 43.265.547 | 112.734.091 | – | – | 155.999.638 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 43.265.547 | 112.739.578 | – | – | 156.005.125 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Antizipative Passiva | 126.705 | – | – | – | 126.705 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 4.259.495 | – | – | – | 4.259.495 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 271.321.884 | – | – | – | 271.321.884 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 318.973.631 | 112.739.578 | – | – | 431.713.209 |
| BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR) | | | | | |
| | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR |
| Optionen | 7.708 | 51.830 | 31.610 | – | 91.148 |
| Terminkontrakte (Forwards) | 6.575.246 | 5.045.641 | – | – | 11.620.887 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 6.582.954 | 5.097.471 | 31.610 | – | 11.712.035 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Antizipative Passiva | 49.992 | – | – | – | 49.992 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 5.360 | – | – | – | 5.360 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 34.247.376 | – | – | – | 34.247.376 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 40.885.682 | 5.097.471 | 31.610 | – | 46.014.763 |
| BNY Mellon Targeted Return Bond Fund | | | | | |
| | USD | USD | USD | USD | USD |
| Terminkontrakte (Futures) | – | 48.837 | – | – | 48.837 |
| Terminkontrakte (Forwards) | 32.955.716 | 1.558.117 | – | – | 34.513.833 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 32.955.716 | 1.606.954 | – | – | 34.562.670 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Margen auf Derivatkontrakte | 102.845 | – | – | – | 102.845 |
| Antizipative Passiva | 95.645 | – | – | – | 95.645 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 1.740.943 | – | – | – | 1.740.943 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 92.952.258 | – | – | – | 92.952.258 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 127.847.407 | 1.606.954 | – | – | 129.454.361 |
| BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund | | | | | |
| | USD | USD | USD | USD | USD |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Antizipative Passiva | 21.570 | – | – | – | 21.570 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 3.704.307 | – | – | – | 3.704.307 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 3.725.877 | – | – | – | 3.725.877 |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

| Fonds | Weniger als 1 Monat | 1-3 Monate | 3 Monate bis 1 Jahr | Über 1 Jahr | Gesamt 31. Dezember 2020 |
|--|------------------------|------------|------------------------|----------------|-----------------------------|
| | USD | USD | USD | USD | USD |
| BNY Mellon U.S. Equity Income Fund | | | | | |
| Terminkontrakte (Forwards) | 389.410 | – | – | – | 389.410 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 389.410 | – | – | – | 389.410 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Antizipative Passiva | 198.430 | – | – | – | 198.430 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 463.554 | – | – | – | 463.554 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 230.267.279 | – | – | – | 230.267.279 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 231.318.673 | – | – | – | 231.318.673 |
| BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund | | | | | |
| Terminkontrakte (Forwards) | 15.971.563 | – | – | – | 15.971.563 |
| Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Verbindlichkeiten | 15.971.563 | – | – | – | 15.971.563 |
| Verbindlichkeiten | | | | | |
| Antizipative Passiva | 384.049 | – | – | – | 384.049 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | 10.026.892 | – | – | – | 10.026.892 |
| Einlösbare, partizipierende Anteile | 613.916.282 | – | – | – | 613.916.282 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt | 640.298.786 | – | – | – | 640.298.786 |

Einlösbare Anteile werden nach Wahl der Inhaber auf Verlangen zurückgenommen. Der Verwaltungsrat beabsichtigt jedoch nicht, dass die vertragliche Fälligkeit für die tatsächlichen Mittelabflüsse repräsentativ ist, da Inhaber dieser Instrumente üblicherweise einen mittleren bis langfristigen Anlagehorizont aufweisen.

Um die Gesamtliquidität der Gesellschaft zu steuern und einen ordnungsgemäßen Verkauf von Wertpapieren zu ermöglichen, darf der Verwaltungsrat gemäß den Bestimmungen des Prospekts den Rückkauf von Anteilen verweigern, die an einem Bewertungstag ein Zehntel der im Umlauf befindlichen Anteile eines Fonds übersteigen.

Nachfolgend ist die Anzahl der Anleger angegeben, die gemessen am Handelswert zum Ende des Geschäftsjahres mehr als 10 % des Nettovermögens des Fonds hielten:

| Fonds | 31. Dezember 2021 | 31. Dezember 2020 |
|--|-------------------|-------------------|
| BNY Mellon Absolute Return Bond Fund | 3 | 3 |
| BNY Mellon Absolute Return Equity Fund | 1 | 3 |
| BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund | 4 | 2 |
| BNY Mellon Asian Equity Fund | 2 | 1 |
| BNY Mellon Asian Income Fund | 2 | 1 |
| BNY Mellon Blockchain Innovation Fund | 1 | 2 |
| BNY Mellon Brazil Equity Fund | 2 | 1 |
| BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund* | 1 | k. A. |
| BNY Mellon Dynamic Total Return Fund* | k. A. | 1 |
| BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund | 4 | 4 |
| BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund | 4 | 1 |
| BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund | 1 | 1 |
| BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund | 2 | 2 |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

| Fonds | 31. Dezember 2021 | 31. Dezember 2020 |
|--|-------------------|-------------------|
| BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund | 3 | 2 |
| BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund | 3 | 2 |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund | 2 | 2 |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund | 1 | 2 |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund | 2 | 1 |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund | 2 | 2 |
| BNY Mellon Euroland Bond Fund | 1 | 1 |
| BNY Mellon European Credit Fund | 2 | 2 |
| BNY Mellon Future Earth Fund* | 1 | k. A. |
| BNY Mellon Future Food Fund* | 2 | k. A. |
| BNY Mellon Future Life Fund* | 1 | k. A. |
| BNY Mellon Global Bond Fund | 3 | 2 |
| BNY Mellon Global Credit Fund | 2 | 3 |
| BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund | 2 | 2 |
| BNY Mellon Global Emerging Markets Fund | 4 | 2 |
| BNY Mellon Global Equity Fund | 1 | 1 |
| BNY Mellon Global Equity Income Fund | - | 2 |
| BNY Mellon Global High Yield Bond Fund | 3 | 3 |
| BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund | 3 | 3 |
| BNY Mellon Global Leaders Fund | 4 | 3 |
| BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund* | k. A. | 2 |
| BNY Mellon Global Opportunities Fund | 1 | 1 |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) | 3 | 3 |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP) | 2 | 1 |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (USD) | 3 | 1 |
| BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund | 2 | 2 |
| BNY Mellon Global Unconstrained Fund | 1 | 1 |
| BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund | 3 | 3 |
| BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund | - | 1 |
| BNY Mellon Mobility Innovation Fund | 1 | 1 |
| BNY Mellon S&P 500® Index Tracker* | k. A. | 2 |
| BNY Mellon Small Cap Euroland Fund | 3 | 2 |
| BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund | 1 | 1 |
| BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund | 3 | 4 |
| BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR) | 5 | 1 |
| BNY Mellon Targeted Return Bond Fund | 1 | 1 |
| BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund* | k. A. | 1 |
| BNY Mellon U.S. Equity Income Fund | 5 | 3 |
| BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund | 2 | 3 |
| Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund* | 1 | k. A. |

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

ANZAHL DER ANTEILSINHABER

Die Gesellschaft hatte am Ende des aktuellen Geschäftsjahres und des vorherigen Geschäftsjahres mindestens zehn Inhaber von einlösbaren, partizipierenden Anteilen.

MANAGEMENT DES KAPITALRISIKOS

Das Kapital der Fonds wird durch das Nettovermögen am Ende des Geschäftsjahres dargestellt. Die Höhe des Nettovermögens kann täglich erheblich schwanken, da die Fonds täglichen Zeichnungen und Rücknahmen im Ermessen der Anteilshaber unterliegen. Das Ziel der Fonds bei der Kapitalverwaltung besteht darin, seine Fähigkeit zur Unternehmensfortführung zu bewahren, um Erträge für die Anteilshaber und Vorteile für sonstige Interessengruppen zu liefern und eine solide Kapitalbasis zu erhalten und so die Entwicklung der Anlagetätigkeit der Fonds zu unterstützen.

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

MANAGEMENT DES KAPITALRISIKOS Forts.

Im Rahmen ihrer Politik führt die Gesellschaft unter anderem folgende Maßnahmen durch, um die Kapitalstruktur zu erhalten oder anzupassen:

- Die Gesellschaft überwacht die Menge der täglichen Zeichnungen und Rücknahmen in Bezug auf die voraussichtlich liquidierbaren Anlagen und passt die Höhe der an die Inhaber einlösbarer, partizipierender Anteile zu zahlenden Ausschüttungen entsprechend an.
- Einlösbare, partizipierende Anteile werden in Übereinstimmung mit dem Prospekt und den Nachträgen für die Fonds ausgegeben und zurückgenommen; dies beinhaltet die Fähigkeit, Rücknahmen zu beschränken und das Erfordernis gewisser Mindestbestände und Mindestzeichnungen.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS

Die Gesellschaft hat die Bewertungen zum beizulegenden Zeitwert anhand einer Zeitwerthierarchie (Fair-Value-Hierarchie) eingestuft, die die Bedeutung der Inputfaktoren für die Bewertungen widerspiegelt: Die Hierarchie für den beizulegenden Zeitwert hat folgende Stufen:

Stufe 1: Kursnotierungen (nicht angepasst) auf aktiven Märkten für identische Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten.

Stufe 2: Andere Inputfaktoren als die Kursnotierungen der Stufe 1, die für einen Vermögenswert oder eine Verbindlichkeit entweder direkt (das heißt als Kurse) oder indirekt (das heißt abgeleitet von Kursen) beobachtbar sind.

Stufe 3: Inputfaktoren zu Vermögenswerten oder Verbindlichkeiten, die nicht auf beobachtbaren Marktdaten basieren (das heißt nicht beobachtbare Inputfaktoren).

Zu den Instrumenten, deren Werte auf Kursnotierungen an aktiven Märkten basieren und die daher in die Stufe 1 eingestuft werden, gehören aktiv notierte Aktien, börsengehandelte Fonds (ETF) und Derivate, hoch liquide Staatsanleihen (der G7-Länder), Einlagenzertifikate und andere notierte Wertpapiere. Die Gesellschaft passt die Kursnotierungen für diese Instrumente nicht an.

Finanzinstrumente, die an Märkten gehandelt werden, die nicht als aktiv eingestuft werden, jedoch auf der Grundlage von Kursnotierungen, Händlernoteierungen oder alternativen Preisquellen bewertet werden, die durch beobachtbare Inputfaktoren untermauert werden, werden in Stufe 2 eingestuft. Dies beinhaltet Staatsanleihen mit Investment-Grade-Rating (Nicht-G7-Länder) und Unternehmensanleihen, OTC-Derivate, Organismen für gemeinsame Anlagen, Geldmarktinstrumente, Genussscheine und bestimmte börsennotierte Aktien. Da Anlagen der Stufe 2 Positionen beinhalten, die nicht an aktiven Märkten gehandelt werden und/oder Übertragungsbeschränkungen unterliegen, können die Bewertungen, die üblicherweise auf den verfügbaren Marktdaten basieren, angepasst werden, um die Illiquidität und/oder Nichtübertragbarkeit zu reflektieren.

Die in Stufe 3 eingestufteten Anlagen zeichnen sich durch umfangreiche nicht beobachtbare Inputfaktoren aus, da sie unregelmäßig gehandelt werden. Zu den Instrumenten der Stufe 3 zählen unter anderem Leveraged Loans und Unternehmensanleihen, die zum Anschaffungswert oder nach ihrem beizulegenden Zeitwert unter Verwendung der Notierung eines einzelnen Maklers bewertet werden. Nicht beobachtbare Inputfaktoren werden bei der Bewertung des beizulegenden Zeitwerts verwendet, sofern keine relevanten verfügbaren Inputfaktoren zur Verfügung stehen und dadurch Situationen entstehen, in denen es am Bewertungstag wenn überhaupt nur geringe Marktaktivitäten für den Vermögenswert oder die Verbindlichkeit gibt. Das Ziel der Bewertung zum beizulegenden Zeitwert ist jedoch immer dasselbe und besteht darin, aus der Sicht eines Marktteilnehmers, der den Vermögenswert hält oder die Verbindlichkeit schuldet, einen Verkaufspreis zu ermitteln. Daher müssen nicht erkennbare Inputfaktoren jene Annahmen widerspiegeln, die Marktteilnehmer bei der Preisermittlung für den Vermögenswert oder die Verbindlichkeit verwenden würden, einschließlich der Risikoannahmen. Die Sensitivität nicht beobachtbarer Inputfaktoren, die bei der Feststellung des beizulegenden Zeitwerts der Wertpapiere der Stufe 3 verwendet werden, ist nicht unmittelbar bestimmbar.

Die nachfolgende Tabelle enthält eine Analyse von Finanzinstrumenten, die zum beizulegenden Zeitwert zum 31. Dezember 2021 bewertet wurden:

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

| Fonds | Klassifizierung | Stufe 1 | Stufe 2 | Stufe 3 | Summe 31. Dezember 2021 |
|---|---|--------------------|---------------------|------------------|----------------------------|
| 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 |
| | Terminkontrakte (Futures) | 3.776.347 | – | – | 3.776.347 |
| | Zinsswaps | – | 896.802 | – | 896.802 |
| | Fremdfinanzierte Darlehen (Leveraged Loans) | – | 17.454.923 | 2.182.910 | 19.637.833 |
| | Optionen | – | 258.551 | – | 258.551 |
| | 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) |
| | Terminkontrakte (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 | – | 15.556.493 | – | 15.556.493 |
| | Commercial Paper | – | 41.977.848 | – | 41.977.848 |
| | Aktien | 11.322.670 | – | 23.683 | 11.346.353 |
| | Aktienindex-Swaps | – | 237.927 | – | 237.927 |
| | Aktien-Swaps | – | 5.566.346 | – | 5.566.346 |
| | Variabel verzinsliche Schuldtitel (FRN) | – | 13.632.347 | – | 13.632.347 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | 129.730 | – | 129.730 |
| | Finanzielle Vermögenswerte | 46.805.190 | 81.105.831 | 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) |
| | Terminkontrakte (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 | Summe 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 |
| | Terminkontrakte (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) |
| | Terminkontrakte (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 Equity 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 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 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 | Summe 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 |
| | Terminkontrakte (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) |
| | Terminkontrakte (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 |
| | Terminkontrakte (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 | Summe 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 |
| | Terminkontrakte (Futures) | 12.616 | – | – | 12.616 |
| | Finanzielle Vermögenswerte | 12.616 | 20.151.757 | – | 20.164.373 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | (53.875) | – | (53.875) |
| | Terminkontrakte (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 |
| | Terminkontrakte (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) |
| | Terminkontrakte (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 |
| | Terminkontrakte (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 |
|--------------------------------------|------------------|-----------------|----------|------------------|
| Terminkontrakte (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 |
| Terminkontrakte (Futures) | 27.476 | – | – | 27.476 |
| Finanzielle Vermögenswerte | 27.476 | 31.921.315 | – | 31.948.791 |
| Terminkontrakte (Forwards) | – | (5.140) | – | (5.140) |
| Terminkontrakte (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 |
| Terminkontrakte (Futures) | 3.494 | – | – | 3.494 |
| Finanzielle Vermögenswerte | 3.494 | 26.627.871 | – | 26.631.365 |
| Terminkontrakte (Forwards) | – | (81.789) | – | (81.789) |
| Terminkontrakte (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 |
| Terminkontrakte (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) |
| | Terminkontrakte (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) |
| | Terminkontrakte (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 |
| | Terminkontrakte (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) |
| | Terminkontrakte (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 | Summe 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 |
| | Terminkontrakte (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 |
| | Terminkontrakte (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) |
| | Terminkontrakte (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 | Summe 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 |
| | Terminkontrakte (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 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 | Summe 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 | Summe 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 |
| | Terminkontrakte (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) |
| | Terminkontrakte (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 |
| | Terminkontrakte (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) |
| | Terminkontrakte (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 |
| | Terminkontrakte (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 |
|--------------------------------------|--------------------|------------------|----------|--------------------|
| Terminkontrakte (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 | Summe 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 |
| | Terminkontrakte (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 | Summe 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 |
| | Terminkontrakte (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) |
| | Terminkontrakte (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 |
| | Terminkontrakte (Futures) | 470.392 | – | – | 470.392 |
| | Finanzielle Vermögenswerte | 28.370.263 | 64.619.698 | 349.685 | 93.339.646 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | (162.053) | – | (162.053) |
| | Terminkontrakte (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 | Summe 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 |
| | Terminkontrakte (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) |
| | Terminkontrakte (Futures) | (206.623) | – | – | (206.623) |
| | Finanzielle Verbindlichkeiten | (206.623) | (1.900.023) | – | (2.106.646) |

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Die nachfolgende Tabelle enthält eine Analyse von Finanzinstrumenten, die zum beizulegenden Zeitwert zum 31. Dezember 2020 bewertet wurden:

| Fonds | Klassifizierung | Stufe 1 | Stufe 2 | Stufe 3 | Summe 31. Dezember 2020 |
|---|---|--------------------|---------------------|------------------|----------------------------|
| BNY Mellon Absolute Return Bond Fund | | | | | |
| | | EUR | EUR | EUR | EUR |
| | Anleihen | 156.451.130 | 186.823.950 | 596.439 | 343.871.519 |
| | Organismen für gemeinsame Anlagen | – | 7.123.756 | – | 7.123.756 |
| | Credit Default Swaps | – | 10.676.955 | – | 10.676.955 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | 7.499.543 | – | 7.499.543 |
| | Terminkontrakte (Futures) | 157.757 | – | – | 157.757 |
| | Fremdfinanzierte Darlehen (Leveraged Loans) | – | 7.672.590 | 7.122.782 | 14.795.372 |
| | Optionen | – | 2.606.523 | – | 2.606.523 |
| | Finanzielle Vermögenswerte | 156.608.887 | 222.403.317 | 7.719.221 | 386.731.425 |
| | Credit Default Swaps | – | (14.557.919) | – | (14.557.919) |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | (2.543.654) | – | (2.543.654) |
| | Terminkontrakte (Futures) | (767.997) | – | – | (767.997) |
| | Optionen | – | (616.120) | – | (616.120) |
| | Finanzielle Verbindlichkeiten | (767.997) | (17.717.693) | – | (18.485.690) |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

| Fonds | Klassifizierung | Stufe 1 | Stufe 2 | Stufe 3 | Summe 31. Dezember 2020 |
|---|---|--------------------|---------------------|------------|----------------------------|
| BNY Mellon Absolute Return Equity Fund | | | | | |
| | | GBP | GBP | GBP | GBP |
| | Anleihen | 7.004.160 | – | – | 7.004.160 |
| | Einlagenzertifikate | 77.503.966 | – | – | 77.503.966 |
| | Organismen für gemeinsame Anlagen | – | 27.768.062 | – | 27.768.062 |
| | Commercial Paper | – | 44.996.961 | – | 44.996.961 |
| | Aktien | 19.549.995 | – | – | 19.549.995 |
| | Aktienindex-Swaps | – | 246.297 | – | 246.297 |
| | Aktien-Swaps | – | 20.740.176 | – | 20.740.176 |
| | Variabel verzinsliche Schuldtitel (FRN) | – | 21.052.890 | – | 21.052.890 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | 61.505 | – | 61.505 |
| | Finanzielle Vermögenswerte | 104.058.121 | 114.865.891 | – | 218.924.012 |
| | Aktienindex-Swaps | – | (4.327.072) | – | (4.327.072) |
| | Aktien-Swaps | – | (8.523.887) | – | (8.523.887) |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | (749.434) | – | (749.434) |
| | Terminkontrakte (Futures) | (464.858) | – | – | (464.858) |
| | Finanzielle Verbindlichkeiten | (464.858) | (13.600.393) | – | (14.065.251) |
| BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund | | | | | |
| | | EUR | EUR | EUR | EUR |
| | Anleihen | 18.117.824 | 11.550.606 | – | 29.668.430 |
| | Organismen für gemeinsame Anlagen | – | 2.887.304 | – | 2.887.304 |
| | Aktien-Swaps | – | 283.172 | – | 283.172 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | 51.159 | – | 51.159 |
| | Total Return Swaps | – | 6.380.166 | – | 6.380.166 |
| | Finanzielle Vermögenswerte | 18.117.824 | 21.152.407 | – | 39.270.231 |
| | Aktien-Swaps | – | (5.763.799) | – | (5.763.799) |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | (26.326) | – | (26.326) |
| | Terminkontrakte (Futures) | (24.136) | – | – | (24.136) |
| | Total Return Swaps | – | (256.944) | – | (256.944) |
| | Finanzielle Verbindlichkeiten | (24.136) | (6.047.069) | – | (6.071.205) |
| BNY Mellon Asian Equity Fund | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD |
| | Aktien | 64.927.494 | – | – | 64.927.494 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | 840 | – | 840 |
| | Finanzielle Vermögenswerte | 64.927.494 | 840 | – | 64.928.334 |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

| Fonds | Klassifizierung | Stufe 1 | Stufe 2 | Stufe 3 | Summe 31. Dezember 2020 |
|--|--------------------------------------|-------------------|------------------|------------|----------------------------|
| BNY Mellon Asian Income Fund | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD |
| | Organismen für gemeinsame Anlagen | – | 1.073.141 | 660 | 1.073.801 |
| | Aktien | 28.851.743 | 4.815.027 | – | 33.666.770 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | 13 | – | 13 |
| | Finanzielle Vermögenswerte | 28.851.743 | 5.888.181 | 660 | 34.740.584 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | (84) | – | (84) |
| | Finanzielle Verbindlichkeiten | – | (84) | – | (84) |
| BNY Mellon Blockchain Innovation Fund | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD |
| | Organismen für gemeinsame Anlagen | – | 1.555.808 | – | 1.555.808 |
| | Aktien | 14.148.639 | – | – | 14.148.639 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | 7.116 | – | 7.116 |
| | Finanzielle Vermögenswerte | 14.148.639 | 1.562.924 | – | 15.711.563 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | (322) | – | (322) |
| | Finanzielle Verbindlichkeiten | – | (322) | – | (322) |
| BNY Mellon Brazil Equity Fund | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD |
| | Aktien | 61.212.522 | 7.866.941 | – | 69.079.463 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | 103.507 | – | 103.507 |
| | Finanzielle Vermögenswerte | 61.212.522 | 7.970.448 | – | 69.182.970 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | (4.186) | – | (4.186) |
| | Finanzielle Verbindlichkeiten | – | (4.186) | – | (4.186) |
| BNY Mellon Dynamic Total Return Fund | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD |
| | Anleihen | 11.642.085 | – | – | 11.642.085 |
| | Organismen für gemeinsame Anlagen | 1.580.485 | – | – | 1.580.485 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | 123.748 | – | 123.748 |
| | Terminkontrakte (Futures) | 128.581 | – | – | 128.581 |
| | Optionen | 1.670.550 | – | – | 1.670.550 |
| | Finanzielle Vermögenswerte | 15.021.701 | 123.748 | – | 15.145.449 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | (144.295) | – | (144.295) |
| | Terminkontrakte (Futures) | (123.086) | – | – | (123.086) |
| | Finanzielle Verbindlichkeiten | (123.086) | (144.295) | – | (267.381) |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

| Fonds | Klassifizierung | Stufe 1 | Stufe 2 | Stufe 3 | Summe 31. Dezember 2020 |
|---|--------------------------------------|--------------------|----------------------|----------|----------------------------|
| BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD |
| | Anleihen | 41.029.117 | – | – | 41.029.117 |
| | Aktien | 462.838.067 | – | – | 462.838.067 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | 225.847 | – | 225.847 |
| | Terminkontrakte (Futures) | 1.879.730 | – | – | 1.879.730 |
| | Optionen | 855.113 | – | – | 855.113 |
| | Finanzielle Vermögenswerte | 506.602.027 | 225.847 | – | 506.827.874 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | (8.127) | – | (8.127) |
| | Terminkontrakte (Futures) | (998.353) | – | – | (998.353) |
| | Finanzielle Verbindlichkeiten | (998.353) | (8.127) | – | (1.006.480) |
| BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD |
| | Anleihen | – | 25.266.762 | – | 25.266.762 |
| | Credit Default Swaps | – | 120.241 | – | 120.241 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | 24.869 | – | 24.869 |
| | Finanzielle Vermögenswerte | – | 25.411.872 | – | 25.411.872 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | (43.183) | – | (43.183) |
| | Finanzielle Verbindlichkeiten | – | (43.183) | – | (43.183) |
| BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD |
| | Anleihen | – | 42.122.602 | – | 42.122.602 |
| | Credit Default Swaps | – | 98.005 | – | 98.005 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | 992.308 | – | 992.308 |
| | Terminkontrakte (Futures) | 1.608 | – | – | 1.608 |
| | Finanzielle Vermögenswerte | 1.608 | 43.212.915 | – | 43.214.523 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | (345.060) | – | (345.060) |
| | Terminkontrakte (Futures) | (44.678) | – | – | (44.678) |
| | Finanzielle Verbindlichkeiten | (44.678) | (345.060) | – | (389.738) |
| BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD |
| | Anleihen | 1.534.873 | 1.169.873.274 | – | 1.171.408.147 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | 5.338.922 | – | 5.338.922 |
| | Terminkontrakte (Futures) | 499.680 | – | – | 499.680 |
| | Finanzielle Vermögenswerte | 2.034.553 | 1.175.212.196 | – | 1.177.246.749 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | (49.500) | – | (49.500) |
| | Terminkontrakte (Futures) | (396.547) | – | – | (396.547) |
| | Finanzielle Verbindlichkeiten | (396.547) | (49.500) | – | (446.047) |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

| Fonds | Klassifizierung | Stufe 1 | Stufe 2 | Stufe 3 | Summe 31. Dezember 2020 |
|---|--------------------------------------|-----------------|--------------------|----------|----------------------------|
| BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD |
| | Anleihen | - | 733.560.564 | - | 733.560.564 |
| | Credit Default Swaps | - | 1.986.419 | - | 1.986.419 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | - | 9.442.896 | - | 9.442.896 |
| | Finanzielle Vermögenswerte | - | 744.989.879 | - | 744.989.879 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | - | (333.500) | - | (333.500) |
| | Finanzielle Verbindlichkeiten | - | (333.500) | - | (333.500) |
| BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD |
| | Anleihen | - | 369.328.292 | - | 369.328.292 |
| | Organismen für gemeinsame Anlagen | - | 7.896.733 | - | 7.896.733 |
| | Credit Default Swaps | - | 389.305 | - | 389.305 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | - | 2.413.093 | - | 2.413.093 |
| | Finanzielle Vermögenswerte | - | 380.027.423 | - | 380.027.423 |
| | Credit Default Swaps | - | (228.094) | - | (228.094) |
| | Terminkontrakte (Forwards) | - | (1.598.114) | - | (1.598.114) |
| | Finanzielle Verbindlichkeiten | - | (1.826.208) | - | (1.826.208) |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD |
| | Anleihen | 189.998 | 37.598.632 | - | 37.788.630 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | - | 17.292 | - | 17.292 |
| | Terminkontrakte (Futures) | 4.093 | - | - | 4.093 |
| | Finanzielle Vermögenswerte | 194.091 | 37.615.924 | - | 37.810.015 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | - | (1.722) | - | (1.722) |
| | Terminkontrakte (Futures) | (31.711) | - | - | (31.711) |
| | Finanzielle Verbindlichkeiten | (31.711) | (1.722) | - | (33.433) |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD |
| | Anleihen | - | 163.813.838 | - | 163.813.838 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | - | 1.165.896 | - | 1.165.896 |
| | Finanzielle Vermögenswerte | - | 164.979.734 | - | 164.979.734 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | - | (939.928) | - | (939.928) |
| | Finanzielle Verbindlichkeiten | - | (939.928) | - | (939.928) |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

| Fonds | Klassifizierung | Stufe 1 | Stufe 2 | Stufe 3 | Summe 31. Dezember 2020 |
|--|--------------------------------------|--------------------|--------------------|----------|----------------------------|
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD |
| | Anleihen | 20.000 | 27.720.940 | – | 27.740.940 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | 69.009 | – | 69.009 |
| | Finanzielle Vermögenswerte | 20.000 | 27.789.949 | – | 27.809.949 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | (89.046) | – | (89.046) |
| | Terminkontrakte (Futures) | (550) | – | – | (550) |
| | Finanzielle Verbindlichkeiten | (550) | (89.046) | – | (89.596) |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD |
| | Anleihen | – | 153.926.945 | – | 153.926.945 |
| | Organismen für gemeinsame Anlagen | – | 5.770.066 | – | 5.770.066 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | 3.960.505 | – | 3.960.505 |
| | Terminkontrakte (Futures) | 39.729 | – | – | 39.729 |
| | Optionen | – | 39.075 | – | 39.075 |
| | Finanzielle Vermögenswerte | 39.729 | 163.696.591 | – | 163.736.320 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | (2.854.632) | – | (2.854.632) |
| | Optionen | – | (3.138) | – | (3.138) |
| | Finanzielle Verbindlichkeiten | – | (2.857.770) | – | (2.857.770) |
| BNY Mellon Euroland Bond Fund | | | | | |
| | | EUR | EUR | EUR | EUR |
| | Anleihen | 162.462.925 | 250.345.625 | – | 412.808.550 |
| | Organismen für gemeinsame Anlagen | – | 15.230.642 | – | 15.230.642 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | 596.945 | – | 596.945 |
| | Terminkontrakte (Futures) | 495.838 | – | – | 495.838 |
| | Zinsswaps | – | 2.479.379 | – | 2.479.379 |
| | Optionen | – | 168.163 | – | 168.163 |
| | Finanzielle Vermögenswerte | 162.958.763 | 268.820.754 | – | 431.779.517 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | (633.155) | – | (633.155) |
| | Terminkontrakte (Futures) | (153.163) | – | – | (153.163) |
| | Finanzielle Verbindlichkeiten | (153.163) | (633.155) | – | (786.318) |
| BNY Mellon European Credit Fund | | | | | |
| | | EUR | EUR | EUR | EUR |
| | Anleihen | – | 38.240.902 | – | 38.240.902 |
| | Organismen für gemeinsame Anlagen | – | 2.007.896 | – | 2.007.896 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | 87.379 | – | 87.379 |
| | Terminkontrakte (Futures) | 4.113 | – | – | 4.113 |
| | Finanzielle Vermögenswerte | 4.113 | 40.336.177 | – | 40.340.290 |
| | Credit Default Swaps | – | (112.022) | – | (112.022) |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

| Fonds | Klassifizierung | Stufe 1 | Stufe 2 | Stufe 3 | Gesamt 31. Dezember 2020 |
|---|--------------------------------------|----------------|------------------|----------|-----------------------------|
| BNY Mellon European Credit Fund Forts. | | | | | |
| | | EUR | EUR | EUR | EUR |
| | Terminkontrakte (Forwards) | - | (8.081) | - | (8.081) |
| | Terminkontrakte (Futures) | (4.300) | - | - | (4.300) |
| | Finanzielle Verbindlichkeiten | (4.300) | (120.103) | - | (124.403) |

BNY Mellon Global Bond Fund

| | | | | |
|--------------------------------------|--------------------|--------------------|----------|--------------------|
| | USD | USD | USD | USD |
| Anleihen | 280.750.990 | 305.225.744 | - | 585.976.734 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | 16.427.021 | - | - | 16.427.021 |
| Terminkontrakte (Forwards) | - | 2.166.598 | - | 2.166.598 |
| Finanzielle Vermögenswerte | 297.178.011 | 307.392.342 | - | 604.570.353 |
| Terminkontrakte (Forwards) | - | (3.033.181) | - | (3.033.181) |
| Terminkontrakte (Futures) | (13.115) | - | - | (13.115) |
| Finanzielle Verbindlichkeiten | (13.115) | (3.033.181) | - | (3.046.296) |

BNY Mellon Global Credit Fund

| | | | | |
|--------------------------------------|--------------------|---------------------|------------------|---------------------|
| | USD | USD | USD | USD |
| Anleihen | 250.799.690 | 508.806.026 | 1.343.135 | 760.948.851 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | - | 14.546.122 | - | 14.546.122 |
| Credit Default Swaps | - | 10.996.179 | - | 10.996.179 |
| Terminkontrakte (Forwards) | - | 2.463.873 | - | 2.463.873 |
| Terminkontrakte (Futures) | 235.371 | - | - | 235.371 |
| Optionen | - | 1.921.321 | - | 1.921.321 |
| Finanzielle Vermögenswerte | 251.035.061 | 538.733.521 | 1.343.135 | 791.111.717 |
| Credit Default Swaps | - | (6.839.835) | - | (6.839.835) |
| Terminkontrakte (Forwards) | - | (2.936.892) | - | (2.936.892) |
| Terminkontrakte (Futures) | (552.754) | - | - | (552.754) |
| Optionen | - | (613.452) | - | (613.452) |
| Finanzielle Verbindlichkeiten | (552.754) | (10.390.179) | - | (10.942.933) |

BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund

| | | | | |
|--------------------------------------|--------------------|--------------------|----------|--------------------|
| | USD | USD | USD | USD |
| Anleihen | 104.949.828 | 349.868.273 | - | 454.818.101 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | 20.977.824 | 6.139.869 | - | 27.117.693 |
| Terminkontrakte (Forwards) | - | 3.068.650 | - | 3.068.650 |
| Optionen | 54.375 | - | - | 54.375 |
| Finanzielle Vermögenswerte | 125.982.027 | 359.076.792 | - | 485.058.819 |
| Terminkontrakte (Forwards) | - | (5.173.432) | - | (5.173.432) |
| Terminkontrakte (Futures) | (10.800) | - | - | (10.800) |
| Finanzielle Verbindlichkeiten | (10.800) | (5.173.432) | - | (5.184.232) |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

| Fonds | Klassifizierung | Stufe 1 | Stufe 2 | Stufe 3 | Summe 31. Dezember 2020 |
|---|---|--------------------|--------------------|--------------|----------------------------|
| BNY Mellon Global Emerging Markets Fund | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD |
| | Aktien | 53.256.127 | – | – | 53.256.127 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | 28.662 | – | 28.662 |
| | Finanzielle Vermögenswerte | 53.256.127 | 28.662 | – | 53.284.789 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | (2.162) | – | (2.162) |
| | Finanzielle Verbindlichkeiten | – | (2.162) | – | (2.162) |
| BNY Mellon Global Equity Fund | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD |
| | Aktien | 428.519.453 | 5.010.149 | – | 433.529.602 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | 398.999 | – | 398.999 |
| | Finanzielle Vermögenswerte | 428.519.453 | 5.409.148 | – | 433.928.601 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | (386.114) | – | (386.114) |
| | Finanzielle Verbindlichkeiten | – | (386.114) | – | (386.114) |
| BNY Mellon Global Equity Income Fund | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD |
| | Organismen für gemeinsame Anlagen | – | 8.364.982 | 5.902 | 8.370.884 |
| | Aktien | 712.068.552 | 36.913.952 | – | 748.982.504 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | 375.646 | – | 375.646 |
| | Optionsscheine | – | 139.320 | – | 139.320 |
| | Finanzielle Vermögenswerte | 712.068.552 | 45.793.900 | 5.902 | 757.868.354 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | (9.834) | – | (9.834) |
| | Finanzielle Verbindlichkeiten | – | (9.834) | – | (9.834) |
| BNY Mellon Global High Yield Bond Fund | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD |
| | Anleihen | – | 141.980.015 | – | 141.980.015 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | 550.506 | – | 550.506 |
| | Fremdfinanzierte Darlehen (Leveraged Loans) | – | 6.462.843 | – | 6.462.843 |
| | Finanzielle Vermögenswerte | – | 148.993.364 | – | 148.993.364 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | (122.171) | – | (122.171) |
| | Finanzielle Verbindlichkeiten | – | (122.171) | – | (122.171) |
| BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD |
| | Aktien | 140.333.863 | – | – | 140.333.863 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | 1.816.466 | – | 1.816.466 |
| | Finanzielle Vermögenswerte | 140.333.863 | 1.816.466 | – | 142.150.329 |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

| Fonds | Klassifizierung | Stufe 1 | Stufe 2 | Stufe 3 | Gesamt 31. Dezember 2020 |
|--|--------------------------------------|-------------------|------------------|----------|-----------------------------|
| BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund Forts. | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | (72.634) | – | (72.634) |
| | Finanzielle Verbindlichkeiten | – | (72.634) | – | (72.634) |
| BNY Mellon Global Leaders Fund | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD |
| | Aktien | 38.548.211 | – | – | 38.548.211 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | 18.265 | – | 18.265 |
| | Finanzielle Vermögenswerte | 38.548.211 | 18.265 | – | 38.566.476 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | (933) | – | (933) |
| | Finanzielle Verbindlichkeiten | – | (933) | – | (933) |
| BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund | | | | | |
| | | EUR | EUR | EUR | EUR |
| | Anleihen | 641.013 | 2.980.070 | – | 3.621.083 |
| | Organismen für gemeinsame Anlagen | – | 1.805.285 | – | 1.805.285 |
| | Aktien | 10.870.447 | 896.735 | – | 11.767.182 |
| | Kapitalbeteiligungsinstrumente | – | 3.031.214 | – | 3.031.214 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | 154.579 | – | 154.579 |
| | Finanzielle Vermögenswerte | 11.511.460 | 8.867.883 | – | 20.379.343 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | (126.199) | – | (126.199) |
| | Finanzielle Verbindlichkeiten | – | (126.199) | – | (126.199) |
| BNY Mellon Global Opportunities Fund | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD |
| | Aktien | 35.095.853 | 532.138 | – | 35.627.991 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | 7.872 | – | 7.872 |
| | Finanzielle Vermögenswerte | 35.095.853 | 540.010 | – | 35.635.863 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | (149) | – | (149) |
| | Finanzielle Verbindlichkeiten | – | (149) | – | (149) |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

| Fonds | Klassifizierung | Stufe 1 | Stufe 2 | Stufe 3 | Summe 31. Dezember 2020 |
|---|--------------------------------------|----------------------|---------------------|----------|----------------------------|
| BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) | | | | | |
| | | EUR | EUR | EUR | EUR |
| | Anleihen | – | 442.651.648 | – | 442.651.648 |
| | Organismen für gemeinsame Anlagen | 119.941.755 | 3.407.634 | – | 123.349.389 |
| | Aktien | 1.581.036.392 | 33.151.866 | – | 1.614.188.258 |
| | Kapitalbeteiligungsinstrumente | – | 184.163.676 | – | 184.163.676 |
| | Börsengehandelte Rohstoffe | 335.623.276 | – | – | 335.623.276 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | 65.016.516 | – | 65.016.516 |
| | Terminkontrakte (Futures) | 3.967.462 | – | – | 3.967.462 |
| | Optionen | 23.915.389 | – | – | 23.915.389 |
| | Optionsscheine | – | 88.559.036 | – | 88.559.036 |
| | Finanzielle Vermögenswerte | 2.064.484.274 | 816.950.376 | – | 2.881.434.650 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | (16.084.605) | – | (16.084.605) |
| | Optionen | (8.313.488) | – | – | (8.313.488) |
| | Finanzielle Verbindlichkeiten | (8.313.488) | (16.084.605) | – | (24.398.093) |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP) | | | | | |
| | | GBP | GBP | GBP | GBP |
| | Anleihen | – | 9.662.125 | – | 9.662.125 |
| | Organismen für gemeinsame Anlagen | 2.120.819 | 197.469 | – | 2.318.288 |
| | Aktien | 32.699.642 | 666.138 | – | 33.365.780 |
| | Kapitalbeteiligungsinstrumente | – | 4.178.909 | – | 4.178.909 |
| | Börsengehandelte Rohstoffe | 6.952.484 | – | – | 6.952.484 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | 1.814.858 | – | 1.814.858 |
| | Terminkontrakte (Futures) | 91.828 | – | – | 91.828 |
| | Optionen | 532.999 | – | – | 532.999 |
| | Optionsscheine | – | 2.057.163 | – | 2.057.163 |
| | Finanzielle Vermögenswerte | 42.397.772 | 18.576.662 | – | 60.974.434 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | (257.658) | – | (257.658) |
| | Optionen | (185.509) | – | – | (185.509) |
| | Finanzielle Verbindlichkeiten | (185.509) | (257.658) | – | (443.167) |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

| Fonds | Klassifizierung | Stufe 1 | Stufe 2 | Stufe 3 | Summe 31. Dezember 2020 |
|---|---|--------------------|---------------------|------------------|----------------------------|
| BNY Mellon Global Real Return Fund (USD) | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD |
| | Anleihen | – | 47.062.739 | – | 47.062.739 |
| | Organismen für gemeinsame Anlagen | 11.199.041 | – | – | 11.199.041 |
| | Aktien | 160.119.125 | 3.100.652 | – | 163.219.777 |
| | Kapitalbeteiligungsinstrumente | – | 22.807.540 | – | 22.807.540 |
| | Börsengehandelte Rohstoffe | 34.232.554 | – | – | 34.232.554 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | 660.975 | – | 660.975 |
| | Terminkontrakte (Futures) | 413.365 | – | – | 413.365 |
| | Optionen | 2.524.275 | – | – | 2.524.275 |
| | Optionsscheine | – | 9.224.705 | – | 9.224.705 |
| | Finanzielle Vermögenswerte | 208.488.360 | 82.856.611 | – | 291.344.971 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | (4.790.803) | – | (4.790.803) |
| | Optionen | (891.632) | – | – | (891.632) |
| | Finanzielle Verbindlichkeiten | (891.632) | (4.790.803) | – | (5.682.435) |
| BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD |
| | Anleihen | – | 613.547.504 | – | 613.547.504 |
| | Organismen für gemeinsame Anlagen | – | 37.621.950 | – | 37.621.950 |
| | Credit Default Swaps | – | 55.114 | – | 55.114 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | 5.863.263 | – | 5.863.263 |
| | Fremdfinanzierte Darlehen (Leveraged Loans) | – | 26.411.072 | 7.824.673 | 34.235.745 |
| | Finanzielle Vermögenswerte | – | 683.498.903 | 7.824.673 | 691.323.576 |
| | Credit Default Swaps | – | (46.988) | – | (46.988) |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | (11.621.219) | – | (11.621.219) |
| | Finanzielle Verbindlichkeiten | – | (11.668.207) | – | (11.668.207) |
| BNY Mellon Global Unconstrained Fund | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD |
| | Anleihen | 2.739.921 | 3.073.872 | – | 5.813.793 |
| | Organismen für gemeinsame Anlagen | 106.277 | 230.907 | – | 337.184 |
| | Aktien | 18.872.663 | 629.788 | – | 19.502.451 |
| | Kapitalbeteiligungsinstrumente | – | 1.202.567 | – | 1.202.567 |
| | Börsengehandelte Rohstoffe | 1.563.620 | – | – | 1.563.620 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | 129.353 | – | 129.353 |
| | Optionen | 60.184 | – | – | 60.184 |
| | Finanzielle Vermögenswerte | 23.342.665 | 5.266.487 | – | 28.609.152 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | (128.731) | – | (128.731) |
| | Finanzielle Verbindlichkeiten | – | (128.731) | – | (128.731) |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

| Fonds | Klassifizierung | Stufe 1 | Stufe 2 | Stufe 3 | Summe 31. Dezember 2020 |
|---|--------------------------------------|-----------------------|---------------------|----------|----------------------------|
| BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund | | | | | |
| | | JPY | JPY | JPY | JPY |
| | Aktien | 15.004.460.100 | – | – | 15.004.460.100 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | 7.683.437 | – | 7.683.437 |
| | Finanzielle Vermögenswerte | 15.004.460.100 | 7.683.437 | – | 15.012.143.537 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | (41.410.420) | – | (41.410.420) |
| | Finanzielle Verbindlichkeiten | – | (41.410.420) | – | (41.410.420) |
| BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund | | | | | |
| | | EUR | EUR | EUR | EUR |
| | Aktien | 1.535.299.266 | – | – | 1.535.299.266 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | 2.227 | – | 2.227 |
| | Finanzielle Vermögenswerte | 1.535.299.266 | 2.227 | – | 1.535.301.493 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | (42.170) | – | (42.170) |
| | Finanzielle Verbindlichkeiten | – | (42.170) | – | (42.170) |
| BNY Mellon Mobility Innovation Fund | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD |
| | Aktien | 467.649.573 | – | – | 467.649.573 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | 1.244.388 | – | 1.244.388 |
| | Finanzielle Vermögenswerte | 467.649.573 | 1.244.388 | – | 468.893.961 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | (55.097) | – | (55.097) |
| | Finanzielle Verbindlichkeiten | – | (55.097) | – | (55.097) |
| BNY Mellon S&P 500® Index Tracker | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD |
| | Anleihen | 35.997 | – | – | 35.997 |
| | Aktien | 36.533.926 | – | – | 36.533.926 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | 274 | – | 274 |
| | Terminkontrakte (Futures) | 9.446 | – | – | 9.446 |
| | Finanzielle Vermögenswerte | 36.579.369 | 274 | – | 36.579.643 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | (3) | – | (3) |
| | Finanzielle Verbindlichkeiten | – | (3) | – | (3) |
| BNY Mellon Small Cap Euroland Fund | | | | | |
| | | EUR | EUR | EUR | EUR |
| | Aktien | 58.239.794 | 1.932.986 | – | 60.172.780 |
| | Finanzielle Vermögenswerte | 58.239.794 | 1.932.986 | – | 60.172.780 |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

| Fonds | Klassifizierung | Stufe 1 | Stufe 2 | Stufe 3 | Summe 31. Dezember 2020 |
|---|--------------------------------------|-------------------|--------------------|------------------|----------------------------|
| BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD |
| | Aktien | 4.830.629 | 84.765 | – | 4.915.394 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | 6.080 | – | 6.080 |
| | Finanzielle Vermögenswerte | 4.830.629 | 90.845 | – | 4.921.474 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | (74) | – | (74) |
| | Finanzielle Verbindlichkeiten | – | (74) | – | (74) |
| BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund | | | | | |
| | | EUR | EUR | EUR | EUR |
| | Anleihen | 58.895.572 | 201.519.595 | – | 260.415.167 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | 4.971.038 | – | 4.971.038 |
| | Optionen | 28.720 | – | – | 28.720 |
| | Finanzielle Vermögenswerte | 58.924.292 | 206.490.633 | – | 265.414.925 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | (2.744.706) | – | (2.744.706) |
| | Terminkontrakte (Futures) | (5.487) | – | – | (5.487) |
| | Finanzielle Verbindlichkeiten | (5.487) | (2.744.706) | – | (2.750.193) |
| BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR) | | | | | |
| | | EUR | EUR | EUR | EUR |
| | Anleihen | – | 5.207.301 | – | 5.207.301 |
| | Organismen für gemeinsame Anlagen | – | 474.230 | – | 474.230 |
| | Aktien | 19.060.283 | – | – | 19.060.283 |
| | Kapitalbeteiligungsinstrumente | – | 2.639.505 | – | 2.639.505 |
| | Börsengehandelte Rohstoffe | 3.946.902 | – | – | 3.946.902 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | 678.689 | – | 678.689 |
| | Terminkontrakte (Futures) | 3.603 | – | – | 3.603 |
| | Optionen | 196.328 | – | – | 196.328 |
| | Optionsscheine | – | 1.031.439 | – | 1.031.439 |
| | Finanzielle Vermögenswerte | 23.207.116 | 10.031.164 | – | 33.238.280 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | (204.318) | – | (204.318) |
| | Optionen | (91.148) | – | – | (91.148) |
| | Finanzielle Verbindlichkeiten | (91.148) | (204.318) | – | (295.466) |
| BNY Mellon Targeted Return Bond Fund | | | | | |
| | | USD | USD | USD | USD |
| | Anleihen | 37.062.371 | 51.620.038 | 1.550.000 | 90.232.409 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | 1.763.033 | – | 1.763.033 |
| | Terminkontrakte (Futures) | 151.689 | – | – | 151.689 |
| | Finanzielle Vermögenswerte | 37.214.060 | 53.383.071 | 1.550.000 | 92.147.131 |
| | Terminkontrakte (Forwards) | – | (332.738) | – | (332.738) |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

| Fonds | Klassifizierung | Stufe 1 | Stufe 2 | Stufe 3 | Gesamt 31. Dezember 2020 |
|-------|-----------------|---------|---------|---------|-----------------------------|
|-------|-----------------|---------|---------|---------|-----------------------------|

BNY Mellon Targeted Return Bond Fund Forts.

| | USD | USD | USD | USD |
|--------------------------------------|-----------------|------------------|----------|------------------|
| Terminkontrakte (Futures) | (48.837) | – | – | (48.837) |
| Finanzielle Verbindlichkeiten | (48.837) | (332.738) | – | (381.575) |

BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund

| | USD | USD | USD | USD |
|-----------------------------------|------------------|----------|----------|------------------|
| Organismen für gemeinsame Anlagen | 37.326 | – | – | 37.326 |
| Aktien | 3.667.968 | – | – | 3.667.968 |
| Finanzielle Vermögenswerte | 3.705.294 | – | – | 3.705.294 |

BNY Mellon U.S. Equity Income Fund

| | USD | USD | USD | USD |
|--------------------------------------|--------------------|------------------|----------|--------------------|
| Aktien | 219.243.684 | – | – | 219.243.684 |
| Terminkontrakte (Forwards) | – | 36.670 | – | 36.670 |
| Vorzugsanleihen | – | 4.225.889 | – | 4.225.889 |
| Finanzielle Vermögenswerte | 219.243.684 | 4.262.559 | – | 223.506.243 |
| Terminkontrakte (Forwards) | – | (10.554) | – | (10.554) |
| Finanzielle Verbindlichkeiten | – | (10.554) | – | (10.554) |

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund

| | USD | USD | USD | USD |
|--------------------------------------|----------|--------------------|----------|--------------------|
| Anleihen | – | 588.446.936 | – | 588.446.936 |
| Terminkontrakte (Forwards) | – | 2.183.004 | – | 2.183.004 |
| Finanzielle Vermögenswerte | – | 590.629.940 | – | 590.629.940 |
| Terminkontrakte (Forwards) | – | (77.833) | – | (77.833) |
| Finanzielle Verbindlichkeiten | – | (77.833) | – | (77.833) |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Die nachfolgenden Tabellen zeigen die Veränderungen bei Stufe-3-Anlagen für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021:

BNY Mellon Absolute Return Bond Fund

| Einzelheiten | Anleihen | Fremd-finanzierte Darlehen (Leveraged Loans) | Summe |
|--|----------------|--|------------------|
| | EUR | EUR | 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 | Summe |
|--|-----------------------------------|---------------|
| | GBP | 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 |

BNY Mellon Asian Income Fund

| Einzelheiten | Organismen für gemeinsame Anlagen | Summe |
|--|-----------------------------------|----------|
| | 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 | Summe |
|--------------------------|----------|--------|
| | USD | USD |
| Anfangssaldo | – | – |
| Käufe | 17.371 | 17.371 |
| Verkäufe | – | – |
| Übertragungen in Stufe 3 | – | – |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund

| | Anleihen USD | Gesamt USD |
|--|-----------------|---------------|
| Einzelheiten | | |
| 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

| | Anleihen USD | Summe USD |
|--|-----------------|--------------|
| Einzelheiten | | |
| 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 | – | – |

BNY Mellon Global Equity Income Fund

| | Organismen für gemeinsame Anlagen USD | Summe USD |
|--|---|--------------|
| Einzelheiten | | |
| 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 | – | – |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

BNY Mellon Global High Yield Bond Fund

| Einzelheiten | Fremd- finanzierte Darlehen (Leveraged Loans) USD | Summe USD |
|--|--|------------------|
| Anfangssaldo | – | – |
| Käufe | 791.689 | 791.689 |
| Verkäufe | (7.011) | (7.011) |
| Übertragungen in Stufe 3 | 476.533 | 476.533 |
| Übertragungen aus Stufe 3 | – | – |
| Nettogewinne/(-verluste), die in sonstigen Nettoveränderungen im beizulegenden Zeitwert von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten ausgewiesen werden | | |
| Realisierte Gewinne | 10 | 10 |
| Nicht realisierte Gewinne | 27.258 | 27.258 |
| Schlussaldo | 1.288.479 | 1.288.479 |

BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund

| Einzelheiten | Fremd- finanzierte Darlehen (Leveraged Loans) USD | Summe USD |
|--|--|------------------|
| Anfangssaldo | 7.824.673 | 7.824.673 |
| Käufe | 3.382.940 | 3.382.940 |
| Verkäufe | (1.612.643) | (1.612.643) |
| Übertragungen in Stufe 3 | – | – |
| Übertragungen aus Stufe 3 | – | – |
| Nettogewinne/(-verluste), die in sonstigen Nettoveränderungen im beizulegenden Zeitwert von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten ausgewiesen werden | | |
| Realisierte Gewinne | 25.438 | 25.438 |
| Nicht realisierte Verluste | (691.308) | (691.308) |
| Schlussaldo | 8.929.100 | 8.929.100 |

BNY Mellon Targeted Return Bond Fund

| Einzelheiten | Anleihen USD | Summe USD |
|--|-----------------|----------------|
| Anfangssaldo | 1.550.000 | 1.550.000 |
| Käufe | 350.000 | 350.000 |
| Verkäufe | – | – |
| Übertragungen in Stufe 3 | – | – |
| Übertragungen aus Stufe 3 | (1.550.000) | (1.550.000) |
| Nettogewinne/(-verluste), die in sonstigen Nettoveränderungen im beizulegenden Zeitwert von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten ausgewiesen werden | | |
| Realisierte Gewinne | – | – |
| Nicht realisierte Verluste | (315) | (315) |
| Schlussaldo | 349.685 | 349.685 |

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund

| Einzelheiten | Anleihen USD | Summe USD |
|--|-----------------|--------------|
| Anfangssaldo | – | – |
| Käufe | – | – |
| Verkäufe | (3.000.000) | (3.000.000) |
| Übertragungen in Stufe 3 | 6.160.000 | 6.160.000 |
| Übertragungen aus Stufe 3 | – | – |
| Nettogewinne/(-verluste), die in sonstigen Nettoveränderungen im beizulegenden Zeitwert von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten ausgewiesen werden | | |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund

| Einzelheiten | Anleihen USD | Gesamt USD |
|---------------------------|------------------|------------------|
| Realisierte Gewinne | – | – |
| Nicht realisierte Gewinne | – | – |
| Schlussaldo | 3.160.000 | 3.160.000 |

Die nachfolgende Tabelle zeigt die Veränderungen bei Stufe-3-Anlagen für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2020:

BNY Mellon Absolute Return Bond Fund

| Einzelheiten | Anleihen EUR | Fremd- finanzierte Darlehen (Leveraged Loans) EUR | Summe EUR |
|--|-----------------|--|------------------|
| Anfangssaldo | 2.408.332 | 11.398.966 | 13.807.298 |
| Käufe | 568.941 | – | 568.941 |
| Verkäufe | (2.420.812) | (3.178.607) | (5.599.419) |
| Übertragungen in Stufe 3 | – | – | – |
| Übertragungen aus Stufe 3 | – | – | – |
| Nettogewinne/(-verluste), die in sonstigen Nettoveränderungen im beizulegenden Zeitwert von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten ausgewiesen werden | | | |
| Realisierte Gewinne/(Verluste) | 188.806 | (275.377) | (86.571) |
| Nicht realisierte Verluste | (148.828) | (822.200) | (971.028) |
| Schlussaldo | 596.439 | 7.122.782 | 7.719.221 |

BNY Mellon Asian Income Fund

| Einzelheiten | Organismen für gemeinsame Anlagen USD | Summe USD |
|--|---|--------------|
| Anfangssaldo | – | – |
| Käufe | – | – |
| Verkäufe | – | – |
| Übertragungen in Stufe 3 | – | – |
| Übertragungen aus Stufe 3 | – | – |
| Nettogewinne/(-verluste), die in sonstigen Nettoveränderungen im beizulegenden Zeitwert von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten ausgewiesen werden | | |
| Realisierte Gewinne | – | – |
| Nicht realisierte Gewinne | 660 | 660 |
| Schlussaldo | 660 | 660 |

BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund

| Einzelheiten | Anleihen USD | Summe USD |
|--|-----------------|--------------|
| Anfangssaldo | 11.034 | 11.034 |
| Käufe | – | – |
| Verkäufe | (2.078) | (2.078) |
| Übertragungen in Stufe 3 | – | – |
| Übertragungen aus Stufe 3 | – | – |
| Nettogewinne/(-verluste), die in sonstigen Nettoveränderungen im beizulegenden Zeitwert von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten ausgewiesen werden | | |
| Realisierte Verluste | (8.959) | (8.959) |
| Nicht realisierte Gewinne | 3 | 3 |
| Schlussaldo | – | – |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

BNY Mellon Global Credit Fund

| Einzelheiten | Anleihen USD | Summe USD |
|--|------------------|------------------|
| Anfangssaldo | 927.221 | 927.221 |
| Käufe | 1.224.691 | 1.224.691 |
| Verkäufe | – | – |
| Übertragungen in Stufe 3 | – | – |
| Übertragungen aus Stufe 3 | (927.221) | (927.221) |
| Nettogewinne/(-verluste), die in sonstigen Nettoveränderungen im beizulegenden Zeitwert von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten ausgewiesen werden | | |
| Realisierte Gewinne | – | – |
| Nicht realisierte Gewinne | 118.444 | 118.444 |
| Schlussaldo | 1.343.135 | 1.343.135 |

BNY Mellon Global Equity Income Fund

| Einzelheiten | Organismen für gemeinsame Anlagen USD | Summe USD |
|--|---|--------------|
| Anfangssaldo | – | – |
| Käufe | – | – |
| Verkäufe | – | – |
| Übertragungen in Stufe 3 | – | – |
| Übertragungen aus Stufe 3 | – | – |
| Nettogewinne/(-verluste), die in sonstigen Nettoveränderungen im beizulegenden Zeitwert von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten ausgewiesen werden | | |
| Realisierte Gewinne | – | – |
| Nicht realisierte Gewinne | 5.902 | 5.902 |
| Schlussaldo | 5.902 | 5.902 |

BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund

| Einzelheiten | Fremd- finanzierte Darlehen (Leveraged Loans) USD | Summe USD |
|--|--|------------------|
| Anfangssaldo | – | – |
| Käufe | – | – |
| Verkäufe | – | – |
| Übertragungen in Stufe 3 | 7.851.904 | 7.851.904 |
| Übertragungen aus Stufe 3 | – | – |
| Nettogewinne/(-verluste), die in sonstigen Nettoveränderungen im beizulegenden Zeitwert von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten ausgewiesen werden | | |
| Realisierte Gewinne | – | – |
| Nicht realisierte Verluste | (27.231) | (27.231) |
| Schlussaldo | 7.824.673 | 7.824.673 |

BNY Mellon Targeted Return Bond Fund

| Einzelheiten | Anleihen USD | Summe USD |
|--|-----------------|--------------|
| Anfangssaldo | – | – |
| Käufe | 1.550.000 | 1.550.000 |
| Verkäufe | – | – |
| Übertragungen in Stufe 3 | – | – |
| Übertragungen aus Stufe 3 | – | – |
| Nettogewinne/(-verluste), die in sonstigen Nettoveränderungen im beizulegenden Zeitwert von erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten ausgewiesen werden | | |

16. ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

SCHÄTZUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

BNY Mellon Targeted Return Bond Fund

| Einzelheiten | Anleihen USD | Gesamt USD |
|---------------------------|------------------|------------------|
| Realisierte Gewinne | - | - |
| Nicht realisierte Gewinne | - | - |
| Schlussaldo | 1.550.000 | 1.550.000 |

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 2021 oder 31. Dezember 2020.

18. GETRENNTE HAFTUNG

Die Gesellschaft macht von den Bestimmungen zur Haftungstrennung in Abschnitt 1405 (1) des Companies Act 2014 Gebrauch. Nach irischem Recht ist die Gesellschaft als Ganzes demnach generell nicht haftbar gegenüber Dritten, und generell besteht kein Potenzial für eine wechselseitige Haftung zwischen den Fonds.

19. WICHTIGE EREIGNISSE

Am 6. Januar 2021 wurden die Anteilhaber darüber informiert, dass die Global Exposure- and Leverage-Methode in Bezug auf den BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund, BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund, BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR), BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP), BNY Mellon Global Real Return Fund (USD), BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund und BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR) vom Commitment-Ansatz auf die „absolute VaR“-Methode umgestellt wird. Die Veränderung trat am 22. Januar 2021 in Kraft.

Der BNY Mellon Future Earth Fund, der BNY Mellon Future Food Fund und der BNY Mellon Future Life Fund wurden am 12. Januar 2021 aufgelegt.

Der BNY Mellon S&P 500® Index Tracker wurde am 15. Januar 2021 geschlossen.

Der BNY Mellon Dynamic Total Return Fund wurde am 26. Februar 2021 geschlossen.

Am 26. Februar 2021 wurde dem BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR) und dem BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund der Wortlaut der französischen Marktaufsichtsbehörde Autorité des Marchés Financiers hinzugefügt, um die Fonds in Frankreich als ESG-Fonds zu registrieren.

Der BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund wurde am 5. März 2021 geschlossen.

Am 5. März 2021 wurde ein zusätzlicher Wortlaut in den Prospekt aufgenommen, um den Anforderungen gemäß der Verordnung (EU) 2019/2088 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (SFDR) zu entsprechen.

Der BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund wurde am 18. März 2021 geschlossen.

Der Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund wurde am 27. März 2021 aufgelegt.

19. WICHTIGE EREIGNISSE Forts.

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

Am 27. Mai wurde ein zusätzlicher Wortlaut in den Prospekt aufgenommen, um den folgenden Fonds zu erlauben, über das Shanghai-Hong Kong Stock Connect-Programm in chinesische A-Aktien zu investieren, die an der Shanghai Stock Exchange notiert sind: BNY Mellon Blockchain Innovation Fund, BNY Mellon Global Emerging Markets Fund, BNY Mellon Global Equity Fund, BNY Mellon Global Equity Income Fund, BNY Mellon Global Opportunities Fund, BNY Mellon Global Real Return Fund (USD), BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR), BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP), BNY Mellon Global Unconstrained Fund, BNY Mellon Mobility Innovation Fund und BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR).

Am 17. Mai 2021 wurde ein zusätzlicher Wortlaut in den Prospekt aufgenommen, um den folgenden Fonds zu erlauben, in chinesische B-Aktien zu investieren: BNY Mellon Blockchain Innovation Fund, BNY Mellon Mobility Innovation Fund und BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund.

Am 17. Mai 2021 wurde ein zusätzlicher Wortlaut in den Prospekt aufgenommen, um den folgenden Fonds zu erlauben, direkt in Indien zu investieren: BNY Mellon Asian Income Fund, BNY Mellon Blockchain Innovation Fund, BNY Mellon Mobility Innovation Fund und BNY Mellon Smart Cures Innovation.

Am 29. Juli 2021 wurde Anlegern der von der Mellon Investments Corporation („Mellon“) verwalteten Teilfonds der Wechsel des Anlageverwalters mit Wirkung vom 1. September 2021 mitgeteilt. Der Anlageverwalter der von Mellon verwalteten Teilfonds wird:

| Name des Teilfonds | Neuer Anlageverwalter |
|--|---|
| BNY Mellon Efficient EM Debt Local Currency Beta Fund^ BNY Mellon Efficient Euro High Yield Beta Fund^ BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund BNY Mellon Targeted Return Bond Fund BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund | Insight North America LLC |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund BNY Mellon Euroland Bond Fund | Insight Investment Management (Global) Limited |
| BNY Mellon Blockchain Innovation Fund BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund BNY Mellon Mobility Innovation Fund BNY Mellon Small Cap Euroland Fund BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund BNY Mellon U.S. Equity Income Fund | Newton Investment Management North America LLC |

Der BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund wurde am 18. November 2021 aufgelegt.

Die Zulassung des BNY Mellon Global Opportunistic Bond Fund, BNY Mellon Japan All Cap Equity Fund, BNY Mellon Japan REIT Alpha Fund, BNY Mellon US Opportunities Fund und BNY Mellon U.S. Opportunistic Alpha Fund wurde am 8. Dezember 2021 von der Zentralbank widerrufen.

Coronavirus („COVID-19“)

Der weltweite Ausbruch von COVID-19 im ersten Quartal 2020 hatte erhebliche negative Auswirkungen auf die globalen Finanzmärkte. Die Marktvolatilität hat deutlich zugenommen und dürfte sich auf absehbare Zeit auf hohem Niveau halten.

Die Entwicklungen werden sorgfältig überwacht. Angesichts der Art des Ausbruchs und der laufenden Entwicklungen besteht hohe Ungewissheit, und zum gegenwärtigen Zeitpunkt können keine Prognosen zu Ausmaß und Art der gesamten zukünftigen Auswirkungen auf die Gesellschaft gestellt werden.

Außer den vorgenannten Ereignissen sind zum Ende des Geschäftsjahres keine weiteren wichtigen Ereignisse mit Auswirkungen auf die Gesellschaft eingetreten.

20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG

Die Gesellschaft gab am 4. Januar 2022 und am 2. April 2022 folgende Ausschüttungen bekannt:

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | 4. Januar 2022 | 1. April 2022 |
|--|---|-------------------------|----------------|---------------|
| BNY Mellon Absolute Return Bond Fund | Klasse T (Hedged) | CHF | 0,0709 | 0,1052 |
| | Klasse T (Hedged) | USD | 0,1960 | 0,0553 |
| | Sterling T (Acc) (Hedged) | GBP | 0,0821 | 0,1291 |
| | Klasse W (Acc) | EUR | 0,0104 | 0,0498 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | USD | 0,0118 | 0,0524 |
| | Sterling W (Acc) (Hedged) | GBP | 0,0092 | 0,0528 |
| | Sterling W (Inc) (Hedged) | GBP | 0,0142 | 0,0510 |
| | Sterling X (Acc) (Hedged) | GBP | 0,2456 | 0,2975 |
| | BNY Mellon Absolute Return Equity Fund | Klasse U (Inc) (Hedged) | EUR | 0,0032 |
| BNY Mellon Asian Income Fund | Klasse A (Acc) | EUR | 0,0065 | 0,0094 |
| | Klasse A (Inc) | USD | 0,0042 | 0,0059 |
| | Klasse A (Inc) | EUR | 0,0051 | 0,0074 |
| | Klasse B (Acc) | USD | 0,0055 | 0,0079 |
| | Klasse C (Acc) | USD | 0,0060 | 0,0086 |
| | Klasse W (Acc) | EUR | 0,0047 | 0,0068 |
| | Klasse W (Inc) | EUR | 0,0057 | 0,0083 |
| | Klasse W (Inc) | USD | 0,0047 | 0,0067 |
| | Sterling W (Inc) | GBP | 0,0059 | 0,0086 |
| BNY Mellon Blockchain Innovation Fund | Klasse E (Acc) | USD | 0,0052 | - |
| | Klasse E (Acc) | EUR | 0,0052 | - |
| | Sterling E (Acc) (Hedged) | GBP | 0,0002 | - |
| | Klasse G (Acc) | USD | 0,0009 | - |
| | Klasse G (Acc) | EUR | 0,0006 | - |
| | Klasse G (Acc) (Hedged) | EUR | 0,0007 | - |
| | Klasse W (Acc) | USD | 0,0016 | - |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | EUR | 0,0009 | - |
| | BNY Mellon Brazil Equity Fund | Sterling B (Acc) | GBP | 0,0519 |
| Sterling C (Inc) | GBP | 0,0669 | - | |
| Klasse G (Acc) | EUR | 0,0598 | - | |
| Klasse I (Acc) (Hedged) | EUR | 0,0512 | - | |
| Sterling W (Acc) | GBP | 0,0745 | - | |
| BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund | Klasse A (Acc) | USD | 0,0018 | - |
| | Klasse C (Acc) | USD | 0,0018 | - |
| | Klasse E (Acc) | USD | 0,0018 | - |
| | Klasse E (Acc) (Hedged) | EUR | 0,0018 | - |
| | Sterling E (Acc) (Hedged) | GBP | 0,0018 | - |
| | Klasse W (Acc) | USD | 0,0018 | - |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | EUR | 0,0018 | - |
| | Sterling W (Acc) (Hedged) | GBP | 0,0018 | - |
| | Klasse X (Acc) | USD | 0,0018 | - |
| | Klasse X (Acc) (Hedged) | EUR | 0,0018 | - |
| | Sterling X (Acc) (Hedged) | GBP | 0,0018 | - |

20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

| Fonds | Anteilstklasse | Währung | 4. Januar 2022 | 1. April 2022 |
|---|---------------------------|---------|----------------|---------------|
| BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund | Klasse C (Acc) | USD | 0,0033 | - |
| | Klasse G (Acc) | USD | 0,0024 | - |
| | Klasse G (Acc) | EUR | 0,0024 | - |
| | Klasse G (Acc) (Hedged) | EUR | 0,0020 | - |
| | Klasse W (Acc) | USD | 0,0069 | - |
| | Klasse W (Acc) | EUR | 0,0061 | - |
| | Klasse W (Inc) | EUR | 0,0050 | - |
| | Sterling W (Acc) | GBP | 0,0008 | - |
| | Klasse X (Acc) | USD | 0,0149 | - |
| BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund | Klasse A (Acc) | USD | 0,0121 | 0,0120 |
| | Klasse A (Inc) | USD | 0,0116 | 0,0113 |
| | Klasse C (Acc) | USD | 0,0121 | 0,0120 |
| | Klasse C (Inc) | USD | 0,0116 | 0,0113 |
| | Klasse E (Acc) | USD | 0,0121 | 0,0121 |
| | Klasse E (Acc) (Hedged) | EUR | 0,0121 | 0,0120 |
| | Sterling E (Acc) (Hedged) | GBP | 0,0120 | 0,0122 |
| | Klasse E (Inc) | USD | 0,0116 | 0,0114 |
| | Klasse E (Inc) (Hedged) | EUR | 0,0116 | 0,0114 |
| | Sterling E (Inc) (Hedged) | GBP | 0,0115 | 0,0115 |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | EUR | 0,0121 | 0,0120 |
| | Klasse H (Inc) (Hedged) | EUR | 0,0116 | 0,0113 |
| | Klasse W (Acc) | USD | 0,0117 | 0,0115 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | DKK | 0,1213 | 0,1200 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | EUR | 0,0121 | 0,0120 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | NOK | 0,1223 | 0,1179 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | SEK | 0,1233 | 0,1190 |
| | Sterling W (Acc) (Hedged) | GBP | 0,0120 | 0,0122 |
| | Klasse W (Inc) | USD | 0,0116 | 0,0114 |
| | Klasse W (Inc) (Hedged) | EUR | 0,0116 | 0,0113 |
| Sterling W (Inc) (Hedged) | GBP | 0,0115 | 0,0115 | |
| Klasse X (Acc) | USD | 0,0122 | 0,0121 | |
| BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund | Klasse A (Acc) | USD | 0,0042 | 0,0043 |
| | Sterling L (Acc) (Hedged) | GBP | 0,0053 | 0,0054 |
| | Klasse W (Acc) | USD | 0,0048 | 0,0048 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | EUR | 0,0047 | 0,0048 |
| BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fonds | Klasse A (Acc) | USD | 0,0113 | 0,0111 |
| | Klasse C (Acc) | USD | 0,0113 | 0,0111 |
| | Klasse C (Inc) | USD | 0,0101 | 0,0098 |
| | Klasse E (Acc) (Hedged) | EUR | 0,0105 | 0,0103 |
| | Klasse I (Acc) (Hedged) | EUR | 0,0105 | 0,0103 |
| | Klasse N (Acc) | USD | 0,0100 | 0,0098 |
| | Klasse N (Acc) (Hedged) | EUR | 0,0101 | 0,0099 |
| | Klasse N (Inc) (M) | USD | 0,0033 | 0,0032 |
| | Klasse W (Acc) | USD | 0,0113 | 0,0111 |

20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

| Fonds | Anteilstklasse | Währung | 4. Januar 2022 | 1. April 2022 |
|---|---------------------------|---------|----------------|---------------|
| BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund Forts. | Klasse W (Acc) (Hedged) | EUR | 0,0105 | 0,0103 |
| | Klasse W (Inc) | USD | 0,0102 | 0,0099 |
| | Klasse W (Inc) (Hedged) | EUR | 0,0109 | 0,0106 |
| | Klasse X (Acc) | USD | 0,0114 | 0,0112 |
| | Sterling X (Acc) (Hedged) | GBP | 0,0113 | 0,0114 |
| | Klasse X (Inc) | USD | 0,0109 | 0,0106 |
| | Sterling X (Inc) (Hedged) | GBP | 0,0015 | 0,0100 |
| BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund | Klasse A (Inc) | USD | 0,0126 | 0,0125 |
| | Klasse A (Inc) | EUR | 0,0132 | 0,0134 |
| | Klasse C (Acc) | USD | 0,0162 | 0,0163 |
| | Klasse E (Acc) (Hedged) | EUR | 0,0151 | 0,0152 |
| | Sterling E (Acc) (Hedged) | GBP | 0,0154 | 0,0159 |
| | Klasse G (Acc) (Hedged) | EUR | 0,0148 | 0,0149 |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | EUR | 0,0145 | 0,0146 |
| | Klasse K (Acc) | USD | 0,0158 | 0,0159 |
| | Klasse K (Acc) (Hedged) | EUR | 0,0150 | 0,0151 |
| | Klasse L (Acc) | USD | 0,0159 | 0,0160 |
| | Klasse L (Acc) (Hedged) | EUR | 0,0151 | 0,0152 |
| | Klasse L (Inc) (Hedged)^ | EUR | - | 0,0064 |
| | Sterling L (Acc) (Hedged) | GBP | 0,0144 | 0,0148 |
| | Sterling L (Inc) (Hedged) | GBP | 0,0124 | 0,0127 |
| | Klasse W (Acc) | USD | 0,0162 | 0,0164 |
| | Klasse W (Inc) | USD | 0,0140 | 0,0139 |
| | Klasse W (Inc) (Hedged) | EUR | 0,0117 | 0,0117 |
| | Sterling W (Inc) (hedged) | GBP | 0,0139 | 0,0142 |
| | Klasse X (Acc) | USD | 0,0133 | 0,0134 |
| | Sterling X (Inc) (Hedged) | GBP | 0,0018 | 0,0136 |
| BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund | Klasse A (Inc) (M) | HKD | 2,2012 | 1,8605 |
| | Klasse G (Inc) | USD | 0,8137 | 0,7926 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | CHF | 0,9695 | 0,9507 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | EUR | 0,9559 | 0,9301 |
| | Klasse W (Inc) (Hedged) | CHF | 0,8552 | 0,8317 |
| | Klasse W (Inc) (Hedged) | EUR | 0,8107 | 0,7855 |
| | Sterling W (Acc) (Hedged) | GBP | 1,3499 | 1,3517 |
| | Klasse X | USD | 1,9941 | 1,9333 |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund | Klasse C (Inc) | USD | 0,0080 | 0,0077 |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | EUR | 0,0104 | 0,0102 |
| | Klasse X (Inc) | USD | 0,0126 | 0,0120 |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund | Klasse A (Inc) | USD | 0,0058 | 0,0036 |
| | Klasse A (Inc) | EUR | 0,0084 | 0,0052 |
| | Sterling A (Acc) | GBP | 0,0119 | 0,0076 |
| | Sterling B (Acc) | GBP | 0,0130 | 0,0086 |
| | Klasse C (Inc) | USD | 0,0069 | 0,0044 |
| | Klasse C (Inc) | EUR | 0,0087 | 0,0057 |

20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | 4. Januar 2022 | 1. April 2022 |
|--|---------------------------|---------|----------------|---------------|
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund Forts. | Sterling C (Acc) | GBP | 0,0199 | 0,0136 |
| | Sterling C (Inc) | GBP | 0,0101 | 0,0067 |
| | Sterling J (Inc) (Hedged) | GBP | 0,0055 | 0,0035 |
| | Klasse W (Hedged) | EUR | 0,0110 | 0,0074 |
| | Klasse W (Inc) | EUR | 0,0081 | 0,0055 |
| | Klasse W (Inc) (Hedged) | EUR | 0,0095 | 0,0062 |
| | Sterling W (Inc) | GBP | 0,0084 | 0,0057 |
| | Sterling W (Inc) (Hedged) | GBP | 0,0069 | 0,0047 |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund | Klasse W (Acc) | USD | 0,0146 | 0,0112 |
| | Klasse X (Inc) | USD | 0,0127 | 0,0097 |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund | Klasse A (Acc) | USD | 0,0164 | 0,0123 |
| | Sterling E (Inc) (Hedged) | GBP | 0,0144 | 0,0110 |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | EUR | 0,0159 | 0,0120 |
| | Klasse W (Acc) | USD | 0,0167 | 0,0125 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | EUR | 0,0154 | 0,0116 |
| | Sterling W (Acc) (Hedged) | GBP | 0,0153 | 0,0118 |
| | Klasse X (Acc) | USD | 0,0170 | 0,0129 |
| BNY Mellon Euroland Bond Fund | Klasse A (Inc) | EUR | - | 0,0008 |
| | Klasse B (Inc) | EUR | 0,0008 | 0,0016 |
| | Klasse C (Inc) | EUR | 0,0016 | 0,0025 |
| | Klasse G (Acc) | EUR | 0,0013 | 0,0020 |
| | Klasse W (Acc) | EUR | 0,0016 | 0,0022 |
| BNY Mellon European Credit Fund | Klasse W (Acc) | EUR | 0,1334 | 0,1273 |
| | Klasse X | EUR | 0,3187 | 0,3039 |
| BNY Mellon Future Earth Fund | Klasse C (Acc) | USD | 0,0038 | - |
| | Klasse E (Acc) | EUR | 0,0100 | - |
| | Klasse I (Acc) (Hedged) | EUR | 0,0040 | - |
| | Klasse W (Acc) | USD | 0,0059 | - |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | EUR | 0,0062 | - |
| BNY Mellon Future Food Fund | Klasse E (Acc) | EUR | 0,0085 | - |
| | Klasse W (Acc) | USD | 0,0045 | - |
| BNY Mellon Future Life Fund | Klasse E (Acc) | EUR | 0,0104 | - |
| | Klasse W (Acc) | USD | 0,0063 | - |
| BNY Mellon Global Bond Fund | Klasse C | USD | 0,0076 | - |
| | Klasse C (Inc) | USD | 0,0017 | 0,0016 |
| | Sterling C (Inc) | GBP | 0,0041 | - |
| | Klasse I (Acc) (Hedged) | AUD | 0,0027 | - |
| | Klasse W (Acc) | USD | 0,0037 | - |
| | Klasse W (Acc) | EUR | 0,0016 | - |
| | Sterling Z (Acc) (Hedged) | GBP | 0,0039 | - |
| | Sterling Z (Inc) (Hedged) | GBP | 0,0039 | - |
| BNY Mellon Global Credit Fund | Klasse A (Acc) | USD | 0,0086 | - |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | EUR | 0,0102 | - |
| | Klasse W (Acc) | USD | 0,0195 | - |
| | Sterling W (Acc) (Hedged) | GBP | 0,0186 | - |

20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

| Fonds | Anteilstklasse | Währung | 4. Januar 2022 | 1. April 2022 | |
|---|--------------------------------------|-------------------------|----------------|---------------|---|
| BNY Mellon Global Credit Fund Forts. | Klasse X (Acc) | USD | 0,0263 | - | |
| | Klasse X (Acc) | JPY | 0,7812 | - | |
| | Klasse X (Acc) (Hedged) | CAD | 0,0259 | - | |
| | Klasse X (Acc) (Hedged) | JPY | 0,7309 | - | |
| BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund | Klasse A (Inc) | USD | 0,0027 | 0,0029 | |
| | Klasse C | USD | 0,0054 | 0,0055 | |
| | Klasse G (Acc) | EUR | 0,0044 | 0,0047 | |
| | Klasse H (Inc) (Hedged) | EUR | 0,0024 | 0,0026 | |
| | Klasse I (Hedged) | EUR | 0,0042 | 0,0043 | |
| | Klasse I (Acc) (Hedged) | SGD | 0,0019 | 0,0040 | |
| | Klasse I (Inc) (Hedged) | EUR | 0,0036 | 0,0037 | |
| | Klasse W | USD | 0,0055 | 0,0055 | |
| | Klasse W (Inc) (Hedged) | EUR | 0,0044 | 0,0045 | |
| | Sterling W (Acc) (Hedged) | GBP | 0,0050 | 0,0053 | |
| | Klasse X (Acc) (Hedged) | JPY | 0,6136 | 0,6397 | |
| | Klasse X (Inc) (Hedged) | JPY | 0,5917 | 0,6133 | |
| | Sterling Z (Acc) | GBP | 0,0048 | 0,0050 | |
| | Sterling Z (Inc) | GBP | 0,0046 | 0,0048 | |
| | Sterling Z (Acc) (Hedged) | GBP | 0,0049 | 0,0051 | |
| | Sterling Z (Inc) (Hedged) | GBP | 0,0048 | 0,0050 | |
| | BNY Mellon Global Equity Fund | Klasse I (Acc) (Hedged) | AUD | 0,0031 | - |
| | | Klasse W (Acc) | USD | 0,0084 | - |
| Klasse W (Acc) | | EUR | 0,0085 | - | |
| BNY Mellon Global Equity Income Fund | Klasse A | EUR | 0,0157 | 0,0157 | |
| | Klasse A (Inc) | USD | 0,0085 | 0,0083 | |
| | Klasse A (Inc) | EUR | 0,0077 | 0,0077 | |
| | Sterling A (Acc) | GBP | 0,0106 | 0,0106 | |
| | Klasse B | USD | 0,0146 | 0,0144 | |
| | Klasse B | EUR | 0,0156 | 0,0157 | |
| | Klasse B (Inc) | USD | 0,0104 | 0,0102 | |
| | Klasse B (Inc) | EUR | 0,0120 | 0,0119 | |
| | Sterling B (Inc) | GBP | 0,0121 | 0,0121 | |
| | Klasse C (Inc) | USD | 0,0109 | 0,0107 | |
| | Klasse C (Inc) | EUR | 0,0120 | 0,0120 | |
| | Sterling C (Inc) | GBP | 0,0127 | 0,0127 | |
| | Klasse G (Acc) | EUR | 0,0078 | 0,0078 | |
| | Klasse H (Inc) (Hedged) | EUR | 0,0071 | 0,0069 | |
| | Klasse W | USD | 0,0123 | 0,0121 | |
| | Klasse W | EUR | 0,0142 | 0,0143 | |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | EUR | 0,0072 | 0,0070 | |
| | Klasse W (Inc) | USD | 0,0093 | 0,0091 | |
| | Klasse W (Inc) | EUR | 0,0109 | 0,0108 | |
| Sterling W (Acc) | GBP | 0,0147 | 0,0148 | | |

20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | 4. Januar 2022 | 1. April 2022 |
|--|---------------------------|---------|----------------|---------------|
| BNY Mellon Global Equity Income Fund Forts. | Sterling W (Inc) | GBP | 0,0111 | 0,0112 |
| | Klasse Z (Acc) | USD | 0,0103 | 0,0102 |
| | Klasse Z (Acc) | EUR | 0,0114 | 0,0114 |
| | Klasse Z (Inc) | USD | 0,0073 | 0,0072 |
| | Klasse Z (Inc) | EUR | 0,0074 | 0,0074 |
| | Sterling Z (Inc) | GBP | 0,0070 | 0,0070 |
| BNY Mellon Global High Yield Bond Fund | Klasse C (Inc) | USD | 0,0120 | 0,0118 |
| | Klasse W (Acc) | USD | 0,0153 | 0,0153 |
| | Sterling W (Acc) (Hedged) | GBP | 0,0139 | 0,0142 |
| | Klasse X (Inc) | USD | 0,0126 | 0,0125 |
| BNY Mellon Global Infrastructure Income Fonds | Klasse X (Inc) (Hedged) | EUR | 0,0115 | 0,0113 |
| | Klasse A (Acc) | USD | 0,0110 | 0,0106 |
| | Klasse A (Inc) | USD | 0,0096 | 0,0091 |
| | Klasse A (Inc) | EUR | 0,0097 | 0,0094 |
| | Klasse B (Acc) | SGD | 0,0135 | 0,0130 |
| | Klasse B (Acc) | USD | 0,0112 | 0,0107 |
| | Klasse B (Inc) | USD | 0,0098 | 0,0093 |
| | Klasse B (Inc) | SGD | 0,0126 | 0,0120 |
| | Klasse B (Inc) (M) | USD | 0,0060 | 0,0049 |
| | Klasse B (Inc) (M) | SGD | 0,0063 | 0,0051 |
| | Klasse E (Inc) | USD | 0,0101 | 0,0096 |
| | Klasse E (Inc) | EUR | 0,0102 | 0,0099 |
| | Sterling E (Inc) (Hedged) | GBP | 0,0094 | 0,0091 |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | EUR | 0,0103 | 0,0098 |
| | Klasse H (Inc) (Hedged) | EUR | 0,0090 | 0,0085 |
| | Klasse J (Acc) (Hedged) | SGD | 0,0141 | 0,0135 |
| | Klasse J (Inc) (Hedged) | SGD | 0,0131 | 0,0125 |
| | Klasse W (Acc) | USD | 0,0115 | 0,0110 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | EUR | 0,0107 | 0,0102 |
| | Klasse W (Inc) | USD | 0,0100 | 0,0095 |
| Klasse W (Inc) (Hedged) | EUR | 0,0093 | 0,0089 | |
| BNY Mellon Global Leaders Fund | Klasse E (Acc) | USD | 0,0025 | - |
| | Klasse E (Acc) | EUR | 0,0018 | - |
| | Sterling E (Acc) | GBP | 0,0027 | - |
| BNY Mellon Global Opportunities Fund | Klasse W (Acc) | USD | 0,0079 | - |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) | Klasse A | EUR | 0,0036 | - |
| | Klasse A (Inc) | EUR | 0,0027 | - |
| | Klasse C | EUR | 0,0115 | - |
| | Klasse C (Inc) | EUR | 0,0093 | - |
| | Klasse G (Acc) | EUR | 0,0089 | - |
| | Klasse G (Inc) | EUR | 0,0086 | - |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | SGD | 0,0024 | - |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | USD | 0,0024 | - |
| | Sterling H (Acc) (Hedged) | GBP | 0,0024 | - |

20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | 4. Januar 2022 | 1. April 2022 |
|--|---|----------------|----------------|---------------|
| BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) Forts. | Klasse W | EUR | 0,0144 | - |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | CHF | 0,0109 | - |
| | Klasse W (Inc) | EUR | 0,0110 | - |
| | Klasse Z (Acc) | EUR | 0,0132 | - |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP) | Sterling B (Acc) | GBP | 0,0012 | - |
| | Sterling B (Inc) | GBP | 0,0011 | - |
| | Sterling C (Inc) | GBP | 0,0075 | - |
| | Sterling W (Acc) | GBP | 0,0118 | - |
| | Sterling W (Inc) | GBP | 0,0105 | - |
| | Sterling X (Acc) | GBP | 0,0239 | - |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (USD) | Klasse A | USD | 0,0009 | - |
| | Klasse C | USD | 0,0100 | - |
| | Klasse C (Inc) | USD | 0,0077 | - |
| | Klasse G (Acc) | USD | 0,0073 | - |
| | Klasse W (Acc) | USD | 0,0119 | - |
| | Klasse W (Inc) | USD | 0,0105 | - |
| | BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund | Klasse A (Acc) | USD | 0,0113 |
| Klasse A (Inc) | | USD | 0,0092 | 0,0088 |
| Klasse C (Acc) | | USD | 0,0131 | 0,0127 |
| Klasse G (Acc) | | USD | 0,0118 | 0,0114 |
| Klasse H (Acc) (Hedged) | | EUR | 0,0104 | 0,0100 |
| Klasse H (Inc) (Hedged) | | EUR | 0,0085 | 0,0081 |
| Klasse I (Acc) (Hedged) | | EUR | 0,0120 | 0,0116 |
| Klasse I (Inc) (Hedged) | | EUR | 0,0096 | 0,0092 |
| Klasse W (Acc) | | USD | 0,0141 | 0,0136 |
| Klasse W (Acc) (Hedged) | | CHF | 0,0122 | 0,0119 |
| Klasse W (Acc) (Hedged) | | EUR | 0,0126 | 0,0122 |
| Klasse W (Inc) | | USD | 0,0110 | 0,0106 |
| Klasse W (Inc) (Hedged) | | EUR | 0,0102 | 0,0097 |
| Sterling W (Acc) (Hedged) | | GBP | 0,0132 | 0,0131 |
| Sterling W (Inc) (Hedged) | | GBP | 0,0105 | 0,0103 |
| Klasse X (Acc) | | USD | 0,0162 | 0,0158 |
| Sterling X (Acc) (Hedged) | | GBP | 0,0141 | 0,0140 |
| Klasse Y (Acc) | | USD | 0,0163 | 0,0158 |
| Sterling Y (Acc) (Hedged) | | GBP | 0,0153 | 0,0152 |
| Klasse Z (Acc) | | USD | 0,0119 | 0,0116 |
| Klasse Z (Inc) | | USD | 0,0117 | 0,0112 |
| Sterling Z (Acc) (Hedged) | | GBP | 0,0125 | 0,0124 |
| Sterling Z (Inc) (Hedged) | GBP | 0,0110 | 0,0108 | |
| BNY Mellon Global Unconstrained Fund | Klasse W (Acc) | USD | 0,0083 | - |
| | Klasse X (Acc) (Hedged) | CAD | 0,0199 | - |
| BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund | Klasse C | USD | 0,0013 | - |
| | Klasse E (Acc) (Hedged) | CHF | 0,0058 | - |
| | Klasse E (Acc) (Hedged) | USD | 0,0063 | - |

20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

| Fonds | Anteilstklasse | Währung | 4. Januar 2022 | 1. April 2022 |
|--|--|------------------|----------------|---------------|
| BNY Mellon Japan Small Cap Equity | Klasse G (Acc) (Hedged) | EUR | 0,0006 | - |
| | Klasse W (Acc) | EUR | 0,0034 | - |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | EUR | 0,0034 | - |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | NOK | 0,0382 | - |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | SEK | 0,0350 | - |
| | Sterling W (Acc) | GBP | 0,0083 | - |
| | Sterling W (Inc) | GBP | 0,0032 | - |
| | BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund | Klasse S (Acc) 1 | USD | 0,0055 |
| Klasse W | | EUR | 0,0042 | - |
| Klasse W | | USD | 0,0037 | - |
| Klasse W (Hedged) | | USD | 0,0040 | - |
| Klasse W (Acc) (Hedged) | | SGD | 0,0020 | - |
| Klasse W (Inc) | | USD | 0,0035 | - |
| Sterling W (Acc) | | GBP | 0,0044 | - |
| Sterling W (Inc) | | GBP | 0,0043 | - |
| Sterling X | | GBP | 0,0245 | - |
| BNY Mellon Mobility Innovation Fund | | Klasse E (Acc) | USD | 0,0007 |
| | Klasse E (Acc) | CHF | 0,0007 | - |
| | Klasse E (Acc) | EUR | 0,0006 | - |
| | Klasse E (Acc) (Hedged) | CHF | 0,0006 | - |
| | Klasse E (Acc) (Hedged) | EUR | 0,0009 | - |
| | Sterling E (Acc) (Hedged) | GBP | 0,0006 | - |
| BNY Mellon Small Cap Euroland Fund | Klasse W (Acc) | EUR | 0,0175 | - |
| BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund | Klasse A (Acc) | EUR | 0,0023 | 0,0024 |
| | Klasse A (Acc) | USD | 0,0022 | 0,0023 |
| | Klasse A (Inc) | EUR | 0,0022 | 0,0023 |
| | Klasse C (Acc) | EUR | 0,0036 | 0,0037 |
| | Klasse E (Acc) | EUR | 0,0050 | 0,0050 |
| | Klasse E (Acc) (Hedged) | CHF | 0,0047 | 0,0048 |
| | Klasse G (Acc) | EUR | 0,0036 | 0,0037 |
| | Klasse H (Acc) (Hedged) | CHF | 0,0021 | 0,0023 |
| | Klasse V (Acc)^ | EUR | - | 0,0038 |
| | Klasse W (Acc) | EUR | 0,0043 | 0,0043 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | CHF | 0,0040 | 0,0041 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | USD | 0,0041 | 0,0042 |
| | Sterling W (Acc) (Hedged) | GBP | 0,0041 | 0,0043 |
| | Klasse W (Inc) | EUR | 0,0039 | 0,0040 |
| | Sterling W (Inc) (Hedged) | GBP | 0,0040 | 0,0042 |
| | Klasse X (Acc) | EUR | 0,0058 | 0,0058 |
| | Klasse Z (Acc) | EUR | 0,0044 | 0,0045 |
| | Klasse Z (Inc) | EUR | 0,0043 | 0,0044 |
| | Klasse Z (Inc) (Hedged) | USD | 0,0043 | 0,0044 |

20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

| Fonds | Anteilstklasse | Währung | 4. Januar 2022 | 1. April 2022 |
|---|---|----------------|----------------|---------------|
| BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR) | Klasse A (Acc) | EUR | 0,0009 | - |
| | Klasse A (Inc) | EUR | 0,0006 | - |
| | Klasse E (Acc) | EUR | 0,0118 | - |
| | Klasse E (Acc) (Hedged) | USD | 0,0114 | - |
| | Klasse G (Acc) | EUR | 0,0065 | - |
| | Klasse W (Acc) | EUR | 0,0089 | - |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | USD | 0,0010 | - |
| | Sterling W (Acc) (Hedged) | GBP | 0,0087 | - |
| | Klasse W (Inc) | EUR | 0,0089 | - |
| | Sterling W (Inc) (Hedged) | GBP | 0,0086 | - |
| | BNY Mellon Targeted Return Bond Fund | Klasse A (Acc) | USD | 0,0001 |
| Sterling W (Acc) (Hedged) | | GBP | 0,0023 | 0,0019 |
| BNY Mellon U.S. Equity Income Fund | Klasse A (Acc) | EUR | 0,0074 | 0,0077 |
| | Klasse B (Inc) | USD | 0,0068 | 0,0068 |
| | Klasse C (Acc) | USD | 0,0043 | 0,0054 |
| | Klasse C (Inc) | USD | 0,0074 | 0,0075 |
| | Klasse E (Inc) | USD | 0,0076 | 0,0077 |
| | Klasse E (Inc) | EUR | 0,0074 | 0,0076 |
| | Sterling E (Acc) | GBP | 0,0078 | 0,0082 |
| | Sterling E (Inc) | GBP | 0,0070 | 0,0073 |
| | Sterling E (Inc) (Hedged) | GBP | 0,0070 | 0,0072 |
| | Klasse W (Acc) | USD | 0,0084 | 0,0085 |
| | Klasse W (Acc) | EUR | 0,0075 | 0,0078 |
| | Klasse W (Inc) | USD | 0,0076 | 0,0076 |
| | Sterling W (Inc) | GBP | 0,0069 | 0,0072 |
| | BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund | Klasse A (Acc) | USD | 0,0143 |
| Klasse A (Inc) | | USD | 0,0047 | - |
| Klasse A (Inc) (M) | | USD | 0,0023 | 0,0023 |
| Klasse C (Acc) | | USD | 0,0175 | - |
| Klasse E (Acc) | | USD | 0,0168 | - |
| Klasse E (Acc) (Hedged) | | CHF | 0,0151 | - |
| Klasse E (Acc) (Hedged) | | EUR | 0,0165 | - |
| Klasse E (Inc) (Hedged) | | EUR | 0,0142 | - |
| Klasse G (Acc) | | USD | 0,0015 | - |
| Sterling G (Inc) (Hedged) | | GBP | 0,0142 | - |
| Klasse H (Acc) (Hedged) | | EUR | 0,0160 | - |
| Klasse H (Acc) (Hedged) | | CHF | 0,0137 | - |
| Klasse H (Inc) (Hedged) | | EUR | 0,0138 | - |
| Sterling H (Acc) (Hedged) | | GBP | 0,0140 | - |
| Klasse P (Acc) | | USD | 0,0138 | - |
| Klasse P (Acc) (Hedged) | | AUD | 0,0137 | - |
| Klasse P (Acc) (Hedged) | | EUR | 0,0139 | - |
| Klasse P (Inc) | | USD | 0,0137 | - |
| Klasse P (Inc) (Hedged) | | AUD | 0,0137 | - |

20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | 4. Januar 2022 | 1. April 2022 |
|--|--|----------------|----------------|---------------|
| BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Forts. | Klasse P (Inc) (Hedged) | EUR | 0,0139 | - |
| | Klasse W (Acc) | USD | 0,0176 | - |
| | Klasse W (Acc) | EUR | 0,0147 | - |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | CHF | 0,0153 | - |
| | Klasse W (Acc) (Hedged) | EUR | 0,0164 | - |
| | Klasse W (Inc) | USD | 0,0148 | - |
| | Klasse W (Inc) (Hedged) | CHF | 0,0141 | - |
| | Klasse W (Inc) (Hedged) | EUR | 0,0142 | - |
| | Sterling W (Acc) (Hedged) | GBP | 0,0139 | - |
| | Klasse Z (Acc) | USD | 0,0139 | - |
| | Klasse Z (Acc) (Hedged) | CHF | 0,0137 | - |
| | Klasse Z (Acc) (Hedged) | EUR | 0,0142 | - |
| | Sterling Z (Acc) (Hedged) | GBP | 0,0139 | - |
| | Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund | Klasse G (Acc) | EUR | 0,0005 |
| Klasse W (Acc) | | EUR | 0,0008 | 0,0008 |
| Klasse W (Inc) | | EUR | 0,0005 | 0,0008 |
| Klasse X (Acc) | | EUR | 0,0017 | 0,0018 |
| Klasse Z (Acc) | | EUR | 0,0010 | 0,0011 |
| Responsible Horizons Euro Impact Bond Fonds | Klasse A (Acc)^ | EUR | - | 0,0005 |
| | Klasse C (Acc)^ | EUR | - | 0,0009 |
| | Klasse E (Acc)^ | EUR | - | 0,0011 |
| | Klasse E (Acc) (Hedged)^ | USD | - | 0,0012 |
| | Sterling E (Acc) (Hedged)^ | GBP | - | 0,0012 |
| | Klasse G (Acc)^ | EUR | - | 0,0009 |
| | Klasse W (Acc)^ | EUR | - | 0,0010 |
| | Klasse W (Acc) (Hedged)^ | USD | - | 0,0010 |
| | Sterling W (Acc) (Hedged)^ | GBP | - | 0,0011 |
| | Klasse X (Acc)^ | EUR | - | 0,0014 |
| | Klasse X (Acc) (Hedged)^ | USD | - | 0,0014 |
| Sterling X (Acc) (Hedged)^ | GBP | - | 0,0014 | |

^ Diese Anteilsklasse wurde im ersten Quartal 2022 aufgelegt.

Die Gesellschaft gab am 1. Februar 2022 folgende Ausschüttungen bekannt:

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | 1. Februar 2022 |
|---|--------------------|---------|-----------------|
| BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund | Klasse N (Inc) | USD | 0,0032 |
| BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund | Klasse A (Inc) (M) | HKD | 2,2903 |
| BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund | Klasse B (Inc) (M) | USD | 0,0036 |
| | Klasse B (Inc) (M) | SGD | 0,0038 |
| BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund | Klasse A (Inc) (M) | USD | 0,0022 |

20. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

Die Gesellschaft gab am 1. März 2022 folgende Ausschüttungen bekannt:

| Fonds | Anteilsklasse | Währung | 1. März 2022 |
|---|--------------------|---------|--------------|
| BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund | Klasse N (Inc) | USD | 0,0032 |
| BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund | Klasse A (Inc) (M) | HKD | 2,5194 |
| BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund | Klasse B (Inc) (M) | USD | 0,0022 |
| | Klasse B (Inc) (M) | SGD | 0,0023 |
| BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund | Klasse A (Inc) (M) | USD | 0,0023 |

Der Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund wurde am 10. Januar 2022 aufgelegt.

Nach dem Bilanzstichtag sind die Finanzmärkte hauptsächlich aufgrund der durch den Konflikt zwischen Russland und der Ukraine ausgelösten geopolitischen Spannungen sowie der Auswirkungen der verhängten Sanktionen gefallen. Zum Zeitpunkt der Erstellung dieses Berichts hatte die Realisierung des Dominoeffekts auf die Wirtschaft und Märkte erst langsam eingesetzt. Die Verwaltungsgesellschaft und der/die Anlageverwalter werden wie immer weiterhin die Anlageperformance im Einklang mit den Anlagezielen der jeweiligen Teilfonds überwachen.

Mit Ausnahme der zuvor genannten hat es nach Ablauf des Geschäftsjahres keine Ereignisse gegeben, die nach Auffassung der Verwaltungsgesellschaft eine Auswirkung auf den Jahresabschluss für das am 31. Dezember 2021 beendete Geschäftsjahr hätten haben können.

21. GENEHMIGUNG DES ABSCHLUSSES

Der Jahresabschluss wurde am 14. April 2022 vom Verwaltungsrat genehmigt.

BNY MELLON GLOBAL FUNDS, PLC

BEDEUTENDE PORTFOLIOBEWEGUNGEN (ungeprüft)

BNY Mellon Absolute Return Bond Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Wichtige Käufe | Nominal | Kosten EUR | Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten | Nominal | Erlöse EUR |
|---|---------------|---------------|---|---------------|---------------|
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.250% 15-Mar-2028 | 49.510.000 | 49.097.287 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.250% 15-Mar-2028 | 49.510.000 | 48.892.228 |
| BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund | 39.031.384 | 41.198.955 | German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 27-Oct-2021 | 26.611.000 | 26.611.000 |
| German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 27-Oct-2021 | 26.611.000 | 26.659.498 | German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 15-Dec-2021 | 26.545.000 | 26.545.000 |
| German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 15-Dec-2021 | 26.545.000 | 26.580.355 | Insight Liquidity Funds PLC - ILF EUR Cash Fund | 25.291.581 | 24.718.431 |
| Japan Government Thirty Year Bond 0.700% 20-Sep-2051 | 3.100.000.000 | 24.234.732 | German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 29-Sep-2021 | 23.295.000 | 23.295.000 |
| German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 29-Sep-2021 | 23.295.000 | 23.335.949 | German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 28-Jul-2021 | 22.500.000 | 22.502.981 |
| German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 25-Aug-2021 | 19.200.000 | 19.247.883 | German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 03-Mar-2021 | 21.197.000 | 21.197.000 |
| German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 09-Jun-2021 | 19.145.000 | 19.180.151 | German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 05-May-2021 | 21.161.000 | 21.163.380 |
| Japan Government Forty Year Bond 0.500% 20-Mar-2060 | 2.726.000.000 | 19.170.446 | German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 14-Apr-2021 | 21.150.000 | 21.150.000 |
| United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 03-Mar-2022 | 21.500.000 | 18.348.136 | German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 20-Jan-2021 | 21.145.000 | 21.145.000 |
| United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 24-Feb-2022 | 21.000.000 | 18.161.577 | Japan Government Forty Year Bond 0.500% 20-Mar-2060 | 2.726.000.000 | 19.282.398 |
| United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 16-Dec-2021 | 21.000.000 | 17.831.349 | German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 25-Aug-2021 | 19.200.000 | 19.200.000 |
| United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 27-Jan-2022 | 21.000.000 | 17.830.864 | German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 09-Jun-2021 | 19.145.000 | 19.150.666 |
| United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 26-Aug-2021 | 21.000.000 | 17.608.641 | United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 26-Nov-2021 | 21.000.000 | 18.617.844 |
| United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 26-Nov-2021 | 21.000.000 | 17.593.112 | United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 16-Dec-2021 | 21.000.000 | 18.589.820 |
| Insight Liquidity Funds PLC - ILF EUR Cash Fund | 18.014.274 | 17.587.305 | United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 07-Oct-2021 | 21.000.000 | 18.165.294 |
| United States Treasury Bill - When Issued 0.000% 23-Sep-2021 | 21.000.000 | 17.565.639 | United States Treasury Bill - When Issued 0.000% 23-Sep-2021 | 21.000.000 | 17.923.427 |
| United States Cash Management Bill - Reopening (Zero Coupon) 0.000% 15-Jul-2021 | 21.000.000 | 17.450.188 | United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 26-Aug-2021 | 21.000.000 | 17.833.631 |
| United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 07-Oct-2021 | 21.000.000 | 17.435.586 | United States Cash Management Bill - Reopening (Zero Coupon) 0.000% 15-Jul-2021 | 21.000.000 | 17.766.494 |
| United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 06-May-2021 | 21.000.000 | 17.393.116 | United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 17-Jun-2021 | 21.000.000 | 17.596.772 |
| United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 18-Mar-2021 | 21.000.000 | 17.335.731 | United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 18-Mar-2021 | 21.000.000 | 17.587.196 |
| United States Cash Management Bill 0.000% 15-Apr-2021 | 21.000.000 | 17.334.435 | United States Cash Management Bill 0.000% 15-Apr-2021 | 21.000.000 | 17.554.110 |
| Japan Government Twenty Year Bond 0.400% 20-Sep-2040 | 2.190.000.000 | 17.279.389 | United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 06-May-2021 | 21.000.000 | 17.439.671 |
| United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 17-Jun-2021 | 21.000.000 | 17.261.857 | United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 18-Feb-2021 | 20.500.000 | 16.980.027 |
| Bundesschatzanweisungen 0.000% 11-Mar-2022 | 17.000.000 | 17.029.750 | Japan Government Twenty Year Bond 0.000% 20-Sep-2040 | 2.190.000.000 | 16.563.480 |
| German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 05-May-2021 | 17.000.000 | 17.020.813 | United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 14-Jan-2021 | 20.000.000 | 16.455.480 |
| German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 24-Nov-2021 | 14.600.000 | 14.631.982 | Australia Government Bond 0.000% 21-Jun-2051 | 27.900.000 | 14.829.653 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 1.450% 01-Mar-2036 | 13.370.000 | 13.972.608 | German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 24-Nov-2021 | 14.600.000 | 14.600.000 |
| China Government Bond 3.720% 12-Apr-2051 | 96.000.000 | 13.442.382 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 0.000% 01-Mar-2036 | 13.370.000 | 14.012.969 |
| Republic of Austria Government Bond '144A' 2.100% 20-Sep-2117 | 6.480.000 | 11.673.453 | Japan Government Thirty Year Bond 0.000% 20-Jun-2050 | 1.533.000.000 | 11.716.896 |
| French Republic Government Bond OAT '144A' 0.750% 25-May-2052 | 11.170.000 | 11.560.950 | French Republic Government Bond OAT '144A' 0.000% 25-May-2052 | 11.170.000 | 11.410.155 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 2.800% 01-Mar-2067 | 9.600.000 | 11.337.600 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 2.800% 01-Mar-2067 | 8.400.000 | 10.461.180 |
| China Government Bond 3.270% 19-Nov-2030 | 81.600.000 | 10.402.435 | China Government Bond 3.270% 19-Nov-2030 | 75.000.000 | 9.637.528 |

BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Wichtige Käufe | Nominal | Kosten EUR | Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten | Nominal | Erlöse EUR |
|---|------------|---------------|--|------------|---------------|
| French Republic Government Bond OAT 3.250% 25-Oct-2021 | 19.350.000 | 19.551.980 | French Republic Government Bond OAT 3.250% 25-Oct-2021 | 19.350.000 | 19.372.041 |
| German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 27-Oct-2021 | 16.500.000 | 16.534.295 | German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 27-Oct-2021 | 16.500.000 | 16.501.147 |
| Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 3.250% 04-Jul-2021 | 16.000.000 | 16.136.220 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 3.250% 04-Jul-2021 | 16.000.000 | 16.000.000 |
| Bundesschatzanweisungen (Zero Coupon) 0.000% 10-Sep-2021 | 13.000.000 | 13.011.830 | Bundesschatzanweisungen (Zero Coupon) 0.000% 10-Sep-2021 | 13.000.000 | 13.000.180 |
| Bundesschatzanweisungen (Zero Coupon) 0.000% 08-Oct-2021 | 13.000.000 | 13.007.440 | Bundesschatzanweisungen (Zero Coupon) 0.000% 10-Sep-2021 | 13.000.000 | 13.000.000 |
| France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 07-Jul-2021 | 13.000.000 | 13.006.431 | France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 07-Jul-2021 | 13.000.000 | 13.000.000 |
| France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 21-Jul-2021 | 13.000.000 | 13.003.317 | France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 21-Jul-2021 | 13.000.000 | 13.000.000 |
| France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 19-Jan-2022 | 12.500.000 | 12.521.777 | French Republic Government Bond OAT 3.750% 25-Apr-2021 | 11.450.000 | 11.450.000 |
| France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 12-Jan-2022 | 10.400.000 | 10.428.317 | France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 18-Aug-2021 | 8.700.000 | 8.700.000 |
| Insight Liquidity Funds Plc - ILF EUR Cash Fund | 10.271.790 | 10.030.000 | German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 24-Nov-2021 | 8.000.000 | 8.001.357 |
| French Republic Government Bond OAT 3.750% 25-Apr-2021 | 9.000.000 | 9.058.190 | Bundesschatzanweisungen (Zero Coupon) 0.000% 12-Mar-2021 | 7.000.000 | 7.000.000 |
| France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 18-Aug-2021 | 8.700.000 | 8.704.576 | France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 23-Jun-2021 | 7.000.000 | 7.000.000 |
| German Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 24-Nov-2021 | 8.000.000 | 8.004.034 | French Republic Government Bond OAT (Zero Coupon) 0.000% 25-May-2021 | 6.700.000 | 6.700.000 |
| Bundesschatzanweisungen 0.000% 11-Mar-2022 | 7.500.000 | 7.513.275 | France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 09-Jun-2021 | 6.600.000 | 6.600.000 |
| France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 23-Jun-2021 | 7.000.000 | 7.010.027 | France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 16-Jun-2021 | 6.600.000 | 6.600.000 |
| Kingdom of Belgium Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 10-Mar-2022 | 6.700.000 | 6.710.334 | France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 15-Sep-2021 | 6.000.000 | 6.000.000 |
| France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 09-Jun-2021 | 6.600.000 | 6.609.903 | Insight Liquidity Funds Plc - EUR Cash Fund | 6.156.501 | 6.000.000 |
| France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 16-Jun-2021 | 6.600.000 | 6.600.783 | France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 04-Nov-2021 | 5.800.000 | 5.802.194 |
| France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 09-Mar-2022 | 6.000.000 | 6.017.098 | France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 22-Sep-2021 | 5.500.000 | 5.500.000 |
| France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 15-Sep-2021 | 6.000.000 | 6.009.753 | France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 17-Nov-2021 | 5.000.000 | 5.000.304 |
| France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 04-Nov-2021 | 5.800.000 | 5.812.291 | Airbus SE (Zero Coupon) 0.000% 14-Jun-2021 | 5.000.000 | 5.000.000 |
| France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 09-Feb-2022 | 5.500.000 | 5.514.411 | France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 24-Nov-2021 | 4.700.000 | 4.700.000 |
| France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 22-Sep-2021 | 5.500.000 | 5.500.724 | Dutch Treasury Certificate (Zero Coupon) 0.000% 29-Apr-2021 | 4.500.000 | 4.501.521 |
| France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 17-Nov-2021 | 5.000.000 | 5.013.731 | France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 04-Aug-2021 | 4.500.000 | 4.500.000 |
| French Republic Government Bond OAT 0.000% 25-May-2021 | 5.000.000 | 5.010.000 | France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 13-Oct-2021 | 4.500.000 | 4.500.000 |
| France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 02-Feb-2022 | 5.000.000 | 5.009.273 | Netherlands Government Bond '144A' 3.250% 15-Jul-2021 | 4.400.000 | 4.400.000 |
| Bundesschatzanweisungen (Zero Coupon) 0.000% 12-Mar-2021 | 5.000.000 | 5.003.800 | France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 28-Jul-2021 | 4.000.000 | 4.000.000 |
| Airbus SE (Zero Coupon) 0.000% 14-Jun-2021 | 5.000.000 | 5.000.000 | France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 01-Sep-2021 | 4.000.000 | 4.000.000 |
| France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 24-Nov-2021 | 4.700.000 | 4.707.616 | Kering SA (Zero Coupon) 0.000% 30-Sep-2022 | 3.200.000 | 3.794.475 |
| France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 13-Oct-2021 | 4.500.000 | 4.507.212 | | | |
| Dutch Treasury Certificate (Zero Coupon) 0.000% 29-Apr-2021 | 4.500.000 | 4.507.155 | | | |
| France Treasury Bill BTF (Zero Coupon) 0.000% 04-Aug-2021 | 4.500.000 | 4.503.357 | | | |
| Netherlands Government Bond '144A' 3.250% 15-Jul-2021 | 4.400.000 | 4.442.420 | | | |

BNY Mellon Asian Equity Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Wichtige Käufe | Nominal | Kosten USD | Wichtige Verkäufe | Nominal | Erlöse USD |
|---|---------|---------------|---|-----------|---------------|
| Tata Consultancy Services Ltd | 62.291 | 2.643.316 | New Oriental Education & Technology Group Inc ADR | 267.656 | 2.860.391 |
| By-health Co Ltd | 390.543 | 2.033.523 | Ilijin Materials Co Ltd | 33.801 | 2.842.177 |
| Tencent Holdings Ltd | 24.769 | 1.989.068 | Flat Glass Group Co Ltd 'H' | 754.000 | 2.735.297 |
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | 89.000 | 1.939.059 | Orocobre Ltd | 386.020 | 2.081.064 |
| Yum China Holdings Inc | 30.371 | 1.850.652 | Titan Co Ltd | 93.747 | 2.063.843 |
| LONGi Green Energy Technology Co Ltd 'A' | 111.100 | 1.849.722 | Housing Development Finance Corp Ltd | 57.551 | 2.048.730 |
| Shenzhen Inovance Technology Co Ltd | 173.000 | 1.743.243 | Samsung SDI Co Ltd | 3.410 | 1.980.756 |
| Hindustan Unilever Ltd | 50.882 | 1.658.322 | Meituan '144A' | 50.656 | 1.972.613 |
| Tencent Music Entertainment Group ADR | 90.215 | 1.611.667 | Info Edge India Ltd | 24.611 | 1.935.210 |
| Foshan Haitian Flavouring & Food Co Ltd 'A' | 94.700 | 1.572.134 | AIA Group Ltd | 148.000 | 1.805.273 |
| Samsung Electronics Co Ltd | 18.054 | 1.430.134 | Bilibili Inc ADR | 14.389 | 1.695.367 |
| Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H' | 112.500 | 1.405.017 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | 77.000 | 1.670.006 |
| Godrej Consumer Products Ltd | 120.839 | 1.277.513 | Asian Paints Ltd | 40.476 | 1.578.855 |
| LG Chem Ltd | 1.691 | 1.262.379 | Tencent Holdings Ltd | 21.097 | 1.559.756 |
| NARI Technology Co Ltd 'A' | 252.300 | 1.131.374 | Maruti Suzuki India Ltd | 15.916 | 1.547.732 |
| Vitasoy International Holdings Ltd | 317.627 | 1.106.070 | Jubilant Foodworks Ltd | 36.183 | 1.424.658 |
| Sungrow Power Supply Co Ltd | 50.100 | 1.020.686 | Xinyi Solar Holdings Ltd | 640.000 | 1.358.399 |
| Maruti Suzuki India Ltd | 9.619 | 1.006.340 | Tencent Music Entertainment Group ADR | 69.741 | 1.340.762 |
| Samsung SDI Co Ltd | 1.528 | 999.738 | Alibaba Group Holding Ltd | 49.700 | 1.186.230 |
| New Oriental Education & Technology Group Inc ADR | 9.197 | 978.774 | Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H' | 94.500 | 980.121 |
| AIA Group Ltd | 74.600 | 976.673 | Elite Material Co Ltd | 118.000 | 973.138 |
| Pharmaron Beijing Co Ltd 'H' '144A' | 49.700 | 976.034 | Vale Indonesia Tbk PT | 2.743.962 | 929.558 |
| Housing Development Finance Corp Ltd | 26.627 | 960.885 | PVR Ltd | 52.245 | 814.498 |
| Meituan '144A' | 19.510 | 867.687 | IDP Education Ltd | 41.358 | 773.098 |
| Delta Electronics Inc | 80.000 | 792.162 | Tata Consultancy Services Ltd | 14.915 | 652.681 |
| PB Fintech Ltd | 48.312 | 784.844 | NARI Technology Co Ltd 'A' | 95.300 | 608.994 |
| Alibaba Group Holding Ltd ADR | 3.014 | 748.635 | China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd | 344.500 | 599.313 |
| StarPower Semiconductor Ltd 'A' | 11.100 | 731.320 | CSL Ltd | 2.669 | 580.986 |
| Info Edge India Ltd | 10.558 | 727.383 | Autohome Inc ADR | 8.248 | 565.250 |
| Flat Glass Group Co Ltd 'H' | 189.000 | 720.930 | HDFC Bank Ltd | 25.391 | 523.822 |
| Bilibili Inc ADR | 6.805 | 678.698 | ASML Holding NV | 748 | 503.563 |
| Autohome Inc ADR | 5.695 | 591.074 | | | |
| Asian Paints Ltd | 16.239 | 574.499 | | | |
| HDFC Asset Management Co Ltd '144A' | 12.338 | 547.787 | | | |

BNY Mellon Asian Income Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Wichtige Käufe | Nominal | Kosten USD | Wichtige Verkäufe | Nominal | Erlöse USD |
|--|---------|---------------|--|-----------|---------------|
| Infosys Ltd ADR | 73.616 | 1.328.323 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | 151.000 | 3.260.427 |
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | 48.000 | 1.026.554 | Samsung Electronics Co Ltd - Preference | 45.965 | 3.078.470 |
| Samsung Electronics Co Ltd - Preference | 14.886 | 990.430 | United Overseas Bank Ltd | 98.700 | 1.954.069 |
| AIA Group Ltd | 67.000 | 828.713 | DBS Group Holdings Ltd | 82.100 | 1.796.618 |
| BHP Group Plc | 22.316 | 641.312 | Link REIT (Units) (REIT) | 148.900 | 1.417.096 |
| DBS Group Holdings Ltd | 28.500 | 613.362 | Singapore Technologies Engineering Ltd | 436.600 | 1.289.908 |
| United Overseas Bank Ltd | 30.200 | 581.765 | BHP Group Plc | 40.125 | 1.226.193 |
| Link REIT (Units) (REIT) | 56.300 | 520.944 | Insurance Australia Group Ltd | 328.955 | 1.216.914 |
| Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H' | 47.000 | 489.625 | CLP Holdings Ltd | 118.000 | 1.164.295 |
| Insurance Australia Group Ltd | 118.947 | 436.864 | Delta Electronics Inc | 103.000 | 1.076.313 |
| MediaTek Inc | 13.000 | 433.975 | Dexus (REIT) | 136.749 | 1.065.865 |
| Singapore Technologies Engineering Ltd | 145.200 | 429.065 | Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H' | 94.000 | 1.040.310 |
| CLP Holdings Ltd | 40.500 | 394.420 | Venture Corp Ltd | 67.000 | 1.021.959 |
| Venture Corp Ltd | 26.000 | 391.563 | Macquarie Korea Infrastructure Fund | 92.709 | 930.637 |
| Delta Electronics Inc | 36.000 | 370.422 | Parkway Life Real Estate Investment Trust (Units) (REIT) | 271.300 | 868.229 |
| Dexus (REIT) | 47.265 | 362.572 | Bangkok Bank PCL (Foreign Market) | 218.600 | 852.509 |
| ITC Ltd GDR | 113.941 | 320.604 | Sands China Ltd | 212.800 | 835.217 |
| Bank Central Asia Tbk PT | 162.900 | 318.328 | Infosys Ltd ADR | 45.756 | 828.439 |
| Bangkok Bank PCL (Foreign Market) | 75.600 | 295.690 | ITC Ltd GDR | 292.568 | 782.826 |
| Parkway Life Real Estate Investment Trust (Units) (REIT) | 87.300 | 271.711 | Elite Material Co Ltd | 108.000 | 744.182 |
| Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd | 4.546 | 270.753 | Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd | 11.786 | 733.854 |
| Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT | 910.295 | 257.670 | Star Entertainment Grp Ltd/The | 211.149 | 624.434 |
| Sands China Ltd | 52.000 | 239.413 | Scentre Group (REIT) | 277.075 | 601.952 |
| Elite Material Co Ltd | 36.000 | 224.635 | Mapletree North Asia Commercial Trust (REIT) | 715.000 | 558.008 |
| Star Entertainment Grp Ltd/The | 74.902 | 215.381 | Mercury NZ Ltd | 119.478 | 540.425 |
| By-health Co Ltd | 49.417 | 212.766 | Singapore Telecommunications Ltd | 296.200 | 525.767 |
| Spark New Zealand Ltd | 57.882 | 184.136 | Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT | 1.802.400 | 521.069 |
| Meridian Energy Ltd | 42.959 | 182.689 | Spark New Zealand Ltd | 154.150 | 490.543 |
| Kasikornbank PCL (Foreign Market) | 41.000 | 176.744 | SK Telecom Co Ltd | 1.728 | 478.799 |
| SK Telecom Co Ltd | 690 | 166.389 | Kasikornbank PCL (Foreign Market) | 105.600 | 459.873 |
| Telkom Indonesia Persero Tbk PT | 663.420 | 156.090 | Meridian Energy Ltd | 114.403 | 454.868 |
| Transurban Group | 14.710 | 153.005 | SKYCITY Entertainment Group Ltd | 166.210 | 409.438 |
| SKYCITY Entertainment Group Ltd | 62.411 | 151.090 | Transurban Group | 37.416 | 409.407 |
| Scentre Group (REIT) | 67.504 | 147.953 | Telkom Indonesia Persero Tbk PT | 1.703.556 | 381.232 |

BNY Mellon Blockchain Innovation Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Wichtige Käufe | Nominal | Kosten USD | Wichtige Verkäufe | Nominal | Erlöse USD |
|--|---------|---------------|-----------------------------------|---------|---------------|
| Coinbase Global Inc | 16.997 | 4.755.576 | Grayscale Bitcoin Trust BTC | 135.476 | 6.606.794 |
| MicroStrategy Inc - Class A | 6.166 | 4.690.295 | Grayscale Ethereum Trust | 109.652 | 4.148.096 |
| Kakao Corp | 25.115 | 3.709.001 | Lemonade Inc | 20.270 | 1.641.270 |
| Signature Bank/New York NY | 14.087 | 3.572.844 | PayPal Holdings Inc | 6.032 | 1.298.857 |
| Voyager Digital Ltd | 222.121 | 3.473.820 | Fintech Acquisition Corp V | 109.585 | 1.096.374 |
| Overstock.com Inc | 46.073 | 3.463.757 | Nuvei Corp '144A' | 16.951 | 1.041.676 |
| Hut 8 Mining Corp (Units) | 259.129 | 3.369.544 | Silvergate Capital Corp - Class A | 7126 | 1.039.104 |
| Unity Software Inc | 19.673 | 3.349.532 | JPMorgan Chase & Co | 5.541 | 864.208 |
| Okta Inc | 13.278 | 3.328.676 | Kakao Corp | 7.289 | 818.225 |
| EPAM Systems Inc | 5.652 | 3.314.078 | JD.com Inc ADR | 10.351 | 769.829 |
| Grayscale Ethereum Trust | 109.652 | 3.263.719 | Tencent Holdings Ltd | 7000 | 680.533 |
| Silvergate Capital Corp - Class A | 27.426 | 3.159.254 | NVIDIA Corp | 2.486 | 624.686 |
| Grayscale Bitcoin Trust BTC | 86.857 | 3.152.590 | Coinbase Global Inc | 2.399 | 605.606 |
| ROBLOX Corp | 27.284 | 3.041.034 | Alphabet Inc - Class A | 321 | 604.191 |
| ASX Ltd | 50.799 | 3.039.513 | DocuSign Inc - Class A | 3.686 | 602.325 |
| Enphase Energy Inc | 15.473 | 2.795.817 | Signature Bank/New York NY | 2.005 | 599.369 |
| Block Inc | 10.996 | 2.744.190 | Visa Inc - Class A | 2.908 | 573.926 |
| DraftKings Inc - Class A | 52.809 | 2.704.566 | ASX Ltd | 8.615 | 537.928 |
| Hive Blockchain Technologies Ltd (Units) | 676.034 | 2.563.084 | Block Inc | 2.350 | 491.702 |
| NVIDIA Corp | 9.927 | 2.446.579 | Change Healthcare Inc | 20.591 | 490.148 |
| Shopify Inc - Class A | 1.508 | 2.287.615 | Okta Inc | 2.060 | 485.685 |
| HYBE Co Ltd | 6.803 | 2.266.687 | EPAM Systems Inc | 758 | 476.763 |
| Marathon Digital Holdings Inc | 33.205 | 2.156.652 | salesforce.com Inc | 1.762 | 458.448 |
| SVB Financial Group | 3.133 | 2.115.417 | AP Moller - Maersk A/S - Class B | 137 | 427.778 |
| salesforce.com Inc | 8.242 | 2.080.216 | Starbucks Corp | 3.825 | 426.133 |
| Daimler AG | 22.122 | 2.007.308 | Enphase Energy Inc | 2.468 | 414.276 |
| AP Moller - Maersk A/S - Class B | 701 | 1.974.682 | Walmart Inc | 2.756 | 398.103 |
| BayCurrent Consulting Inc | 4.500 | 1.850.022 | Alibaba Group Holding Ltd ADR | 1.518 | 388.994 |
| Galaxy Digital Holdings Ltd | 69.964 | 1.785.801 | Microsoft Corp | 1.599 | 386.674 |
| LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE | 2.277 | 1.762.893 | | | |
| WisdomTree Investments Inc | 277.417 | 1.760.793 | | | |
| Nuvei Corp '144A' | 16.951 | 1.632.336 | | | |
| Kering SA | 1.986 | 1.632.188 | | | |
| Quest Diagnostics Inc | 11.036 | 1.618.369 | | | |
| Meta Platforms Inc - Class A | 4.532 | 1.584.793 | | | |
| SBI Holdings Inc/Japan | 56.700 | 1.529.123 | | | |
| Siemens AG ADR | 17.066 | 1.415.366 | | | |
| Lemonade Inc | 14.814 | 1.404.760 | | | |
| Funko Inc - Class A | 70.762 | 1.402.342 | | | |
| XPO Logistics Inc | 12.016 | 1.307.089 | | | |
| Figure Acquisition Corp I | 118.841 | 1.302.505 | | | |
| VPC Impact Acquisition Holdings | 104.880 | 1.293.292 | | | |
| Nasdaq Inc | 6.875 | 1.289.882 | | | |
| PayPal Holdings Inc | 4.596 | 1.250.848 | | | |
| Metropolitan Bank Holding Corp | 17.911 | 1.230.922 | | | |

BNY Mellon Brazil Equity Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Wichtige Käufe | Nominal | Kosten USD | Wichtige Verkäufe | Nominal | Erlöse USD |
|---|---------|---------------|---|---------|---------------|
| Petroleo Brasileiro SA ADR | 147.700 | 1.479.044 | Gerdau SA ADR | 529.700 | 2.863.859 |
| Vale SA ADR - Class B | 69.100 | 1.214.275 | Vale SA | 134.701 | 2.565.883 |
| Cia Brasileira de Distribuicao | 182.417 | 957.951 | Marfrig Global Foods SA | 577.902 | 2.254.349 |
| Cia Brasileira de Distribuicao ADR | 179.500 | 952.859 | EDP - Energias do Brasil SA | 550.051 | 2.010.089 |
| Bradespar SA - Preference | 136.200 | 923.709 | Hapvida Participacoes e Investimentos SA '144A' | 554.156 | 1.622.373 |
| Sul America SA (Units) | 123.186 | 872.416 | Petroleo Brasileiro SA ADR | 140.850 | 1.365.984 |
| C&A Modas Ltda | 460.623 | 851.826 | Itau Unibanco Holding SA ADR | 266.500 | 1.360.826 |
| Itau Unibanco Holding SA ADR | 144.400 | 820.354 | Cia Paranaense de Energia ADR | 243.300 | 1.304.367 |
| AES Brasil Energia SA | 367.644 | 817.622 | Banco Bradesco SA ADR | 276.700 | 1.204.122 |
| Sendas Distribuidora SA ADR | 56.100 | 773.325 | B3 SA - Brasil Bolsa Balcao | 227.200 | 1.168.123 |
| Suzano SA | 81.436 | 747.151 | Vale SA ADR - Class B | 70.500 | 1.164.407 |
| B3 SA - Brasil Bolsa Balcao | 221.958 | 694.119 | Lojas Americanas SA | 632.524 | 1.036.556 |
| Banco Bradesco SA ADR | 126.500 | 620.956 | Banco do Brasil SA | 180.600 | 1.035.753 |
| Rede D'Or Sao Luiz SA '144A' | 45.946 | 586.659 | Cia Brasileira de Distribuicao | 139.600 | 992.825 |
| YDUQS Participacoes SA | 120.099 | 567.552 | Americanas SA | 69.000 | 964.683 |
| Banco do Brasil SA | 81.700 | 538.287 | Petroleo Brasileiro SA - Preference | 189.079 | 945.160 |
| Lojas Americanas SA - Preference | 463.800 | 531.680 | Sendas Distribuidora SA ADR | 59.300 | 923.200 |
| Atacadao SA | 139.536 | 512.898 | Santos Brasil Participacoes SA | 660.900 | 888.031 |
| Marfrig Global Foods SA | 143.900 | 500.027 | Cia Paranaense de Energia ADR | 537.300 | 876.271 |
| Hapvida Participacoes e Investimentos SA '144A' | 174.647 | 485.846 | Grupo Mateus SA | 637.214 | 863.243 |
| Vale SA | 34.069 | 476.054 | Petroleo Brasileiro SA ADR | 87.750 | 859.414 |
| TIM SA/Brazil | 187.192 | 474.068 | Vibra Energia SA | 161.700 | 720.390 |
| Santos Brasil Participacoes SA | 298.300 | 444.639 | Embraer SA ADR | 58.325 | 698.404 |
| Vibra Energia SA | 83.420 | 425.165 | BR Malls Participacoes SA | 363.000 | 644.127 |
| Gerdau SA ADR | 71.600 | 417.503 | Bradespar SA - Preference | 52.703 | 634.631 |
| Lojas Americanas SA | 136.493 | 374.613 | Atacadao SA | 158.000 | 577.168 |
| Americanas SA | 26.300 | 359.952 | Telefonica Brasil SA ADR | 67.200 | 556.172 |
| Petroleo Brasileiro SA ADR | 29.150 | 336.878 | Cia Brasileira de Distribuicao ADR | 82.900 | 513.025 |
| BR Malls Participacoes SA | 163.800 | 323.892 | Sul America SA (Units) | 82.800 | 500.929 |
| Embraer SA ADR | 19.425 | 312.603 | Americanas SA | 63.508 | 482.255 |
| Light SA | 88.129 | 310.594 | Cia Energetica de Sao Paulo - Preference | 98.800 | 475.707 |
| Telefonica Brasil SA ADR | 30.300 | 267.364 | TIM SA/Brazil | 201.900 | 473.855 |
| EDP - Energias do Brasil SA | 69.800 | 258.342 | JBS SA | 74.600 | 466.548 |
| Cia Energetica de Sao Paulo - Preference | 44.700 | 215.401 | Sendas Distribuidora SA | 129.055 | 464.226 |

BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund* für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Alle Käufe | Nominal | Kosten USD | Alle Verkäufe und Fälligkeiten | Nominal | Erlöse USD |
|--|-----------|---------------|--|-----------|---------------|
| United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0,000% 19-May-2022 | 5.059.000 | 5.057.472 | United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0,000% 30-Dec-2021 | 2.600.000 | 2.599.950 |
| United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0,000% 16-Jun-2022 | 3.400.000 | 3.397.941 | United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0,000% 19-May-2022 | 2.600.000 | 2.598.944 |
| United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0,000% 30-Dec-2021 | 2.600.000 | 2.599.688 | United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0,000% 16-Dec-2021 | 1.700.000 | 1.700.000 |
| United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0,000% 16-Dec-2021 | 1.700.000 | 1.699.930 | Microchip Technology Inc | 2 | 83 |
| United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0,000% 06-Jan-2022 | 1.700.000 | 1.699.891 | Electrolux AB | 1 | 25 |
| United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0,000% 20-Jan-2022 | 1.700.000 | 1.699.881 | Electrolux AB | 1 | 2 |
| United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0,000% 27-Jan-2022 | 1.700.000 | 1.699.861 | | | |
| United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0,000% 17-Feb-2022 | 1.700.000 | 1.699.819 | | | |
| United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0,000% 24-Feb-2022 | 1.700.000 | 1.699.784 | Obiges stellt die vollständigen Angaben zu den Verkäufen des Fonds im Geschäftsjahr dar. | | |
| United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0,000% 24-Mar-2022 | 1.700.000 | 1.699.720 | | | |
| United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0,000% 31-Mar-2022 | 1.700.000 | 1.699.674 | | | |
| United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0,000% 21-Apr-2022 | 1.700.000 | 1.699.624 | | | |
| United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0,000% 28-Apr-2022 | 1.700.000 | 1.699.592 | | | |

Obiges stellt die vollständigen Angaben zu den Käufen des Fonds im Geschäftsjahr dar.

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

BNY Mellon Dynamic Total Return Fund* für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Alle Käufe | Nominal | Kosten USD | Alle Verkäufe und Fälligkeiten | Nominal | Erlöse USD |
|--|-----------|---------------|--|-----------|---------------|
| United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 15-Jul-2021 | 1.527.000 | 1.526.345 | United States Cash Management Bill 0.000% 25-Feb-2021 | 1.721.000 | 1.720.923 |
| United States Cash Management Bill 0.000% 12-Aug-2021 | 955.000 | 954.785 | United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 01-Apr-2021 | 1.653.000 | 1.652.885 |
| United States Cash Management Bill 0.000% 25-Feb-2021 | 425.000 | 424.967 | United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 17-Jun-2021 | 1.568.000 | 1.567.667 |
| United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 01-Apr-2021 | 300.000 | 299.994 | United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 15-Jul-2021 | 1.527.000 | 1.526.626 |
| United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 20-May-2021 | 212.000 | 211.943 | United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 20-May-2021 | 1.478.000 | 1.477.781 |
| United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 17-Jun-2021 | 212.000 | 211.929 | United States Cash Management Bill 0.000% 04-Mar-2021 | 1.418.000 | 1.417.937 |
| United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 24-Jun-2021 | 95.000 | 94.991 | United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 29-Apr-2021 | 1.413.000 | 1.412.819 |
| | | | United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 14-Jan-2021 | 1.273.000 | 1.273.000 |
| | | | SPDR Bloomberg Barclays Short Term High Yield Bond ETF - ETF | 46.244 | 1.254.409 |
| | | | United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 22-Apr-2021 | 1.142.000 | 1.141.888 |
| | | | United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 11-Feb-2021 | 1.127.000 | 1.126.979 |
| | | | United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 12-Aug-2021 | 955.000 | 954.821 |
| | | | iShares Diversified Commodity Swap UCITS ETF - ETF | 68.438 | 356.593 |

Obiges stellt die vollständigen Angaben zu den Käufen des Fonds im Geschäftsjahr dar.

Obiges stellt die vollständigen Angaben zu den Verkäufen des Fonds im Geschäftsjahr dar.

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Wichtige Käufe | Nominal | Kosten USD | Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten | Nominal | Erlöse USD |
|---|-----------|---------------|---|-----------|---------------|
| United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 24-Feb-2022 | 9.000.000 | 8.997.862 | United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 04-Mar-2021 | 9.000.000 | 9.000.000 |
| United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 26-Aug-2021 | 9.000.000 | 8.997.616 | United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 26-Aug-2021 | 9.000.000 | 9.000.000 |
| Apple Inc | 41.118 | 6.409.207 | Apple Inc | 61.392 | 8.313.383 |
| Microsoft Corp | 20.111 | 6.278.132 | Microsoft Corp | 27.857 | 7.360.396 |
| United States Treasury Bill - When Issued 0.000% 23-Sep-2021 | 6.000.000 | 5.999.213 | United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 25-Feb-2021 | 6.035.000 | 6.035.000 |
| United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 24-Mar-2022 | 6.000.000 | 5.998.802 | United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 01-Apr-2021 | 6.000.000 | 6.000.000 |
| United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 02-Dec-2021 | 5.000.000 | 4.999.347 | United States Treasury Bill - When Issued 0.000% 23-Sep-2021 | 6.000.000 | 6.000.000 |
| United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 26-May-2022 | 5.000.000 | 4.997.727 | Amazon.com Inc | 1.543 | 5.162.291 |
| Amazon.com Inc | 1.279 | 4.298.441 | United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 17-Jun-2021 | 5.000.000 | 5.000.000 |
| United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 07-Oct-2021 | 3.000.000 | 2.999.738 | United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 02-Dec-2021 | 5.000.000 | 5.000.000 |
| United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 04-Nov-2021 | 3.000.000 | 2.999.727 | United States Cash Management Bill - Reopening (Zero Coupon) 0.000% 15-Jul-2021 | 3.000.000 | 3.000.000 |
| United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 06-Jan-2022 | 3.000.000 | 2.999.431 | United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 14-Jan-2021 | 3.000.000 | 3.000.000 |
| United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 27-Jan-2022 | 3.000.000 | 2.999.377 | United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 04-Feb-2021 | 3.000.000 | 3.000.000 |
| United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 30-Dec-2021 | 3.000.000 | 2.999.356 | United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 11-Feb-2021 | 3.000.000 | 3.000.000 |
| United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 31-Mar-2022 | 3.000.000 | 2.999.278 | United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 29-Apr-2021 | 3.000.000 | 3.000.000 |
| United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 12-Aug-2021 | 3.000.000 | 2.999.173 | United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 20-May-2021 | 3.000.000 | 3.000.000 |
| United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 29-Jul-2021 | 3.000.000 | 2.999.096 | United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 29-Jul-2021 | 3.000.000 | 3.000.000 |
| United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 28-Apr-2022 | 3.000.000 | 2.999.059 | United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 12-Aug-2021 | 3.000.000 | 3.000.000 |
| United States Cash Management Bill - Reopening (Zero Coupon) 0.000% 15-Jul-2021 | 3.000.000 | 2.998.681 | United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 07-Oct-2021 | 3.000.000 | 3.000.000 |
| United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 16-Jun-2022 | 3.000.000 | 2.998.292 | United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 04-Nov-2021 | 3.000.000 | 3.000.000 |
| Tesla Inc | 2.813 | 2.302.659 | United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 30-Dec-2021 | 3.000.000 | 3.000.000 |
| Alphabet Inc - Class A | 800 | 2.232.055 | Meta Platforms Inc - Class A | 8.917 | 2.813.291 |
| Meta Platforms Inc - Class A | 6.255 | 2.136.664 | Alphabet Inc | 1.148 | 2.751.188 |
| Alphabet Inc | 744 | 2.091.555 | Alphabet Inc - Class A | 1.093 | 2.572.289 |
| | | | Berkshire Hathaway Inc - Class B | 8.276 | 2.208.412 |

BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Wichtige Käufe | Nominal | Kosten USD | Wichtige Verkäufe | Nominal | Erlöse USD |
|--|-----------|---------------|--|-----------|---------------|
| Brookfield Property REIT Inc / BPR Cumulus LLC / BPR Nimbus LLC / GCSI Sellco LL '144A' 4.500% 01-Apr-2027 | 2.580.000 | 2.580.000 | Brookfield Property REIT Inc / BPR Cumulus LLC / BPR Nimbus LLC / GCSI Sellco LL '144A' 4.500% 01-Apr-2027 | 2.450.000 | 2.388.150 |
| Uniti Group LP / Uniti Fiber Holdings Inc / CSL Capital LLC '144A' 6.000% 15-Jan-2030 | 1.315.000 | 1.315.000 | WMG Acquisition Corp '144A' 3.750% 01-Dec-2029 | 1.200.000 | 1.196.190 |
| WMG Acquisition Corp '144A' 3.750% 01-Dec-2029 | 1.300.000 | 1.288.885 | Uniti Group LP / Uniti Fiber Holdings Inc / CSL Capital LLC '144A' 6.000% 15-Jan-2030 | 1.140.000 | 1.092.452 |
| LD Holdings Group LLC '144A' 6.125% 01-Apr-2028 | 1.185.000 | 1.183.411 | HAT Holdings I LLC / HAT Holdings II LLC '144A' 3.375% 15-Jun-2026 | 1.050.000 | 1.059.743 |
| American Axle & Manufacturing Inc 5.000% 01-Oct-2029 | 1.115.000 | 1.115.000 | LD Holdings Group LLC '144A' 6.125% 01-Apr-2028 | 1.058.000 | 1.051.512 |
| HAT Holdings I LLC / HAT Holdings II LLC '144A' 3.375% 15-Jun-2026 | 1.115.000 | 1.115.000 | American Axle & Manufacturing Inc 5.000% 01-Oct-2029 | 1.030.000 | 1.026.215 |
| Cinemark USA Inc '144A' 5.250% 15-Jul-2028 | 985.000 | 984.256 | Cinemark USA Inc '144A' 5.250% 15-Jul-2028 | 940.000 | 909.411 |
| Canpack SA / Canpack US LLC '144A' 1.000% 15-Nov-2029 | 860.000 | 860.000 | Canpack SA / Canpack US LLC '144A' 3.875% 15-Nov-2029 | 860.000 | 850.388 |
| Delek Logistics Partners LP / Delek Logistics Finance Corp '144A' 7.125% 01-Jun-2028 | 790.000 | 790.000 | Delek Logistics Partners LP / Delek Logistics Finance Corp '144A' 7.125% 01-Jun-2028 | 705.000 | 729.071 |
| Jaguar Land Rover Automotive Plc '144A' 5.500% 15-Jul-2029 | 765.000 | 765.000 | Uber Technologies Inc '144A' 4.500% 15-Aug-2029 | 650.000 | 650.268 |
| Uber Technologies Inc '144A' 4.500% 15-Aug-2029 | 765.000 | 765.000 | Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC / Hilton Grand Vacations Borrower Esc '144A' 5.000% 01-Jun-2029 | 627.000 | 633.437 |
| DISH DBS Corp '144A' 1.000% 01-Jun-2029 | 735.000 | 735.000 | Patrick Industries Inc '144A' 4.750% 01-May-2029 | 600.000 | 599.846 |
| Sirius XM Radio Inc '144A' 4.000% 15-Jul-2028 | 720.000 | 724.107 | Jaguar Land Rover Automotive Plc '144A' 5.500% 15-Jul-2029 | 550.000 | 555.836 |
| Rakuten Group Inc 'REGS' FRN (Perpetual) 4.250% 22-Apr-2027 | 600.000 | 722.853 | Consensus Cloud Solutions Inc '144A' 6.000% 15-Oct-2026 | 530.000 | 542.595 |
| Altice France SA/France '144A' 5.125% 15-Jul-2029 | 700.000 | 700.000 | Sirius XM Radio Inc '144A' 4.000% 15-Jul-2028 | 530.000 | 541.786 |
| Patrick Industries Inc '144A' 4.750% 01-May-2029 | 700.000 | 700.000 | Carvana Co '144A' 4.875% 01-Sep-2029 | 510.000 | 507.971 |
| Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC / Hilton Grand Vacations Borrower Esc '144A' 5.000% 01-Jun-2029 | 695.000 | 697.332 | DISH DBS Corp '144A' 5.125% 01-Jun-2029 | 500.000 | 496.100 |
| Carvana Co '144A' 4.875% 01-Sep-2029 | 650.000 | 650.000 | Altice France SA/France '144A' 5.125% 15-Jul-2029 | 500.000 | 490.690 |
| Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp '144A' 6.000% 01-Sep-2031 | 575.000 | 575.000 | Arko Corp '144A' 5.125% 15-Nov-2029 | 500.000 | 487.660 |
| Arko Corp '144A' 5.125% 15-Nov-2029 | 565.000 | 565.000 | Rakuten Group Inc 'REGS' FRN (Perpetual) 4.250% 22-Apr-2027 | 400.000 | 474.282 |

BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Wichtige Käufe | Nominal | Kosten USD | Wichtige Verkäufe | Nominal | Erlöse USD |
|---|---------|---------------|--|---------|---------------|
| Broadcom Inc '144A' 2.600% 15-Feb-2033 | 400.000 | 399.088 | Broadcom Inc '144A' 3.750% 15-Feb-2051 | 395.000 | 403.647 |
| Broadcom Inc '144A' 3.750% 15-Feb-2051 | 400.000 | 398.272 | Broadcom Inc '144A' 2.600% 15-Feb-2033 | 390.000 | 387.925 |
| Toyota Motor Credit Corp 'GMTN' 1.650% 10-Jan-2031 | 300.000 | 299.751 | Toyota Motor Credit Corp 'GMTN' 1.650% 10-Jan-2031 | 300.000 | 297.353 |
| Bank of Montreal 'MTN' FRN 0.949% 22-Jan-2027 | 200.000 | 200.000 | Enel SpA 'EMTN' 5.750% 22-Jun-2037 | 100.000 | 203.721 |
| General Motors Financial Co Inc 2.350% 08-Jan-2031 | 200.000 | 200.000 | Air Lease Corp 'GMTN' 0.700% 15-Feb-2024 | 200.000 | 198.505 |
| Air Lease Corp 'GMTN' 0.700% 15-Feb-2024 | 200.000 | 198.672 | General Motors Financial Co Inc 2.350% 08-Jan-2031 | 200.000 | 197.167 |
| JPMorgan Chase & Co FRN 1.953% 04-Feb-2032 | 150.000 | 150.000 | Bank of Montreal 'MTN' FRN 0.949% 22-Jan-2027 | 195.000 | 194.749 |
| Ryanair DAC 'EMTN' 2.875% 15-Sep-2025 | 100.000 | 130.987 | Heathrow Funding Ltd 'EMTN' 6.750% 03-Dec-2026 | 100.000 | 176.337 |
| Italgas SpA 'EMTN' 1.625% 19-Jan-2027 | 100.000 | 128.915 | AT&T Inc 3.550% 17-Dec-2032 | 100.000 | 153.465 |
| Volkswagen Bank GmbH 'EMTN' 2.500% 31-Jul-2026 | 100.000 | 124.136 | Philip Morris International Inc 3.125% 03-Jun-2033 | 100.000 | 151.364 |
| Unibail-Rodamco-Westfield SE 'EMTN' 1.375% 04-Dec-2031 | 100.000 | 122.998 | Hutchison Whampoa International 03/33 Ltd '144A' 7.450% 24-Nov-2033 | 95.000 | 148.148 |
| Societe Generale SA 'EMTN' 1.750% 22-Mar-2029 | 100.000 | 122.640 | JPMorgan Chase & Co FRN 1.953% 04-Feb-2032 | 150.000 | 146.783 |
| Wintershall Dea Finance BV 0.840% 25-Sep-2025 | 100.000 | 122.497 | Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen FRN 3.250% 26-May-2049 | 100.000 | 143.291 |
| AT&T Inc 1.800% 05-Sep-2026 | 100.000 | 120.835 | AbbVie Inc 2.125% 17-Nov-2028 | 100.000 | 137.084 |
| Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN' 1.875% 04-Nov-2026 | 100.000 | 120.214 | McDonald's Corp 'GMTN' 1.750% 03-May-2028 | 100.000 | 136.033 |
| Credit Agricole SA 'EMTN' 2.000% 25-Mar-2029 | 100.000 | 120.104 | AXA SA 'EMTN' FRN 5.125% 04-Jul-2043 | 100.000 | 135.255 |
| BP Capital Markets PLC FRN (Perpetual) 3.250% 22-Jun-2170 | 100.000 | 119.770 | Apple Inc 1.625% 10-Nov-2026 | 100.000 | 134.224 |
| Verizon Communications Inc 1.375% 27-Oct-2026 | 100.000 | 119.711 | Verizon Communications Inc 1.875% 26-Oct-2029 | 100.000 | 133.573 |
| TotalEnergies SE 'EMTN' FRN (Perpetual) 2.625% 26-Feb-2025 | 100.000 | 118.405 | Barclays PLC 'EMTN' FRN 3.375% 02-Apr-2025 | 100.000 | 133.123 |
| Altea SCA 1.875% 17-Jan-2028 | 100.000 | 118.311 | Mondelez International Inc 1.625% 08-Mar-2027 | 100.000 | 131.907 |

BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Wichtige Käufe | Nominal | Kosten USD | Wichtige Verkäufe | Nominal | Erlöse USD |
|--|------------|---------------|--|------------|---------------|
| Carnival Corp '144A' 11.500% 01-Apr-2023 | 70.840.000 | 80.726.322 | Carnival Corp '144A' 11.500% 01-Apr-2023 | 88.740.000 | 100.444.281 |
| Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 11.500% 01-Jun-2025 | 46.534.000 | 54.159.577 | Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 11.500% 01-Jun-2025 | 43.256.000 | 48.913.234 |
| Perrigo Finance Unlimited Co 4.375% 15-Mar-2026 | 33.235.000 | 35.787.712 | Howmet Aerospace Inc 6.875% 01-May-2025 | 27.311.000 | 31.807.275 |
| Nordstrom Inc 5.000% 15-Jan-2044 | 35.810.000 | 35.273.260 | CF Industries Inc 5.375% 15-Mar-2044 | 23.000.000 | 29.558.950 |
| Perrigo Finance Unlimited Co 3.900% 15-Jun-2030 | 33.767.000 | 34.514.259 | Nordstrom Inc 5.000% 15-Jan-2044 | 27.000.000 | 26.745.317 |
| Howmet Aerospace Inc 6.875% 01-May-2025 | 26.106.000 | 30.491.750 | CF Industries Inc 4.950% 01-Jun-2043 | 17.300.000 | 20.857.720 |
| Perrigo Finance Unlimited Co 3.900% 15-Dec-2024 | 25.898.000 | 27.398.124 | Ovintiv Inc 6.625% 15-Aug-2037 | 13.690.000 | 17.930.577 |
| Methanex Corp 5.250% 15-Dec-2029 | 22.933.000 | 24.858.122 | ArcelorMittal SA 4.550% 11-Mar-2026 | 15.794.000 | 17.767.932 |
| Royal Caribbean Cruises Ltd '144A' 10.875% 01-Jun-2023 | 19.388.000 | 22.212.592 | Ovintiv Inc 6.500% 15-Aug-2034 | 13.578.000 | 17.692.465 |
| Newell Brands Inc 4.700% 01-Apr-2026 | 19.763.000 | 22.058.788 | ArcelorMittal SA 3.600% 16-Jul-2024 | 15.320.000 | 16.371.580 |
| Western Midstream Operating LP 4.350% 01-Feb-2025 | 20.886.000 | 21.999.488 | Newell Brands Inc 4.700% 01-Apr-2026 | 15.191.000 | 16.313.873 |
| Howmet Aerospace Inc 5.125% 01-Oct-2024 | 19.705.000 | 21.758.200 | Ovintiv Inc 6.500% 01-Feb-2038 | 12.107.000 | 15.856.313 |
| Nordstrom Inc 4.250% 01-Aug-2031 | 20.910.000 | 21.334.473 | ArcelorMittal SA 7.000% 15-Oct-2039 | 10.822.000 | 15.434.230 |
| Seagate HDD Cayman 4.875% 01-Jun-2027 | 18.370.000 | 20.539.025 | Ovintiv Exploration Inc 5.625% 01-Jul-2024 | 13.720.000 | 15.056.000 |
| FirstEnergy Corp 7.375% 15-Nov-2031 | 14.800.000 | 20.258.441 | Kraft Heinz Foods Co 4.625% 30-Jan-2029 | 13.071.000 | 15.045.193 |
| Vodafone Group Plc FRN 7.000% 04-Apr-2079 | 16.487.000 | 20.208.860 | Western Midstream Operating LP 4.350% 01-Feb-2025 | 14.225.000 | 14.936.250 |
| Howmet Aerospace Inc 5.950% 01-Feb-2037 | 16.489.000 | 20.181.957 | Apache Corp 4.750% 15-Apr-2043 | 14.370.000 | 14.902.225 |
| Seagate HDD Cayman 4.875% 01-Mar-2024 | 16.970.000 | 18.352.233 | EPR Properties 3.750% 15-Aug-2029 | 14.050.000 | 14.349.112 |
| Ovintiv Inc 6.625% 15-Aug-2037 | 13.690.000 | 17.928.238 | American Airlines 2013-2 Class A Pass Through Trust 4.950% 15-Jan-2023 | 13.746.518 | 13.758.390 |
| Ovintiv Inc 6.500% 15-Aug-2034 | 13.578.000 | 17.498.936 | Methanex Corp 5.250% 15-Dec-2029 | 12.171.000 | 13.376.210 |

BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Wichtige Käufe | Nominal | Kosten USD | Wichtige Verkäufe | Nominal | Erlöse USD |
|--|-----------|------------|--|-----------|------------|
| Brookfield Property REIT Inc / BPR Cumulus LLC / BPR Nimbus LLC / GCSI Sellco LL '144A' 4.500% 01-Apr-2027 | 8.635.000 | 8.635.000 | Brookfield Property REIT Inc / BPR Cumulus LLC / BPR Nimbus LLC / GCSI Sellco LL '144A' 4.500% 01-Apr-2027 | 7.834.000 | 7.689.822 |
| LD Holdings Group LLC '144A' 6.125% 01-Apr-2028 | 6.525.000 | 6.525.000 | LD Holdings Group LLC '144A' 6.125% 01-Apr-2028 | 6.310.000 | 6.406.061 |
| American Axle & Manufacturing Inc 5.000% 01-Oct-2029 | 5.065.000 | 5.065.000 | American Axle & Manufacturing Inc 5.000% 01-Oct-2029 | 5.065.000 | 5.029.680 |
| WMG Acquisition Corp '144A' 3.750% 01-Dec-2029 | 5.100.000 | 5.056.395 | AMC Networks Inc 4.250% 15-Feb-2029 | 4.515.000 | 4.443.787 |
| AMC Networks Inc 4.250% 15-Feb-2029 | 4.825.000 | 4.822.288 | WMG Acquisition Corp '144A' 3.750% 01-Dec-2029 | 4.430.000 | 4.413.388 |
| Uniti Group LP / Uniti Fiber Holdings Inc / CSL Capital LLC '144A' 6.000% 15-Jan-2030 | 4.405.000 | 4.405.000 | Jaguar Land Rover Automotive Plc '144A' 5.875% 15-Jan-2028 | 4.240.000 | 4.323.000 |
| HAT Holdings I LLC / HAT Holdings II LLC '144A' 3.375% 15-Jun-2026 | 4.400.000 | 4.400.000 | HAT Holdings I LLC / HAT Holdings II LLC '144A' 3.375% 15-Jun-2026 | 3.950.000 | 3.992.040 |
| Altice France SA/France '144A' 5.125% 15-Jul-2029 | 4.180.000 | 4.182.670 | Patrick Industries Inc '144A' 4.750% 01-May-2029 | 3.880.000 | 3.893.571 |
| SBA Communications Corp '144A' 3.125% 01-Feb-2029 | 4.175.000 | 4.170.476 | Cinemark USA Inc '144A' 5.250% 15-Jul-2028 | 3.780.000 | 3.759.385 |
| Patrick Industries Inc '144A' 4.750% 01-May-2029 | 3.980.000 | 3.980.000 | Uniti Group LP / Uniti Fiber Holdings Inc / CSL Capital LLC '144A' 6.000% 15-Jan-2030 | 3.727.000 | 3.582.759 |
| Cinemark USA Inc '144A' 5.250% 15-Jul-2028 | 3.870.000 | 3.865.602 | SBA Communications Corp '144A' 3.125% 01-Feb-2029 | 3.440.000 | 3.391.241 |
| Jaguar Land Rover Automotive Plc '144A' 5.500% 15-Jul-2029 | 3.465.000 | 3.465.000 | Jaguar Land Rover Automotive Plc '144A' 5.500% 15-Jul-2029 | 3.300.000 | 3.323.630 |
| Mohegan Gaming & Entertainment '144A' 8.000% 01-Feb-2026 | 3.410.000 | 3.426.227 | Yum! Brands Inc 4.625% 31-Jan-2032 | 3.134.000 | 3.257.290 |
| Yum! Brands Inc 4.625% 31-Jan-2032 | 3.350.000 | 3.392.261 | Altice France SA/France '144A' 5.125% 15-Jul-2029 | 3.020.000 | 3.024.086 |
| Uber Technologies Inc '144A' 4.500% 15-Aug-2029 | 3.345.000 | 3.345.000 | Canpack SA / Canpack US LLC '144A' 3.875% 15-Nov-2029 | 2.980.000 | 2.966.960 |
| DISH DBS Corp '144A' 5.125% 01-Jun-2029 | 3.310.000 | 3.310.000 | Mohegan Gaming & Entertainment '144A' 8.000% 01-Feb-2026 | 2.770.000 | 2.796.464 |
| Carnival Corp '144A' 5.750% 01-Mar-2027 | 3.160.000 | 3.207.767 | Ford Motor Co 8.500% 21-Apr-2023 | 2.485.000 | 2.749.185 |
| Canpack SA / Canpack US LLC '144A' 3.875% 15-Nov-2029 | 2.980.000 | 2.980.000 | Carnival Corp '144A' 11.500% 01-Apr-2023 | 2.393.000 | 2.729.025 |
| Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp '144A' 5.250% 15-May-2027 | 2.897.000 | 2.957.624 | Murphy Oil Corp 6.375% 15-Jul-2028 | 2.665.000 | 2.716.496 |
| Carvana Co '144A' 4.875% 01-Sep-2029 | 2.930.000 | 2.930.000 | Delek Logistics Partners LP / Delek Logistics Finance Corp '144A' 7.125% 01-Jun-2028 | 2.580.000 | 2.678.624 |

BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Wichtige Käufe | Nominal | Kosten USD | Wichtige Verkäufe | Nominal | Erlöse USD |
|--|-------------|---------------|--|-------------|---------------|
| Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund | 512.589.600 | 512.589.600 | Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund | 491.737.171 | 491.737.171 |
| Becle SAB de CV 'REGS' 2.500% 14-Oct-2031 | 15.000.000 | 14.846.400 | Petroleos Mexicanos 6.950% 28-Jan-2060 | 14.430.000 | 12.929.291 |
| Petroleos del Peru SA 5.625% 19-Jun-2047 | 9.710.000 | 10.922.546 | Eskom Holdings SOC Ltd 'REGS' 8.450% 10-Aug-2028 | 11.000.000 | 12.305.000 |
| Orbia Advance Corp SAB de CV 'REGS' 2.875% 11-May-2031 | 10.916.000 | 10.894.195 | Petroleos del Peru SA 5.625% 19-Jun-2047 | 9.710.000 | 10.732.079 |
| Credito Real SAB de CV SOFOM ER 'REGS' 8.000% 21-Jan-2028 | 10.230.000 | 9.770.000 | CSN Inova Ventures 'REGS' 6.750% 28-Jan-2028 | 9.300.000 | 10.008.900 |
| Ecopetrol SA 5.875% 28-May-2045 | 8.700.000 | 9.594.740 | Metinvest BV 'REGS' 5.625% 17-Jun-2025 | 7.400.000 | 9.250.125 |
| Petroleos Mexicanos 6.950% 28-Jan-2060 | 10.130.000 | 9.334.205 | Petrobras Global Finance BV 5.600% 03-Jan-2031 | 7.794.000 | 8.734.521 |
| Minerva Luxembourg SA 'REGS' 4.375% 18-Mar-2031 | 9.000.000 | 8.910.180 | Boubyan Tier 1 Sukuk Ltd FRN (Perpetual) 3.950% 01-Oct-2169 | 8.500.000 | 8.545.775 |
| Fortune Star BVI Ltd 3.950% 02-Oct-2026 | 7.400.000 | 8.817.130 | lochpe-Maxion Austria GmbH / Maxion Wheels de Mexico S de RL de CV 'REGS' 5.000% 07-May-2028 | 8.000.000 | 8.011.400 |
| Türkiye ihracat Kredi Bankasi AS 'REGS' 5.750% 06-Jul-2026 | 8.800.000 | 8.752.656 | Banque Ouest Africaine de Developpement 'REGS' 2.750% 22-Jan-2033 | 6.000.000 | 7.493.951 |
| Qatar Energy 'REGS' 2.250% 12-Jul-2031 | 8.620.000 | 8.572.259 | Petroleos Mexicanos 7.690% 23-Jan-2050 | 7.700.000 | 7.354.250 |
| Boubyan Tier 1 Sukuk Ltd FRN (Perpetual) 3.950% 01-Oct-2169 | 8.500.000 | 8.500.000 | VTR Comunicaciones SpA '144A' 4.375% 15-Apr-2029 | 7.200.000 | 7.285.750 |
| NBK SPC Ltd 'REGS' FRN 1.625% 15-Sep-2027 | 8.500.000 | 8.459.030 | Türkiye ihracat Kredi Bankasi AS 'REGS' 5.750% 06-Jul-2026 | 7.100.000 | 7.105.850 |
| Doha Finance Ltd 'EMTN' 2.375% 31-Mar-2026 | 8.200.000 | 8.178.516 | United Overseas Bank Ltd 'REGS' FRN 2.000% 14-Oct-2031 | 7.000.000 | 7.003.753 |
| GCM Mining Corp 'REGS' 6.875% 09-Aug-2026 | 8.000.000 | 7.958.400 | Light Servicios de Eletricidade SA/Light Energia SA 'REGS' 4.375% 18-Jun-2026 | 6.890.000 | 6.881.573 |
| Bank of Cyprus Holdings Plc 'EMTN' FRN 6.625% 23-Oct-2031 | 6.585.000 | 7.954.256 | Braskem Idesa SAPI 'REGS' 7.450% 15-Nov-2029 | 6.800.000 | 6.783.100 |
| lochpe-Maxion Austria GmbH / Maxion Wheels de Mexico S de RL de CV 'REGS' 5.000% 07-May-2028 | 8.000.000 | 7.946.060 | Minerva Luxembourg SA 'REGS' 4.375% 18-Mar-2031 | 6.400.000 | 6.345.680 |
| Credit Bank of Moscow Via CBOM Finance Plc 'REGS' 3.875% 21-Sep-2026 | 7.900.000 | 7.900.000 | Doha Finance Ltd 'EMTN' 2.375% 31-Mar-2026 | 6.200.000 | 6.240.600 |
| Rumo Luxembourg Sarl 'REGS' 4.200% 18-Jan-2032 | 7.930.000 | 7.897.566 | Movida Europe SA 'REGS' 5.250% 08-Feb-2031 | 6.000.000 | 5.997.500 |
| UltraTech Cement Ltd 'REGS' 2.800% 16-Feb-2031 | 8.000.000 | 7.830.330 | Braskem Netherlands Finance BV 'REGS' 4.500% 31-Jan-2030 | 5.800.000 | 5.917.610 |

BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Wichtige Käufe | Nominal | Kosten USD | Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten | Nominal | Erlöse USD |
|---|---------|------------|---|---------|------------|
| Republic of Kenya Government International Bond 'REGS' 6.300% 23-Jan-2034 | 550.000 | 549.951 | Orazul Energy Egenor SCA 'REGS' 5.625% 28-Apr-2027 | 625.000 | 629.855 |
| Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd 'REGS' 2.300% 08-Jan-2031 | 475.000 | 472.559 | Bank of Georgia JSC 'REGS' 6.000% 26-Jul-2023 | 525.000 | 553.609 |
| Costa Rica Government International Bond 'REGS' 6.125% 19-Feb-2031 | 400.000 | 416.980 | Senegal Government International Bond 'REGS' 4.750% 13-Mar-2028 | 385.000 | 502.949 |
| SA Global Sukuk Ltd 'REGS' 2.694% 17-Jun-2031 | 400.000 | 400.000 | Republic of Kenya Government International Bond 'REGS' 7.250% 28-Feb-2028 | 440.000 | 491.744 |
| Turkey Government International Bond 5.950% 15-Jan-2031 | 375.000 | 363.169 | NBM US Holdings Inc 'REGS' 7.000% 14-May-2026 | 450.000 | 479.425 |
| Panama Government International Bond 2.252% 29-Sep-2032 | 350.000 | 351.901 | Mongolia Government International Bond 'REGS' 5.125% 07-Apr-2026 | 400.000 | 433.500 |
| Ivory Coast Government International Bond 'REGS' 6.625% 22-Mar-2048 | 250.000 | 336.390 | Vnesheconombank Via VEB Finance PLC 'RegS' 6.025% 05-Jul-2022 | 402.000 | 426.535 |
| Comision Federal de Electricidad 'REGS' 3.348% 09-Feb-2031 | 325.000 | 325.000 | Cosan SA 'REGS' 5.500% 20-Sep-2029 | 395.000 | 426.106 |
| Egypt Government International Bond 'REGS' 5.875% 16-Feb-2031 | 300.000 | 300.000 | Turkey Government International Bond 6.250% 26-Sep-2022 | 400.000 | 416.190 |
| Egypt Government International Bond 'REGS' 7.500% 16-Feb-2061 | 300.000 | 300.000 | Petrobras Global Finance BV 5.625% 20-May-2043 | 385.000 | 401.463 |
| Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd 'REGS' 1.450% 08-Jan-2026 | 300.000 | 299.598 | Vnesheconombank Via VEB Finance PLC 'REGS' 6.800% 22-Nov-2025 | 325.000 | 384.735 |
| CBQ Finance Ltd 'EMTN' 2.000% 12-May-2026 | 300.000 | 299.235 | Mexico Government International Bond 2.659% 24-May-2031 | 362.000 | 361.167 |
| Indonesia Government International Bond 1.850% 12-Mar-2031 | 275.000 | 273.730 | Tencent Holdings Ltd 'REGS' 3.975% 11-Apr-2029 | 325.000 | 357.289 |
| Colombia Government International Bond 3.125% 15-Apr-2031 | 275.000 | 268.950 | Republic of Azerbaijan International Bond 'REGS' 3.500% 01-Sep-2032 | 350.000 | 355.425 |
| Comision Federal de Electricidad 'REGS' 3.875% 26-Jul-2033 | 255.000 | 255.000 | Dubai DOF Sukuk Ltd 'EMTN' 2.763% 09-Sep-2030 | 350.000 | 353.938 |
| Sasol Financing USA LLC 5.500% 18-Mar-2031 | 250.000 | 250.000 | Empresas Publicas de Medellin ESP 'REGS' 4.250% 18-Jul-2029 | 310.000 | 328.910 |
| Paraguay Government International Bond 'REGS' 5.400% 30-Mar-2050 | 200.000 | 243.726 | Ukraine Government International Bond 'REGS' 7.750% 01-Sep-2026 | 300.000 | 324.150 |
| El Salvador Government International Bond 'REGS' 7.650% 15-Jun-2035 | 225.000 | 230.828 | Mexico Government International Bond 4.500% 22-Apr-2029 | 270.000 | 304.425 |
| Bank Hapoalim BM '144A' FRN 3.255% 21-Jan-2032 | 225.000 | 225.000 | Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd 'REGS' 1.450% 08-Jan-2026 | 300.000 | 300.612 |
| Nigeria Government International Bond 'REGS' 8.250% 28-Sep-2051 | 225.000 | 225.000 | Saudi Government International Bond 'REGS' 4.500% 26-Oct-2046 | 255.000 | 295.206 |
| Republic of Kenya Government International Bond 'REGS' 8.000% 22-May-2032 | 200.000 | 224.970 | Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 'REGS' 2.800% 23-Jun-2030 | 275.000 | 288.819 |
| Panama Government International Bond 3.870% 23-Jul-2060 | 200.000 | 220.782 | Al Candelaria Spain SA 'REGS' 7.500% 15-Dec-2028 | 250.000 | 288.750 |
| Petrobras Global Finance BV 5.600% 10-Jun-2051 | 225.000 | 217.004 | Oman Government International Bond 'REGS' 6.000% 01-Aug-2029 | 265.000 | 281.695 |
| Turkey Government International Bond 7.375% 05-Feb-2025 | 200.000 | 215.476 | QNB Finance Ltd 'EMTN' 1.625% 22-Sep-2025 | 275.000 | 278.025 |
| Colombia Government International Bond 5.000% 15-Jun-2045 | 200.000 | 208.500 | Republic of Kenya Government International Bond 'REGS' 6.300% 23-Jan-2034 | 275.000 | 275.784 |
| Oman Government International Bond 'REGS' 6.750% 17-Jan-2048 | 200.000 | 201.180 | Turkey Government International Bond 5.125% 17-Feb-2028 | 310.000 | 272.165 |
| Peruvian Government International Bond 2.783% 23-Jan-2031 | 200.000 | 200.824 | Indonesia Government International Bond 1.850% 12-Mar-2031 | 275.000 | 266.992 |
| Energean Israel Finance Ltd '144A' 5.875% 30-Mar-2031 | 200.000 | 200.225 | Bahrain Government International Bond 'REGS' 5.625% 30-Sep-2031 | 260.000 | 260.832 |
| African Export-Import Bank/The 'REGS' 2.634% 17-May-2026 | 200.000 | 200.000 | Corp Financiera de Desarrollo SA 'REGS' 2.400% 28-Sep-2027 | 260.000 | 259.675 |
| Credit Bank of Moscow Via CBOM Finance Plc 'REGS' 3.875% 21-Sep-2026 | 200.000 | 200.000 | Petroleos Mexicanos 5.625% 23-Jan-2046 | 305.000 | 252.388 |
| Dominican Republic International Bond 'REGS' 5.300% 21-Jan-2041 | 200.000 | 200.000 | Dominican Republic International Bond 'REGS' 6.850% 27-Jan-2045 | 220.000 | 250.800 |
| Gazprom PJSC via Gaz Finance Plc 'REGS' 3.500% 14-Jul-2031 | 200.000 | 200.000 | Sasol Financing USA LLC 5.500% 18-Mar-2031 | 250.000 | 248.125 |
| Hidrovias International Finance SARL 'REGS' 4.950% 08-Feb-2031 | 200.000 | 200.000 | TC Ziraat Bankasi AS 'REGS' 4.750% 29-Apr-2021 | 240.000 | 240.000 |
| Lukoil Capital DAC 'REGS' 3.600% 26-Oct-2031 | 200.000 | 200.000 | Colombia Government International Bond 5.000% 15-Jun-2045 | 200.000 | 233.060 |
| Oman Government International Bond 'REGS' 6.250% 25-Jan-2031 | 200.000 | 200.000 | Iraq International Bond 'REGS' 5.800% 15-Jan-2028 | 234.375 | 227.012 |
| Oman Sovereign Sukuk Co 'REGS' 4.875% 15-Jun-2030 | 200.000 | 200.000 | Republic of Kenya Government International Bond 'REGS' 6.875% 24-Jun-2024 | 200.000 | 221.500 |
| Polyus Finance Plc 'REGS' 3.250% 14-Oct-2028 | 200.000 | 200.000 | Banque Oueat Africaine de Developpement 'REGS' 5.000% 27-Jul-2027 | 200.000 | 220.138 |
| Tullow Oil Plc 'REGS' 10.250% 15-May-2026 | 200.000 | 200.000 | Eskom Holdings SOC Ltd 'REGS' 6.350% 10-Aug-2028 | 200.000 | 216.050 |
| Equate Petrochemical BV 'REGS' 2.625% 28-Apr-2028 | 200.000 | 199.796 | Republic of Kenya Government International Bond 'REGS' 8.000% 22-May-2032 | 200.000 | 213.500 |
| Colbun SA 'REGS' 3.150% 19-Jan-2032 | 200.000 | 199.652 | Egypt Government International Bond 'REGS' 5.250% 06-Oct-2025 | 200.000 | 212.530 |
| AngloGold Ashanti Holdings Plc 3.375% 01-Nov-2028 | 200.000 | 199.576 | El Salvador Government International Bond 'REGS' 7.650% 15-Jun-2035 | 225.000 | 211.875 |
| Rumo Luxembourg Sarl 'REGS' 4.200% 18-Jan-2032 | 200.000 | 199.182 | Pakistan Government International Bond 'REGS' 6.875% 05-Dec-2027 | 200.000 | 207.120 |
| Development Bank of Kazakhstan JSC 'REGS' 2.950% 06-May-2031 | 200.000 | 199.142 | Sasol Financing USA LLC 5.875% 27-Mar-2024 | 200.000 | 207.000 |
| Georgia Government International Bond 'REGS' 2.750% 22-Apr-2026 | 200.000 | 198.844 | Turkey Government International Bond 7.375% 05-Feb-2025 | 200.000 | 206.824 |
| Sociedad Quimica y Minera de Chile SA 'REGS' 3.500% 10-Sep-2051 | 200.000 | 198.348 | Ukraine Government International Bond 'REGS' 7.375% 25-Sep-2032 | 200.000 | 206.000 |
| Peruvian Government International Bond 3.000% 15-Jan-2034 | 200.000 | 198.330 | Dominican Republic International Bond 'REGS' 4.500% 30-Jan-2030 | 200.000 | 204.100 |
| Endeavour Mining Plc 'REGS' 5.000% 14-Oct-2026 | 200.000 | 197.826 | Ghana Government International Bond 'REGS' 7.625% 16-May-2029 | 200.000 | 204.040 |
| Fund of National Welfare Samruk-Kazyna JSC 'REGS' 2.000% 28-Oct-2026 | 200.000 | 197.648 | AngloGold Ashanti Holdings PLC 3.750% 01-Oct-2030 | 200.000 | 203.640 |
| DAE Funding LLC 'REGS' 3.375% 20-Mar-2028 | 200.000 | 197.422 | Oman Government International Bond 'REGS' 6.750% 17-Jan-2048 | 200.000 | 203.250 |
| Medco Laurel Tree Pte Ltd 'REGS' 6.950% 12-Nov-2028 | 200.000 | 196.752 | Peruvian Government International Bond 2.783% 23-Jan-2031 | 200.000 | 203.200 |
| Hungary Government International Bond 'REGS' 3.125% 21-Sep-2051 | 200.000 | 191.746 | Saudi Arabian Oil Co 'REGS' 1.625% 24-Nov-2025 | 200.000 | 202.100 |
| Ghana Government International Bond 'REGS' 7.625% 16-May-2029 | 200.000 | 184.480 | Bahrain Government International Bond 'REGS' 6.000% 19-Sep-2044 | 210.000 | 197.896 |
| Serbia International Bond 'REGS' 2.050% 23-Sep-2036 | 125.000 | 142.401 | Colombia Government International Bond 3.125% 15-Apr-2031 | 200.000 | 195.250 |
| | | | Hungary Government International Bond 'REGS' 3.125% 21-Sep-2051 | 200.000 | 193.260 |
| | | | United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 14-Jan-2021 | 190.000 | 190.000 |
| | | | Ghana Government International Bond 'REGS' 8.950% 26-Mar-2051 | 200.000 | 178.050 |

BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Alle Käufe | Nominal | Kosten USD | Wichtige Verkäufe | Nominal | Erlöse USD |
|--|---------------|------------|--|----------------|------------|
| Republic of South Africa Government Bond 8.000% 31-Jan-2030 | 56.300.000 | 3.567.287 | Petroleos Mexicanos 'REGS' 7.190% 12-Sep-2024 | 210.965.000 | 9.698.318 |
| Peru Government Bond 5.700% 12-Aug-2024 | 10.550.000 | 3.042.457 | Republic of South Africa Government Bond 10.500% 21-Dec-2026 | 55.830.000 | 4.425.757 |
| Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos '144A' 5.000% 01-Oct-2028 | 1.225.000.000 | 1.713.505 | China Government Bond 3.250% 06-Jun-2026 | 27.800.000 | 4.386.509 |
| Czech Republic Government Bond 2.750% 23-Jul-2029 | 271.000.000 | 1.331.528 | Republic of South Africa Government Bond 8.750% 28-Feb-2048 | 76.700.000 | 4.162.791 |
| Czech Republic Government Bond 1.500% 24-Apr-2040 | 34.900.000 | 1.313.430 | International Finance Corp 'GMTN' 6.300% 25-Nov-2024 | 205.000.000 | 2.905.099 |
| Peru Government Bond 5.940% 12-Feb-2029 | 4.150.000 | 1.282.714 | Indonesia Treasury Bond 8.250% 15-May-2036 | 30.100.000.000 | 2.303.291 |
| Russian Federal Bond - OFZ 8.150% 03-Feb-2027 | 88.500.000 | 1.276.657 | Russian Federal Bond - OFZ 7.050% 19-Jan-2028 | 159.800.000 | 2.209.363 |
| Mexican Bonos 7.500% 03-Jun-2027 | 21.000.000 | 1.107.012 | Russian Federal Bond - OFZ 8.150% 03-Feb-2027 | 139.900.000 | 2.027.078 |
| Hungary Government Bond 3.000% 27-Oct-2038 | 328.000.000 | 838.877 | Peru Government Bond 5.700% 12-Aug-2024 | 6.450.000 | 1.686.473 |
| Malaysia Government Bond 3.828% 05-Jul-2034 | 3.325.000 | 804.895 | Peru Government Bond 5.350% 12-Aug-2040 | 6.575.000 | 1.653.065 |
| Thailand Government Bond 3.650% 20-Jun-2031 | 19.600.000 | 754.409 | Republic of Poland Government Bond 2.500% 25-Jul-2027 | 5.350.000 | 1.569.015 |
| Malaysia Government Bond 3.502% 31-May-2027 | 2.700.000 | 677.835 | Republic of Poland Government Bond 2.750% 25-Oct-2029 | 5.400.000 | 1.545.152 |
| Hungary Government Bond 2.250% 20-Apr-2033 | 265.000.000 | 658.386 | Mexican Bonos 7.500% 03-Jun-2027 | 26.700.000 | 1.459.022 |
| Czech Republic Government Bond 0.950% 15-May-2030 | 8.800.000 | 383.698 | Russian Federal Bond - OFZ 7.700% 23-Mar-2033 | 100.000.000 | 1.416.322 |
| Russian Federal Bond - OFZ 7.050% 19-Jan-2028 | 9.800.000 | 131.145 | Mexican Bonos 7.750% 13-Nov-2042 | 27.500.000 | 1.401.653 |
| Uruguay Government International Bond 8.250% 21-May-2031 | 5.500.000 | 125.071 | Thailand Government Bond 3.400% 17-Jun-2036 | 37.400.000 | 1.245.798 |
| | | | Indonesia Treasury Bond 7.500% 15-Aug-2032 | 17.000.000.000 | 1.238.080 |
| | | | Empresas Publicas de Medellin ESP 'REGS' 7.625% 10-Sep-2024 | 4.325.000.000 | 1.230.745 |
| | | | Indonesia Treasury Bond 7.000% 15-Sep-2030 | 16.150.000.000 | 1.190.953 |
| | | | Thailand Government Bond 3.650% 20-Jun-2031 | 30.400.000 | 1.133.539 |
| | | | Indonesia Treasury Bond 8.375% 15-Mar-2034 | 12.800.000.000 | 984.703 |
| | | | Indonesia Treasury Bond 7.000% 15-May-2027 | 12.216.000.000 | 904.110 |
| | | | Romania Government Bond 4.750% 24-Feb-2025 | 2.900.000 | 773.479 |
| | | | Indonesia Treasury Bond 6.125% 15-May-2028 | 10.113.000.000 | 723.500 |
| | | | Peru Government Bond 5.400% 12-Aug-2034 | 2.365.000 | 641.515 |
| | | | Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos '144A' 4.700% 01-Sep-2030 | 400.000.000 | 638.363 |

Obiges stellt die vollständigen Angaben zu den Käufen des Fonds im Geschäftsjahr dar.

BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Wichtige Käufe | Nominal | Kosten USD | Wichtige Verkäufe | Nominal | Erlöse USD |
|---|-------------|------------|---|---------------|------------|
| Republic of South Africa Government Bond 8.000% 31-Jan-2030 | 10.850.000 | 672.422 | Petroleos Mexicanos 'REGS' 7.190% 12-Sep-2024 | 21.200.000 | 968.777 |
| Peru Government Bond 5.700% 12-Aug-2024 | 2.175.000 | 627.269 | VEON Holdings BV 'REGS' 3.375% 25-Nov-2027 | 525.000 | 527.925 |
| Comision Federal de Electricidad 'REGS' 3.348% 09-Feb-2031 | 600.000 | 599.400 | Bank of Georgia JSC 'REGS' 6.000% 26-Jul-2023 | 460.000 | 484.790 |
| Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031 | 9.000.000 | 463.814 | Vnesheconombank Via VEB Finance PLC 'REGS' 5.942% 21-Nov-2023 | 400.000 | 442.060 |
| China Government Bond 3.290% 23-May-2029 | 2.860.000 | 454.852 | Orazul Energy Egenor SCA 'REGS' 5.625% 28-Apr-2027 | 400.000 | 402.810 |
| Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos '144A' 5.000% 01-Oct-2028 | 335.000.000 | 453.311 | Aegae Finance Sari 'REGS' 5.750% 10-Oct-2024 | 360.000 | 376.020 |
| DP World Crescent Ltd 'EMTN' 3.875% 18-Jul-2029 | 400.000 | 430.350 | Indonesia Treasury Bond 7.500% 15-Jun-2035 | 4.900.000.000 | 360.309 |
| China Government Bond 3.810% 14-Sep-2050 | 2.450.000 | 407.250 | Peru Government Bond 5.700% 12-Aug-2024 | 1.325.000 | 347.460 |
| Thailand Government Bond 3.650% 20-Jun-2031 | 8.675.000 | 320.676 | Russian Federal Bond - OFZ 7.050% 19-Jan-2028 | 22.700.000 | 316.893 |
| VEON Holdings BV 'REGS' 3.375% 25-Nov-2027 | 300.000 | 305.175 | China Government Bond 3.250% 06-Jun-2026 | 2.000.000 | 316.409 |
| Qatar Energy 'REGS' 2.250% 12-Jul-2031 | 300.000 | 302.820 | Orbia Advance Corp SAB de CV 'REGS' 5.875% 17-Sep-2044 | 250.000 | 300.750 |
| Egypt Government International Bond 'REGS' 5.875% 16-Feb-2031 | 300.000 | 300.000 | Al Candelaria Spain SA 'REGS' 7.500% 15-Dec-2028 | 250.000 | 288.750 |
| Egypt Government International Bond 'REGS' 7.500% 16-Feb-2061 | 300.000 | 300.000 | Turkey Government International Bond 5.750% 22-Mar-2024 | 260.000 | 266.552 |
| Colombia Government International Bond 3.125% 15-Apr-2031 | 300.000 | 292.935 | Indonesia Treasury Bond 8.375% 15-Sep-2026 | 3.272.000.000 | 258.128 |
| Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 5.000% 01-Mar-2035 | 260.000.000 | 280.312 | Indonesia Treasury Bond 8.250% 15-May-2036 | 3.101.000.000 | 244.350 |
| Russian Federal Bond - OFZ 7.700% 16-Mar-2039 | 19.700.000 | 252.138 | Dominican Republic International Bond 'REGS' 4.875% 23-Sep-2032 | 225.000 | 239.128 |
| Petroleos Mexicanos 'REGS' 6.700% 16-Feb-2032 | 250.000 | 249.940 | Metinvest BV 'REGS' 8.500% 23-Apr-2026 | 200.000 | 225.820 |
| KazMunayGas National Co JSC 'REGS' 5.375% 24-Apr-2030 | 200.000 | 238.358 | Republic of Kenya Government International Bond 'REGS' 6.300% 23-Jan-2034 | 225.000 | 225.641 |
| Czech Republic Government Bond 1.500% 24-Apr-2040 | 6.350.000 | 237.506 | Republic of Kenya Government International Bond 'REGS' 7.250% 28-Feb-2028 | 200.000 | 223.520 |
| Republic of Kenya Government International Bond 'REGS' 8.000% 22-May-2032 | 200.000 | 224.996 | CBB International Sukuk Programme Co WLL 'REGS' 6.250% 14-Nov-2024 | 200.000 | 218.040 |
| Republic of Kenya Government International Bond 'REGS' 6.300% 23-Jan-2034 | 225.000 | 224.980 | OCP SA 'REGS' 4.500% 22-Oct-2025 | 200.000 | 218.000 |
| Nigeria Government International Bond 'REGS' 7.875% 16-Feb-2032 | 200.000 | 215.030 | DP World Crescent Ltd 'EMTN' 3.875% 18-Jul-2029 | 200.000 | 217.500 |
| OCP SA 'REGS' 4.500% 22-Oct-2025 | 200.000 | 213.710 | Mongolia Government International Bond 'REGS' 5.125% 07-Apr-2026 | 200.000 | 216.700 |
| Ivory Coast Government International Bond 'REGS' 6.125% 15-Jun-2033 | 200.000 | 211.310 | Republic of Kenya Government International Bond 'REGS' 8.000% 22-May-2032 | 200.000 | 216.300 |
| Malaysia Government Bond 3.828% 05-Jul-2034 | 870.000 | 210.743 | Cosan SA 'REGS' 5.500% 20-Sep-2029 | 200.000 | 216.100 |
| Russian Federal Bond - OFZ 6.000% 06-Oct-2027 | 16.100.000 | 210.458 | Egypt Government International Bond 'REGS' 5.250% 06-Oct-2025 | 200.000 | 212.530 |
| Tengizchevroil Finance Co International Ltd 'REGS' 3.250% 15-Aug-2030 | 200.000 | 204.460 | PTT Treasury Center Co Ltd 'REGS' 3.700% 16-Jul-2070 | 200.000 | 210.214 |
| Oman Government International Bond 'REGS' 6.750% 17-Jan-2048 | 200.000 | 201.180 | VTR Comunicaciones SpA 'REGS' 5.125% 15-Jan-2028 | 200.000 | 208.844 |
| Energean Israel Finance Ltd '144A' 5.875% 30-Mar-2031 | 200.000 | 200.225 | International Finance Corp 'GMTN' 6.300% 25-Nov-2024 | 14.700.000 | 208.338 |
| Bank Hapoalim BM '144A' FRN 3.255% 21-Jan-2032 | 200.000 | 200.000 | Pakistan Government International Bond 'REGS' 6.875% 05-Dec-2027 | 200.000 | 207.120 |
| Comision Federal de Electricidad 'REGS' 3.875% 26-Jul-2033 | 200.000 | 200.000 | Ghana Government International Bond 'REGS' 7.625% 16-May-2029 | 200.000 | 204.040 |
| Credit Bank of Moscow Via CBOM Finance Plc 'REGS' 3.875% 21-Sep-2026 | 200.000 | 200.000 | Oman Government International Bond 'REGS' 6.750% 17-Jan-2048 | 200.000 | 203.250 |
| Hidroviias International Finance SARL 'REGS' 4.950% 08-Feb-2031 | 200.000 | 200.000 | QNB Finance Ltd 'EMTN' 1.625% 22-Sep-2025 | 200.000 | 202.500 |
| Lukoil Capital DAC 'REGS' 3.600% 26-Oct-2031 | 200.000 | 200.000 | MMC Norilsk Nickel OJSC Via MMC Finance DAC 'REGS' 2.550% 11-Sep-2025 | 200.000 | 201.400 |
| MARB BondCo PLC 'REGS' 3.950% 29-Jan-2031 | 200.000 | 200.000 | BRF SA 'REGS' 4.875% 24-Jan-2030 | 200.000 | 200.902 |
| Nigeria Government International Bond 'REGS' 8.250% 28-Sep-2051 | 200.000 | 200.000 | Bank Hapoalim BM '144A' FRN 3.255% 21-Jan-2032 | 200.000 | 200.704 |
| Polysus Finance Plc 'REGS' 3.250% 14-Oct-2028 | 200.000 | 200.000 | Comision Federal de Electricidad 'REGS' 3.348% 09-Feb-2031 | 200.000 | 198.318 |
| Sasol Financing USA LLC 5.500% 18-Mar-2031 | 200.000 | 200.000 | Colbun SA 'REGS' 3.150% 19-Jan-2032 | 200.000 | 197.750 |
| Tullow Oil Plc 'REGS' 10.250% 15-May-2026 | 200.000 | 200.000 | Mexican Bonos 8.500% 31-May-2029 | 3.650.000 | 192.929 |
| Colbun SA 'REGS' 3.150% 19-Jan-2032 | 200.000 | 199.652 | MARB BondCo PLC 'REGS' 3.950% 29-Jan-2031 | 200.000 | 192.100 |
| AngloGold Ashanti Holdings Plc 3.375% 01-Nov-2028 | 200.000 | 199.576 | Egypt Government International Bond 'REGS' 8.700% 01-Mar-2049 | 200.000 | 189.544 |
| Rumo Luxembourg Sari 'REGS' 4.200% 18-Jan-2032 | 200.000 | 199.182 | Malaysia Government Bond 3.828% 05-Jul-2034 | 750.000 | 177.019 |
| Anadolu Efes Biraclik Ve Malt Sanayii AS 'REGS' 3.375% 29-Jun-2028 | 200.000 | 198.460 | Republic of South Africa Government Bond 10.500% 21-Dec-2026 | 2.150.000 | 170.890 |
| Peruvian Government International Bond 3.000% 15-Jan-2034 | 200.000 | 198.330 | Central American Bottling Corp 'REGS' 5.750% 31-Jan-2027 | 160.000 | 165.742 |
| Endeavour Mining Plc 'REGS' 5.000% 14-Oct-2026 | 200.000 | 197.826 | Turkey Government International Bond 4.875% 16-Apr-2043 | 200.000 | 148.366 |
| DAE Funding LLC 'REGS' 3.375% 20-Mar-2028 | 200.000 | 197.422 | | | |
| Medco Laurel Tree Pte Ltd 'REGS' 6.950% 12-Nov-2028 | 200.000 | 196.752 | | | |
| OCP SA 'REGS' 5.125% 23-Jun-2051 | 200.000 | 196.482 | | | |
| Ukraine Government International Bond 'REGS' 7.375% 25-Sep-2032 | 200.000 | 193.000 | | | |
| Russian Federal Bond - OFZ 7.700% 23-Mar-2033 | 13.250.000 | 191.797 | | | |
| Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2025 | 1.000.000 | 186.797 | | | |
| Russian Federal Bond - OFZ 7.050% 19-Jan-2028 | 13.160.000 | 180.083 | | | |
| Dominican Republic International Bond 'REGS' 5.300% 21-Jan-2041 | 175.000 | 175.000 | | | |
| Petrobras Global Finance BV 5.500% 10-Jun-2051 | 175.000 | 168.781 | | | |

BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Wichtige Käufe | Nominal | Kosten USD | Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten | Nominal | Erlöse USD |
|--|-------------|---------------|--|----------------|---------------|
| Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund | 127.246.563 | 127.246.563 | Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund | 129.002.629 | 129.002.629 |
| Mexican Bonos 5.750% 05-Mar-2026 | 154.407.300 | 7.676.401 | Mexican Bonos 5.750% 05-Mar-2026 | 110.000.000 | 5.477.515 |
| Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2025 | 27.000.000 | 5.210.016 | Indonesia Treasury Bond 8.250% 15-May-2029 | 66.000.000.000 | 5.226.293 |
| Mexican Bonos 8.500% 18-Nov-2038 | 77.500.000 | 4.207.662 | Russian Federal Bond - OFZ 7.150% 12-Nov-2025 | 329.200.000 | 4.573.881 |
| Chile Government International Bond 3.100% 07-May-2041 | 3.700.000 | 3.621.708 | Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2025 | 22.000.000 | 4.359.907 |
| Peruvian Government International Bond 'REGS' 6.950% 12-Aug-2031 | 12.400.000 | 3.619.488 | Mexican Bonos 8.500% 18-Nov-2038 | 77.500.000 | 4.068.164 |
| Turkey Government International Bond 4.750% 26-Jan-2026 | 3.100.000 | 3.079.602 | Chile Government International Bond 3.100% 07-May-2041 | 3.700.000 | 3.722.050 |
| Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS 'REGS' 5.125% 22-Jun-2026 | 3.000.000 | 3.000.000 | Colombian TES 7.250% 26-Oct-2050 | 11.900.000.000 | 3.574.488 |
| Turkey Government International Bond 6.500% 20-Sep-2033 | 2.900.000 | 2.900.000 | Egypt Treasury Bills (Zero Coupon) 0.000% 16-Feb-2021 | 53.000.000 | 3.393.086 |
| Russian Federal Bond - OFZ 7.750% 16-Sep-2026 | 213.000.000 | 2.853.674 | Petroleos Mexicanos 6.950% 28-Jan-2060 | 3.800.000 | 3.312.549 |
| Indonesia Government International Bond 3.050% 12-Mar-2051 | 2.800.000 | 2.791.343 | Peruvian Government International Bond 'REGS' 6.950% 12-Aug-2031 | 11.200.000 | 3.194.421 |
| Credito Real SAB de CV SOFOM ER 'REGS' 8.000% 21-Jan-2028 | 2.740.000 | 2.675.000 | Turkey Government International Bond 4.750% 26-Jan-2026 | 3.100.000 | 3.085.620 |
| Petroleos del Peru SA 5.625% 19-Jun-2047 | 2.340.000 | 2.632.125 | Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS 'REGS' 5.125% 22-Jun-2026 | 3.000.000 | 3.009.200 |
| Russian Federal Bond - OFZ 7.950% 07-Oct-2026 | 193.000.000 | 2.573.333 | Indonesia Treasury Bond 8.125% 15-May-2024 | 39.451.000.000 | 2.996.720 |
| Lukoil Capital DAC 'REGS' 3.600% 26-Oct-2031 | 2.550.000 | 2.524.140 | Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031 | 49.530.000 | 2.833.877 |
| Petroleos Mexicanos 6.950% 28-Jan-2060 | 2.800.000 | 2.507.885 | Turkey Government International Bond 6.500% 20-Sep-2033 | 2.900.000 | 2.772.550 |
| Boubyan Tier 1 Sukuk Ltd FRN (Perpetual) 3.950% 01-Oct-2169 | 2.500.000 | 2.500.000 | Russian Federal Bond - OFZ 7.950% 07-Oct-2026 | 181.147.000 | 2.652.194 |
| Minerva Luxembourg SA 'REGS' 4.375% 18-Mar-2031 | 2.500.000 | 2.475.050 | Petroleos del Peru SA 5.625% 19-Jun-2047 | 2.340.000 | 2.567.487 |
| Turkey Government International Bond 5.875% 26-Jun-2031 | 2.400.000 | 2.386.320 | Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10.000% 01-Jan-2027 | 14.000.000 | 2.555.140 |
| Turkiye Ihracat Kredi Bankasi AS 'REGS' 5.750% 06-Jul-2026 | 2.300.000 | 2.287.626 | Qatar Government International Bond 'REGS' 4.000% 14-Mar-2029 | 2.150.000 | 2.517.858 |

BNY Mellon Euroland Bond Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Wichtige Käufe | Nominal | Kosten EUR | Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten | Nominal | Erlöse EUR |
|---|-------------|---------------|--|------------|---------------|
| Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15-Aug-2030 | 25.750.000 | 27.077.951 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 4.750% 04-Jul-2028 | 40.450.000 | 56.378.530 |
| Bundesobligation 0.000% 10-Oct-2025 | 20.525.000 | 21.211.144 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15-Aug-2030 | 25.750.000 | 26.868.989 |
| Norway Government Bond '144A' 1.500% 19-Feb-2026 | 175.000.000 | 17.981.202 | Bundesobligation 0.000% 10-Oct-2025 | 20.525.000 | 21.129.746 |
| Kingdom of Belgium Government Bond '144A' 1.000% 22-Jun-2026 | 16.550.000 | 17.845.529 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2.500% 15-Aug-2046 | 12.350.000 | 19.149.922 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.000% 01-Aug-2026 | 17.500.000 | 17.466.225 | French Republic Government Bond OAT 0.750% 25-Nov-2028 | 12.975.000 | 13.963.176 |
| French Republic Government Bond OAT 0.750% 25-Nov-2028 | 12.975.000 | 13.888.570 | Bundesobligation 0.000% 05-Apr-2024 | 13.200.000 | 13.530.924 |
| French Republic Government Bond OAT 0.000% 25-Nov-2030 | 12.800.000 | 13.066.377 | French Republic Government Bond OAT 0.000% 25-Nov-2030 | 12.800.000 | 12.840.769 |
| Bundesobligation 0.000% 09-Oct-2026 | 12.200.000 | 12.566.890 | French Republic Government Bond OAT '144A' 2.000% 25-May-2048 | 8.975.000 | 11.642.031 |
| Bundesschatzanweisungen 0.000% 15-Dec-2023 | 12.000.000 | 12.183.000 | Spain Government Bond '144A' 0.100% 30-Apr-2031 | 11.700.000 | 11.356.447 |
| Spain Government Bond '144A' 0.100% 30-Apr-2031 | 11.700.000 | 11.434.791 | French Republic Government Bond OAT 2.500% 25-May-2030 | 8.250.000 | 10.194.158 |
| French Republic Government Bond OAT 2.500% 25-May-2030 | 8.250.000 | 10.374.701 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2.250% 04-Sep-2021 | 9.100.000 | 9.238.601 |
| Netherlands Government Bond '144A' 0.000% 15-Jul-2031 | 9.130.000 | 9.149.223 | Australia Government Bond 1.750% 21-Jun-2051 | 16.225.000 | 8.869.210 |
| Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15-May-2036 | 8.150.000 | 8.228.168 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0.000% 01-Aug-2026 | 8.650.000 | 8.571.199 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 0.950% 01-Dec-2031 | 7.750.000 | 7.715.834 | Bundesschatzanweisungen 0.000% 15-Dec-2023 | 8.300.000 | 8.418.382 |
| Republic of Austria Government Bond '144A' 0.000% 20-Feb-2031 | 7.150.000 | 7.222.501 | BNY Mellon Global Funds PLC-Bny Mellon US Municipal Infrastructure Debt Fund | 7.976.912 | 8.033.435 |
| French Republic Government Bond OAT 0.000% 25-Nov-2031 | 6.950.000 | 6.851.797 | French Republic Government Bond OAT '144A' 0.700% 25-Jul-2030 | 6.536.164 | 7.794.031 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 1.650% 01-Dec-2030 | 6.275.000 | 6.703.799 | Spain Government Bond '144A' 2.900% 31-Oct-2046 | 5.155.000 | 7.193.551 |
| Fannie Mae or Freddie Mac 0.000% 31-Dec-2049 | 6.275.000 | 5.431.032 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 3.250% 01-Sep-2046 | 5.145.000 | 6.979.279 |
| Fannie Mae or Freddie Mac 0.000% 31-Dec-2049 | 6.275.000 | 5.419.951 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 2.450% 01-Sep-2050 | 5.875.000 | 6.936.651 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 1.500% 30-Apr-2045 | 5.400.000 | 5.355.072 | Bundesobligation 0.000% 09-Oct-2026 | 6.000.000 | 6.131.131 |
| China Government Bond 3.810% 14-Sep-2050 | 41.100.000 | 5.274.412 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.350% 15-Apr-2022 | 5.455.000 | 5.543.423 |
| Japan Government Thirty Year Bond 0.400% 20-Mar-2050 | 643.100.000 | 4.609.685 | Fannie Mae or Freddie Mac 0.000% 31-Dec-2049 | 6.275.000 | 5.431.898 |
| Ireland Government Bond 0.200% 18-Oct-2030 | 4.545.000 | 4.609.648 | Latvia Government International Bond 0.375% 07-Oct-2026 | 5.200.000 | 5.396.040 |
| Thailand Government Bond 1.600% 17-Dec-2029 | 164.150.000 | 4.428.039 | Fannie Mae or Freddie Mac 0.000% 31-Dec-2049 | 6.275.000 | 5.372.801 |
| Republic of South Africa Government Bond 10.500% 21-Dec-2026 | 57.075.000 | 3.972.017 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 1.500% 30-Apr-2045 | 5.400.000 | 5.220.679 |
| Spain Government Bond '144A' 0.500% 31-Oct-2031 | 3.800.000 | 3.840.204 | | | |
| European Union 0.450% 02-May-2046 | 3.850.000 | 3.826.361 | | | |
| United States Treasury Bill 0.000% 13-Apr-2021 | 4.500.000 | 3.772.873 | | | |
| United States Cash Management Bill 0.000% 11-May-2021 | 4.500.000 | 3.764.250 | | | |

BNY Mellon European Credit Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Wichtige Käufe | Nominal | Kosten EUR | Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten | Nominal | Erlöse EUR |
|---|---------|---------------|---|-----------|---------------|
| Credit Suisse Group AG 'EMTN' FRN 3.250% 02-Apr-2026 | 565.000 | 627.065 | BPCE SA 'EMTN' FRN 2.750% 30-Nov-2027 | 1.100.000 | 1.152.954 |
| BNP Paribas SA 'EMTN' FRN 0.250% 13-Apr-2027 | 500.000 | 499.655 | European Residential Loan Securitisation 2019-NPL2 DAC '2019-NPL2 A' FRN 0.857% 24-Feb-2058 | 641.565 | 630.046 |
| TotalEnergies SE 'EMTN' FRN (Perpetual) 1.750% 04-Apr-2170 | 450.000 | 461.475 | BNP Paribas SA 'EMTN' 0.125% 04-Sep-2026 | 500.000 | 500.095 |
| Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 0.250% 26-Jan-2028 | 423.000 | 417.445 | Dowson 2019-1 PLC FRN 2.450% 20-Sep-2026 | 417.000 | 493.238 |
| Zimmer Biomet Holdings Inc 2.425% 13-Dec-2026 | 370.000 | 408.874 | TotalEnergies SE 'EMTN' FRN (Perpetual) 1.750% 04-Apr-2170 | 450.000 | 462.420 |
| Standard Chartered Plc 'EMTN' FRN 1.200% 23-Sep-2031 | 400.000 | 401.264 | Huntsman International LLC 5.125% 15-Apr-2021 | 460.000 | 460.000 |
| Vantage Towers AG 'EMTN' 0.000% 31-Mar-2025 | 400.000 | 398.900 | SES SA FRN (Perpetual) 4.625% 02-Jan-2170 | 445.000 | 457.629 |
| RCI Banque SA 'EMTN' 1.375% 08-Mar-2024 | 380.000 | 390.298 | Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' 1.375% 18-Jan-2024 | 440.000 | 456.215 |
| Virgin Money UK Plc FRN 2.875% 24-Jun-2025 | 345.000 | 369.357 | AT&T Inc 1.950% 15-Sep-2023 | 436.000 | 449.664 |
| TotalEnergies SE FRN (Perpetual) 2.000% 04-Jun-2030 | 362.000 | 365.220 | Volkswagen Bank GmbH 'EMTN' 1.250% 10-Jun-2024 | 400.000 | 412.184 |
| InterContinental Hotels Group Plc 'EMTN' 2.125% 15-May-2027 | 340.000 | 364.616 | Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 'GMTN' FRN 1.000% 16-Jan-2030 | 400.000 | 400.920 |
| HSBC Holdings Plc FRN 0.641% 24-Sep-2029 | 340.000 | 340.537 | Societe Generale SA FRN 2.500% 16-Sep-2026 | 400.000 | 400.000 |
| Athora Netherlands NV FRN 2.250% 15-Jul-2031 | 335.000 | 337.638 | RCI Banque SA 'EMTN' 1.375% 08-Mar-2024 | 380.000 | 389.850 |
| Comcast Corp 0.000% 14-Sep-2026 | 337.000 | 335.942 | BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund | 349.917 | 383.706 |
| BP Capital Markets Plc 'EMTN' 2.213% 25-Sep-2026 | 300.000 | 334.584 | Goldman Sachs Group Inc/The 3.375% 27-Mar-2025 | 343.000 | 379.783 |
| British American Tobacco Plc FRN (Perpetual) 3.000% 27-Sep-2026 | 334.000 | 332.036 | VF Corp 0.625% 20-Sep-2023 | 365.000 | 371.479 |
| Merck KGaA FRN 2.875% 25-Jun-2079 | 300.000 | 324.600 | Barclays PLC 'EMTN' FRN 2.000% 07-Feb-2028 | 350.000 | 359.832 |
| AT&T Inc 2.400% 15-Mar-2024 | 300.000 | 321.384 | BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund | 2.231 | 355.590 |
| Hammerson Ireland Finance DAC 1.750% 03-Jun-2027 | 316.000 | 316.023 | Capgemini SE 2.375% 15-Apr-2032 | 300.000 | 353.215 |
| Commonwealth Bank of Australia 'REGS' 3.305% 11-Mar-2041 | 380.000 | 315.811 | Stellantis NV 3.375% 07-Jul-2023 | 330.000 | 349.704 |

BNY Mellon Future Earth Fund* für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Wichtige Käufe | Nominal | Kosten USD | Alle Verkäufe | Nominal | Erlöse USD |
|------------------------------------|---------|---------------|--|---------|---------------|
| Microsoft Corp | 411 | 88.587,00 | Microsoft Corp | 241 | 78.642 |
| Eversource Energy | 960 | 86.183,00 | Hella GmbH & Co KGaA | 1.059 | 69.102 |
| Legrand SA | 852 | 81.268,00 | Raven Industries Inc | 894 | 51.852 |
| Unilever Plc | 1.358 | 80.188,00 | Xylem Inc/NY | 198 | 24.612 |
| Samsung SDI Co Ltd | 119 | 78.741,00 | Valeo | 754 | 20.491 |
| Deere & Co | 248 | 74.594,00 | Acuity Brands Inc | 83 | 17.405 |
| Hella GmbH & Co KGaA | 1.059 | 70.591,00 | Unilever Plc | 319 | 16.588 |
| Mowi ASA | 3.136 | 70.256,00 | Siemens Gamesa Renewable Energy SA | 346 | 10.189 |
| Ecolab Inc | 314 | 69.694,00 | TOMRA Systems ASA | 95 | 6.488 |
| Nidec Corp | 500 | 69.027,00 | | | |
| Daikin Industries Ltd | 300 | 68.849,00 | | | |
| Weyerhaeuser Co (REIT) | 2.080 | 68.680,00 | Obiges stellt die vollständigen Angaben zu den Verkäufen des Fonds im Geschäftsjahr dar. | | |
| National Grid Plc | 5.765 | 67.688,00 | | | |
| Toyota Industries Corp | 800 | 66.630,00 | | | |
| Kubota Corp | 3.000 | 65.220,00 | | | |
| TE Connectivity Ltd | 474 | 62.090,00 | | | |
| Genuit Group Plc | 6.991 | 59.733,00 | | | |
| Orsted AS '144A' | 273 | 56.736,00 | | | |
| Infineon Technologies AG | 1.283 | 55.148,00 | | | |
| Smurfit Kappa Group Plc | 1.075 | 54.068,00 | | | |
| Novozymes A/S | 881 | 50.537,00 | | | |
| Shimano Inc | 200 | 48.103,00 | | | |
| Trimble Inc | 611 | 44.921,00 | | | |
| Albemarle Corp | 251 | 44.681,00 | | | |
| Greencoat UK Wind Plc/Funds | 23.971 | 44.643,00 | | | |
| Johnson Matthey Plc | 1.175 | 43.929,00 | | | |
| Xylem Inc/NY | 410 | 43.923,00 | | | |
| Texas Instruments Inc | 250 | 43.311,00 | | | |
| Ebara Corp | 1.200 | 41.671,00 | | | |
| Trane Technologies Plc | 221 | 41.118,00 | | | |
| Koninklijke DSM NV | 235 | 40.701,00 | | | |
| Acuity Brands Inc | 338 | 39.692,00 | | | |
| Raven Industries Inc | 894 | 33.440,00 | | | |
| Hubbell Inc - Class B | 156 | 32.602,00 | | | |
| TOMRA Systems ASA | 615 | 30.309,00 | | | |
| Kurita Water Industries Ltd | 700 | 29.968,00 | | | |
| Vitasoy International Holdings Ltd | 7.037 | 29.375,00 | | | |
| Valeo | 754 | 28.700,00 | | | |
| Vestas Wind Systems A/S | 121 | 28.300,00 | | | |
| FANUC Corp | 100 | 25.975,00 | | | |
| Ashtead Group Plc | 260 | 22.386,00 | | | |

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

BNY Mellon Future Food Fund* für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Wichtige Käufe | Nominal | Kosten USD | Alle Verkäufe und Fälligkeiten | Nominal | Erlöse USD |
|---|---------|---------------|--|---------|---------------|
| Deere & Co | 366 | 113.918 | Fomento Economico Mexicano SAB de CV ADR | 456 | 38.908 |
| AGCO Corp | 845 | 100.562 | Sociedad Quimica y Minera de Chile SA ADR | 690 | 35.548 |
| Nestle SA | 841 | 95.293 | Deere & Co | 95 | 33.925 |
| Kerry Group Plc | 658 | 92.847 | Tyson Foods Inc - Class A | 431 | 33.529 |
| Kubota Corp | 4.000 | 87.653 | Raven Industries Inc | 575 | 33.350 |
| Bucher Industries AG | 157 | 77.997 | Kubota Corp | 1.000 | 23.009 |
| Corteva Inc | 1.729 | 76.897 | Meituan '144A' | 295 | 13.969 |
| Trimble Inc | 1.030 | 76.481 | Bucher Industries AG | 23 | 11.844 |
| Unilever Plc | 1.287 | 75.228 | AGCO Corp | 79 | 10.264 |
| Ecolab Inc | 339 | 75.142 | Mosaic Co/The | 324 | 10.260 |
| Costco Wholesale Corp | 163 | 73.456 | Givaudan SA | 2 | 9.862 |
| Koninklijke Ahold Delhaize NV | 2.573 | 73.427 | Symrise AG - Class A | 49 | 7.044 |
| Nomad Foods Ltd | 2.842 | 72.899 | Sociedad Quimica y Minera de Chile SA ADR - Rights 19/05/2021 | 115 | 371 |
| Novozymes A/S | 1.119 | 69.180 | | | |
| Mowi ASA | 2.983 | 68.402 | | | |
| Danone SA | 1.043 | 68.008 | Obiges stellt die vollständigen Angaben zu den Verkäufen des Fonds im Geschäftsjahr dar. | | |
| PepsiCo Inc | 483 | 67.934 | | | |
| Meituan '144A' | 1.712 | 66.922 | | | |
| Nutrien Ltd | 1.241 | 64.695 | | | |
| Wal-Mart de Mexico SAB de CV | 20.000 | 61.567 | | | |
| Koninklijke DSM NV | 347 | 60.359 | | | |
| Mosaic Co/The | 2.100 | 59.133 | | | |
| CNH Industrial NV | 4.097 | 58.752 | | | |
| Sprouts Farmers Market Inc | 2.790 | 58.196 | | | |
| Givaudan SA | 14 | 57.413 | | | |
| International Flavors & Fragrances Inc | 442 | 56.785 | | | |
| Bayer AG | 896 | 55.575 | | | |
| Ingredion Inc | 654 | 53.145 | | | |
| Suntory Beverage & Food Ltd | 1.500 | 52.469 | | | |
| Tyson Foods Inc - Class A | 782 | 52.258 | | | |
| Genus Plc | 818 | 51.935 | | | |
| Chr Hansen Holding A/S | 528 | 51.191 | | | |
| Symrise AG - Class A | 403 | 50.869 | | | |
| Brixmor Property Group Inc (REIT) | 2.949 | 50.214 | | | |
| Delivery Hero SE '144A' | 302 | 48.205 | | | |
| Topcon Corp | 3.200 | 44.124 | | | |
| Sociedad Quimica y Minera de Chile SA ADR | 690 | 39.545 | | | |
| TOMRA Systems ASA | 721 | 37.088 | | | |
| a2 Milk Co Ltd/The | 4.683 | 36.481 | | | |
| Fomento Economico Mexicano SAB de CV ADR | 456 | 34.731 | | | |
| SunOpta Inc | 4.437 | 32.771 | | | |
| Health & Happiness H&H International Holdings Ltd | 7.346 | 31.137 | | | |
| Vitasoy International Holdings Ltd | 7.314 | 29.643 | | | |

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

BNY Mellon Future Life Fund* für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Wichtige Käufe | Nominal | Kosten USD | Alle Verkäufe | Nominal | Erlöse USD |
|---|---------|---------------|---|---------|---------------|
| Abbott Laboratories | 1.148 | 126.217 | Lowe's Cos Inc | 106 | 20.706 |
| Roche Holding AG | 323 | 116.298 | Chr Hansen Holding A/S | 260 | 19.821 |
| Medtronic Plc | 948 | 111.570 | Roche Holding AG | 59 | 19.648 |
| AIA Group Ltd | 7.200 | 93.879 | Smith & Nephew Plc | 894 | 17.973 |
| Johnson & Johnson | 521 | 82.438 | Fresenius Medical Care AG & Co KGaA | 239 | 17.912 |
| Novo Nordisk A/S | 1.148 | 80.262 | Sherwin-Williams Co/The | 60 | 17.754 |
| UnitedHealth Group Inc | 221 | 79.102 | HCA Healthcare Inc | 61 | 12.887 |
| Prudential Plc | 3.833 | 75.211 | Topcon Corp | 800 | 12.645 |
| AstraZeneca Plc | 621 | 63.218 | Danaher Corp | 36 | 11.579 |
| Danaher Corp | 259 | 62.781 | Novo Nordisk A/S | 136 | 10.736 |
| GlaxoSmithKline Plc | 3.220 | 60.391 | Novartis AG | 117 | 9.998 |
| Principal Financial Group Inc | 1.102 | 58.232 | Home Depot Inc/The | 28 | 9.315 |
| HCA Healthcare Inc | 336 | 57.720 | Organon & Co | 62 | 1.885 |
| Sherwin-Williams Co/The | 78 | 57.355 | | | |
| Home Depot Inc/The | 205 | 56.300 | | | |
| Cooper Cos Inc/The | 154 | 55.914 | Obiges stellt die vollständigen Angaben zu den Verkäufen des Fonds im Geschäftsjahr dar. | | |
| Novartis AG | 579 | 54.064 | | | |
| Merck & Co Inc | 626 | 52.341 | | | |
| Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H' | 4.000 | 52.117 | | | |
| Fresenius Medical Care AG & Co KGaA | 596 | 49.912 | | | |
| Smith & Nephew Plc | 2.281 | 48.185 | | | |
| Lowe's Cos Inc | 281 | 47.271 | | | |
| Zurich Insurance Group AG | 93 | 39.829 | | | |
| Sugi Holdings Co Ltd | 600 | 39.644 | | | |
| Topcon Corp | 2.800 | 39.056 | | | |
| Intuitive Surgical Inc | 48 | 38.664 | | | |
| Alcon Inc | 513 | 34.489 | | | |
| Siemens Healthineers AG '144A' | 608 | 32.318 | | | |
| EssilorLuxottica SA | 200 | 31.341 | | | |
| Lonza Group AG | 45 | 30.812 | | | |
| M3 Inc | 400 | 29.809 | | | |
| Amplifon SpA | 718 | 29.414 | | | |
| Cochlear Ltd | 211 | 29.401 | | | |
| Thermo Fisher Scientific Inc | 63 | 29.086 | | | |
| Healthpeak Properties Inc (REIT) | 1.008 | 28.612 | | | |
| Straumann Holding AG | 25 | 28.213 | | | |
| Chr Hansen Holding A/S | 260 | 26.019 | | | |
| L'Oreal SA | 67 | 24.452 | | | |
| Booking Holdings Inc | 11 | 24.424 | | | |
| Discovery Ltd | 2.458 | 23.704 | | | |
| Acushnet Holdings Corp | 523 | 22.172 | | | |

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

BNY Mellon Global Bond Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Wichtige Käufe | Nominal | Kosten USD | Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten | Nominal | Erlöse USD |
|--|----------------|------------|---|---------------|------------|
| French Republic Government Bond OAT 0.100% 01-Mar-2025 | 12.909.709 | 16.118.310 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.750% 15-Jul-2028 | 24.125.073 | 28.049.482 |
| iShares China CNY Bond UCITS ETF - ETF | 2.979.537 | 14.921.987 | United States Treasury Note/Bond 0.500% 15-Mar-2023 | 15.870.000 | 15.958.922 |
| Canadian Government Real Return Bond 4.000% 01-Dec-2031 | 8.329.545 | 9.629.770 | Australia Government Bond 5.500% 21-Apr-2023 | 15.250.000 | 13.016.777 |
| Australia Government Bond 5.500% 21-Apr-2023 | 9.800.000 | 8.389.325 | United Kingdom Gilt 3.250% 22-Jan-2044 | 5.630.000 | 10.711.324 |
| Agence Francaise de Developpement EPIC 'EMTN' 0.625% 22-Jan-2026 | 7.000.000 | 6.957.679 | United States Treasury Note/Bond 2.375% 15-May-2029 | 9.450.000 | 10.175.891 |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15-Apr-2023 | 6.632.612 | 6.882.344 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 5.000% 01-Aug-2034 | 5.623.000 | 9.781.789 |
| Colombia Government International Bond 'REGS' 7.000% 30-Jun-2032 | 23.100.400.000 | 6.880.809 | Japan Government Two Year Bond 0.100% 01-Apr-2022 | 1.064.200.000 | 9.705.388 |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.000% 15-Feb-2046 | 4.943.249 | 6.305.502 | iShares China CNY Bond UCITS ETF - ETF | 1.746.980 | 9.700.397 |
| Czech Republic Government Bond 0.450% 25-Oct-2023 | 123.780.000 | 5.709.668 | United States Treasury Note/Bond 2.000% 15-Feb-2050 15-Feb-2050 | 9.740.000 | 9.613.036 |
| Kommuninvest I Sverige AB 'REGS' 0.500% 29-Nov-2024 | 5.450.000 | 5.435.503 | Australia Government Bond 3.250% 21-Apr-2029 | 9.540.000 | 8.555.520 |
| European Investment Bank 0.375% 24-Jul-2024 | 5.450.000 | 5.430.544 | Canada Housing Trust No 1 '144A' 2.100% 15-Sep-2029 | 10.160.000 | 8.385.938 |
| United Kingdom Gilt 1.500% 31-Jul-2053 | 3.800.000 | 5.361.059 | United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Aug-2026 | 7.340.000 | 7.608.573 |
| European Bank for Reconstruction & Development 'GMTN' FRN 0.239% 14-Apr-2026 | 5.300.000 | 5.300.000 | German Postal Pensions Securitisation Plc 3.750% 18-Jan-2021 | 6.300.000 | 7.600.636 |
| International Finance Facility for Immunisation Co 'GMTN' 1.000% 21-Apr-2036 | 5.003.000 | 4.988.191 | Norway Government Bond '144A' 1.375% 19-Aug-2030 | 60.300.000 | 7.032.628 |
| Colombia Government International Bond 4.500% 15-Mar-2029 | 4.230.000 | 4.822.731 | United Kingdom Inflation-Linked Gilt 0.125% 22-Mar-2026 | 3.969.732 | 6.416.552 |
| United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Feb-2030 | 4.700.000 | 4.794.734 | United States Treasury Note/Bond 3.000% 15-Nov-2045 | 5.315.600 | 6.251.319 |
| Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031 | 81.300.000 | 4.720.692 | Denmark Government Bond '144A' 0.500% 15-Nov-2029 | 35.880.000 | 6.219.214 |
| International Bank for Reconstruction & Development FRN 0.480% 19-Aug-2027 | 4.630.000 | 4.657.456 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.000% 15-Feb-2046 | 4.943.249 | 6.166.100 |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15-Jul-2031 | 4.106.126 | 4.553.857 | International Bank for Reconstruction & Development 'GMTN' 2.800% 12-Jan-2022 | 8.330.000 | 6.138.215 |
| United States Treasury Note/Bond 0.500% 15-Mar-2023 | 4.400.000 | 4.430.250 | Philippine Government International Bond 4.950% 15-Jan-2021 | 290.000.000 | 6.033.810 |
| International Bank for Reconstruction & Development FRN 0.340% 22-Nov-2028 | 4.430.000 | 4.430.000 | Canada Housing Trust No 1 '144A' 2.350% 15-Sep-2023 | 7.235.000 | 6.009.557 |
| Inter-American Development Bank 'GMTN' FRN 0.320% 20-Mar-2028 | 4.244.000 | 4.244.000 | Oesterreichische Kontrollbank AG 2.875% 07-Sep-2021 | 5.750.000 | 5.750.000 |
| United States Treasury Note/Bond 2.875% 15-May-2043 | 3.590.000 | 4.116.974 | Japan Government Thirty Year Bond 0.500% 20-Sep-2046 | 626.000.000 | 5.624.901 |
| Queensland Treasury Corp '144A' 1.750% 20-Jul-2034 | 5.570.000 | 4.050.741 | United States Treasury Note/Bond 2.875% 15-May-2043 | 4.678.900 | 5.273.627 |
| Inter-American Development Bank 'GMTN' FRN 0.250% 10-Feb-2026 | 3.948.000 | 3.948.000 | United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Feb-2030 | 5.170.000 | 5.131.511 |
| Republic of Italy Government International Bond 0.875% 06-May-2024 | 3.929.000 | 3.916.152 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4.500% 01-May-2023 | 3.880.000 | 4.777.568 |
| Treasury Corp of Victoria 2.000% 17-Sep-2035 | 4.760.000 | 3.447.394 | Mexican Bonos 7.500% 03-Jun-2027 | 82.060.000 | 4.659.690 |
| iShares China CNY Bond UCITS ETF - ETF | 611.803 | 3.381.134 | United Kingdom Gilt 3.750% 22-Jul-2052 | 2.080.000 | 4.621.994 |
| Asian Infrastructure Investment Bank/The 0.500% 30-Oct-2024 | 3.257.000 | 3.252.180 | Mexico Government International Bond 3.900% 27-Apr-2025 | 4.030.000 | 4.517.744 |
| United States Treasury Note/Bond 2.375% 15-May-2029 | 3.010.000 | 3.237.391 | Abu Dhabi Government International Bond 'REGS' 2.500% 16-Apr-2025 | 4.031.000 | 4.298.668 |
| Canada Housing Trust No 1 FRN 0.323% 15-Mar-2027 | 3.800.000 | 3.023.311 | Spain Government Bond 5.750% 30-Jul-2032 | 2.200.000 | 4.203.847 |
| Kommunalbanken AS 'REGS' FRN 1.050% 17-Jun-2026 | 2.722.000 | 2.820.055 | Qatar Government International Bond 'REGS' 3.400% 16-Apr-2025 | 3.793.000 | 4.085.645 |
| International Finance Corp 'GMTN' 6.300% 25-Nov-2024 | 191.800.000 | 2.717.605 | Queensland Treasury Corp '144A' 1.750% 20-Jul-2034 | 5.570.000 | 4.011.758 |
| Indonesia Treasury Bond 6.500% 15-Jun-2025 | 33.890.000.000 | 2.482.437 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 1.850% 01-Jul-2025 | 3.020.000 | 3.939.791 |
| Province of British Columbia Canada 'EMTN' 0.875% 08-Oct-2025 | 1.887.000 | 2.413.906 | Malaysia Government Bond 3.828% 05-Jul-2034 | 16.180.000 | 3.882.552 |
| Japan Government Thirty Year Bond 0.500% 20-Sep-2046 | 264.550.000 | 2.384.201 | United States Treasury Note/Bond 1.125% 28-Feb-2022 | 3.820.000 | 3.858.946 |
| New Zealand Government Bond 2.750% 15-May-2051 | 3.330.000 | 2.320.676 | | | |

BNY Mellon Global Credit Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Wichtige Käufe | Nominal | Kosten USD | Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten | Nominal | Erlöse USD |
|---|-------------|---------------|--|-------------|---------------|
| Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund | 541.425.769 | 541.425.769 | Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund | 555.121.891 | 555.121.891 |
| United States Treasury Note/Bond 0.750% 31-May-2026 | 27.810.000 | 27.259.232 | United States Treasury Note/Bond 0.125% 30-Nov-2022 | 53.449.400 | 53.446.579 |
| United States Treasury Note/Bond 1.250% 31-Mar-2028 | 19.873.100 | 19.638.660 | United States Treasury Note/Bond 0.125% 30-Jun-2022 | 42.795.800 | 42.812.827 |
| United States Treasury Note/Bond 1.125% 15-Feb-2031 | 17.000.000 | 16.471.406 | Bundesobligation 0.000% 11-Apr-2025 | 25.377.777 | 31.518.747 |
| Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 4.750% 23-Jan-2029 | 10.000.000 | 11.797.400 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15-Aug-2030 | 21.474.946 | 26.650.694 |
| salesforce.com Inc 1.950% 15-Jul-2031 | 10.318.000 | 10.288.181 | United States Treasury Note/Bond 0.375% 30-Apr-2025 | 24.203.600 | 24.002.297 |
| Coca-Cola Co/The 0.950% 06-May-2036 | 8.464.000 | 10.228.507 | United States Treasury Note/Bond 1.250% 31-Mar-2028 | 19.873.100 | 20.035.383 |
| Imperial Brands Finance Plc 'EMTN' 2.125% 12-Feb-2027 | 7.860.000 | 9.904.495 | Intercontinental Exchange Inc 1.850% 15-Sep-2032 | 18.594.000 | 18.019.419 |
| Hammerson Ireland Finance DAC 1.750% 03-Jun-2027 | 7.247.000 | 8.757.446 | United States Treasury Note/Bond 0.375% 30-Nov-2025 | 17.410.400 | 17.151.984 |
| Intercontinental Exchange Inc 1.850% 15-Sep-2032 | 9.242.000 | 8.506.429 | United States Treasury Note/Bond 1.125% 15-Feb-2031 | 17.000.000 | 16.799.834 |
| Credit Suisse Group AG '144A' 4.282% 09-Jan-2028 | 7.652.000 | 8.429.368 | United States Treasury Note/Bond 1.125% 15-May-2040 | 17.988.500 | 15.336.057 |
| UBS Group AG 'EMTN' FRN 0.250% 29-Jan-2026 | 6.846.000 | 8.352.654 | Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 4.750% 23-Jan-2029 | 10.000.000 | 11.867.300 |
| Volkswagen Leasing GmbH 'EMTN' 0.000% 19-Jul-2024 | 6.886.000 | 8.351.746 | Electricite de France SA 'EMTN' 6.250% 30-May-2028 | 6.250.000 | 11.622.412 |
| Daimler International Finance BV 'EMTN' 0.250% 06-Nov-2023 | 6.812.000 | 8.346.353 | salesforce.com Inc 1.950% 15-Jul-2031 | 10.318.000 | 10.445.737 |
| Danaher Corp 1.700% 30-Mar-2024 | 6.536.000 | 8.329.172 | United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Feb-2030 | 10.436.000 | 10.408.095 |
| Asahi Group Holdings Ltd 0.010% 19-Apr-2024 | 6.861.000 | 8.284.338 | Coca-Cola Co/The 0.950% 06-May-2036 | 8.464.000 | 10.209.260 |
| Fidelity National Information Services Inc 1.100% 15-Jul-2024 | 6.588.000 | 8.257.196 | PPL Capital Funding Inc 4.125% 15-Apr-2030 | 8.641.000 | 10.165.618 |
| Teck Resources Ltd 3.900% 15-Jul-2030 | 7.870.000 | 8.228.479 | BAT International Finance PLC 'EMTN' 2.250% 26-Jun-2028 | 6.621.000 | 9.441.654 |
| Bank of America Corp 'EMTN' FRN 1.667% 02-Jun-2029 | 5.740.000 | 8.118.663 | Republic of Ireland Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 22-Feb-2021 | 7.720.000 | 9.381.348 |
| Schlumberger Holdings Corp '144A' 3.900% 17-May-2028 | 7.189.000 | 8.118.322 | Teck Resources Ltd 3.900% 15-Jul-2030 | 7.870.000 | 8.405.790 |

BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Wichtige Käufe | Nominal | Kosten USD | Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten | Nominal | Erlöse USD |
|--|----------------|---------------|--|---------------|---------------|
| United States Treasury Note/Bond 0.500% 15-Mar-2023 | 16.130.000 | 16.225.741 | Australia Government Bond 5.500% 21-Apr-2023 | 39.440.000 | 32.668.770 |
| French Republic Government Bond OAT 0.100% 01-Mar-2025 | 12.270.923 | 15.335.817 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.750% 15-Jul-2028 | 18.670.707 | 21.724.043 |
| Australia Government Bond 5.500% 21-Apr-2023 | 15.960.000 | 13.755.748 | United States Treasury Note/Bond 0.500% 15-Mar-2023 | 21.420.000 | 21.503.656 |
| iShares China CNY Bond UCITS ETF - ETF | 2.635.811 | 13.218.270 | United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Feb-2030 | 21.260.000 | 21.234.206 |
| United States Treasury Floating Rate Note - When Issued FRN 0.120% 31-Oct-2023 | 13.030.000 | 13.030.000 | Japan Government Two Year Bond 0.100% 01-Dec-2022 | 1.636.400.000 | 15.139.451 |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15-Apr-2023 | 9.550.357 | 9.932.212 | iShares J.P. Morgan USD EM Bond UCITS ETF - ETF | 128.863 | 14.239.982 |
| Mellon Investments Funds ICVC - BNY Mellon Global High Yield Bond Fund | 4.180.241 | 8.584.138 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 5.000% 01-Aug-2034 | 7.790.000 | 14.108.880 |
| Canadian Government Real Return Bond 4.000% 01-Dec-2031 | 6.786.740 | 7.806.664 | Norway Government Bond '144A' 1.750% 17-Feb-2027 | 97.225.000 | 11.529.644 |
| Canada Housing Trust No 1 '144A' 2.350% 15-Sep-2023 | 8.870.000 | 7.390.409 | United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Aug-2026 | 7.600.000 | 7.923.297 |
| SPDR Bloomberg Barclays Emerging Markets Local Bond UCITS ETF - ETF | 100.799 | 7.080.350 | Japan Government Two Year Bond 0.100% 01-Apr-2022 | 840.750.000 | 7.850.263 |
| Colombia Government International Bond 'REGS' 7.000% 30-Jun-2032 | 19.551.800.000 | 5.763.588 | Mellon Investments Funds ICVC - BNY Mellon Global High Yield Bond Fund | 3.954.090 | 7.672.367 |
| Japan Government Two Year Bond 0.100% 01-Dec-2022 | 528.050.000 | 5.008.742 | French Republic Government Bond OAT 0.100% 01-Mar-2025 | 6.054.314 | 7.499.706 |
| Asian Development Bank 'GMTN' FRN 1.050% 27-Aug-2026 | 4.770.000 | 4.967.287 | iShares China CNY Bond UCITS ETF - ETF | 1.274.149 | 7.090.295 |
| European Bank for Reconstruction & Development 'GMTN' FRN 0.239% 14-Apr-2026 | 4.850.000 | 4.850.000 | Spain Government Bond '144A' 5.150% 31-Oct-2028 | 4.125.000 | 6.811.368 |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.000% 15-Feb-2046 | 3.782.998 | 4.839.357 | SPDR Bloomberg Barclays Emerging Markets Local Bond UCITS ETF - ETF | 100.799 | 6.748.695 |
| Czech Republic Government Bond 0.450% 25-Oct-2023 | 105.900.000 | 4.769.312 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15-Apr-2023 | 5.342.386 | 5.607.954 |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15-Jul-2031 | 4.126.760 | 4.576.740 | Treasury Corp of Victoria 2.250% 20-Nov-2034 | 6.810.000 | 5.458.578 |
| Canada Housing Trust No 1 FRN 0.323% 15-Mar-2027 | 5.715.000 | 4.546.901 | United Kingdom Inflation-Linked Gilt 0.125% 22-Mar-2026 | 3.238.647 | 5.249.285 |
| International Finance Facility for Immunisation Co 'GMTN' 1.000% 21-Apr-2026 | 4.540.000 | 4.526.582 | Societe Generale SA FRN (Perpetual) 6.750% 07-Oct-2169 | 4.048.000 | 4.814.085 |
| Japan Government Two Year Bond 0.005% 01-Nov-2023 | 498.950.000 | 4.395.187 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.000% 15-Feb-2046 | 3.782.998 | 4.720.167 |
| Inter-American Development Bank 'GMTN' FRN 0.320% 20-Mar-2028 | 3.840.000 | 3.840.000 | Philippine Government International Bond 4.950% 15-Jan-2021 | 220.000.000 | 4.577.373 |
| Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031 | 66.090.000 | 3.837.950 | German Postal Pensions Securitisation Plc 3.750% 18-Jan-2021 | 3.500.000 | 4.222.576 |
| Royal Bank of Canada 'GMTN' FRN 0.620% 27-Apr-2026 | 3.700.000 | 3.700.000 | | | |
| Colombia Government International Bond 4.500% 15-Mar-2029 | 3.230.000 | 3.692.377 | | | |
| Pacific Life Global Funding II 'REGS' 1.375% 14-Apr-2026 | 3.650.000 | 3.648.066 | | | |
| HSBC Holdings Plc FRN 0.732% 17-Aug-2024 | 3.600.000 | 3.600.895 | | | |
| TotalEnergies SE FRN (Perpetual) 1.625% 25-Jan-2170 | 2.900.000 | 3.548.797 | | | |
| Asian Infrastructure Investment Bank/The 0.500% 30-Oct-2024 | 3.496.000 | 3.490.826 | | | |

BNY Mellon Global Emerging Markets Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Wichtige Käufe | Nominal | Kosten USD | Wichtige Verkäufe | Nominal | Erlöse USD |
|---|---------|---------------|---|-----------|---------------|
| Tencent Holdings Ltd | 44.945 | 3.445.377 | Ilijin Materials Co Ltd | 40.535 | 3.295.364 |
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | 118.000 | 2.556.866 | Flat Glass Group Co Ltd 'H' | 868.000 | 2.934.974 |
| Tencent Music Entertainment Group ADR | 136.470 | 2.547.939 | New Oriental Education & Technology Group Inc ADR | 260.008 | 2.885.501 |
| LONGi Green Energy Technology Co Ltd 'A' | 143.200 | 2.429.492 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | 132.000 | 2.854.333 |
| By-health Co Ltd | 459.600 | 2.339.598 | Samsung SDI Co Ltd | 4.600 | 2.696.037 |
| Samsung SDI Co Ltd | 3.506 | 2.251.680 | Prosus NV | 29.315 | 2.586.454 |
| Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H' | 188.500 | 2.246.662 | Livent Corp | 112.180 | 2.569.182 |
| Tata Consultancy Services Ltd | 48.816 | 2.081.138 | Meituan '144A' | 63.817 | 2.548.588 |
| Yum China Holdings Inc | 33.734 | 2.040.752 | Housing Development Finance Corp Ltd | 67.923 | 2.462.919 |
| New Oriental Education & Technology Group Inc ADR | 24.229 | 2.025.775 | Info Edge India Ltd | 30.919 | 2.371.783 |
| Housing Development Finance Corp Ltd | 51.292 | 1.833.385 | Orocobre Ltd | 426.478 | 2.316.856 |
| AIA Group Ltd | 143.600 | 1.828.192 | Titan Co Ltd | 99.133 | 2.160.640 |
| Alibaba Group Holding Ltd ADR | 7.252 | 1.803.227 | Tencent Holdings Ltd | 28.915 | 2.085.546 |
| Prosus NV | 15.783 | 1.795.451 | AIA Group Ltd | 157.600 | 1.930.900 |
| Maruti Suzuki India Ltd | 16.353 | 1.662.008 | Maruti Suzuki India Ltd | 20.094 | 1.929.498 |
| Hindustan Unilever Ltd | 48.848 | 1.598.758 | Asian Paints Ltd | 42.419 | 1.712.934 |
| Meituan '144A' | 34.887 | 1.556.921 | Alibaba Group Holding Ltd | 72.900 | 1.620.893 |
| Info Edge India Ltd | 23.217 | 1.537.133 | Globant SA | 6.056 | 1.614.979 |
| Godrej Consumer Products Ltd | 142.997 | 1.504.623 | Jubilant Foodworks Ltd | 35.508 | 1.548.218 |
| Flat Glass Group Co Ltd 'H' | 392.000 | 1.500.895 | EPAM Systems Inc | 3.021 | 1.537.617 |
| LG Chem Ltd | 1.951 | 1.457.822 | Xinyi Solar Holdings Ltd | 726.000 | 1.491.419 |
| Livent Corp | 71.443 | 1.452.748 | Sociedad Quimica y Minera de Chile SA ADR | 27.889 | 1.338.206 |
| Shenzhen Inovance Technology Co Ltd | 143.900 | 1.452.312 | LONGi Green Energy Technology Co Ltd 'A' | 95.900 | 1.295.418 |
| B3 SA - Brasil Bolsa Balcao | 320.399 | 1.345.863 | Bilibili Inc ADR | 11.805 | 1.293.777 |
| HDFC Bank Ltd | 65.448 | 1.301.588 | Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H' | 130.500 | 1.198.929 |
| Advantest Corp | 14.700 | 1.297.644 | ASML Holding NV | 1.490 | 1.124.730 |
| MercadoLibre Inc | 798 | 1.282.513 | Tencent Music Entertainment Group ADR | 77.020 | 1.093.974 |
| NARI Technology Co Ltd 'A' | 262.100 | 1.179.258 | Elite Material Co Ltd | 122.000 | 944.949 |
| Wal-Mart de Mexico SAB de CV | 377.380 | 1.175.182 | MercadoLibre Inc | 561 | 942.919 |
| Autohome Inc ADR | 10.871 | 1.116.195 | Vale Indonesia Tbk PT | 2.506.796 | 930.203 |
| Foshan Haitian Flavouring & Food Co Ltd 'A' | 65.400 | 1.109.396 | China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd | 537.500 | 920.512 |
| EPAM Systems Inc | 2.893 | 1.066.026 | Godrej Consumer Products Ltd | 72.062 | 895.903 |
| Asian Paints Ltd | 29.594 | 1.042.781 | NARI Technology Co Ltd 'A' | 146.500 | 861.816 |
| ASML Holding NV | 1.594 | 970.883 | Tata Consultancy Services Ltd | 16.730 | 807.408 |
| Ilijin Materials Co Ltd | 15.393 | 970.495 | PVR Ltd | 50.504 | 779.102 |
| Globant SA | 4.472 | 961.081 | | | |
| Titan Co Ltd | 43.606 | 910.247 | | | |
| Jubilant Foodworks Ltd | 22.318 | 869.941 | | | |
| Pharmaron Beijing Co Ltd 'H' '144A' | 42.600 | 840.547 | | | |
| OTP Bank Nyrt | 14.326 | 817.606 | | | |
| Sungrow Power Supply Co Ltd | 36.900 | 756.695 | | | |

BNY Mellon Global Equity Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Wichtige Käufe | Nominal | Kosten USD | Wichtige Verkäufe | Nominal | Erlöse USD |
|------------------------------|---------|---------------|---|-----------|---------------|
| CME Group Inc | 42.494 | 8.929.280 | Goldman Sachs Group Inc/The | 27.788 | 9.908.638 |
| Volkswagen AG - Preference | 29.268 | 7.954.661 | Brenntag SE | 96.176 | 8.443.495 |
| Relx Plc | 404.564 | 7.532.414 | Relx Plc | 422.622 | 8.110.462 |
| JPMorgan Chase & Co | 44.355 | 7.395.629 | Alphabet Inc - Class A | 2.941 | 7.324.917 |
| TE Connectivity Ltd | 54.608 | 7.379.047 | Applied Materials Inc | 64.557 | 7.159.048 |
| Cooper Cos Inc/The | 16.022 | 6.574.024 | Kasikornbank PCL (Foreign Market) | 1.465.900 | 6.105.434 |
| Novozymes A/S | 89.428 | 5.878.272 | Intact Financial Corp | 51.475 | 5.872.951 |
| HDFC Bank Ltd | 253.081 | 5.489.451 | Deutsche Post AG | 84.516 | 5.118.168 |
| Ecolab Inc | 22.114 | 4.791.577 | Ferguson Plc | 36.979 | 5.108.187 |
| Diageo Plc | 95.785 | 4.050.527 | Citigroup Inc | 70.776 | 4.977.504 |
| Ebara Corp | 92.700 | 3.391.408 | Meituan - Class B '144A' | 127.079 | 4.821.094 |
| Roche Holding AG | 8.815 | 3.387.186 | Microsoft Corp | 17.282 | 4.708.375 |
| Microsoft Corp | 12.703 | 3.132.718 | Merck & Co Inc | 60.169 | 4.526.108 |
| Ferguson Plc | 23.806 | 3.073.838 | Apple Inc | 31.563 | 4.392.253 |
| Apple Inc | 23.198 | 3.058.461 | Samsung SDI Co Ltd | 6.842 | 4.014.528 |
| Norfolk Southern Corp | 10.683 | 3.001.552 | Amazon.com Inc | 1.101 | 3.611.438 |
| Texas Instruments Inc | 16.406 | 2.915.147 | Sony Group Corp | 30.400 | 3.280.599 |
| Alphabet Inc - Class A | 1.317 | 2.824.781 | Verizon Communications Inc | 56.738 | 3.228.569 |
| Amazon.com Inc | 810 | 2.584.468 | Albemarle Corp | 14.386 | 3.180.658 |
| Continental AG | 18.593 | 2.494.983 | Continental AG | 22.892 | 3.065.633 |
| Bayer AG | 37.854 | 2.472.250 | SAP SE | 20.933 | 2.670.196 |
| General Electric Co | 63.016 | 2.466.716 | Abbott Laboratories | 20.712 | 2.542.703 |
| Associated British Foods Plc | 69.135 | 2.287.250 | Informa Plc | 351.049 | 2.513.264 |
| Albemarle Corp | 13.224 | 2.176.092 | Accenture Plc - Class A | 7.788 | 2.353.704 |
| Samsung SDI Co Ltd | 2.894 | 1.841.481 | Wolters Kluwer NV | 27.347 | 2.346.726 |
| Abbott Laboratories | 15.223 | 1.800.115 | AIA Group Ltd | 178.600 | 2.143.772 |
| Goldman Sachs Group Inc/The | 5.308 | 1.773.861 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR | 16.047 | 1.903.661 |
| Citigroup Inc | 25.732 | 1.754.515 | Mastercard Inc | 5.338 | 1.862.266 |
| Barclays Plc | 695.941 | 1.736.473 | L'Oreal SA | 4.092 | 1.789.221 |
| Suzuki Motor Corp | 38.300 | 1.715.907 | Medtronic Plc | 13.921 | 1.647.443 |
| AIA Group Ltd | 131.400 | 1.699.659 | | | |
| Costco Wholesale Corp | 4.714 | 1.670.764 | | | |
| Sony Group Corp | 15.200 | 1.606.897 | | | |
| Accenture Plc - Class A | 5.724 | 1.602.979 | | | |
| Swedbank AB | 85.698 | 1.599.350 | | | |
| Applied Materials Inc | 12.727 | 1.514.427 | | | |

BNY Mellon Global Equity Income Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Wichtige Käufe | Nominal | Kosten USD | Wichtige Verkäufe | Nominal | Erlöse USD |
|---|-----------|---------------|---|-----------|---------------|
| JPMorgan Chase & Co | 131.553 | 21.164.975 | Cisco Systems Inc/Delaware | 535.126 | 28.455.741 |
| Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen | 68.208 | 20.064.192 | Samsung Electronics Co Ltd - Preference | 394.550 | 24.810.306 |
| Dominion Energy Inc | 191.181 | 14.749.259 | Infosys Ltd ADR | 1.167.878 | 24.226.536 |
| Volkswagen AG - Preference | 52.863 | 13.420.029 | QUALCOMM Inc | 147.898 | 22.191.637 |
| Bunzl Plc | 369.546 | 12.584.296 | Cie Financiere Richemont SA | 178.182 | 21.991.650 |
| Insurance Australia Group Ltd | 2.422.481 | 9.357.799 | Zurich Insurance Group AG | 43.421 | 18.197.600 |
| Anglo American Plc | 232.310 | 8.948.918 | Roche Holding AG | 45.019 | 17.192.146 |
| Sysco Corp | 118.787 | 8.854.572 | H & M Hennes & Mauritz AB | 726.687 | 16.643.479 |
| Sage Group Plc/The | 1.028.788 | 8.723.346 | PepsiCo Inc | 98.354 | 15.358.243 |
| Home Depot Inc/The | 31.389 | 8.576.155 | RELX Plc | 498.007 | 14.877.640 |
| RELX Plc | 302.292 | 7.658.991 | Goldman Sachs Group Inc/The | 41.440 | 14.312.520 |
| Medtronic Plc | 61.954 | 6.847.303 | Industria de Diseno Textil SA | 392.750 | 13.604.489 |
| Credicorp Ltd | 50.246 | 6.305.051 | Paychex Inc | 117.924 | 13.599.775 |
| Taylor Wimpey Plc | 2.863.381 | 6.222.681 | Sanofi | 135.209 | 13.448.909 |
| CMS Energy Corp | 101.332 | 5.898.259 | Merck & Co Inc | 165.341 | 13.003.079 |
| Roche Holding AG | 16.373 | 5.747.035 | Unilever Plc | 238.893 | 12.892.866 |
| Organon & Co | 159.961 | 5.719.162 | Texas Instruments Inc | 67.003 | 12.786.429 |
| Hubbell Inc - Class B | 24.531 | 4.656.695 | Procter & Gamble Co/The | 83.939 | 11.816.209 |
| Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H' | 378.500 | 3.618.533 | Informa Plc | 1.639.309 | 11.677.039 |
| CME Group Inc | 17.540 | 3.617.960 | CME Group Inc | 54.427 | 11.601.249 |
| Eversource Energy | 32.655 | 2.660.080 | Home Depot Inc/The | 31.389 | 11.384.943 |
| TotalEnergies SE | 50.141 | 2.589.459 | Emerson Electric Co | 124.949 | 11.350.071 |
| Royal Dutch Shell Plc | 105.439 | 2.548.313 | Novartis AG | 134.931 | 11.349.438 |
| Emerson Electric Co | 22.550 | 2.213.817 | Tapestry Inc | 249.276 | 11.329.515 |
| | | | KDDI Corp | 339.200 | 10.874.529 |
| | | | Principal Financial Group Inc | 164.133 | 10.607.376 |
| | | | Ferguson PLC | 72.427 | 10.606.991 |
| | | | CMS Energy Corp | 166.323 | 10.089.208 |
| | | | BAE Systems Plc | 1.335.869 | 10.000.220 |
| | | | JPMorgan Chase & Co | 61.409 | 9.948.571 |
| | | | Eversource Energy | 114.346 | 9.830.994 |
| | | | Macquarie Korea Infrastructure Fund | 851.230 | 9.138.075 |
| | | | Svenska Handelsbanken AB | 815.408 | 9.048.628 |
| | | | British American Tobacco Plc | 250.388 | 8.943.664 |
| | | | Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen | 31.483 | 8.841.867 |
| | | | Bayer AG | 158.699 | 8.822.658 |
| | | | Nestle SA | 69.744 | 8.714.903 |
| | | | Citigroup Inc | 126.232 | 8.433.010 |
| | | | Bunzl Plc | 214.176 | 7.912.016 |
| | | | Continental AG | 65.135 | 7.708.460 |
| | | | Western Union Co/The | 297.965 | 7.334.735 |
| | | | Verizon Communications Inc | 132.521 | 7.332.234 |
| | | | Philip Morris International Inc | 74.776 | 6.814.915 |
| | | | Dominion Energy Inc | 86.538 | 6.374.025 |

BNY Mellon Global High Yield Bond Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Wichtige Käufe | Nominal | Kosten USD | Wichtige Verkäufe | Nominal | Erlöse USD |
|--|-----------|---------------|--|-----------|---------------|
| Olympus Water US Holding Corp '144A' 4.250% 01-Oct-2028 | 1.833.000 | 1.833.000 | Banijay Group SAS 'REGS' 6.500% 01-Mar-2026 | 1.100.000 | 1.315.622 |
| Lorca Telecom Bondco SA 4.000% 18-Sep-2027 | 1.130.000 | 1.310.123 | Olympus Water US Holding Corp '144A' 4.250% 01-Oct-2028 | 1.170.000 | 1.149.084 |
| Carnival Corp '144A' 5.750% 01-Mar-2027 | 1.270.000 | 1.280.588 | Electricite de France SA FRN (Perpetual) 3.375% 15-Jun-2030 | 800.000 | 1.030.281 |
| Picard Groupe SAS 'REGS' 3.875% 01-Jul-2026 | 1.060.000 | 1.259.970 | Synlab Bondco PLC 'REGS' FRN 4.750% 01-Jul-2025 | 760.000 | 928.280 |
| Faurecia SE 2.750% 15-Feb-2027 | 910.000 | 1.054.463 | West Street Merger Sub Inc '144A' 6.375% 01-Sep-2025 | 865.000 | 891.702 |
| Endure Digital Inc '144A' 6.000% 15-Feb-2029 | 1.050.000 | 1.031.234 | Ardagh Packaging Finance PLC / Ardagh Holdings USA Inc 'REGS' 4.750% 15-Jul-2027 | 630.000 | 887.691 |
| Team Health Holdings Inc '144A' 6.375% 01-Feb-2025 | 1.115.000 | 1.011.363 | CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4.500% 01-May-2032 | 820.000 | 852.589 |
| Flamingo Lux II SCA 'REGS' 5.000% 31-Mar-2029 | 851.000 | 1.010.119 | Picard Groupe SAS 'REGS' 3.875% 01-Jul-2026 | 705.000 | 840.606 |
| Mausier Packaging Solutions Holding Co '144A' 7.250% 15-Apr-2025 | 986.000 | 975.308 | CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 4.500% 01-May-2032 | 820.000 | 826.193 |
| DirecTV Financing LLC Term Loan 5.750% 22-Jul-2027 0.000% 22-Jul-2027 | 970.000 | 966.513 | Altice France Holding SA 'REGS' 8.000% 15-May-2027 | 620.000 | 822.898 |
| AA Bond Co Ltd 'REGS' 6.500% 31-Jan-2026 | 665.000 | 938.938 | Vodafone Group PLC FRN 4.875% 03-Oct-2078 | 525.000 | 786.421 |
| LABL Inc '144A' 8.250% 01-Nov-2029 | 931.000 | 931.000 | US Concrete Inc '144A' 5.125% 01-Mar-2029 | 692.000 | 759.055 |
| TransDigm Inc '144A' 4.875% 01-May-2029 | 910.000 | 910.568 | Radiate Holdco LLC / Radiate Finance Inc '144A' 0.000 % 25-Sep-2026 | 750.000 | 753.906 |
| WW International Inc '144A' 4.500% 15-Apr-2029 | 910.000 | 910.000 | Lions Gate Capital Holdings LLC '144A' 6.375% 01-Feb-2024 | 730.000 | 753.272 |
| Paysafe Finance Plc / Paysafe Holdings US Corp 'REGS' 3.000% 15-Jun-2029 | 770.000 | 902.010 | WW International Inc '144A' 4.500% 15-Apr-2029 | 753.000 | 745.706 |
| UPC Broadband Finco BV '144A' 4.875% 15-Jul-2031 | 890.000 | 894.950 | William Hill Ltd 4.750% 01-May-2026 | 490.000 | 737.700 |
| Adtalem Global Education Inc '144A' 5.500% 01-Mar-2028 | 885.000 | 887.938 | Iron Mountain Inc '144A' 5.250% 15-Jul-2030 | 705.000 | 736.725 |
| Dycom Industries Inc '144A' 4.500% 15-Apr-2029 | 880.000 | 880.613 | Telecom Italia Finance SA 'EMTN' 7.750% 24-Jan-2033 | 430.000 | 716.778 |
| Clear Channel Outdoor Holdings Inc '144A' 7.750% 15-Apr-2028 | 855.000 | 862.213 | Dryden 69 Euro CLO 2018 DAC '144A' FRN 6.290% 18-Apr-2032 | 620.000 | 695.548 |
| CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 4.500% 01-May-2032 | 820.000 | 852.589 | Pinewood Finance Co Ltd 'REGS' 3.250% 30-Sep-2025 | 490.000 | 686.635 |

BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Wichtige Käufe | Nominal | Kosten USD | Wichtige Verkäufe | Nominal | Erlöse USD |
|---------------------------------------|-----------|---------------|-------------------------------------|---------|---------------|
| Antero Midstream Corp | 1.459.663 | 13.656.348 | PPL Corp | 500.726 | 14.379.514 |
| Engie SA | 809.705 | 11.332.593 | Deutsche Post AG | 156.763 | 10.358.160 |
| Omega Healthcare Investors Inc (REIT) | 352.916 | 10.998.486 | American Tower Corp (REIT) | 37.284 | 9.946.957 |
| Williams Cos Inc/The | 397.523 | 10.485.722 | Clearway Energy Inc | 266.672 | 8.450.272 |
| Naturgy Energy Group SA | 382.059 | 10.036.405 | ONEOK Inc | 130.333 | 7.415.553 |
| Medical Properties Trust Inc (REIT) | 425.639 | 8.981.878 | Enagas SA | 223.199 | 5.098.972 |
| Enagas SA | 386.165 | 8.542.520 | Williams Cos Inc/The | 160.098 | 4.736.206 |
| PPL Corp | 252.499 | 7.454.268 | SFL Corp Ltd | 500.645 | 3.982.588 |
| Orange SA | 596.357 | 7.099.538 | Dominion Energy Inc | 46.378 | 3.407.870 |
| Vistra Corp | 325.584 | 6.703.843 | Enbridge Inc | 76.854 | 2.972.972 |
| Clearway Energy Inc | 219.076 | 6.015.679 | Aena SME SA '144A' | 17.640 | 2.933.680 |
| Proximus SADP | 246.582 | 5.181.227 | Vinci SA | 23.380 | 2.661.978 |
| Enbridge Inc | 136.892 | 5.058.283 | Medical Properties Trust Inc (REIT) | 116.184 | 2.516.205 |
| Verizon Communications Inc | 84.078 | 4.740.637 | Atlantia SpA | 107.796 | 2.077.148 |
| Exelon Corp | 106.160 | 4.476.201 | Proximus SADP | 70.869 | 1.497.331 |
| Italgas SpA | 546.085 | 3.578.410 | Orange SA | 123.572 | 1.495.398 |
| American Tower Corp (REIT) | 14.864 | 3.248.372 | SSE Plc | 71.190 | 1.417.446 |
| Jiangsu Expressway Co Ltd 'H' | 3.146.000 | 3.215.044 | Naturgy Energy Group SA | 41.998 | 1.271.491 |
| Atlantia SpA | 177.768 | 3.171.625 | Verizon Communications Inc | 14.418 | 802.004 |
| Deutsche Post AG | 50.012 | 2.901.868 | Red Electrica Corp SA | 40.011 | 726.818 |
| Drax Group Plc | 383.343 | 2.891.878 | | | |
| ONEOK Inc | 51.807 | 2.439.739 | | | |
| Red Electrica Corp SA | 135.005 | 2.303.154 | | | |
| SSE Plc | 88.522 | 1.748.468 | | | |

BNY Mellon Global Leaders Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Wichtige Käufe | Nominal | Kosten USD | Alle Verkäufe | Nominal | Erlöse USD |
|---|---------|---------------|--|---------|---------------|
| Tencent Holdings Ltd | 32.400 | 2.206.198 | Cognizant Technology Solutions Corp | 11.100 | 813.485 |
| CSL Ltd | 6.100 | 1.290.827 | Alphabet Inc | 325 | 758.894 |
| Illumina Inc | 3.300 | 1.253.877 | Industria de Diseno Textil SA | 22.100 | 692.033 |
| Roche Holding AG | 3.400 | 1.173.678 | Ecolab Inc | 3.250 | 637.485 |
| Mastercard Inc | 3.200 | 1.101.761 | FANUC Corp | 2.200 | 461.917 |
| Novo Nordisk A/S | 13.400 | 1.044.593 | Air Liquide SA | 2.650 | 444.023 |
| Texas Instruments Inc | 5.300 | 1.013.328 | Texas Instruments Inc | 2.300 | 424.035 |
| TJX Cos Inc/The | 14.600 | 1.000.027 | LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE | 550 | 409.018 |
| Edwards Lifesciences Corp | 10.900 | 990.715 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR | 3.400 | 387.217 |
| Adobe Inc | 1.900 | 976.846 | ASML Holding NV | 550 | 356.959 |
| AIA Group Ltd | 85.200 | 965.523 | Colgate-Palmolive Co | 4.300 | 324.169 |
| Automatic Data Processing Inc | 4.900 | 928.460 | Reckitt Benckiser Group PLC | 3.600 | 309.624 |
| Air Liquide SA | 5.150 | 869.131 | Automatic Data Processing Inc | 1.400 | 273.250 |
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR | 7.300 | 868.725 | Intuitive Surgical Inc | 260 | 213.975 |
| Amphenol Corp - Class A | 11.700 | 853.888 | Amphenol Corp - Class A | 2.100 | 138.218 |
| L'Oreal SA | 2.100 | 814.952 | | | |
| Microsoft Corp | 2.900 | 744.684 | | | |
| Alphabet Inc | 300 | 728.872 | Obiges stellt die vollständigen Angaben zu den Verkäufen des Fonds im Geschäftsjahr dar. | | |
| Intuitive Surgical Inc | 1.300 | 684.227 | | | |
| Ecolab Inc | 3.400 | 681.916 | | | |
| LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE | 850 | 642.208 | | | |
| NIKE Inc | 3.900 | 572.822 | | | |
| Industria de Diseno Textil SA | 16.300 | 532.694 | | | |
| Keyence Corp | 1.000 | 504.974 | | | |
| FANUC Corp | 1.800 | 457.798 | | | |
| ASML Holding NV | 450 | 363.915 | | | |

BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund* für das Geschäftsjahr zum
31. Dezember 2021

| Alle Käufe | Nominal | Kosten EUR | Wichtige Verkäufe | Nominal | Erlöse EUR |
|---|-----------|---------------|---|-----------|---------------|
| Bundesschatzanweisungen 0.000% 10-Sep-2021 | 1.000.000 | 1.003.110 | Bundesschatzanweisungen 0.000% 10-Sep-2021 | 1.000.000 | 1.003.020 |
| Cordiant Digital Infrastructure Ltd/Fund '144A' | 139.168 | 158.427 | Hipgnosis Songs Fund Ltd/The Fund | 541.648 | 731.924 |
| VH Global Sustainable Energy Opportunities PLC | 138.880 | 156.587 | Renewables Infrastructure Group Ltd/The | 409.173 | 614.818 |
| ConocoPhillips | 4.369 | 154.764 | AIA Group Ltd | 45.600 | 484.517 |
| Home Depot Inc/The | 671 | 141.565 | Greencoat UK Wind PLC/Funds | 324.061 | 480.722 |
| TotalEnergies SE | 3.545 | 127.622 | GCP Infrastructure Investments Ltd | 342.644 | 391.240 |
| Royal Dutch Shell PLC | 6.833 | 101.538 | VPC Specialty Lending Investments Plc/Fund | 389.176 | 385.668 |
| Suncor Energy Inc | 3.593 | 59.572 | Mexican Bonos 8.500% 31-May-2029 | 8.104.600 | 376.560 |
| Hipgnosis Songs Fund Ltd/The Fund | 40.604 | 55.470 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.750% 15-Jul-2028 | 391.541 | 376.242 |
| RELX PLC | 2.682 | 53.662 | Ping An Insurance Group Co of China Ltd | 36.000 | 375.761 |
| Taylor Wimpey PLC | 27.031 | 50.538 | Greencoat Renewables PLC | 317.343 | 375.419 |
| Diageo PLC | 475 | 16.033 | International Public Partnerships Ltd | 186.528 | 358.991 |
| | | | B&M European Value Retail SA | 53.855 | 341.199 |
| | | | Albemarle Corp | 2.537 | 334.985 |
| | | | Volkswagen AG - Preference | 1.672 | 334.753 |
| | | | Samsung SDI Co Ltd | 657 | 330.293 |
| | | | Informa PLC | 50.444 | 327.411 |
| | | | Sdcl Energy Efficiency Income Trust PLC | 243.062 | 311.606 |
| | | | BAE Systems PLC | 53.387 | 308.359 |
| | | | Samsung Electronics Co Ltd - Preference | 5.549 | 303.994 |
| | | | Gresham House Energy Storage Fund PLC/The Fund | 230.185 | 297.016 |
| | | | Tufton Oceanic Assets Ltd/The Fund | 359.180 | 291.559 |
| | | | JLEN Environmental Assets Group Ltd Foresight Group Holdings | 220.770 | 287.377 |
| | | | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2.375% 15-Jan-2025 | 286.604 | 282.359 |
| | | | Ferguson PLC | 2.704 | 280.191 |
| | | | SKYCITY Entertainment Group Ltd | 145.698 | 280.141 |
| | | | British American Tobacco PLC | 9.101 | 280.008 |
| | | | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | 15.000 | 276.340 |
| | | | Civitas Social Housing Plc (REIT) | 208.487 | 260.517 |
| | | | Star Entertainment Grp Ltd/The | 104.371 | 260.330 |
| | | | Australia Government Bond 3.250% 21-Apr-2029 | 350.000 | 259.223 |
| | | | Goldman Sachs Group Inc/The | 871 | 243.763 |
| | | | Royal Dutch Shell PLC | 14.620 | 243.068 |

Obiges stellt die vollständigen Angaben zu den Käufen des Fonds im Geschäftsjahr dar.

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

BNY Mellon Global Opportunities Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Wichtige Käufe | Nominal | Kosten USD | Wichtige Verkäufe | Nominal | Erlöse USD |
|-----------------------------|---------|---------------|---|---------|---------------|
| Amazon.com Inc | 487 | 1.625.437 | Brenntag SE | 13.456 | 1.257.970 |
| CME Group Inc | 5.024 | 1.031.452 | Apple Inc | 7.402 | 982.341 |
| TE Connectivity Ltd | 7.476 | 1.025.540 | Relx Plc | 42.477 | 963.042 |
| Relx Plc | 37.834 | 819.964 | Continental AG | 7.248 | 930.909 |
| Roche Holding AG | 2.292 | 809.465 | Microsoft Corp | 3.133 | 910.841 |
| Ecolab Inc | 3.560 | 777.698 | Alphabet Inc - Class A | 330 | 856.730 |
| Cooper Cos Inc/The | 1.755 | 729.410 | Citigroup Inc | 11.085 | 783.843 |
| HDFC Bank Ltd | 33.261 | 727.742 | Applied Materials Inc | 6.430 | 767.768 |
| Novozymes A/S | 8.259 | 538.706 | Royal Dutch Shell PLC | 31.860 | 698.205 |
| SAP SE | 3.321 | 460.042 | Novartis AG | 7.725 | 688.490 |
| Abbott Laboratories | 3.512 | 424.541 | Intact Financial Corp | 5.810 | 664.701 |
| Microsoft Corp | 1.431 | 369.649 | Kasikornbank PCL (Foreign Market) | 155.200 | 640.320 |
| Medtronic Plc | 2.837 | 341.319 | Alibaba Group Holding Ltd | 34.772 | 634.311 |
| Suzuki Motor Corp | 7.900 | 332.278 | Ferguson Plc | 4.296 | 608.099 |
| Alphabet Inc - Class A | 134 | 302.196 | Accenture Plc - Class A | 1.625 | 542.507 |
| Apple Inc | 1.963 | 260.345 | Associated British Foods PLC | 17.410 | 499.391 |
| Eversource Energy | 3.082 | 259.669 | Altria Group Inc | 11.344 | 491.264 |
| Costco Wholesale Corp | 635 | 226.491 | Goldman Sachs Group Inc/The | 1.320 | 477.943 |
| Barclays Plc | 93.725 | 224.846 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR | 3.334 | 387.148 |
| Goldman Sachs Group Inc/The | 570 | 192.155 | Costco Wholesale Corp | 832 | 370.859 |
| Accenture Plc - Class A | 650 | 187.171 | Sony Group Corp | 3.300 | 353.741 |
| AIA Group Ltd | 14.600 | 186.493 | Roche Holding AG | 906 | 339.737 |
| Mastercard Inc | 524 | 178.093 | Medtronic Plc | 2.692 | 332.208 |
| Sony Group Corp | 1.600 | 177.402 | Mastercard Inc | 927 | 325.788 |
| Ferguson Plc | 1.344 | 177.208 | Diageo Plc | 6.860 | 324.910 |
| Diageo Plc | 3.868 | 172.446 | Samsung SDI Co Ltd | 504 | 313.118 |
| Citigroup Inc | 2.501 | 164.299 | Amazon.com Inc | 88 | 306.063 |
| Applied Materials Inc | 1.248 | 153.000 | AIA Group Ltd | 25.600 | 301.452 |
| | | | Vivendi SE | 9.278 | 286.135 |
| | | | SAP SE | 1.969 | 273.889 |
| | | | Abbott Laboratories | 2.249 | 272.454 |
| | | | Suzuki Motor Corp | 5.800 | 256.153 |
| | | | Unilever Plc | 4.483 | 252.831 |
| | | | Ebara Corp | 5.100 | 245.163 |
| | | | Texas Instruments Inc | 1.287 | 242.722 |
| | | | Wolters Kluwer NV | 2.308 | 239.809 |
| | | | Informa Plc | 32.554 | 232.912 |
| | | | Swedbank AB | 11.453 | 219.287 |
| | | | Barclays Plc | 91.041 | 217.822 |

BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Wichtige Käufe | Nominal | Kosten EUR | Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten | Nominal | Erlöse EUR |
|--|------------|---------------|--|-------------|---------------|
| BNP Paribas Issuance BV (WTS) (Zero Coupon) 18-Nov-2021 | 979.430 | 82.863.070 | iShares Physical Gold ETC - ETF | 6.477.247 | 184.887.944 |
| WisdomTree WTI Crude Oil - ETF | 14.626.056 | 81.855.354 | iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF - ETF | 2.438.069 | 112.796.302 |
| Barclays Bank Plc (WTS) 15-Aug-2022 | 768.117 | 65.346.594 | BNP Paribas Issuance BV (WTS) (Zero Coupon) 18-Nov-2021 | 979.430 | 88.379.821 |
| Barclays Bank Plc (WTS) 12-Aug-2022 | 768.117 | 65.064.311 | Invesco Physical Gold ETC - ETF | 467.947 | 67.408.967 |
| JPMorgan Chase & Co | 329.358 | 44.254.098 | Barclays Bank Plc (WTS) 16-Aug-2021 | 681.793 | 65.789.142 |
| AstraZeneca Plc | 512.646 | 43.493.378 | Barclays Bank Plc (WTS) 13-Aug-2021 | 685.759 | 63.678.237 |
| Sony Group Corp | 384.100 | 32.967.017 | ConocoPhillips | 1.051.019 | 56.549.899 |
| Bank of America Corp | 739.685 | 30.667.878 | WisdomTree Physical Swiss Gold - ETF | 333.482 | 47.896.228 |
| iShares Physical Gold ETC - ETF | 1.017.911 | 29.880.776 | Citigroup Inc | 742.989 | 44.294.530 |
| ConocoPhillips | 567.564 | 28.423.153 | Texas Instruments Inc | 261.302 | 43.544.896 |
| Thermo Fisher Scientific Inc | 68.532 | 26.984.111 | Anglo American PLC | 1.210.859 | 43.336.018 |
| Chubb Ltd | 146.856 | 24.759.871 | Amundi Physical Gold ETC - ETF | 717.037 | 43.140.972 |
| Home Depot Inc/The | 109.573 | 24.327.449 | Zurich Insurance Group AG | 93.414 | 35.592.238 |
| Advantest Corp | 302.200 | 22.699.578 | Home Depot Inc/The | 109.573 | 34.420.121 |
| WisdomTree Copper - ETF | 696.569 | 21.565.764 | Kansas City Southern/Old | 137.026 | 29.123.045 |
| Taylor Wimpey Plc | 10.199.061 | 20.233.534 | Vivendi SE | 1.024.411 | 29.035.310 |
| Trane Technologies Plc | 123.395 | 19.514.721 | iShares Physical Silver ETC - ETF | 1.402.212 | 25.873.397 |
| Fidelity National Information Services Inc | 169.277 | 19.016.063 | Alphabet Inc - Class A | 16.158 | 25.708.702 |
| IDEXX Laboratories Inc | 33.690 | 18.798.423 | Novartis AG | 321.495 | 23.202.750 |
| Relx Plc | 1.126.650 | 17.859.528 | Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031 | 483.175.100 | 20.791.556 |
| Alphabet Inc - Class A | 8.075 | 17.358.791 | Relx Plc | 1.209.100 | 20.091.815 |
| Novozymes A/S | 318.234 | 16.833.789 | | | |
| Hubbell Inc - Class B | 92.028 | 16.701.167 | | | |
| Star Entertainment Grp Ltd/The | 7.051.000 | 16.628.086 | | | |
| Morgan Stanley | 190.085 | 16.410.430 | | | |
| Zoetis Inc | 93.961 | 16.352.682 | | | |
| Universal Music Group NV | 646.018 | 16.300.762 | | | |
| TE Connectivity Ltd | 143.930 | 15.800.784 | | | |
| Nestle SA | 127.890 | 15.548.112 | | | |
| Yum China Holdings Inc | 287.833 | 15.382.665 | | | |
| DMS UCITS Platform ICAV - FVC Equity Dispersion UCITS Fund | 169.730 | 15.368.375 | | | |
| Barclays Bank Plc (WTS) 16-Aug-2021 | 162.948 | 14.568.721 | | | |
| Barclays Bank Plc (WTS) 13-Aug-2021 | 168.706 | 14.476.623 | | | |
| Alibaba Group Holding Ltd | 656.133 | 14.325.303 | | | |
| CME Group Inc | 81.903 | 13.856.410 | | | |

BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP) für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Wichtige Käufe | Nominal | Kosten GBP | Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten | Nominal | Erlöse GBP |
|---|-----------|---------------|---|------------|---------------|
| United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 19-Apr-2022 | 3.600.000 | 3.599.747 | United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 18-Oct-2021 | 3.100.000 | 3.100.000 |
| United Kingdom Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 18-Oct-2021 | 3.100.000 | 3.099.541 | iShares Physical Gold ETC - ETF | 125.244 | 3.058.515 |
| BNP Paribas Issuance BV (Zero Coupon) (WTS) 18-Nov-2021 | 23.500 | 1.759.306 | iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF - ETF | 53.230 | 2.110.440 |
| WisdomTree WTI Crude Oil - ETF | 337.922 | 1.611.200 | BNP Paribas Issuance BV (Zero Coupon) (WTS) 18-Nov-2021 | 23.500 | 1.779.969 |
| Barclays Bank Plc (WTS) 15-Aug-2022 | 18.267 | 1.315.971 | Invesco Physical Gold ETC - ETF | 14.032 | 1.763.870 |
| Barclays Bank Plc (WTS) 12-Aug-2022 | 18.267 | 1.313.227 | Barclays Bank Plc (WTS) 16-Aug-2021 | 16.788 | 1.371.779 |
| AstraZeneca Plc | 12.309 | 902.621 | Barclays Bank Plc (WTS) 13-Aug-2021 | 16.862 | 1.328.879 |
| JPMorgan Chase & Co | 7.280 | 834.760 | WisdomTree Physical Swiss Gold - ETF | 9.100 | 1.114.006 |
| Sony Group Corp | 9.000 | 663.768 | Amundi Physical Gold ETC - ETF | 17.865 | 943.222 |
| Ensemble Investment Corporation SA (WTS) 27-Oct-2022 | 7.650 | 646.756 | Texas Instruments Inc | 6.250 | 878.778 |
| Bank of America Corp | 16.548 | 580.021 | Citigroup Inc | 16.271 | 824.876 |
| Thermo Fisher Scientific Inc | 1.618 | 548.684 | ConocoPhillips | 17.822 | 783.383 |
| Chubb Ltd | 3.531 | 505.041 | Zurich Insurance Group AG | 2.230 | 717.512 |
| Home Depot Inc/The | 2.627 | 496.057 | Home Depot Inc/The | 2.627 | 704.956 |
| ConocoPhillips | 10.459 | 490.640 | Anglo American PLC | 21.193 | 667.848 |
| Advantest Corp | 7.300 | 467.015 | Kansas City Southern/Old | 3.433 | 626.150 |
| Relx Plc | 31.106 | 464.623 | Vivendi SE | 25.318 | 618.366 |
| WisdomTree Copper - ETF | 16.423 | 436.099 | Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031 | 15.784.300 | 584.026 |
| Trane Technologies Plc | 2.967 | 399.325 | Relx Plc | 31.074 | 461.001 |
| Taylor Wimpey Plc | 220.849 | 379.038 | Novartis AG | 7.471 | 455.210 |
| Fidelity National Information Services Inc | 3.809 | 374.823 | iShares Physical Silver ETC - ETF | 27.236 | 426.946 |
| IDEXX Laboratories Inc | 782 | 373.124 | | | |
| TE Connectivity Ltd | 3.669 | 350.581 | | | |
| Hubbell Inc - Class B | 2.228 | 343.584 | | | |
| Novozymes A/S | 7.512 | 339.813 | | | |
| Zoetis Inc | 2.259 | 337.935 | | | |

BNY Mellon Global Real Return Fund (USD) für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Wichtige Käufe | Nominal | Kosten USD | Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten | Nominal | Erlöse USD |
|--|------------|---------------|--|------------|---------------|
| United States Treasury Note/Bond 2.000% 15-Feb-2022 | 28.000.000 | 28.262.305 | iShares Physical Gold ETC - ETF | 523.658 | 17.773.439 |
| United States Treasury Note/Bond 2.125% 15-Aug-2021 | 14.300.000 | 14.380.906 | United States Treasury Note/Bond 2.125% 15-Aug-2021 | 14.300.000 | 14.300.000 |
| WisdomTree WTI Crude Oil - ETF | 1.529.575 | 10.088.782 | iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF - ETF | 206.153 | 11.181.696 |
| BNP Paribas Issuance BV (Zero Coupon) | 85.400 | 8.597.518 | BNP Paribas Issuance BV (Zero Coupon) 0.000% 18-Nov-2021 | 85.400 | 8.701.406 |
| Barclays Bank Plc (WTS) 12-Aug-2022 | 79.137 | 7.913.700 | Amundi Physical Gold ETC - ETF | 114.098 | 8.078.985 |
| Barclays Bank Plc (WTS) 15-Aug-2022 | 79.137 | 7.913.700 | Invesco Physical Gold ETC - ETF | 41.940 | 7.254.829 |
| JPMorgan Chase & Co | 44.302 | 7.071.856 | Barclays Bank Plc (WTS) 16-Aug-2021 | 59.801 | 6.782.887 |
| AstraZeneca Plc | 54.550 | 5.656.055 | Barclays Bank Plc (WTS) 13-Aug-2021 | 60.044 | 6.582.239 |
| ConocoPhillips | 74.276 | 4.801.408 | Home Depot Inc/The | 14.193 | 5.161.509 |
| Sony Group Corp | 44.100 | 4.523.170 | Texas Instruments Inc | 25.184 | 4.834.729 |
| Ensemble Investment Corporation SA (WTS) 27-Oct-2022 | 36.101 | 4.199.993 | Citigroup Inc | 64.673 | 4.461.860 |
| Thermo Fisher Scientific Inc | 8.052 | 3.899.570 | ConocoPhillips | 69.600 | 4.285.239 |
| Home Depot Inc/The | 14.193 | 3.822.129 | Zurich Insurance Group AG | 8.953 | 3.896.979 |
| Norfolk Southern Corp | 14.037 | 3.805.643 | Anglo American PLC | 85.974 | 3.789.223 |
| Bank of America Corp | 73.944 | 3.485.325 | Vivendi SE | 104.874 | 3.536.622 |
| Chubb Ltd | 17.417 | 3.349.837 | WisdomTree Physical Swiss Gold - ETF | 20.241 | 3.411.306 |
| Relx Plc | 159.938 | 3.294.341 | Kansas City Southern/Old | 12.686 | 3.233.737 |
| RWE AG | 81.382 | 3.129.198 | Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031 | 63.439.600 | 3.168.287 |
| Advantest Corp | 35.400 | 3.126.439 | Novartis AG | 35.239 | 2.917.144 |
| Linde Plc | 10.902 | 3.038.539 | Relx Plc | 132.518 | 2.541.244 |
| TE Connectivity Ltd | 21.113 | 2.841.804 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR | 20.686 | 2.391.160 |
| Trane Technologies Plc | 14.635 | 2.682.951 | Fidelity National Information Services Inc | 16.720 | 2.015.475 |
| iShares Physical Gold ETC - ETF | 75.516 | 2.680.848 | | | |

BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Wichtige Käufe | Nominal | Kosten USD | Wichtige Verkäufe | Nominal | Erlöse USD |
|---|-------------|---------------|---|-------------|---------------|
| Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund | 558.158.076 | 558.158.076 | Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund | 522.244.000 | 522.244.000 |
| Ithaca Energy North Sea Plc 'REGS' 9.000% 15-Jul-2026 | 20.000.000 | 20.000.000 | Bausch Health Americas Inc '144A' 8.500% 31-Jan-2027 | 16.449.000 | 17.422.496 |
| Trivium Packaging Finance BV 'REGS' 3.750% 15-Aug-2026 | 10.605.000 | 12.945.394 | Ithaca Energy North Sea Plc 'REGS' 9.375% 15-Jul-2024 | 16.500.000 | 17.273.850 |
| Promontoria Holding 264 BV 'REGS' 6.750% 15-Aug-2023 | 10.346.000 | 12.158.810 | Nouryon Holding BV 'REGS' 6.500% 01-Oct-2026 | 13.000.000 | 16.207.221 |
| INEOS Quattro Finance 1 Plc 'REGS' 3.750% 15-Jul-2026 | 9.595.000 | 11.845.627 | MARB BondCo PLC 'REGS' 7.000% 15-Mar-2024 | 15.700.000 | 15.974.750 |
| Trinseo Materials Operating SCA / Trinseo Materials Finance Inc '144A' 5.375% 01-Sep-2025 | 11.000.000 | 11.266.250 | RAC Bond Co PLC 'REGS' 5.000% 06-Nov-2022 | 11.347.000 | 15.823.355 |
| FS Luxembourg Sarl 'REGS' 10.000% 15-Dec-2025 | 10.104.000 | 11.226.094 | Groupe Ecore Holding SAS 'REGS' FRN 6.250% 15-Nov-2023 | 10.355.000 | 11.807.207 |
| Summer BC Holdco A Sarl 'REGS' 9.250% 31-Oct-2027 | 8.019.368 | 10.381.345 | Synlab Bondco PLC 'REGS' FRN 4.750% 01-Jul-2025 | 9.250.000 | 11.388.000 |
| Casino Guichard Perrachon SA 'EMTN' 4.561% 25-Jan-2023 | 8.000.000 | 10.268.127 | INEOS Group Holdings SA 'REGS' 5.375% 01-Aug-2024 | 9.626.000 | 11.150.110 |
| Emeco Pty Ltd 'MTN' 6.250% 10-Jul-2026 | 13.550.000 | 10.222.168 | INEOS Styrolution Group GmbH 'REGS' 2.250% 16-Jan-2027 | 9.000.000 | 10.558.705 |
| Sunshine Mid BV 'REGS' 6.500% 15-May-2026 | 8.400.000 | 9.995.053 | Casino Guichard Perrachon SA 'EMTN' 1.865% 13-Jun-2022 | 8.000.000 | 9.719.379 |
| Surgery Center Holdings Inc '144A' 10.000% 15-Apr-2027 | 9.000.000 | 9.804.900 | DNO ASA '144A' 8.750% 31-May-2023 | 9.300.000 | 9.667.207 |
| TK Elevator Midco GmbH 'REGS' 4.375% 15-Jul-2027 | 8.000.000 | 9.748.188 | Constantin Investissement 3 SASU 'REGS' 5.375% 15-Apr-2025 | 7.000.000 | 8.645.391 |
| Kenbourne Invest SA 'REGS' 6.875% 26-Nov-2024 | 9.000.000 | 9.581.270 | Rubis Terminal Infra SAS 'REGS' 5.625% 15-May-2025 | 6.850.000 | 8.580.959 |
| Kleopatra Holdings 2 SCA 'REGS' 6.500% 01-Sep-2026 | 7.860.000 | 9.244.415 | Leviathan Bond Ltd '144A' 5.750% 30-Jun-2023 | 8.000.000 | 8.477.500 |
| LABL Inc '144A' 10.500% 15-Jul-2027 | 8.000.000 | 8.782.500 | EC Finance PLC 'REGS' 2.375% 15-Nov-2022 | 7.000.000 | 8.267.105 |
| Gestamp Automocion SA 'REGS' 3.250% 30-Apr-2026 | 7.000.000 | 8.554.935 | XPO Logistics Inc '144A' 6.500% 15-Jun-2022 | 8.192.000 | 8.192.000 |
| PHM Group Holding Oy '144A' 4.750% 18-Jun-2026 | 7.000.000 | 8.523.294 | American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd '144A' 5.500% 20-Apr-2026 | 7.684.000 | 7.927.940 |
| Bausch Health Americas Inc '144A' 8.500% 31-Jan-2027 | 7.949.000 | 8.513.121 | Synthomer PLC 'REGS' 3.875% 01-Jul-2025 | 6.000.000 | 7.499.438 |
| Groupe Ecore Holding SAS 'REGS' FRN 6.250% 15-Nov-2023 | 7.355.000 | 8.487.681 | Altice France Holding SA 'REGS' 8.000% 15-May-2027 | 6.240.000 | 7.469.939 |

BNY Mellon Global Unconstrained Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Wichtige Käufe | Nominal | Kosten USD | Wichtige Verkäufe | Nominal | Erlöse USD |
|---|---------|---------------|--|---------|---------------|
| AstraZeneca Plc | 2.908 | 330.768 | Ebara Corp | 12.300 | 600.757 |
| HDFC Bank Ltd ADR | 4.288 | 325.548 | Samsung Electronics Co Ltd - Preference | 7.696 | 426.428 |
| SAP SE | 1.784 | 257.310 | Merck & Co Inc | 4.993 | 375.936 |
| Smurfit Kappa Group Plc | 4.773 | 250.782 | Novartis AG | 4.490 | 366.985 |
| GlaxoSmithKline Plc | 12.386 | 250.254 | Naspers Ltd | 1.791 | 307.407 |
| Legrand SA | 2.469 | 242.313 | Lennar Corp | 2.603 | 258.229 |
| Hays Plc | 103.266 | 233.800 | Ferguson Plc | 1.551 | 225.324 |
| Ecolab Inc | 801 | 184.099 | Continental AG | 1.678 | 225.259 |
| Greencoat UK Wind Plc/Funds | 92.893 | 168.441 | Royal Dutch Shell PLC | 9.202 | 204.083 |
| Barclays Plc | 59.772 | 165.924 | Thales SA | 1.771 | 181.937 |
| CME Group Inc | 774 | 159.877 | Brenntag SE | 1.904 | 167.470 |
| Novozymes A/S | 2.429 | 151.033 | Prosus NV | 1.870 | 164.285 |
| T-Mobile USA Inc 3.375% 15-Apr-2029 | 149.000 | 149.000 | Albemarle Corp | 732 | 153.066 |
| VH Global Sustainable Energy Opportunities Plc | 107.147 | 146.202 | Microsoft Corp | 420 | 139.024 |
| M3 Inc | 2.100 | 140.507 | BAE Systems PLC | 16.952 | 127.824 |
| United States Treasury Note/Bond 2.875% 15-May-2043 | 105.000 | 124.979 | ams AG 'REGS' 6.000% 31-Jul-2025 | 100.000 | 125.805 |
| Alibaba Group Holding Ltd | 4.000 | 114.524 | Applied Materials Inc | 1.048 | 121.296 |
| Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H' | 8.000 | 104.305 | Citigroup Inc | 1.581 | 112.616 |
| Zurich Insurance Group AG | 244 | 103.723 | iShares USD Short Duration Corp Bond UCITS ETF - ETF | 1.014 | 106.150 |
| Mastercard Inc | 267 | 94.335 | Alphabet Inc - Class A | 35 | 102.622 |
| Fresenius Medical Care AG & Co KGaA | 1.017 | 85.074 | Peruvian Government International Bond 'REGS' 6.950% 12-Aug-2031 | 340.000 | 96.517 |
| Universal Music Group NV | 2.722 | 76.339 | Samsung SDI Co Ltd | 110 | 70.810 |
| Suzuki Motor Corp | 1.400 | 60.347 | Goldman Sachs Group Inc/The | 189 | 62.226 |
| Alcon Inc | 747 | 52.322 | M3 Inc | 600 | 58.592 |
| T-Mobile USA Inc 3.875% 15-Apr-2030 | 47.000 | 46.698 | Fresenius Medical Care AG & Co KGaA | 915 | 56.217 |
| Prudential Plc | 1.976 | 42.657 | Vivendi SE | 1.394 | 52.760 |

BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund für das Geschäftsjahr zum
31. Dezember 2021

| Wichtige Käufe | Kosten | | Wichtige Verkäufe | Erlöse | |
|-------------------------------------|---------|-------------|-------------------------------|---------|-------------|
| | Nominal | JPY | | Nominal | JPY |
| Optorun Co Ltd | 357.600 | 908.306.755 | BayCurrent Consulting Inc | 24.800 | 423.717.858 |
| Direct Marketing MIX Inc | 227.200 | 743.514.384 | Sanken Electric Co Ltd | 78.400 | 416.627.000 |
| Anicom Holdings Inc | 534.300 | 514.319.333 | Arata Corp | 77.300 | 317.547.639 |
| TechMatrix Corp | 251.300 | 499.403.038 | Insource Co Ltd | 112.700 | 260.567.750 |
| MCJ Co Ltd | 397.100 | 417.766.982 | Premium Group Co Ltd | 72.700 | 226.056.121 |
| Ain Holdings Inc | 58.400 | 380.879.228 | Direct Marketing MIX Inc | 53.600 | 214.809.556 |
| Nippon Gas Co Ltd | 191.500 | 362.281.812 | Dowa Holdings Co Ltd | 44.300 | 199.028.432 |
| Aida Engineering Ltd | 327.800 | 327.754.272 | RS Technologies Co Ltd | 29.300 | 190.159.905 |
| Nifco Inc/Japan | 83.400 | 305.256.787 | MCJ Co Ltd | 164.100 | 189.464.549 |
| Takeei Corp | 228.800 | 296.073.630 | Yonex Co Ltd | 206.300 | 180.415.606 |
| Anritsu Corp | 120.900 | 271.179.506 | m-up Holdings Inc | 48.000 | 179.442.879 |
| RS Technologies Co Ltd | 45.400 | 269.930.327 | Resorttrust Inc | 86.400 | 172.457.275 |
| Sakata INX Corp | 234.600 | 256.265.971 | Takeuchi Manufacturing Co Ltd | 57.700 | 169.546.783 |
| Japan Medical Dynamic Marketing Inc | 112.100 | 250.037.669 | Vision Inc/Tokyo Japan | 112.700 | 164.881.652 |
| Resorttrust Inc | 153.200 | 244.463.861 | Osaki Electric Co Ltd | 236.900 | 140.261.303 |
| Totetsu Kogyo Co Ltd | 90.800 | 230.017.860 | Vector Inc | 112.600 | 138.581.986 |
| Dowa Holdings Co Ltd | 52.000 | 223.335.886 | BrainPad Inc | 19.900 | 119.676.252 |
| Takeuchi Manufacturing Co Ltd | 73.000 | 201.764.229 | TRE Holdings Corp | 68.036 | 117.951.517 |
| Zenkoku Hosho Co Ltd | 36.600 | 177.977.277 | Atrae Inc | 55.200 | 113.012.976 |
| Wacom Co Ltd | 223.300 | 173.117.911 | Takeei Corp | 56.800 | 104.715.296 |
| m-up Holdings Inc | 58.200 | 141.901.573 | Zenkoku Hosho Co Ltd | 19.600 | 100.882.517 |
| Arata Corp | 28.700 | 134.787.744 | Nippon Gas Co Ltd | 29.300 | 89.697.115 |
| Vector Inc | 119.400 | 117.094.085 | Wacom Co Ltd | 65.900 | 60.635.006 |
| Fibergate Inc/Japan | 69.700 | 114.238.277 | Sakata INX Corp | 46.200 | 51.013.438 |
| Premium Group Co Ltd | 45.600 | 113.284.683 | | | |

BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Alle Käufe | Nominal | Kosten EUR | Wichtige Verkäufe | Nominal | Erlöse EUR |
|---|-----------|---------------|---|-----------|---------------|
| Prudential Plc | 1.796.500 | 30.789.565 | Reckitt Benckiser Group PLC | 447.400 | 30.302.774 |
| Fortinet Inc | 106.300 | 18.311.858 | Novartis AG | 397.379 | 29.508.045 |
| Microsoft Corp | 65.100 | 13.282.801 | Cerner Corp | 470.052 | 28.311.673 |
| Compass Group Plc | 528.000 | 9.742.470 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR | 202.370 | 20.905.510 |
| Adobe Inc | 23.900 | 9.604.836 | Walt Disney Co/The | 114.227 | 18.069.324 |
| NIKE Inc | 74.800 | 8.234.252 | Waters Corp | 60.408 | 17.248.589 |
| Linde Plc | 29.200 | 7.200.111 | Oracle Corp | 273.296 | 17.034.548 |
| Edwards Lifesciences Corp | 91.000 | 6.888.280 | Cisco Systems Inc/Delaware | 347.214 | 15.837.771 |
| Walt Disney Co/The | 46.800 | 6.860.037 | Johnson & Johnson | 112.363 | 15.766.359 |
| L'Oreal SA | 18.000 | 6.627.560 | Booking Holdings Inc | 8.159 | 15.646.594 |
| Roche Holding AG | 22.200 | 6.465.815 | Colgate-Palmolive Co | 213.209 | 14.586.761 |
| Oracle Corp | 92.300 | 6.016.341 | AIA Group Ltd | 1.368.600 | 14.203.533 |
| Shin-Etsu Chemical Co Ltd | 43.400 | 5.988.872 | Industria de Diseno Textil SA | 457.100 | 13.232.112 |
| Intuitive Surgical Inc | 8.500 | 5.824.492 | Novo Nordisk A/S | 187.119 | 12.891.809 |
| Cisco Systems Inc/Delaware | 131.000 | 5.808.656 | Keyence Corp | 28.900 | 12.812.616 |
| Alphabet Inc | 2.700 | 5.277.390 | LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE | 21.601 | 12.602.319 |
| Booking Holdings Inc | 2.700 | 5.063.912 | Alphabet Inc | 6.182 | 12.427.647 |
| Alimentation Couche-Tard Inc | 160.300 | 4.956.712 | FANUC Corp | 61.600 | 12.209.462 |
| TJX Cos Inc/The | 88.600 | 4.877.897 | Edwards Lifesciences Corp | 129.522 | 12.182.381 |
| Cognizant Technology Solutions Corp | 72.900 | 4.467.418 | Intuitive Surgical Inc | 15.908 | 12.028.177 |
| Kone Oyj - Class B | 59.800 | 3.988.628 | Texas Instruments Inc | 77.429 | 11.846.350 |
| Novo Nordisk A/S | 54.600 | 3.699.741 | Cognizant Technology Solutions Corp | 176.910 | 11.559.590 |
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR | 40.400 | 3.698.562 | Shin-Etsu Chemical Co Ltd | 80.900 | 11.463.219 |
| Waters Corp | 14.000 | 3.589.436 | Amphenol Corp - Class A | 195.268 | 11.253.215 |
| Nestle SA | 34.800 | 3.460.176 | Nestle SA | 112.398 | 11.029.664 |
| Johnson & Johnson | 24.500 | 3.448.946 | L'Oreal SA | 30.876 | 10.973.496 |
| Mastercard Inc | 11.500 | 3.446.631 | Microsoft Corp | 46.081 | 10.863.169 |
| Keyence Corp | 8.600 | 3.373.440 | Automatic Data Processing Inc | 65.279 | 10.625.990 |
| Dassault Systemes SE | 18.200 | 3.368.687 | Roche Holding AG | 34.396 | 10.370.676 |
| LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE | 5.300 | 3.331.902 | Adobe Inc | 18.300 | 10.240.244 |
| Stryker Corp | 16.000 | 3.322.435 | SGS SA | 4.071 | 10.187.878 |
| Texas Instruments Inc | 20.700 | 3.184.558 | Stryker Corp | 43.587 | 9.246.644 |
| CSL Ltd | 17.500 | 3.027.064 | Linde Plc | 36.974 | 9.062.799 |
| Fastenal Co | 70.000 | 3.010.112 | Hong Kong & China Gas Co Ltd | 7.342.069 | 8.658.625 |
| AIA Group Ltd | 255.600 | 2.801.297 | Kone Oyj - Class B | 114.904 | 7.880.154 |
| Amphenol Corp - Class A | 46.300 | 2.594.414 | Alimentation Couche-Tard Inc | 245.289 | 7.547.582 |
| Canadian National Railway Co | 28.500 | 2.536.248 | TJX Cos Inc/The | 123.618 | 7.267.816 |
| FANUC Corp | 13.400 | 2.494.226 | Mastercard Inc | 22.527 | 6.795.228 |
| | | | Dassault Systemes SE | 134.557 | 6.552.847 |
| | | | Fastenal Co | 147.843 | 6.531.865 |
| | | | Experian Plc | 190.656 | 6.282.409 |

Obiges stellt die vollständigen Angaben zu den Käufen des Fonds im Geschäftsjahr dar.

BNY Mellon Mobility Innovation Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Wichtige Käufe | Nominal | Kosten USD | Wichtige Verkäufe | Nominal | Erlöse USD |
|--|-----------|------------|------------------------------|---------|------------|
| Alstom SA | 388.702 | 20.530.970 | Tesla Inc | 25.271 | 20.887.730 |
| NIO Inc ADR | 428.349 | 19.883.088 | General Motors Co | 327.768 | 18.511.098 |
| MP Materials Corp | 580.559 | 19.050.132 | LG Chem Ltd | 26.991 | 17.874.713 |
| Magna International Inc (Units) | 239.761 | 18.951.011 | Yandex NV - Class A | 205.359 | 15.235.613 |
| Lyft Inc | 330.987 | 18.081.638 | NIO Inc ADR | 428.349 | 13.843.655 |
| Plug Power Inc | 509.483 | 17.803.095 | Raven Industries Inc | 234.302 | 13.513.404 |
| Uber Technologies Inc | 326.564 | 17.106.696 | Plug Power Inc | 250.097 | 11.310.207 |
| Everbridge Inc | 131.848 | 16.870.234 | Workhorse Group Inc | 318.553 | 10.221.417 |
| General Motors Co | 330.908 | 16.543.652 | Meituan - Class B '144A' | 294.000 | 10.070.724 |
| Twilio Inc - Class A | 49.241 | 16.314.710 | ON Semiconductor Corp | 254.078 | 9.249.669 |
| Semtech Corp | 221.177 | 15.868.694 | FLIR Systems Inc | 173.578 | 9.187.266 |
| Schneider Electric SE | 96.733 | 15.443.317 | JD.com Inc ADR | 113.026 | 8.641.246 |
| ANSYS Inc | 35.204 | 13.148.269 | NextEra Energy Inc | 106.511 | 7.775.835 |
| Daimler AG | 161.973 | 13.096.863 | Virgin Galactic Holdings Inc | 193.068 | 7.613.505 |
| XPeng Inc ADR - Class A | 281.852 | 12.270.582 | Aptiv Plc | 40.263 | 6.152.380 |
| Zuora Inc | 717.738 | 12.075.946 | Daimler AG | 61.146 | 5.225.047 |
| Alphabet Inc | 4.856 | 11.549.936 | MediaTek Inc | 168.000 | 5.157.101 |
| Marvell Technology Group Ltd | 216.411 | 11.022.025 | Samsung SDI Co Ltd | 8.084 | 5.083.875 |
| LG Chem Ltd | 13.481 | 10.638.811 | Littelfuse Inc | 15.116 | 3.917.239 |
| CNH Industrial NV | 642.329 | 10.268.957 | ABB Ltd | 91.076 | 3.218.154 |
| Samsung SDI Co Ltd | 15.129 | 9.939.925 | STMicroelectronics NV | 65.420 | 2.424.495 |
| Alfen Beheer BV '144A' | 113.887 | 9.860.083 | | | |
| Visteon Corp | 82.987 | 9.824.457 | | | |
| Aptiv Plc | 63.557 | 9.705.348 | | | |
| Geely Automobile Holdings Ltd | 2.948.000 | 9.682.421 | | | |
| CrowdStrike Holdings Inc | 36.112 | 9.666.400 | | | |
| Wuxi Lead Intelligent Equipment Co Ltd | 1.065.770 | 9.613.114 | | | |
| QUALCOMM Inc | 68.892 | 9.556.711 | | | |
| NVIDIA Corp | 28.305 | 9.555.375 | | | |
| Lumentum Holdings Inc | 103.114 | 9.322.677 | | | |
| East Japan Railway Co | 134.500 | 9.242.535 | | | |
| MediaTek Inc | 264.000 | 9.101.070 | | | |
| Splunk Inc | 54.839 | 8.393.864 | | | |
| Hanon Systems | 577.886 | 8.322.963 | | | |
| Tesla Inc | 10.212 | 8.144.955 | | | |
| STMicroelectronics NV | 179.532 | 7.678.189 | | | |
| Denso Corp | 114.300 | 7.645.925 | | | |
| Siemens AG | 46.424 | 7.613.312 | | | |
| Infineon Technologies AG | 170.327 | 7.322.513 | | | |
| ON Semiconductor Corp | 170.354 | 7.262.829 | | | |
| Taiyo Yuden Co Ltd | 127.700 | 7.046.374 | | | |
| Diodes Inc | 72.194 | 6.279.139 | | | |
| Rockwell Automation Inc | 21.603 | 6.128.624 | | | |
| Eaton Corp Plc | 42.323 | 6.031.265 | | | |

BNY Mellon S&P 500® Index Tracker* für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Alle Käufe | Nominal | Kosten USD | Wichtige Verkäufe | Nominal | Erlöse USD |
|------------------------------|---------|---------------|-------------------------|---------|---------------|
| Enphase Energy Inc | 135 | 27.456 | Apple Inc | 18.447 | 2.378.455 |
| Devon Energy Corp | 222 | 4.067 | Microsoft Corp | 8.727 | 1.859.888 |
| Pioneer Natural Resources Co | 28 | 3.783 | Amazon.com Inc | 492 | 1.539.044 |
| SL Green Realty Corp (REIT) | 2 | 128 | Tesla Inc | 875 | 738.603 |
| | | | Facebook Inc | 2.774 | 682.498 |
| | | | Alphabet Inc - Class A | 347 | 600.837 |
| | | | Alphabet Inc - Class C | 335 | 583.140 |
| | | | Berkshire Hathaway Inc | 2.246 | 527.670 |
| | | | JPMorgan Chase & Co | 3.517 | 495.912 |
| | | | Johnson & Johnson | 3.038 | 487.902 |
| | | | Visa Inc | 1.956 | 395.375 |
| | | | Procter & Gamble Co/The | 2.860 | 388.552 |
| | | | UnitedHealth Group Inc | 1.094 | 383.675 |
| | | | NVIDIA Corp | 715 | 377.652 |
| | | | Walt Disney Co/The | 2.089 | 362.510 |
| | | | Home Depot Inc/The | 1.242 | 333.290 |
| | | | Mastercard Inc | 1.015 | 332.388 |
| | | | PayPal Holdings Inc | 1.352 | 327.064 |
| | | | Bank of America Corp | 8.781 | 298.100 |
| | | | Intel Corp | 4.727 | 279.250 |

Obiges stellt die vollständigen Angaben zu den Käufen des Fonds im Geschäftsjahr dar.

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

BNY Mellon Small Cap Euroland Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Wichtige Käufe | Nominal | Kosten EUR | Wichtige Verkäufe | Nominal | Erlöse EUR |
|--|---------|---------------|--|-----------|---------------|
| Unibail-Rodamco-Westfield (REIT) | 28.147 | 2.186.551 | D'ieteren Group | 20.002 | 2.317.557 |
| Publicis Groupe SA | 37.601 | 2.071.195 | Teleperformance | 6.005 | 1.951.081 |
| Eiffage SA | 19.840 | 1.764.238 | HelloFresh SE | 23.496 | 1.892.882 |
| Kleipierre SA (REIT) | 75.762 | 1.534.976 | Sartorius AG - Preference | 3.224 | 1.698.389 |
| Aegon NV | 428.164 | 1.507.421 | Euronext NV '144A' | 14.279 | 1.254.231 |
| Covestro AG '144A' | 25.381 | 1.423.840 | Valmet Oyj | 36.378 | 1.251.657 |
| Krones AG | 14.007 | 1.323.844 | Stroeer SE & Co KGaA | 18.634 | 1.237.609 |
| Almirall SA | 85.311 | 1.266.295 | Euskaltel SA '144A' | 108.891 | 1.200.898 |
| Roxel SA | 70.430 | 1.199.504 | Dialog Semiconductor Plc | 17.817 | 1.173.434 |
| Italgas SpA | 197.681 | 1.081.119 | Kemira Oyj | 80.517 | 1.094.102 |
| HUGO BOSS AG | 19.949 | 1.014.134 | BE Semiconductor Industries NV | 14.770 | 1.032.651 |
| Banca IFIS SpA | 63.294 | 981.853 | ASTM SpA | 34.866 | 976.248 |
| Unipol Gruppo SpA | 187.718 | 951.698 | Linea Directa Aseguradora SA Cia de Seguros y Reaseguros | 557.416 | 952.265 |
| Aalberts NV | 17.868 | 937.146 | Iliad SA | 5.125 | 915.324 |
| DWS Group GmbH & Co KGaA '144A' | 23.872 | 905.655 | Hella GmbH & Co KGaA | 14.479 | 893.306 |
| Outokumpu Oyj | 165.316 | 845.600 | Unipol Gruppo SpA | 203.790 | 856.609 |
| Gestamp Automocion SA '144A' | 186.632 | 821.315 | Arcadis NV | 21.594 | 849.978 |
| Linea Directa Aseguradora SA Cia de Seguros y Reaseguros | 446.460 | 807.611 | Leroy Seafood Group ASA | 104.905 | 814.673 |
| Deutsche Pfandbriefbank AG '144A' | 83.453 | 797.837 | Cofinimmo SA (REIT) | 5.762 | 806.157 |
| Alten SA | 5.329 | 786.685 | Unicaja Banco SA '144A' | 1.005.574 | 801.588 |
| Nobina AB '144A' | 105.534 | 773.190 | Cewe Stiftung & Co KGAA | 6.162 | 780.036 |
| Iren SpA | 312.185 | 753.835 | Cie Plastic Omnium SA | 34.830 | 769.187 |
| Trigano SA | 4.616 | 749.574 | KION Group AG | 8.027 | 743.910 |
| Elis SA | 44.905 | 748.355 | Royal Unibrew A/S | 7.546 | 735.539 |
| Deutz AG | 100.320 | 735.803 | Talanx AG | 20.371 | 695.845 |
| Telefonica Deutschland Holding AG | 289.918 | 709.497 | Adapteo Oyj | 42.712 | 689.522 |
| AURELIUS Equity Opportunities SE & Co KGaA | 22.957 | 668.642 | Signify NV '144A' | 15.299 | 678.318 |
| Deutsche EuroShop AG | 36.998 | 651.508 | AMG Advanced Metallurgical Group NV | 22.091 | 641.470 |
| BPER Banca | 356.956 | 623.841 | Kindred Group Plc SDR | 49.298 | 569.188 |
| flatexDEGIRO AG | 5.141 | 582.381 | UDG Healthcare Plc (Units) | 44.004 | 556.672 |
| Ubisoft Entertainment SA | 8.857 | 579.764 | Bankinter SA | 123.486 | 556.118 |
| Dermapharm Holding SE | 7.049 | 577.270 | Almirall SA | 39.028 | 432.715 |
| Schaeffler AG - Preference | 72.608 | 560.297 | | | |
| Scandic Hotels Group AB '144A' | 168.197 | 552.787 | | | |
| GFT Technologies SE | 12.206 | 520.445 | | | |
| Heidelberger Druckmaschinen AG | 166.205 | 443.045 | | | |

BNY Mellon Smart Cures Innovation Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Wichtige Käufe | Nominal | Kosten USD | Wichtige Verkäufe | Nominal | Erlöse USD |
|---------------------------------------|---------|---------------|--|---------|---------------|
| AstraZeneca Plc | 1.917 | 241.025 | Bristol-Myers Squibb Co | 4.652 | 276.866 |
| Guardant Health Inc | 1.841 | 235.231 | Laboratory Corp of America Holdings | 917 | 251.384 |
| Eli Lilly & Co | 1.184 | 225.725 | IQVIA Holdings Inc | 1.014 | 248.988 |
| Lonza Group AG | 277 | 212.535 | Novartis AG | 2.588 | 243.613 |
| ICON Plc | 776 | 180.413 | Charles River Laboratories International Inc | 579 | 226.532 |
| Beam Therapeutics Inc | 1.639 | 178.922 | Roche Holding AG | 581 | 213.384 |
| Pacific Biosciences of California Inc | 5.176 | 177.731 | Syneos Health Inc | 2.410 | 205.942 |
| CRISPR Therapeutics AG | 1.400 | 175.425 | Illumina Inc | 399 | 185.020 |
| Kymera Therapeutics Inc | 2.750 | 165.374 | Neurocrine Biosciences Inc | 1.882 | 185.014 |
| Danaher Corp | 570 | 144.373 | Vertex Pharmaceuticals Inc | 811 | 160.640 |
| Denali Therapeutics Inc | 2.692 | 141.229 | Thermo Fisher Scientific Inc | 327 | 159.113 |
| Alnylam Pharmaceuticals Inc | 683 | 123.465 | Lonza Group AG | 259 | 157.441 |
| Moderna Inc | 656 | 115.411 | Dyne Therapeutics Inc | 9.101 | 147.328 |
| Quantarix Corp | 2.346 | 115.183 | Avantor Inc | 3.615 | 139.669 |
| Twist Bioscience Corp | 901 | 110.393 | Biogen Inc | 466 | 121.233 |
| Fate Therapeutics Inc | 1.855 | 106.219 | Bio-Techne Corp | 211 | 93.998 |
| Roche Holding AG | 292 | 100.109 | Moderna Inc | 389 | 92.223 |
| Catalent Inc | 778 | 94.975 | Repligen Corp | 347 | 91.009 |
| Ultragenyx Pharmaceutical Inc | 896 | 85.463 | Avidity Biosciences Inc | 3.872 | 85.544 |
| Avantor Inc | 2.679 | 83.713 | ICON Plc | 287 | 79.387 |
| Bristol-Myers Squibb Co | 1.221 | 79.928 | Eli Lilly & Co | 313 | 78.824 |
| Generation Bio Co | 3.019 | 78.844 | CRISPR Therapeutics AG | 404 | 75.205 |
| Sarepta Therapeutics Inc | 925 | 77.811 | AvroBio Inc | 5.383 | 62.399 |
| Biogen Inc | 198 | 68.568 | Amicus Therapeutics Inc | 2.661 | 60.139 |
| Adaptive Biotechnologies Corp | 1.676 | 66.847 | Intellia Therapeutics Inc | 295 | 54.588 |
| Dyne Therapeutics Inc | 2.877 | 61.051 | Merck KGaA | 293 | 53.463 |
| Illumina Inc | 126 | 52.957 | Passage Bio Inc | 6.044 | 53.185 |
| Intellia Therapeutics Inc | 488 | 51.688 | Danaher Corp | 174 | 52.344 |
| Laboratory Corp of America Holdings | 190 | 51.531 | Catalent Inc | 409 | 41.857 |
| uniQure NV | 1.557 | 50.372 | | | |
| Passage Bio Inc | 1.920 | 46.830 | | | |
| PTC Therapeutics Inc | 1.050 | 45.549 | | | |
| MeiraGTx Holdings plc | 2.434 | 42.208 | | | |

BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Wichtige Käufe | Nominal | Kosten EUR | Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten | Nominal | Erlöse EUR |
|--|----------------|---------------|--|---------------|---------------|
| United Kingdom Gilt 1.750% 07-Sep-2022 | 8.190.000 | 9.794.390 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,750% 15-Jul-2028 | 12.211.939 | 11.796.179 |
| French Republic Government Bond OAT 0.100% 01-Mar-2025 | 9.131.542 | 9.539.866 | United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Feb-2030 | 13.900.000 | 11.593.388 |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15-Apr-2023 | 7.353.568 | 6.541.908 | United States Treasury Note/Bond 0.500% 15-Mar-2023 | 11.900.000 | 10.280.964 |
| Australia Government Bond 5.500% 21-Apr-2023 | 8.560.000 | 6.173.829 | United Kingdom Gilt 1.750% 07-Sep-2022 | 8.190.000 | 9.852.688 |
| Canadian Government Real Return Bond 4.000% 01-Dec-2031 | 5.387.112 | 5.114.826 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 5.000% 01-Aug-2034 | 5.490.000 | 8.309.853 |
| United States Treasury Floating Rate Note - When Issued FRN 0.120% 31-Oct-2023 | 5.630.000 | 4.962.808 | Australia Government Bond 5.500% 21-Apr-2023 | 11.870.000 | 8.246.029 |
| Canada Housing Trust No 1 '144A' 2.350% 15-Sep-2023 | 7.100.000 | 4.945.859 | Norway Government Bond '144A' 1.750% 17-Feb-2027 | 71.790.000 | 7.184.004 |
| United States Treasury Note/Bond 0.500% 15-Mar-2023 | 5.740.000 | 4.891.734 | Japan Government Two Year Bond 0.100% 01-Dec-2022 | 835.550.000 | 6.468.133 |
| Czech Republic Government Bond 0.450% 25-Oct-2023 | 125.640.000 | 4.811.072 | Indonesia Government International Bond 3.850% 15-Oct-2030 | 4.772.000 | 4.522.654 |
| Canada Housing Trust No 1 FRN 0.323% 15-Mar-2027 | 4.920.000 | 3.456.722 | Spain Government Bond '144A' 5.150% 31-Oct-2028 | 3.190.000 | 4.385.343 |
| Colombia Government International Bond 'REGS' 7,000% 30-Jun-2032 | 14.335.400.000 | 3.447.717 | Japan Government Two Year Bond 0.100% 01-Apr-2022 | 517.800.000 | 4.112.634 |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.125% 15-Jul-2031 | 3.518.063 | 3.441.081 | United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Aug-2026 | 4.780.000 | 4.100.327 |
| Asian Development Bank 'GMTN' FRN 1.050% 27-Aug-2026 | 3.780.000 | 3.366.119 | French Republic Government Bond OAT 0.100% 01-Mar-2025 | 3.708.656 | 3.934.025 |
| Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031 | 70.360.000 | 3.342.641 | United Kingdom Inflation-Linked Gilt 0.125% 22-Mar-2026 | 2.445.819 | 3.402.134 |
| European Investment Bank 'EMTN' 1.500% 12-May-2022 | 32.520.000 | 3.240.834 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0.625% 15-Apr-2023 | 3.657.677 | 3.294.936 |
| International Finance Corp 'GMTN' 6.300% 25-Nov-2024 | 252.960.000 | 2.942.581 | Paraguay Government International Bond 'REGS' 5.000% 15-Apr-2026 | 3.450.000 | 3.229.486 |
| United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.000% 15-Feb-2046 | 2.729.602 | 2.899.986 | Treasury Corp of Victoria 2.250% 20-Nov-2034 | 4.410.000 | 2.920.854 |
| International Finance Facility for Immunisation Co 'GMTN' 1.000% 21-Apr-2026 | 3.380.000 | 2.823.554 | United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1.000% 15-Feb-2046 | 2.729.602 | 2.831.429 |
| European Bank for Reconstruction & Development 'GMTN' FRN 0.239% 14-Apr-2026 | 3.300.000 | 2.774.858 | German Postal Pensions Securitisation PLC 3.750% 18-Jan-2021 | 2.450.000 | 2.450.000 |
| Colombia Government International Bond 4.500% 15-Mar-2029 | 2.920.000 | 2.745.698 | Colombia Government International Bond 'REGS' 6.000% 28-Apr-2028 | 9.438.000.000 | 2.322.476 |
| Japan Government Two Year Bond 0.100% 01-Dec-2022 | 351.050.000 | 2.737.335 | Asian Infrastructure Investment Bank/The 0.500% 30-Oct-2024 | 2.710.000 | 2.310.102 |
| Inter-American Development Bank 'GMTN' FRN 0.320% 20-Mar-2028 | 3.252.000 | 2.735.186 | CommScope Inc '144A' 5.500% 01-Mar-2024 | 2.565.000 | 2.256.550 |
| Bellis Acquisition Co Plc 'REGS' 3.250% 16-Feb-2026 | 2.173.000 | 2.513.584 | Mexico Government International Bond 3.900% 27-Apr-2025 | 2.443.000 | 2.252.715 |
| HSBC Holdings Plc FRN 0.732% 17-Aug-2024 | 2.840.000 | 2.424.108 | Republic of Italy Government International Bond 0.875% 06-May-2024 | 2.595.000 | 2.219.457 |
| | | | United States Treasury Note/Bond 2.000% 15-Feb-2050 | 2.725.000 | 2.212.644 |
| | | | Pacific Life Global Funding II 'REGS' 1.375% 14-Apr-2026 | 2.500.000 | 2.205.671 |
| | | | Tesla Inc '144A' 5.300% 15-Aug-2025 | 2.500.000 | 2.178.387 |
| | | | UBS AG 'EMTN' FRN 4.750% 12-Feb-2026 | 2.145.000 | 2.145.000 |
| | | | Mexican Bonos 7.500% 03-Jun-2027 | 44.615.800 | 2.092.472 |
| | | | Philippine Government International Bond 4.950% 15-Jan-2021 | 120.000.000 | 2.059.428 |
| | | | Peruvian Government International Bond 'REGS' 6.950% 12-Aug-2031 | 8.490.000 | 1.953.966 |

BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR) für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Wichtige Käufe | Nominal | Kosten EUR | Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten | Nominal | Erlöse EUR |
|--|---------|---------------|--|---------------|---------------|
| Barclays Bank Plc (WTS) 15-Aug-2022 | 15.177 | 1.291.164 | WisdomTree Physical Swiss Gold - ETF | 15.119 | 2.163.396 |
| Barclays Bank Plc (WTS) 12-Aug-2022 | 15.177 | 1.285.587 | iShares Physical Gold ETC - ETF | 53.187 | 1.534.763 |
| JPMorgan Chase & Co | 9.401 | 1.262.253 | Invesco Physical Gold ETC - ETF | 9.058 | 1.306.339 |
| Greencoast UK Wind Plc/Funds | 776.315 | 1.196.177 | BNP Paribas Issuance BV (Zero Coupon) 0.000% 18-Nov-2021 | 14.070 | 1.269.620 |
| BNP Paribas Issuance BV (Zero Coupon) 0.000% 18-Nov-2021 | 14.070 | 1.192.588 | Barclays Bank Plc 16-Aug-2021 | 12.731 | 1.228.469 |
| WisdomTree Physical Swiss Gold - ETF | 8.240 | 1.177.179 | Barclays Bank Plc 13-Aug-2021 | 12.687 | 1.178.090 |
| Volkswagen AG - Preference | 5.177 | 1.081.625 | Texas Instruments Inc | 6.692 | 1.120.655 |
| Relx Plc | 46.702 | 1.033.675 | Malaysia Government Bond 3.828% 05-Jul-2034 | 4.052.000 | 827.127 |
| AstraZeneca Plc | 11.853 | 1.031.047 | Home Depot Inc/The | 2.400 | 757.202 |
| Wisdomtree Carbon | 36.909 | 835.704 | Zurich Insurance Group AG | 1.927 | 734.017 |
| CME Group Inc | 4.751 | 810.868 | Relx Plc | 32.425 | 722.296 |
| Sony Group Corp | 8.800 | 770.198 | Indonesia Treasury Bond 8.250% 15-May-2036 | 7.924.000.000 | 532.621 |
| Ensemble Investment Corporation SA (WTS) 27-Oct-2022 | 7.238 | 723.800 | Kerry Group Plc | 4.612 | 522.746 |
| WisdomTree Copper - ETF | 22.260 | 710.840 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR | 5.104 | 518.307 |
| Linde Plc | 2.891 | 697.865 | Novartis AG | 7.093 | 512.211 |
| Prudential Plc | 38.162 | 666.583 | Mexican Bonos 7,750% 29-May-2031 | 11.885.500 | 511.446 |
| Medtronic Plc | 6.181 | 653.664 | Toyota Industries Corp | 6.500 | 485.077 |
| Thermo Fisher Scientific Inc | 1.576 | 644.746 | Amundi Physical Gold ETC - ETF | 7.663 | 461.333 |
| TE Connectivity Ltd | 5.626 | 635.293 | Ping An Insurance Group Co of China Ltd | 63.000 | 450.778 |
| Barclays Bank PLC 16-Aug-2021 | 6.688 | 610.867 | Fidelity National Information Services Inc | 3.860 | 391.330 |
| Morgan Stanley | 6.927 | 604.831 | New Oriental Education & Technology Group Inc ADR | 36.999 | 376.533 |
| Texas Instruments Inc | 3.835 | 602.221 | Kansas City Southern/Old | 1.770 | 376.040 |
| Continental AG | 5.395 | 592.812 | Vivendi SE | 12.833 | 363.415 |
| Barclays Bank PLC 13-Aug-2021 | 6.665 | 590.837 | Flat Glass Group Co Ltd 'H' | 90.000 | 340.934 |
| AIA Group Ltd | 57.000 | 588.015 | Bureau Veritas SA | 11.908 | 335.461 |
| Home Depot Inc/The | 2.400 | 579.260 | | | |
| Alphabet Inc - Class A | 276 | 573.553 | | | |
| Chubb Ltd | 3.395 | 572.400 | | | |
| HDFC Bank Ltd ADR | 8.891 | 563.348 | | | |

BNY Mellon Targeted Return Bond Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Wichtige Käufe | Nominal | Kosten USD | Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten | Nominal | Erlöse USD |
|---|------------|------------|---|-------------|------------|
| United States Treasury Bill 0.000% 12-Aug-2021 | 7.350.000 | 7.349.775 | United States Treasury Bill 0.000% 14-Sep-2021 | 7.350.000 | 7.350.000 |
| United States Treasury Bill 0.000% 14-Sep-2021 | 7.350.000 | 7.349.743 | United States Treasury Bill 0.000% 12-Aug-2021 | 7.350.000 | 7.349.982 |
| United States Treasury Bill 0.000% 14-Oct-2021 | 7.325.000 | 7.324.698 | United States Treasury Bill 0.000% 14-Oct-2021 | 7.325.000 | 7.325.000 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.350% 15-Apr-2022 | 5.750.000 | 7.090.212 | United States Treasury Bill- When Issued (Zero Coupon) 0.000% 13-Jul-2021 | 6.650.000 | 6.650.000 |
| Bundesobligation 0.000% 05-Apr-2024 | 5.675.000 | 7.007.421 | United States Treasury Bill 0.000% 13-Apr-2021 | 6.625.000 | 6.625.000 |
| United States Treasury Bill- When Issued (Zero Coupon) 0.000% 13-Jul-2021 | 6.650.000 | 6.649.963 | United States Treasury Bill 0.000% 10-Jun-2021 | 6.600.000 | 6.600.000 |
| United States Treasury Bill 0.000% 13-Apr-2021 | 6.625.000 | 6.624.884 | United States Treasury Bill 0.000% 11-May-2021 | 6.500.000 | 6.500.000 |
| United States Treasury Bill 0.000% 10-Jun-2021 | 6.600.000 | 6.599.995 | Bundesobligation 0.000% 05-Apr-2024 | 5.050.000 | 6.123.267 |
| United States Treasury Bill 0.000% 11-May-2021 | 6.500.000 | 6.499.962 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.450% 15-May-2025 | 4.550.000 | 5.753.598 |
| United States Treasury Note/Bond 0.250% 30-Sep-2023 | 6.200.000 | 6.176.759 | Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2.250% 04-Sep-2021 | 4.750.000 | 5.643.570 |
| Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 0.950% 01-Dec-2031 | 4.550.000 | 5.258.146 | United States Treasury Note/Bond 2.875% 30-Nov-2023 | 5.095.000 | 5.456.126 |
| Bundesobligation 0.000% 10-Apr-2026 | 3.550.000 | 4.321.651 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 0.950% 01-Dec-2031 | 4.550.000 | 5.146.333 |
| United States Treasury Bill (Zero Coupon) 0.000% 21-Apr-2022 | 4.000.000 | 3.998.879 | United States Treasury Note/Bond 1.500% 15-Feb-2030 | 4.450.000 | 4.457.393 |
| Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0.000% 15-Aug-2031 | 2.775.000 | 3.248.736 | United States Treasury Note/Bond 3.375% 15-Nov-2048 | 3.330.000 | 4.063.796 |
| Mexican Bonos 7.750% 29-May-2031 | 48.000.000 | 2.485.332 | United States Treasury Note/Bond 0.125% 15-May-2023 | 3.525.000 | 3.518.173 |
| United Kingdom Gilt 0.250% 31-Jul-2031 | 1.925.000 | 2.445.315 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1.350% 15-Apr-2022 | 2.850.000 | 3.314.398 |
| French Republic Government Bond OAT 0.000% 25-Mar-2023 | 1.925.000 | 2.371.435 | United States Treasury Note/Bond 0.000% 14-Jan-2021 | 2.570.000 | 2.570.000 |
| Fannie Mae or Freddie Mac 0.000% 31-Dec-2049 | 2.250.000 | 2.339.799 | Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 2.450% 01-Sep-2050 | 1.750.000 | 2.368.218 |
| Fannie Mae or Freddie Mac 0.000% 31-Dec-2049 | 2.250.000 | 2.330.324 | Australia Government Bond 2.250% 21-May-2028 | 2.925.000 | 2.346.394 |
| Fannie Mae or Freddie Mac 0.000% 31-Dec-2049 | 2.250.000 | 2.329.978 | Fannie Mae or Freddie Mac 0.000% 31-Dec-2049 | 2.250.000 | 2.344.926 |
| Fannie Mae or Freddie Mac 0.000% 31-Dec-2049 | 2.250.000 | 2.329.695 | Fannie Mae or Freddie Mac 0.000% 31-Dec-2049 | 2.250.000 | 2.335.703 |
| Fannie Mae or Freddie Mac 0.000% 31-Dec-2049 | 2.250.000 | 2.327.601 | Fannie Mae or Freddie Mac 0.000% 31-Dec-2049 | 2.250.000 | 2.334.312 |
| Fannie Mae or Freddie Mac 0.000% 31-Dec-2049 | 2.250.000 | 2.321.754 | Fannie Mae or Freddie Mac 0.000% 31-Dec-2049 | 2.250.000 | 2.333.801 |
| Fannie Mae or Freddie Mac 0.000% 31-Dec-2049 | 2.250.000 | 2.319.930 | Fannie Mae or Freddie Mac 0.000% 31-Dec-2049 | 2.250.000 | 2.332.488 |
| Fannie Mae or Freddie Mac 0.000% 31-Dec-2049 | 2.250.000 | 2.314.357 | Fannie Mae or Freddie Mac 0.000% 31-Dec-2049 | 2.250.000 | 2.324.236 |
| Fannie Mae or Freddie Mac 0.000% 31-Dec-2049 | 2.250.000 | 2.308.404 | Fannie Mae or Freddie Mac 0.000% 31-Dec-2049 | 2.250.000 | 2.319.213 |
| Fannie Mae or Freddie Mac '2.5 1/22' TBA 2.500% 31-Dec-2049 | 2.250.000 | 2.295.951 | Fannie Mae or Freddie Mac 0.000% 31-Dec-2049 | 2.250.000 | 2.313.837 |
| Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2.250% 04-Sep-2021 | 1.875.000 | 2.290.959 | Fannie Mae or Freddie Mac 0.000% 31-Dec-2049 | 2.250.000 | 2.301.464 |
| | | | French Republic Government Bond OAT 0.000% 25-Mar-2023 | 1.925.000 | 2.272.031 |
| | | | Russian Federal Bond - OFZ 7.650% 10-Apr-2030 | 158.475.000 | 2.254.031 |

BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund* für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Wichtige Käufe | Nominal | Kosten USD | Wichtige Verkäufe | Nominal | Erlöse USD |
|--------------------------------------|---------|---------------|--------------------------------------|---------|---------------|
| iShares Russell 1000 Value ETF - ETF | 824 | 117.881 | JPMorgan Chase & Co | 1.262 | 189.432 |
| Bank of America Corp | 1.842 | 61.731 | iShares Russell 1000 Value ETF - ETF | 1.097 | 156.258 |
| Exxon Mobil Corp | 978 | 48.750 | Alphabet Inc - Class A | 64 | 131.283 |
| Newmont Corp | 526 | 31.129 | Goldman Sachs Group Inc/The | 375 | 121.501 |
| Zimmer Biomet Holdings Inc | 189 | 30.478 | Berkshire Hathaway Inc - Class B | 475 | 115.915 |
| Abbott Laboratories | 241 | 29.700 | Morgan Stanley | 1.432 | 115.228 |
| HCA Healthcare Inc | 167 | 28.968 | Medtronic PLC | 956 | 111.014 |
| Exelon Corp | 665 | 28.313 | Freeport-McMoRan Inc | 3.194 | 104.469 |
| Valero Energy Corp | 276 | 21.660 | Chubb Ltd | 618 | 102.797 |
| Hubbell Inc - Class B | 125 | 21.368 | Capital One Financial Corp | 793 | 98.422 |
| Vodafone Group PLC ADR | 1.121 | 20.949 | Marathon Petroleum Corp | 1.744 | 97.210 |
| Eli Lilly & Co | 111 | 20.926 | Eaton Corp PLC | 723 | 96.132 |
| EQT Corp | 1.204 | 20.218 | Voya Financial Inc | 1.475 | 90.528 |
| Philip Morris International Inc | 239 | 20.129 | Exelon Corp | 2.173 | 86.803 |
| United Therapeutics | 120 | 19.953 | PPL Corp | 3.023 | 83.943 |
| Weyerhaeuser Co (REIT) | 583 | 19.198 | CF Industries Holdings Inc | 1.833 | 83.340 |
| Truist Financial Corp | 360 | 18.544 | General Motors Co | 1.590 | 83.150 |
| Cloudera Inc. | 1.258 | 18.351 | Assurant Inc | 625 | 80.024 |
| Alphabet Inc - Class A | 10 | 18.048 | Applied Materials Inc | 728 | 79.510 |
| Assurant Inc | 119 | 15.896 | Las Vegas Sands Corp | 1.220 | 75.704 |
| Mosaic Co/The | 555 | 14.876 | Vulcan Materials Co | 453 | 74.619 |
| Ameriprise Financial Inc | 67 | 14.335 | Eli Lilly & Co | 355 | 71.322 |
| Voya Financial Inc | 238 | 13.472 | Hess Corp | 1.068 | 71.259 |
| VF Corp | 156 | 12.574 | Union Pacific Corp | 341 | 69.151 |
| Las Vegas Sands Corp | 215 | 11.958 | QUALCOMM Inc | 494 | 67.588 |
| Biogen Inc | 43 | 11.951 | Bank of America Corp | 1.842 | 66.841 |
| Marathon Petroleum Corp | 265 | 11.928 | NXP Semiconductors NV | 336 | 58.758 |
| PPL Corp | 415 | 11.568 | Exxon Mobil Corp | 978 | 56.357 |
| Chubb Ltd | 62 | 9.808 | Becton Dickinson and Co | 221 | 53.647 |
| | | | Corning Inc | 1.441 | 53.359 |
| | | | Micron Technology Inc | 613 | 52.330 |
| | | | Philip Morris International Inc | 598 | 50.879 |
| | | | Ally Financial Inc | 1.188 | 50.744 |

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

BNY Mellon U.S. Equity Income Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Wichtige Käufe | Nominal | Kosten USD | Wichtige Verkäufe | Nominal | Erlöse USD |
|--|---------|---------------|--|---------|---------------|
| SPDR S&P 500 ETF Trust - ETF | 30.291 | 13.126.210 | SPDR S&P 500 ETF Trust - ETF | 30.291 | 13.128.150 |
| Exxon Mobil Corp | 164.039 | 9.208.327 | Goldman Sachs Group Inc/The | 30.832 | 10.296.611 |
| UnitedHealth Group Inc | 19.765 | 8.276.641 | PPL Corp | 292.331 | 8.398.121 |
| Exelon Corp | 153.674 | 7.416.591 | Eaton Corp Plc | 53.770 | 8.045.760 |
| Charles Schwab Corp/The | 95.862 | 7.076.283 | Chubb Ltd | 46.951 | 7.873.395 |
| Chubb Ltd | 38.864 | 6.918.058 | Bank of America Corp | 193.595 | 7.797.505 |
| Devon Energy Corp | 262.019 | 6.624.035 | Ally Financial Inc | 157.425 | 7.763.269 |
| Northrop Grumman Corp | 17.019 | 6.248.832 | JPMorgan Chase & Co | 51.021 | 7.757.379 |
| Cisco Systems Inc/Delaware | 114.331 | 6.217.451 | Morgan Stanley | 88.354 | 7.383.690 |
| CVS Health Corp | 70.239 | 5.846.055 | Marathon Petroleum Corp | 115.994 | 6.597.593 |
| Newmont Corp | 89.263 | 5.379.397 | CF Industries Holdings Inc | 127.183 | 6.181.813 |
| Merck & Co Inc | 61.986 | 5.205.246 | Union Pacific Corp | 28.212 | 6.000.471 |
| Wells Fargo & Co | 111.421 | 5.068.352 | Wells Fargo & Co | 111.421 | 5.207.718 |
| Bank of America Corp | 124.014 | 4.735.272 | Newmont Corp | 89.263 | 5.100.539 |
| Assurant Inc | 31.248 | 4.670.930 | Vulcan Materials Co | 28.333 | 5.042.834 |
| Willis Towers Watson Plc | 20.341 | 4.659.541 | Exxon Mobil Corp | 79.926 | 4.888.298 |
| Freeport-McMoRan Inc | 122.628 | 4.553.767 | Applied Materials Inc | 37.346 | 4.657.962 |
| Eli Lilly & Co | 22.111 | 4.514.778 | Eli Lilly & Co | 19.967 | 4.544.975 |
| Medical Properties Trust Inc (REIT) | 213.287 | 4.467.003 | Hess Corp | 60.307 | 4.346.269 |
| Comerica Inc | 51.492 | 4.359.130 | Philip Morris International Inc | 45.667 | 4.344.534 |
| JPMorgan Chase & Co | 26.838 | 4.354.687 | General Motors Co | 77.378 | 4.282.308 |
| Vistra Corp | 222.216 | 4.336.252 | L3Harris Technologies Inc | 19.386 | 4.140.119 |
| Morgan Stanley | 45.000 | 4.322.339 | Mondelez International Inc | 67.293 | 4.115.421 |
| AES Corp/The | 171.691 | 4.263.384 | Weyerhaeuser Co (REIT) | 110.400 | 4.048.457 |
| Organon & Co | 124.689 | 4.142.291 | QUALCOMM Inc | 27.189 | 3.989.100 |
| State Street Corp | 44.774 | 4.123.947 | Carrier Global Corp | 79.402 | 3.928.465 |
| Marathon Petroleum Corp | 64.018 | 4.012.049 | Medtronic PLC | 32.551 | 3.694.661 |
| Voya Financial Inc | 64.466 | 3.905.874 | Devon Energy Corp | 96.431 | 3.679.767 |
| Mondelez International Inc | 67.293 | 3.860.230 | Voya Financial Inc | 55.366 | 3.559.583 |
| AbbVie Inc | 33.730 | 3.834.728 | Las Vegas Sands Corp | 61.868 | 3.415.788 |
| Medtronic PLC | 30.882 | 3.806.151 | ConocoPhillips | 65.646 | 3.278.206 |
| QUALCOMM Inc | 26.382 | 3.786.347 | US Bancorp | 60.198 | 3.210.596 |
| Ameriprise Financial Inc | 15.359 | 3.759.418 | Assurant Inc | 19.758 | 3.111.355 |
| Norfolk Southern Corp | 14.293 | 3.724.099 | Becton Dickinson and Co - Preferred Stock 6.000% 01-Jun-2023 | 58.652 | 3.110.613 |
| US Bancorp | 63.539 | 3.707.507 | Phillips 66 | 38.091 | 3.076.311 |
| Newell Brands Inc | 141.155 | 3.585.506 | Bristol-Myers Squibb Co | 48.922 | 3.046.265 |
| L3Harris Technologies Inc | 16.077 | 3.400.582 | Ameriprise Financial Inc | 10.210 | 2.836.413 |
| Becton Dickinson and Co - Preferred Stock 6.000% 01-Jun-2023 | 57.980 | 3.178.626 | Truist Financial Corp | 48.029 | 2.639.453 |
| International Game Technology Plc | 119.928 | 3.115.097 | VF Corp | 33.193 | 2.633.769 |
| Valero Energy Corp | 38.668 | 3.073.467 | Viatis Inc | 192.131 | 2.601.325 |
| Viatis Inc | 192.131 | 2.990.348 | Valero Energy Corp | 38.668 | 2.574.723 |
| EQT Corp | 140.746 | 2.979.271 | Charles Schwab Corp/The | 31.511 | 2.457.038 |
| CME Group Inc | 12.906 | 2.910.922 | | | |
| Clearway Energy Inc | 89.479 | 2.800.374 | | | |
| Vodafone Group Plc ADR | 154.311 | 2.722.521 | | | |
| General Motors Co | 46.731 | 2.683.321 | | | |

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Wichtige Käufe | Nominal | Kosten USD | Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten | Nominal | Erlöse USD |
|---|------------|------------|--|------------|------------|
| City of San Francisco CA Public Utilities Commission Water Revenue 3.303% 01-Nov-2039 | 21.635.000 | 23.084.329 | Virginia College Building Authority 1.865% 01-Feb-2031 | 12.000.000 | 11.782.440 |
| City of Philadelphia PA 5.000% 01-May-2033 | 11.000.000 | 14.729.330 | Massachusetts School Building Authority 1.753% 15-Aug-2030 | 11.000.000 | 11.192.060 |
| City of New York NY 4.000% 01-Mar-2050 | 11.000.000 | 12.685.530 | Triborough Bridge & Tunnel Authority 5.000% 15-Nov-2049 | 8.725.000 | 11.191.383 |
| San Francisco City & County Airport Comm-San Francisco International Airport 5.000% 01-May-2049 | 10.000.000 | 12.252.900 | California Infrastructure & Economic Development Bank 2.716% 01-Oct-2040 | 10.240.000 | 10.164.224 |
| Massachusetts School Building Authority 3.395 % 15-Oct-2040 | 11.450.000 | 12.142.761 | Illinois State Toll Highway Authority 5.000% 01-Jan-2044 | 8.000.000 | 10.081.200 |
| New York State Dormitory Authority 4.000% 15-Mar-2044 | 10.000.000 | 11.490.800 | Illinois State Toll Highway Authority 5.000% 01-Jan-2045 | 5.500.000 | 7.127.560 |
| Piedmont Municipal Power Agency 5.000% 01-Jan-2030 | 8.700.000 | 11.119.644 | City Of South Miami Health Facilities Authority Inc 5.000% 15-Aug-2047 | 5.000.000 | 6.148.600 |
| New York State Urban Development Corp 4.000% 15-Mar-2046 | 9.510.000 | 11.016.860 | University of California 4.000% 15-May-2051 | 5.020.000 | 5.994.282 |
| Triborough Bridge & Tunnel Authority 5.000% 15-Nov-2049 | 8.725.000 | 10.956.244 | Metropolitan Atlanta Rapid Transit Authority 2.410% 01-Jul-2036 | 6.000.000 | 5.909.700 |
| San Jose Redevelopment Agency Successor Agency 3.375% 01-Aug-2034 | 10.000.000 | 10.690.900 | Massachusetts Port Authority 5.000% 01-Jul-2040 | 4.000.000 | 5.146.920 |
| California Community Choice Financing Authority 4.000% 01-Feb-2052 | 8.750.000 | 10.652.775 | Sycamore Community City School District 4.000% 01-Dec-2028 | 3.270.000 | 4.037.600 |
| State of New York 3.110% 15-Feb-2037 | 10.000.000 | 10.619.700 | Black Belt Energy Gas District 4.000% 01-Oct-2049 | 3.470.000 | 3.928.248 |
| New York State Urban Development Corp 2.840% 15-Mar-2032 | 10.000.000 | 10.450.000 | Industrial Development Authority of the City of Phoenix/The 0.010% 15-Nov-2052 | 3.000.000 | 3.000.000 |
| California Infrastructure & Economic Development Bank 2.716% 01-Oct-2040 | 10.240.000 | 10.444.186 | Tennessee Energy Acquisition Corp 4.000% 01-Nov-2049 | 2.245.000 | 2.484.542 |
| Illinois State Toll Highway Authority 5.000% 01-Jan-2045 | 8.000.000 | 10.347.200 | New York City Housing Development Corp 4.249% 01-May-2030 | 2.340.000 | 2.340.000 |
| New Jersey Turnpike Authority 1.483% 01-Jan-2028 | 10.000.000 | 10.007.200 | California Housing Finance 3.656% 01-Feb-2029 | 2.000.000 | 2.000.000 |
| Santa Monica-Malibu Unified School District 2.944% 01-Aug-2036 | 9.500.000 | 10.003.310 | State of Texas 4.000% 01-Aug-2029 | 1.375.000 | 1.542.379 |
| County of Miami-Dade Seaport Department 1.862% 01-Oct-2029 | 10.000.000 | 10.000.000 | Industrial Development Authority of the City of Phoenix/The 3.790% 01-Jul-2021 | 1.460.000 | 1.460.000 |
| Illinois State Toll Highway Authority 5.000% 01-Jan-2044 | 8.000.000 | 9.959.920 | New Jersey Higher Education Student Assistance Authority 3.350% 01-Dec-2029 | 1.140.000 | 1.140.000 |
| Indiana Finance Authority 2.672% 01-Jul-2034 | 9.890.000 | 9.890.000 | County of Cook IL 5.000% 15-Nov-2033 | 1.000.000 | 1.061.450 |
| University of California 1.997% 15-May-2031 | 10.000.000 | 9.874.400 | | | |
| Indianapolis Local Public Improvement Bond Bank 4.000% 01-Jun-2040 | 8.000.000 | 9.311.840 | | | |
| City & County of Denver CO Airport System Revenue 2.037% 15-Nov-2028 | 8.250.000 | 8.583.960 | | | |
| State of New York 3.170% 15-Feb-2038 | 7.500.000 | 7.915.725 | | | |
| Ascension Health 3.106% 15-Nov-2039 | 7.600.000 | 7.791.216 | | | |
| Massachusetts School Building Authority 2.866% 15-Oct-2031 | 7.240.000 | 7.648.626 | | | |
| North Texas Tollway Authority 2.327% 01-Jan-2033 | 7.000.000 | 7.165.480 | | | |
| New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 4.000% 01-May-2043 | 6.000.000 | 6.961.320 | | | |
| City of Los Angeles Department of Airports 5.000% 15-May-2036 | 5.110.000 | 6.343.758 | | | |
| School District of Philadelphia/The 4.000% 01-Sep-2038 | 5.435.000 | 6.342.047 | | | |
| Metropolitan Washington Airports Authority Aviation Revenue 5.000% 01-Oct-2044 | 5.000.000 | 6.089.150 | | | |
| Massachusetts School Building Authority 1.753% 15-Aug-2030 | 6.000.000 | 5.922.180 | | | |
| University of California 4.000% 15-May-2051 | 5.020.000 | 5.914.966 | | | |
| City of Los Angeles Department of Airports 5.000% 15-May-2040 | 4.500.000 | 5.692.410 | | | |
| Pennsylvania Higher Educational Facilities Authority 4.000% 15-Aug-2044 | 4.965.000 | 5.670.129 | | | |
| City of New York NY 1.723% 01-Aug-2029 | 5.485.000 | 5.499.261 | | | |
| State of Oregon Department of Transportation 2.851% 15-Nov-2032 | 5.000.000 | 5.427.900 | | | |
| California Health Facilities Financing Authority 2.864% 01-Jun-2031 | 5.000.000 | 5.323.700 | | | |
| New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 2.400% 01-Aug-2025 | 5.000.000 | 5.321.500 | | | |

Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund* für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

| Wichtige Käufe | Nominal | Kosten EUR | Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten | Nominal | Erlöse EUR |
|---|-----------|---------------|---|-----------|---------------|
| AT&T Inc 3.150% 04-Sep-2036 | 8.965.000 | 10.819.176 | Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN' 3.700% 02-Apr-2040 | 4.162.000 | 5.669.550 |
| Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl 'EMTN' 1.000% 04-May-2028 | 8.311.000 | 8.291.200 | American Tower Corp 0.500% 15-Jan-2028 | 3.766.000 | 3.729.416 |
| Credit Suisse Group AG 'EMTN' FRN 3.250% 02-Apr-2026 | 6.803.000 | 7.602.148 | Commonwealth Bank of Australia 'REGS' 3.305% 11-Mar-2041 | 4.491.000 | 3.584.065 |
| Deutsche Bahn Finance GMBH FRN (Perpetual) 0.950% 22-Jan-2025 | 7.400.000 | 7.427.690 | XLIT Ltd FRN 3.250% 29-Jun-2047 | 2.980.000 | 3.358.365 |
| Comcast Corp 0.000% 14-Sep-2026 | 7.034.000 | 7.011.913 | UBS Group AG 0.625% 24-Feb-2033 | 3.416.000 | 3.323.495 |
| Abanca Corp Bancaria SA 'EMTN' FRN 0.500% 08-Sep-2027 | 6.700.000 | 6.665.145 | Deutsche Bahn Finance GMBH FRN (Perpetual) 0.950% 22-Jan-2025 | 3.200.000 | 3.216.954 |
| OP Corporate Bank plc 'EMTN' 0.125% 01-Jul-2024 | 6.242.000 | 6.315.113 | BNP Paribas SA 'EMTN' 1.125% 28-Aug-2024 | 3.000.000 | 3.099.930 |
| CaixaBank SA 'EMTN' 0.375% 03-Feb-2025 | 6.200.000 | 6.261.745 | UBS AG/London 'eMTN' 0.750% 21-Apr-2023 | 2.910.000 | 2.965.668 |
| CCEP Finance Ireland DAC 0.875% 06-May-2033 | 6.112.000 | 6.075.389 | Morgan Stanley 'GMTN' 1.000% 02-Dec-2022 | 2.920.000 | 2.963.450 |
| Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' FRN 0.010% 30-Apr-2024 | 6.041.000 | 6.040.396 | ALD SA 'EMTN' 1.250% 11-Oct-2022 | 2.900.000 | 2.945.820 |
| HSBC Holdings Plc FRN 3.000% 22-Jul-2028 | 4.800.000 | 6.032.844 | Carlsberg Breweries AS 'EMTN' 2.500% 28-May-2024 | 2.684.000 | 2.878.021 |
| XLIT Ltd FRN 3.250% 29-Jun-2047 | 5.247.000 | 5.898.806 | SES SA FRN (Perpetual) 4.625% 02-Jan-2170 | 2.760.000 | 2.838.329 |
| ING Groep NV 'EMTN' 1.000% 20-Sep-2023 | 5.700.000 | 5.873.287 | Medtronic Global Holdings SCA 'EMTN' 0.000% 02-Dec-2022 | 2.695.000 | 2.709.595 |
| Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN' 0.125% 05-Feb-2024 | 5.700.000 | 5.759.103 | Molson Coors Beverage Co 1.250% 15-Jul-2024 | 2.579.000 | 2.664.598 |
| Coca-Cola Co/The 0.800% 15-Mar-2040 | 5.941.000 | 5.663.128 | Ball Corp 0.875% 15-Mar-2024 | 2.640.000 | 2.661.912 |
| Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN' 3.700% 02-Apr-2040 | 4.162.000 | 5.556.865 | Heineken NV 'EMTN' 2.875% 04-Aug-2025 | 2.370.000 | 2.657.993 |
| RELX Finance BV 0.000% 18-Mar-2024 | 5.361.000 | 5.385.712 | Covivio Hotels SACA 1.000% 27-Jul-2029 | 2.600.000 | 2.654.951 |
| CNH Industrial Finance Europe SA 'EMTN' 1.625% 03-Jul-2029 | 4.984.000 | 5.305.979 | Diageo Finance PLC 'EMTN' 1.000% 22-Apr-2025 | 2.494.000 | 2.600.269 |
| Grand City Properties SA 'EMTN' 0.125% 11-Jan-2028 | 5.500.000 | 5.305.671 | National Australia Bank Ltd 'gmtn' 0.625% 30-Aug-2023 | 2.500.000 | 2.552.625 |
| Morgan Stanley FRN 0.497% 07-Feb-2031 | 5.326.000 | 5.261.917 | Credit Agricole Assurances SA FRN 4.750% 27-Sep-2048 | 1.900.000 | 2.349.968 |
| | | | AT&T Inc 1.800% 14-Sep-2039 | 2.250.000 | 2.318.850 |
| | | | Verizon Communications Inc 3.550% 22-Mar-2051 | 2.553.000 | 2.274.178 |
| | | | Diageo Finance PLC 'EMTN' 2.375% 20-May-2026 | 2.029.000 | 2.262.545 |
| | | | TenneT Holding BV FRN (Perpetual) 2.374% 22-Oct-2170 | 2.152.000 | 2.235.928 |
| | | | Coca-Cola Europacific Partners PLC FRN 0.000% 16-Nov-2021 | 2.200.000 | 2.200.000 |
| | | | Diageo Finance PLC 'EMTN' 2.500% 27-Mar-2032 | 1.840.000 | 2.197.420 |
| | | | BMW Finance NV 'EMTN' 0.625% 06-Oct-2023 | 2.109.000 | 2.152.762 |

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

ANHANG 1

OGAW-V-VERGÜTUNGSPOLITIK (ungeprüft)

Gemäß der OGAW-V-Richtlinie, den irischen Umsetzungsvorschriften und den Leitlinien der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde (ESMA) zur Vergütung im Rahmen von OGAW („der OGAW-Vergütungskodex“) ist die Gesellschaft verpflichtet, Einzelheiten zu der von der Verwaltungsgesellschaft im Geschäftsjahr an ihre Mitarbeiter gezahlten Vergütung offenzulegen.

In Übereinstimmung mit den Anforderungen der Richtlinie 2009/65/EG, geändert durch die Richtlinie 2014/91/EG, (die „OGAW-Richtlinie“) unterliegt die Verwaltungsgesellschaft den in Artikel 14(b) der OGAW-Richtlinie genannten Vergütungsregelungen. Diese fordern von den Verwaltungsgesellschaften von OGAW die Einführung von Vergütungsvorschriften, -verfahren und -praktiken, die:

- mit einem soliden und wirksamen Risikomanagement vereinbar und diesem förderlich sind;
- nicht zur Übernahme von übermäßigen Risiken ermutigen, die mit den Risikoprofilen oder der maßgeblichen Dokumentation des OGAW nicht vereinbar sind; und
- die Verwaltungsgesellschaft des OGAW nicht daran hindern, pflichtgemäß im besten Interesse des OGAW zu handeln.

Die Verwaltungsgesellschaft wendet ihre Vergütungspolitik und -praxis in einer Weise an, die ihrer Größe und der Größe des von ihr verwalteten OGAW, ihrer internen Organisation und der Art, dem Umfang und der Komplexität ihrer Geschäfte angemessen ist. Daneben wendet die Verwaltungsgesellschaft bei der Ernennung von Dritten, die gemäß einer formalen Übertragungsvereinbarung im Namen des OGAW Anlageentscheidungen treffen, die sich auf das Risikoprofil der jeweiligen Teilfonds auswirken können, das Verhältnismäßigkeitsprinzip an.

Das Geschäftsmodell der Verwaltungsgesellschaft ist in weitestem Sinne darauf ausgelegt, nicht das Eingehen übermäßiger Risiken zu fördern. In Übereinstimmung mit den Anforderungen der OGAW-Richtlinie ergreift die Verwaltungsgesellschaft angemessene Maßnahmen, um natürliche Personen zu identifizieren, die der Verwaltungsgesellschaft Dienstleistungen erbringen und deren Tätigkeit einen wesentlichen Einfluss auf das Risikoprofil der Verwaltungsgesellschaft und des von ihr verwalteten OGAW haben können, und die als „identifizierte Mitarbeiter“ bezeichnet werden, unter anderem:

- satzungsmäßige Verwaltungsratsmitglieder;
- Mitglieder der Geschäftsführung und andere Mitarbeiter auf derselben Einkommensstufe;
- die Leiter der Kontrollfunktionen und
- sonstige Risikoträger, unter anderem alle Mitarbeiter, deren Tätigkeiten – einzeln oder gemeinsam als Teil einer Gruppe – wesentlichen Einfluss auf die Risikoprofile der Verwaltungsgesellschaft oder eines von ihr verwalteten OGAW haben können.

Die geschäftsführenden Verwaltungsratsmitglieder erhalten keine direkte Vergütung von der Verwaltungsgesellschaft. Die unabhängigen, nicht-geschäftsführenden Verwaltungsratsmitglieder erhalten von der Verwaltungsgesellschaft eine Vergütung für ihre Dienstleistungen, die ein festes und kein variables Vergütungselement enthält.

Die Geschäfte und Aktivitäten der Verwaltungsgesellschaft und des von ihr verwalteten OGAW werden weitgehend von Mitarbeitern anderer Unternehmen der BNY Mellon Group durchgeführt. Die Vergütung dieser Mitarbeiter wird von der Geschäftsführung des betreffenden Geschäftsbereichs in Übereinstimmung mit den globalen und regionalen Richtlinien, Grundsätzen und Praktiken von BNY Mellon festgelegt. Sofern es Service-Vereinbarungen gibt, oder die Portfolioverwaltung formal übertragen wurde, versucht die Verwaltungsgesellschaft sicherzustellen, dass Vergütungsvereinbarungen für identifizierte Mitarbeiter als ebenso wirksam eingestuft werden wie jene, denen die Verwaltungsgesellschaft direkt unterliegt, einschließlich der Grundsätze der Verhältnismäßigkeit. Daneben soll mit dem Risikorahmen, den die Verwaltungsgesellschaft bei Vereinbarungen zur Übertragung der Portfolioverwaltung zugrunde legt, sichergestellt werden, dass die bei diesen Dritten mit der Durchführung von Aufgaben betrauten Personen, nicht in der Lage sind, das Risikoprofil des OGAW wesentlich zu beeinflussen.

Die Vergütungsphilosophie und die Vergütungsgrundsätze von BNY Mellon basieren auf der Gewährung einer Gesamtvergütung, die ihre Kernwerte Kundenfokus, Integrität, Teamwork und herausragende Leistungen unterstützt. Leistung wird sowohl auf der Mitarbeiter- als auch auf Unternehmensebene belohnt und anhand finanzieller und anderer Faktoren bewertet. Dadurch sollen die Interessen von Mitarbeitern und Anteilshabern bzw. Kunden abgestimmt und Anreize für Aktivitäten geschaffen werden, die zu einem überdurchschnittlichen Finanzergebnis und langfristigen Wertzuwachs beitragen. Gleichzeitig soll sichergestellt werden, dass anreizbasierte Vergütungsvereinbarungen Mitarbeiter nicht zum Eingehen unnötiger und übermäßiger Risiken ermutigen. Die Gesamtvergütungsstruktur von BNY Mellon stellt ein ausgewogenes Verhältnis zwischen kurzfristigen und langfristigen Anreizen und eine Mischung aus Bar- und Aktienvergütung dar. Dies soll Mitarbeiter vom Eingehen übermäßiger Risiken abhalten, die sich nachteilig auf die langfristigen Ergebnisse von Unternehmen innerhalb der BNY Mellon Group auswirken können und einen wesentlichen Teil ihrer eigenen Vergütung beeinflussen.

BNY Mellon hat auf globaler, regionaler und auf Unternehmensebene Vergütungsausschüsse eingerichtet, die für die Überwachung der Mitarbeitervergütung und Mitarbeiterpläne und -programme zuständig sind. Die Verwaltungsgesellschaft verfügt nicht über einen gesonderten Vergütungsausschuss.

Vergütung für identifizierte Mitarbeiter für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021:

| | USD |
|---|----------------|
| Gesamtvergütung für das Geschäftsjahr (ohne MwSt.) | 433.406 |
| Davon feste Vergütung | 241.795 |
| Davon variable Vergütung | 191.611 |

ANHANG 2

ANGABEN ZUR VERORDNUNG ÜBER WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE („SFTR“) (ungeprüft)

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE

Die Gesellschaft hat am 27. November 2015 mit The Bank of New York Mellon, Niederlassung London (der „Verleiher“) eine Wertpapierleihvereinbarung (in der geänderten, abgetretenen, erneuerten und angenommenen Fassung) geschlossen.

In der nachfolgenden Tabelle sind der Gesamtwert der entliehenen Wertpapiere nach Fonds als Anteil der ausleihbaren Vermögenswerte insgesamt sowie der Nettoinventarwert jedes Fonds per 31. Dezember 2021 angegeben:

| Fonds | Währung | Gesamtwert der entliehenen Wertpapiere | % der Summe der ausleihbaren Vermögenswerte | % des Nettoinventarwerts |
|--|---------|--|---|-----------------------------|
| BNY Mellon Absolute Return Bond Fund | EUR | 48.964.810 | 18,51 | 11,64 |
| BNY Mellon Absolute Return Equity Fund | GBP | 465.481 | 1,44 | 0,38 |
| BNY Mellon Blockchain Innovation Fund | USD | 1.044.909 | 100,00 | 1,10 |
| BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund | USD | 16.448.484 | 2,79 | 2,55 |
| BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund | USD | 3.079.695 | 1,69 | 1,61 |
| BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund | USD | 155.871 | 0,79 | 0,75 |
| BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund | USD | 20.082.140 | 100,00 | 1,05 |
| BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund | USD | 36.648.023 | 5,20 | 5,04 |
| BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund | USD | 39.651.491 | 8,58 | 7,15 |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund | USD | 2.380.707 | 8,18 | 7,18 |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund | USD | 8.189.363 | 16,71 | 7,21 |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund | USD | 2.006.090 | 11,16 | 7,19 |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund | USD | 13.035.578 | 16,91 | 10,37 |
| BNY Mellon Euroland Bond Fund | EUR | 39.208.171 | 15,03 | 14,21 |
| BNY Mellon European Credit Fund | EUR | 2.382.798 | 6,25 | 5,85 |
| BNY Mellon Global Bond Fund | USD | 60.059.217 | 23,36 | 13,82 |
| BNY Mellon Global Credit Fund | USD | 40.652.715 | 9,82 | 9,18 |
| BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund | USD | 6.999.787 | 5,86 | 1,62 |
| BNY Mellon Global Equity Income Fund | USD | 3.593.546 | 1,32 | 0,87 |
| BNY Mellon Global High Yield Bond Fund | USD | 23.517.538 | 15,39 | 14,11 |
| BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund | USD | 16.769.732 | 7,54 | 7,36 |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) | EUR | 292.837 | 0,02 | 0,01 |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP) | GBP | 165.980 | 0,53 | 0,25 |
| BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund | USD | 100.866.936 | 14,98 | 12,73 |
| BNY Mellon Global Unconstrained Fund | USD | 1.171.333 | 6,27 | 3,60 |
| BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund | JPY | 465.167.861 | 2,48 | 2,20 |
| BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund | EUR | 275.321 | 0,02 | 0,02 |
| BNY Mellon Mobility Innovation Fund | USD | 24.734.281 | 100,00 | 2,49 |
| BNY Mellon Small Cap Euroland Fund | EUR | 11.643.158 | 14,64 | 14,34 |
| BNY Mellon U.S. Equity Income Fund | USD | 15.845.066 | 5,57 | 5,32 |

Die Sicherheiten werden im Namen des Verleihers im Auftrag seiner Kunden gehalten; die effektive Trennung nach zugrunde liegenden Kunden erfolgt in den Büchern und Aufzeichnungen des Verleihers. Die Sicherheiten werden auf einem Konto beim Tri-Party-Agent gehalten, der als Abrechnungs und Sammelstelle für Wertpapiere und Sicherheiten zwischen dem Verleiher und dem Entleiher fungiert. Als Tri-Party-Agents werden Euroclear, Global Collateral Management – The Bank of New York Mellon Institutional Bank und JPMorgan Chase Bank, N.A. genutzt (wenn JPMorgan der Entleiher ist). Bei bilateralen Geschäften werden die Sicherheiten auf einem Konto beim Verleiher gehalten.

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Die nachfolgenden Tabellen enthalten eine Analyse der Beträge, die zum 31. Dezember 2021 bei jedem Sicherheitentreuhänder als Sachsicherheiten gehalten wurden, die im Zusammenhang mit Wertpapierleihgeschäften entgegengenommen wurden:

| Fonds | Sicherheitentreuhänder | Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten | Fonds | Sicherheitentreuhänder | Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten |
|---|---|--|---|---|--|
| BNY Mellon Absolute Return Bond Fund | | EUR | BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund | | USD |
| | The Bank of New York Mellon, Niederlassung London | 41.745.413 | | The Bank of New York Mellon Institutional Bank | 37.236.215 |
| | Euroclear Triparty | 11.668.557 | | Euroclear Triparty | 223.504 |
| | | 53.413.970 | | | 37.459.719 |
| BNY Mellon Absolute Return Equity Fund | | GBP | BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund | | USD |
| | The Bank of New York Mellon, Niederlassung London | 512.816 | | The Bank of New York Mellon, Niederlassung London | 3.120.320 |
| | | 512.816 | | The Bank of New York Mellon Institutional Bank | 13.575.034 |
| BNY Mellon Blockchain Innovation Fund | | USD | | Euroclear Triparty | 23.836.970 |
| | The Bank of New York Mellon, Niederlassung London | 1.193.781 | | JPMorgan Chase Bank, N.A. | 1.152.554 |
| | | 1.193.781 | | | 41.684.878 |
| BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund | | USD | BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund | | USD |
| | The Bank of New York Mellon, Niederlassung London | 15.080.569 | | The Bank of New York Mellon Institutional Bank | 413.162 |
| | The Bank of New York Mellon Institutional Bank | 2.780.571 | | Euroclear Triparty | 2.111.556 |
| | | 17.861.140 | | | 2.524.718 |
| BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund | | USD | BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund | | USD |
| | The Bank of New York Mellon Institutional Bank | 3.153.750 | | Euroclear Triparty | 9.029.862 |
| | | 3.153.750 | | | 9.029.862 |
| BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund | | USD | BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund | | USD |
| | The Bank of New York Mellon Institutional Bank | 83.787 | | The Bank of New York Mellon Institutional Bank | 431.655 |
| | Euroclear Triparty | 75.718 | | Euroclear Triparty | 1.730.427 |
| | | 159.505 | | | 2.162.082 |
| BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund | | USD | BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund | | USD |
| | The Bank of New York Mellon Institutional Bank | 21.303.384 | | The Bank of New York Mellon, Niederlassung London | 509.053 |
| | | 21.303.384 | | The Bank of New York Mellon Institutional Bank | 1.754.275 |
| | | | | Euroclear Triparty | 11.768.583 |
| | | | | | 14.031.911 |

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

| Fonds | Sicherheitentrehänder | Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten | Fonds | Sicherheitentrehänder | Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten |
|--|-----------------------|--|---|-----------------------|--|
| BNY Mellon Euroland Bond Fund | | EUR | BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund | | USD |
| The Bank of New York Mellon, Niederlassung London | | 11.274.888 | The Bank of New York Mellon, Niederlassung London | | 18.495.338 |
| Euroclear Triparty | | 30.014.962 | | | 18.495.338 |
| | | 41.289.850 | | | |
| BNY Mellon European Credit Fund | | EUR | BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) | | EUR |
| Euroclear Triparty | | 2.430.658 | The Bank of New York Mellon, Niederlassung London | | 322.352 |
| | | 2.430.658 | | | 322.352 |
| BNY Mellon Global Bond Fund | | USD | BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP) | | GBP |
| The Bank of New York Mellon, Niederlassung London | | 23.060.549 | The Bank of New York Mellon Institutional Bank | | 169.468 |
| The Bank of New York Mellon Institutional Bank | | 3.161.022 | | | 169.468 |
| Euroclear Triparty | | 37.469.917 | | | |
| | | 63.691.488 | BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund | | USD |
| BNY Mellon Global Credit Fund | | USD | The Bank of New York Mellon, Niederlassung London | | 2.561.092 |
| The Bank of New York Mellon, Niederlassung London | | 7.566.142 | The Bank of New York Mellon Institutional Bank | | 9.826.930 |
| Euroclear Triparty | | 35.542.059 | Euroclear Triparty | | 93.028.719 |
| | | 43.108.201 | | | 105.416.741 |
| BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund | | USD | BNY Mellon Global Unconstrained Fund | | USD |
| The Bank of New York Mellon, Niederlassung London | | 4.846.536 | The Bank of New York Mellon, Niederlassung London | | 581.685 |
| Euroclear Triparty | | 2.661.106 | Euroclear Triparty | | 669.524 |
| | | 7.507.642 | | | 1.251.209 |
| BNY Mellon Global Equity Income Fund | | USD | BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund | | JPY |
| The Bank of New York Mellon, Niederlassung London | | 756.342 | The Bank of New York Mellon, Niederlassung London | | 473.254.470 |
| The Bank of New York Mellon Institutional Bank | | 2.945.851 | JPMorgan Chase Bank, N.A. | | 37.250.971 |
| | | 3.702.193 | | | 510.505.441 |
| BNY Mellon Global High Yield Bond Fund | | USD | BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund | | EUR |
| The Bank of New York Mellon, Niederlassung London | | 1.176.274 | The Bank of New York Mellon, Niederlassung London | | 289.724 |
| The Bank of New York Mellon Institutional Bank | | 13.428.966 | | | 289.724 |
| Euroclear Triparty | | 9.697.894 | | | |
| | | 24.303.134 | | | |

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

| Fonds | Sicherheitentreuhänder | Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten | Fonds | Sicherheitentreuhänder | Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten |
|--|--|--|---|--|--|
| BNY Mellon Mobility Innovation Fund | | USD | BNY Mellon U.S. Equity Income Fund | | USD |
| | The Bank of New York Mellon, Niederlassung London | 27.226.897 | | The Bank of New York Mellon, Niederlassung London | 10.444.038 |
| | | 27.226.897 | | The Bank of New York Mellon Institutional Bank | 6.580.204 |
| | | | | | 17.024.242 |
| BNY Mellon Small Cap Euroland Fund | | EUR | | | |
| | The Bank of New York Mellon, Niederlassung London | 12.849.081 | | | |
| | | 12.849.081 | | | |

Nachfolgend Angaben zu Art und Qualität der im Rahmen von Wertpapierleihgeschäften entgegengenommenen Sicherheiten:

- (1) Schuldverschreibungen und Wertpapiere, die von folgenden Staaten, Behörden und Institutionen begeben oder garantiert wurden, sofern diese ein Rating von (i) mindestens AA der Ratingagentur Standard & Poor's oder (ii) mindestens AA der Ratingagentur Fitch bzw. (iii) mindestens Aa2 der Ratingagentur Moody's aufweisen: Australien, Belgien, Dänemark, Deutschland, Finnland, Frankreich, Irland, Italien, Japan, Kanada, Luxemburg, die Niederlande, Neuseeland, Norwegen, Österreich, Portugal, Schweden, Schweiz, Spanien, das Vereinigte Königreich, die Vereinigten Staaten von Amerika;
- (2) Schuldverschreibungen, sofern diese ein Rating von (i) mindestens AAA der Ratingagentur Standard & Poor's oder (ii) mindestens AAA der Ratingagentur Fitch bzw. (iii) mindestens Aaa2 der Ratingagentur Moody's aufweisen, der folgenden supranationalen Emittenten: Europäische Bank für Wiederaufbau und Entwicklung, Europäische Investitionsbank, Europäische Union, Interamerikanische Entwicklungsbank, Internationale Bank für Wiederaufbau und Entwicklung; International Finance Corporation;
- (3) Aktienwerte aus den folgenden Indizes: AEX 25 (Niederlande), CAC 40 (Frankreich), DAX 30 (Deutschland), Euro 50 (Eurozone), FTSE 100 (Vereinigtes Königreich), Nikkei 225 (Japan), SMI 20 (Schweiz), S&P 500 (Vereinigte Staaten von Amerika);
- (4) FTSE100 DBV (Klasse F10) wie im Crest Reference Manual definiert und
- (5) unstripped British Government Stock (Klasse UBG) wie im CREST Reference Manual definiert.

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Die nachfolgenden Tabellen enthalten eine Analyse der Art und Qualität der Sachsicherheiten, die im Rahmen von Wertpapierleihgeschäften entgegengenommen wurden, zum 31. Dezember 2021:

| Fonds | Art der Sicherheiten | Qualität der Sicherheiten | Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten | Fonds | Art der Sicherheiten | Qualität der Sicherheiten | Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten |
|---|------------------------------|---------------------------|--|---|------------------------------|---------------------------|--|
| BNY Mellon Absolute Return Bond Fund | | | EUR | BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund | | | USD |
| | Festverzinsliche Wertpapiere | Investment Grade | 12.835.549 | | Festverzinsliche Wertpapiere | Investment Grade | 159.505 |
| | Aktien | Anerkannte Aktienindizes | 40.578.421 | | | | 159.505 |
| | | | 53.413.970 | | | | |
| BNY Mellon Absolute Return Equity Fund | | | GBP | BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund | | | USD |
| | Festverzinsliche Wertpapiere | Investment Grade | 177.831 | | Festverzinsliche Wertpapiere | Investment Grade | 21.303.384 |
| | Aktien | Anerkannte Aktienindizes | 334.985 | | | | 21.303.384 |
| | | | 512.816 | | | | |
| BNY Mellon Blockchain Innovation Fund | | | USD | BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund | | | USD |
| | Aktien | Anerkannte Aktienindizes | 1.193.781 | | Festverzinsliche Wertpapiere | Investment Grade | 37.459.719 |
| | | | 1.193.781 | | | | 37.459.719 |
| BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund | | | USD | BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund | | | USD |
| | Festverzinsliche Wertpapiere | Investment Grade | 3.175.469 | | Festverzinsliche Wertpapiere | Investment Grade | 41.684.878 |
| | Aktien | Anerkannte Aktienindizes | 14.685.671 | | | | 41.684.878 |
| | | | 17.861.140 | | | | |
| BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund | | | USD | BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund | | | USD |
| | Festverzinsliche Wertpapiere | Investment Grade | 3.153.750 | | Festverzinsliche Wertpapiere | Investment Grade | 2.524.718 |
| | | | 3.153.750 | | | | 2.524.718 |
| | | | | BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund | | | USD |
| | | | | | Festverzinsliche Wertpapiere | Investment Grade | 9.029.862 |
| | | | | | | | 9.029.862 |
| | | | | BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund | | | USD |
| | | | | | Festverzinsliche Wertpapiere | Investment Grade | 2.162.082 |
| | | | | | | | 2.162.082 |

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

| Fonds | Art der Sicherheiten | Qualität der Sicherheiten | Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten | Fonds | Art der Sicherheiten | Qualität der Sicherheiten | Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten |
|---|------------------------------|---------------------------|--|---|------------------------------|---------------------------|--|
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund | | | USD | BNY Mellon Global Equity Income Fund | | | USD |
| | Festverzinsliche Wertpapiere | Investment Grade | 14.031.911 | | Festverzinsliche Wertpapiere | Investment Grade | 3.458.843 |
| | | | 14.031.911 | | Aktien | Anerkannte Aktienindizes | 243.350 |
| | | | | | | | 3.702.193 |
| BNY Mellon Euroland Bond Fund | | | EUR | BNY Mellon Global High Yield Bond Fund | | | USD |
| | Festverzinsliche Wertpapiere | Investment Grade | 30.014.962 | | Festverzinsliche Wertpapiere | Investment Grade | 24.303.134 |
| | Aktien | Anerkannte Aktienindizes | 11.274.888 | | | | 24.303.134 |
| | | | 41.289.850 | | | | |
| BNY Mellon European Credit Fund | | | EUR | BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund | | | USD |
| | Festverzinsliche Wertpapiere | Investment Grade | 2.430.658 | | Festverzinsliche Wertpapiere | Investment Grade | 9.663.126 |
| | | | 2.430.658 | | Aktien | Anerkannte Aktienindizes | 8.832.212 |
| | | | | | | | 18.495.338 |
| BNY Mellon Global Bond Fund | | | USD | BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) | | | EUR |
| | Festverzinsliche Wertpapiere | Investment Grade | 40.691.308 | | Aktien | Anerkannte Aktienindizes | 322.352 |
| | Aktien | Anerkannte Aktienindizes | 23.000.180 | | | | 322.352 |
| | | | 63.691.488 | | | | |
| BNY Mellon Global Credit Fund | | | USD | BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP) | | | GBP |
| | Festverzinsliche Wertpapiere | Investment Grade | 38.574.522 | | Festverzinsliche Wertpapiere | Investment Grade | 169.468 |
| | Aktien | Anerkannte Aktienindizes | 4.533.679 | | | | 169.468 |
| | | | 43.108.201 | | | | |
| BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund | | | USD | BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund | | | USD |
| | Festverzinsliche Wertpapiere | Investment Grade | 2.661.106 | | Festverzinsliche Wertpapiere | Investment Grade | 105.416.660 |
| | Aktien | Anerkannte Aktienindizes | 4.846.536 | | Aktien | Anerkannte Aktienindizes | 81 |
| | | | 7.507.642 | | | | 105.416.741 |
| | | | | BNY Mellon Global Unconstrained Fund | | | USD |
| | | | | | Festverzinsliche Wertpapiere | Investment Grade | 776.307 |
| | | | | | Aktien | Anerkannte Aktienindizes | 474.902 |
| | | | | | | | 1.251.209 |

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

| Fonds | Art der Sicherheiten | Qualität der Sicherheiten | Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten |
|---|------------------------------|----------------------------------|---|
| BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund | | | JPY |
| | Festverzinsliche Wertpapiere | Investment Grade | 237.257.543 |
| | Aktien | Anerkannte Aktienindizes | 273.247.898 |
| | | | 510.505.441 |
| BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund | | | EUR |
| | Festverzinsliche Wertpapiere | Investment Grade | 289.724 |
| | | | 289.724 |
| BNY Mellon Mobility Innovation Fund | | | USD |
| | Festverzinsliche Wertpapiere | Investment Grade | 9.092.865 |
| | Aktien | Anerkannte Aktienindizes | 18.134.032 |
| | | | 27.226.897 |
| BNY Mellon Small Cap Euroland Fund | | | EUR |
| | Festverzinsliche Wertpapiere | Investment Grade | 5.324.044 |
| | Aktien | Anerkannte Aktienindizes | 7.525.037 |
| | | | 12.849.081 |
| BNY Mellon U.S. Equity Income Fund | | | USD |
| | Festverzinsliche Wertpapiere | Investment Grade | 11.711.944 |
| | Aktien | Anerkannte Aktienindizes | 5.312.298 |
| | | | 17.024.242 |

In den folgenden Tabellen sind die zehn größten Emittenten von Sicherheiten basierend auf dem Wert der Sachsicherheiten, die im Rahmen von Wertpapierleihgeschäften entgegengenommen wurden, per 31. Dezember 2021 aufgeführt:

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

| Sicherheitsgeber | Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten | Sicherheitsgeber | Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten |
|---|---|--|---|
| BNY Mellon Absolute Return Bond Fund | EUR | BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund^ | USD |
| French Republic | 5.867.878 | United States of America | 3.153.750 |
| Amazon.com Inc | 4.057.827 | | |
| Xilinx Inc | 2.999.580 | BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund^ | USD |
| JPMorgan Chase & Co | 2.832.902 | United States of America | 83.788 |
| Gilead Sciences Inc | 2.498.310 | French Republic | 75.703 |
| German Federal Republic | 2.290.481 | Republic of Austria | 14 |
| McDonald's Corp | 2.278.364 | | |
| Moderna Inc | 1.774.901 | BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund^ | USD |
| Booking Holdings Inc | 1.463.441 | United States of America | 21.303.384 |
| Capital One Financial Corp | 1.434.020 | | |
| BNY Mellon Absolute Return Equity Fund | GBP | BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund^ | USD |
| United States of America | 102.338 | United States of America | 37.236.216 |
| French Republic | 49.892 | French Republic | 206.531 |
| ITOCHU Corp | 24.943 | Republic of Finland | 14.698 |
| FUJIFILM Holdings Corp | 24.943 | European Investment Bank | 1.684 |
| Fast Retailing Co Ltd | 24.943 | Inter-American Development Bank | 318 |
| MINEBEA MITSUMI Inc | 22.251 | The Grand Duchy of Luxembourg | 161 |
| Kubota Corp | 19.852 | International Bank for Reconstruction & Development | 111 |
| Sojitz Corp | 15.516 | | |
| Central Japan Railway Co | 14.877 | BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund | USD |
| Japan Post Holdings Co Ltd | 13.994 | United States of America | 15.857.020 |
| | | French Republic | 12.266.043 |
| BNY Mellon Blockchain Innovation Fund | USD | German Federal Republic | 7.700.606 |
| NVIDIA Corp | 119.378 | Kingdom of the Netherlands | 1.490.085 |
| L3Harris Technologies Inc | 92.245 | Commonwealth of Australia | 1.206.506 |
| Eli Lilly & Co | 83.684 | European Investment Bank | 709.768 |
| Boston Scientific Corp | 62.220 | International Bank for Reconstruction & Development | 645.424 |
| Abbott Laboratories | 57.109 | Kingdom of Sweden | 521.595 |
| BHP Group Plc | 48.548 | Republic of Austria | 476.929 |
| Amgen Inc | 48.012 | Republic of Finland | 420.554 |
| Global Payments Inc | 47.283 | | |
| Cadence Design Systems Inc | 45.869 | BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund | USD |
| Porsche Automobil Holding SE | 45.548 | United States of America | 2.905.950 |
| | | Amazon.com Inc | 1.374.000 |
| | | Xilinx Inc | 972.081 |
| | | JPMorgan Chase & Co | 718.586 |
| | | Gilead Sciences Inc | 621.021 |
| | | McDonald's Corp | 555.851 |
| | | Moderna Inc | 433.022 |
| | | Meta Platforms Inc | 400.256 |
| | | Pfizer Inc | 384.023 |
| | | Booking Holdings Inc | 357.105 |

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

| Sicherheitsgeber | Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten | Sicherheitsgeber | Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten |
|---|---|---|---|
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund | USD | BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund | USD |
| German Federal Republic | 932.488 | French Republic | 3.275.076 |
| French Republic | 794.775 | United States of America | 2.714.934 |
| United States of America | 445.669 | German Federal Republic | 2.297.917 |
| Kingdom of the Netherlands | 240.243 | European Investment Bank | 1.575.302 |
| Commonwealth of Australia | 59.300 | Norwegian Government | 1.120.189 |
| Republic of Austria | 36.203 | International Bank for Reconstruction & Development | 1.012.324 |
| Republic of Finland | 6.361 | Republic of Finland | 709.090 |
| International Bank for Reconstruction & Development | 5.411 | Kingdom of the Netherlands | 346.510 |
| European Investment Bank | 3.946 | Commonwealth of Australia | 319.433 |
| Government of Canada | 229 | Kingdom of Denmark | 306.588 |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund | USD | BNY Mellon Euroland Bond Fund | EUR |
| European Investment Bank | 1.779.826 | French Republic | 15.336.005 |
| French Republic | 1.746.590 | German Federal Republic | 6.114.007 |
| Norwegian Government | 1.312.261 | European Investment Bank | 1.833.202 |
| International Bank for Reconstruction & Development | 1.126.634 | International Bank for Reconstruction & Development | 1.173.175 |
| German Federal Republic | 889.698 | Norwegian Government | 1.164.134 |
| Republic of Finland | 811.087 | Kingdom of the Netherlands | 1.147.731 |
| United States of America | 588.461 | Commonwealth of Australia | 969.038 |
| Kingdom of Denmark | 359.292 | Volkswagen AG | 939.963 |
| Kingdom of the Netherlands | 296.993 | Kawasaki Kisen Kaisha Ltd | 914.714 |
| Inter-American Development Bank | 116.694 | Republic of Finland | 895.562 |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund | USD | BNY Mellon European Credit Fund | EUR |
| French Republic | 645.099 | French Republic | 1.778.451 |
| United States of America | 431.655 | German Federal Republic | 344.457 |
| European Investment Bank | 280.493 | Kingdom of Sweden | 100.475 |
| Norwegian Government | 205.485 | Kingdom of the Netherlands | 62.061 |
| International Bank for Reconstruction & Development | 176.537 | Commonwealth of Australia | 50.371 |
| Republic of Finland | 142.646 | Swiss Federation | 48.683 |
| German Federal Republic | 136.073 | Republic of Austria | 21.805 |
| Kingdom of Denmark | 56.261 | Republic of Finland | 10.727 |
| Kingdom of the Netherlands | 47.602 | International Bank for Reconstruction & Development | 7.123 |
| Inter-American Development Bank | 18.611 | European Investment Bank | 6.138 |
| | | BNY Mellon Global Bond Fund | USD |
| | | French Republic | 16.936.852 |
| | | German Federal Republic | 12.796.591 |
| | | United States of America | 3.162.585 |
| | | Commonwealth of Australia | 2.646.649 |
| | | Kingdom of the Netherlands | 2.089.024 |
| | | Republic of Austria | 1.379.390 |
| | | Apple Inc | 1.140.162 |
| | | Republic of Finland | 895.748 |
| | | Rio Tinto Plc | 843,477 |
| | | UnitedHealth Group Inc | 691,701 |

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

| Sicherheitsgeber | Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten | Sicherheitsgeber | Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten |
|---|---|---|---|
| BNY Mellon Global Credit Fund | | BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund | |
| | USD | | USD |
| German Federal Republic | 11.395.856 | United States of America | 3.641.267 |
| French Republic | 10.390.864 | French Republic | 3.001.559 |
| United Kingdom | 9.445.966 | German Federal Republic | 1.804.767 |
| United States of America | 2.514.893 | Kingdom of the Netherlands | 1.165.853 |
| Kingdom of the Netherlands | 2.311.012 | NVIDIA Corp | 686.687 |
| Commonwealth of Australia | 807.845 | L3Harris Technologies Inc | 530.612 |
| Kingdom of Sweden | 604.364 | Eli Lilly & Co | 481.369 |
| Republic of Austria | 348.285 | Boston Scientific Corp | 357.900 |
| European Investment Bank | 294.143 | Abbott Laboratories | 328.504 |
| Swiss Federation | 292.657 | BHP Group Plc | 286.124 |
| BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund | | BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) | |
| | USD | | EUR |
| French Republic | 1.492.154 | GlaxoSmithKline Plc | 32.235 |
| German Federal Republic | 869.946 | BHP Group Plc | 32.235 |
| Apple Inc | 215.925 | Prudential Plc | 27.897 |
| Rio Tinto Plc | 211.258 | Royal Dutch Shell Plc | 26.347 |
| United States of America | 198.250 | Meta Platforms Inc | 25.202 |
| UnitedHealth Group Inc | 173.244 | Unilever Plc | 20.807 |
| GlaxoSmithKline Plc | 167.584 | Vinci SA | 18.315 |
| Goldman Sachs Group Inc/The | 157.297 | Compass Group Plc | 17.327 |
| ViacomCBS Inc | 145.419 | Barclays Plc | 17.322 |
| BHP Group Plc | 131.444 | Ashtead Group Plc | 17.121 |
| BNY Mellon Global Equity Income Fund | | BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)^ | |
| | USD | | GBP |
| United States of America | 3.103.832 | United States of America | 169.468 |
| French Republic | 219.906 | | |
| German Federal Republic | 51.646 | BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund | |
| Kingdom of the Netherlands | 48.517 | | USD |
| Government of Canada | 34.942 | French Republic | 52.420.684 |
| GlaxoSmithKline Plc | 24.335 | German Federal Republic | 25.656.722 |
| BHP Group Plc | 24.335 | United States of America | 14.105.281 |
| Prudential Plc | 21.060 | Kingdom of the Netherlands | 4.101.854 |
| Royal Dutch Shell Plc | 19.890 | United Kingdom | 3.687.697 |
| Meta Platforms Inc | 19.025 | European Investment Bank | 1.489.987 |
| BNY Mellon Global High Yield Bond Fund | | Commonwealth of Australia | 949.311 |
| | USD | Republic of Finland | 944.011 |
| United States of America | 14.011.842 | Norwegian Government | 885.424 |
| French Republic | 5.060.255 | International Bank for Reconstruction & Development | 774.448 |
| German Federal Republic | 3.205.621 | | |
| United Kingdom | 479.447 | | |
| Kingdom of the Netherlands | 463.085 | | |
| European Investment Bank | 314.833 | | |
| International Bank for Reconstruction & Development | 296.002 | | |
| Commonwealth of Australia | 223.565 | | |
| Republic of Finland | 68.764 | | |
| Kingdom of Sweden | 61.915 | | |

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

| Sicherheitsgeber | Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten | Sicherheitsgeber | Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten |
|--|---|---|---|
| BNY Mellon Global Unconstrained Fund | USD | BNY Mellon Small Cap Euroland Fund | EUR |
| German Federal Republic | 41.1350 | French Republic | 2.153.934 |
| French Republic | 136.531 | United States of America | 1.829.189 |
| Commonwealth of Australia | 104.247 | German Federal Republic | 976.181 |
| Tesla Inc | 47.490 | Meta Platforms Inc | 348.997 |
| Republic of Austria | 44.940 | Royal Dutch Shell Plc | 328.180 |
| Kingdom of the Netherlands | 41.871 | Xilinx Inc | 316.129 |
| IHS Markit Ltd | 41.724 | Intuit Inc | 316.128 |
| Apple Inc | 38.733 | Alphabet Inc | 316.127 |
| Keyence Corp | 22.027 | HSBC Holdings Plc | 264.510 |
| Pfizer Inc | 18.135 | GlaxoSmithKline Plc | 185.947 |
| BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund | JPY | BNY Mellon U.S. Equity Income Fund | USD |
| French Republic | 104.239.201 | United States of America | 9.793.842 |
| United States of America | 78.331.806 | German Federal Republic | 1.251.883 |
| Kingdom of the Netherlands | 24.619.981 | Kingdom of the Netherlands | 403.719 |
| NVIDIA Corp | 20.738.383 | Vinci SA | 377.504 |
| German Federal Republic | 18.199.809 | Tesla Inc | 377.035 |
| L3Harris Technologies Inc | 16.024.839 | General Motors Co | 339.760 |
| Eli Lilly & Co | 14.537.660 | Coca-Cola Co/The | 306.539 |
| Government of Canada | 11.866.737 | French Republic | 262.500 |
| Boston Scientific Corp | 10.808.823 | AT&T Inc | 260.843 |
| BHP Group Plc | 10.242.149 | GlaxoSmithKline Plc | 255.353 |
| BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund[^] | EUR | | |
| United States of America | 289.724 | | |
| BNY Mellon Mobility Innovation Fund | USD | | |
| French Republic | 5.779.892 | | |
| Meggitt Plc | 1.560.624 | | |
| United States of America | 1.304.940 | | |
| Koninklijke KPN NV | 1.104.873 | | |
| Dassault Systemes SE | 1.070.301 | | |
| Avast PLC | 1.058.347 | | |
| Kingdom of the Netherlands | 961.567 | | |
| German Federal Republic | 941.509 | | |
| Stellantis NV | 752.319 | | |
| Kering SA | 638.742 | | |

[^] Wenn zum 31. Dezember 2021 weniger als zehn Sicherheitsgeber vorhanden waren, wurden alle Emittenten einbezogen.

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Die nachfolgenden Tabellen enthalten eine Analyse der Währungen der Sachsicherheiten, die im Rahmen von Wertpapierleihgeschäften entgegengenommen wurden, zum 31. Dezember 2021:

| Fonds Währung | Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten | Fonds Währung | Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten |
|---|--|---|--|
| BNY Mellon Absolute Return Bond Fund | EUR | BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund | USD |
| Australischer Dollar | 107.736 | Kanadischer Dollar | 86.982 |
| Brasilianischer Real | 24.922 | Euro | 313.437 |
| Dänische Krone | 184.117 | Japanischer Yen | 578.143 |
| Euro | 9.030.169 | Pfund Sterling | 230.523 |
| Indische Rupie | 21.973 | US-Dollar | 16.652.055 |
| Indonesische Rupiah | 42.420 | | 17.861.140 |
| Lari | 2.385 | BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund | USD |
| Mexikanischer neuer Peso | 58.882 | US-Dollar | 3.153.750 |
| Norwegische Krone | 685.656 | | 3.153.750 |
| Pfund Sterling | 75.394 | BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund | USD |
| Russischer Rubel | 40.079 | Euro | 75.717 |
| Südafrikanischer Rand | 60.387 | US-Dollar | 83.788 |
| Schwedische Krone | 15.524 | | 159.505 |
| Schweizer Franken | 26.993 | BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund | USD |
| Türkische Lira | 1.097 | US-Dollar | 21.303.384 |
| US-Dollar | 43.036.236 | | 21.303.384 |
| | 53.413.970 | BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund | USD |
| BNY Mellon Absolute Return Equity Fund | GBP | Euro | 223.167 |
| Kanadischer Dollar | 6.619 | Pfund Sterling | 1 |
| Euro | 88.445 | US-Dollar | 37.236.551 |
| Japanischer Yen | 238.249 | | 37.459.719 |
| Pfund Sterling | 6.683 | | |
| Schweizer Franken | 310 | | |
| US-Dollar | 172.510 | | |
| | 512.816 | | |
| BNY Mellon Blockchain Innovation Fund | USD | | |
| Euro | 86.890 | | |
| Japanischer Yen | 29.485 | | |
| Pfund Sterling | 92.897 | | |
| Schweizer Franken | 4.283 | | |
| US-Dollar | 980.226 | | |
| | 1.193.781 | | |

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

| Fonds Währung | Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten | BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund | USD |
|---|--|---|------------------|
| BNY Mellon Emerging Market Corporate Debt Fund | USD | Dänische Krone | 56.261 |
| Australischer Dollar | 1.206.506 | Euro | 973.745 |
| Brasilianischer Real | 99.295 | Pfund Sterling | 23.039 |
| Kanadischer Dollar | 127.019 | Norwegische Krone | 209.518 |
| Dänische Krone | 24.039 | Schwedische Krone | 4.744 |
| Euro | 22.505.593 | Schweizer Franken | 6.914 |
| Indische Rupie | 87.542 | US-Dollar | 887.861 |
| Indonesische Rupiah | 169.008 | | 2.162.082 |
| Lari | 9.500 | | |
| Mexikanischer neuer Peso | 234.593 | | |
| Norwegische Krone | 90.479 | | |
| Pfund Sterling | 13.721 | | |
| Russischer Rubel | 159.680 | | |
| Südafrikanischer Rand | 240.591 | | |
| Schwedische Krone | 2.027 | | |
| Schweizer Franken | 125.306 | | |
| Türkische Lira | 4.371 | | |
| US-Dollar | 16.585.608 | | |
| | 41.684.878 | | |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund | USD | | |
| Australischer Dollar | 59.300 | | |
| Kanadischer Dollar | 229 | | |
| Euro | 2.019.336 | | |
| Pfund Sterling | 121 | | |
| Norwegische Krone | 62 | | |
| US-Dollar | 445.670 | | |
| | 2.524.718 | | |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund | USD | | |
| Dänische Krone | 359.292 | | |
| Euro | 3.746.693 | | |
| Pfund Sterling | 147.125 | | |
| Norwegische Krone | 1.338.014 | | |
| Schwedische Krone | 30.293 | | |
| US-Dollar | 3.408.445 | | |
| | 9.029.862 | | |

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

| Fonds Währung | Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten | Fonds Währung | Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten |
|---|--|--|--|
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund | USD | BNY Mellon Global Bond Fund | USD |
| Australischer Dollar | 319.433 | Australischer Dollar | 2.646.649 |
| Dänische Krone | 306.588 | Euro | 37.531.712 |
| Euro | 6.869.699 | Japanischer Yen | 1.710.873 |
| Pfund Sterling | 236.090 | Norwegische Krone | 4.187 |
| Norwegische Krone | 1.142.164 | Pfund Sterling | 5.992.510 |
| Schwedische Krone | 25.850 | Schweizer Franken | 510.447 |
| US-Dollar | 5.132.087 | Schwedische Krone | 1.071 |
| | | US-Dollar | 15.294.039 |
| | 14.031.911 | | 63.691.488 |
| BNY Mellon Euroland Bond Fund | EUR | BNY Mellon Global Credit Fund | USD |
| Australischer Dollar | 969.038 | Australischer Dollar | 807.845 |
| Kanadischer Dollar | 4.718 | Euro | 25.327.234 |
| Dänische Krone | 318.499 | Japanischer Yen | 75.071 |
| Euro | 25.336.603 | Norwegische Krone | 1.331 |
| Japanischer Yen | 9.597.349 | Pfund Sterling | 11.018.114 |
| Norwegische Krone | 1.186.963 | Schweizer Franken | 412.251 |
| Pfund Sterling | 805.180 | US-Dollar | 5.466.355 |
| Schwedische Krone | 26.854 | | 43.108.201 |
| Schweizer Franken | 25.253 | | |
| US-Dollar | 3.019.393 | BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund | USD |
| | 41.289.850 | Australischer Dollar | 96.715 |
| | | Schweizer Franken | 127.847 |
| BNY Mellon European Credit Fund | EUR | Euro | 3.038.239 |
| Australischer Dollar | 50.372 | Pfund Sterling | 1.456.887 |
| Euro | 2.230.876 | Japanischer Yen | 80.253 |
| Norwegische Krone | 83 | US-Dollar | 2.707.701 |
| Schweizer Franken | 48.682 | | 7.507.642 |
| US-Dollar | 100.645 | | |
| | 2.430.658 | | |

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

| Fonds Währung | Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten | Fonds Währung | Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten |
|---|--|---|--|
| BNY Mellon Global Equity Income Fund | USD | BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP) | GBP |
| Kanadischer Dollar | 34.942 | US-Dollar | 169.468 |
| Euro | 338.260 | | 169.468 |
| Pfund Sterling | 195.832 | | |
| US-Dollar | 3.133.159 | | |
| | 3.702.193 | BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund | USD |
| BNY Mellon Global High Yield Bond Fund | USD | Australischer Dollar | 949.311 |
| Australischer Dollar | 223.565 | Dänische Krone | 242.390 |
| Brasilianischer Real | 57.757 | Euro | 83.321.368 |
| Kanadischer Dollar | 30.378 | Pfund Sterling | 3.963.738 |
| Euro | 8.880.065 | Norwegische Krone | 902.798 |
| Indische Rupie | 50.920 | Schwedische Krone | 20.437 |
| Indonesische Rupiah | 98.306 | US-Dollar | 16.016.699 |
| Lari | 5.526 | | 105.416.741 |
| Mexikanischer neuer Peso | 136.455 | BNY Mellon Global Unconstrained Fonds | USD |
| Norwegische Krone | 171 | Australischer Dollar | 104.247 |
| Pfund Sterling | 479.449 | Euro | 667.228 |
| Russischer Rubel | 92.880 | Japanischer Yen | 194.348 |
| Südafrikanischer Rand | 139.944 | Pfund Sterling | 24.331 |
| Schweizer Franken | 29.999 | Norwegische Krone | 172 |
| Türkische Lira | 2.543 | Schwedische Krone | 1.895 |
| US-Dollar | 14.075.176 | US-Dollar | 258.988 |
| | 24.303.134 | | 1.251.209 |
| BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund | USD | BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fonds | JPY |
| Euro | 7.561.415 | Kanadischer Dollar | 11.866.725 |
| Japanischer Yen | 169.605 | Euro | 180.801.508 |
| Pfund Sterling | 1.186.576 | Pfund Sterling | 41.131.967 |
| Schwedische Krone | 49.663 | Schweizer Franken | 2.083.654 |
| Schweizer Franken | 94.049 | Japanischer Yen | 17.411.861 |
| US-Dollar | 9.434.030 | US-Dollar | 257.209.726 |
| | 18.495.338 | | 510.505.441 |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) | EUR | | |
| Euro | 24.097 | | |
| Pfund Sterling | 259.409 | | |
| US-Dollar | 38.846 | | |
| | 322.352 | | |

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

| Fonds Währung | Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten |
|---------------|--|
|---------------|--|

| BNY Mellon Long-Term Global Equity Fonds | EUR |
|---|------------|
|---|------------|

| | |
|-----------|---------|
| US-Dollar | 289.724 |
|-----------|---------|

289.724

| BNY Mellon Mobility Innovation Fund | USD |
|--|------------|
|--|------------|

| | |
|--------------------|---------|
| Kanadischer Dollar | 104.958 |
|--------------------|---------|

| | |
|------|------------|
| Euro | 16.443.259 |
|------|------------|

| | |
|----------------|-----------|
| Pfund Sterling | 5.194.160 |
|----------------|-----------|

| | |
|-------------------|---------|
| Schweizer Franken | 556.050 |
|-------------------|---------|

| | |
|-----------------|--------|
| Japanischer Yen | 71.080 |
|-----------------|--------|

| | |
|-----------|-----------|
| US-Dollar | 4.857.390 |
|-----------|-----------|

27.226.897

| BNY Mellon Small Cap Euroland Fund | EUR |
|---|------------|
|---|------------|

| | |
|----------------------|--------|
| Brasilianischer Real | 18.110 |
|----------------------|--------|

| | |
|------|-----------|
| Euro | 4.455.447 |
|------|-----------|

| | |
|----------------|--------|
| Indische Rupie | 15.967 |
|----------------|--------|

| | |
|---------------------|--------|
| Indonesische Rupiah | 30.825 |
|---------------------|--------|

| | |
|-----------------|-----------|
| Japanischer Yen | 1.855.356 |
|-----------------|-----------|

| | |
|------------------|-------|
| Georgischer Lari | 1.733 |
|------------------|-------|

| | |
|--------------------------|--------|
| Mexikanischer neuer Peso | 42.786 |
|--------------------------|--------|

| | |
|----------------|-----------|
| Pfund Sterling | 2.015.702 |
|----------------|-----------|

| | |
|------------------|--------|
| Russischer Rubel | 29.123 |
|------------------|--------|

| | |
|-----------------------|--------|
| Südafrikanischer Rand | 43.881 |
|-----------------------|--------|

| | |
|-------------------|-------|
| Schwedische Krone | 3.413 |
|-------------------|-------|

| | |
|-------------------|---------|
| Schweizer Franken | 222.210 |
|-------------------|---------|

| | |
|----------------|-----|
| Türkische Lira | 798 |
|----------------|-----|

| | |
|-----------|-----------|
| US-Dollar | 4.113.730 |
|-----------|-----------|

12.849.081

| BNY Mellon U.S. Equity Income Fund | USD |
|---|------------|
|---|------------|

| | |
|------|-----------|
| Euro | 2.420.401 |
|------|-----------|

| | |
|-----------------|--------|
| Japanischer Yen | 37.970 |
|-----------------|--------|

| | |
|----------------|---------|
| Pfund Sterling | 401.693 |
|----------------|---------|

| | |
|-------------------|-------|
| Schweizer Franken | 5.527 |
|-------------------|-------|

| | |
|-----------|------------|
| US-Dollar | 14.158.651 |
|-----------|------------|

17.024.242

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Die nachfolgenden Tabellen enthalten eine Analyse der Laufzeiten bis zur Fälligkeit von Wertpapierleihgeschäften und den damit verbundenen entgegengenommenen Sicherheiten zum 31. Dezember 2021:

Die Analyse der Laufzeiten bis zur Fälligkeit basiert auf dem vertraglichen Fälligkeitsdatum der entliehenen Wertpapiere und bei Sachsicherheiten dem vertraglichen Fälligkeitstermin des als Sicherheit entgegengenommenen Wertpapiers.

| Fonds | Weniger als 1 Tag | 1 Tag bis 1 Woche | 1 Woche bis 1 Monat | 1 Monat bis 3 Monate | 3 Monate bis 1 Jahr | Über 1 Jahr | Offene Fälligkeit | Gesamt |
|---|----------------------|----------------------|------------------------|-------------------------|------------------------|-------------|-------------------|------------|
| BNY Mellon Absolute Return Bond Fund | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR |
| Entlehene Wertpapiere | - | - | - | 36.889.140 | - | 12.075.670 | - | 48.964.810 |
| Erhaltene Sachsicherheiten | - | 64.856 | - | 41.817 | 604.565 | 12.124.312 | 40.578.420 | 53.413.970 |
| BNY Mellon Absolute Return Equity Fund | GBP | GBP | GBP | GBP | GBP | GBP | GBP | GBP |
| Entlehene Wertpapiere | - | - | - | - | - | - | 465.481 | 465.481 |
| Erhaltene Sachsicherheiten | - | - | - | - | - | 177.831 | 334.985 | 512.816 |
| BNY Mellon Blockchain Innovation Fund | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD |
| Entlehene Wertpapiere | - | - | - | - | - | - | 1.044.909 | 1.044.909 |
| Erhaltene Sachsicherheiten | - | - | - | - | - | 1.193.781 | - | 1.193.781 |
| BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD |
| Entlehene Wertpapiere | - | - | - | 8.999.820 | - | - | 7.448.664 | 16.448.484 |
| Erhaltene Sachsicherheiten | - | - | 93.822 | 55.702 | 171.994 | 2.853.951 | 14.685.671 | 17.861.140 |
| BNY Mellon Efficient Global High Yield Beta Fund | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD |
| Entlehene Wertpapiere | - | - | - | - | - | 3.079.695 | - | 3.079.695 |
| Erhaltene Sachsicherheiten | - | - | - | - | - | 3.153.750 | - | 3.153.750 |
| BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD |
| Entlehene Wertpapiere | - | - | - | - | - | 155.871 | - | 155.871 |
| Erhaltene Sachsicherheiten | - | - | - | - | - | 159.505 | - | 159.505 |
| BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD |
| Entlehene Wertpapiere | - | - | - | - | 462.638 | 19.619.502 | - | 20.082.140 |
| Erhaltene Sachsicherheiten | - | - | - | - | - | 21.303.384 | - | 21.303.384 |

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

| Fonds | Weniger als 1 Tag | 1 Tag bis 1 Woche | 1 Woche bis 1 Monat | 1 Monat bis 3 Monate | 3 Monate bis 1 Jahr | Über 1 Jahr | Offene Fäll- igkeit | Gesamt |
|---|----------------------|----------------------|------------------------|-------------------------|------------------------|-------------|------------------------|------------|
| BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD |
| Entlehene Wertpapiere | - | - | - | - | 535.159 | 36.112.864 | - | 36.648.023 |
| Erhaltene Sachsicherheiten | - | - | 359.821 | 210.785 | 2.148.154 | 34.740.959 | - | 37.459.719 |
| BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD |
| Entlehene Wertpapiere | - | - | - | - | - | 39.651.491 | - | 39.651.491 |
| Erhaltene Sachsicherheiten | - | 142.907 | 372.943 | 613.779 | 4.192.982 | 36.362.267 | - | 41.684.878 |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD |
| Entlehene Wertpapiere | - | - | - | - | - | 2.380.707 | - | 2.380.707 |
| Erhaltene Sachsicherheiten | - | 36.681 | 8.581 | 22.016 | 184.785 | 2.272.655 | - | 2.524.718 |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD |
| Entlehene Wertpapiere | - | - | - | - | - | 8.189.363 | - | 8.189.363 |
| Erhaltene Sachsicherheiten | - | 5.588 | - | 7.084 | 204.666 | 8.812.524 | - | 9.029.862 |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD |
| Entlehene Wertpapiere | - | - | - | - | - | 2.006.090 | - | 2.006.090 |
| Erhaltene Sachsicherheiten | - | 875 | 7.821 | 13.994 | 133.242 | 2.006.150 | - | 2.162.082 |
| BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD |
| Entlehene Wertpapiere | - | - | - | - | - | 13.035.578 | - | 13.035.578 |
| Erhaltene Sachsicherheiten | - | - | 21.087 | 57.520 | 818.822 | 13.134.482 | - | 14.031.911 |
| BNY Mellon Euroland Bond Fund | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR |
| Entlehene Wertpapiere | - | - | - | - | - | 39.208.171 | - | 39.208.171 |
| Erhaltene Sachsicherheiten | - | 119.853 | 19.796 | 221.679 | 2.338.806 | 27.314.829 | 11.274.887 | 41.289.850 |
| BNY Mellon European Credit Fund | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR |
| Entlehene Wertpapiere | - | - | - | - | - | 2.382.798 | - | 2.382.798 |
| Erhaltene Sachsicherheiten | - | 45 | 1.037 | 63.872 | 223.545 | 2.142.159 | - | 2.430.658 |

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

| Fonds | Weniger als 1 Tag | 1 Tag bis 1 Woche | 1 Woche bis 1 Monat | 1 Monat bis 3 Monate | 3 Monate bis 1 Jahr | Über 1 Jahr | Offene Fäll- igkeit | Gesamt |
|---|----------------------|----------------------|------------------------|-------------------------|------------------------|-------------|------------------------|------------|
| BNY Mellon Global Bond Fund | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD |
| Entliehene Wertpapiere | - | - | - | - | - | 60.059.217 | - | 60.059.217 |
| Erhaltene Sachsicherheiten | - | 2.270 | 246.900 | 576.061 | 5.258.992 | 34.607.085 | 23.000.180 | 63.691.488 |
| BNY Mellon Global Credit Fund | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD |
| Entliehene Wertpapiere | - | - | - | - | 1.170.684 | 39.482.031 | - | 40.652.715 |
| Erhaltene Sachsicherheiten | - | 597.961 | 58.644 | 771.963 | 1.751.447 | 35.394.507 | 4.533.679 | 43.108.201 |
| BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD |
| Entliehene Wertpapiere | - | - | - | - | 1.455.020 | 5.544.767 | - | 6.999.787 |
| Erhaltene Sachsicherheiten | - | - | - | 645 | 142.341 | 2.518.120 | 4.846.536 | 7.507.642 |
| BNY Mellon Global Equity Income Fund | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD |
| Entliehene Wertpapiere | - | - | - | - | - | - | 3.593.546 | 3.593.546 |
| Erhaltene Sachsicherheiten | - | - | 118.055 | 68.923 | 205.381 | 3.066.484 | 243.350 | 3.702.193 |
| BNY Mellon Global High Yield Bond Fund | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD |
| Entliehene Wertpapiere | - | - | - | - | - | 23.517.538 | - | 23.517.538 |
| Erhaltene Sachsicherheiten | - | 120.946 | 18.836 | 135.821 | 1.462.049 | 22.565.482 | - | 24.303.134 |
| BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD |
| Entliehene Wertpapiere | - | - | - | - | - | - | 16.769.732 | 16.769.732 |
| Erhaltene Sachsicherheiten | - | - | - | - | - | 18.495.338 | - | 18.495.338 |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR |
| Entliehene Wertpapiere | - | - | - | - | - | - | 292.837 | 292.837 |
| Erhaltene Sachsicherheiten | - | - | - | - | - | - | 322.352 | 322.352 |
| BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP) | GBP | GBP | GBP | GBP | GBP | GBP | GBP | GBP |
| Entliehene Wertpapiere | - | - | - | - | - | 165.980 | - | 165.980 |
| Erhaltene Sachsicherheiten | - | - | - | 287 | 7.284 | 161.897 | - | 169.468 |

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

| Fonds | Weniger als 1 Tag | 1 Tag bis 1 Woche | 1 Woche bis 1 Monat | 1 Monat bis 3 Monate | 3 Monate bis 1 Jahr | Über 1 Jahr | Offene Fäll- ligkeit | Gesamt |
|---|----------------------|----------------------|------------------------|-------------------------|------------------------|-------------|-------------------------|-------------|
| BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD |
| Entlehene Wertpapiere | - | - | - | - | - | 100.866.936 | - | 100.866.936 |
| Erhaltene Sachsicherheiten | - | 1.159.881 | 37.135 | 305.989 | 6.092.443 | 97.821.212 | 81 | 105.416.741 |
| BNY Mellon Global Unconstrained Fund | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD |
| Entlehene Wertpapiere | - | - | - | - | - | 1.171.333 | - | 1.171.333 |
| Erhaltene Sachsicherheiten | - | 93 | 2.608 | 17.152 | 100.791 | 655.663 | 474.902 | 1.251.209 |
| BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund | JPY | JPY | JPY | JPY | JPY | JPY | JPY | JPY |
| Entlehene Wertpapiere | - | - | - | - | - | - | 465.167.861 | 465.167.861 |
| Erhaltene Sachsicherheiten | - | - | - | 5.969.256 | - | 231.288.304 | 273.247.881 | 510.505.441 |
| BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR |
| Entlehene Wertpapiere | - | - | - | - | - | - | 275.321 | 275.321 |
| Erhaltene Sachsicherheiten | - | - | - | 8.776 | 20.269 | 260.679 | - | 289.724 |
| BNY Mellon Mobility Innovation Fund | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD |
| Entlehene Wertpapiere | - | - | - | - | - | - | 24.734.281 | 24.734.281 |
| Erhaltene Sachsicherheiten | - | - | - | - | - | 27.226.897 | - | 27.226.897 |
| BNY Mellon Small Cap Euroland Fund | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR |
| Entlehene Wertpapiere | - | - | - | - | - | - | 11.643.158 | 11.643.158 |
| Erhaltene Sachsicherheiten | - | - | 833 | 76.093 | 118.966 | 5.128.151 | 7.525.038 | 12.849.081 |
| BNY Mellon U.S. Equity Income Fund | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD | USD |
| Entlehene Wertpapiere | - | - | - | - | - | - | 15.845.066 | 15.845.066 |
| Erhaltene Sachsicherheiten | - | - | 196.462 | 334.603 | 1.101.450 | 10.079.429 | 5.312.298 | 17.024.242 |

TRANSAKTIONEN MIT SWAPS, AKTIENINDEX-SWAPS UND TOTAL RETURN SWAPS

Die nachfolgenden Tabellen enthalten ausführliche Angaben zum gesamten Bruttonominalwert von Aktien-Swaps, Aktienindex-Swaps und Total Return Swaps sowie den absoluten beizulegenden Zeitwert als Anteil des Nettoinventarwerts jedes Fonds, analysiert nach Kontrahenten, zum 31. Dezember 2021:

| Fonds | Kontrahent | Gründungsland | Gesamter Bruttonominalwert | Absoluter beizulegender Zeitwert | % des Netto- inventarwerts |
|---|-------------------------------|------------------------|-------------------------------|--|-------------------------------|
| BNY Mellon Absolute Return Equity Fund | | | GBP | GBP | |
| | Bank of America Merrill Lynch | Vereinigtes Königreich | 45.930.872 | 2.768.095 | 2,24 |
| | Barclays Bank PLC | Vereinigtes Königreich | 30.268.935 | 1.517.332 | 1,22 |

TRANSAKTIONEN MIT SWAPS, AKTIENINDEX-SWAPS UND TOTAL RETURN SWAPS Forts.

| Fonds | Kontrahent | Gründungsland | Gesamter Bruttonominalwert | Absoluter beizulegender Zeitwert | % des Netto- inventarwerts |
|---|---------------------|--------------------------------|-------------------------------|--|-------------------------------|
| BNY Mellon Absolute Return Equity Fund Forts. | | | GBP | GBP | |
| | JPMorgan Chase Bank | Vereinigte Staaten von Amerika | 43.543.494 | 2.353.522 | 1,90 |
| | Morgan Stanley | Vereinigtes Königreich | 39.481.308 | 2.842.160 | 2,30 |
| | Gesamt | | 159.224.609 | 9.481.109 | 7,66 |
| BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund | | | EUR | EUR | |
| | BNP Paribas | Vereinigte Staaten von Amerika | 92.142.094 | 25.221.352 | 26,51 |
| | Gesamt | | 92.142.094 | 25.221.352 | 26,51 |

Die nachfolgende Tabelle enthält eine Analyse der Währungen der vom Fonds im Rahmen von offenen Derivatgeschäften vereinnahmten/bereitgestellten Barmittel zum 31. Dezember 2021:

| Fonds | Währung | Erhaltene Barsicherheiten | Gestellte Barsicherheiten |
|---|-------------------|------------------------------|---------------------------|
| BNY Mellon Absolute Return Equity Fund | | | |
| | | GBP | GBP |
| | Pfund Sterling | 2.530.000 | (160.000) |
| | | 2.530.000 | (160.000) |
| BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund | | | |
| | | EUR | EUR |
| | Euro | 770.000 | - |
| | | 770.000 | - |

Die nachfolgenden Tabellen enthalten eine Analyse der Laufzeiten bis zur Fälligkeit von Aktien-Swaps, Aktienindex-Swaps und Total Return Swaps (Nettoengagement) und der in diesem Zusammenhang entgegengenommenen/gestellten Sicherheiten zum 31. Dezember 2021:

Die Analyse der Laufzeiten bis zur Fälligkeit basiert auf dem vertraglichen Fälligkeitstermin der offenen Derivate.

| Fonds | Weniger als 1 Tag | 1 Tag bis 1 Woche | 11 Woche bis 1 Monat | 1 Monat bis 3 Monate | 3 Monate bis 1 Jahr | Über 1 Jahr | Offene Fälligkeit | Gesamt |
|---|----------------------|----------------------|-------------------------|-------------------------|------------------------|-------------|----------------------|-------------|
| BNY Mellon Absolute Return Equity Fund | | | | | | | | |
| | GBP | GBP | GBP | GBP | GBP | GBP | GBP | GBP |
| Aktienindex-Swaps | - | - | (452.714) | - | (471.425) | - | - | (924.139) |
| Aktien-Swaps | - | - | 144.652 | - | 2.906.923 | - | - | 3.051.575 |
| Erhaltene/(gestellte) Barsicherheiten | 2.370.000 | - | - | - | - | - | - | 2.370.000 |
| BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund | | | | | | | | |
| | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR |
| Aktien-Swaps | - | - | - | - | (5.233.643) | - | - | (5.233.643) |
| Total Return Swaps | - | - | - | - | 3.952.377 | 2.271.745 | - | 6.224.122 |
| Erhaltene/(gestellte) Barsicherheiten | 770.000 | - | - | - | - | - | - | 770.000 |

ANHANG 3

FINANZINDIZES (ungeprüft)

Die nachfolgende Tabelle enthält sämtliche Finanzindizes, die von den jeweiligen Anlageverwaltern der Fonds im Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 zu Anlagezwecken verwendet wurden:

| Fonds | Für Anlagezwecke verwendeter Index | Markt | Website |
|--|--|------------------|--|
| BNY Mellon Absolute Return Bond Fund | Markit iTraxx Europe Crossover Index | Europa | https://www.theice.com |
| BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund | Markit iTraxx Europe Crossover Index Markit iTraxx Europe Index | Europa Europa | https://www.theice.com https://www.theice.com |
| BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund | S&P 500 NR Index | U.S.A | https://www.spglobal.com |
| BNY Mellon U.S. Equity Income Fund | S&P 500 NR Index | U.S.A | https://www.spglobal.com |

ANHANG 4

VERORDNUNG ÜBER NACHHALTIGKEITSBEZOGENE OFFENLEGUNGSPFLICHTEN IM FINANZDIENSTLEISTUNGSSEKTOR UND TAXONOMIE-VERORDNUNG (ungeprüft)

Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor

Der Anlageverwalter hat die folgenden Fonds als Fonds kategorisiert, welche die Bestimmungen in Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 (die „Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor“, „SFDR“) erfüllen:

BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund

Die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale umfassen die Eindämmung umweltschädlicher Praktiken (einschließlich solcher, die zum Klimawandel beitragen können, wie z. B. die Gewinnung von Teersanden und Kraftwerkskohle), die Reduzierung der Herstellung umstrittener Waffen und die Förderung verantwortungsbewusster Geschäftspraktiken im Sinne der Prinzipien des UN Global Compact.

Vom 10. März 2021 bis zum 31. Dezember 2021 hat der Anlageverwalter Nachhaltigkeitsindikatoren angewandt, die von externen Datenanbietern bereitgestellt wurden, u. a. von MSCI und Sustainalytics, um die Beurteilung, Bewertung und Überwachung der vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu unterstützen. Durch Anwendung dieser Nachhaltigkeitsindikatoren wurden die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erfüllt, da der Fonds gegenüber dem Referenzwert sein Engagement in Emittenten reduziert hat, die zum Klimawandel beitragen können (z. B. Emittenten, die in der Gewinnung von Teersanden und Kraftwerkskohle aktiv sind), und der Fonds nicht in Emittenten engagiert war, die umstrittene Waffen herstellen oder als Emittenten identifiziert wurden, die gegen die Prinzipien des UN Global Compact verstoßen.

BNY Mellon Future Earth Fund

Die von diesem Fonds beworbenen ökologischen Merkmale beinhalten das Bestreben, in Unternehmen zu investieren die Produkte, Dienstleistungen und Lösungen anbieten, die dazu beitragen, den Druck auf die Umwelt und die natürlichen Ressourcen auf der Erde zu mindern.

Vom 10. März 2021 bis zum 31. Dezember 2021 verwendete der Anlageverwalter Daten zu bestimmten ökologischen, sozialen und Nachhaltigkeitsindikatoren, die sowohl von Emittenten als auch von externen Datenanbietern bereitgestellt wurden, um die vom Fonds beworbenen ökologischen Merkmale zu beurteilen, zu bewerten und zu überwachen. Durch Anwendung dieser Nachhaltigkeitsindikatoren wurden die vom Fonds beworbenen ökologischen Merkmale im Wesentlichen erfüllt, da der Fonds in erheblichem Umfang in Unternehmen engagiert war, die Produkte, Dienstleistungen und Lösungen anbieten, die dazu beitragen, den Druck auf die Umwelt und die natürlichen Ressourcen auf der Erde zu mindern. Zudem hatte der Fonds kein wesentliches Engagement in Emittenten, die an bestimmten Tätigkeitsbereichen teilnehmen, die der Anlageverwalter aus ökologischer Perspektive für schädlich hält (z. B. Unternehmen mit wesentlichen Aktivitäten im Sektor fossile Brennstoffe), und war nicht in Unternehmen engagiert, die als Unternehmen identifiziert wurden, die gegen die Prinzipien des UN Global Compact verstoßen.

BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund, BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)

Die von diesen Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale umfassen Bemühungen:

a) Emittenten zu identifizieren und zu vermeiden, die an bestimmten Tätigkeitsbereichen teilnehmen, die der Anlageverwalter aus ökologischer oder sozialer oder Unternehmensführungsperspektive für schädlich hält, oder die die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung nicht befolgen. Dies beinhaltet auch den Ausschluss von Unternehmen, die gegen die Prinzipien des UN Global Compact verstoßen, der Grundsätze in Bezug auf Menschenrechte, Arbeit, Umwelt und Korruptionsbekämpfung enthält.

b) Emittenten zu identifizieren und in Emittenten zu investieren, die proaktiv versuchen, soziale und Umweltfaktoren gut zu managen, um nachhaltige Renditen zu erzielen.

Vom 10. März 2021 bis zum 31. Dezember 2021 verwendete der Anlageverwalter Daten zu bestimmten ökologischen, sozialen und Nachhaltigkeitsindikatoren, die sowohl von Emittenten als auch von externen Datenanbietern bereitgestellt wurden, um die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu beurteilen, zu bewerten und zu überwachen. Durch Anwendung dieser Nachhaltigkeitsindikatoren wurden die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erfüllt, da der Fonds nicht in Emittenten engagiert war, von denen bekannt ist, dass sie gegen die Prinzipien des UN Global Compact verstoßen, oder in Emittenten, die in der Herstellung umstrittener Waffen tätig sind, und kein wesentliches Engagement in Emittenten hatte, die an bestimmten Tätigkeitsbereichen teilnehmen, die der Anlageverwalter aus ökologischer, sozialer oder Unternehmensführungsperspektive für schädlich hält (z. B. Unternehmen mit wesentlichen Aktivitäten im Sektor fossile Brennstoffe).

Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund

Zu den von diesem Fonds beworbenen Merkmalen kann eine positive Allokation in Emittenten mit stärkeren (besseren) Ratings für Umwelt, Soziales und Unternehmensführung (Environmental, Social and Governance, „ESG“) gehören, wobei Emittenten mit schwächeren (schlechteren) ESG-Ratings ausgeschlossen werden können. Zu den weiteren Merkmalen, die von diesem Fonds beworben werden, kann der Ausschluss von Engagements in Emittenten mit Geschäftseinkünften oder betrieblichen Aktivitäten gehören, die nach Ansicht des Anlageverwalters überhöhte ökologische, soziale oder reputationsbezogene Nachhaltigkeitsrisiken aufweisen.

Vom 10. März 2021 bis zum 31. Dezember 2021 bediente sich der Anlageverwalter einer Kombination aus externen und/oder internen Analysen mit Schwerpunkt auf Nachhaltigkeit sowie „Bottom-up“-Kreditanalysen und Einschätzungen zum relativen Wert, um die von dem Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale vor der Anlage und fortlaufend zu bewerten, zu messen und zu überwachen. Anhand dieser Nachhaltigkeitsindikatoren wurden die von dem Teilfonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale erfüllt, da der Fonds sein Engagement in Unternehmen erhöhte, die nach der internen ESG-Rating-Methode des Anlageverwalters gut abschnitten, wodurch ein besseres durchschnittliches ESG-Rating erzielt wurde als das seines Referenzwerts, des Bloomberg Barclays Euro Aggregate Corporate Total Return Index. Ferner hielt der Fonds Instrumente und Emittenten mit positiven Auswirkungen, darunter grüne und soziale Anleihen, erreichte ein niedrigeres CO₂-Intensitätsrating als der Referenzwert und war nicht in Emittenten engagiert, die nachweislich gegen die Prinzipien des UN Global Compact verstoßen oder an der Herstellung umstrittener Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen) beteiligt sind.

Der Anlageverwalter hat die folgenden Fonds als Fonds kategorisiert, welche die Bestimmungen in Artikel 9 der SFDR erfüllen:

Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund

Das nachhaltige Anlageziel dieses Fonds besteht darin, eine Gesamtrendite aus Ertrags- und Kapitalwachstum zu erzielen, indem er überwiegend in eine breite Palette von auf Euro lautenden Schuldtiteln und schuldttitelbezogenen Wertpapieren und damit verbundenen FDI investiert, wobei die Erlöse ausschließlich für die teilweise oder vollständige Finanzierung oder Refinanzierung von Projekten mit positiven ökologischen und/oder sozialen Auswirkungen verwendet werden.

Dieser Fonds war am 31. Dezember 2021 noch nicht aufgelegt. Deshalb ist es nicht möglich, einen Vergleich der Gesamtnachhaltigkeitswirkung des Fonds mit den Auswirkungen seines Referenzwerts, des Bloomberg Barclays MSCI Euro Corporate Green Bond Index, und eines breiten Marktindex anhand von Nachhaltigkeitsindikatoren vorzulegen.

Außer den oben aufgeführten Fonds verfolgen die Fonds der Gesellschaft kein Ziel oder keine Verpflichtung, in Unternehmen zu investieren, die ökologische oder soziale Merkmale bewerben oder als nachhaltige Anlagen qualifiziert sind und daher die Bestimmungen von Artikel 6 der SFDR erfüllen.

EU-Taxonomie-Verordnung**BNY Mellon Future Earth Fund, BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund, BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR), Responsible Horizons Euro Corporate Bond Fund**

Der Anlageverwalter hat diese Fonds als Fonds kategorisiert, welche die Bestimmungen in Artikel 6 der EU-Taxonomie-Verordnung erfüllen.

Die technischen Bewertungskriterien („TSC“) der EU-Taxonomie-Verordnung werden die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte zu jeder Anlage erfordern. Zum 31. Dezember 2021 waren keine ausreichenden verlässlichen, aktuellen und überprüfbareren Daten verfügbar, die es dem Anlageverwalter ermöglicht hätten, die Anlagen dieser Fonds mittels der TSC zu bewerten.

Obwohl es in diesen Fonds Anlagen in Wirtschaftstätigkeiten gab, die zu einem Umweltziel beitragen und für eine Bewertung nach den TSC in Frage kommen können, kann die Verwaltungsgesellschaft derzeit noch keine Angaben zu Folgendem machen:

- a) Das Ausmaß, in dem die Anlagen dieser Fonds in ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten geflossen sind;
- b) Der prozentuale Anteil der Anlagen in ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten am Portfolio dieser Fonds; oder
- c) der prozentuale Anteil des Portfolios dieser Fonds an ermöglichenden Tätigkeiten im Sinne der EU-Taxonomie-Verordnung sowie an Übergangstätigkeiten im Sinne der EU-Taxonomie-Verordnung.

Responsible Horizons Euro Impact Bond Fund

Der Anlageverwalter hat den Fonds als Fonds kategorisiert, welcher die Bestimmungen in Artikel 5 der EU-Taxonomie-Verordnung erfüllt.

Die TSC der EU-Taxonomie-Verordnung werden die Verfügbarkeit mehrerer spezifischer Datenpunkte zu jeder Anlage erfordern. Zum 31. Dezember 2021 waren keine ausreichenden verlässlichen, aktuellen und überprüfbaren Daten verfügbar, die es der Verwaltungsgesellschaft ermöglicht hätten, die Anlagen des Fonds mittels der TSC zu bewerten.

Obwohl es im Fonds Anlagen in Wirtschaftstätigkeiten gab, die zu einem Umweltziel beitragen und für eine Bewertung nach den TSC in Frage kommen können, kann die Verwaltungsgesellschaft derzeit noch keine Angaben zu Folgendem machen:

- a) das Ausmaß, in dem die Anlagen des Teilfonds in ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten erfolgten;
- b) der prozentuale Anteil der Investitionen in ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten am Portfolio des Teilfonds; oder
- c) der prozentuale Anteil des Portfolios des Teilfonds an ermöglichenden Tätigkeiten im Sinne der EU-Taxonomie-Verordnung sowie an Übergangstätigkeiten im Sinne der EU-Taxonomie-Verordnung.

Abgesehen von den vorstehend aufgeführten Fonds berücksichtigen die den Fonds der Gesellschaft zugrunde liegenden Anlagen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten.

VERWALTUNGSRATSMITGLIEDER UND SONSTIGE ANGABEN

EINGETRAGENER SITZ

One Dockland Central, Guild Street
IFSC, Dublin 1, D01E4XO
Irland

DIE MITGLIEDER DES VERWALTUNGSRATS

Die Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft sind:

David Dillon (Ire)*^
Gerald Rehn (US-Amerikaner)
Greg Brisk (Brite)
Claire Cawley (Irin)^

Alle vorstehend aufgeführten Verwaltungsratsmitglieder sind nicht-geschäftsführende Verwaltungsratsmitglieder.

* Vorsitzender des Verwaltungsrats

^ Unabhängiges Verwaltungsratsmitglied

VERWALTUNGSGESELLSCHAFT

BNY Mellon Fund Management (Luxembourg) S.A.
2-4 Rue Eugène Ruppert
L-2453
Luxemburg

ANLAGEVERWALTER, UNTERANLAGEVERWALTER UND DELEGIERTE ANLAGEVERWALTER

Mellon Investments Corporation*
BNY Mellon Center
One Boston Place
201 Washington Street
Boston, MA 02108-4408
Vereinigte Staaten von Amerika

Newton Investment Management Limited
BNY Mellon Centre
160 Queen Victoria Street
London EC4V 4LA
Vereinigtes Königreich

Walter Scott & Partners Limited
One Charlotte Square
Edinburgh EH2 4DR
Schottland
Vereinigtes Königreich

ARX Investimentos Ltda
Avenida Borges de Medeiros, 633,
4th floor, Leblon
Rio de Janeiro, R.J. 22430-041
Brasilien

BNY Mellon Asset Management Japan Limited
Maranouchi Trust Tower Main
1-8-3 Maranouchi
Chiyoda – ku
Toyko 100-0005
Japan

Insight Investment Management (Global) Limited*
BNY Mellon Centre
160 Queen Victoria Street
London EC4V 4LA
Vereinigtes Königreich

Alcentra NY, LLC
200 Park Avenue
New York
10166 NY
Vereinigte Staaten von Amerika

Insight North America LLC*
200 Park Avenue
New York
10166 NY
Vereinigte Staaten von Amerika

Maybank Asset Management Singapore Pte. LTD.
9 Temasek Boulevard
13-01 Suntec Tower Two
Singapore 038989
Singapur

Alcentra Limited
160 Quesen Victoria Street
London EC4V 4LA
Vereinigtes Königreich

Newton Investment Management North America LLC*
One Boston Place
201 Washington Street
Boston MA 02108

ADMINISTRATOR, REGISTERFÜHRER UND ÜBERTRAGUNGSAGENT

BNY Mellon Fund Services (Ireland) Designated Activity Company
One Dockland Central, Guild Street
IFSC, Dublin 1, D01E4XO
Irland

GESELLSCHAFTSSEKRETÄR

Tudor Trust Limited
33 Sir John Rogerson's Quay
Dublin 2, D02 XK09
Irland

RECHTSBERATER DER GESELLSCHAFT

Dillon Eustace
33 Sir John Rogerson's Quay
Dublin 2, D02 XK09
Irland

UNABHÄNGIGE ABSCHLUSSPRÜFER

Ernst & Young
Chartered Accountants & Registered Auditors
Harcourt Centre
Harcourt Street
Dublin 2, D02 YA40
Irland

VERWAHRSTELLE

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

VERTRIEBSGESELLSCHAFT (OHNE DEN EWR)

BNY Mellon Investment Management EMEA Limited
BNY Mellon Centre
160 Queen Victoria Street
London EC4V 4LA
Vereinigtes Königreich

VERTRIEBSGESELLSCHAFT (INNERHALB DES EWR)

BNY Mellon Fund Management (Luxembourg) S.A.
2-4 Rue Eugène Ruppert
L-2453
Luxemburg

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

WICHTIGE HINWEISE (UNGEPRÜFT)

BNY MELLON S&P 500® INDEX TRACKER*

S&P 500® ist eine Marke von The McGraw-Hill Companies, Inc. und wurde für die Verwendung durch BNY Mellon Global Funds, plc lizenziert. Der BNY Mellon S&P 500® Index Tracker wird nicht von Standard & Poor's gesponsert, unterstützt, verkauft oder beworben, und Standard & Poor's übernimmt keine Gewährleistungen hinsichtlich der Ratsamkeit von Anlagen in den BNY Mellon S&P 500® Index Tracker.

* Siehe Erläuterung 19 zum Abschluss.

Bitte beachten Sie Folgendes: Wenn ein Fonds der Gesellschaft in die Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen investiert, die direkt oder per Delegation von der Verwaltungsgesellschaft der Gesellschaft, BNY Mellon Fund Management (Luxembourg) S.A. („BNY MFM Lux“), oder von einer anderen Gesellschaft, mit der BNY MFM Lux durch eine gemeinsame Verwaltung oder Kontrolle oder durch eine direkte oder indirekte Beteiligung von mehr als 10 % des Anteilskapitals oder der Stimmen verbunden ist, berechnet BNY MFM Lux oder die andere Gesellschaft keine Management-, Zeichnungs-, Umtausch- oder Rücknahmegebühren in Bezug auf die Anlage des Fonds in die Anteile dieses anderen Organismus für gemeinsame Anlagen.

