



Ungeprüfter Zwischenbericht & Abschluss

BNY MELLON GLOBAL FUNDS, PLC

FÜR DEN BERICHTSZEITRAUM ZUM 30. JUNI 2020



BNY MELLON
INVESTMENT MANAGEMENT

INHALT

HINTERGRUND DER GESELLSCHAFT	4
BERICHT DES INVESTMENT-MANAGERS	6
GLOSSAR DER FINANZBEGRIFFE	46
ZWISCHENLAGEBERICHT	50
AUFSTELLUNG DER WERTPAPIERBESTÄNDE	52
GESAMTERGEBNISRECHNUNG	284
BILANZ	300
AUFSTELLUNG DER ÄNDERUNGEN DES NETTOVERMÖGENS, DAS INHABERN VON EINLÖSBAREN PARTIZIPIERENDEN ANTEILEN ZUZUSCHREIBEN IST	316
ERLÄUTERUNGEN ZUM HALBJAHRESABSCHLUSS	324
WICHTIGE BEWEGUNGEN IN DEN PORTEFEUILLES	441
ANHANG 1: OFFENLEGUNGEN GEMÄSS DER VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN („SFTR“)	471
ANHANG 2: FINANZINDIZES	487
MANAGER UND SONSTIGE INFORMATIONEN	488
WICHTIGE HINWEISE	489

HINWEIS: Bitte beachten sie, dass für die weiteren Teilfonds BNY Mellon Asia Rising Stars Fund, BNY Mellon Japan REIT Alpha Fund, BNY Mellon Multi-Asset High Income Fund und BNY Mellon U.S. Credit Select Income Fund keine Anzeige gemäß § 310 KAGB erstattet worden ist und Anteile dieser Teilfonds an Anleger im Geltungsbereich des Kapitalanlagegesetzbuches nicht vertrieben werden dürfen.

BNY MELLON 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

Der BNY Mellon Global Funds, plc (die „Gesellschaft“) wurde am 27. November 2000 in der Republik Irland mit der Registrierungsnummer 335837 gemäß dem Companies Act 2014 („Aktiengesetz“) als 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 Grundkapital, die nach irischem Recht mit getrennter Haftung zwischen 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 in Irland und wurde in Irland von der irischen Zentralbank „Central Bank of Ireland“ (die „Zentralbank“) gemäß den EG-Richtlinien (über die Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren) von 2011 (in der jeweils gültigen Fassung) zugelassen (die „OGAW-Richtlinien“). Die Gesellschaft umfasst aktuell zum 30. Juni 2020 46 aktive Fonds (31. Dezember 2019: 44).

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

Fonds	Anlagemanagementgesellschaft	Auflegungsdatum
BNY Mellon Absolute Insight Fund ¹	Insight Investment Management (Global) Limited	30. Juni 2014
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	BNY Mellon Asset Management Japan Limited	10. Januar 2017
BNY Mellon Asian Bond Fund ²	Mellon Investments Corporation	25. Juli 2014
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 Brazil Equity Fund	ARX Investimentos Ltda	31. August 2007
BNY Mellon Digital Assets Fund	Mellon Investments Corporation	19. Februar 2019
BNY Mellon Dynamic Total Return Fund	Mellon Investments Corporation	15. Mai 2015
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	Mellon Investments Corporation	3. November 2017
BNY Mellon Efficient EM Debt Local Currency Beta Fund [^]	Mellon Investments Corporation	–
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund	Mellon Investments Corporation	10. März 2020
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	Mellon Investments Corporation	26. September 2017
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund	Insight Investment Management (Global) Limited	31. Januar 2012
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	Mellon Investments Corporation	10. Mai 2005
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund	Mellon Investments Corporation	28. April 2006
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund	Mellon Investments Corporation	27. September 2013
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund	Insight Investment Management (Global) Limited	11. Dezember 2017
BNY Mellon Eurobond Bond Fund	Mellon Investments Corporation	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 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 Equity Value Fund ³	Mellon Investments Corporation	17. Juli 2002
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	Mellon Investments Corporation	13. August 2018
BNY Mellon Global Leaders Fund	Walter Scott & Partners Limited	7. Dezember 2016
BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund	Newton Investment Management Limited	10. Juli 2018
BNY Mellon Global Opportunistic Bond Fund ⁴	Mellon Investments Corporation	29. Oktober 2010
BNY Mellon Global Opportunities Fund	Newton Investment Management Limited	10. Dezember 2001
BNY Mellon Global Property Securities Fund ⁵	CenterSquare Investment Management, Inc	23. April 2008
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	Newton Investment Management Limited	8. März 2010

Fonds	Anlagemanagementgesellschaft	Auflegungsdatum
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 All Cap Equity Fund ⁶	BNY Mellon Asset Management Japan Limited	10. Dezember 2013
BNY Mellon Japan REIT Alpha Fund ⁶	BNY Mellon Asset Management Japan Limited	13. Dezember 2016
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	Mellon Investments Corporation	1. August 2018
BNY Mellon Multi-Asset High Income Fund ⁷	Mellon Investments Corporation	10. Januar 2018
BNY Mellon Pan European Equity Fund ⁸	Newton Investment Management Limited	10. Dezember 2001
BNY Mellon S&P 500 [®] Index Tracker	Mellon Investments Corporation	23. März 2001
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	Mellon Investments Corporation	28. April 2003
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	Mellon Investments Corporation	16. November 2015
BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund	Mellon Investments Corporation	18. September 2002
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	Mellon Investments Corporation	17. Januar 2017
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund	Mellon Investments Corporation	19. April 2017
BNY Mellon U.S. Opportunistic Alpha Fund ⁹	Newton Investment Management Limited	7. Dezember 2018
BNY Mellon U.S. Credit Select Income Fund [^]	Insight Investment Management (Global) Limited	–
BNY Mellon US Opportunities Fund ¹⁰	Mellon Investments Corporation	16. Juni 2014

¹ Dieser Fonds wurde am 1. Dezember 2017 geschlossen und der Antrag auf Aufhebung der Zulassung des Fonds und somit Entfernung aus dem Verkaufsprospekt ist bei der Zentralbank anhängig.

² Dieser Fonds wurde am 31. Mai 2017 geschlossen und der Antrag auf Aufhebung der Zulassung des Fonds und somit Entfernung aus dem Verkaufsprospekt ist bei der Zentralbank anhängig.

³ Dieser Fonds wurde am 26. Februar 2016 geschlossen und der Antrag auf Aufhebung der Zulassung des Fonds und somit Entfernung aus dem Verkaufsprospekt ist bei der Zentralbank anhängig.

⁴ Dieser Fonds wurde am 7. März 2019 geschlossen und der Antrag auf Aufhebung der Zulassung des Fonds und somit Entfernung aus dem Verkaufsprospekt ist bei der Zentralbank anhängig.

⁵ Dieser Fonds wurde am 30. August 2017 geschlossen und der Antrag auf Aufhebung der Zulassung des Fonds und somit Entfernung aus dem Verkaufsprospekt ist bei der Zentralbank anhängig.

⁶ Dieser Fonds wurde am 15. Februar 2019 geschlossen und der Antrag auf Aufhebung der Zulassung der Fonds und somit Entfernung aus dem Verkaufsprospekt ist bei der Zentralbank anhängig.

⁷ Dieser Fonds wurde am 28. August 2018 geschlossen und der Antrag auf Aufhebung der Zulassung des Fonds und somit Entfernung aus dem Verkaufsprospekt ist bei der Zentralbank anhängig.

⁸ Dieser Fonds wurde am 9. März 2017 geschlossen und der Antrag auf Aufhebung der Zulassung des Fonds und somit Entfernung aus dem Verkaufsprospekt ist bei der Zentralbank anhängig.

⁹ Dieser Fonds wurde am 27. September 2019 geschlossen und der Antrag auf Aufhebung der Zulassung des Fonds und somit Entfernung aus dem Verkaufsprospekt ist bei der Zentralbank anhängig.

¹⁰ Dieser Fonds wurde am 29. August 2019 geschlossen und der Antrag auf Aufhebung der Zulassung des Fonds und somit Entfernung aus dem Verkaufsprospekt ist bei der Zentralbank anhängig.

[^] Der Fonds wurde von der Zentralbank genehmigt, aber noch nicht aufgelegt.

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

Die Fonds der Gesellschaft sind an der Euronext Dublin notiert.

ANLAGEZIEL

Das Vermögen jedes Fonds wird separat gemäß den im Anhang zum jeweiligen Prospekt genannten Anlagezielen und der Investmentpolitik des entsprechenden Fonds angelegt.

SONSTIGE WICHTIGE ANGABEN

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

BERICHT DES INVESTMENT-MANAGERS

KONJUNKTUR- UND MARKTÜBERBLICK

Die erste Jahreshälfte stand fast vollständig im Zeichen des Ausbruchs des Coronavirus und seinen Auswirkungen auf Wirtschaft und Gesellschaft. Bis Anfang Februar hatten die Aktienmärkte die im Spätsommer 2019 begonnene kräftige Rally fortgesetzt. Eine lockere *Geldpolitik* und Anzeichen für eine Annäherung zwischen China und den USA im Handelsstreit hatten die *Aktien*-als auch die Anleihenmärkte mit unterstützt. Ab Februar setzte der weltweite Ausbruch von COVID-19 dem ein jähes Ende, und die Märkte fielen im Februar sowie über weite Teile im März.

Die Aktienmärkte wurden massiv erschüttert und fielen rapide, da viele Länder das gesellschaftliche Leben außer Haus schrittweise einfroren und die Wirtschaftstätigkeit auf das absolut wesentliche Minimum beschränkt wurde. Die meisten Industrieländer, wie z. B. die USA, Großbritannien und Japan, griffen tief in die Tasche und schnürten umfangreiche Hilfspakete, um die wirtschaftlichen Folgen von COVID-19 abzufedern, während die großen Zentralbanken unisono die Zinsen senkten.

An den Wirtschaftsdaten ließ sich nach und nach der immense Schaden der Pandemie für die Volkswirtschaften rund um den Globus ablesen. Zahlreiche Länder rutschten in die Rezession, sodass zunehmend mit einer weltwirtschaftlichen Depression gerechnet wurde, die mindestens der Großen Depression Ende der 1920er und Anfang der 1930er Jahre entsprechen würde. Die Zahlen zum *Bruttoinlandsprodukt (BIP)*, zur Beschäftigung, für das verarbeitende Gewerbe und die Verbraucherstatistiken wiesen allesamt auf den größten Abschwung hin, der je in Friedenszeiten verzeichnet wurde. In Japan, Deutschland, Frankreich und den USA wurde die Rezession bestätigt. In den USA wandelten sich die besten Arbeitsmarktzahlen seit 50 Jahren schnell zu den schlechtesten seit über 80 Jahren. China verzeichnete das geringste BIP seit Beginn der Aufzeichnungen und den ersten Rückgang seit 30 Jahren.

Ende März erreichten die Aktienmärkte jedoch die Talsohle und verbuchten dann bis zum Ende des Berichtszeitraums eine Rally. Das war der langsamen Lockerung der wirtschaftlichen und sozialen Beschränkungen in einigen Ländern zuzuschreiben. Teilweise begannen sich die Wirtschaftsdaten weltweit zu erholen, die Hoffnung auf eine so genannte „V-förmige“ Schwand allerdings. Der Anleihenmarkt profitierte nachhaltig von extrem lockeren geldpolitischen Bedingungen und der Flucht in „sicherere“ Anlagen, als sich die Wirtschaftsdaten eintrübten. Die *Renditen* fielen auf breiter Front rasant und markierten auf den meisten Märkten Tiefststände, insbesondere in den USA, Großbritannien und Deutschland. Dort verharrten sie in negativem Terrain.

NORDAMERIKA

Der US-Markt rutschte genau wie viele Märkte stark ab, erholte sich aber schnell und schloss nur knapp unter dem Januar-Höchststand. Die Indizes S&P 500, Dow Jones und Nasdaq setzten Anfang 2020 ihren Aufwärtstrend fort und erreichten neue Allzeithochs. Der Markt wurde durch positives Gewinnwachstum, die Wiederherstellung einer lockeren Geldpolitik und die Verbesserung der Beziehungen zwischen den USA und China beflügelt, die sich an dem „Teilabkommen“ ablesen lässt.

Der US-Markt verzeichnete in der zweiten Februarhälfte und über weite Teile des März einen dramatischen Ausverkauf, als sich das Coronavirus weltweit ausbreitete. Der S&P-500-Index verbuchte gemessen am Tempo der Verluste die stärkste Talfahrt in seiner Geschichte. Wie andere Länder verhängten auch die USA einen allgemeinen Lockdown, bei dem alle nicht wesentlichen gesellschaftlichen und geschäftlichen Aktivitäten ausgesetzt wurden. Ende März erreichte der Markt die Talsohle, bevor er sich in den letzten Monaten des Berichtszeitraums kräftig erholte, als der Markt sein Augenmerk über die Krise hinaus auf die Erholung richtete und die Lockdown-Beschränkungen gelockert wurden.

Die US-Notenbank Federal Reserve (Fed) senkte angesichts der Ausbreitung der COVID-19-Krise im März die Zinsen auf eine Bandbreite von 0 % - 0,25 % und beschleunigte gleichzeitig die *quantitative Lockerung*. Daneben schnürte die Trump-Administration ein massives, mehrere Billionen Dollar schweres Konjunkturpaket.

Der enorme Anstieg der Arbeitslosenzahlen verdeutlichte den wirtschaftlichen Schaden aufgrund der globalen Pandemie. Die Zahl der Anträge auf Arbeitslosenhilfe waren im Juni auf über 45 Mio. gestiegen. Das ist mehr als ein Viertel aller Erwerbstätigen in den USA. Nur wenige Monate zuvor war die Arbeitslosenquote auf ein 50-Jahres-Tief gesunken. Danach stieg sie von 3,5 % im Februar auf 14,7 % im April und ging im Mai wieder auf 13,3 % zurück. Das BIP schrumpfte im ersten Quartal annualisiert um 5,0 % auf den schwächsten Stand seit 2008 und der globalen Finanzkrise. Für das zweite Quartal wurden ein noch kräftigerer Rückgang und eine Rezession erwartet. Im Juni bereitete der erneute Anstieg der Infektionszahlen in einigen Regionen der USA Marktteilnehmern Sorgen.

EUROPA

Die europäischen Märkte gaben im Berichtszeitraum nach, wobei das Gros der Verluste im Februar und März durch die Ausbreitung der globalen Pandemie verzeichnet wurde. Die Entwicklung an den europäischen Aktienmärkten im Januar ließ die bevorstehenden Ereignisse nicht erahnen, da sie gelassen aufwärts tendierten, und vor allem durch die erneut lockere *Geldpolitik* der Europäischen Zentralbank (EZB) getragen wurden.

KONJUNKTUR- UND MARKTÜBERBLICK Forts.

Die europäischen Märkte gaben im Gleichschritt nach, als die Corona-Fallzahlen in Europa stiegen. Italien war anfangs das Epizentrum der Krise, die sich aber bald auf alle Länder ausbreitete. Die meisten Länder verhängten einen Lockdown. Als die Auswirkungen des Lockdowns auf die Wirtschaft und das gesellschaftliche Leben zutage traten und eine schwere Rezession prognostiziert wurde, löste dies panikartige Verkäufe bei den Anlegern aus.

Die britische Regierung und die Eurozone unterstützten ihre Volkswirtschaften mit umfangreichen Hilfspaketen. Die EZB erhöhte das Budget für ihr monatliches Anleihekaufprogramm. Mit der Umsetzung eines Pakets, das den Ankauf italienischer Anleihen im großen Stil vorsah, löste die EZB eine Kontroverse in der Eurozone aus. Deutsche Gerichte gingen dagegen vor und auch andere nordeuropäische Länder wehrten sich dagegen.

Der Ausbruch der Coronakrise führte zum Kollaps einiger ohnehin angeschlagener europäischer Volkswirtschaften. Deutschland, Frankreich und Italien gehörten zu den drei großen europäischen Volkswirtschaften, die in eine Rezession rutschten. Das BIP in der Eurozone sank im ersten Quartal 2020 annualisiert um 3,6% - das ist der stärkste Rückgang, der jemals verzeichnet wurde.

In Großbritannien stagnierte das BIP im vierten Quartal 2019, fiel dann aber im ersten Quartal 2020 um 2,2% gegenüber dem Vorquartal. Das war der schlechteste Wert seit 1979 und eine Rezession schien so gut wie garantiert, da das zweite Quartal über weite Teile mit dem Lockdown zusammenfiel. Die Erwerbsquote war in Großbritannien in den ersten Monaten des Jahres 2019 auf ein Allzeithoch angestiegen. Die Arbeitslosenquote verharrte auch bei Ausbruch der Pandemie auf niedrigem Niveau (im April lag sie bei 3,9%), da viele Beschäftigte im Rahmen des Job-Rettungsschirms der britischen Regierung „beurlaubt“ wurden.

Die Ungewissheit über den Austritt Großbritanniens aus der EU endete im Januar zwar mit dem ordentlichen Austritt der Briten, die Verhandlungen zwischen den beiden Seiten über eine neue Handelsbeziehung wurden jedoch fortgesetzt. Die unmittelbaren Sorgen aufgrund der Pandemie forderten jedoch die ganze Aufmerksamkeit.

ASIEN

An den asiatischen Märkten zeichnete sich ein ähnliches Muster wie an den anderen Weltmärkten ab: auf die ersten fünf bis sechs starken Wochen Anfang 2020 folgte mit der Ausbreitung von COVID-19 ein kräftiger Einbruch. China schnitt auf dem asiatischen Markt am besten ab.

Im Januar wurden Märkte durch die Unterzeichnung des Phase 1-Abkommens zwischen China und den USA beflügelt. Anschließend brachensie im Februar aufgrund von COVID-19 ein, bevor sie sich ab Ende März wieder erholten.

Aufgrund der früheren Erfahrungen der asiatischen Länder mit SARS (Schweres Akutes Respiratorisches Syndrom) zwischen 2002-2004 und den dementsprechend schnellen Lockdown-Maßnahmen angesichts von COVID-19 kamen die meisten großen asiatischen Länder im Vergleich zu den westlichen Ländern relativ ungeschoren davon.

Das chinesische Wirtschaftswachstum verlangsamte sich weiter. Das BIP-Wachstum von 6,1% im Jahr 2019 war das schwächste seit fast 30 Jahren. Im ersten Quartal 2020 ging das BIP infolge der coronabedingten wirtschaftlichen Schäden und des damit zusammenhängenden Herunterfahrens der Wirtschaftstätigkeit um 6,8% zurück. Die chinesische Zentralbank People's Bank of China griff ein und senkte die kurz- und mittelfristigen Zinsen sowie die Mindestreservequote für Geschäftsbanken. Die Rezession in Hongkong verschärfte sich, als die Auswirkungen der pro-demokratischen Proteste und von COVID-19 ihren Tribut forderten. China drohte mit der Umsetzung strenger nationaler Sicherheitsgesetze und erhöhte damit den Druck auf Hongkong. Diese Maßnahmen wurden vom Ausland verurteilt, nicht zuletzt durch die USA, die damit drohten, Hongkong seinen Sonderstatus als Handelsplatz abzuerkennen.

Die meisten führenden asiatischen Zentralbanken, unter anderem in Indien und Thailand, bemühten sich aktiv, ihre jeweiligen Volkswirtschaften durch Zinssenkungen zu unterstützen.

In Japan blieben die Wirtschaftsdaten während des gesamten Berichtszeitraums unverändert schwach. Die Zahlen aus der vierteljährlichen Tankan-Umfrage (Umfrage zum Geschäftsausblick unter japanischen Führungskräften) trübten sich weiter ein und fielen im ersten Quartal auf den niedrigsten Stand seit sieben Jahren. Das BIP sank im letzten Quartal 2019 (veröffentlicht 2020) annualisiert um 7,2%, was weitgehend auf die Auswirkungen einer Umsatzsteuererhöhung im Oktober 2019 zurückzuführen war. Als das BIP im ersten Quartal 2020 annualisiert erneut um 2,2% nachgab, bestätigte sich die Rezession. Die *Inflation* blieb jedoch gedämpft und weit unter dem mittel- bis langfristigen offiziellen Ziel der Bank of Japan (BoJ) von 2,0%. Im April und Mai stieg sie lediglich um 0,1%.

RENTENMARKT

Die Anleihenmärkte profitierten von den massiven *geldpolitischen Stimulierungsmaßnahmen* der globalen Zentralbanken und von einer coronabedingten „Flucht in sichere Häfen“, da Anleger riskante Vermögenswerte zugunsten relativ sicherer Festzinsanlagen veräußerten. Insgesamt war es ein starker Zeitraum für die Anleihenmärkte, wobei fast alle Sektoren positive Renditen verzeichneten. Das galt vor allem für die Staats- und Unternehmensanleihenmärkte, während

KONJUNKTUR- UND MARKTÜBERBLICK Forts.

Schwellenländer- und *Hochzinsanleihen* deutlich hinterherhinkten. Die wachsenden Anzeichen für die Fragilität des globalen Wirtschaftswachstums und die gedämpften Inflationsraten in den Industrieländern bescherten ein günstiges Umfeld für die Rentenmärkte. Die Anleiherenditen fielen dramatisch und erreichten in vielen Ländern wie den USA und Großbritannien Allzeittiefs. Die *Rendite* 10-jähriger US-*Treasuries* fiel im März auf dem Höhepunkt der Krise unter 0,5%. Im letzten Quartal des Berichtszeitraums stiegen die *Renditen* leicht, da eine größere Risikobereitschaft einige Anleger veranlasste, aus besonders sicheren Anleihenpositionen umzuschichten.

Die Zinsen wurden im Berichtszeitraum weltweit stark gesenkt. Bei Eintritt der Coronakrise senkten die Zentralbanken rasch ihre Zinsen, um ihre Volkswirtschaften zu unterstützen. Im März senkte die US-Notenbank innerhalb weniger Tage zweimal den Leitzins um insgesamt 1,5% auf eine Bandbreite von 0% - 0,25%. Die Bank of England senkte die Zinsen ebenfalls in zwei rasch aufeinanderfolgenden Zinsschritten auf 0,1%.

Andere wichtige Märkte für Staatsanleihen verzeichneten ebenfalls eine gute Wertentwicklung. Die *Rendite* zehnjähriger britischer *Gilts* fiel aufgrund der Pandemie von etwa 0,8% Anfang Januar auf unter 0,2% im März. Die *Renditen* Schweizer Staatsanleihen und deutscher Bundesanleihen verharrten tief in negativem Terrain. Die *Rendite* 10-jähriger deutscher Bundesanleihen fiel von etwa -0,25% zum Jahreswechsel auf unter -0,8% im März, den niedrigsten jemals verzeichneten Stand, bevor sie sich bis zum Ende des Berichtszeitraums etwas erholte.

Die *Renditen* japanischer Staatsanleihen verharrten auf niedrigem Niveau, da die BoJ an ihrer Ultraniedrigzinspolitik festhielt, die Wirtschaft aber damit dennoch nicht in Schwung brachte.

Unternehmens- und *Hochzinsanleihen* folgten Staatsanleihen und entwickelten sich ebenfalls erfreulich, obwohl das niedrige Zinsniveau und die niedrigen Renditen ein hohes Emissionsniveau begünstigten.

WÄHRUNGEN UND ROHSTOFFE

Der US-Dollar legte im Berichtszeitraum leicht zu, tendierte aber stark volatil, als sich das Coronavirus weltweit ausbreitete. Zunächst fiel er im Gleichschritt mit den Aktienmärkten, danach erholte er sich bei steigenden Märkten, bevor er Ende Mai und im Juni erneut nachgab. Sein Status als „relativ sicherer Hafen“ verhalf dem Dollar nach oben.

Das Pfund Sterling war *volatil*, wertete aber unter dem Strich ab, da die Sorgen um die britische Wirtschaft überwogen.

Der Euro wertete gegenüber anderen Währungen weiter auf und setzte damit den seit Anfang 2019 beobachteten Trend fort. Der Euro-Index ging im Berichtszeitraum steil nach oben und markierte neue Sechsjahreshochs. Die Händler blickten über die gegenwärtige Wirtschaftskrise hinaus und begannen, die wirtschaftliche Erholung einzupreisen.

Der Yen wertete insgesamt gegenüber anderen Währungen auf und war im Berichtszeitraum gegenüber der US-Währung stärker, wobei er von einer gewissen „Flucht in die Sicherheit“ profitierte.

Rohstoffe gaben im Berichtszeitraum insgesamt deutlich nach, als sich COVID-19 weltweit ausbreitete. Die Ölpreise brachen im Februar und März dramatisch ein, bevor sie im April noch weiter sanken. Der Preis für West Texas Intermediate fiel in negatives Terrain, da die Händler steigende Lagerkosten einpreisten, als die Nachfrage vollständig erlosch und das Angebot nach wie vor hoch war. Produktionskürzungen der OPEC- und Nicht-OPEC-Länder in Höhe von rund 10 Mio. Barrel täglich stabilisierten den Markt und ebneten den Weg für eine Erholung des Ölpreises bis zum Ende des Berichtszeitraums. Die meisten wichtigen Industriemetalle wie Eisenerz und Zink erlebten ähnlich dramatische Rückgänge infolge von COVID-19. Kupfer schnitt besser ab als die meisten anderen Industriemetalle.

Gold bildete aufgrund seines Status als „*sicherer Hafen*“ die wichtigste Ausnahme und setzte damit einen seit fast zwei Jahren anhaltenden Trend fort. Die wirtschaftliche Unsicherheit ermutigte Anleger, in Gold zu investieren. Ende des Berichtszeitraums hatte sich der Goldpreis einem Achtjahreshoch genähert.

Alle Daten zur Wertentwicklung beziehen sich, soweit nicht anders angegeben, auf die Gesamtrenditen in Lokalwährungen vom 1. Januar 2020 bis 30. Juni 2020. Quelle: Lipper Hindsight und Bloomberg.

ABSOLUTE RENDITE, GESAMTRENDITE & MULTI-ASSET

BNY MELLON ABSOLUTE RETURN BOND FUND

Im sechsmonatigen Berichtszeitraum erzielte die Anteilsklasse Euro S des Fonds eine Rendite von -1,74%, verglichen mit einer Rendite von -0,18% für den 3-Monats-EURIBOR (die Cash-Benchmark, die als Ziel zur Bewertung der Wertentwicklung des Fonds auf einer gleitenden 12-Monatsbasis nach Gebühren verwendet wird) und 1,32% für die Cash-Benchmark +3% p.a. (die 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 und blieb unter der Cash-Benchmark.

Trotz enormer *fiskalpolitischer* Impulse fielen die Renditen von Staatsanleihen im Berichtszeitraum, da die US-Notenbank (Fed) den Leitzins auf eine Bandbreite von 0 bis 0,25% senkte und unbegrenzte Anleihenkäufe ankündigte. Die Europäische Zentralbank (EZB) ließ ihren Hauptrefinanzierungssatz bei 0%, lancierte aber gleichzeitig ein 1,35 Billionen Euro schweres Pandemie-Notfallankaufprogramm (PEPP). Die US-Wirtschaft litt angesichts der bevorstehenden Präsidentschaftswahl besonders stark unter COVID-19. In Europa stellt der Brexit nach wie vor das Hauptrisiko dar. *Investment-Grade*- und *Hochzins*-Unternehmensanleihen erlebten nach einem fulminanten Jahresauftakt im März einen Ausverkauf, um sich anschließend wieder zu erholen. Anlagen in „*sichere Häfen*“ verzeichneten Mittelzuflüsse, die den US-Dollar stützten. Später wurden sie massiv verkauft, als die Risikobereitschaft der Anleger zurückkehrte (was Schwellenländerwährungen zugutekam).

Der Fonds erzielte im Berichtszeitraum eine negative Rendite, da der Negativbeitrag seiner Zinsstrategien den Positiveffekt seiner Unternehmensanleihe-Strategien überwog.

Im Zinssegment erwies sich unsere *Long*-Position auf 30-jährige inflationsindexierte Anleihen als größter Verlustbringer, da die US-Inflationserwartungen im März drastisch sanken. Auch die Länderallokationspositionen des Fonds schmälerten den Ertrag, da die *Long*-Positionen auf deutsche Bundesanleihen und britische Gilts im März heftige Verluste verursachten. Die Positionen entlang der *Renditekurve* erbrachten eine leicht negative Rendite. Allerdings wirkten sich sowohl die *Duration* als auch die kleinen Währungspositionen geringfügig positiv aus.

Im Unternehmensanleihensegment schnitten *Investment-Grade*- und *Hochzinsanleihen* besonders gut ab, da die *Spreads* nach ihrer Weitung im März einliefen. Die Positionen auf *Asset Backed Securities*, Schwellenländeranleihen und Darlehen verzeichneten jedoch geringe Verluste.

Der Manager passte die Positionierung des Fonds über seine verschiedenen Strategien an. Im Zinssegment wurden die Länderallokationspositionen angepasst und zwei neue *Long*-Positionen auf 30-jährige US-TIPS (*Treasury Inflation-Protected Securities*) eröffnet. Die *Long*-Position auf die US-Inflation wurde am Ende des Quartals nach einer guten Wertentwicklung glattgestellt. Außerdem wurde die *Long*-Position auf die *Duration* aufgestockt, und die Positionen auf eine Abflachung der italienischen und US-Renditekurve wurden glattgestellt. Im Unternehmensanleihensegment wurde das Engagement bei *Unternehmensanleihen* im Februar auf neutral reduziert. Danach wurde das Risiko mit Schwerpunkt auf US-*Investment-Grade-Anleihen* mit langen Laufzeiten erhöht. Das Engagement bei Unternehmensanleihen wurde danach allerdings reduziert, wobei die *Long*-Position auf *Investment-Grade-Anleihen* verringert und eine *Short*-Position auf Hochzinsanleihen eröffnet wurde. Der Manager stockte die *Long-Durations*position auf die lokalen Schwellenländerzinsmärkte auf und ließ die *defensive* Währungsposition unverändert.

Die Fed erklärte, dass die Zinsen mindestens bis Ende 2022 auf Eis gelegt werden. Derzeit geht die Fed davon aus, dass die Zinsen nicht angehoben werden, bis sie ihre Beschäftigungs- und Inflationsziele erreicht hat, was vor Ende 2022 unwahrscheinlich erscheint. Die kurzfristigen Risiken sind unverändert hoch, der Manager hält aber gleichzeitig Negativzinsen für unwahrscheinlich. Die Fed erwägt jedoch eine Kontrolle der Renditekurven, wobei sie sich wahrscheinlich auf Laufzeiten von bis zu fünf Jahren konzentrieren wird. Der Manager erwartet, dass die Zinsen über längere Zeit stabil bleiben und sich dann ab Ende 2024 allmählich normalisieren werden.

Angesichts des verlangsamten Wachstums kündigte die EZB auf ihrer Juni-Sitzung an, dass sie den Umfang des PEPP um 600 Milliarden Euro auf 1,35 Billionen Euro erhöht und die Käufe im Rahmen des Programms mindestens bis Juni 2021 fortgesetzt werden. *Fällige Anleihen* werden mindestens bis Ende 2022 reinvestiert. Das PEPP hat sich zum wichtigsten politischen Instrument der EZB als Reaktion auf die Krise entwickelt. Die Dauer des Programms, die Anlageklassen und Länder werden weiterhin überwacht, aber der Manager erwartet bis zum Jahresende keine nennenswerten Änderungen.

Insight Investment Management (Global) Limited
Juli 2020

BNY MELLON ABSOLUTE RETURN EQUITY FUND

Im sechsmonatigen Berichtszeitraum erzielte die Anteilsklasse Sterling R (Acc.) des Fonds eine Rendite von -0,19% verglichen mit einer Rendite von 0,18% für den 1-Monats-LIBOR GBP (die Cash-Benchmark, die als Ziel zur Bewertung der Wertentwicklung des Fonds auf einer

ABSOLUTE RENDITE, GESAMTRENDITE & MULTI-ASSET Forts.

BNY MELLON ABSOLUTE RETURN EQUITY FUND Forts. gleitenden 12-Monatsbasis nach Gebühren verwendet wird) und 3,18% für die Cash-Benchmark +6% p.a. (die als Ziel zur Bewertung der Wertentwicklung des Fonds auf einer gleitenden annualisierten 5-Jahresbasis nach Gebühren verwendet wird), jeweils in Pfund Sterling.

Das erste Halbjahr 2020 stand im Zeichen außerordentlicher Turbulenzen. Dabei wurde auf die gravierenden wirtschaftlichen Folgen der Coronakrise mit beispiellosen politischen Maßnahmen reagiert.

Der Ausbruch und die weltweite Ausbreitung des Coronavirus schürten ab Ende Februar und insbesondere ab März große Angst an den Aktienmärkten. Die zuvor durch die Zentralbankmaßnahmen und die übermäßige Gelassenheit der Anleger sowie den automatisierten Handel verursachten Verzerrungen, rückten plötzlich in den Mittelpunkt.

Die veröffentlichten Wirtschaftsdaten belegten einen historisch einzigartigen Einbruch der Wirtschaftstätigkeit. Im Laufe der Zeit hellte sich die Marktstimmung angesichts der Ankündigungen von Maßnahmen, der Abflachung der Infektionskurven und zaghafter Schritte zur Wiedereröffnung der Volkswirtschaften auf. Die Aktienmärkte erholten sich von ihren Tiefstständen im März, und es kam zu einer starken Rotation innerhalb des Aktienmarkts, als *Zykliker* sich an die Spitze setzten. Der anschließende Wiederanstieg der Infektionszahlen in den USA und die Sorge um einen Stellenabbau aufgrund des Auslaufens der weltweiten Beschäftigungsförderungsprogramme dämpften jedoch den Optimismus, dass es zu einer „V-förmigen“ Erholung auf frühere Wachstums- und Gewinnniveaus kommen würde.

Der Fonds überstand den Zeitraum relativ gut, indem er sein Exposure dynamisch steuerte, um den potenziellen *Rückgang* im Februar und März einzudämmen, und anschließend neue Anlagechancen nutzte. Während des Ausverkaufs im ersten Quartal stellte der Manager fest, dass technische Faktoren offenbar zu Verzerrungen zwischen verschiedenen Anlageklassen derselben Unternehmen geführt haben: Der Fonds nutzte einige dieser Chancen, die sich im Allgemeinen auszahlten. Einige andere Positionen profitierten von relativen Aktienkursschwankungen als Reaktion auf unterschiedliche Entwicklungen von *Fundamentaldaten*.

Den größten positiven Performancebeitrag in diesem Zeitraum lieferte die *Long*-Position des Fonds auf den italienischen Finanzdienstleistungskonzern Fineco, der in diesem Jahr einen stark positiven Performancebeitrag lieferte. Er ist ein gutes Beispiel dafür, dass die Fundamentaldaten für die Performance maßgeblich sind. Seine Aktienhandelsplattform hat ihren Umsatz

im Vergleich zum Vorjahr mehr als verdoppelt, was durch die höhere Marktvolatilität begünstigt wurde. Die Bankingsparte blieb von den coronabedingten Lockdowns und der anschließenden Rezession im Vergleich zu Rivalen weitgehend verschont. Dies ist Teil eines breiteren Engagements, zu dem auch eine *Long*-Position auf den italienischen Vermögensverwalter Banca Generali gehört. Die *Absicherungsgeschäfte* des Fonds beinhalteten eine Kombination aus italienischem Markt und einem maßgeschneiderten Korb traditioneller italienischer Banken. Die Position auf Banca Generali wurde nach Berichten verkauft, die Zweifel an der Unternehmensführung aufwarfen. Der Fonds wird die Position möglicherweise wieder eröffnen, wenn diese Bedenken ausgeräumt sind.

Aufgrund des Marktumfelds schälerten einige Positionen auch das Fondsergebnis, weil der wirtschaftliche Stillstand historisch einmalige Auswirkungen auf bestimmte Unternehmen und Sektoren hatte. Beispielsweise profitierte die *Long*-Position auf das Medienunternehmen Time Out vom erwarteten Wachstum seines Konzepts, das auf Food-Märkte mit mehreren Restaurants setzt. Die letzten Eröffnungen waren erfolgreich verlaufen, weitere Eröffnungen sind in Vorbereitung. Das Unternehmen litt aufgrund des Wesens seiner Geschäfte besonders stark unter den Maßnahmen zur Eindämmung des Coronavirus, die den Aktienkurs zu Beginn des Zeitraums bremsten, wobei die *Absicherungsgeschäfte* des Fonds auf dem britischen Markt und ein britischer Gastronomiewert nur teilweise für Ausgleich sorgten. Der Manager hielt die Bilanz von Time Out nicht für ausreichend solide, um das Unternehmen in einer anhaltenden Krise zu stützen. Daher wurde die Position glattgestellt.

Für die Zukunft erwartet der Manager ein günstiges Umfeld für den Fonds. Die Aktienbewertungen scheinen auf einer raschen Erholung der Wirtschaftstätigkeit und der Unternehmensgewinne zu basieren, was bei Weitem nicht sicher erscheint. Die politischen Hilfspakete könnten jedoch für einige Zeit erhöhte Bewertungen begünstigen. In der kommenden Zeit wird die Stimmung schwanken, je nachdem, wie die veröffentlichten Daten ausfallen, wie sich das Virus entwickelt und welche Maßnahmen angekündigt werden. Insgesamt hält der Manager daher ein konservatives Exposure und eine sorgfältige *Absicherung* von Faktorrisiken für angemessen, wobei der Schwerpunkt weiterhin auf dem Titelauswahlrisiko liegt.

Insight Investment Management (Global) Limited
Juli 2020

BNY MELLON ABSOLUTE RETURN GLOBAL CONVERTIBLE FUND

Die Anteilsklasse Euro U (Acc.) des Fonds erzielte im sechsmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 1,06%.

ABSOLUTE RENDITE, GESAMTRENDITE & MULTI-ASSET Forts.

BNY MELLON ABSOLUTE RETURN GLOBAL CONVERTIBLE FUND Forts.

Im Vergleich dazu verzeichnete der 1-Monats-EURIBOR -0,23 %, jeweils in Euro.

Das erste Halbjahr 2020 stand im Zeichen außerordentlicher Turbulenzen. Dabei wurde auf die gravierenden wirtschaftlichen Auswirkungen der Coronakrise mit beispiellosen politischen Maßnahmen reagiert.

Der Ausbruch und die weltweite Ausbreitung des Coronavirus schürten ab Ende Februar und insbesondere im März große Angst an den Aktienmärkten. Die veröffentlichten Wirtschaftsdaten belegten einen historisch einzigartigen Einbruch der Wirtschaftstätigkeit. Im Laufe der Zeit hellte sich die Marktstimmung angesichts der Ankündigungen von Maßnahmen, der Abflachung der Infektionskurven und zaghafter Schritte zur Wiedereröffnung der Volkswirtschaften auf. Die Märkte erholten sich von ihren Tiefständen im März. Der anschließende Wiederanstieg der Infektionszahlen in den USA und die Sorge um einen Stellenabbau aufgrund des Auslaufens der weltweiten Beschäftigungsförderungsprogramme dämpften jedoch den Optimismus, dass es zu einer „V-förmigen“ Erholung auf frühere Wachstums- und Gewinnniveaus kommen würde.

Der Fonds hat den Berichtszeitraum gut gemeistert, indem er potenzielle Verluste aufgrund der Turbulenzen zu Beginn des Berichtszeitraums eindämmte und sich neu positionierte, um spätere Chancen zu nutzen. Ein Hauptmerkmal war das aktive Management von Einzelpositionen und der strategischen Positionen insgesamt.

Der Fonds verringerte ab Mitte Februar rasch sein Risiko. Die Manager stellten etwa die Hälfte der Portfoliopositionen glatt. Die Ausbreitung des Virus sowie die weltweiten politischen Reaktionen wurden überwacht. Im März waren die Märkte etwas unruhig, aber dank der Anleihekaufprogramme der Zentralbanken funktionierten die Märkte langsam wieder reibungslos.

Das förderte an den *Investment-Grade*-Märkten Bereiche mit Wertpotenzial zutage, in die der Fonds selektiv und in geringerem Umfang investierte. Angesichts der erhöhten Marktvolatilität blieben Einzeltitelpositionen sorgfältig abgesichert. Im Laufe des zweiten Quartals, als sich die Stimmung und die Märkte weitgehend erholten, erhöhte der Manager methodisch das Exposure, indem er zyklische Werte, die sich vom Coronavirus erholten, und Titel aufnahm, die in einer Post-Coronawelt nach den globalen Lockdowns voraussichtlich erfolgreich sein werden. Der Manager erhöhte sein Exposure weiter, als sich neue Anlagechancen boten.

Mehrere Positionen zahlten sich aus, darunter Sika, Booking Holdings und Pioneer Natural Resources. Coronabezogene Themenanlagen wie DocuSign, Coupa Software, Winnebago und Sea Ltd. trugen ebenfalls positiv zum Fondsergebnis bei. Kurzfristige taktische Positionen lieferten positive Performancebeiträge, wobei die Positionen auf Slack Technologies und Carnival Cruises im Mittelpunkt standen.

Mit Blick auf die Zukunft sprechen stark volatile Phasen wie in der letzten Juniwoche für besondere Sorgfalt. Der Fonds ist ausgewogen positioniert. Der Manager ist der Ansicht, dass sich robuste Unternehmensanleihen und kürzere Fälligkeitsprofile sowie thematische Kernpositionen in einem von COVID-19-Schlagzeilen geprägten Umfeld am meisten auszahlen.

Die Kombination aus einer historisch beispiellosen Lockerung der globalen *Geld-* und *Fiskalpolitik* dürfte die langfristige Stabilität der Volkswirtschaften rund um den Globus gewährleisten. Riskante Vermögenswerte werden aber kurzfristig weiterhin von Corona- und Gewinnmeldungen beeinflusst werden. Der Fonds ist weiterhin mit dem Ziel positioniert, Kapital zu erhalten und positive Renditen zu erzielen, wenn sich die Märkte weiter aufhellen. Darüber hinaus konzentriert sich der Manager darauf, tägliche Schwankungen abzufedern, die bis auf Weiteres anhalten könnten.

Insight Investment Management (Global) Limited
Juli 2020

BNY MELLON DYNAMIC TOTAL RETURN FUND

Die Anteilsklasse USD A (Acc.) des Fonds verzeichnete im sechsmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -6,11 % in US-Dollar.

Der Fonds ging im Berichtszeitraum aufgrund von Verlusten durch Wachstums- und Diversifizierungswerte zurück. Die Ausbreitung von COVID-19 bewirkte eine akute Eintrübung der Stimmung, da die Märkte die Gefahr einer globalen Rezession einpreisten. Die Bemühungen um eine Eindämmung der Pandemie brachten die Weltwirtschaft effektiv zum Erliegen, da viele Länder Grenzkontrollen einführten und Ausgangssperren verhängten. Riskante Vermögenswerte brachen ein, und Aktien verzeichneten die stärksten Kurseinbrüche seit 2008. Im zweiten Quartal machten sie die Kursverluste weitgehend wieder gut. Unter den Wachstumstiteln schmäleren *Long*-Positionen auf japanische, britische und *Eurozone-Aktien* das Fondsergebnis am stärksten. Eine *Long*-Position in *US-Aktien* und Hochzinsanleihen verringerte den Verlust.

Bei den Diversifizierungswerten verursachte der starke Anstieg der *Volatilität* zu Beginn des Berichtszeitraums einen Verlust. Währungsallokationen verringerten den Verlust. *Short*-Positionen auf den australischen Dollar und

ABSOLUTE RENDITE, GESAMTRENDITE & MULTI-ASSET Forts.

BNY MELLON DYNAMIC TOTAL RETURN FUND Forts.

kanadischen Dollar waren Treiber des Positivbeitrags, den Währungsallokationen bescherten. Der US-Dollar stieg Anfang des Jahres, da er von der Nachfrage nach „sicheren Häfen“ profitierte. Rohstoff- und Wachstumswährungen gaben kräftig nach, da die Rohstoffpreise und insbesondere die Energiepreise Anfang des Jahres einbrachen.

Defensive Vermögenswerte trugen angesichts einer *Long*-Position auf US-Anleihen positiv zum Ergebnis bei. Die erhöhte Risikoaversion und die historischen geldpolitischen Maßnahmen der US-Notenbank trieben die US-Treasury-Renditen auf historische Tiefstände. Die Rendite 10-jähriger US-Treasuries fiel um 126 Basispunkte auf 0,66% und wirkte sich erneut günstig auf die *Long*-Position des Fonds auf Treasuries aus. Der Manager nahm Ende März eine Position auf Unternehmensanleihen auf, die aufgrund der Verengung der *Spreads* am Ende des Berichtszeitraums ebenfalls positiv zum Fondsergebnis beitrug.

Als die Ungewissheit zunahm und die *Fundamentaldaten* sich stark veränderten, reduzierte der Manager das Fondsrisiko erheblich. Die Änderung der Aktien-Risikoprämie war entscheidend für die Risikoverringung. Höhere Nominalrenditen in allen Unternehmensanleihesektoren reduzierten die erwartete Aktien-Risikoprämie gegenüber Anleihen. Gleichzeitig hatten Aktienanalysten die zukünftigen Gewinnerwartungen abgeschrieben, und die Modelle des Managers deuteten darauf hin, dass weitere Abschreibungen wahrscheinlich sind, wenn der Wachstumsschock deutlicher sichtbar wird. Darüber hinaus preisten die Risikomodell des Fonds eine anhaltendere Unsicherheit bezüglich der künftigen Erwartungen zu den *Fundamentaldaten* ein. Im weiteren Verlauf des Berichtszeitraums, als sich die Risikoindikatoren verbesserten, wurden wieder einige Wachstumswerte in den Fonds aufgenommen, sodass er den Berichtszeitraum mit einer mäßig *defensiven* Allokation beendete.

Mellon Investments Corporation
Juli 2020

BNY MELLON EFFICIENT GLOBAL IG CORPORATE BETA FUND

Der Fonds wurde am 10. März 2020 aufgelegt.

Im Berichtszeitraum seit ihrer Auflegung erzielte die Anteilsklasse USD W (Acc.) des Fonds eine Rendite von 2,16%, verglichen mit einer Rendite von 1,54% für den Bloomberg Barclays Global Aggregate Corporate TR Index (USD Hedged), jeweils in US-Dollar.

Nachdem Unternehmensanleihen im März aufgrund der akuten Eintrübung der Stimmung angesichts der Ausbreitung des Coronavirus stark nachgegeben

hatten, erholten sie sich im zweiten Quartal, als die Zentralbanken mit beispiellosen *fiskal*- und *geldpolitischen* Stimulierungsmaßnahmen reagierten und die coronabedingten Lockdowns gelockert wurden, was Hoffnungen auf eine Erholung schürte. Die Neuemissionen stiegen in den USA und in Europa auf Rekordniveaus, und die Anleger setzten ihre Jagd nach Rendite fort, nachdem sich die *Spreads* Anfang des Jahres erheblich geweitet hatten und die Renditen von Staatsanleihen stark zurückgegangen waren.

Der Fonds ist positioniert, um ein *diversifiziertes* Engagement in globalen Investment-Grade-Unternehmensanleihen mit ähnlichen *Bonitäts*-, *Durations*- und *Fälligkeits*-merkmalen zu bieten wie im Bloomberg Barclays Global Aggregate Corporate Index. Gleichzeitig zielt der Fonds darauf ab, das Risiko einer Bonitäts-Herabstufung und die mit traditionellen Stichproben- und Replikationsansätzen verbundenen Transaktionskosten abzufedern und so gering wie möglich zu halten.

Mellon Investments Corporation
Juli 2020

BNY MELLON GLOBAL MULTI-ASSET INCOME FUND

Die Anteilsklasse EUR A (Inc.) des Fonds erzielte im sechsmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -11,32%. Im Vergleich dazu verzeichnete der MSCI AC World NR Index/ICE BofAML Global Broad Market EUR hedged Index (60:40) eine Rendite von -1,72%, jeweils gemessen in Euro.

Der Fonds erwirtschaftete eine Negativrendite und hielt nicht mit seinem Vergleichsindex Schritt. Die Märkte waren aufgrund der COVID-19-Pandemie sehr *volatil*.

Im ersten Quartal 2020 bekam der Fonds den wahllosen Ausverkauf in allen Anlageklassen aufgrund der Ausbreitung der globalen Pandemie schmerzhaft zu spüren. Im Aktiensegment schmäleren die Sektoren Finanzen und Verbraucherdienstleistungen das Fondsergebnis in diesem Zeitraum am stärksten, da die Lockdowns die üblichen Konsumausgaben der Verbraucher unter Druck setzten. Weitere große Verlustbringer waren unter anderem der indische Mautstraßenanbieter IRB Invit und die Flugzeug-Leasinggesellschaft Doric Nimrod Air Two, da der Straßenverkehr zurückging und die Flotten von Fluggesellschaften weltweit am Boden blieben. Der Fonds erholte sich im zweiten Quartal 2020. Der Fonds profitierte von der Positionierung im Technologie-, Konsumgüter- und Industriesektor im Aktiensegment und von der starken Performance bei *alternativen Anlagen*, die von einer Erholung der wirtschaftlichen Infrastruktur und erneuerbarer Energien profitierten. Im Anleihensegment schnitten Schwellenländer- und *Sub-Investment-Grade*-Anleihen am besten ab.

ABSOLUTE RENDITE, GESAMTRENDITE & MULTI-ASSET Forts.

BNY MELLON GLOBAL MULTI-ASSET INCOME FUND

Forts.

In puncto Portfolioveränderungen wurde vor den Marktturbulenzen eine Position auf den führenden chinesischen Lebensversicherer Ping An Insurance eröffnet. Die Wachstumschancen für Versicherungsprodukte sind nirgendwo auf der Welt so groß wie in China und die Margen sind die höchsten in Asien. Eine Position auf den europäischen Reifenhersteller Continental wurde aufgebaut. Das Unternehmen wird gerade umstrukturiert. In diesem Zusammenhang wird die problematische Antriebssparte abgespalten, was eine bessere Kapitalrendite und Cashflow-Renditen für das verbleibende Geschäft beschern könnte. Bayer, weltweit führend in den Bereichen Pflanzenschutz und Saatgut, wurde ebenfalls in das Portfolio aufgenommen.

Im Segment alternative Anlagen eröffnete der Manager Positionen auf mehrere Titel, darunter auf Gresham House Energy Storage, das sich Kapital zur Finanzierung des Kaufs einer Betriebsanlage und zur Erweiterung des Batteriegeschäfts an einem seiner Standorte beschaffte. Zu den Verkäufen gehörte unter anderem der Vermögensverwalter M&G. Die Positionen auf die Aktien von Greencoat UK Wind und Octopus Renewables aus dem Bereich erneuerbare Energien wurden unterdessen verringert.

Der Manager hält an seinem vorsichtigen Ausblick fest. Seiner Ansicht nach sollten sich Anleger auf Geschäftsmodelle positionieren, die stark genug sind, um die Krise zu überstehen und strukturell intakt oder gestärkt daraus hervorzugehen, wobei sie die Bewertungen in allen Anlageklassen im Auge behalten sollten.

Obwohl die Aktienmärkte im Laufe des Jahres neben zahlreichen Dividendenkürzungen eine erhebliche Marktvolatilität verzeichneten, konnte der Fonds in einer für ertragsorientierte Anleger besonders schwierigen Zeit dennoch ein stabiles Einkommen erzielen. Das ist ein Beweis für die Struktur und Philosophie des Fonds. Sie garantieren dafür, dass sich der Manager auf die zur Erreichung des Ertragsziels erforderlichen Merkmale einzelner Wertpapiere konzentriert, statt auf willkürliche Benchmarks, die möglicherweise nicht das vom Fonds geforderte Ergebnis erzielen.

Newton Investments Management Limited
Juli 2020

BNY MELLON GLOBAL UNCONSTRAINED FUND

Die Anteilsklasse USD W (Acc.) des Fonds erzielte im sechsmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -2,00 %. Im Vergleich dazu verzeichnete der Vergleichsindex, 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 -0,87 % und der Sektordurchschnitt des Lipper Global – Mixed Asset USD Balanced-Global eine Rendite von -4,50 %. Alle Angaben in US-Dollar.

Der Fonds erwirtschaftete eine negative Rendite. Er blieb zwar hinter seinem Vergleichsindex zurück, übertraf jedoch den Sektordurchschnitt.

Die Aktienmärkte setzten ihre Ende 2019 verzeichnete Rally Anfang 2020 fort. Die Ausbreitung von COVID-19 führte jedoch im ersten Quartal zu starken Kursverlusten, bevor beispiellose *geld-* und *fiskalpolitische* Maßnahmen den Märkten zu einer Erholung verhalfen. Die Aktienausswahl steuerte positiv zum Fondsergebnis bei, wobei sowohl die *Aktien-* als auch die Rohstoffpositionen beitrugen. Die Vermögensallokation bremste das Ergebnis jedoch, wobei sich die *Übergewichtung* von Aktien und die *Untergewichtung* von Anleihen nachteilig auswirkten.

Laureate Education zählte zu den größten Verlustbringern, da es weniger Einschreibungen von Studenten für seine Studienkurse meldete. Im Banksektor schmälerte Citigroup den Ertrag, da sich Anleger weiter Sorgen über die Auswirkungen des auf längere Sicht niedrigen Zinsumfelds auf die Rentabilität und die Aussicht auf einen coronabedingten Anstieg notleidender Kredite machten. Suncor Energy enttäuschte und litt unter dem Nachfrageschock im Ölsektor aufgrund der COVID-19-Krise und dem anhaltenden Öl-Überangebot. Der Ölpreis erholte sich zwar und verschiedene Länder kürzten ihre Fördermengen, dennoch sind die Aussichten für die künftige Preisentwicklung deutlich getrübt.

Der Hersteller von Elektrofahrzeugbatterien Samsung SDI präsentierte sich dagegen als Glanzlicht und profitiert von den Initiativen Südkoreas und der Europäischen Kommission im Bereich erneuerbarer Energie. M3, der japanische Anbieter medizinischer Onlinedienste hat von der COVID-19-Pandemie profitiert, da medizinische Beratungen aufgrund der Kontaktbeschränkungen zunehmend online durchgeführt wurden. Microsoft entwickelte sich ebenfalls erfreulich, da Analysten ihre Prognosen angesichts positiver Ergebnisse nach oben korrigierten. Die Corona-Krise und der Trend zum Home Office haben die Akzeptanz von Diensten wie Cloud Computing beschleunigt.

Die anhaltende COVID-19-Pandemie wird die Gewinnaussichten für die Weltwirtschaft auf kurze Sicht deutlich schmälern. Das Gesundheitsrisiko durch eine Lockerung der Beschränkungen vor der Entwicklung eines wirksamen Impfstoffs und das wirtschaftliche Risiko einer Fortsetzung der Beschränkungen müssen in einem ausgewogenen Verhältnis stehen. Zweite Infektionswellen und örtlich begrenzte Lockdowns scheinen wahrscheinlich und verhindern eine schnelle Rückkehr zur „Normalität“.

ABSOLUTE RENDITE, GESAMTRENDITE & MULTI-ASSET Forts.

BNY MELLON GLOBAL UNCONSTRAINED FUND Forts.

Mit Blick auf die Zukunft wird der Fokus weiter auf den wichtigsten Anlagethemen liegen, die nach Ansicht des Managers das Gewinnwachstum und langfristig positive Erträge fördern könnten. Der Manager kann sich dank des flexiblen Anlageansatzes des Fonds auf solche Aktien konzentrieren, die nachhaltige Wettbewerbsvorteile, hohe Kapitalrenditen und konservative Bilanzen aufweisen. So sollte der Manager in der Lage sein, eine Reihe von Anlageideen zu ermitteln und ein ausgewogenes Portfolio mit einer Vielzahl unterschiedlicher Investment Cases zusammenzustellen.

Newton Investment Management Limited
Januar 2020

BNY MELLON GLOBAL REAL RETURN FUND (EUR)

Die Anteilsklasse Euro A des Fonds erzielte im sechsmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -2,64%. Im Vergleich dazu verzeichnete der 1-Monats-EURIBOR + 4% per annum ein Plus von 1,77%, jeweils in Euro.

Der Fonds erzielte eine Negativrendite und beendete den Berichtszeitraum hinter der Benchmark. Die Marktbedingungen waren *volatil*, was in erster Linie auf die Auswirkungen der COVID-19-Pandemie zurückzuführen war. Später setzte eine Erholung ein, und die Verluste wurden weitgehend wettgemacht.

Ertragsorientierte Papiere schmäleren im Berichtszeitraum das Fondsergebnis. *Synthetische* Positionen erwiesen sich als große Verlustbringer, vor allem wegen verkaufter *Verkaufsoptionen* auf Aktienindizes, mit denen zusätzliches Aufwärtspotenzial zu attraktiveren Bewertungsniveaus erzielt werden sollte, und die unter dem plötzlichen, starken Markteinbruch litten. Die Aktienpositionen des Fonds schmäleren den Ertrag ebenfalls. Negative Performancebeiträge kamen aus den Bereichen Luft- /Raumfahrt und Verteidigung (General Electric und Thales) sowie aus dem Öl- und Gassektor (Royal Dutch Shell und Total), wo Anleger mit einer schleppenden Erholung rechnen. Technologiewerte wie Microsoft, SAP und ASML tendierten dagegen erfreulich und profitierten von einer starken Performance, da die Nachfrage nach digitalen und Online-Produkten während des Lockdowns stieg und ihre solide Marktposition stärkte. Schwellenländeranleihen, alternative Anlagen und Unternehmensanleihen schmäleren den Fondsertrag ebenfalls.

Stabilisierende Anlagen und Absicherungspositionen wirkten sich positiv auf den Fondsertrag aus. Edelmetalle, allen voran Gold, entwickelten sich äußerst erfreulich, wobei der Goldpreis auf ein Achtjahreshoch kletterte. Staatsanleihen erzielten ebenfalls positive Erträge, da die Renditen in vielen Fällen auf Allzeittiefs sanken. Beide Anlageklassen profitierten von den wirtschaftlichen

Turbulenzen und der *quantitativen Lockerung*, die Anleger in relativ „sichere Häfen“ trieb. *Derivate* lieferten ebenfalls einen positiven Performancebeitrag. Gleichzeitig zahlte sich die Währungsabsicherung deutlich aus, da der Euro im Laufe des Berichtszeitraums aufwertete.

Die Portfolioveränderungen beinhalteten den Kauf von *Index-Put-Optionen* und die Aufstockung der Goldposition des Fonds zu Beginn des Berichtszeitraums, da die Sorgen aufgrund der Coronakrise stiegen. Im zweiten Quartal 2020 wurde nach der Korrektur im ersten Quartal vor allem das ertragsorientierte Kernportfolio des Fonds aufgestockt. Das Netto-Aktienengagement wurde durch eine Kombination aus Einzeltitelkäufen unter Ausnutzung attraktiver Bewertungen und durch eine Reduzierung der Aktienabsicherungen zugunsten eines indirekten Schutzes erhöht. Der Manager verstärkte daneben das Exposure auf Unternehmensanleihen, um vom weiten Renditeabstand gegenüber Staatsanleihen zu profitieren. Das Exposure auf *US-Treasuries* wurde durch den Kauf von *Futures* mit einer Laufzeit von 10 und 30 Jahren deutlich erhöht, obwohl der Manager die Position im 10-jährigen Laufzeitenbereich unlängst aufgrund von Sorgen über eine potenzielle Versteilung der Renditekurve wegen der möglicherweise *inflationären* Folgen der explodierenden Staatsausgaben konsolidiert hat.

Obwohl der Manager *Risikowerte* seit den Tiefstständen Ende März optimistischer beurteilt, bleibt er wachsam gegenüber den zahlreichen Risiken, wie etwa einer wirtschaftlichen Eintrübung, der enorm steigenden Verschuldung durch die wirksame Kombination von *Geld- und Fiskalpolitik* und einer möglichen zweiten Coronawelle. Das Exposure auf *Risikowerte* ist zwar inzwischen höher als am Ende des Vorquartals, gleichzeitig ist aber auch das Engagement bei stabilisierenden Vermögenswerten gestiegen, allen voran *US-Treasuries* und Gold, die beide in verschiedenen Szenarios als Absicherungen für den Fonds dienen können. Darüber hinaus setzt der Fonds weiter auf eine dynamische Vermögensallokation. Wie sich im Laufe der Zeit gezeigt hat, ist der Manager zudem bereit, diese deutlich anzupassen, wenn die künftigen Aussichten dies erfordern.

Newton Investment Management Limited
Juli 2020

BNY MELLON GLOBAL REAL RETURN FUND (GBP)

Die Anteilsklasse Sterling C (Inc.) des Fonds erzielte im sechsmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -2,50%. Im Vergleich dazu verzeichnete der 1-Monats-GBP-LIBOR + 4% p.a. ein Plus von 2,18%, beide in Pfund Sterling.

Der Fonds erzielte eine negative Rendite und beendete den Berichtszeitraum hinter der Benchmark. Die Marktbedingungen waren *volatil*, was in erster Linie auf die Auswirkungen der Covid-19-Pandemie zurückzuführen war.

ABSOLUTE RENDITE, GESAMTRENDITE & MULTI-ASSET Forts.

BNY MELLON GLOBAL REAL RETURN FUND (GBP) Forts.
Später setzte eine Erholung ein, und die Verluste wurden weitgehend wettgemacht.

Ertragsorientierte Papiere schmälerten im Berichtszeitraum das Fondsergebnis. *Synthetische* Positionen erwiesen sich als große Verlustbringer, vor allem wegen verkaufter *Verkaufsoptionen* auf Aktienindizes, mit denen zusätzliches Aufwärtspotenzial zu attraktiveren Bewertungsniveaus erzielt werden sollte, und die unter dem plötzlichen, starken Markteinbruch litten. Schwellenländeranleihen wurden im Berichtszeitraum verringert und tendierten ebenfalls schwächer. Die Aktienpositionen des Fonds wirkten sich ebenfalls positiv auf den Ertrag aus. Technologiewerte wie Microsoft, ASML und SAP profitierten von einer starken Performance, da die Nachfrage nach digitalen und Online-Produkten während des Lockdowns stieg und ihre solide Marktposition stärkte. Negative Performancebeiträge kamen aus den Bereichen Luft- /Raumfahrt und Verteidigung (General Electric und Thales) sowie aus dem Öl- und Gassektor (Royal Dutch Shell und Total), wo Anleger mit einer schleppenden Erholung rechnen. Unternehmensanleihen wurden von den Anleihekäufen der Zentralbanken getragen, ebenso in geringerem Umfang *alternative* Anlagen. Beide lieferten positive Performancebeiträge.

Stabilisierende Anlagen und Absicherungspositionen wirkten sich positiv auf den Fondsertrag aus. Edelmetalle, insbesondere Gold und Staatsanleihen, legten deutlich zu. Der Goldpreis stieg auf ein Achtjahreshoch, während die Staatsanleihe-Renditen in vielen Fällen auf historische Tiefststände sanken. Beide Anlageklassen profitierten von den wirtschaftlichen Turbulenzen und der *quantitativen Lockerung*, die Anleger in relativ „sichere Häfen“ trieb. Auch Derivate steuerten positiv bei. Währungsabsicherungsgeschäfte belasteten unterdessen, da eine Reihe von Fremdwährungen im Laufe des Berichtszeitraums gegenüber dem Pfund Sterling aufwerteten.

Die Portfolioveränderungen beinhalteten den Kauf von *Index-Put-Optionen* und die Aufstockung der Goldposition des Fonds zu Beginn des Berichtszeitraums, da die Sorgen aufgrund der Coronakrise stiegen. Im zweiten Quartal 2020 wurde nach der Korrektur im ersten Quartal vor allem das auf Ertrag ausgerichtete Kernportfolio des Fonds aufgestockt. Das Netto-Aktienengagement wurde durch eine Kombination aus Einzeltitelkäufen unter Ausnutzung attraktiver Bewertungen und durch eine Reduzierung der Aktienabsicherungen zugunsten eines indirekten Schutzes erhöht. Der Manager verstärkte daneben das Exposure auf Unternehmensanleihen, um von dem breiteren Renditeabstand gegenüber Staatsanleihen zu profitieren. Das Exposure auf US-*Treasuries* wurde durch den Kauf von *Futures* mit einer Laufzeit von 10 und 30 Jahren deutlich erhöht, obwohl der Manager die Position im 10-jährigen

Laufzeitenbereich unlängst aufgrund von Sorgen über eine potenzielle Versteilung der Renditekurve wegen der möglicherweise *inflationären* Folgen der explodierenden Staatsausgaben konsolidiert hat.

Obwohl der Manager *Risikowerte* seit den Tiefstständen Ende März optimistischer beurteilt, bleibt er wachsam gegenüber den zahlreichen Risiken, wie etwa einer wirtschaftlichen Eintrübung, der enorm steigenden Verschuldung durch die wirksame Kombination von *Geld-* und *Fiskalpolitik* und einer möglichen zweiten Coronawelle. Das Exposure auf *Risikowerte* ist zwar inzwischen höher als Ende des Vorquartals, gleichzeitig ist aber auch das Engagement bei stabilisierenden Vermögenswerten gestiegen, allen voran US-*Treasuries* und Gold, die beide in verschiedenen Szenarios als Absicherungen für den Fonds dienen können. Darüber hinaus setzt der Fonds weiter auf eine dynamische Vermögensallokation. Wie sich im Laufe der Zeit gezeigt hat, ist der Manager zudem bereit, diese deutlich anzupassen, wenn die künftigen Aussichten dies erfordern.

Newton Investment Management Limited
Juli 2020

BNY MELLON GLOBAL REAL RETURN FUND (USD)

Im sechsmonatigen Berichtszeitraum erzielte die Anteilsklasse USD A des Fonds eine Rendite von -2,01 %, verglichen mit einer Rendite von 2,44 % für den 1-Monats-LIBOR USD + 4 % p.a., jeweils in US-Dollar.

Der Fonds erzielte eine Negativrendite und beendete den Berichtszeitraum hinter der Benchmark. Die Marktbedingungen waren *volatil*, was in erster Linie auf die Auswirkungen der COVID-19-Pandemie zurückzuführen war. Später setzte eine Erholung ein, und die Verluste wurden weitgehend wettgemacht.

Ertragsorientierte Papiere schmälerten im Berichtszeitraum das Fondsergebnis. *Synthetische* Positionen erwiesen sich als große Verlustbringer, vor allem wegen verkaufter *Verkaufsoptionen* auf Aktienindizes, mit denen zusätzliches Aufwärtspotenzial zu attraktiveren Bewertungsniveaus erzielt werden sollte, und die unter dem plötzlichen, starken Markteinbruch litten. Die Aktienpositionen des Fonds schmälerten den Ertrag ebenfalls. Negative Performancebeiträge kamen aus den Bereichen Luft- /Raumfahrt und Verteidigung (General Electric und Thales) sowie aus dem Öl- und Gassektor (Royal Dutch Shell und Total), wo Anleger mit einer schleppenden Erholung rechnen. Technologiewerte wie Accenture, Apple, Microsoft und ASML tendierten dagegen erfreulich und profitierten von einer starken Performance, da die Nachfrage nach digitalen und Online-Produkten während des Lockdowns stieg und ihre solide Marktposition stärkte. Schwellenländeranleihen, die im Laufe des Berichtszeitraums reduziert wurden, *alternative*

ABSOLUTE RENDITE, GESAMTRENDITE & MULTI-ASSET Forts.

BNY MELLON GLOBAL REAL RETURN FUND (USD) Forts.

Anlagen und in geringerem Umfang Unternehmensanleihen schmälerten den Fondsertrag ebenfalls.

Stabilisierende Anlagen und Absicherungspositionen wirkten sich positiv auf den Fondsertrag aus. Edelmetalle, allen voran Gold, entwickelten sich äußerst erfreulich, wobei der Goldpreis auf ein Achtjahreshoch kletterte. Staatsanleihen erzielten ebenfalls positive Erträge, da die Renditen in vielen Fällen auf Allzeittiefs sanken. Beide Anlageklassen profitierten von den wirtschaftlichen Turbulenzen und der *quantitativen Lockerung*, die Anleger in relativ „sichere Häfen“ trieb. *Derivate* lieferten ebenfalls einen positiven Performancebeitrag. Gleichzeitig zahlte sich die Währungsabsicherung deutlich aus, da der US-Dollar während des Berichtszeitraums aufwertete.

Die Portfolioveränderungen betrafen den Kauf von Index-*Put-Optionen* und die Aufstockung von Goldposition zu Beginn des Berichtszeitraums, da die Sorgen aufgrund der Coronakrise stiegen. Im zweiten Quartal 2020 wurde nach der Korrektur im ersten Quartal vor allem das auf Ertrag ausgerichtete Kernportfolio des Fonds aufgestockt. Das Netto-Aktienengagement wurde durch eine Kombination aus Einzeltitelkäufen unter Ausnutzung attraktiver Bewertungen und durch eine Reduzierung der Aktienabsicherungen zugunsten eines indirekten Schutzes erhöht. Der Manager verstärkte daneben das Exposure auf Unternehmensanleihen, um von dem breiteren Renditeabstand gegenüber Staatsanleihen zu profitieren. Das Exposure auf US-*Treasuries* wurde durch den Kauf von *Futures* mit einer Laufzeit von 10 und 30 Jahren deutlich erhöht, obwohl der Manager die Position im 10-jährigen Laufzeitenbereich unlängst aufgrund von Sorgen über eine potenzielle Versteilung der Renditekurve aufgrund der möglicherweise *inflationären* Folgen der explodierenden Staatsausgaben konsolidiert hat.

Obwohl der Manager *Risikowerte* seit den Tiefstständen Ende März optimistischer beurteilt, bleibt er wachsam gegenüber den zahlreichen Risiken, wie etwa einer wirtschaftlichen Eintrübung, der enorm steigenden Verschuldung durch die wirksame Kombination von *Geld-* und *Fiskalpolitik* und eine mögliche zweite Coronawelle. Das Exposure auf *Risikowerte* ist jetzt zwar inzwischen höher als Ende des Vorquartals, gleichzeitig ist aber auch das Engagement bei stabilisierenden Vermögenswerten gestiegen, allen voran US-*Treasuries* und Gold, die beide in verschiedenen Szenarien als Absicherungen für den Fonds dienen können. Darüber hinaus setzt der Fonds weiter auf eine dynamische Vermögensallokation. Wie sich im Laufe der Zeit gezeigt hat, ist der Manager zudem bereit, diese deutlich anzupassen, wenn die künftigen Aussichten dies erfordern.

Newton Investment Management Limited
Juli 2020

BNY MELLON SUSTAINABLE GLOBAL REAL RETURN FUND (EUR)

Der Fonds wurde am 6. Februar 2020 aufgelegt.

Die Anteilsklasse Euro W (Acc.) des Fonds erzielte im Berichtszeitraum seit ihrer Auflegung eine Rendite von -2,85%. Im Vergleich dazu verzeichnete der 1-Monats-EURIBOR +4 % p.a. 1,41 %, jeweils in Euro.

Der Fonds erwirtschaftete eine Negativrendite und hielt nicht mit seinem Vergleichsindex Schritt.

Die Märkte, insbesondere die *Aktienmärkte*, knüpften Anfang 2020 an ihre Rally Ende 2019 an. Der Ausbruch der Coronakrise führte jedoch zu starken Marktverlusten, bevor beispiellose *geld-* und *fiskalpolitische* Maßnahmen eine Erholung ermöglichten.

Ertragsorientierte Papiere steuerten insgesamt negativ bei und bescherten in allen Kategorien Verluste. Aktien und Schwellenländeranleihen bildeten das Schlusslicht. Stabilisierende Vermögenswerte und Absicherungspositionen trugen unterdessen positiv, aber nicht ausreichend dazu bei, die Schwäche bei ertragsorientierten Titeln auszugleichen. Währungsabsicherungsinstrumente und Edelmetalle steuerten am stärksten positiv bei.

Die Positionen auf iShares Physical Gold, Invesco Physical Gold und Amundi Physical Metals führten das Feld an. Gold gilt oft als „sicherer Hafen“ und als Inflationsschutz und hat sich in der COVID-19-Pandemie und angesichts der damit verbundenen Stimulierungsmaßnahmen gut entwickelt. Der chinesische Social-Media-Titel und Spezialist für Videospiele Tencent schnitt überdurchschnittlich ab und profitierte von der gestiegenen Nachfrage während der Ausgangssperren. Auch Microsoft und Amazon steigerten aus ähnlichen Gründen ihre Renditen. Beide verzeichneten durch die Schließung von Unternehmen und Geschäften während der coronabedingten Lockdowns eine erhöhte Nachfrage nach ihren Dienstleistungen und Produkten.

Der Vermögensverwalter M&G bescherte unterdessen Verluste, da schwache Finanzmärkte und Mittelabflüsse die Stimmung trübten. Die Position auf den Unternehmensdienstleister Bureau Veritas schmälerte das Fondsergebnis ebenfalls, da das Unternehmen starke coronabedingte Rückgänge in den Bereichen Verbraucherprodukte und Zertifizierung meldete. Die Messgesellschaft Informa litt in ähnlicher Weise unter der Absage vieler wichtiger Konferenzen.

Wir beurteilen *Risikowerte* zwar optimistischer, der Manager sieht jedoch nach wie vor viele Risiken für die Weltwirtschaft. Das Engagement des Fonds bei Risikowerten hat sich zwar erhöht, wird aber durch ein verstärktes Exposure auf stabilisierende Werte ausgeglichen, die in unterschiedlichen Szenarien

ABSOLUTE RENDITE, GESAMTRENDITE & MULTI-ASSET Forts.

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

als *Absicherung* für den Fonds dienen können. Darüber hinaus bleibt die Vermögensallokation dynamisch und wie sich im Laufe der Zeit gezeigt hat, ist der Manager zudem bereit, diese deutlich anzupassen, wenn die künftigen Aussichten dies erfordern.

Newton Investment Management Limited
Juli 2020

BNY MELLON TARGETED RETURN BOND FUND

Im sechsmonatigen Berichtszeitraum erzielte die Anteilsklasse USD A (Acc.) des Fonds eine Rendite von 2,60%, verglichen mit einer Rendite von 0,24% für den Lipper Global – Bond Global USD Sektordurchschnitt, jeweils in USD.

Die Märkte tendierten zu Jahresbeginn robust und legten ungeachtet der geopolitischen Spannungen zwischen den USA und dem Iran weiter zu. Aufgrund der raschen Ausbreitung von COVID-19 und der beispiellosen Reaktionen von Regierungen, die die Weltwirtschaft faktisch zum Erliegen brachten, trübte sich die Stimmung jedoch dramatisch ein. Im zweiten Quartal setzte eine langsame Erholung an den Märkten ein, als die *geld-* und *fiskalpolitischen* Stimulierungsmaßnahmen in Industrie- und Schwellenländer zaghafte Positiv-Signale in den regelmäßig veröffentlichten Daten bescherten. Die politischen Hilfsmaßnahmen dauern an und in China, dem Ausgangspunkt der Pandemie, erholt sich die Produktion wieder. Der Welthandel wurde jedoch erheblich beeinträchtigt, und die erste Coronawelle breitet sich weltweit weiter aus.

Der Fonds ging mit einem relativ bescheidenen Risikobudget in den Marktabschwung und obwohl seine Allokation in *Unternehmensanleihen* und *Schwellenländeranleihen* zu einer negativen Gesamtrendite im ersten Quartal beitrug, konnte er sich aggressiv auf die Erholung der *Kreditspreads* positionieren und seit März eine starke Rendite erzielen, da sich die *Spreads* von Unternehmensanleihen gegenüber den weiten Ständen am Ende des Vorquartals verengt haben. Ende Juni hielt der Fonds ca. 37,5% in *Investment-Grade*-Unternehmensanleihen und weitere 4% in *Hochzins*-Unternehmensanleihen. Ende Februar 2020 belief sich das Gesamtengagement in beiden Segmenten dagegen vor dem heftigen Marktabschwung im Folgemonat auf 8,3%.

Die Gesamtduration des Fonds erhöhte sich seit Dezember 2019 um ca. 1 Jahr auf ca. 1,5 Jahre zum 30. Juni 2020 mit einem durchschnittlichen *Kreditrating* von A. Der Fonds ist weiterhin auf ca. 200 Einzelanleihen *diversifiziert* und erzielt eine gewichtete laufende *Rendite* von 2,03% (1,48% auf *Yield-to-Worst*-Basis), jeweils in US-Dollar.

Mellon Investments Corporation
Juli 2020

GLOBALE AKTIENMÄRKTE

BNY MELLON GLOBAL EQUITY FUND

Im sechsmonatigen Berichtszeitraum erzielte die Anteilsklasse USD A des Fonds eine Rendite von -4,68%. Im Vergleich dazu belief sich die Rendite des MSCI AC World NR Index auf -6,25% und der Lipper Global – Equity Global-Sektordurchschnitt auf -6,00%, jeweils in US-Dollar.

Der Fonds verzeichnete eine negative Rendite, übertraf aber seinen Vergleichsindex. Die Aktienmärkte setzten ihre Ende 2019 verzeichnete Rallye Anfang 2020 fort. Die Ausbreitung von COVID-19 führte jedoch im ersten Quartal zu starken Kursverlusten, bevor beispiellose *geld-* und *fiskalpolitische* Maßnahmen den Märkten anschließend zu einer Erholung verhalfen.

Die Titel- und die Sektorauswahl trugen beide positiv zum relativen Fondsergebnis bei. Am stärksten war die Titelauswahl in den Sektoren *Nicht-Basis-Konsumgüter* und *Finanzen*, während Kommunikationsdienste das Schlusslicht bildeten. Microsoft entwickelte sich erfreulich, da Analysten ihre Prognosen angesichts positiver Ergebnisse nach oben korrigierten. Die Coronakrise und der Trend zum Home Office haben die Akzeptanz von Diensten wie Cloud Computing beschleunigt. Der Hersteller von Elektrofahrzeugbatterien Samsung SDI entwickelte sich überdurchschnittlich und profitierte von den Initiativen Südkoreas und der Europäischen Kommission im Bereich erneuerbare Energien sowie von positiven Meldungen über seine Gen5-Batterie. Ein weiteres Glanzlicht war Dollar General. Der US-Discounter profitierte vom Ansturm der Kunden auf Waren des täglichen Bedarfs wie Toilettenpapier und Lebensmittel, die Verbraucher jetzt benötigen, wenn sie zu Hause arbeiten.

Citigroup erwies sich als größter Verlustbringer, da Anleger sich weiter Sorgen über die Auswirkungen der längerfristig niedrigen Zinsen auf die Rentabilität machten. Der Ölriese Royal Dutch Shell hinkte ebenfalls hinterher, da das Coronavirus ungeachtet des anhaltenden Öl-Überangebots einen Nachfrageschock auslöste und das Management zum ersten Mal seit 1945 gezwungen war, die *Dividende* zu kürzen. Die Messegesellschaft Informa tendierte ebenfalls schwach, da viele wichtige Konferenzen aufgrund von COVID-19 abgesagt wurden. Der Manager geht jedoch davon aus, dass sich die Aktien wieder erholen, sobald das Face-to-Face-Marketing wieder aufgenommen wird.

Die Portfolioveränderungen beinhalteten unter anderem die Aufstockung von Mastercard unter Ausnutzung der Kursschwäche, die der coronabedingte Rückgang des grenzüberschreitenden Reiseverkehrs beschert. Der Manager ist der Ansicht, dass die Anleger die Aktien übermäßig stark abgestraft haben und weitete die Position daher aus. Außerdem eröffnete er eine Position auf den führenden chinesischen Lebensversicherer Ping An Insurance. Die Wachstumschancen für Versicherungsprodukte sind in China enorm und die Margen

Globale Aktienmärkte Forts.

BNY MELLON GLOBAL EQUITY FUND Forts.

sind die höchsten in Asien. Zudem nutzte der Manager die Gelegenheit, um beim deutschen Automobilzulieferer Continental einzusteigen. Kostensenkungen in seiner Reifensparte und Anzeichen für eine Erholung der Autoproduktion in China deuten darauf hin, dass das Unternehmen gut aufgestellt ist, um seinen Marktanteil trotz des Abschwungs auszubauen.

Die Positionen auf ausgewählte Wachstumsaktien wurden nach einer starken relativen Performance reduziert. Dies betraf unter anderem L'Oréal, Roche, Merck, Costco Wholesale und Novartis. Der deutsche Immobilienverwalter Deutsche Wohnen wurde vollständig glattgestellt, als sich die Aktien von den vorangegangenen aufsichtsrechtlichen Problemen erholten. Angesichts fehlender kurzfristiger Katalysatoren und eines schwierigen Umfelds für US-Apotheken trennte der Manager sich von der restlichen Position auf Walgreens Boots Alliance.

Mit Blick auf die Zukunft wird der Fokus weiter auf den wichtigsten Anlagethemen liegen, die das Gewinnwachstum und langfristig positive Erträge fördern könnten. Auf Unternehmensebene stehen Schlüsselmerkmale wie nachhaltige Wettbewerbsvorteile, hohe Kapitalrenditen und konservative Bilanzen im Mittelpunkt der Analyse des Managers. So sollte der Manager in der Lage sein, eine Reihe von Anlageideen zu ermitteln und ein ausgewogenes Portfolio mit einer Vielzahl unterschiedlicher Investment Cases zusammenzustellen.

Newton Investment Management Limited
Juli 2020

BNY MELLON GLOBAL EQUITY INCOME FUND

Die Anteilsklasse USD A (Inc.) des Fonds erzielte im sechsmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -13,14 %. Im Vergleich dazu verzeichnete der FTSE World TR Index eine Rendite von -6,20 % und der Lipper Global – Equity Global Income Sektordurchschnitt -12,06 %, jeweils gemessen in US-Dollar.

Der Fonds verzeichnete eine Negativrendite und hielt weder mit seinem Vergleichsindex noch mit dem Sektor Schritt.

Die Aktienmärkte setzten ihre Ende 2019 verzeichnete Rally Anfang 2020 fort. Die Ausbreitung von COVID-19 führte jedoch im ersten Quartal zu starken Kursverlusten, bevor beispiellose *geld-* und *fiskalpolitische* Maßnahmen den Märkten zu einer Erholung verhalfen. Die Titelauswahl bremste das Fondsergebnis insgesamt, vor allem im Bereich Verbraucherdienstleistungen, *Basiskonsumgüter* und Technologie. Finanzwerte steuerten unterdessen positiv bei. Die branchenbezogene Vermögensallokation erwies sich als günstig, wobei der Finanzsektor erneut den Glanzpunkt bildete.

Die Messegesellschaft Informa litt stark unter der Corona-Pandemie, da die weltweite Unterbrechung des Reiseverkehrs dazu führte, dass viele ihrer Veranstaltungen und Konferenzen abgesagt oder verschoben wurden. Auch der Hersteller von Schönheitsprodukten Coty schmälerte das Fondsergebnis, nachdem er bekannt gegeben hatte, dass die Umstrukturisierungskosten höher als erwartet ausfallen würden. Der Verzicht auf ein Engagement bei Microsoft belastete den Ertrag, da der Aktienkurs zulegte nachdem sich die Annahme seiner Cloud-Softwaredienste angesichts des Coronavirus beschleunigt hatten.

Die Pharma-Unternehmen Gilead Sciences und Roche gehörten zu den Performancespitzenreitern. Der Aktienkurs von Gilead Sciences legte getragen von der Hoffnung zu, dass sich das Medikament Remdesivir als wirksame Therapie zur Behandlung von COVID-19 erweisen könnte. Die Aktie von Roche ging unterdessen nach oben, nachdem der Coronavirustest des Unternehmens eine Notfallzulassung von der US-Arzneimittelaufsichtsbehörde FDA erhalten hatte. Die Qualcomm-Aktie reagierte weiter positiv auf die soliden Halbleiterumsätze, die durch die Nachfrage nach immer anspruchsvolleren Chips angekurbelt wurden.

Zu den Portfolioveränderungen zählten unter anderem Gewinnmitnahmen bei Gilead Sciences. In seine COVID-19-Therapie werden starke Hoffnungen gesetzt. Aber selbst, wenn sie erfolgreich ist, wird sie kaum wesentlicher Bestandteil des Geschäfts werden. Der Kosmetikwert Coty wurde wegen seiner übermäßigen Verschuldung verkauft. Der zur Stabilisierung des Unternehmens erforderliche Turnaround wird angesichts des rauen Wettbewerbs an den Märkten nach Einschätzung des Managers äußerst schwierig sein. Der Manager trennte sich aufgrund des hohen Aktienkurses von der Position auf Harley-Davidson. Obwohl das Unternehmen eine Markenkönigin besitzt, steht es vor ökologischen und demografischen Herausforderungen.

Ping An Insurance, Chinas führender Lebensversicherer, wurde in das Portfolio aufgenommen. Die Wachstumschancen für Versicherungsprodukte sind in China enorm und die Margen sind die höchsten in Asien. Der Bankwert Citigroup kam ebenfalls ins Portfolio, nachdem die Aktien trotz geringerer Zinssensitivität und eines attraktiven Aktienrückkaufplans im Gleichschritt mit dem US-Sektor gefallen waren. Schließlich wurde eine Position auf den japanischen Telekommunikationsriesen KDDI eröffnet. Der japanische Markt ist strukturell nach wie vor attraktiv, und mit seinem starken Kundendienst, der klugen Preisgestaltung und einer attraktiven *Dividende* könnte KDDI dem Fondsergebnis zugutekommen.

Die disziplinierte Einkommensstrategie des Fonds hat nach Ansicht des Managers nichts von ihrer Attraktivität

Globale Aktienmärkte Forts.

BNY MELLON GLOBAL EQUITY INCOME FUND Forts.

eingebüßt. Es bleibt abzuwarten, ob die an den Märkten eingepreiste rasche „V-förmige“ wirtschaftliche Erholung eintritt. Ein aktiver Stockpicking-Ansatz ist unerlässlich in diesem schwierigen Umfeld und um Unternehmen zu identifizieren, die überleben und langfristig erfolgreich sein können, sobald sich das Geschäftsklima normalisiert.

Newton Investment Management Limited
Juli 2020

BNY MELLON GLOBAL LEADERS FUND

Die Anteilsklasse USD A (Acc.) des Fonds erzielte im sechsmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -1,24 %. Im Vergleich dazu verzeichnete der MSCI World NR Index -5,77 % und der Lipper Global – Equity Global Sektordurchschnitt -5,91 %, jeweils gemessen in US-Dollar.

Nach der rasanten Talfahrt im ersten Quartal 2020 erholten sich die globalen Aktienindizes trotz der anhaltenden Wirtschaftskrise, die durch die COVID-19-Pandemie und die damit verbundenen Maßnahmen zur Eindämmung verursacht wurden, teilweise wieder. Die Rallye wird durch die massiven *fiskal-* und *geldpolitischen* Stimulierungsmaßnahmen politischer Entscheidungsträger weltweit und die allmähliche Wiedereröffnung einiger Volkswirtschaften nach den Lockdowns getragen.

Aktien aus den Sektoren Informationstechnologie und Gesundheit lieferten mit die besten absoluten Performancebeiträge. Den größten relativen Performancebeitrag steuerte allerdings die deutliche Untergewichtung des Finanzsektors bei.

Im Aktiensegment trug Adobe wesentlich zur Fonds-Performance bei. IT-Produkte und -Dienstleistungen werden aufgrund der Pandemie beschleunigt angenommen und könnten die langfristigen Wachstumsaussichten für den Spezialisten für Publishing-Software untermauern. Der neu ins Portfolio aufgenommene Gensequenzierungsspezialist Illumina, der von der Krebsforschung bis hin zur Landwirtschaft tätig ist, entwickelte sich ebenfalls solide. Der japanische Sensorhersteller Keyence verzeichnete nach Bekanntgabe erfreulicher Ergebnisse für das vierte Quartal des *Geschäftsjahres* 2020 solide Gewinne.

Unternehmen, die stärker unter dem wirtschaftlichen Stillstand litten, verzeichneten deutliche Rückgänge. Die Energieunternehmen Schlumberger und EOG Resources gaben im Berichtszeitraum kräftig nach. Darin spiegelte sich die *Volatilität* auf dem Ölmarkt aufgrund des anfänglichen, von Saudi-Arabien verursachten Angebotsschocks und des durch die Pandemie verursachten Nachfragerückgangs wider. Der spanische Einzelhändler Inditex, Eigentümer der Marke Zara, leidet vorübergehend unter unvermeidlichen Filialschließungen. Das Unternehmen stärkt jedoch nach

wie vor das Geschäft durch die Schließung einiger weniger effizienter Filialen und die Steigerung des Online-Vertriebs.

Neben Illumina wurden im Berichtszeitraum auch ASML, Edwards Lifesciences und der Hersteller analoger Halbleiter Texas Instruments ins Portfolio aufgenommen. Ersteres liefert wesentliche Ausrüstung für die Halbleiterindustrie, während Letzteres ein führender Hersteller von Produkten zur Behandlung von Herzkrankheiten ist. Veräußert wurden unter anderem Gilead Sciences, Johnson & Johnson, Schlumberger und Starbucks. Vor dem Hintergrund des aktuellen Umfelds bestanden nach Einschätzung des Managers nicht quantifizierbare Abwärtsrisiken für die kurzfristige Geschäftstätigkeit von Starbucks und große Bedenken aufgrund der schwachen Bilanz.

Mit Blick auf die Zukunft werden die aufgehellten Wirtschaftsindikatoren durch die Tatsache gedämpft, dass die Maßnahmen zur Eindämmung der Pandemie in Ländern weltweit tiefe Narben hinterlassen. Die Lage an den Arbeitsmärkten bleibt angespannt und die Arbeitslosigkeit hoch. Viele Unternehmen leiden unverändert unter dem Nachfragerückgang in diesem rauen Umfeld. Die Krise hat die Schwächen überschuldeter Unternehmen mit schwachen Geschäftsmodellen aufgezeigt. Während diese verhängnisvolle Krise ihren Lauf nimmt, sind nach Ansicht des Managers Anpassungsfähigkeit, Innovation, solides Management und Bilanzdisziplin von größter Bedeutung. Dies sind zentrale Eigenschaften der Unternehmen, in die der Fonds investiert.

Walter Scott & Partners Limited
Juli 2020

BNY MELLON GLOBAL OPPORTUNITIES FUND

Die Anteilsklasse USD A des Fonds erzielte im sechsmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -7,48 %, während der MSCI AC World NR Index um -6,25 % nachgab, jeweils in US-Dollar.

Der Fonds erwirtschaftete eine Negativrendite und hielt nicht mit seinem Vergleichsindex Schritt.

Auf Sektorebene zahlte sich die Vermögensallokation aus. Die *Übergewichtung* im IT-Sektor lieferte den größten Positivbeitrag, während die *Untergewichtung* von *Nicht-Basiskonsumgütern* das Fondsergebnis schmälerte. Die Titelauswahl bremste den Fondsertrag insgesamt, allen voran im Bereich Nicht-Basiskonsumgüter und Basiskonsumgüter.

Der Berichtszeitraum war für Aktienanleger einer der schwierigsten seit vielen Jahren. Die kurzfristige Euphorie zu Jahresbeginn wich rasch einer extremen Risikoaversion, als das globale Ausmaß der COVID-19-Pandemie deutlich wurde. Als die Lockdown-Maßnahmen gelockert wurden,

Globale Aktienmärkte Forts.

BNY MELLON GLOBAL OPPORTUNITIES FUND Forts.

begannen Anleger jedoch, auf eine wirtschaftliche Normalisierung zu hoffen. Die Finanzmärkte mussten ferner den Schock durch den Ölpreiskrieg verkraften, während die USA und China an ihrer feindselige Rhetorik festhielten.

Die Position auf Rolls-Royce war der größte Verlustbringer für den Fonds, da Anleger mit Sorge den weltweit rückläufigen Flugverkehr beobachteten. Die Aktie von Royal Dutch Shell reagierte mit Verlusten auf die historische Entscheidung, nach dem Ölpreiseinbruch die *Dividende* zum ersten Mal seit 1945 zu kürzen. Der Verzicht auf ein Engagement beim Indexschwergewicht Amazon belastete das Fondsergebnis ebenfalls. Das Unternehmen profitiert vom beschleunigten Umstieg auf den Online-Einzelhandel und blieb daher für Anleger attraktiv.

Microsoft lieferte unbeeindruckt von Warnungen vor coronabedingten Störungen in einigen Geschäftsbereichen den größten positiven Performancebeitrag. Die steigende Nachfrage nach der Cloud-Software des Unternehmens begünstigte die Aktie, da mehr Menschen von zu Hause aus arbeiteten.

Der Hersteller von Batterien für Elektroautos Samsung SDI war ein weiterer Performance-Spitzenreiter im IT-Sektor. Darin spiegeln sich Südkoreas Absicht, seine Wirtschaft durch einen „Green Deal“ anzukurbeln, sowie positive Meldungen über die Gen5-Batterie des Unternehmens wider. Auch Gilead Sciences entwickelte sich erfreulich getragen von Hoffnungen, dass sich sein Medikament Remdesivir als wirksame COVID-19-Therapie erweisen könnte.

Der Manager investierte in den deutschen Automobilzulieferer Continental. Das Unternehmen wird gerade restrukturiert und spaltet die angeschlagene Antriebssparte ab. Der Manager geht davon aus, dass sich dies positiv auf den Cashflow und die Kapitalrendite des verbleibenden Geschäfts auswirken könnte. Der Manager nutzte die coronabedingte Kursschwäche der Aktien von Alibaba, der ältesten E-Commerce-Plattform in China, um eine Position auf den Titel zu eröffnen. Ferner stieg der Manager beim US-Hausbauer Lennar ein, um die Aktie anschließend zu verkaufen, als sich der Titel von den Tiefstständen im März gut erholte.

Der Manager verringerte die Position auf Gilead Sciences, dessen Aktienkurs von einigen Positivmeldungen über den Einsatz seines Medikaments Remdesivir zur Behandlung von COVID-19 beflügelt wurde. Angesichts der Eintrübung des *makroökonomischen* Umfelds in Norwegen und rekordtiefer Zinsen veräußerte der Manager die Position auf DNB bis auf einen kleinen Rest, da sich die Aktien im Vergleich zum breiter gefassten Bankensektor seit mehreren Jahren gut entwickeln.

Da die Anleger mit einer raschen Erholung der Wirtschaft, der Beschäftigung und der Unternehmensgewinne rechnen, war der Aufwärtstrend an den globalen Aktienmärkten nach den rasanten Kursverlusten im März atemberaubend. Die Finanzmärkte könnten an die Realität eines derart heiklen Umfelds anknüpfen und angesichts des liquiditätsgesteuerten Hintergrunds hält es der Manager für wichtig, sich weiterhin auf einzelne Titel, ihre langfristigen Aussichten und Bewertungen zu konzentrieren. Der Manager will nach wie vor insbesondere sicherstellen, dass das Portfolio gut für das Umfeld aufgestellt ist, das die Anlagethemen des Fonds für die Zukunft erwarten lassen.

Newton Investment Management Limited
Juli 2020

BNY MELLON LONG-TERM GLOBAL EQUITY FUND

Die Anteilsklasse A des Fonds erzielte im sechsmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -5,03 %. Im Vergleich dazu erzielte der MSCI World NR Index -5,82 % und der Lipper Global – Equity Global Sektordurchschnitt -5,97 %. Alle Angaben in Euro.

Im ersten Quartal 2020 verzeichneten einige führende Indizes nach neuen Höchstständen so umfangreiche Kursverluste wie zuletzt während des Crashes 1987. Die Maßnahmen zur Eindämmung des Coronavirus wirkten sich auf fast jeden Wirtschaftsbereich aus. Die globalen Aktienmärkte erholten sich jedoch im zweiten Quartal 2020 deutlich. Ungeachtet einer Flut von Negativmeldungen wurde die Anlegerstimmung durch die außerordentlichen *geld-* und *fiskalpolitischen* Stimulierungsmaßnahmen, die fast weltweit zur Wiederankurbelung des Wirtschaftswachstums eingesetzt werden, sowie durch die Lockerung der Eindämmungsmaßnahmen in verschiedenen Ländern angesichts des Abklingens der Pandemie gestärkt.

IT-Aktien lieferten den größten absoluten Beitrag zum Fondsergebnis, obgleich auf relativer Basis das begrenzte Engagement des Fonds im unterdurchschnittlichen Finanzsektor den größten Performancebeitrag beisteuerte.

In diesem Halbjahr setzten Anleger auf Wachstumsthemen, die weniger unter der Coronakrise leiden. Die Pandemie hat die Annahme von IT-Produkten und -Dienstleistungen beschleunigt. Das könnte die langfristigen Wachstumsaussichten für Microsoft Corporation, das den größten absoluten Performancebeitrag lieferte, und für den Publishing-Softwarespezialisten Adobe untermauern, der von der zunehmenden Verlagerung ins Homeoffice profitiert. Auch der japanische Sensorhersteller Keyence zählte zu den Performancespitzenreitern und gab im April robuste Ergebnisse für das vierte Quartal bekannt. Auch wenn die kurzfristigen Aussichten für das Unternehmen mit einer gewissen Vorsicht beurteilt werden, könnten

Globale Aktienmärkte Forts.

BNY MELLON LONG-TERM GLOBAL EQUITY FUND Forts. seine *diversifizierten* Aktivitäten im Industriesektor und die Erholung in China den Umsatz unterstützen.

Aktien, die im Zentrum der pandemiebedingten Turbulenzen standen, hatten das Nachsehen. Das Catering-Unternehmen Compass Group büßte kurzfristig aufgrund des Lockdowns ein. Da es voraussichtlich zu einer Branchenkonsolidierung kommen wird und Unternehmen, die ihre Mitarbeiter nicht langfristig ins Homeoffice schicken können, weiterhin Bedarf haben, sind die längerfristigen Aussichten für dieses finanzstarke Unternehmen nach Einschätzung des Managers glänzend. Energieaktien von EOG Resources und Schlumberger tendierten im Berichtszeitraum schwach, da sich der anfängliche Angebotsschock in Saudi-Arabien und der pandemiebedingte Nachfragerückgang im Ölpreis niederschlugen.

Zu den im Berichtszeitraum neu eröffneten Positionen zählten das führende Gensequenzierungsunternehmen Illumina, das in Bereichen von der Krebsforschung bis zur Landwirtschaft tätig ist, und Texas Instruments, das auf dem Markt für analoge Halbleiter eine dominierende Stellung innehat.

Zu den nennenswerten Veräußerungen gehörte auch Starbucks. Vor dem Hintergrund des aktuellen Umfelds bestanden nach Einschätzung des Managers nicht quantifizierbare Abwärtsrisiken für die kurzfristige Geschäftstätigkeit und große Bedenken aufgrund der schwachen Bilanz. Gilead Sciences und Schlumberger wurden ebenfalls verkauft, wobei Letzterer angesichts der eingetrübten Aussichten und der erhöhten Bilanzrisiken abgestoßen wurde.

Kurzfristig könnte es erneut *Volatilität* am Aktienmarkt geben. Trotz der Bemühungen um eine Rückkehr zur Normalität bleibt abzuwarten, was die „neue Normalität“ für viele Länder bedeutet, da die Unsicherheit über das vollständige Ausmaß des pandemiebedingten wirtschaftlichen Schadens groß ist. Die aktuellen wirtschaftlichen Turbulenzen unterstreichen die Einschätzung des Managers, dass sich Anleger auf finanzstarke, innovative Unternehmen konzentrieren müssen, die von langfristigen Wachstumstrends profitieren und gleichzeitig die bevorstehenden kurzfristigen Herausforderungen meistern können.

Walter Scott & Partners Limited
Juli 2020

Regionale Aktienfonds

BNY MELLON ASIA RISING STARS FUND

Die Anteilsklasse USD A (Acc.) des Fonds erzielte im sechsmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -7,86 %. Im Vergleich dazu verzeichnete der MSCI AC Asia Small Cap NR Index -8,35 % und der Sektordurchschnitt des Lipper Global – Equity Asia Pacific Small & Mid Cap -6,41 %. Alle Angaben in USD.

Die Gewichtung des Fonds im Segment asiatische Aktien ohne Japan betrug 46,7 % und im Bereich japanische Small Caps 51,4 %. Der Fonds hielt am Ende des Berichtszeitraums 131 Titel im Segment asiatische Aktien ohne Japan und 30 Titel im Segment japanische Small Caps.

Die Märkte blieben in der ersten Jahreshälfte *volatil*, was hauptsächlich auf den Ausbruch der Coronapandemie zurückzuführen war. Im ersten Quartal kam es zu einem starken Ausverkauf an den Märkten, gefolgt von einer Erholung im zweiten Quartal. Das Aktiensegment Asien ohne Japan des Fonds erzielte beim Ausverkauf im ersten Quartal eine Outperformance, hinkte jedoch der Erholung im zweiten Quartal hinterher und lag schließlich im sechsmonatigen Berichtszeitraum unter dem Vergleichsindex.

Dieses Segment war am Ende des Berichtszeitraums fast vollständig investiert, wobei Hongkong/China, Indien und Indonesien die größten Länder-Exposures waren.

Trotz der Marktvolatilitätschätzungen der Manager die Aussichten für Aktien asiatischer *Small-* und *Mid-Caps* weiterhin positiv ein. *Small-* und *Mid-Cap-* Unternehmen weisen in der Regel höhere Wachstumsraten auf. Hinzu kommt, dass unzureichende Informationen bei der Anlageklasse *Small-* und *Mid-Caps* aufgrund von uneinheitlichen Research-Ergebnissen auf der Verkaufsseite zu Fehlbewertungen führen können, die Stock-Pickern die Gelegenheit bieten, überdurchschnittliche Renditen für Anleger zu erwirtschaften, indem sie in diese fehlbewerteten Aktien investieren.

Das japanische *Small-Cap*-Segment des Fonds entwickelte sich im sechsmonatigen Berichtszeitraum erfreulich. Die Aktienausswahl lieferte den größten positiven Performancebeitrag.

Auf Branchenebene steuerten die Bereiche Versicherung, Information und Kommunikation positiv zum Ergebnis bei, in denen der Fonds im Vergleich zur Benchmark *übergewichtet* war, ebenso Maschinenbau, wo der Fonds *untergewichtet* war. Als größte Verlustbringer erwiesen sich die *übergewichteten* Sektoren Elektrogeräte und Dienstleistungen sowie das fehlende Engagement im Pharmasektor.

Auf Einzeltitelebene trugen vor allem TechMatrix (Systemintegration und IT-Lösungen) eGuarantee (Garantie-

REGIONALE AKTIENFONDS Forts.

BNY MELLON ASIA RISING STARS FUND Forts.

dienstleistungen für Konten und Wechselforderungen) und BayCurrent Consulting zur Performance bei, das umfassende Beratungsdienstleistungen anbietet. Die größten Verlustbringer waren Vision, ein führender Anbieter mobiler WiFi-Router-Mietservices im Ausland, Sanken Electric, das diskrete Halbleiter und analoge integrierte Schaltkreise herstellt, und Tomy, ein führender Spielzeughersteller.

Während des Berichtszeitraums stieg der Fonds bei Insource ein. Das Unternehmen bietet Schulungen für Unternehmen und offene Business-Kurse an. Die Position auf den Hersteller von Hochleistungswerkzeugmaschinen Star Micronics wurde verkauft. Ende Juni war der Fonds in den Bereichen Dienstleistungen, Elektrogeräte und sonstige Finanzierungsgeschäfte *übergewichtet*.

Regierungen weltweit haben drastische Maßnahmen ergriffen, um die Ausbreitung des Coronavirus einzudämmen und sowohl *geld-* als auch *fiskalpolitische* Hilfe zu bieten. Der Manager ist unverändert optimistisch. Wann die Talsohle am Markt erreicht wird, lässt sich zwar nur schwer vorhersagen und aus Furcht vor einer zweiten Viruswelle könnte es zu Kursverlusten kommen. Dennoch erwartet der Manager, dass der Aktienmarkt mittelfristig ebenfalls ein besseres Niveau erreichen wird. In puncto Strategie ist der Manager der Ansicht, dass viele Aktien des Fonds verkauft wurden und daher inzwischen attraktiv bewertet sind. Diese hat er aufgestockt. Finanziert hat er dies durch den Verkauf von Aktien, die sich relativ gut behauptet haben.

BNY Mellon Asset Management Japan Limited
Juli 2020

BNY MELLON ASIAN EQUITY FUND

Die Anteilsklasse USD A des Fonds erzielte im sechsmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 5,28%, verglichen mit einer Rendite von -6,02% für den MSCI AC Asia Pacific ex Japan TR Index und -6,64% für den Lipper Global – Equity Asia Pacific ex Japan Sektordurchschnitt. Alle Angaben in US-Dollar.

Der Fonds erwirtschaftete einen positiven Ertrag, der deutlich über der Benchmark lag, und erwirtschaftete trotz des COVID-19-Schocks ein beachtlich positives Ergebnis. Asiatische *Aktien* verzeichneten genau wie andere globale Märkte einen starken coronabedingten Marktabschwung im Februar und März, bevor sie sich im zweiten Quartal 2020 etwas erholten.

Die Aktienausswahl zahlte sich vor allem in China kräftig aus. Auf Sektorebene war sie vor allem im Bereich Informationstechnologie besonders günstig. Die Sektorallokation verhalf dem Fondsergebnis ebenfalls nach oben, wobei sich die erhebliche *Übergewichtung*

von *Nicht-Basiskonsumgütern* und die *Untergewichtung* von Finanztiteln günstig auf die Performance auswirkten. Der Fonds hielt keine Ölk Aktien.

Auf Titelebene hat sich der Kurs der chinesischen Online-Bildungsaktie GSX Techedu mehr als verdoppelt, da die Anleger aufgrund des starken Anstiegs der Anmeldungen für die Online-Kurse im Berichtszeitraum eine langfristig starke Gewinndynamik erwarten. Das half auch New Oriental Education nach oben, die ebenfalls kräftig zulegte und von einem ähnlich großen Vertrauen der Anleger auf das Geschäftsmodell getragen wurde. Der Fonds profitierte ferner vom Online-Essenslieferanten Meituan Dianping, der in einer Zeit robust tendierte, die für Laufkundschaft-orientierte Unternehmen schwierig war. Auch der Lithium-Batterie-Hersteller Samsung SDI erzielte aufgrund seiner sehr vorteilhaften Position in der Lieferkette für Elektrofahrzeuge gute Ergebnisse. Einige Fondspositionen in Indien bremsen die Performance, da sie unter der Furcht des Marktes vor erheblichen Auswirkungen von COVID-19 auf den indischen Konsumsektor litten. Der Manager beurteilt die Aussichten für die nächsten Jahre jedoch äußerst optimistisch und hält die Positionen für robust. Die Korrektur am indischen Markt belastete die Positionen auf den Fahrzeughersteller Maruti Suzuki, den Hypothekenfinanzierer HDFC und den Kinobetreiber PVR, die in absehbarer Zukunft eine kleine Bezugsrechtsemission durchführen werden, um auf der sicheren Seite zu sein.

Bei den Portfolioveränderungen gab es eine neue Position auf Elite Material, Spezialist für hochwertige kupferkaschierte Lamine. Das Unternehmen gewinnt dank seiner High-End-Produkten Marktanteile und wird durch starke Trends wie 5G, Cloud Computing und Elektrofahrzeuge unterstützt.

Eine Position beim Mautstraßenbetreiber IRB Invit wurde ebenfalls eröffnet. Diese ist angesichts des hohen Risikos allerdings klein, obwohl die Aktie hohe Cashflows erzeugt und die Urbanisierung Indiens im Laufe der Zeit zu steigendem Verkehrswachstum führt. Der Manager nahm daneben eine weitaus größere Position auf den Hersteller von Solarenergie-Produkten LONGi Green Energy hinzu. Dieser weist ein attraktives Wachstumspotenzial auf, da die Solarwirtschaft eine rasche Akzeptanz fördert, und der Manager der Ansicht ist, dass es sich hier um das absolut führende Technologieunternehmen mit beeindruckenden ESG-Verbesserungen für ein chinesisches Unternehmen handelt.

Nach einer starken Performance, die die chinesische Gesundheitsaktie 3SBio zu einem der wichtigsten Performancetreiber 2019 gemacht hatte, wurde die verbleibende Position verkauft. Das indische Finanzdienstleistungsunternehmen Edelweiss wurde ebenfalls veräußert, da es aufgrund seiner Abhängigkeit

REGIONALE AKTIENFONDS Forts.

BNY MELLON ASIAN EQUITY FUND Forts.

vom Großkreditmarkt in die indische Liquiditätskrise geraten war. Godrej Consumer Products und Hindustan Unilever wurden ebenfalls glattgestellt, wobei Letztere im ersten Quartal besonders defensiv agiert hatte.

Der Manager ist der Ansicht, dass das annualisierte Renditepotenzial für den Fonds ausgehend vom aktuellen Niveau sehr attraktiv ist, da das zugrunde liegende Wachstum der Unternehmen in der Regel fast 20 % beträgt. Das langfristige Abwärtsrisiko ist nach Einschätzung des Managers sehr gering, sofern es nicht zu einer ausgedehnten weltweiten Rezession kommt. Robuste Schwellenländer wie China und Indien könnten vor diesem Hintergrund Industrieländer übertreffen, insbesondere wenn sich die US-Dollar-*Hausse* umzukehren beginnt. Gleichwohl sollten bestimmte Aktien gemieden werden, weshalb sich ein äußerst aktiver Ansatz empfiehlt.

Newton Investment Management Limited
Juli 2020

BNY MELLON ASIAN INCOME FUND

Die Anteilsklasse USD W (Inc.) des Fonds erzielte im sechsmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -16,19 %. Im Vergleich dazu erzielte der FTSE Asia Pacific ex Japan TR Index -5,95 % und der Lipper Global – Equity Asia Pacific ex Japan Sektordurchschnitt -6,64 %. Alle Angaben in US-Dollar.

Der Fonds erwirtschaftete eine Negativrendite und hielt nicht mit seinem Vergleichsindex Schritt. Asiatische *Aktien* verzeichneten im Februar einen starken coronabedingten Marktabschwung, bevor sie sich im letzten Quartal etwas erholten.

Sowohl die Titelauswahl als auch die Sektorallokation belasteten und bescherten ein schwaches relatives Ergebnis. Der Verzicht auf ein Engagement bei Tencent aufgrund seiner geringen *Rendite* belastete, wobei der Aktienkurs davon profitierte, dass das Unternehmen sich die Ausgangssperren zunutze machte (aufgrund seines sozialen Netzwerks und der Gaming-Aktivität). Das fehlende Exposure auf Alibaba aufgrund der mangelnden *Rendite* bremste die Performance gegenüber dem Vergleichsindex ebenfalls. Auch die Aktien von Link REIT, die aufgrund der anhaltenden sozialen Unruhen in Hongkong fielen, schmälerten das Fondsergebnis. Bei der Länderallokation wirkten sich die deutliche *Untergewichtung* des Fonds in China und die *Übergewichtung* Singapurs negativ auf das Fondsergebnis aus. Die Technologiepositionen des Fonds erwiesen sich dagegen als günstig. Taiwan Semiconductor gehörte zu den Top-Performern und profitierte von einer starken Gewinndynamik dank eines glänzenden Chipherstellungsgeschäfts, in dem sich die wachsende Halbleiternachfrage widerspiegelt. Samsung Electronics

erzielte ebenfalls eine starke Performance in diesem Sektor und wurde durch eine positive Gewinndynamik beflügelt. Die Position auf Hong Kong Exchanges & Clearing wirkte sich ebenfalls günstig aus, was hauptsächlich auf mehr Zweitnotierungen von in den USA börsennotierten chinesischen Unternehmen zurückzuführen ist.

Elite Material, Lieferant von kupferkaschierten Laminaten für Leiterplatten, wurde ins Portfolio aufgenommen. Das Unternehmen gewinnt dank seiner High-Endprodukte Marktanteile hinzu.

Der Manager investierte auch in Jiangsu Expressway, das Mautstraßen in der chinesischen Provinz Jiangsu betreibt. Langfristig könnte das Unternehmen stark wachsen. Es bietet eine sichere *Dividendenrendite* von 5,5 %. Außerdem kam eine neue Position auf Chinas führenden Lebensversicherer Ping An Insurance hinzu. Die Wachstumschancen für Versicherungsprodukte sind in China nach Ansicht des Managers attraktiv. Im Technologiesektor wurde die Position auf Quanta Computer (Taiwan) verkauft, da der Manager aufgrund verschiedener Unterbrechungen der Lieferkette weltweit bezweifelt, dass die hohe Dividendenrendite aufrechterhalten bleiben kann. Auch die Position in Taiwan Mobile wurde aufgrund der geplanten höheren Investitionsausgaben und des Wettbewerbs verkauft. Schließlich wurde die Position auf Sydney Airport angesichts der Schwierigkeiten für die Reisebranche veräußert.

Der Fonds konzentriert sich auf Investitionen in Unternehmen, die nach Ansicht des Managers den gegenwärtigen Abschwung überstehen und auf Wachstumskurs zurückkehren können, sobald sich das Geschäftsklima normalisiert. Starke Unternehmen werden gestärkt aus der Krise hervorgehen, während einige schwächere Firmen die Krise vermutlich nicht überstehen werden. Der Fonds ist in einige der am besten geführten Unternehmen Asiens mit soliden Bilanzen und nachhaltigen Geschäftsmodellen investiert. Allerdings sieht der Manager die Aussichten für die Finanzmärkte und die Weltwirtschaft skeptisch. Trotz der *fiskal-* und *geldpolitischen* Unterstützung durch Regierungen und Zentralbanken sind die Märkte nervös. Der Manager bezweifelt stark, dass es zu einer V-förmigen Erholung kommen wird.

Newton Investment Management Limited
Juli 2020

BNY MELLON BRAZIL EQUITY FUND

Die Anteilsklasse USD A des Fonds erzielte im sechsmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -33,58 %, verglichen mit einer Rendite von -37,80 % für den MSCI Brazil 10/40 NR Index und -35,79 % für den Lipper Global – Equity Brazil Sektordurchschnitt. Alle Angaben in US-Dollar.

REGIONALE AKTIENFONDS Forts.

BNY MELLON BRAZIL EQUITY FUND Forts.

Auf Sektorebene kamen die größten Positivbeiträge zum Fondsergebnis von der Titelauswahl bei *Nicht-Basiskonsumgütern* und in der Lebensmittelverarbeitung sowie von der *Untergewichtung* bei Banken. Die Titelauswahl im Softwaresegment, die *Übergewichtung* im Vergleich zur Benchmark bei globalen Investitionsgütern sowie die *Untergewichtung* und Titelauswahl bei Investitionsgütern schmälerten das Ergebnis dagegen.

Auf Titelebene profitierte der Fonds von seinem Engagement auf B2W, B3 und Marfrig. Die starke Wertentwicklung der B2W-Aktien war dem steilen Umsatzzanstieg nach dem Ausbruch der Corona-Pandemie in Brasilien zuzuschreiben. Das Geschäftsmodell des Unternehmens beinhaltet ein starkes Artikelsortiment, eine robuste Logistik-Plattform und eine große Markenbekanntheit und hat mehrere Neukunden, einen Anstieg der wiederkehrenden Käufe und höhere Volumen pro Kunde beschert. Die B3-Aktien entwickelten sich im sechsmonatigen Berichtszeitraum erfreulich, wobei das Börsenvolumen stark zunahm und die Zahl neuer Privatkunden einen Rekord markierte. Marfrig-Aktien verzeichneten eine positive Performance, da das Unternehmen äußerst positive Trends im Nordamerika- und Südamerika-Geschäft aufweist. Im Nordamerikageschäft werden mit Rindfleisch solide Gewinne erwirtschaftet bei mittelfristig positivem Rinderangebot. Das Südamerikageschäft profitiert zudem von der Abwertung der Lokalwährungen und mehr Exporten nach China, was sich positiv auf das Ergebnis auswirkt.

Zu den Verlustbringern auf Einzeltitelebene gehörten Embraer, Banken (Itaú, Banco do Brasil und Bradesco) sowie BR Malls. Die Aktien von Embraer litten unter der Eskalation der Pandemie und dem Rückgang des Flugreisemarktes. Die Ankündigung der Beendigung des Joint Ventures mit Boeing brachte ebenfalls Verluste ein. Die Itaú-Aktien entwickelten sich genau wie andere im Fonds enthaltene Bankaktien, unter anderem von Banco do Brasil und Bradesco, enttäuschend, da Anleger ein Szenario niedrigerer Zinsen, verschärften Wettbewerbs durch Mitbewerber im Bereich Finanztechnologie und höherer *Ausfallquoten* angesichts einer voranschreitenden Rezession einpreisen. Auch die Aktien von BR Malls bremsen das Fondsergebnis im sechsmonatigen Berichtszeitraums, da die Einkaufszentren ihren Betrieb aufgrund der Kontaktbeschränkungen vorübergehend schlossen und Anleger noch die mittelfristigen Auswirkungen auf ihre Geschäftstätigkeit analysieren.

In der ersten Jahreshälfte stieg der Fonds bei folgenden Titeln ein: Bradespar (Bergbau), JBS (Lebensmittelverarbeitung) und Yduqs (Bildung). Die Positionen auf CCR, Metalurgica Gerdau, Tupy und Vivara wurden dagegen verkauft.

Der Manager beurteilt die Aussichten für den brasilianischen Aktienmarkt in der zweiten Jahreshälfte 2020 vorsichtig

optimistisch. Vor der Pandemie waren die Binnenkonjunktur und viele Stimmungsbarometer solide. Die Wirtschaft des Landes hat stark unter dem Lockdown gelitten. Die Zinsen sind historisch niedrig und die *fiskal-* und *geldpolitischen* Maßnahmen scheinen einigen besonders angeschlagenen Unternehmen wirksam zu helfen. So waren die aktuellen Daten besser als ursprünglich prognostiziert.

ARX Investimentos Ltda
Juli 2020

BNY MELLON DYNAMIC U.S. EQUITY FUND

Die Anteilsklasse USD A (Inc.) des Fonds beendete den sechsmonatigen Berichtszeitraum mit -1,63 %. Im Vergleich dazu verzeichnete der S&P 500 Index NR eine Rendite von -3,37 %, jeweils bezogen auf den US-Dollar.

Der Fonds verbuchte ein negatives Ergebnis, übertraf aber dank der *Long-Position* auf *US-Treasuries* die Benchmark. Anfang 2020 hielt der Fonds ein Aktienengagement von 110 %, wobei 10 % auf *Call-Optionen* entfielen. *Optionen* waren während des extremen Ausverkaufs ab 20. Februar entscheidend. Der S&P 500 brach in den darauf folgenden 23 Handelstagen um ein Drittel ein. Als sich der Ausverkauf am Markt verstärkte, fiel das Aktienengagement des Fonds bis zum 10. März rasant auf 100 %, da die Optionsposition effektiv wertlos verfiel. Der Manager musste das Risiko nicht mit teuren oder ungewöhnlichen Transaktionen senken. Der Fonds setzt systematisch *Optionen* ein, was wie erwartet funktioniert hat.

Während das Aktienengagement auf neutral (100 %) gesunken ist, hat auch die Allokation zugunsten lang laufender *US-Treasuries*, die eine Absicherung des Aktienrisikos und einen allgemeinen Verfallsschutz bietet, wie geplant funktioniert. Der Fonds startete 2020 mit einer 10 %-Allokation in lang laufende *Treasury-Futures*. Mitte Januar, als die Rendite lang laufender *Treasuries* über 2,3 % lag, erhöhte der Manager die Allokation auf 20 %. *Treasuries* mit langen Laufzeiten verbuchten eine Rally, da Anleger angesichts der kräftigen Verluste am Aktienmarkt in „sichere Häfen“ flüchteten. Vor dem Hintergrund der steilen Rally von *Treasuries* aus dem langen Laufzeitspektrum, erwies sich die Allokation als entscheidender Renditetreiber.

Angesichts deutlich niedrigerer Gewinnerwartungen und wirtschaftlicher Frühindikatoren behielt der Fonds im zweiten Quartal seine *defensive* Position bei. Die Aktien-Zielallokation wurde Ende April nach anhaltend schwachen Gewinnen und *makroökonomischen* Daten auf 90 % reduziert. Das *Treasury-Exposure* des Fonds blieb konstant bei 10 %, da der Fonds nach Ansicht des Managers aufgrund seiner negativen *Korrelation* weiterhin einen attraktiven Schutz gegen das Aktienrisiko darstellt.

Mellon Investments Corporation
Juli 2020

REGIONALE AKTIENFONDS Forts.

BNY MELLON GLOBAL EMERGING MARKETS FUND

Die Anteilsklasse USD A des Fonds erzielte im sechsmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 2,15%, verglichen mit einer Rendite von -9,78% für den MSCI Emerging Markets NR Index und -10,36% für den Lipper Global – Equity Emerging Markets Global Sektordurchschnitt. Alle Angaben in US-Dollar.

Der Fonds verzeichnete trotz des COVID-19-Schocks eine positive Rendite und übertraf seinen Vergleichsindex deutlich. Schwellenländeraktien verzeichneten genau wie andere globale Märkte im Berichtszeitraum eine erhöhte *Volatilität* und gaben angesichts der weltweiten Ausbreitung von COVID-19 kräftig nach, bevor sie sich im letzten Quartal wieder erholten. Der Manager nutzte die Kursschwankungen, um einige Positionen im Anschluss an eine Outperformance zu verkaufen und ausgewählte, zyklischere Positionen, die stark eingebüßt hatten, aufzustocken. Gleichzeitig ließ er die umfangreiche Kernposition auf Internet- und technologiebasierte Unternehmen unverändert, die sich deutlich besser behaupteten als der Markt.

Die Titelauswahl war im Berichtszeitraum regional vor allem in China und Südkorea sowie in den Sektoren Informationstechnologie und *Nicht-Basiskonsumgüter* der Haupttreiber für den relativen Ertrag. Die Sektorallokation steuerte allerdings ebenfalls stark positiv bei, allen voran die *Übergewichtung von Nicht-Basiskonsumgütern* in erster Linie bei Internetunternehmen. Die Aktien von Meituan Dianping, Chinas führendem Lebensmittel-Lieferdienst und Anbieter von Verbraucherdienstleistungen schnellten nach oben, nachdem die Ergebnisse für das erste Quartal die Erwartungen übertroffen hatten. Der Lithiumbatterie-Hersteller Samsung SDI lieferte einen stark positiven Performancebeitrag und wurde durch strengere globale Emissionsziele und die steigende Nachfrage in der gesamten Lieferkette für Elektrofahrzeuge sowie durch den zunehmenden Wettbewerbsvorteil seiner führenden Technologie beflügelt. Der Aktienkurs der chinesischen Bildungsplattform GSX Techedu entwickelte sich erfreulich und hat sich mehr als verdoppelt, da sich der Gewinn dank einer regen Nachfrage nach ihren Online-Kursen dynamisch entwickelte. Die Position auf die chinesische New Oriental Education profitierte von einem ähnlichen Thema. Für Enttäuschung sorgten dagegen indische Aktien wie der Fahrzeughersteller Maruti Suzuki, der Hypothekenfinanzierer HDFC und der Kinobetreiber PVR. Der indische Markt hielt trotz robuster Bilanzen und starker langfristiger Wachstumsaussichten nicht mit anderen Schwellenländern Schritt, da die Auswirkungen der Corona-Pandemie als stärker eingestuft wurden. Jeweiler Titan verzeichnete beispielsweise Kursverluste, nachdem das Unternehmen seine Umsatzprognosen gesenkt hatte. Dennoch stockte der Manager solche Titel auf, da sie sich seiner Ansicht nach rasch erholen werden

und er ihre langfristigen Wachstumsaussichten weiterhin für ausgezeichnet hält.

Die Portfolioveränderungen betrafen unter anderem die Eröffnung einer neuen Position auf die in Hongkong börsennotierte Meituan Dianping. Das schnell wachsende E-Commerce-Unternehmen ist auf Lebensmittellieferungen spezialisiert und nach Ansicht des Managers gut positioniert, um sein Dienstleistungsangebot zu erweitern. Zudem könnte es durchaus ein attraktives Rentabilitätsniveau erreichen. Der Wert entwickelte sich rasch zu einer der größten Positionen. Zudem kam eine Position auf Elite Material (Anbieter von hochwertigen kupferkaschierten Laminaten) hinzu. Das Unternehmen gewinnt dank seiner High-Endprodukte Marktanteile und wird durch starke Trends wie 5G, Cloud Computing und Elektrofahrzeuge unterstützt. Bei HeadHunter wurde eine Position eröffnet. Das Unternehmen ist die führende Online-Plattform für Personalbeschaffung in Russland und der Gemeinschaft Unabhängiger Staaten. Wie viele andere Online-Personaldienstleister ist auch HeadHunter thematisch attraktiv, da sich seine Aktivitäten durch die Verbreitung von Smartphones und verbesserte Netzwerke zunehmend ins Internet verlagern.

Zu den wichtigsten Verkäufen gehörten das brasilianische Reiseunternehmen CVC, Godrej Consumer Products in Indien und das indische Finanzunternehmen Edelweiss.

Der Manager ist der Ansicht, dass das annualisierte Renditepotenzial für den Fonds ausgehend vom aktuellen Niveau sehr attraktiv ist, da das zugrunde liegende Wachstum der Unternehmen in der Regel fast 20% beträgt. Das langfristige Abwärtsrisiko ist nach Einschätzung des Managers sehr gering, sofern es nicht zu einer ausgedehnten weltweiten Rezession kommt. Robuste Schwellenländer wie China und Indien könnten vor diesem Hintergrund Industrieländer übertreffen, insbesondere wenn sich die mehrjährige Hausse des US-Dollars umzukehren beginnt. Gleichwohl sollten bestimmte Aktien gemieden werden, weshalb sich ein sehr aktiver Ansatz empfiehlt.

Newton Investment Management Limited
Juli 2020

BNY MELLON JAPAN SMALL CAP EQUITY FOCUS FUND

Die Anteilsklasse JPY C des Fonds erzielte im sechsmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -7,46%, verglichen mit -11,20% für den Russell/Nomura Small Cap TR Index und -8,13% für den Lipper Global -Equity Japan Small & Mid Cap Sektordurchschnitt. Alle Angaben in japanischen Yen.

Der größte Positivbeitrag zur Fondsperformance kam von der Titelauswahl. Auf Branchenebene steuerten die Bereiche Versicherung, Information und Kommunikation

REGIONALE AKTIENFONDS Forts.

BNY MELLON JAPAN SMALL CAP EQUITY FOCUS FUND

Forts.

positiv zum Ergebnis bei, in denen der Fonds im Vergleich zur Benchmark *übergewichtet* war, sowie Maschinenbau, wo der Fonds *untergewichtet* war. Als größte Verlustbringer erwiesen sich die *übergewichteten* Sektoren Elektrogeräte und Dienstleistungen sowie das fehlende Engagement im Pharmasektor.

Die stärksten Positivbeiträge auf Einzeltitelebene kamen unter anderem von TechMatrix (Systemintegration und IT-Lösungen) BayCurrent Consulting (umfassende Beratungsdienste) und Wacom (Grafiktablets und verwandte Produkte). Die größten Verlustbringer waren Vision, ein führender Anbieter mobiler WiFi-Router-Mietservices im Ausland, Sanken Electric, Hersteller diskreter Halbleiter und analoger integrierter Schaltkreise und Tomy, ein führender Spielzeughersteller.

Drei neue Positionen wurden eröffnet, unter anderem auf M-UP, den Betreiber von Fanclub-Websites und eines elektronischen Ticketgeschäfts, BrainPad, das seine Kunden bei der Steigerung ihres Geschäftsergebnisses mit Datenanalysen unterstützt, und Takeuchi, einer der größten Hersteller von Baumaschinen wie kompakten Hydraulikbaggern und Raupenladern. Im Gegenzug veräußerte der Manager V-Cube, das Plattformen und Software für Videokonferenzdienste anbietet, Nichias, Hersteller von Bau- und Isoliermaterial, und Open Door, Betreiber eines Reisevergleichsportals.

Darüber hinaus erhöhte der Manager die Gewichtung bestehender Positionen, die vom Markt verkauft wurden. Finanziert wurde dies mit Hilfe von Titeln, die sich relativ gut gehalten haben.

Ende Juni 2020 hielt der Fonds 30 Aktien, genau wie Ende Dezember 2019. Ende Juni war der Fonds in den Bereichen Dienstleistungen, Elektrogeräte und sonstige Finanzierungsgeschäfte *übergewichtet*. Die Sektorallokationsentscheidungen des Fonds resultieren in erster Linie aus der Bottom-up-Titelauswahl.

Zu den größten *Übergewichtungen* im Fonds gehören der Hersteller von Druckfarben Sakata, Techmatrix; Vector, ein PR- und Werbeunternehmen, das einfache Benachrichtigungsdienste und das Internet nutzt und führender Anbieter von Pressemitteilungen ist; RS Technologies, führender Anbieter von Silizium-Wafer-Reclaim-Dienstleistungen für die Halbleiterindustrie; und Wacom.

Regierungen rund um den Globus haben drastische Maßnahmen ergriffen, um die Ausbreitung von COVID-19 einzudämmen und *geld-* sowie *fiskalpolitische* Hilfspakete zu schnüren. Der Manager ist nach wie vor der Ansicht, dass

die Wirtschaftslage sich mittelfristig deutlich verbessern könnte.

Wann genau die Talsohle am Markt erreicht wird, lässt sich zwar nur schwer vorhersagen, und aus Angst vor einer zweiten Viruswelle könnte es zu Kursverlusten kommen. Dennoch bleibt der Manager optimistisch. In puncto Strategie ist der Manager der Ansicht, dass viele Aktien des Fonds verkauft wurden und daher inzwischen attraktiv bewertet sind. Diese Titel hat er aufgestockt. Finanziert hat er dies durch den Verkauf von Aktien, die sich relativ gut behauptet haben.

Der Manager geht davon aus, dass er sich sobald sich die Wirtschaft stärker normalisiert hat, wieder auf das längerfristige Thema konzentrieren kann, dass Japan nach vielen Jahren eines nominalen *Bruttoinlandsprodukts (BIP)* in eine Expansionsphase übergegangen ist.

BNY Mellon Asset Management Japan Limited
Juli 2020

BNY MELLON S&P 500® INDEX TRACKER

Die Anteilsklasse USD A des Fonds erzielte im sechsmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -4,03%, verglichen mit einer Rendite von -3,37% für den S&P 500 NR Index und -4,06% für den Lipper Global – Equity US-Sektordurchschnitt, jeweils in US-Dollar.

Der einjährige annualisierte Tracking Error des Fonds lag am 30. Juni 2020 bei 0,03%. Der Tracking Error steht in Zusammenhang mit Quellensteuern und den mit der alltäglichen Verwaltung verbundenen Kosten. Der erwartete Tracking Error des Teilfonds liegt bei 0,10%. Indes ist der Unterschied zwischen der Wertentwicklung des Fonds und des S&P 500-Index auf die Marktwirkung der Gebühren und Kosten zurückzuführen, die in Zusammenhang mit der alltäglichen Verwaltung des Fonds anfallen.

Der angegebene annualisierte Tracking Error wurde anhand der monatlichen Erträge vor Gebühren für den betreffenden Zeitraum errechnet. Der Tracking Error ist die *Standardabweichung* der annualisierten relativen Erträge (multipliziert mit der Quadratwurzel aus 12).

Weitere Kommentare zum Fonds entnehmen Sie bitte dem Marktüberblick am Anfang dieses Dokuments.

Die Strategie zielt 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
Juli 2020

REGIONALE AKTIENFONDS Forts.

BNY MELLON SMALL CAP EUROLAND FUND

Die Anteilsklasse Euro A des Fonds erzielte im sechsmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -12,48%, verglichen mit einer Rendite von -12,56% für den S&P EuroZone Small Cap TR Index und -11,22% für den Lipper Global – Equity EuroZone Small & Mid Cap Sektordurchschnitt. Alle Angaben in Euro.

Die Aktienmärkte litten in der ersten Jahreshälfte 2020 aufgrund der globalen Auswirkungen der COVID-19-Pandemie unter einer starken *Volatilität*. Als die Wirtschaftstätigkeit zum Erliegen kam, stürzten Aktien im ersten Quartal ab, erholten sich jedoch im zweiten Quartal, als die Weltwirtschaft sich wieder öffnete und sich die Hoffnung auf einen potenziellen Impfstoff belebte. Am Anfang des Berichtszeitraums rief Präsident Donald Trump den nationalen Notstand in den USA aus, und der Kongress verabschiedete ein 2 Bio. US-Dollar schweres Konjunkturpaket. Ende des zweiten Quartals erlebten die Märkte das beste Quartal seit mehr als zwei Jahrzehnten, was zum Teil auf umfangreiche Stimulierungsmaßnahmen der Notenbank Federal Reserve (Fed) zurückzuführen war. Die Arbeitslosenquote stieg zu Beginn des Quartals auf ein Rekordhoch, ging jedoch im gesamten Berichtszeitraum kontinuierlich zurück. Nachdem die Fed die Zinsen im März auf nahe Null gesenkt hatte, ließ sie sie im zweiten Quartal unverändert, während der US-Dollar stetig fiel.

Der Fonds übertraf seinen Vergleichsindex in diesem Klima. Auf Länderebene lieferte Deutschland dank der positiven Titelauswahl bei Weitem den größten Positivbeitrag zur relativen Performance. Die Positionierung und die effektive Titelauswahl bei spanischen *Aktien* trugen ebenfalls positiv bei.

Frankreich war dagegen der größte relative Verlustbringer, gefolgt von den Niederlanden. Auf Sektorebene kamen die größten relativen Performancebeiträge von *Nicht-Basiskonsumgütern* und Industrie, während Informationstechnologie und Immobilien am stärksten belasteten. Die günstige Titelauswahl im Bereich *Nicht-Basiskonsumgüter*, insbesondere in Deutschland, trug zu den relativen Ergebnissen bei. Vor allem die Position auf HelloFresh SE half dem Fondsergebnis nach oben, da das Unternehmen dreistellige Renditen erzielte.

Die ungünstige Titelauswahl bei französischen IT-Werten schmälerte das Fondsergebnis dagegen am stärksten. Im Immobiliensektor schmälerte die ungünstige Titelauswahl im Bereich Immobilienverwaltung und -entwicklung die relative Performance. Die Aktien der italienischen Immobiliengesellschaft Immobiliare Grande Distribuzione SIQ hielten nicht Schritt.

Im Berichtszeitraum gab es kaum Portfolioveränderungen. Das Exposure im Industriesegment wurde durch

neue Positionen auf Arcadis und ASTM erhöht. Im Energiesektor wurde das Exposure durch den Verkauf des niederländischen Tanklagerunternehmens Royal Vopak verringert.

Im ersten Quartal 2020 schnitten die internationalen Märkte schlechter ab als die US-Märkte. Internationale Industrieländer sind im Vergleich zu den USA tendenziell eine *zyklischere* Anlageklasse. Die Sektoren Technologie und Gesundheit machen einen großen Teil des US-Marktes aus und sind eher *defensiv*, während die Sektoren Finanzen, Energie und Industrie auf den internationalen Märkten stärker vertreten und weniger *defensiv* sind. Das wurde während des Abschwungs im ersten Quartal deutlich sichtbar.

Im zweiten Quartal 2020 setzte eine Erholung ausgehend von zuvor niedrigen Niveaus ein. Die harten Daten zu Beschäftigung, Ausgaben und Konsum hellen sich in China weiter auf. In den letzten zwei Monaten haben sich die Leitindikatoren in Industrieländern außerhalb der USA deutlich verbessert. Die unverändert kräftige und rasche *geld-* und *fiskalpolitische* Reaktion dient nach wie vor als Rückenwind für die allmähliche Erholung in Europa, Großbritannien und Japan.

Künftig rechnet der Manager in Europa und auch den USA mit einer allmählichen Wiederankurbelung der Wirtschaft, was sich bereits in den realen Wirtschaftsdaten niederschlägt. Die Europäische Zentralbank hält unbeirrt an ihrer akkommodierenden Politik fest, und das Inflationsniveau liegt deutlich unter den Zielvorgaben. Nach Einschätzung des Managers werden Anleger in den nächsten Quartalen mögliche Rückschläge im Zusammenhang mit dem Coronavirus gegen die realen Verbesserungen bei den Beschäftigungstrends und der wirtschaftlichen Normalisierung abwägen, um abzuschätzen, wie die Regierungen bei einer zweiten Welle reagieren könnten.

Der Manager hält eine Stabilisierung in den nächsten 12 Monaten durchaus für möglich, sofern sich diese Erholung fortsetzt. Allerdings wird diese konjunkturelle Erholung seines Erachtens nicht geradlinig verlaufen, obwohl die globalen Aktienmärkte im vergangenen Quartal eine „V-förmige“ Erholung verzeichnet haben. Der Manager erwartet jedoch, dass die Vergleichszahlen auf den Märkten Ende 2020 und Anfang nächsten Jahres sehr günstig ausfallen werden.

Mellon Investments Corporation
Juli 2020

BNY MELLON U.S. DYNAMIC VALUE FUND

Die Anteilsklasse USD A des Fonds erzielte im sechsmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -19,97%, verglichen mit einer Rendite von -16,26% für den

REGIONALE AKTIENFONDS Forts.

BNY MELLON U.S. DYNAMIC VALUE FUND Forts.

Russell 1000 Value TR Index und -4,06% für den Lipper Global – Equity US-Sektordurchschnitt. Alle Angaben in US-Dollar.

Die Aktienmärkte litten in der ersten Jahreshälfte 2020 aufgrund der globalen Auswirkungen der COVID-19-Pandemie unter einer starken *Volatilität*. Als die Wirtschaftstätigkeit zum Erliegen kam, stürzten *Aktien* im ersten Quartal ab, erholten sich jedoch im zweiten Quartal, als die Weltwirtschaft sich wieder öffnete und sich die Hoffnung auf einen potenziellen Impfstoff belebte. Am Anfang des Berichtszeitraums rief Präsident Donald Trump den nationalen Notstand in den USA aus, und der Kongress verabschiedete ein 2 Bio. US-Dollar schweres Konjunkturpaket. Ende des zweiten Quartals erlebten die Märkte das beste Quartal seit mehr als zwei Jahrzehnten, was zum Teil auf umfangreiche Stimulierungsmaßnahmen der Notenbank Federal Reserve (Fed) zurückzuführen war. Nachdem die Fed die Zinsen im März auf nahe Null gesenkt hatte, ließ sie sie im zweiten Quartal unverändert, während der US-Dollar stetig fiel.

In diesem Umfeld hielt der Fonds nicht mit seinem Vergleichsindex Schritt. Auf Sektorebene führten Positionen auf Finanztitel die positiven Beiträge zum relativen Fondsergebnis an, gefolgt von Titeln im IT-Sektor. Der Gesundheitssektor brachte dagegen die größten relativen Verluste ein, gefolgt von Industrie und Werkstoffen.

Im Finanzsektor trugen eine solide Titelauswahl und Positionierung im Banksegment zu den relativen Ergebnissen im Sektor bei. Die *Übergewichtung* an den Kapitalmärkten wirkte sich ebenfalls günstig aus. Im IT-Sektor wirkte sich die *Übergewichtung* im Segment Halbleiter und Halbleiterausstattung am positivsten auf die relativen Ergebnisse aus.

Der Gesundheitssektor brachte im Berichtszeitraum die größten Verluste ein, hauptsächlich wegen der ungünstigen Titelauswahl. Große Positionen im Bereich medizinische Ausrüstung und Produkte sowie die *Untergewichtung* von Pharmawerten belasteten hauptsächlich das relative Ergebnis. Die *Übergewichtung* bei angeschlagenen Fluggesellschaften sowie im Segment Luft-/Raumfahrt und Verteidigung bremste die Wertentwicklung im Industriesektor am stärksten.

Der Manager erhöhte vor Kurzem das Engagement des Fonds im Gesundheitssektor von *unter-* auf *übergewichtet*. Die Gewichtung bei Gesundheitswerten wurde durch eine Reihe neuer Positionen wie AbbVie und Eli Lilly and Company erhöht. AbbVie erzielte getragen von der optimistischen Anlegerstimmung eine Outperformance, da das Biotechnologieunternehmen den Abschluss der Übernahme von Allergan bekannt gab, nachdem

die zuständigen Behörden grünes Licht für den Deal erteilt hatten. Der Manager reduzierte das Exposure bei Kommunikationsdienstleistungen und stellte im Berichtszeitraum die Positionen auf AT&T und Comcast glatt.

Die Märkte haben sich nach den Tiefstständen von Ende März eindrucksvoll erholt, da die Wirtschaft langsam wieder geöffnet wird und die Anleger eine gewisse Normalisierung erwarten, nachdem das Schlimmste bei der Corona-Pandemie hoffentlich vorüber ist. Der Anlageansatz des Managers basiert auf dem attraktiven Zusammenspiel aus pessimistischen Erwartungen und historisch niedrigen Bewertungen. Sie bilden die Grundlage für eine potenziell solide Erholung sobald sich Umsätze und Gewinne nach der Pandemie wieder beschleunigen.

Nach der anfänglichen Erholung im April glich der Rest des zweiten Quartals einem Wechselspiel aus Risikobereitschaft und Risikoscheu. Da sich die Einkaufsmanagerindizes in China und in jüngster Zeit auch in den USA weiter von ihren niedrigen Niveaus erholen, halten Anleger in China Ausschau nach Anzeichen dafür, wie eine schrittweise Wiedereröffnung der Wirtschaft aussehen könnte. Der Manager rechnet damit, dass sich das Gewinnwachstum im zweiten Halbjahr 2020 wieder beleben wird, nachdem es in der ersten Hälfte aufgrund des negativen Angebots- und Nachfrageschocks im Zusammenhang mit dem Virus deutlich geschrumpft ist. Sobald sich die Wirtschaft langsam normalisiert, könnten großzügige Konjunkturmaßnahmen in Verbindung mit niedrigen Rohstoffpreisen das Verbrauchervertrauen zusätzlich stärken.

Die jüngsten US-Beschäftigungstrends haben die Erwartungen übertroffen, da große Bundesstaaten ihre Wirtschaft wieder öffnen. Das Verbrauchervertrauen und die starke Nachfrage im Wohnungssektor runden die jüngsten Signale für eine Erholung ab. Anleger müssen die Sorgen über den jüngsten Anstieg der Corona-Infektionen in den US-Sun-Belt-Staaten sowie in Kalifornien abwägen, um das Ausmaß und das Tempo der wirtschaftlichen Normalisierung zu bestimmen; es ist unwahrscheinlich, dass diese geradlinig verlaufen wird. Die akuteste Phase der Rezession scheint vorüber zu sein, und langsam gibt es zaghafte Anzeichen für eine Erholung.

Der Manager ist nach wie vor von der Positionierung des Fonds überzeugt und geht davon aus, dass US *Large-Caps* aufgrund der Marktverzerrung gut positioniert sind, um in den nächsten Jahren attraktive Renditen zu erzielen.

Mellon Investments Corporation
Juli 2020

REGIONALE AKTIENFONDS Forts.

BNY MELLON U.S. EQUITY INCOME FUND

Die Anteilsklasse USD C (Inc.) des Fonds erzielte während des sechsmonatigen Berichtszeitraums eine Rendite von -22,06%, verglichen mit einer Rendite von -3,37% für den S&P 500 NR Index und -17,99% für den Lipper Global – Equity US Income Sektordurchschnitt. Alle Angaben in US-Dollar.

Die Aktienmärkte litten in der ersten Jahreshälfte 2020 aufgrund der globalen Auswirkungen der COVID-19-Pandemie unter einer starken *Volatilität*. Als die Wirtschaftstätigkeit zum Erliegen kam, stürzten *Aktien* im ersten Quartal ab, erholten sich jedoch im zweiten Quartal, als die Weltwirtschaft sich wieder öffnete und sich die Hoffnung auf einen potenziellen Impfstoff belebte. Am Anfang des Berichtszeitraums rief Präsident Donald Trump den nationalen Notstand in den USA aus, und der Kongress verabschiedete ein 2 Bio. US-Dollar schweres Konjunkturpaket. Ende des zweiten Quartals erlebten die Märkte das beste Quartal seit mehr als zwei Jahrzehnten, was zum Teil auf umfangreiche Stimulierungsmaßnahmen der Notenbank Federal Reserve (Fed) zurückzuführen war. Die Arbeitslosenquote stieg Anfang des zweiten Quartals 2020 auf ein Rekordhoch, ging jedoch im gesamten Berichtszeitraum kontinuierlich zurück. Nachdem die Fed die Zinsen im März auf nahe Null gesenkt hatte, ließ sie sie im zweiten Quartal unverändert, während der US-Dollar stetig fiel.

In diesem Umfeld hielt der Fonds nicht mit seinem Vergleichsindex Schritt. Auf Sektorebene lieferten Basiskonsumgüterden einzigen positiven Performancebeitrag, während Informationstechnologie und Finanzwerte die größten Verlustbringer gegenüber der Benchmark waren.

Bei *Basiskonsumgütern* steuerte die solide Titelauswahl im Getränkesegment am stärksten positiv zur Performance bei. Eine günstige Titelauswahl und die Positionierung auf Lebensmittelprodukte unterstützten die Ergebnisse ebenfalls. Der Verzicht des Fonds auf ein Exposure beim Getränkehersteller Coca-Cola Company wirkte sich ebenfalls positiv auf die Performance aus.

Im IT-Sektor schmälerte die *Untergewichtung* des Fonds im Softwaresegment dagegen das Fondsergebnis am stärksten. Das fehlende Exposure des Portfolios bei Microsoft und Amazon.com brachte im Berichtszeitraum umfangreiche Verluste ein. Die *Untergewichtung* und eine ungünstige Titelauswahl in den Bereichen Technologie-Hardware, Speicher und Peripheriegeräte beeinträchtigten ebenfalls die relative Performance. Eine starke *Übergewichtung* des Banksegments bescherte eine unterdurchschnittliche Performance im Finanzsektor. Die *Übergewichtung* von Versicherungswerten und eine ungünstige Titelauswahl im Segment belasteten das Fondsergebnis ebenfalls.

Der Fonds bleibt in den Sektoren Finanzen, Werkstoffe, Versorger und Energie *übergewichtet* und bei *Basiskonsumgütern*, Informationstechnologie, Kommunikationsdienstleistungen sowie *Nicht-Basiskonsumgütern* *untergewichtet*. Der Manager verringerte während des Berichtszeitraums das Exposure im Immobiliensektor zugunsten einer *Übergewichtung* von Industriewerten. Auch das Exposure im Gesundheitssektor wurde durch neue Positionen auf AbbVie und Bristol-Myers Squibb verstärkt. Die Anlegerstimmung hellte sich weiter auf, als AbbVie den Abschluss der Übernahme von Allergan bekannt gab, nachdem die zuständigen Behörden grünes Licht für den Deal erteilt hatten.

Die Märkte haben sich von den Tiefstständen Ende März in beeindruckender Weise erholt, da sich die Wirtschaft langsam wieder öffnet und die Anleger eine gewisse Normalisierung erwarten, nachdem das Schlimmste bei der Corona-Pandemie hoffentlich vorüber ist. Der Anlageansatz des Managers basiert auf dem attraktiven Zusammenspiel aus pessimistischen Erwartungen und historisch niedrigen Bewertungen. Sie bilden die Grundlage für eine potenziell solide Erholung, sobald sich Umsätze und Gewinne nach der Pandemie wieder beschleunigen.

Nach der anfänglichen Erholung im April glich der Rest des zweiten Quartals einem Wechselspiel aus Risikobereitschaft und Risikoscheu. Da sich die Einkaufsmangerindizes in China und in jüngster Zeit auch in den USA weiter von ihren niedrigen Niveaus erholen, halten Anleger in China Ausschau nach Anzeichen dafür, wie eine schrittweise Wiedereröffnung der Wirtschaft aussehen könnte. Der Manager rechnet damit, dass sich das Gewinnwachstum im zweiten Halbjahr 2020 wieder beleben wird, nachdem es in der ersten Hälfte aufgrund des negativen Angebots- und Nachfrageschocks im Zusammenhang mit der Pandemie deutlich geschrumpft ist. Sobald sich die Wirtschaft langsam normalisiert, könnten großzügige Konjunkturmaßnahmen in Verbindung mit niedrigen Rohstoffpreisen das Verbrauchervertrauen zusätzlich stärken.

Die jüngsten US-Beschäftigungstrends haben die Erwartungen übertroffen, da große Bundesstaaten ihre Wirtschaft wieder öffnen. Das Verbrauchervertrauen und die starke Nachfrage im Wohnungssektor runden die jüngsten Signale für eine Erholung ab. Anleger müssen die Sorgen über den jüngsten Anstieg der Corona-Infektionen in den USA in den Sun-Belt-Staaten sowie in Kalifornien abwägen, um das Ausmaß und das Tempo der wirtschaftlichen Normalisierung zu bestimmen; es ist unwahrscheinlich, dass diese geradlinig verlaufen wird. Die akuteste Phase der Rezession scheint vorüber und langsam gibt es zaghafte Anzeichen für eine Erholung.

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

Der Manager ist nach wie vor von der Positionierung des Fonds überzeugt und geht davon aus, dass US-*Large-Caps* aufgrund der Marktverzerrung gut positioniert sind, um in den nächsten Jahren attraktive Renditen zu erzielen.

Mellon Investments Corporation
Juli 2020

SPEZIELLE ANTEILE**BNY MELLON DIGITAL ASSETS FUND**

Die Anteilsklasse USD W (Acc.) erzielte im sechsmonatigen Berichtszeitraum 4,06%. Im Vergleich dazu verzeichnete der MSCI AC World NR Index -6,25%, jeweils bezogen auf den US-Dollar.

Die Aktienmärkte litten in der ersten Jahreshälfte 2020 aufgrund der globalen Auswirkungen der COVID-19-Pandemie unter einer starken *Volatilität*. Als die Wirtschaftstätigkeit zum Erliegen kam, stürzten *Aktien* im ersten Quartal ab, erholten sich jedoch im zweiten Quartal, als die Weltwirtschaft sich wieder öffnete und sich die Hoffnung auf einen potenziellen Impfstoff belebte. Anfang des Berichtszeitraums rief Präsident Donald Trump den nationalen Notstand in den USA aus, und der Kongress verabschiedete ein 2 Bio. US-Dollar schweres Konjunkturpaket. Ende des zweiten Quartals erlebten die Märkte das beste Quartal seit mehr als zwei Jahrzehnten, was zum Teil auf umfangreiche Maßnahmen der Notenbank Federal Reserve (Fed) zurückzuführen war. Die Arbeitslosenquote stieg zu Beginn des Quartals auf ein Rekordhoch, ging jedoch im gesamten Berichtszeitraum kontinuierlich zurück. Nachdem die Fed die Zinsen im März auf nahe Null gesenkt hatte, ließ sie sie im zweiten Quartal unverändert, während der US-Dollar stetig fiel.

Im Berichtszeitraum übertraf der Fonds die Benchmark deutlich. Die Übergewichtung und die effektive Titelauswahl im Softwaresegment lieferten bei Weitem den größten Positivbeitrag zur relativen Performance. Insbesondere die Position auf OneConnect Financial Technology legte zu, nachdem das Unternehmen Anfang Mai seinen Gewinn gemeldet hatte und damit ein positives Echo am Markt hervorrief. Eine effektive Titelauswahl und *Übergewichtung* von IT-Dienstleistungen sowie Halbleitern und Halbleiterausstattung trugen ebenfalls zur Performance bei.

Die ungünstige Titelauswahl bei Internet- und Direktmarketing-Einzelhandelsnamen belasteten das relative Ergebnis am stärksten. Vor allem die Position auf Webjet hinkte hinterher. Das fehlende Exposure bei Technologie-Hardware, Speicher und Peripheriegeräte schmälerte das Ergebnis ebenfalls. Die ungünstige Titelauswahl im Sektor Medizintechnik belastete ebenfalls die Performance, da der Sektor die beste Performance im Index erzielte.

Im Berichtszeitraum gab es kaum Portfolioveränderungen. Der Manager erhöhte sein Software-Exposure durch eine neue Position bei OneConnect Financial Technology, einem Spin-off von Ping An Insurance. Diese Position entspricht nach Einschätzung des Managers einem Bedarf im Bereich börsengehandeltes Eigenkapital (Public Equity), da das Unternehmen zu den klassischen führenden Blockchain-Enablern zählt. Das Exposure im Bereich Luftfracht und

SPEZIELLE ANTEILE Forts.

BNY MELLON DIGITAL ASSETS FUND Forts.

Logistik wurde durch den Verkauf von XPO Logistics reduziert.

Der Manager beurteilt die Chancen auf dem Blockchain-Markt unverändert optimistisch. Er ist überzeugt, dass die digitale Transformation im Laufe der Zeit zu erheblichen Ausgaben für neue Technologien führen wird und dass diese als Reaktion auf die globale Pandemie bereits deutlich erhöht wurden.

Nach Ansicht des Managers werden die Investitionen in Blockchain-Technologie schon bald stark steigen. Davon werden sowohl Enabler als auch Nutzer profitieren. Infolgedessen wächst das Anlageuniversum weiter und bietet weltweit Chancen in allen Branchen und Regionen. Vor allem China scheint massiv in die Blockchain-Technologie zu investieren, was sich in der Zusammensetzung des Fondsportfolios widerspiegelt. Die Erweiterung der Anwendungsbereiche hat neue Möglichkeiten etwa im Gesundheitswesen und Supply Chain Management zutage gefördert, und der Manager geht davon aus, dass das Interesse an der Technologie in beiden Bereichen anhalten wird. Analog wurde das Exposure bei Technologie und Kommunikationsdiensten verstärkt, da einige Technologie-Unternehmen verstärkt in Blockchain-basierte Lösungen investieren.

Der Manager geht davon aus, dass Blockchain über dieses Jahr hinaus betrachtet gut aufgestellt ist, um integraler Bestandteil der Technologieinfrastruktur der nächsten Generation zu werden. Die Schlüsselmerkmale von Blockchain in Bereichen wie Unveränderlichkeit, Sicherheit und Transparenz sind nach Ansicht des Managers für den Erfolg in einer digitalen Gesellschaft von entscheidender Bedeutung. Der Manager geht stark davon aus, dass das Blockchain-Thema mindestens ein Jahrzehnt benötigen wird, um sein volles Potenzial zu entfalten, und ist der Ansicht, dass fundiertes Fachwissen, kombiniert mit einer soliden globalen Aktien-Researchplattform, dem Fonds langfristig zugute kommen könnte.

Mellon Investment Corporation
Juli 2020

BNY MELLON GLOBAL INFRASTRUCTURE INCOME FUND

Die Anteilsklasse USD W (Acc.) des Fonds erzielte im sechsmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -21,25 %, verglichen mit einer Rendite von -19,68 % für den S&P Global Infrastructure NR Index, jeweils in US-Dollar.

Die Aktienmärkte litten in der ersten Jahreshälfte 2020 aufgrund der globalen Auswirkungen der COVID-19-Pandemie unter einer starken *Volatilität*. Als die Wirtschaftstätigkeit zum Erliegen kam, stürzten Aktien

im ersten Quartal ab, erholten sich jedoch im zweiten Quartal, als die Weltwirtschaft sich wieder öffnete und sich die Hoffnung auf einen potenziellen Impfstoff belebte. Am Anfang des Berichtszeitraums rief Präsident Donald Trump den nationalen Notstand in den USA aus, und der Kongress verabschiedete ein 2 Bio. US-Dollar schweres Konjunkturpaket. Ende des zweiten Quartals erlebten die Märkte das beste Quartal seit mehr als zwei Jahrzehnten, was zum Teil auf umfangreiche Stimulierungsmaßnahmen der Notenbank Federal Reserve (Fed) zurückzuführen war. Die Arbeitslosenquote stieg zu Beginn des Quartals auf ein Rekordhoch, ging jedoch im gesamten Berichtszeitraum kontinuierlich zurück. Nachdem die Fed die Zinsen im März auf nahe Null gesenkt hatte, ließ sie sie im zweiten Quartal unverändert, während der US-Dollar stetig fiel.

Der Fonds hielt im Berichtszeitraum nicht mit dem S&P Global Infrastructure Index Schritt. Die *Untergewichtung* bei Industriewerten verhalf dem relativen Ergebnis nach oben. Die Positionierung auf europäische Infrastrukturwerte wirkte vor allem dank der Positionen auf Deutsche Post und Bouygues als erfreulicher Rückenwind. Beide Titel rückten vor.

Zu den kurzfristigen Treibern für Bouygues gehören unter anderem Preiserhöhungen beim preisgünstigen Mobilfunkdienst sowie Signale der französischen Regierung, einigen Infrastruktur-Bauunternehmen bei coronabedingten Kosten unter die Arme zu greifen. Der zweitgrößte Positivbeitrag kam von Versorgern. Hier zahlten sich eine effektive Titelauswahl bei US-Versorgern und eine deutliche Übergewichtung Europas aus, das andere Regionen übertraf.

Der Energiesektor brachte dagegen die stärksten relativen Verluste ein. Der Fonds musste eine besonders schwierige relative Performance bei seinem Exposure im Bereich Energieinfrastruktur hinnehmen. Dort wurde die Nachfrage durch die Ausbreitung von COVID-19 und den weltweiten Zusammenbruch im Energiesektor im Anschluss an die Förderbremse der OPEC vernichtet. Die kanadische Midstream-Pipeline-Konzern Inter Pipeline gab nach, als Anleger die laufenden Investitionsverpflichtungen des Unternehmens im Zusammenhang mit seinem Großprojekt Heartland Petrochemical einpreisten. Im Immobiliensektor schmälerte das Engagement abseits der Benchmark bei Omega Healthcare Investors das Fondsergebnis. Die Anleger preisten die Risiken steigender Kosten im Zusammenhang mit Arbeits-, Hygiene- und Tiefenreinigungsdiensten sowie Schutzausrüstungen wie Masken und Handschuhen neben möglichen Belegungsrückgängen angesichts der Ausbreitung von COVID-19 ein.

Der Manager reduzierte während des Berichtszeitraums die Gewichtung des Fonds bei Versorgern und Industriewerten leicht und erhöhte das Engagement im Energiesektor. Die

SPEZIELLE ANTEILE Forts.

BNY MELLON GLOBAL INFRASTRUCTURE INCOME FUND Forts.

restliche Beteiligung am Stromversorgungskonzern Exelon wurde aus Sorge darüber verkauft, das Unternehmen könne aufgrund der laufenden Untersuchung in Illinois möglicherweise nur eingeschränkt von Gesetzen profitieren, die seinen Atomkraftanlagen zugute kommen. Die Aktien des Midstream-Erdgas-Konzerns Oneok wurden gekauft.

Die Anlageklasse wird sich voraussichtlich gemeinsam mit globalen Aktien insgesamt erholen, wenn die Weltwirtschaft allmählich wieder anläuft. Traditionell *defensive* Infrastrukturwerte wie Mautstraßen, Flug- und Seehäfen mussten aufgrund der Lockdowns auf breiter Front ebenso wie andere Einzelhandelstitel einen rasanten Volumenrückgang hinnehmen. Wenn sich die wirtschaftlichen Bedingungen normalisieren, wird sich das Verkehrsvolumen in diesen Netzwerken ausgehend von einem historisch niedrigen Niveau verbessern. Daher erwartet der Manager einen starken operativen Leverage-Effekt für die wirtschaftliche Erholung, der sich in attraktiven potenziellen Renditen für viele Segmente der Anlageklasse niederschlagen könnte. Asien, insbesondere China, verlässt die Lockdown-Phase schrittweise, und die Normalisierung wird wahrscheinlich voranschreiten, wenn die Infektionszahlen und die Zahl der Todesopfer sinken und potenzielle Therapien sowie ein Impfstoff in greifbare Nähe rücken. Positive Trends bei bahnbrechenden medizinischen Entwicklungen in Verbindung mit einem allmählichen Wiederanlaufen der Weltwirtschaft könnten die Stärke der Gewinne und Cashflows von Infrastrukturanlagen untermauern. Daher hält der Manager die Bewertungen und Chancen für Dividendenrenditen innerhalb der Anlageklasse nach wie vor für sehr attraktiv.

Mellon Investments Corporation
Juli 2020

BNY MELLON MOBILITY INNOVATION FUND

Die Anteilsklasse USD A (Acc.) des Fonds erzielte im sechsmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 6,64 %, verglichen mit einer Rendite von -9,99 % für den MSCI AC World Mid Cap NR Index, jeweils in US-Dollar.

Die Aktienmärkte litten in der ersten Jahreshälfte 2020 aufgrund der globalen Auswirkungen der COVID-19-Pandemie unter einer starken *Volatilität*. Als die Wirtschaftstätigkeit zum Erliegen kam, stürzten Aktien im ersten Quartal ab, erholten sich jedoch im zweiten Quartal, als die Weltwirtschaft sich wieder öffnete und sich die Hoffnung auf einen potenziellen Impfstoff belebte. Am Anfang des Berichtszeitraums rief Präsident Donald Trump den nationalen Notstand in den USA aus, und der Kongress verabschiedete ein 2 Bio. US-Dollar schweres Konjunkturpaket. Ende des zweiten Quartals erlebten die

Märkte das beste Quartal seit mehr als zwei Jahrzehnten, was zum Teil auf umfangreiche Stimulierungsmaßnahmen der Notenbank Federal Reserve (Fed) zurückzuführen war. Die Arbeitslosenquote stieg zu Beginn des Quartals auf ein Rekordhoch, ging jedoch im gesamten Berichtszeitraum kontinuierlich zurück. Nachdem die Fed die Zinsen im März auf nahe Null gesenkt hatte, ließ sie sie im zweiten Quartal unverändert, während der US-Dollar stetig fiel.

Die Übergewichtung des Fonds im Vergleich zur Benchmark bei Software und Halbleitern sowie Halbleiterausrüstung lieferte den größten Positivbeitrag zur relativen Performance. Das fehlende Engagement im Bereich medizinische Ausrüstung und Produkte und die ungünstige Titelauswahl bei Automobilzulieferern hielten am wenigsten Schritt.

Im Softwaresektor war Splunk Performancespitzenreiter, da das Cloud-Geschäft vom Trend zum Home Office profitiert. Die Aktien stiegen, nachdem das Unternehmen unerwartet gute Quartalsgewinne gemeldet hatte. Die trotz des konjunkturellen Gegenwinds positive Stimmung angesichts einer robusten Pipeline beflügelte die Aktien ebenfalls. Im Sektor Halbleiter und Halbleiterausrüstung legte MediaTek zu, da der wichtigste Chiplieferant für Huawei voraussichtlich von den kürzlich angekündigten Beschränkungen profitieren wird, die Huawei daran hindern sollen, eigene Chips zu fertigen, was den Hauptlieferanten zugute kommen dürfte.

Die Aktien von Hyundai Mobis im Segment Automobilzulieferer bildeten unterdessen das Schlusslicht. Im Gesamtfonds schmälerte auch Guangzhou Automobile Group im Automobilsegment das Ergebnis. Negative Trends beim chinesischen Pkw-Volumen und Konsum bremsen weiterhin das Fondsergebnis. Der Manager geht jedoch davon aus, dass sich das Unternehmen wahrscheinlich erholen wird, wenn die Stimulierungsmaßnahmen der Lokalregierungen greifen.

Das Exposure im Maschinenbau wurde aufgestockt, indem neue Positionen auf Kion Group, weltweit führend im Bereich Fördertechnik, und den Hersteller von Hybrid-Trucks Nikola Corporation, eröffnet wurden.

Durch die Veräußerung von Delta Electronics verringerte der Manager das Exposure auf elektronische Ausrüstung/Instrumente und Komponenten, was auf eine geringere Wesentlichkeit für das Thema Mobilität und schwächere *Fundamentaldaten* zurückzuführen ist.

Der Ausblick für die Weltwirtschaft und die Aktienmärkte scheint sich nach Einschätzung des Managers aufzuhellen, nachdem die Weltwirtschaft zur Eindämmung des Coronavirus in historisch beispielloser Weise heruntergefahren worden war.

SPEZIELLE ANTEILE Forts.

BNY MELLON MOBILITY INNOVATION FUND Forts.

Der US-Pkw-Markt verzeichnete im Juni den zweiten Monat in Folge eine saisonbereinigte jährliche Wachstumsrate von 13,2 Mio. Da die US-Wirtschaft nach dem coronabedingten Stillstand langsam wieder geöffnet wird und die Fahrzeugproduktion wieder anläuft, erwartet der Manager, dass die saisonbereinigte jährliche Wachstumsrate in den kommenden Monaten weiter steigen wird. In Westeuropa war der Juni erneut ein schwieriger Monat für den Pkw-Markt, dennoch wurde eine Verbesserung gegenüber dem Vormonat Mai verbucht. China ist der weltweit größte Pkw-Markt und erlebt seit März dieses Jahres eine „V-förmige“ Erholung. Die Zahlen des chinesischen Pkw-Verbands belegen, dass sich die Erholung im Juni fortgesetzt hat. Für die zweite Jahreshälfte rechnet der Manager mit einem weiteren Anstieg der zugrunde liegenden Nachfrage, sofern die chinesische Binnenkonjunktur im Aufwind bleibt.

Für die Zukunft geht der Manager davon aus, dass die Fondspositionen als potenzielle Profiteure des langfristigen Wachstums innerhalb des Mobilitätsthemas gut aufgestellt sind. Trotz der bisherigen Herausforderungen 2020 beurteilt der Manager die Wachstumsaussichten für moderne Fahrer-Assistenzsysteme (Advanced Driver Assisted Systems, ADAS) und die Fahrzeugelektrifizierung mittel- bis langfristig weiterhin positiv. ADAS-Inhalt und -Funktionen pro Fahrzeug nehmen in den Schlüsselmärkten weiter zu, ebenso wie der grundlegende Trend zur Fahrzeugelektrifizierung, der aufgrund der Emissionspolitik und -vorschriften für Europa und China weiterhin ein Schwerpunkt ist.

Mellon Investments Corporation
Juli 2020

GLOBALE FESTVERZINSLICHE WERTPAPIERE

BNY MELLON GLOBAL BOND FUND

Die Anteilsklasse USD A des Fonds erzielte im sechsmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 3,54 %. Im Vergleich dazu verzeichneten der JP Morgan Global Government Bond (*Unhedged*) TR Index 4,60 % und der Sektordurchschnitt des Lipper Global – Bond Global USD 0,34 %. Alle Angaben in US-Dollar.

Der Fonds erwirtschaftete eine positive Rendite, hielt aber nicht mit seinem Vergleichsindex Schritt. Die Anleihenmärkte schnellten angesichts der erneuten *quantitativen Lockerung* durch die führenden Zentralbanken als Reaktion auf den Ausbruch von COVID-19 nach oben.

Die Fondspositionen auf Staatsanleihen erzielten solide Positivverträge. US-Treasuries führten das Feld an, aber auch die Positionen auf Staatsanleihen aus Australien, Singapur und Neuseeland verhalfen dem Fondsergebnis aufgrund der aggressiven *geldpolitischen Lockerung* nach oben. Trotz bereits niedriger Inflationserwartungen schmälerte die erhebliche *Diversifizierung* in US-TIPS (*Treasury inflation-protected securities*) die Wertentwicklung im ersten Quartal, da die realen Renditen und Inflationserwartungen nach dem Scheitern der Gespräche über die Drosselung der Ölfördermengen einbrachen. Ferner verzeichneten Staatsanleihen aus Schwellenländern umfangreiche Kapitalverluste, wobei die Ölexport-Länder (Kolumbien und Mexiko) zu den Schlusslichtern zählten. Die Renditen von Schwellenländer-Staatsanleihen wurden im späteren Verlauf des Berichtszeitraums durch die starke Performance von Neuemissionen unter anderem in Katar, Abu Dhabi und Mexiko, angekurbelt, als sich die US-Dollar-Liquiditätsbedingungen und die Risikobereitschaft weltweit erholten.

Die *Untergewichtung* der *Duration* bei japanischen Staatsanleihen erwies sich insbesondere im zweiten Quartal des Berichtszeitraums als günstig, als die japanischen Staatsanleihenrenditen stiegen. Die *Untergewichtung* der *Duration* bei britischen *Gilts* belastete die relative Performance jedoch, da die trüben Wirtschaftsaussichten für Großbritannien und der Hinweis der Bank of England auf potenzielle Negativzinsen dafür sorgten, dass *Gilts* sich angesichts sinkender Renditen relativ solide entwickelten. Die Position auf europäische Anleihen wirkte sich im weiteren Verlauf des Berichtszeitraums positiv aus, wobei die *Übergewichtung* des Fonds in Spanien stark positiv beisteuerte, da sich die *Spreads* massiv verengten.

Die Portfolioveränderungen beinhalteten unter anderem die Erhöhung der Fondsduration im ersten Quartal, unterstützt durch den Kauf von US-Treasuries mit Fälligkeit 2029 (Jahr, in dem die Anleihe fällig wird) und 2045 sowie Australien-Anleihen mit Fälligkeit 2047. Die US-Dollar-Duration wurde dagegen im zweiten Quartal verringert, insbesondere am langen Ende der US-Treasury-Renditekurve.

GLOBALE FESTVERZINSLICHE WERTPAPIERE Forts.

BNY MELLON GLOBAL BOND FUND Forts.

Bei der Währungsstrategie wurde das Risiko erhöht, wobei die Netto-US-Dollar-Position auf -5 % verändert wurde, während das Exposure auf die indonesische Rupiah, die tschechische Krone, den peruanischen Sol, die norwegische Krone und den kanadischen Dollar aufgestockt wurde. Die als „sichere Häfen“ geltenden Währungspositionen wurden reduziert, wobei die Long-Position auf den japanischen Yen verkauft und riskante Short-Währungspositionen auf kanadischen Dollar, polnischen Zloty und philippinischen Peso glattgestellt wurden.

Nach Ansicht des Managers wird sich das Spannungsfeld zwischen einer wirtschaftlichen Erholung, die durch kräftige *fiskal-* und *geldpolitische* Hilfsmaßnahmen unterstützt wird, und den Auswirkungen längerer Lockdowns und dem längerfristigen wirtschaftlichen Schaden voraussichtlich fortsetzen. Daher ist eine ausgewogene Gewichtung des Fonds besonders wichtig. Damit die Verschuldung tragbar bleibt, müssen die Zinsen auf ultraniedrigem Niveau bleiben, wodurch das kurze Ende der *Renditekurven* verankert bleibt. Längerfristige Emissionen sind dagegen nach wie vor anfällig für einen Anstieg der Inflationserwartungen.

Newton Investment Management Limited
Juli 2020

BNY MELLON GLOBAL CREDIT FUND

Die Anteilsklasse USD W (Acc.) des Fonds erzielte im sechsmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 6,94 %, verglichen mit einer Rendite von 3,43 % für den Bloomberg Barclays Global Aggregate Credit TR Index (USD Hedged) und 2,91 % für den Lipper Global – Bond Global Corporates USD Sektordurchschnitt. Alle Angaben in US-Dollar.

Der Fonds erzielte eine positive Rendite und übertraf seinen Vergleichsindex sowie den Sektordurchschnitt.

Mit dem Ausbruch des Coronavirus weiteten sich die globalen *Kreditspreads* im ersten Quartal beträchtlich, da *Risikowerte* auf breiter Front abrutschten; die *Spreads* verengten sich anschließend jedoch deutlich, als die Risikobereitschaft dank einer enormen *fiskal-* und *geldpolitischen* Reaktion und der allmählichen Wiedereröffnung der Volkswirtschaften wieder stieg. *Investment-Grade-* und *Hochzins-*Unternehmensanleihen erlebten nach einem fulminanten Jahresauftakt im März einen Ausverkauf, um sich anschließend wieder zu erholen. Als sich das Wirtschaftswachstum verlangsamte, nahmen die *Ausfälle* zu (insbesondere im US-Energiesektor), blieben aber unter dem historischen Durchschnitt. Ferner half die Erholung der Kapitalmärkte den Unternehmen, sich zu attraktiven Zinsen zu refinanzieren. Die *Renditen* von Staatsanleihen fielen im Berichtszeitraum, da die US-Notenbank Federal Reserve (Fed) den Leitzins auf eine Bandbreite von 0 bis 0,25 % senkte und unbegrenzte

Anleihekäufe ankündigte. Die Europäische Zentralbank (EZB) ließ ihren Hauptrefinanzierungssatz bei 0 %, lancierte aber gleichzeitig ein 1,35 Bio. Euro schweres Pandemie-Notfallankaufprogramm (PEPP). Die US-Wirtschaft litt im Vorfeld der Präsidentschaftswahl besonders stark unter COVID-19 und dem anhaltenden Handelskonflikt mit China. In Europa ist der Brexit nach wie vor das größte Risiko. Anlagen in „*sichere Häfen*“ verzeichneten Mittelzuflüsse, die den US-Dollar stützten, bevor sie massiv verkauft wurden, als die Risikobereitschaft der Anleger zurückkehrte (was Schwellenländerwährungen zugutekam).

Die Unternehmensanleihestrategie des Fonds trug im Berichtszeitraum positiv zur Performance bei, wobei ein starker Performancebeitrag im April einen erheblichen Verlust im März ausglich. Die Wertpapierauswahl bescherte im Verlauf des Berichtszeitraums stetigen Wertzuwachs. Die Zinsstrategien des Fonds waren jedoch ungünstig, vor allem die Länderallokation und die Inflationspositionen (hauptsächlich aufgrund der Verluste im Februar und März).

Der Manager erhöhte die *Übergewichtung* von Unternehmensanleihen im ersten Quartal 2020 und nutzte dabei die attraktiven Bewertungen nach dem massiven Ausverkauf. Später wurde die *Übergewichtung* leicht reduziert, indem *zyklische* Sektoren wie Energie und Automobile veräußert wurden. Der Manager hielt an der *übergewichteten Duration* fest und verlagerte den regionalen Anlageschwerpunkt, als sich Relative-Value-Chancen präsentierten.

Die Wirtschaft und die Märkte stehen aufgrund der Coronakrise unter einem historisch beispiellosen Schock. Die politischen Reaktionen darauf waren jedoch immens. Die direkte oder indirekte monetäre Expansion hat zu hohen Staatsschulden geführt. Der Manager geht daher davon aus, dass die *Renditen* auf lange Zeit niedrig und die *Renditekurven* flach bleiben. Das Risiko einer zweiten Corona-Infektionswelle besteht nach wie vor, wobei einige örtlich begrenzte Beschränkungen bereits zurückgenommen wurden.

Der Manager geht davon aus, dass die politischen Risiken bis auf Weiteres bleiben, sei es mit Blick auf die Beziehungen zwischen den USA und China, den Brexit oder die US-Präsidentschaftswahlen.

Die Duration des Fonds bleibt *übergewichtet*, wodurch sich der regionale Schwerpunkt mit der Entwicklung des Relative Value verschiebt. Der Fonds hält weiterhin Positionen, die nach Ansicht des Managers mittelfristig strukturelles Wertpotenzial bieten. Dies gilt vor allem für *Long-Positionen* in Peripheriemärkten gegenüber den europäischen Kernmärkten.

Im Unternehmensanleihesegment sind die Bewertungen auf ein Niveau gesunken, auf dem sie im Vergleich zum

Globale Festverzinsliche Wertpapiere Forts.

BNY MELLON GLOBAL CREDIT FUND Forts.

langfristigen Durchschnitt nur noch mäßig attraktiv sind. Alle *Unternehmensanleihen* erscheinen inzwischen strategisch günstig. Der Manager bevorzugt jedoch Segmente, die am wenigsten von zunehmenden *Ausfällen* betroffen sind, da sie aktiv durch Zentralbankmaßnahmen unterstützt werden sowie Länder, deren staatliche Fiskalpolitik weniger von ausländischen Finanzströmen abhängt.

Insight Investment Management (Global) Limited
Juli 2020

BNY MELLON GLOBAL DYNAMIC BOND FUND

Die Anteilsklasse USD A des Fonds schloss den sechsmonatigen Berichtszeitraum mit einem Plus von 0,64%. Im Vergleich dazu verzeichnete der 1-Monats-USD-LIBOR + 2% p.a. ein Plus von 1,44%. Alle Angaben in US-Dollar.

Der Fonds erwirtschaftete eine positive Rendite, hielt aber nicht mit seinem Vergleichsindex Schritt. Die Anleihenmärkte schnellten angesichts der erneuten *quantitativen Lockerung* durch die führenden Zentralbanken als Reaktion auf den Ausbruch des Coronavirus nach oben.

Die Fondspositionen auf Staatsanleihen erzielten solide Positivverträge. US-Treasuries führten das Feld an, aber auch die Positionen auf Staatsanleihen aus Australien, Singapur und Neuseeland verhalfen dem Fondsergebnis nach oben. Trotz bereits niedriger Inflationserwartungenschmälerte die erhebliche *Diversifizierung* in US-TIPS (*Treasury inflation-protected securities*) die Wertentwicklung im ersten Quartal, da die realen Renditen und Inflationserwartungen nach dem Scheitern der Gespräche über die Drosselung der Ölfördermengen einbrachen.

Hochzinsanleihen brachten im ersten Quartal erhebliche Verluste ein, da sich die maßgeblichen Spreads mit dem Ausbruch von COVID-19 auf den höchsten Stand seit der globalen Finanzkrise weiteten. Auch Schwellenländer-Staatsanleihen verzeichneten dramatische Kapitalverluste. Zu den größten Verlustbringern zählten *börsengehandelte Fonds (ETFs)* in Lokalwährung und Ölexportländer wie Kolumbien, Mexiko und Ecuador. Das zweite Quartal war jedoch für Hochzins-Unternehmensanleihen günstig, da unter anderem die Emissionen von UBS, Nationwide und Lloyds allesamt eine Rallye verbuchten. *Investment-Grade-Unternehmensanleihen* und Schwellenländer-Staatsanleihen bescherten in diesem Zeitraum ähnlich positive Erträge. Die Renditen von *Schwellenländer-Staatsanleihen* wurden durch die starke Performance von Neuemissionen unter anderem in Katar, Abu Dhabi und Mexiko, angekurbelt, als sich die Dollar-Liquiditätsbedingungen und die Risikobereitschaft weltweit erholten.

Die Portfolioveränderungen beinhalteten unter anderem die Erhöhung der Fondsduration im ersten Quartal, unterstützt durch den Kauf von US-Treasuries mit Fälligkeit 2029 (Jahr, in dem die Anleihe *fällig* wird) und 2045 sowie Australien-Anleihen mit Fälligkeit 2024. Im zweiten Quartal wurde die *Duration* dann verkürzt. Das Exposure auf US-TIPS wurde durch Anleihen mit Fälligkeit 2024 erhöht. Das *Hochzins*-Exposure des Fonds wurde gesenkt, gleichzeitig wurde auch das Engagement bei Schwellenländer-Staatsanleihen reduziert. Der Manager verkaufte die auf Lokalwährung lautende *ETF*-Position.

Im zweiten Quartal erhöhte der Manager sein Exposure auf *Investment-Grade*-Anleihen. Dazu investierte er hauptsächlich in Neuemissionen wie General Motors, Apple, AT&T, Linde und Richemont. Das Engagement im Hochzinssegment wurde durch Neuemissionen wie Carnival, Labco und Nokia ausgeweitet.

Die *Duration* bei Schwellenländer-Staatsanleihen wurde erhöht, wobei in Katar, Abu Dhabi und Mexiko Neuemissionen von Staatsanleihen mit stabilem *Investment-Grade*-Rating ins Portfolio aufgenommen wurden. In Marokko und Ungarn wurden Gewinne mitgenommen.

Bei der Währungsstrategie wurde das Risiko erhöht, wobei die US-Dollar-Position auf -5% verändert wurde, während das Engagement auf die indonesische Rupiah, den malaysischen Ringgit, die tschechische Krone, den peruanischen Sol, die norwegische Krone und den kanadischen Dollar aufgestockt wurde.

Nach Ansicht des Managers wird das Spannungsfeld zwischen einer wirtschaftlichen Erholung, die durch kräftige *fiskal-* und *geldpolitische* Hilfsmaßnahmen unterstützt wird, und den Auswirkungen längerer Lockdowns und dem längerfristigen wirtschaftlichen Schaden voraussichtlich bestehen bleiben. Daher ist eine ausgewogene Gewichtung des Fonds besonders wichtig. Damit die Verschuldung tragbar bleibt, müssen die Zinsen auf ultraniedrigem Niveau bleiben, wodurch das kurze Ende der *Renditekurven* verankert bleibt. Längerfristige Emissionen sind dagegen nach wie vor anfällig für einen Anstieg der Inflationserwartungen.

Newton Investment Management Limited
Juli 2020

BNY MELLON GLOBAL HIGH YIELD BOND FUND

Im sechsmonatigen Berichtszeitraum erzielte die Anteilsklasse USD C des Fonds eine Rendite von -5,51%, verglichen mit einer Rendite von -4,64% für den ICE Bank of America Merrill Lynch Developed Markets High Yield Constrained TR Index (USD Hedged) und -5,16% für den Lipper Global – Bond Global High Yield USD-Sektordurchschnitt. Alle Angaben in US-Dollar.

Globale Festverzinsliche Wertpapiere Forts.

BNY MELLON GLOBAL HIGH YIELD BOND FUND Forts.

Nach einem starken zweiten Halbjahr 2019 erholten sich die Hochzins-Spreads in Industrieländern zu Jahresanfang fast auf die Tiefststände nach der Finanzkrise, da der Renditehunger der Anleger kombiniert mit der Entspannung der Handelsbeziehungen zwischen den USA und China eine starke Nachfrage nach Risikowerten schürte. Ende Februar bis März 2020 schlug die Stimmung deutlich um, als die Coronakrise einen beispiellosen Nachfrageschock bewirkte und sich die Spreads bei Hochzinsanleihen aus Industrieländern so stark weiteten wie selten zuvor. Der Markt begab sich auf breiter Front auf Talfahrt, erstklassige Werte erzielten anfangs jedoch eine Outperformance.

Die Talsohle wurde am 23. März erreicht, nachdem die US-Notenbank Federal Reserve (Fed) Konjunkturmaßnahmen beschlossen hatte und sich die Infektionszahlen weltweit verlangsamten. Daraufhin hellte sich die Stimmung auf. B- und CCC-Anleihen holten bei der Rallye im zweiten Quartal vor allem in Europa auf, wobei europäische CCC-Anleihen in der ersten Jahreshälfte Performance-Spitzenreiter waren. Infolge des Stimmungsumschwungs im zweiten Quartal des Jahres verengten sich die *Spreads*, verharrten aber über dem Niveau von Ende 2019.

Hochzinsanleihen verbuchten im zweiten Quartal 2020 zwar eine Rallye aber dennoch entwickelten sich *defensivere* Sektoren immer noch besser, da die Marktteilnehmer gegenüber den von der Coronakrise besonders betroffenen Emittenten und Branchen skeptisch blieben. Europäische *Hochzinsanleihen* schnitten im Berichtszeitraum schlechter ab als *US-Hochzinsanleihen*, was in erster Linie auf die Ende März von der US-Notenbank Fed beschlossenen Konjunkturmaßnahmen zurückzuführen war. Sie beinhalteten ein robustes Anleihekaufprogramm, das *US-Unternehmensanleihen* insgesamt unterstützte.

Das Neuemissionsvolumen stieg 2020 deutlich, vor allem im *US-Hochzins*-Segment, da Emittenten angesichts der günstigen Politik der Fed und einer starken Anlegernachfrage am *Hochzinsmarkt* rege tätig waren. Das Emissionsvolumen im *US-Hochzinssegment* erreichte im zweiten Quartal Rekordniveau. Die meisten Emissionen waren für allgemeine Unternehmenszwecke bestimmt, aber im Juni markierten auch die Refinanzierungsemissionen einen Rekord.

Der Fonds hielt im Berichtszeitraum nicht mit dem breiter gefassten *Hochzinsmarkt* der Industrieländer Schritt. In der ersten Jahreshälfte kamen dem Fonds bestimmte Asset-Allokationsentscheidungen zugute, insbesondere die, von der Coronakrise besonders betroffene Sektoren wie Freizeit, Transport und Einzelhandel, weiterhin *unterzugewichten*. Die *Übergewichtung* des Fonds im Rundfunksektor, der einen starken Rückgang der Werbeausgaben verzeichnete, und die *Untergewichtung*

in den defensiven Sektoren Telekommunikation sowie Nahrungsmittel und Getränke schmälerten das Fondsergebnis jedoch. Angesichts der Ungewissheit über die Dauer und das Ausmaß der Krise leitete der Manager eine sorgfältige Analyse der *Liquiditätssituation* und des Zugangs zu den Kapitalmärkten ein. In der Folge wurden einige titelspezifische Verringerungen vorgenommen und Ausfallverluste abgefedert. Darüber hinaus hat der Manager den Fonds aufgrund dieser strengeren Überwachung auf die Positionen konzentriert, von denen er besonders stark überzeugt ist. Der Manager nutzte den Anstieg der Zahl von „Fallen Angels“ (Anleihen, die ursprünglich aus dem „*Investment Grade*“-Segment stammen, inzwischen aber auf Ramschniveau heruntergestuft wurden) während des Berichtszeitraums, was sich positiv auf das Fondsergebnis auswirkte. Der Fonds stand *US-Hochzinsanleihen* im zweiten Quartal 2020 aufgrund des Hilfsprogramms der Fed positiv gegenüber, was sich günstig auf das Fondsergebnis auswirkte. Die Allokation des Fonds bei BB-Unternehmensanleihen wurde im Berichtszeitraum erhöht, da der Manager das Risiko-/Ertragspotenzial bei erstklassigen *Unternehmensanleihen* als attraktiver einstufte.

Alcentra NY, LLC
 Juli 2020

BNY MELLON GLOBAL SHORT-DATED HIGH YIELD BOND FUND

Die Anteilsklasse USD A (Acc.) des Fonds erzielte im sechsmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -4,56%, verglichen mit einer Rendite von 0,53% für den 3-Monats-LIBOR USD und -4,70% für den Lipper Global – Bond Global High Yield USD Sektordurchschnitt. Alle Angaben in US-Dollar.

Der Fonds erzielte eine Negativrendite und hielt nicht mit der Cash-Benchmark (3-Monats-USD-LIBOR) Schritt, übertraf aber den Sektordurchschnitt.

Da sich das Wirtschaftswachstum aufgrund der Corona-Pandemie stark verlangsamte, stiegen die *Ausfälle* von Unternehmensanleihen, insbesondere im US-Energiesektor (nach dem Ölpreiskrieg zwischen Saudi-Arabien und Russland im März). Der *Hochzinssektor* geriet im Laufe des ersten Quartals zunehmend unter Verkaufsdruck. Die Mittelabflüsse und die gleichzeitig deutlich geringeren Neuemissionen sorgten für ein schwierigeres technisches Umfeld. Eine aggressive *geld-* und *fiskalpolitische* Reaktion auf den Konjunkturabschwung erhöhte jedoch die Risikobereitschaft der Anleger. Dementsprechend entwickelte sich das *Hochzinssegment* im zweiten Quartal 2020 solide. Das Segment verzeichnete erneut Mittelzuflüsse, die Neuemissionstätigkeit stieg jedoch deutlich, da sich die Unternehmen refinanzierten und ihre *Liquidität* erhöhten. Angesichts der wachsenden

Globale festverzinsliche Wertpapiere Forts.

BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Forts.

Furcht vor einer weltweiten Rezession gingen die Renditen von Staatsanleihen im ersten Quartal deutlich zurück, traten aber danach auf der Stelle, da die Wiedereröffnung der Volkswirtschaften von der Angst vor einer zweiten Coronawelle überschattet wurde.

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

Das Portfolio enthält jetzt 86 verschiedene Titel. Der Fonds hat ein durchschnittliches *Kreditrating* von BB- (das sich seit dem letzten Berichtszeitraum ausgehend von B+ verbessert hat, da besser bewertete Titel in den Fonds aufgenommen wurden) und eine durchschnittliche *Duration* von 1,8 Jahren.

Im Januar und Februar schichtete der Fonds weitere Positionen um und reinvestierte die Barerlöse. Als die Märkte im März deutlich nachgaben, baute der Manager eine Cash-Position im Fonds auf, stieg aber nach dem massiven Ausverkauf auch bei sorgfältig ausgewählten Kurzläufnern ein. Im April und Mai schichtete der Fonds weiter in besser bewertete Anleihen um, verkürzte die *Duration* und reinvestierte Barmittel bevorzugt im Telekommunikations-, Kabel- und Verpackungssektor. Im Juni wertete der Manager den Fonds weiter auf und reinvestierte die Barerlöse aus zurückgenommenen Anleihen.

Der Manager bleibt in einem durch die Auswirkungen des globalen Lockdowns und die anschließende Wiedereröffnung der Volkswirtschaften geprägten Umfeld bei seiner äußerst vorsichtigen, aber opportunistischen Strategie. Der Manager pflegt einen aktiven Dialog mit den Führungen aller Portfoliounternehmen und fand diese Gespräche beruhigend. Die wichtigsten Käufe waren *defensive* Unternehmen, die trotz robuster Geschäftsprofile und Cashflows in den Sog des Ausverkaufs geraten waren. Im Gegenzug wurden Emittenten, die der Manager weiter als zu riskant erachtet, reduziert. Der Manager findet einige äußerst attraktive Gelegenheiten für den Fonds, hält weltweit Ausschau, um das Risiko zu erhöhen und erwartet, dass die Märkte sich in den kommenden Monaten solide entwickeln werden.

Insight Investment Management (Global) Limited
 Juli 2020

BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund

Die Anteilsklasse Euro A des Fonds erzielte im sechsmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -0,51%. Im Vergleich dazu verzeichnete der 1-Monats-EURIBOR + +2% per annum ein Plus von 0,77%, jeweils in Euro.

Der Fonds erwirtschaftete eine Negativrendite und hielt nicht mit seinem Vergleichsindex Schritt.

Das erste Quartal 2020 verzeichnete aufgrund der weltweiten Corona-Pandemie die bei Weitem stärksten Marktturbulenzen seit der globalen Finanzkrise. Der Fonds erwirtschaftete bis Ende Februar eine positive Rendite. Die massiven Verluste im März machten die vorangegangenen Gewinne jedoch wett, da *Unternehmensanleihen* und *Schwellenländer-Staatsanleihen* dramatisch fielen. Die Positionen auf Staatsanleihen bescherten positive Renditen, wobei sich US-*Treasuries* an die Spitze setzten. Hochzins-Unternehmensanleihen brachten die größten Verluste ein, da sich die maßgeblichen *Spreads* seit der globalen Finanzkrise auf den höchsten Stand weiteten. *Contingent Convertible Bonds* von BBVA, Lloyds, Santander und Nationwide schmälerten das Fondsergebnis deutlich. Auch *Schwellenländer-Staatsanleihen* verzeichneten dramatische Kapitalverluste.

Der Fonds machte einen Teil dieser Verluste im zweiten Quartal 2020 wieder wett, da die Renditen von Staatsanleihen innerhalb der jüngsten Bandbreiten blieben, während die *Kreditspreads* stark einliefen. Staatsanleihen rückten leicht vor, wobei sich Positionen auf neuseeländische Kommunalanleihen mit am besten entwickelten. *Hochzins-Unternehmensanleihen* lieferten den stärksten Positivbeitrag zum Fondsergebnis, wobei die Positionen auf *Contingent Convertible Bonds* unter anderem von UBS, Nationwide und Lloyds eine Rally verbuchten. *Investment-Grade-Unternehmensanleihen* und *Schwellenländer-Staatsanleihen* erzielten ähnlich solide positive Renditen. Die Renditen von *Schwellenländer-Staatsanleihen* wurden durch die starke Performance von Neuemissionen, unter anderem in Mexiko und Paraguay, angekurbt, als sich die US-Dollar-Liquiditätsbedingungen und die Risikobereitschaft weltweit erholten. Aktive Währungspositionen trugen ebenfalls positiv zur Performance bei, vor allem aufgrund einer riskanten *Long*-Position auf den mexikanischen Peso, die norwegische Krone und den kanadischen Dollar sowie *Short*-Positionen in US-Dollar und Pfund Sterling.

Die Portfolioveränderungen beinhalteten die Reduzierung des Engagements im Hochzinssegment, unter anderem durch Veräußerung von InterXion 2025 (Jahr, in dem die Anleihe fällig wird), Charter 2024 und Panther 2026 im ersten Quartal. Das Engagement des Fonds auf *Schwellenländer-*

Globale festverzinsliche Wertpapiere Forts.

BNY MELLON SUSTAINABLE GLOBAL DYNAMIC BOND FUND Forts.

Staatsanleihen wurde ebenfalls verringert. Das Exposure bei Risikowährungen wurde verringert, unter anderem durch den Verkauf von Fondspositionen auf die indonesische Rupiah, den malaysischen Ringgit und die norwegische Krone. Eine *Short*-Position auf den polnischen Zloty vs. US-Dollar wurde eröffnet. Im letzten Quartal setzte der Manager die schrittweise Reduzierung der *Duration* bei als „sicher“ eingestuften Staatsanleihen fort und erhöhte das Engagement bei Schwellenländer- und Hochzinsanleihen. Das Engagement bei *Investment-Grade*-Anleihen wurde vor allem durch Neuemissionen von Apple, Cellnex, Telecom, Covivio, Linde und Lonza erhöht. Im *Hochzins*-Segment weitete der Manager das Engagement selektiv durch Neuemissionen unter anderem von IQVIA und Virgin Media aus. Bei der Währungsstrategie wurde das Risiko erhöht. Dazu wurde das Engagement in Währungen wie der indonesischen Rupiah, der tschechischen Krone und dem peruanischen Sol aufgestockt.

Nach Ansicht des Managers wird das Spannungsfeld zwischen einer durch kräftige *fiskal*- und *geldpolitische* Hilfsmaßnahmen unterstützten wirtschaftlichen Erholung und den Auswirkungen längerer Lockdowns sowie dem längerfristigen wirtschaftlichen Schaden voraussichtlich bestehen bleiben. Daher ist eine ausgewogene Gewichtung des Fonds besonders wichtig. Damit die Verschuldung tragbar bleibt, müssen die Zinsen auf ultraniedrigem Niveau bleiben, wodurch die *Renditekurven* am kurzen Ende verankert bleiben. Emissionen mit längeren Laufzeiten reagieren dagegen nach wie vor empfindlich auf einen Anstieg der Inflationserwartungen.

Newton Investment Management Limited
 Juli 2020

Regionale & spezialisierte festverzinsliche Wertpapiere

BNY MELLON EFFICIENT U.S. HIGH YIELD BETA FUND

Die Anteilsklasse USD A (Inc.) des Fonds rentierte im sechsmonatigen Berichtszeitraum mit -5,99%. Im Vergleich dazu verzeichnete der Bloomberg Barclays US Corporate High Yield TR Index -3,80% und der Sektordurchschnitt des Lipper Global – Bond USD High Yield -5,36%, jeweils gemessen in US-Dollar.

Zu Jahresbeginn führte der Ausbruch des Coronavirus zu einer akuten Eintrübung der Stimmung, da die Märkte die Gefahr einer globalen Rezession einpreisten. Hochzinsanleihen gerieten im März ins Rutschen und verzeichneten ihren schlechtesten Monat seit Oktober 2008. Die Risikobereitschaft erholte sich im zweiten Quartal, als die Zentralbanken mit beispiellosen *fiskal*- und *geldpolitischen* Impulsen reagierten und die coronabedingten Lockdowns gelockert wurden, was Hoffnungen auf eine Erholung schürte. Hochzinsanleihen machten die zu Jahresanfang verzeichneten Verluste größtenteils wieder wett, verzeichneten jedoch im bisherigen Jahresverlauf einen Rückgang um mehrere Prozentpunkte. Anleihen mit einem höheren *Kreditrating* schnitten überdurchschnittlich ab. Auf *Total-Return*-Basis legten BB-Anleihen um 0,21% zu, während B-Anleihen 5,45% nachgaben. CCC-Anleihen fielen um 13,32%. Die meisten Sektoren verzeichneten Verluste, allen voran der Energiesektor. Die *Rendite* von 10-jährigen US-*Treasuries* sank um 126 *Basispunkte (Bp.)* auf 0,66%, während die Rendite von 5-jährigen Papieren um 140 *Bp.* auf 0,29% schrumpfte. Hochzinsanleihen schnitten 8,67% schlechter ab als US-*Treasuries*.

Der Fonds ist positioniert, um ein *diversifiziertes* Engagement in hochverzinslichen US-Unternehmensanleihen mit ähnlichen Bonitäts-, *Durations*- und Fälligkeitsmerkmalen zu bieten wie im Bloomberg Barclays US Corporate High Yield Index. Gleichzeitig zielt der Fonds darauf ab, das *Ausfallrisiko* und die mit traditionellen Stichproben- und Replikationsansätzen verbundenen Transaktionskosten abzufedern und so gering wie möglich zu halten.

Mellon Investments Corporation
 Juli 2020

BNY MELLON EMERGING MARKETS CORPORATE DEBT FUND

Die Anteilsklasse USD A des Fonds erzielte im sechsmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -2,35%, verglichen mit einer Rendite von -0,16% für den JP Morgan Corporate EMBI Broad Diversified TR Index und -2,45% für den Lipper Global – Bond Emerging Markets Global Corporates Sektordurchschnitt. Alle Angaben in US-Dollar.

Der Fonds erzielte eine Negativrendite und hielt weder mit seiner Benchmark noch mit dem Sektordurchschnitt Schritt.

REGIONALE & SPEZIALISIERTE FESTVERZINSLICHE WERTPAPIERE Forts.

BNY MELLON EMERGING MARKETS CORPORATE DEBT FUND Forts.

Nach dem dramatischen Ausverkauf im März aufgrund der COVID-19-Pandemie wurden Schwellenländer-Unternehmensanleihen durch die Zinssenkungen zahlreicher Zentralbanken in Entwicklungs- und Industrieländern, einen schwächeren US-Dollar und die sich erholenden Rohstoffpreise unterstützt. Während die Weltwirtschaft rasant an Fahrt verliert, verzeichnen lokale Volkswirtschaften weiterhin relativ hohe Wachstumsraten. Die Anlageklasse erholte sich ungeachtet der Sorgen über eine mögliche zweite Coronawelle, den globalen Handelskrieg und die erhöhte *geopolitische* Unsicherheit in verschiedenen Regionen. Angesichts der rückläufigen *Volatilität* verzeichneten Schwellenländer-Unternehmensanleihen wachsende Mittelzuflüsse, da sie vor dem Hintergrund des weltweit niedrigen Zinsumfelds besonders attraktiv für ertragsorientierte Anleger sind.

Auf regionaler Ebene schmälerten Mittel- und Osteuropa sowie der Nahe Osten und Afrika das Fondsergebnis im Berichtszeitraum erheblich, während Lateinamerika und Asien leicht positiv beisteuerten.

Die stärksten positivsten Performancebeiträge kamen aus Chile, Kolumbien, China, der Türkei und Argentinien, während die Ukraine, Saudi-Arabien, Mexiko, Indonesien und Brasilien sich als die größten Verlustbringer erwiesen.

Auf Sektorebene steuerten Technologie, Medien und Telekommunikation, Zellstoff und Papier, Industrie und Staatsanleihen am stärksten positiv bei. Versorger, Immobilien, Öl und Gas sowie Konsumgüter bescherten die größten Verluste.

Investment-Grade-Anleihen, insbesondere BBB-Papiere, schmälerten das Fondsergebnis. *Hochzinsanleihen* steuerten ebenfalls negativ zum Fondsergebnis bei. Hauptgrund waren C-Anleihen, wenngleich B-, CCC- und CC-Anleihen sich leicht positiv auswirkten.

Der Manager nahm im Berichtszeitraum verschiedene Anpassungen der Fondspositionen vor. Daneben beteiligte er sich auch selektiv am Primärmarkt. Als die Pandemie im ersten Quartal einsetzte, wurde das Engagement bei Hochzinsanleihen leicht reduziert, da der Fonds *defensiver* ausgerichtet wurde. Angesichts der umfangreichen politischen Hilfsprogramme, der Wiedereröffnung der Volkswirtschaften und der attraktiven Bewertungen investierte der Manager im zweiten Quartal jedoch Barmittel, bevor er diese zur Finanzierung der für Juli erwarteten Neuemissionen aufstockte. Insgesamt ist der Fonds angesichts des optimistischen kurzfristigen Ausblicks des Managers bei *Hochzinsanleihen* übergewichtet und setzt auf eine leichte Long-Position auf die Duration. Der Fonds investiert nach wie vor bevorzugt in Lateinamerika sowie Mittel- und Osteuropa statt in Asien.

Die Lockerung der Beschränkungen hat die Stimmungsumfragen sprunghaft nach oben befördert. Dadurch sind die Markterwartungen für ein Einsetzen des Aufschwungs im dritten Quartal des Jahres gestiegen. Die Form der Erholung ist jedoch nach wie vor ungewiss und wird wahrscheinlich von Land zu Land unterschiedlich sein. Darüber hinaus könnten die Angst vor einer zweiten Welle und die Wiedereröffnung der Volkswirtschaften zu einem sprunghaften Anstieg der Volatilität führen.

Der Manager geht davon aus, dass sich die Spreads von Schwellenländer-Unternehmensanleihen weiter verengen werden, während sich die Volkswirtschaften der Schwellenländer (in unterschiedlichem Maße) erholen, unterstützt durch ihre jeweiligen laufenden politischen Hilfsmaßnahmen. Die Käufe von Unternehmensanleihen der Industrieländer durch Zentralbanken weltweit könnten durchsickern und zu einer weiteren Verengung der *Spreads* in Schwellenländern führen.

Auf Bottom-up-Basis werden Schwellenländer-Unternehmensanleihen nach wie vor durch äußerst attraktive Bewertungen und nach Ansicht des Managers robuste *Fundamentaldaten* unterstützt.

Der Manager beurteilt Schwellenländer-Unternehmensanleihen nach wie vor optimistisch und hat eine Barbell-Position (Positionen am langen und kurzen Ende des Laufzeitspektrums) auf *Investment-Grade*- und *Hochzins*-Unternehmensanleihen aus Schwellenländern. Der optimistische Ausblick des Managers könnte sich eintrüben, wenn das Angebot am Primärmarkt stärker als erwartet steigt bzw. wenn die Attraktivität der Bewertungen durch eine steile Rally sowohl historisch als auch im Vergleich zu den Bewertungen in Industrieländern sinkt.

Insight Investment Management (Global) Limited
Juli 2020

BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT FUND

Die Anteilsklasse USD A des Fonds verzeichnete im sechsmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -5,81 %. Im Vergleich dazu rentierten der JP Morgan EMBI Global TR Index mit -1,87 % und der Lipper Global – Bond Emerging Markets Global HC Sektordurchschnitt mit -3,64 %, jeweils gemessen in US-Dollar.

Die Finanzmärkte litten in der ersten Jahreshälfte 2020 aufgrund der globalen Auswirkungen der COVID-19-Pandemie unter einer starken *Volatilität*. Als die Wirtschaftstätigkeit zum Erliegen kam, stürzten *Aktien* im ersten Quartal ab, erholten sich jedoch im zweiten Quartal, als die Volkswirtschaften rund um den Globus wieder geöffnet wurden, und sich die Hoffnung auf einen potenziellen Impfstoff belebte.

REGIONALE & SPEZIALISIERTE FESTVERZINSLICHE WERTPAPIERE Forts.

BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT FUND Forts.

Die regelmäßig veröffentlichten Daten belegten, dass die *geld-* und *fiskalpolitischen* Stimulierungsmaßnahmen in Industrie- und Schwellenländer zaghafte Positiv-Signale bescherten. Die politischen Hilfsprogramme wurden fortgesetzt und die Produktion in China erholt sich. Der Welthandel wurde jedoch stark gebremst und die erste Coronawelle breitet sich weiterhin weltweit aus.

Der Fonds entwickelte sich im ersten Halbjahr 2020 unterdurchschnittlich. Diese Underperformance ging größtenteils auf das Konto von *Long*-Positionen in ölsensitiven Ländern und Unternehmen während des Ausverkaufs zu Jahresbeginn. In der zweiten Hälfte des Berichtszeitraums erholte sich die Titelauswahl wieder, insbesondere bei lateinamerikanischen Unternehmensanleihen. Dennoch brachte die *Titelauswahl* während des Berichtszeitraums Verluste ein. Bei der Vermögensallokation dominierten in der ersten Jahreshälfte die Themen aus der heftigen Kursbewegung im ersten Quartal.

Zu Beginn des Berichtszeitraums nahm der Fonds mehrere *Investment-Grade*-Titel aus dem umfangreichen Angebot zu Jahresbeginn auf. Als der Ausverkauf begann und der Primärmarkt versiegte, konzentrierte sich der Manager auf die Umschichtung von ölsensitiven in *defensive* Werte. Ein weiteres übergreifendes Handelsthema war der Fokus auf *Unternehmensanleihen* mit geringer Abhängigkeit von Tourismus und Überweisungen.

Der Verlauf der Pandemie ist für den weltwirtschaftlichen Ausblick entscheidend. In Asien ist das Virus inzwischen weitgehend unter Kontrolle und regionale Politiker haben den Schwerpunkt von der Triage auf die Erholung verlagert. Leider ist das weltweite Klima alles andere als heiter. Die USA und Lateinamerika stecken nach wie vor tief in der Krise. Die unverzügliche politische Reaktion der Zentralbanken hat die Ordnung an den Finanzmärkten wiederhergestellt, und staatliche Hilfen haben den Negativschock für die Einkommen privater Haushalte abgefedert. Dennoch ist eine Rückkehr zum Vorkrisen-Niveau der Wirtschaftsleistung nach Ansicht des Managers bis auf Weiteres nicht in Sicht.

Die Welt scheint ein ungewöhnlich unsicherer Ort zu sein. Schocks von historischer Dimension hinterlassen ihre Spuren in der Weltwirtschaft, und die politischen Entscheidungsträger haben entsprechend reagiert. Wie so oft sind die wirtschaftlichen Aussichten mit den politischen Aussichten verbunden, insbesondere mit den Bemühungen um eine Eindämmung. In dem Maß wie sich die Diskussion über die Kompromisse zwischen wirtschaftlicher und physischer Gesundheit entwickelt, werden sich auch die relativen Prioritäten der politischen Entscheidungsträger weiterentwickeln. Der Manager geht davon aus, dass die

neue Normalität nach der Krise von niedriger *Inflation*, hoher Arbeitslosigkeit und anhaltenden staatlichen Eingriffen in die Finanzmärkte gekennzeichnet sein wird. Angesichts dieses düsteren Trends sieht der Manager weiterhin Abwärtsrisiken.

Mellon Investments Corporation
Juli 2020

BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT LOCAL CURRENCY FUND

Die Anteilsklasse USD A des Fonds erzielte im sechsmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -9,50 %, verglichen mit einer Rendite von -6,89 % für den JP Morgan GBI-EM Global Diversified TR Index und -7,17 % für den Lipper Global – Bond Emerging Markets Global LC Sektordurchschnitt. Alle Angaben in US-Dollar.

Die Finanzmärkte litten in der ersten Jahreshälfte 2020 aufgrund der globalen Auswirkungen der COVID-19-Pandemie unter einer starken *Volatilität*. Als die Wirtschaftstätigkeit zum Erliegen kam, stürzten *Aktien* im ersten Quartal ab, erholten sich jedoch im zweiten Quartal, als die Volkswirtschaften rund um den Globus wieder geöffnet wurden, und sich die Hoffnung auf einen potenziellen Impfstoff belebte.

Die regelmäßig veröffentlichten Daten belegten, dass die *geld-* und *fiskalpolitischen* Stimulierungsmaßnahmen in Industrie- und Schwellenländer zaghafte Positiv-Signale bescherten. Die politischen Hilfsprogramme wurden fortgesetzt und die Produktion in China erholt sich. Der Welthandel wurde jedoch stark gebremst und die erste Coronawelle breitet sich weiterhin weltweit aus.

Der Fonds hielt in der ersten Jahreshälfte hauptsächlich *Long*-Positionen auf Schwellenländerwährungen und lokale Zinsmärkte. *Long*-Positionen in Schwellenländerwährungen, insbesondere in ölsensitiven Währungen, schnitten im Allgemeinen unterdurchschnittlich ab, darunter der argentinische Peso, der brasilianische Real, der kolumbianische Peso und der chilenische Peso. Die Entwicklung an den Zinsmärkten war durchwachsen. An die Spitze setzte sich eine *Long*-Position auf inflationsgebundene argentinische Anleihen und eine *Long*-Position auf die russischen Zinsmärkte. Dagegen schmälerten die Zinspositionen das Fondsergebnis, da die lokalen halbstaatlichen Organisationen PEMEX (Mexiko) und EPM (Kolumbien) unter Druck gerieten.

Im ersten Quartal reduzierte der Manager das Risiko an den Zinsmärkten und bei Schwellenländerwährungen, als die wirtschaftlichen Folgen des Virus sichtbar wurden. Mehrere *Long*-Positionen wurden in Richtung Benchmark-Gewichtung verringert, unter teilweiser oder vollständiger Mitnahme der Gewinne. Einige *Long*-Positionen auf Schwellenländerwährungen wurden

REGIONALE & SPEZIALISIERTE FESTVERZINSLICHE WERTPAPIERE Forts.

BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT LOCAL CURRENCY FUND Forts.

ebenfalls verringert, hauptsächlich bei eurozentrischen Währungen. Im zweiten Quartal stockte der Manager einige Zinspositionen in Ländern wie Peru und Mexiko wieder auf. Das Währungsrisiko wurde auch durch größere *Short*-Positionen und verstärkte *Long*-Positionen bzw. reduzierte *Untergewichtungen* erhöht.

Der Verlauf der COVID-19-Pandemie ist für den weltwirtschaftlichen Ausblick entscheidend. In Asien ist das Virus inzwischen weitgehend unter Kontrolle und regionale Politiker setzen statt Triage auf Genesung. Leider ist das weltweite Klima alles andere als heiter. Die USA und Lateinamerika stecken nach wie vor tief in der Krise. Die unverzügliche politische Reaktion der Zentralbanken hat die Ordnung an den Finanzmärkten wiederhergestellt, und staatliche Hilfen haben den Negativschock für die Einkommen privater Haushalte abgefedert. Dennoch ist eine Rückkehr zum Vorkrisen-Niveau der Wirtschaftsleistung nach Ansicht des Managers bis auf Weiteres nicht in Sicht.

Die Welt scheint ein ungewöhnlich unsicherer Ort zu sein. Schocks von historischer Dimension hinterlassen ihre Spuren in der Weltwirtschaft, und die politischen Entscheidungsträger haben entsprechend reagiert. Wie so oft sind die wirtschaftlichen Aussichten mit den politischen Aussichten verbunden, insbesondere mit den Bemühungen um eine Eindämmung. In dem Maß wie sich die Diskussion über die Kompromisse zwischen wirtschaftlicher und physischer Gesundheit entwickelt, werden sich auch die relativen Prioritäten der politischen Entscheidungsträger weiterentwickeln. Der Manager geht davon aus, dass die neue Normalität nach der Krise von niedriger *Inflation*, hoher Arbeitslosigkeit und anhaltenden staatlichen Eingriffen in die Finanzmärkte gekennzeichnet sein wird. Angesichts dieses düsteren Trends sieht der Manager weiterhin Abwärtsrisiken.

Mellon Investments Corporation
Juli 2020

BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT OPPORTUNISTIC FUND

Während des sechsmonatigen Berichtszeitraums erzielte die Anteilsklasse USD C des Fonds eine Rendite von -6,55%, verglichen mit einer Rendite von -3,83% für den Referenzindex, einem 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, zu 25% aus dem JP Morgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified TR Index zusammensetzt. Die Rendite des Lipper Global – Bond Emerging Markets Global HC Sektordurchschnitts betrug -7,17%, jeweils in US-Dollar.

Die Finanzmärkte litten in der ersten Jahreshälfte 2020 aufgrund der globalen Auswirkungen der COVID-19-Pandemie unter einer starken *Volatilität*. Als die Wirtschaftstätigkeit zum Erliegen kam, stürzten *Aktien* im ersten Quartal ab, erholten sich jedoch im zweiten Quartal, als die Volkswirtschaften rund um den Globus wieder geöffnet wurden, und sich die Hoffnung auf einen potenziellen Impfstoff belebte.

Die regelmäßig veröffentlichten Daten belegten, dass die *geld-* und *fiskalpolitischen* Stimulierungsmaßnahmen in Industrie- und Schwellenländer zaghafte Positiv-Signale bescheren. Die politischen Hilfsprogramme wurden fortgesetzt und die Produktion in China erholt sich. Der Welthandel wurde jedoch stark gebremst und die erste Coronawelle breitet sich weiterhin weltweit aus.

Der Fonds entwickelte sich im ersten Halbjahr 2020 unterdurchschnittlich. Im *Hartwährungs*-Segment ging das unterdurchschnittliche Ergebnis hauptsächlich auf das Konto von *Long*-Positionen auf ölsensitive Länder und Unternehmen während des Ausverkaufs Anfang des Jahres. Bei der Vermögensallokation dominierten in der ersten Jahreshälfte die Themen aus der heftigen Kursbewegung im ersten Quartal. Der Fonds hielt in der ersten Jahreshälfte hauptsächlich *Long*-Positionen auf Schwellenländerwährungen und lokale Zinsmärkte. *Long*-Positionen in Schwellenländerwährungen, insbesondere in ölsensitiven lateinamerikanischen Währungen wie dem argentinischen Peso, dem brasilianischen Real, dem kolumbianischen Peso und dem chilenischen Peso, hielten nicht Schritt.

Die Entwicklung an den Zinsmärkten war durchwachsen. An die Spitze setzte sich eine *Long*-Position auf inflationsgebundene argentinische Anleihen und eine *Long*-Position auf die südafrikanischen sowie die russischen Zinsmärkte. Dagegen schmälerten die Zinspositionen das Fondsergebnis, da die lokalen *halbstaatlichen* Organisationen PEMEX (Mexiko) und EPM (Kolumbien) unter Druck gerieten.

Im Lokalwährungssegment reduzierte der Fonds das Risiko sowohl an den Zinsmärkten und bei Schwellenländerwährungen, als die wirtschaftlichen Folgen des Virus sichtbar wurden. Mehrere *Long*-Positionen wurden in Richtung Benchmark-Gewichtung verringert, unter teilweiser oder vollständiger Mitnahme der Gewinne. Einige *Long*-Positionen auf Schwellenländerwährungen wurden ebenfalls verringert, hauptsächlich bei eurozentrischen Währungen. Im zweiten Quartal stockte der Manager einige Zinspositionen in Ländern wie Peru und Mexiko wieder auf. Das Währungsrisiko wurde auch durch größere *Short*-Positionen und verstärkte *Long*-Positionen bzw. reduzierte *Untergewichtungen* erhöht. Als der Ausverkauf begann und der Primärmarkt versiegte,

REGIONALE & SPEZIALISIERTE FESTVERZINSLICHE WERTPAPIERE Forts.

BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT OPPORTUNISTIC FUND Forts.

konzentrierte sich der Manager im Hartwährungssegment auf die Umschichtung von ölsensitiven in *defensive* Titel. Ein weiteres übergreifendes Handelsthema war der Fokus auf *Unternehmensanleihen* mit geringer Abhängigkeit von Tourismus und Überweisungen.

Der Verlauf der COVID-19-Pandemie ist für den weltwirtschaftlichen Ausblick entscheidend. In Asien ist das Virus inzwischen weitgehend unter Kontrolle und regionale Politiker haben den Schwerpunkt von der Triage auf die Erholung verlagert. Leider ist das weltweite Klima alles andere als heiter. Die USA und Lateinamerika stecken nach wie vor tief in der Krise. Die unverzügliche politische Reaktion der Zentralbanken hat die Ordnung an den Finanzmärkten wiederhergestellt, und staatliche Hilfen haben den Negativschock für die Einkommen privater Haushalte abgefedert. Dennoch ist eine Rückkehr zum Vorkrisen-Niveau der Wirtschaftsleistung nach Ansicht des Managers bis auf Weiteres nicht in Sicht.

Die Welt scheint ein ungewöhnlich unsicherer Ort zu sein. Schocks von historischer Dimension hinterlassen ihre Spuren in der Weltwirtschaft, und die politischen Entscheidungsträger haben entsprechend reagiert. Wie so oft sind die wirtschaftlichen Aussichten mit den politischen Aussichten verbunden, insbesondere mit den Bemühungen um eine Eindämmung. In dem Maß wie sich die Diskussion über die Kompromisse zwischen wirtschaftlicher und physischer Gesundheit entwickelt, werden sich auch die relativen Prioritäten der politischen Entscheidungsträger weiterentwickeln. Der Manager geht davon aus, dass die neue Normalität nach der Krise von niedriger *Inflation*, hoher Arbeitslosigkeit und anhaltenden staatlichen Eingriffen in die Finanzmärkte gekennzeichnet sein wird. Angesichts dieses düsteren Trends sieht der Manager weiterhin Abwärtsrisiken.

Mellon Investments Corporation
Juli 2020

BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT TOTAL RETURN FUND

Die Anteilsklasse USD W (Acc.) des Fonds erzielte im sechsmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -3,66%, verglichen mit einer Rendite von -3,27% für die Benchmark* und -7,17% für den Lipper Global – Bond Emerging Markets Global LC-Sektordurchschnitt. Alle Angaben in US-Dollar.

Der Fonds erzielte eine Negativrendite und hielt nicht mit seiner Benchmark Schritt, übertraf aber den Sektordurchschnitt.

Nach dem dramatischen Ausverkauf im März aufgrund der COVID-19-Pandemie wurden Schwellenländer-Anleihen durch die Zinssenkungen zahlreicher Zentralbanken in Entwicklungs- und Industrieländern, einen schwächeren US-Dollar und die sich erholenden Rohstoffpreise unterstützt.

Während die Weltwirtschaft deutlich an Fahrt verliert, verzeichnen lokale Volkswirtschaften weiterhin relativ hohe Wachstumsraten. Die Anlageklasse erholte sich ungeachtet der Sorgen über eine mögliche zweite Coronawelle, den globalen Handelskrieg und die erhöhte *geopolitische* Unsicherheit in verschiedenen Regionen. Angesichts der rückläufigen *Volatilität* verzeichneten Schwellenländer-Anleihen wachsende Mittelzuflüsse, da sie vor dem Hintergrund des weltweit niedrigen Zinsumfelds besonders attraktiv für ertragsorientierte Anleger sind.

Auf regionaler Ebene schmälerten Lateinamerika und vor allem Asien das Fondsergebnis und in gewissem Umfang auch der Nahe Osten und Afrika. Mittel- und Osteuropa steuerten unterdessen positiv bei.

Die Devisenallokationen schmälerten das Fondsergebnis. Die größten Negativbeiträge kamen aus Brasilien, Kolumbien und Südafrika, während sich Tschechien und Ägypten positiv auswirkten. Auf US-Dollar lautende Unternehmensanleihen bremsten das Ergebnis ebenfalls, insbesondere in Mexiko, Indonesien, Saudi-Arabien und den Vereinigten Arabischen Emiraten; Kolumbien, Ghana, Kuwait und die Türkei zahlten sich jedoch aus. Unterdessen wirkten sich die Positionen in Lokalwährungen positiv auf die Renditen aus, insbesondere in Südafrika, Mexiko und Indonesien, aber Peru, Rumänien und Thailand belasteten. Auf US-Dollar lautende Staatsanleihen wirkten sich ebenfalls günstig aus: Mexiko, die Vereinigten Arabischen Emirate und Israel lieferten die größten Positivbeiträge, während Ecuador, Argentinien und die Dominikanische Republik die größten Verluste einbrachten.

Der Manager nahm im Berichtszeitraum verschiedene Anpassungen der Fondspositionen vor. Als die Pandemie im ersten Quartal einsetzte, wurde das Risiko leicht verringert, da der Fonds *defensiver* ausgerichtet wurde. Angesichts der umfangreichen *fiskal-* und *geldpolitischen* Impulse, der Wiedereröffnung der Volkswirtschaften und attraktiven Bewertungen investierte der Manager im zweiten Quartal jedoch Barmittel. Insgesamt ist der Fonds nun bei Staatsanleihen und lokalen Zinsmärkten übergewichtet. Am Ende des Berichtszeitraums war der Fonds bei Unternehmensanleihen neutral und bei Devisen *untergewichtet*.

Die Lockerung der Beschränkungen hat die Stimmungsumfragen sprunghaft nach oben befördert. Dadurch sind die Markterwartungen für ein Einsetzen des

REGIONALE & SPEZIALISIERTE FESTVERZINSLICHE WERTPAPIERE Forts.

BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT TOTAL RETURN FUND Forts.

Aufschwungs im dritten Quartal des Jahres gestiegen. Die Form der Erholung ist jedoch nach wie vor ungewiss und wird wahrscheinlich von Land zu Land unterschiedlich sein. Darüber hinaus könnten die Angst vor einer zweiten Coronawelle und die Wiedereröffnung der Volkswirtschaften zu einem sprunghaften Anstieg der *Volatilität* führen.

Der Manager geht davon aus, dass die Schwellenländer-*Spreads* weiter einlaufen, während sich die Volkswirtschaften der Schwellenländer dank der jeweils laufenden politischen Hilfsmaßnahmen (in unterschiedlichem Maße) erholen. Die Käufe von Unternehmensanleihen der Industrieländer durch Zentralbanken weltweit könnten durchsickern und zu einer weiteren Verengung der *Spreads* in Schwellenländern führen. Gemessen an ihren Bewertungen hält der Manager Schwellenländer-Anlageklassen nach wie vor für attraktiv. Der Ausblick des Managers wird vor allem durch einen starken Anstieg der COVID-19-Fälle gefährdet, der führenden Volkswirtschaften einen weiteren umfassenden Lockdown bescheren könnte. Zu den übrigen Risiken gehört eine Verschärfung der Spannungen zwischen den USA und China im Vorfeld der US-Wahlen, die zu einer Aussetzung des Teilabkommens führen könnte. Ein weiteres Risiko sind stärkere Zinsschwankungen, wenn der Markt vorübergehend die Annahme bezweifelt, dass die Zentralbanken genügend Anleihen kaufen können, um die Form der *Zinskurven* zu kontrollieren.

* 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
Juli 2020

BNY MELLON EUROLAND BOND FUND

Die Anteilsklasse Euro A des Fonds erzielte im sechsmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -0,76%, verglichen mit einer Rendite von 1,24% für den Bloomberg Barclays Euro Aggregate Bond TR Index und -0,41% für den Lipper Global – Bond EUR-Sektordurchschnitt. Alle Angaben in Euro.

Die Märkte tendierten zu Jahresbeginn robust und legten ungeachtet der geopolitischen Spannungen zwischen den USA und dem Iran weiter zu. Aufgrund der raschen Ausbreitung von COVID-19 und der beispiellosen Reaktionen von Regierungen, die die Weltwirtschaft faktisch zum Erliegen brachten, trübte sich die Stimmung jedoch dramatisch ein. Im zweiten Quartal setzte eine langsame Erholung an den Märkten ein, als die *geld- und fiskalpolitischen* Stimulierungsmaßnahmen in Industrie- und Schwellenländer zaghafte Positiv-Signale

in den regelmäßig veröffentlichten Daten bescherten. Die politischen Hilfsmaßnahmen dauern an und in China, dem Ausgangspunkt der Pandemie, erholt sich die Produktion wieder. Der Welthandel wurde jedoch erheblich beeinträchtigt, und die erste Coronawelle breitet sich weltweit weiter aus.

Der Fonds war vor dem Ausverkauf im März bei Investment-Grade-Unternehmensanleihen weitgehend neutral positioniert, da er das Wertpotenzial auf diesem Markt als gering einstufte. Gleichzeitig war er bei Schwellenländeranleihen deutlich *übergewichtet*, was zu der erheblichen Underperformance des Fonds im ersten Quartal des Jahres beitrug, als sich die *Spreads* von Schwellenanleihen in *Hartwährung* weiteten und Lokalwährungsanleihen unter dem starken US-Dollar litten.

Die Verzerrungen bei den *Kreditspreads* im März boten für den Fonds eine attraktive Gelegenheit, um die Allokation auf Unternehmensanleihen zu erhöhen und vom zusätzlichen Renditevorsprung und der Aussicht auf eine Spreadverengung zu profitieren.

Der Bloomberg Barclays Euro Aggregate IG Corporate Index *Spread* markierte am 24. März bei 247 *Basispunkten* (*Bp*) einen Höchststand und beendete das erste Quartal mit 239 *Bp*., nachdem er das Jahr mit 93 *Bp*. begonnen hatte. Im zweiten Quartal 2020 liefen die *Spreads* um 90 *Basispunkte* auf 149 *Basispunkte* ein. Die deutliche *Übergewichtung* dieses Sektors sowie das Engagement in Hochzinsunternehmensanleihen abseits der Benchmark, das in diesem Zeitraum ebenfalls deutlich verringert wurde, trugen wesentlich zur Outperformance im zweiten Quartal 2020 bei. Die *Übergewichtung* von Unternehmensanleihen ist nach wie vor eine starke Anlageüberzeugung des Investmentteams.

Der Fonds hat sein Engagement in Staatsanleihen aus Industrieländern im sechsmonatigen Berichtszeitraum von etwa indexneutral bei ca. 57% auf fast 22% untergewichtet auf ca. 35,8% im Fonds gegenüber 57,7% in der Benchmark reduziert.

Die Gesamtduration des Fonds belief sich am 30. Juni 2020 auf 7,35 Jahre, was einem Rückgang um 0,2 Jahre seit Ende 2019 entspricht. Zu den länderspezifischen *übergewichteten* Durationspositionen gehören Spanien, Australien, Zypern, Italien und Portugal, während die Durationspositionen in Deutschland und den USA im Vergleich zur Benchmark *untergewichtet* sind. Die Benchmark-Duration lag am 30. Juni 2020 bei 7,51 Jahren und hat sich seit Dezember letzten Jahres um ca. 0,3 Jahre verlängert.

Mellon Investments Corporation
Juli 2020

REGIONALE & SPEZIALISIERTE FESTVERZINSLICHE WERTPAPIERE Forts.

BNY MELLON EUROPEAN CREDIT FUND

Die Anteilsklasse Euro A des Fonds erzielte im sechsmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von -2,15 %, verglichen mit einer Rendite von -1,22 % für den Markit iBoxx Euro Corporates TR Index und -1,95 % für den Lipper Global – Bond EUR Corporates Sektordurchschnitt. Alle Angaben in Euro.

Der Fonds erzielte eine Negativrendite und hielt weder mit seiner Benchmark noch mit dem Sektordurchschnitt Schritt.

Die COVID-19-Pandemie löste im ersten Quartal einen massiven Ausverkauf an den Finanzmärkten aus. Beispiellose fiskal- und geldpolitische Stimulierungsmaßnahmen sowie die Wiedereröffnung der Volkswirtschaften bewirkten anschließend jedoch eine kräftige Erholung. Der globale Handelskrieg lastete weiterhin auf den Märkten, obwohl die USA und China im Januar ein „Teilabkommen“ erzielten. Die Brexit-Sorgen blieben ebenfalls bestehen, da Großbritannien bis zum Jahresende ein vorläufiges Handelsabkommen mit der EU unter Dach und Fach bringen will. Die Europäische Zentralbank (EZB) ließ ihren Hauptrefinanzierungssatz bei 0 %, legte aber inzwischen ein Pandemie-Notfallankaufprogramm (PEPP) in Höhe von 1,35 Bio. Euro auf. Die US-Notenbank Federal Reserve (Fed) senkte den Leitzins auf eine Spanne zwischen 0 und 0,25 % und kündigte unbegrenzte Anleihekäufe an. Die Bank of England (BoE) senkte ihren Leitzins um 65 Basispunkte auf 0,1 % und erhöhte die *quantitative Lockerung* auf 745 Mrd. Pfund. Angesichts der gedämpften Basisinflation, Anzeichen für eine wirtschaftliche Erholung und der anhaltenden Hilfsmaßnahmen der EZB erholten sich europäische Unternehmensanleihen nach ihrem Ausverkauf im März wieder, beendeten den Berichtszeitraum aber dennoch im Minus.

Die Unternehmensanleihestrategie erwies sich im ersten Quartal, insbesondere im März, als Nachteil, da sich die Spreads weiteten. Diese Verluste wurden jedoch im zweiten Quartal zum Teil wettgemacht, als sich die *Spreads* wieder verengten. Während die Titelauswahl in einigen Sektoren während des Berichtszeitraums durchweg positiv war, brachten die *Durations*- und Renditekurvenstrategien des Fonds leichte Verluste ein.

Bei der Wertpapierauswahl konzentrierte sich der Manager im Berichtszeitraum auf Neuemissionen in unterschiedlichen Sektoren und verringerte das Engagement auf einige wenige Namen.

Die größten *Übergewichtungen* des Fonds liegen in den Bereichen Telekommunikation, *nachrangige* Versicherungen, *Residential Mortgage-backed Securities* und Energie, während Versorger, Transport, *zyklische* Konsum- und Investitionsgüter untergewichtet sind. Der

Fonds hält ein minimales Engagement in nicht auf Euro lautenden Schuldtiteln (US-Dollar und Pfund Sterling).

Die US-Notenbank Fed erklärte, dass die Zinsen mindestens bis Ende 2022 auf Eis gelegt werden. Derzeit geht die Fed davon aus, dass die Zinsen nicht angehoben werden, bis sie ihre Beschäftigungs- und Inflationsziele erreicht hat, was vor Ende 2022 nach Ansicht des Managers unwahrscheinlich ist. Kurzfristig bleiben die Abwärtsrisiken bestehen, Negativzinsen scheinen jedoch unwahrscheinlich. Die Fed erwägt jedoch eine Kontrolle der Renditekurven, wobei sie sich wahrscheinlich auf Laufzeiten von bis zu fünf Jahren konzentrieren wird. Der Manager erwartet, dass die Zinsen über längere Zeit stabil bleiben und sich dann ab Ende 2024 allmählich normalisieren werden. Eine relativ steile Zinskurve und eine Korrektur des langfristigen neutralen Zinssatzes sind wahrscheinlich.

Angesichts des verlangsamten Wachstums kündigte die EZB auf ihrer Juni-Sitzung an, dass sie den Umfang des PEPP um 600 Mrd. Euro auf 1,35 Bio. Euro erhöht und die Käufe im Rahmen des Programms mindestens bis Juni 2021 fortgesetzt werden. *Fällige Anleihen* werden mindestens bis Ende 2022 reinvestiert. Das PEPP hat sich zum wichtigsten politischen Instrument der EZB als Reaktion auf die Krise entwickelt. Die Dauer des Programms, die Anlageklassen und Länder werden weiterhin überwacht, aber der Manager erwartet bis zum Jahresende keine nennenswerten Änderungen.

Insight Investment Management (Global) Limited
Juli 2020

BNY MELLON U.S. MUNICIPAL INFRASTRUCTURE DEBT FUND

Die Anteilsklasse USD C (Acc.) erzielte im sechsmonatigen Berichtszeitraum eine Rendite von 4,12 %. Im Vergleich dazu rentierte die Benchmark (50 % Bloomberg Barclays US Municipal Bond TR Index, 50 % Bloomberg Barclays Taxable US Municipal Bond TR Index) mit 4,60 %, jeweils in US-Dollar.

Der Fonds ist bestrebt, die Relative-Value-Chancen auf dem gesamten US-Markt für Kommunalanleihen zu nutzen, um ausreichende Erträge für den Kapitalerhalt zu erzielen. Der Fonds kann sowohl steuerbare als auch steuerbefreite Instrumente halten und in US-Emittenten auf State-, County- oder Kommunalebene über Revenue Bonds und allgemeine Schuldeninstrumente anlegen.

Der Fonds wies am 30. Juni 2020 eine Duration von 6,83 Jahren auf und hatte ein durchschnittliches *Kreditrating* von A. Der Fonds umfasste rund 180 Einzeltitel und generierte damit eine aktuelle gewichtete Rendite von 3,61 % (2,40 % auf einer *Yield-to-Worst-Basis*), jeweils in US-Dollar.

REGIONALE & SPEZIALISIERTE FESTVERZINSLICHE WERTPAPIERE Forts.

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

Der Fonds investiert in Emittenten aus vielen US-Bundesstaaten, obgleich die wirtschaftlich bedeutenderen und bevölkerungsreicheren Staaten einen bedeutenden Anteil der Portfoliotitel ausmachen. Aufgeschlüsselt nach Bundesstaaten stellen die fünf größten Fonds-Positionen rund 52 % des Fonds dar und umfassen Anleiheemittenten mit Sitz in Kalifornien, Illinois, Pennsylvania, New York und Florida.

Der Fonds investiert weiterhin bevorzugt in Revenue Bonds, bei denen sich das Exposure auf rund 78 % belief, gegenüber ca. 62 % in der Benchmark. Dabei bestehen *Übergewichtungen* in den Sektoren Kliniken und Flughäfen. Etwa 10 % des Fondsvermögens ist in General Obligation Bonds investiert, während sich ihre Gewichtung in der Benchmark auf ca. 19 % beläuft. Das Engagement in steuerbefreiten Wertpapieren machte rund 30 % aus, und das restliche Fondsvermögen war in steuerbare Kommunalanleihen und Barmittel investiert.

Seit seiner Auflegung im April 2017 zog der Fonds in großem Umfang internationale Anleger an. Das verwaltete Anlagevermögen belief sich am 30. Juni 2020 auf 500 Mio. US-Dollar.

Mellon Investments Corporation
Juli 2020

Alle Daten von Lipper, Stand: 30. Juni 2020. 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 Seite 46-49 zu finden.

GLOSSAR DER FINANZBEGRIFFE

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.	Anleihen	In diesem Kontext ist es ein Synonym für Unternehmensanleihen, d.h. Schuldverschreibungen von Unternehmen.
Asset-Backed Securities (ABS)	Ein strukturiertes Finanzprodukt aus Darlehen, bei dem die Zahlungsansprüche des Inhabers durch einen Bestand an Forderungen besichert werden. Typischerweise sind diese Sicherungen Hypotheken oder Kreditkartenforderungen.	Kreditrating	Eine Bewertung der Kreditwürdigkeit eines Kreditnehmers, wie etwa eines bestimmten Unternehmens oder eines Staates. Ein Unternehmen mit einem AAA-Rating ist kreditwürdiger als ein Unternehmen mit einem BBB-Rating.
Basispunkte (Bp.)	Basispunkt (Bp.) bezieht sich auf eine gemeinsame Messeinheit für Zinssätze und sonstige Finanzprozentsätze. Ein Basispunkt (Bp.) entspricht 1/100 von 1 % oder 0,01 % oder 0,0001.	Kreditspreads	Die Renditedifferenz zwischen zwei Anleihen ähnlicher Laufzeit, aber unterschiedlicher Bonität; wenn z.B. der 10-Jahres-Treasury (US-Staatsanleihe) mit einer Rendite von 6 % gehandelt wird und eine 10-Jahres-Unternehmensanleihe mit einer Rendite von 8 %, bedeutet dies, dass die Unternehmensanleihe einen Spread gegenüber dem Treasury von 200-Basispunkten bietet. Werden Kreditspreads größer, deutet dies darauf hin, dass die Fähigkeit des Kreditnehmers, seinem Schuldendienst nachzukommen, geringer wird. Verengen sich Kreditspreads, deutet dies darauf hin, dass sich die Kreditwürdigkeit erhöht. Siehe dazu auch die Begriffsbestimmungen zu Rendite und Basispunkte.
Hausse/auf Hausse gerichtet	Steht für Hausse oder Aufschwung. Ein Bulle ist ein Anleger, der normalerweise optimistisch ist, dass der Preis eines Wertpapiers oder Marktes steigt.	Zyklischer	Eine zyklische Aktie oder Branche gilt als anfälliger gegenüber der Wirtschaftslage. Das heißt, die Erträge sind allgemein höher in Zeiten des Aufschwungs und einer florierenden Konjunktur und niedriger in Zeiten des Abschwungs und Konjunkturrückgangs.
Hausse-Markt	Ein Markt, auf dem die Wertpapierpreise steigen, häufig gekennzeichnet durch Optimismus und Vertrauen der Anleger auf anhaltend hohe Erträge.	Ausfall	Wenn ein Schuldner Zinsen und Kapital bei einem Darlehen oder Wertpapier bei Fälligkeit nicht zurückzahlen kann.
Kaufoption(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.	Ausfallrate	Ein statistisches Maß, das den Prozentsatz von Emittenten bestimmt festverzinslicher Instrumente angibt, die in den 12 Vormonaten ihren Schuldendienst nicht leisten konnten. Enthält z.B. eine Anlageklasse 100 Einzelemitenten und zwei von ihnen fielen in den 12 Vormonaten aus, wäre die Ausfallrate 2 %.
Nicht-Basiskonsumgüter	Nicht-Basiskonsumgüter gelten für Verbraucher nicht unbedingt notwendig, aber wünschenswert, wenn sie über ein ausreichendes Einkommen für den Kauf verfügen.	Defensiv	Eine defensive Aktie oder Branche ist weniger anfällig gegenüber der Wirtschaftslage, so dass die Erträge und Dividenden im Allgemeinen stabil sind.
Basiskonsumgüter	Waren und Dienstleistungen, die für den Bedarf notwendig sind, unabhängig von der finanziellen Lage einer Person.	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, der auf dem Vermögenswert oder den Vermögenswerten basiert. Sein Preis bestimmt sich durch Schwankungen des Basiswerts. Zu den gängigsten Basiswerten gehören Aktien, Anleihen, Rohstoffe, Währungen, Zinssätze und Marktindizes.
Konsumgüter	Produkte, die vom Durchschnittsverbraucher zum Konsum erworben werden, z.B. Kleidung, Nahrung und Schmuck.		
Verbraucherpreisindex	Ein Index, der die Preisentwicklung auf der Grundlage eines für den Verbrauch repräsentativen Waren- und Dienstleistungskorbs misst.		
Contingent Convertible Bond(s)	Eine Art festverzinsliches Instrument, das in Aktien (Unternehmensanteile) umgewandelt werden kann, wenn ein zuvor festgelegtes auslösendes Ereignis eintritt.		
Korrelation	Die Korrelation gibt an, in welchem Maß sich zwei Variablen im Verhältnis zueinander entwickeln.		

Begriff	Begriffsbestimmung	Begriff	Begriffsbestimmung
<i>Diversifiziert/Diversifizierung</i>	Anlage in vielfältige Unternehmen oder Finanzinstrumente, die sich in der Regel unterschiedlich entwickeln. Zum Beispiel Anlage in verschiedene Regionen oder Sektoren mit dem Ziel, eine schlechte Performance in einer Region durch eine positive Wertentwicklung einer anderen auszugleichen.	<i>Futures</i>	Futures sind Termingeschäfte, bei denen der Käufer bzw. der Verkäufer gezwungen ist, einen Vermögenswert 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 der zugrunde liegenden Vermögenswerte aufgeführt; die Kontrakte sind standardisiert, um den Handel mit Futures zu erleichtern.
<i>Dividende</i>	Betrag, den ein Unternehmen regelmäßig als Vergütung für das Halten von Aktien an seine Anleger bezahlt.	<i>Geopolitik/Geopolitisch</i>	Geografische Einflüsse auf die Machtverhältnisse in internationalen Beziehungen.
<i>Dividendenrendite</i>	Die Dividende für eine Aktie, ausgedrückt in Prozent der Anlagekosten, des aktuellen Marktwerts oder des Nennwerts.	<i>Bruttoinlandsprodukt (BIP)</i>	Das Bruttoinlandsprodukt ist ein monetäres Maß des Marktwertes aller Waren und Dienstleistungen, die in einem bestimmten Zeitraum hergestellt oder erbracht werden.
<i>Rückgang</i>	Ein Rückgang einer Anlage oder eines Fonds.	<i>General Obligation Bonds/ Instruments/Securities</i>	Kommunalanleihen, die mit den Steuereinnahmen des die Papiere ausgebenden staatlichen Organs abgesichert sind. Bei einem Ausfall sind General Obligation Bonds in ihrem Anspruch auf Vermögenswerte oder Steuereinnahmen der Gemeinde oft vorrangig vor anderen Schuldeninstrumenten.
<i>Duration</i>	Die Duration misst die Sensitivität einer Festzinsanlage oder Anleihe gegenüber Zinsänderungen. Je größer die Duration einer Anleihe ist, desto höher ist ihr Sensitivität gegenüber Zinsänderungen.	<i>Gilt(s)</i>	Festverzinsliches Wertpapier, das vom Vereinigten Königreich ausgegeben wird.
<i>Aktie/Aktien</i>	Von einem Unternehmen ausgegebene Anteile, die eine Eigentumsbeteiligung darstellen.	<i>Hartwährung</i>	Harte Währungen werden von Industrieländern mit starker Industrielandschaft und einer stabilen Regierung ausgegeben. Im Allgemeinen werden damit das Pfund Sterling, der Euro und der US-Dollar bezeichnet.
<i>Aktienrisikoaufschlag</i>	Bezeichnet die Differenz zu einer Anlage in eine Position oder einen Aktienmarkt, die gegenüber einem fiktiven „risikofreien“ Satz (oft längerfristige Staatsanleihen, basierend auf der Annahme, dass kein Ausfallrisiko des Staats besteht) erwartet werden kann. Diese Rendite entschädigt die Anleger für das vergleichsweise höhere Risiko, das sie mit einer Aktienanlage eingehen. Die Höhe des Aufschlags schwankt und hängt von der Höhe des Risikos einer bestimmten Position, eines Indexes oder Portfolios ab. Er verändert sich auch im Laufe der Zeit, wenn das Marktrisiko schwankt.	<i>Absicherung/absichern/ abgesichert</i>	Eine Methode, um unnötige oder unbeabsichtigte Risiken abzufangen.
<i>Eurozone</i>	Die Wirtschaftsregion, die alle Mitglieder der Europäischen Union umfasst, deren Währung der Euro ist.	<i>High Yield, Hochzins-, hochverzinslich</i>	Festverzinsliche Wertpapiere mit einer niedrigen Bonität, bei denen ein größeres Ausfallrisiko besteht als bei Wertpapieren höherer Bonität, jedoch mit einem größeren Renditepotenzial.
<i>Börsengehandelter Fonds (ETF)</i>	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.	<i>Inflation/Inflations-</i>	Der prozentuale Anstieg der Lebenshaltungskosten. Die Inflation wird normalerweise als jährlicher prozentualer Anstieg in einem Monat gegenüber dem Durchschnittspreis im Vorjahresmonat angegeben.
<i>Fiskalpolitik</i>	Ein wirtschaftspolitisches Instrument des Staates zur Beeinflussung von Steuern und Staatsausgaben.	<i>Inflationsgeschützte Anleihen</i>	Festverzinsliche Wertpapiere, bei denen sowohl der Wert des Kredits als auch die Zinszahlungen während der Laufzeit des Wertpapiers an die Inflation angepasst werden. Sie werden auch als indexgebundene Anleihen bezeichnet.
<i>Geschäftsjahr</i>	Der zwölfmonatige Zeitraum, den eine Gesellschaft für Rechnungslegungszwecke und die Erstellung des Jahresabschlusses heranzieht.	<i>Investment Grade</i>	Festverzinsliche Wertpapiere mit einem mittleren oder hohen Rating, die als mit einem geringeren Ausfallrisiko behaftet gelten als Wertpapiere mit einem niedrigeren Rating.
<i>Fundamentaldaten (Unternehmen)</i>	Grundlegende Informationen über ein System. Fundamentaldaten von Unternehmen sind Faktoren wie das Geschäftsmodell, Erträge, Bilanz und Schulden.	<i>Large Cap</i>	Der Begriff bezeichnet Unternehmen mit sehr hoher Marktkapitalisierung, basierend auf dem Marktwert der umlaufenden Aktien eines börsennotierten Unternehmens.
<i>Fundamentaldaten (Wirtschaft)</i>	Grundlegende Informationen über ein System. Wirtschaftliche Fundamentaldaten sind Faktoren wie Inflation, Beschäftigung und Wirtschaftswachstum.		

Begriff	Begriffsbestimmung	Begriff	Begriffsbestimmung
<i>Leverage</i>	In Bezug auf ein Unternehmen bezeichnet Leverage die Höhe der Verschuldung des Unternehmens in Bezug auf das vorhandene Kapital an. Ein Unternehmen, das wesentlich höhere Schulden als Kapital hat, gilt als fremdfinanziert. Der Begriff kann auch für einen Fonds angewandt werden, der Geld ausleiht oder Derivate einsetzt, um eine Anlageposition zu vergrößern.	<i>Quantitative Lockerung, expansive Geldpolitik</i>	Eine Geldpolitik, bei der eine Zentralbank Staatsanleihen oder andere Finanzwerte in einer bestimmten Menge kauft, um die Wirtschaft anzukurbeln oder die Liquidität zu erhöhen.
<i>Liquidität</i>	Liquidität beschreibt, in welchem Grad ein Vermögenswert oder Wertpapier im Markt rasch ge- oder verkauft werden kann, ohne dass der Preis dadurch beeinflusst wird. Die Marktliquidität bezieht sich darauf, in welchem Maß Vermögenswerte in einem Markt, zum Beispiel dem Aktienmarkt eines Landes, zu stabilen Preis gekauft oder veräußert werden können.	<i>Halbstaatlich</i>	„Eine Art Körperschaft im privaten Sektor, die durch eine staatliche Einrichtung unterlegt ist. Die meisten halbstaatlichen Körperschaften sind zunächst staatliche Stellen und werden anschließend separate Rechtspersonen.“
<i>Long</i>	Bezieht sich auf ein Wertpapier, das in der Erwartung gehalten wird, dass es im Wert steigt.	<i>Residential Mortgage-Backed Securities (RMBS)</i>	Wertpapier, das durch Grundpfandrechte auf einen Pool von Wohnimmobilien besichert ist.
<i>Makroökonomisch</i>	Bezieht sich auf das gesamtwirtschaftliche Verhalten. Dazu gehören auch verschiedene Faktoren, wie die Wirtschaftsleistung, die Beschäftigungslage, Inflation und Investitionen.	<i>Revenue Bonds</i>	Diese Kommunalanleihen sind zweckgebunden und werden mit den Erträgen eines bestimmten Projekts besichert. Normalerweise können Revenue Bonds von allen staatlichen Behörde oder Fonds ausgegeben werden, die wie ein Unternehmen betrieben werden, d.h. operative Einnahmen und Ausgaben haben.
<i>Laufzeit/Laufzeiten</i>	Die Zeit, bis der ursprüngliche Anlagebetrag eines festverzinslichen Wertpapiers an den Wertpapierinhaber zurückgezahlt werden muss.	<i>Riskante Vermögenswerte, Risikowert(e)</i>	Ein riskanter Vermögenswert ist ein mit einem gewissen Risiko behafteter Vermögenswert. Zu den riskanten Vermögenswerten zählen Vermögenswerte mit einer hohen Preisvolatilität, wie Aktien, Rohstoffe, Hochzinsanleihen und Währungen.
<i>Mid Cap</i>	Der Begriff bezeichnet Unternehmen mit mittlerer Marktkapitalisierung, basierend auf dem Marktwert der umlaufenden Aktien eines börsennotierten Unternehmens.	<i>Sicherer Hafen</i>	Bezieht sich auf Vermögenswerte, die Anleger für relativ sicher halten und die in unruhigen Zeiten keinen Verlust erleiden.
<i>Geldpolitische Lockerung</i>	Geldpolitik, bei der eine Zentralbank die Zinsen und Einlagensätze senkt, um den Zugang zu Krediten zu erleichtern.	<i>Wertpapier/Wertpapiere</i>	Ein handelbarer Finanzwert, wie eine Aktie eines Unternehmens oder ein festverzinsliches Wertpapier bzw. Anleihe.
<i>Geldpolitik</i>	Maßnahmen einer Zentralbank zur Beeinflussung von Geldumlauf und Zinshöhe.	<i>Short</i>	Beschreibt die Ansicht eines Fondsmanagers, dass der Markt oder ein Wertpapier an Wert verliert.
<i>Geldpolitischer Anreiz</i>	Der Versuch einer Regierung, das wirtschaftliche Wachstum durch die Ausweitung der Geldmenge (in der Wirtschaft) oder niedrigere Zinsen anzukurbeln.	<i>Small Cap</i>	Der Begriff bezeichnet Unternehmen mit geringer Marktkapitalisierung, basierend auf dem Marktwert der umlaufenden Aktien eines börsennotierten Unternehmens.
<i>Option(en)</i>	Finanzkontrakte, die das Recht, aber nicht die Pflicht beinhalten, einen Vermögenswert zu einem späteren Zeitpunkt zu einem vereinbarten Preis zu kaufen oder zu verkaufen.	<i>Spread(s)</i>	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.
<i>Übergewichtung/übergewichtet</i>	Stärkere Anlage in ein Unternehmen, eine Region oder einen Sektor als im Vergleichsindex oder bei einem vergleichbaren Produkt.	<i>Standardabweichung</i>	Ein statistisches Maß für die Abweichung einer Reihe von Daten von ihrem Mittelwert.
<i>Put-Option(en)</i>	Ein Optionskontrakt, der dem Inhaber das Recht gibt, eine bestimmte Menge eines zugrunde liegenden Wertpapiers zu einem bestimmten Preis innerhalb einer bestimmten Zeit zu verkaufen, ohne dass dieser dazu verpflichtet ist.	<i>Sub-Investment Grade</i>	Festverzinsliche Wertpapiere mit einem niedrigeren Rating. Für sie gilt ein höheres Ausfallrisiko.
		<i>Nachrangige Anleihen/ Kreditinstrumente</i>	Anleihen oder Kreditinstrumente, die in Bezug auf Forderungen anderen Schuldtiteln nachgeordnet sind.

Begriff	Begriffsbestimmung
<i>Synthetisch</i>	Eine synthetische Anlage ist eine Position, die die Merkmale einer anderen Anlage imitieren soll, ohne eine physische Position in dem zugrunde liegenden Vermögenswert zu halten.
<i>Total Return (Gesamtertrag)</i>	Der Begriff für den Gewinn oder Verlust aus einer Anlage über einen bestimmten Zeitraum. Der Total Return umfasst Einnahmen (in Form von Zinsen oder Dividenden) und Kapitalerträge.
<i>Treasury/Treasuries</i>	US-Staatsanleihen mit einer Laufzeit von über 10 Jahren. Zinszahlungen auf Treasury-Anleihen erfolgen halbjährlich.
<i>Treasury Inflation-Protected Securities (TIPS)</i>	Staatliche US-Schuldverschreibungen, 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.
<i>Untergewichtung</i>	Geringere Anlage in ein Unternehmen, eine Region oder einen Sektor als im Vergleichsindex oder bei einem vergleichbaren Produkt.
<i>Unhedged (nicht abgesichert)</i>	Eine Position, die nicht durch einen Ausgleichskontrakt oder eine Ausgleichstransaktion ausgeglichen wird.
<i>Volatilität/volatil</i>	Große und/oder häufige Auf- und Abwärtsbewegungen im Preis oder Wert einer Anlage oder des Marktes.
<i>Rendite(n)</i>	Die aus einer Anleihe erhaltenen Zinsen oder die Dividende aus einer Aktie. Sie wird üblicherweise in Prozent der Anlagekosten, des aktuellen Marktwerts oder des Nennwerts ausgedrückt.
<i>Renditekurve</i>	Die Renditekurve ist eine Linie, die die Zinsen von Anleihen derselben Bonität, aber verschiedener Laufzeit, zu verschiedenen Zeitpunkten darstellt.
<i>Yield to Worst</i>	Die potenziell niedrigste Anleiherendite, die ohne einen Ausfall des Emittenten erzielt werden kann. Dieses Maß wird zur Bewertung der Rendite im schlimmsten Fall für das Risikomanagement der Anleger verwendet, sodass bestimmte Ertragsanforderungen auch im schlimmsten Falle erfüllt werden.

ZWISCHENLAGEBERICHT

GESCHÄFTSRÜCKBLICK

Die operativen Ergebnisse sind in der Gesamtergebnisrechnung aufgeführt. Weitere Informationen zu Risikomanagement und -politik sind im Folgenden aufgeführt.

Die verwalteten Vermögenswerte per Ende des Berichtszeitraums sind in der Bilanz aufgeführt.

Eine genaue Übersicht über die Faktoren, die zum Fondsergebnis beigetragen haben, ist im Bericht des Investment Managers enthalten. Derzeit plant der Verwaltungsrat keine Veränderungen an der Struktur oder am Anlageziel der Gesellschaft.

AUSSCHÜTTUNGEN

Ausschüttungen an Anteilhaber einlösbarer partizipierender Anteile werden in der Gesamtergebnisrechnung als Finanzkosten ausgewiesen, wenn sie gemäß den Bestimmungen im Prospekt der Euronext Dublin erklärt werden. Die Ausschüttungen für die oben genannten Anteilsklassen werden in dem für die Gewährleistung einer umfassenden Ausschüttungspolitik der Gesellschaft gemäß geltendem britischem Steuerrecht erforderlichen Maße erklärt.

Nähere Angaben zu den Ausschüttungen an Inhaber einlösbarer, partizipierender Anteile sind in der Gesamtergebnisrechnung aufgeführt und Ausschüttungen, die nach dem Ende des Berichtszeitraums für Inhaber einlösbarer, partizipierender Anteile erklärt wurden, sind in Erläuterung 19 zum Halbjahresabschluss enthalten.

WICHTIGE EREIGNISSE IM BERICHTSZEITRAUM COVID-19

Im März 2020 erklärte die Weltgesundheitsorganisation COVID-19 zur Pandemie. Die diesbezüglichen Gesamtfolgen sind derzeit nicht abschätzbar, die Coronavirus-Pandemie kann jedoch zu anhaltender Marktvolatilität und einer weltweiten Wirtschaftskrise führen. Außerdem kann sie sich sehr nachteilig auf den Wert von Teilfondsanlagen und die Fähigkeit auswirken, Zugang zu Märkten zu erhalten oder die Anlagepolitik der Teilfonds wie ursprünglich angestrebt umzusetzen. Des Weiteren können staatliche Eingriffe oder sonstige Beschränkungen und Verbote, die angesichts der erheblichen Marktvolatilität vorübergehend von Aufsichtsbehörden, Börsen und Handelsplätzen auferlegt werden, die Möglichkeiten zur Umsetzung der Anlagepolitik von Teilfonds beeinträchtigen. Der Zugang zur Liquidität könnte sich für die Teilfonds schwieriger gestalten, insbesondere in Zeiten, in denen der Liquiditätsbedarf zur Erfüllung von Rücknahmeanträgen deutlich ansteigt. Die zum Betreiben der Gesellschaft erforderlichen Dienste können infolge der Pandemie zeitweilig unterbrochen werden.

Die Entwicklungen werden sorgfältig überwacht. Der Verwaltungsrat verfolgt zeitnah die Geschehnisse. Angesichts der Art des Virusausbruchs und der laufenden Entwicklungen besteht hohe Ungewissheit, und zum gegenwärtigen Zeitpunkt können keine Aussagen über das Ausmaß und die Art der gesamten zukünftigen Auswirkungen auf die Gesellschaft gemacht werden.

Seit Ende des Berichtszeitraums haben sich außer den in Erläuterung 18 zum Abschluss genannten keine bedeutenden Ereignisse im Berichtszeitraum auf die Gesellschaft ausgewirkt.

EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG

Seit Ende des Berichtszeitraums haben sich außer den in Erläuterung 19 zum Abschluss genannten keine bedeutenden Ereignisse auf die Gesellschaft ausgewirkt.

RISIKEN FÜR DIE GESELLSCHAFT

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 Marktpreisrisiko (einschließlich Marktpreisrisiko, Zinsrisiko und Währungsrisiko), das Kreditrisiko und das Liquiditätsrisiko. Die Gesellschaft nutzt Risikomanagementprogramme, um die möglichen negativen Einflüsse dieser Risiken auf die Wertentwicklung der Fonds zu begrenzen.

ZIELE UND GRUNDSÄTZE DES RISIKOMANAGEMENTS

Einzelheiten zu den wichtigsten Risiken bei Anlagen in die Gesellschaft, den Zielen und Grundsätzen des Risikomanagements, sind in Erläuterung 15 zum Halbjahresabschluss dargelegt.

TRANSAKTIONEN MIT UND POSITIONEN BEI VERBUNDENEN PARTEIEN

Außer wie in Erläuterung 10 zum Halbjahresabschluss angegeben, sind dem Verwaltungsrat keine bedeutenden Verträge oder Vereinbarungen bekannt, die in Verbindung mit der Geschäftstätigkeit der Gesellschaft stehen, an denen Verwaltungsratsmitglieder, wie im Companies Act 2014 (in seiner neusten Fassung) definiert, zu jeglicher Zeit während des Berichtszeitraums zum 30. Juni 2020 und 31. Dezember 2019 ein wirtschaftliches Interesse hatten.

TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PERSONEN

Gemäß Abschnitt 43(1) der OGAW-Richtlinien (Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren) 2019 des Central Bank Act 2013 (Abschnitt 48(1)) (Überwachung und Durchsetzung), muss jede Transaktion, die mit der Gesellschaft durch ihren Promoter, Investment Manager, ihre Depotbank, ihren Anlageberater und/oder deren verbundenen oder Konzernunternehmen („verbundene Personen“) durchgeführt wird, so abgewickelt werden, als ob sie unter normalen Marktbedingungen ausgehandelt

TRANSAKTIONEN MIT VERBUNDENEN PERSONEN

Forts.

worden wäre. Derartige Transaktionen müssen im besten Interesse der Anteilhaber sein. Neben diesen Transaktionen gibt es auch Transaktionen, die von verbundenen Personen im Auftrag der Gesellschaft durchgeführt werden, auf die die Mitglieder des Verwaltungsrats keinen direkten Zugriff haben und bei denen sich die Verwaltungsratsmitglieder auf Zusicherungen ihrer Beauftragten verlassen müssen, dass die verbundenen Personen, die solche Transaktionen ausführen, diese auf einer ähnlichen Grundlage ausführen.

Anteilhaber sollten die Governance-Struktur der Gesellschaft berücksichtigen, die insbesondere im Abschnitt „Erklärung zur Corporate Governance“ des Berichts des Verwaltungsrats im jüngsten Jahresbericht und in den geprüften Finanzausweisen der Gesellschaft für den Berichtszeitraum zum 31. Dezember 2019 beschrieben ist, und ferner die Aufgaben und Verantwortlichkeiten der jeweiligen Vertreter der Gesellschaft, die einer umfassenden Aufsicht durch den Verwaltungsrat unterliegen. Ferner sollten Anteilhaber den Prospekt lesen, in dem viele Transaktionen mit verbundenen Personen sowie die allgemeine Beschaffenheit der vertraglichen Vereinbarungen mit den wichtigsten verbundenen Personen beschrieben sind. Dabei handelt es sich aber nicht um eine vollständige Auflistung aller Transaktionen mit verbundenen Personen. Ferner werden die Anteilhaber auf die Bestimmungen des Prospekts verwiesen, die sich mit Interessenkonflikten befassen.

Daher ist der Verwaltungsrat der Gesellschaft mit Blick auf die Bestätigungen des Managers und ihrer entsprechenden Beauftragten überzeugt, dass:

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

In Erläuterung 10 sind die Transaktionen mit verbundenen Parteien im Berichtszeitraum aufgeführt. Die Anteilhaber sollten jedoch zur Kenntnis nehmen, dass nicht alle „verbundenen Personen“ verbundene Parteien sind. Ausführliche Informationen zu den an verbundene Parteien und bestimmte verbundene Personen gezahlten Gebühren sind in den Erläuterungen 3 bis 7 und 10 dargelegt.

BNY MELLON ABSOLUTE RETURN BOND FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener	Summe			Angemessener	Summe
Bestände	Beschreibung	Wert in EUR	der Netto- vermögen %	Bestände	Beschreibung	Wert in EUR	der Netto- vermögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen				Anleihen Forts.			
Überstaatlich - 5.153.938 (31. Dezember 2019: 16.772.645)		5.153.938	1,63	Frankreich - 16.696.257 (31. Dezember 2019: 17.307.995)		16.696.257	5,27
5.250.548	Insight Liquidity Funds Plc - EUR Cash Fund	5.153.938	1,63	954.000	Airbus SE 'EMTN' 1,625 % 09-Jun.-2030	970.747	0,31
Summe der Anlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen 5.153.938 1,63				925.000	Airbus SE 'EMTN' 2,375 % 07-Apr.-2032	1.017.061	0,32
Anleihen				222.000	Airbus SE 'EMTN' 2,375 % 09-Jun.-2040	230.934	0,07
Australien - 5.727.276 (31. Dezember 2019: 6.950.826)		5.727.276	1,81	2.671.000	BNP Paribas SA '144A' FRN (Immerwährend)		
3.700.000	Australia & New Zealand Banking Group Ltd '144A' FRN 0,864 % 21-Nov.-2022	3.307.720	1,05		4,500 % 25-Feb.-2030	2.083.552	0,66
260.143	Interstar Millennium Series 2006-1 Trust '2006-1 A' FRN 0,510 % 27-März-2038	146.301	0,05	805.000	BNP Paribas SA 'REGS' FRN (Immerwährend)		
231.929	Interstar Millennium Series 2006-4H Trust '2006-4H A2' FRN 0,588 % 07-Nov.-2039	128.157	0,04		7,625 % 30-März-2021	727.598	0,23
427.172	Pepper Residential Securities Trust NO 18 FRN 2,190 % 12-Aug.-2058	261.370	0,08	2.872.000	BPCE SA 'MTN' FRN 1,243 % 31-Mai-2022	2.576.349	0,82
540.185	Pepper Residential Securities Trust NO 18 FRN 2,840 % 12-Aug.-2058	331.152	0,10	415.000	Credit Agricole SA '144A' FRN (Immerwährend)		
1.577.000	Scentre Group Trust 1 / Scentre Group Trust 2 '144A' 4,375 % 28-Mai-2030	1.552.576	0,49		6,875 % 23-Sept.-2024	381.140	0,12
Belgien - 2.437.260 (31. Dezember 2019: 620.250)		2.437.260	0,77	300.000	Credit Agricole SA FRN (Immerwährend)		
1.998.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 3,700 % 02-Apr.-2040	2.437.260	0,77		7,500 % 23-Jun.-2026	359.199	0,11
Bermuda - 120.504 (31. Dezember 2019: 643.708)		120.504	0,04	600.000	Electricite de France SA 'EMTN'		
100.000	XLIT Ltd 5,250 % 15-Dez.-2043	120.504	0,04		2,000 % 09-Dez.-2049	591.018	0,19
Brasilien - 1.547.026 (31. Dezember 2019: 2.084.157)		1.547.026	0,49	200.000	Electricite de France SA 'EMTN' FRN (Immerwährend)	231.666	0,07
6.000.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,000 % 01-Jan.-2025	1.157.284	0,37	2.000.000	French Republic Government Bond OAT 0,250 % 25-Nov.-2020	2.006.100	0,63
2.000.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,000 % 01-Jan.-2027	389.742	0,12		RCI Banque SA FRN 2,625 % 18-Feb.-2030	549.438	0,17
Chile - 3.247.808 (31. Dezember 2019: 3.501.360)		3.247.808	1,03	1.980.000	Societe Generale SA 'REGS' FRN (Immerwährend)	1.850.898	0,59
910.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 4,500 % 01-März-2026	1.158.973	0,37		SPIE SA 2,625 % 18-Jun.-2026	1.558.864	0,49
2.300.000	VTR Finance NV '144A' 6,875 % 15-Jan.-2024	2.088.835	0,66	1.790.000	WEA Finance LLC '144A' 2,875 % 15-Jan.-2027	1.561.693	0,49
Kolumbien - 1.558.170 (31. Dezember 2019: 1.409.483)		1.558.170	0,49	Deutschland - 6.936.097 (31. Dezember 2019: 3.891.738)		6.936.097	2,19
750.000	Colombia Government International Bond 3,875 % 25-Apr.-2027	704.949	0,22	911.000	BMW US Capital LLC 'REGS' 4,150 % 09-Apr.-2030	933.860	0,30
3.537.200.000	Colombian TES 6,000 % 28-Apr.-2028	853.221	0,27	1.216.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 3,000 % 04-Jul.-2020	1.216.134	0,38
Dänemark - 1.072.200 (31. Dezember 2019: 3.910.009)		1.072.200	0,34	2.097.000	German Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 09-Sept.-2020	2.099.548	0,66
979.000	Danske Bank A/S 'EMTN' FRN 1,375 % 12-Feb.-2030	944.368	0,30	2.000.000	IKB Deutsche Industriebank AG FRN 4,000 % 31-Jan.-2028	1.861.000	0,59
125.000	Danske Bank A/S 'EMTN' FRN 2,500 % 21-Jun.-2029	127.832	0,04	739.000	Volkswagen Financial Services AG 'EMTN' 3,375 % 06-Apr.-2028	825.555	0,26
Ägypten - 1.282.252 (31. Dezember 2019: 2.884.173)		1.282.252	0,40	Indonesien - 2.871.414 (31. Dezember 2019: 3.192.426)		2.871.414	0,91
500.000	Egypt Government International Bond 'REGS' 7,500 % 31-Jan.-2027	468.538	0,15	700.000	Indonesia Government International Bond 'REGS' 3,850 % 18-Jul.-2027	677.710	0,21
15.000.000	Egypt Treasury Bills (Null-Coupon) 0,000 % 18-Aug.-2020	813.714	0,25	4.600.000.000	Indonesia Treasury Bond 7,000 % 15-Mai-2027	288.749	0,09
Dänemark - 1.072.200 (31. Dezember 2019: 3.910.009)		1.072.200	0,34	17.500.000.000	Indonesia Treasury Bond 8,125 % 15-Mai-2024	1.153.039	0,37
979.000	Danske Bank A/S 'EMTN' FRN 1,375 % 12-Feb.-2030	944.368	0,30	7.000.000.000	Indonesia Treasury Bond 8,250 % 15-Mai-2029	468.472	0,15
125.000	Danske Bank A/S 'EMTN' FRN 2,500 % 21-Jun.-2029	127.832	0,04	4.200.000.000	Indonesia Treasury Bond 8,375 % 15-Sept.-2026	283.444	0,09
Ägypten - 1.282.252 (31. Dezember 2019: 2.884.173)		1.282.252	0,40	Irland - 2.589.268 (31. Dezember 2019: 3.563.722)		2.589.268	0,82
500.000	Egypt Government International Bond 'REGS' 7,500 % 31-Jan.-2027	468.538	0,15	1.268.000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 6,500 % 15-Jul.-2025	1.178.997	0,37
15.000.000	Egypt Treasury Bills (Null-Coupon) 0,000 % 18-Aug.-2020	813.714	0,25	833.000	AIB Group Plc FRN (Immerwährend) 6,250 % 23-Jun.-2025	827.969	0,26
				435.698	European Residential Loan Securitisation 2018-1 DAC '2018-1 A' FRN 0,493 % 24-März-2061	437.201	0,14
				34.591	Topaz Asset Finance 2016-2 DAC '2016-2 A' 4,000 % 04-Nov.-2026	34.697	0,01

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in EUR	Summe der Nettovermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in EUR	Summe der Nettovermögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
Irland Forts.				Niederlande Forts.			
100.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 'REGS' 4,875 % 15-Jul.-2028	110.404	0,04	1.800.000	Lincoln Financing SARL 'REGS' FRN 3,875 % 01-Apr.-2024	1.667.250	0,53
Italien - 16.576.281 (31. Dezember 2019: 20.383.297) 16.576.281 5,24				400.000	Summer BidCo BV 'REGS' 9,750 % 15-Nov.-2025	368.000	0,12
350.000	Assicurazioni Generali SpA FRN (Immerwährend) 6,416 % 08-Feb.-2022	402.303	0,13	330.000	United Group BV 'REGS' 3,125 % 15-Feb.-2026	312.659	0,10
400.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' FRN (Immerwährend) 7,700 % 17-Sept.-2025	356.114	0,11	980.000	VIVAT NV FRN (Immerwährend) 7,000 % 19-Jun.-2025	1.006.950	0,32
1.976.000	Intesa Sanpaolo SpA FRN (Immerwährend) 3,750 % 27-Feb.-2025	1.598.090	0,51	Peru - 660.461 (31. Dezember 2019: -) 660.461 0,21			
11.668.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 2,800 % 01-März-2067	12.979.003	4,10	1.700.000	Peru Government Bond '144A' 5,400 % 12-Aug.-2034	456.474	0,14
702.000	UniCredit SpA FRN (Immerwährend) 8,000 % 03-Jun.-2024	628.631	0,20	700.000	Peruvian Government International Bond 'REGS' 5,940 % 12-Feb.-2029	203.987	0,07
597.000	Unipol Gruppo SpA 'EMTN' 3,500 % 29-Nov.-2027	612.140	0,19	Portugal - 3.258.925 (31. Dezember 2019: 4.277.480) 3.258.925 1,03			
Japan - 11.647.649 (31. Dezember 2019: 13.597.524) 11.647.649 3,68				1.800.000	Banco Comercial Portugues SA FRN (Immerwährend) 9,250 % 31-Jan.-2024	1.686.654	0,53
7.650.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc FRN 1,373 % 13-Sept.-2021	6.881.970	2,17	400.000	Caixa Geral de Depositos SA FRN (Immerwährend) 10,750 % 30-März-2022	440.000	0,14
5.322.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc FRN 1,641 % 26-Jul.-2021	4.765.679	1,51	1.400.000	Novo Banco SA/Luxembourg 'EMTN' 3,500 % 19-Feb.-2043	1.132.271	0,36
Kasachstan - 294.557 (31. Dezember 2019: 324.658) 294.557 0,09				Qatar - 486.102 (31. Dezember 2019: -) 486.102 0,15			
140.000.000	Development Bank of Kazakhstan JSC 9,500 % 14-Dez.-2020	294.557	0,09	500.000	Qatar Government International Bond 'REGS' 3,400 % 16-Apr.-2025	486.102	0,15
Luxemburg - 6.055.978 (31. Dezember 2019: 5.747.109) 6.055.978 1,91				Russland - 1.947.360 (31. Dezember 2019: 3.174.980) 1.947.360 0,62			
850.000	ARD Finance SA 'REGS' 5,000 % 30-Jun.-2027	822.375	0,26	54.000.000	Russian Federal Bond - OFZ 7,150 % 12-Nov.-2025	742.569	0,24
3.300.000	Emerald Bay SA (Null-Coupon) 0,000 % 08-Okt.-2020	3.242.250	1,02	17.800.000	Russian Federal Bond - OFZ 7,400 % 17-Jul.-2024	244.113	0,08
800.000	Garfunkelux Holdco 2 SA 'REGS' 11,000 % 01-Nov.-2023	758.347	0,24	66.500.000	Russian Federal Bond - OFZ 7,950 % 07-Okt.-2026	960.678	0,30
1.289.000	INEOS Finance Plc 'REGS' 2,875 % 01-Mai-2026	1.233.006	0,39	Saudi Arabien - 736.517 (31. Dezember 2019: 98.356) 736.517 0,23			
Mexiko - 3.806.010 (31. Dezember 2019: 2.900.741) 3.806.010 1,20				750.000	Saudi Government International Bond 'REGS' 3,625 % 04-März-2028	736.517	0,23
1.000.000	CEMEX Finance LLC '144A' 6,000 % 01-Apr.-2024	887.955	0,28	Südafrika - 609.820 (31. Dezember 2019: -) 609.820 0,19			
12.800.000	Mexican Bonos 5,750 % 05-März-2026	505.795	0,16	9.100.000	Republic of South Africa Government Bond 8,875 % 28-Feb.-2035	405.882	0,13
17.640.000	Mexican Bonos 7,750 % 29-Mai-2031	767.303	0,24	3.462.597	Republic of South Africa Government Bond 10,500 % 21-Dez.-2026	203.938	0,06
21.300.000	Mexican Bonos 8,500 % 31-Mai-2029	970.618	0,31	Spanien - 11.857.708 (31. Dezember 2019: 11.748.350) 11.857.708 3,75			
700.000	Mexico Government International Bond 4,125 % 21-Jan.-2026	674.339	0,21	500.000	Abanca Corp Bancaria SA FRN 4,625 % 07-Apr.-2030	472.845	0,15
Niederlande - 11.637.637 (31. Dezember 2019: 24.052.275) 11.637.637 3,68				600.000	Abanca Corp Bancaria SA FRN 6,125 % 18-Jan.-2029	605.250	0,19
5.412.000	ABN AMRO Bank NV '144A' FRN 0,939 % 27-Aug.-2021	4.853.045	1,53	500.000	Banco Santander SA FRN (Immerwährend) 6,250 % 11-Sept.-2021	478.125	0,15
800.000	ABN AMRO Bank NV FRN (Immerwährend) 4,375 % 22-Sept.-2025	775.424	0,24	400.000	CaixaBank SA FRN (Immerwährend) 5,250 % 23-März-2026	355.500	0,11
342.000	Heineken NV 'EMTN' 1,750 % 07-Mai-2040	345.839	0,11	700.000	CellInx Telecom SA 1,875 % 26-Jun.-2029	692.601	0,22
300.000	ING Groep NV FRN (Immerwährend) 6,500 % 16-Apr.-2025	274.534	0,09	1.800.000	Ibercaja Banco SA FRN 2,750 % 23-Jul.-2030	1.584.000	0,50
500.000	ING Groep NV FRN (Immerwährend) 6,875 % 16-Apr.-2022	461.936	0,14	2.400.000	Liberbank SA FRN 6,875 % 14-März-2027	2.466.000	0,78
1.600.000	LeasePlan Corp NV FRN (Immerwährend) 7,375 % 29-Mai-2024	1.572.000	0,50	727.227	TDA 14-Mixto FTA FRN 0,489 % 27-Dez.-2030	708.357	0,23
				3.400.000	TDA 15-Mixto FTA FRN 0,261 % 27-Jun.-2042	3.232.734	1,02
				800.000	TDA 15-Mixto FTA FRN 0,261 % 27-Jun.-2042	734.626	0,23
				578.595	TDA 18-Mixto FTA FRN 0,361 % 22-Jun.-2045	527.670	0,17

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in EUR	Summe der Nettovermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in EUR	Summe der Nettovermögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
Schweden - 1.836.080				Großbritannien Forts.			
(31. Dezember 2019: 2.239.254)				Großbritannien Forts.			
2.050.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB 'REGS' FRN 0,963 % 12-Dez.-2022	1.836.080	0,58	1.540.000	Newday Partnership Funding 2015-1 Plc '2015-1 C' FRN 2,944 % 15-Apr.-2025	1.617.868	0,51
Schweiz - 3.510.823				1.155.000	Newday Partnership Funding 2015-1 Plc '2015-1 D' FRN 3,494 % 15-Apr.-2025	1.204.647	0,38
(31. Dezember 2019: 2.384.753)				100.000	Phoenix Group Holdings Plc 'EMTN' 5,625 % 28-Apr.-2031	118.202	0,04
390.000	Credit Suisse Group AG '144A' FRN (Immerwährend) 7,250 % 12-Sept.-2025	357.309	0,11	470.000	Phoenix Life Ltd FRN (Immerwährend) 7,250 % 25-März-2021	520.292	0,16
340.000	Credit Suisse Group AG FRN (Immerwährend) 7,125 % 29-Jul.-2022	312.424	0,10	373.511	Punch Taverns Finance B Ltd 'REGS' 7,369 % 30-Sept.-2021	401.446	0,13
1.650.000	Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd FRN 3,425 % 16-Apr.-2021	1.495.210	0,47	1.450.000	RAC Bond Co Plc 'EMTN' 4,870 % 06-Mai-2026	1.588.183	0,50
1.071.000	UBS Group AG FRN (Immerwährend) 7,125 % 10-Aug.-2021	975.840	0,31	1.119.000	Reassure Group Plc 5,867 % 13-Jun.-2029	1.313.591	0,41
400.000	UBS Group AG 'REGS' FRN (Immerwährend) 7,000 % 31-Jan.-2024	370.040	0,12	770.000	Residential Mortgage Securities 28 Plc FRN 3,693 % 15-Jun.-2046	844.833	0,27
Ukraine - 286.362				1.569.000	Residential Mortgage Securities 29 Plc FRN 2,432 % 20-Dez.-2046	1.687.163	0,53
(31. Dezember 2019: -)				742.000	Residential Mortgage Securities 30 Plc FRN 2,682 % 20-März-2050	772.440	0,24
2.700.000	Ukraine Government Bond 18,000 % 24-März-2021	95.090	0,03	602.415	RMAC Securities No 1 Plc '2006-NS2X B1C' FRN 0,348 % 12-Jun.-2044	534.647	0,17
200.000	Ukraine Government International Bond 'REGS' 8,994 % 01-Feb.-2024	191.272	0,06	623.321	RMAC Securities No 1 Plc '2006-NS3X M1C' FRN 0,000 % 12-Jun.-2044	551.099	0,17
Großbritannien - 44.103.240				1.294.000	Rothsay Life Plc 3,375 % 12-Jul.-2026	1.403.027	0,44
(31. Dezember 2019: 55.651.851)				500.000	Royal Bank of Scotland Group Plc FRN (Immerwährend) 8,625 % 15-Aug.-2021	462.115	0,15
744.260	Alba 2007-1 Plc '2007-1 B' FRN 0,412 % 17-März-2039	723.889	0,23	462.000	Stanlington No 1 Plc '2017-1 D' FRN 3,048 % 12-Jun.-2046	497.713	0,16
341.000	Bank of Scotland Plc FRN (Immerwährend) 7,281 % 31-Mai-2026	430.224	0,14	250.000	Synlab Bondco Plc 'REGS' FRN 4,750 % 01-Jul.-2025	249.888	0,08
670.000	Barclays Bank Plc 'EMTN' FRN (Immerwährend) 0,352 % 15-Sept.-2020	561.339	0,18	770.000	THRONES 2015-1 Plc '2015-1 D' FRN 2,408 % 18-März-2050	848.079	0,27
1.053.000	BP Capital Markets Plc FRN (Immerwährend) 3,250 % 22-März-2026	1.060.898	0,33	1.924.000	Trinity Square 2015-1 Plc '2015-1X C' FRN 2,368 % 15-Jul.-2051	2.075.446	0,66
1.168.000	BP Capital Markets Plc FRN (Immerwährend) 3,625 % 22-März-2029	1.176.760	0,37	1.924.000	Trinity Square 2015-1 Plc '2015-1X D' FRN 2,818 % 15-Jul.-2051	2.022.480	0,64
2.628.000	Dukinfield Plc FRN 2,092 % 15-Aug.-2045	2.885.498	0,91	600.000	Virgin Media Finance Plc '144A' 5,000 % 15-Jul.-2030	521.789	0,16
420.000	esure Group Plc 6,750 % 19-Dez.-2024	447.112	0,14	250.000	Virgin Money UK Plc FRN (Immerwährend) 8,750 % 10-Nov.-2021	269.406	0,08
1.155.000	Eurosail 2006-1 Plc '2006-1X B1A' FRN 0,000 % 10-Jun.-2044	1.106.665	0,35	770.000	Warwick Finance Residential Mortgages No One Plc FRN 2,432 % 21-Sept.-2049	843.850	0,27
3.079.000	Greene King Finance Plc FRN 2,273 % 15-März-2036	2.866.564	0,91	1.924.000	Warwick Finance Residential Mortgages No One Plc FRN 3,882 % 21-Sept.-2049	2.111.739	0,67
330.000	Hiscox Ltd FRN 6,125 % 24-Nov.-2045	379.779	0,12	USA - 75.192.642			
375.000	HSBC Holdings Plc FRN (Immerwährend) 6,000 % 22-Mai-2027	332.741	0,10	(31. Dezember 2019: 128.572.988)			
525.000	HSBC Holdings Plc FRN (Immerwährend) 6,500 % 23-März-2028	480.464	0,15	624.000	Air Lease Corp 3,375 % 01-Jul.-2025	557.743	0,18
1.090.000	HSBC Holdings Plc FRN (Immerwährend) 6,875 % 01-Jun.-2021	986.843	0,31	227.000	Air Lease Corp 4,625 % 01-Okt.-2028	207.018	0,07
1.100.000	Ithaca Energy North Sea Plc 'REGS' 9,375 % 15-Jul.-2024	777.713	0,25	227.000	Bank of America Corp 'GMTN' FRN 1,769 % 21-Jul.-2021	202.566	0,06
1.314.784	Landmark Mortgage Securities No 1 Plc FRN 0,245 % 17-Jun.-2038	1.220.258	0,39	2.825.000	Boeing Co/The 5,150 % 01-Mai-2030	2.799.580	0,89
1	Ludgate Funding Plc '2006-1X BB' FRN 0,000 % 01-Dez.-2060	1	0,00	528.000	Boeing Co/The 5,805 % 01-Mai-2050	548.372	0,17
1.295.000	Marston's Issuer Plc FRN 1,988 % 15-Okt.-2027	1.195.855	0,38	6.835.000	Citibank NA 'BKNT' FRN 0,977 % 20-Mai-2022	6.108.241	1,93
300.000	Nationwide Building Society FRN (Immerwährend) 5,750 % 20-Jun.-2027	333.561	0,10	695.000	Citigroup Capital XVIII FRN 1,019 % 28-Jun.-2067	686.006	0,22
3.285.000	NatWest Markets Plc 'EMTN' FRN 0,348 % 18-Jun.-2021	3.293.755	1,04	5.000.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' FRN 0,277 % 09-Sept.-2022	4.968.150	1,57
1.274.000	Newday Funding 2017-1 Plc '2017-1 D' FRN 2,344 % 15-Jul.-2025	1.383.378	0,44	1.073.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN 1,540 % 31-Okt.-2022	957.179	0,30
				865.000	ONEOK Inc 6,350 % 15-Jan.-2031	915.163	0,29

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in EUR	Summe der Nettovermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in EUR	Summe der Nettovermögen %
Anleihen Forts.				Kreditverzugsswaps - 13.171.172 (31. Dezember 2019: 4.985.232)			
USA Forts.				(300.000)	CDS Altice France SA/France 5,000 % 20-Dez.-2024	3.801	0,00
440.000	ONEOK Inc 7,150 % 15-Jan.-2051	482.967	0,15	(100.000)	CDS Altice France SA/France 5,000 % 20-Dez.-2024	1.267	0,00
784.000	Pacific Gas and Electric Co 2,500 % 01-Feb.-2031	683.630	0,22	(100.000)	CDS Altice France SA/France 5,000 % 20-Dez.-2024	1.267	0,00
369.000	Pacific Gas and Electric Co 3,300 % 01-Aug.-2040	319.337	0,10	(150.000)	CDS Altice France SA/France 5,000 % 20-Dez.-2024	1.900	0,00
325.000	Pacific Gas and Electric Co 3,500 % 01-Aug.-2050	279.368	0,09	3.200.000	CDS Barclays Bank Plc 1,000 % 20-Dez.-2028	292.082	0,09
832	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1,000 % 15-Feb.-2048	989	0,00	(9.000.000)	CDS BNP Paribas SA 1,000 % 20-Jun.-2022	56.213	0,02
43.546.896	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1,000 % 15-Feb.-2049	52.300.687	16,52	4.750.000	CDS BNP Paribas SA 1,000 % 20-Jun.-2027	191.446	0,06
3.551.000	Wells Fargo Bank NA 'BKNT' FRN 0,989 % 27-Mai-2022	3.175.646	1,00	22.816.000	CDS CDX North America High Yield Index Series 33 Version 1 5,000 % 20-Dez.-2024	280.168	0,09
Summe der Anlagen in Anleihen 240.589.684 76,01				4.845.000	CDS CDX North America High Yield Index Series 34 Version 1 5,000 % 20-Jun.-2025	67.616	0,02
Leveraged Loans				7.220.000	CDS CDX North America High Yield Index Series 34 Version 1 5,000 % 20-Jun.-2025	100.761	0,03
Chile - 2.124.407 (31. Dezember 2019: -)				3.230.000	CDS CDX North America High Yield Index Series 34 Version 1 5,000 % 20-Jun.-2025	45.077	0,01
2.500.000	Coral-U.S. Co-Borrower LLC Term Loan 0,000 % 31-Jan.-2028	2.124.407	0,67	12.160.000	CDS CDX North America High Yield Index Series 34 Version 1 5,000 % 20-Jun.-2025	169.703	0,05
Frankreich - 947.110 (31. Dezember 2019: 984.720)				(23.600.000)	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 33 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	221.882	0,07
987.277	SFR Group S.A. EUR Term Loan B 3,000 % 22-Jun.-2025	947.110	0,30	(1.576.000)	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 33 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	14.817	0,01
Deutschland - 2.054.414 (31. Dezember 2019: 2.475.757)				(11.800.000)	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 33 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	110.941	0,04
2.509.243	SGB-Smit Holding GmbH Term Loan 4,000 % 29-Jun.-2024	1.154.252	0,37	(24.500.000)	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 33 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	230.343	0,07
921.735	Techem Verwaltungsgesellschaft 675 Mbh Term Loan 0,000 % 31-Jul.-2025	900.162	0,28	(52.000.000)	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 33 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	488.892	0,15
Spanien - 2.294.042 (31. Dezember 2019: 2.391.409)				(12.400.000)	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 33 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	116.582	0,04
2.391.409	Dorna Sports S.L. EUR Term Loan 3,000 % 12-Apr.-2024	2.294.042	0,72	(60.200.000)	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 33 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	565.986	0,18
Schweden - 970.000 (31. Dezember 2019: 1.002.975)				(52.300.000)	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 33 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	491.713	0,16
1.000.000	Verisure Holding AB Term Loan 3,000 % 21-Okt.-2022	970.000	0,31	(44.100.000)	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 33 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	414.618	0,13
Großbritannien - 9.353.607 (31. Dezember 2019: 14.100.207)				(2.290.000)	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 33 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	21.530	0,01
1.577.419	Aura Finance Ltd Term Loan 3,250 % 28-Nov.-2021	1.721.794	0,54	(28.287.500)	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 34 Version 1 1,000 % 20-Jun.-2025	258.448	0,08
2.586.519	Project Jura Credit Senior Term Loan 2,930 % 25-Jan.-2022	2.587.959	0,82	(4.400.000)	CDS Danske Bank A/S 1,000 % 20-Dez.-2023	95.374	0,03
510.137	Project Panther Term Loan 4,020 % 31-Jul.-2020	472.587	0,15	900.000	CDS Danske Bank A/S 1,000 % 20-Dez.-2028	82.567	0,03
2.362.311	Swancastle Ltd 2016-1 SanTerm Bank Loan 4,610 % 24-Dez.-2035	2.591.066	0,82	1.800.000	CDS Deutsche Bank AG 1,000 % 20-Dez.-2022	77.855	0,03
2.018.859	TC Funding I Limited Term Loan 0,000 % 26-Sept.-2023	1.980.201	0,62	200.000	CDS Deutsche Bank AG 1,000 % 20-Dez.-2022	8.651	0,00
USA - 1.955.927 (31. Dezember 2019: 2.976.975)				(100.000)	CDS Deutsche Bank AG 1,000 % 20-Jun.-2024	342	0,00
1.858.750	Virgin Media SFA Finance Ltd Term Loan 3,750 % 30-Nov.-2027	1.955.927	0,62	(100.000)	CDS Deutsche Bank AG 1,000 % 20-Jun.-2024	342	0,00
Summe der Anlagen in Leveraged Loans 19.699.507 6,22				(1.000.000)	CDS Deutsche Bank AG 1,000 % 20-Jun.-2024	3.421	0,00
				(900.000)	CDS Deutsche Bank AG 1,000 % 20-Jun.-2024	3.079	0,00
				(100.000)	CDS Deutsche Bank AG 1,000 % 20-Jun.-2024	342	0,00
				(900.000)	CDS Deutsche Bank AG 1,000 % 20-Jun.-2024	3.079	0,00
				(100.000)	CDS Deutsche Bank AG 1,000 % 20-Jun.-2024	342	0,00
				(900.000)	CDS Deutsche Bank AG 1,000 % 20-Jun.-2024	3.079	0,00
				(100.000)	CDS Deutsche Bank AG 1,000 % 20-Jun.-2024	342	0,00
				(900.000)	CDS Deutsche Bank AG 1,000 % 20-Jun.-2024	3.079	0,00
				800.000	CDS Garfunkelux Holdco 2 SA 5,000 % 20-Dez.-2023	128.891	0,04
				1.054.000	CDS HSBC Holdings Plc 1,000 % 20-Dez.-2024	9.897	0,00
				803.000	CDS HSBC Holdings Plc 1,000 % 20-Dez.-2024	7.540	0,00
				653.000	CDS HSBC Holdings Plc 1,000 % 20-Dez.-2024	6.131	0,00
				(19.700.000)	CDS iTraxx Europe Crossover Series 32 Version 1 5,000 % 20-Dez.-2024	953.921	0,30

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in EUR	Summe der Nettovermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in EUR	Summe der Nettovermögen %
Kreditverzugs­swaps Forts.				Kreditverzugs­swaps Forts.			
(13.750.000)	CDS iTraxx Europe Senior Financials Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	151.813	0,05	520.000	CDS Lloyds Banking Group Plc 1,000 % 20-Jun.-2025	13.224	0,00
(13.750.000)	CDS iTraxx Europe Senior Financials Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	151.813	0,05	3.300.000	CDS Royal Bank of Scotland Group Plc 1,000 % 20-Jun.-2025	112.073	0,04
(10.800.000)	CDS iTraxx Europe Senior Financials Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	119.242	0,04	1.150.000	CDS Royal Bank of Scotland Group Plc 1,000 % 20-Jun.-2025	39.056	0,01
(39.300.000)	CDS iTraxx Europe Senior Financials Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	433.910	0,14	1.800.000	CDS Societe Generale 1,000 % 20-Dez.-2027	111.634	0,04
(1.600.000)	CDS iTraxx Europe Senior Financials Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	17.666	0,01	Summe der Kreditverzugs­swaps			
(800.000)	CDS iTraxx Europe Senior Financials Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	8.833	0,00	Devisenoptionen - 47.765 (31. Dezember 2019: 28.831)			
(31.000.000)	CDS iTraxx Europe Senior Financials Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	342.270	0,11	1.400.000	US dollar/Australian dollar Put 20-Jul.-2020 0,685	14.112	0,01
(800.000)	CDS iTraxx Europe Senior Financials Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	8.833	0,00	1.300.000	US dollar/Brazilian real Put 02-Jul.-2020 5,450	8.665	0,00
(1.300.000)	CDS iTraxx Europe Senior Financials Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	14.353	0,00	1.400.000	US dollar/Japanese yen Call 17-Aug.-2020 106,000	5.157	0,00
(8.600.000)	CDS iTraxx Europe Senior Financials Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	94.952	0,03	1.400.000	US dollar/Mexican peso Put 08-Jul.-2020 20,900	43	0,00
(4.500.000)	CDS iTraxx Europe Senior Financials Series 33 Version 1 1,000 % 20-Jun.-2025	35.915	0,01	1.400.000	US dollar/South African rand Call 16-Jul.-2020 17,300	19.788	0,01
(42.300.000)	CDS iTraxx Europe Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	633.434	0,20	Summe der Devisenoptionen			
(9.600.000)	CDS iTraxx Europe Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	143.758	0,05	Offene Terminkontrakte - 1.288.311 (31. Dezember 2019: 4.038.479)			
(19.000.000)	CDS iTraxx Europe Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	284.521	0,09	87	U.S. 2 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Sep.-2020	17138.613	3,032
(66.500.000)	CDS iTraxx Europe Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	995.824	0,32	2	U.S. 5 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Sep.-2020	224.415	474
(9.600.000)	CDS iTraxx Europe Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	143.758	0,05	3	U.S. 5 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Sep.-2020	336.622	878
(46.200.000)	CDS iTraxx Europe Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	691.835	0,22	347	U.S. Treasury Ultra Bond Long Futures Contracts Exp Sep.-2020	67854.402	1.283.927
(52.800.000)	CDS iTraxx Europe Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	790.669	0,25	Summe der offenen Terminkontrakte			
(8.300.000)	CDS iTraxx Europe Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	124.291	0,04	1.288.311			
(19.400.000)	CDS iTraxx Europe Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	290.511	0,09	Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 4.769.777 (siehe unten) (31. Dezember 2019: 3.496.534)			
(19.900.000)	CDS iTraxx Europe Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	297.998	0,09				
22.150.000	CDS iTraxx Europe Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2029	166.698	0,05	Summe der Vermögenswerte zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert			
(53.800.000)	CDS iTraxx Europe Series 33 Version 1 1,000 % 20-Jun.-2025	804.284	0,25	284.720.154			
(4.600.000)	CDS iTraxx Europe Series 33 Version 1 1,000 % 20-Jun.-2025	68.768	0,02	Kreditverzugs­swaps - (14.004.709) (31. Dezember 2019: (11.120.273))			
(12.500.000)	CDS iTraxx Europe Series 33 Version 1 1,000 % 20-Jun.-2025	186.869	0,06	(625.000)	CDS Airbus SE 1,000 % 20-Jun.-2025	(4.720)	(0,00)
(10.350.000)	CDS iTraxx Europe Series 33 Version 1 1,000 % 20-Jun.-2025	154.727	0,05	(5.800.000)	CDS Barclays Bank Plc 1,000 % 20-Dez.-2023	(107.292)	(0,03)
(10.350.000)	CDS iTraxx Europe Series 33 Version 1 1,000 % 20-Jun.-2025	154.728	0,05	1.300.000	CDS Barrick Gold Corp 1,000 % 20-Jun.-2025	(45.111)	(0,01)
1.640.000	CDS iTraxx Europe Sub Financials Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	42.360	0,01	1.050.000	CDS Barrick Gold Corp 1,000 % 20-Jun.-2025	(36.436)	(0,01)
340.000	CDS Lloyds Banking Group Plc 1,000 % 20-Jun.-2025	8.646	0,00	(22.816.000)	CDS CDX North America High Yield Index Series 33 Version 1 5,000 % 20-Dez.-2024	(280.168)	(0,09)
				23.112.500	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 33 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	(217.298)	(0,07)
				16.900.000	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 33 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	(158.890)	(0,05)

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in EUR	Summe der Nettovermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in EUR	Summe der Nettovermögen %
Kreditverzugsswaps Forts.				Kreditverzugsswaps Forts.			
2.050.000	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 33 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	(19.274)	(0,01)	9.600.000	CDS iTraxx Europe Senior Financials Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	(105.993)	(0,03)
21.100.000	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 33 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	(198.377)	(0,06)	8.300.000	CDS iTraxx Europe Senior Financials Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	(91.640)	(0,03)
754.000	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 33 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	(7.089)	(0,00)	15.480.000	CDS iTraxx Europe Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2022	(230.259)	(0,07)
8.450.000	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 33 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	(79.445)	(0,03)	28.870.000	CDS iTraxx Europe Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2022	(429.431)	(0,14)
24.500.000	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 33 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	(230.343)	(0,07)	38.900.000	CDS iTraxx Europe Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	(582.520)	(0,18)
130.366.000	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 33 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	(1.225.671)	(0,39)	46.200.000	CDS iTraxx Europe Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	(691.835)	(0,22)
2.000.000	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 33 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	(18.804)	(0,01)	52.800.000	CDS iTraxx Europe Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	(790.669)	(0,25)
750.000	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 33 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	(7.051)	(0,00)	42.300.000	CDS iTraxx Europe Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	(633.434)	(0,20)
1.210.000	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 33 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	(11.376)	(0,00)	8.600.000	CDS iTraxx Europe Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	(128.783)	(0,04)
523.500	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 33 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	(4.922)	(0,00)	10.800.000	CDS iTraxx Europe Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	(161.728)	(0,05)
750.000	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 33 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	(7.051)	(0,00)	13.750.000	CDS iTraxx Europe Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	(205.903)	(0,07)
52.300.000	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 33 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	(491.713)	(0,16)	13.750.000	CDS iTraxx Europe Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	(205.903)	(0,07)
19.900.000	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 34 Version 1 1,000 % 20-Jun.-2025	(181.816)	(0,06)	19.800.000	CDS iTraxx Europe Series 33 Version 1 1,000 % 20-Jun.-2025	(296.001)	(0,09)
12.420.000	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 34 Version 1 1,000 % 20-Jun.-2025	(113.475)	(0,04)	33.300.000	CDS iTraxx Europe Series 33 Version 1 1,000 % 20-Jun.-2025	(497.819)	(0,16)
12.420.000	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 34 Version 1 1,000 % 20-Jun.-2025	(113.475)	(0,04)	18.500.000	CDS iTraxx Europe Series 33 Version 1 1,000 % 20-Jun.-2025	(276.566)	(0,09)
5.500.000	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 34 Version 1 1,000 % 20-Jun.-2025	(50.251)	(0,02)	16.700.000	CDS iTraxx Europe Series 33 Version 1 1,000 % 20-Jun.-2025	(249.657)	(0,08)
3.987.500	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 34 Version 1 1,000 % 20-Jun.-2025	(36.432)	(0,01)	36.300.000	CDS iTraxx Europe Series 33 Version 1 1,000 % 20-Jun.-2025	(542.668)	(0,17)
15.060.000	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 34 Version 1 1,000 % 20-Jun.-2025	(137.595)	(0,04)	(440.000)	CDS iTraxx Europe Sub Financials Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	(11.365)	(0,00)
(1.800.000)	CDS Danske Bank A/S 1,000 % 20-Dez.-2023	(25.832)	(0,01)	(1.200.000)	CDS iTraxx Europe Sub Financials Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	(30.995)	(0,01)
2.200.000	CDS Danske Bank A/S 1,000 % 20-Dez.-2028	(58.738)	(0,02)	(779.000)	CDS iTraxx Europe Sub Financials Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	(20.121)	(0,01)
900.000	CDS INEOS Group Holdings SA 5,000 % 20-Jun.-2021	(34.856)	(0,01)	(447.000)	CDS iTraxx Europe Sub Financials Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	(11.546)	(0,00)
4.300.000	CDS INEOS Group Holdings SA 5,000 % 20-Jun.-2021	(166.535)	(0,05)	(1.640.000)	CDS iTraxx Europe Sub Financials Series 33 Version 1 1,000 % 20-Jun.-2025	(58.514)	(0,02)
19.700.000	CDS iTraxx Europe Crossover Series 32 Version 1 5,000 % 20-Dez.-2024	(953.921)	(0,30)	5.950.000	CDS Kinder Morgan Inc/DE 1,000 % 20-Jun.-2025	(100.959)	(0,03)
19.300.000	CDS iTraxx Europe Crossover Series 33 Version 1 5,000 % 20-Jun.-2025	(864.156)	(0,27)	2.700.000	CDS Lloyds Banking Group Plc 1,000 % 20-Jun.-2025	(32.134)	(0,01)
3.600.000	CDS iTraxx Europe Crossover Series 33 Version 1 5,000 % 20-Jun.-2025	(161.190)	(0,05)	1.260.000	CDS Newmont Corp 1,000 % 20-Jun.-2025	(45.645)	(0,01)
14.600.000	CDS iTraxx Europe Senior Financials Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	(161.198)	(0,05)	500.000	CDS Newmont Corp 1,000 % 20-Jun.-2025	(18.113)	(0,01)
8.400.000	CDS iTraxx Europe Senior Financials Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	(92.744)	(0,03)	(4.800.000)	CDS Republic of Italy Government International Bond 1,000 % 20-Jun.-2025	(139.524)	(0,04)
8.500.000	CDS iTraxx Europe Senior Financials Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	(93.848)	(0,03)	4.400.000	CDS Sherwin-Williams Co/The 1,000 % 20-Jun.-2025	(118.561)	(0,04)
31.000.000	CDS iTraxx Europe Senior Financials Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	(342.270)	(0,11)	(3.700.000)	CDS Societe Generale 1,000 % 20-Dez.-2022	(2.711)	(0,00)
12.300.000	CDS iTraxx Europe Senior Financials Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	(135.804)	(0,04)	(3.550.000)	CDS Southern Water Services Ltd 1,000 % 20-Jun.-2021	(9.850)	(0,00)
19.400.000	CDS iTraxx Europe Senior Financials Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	(214.195)	(0,07)	600.000	CDS United Rentals North America Inc 5,000 % 20-Jun.-2025	(88.507)	(0,03)
9.600.000	CDS iTraxx Europe Senior Financials Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	(105.993)	(0,03)				
				Summe der Kreditverzugsswaps			

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in EUR	Summe der Nettovermögen %	Beschreibung	Angemessener Wert in EUR	Summe der Nettovermögen %
Devisenoptionen - (23.921) (31. Dezember 2019: (16.761))				Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften - (5.087.307) (siehe unten) (31. Dezember 2019: (4.463.886))	(5.087.307)	(1,61)
(2.800.000)	US dollar/Australian dollar Put 20-Jul.-2020 0,665	(8.059)	(0,00)			
(1.950.000)	US dollar/Brazilian real Put 02-Jul.-2020 5,650	(1.626)	(0,00)			
(1.400.000)	US dollar/Japanese yen Call 17-Aug.-2020 102,000	(1.039)	(0,00)			
(1.400.000)	US dollar/Japanese yen Call 17-Aug.-2020 104,000	(2.196)	(0,00)			
(2.100.000)	US dollar/South African rand Call 16-Jul.-2020 17,800	(11.001)	(0,01)			
Summe der Devisenoptionen				Summe der finanziellen Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert	(21.851.410)	(6,91)
				Nettoumlaufvermögen	53.651.419	16,95
				Summe der Nettovermögen	316.520.163	100,00

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement in EUR	Angemessener Wert in EUR	Summe der Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte - (2.642.113) (31. Dezember 2019: (1.605.562))				
(9)	Euro-Bobl Short Futures Contracts Exp Sep.-2020	(1.215.000)	(6.520)	(0,00)
(28)	Euro-Bobl Short Futures Contracts Exp Sep.-2020	(3.780.000)	(16.030)	(0,01)
(317)	Euro-BTP Short Futures Contracts Exp Sep.-2020	(45.568.750)	(964.275)	(0,31)
(567)	Euro-Bund Short Futures Contracts Exp Sep.-2020	(100.177.560)	(760.824)	(0,24)
(14)	Euro-Buxl 30 Year Bond Short Futures Contracts Exp Sep.-2020	(3.092.040)	(59.752)	(0,02)
(48)	U.S. 10 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Sep.-2020	(5.966.406)	(28.493)	(0,01)
(37)	U.S. 10 Year Ultra Treasury Note Short Futures Contracts Exp Sep.-2020	(5.206.679)	(34.867)	(0,01)
(2)	U.S. 10 Year Ultra Treasury Note Short Futures Contracts Exp Sep.-2020	(281.442)	(1.547)	(0,00)
(3)	U.S. Treasury Bond Short Futures Contracts Exp Sep.-2020	(479.162)	(7.750)	(0,00)
(2)	U.S. Treasury Bond Short Futures Contracts Exp Sep.-2020	(319.442)	(2.705)	(0,00)
(539)	UK Long Gilt Short Futures Contracts Exp Sep.-2020	(81.313.922)	(759.350)	(0,24)
Summe der offenen Terminkontrakte			(2.642.113)	(0,84)

Swaptions - (93.360) (31. Dezember 2019: (186.456))			
(59.000.000)	CDS iTraxx Europe Series 33 Put 20-Jun.-2025 42,500	(93.360)	(0,03)
Summe der Swaptions		(93.360)	(0,03)

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	70,61
Nicht an einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	5,66
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,37
OTC-Finanzderivate	5,17
Sonstiges Umlaufvermögen	18,19
Summe der Aktiva	100,00

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte							Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund							BNY Mellon Absolute Return Bond Fund Forts.						
US-Dollar	Brasilianischer Real	469.393	2.470.694	02-Jul.-20	BNP Paribas	11.016	US-Dollar	Südafrikanischer Rand	446.840	7.544.034	27-Jul.-20	Bank of America Merrill Lynch	11.680
US-Dollar	Brasilianischer Real	634.861	3.250.000	02-Jul.-20	BNP Paribas	30.025	US-Dollar	Südafrikanischer Rand	822.819	13.940.230	27-Jul.-20	Morgan Stanley	19.022
US-Dollar	Brasilianischer Real	1.442.155	7.745.312	02-Jul.-20	Goldman Sachs	8.366	US-Dollar	Südafrikanischer Rand	466.149	8.106.179	27-Jul.-20	Bank of America Merrill Lynch	79
Australischer Dollar	Euro	12.280.000	7.298.719	15-Jul.-20	Bank of America Merrill Lynch	202.966	US-Dollar	Südafrikanischer Rand	478.106	8.250.000	27-Jul.-20	Goldman Sachs	3.368
Euro	US-Dollar	35.647.288	38.765.000	15-Jul.-20	Natwest Markets Plc	1.073.655	Euro	US-Dollar	1.226.546	1.336.000	30-Jul.-20	Natwest Markets Plc	35.401
Euro	US-Dollar	214.866	232.000	15-Jul.-20	Lloyds Bank plc	7.950	Euro	Sterling	805.117	730.000	03-Aug.-20	BNP Paribas	6.395
Euro	US-Dollar	256.680	278.000	15-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	8.738	Euro	Sterling	1.934.903	1.725.000	03-Aug.-20	Barclays Bank PLC	47.512
Euro	US-Dollar	606.118	656.000	15-Jul.-20	Natwest Markets Plc	21.046	Euro	Sterling	1.933.598	1.724.000	03-Aug.-20	Citigroup Global Markets Limited	47.301
Euro	US-Dollar	906.044	1.010.000	15-Jul.-20	Bank of America Merrill Lynch	5.248	Euro	Sterling	153.786	138.000	03-Aug.-20	Citigroup Global Markets Limited	2.795
Euro	US-Dollar	409.925	450.000	15-Jul.-20	Bank of America Merrill Lynch	8.580	Euro	Sterling	49.821.175	44.660.000	03-Aug.-20	UBS AG	956.892
US-Dollar	Euro	1.190.000	1.060.681	15-Jul.-20	BNP Paribas	653	Euro	Sterling	447.444	400.000	03-Aug.-20	BNP Paribas	9.788
US-Dollar	Euro	10.250.000	9.136.857	15-Jul.-20	Bank of America Merrill Lynch	4.888	Euro	Sterling	220.876	200.000	03-Aug.-20	Lloyds Bank plc	2.048
US-Dollar	Australischer Dollar	10.417.279	15.015.144	16-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	118.342	Euro	Sterling	348.729	311.000	03-Aug.-20	Lloyds Bank plc	8.452
US-Dollar	Australischer Dollar	700.000	1.018.552	16-Jul.-20	BNP Paribas	2.091	Euro	Sterling	551.476	495.000	03-Aug.-20	Lloyds Bank plc	9.876
US-Dollar	Australischer Dollar	700.000	1.019.303	16-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	1.633	Euro	Sterling	523.651	470.000	03-Aug.-20	Natwest Markets Plc	9.405
US-Dollar	Euro	1.250.000	1.110.774	16-Jul.-20	Lloyds Bank plc	4.047	Euro	Sterling	1.283.597	1.150.000	03-Aug.-20	BNP Paribas	25.336
US-Dollar	Koreanischer Won	700.800	840.000.000	16-Jul.-20	HSBC Bank plc	2.229	Euro	Sterling	358.920	320.000	03-Aug.-20	BNP Paribas	8.795
US-Dollar	Mexikanischer Peso	350.000	7.873.006	16-Jul.-20	BNP Paribas	9.548	Euro	Sterling	323.617	290.000	03-Aug.-20	Lloyds Bank plc	6.316
US-Dollar	Mexikanischer Peso	700.000	15.951.656	16-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	11.193	US-Dollar	Brasilianischer Real	1.426.780	7.571.496	04-Aug.-20	Goldman Sachs	24.838
US-Dollar	Mexikanischer Peso	350.000	7.888.374	16-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	8.958	US-Dollar	Brasilianischer Real	612.433	3.250.000	04-Aug.-20	Goldman Sachs	10.661
US-Dollar	Mexikanischer Peso	700.000	16.183.725	16-Jul.-20	BNP Paribas	2.273	Euro	US-Dollar	813.564	897.000	17-Aug.-20	RBC Capital Markets	14.137
US-Dollar	Russischer Rubel	693.876	48.300.000	16-Jul.-20	BNP Paribas	13.030	Euro	US-Dollar	178.788	200.000	17-Aug.-20	Natwest Markets Plc	543
US-Dollar	Südafrikanischer Rand	700.000	12.119.710	16-Jul.-20	Bank of America Merrill Lynch	2.044	Euro	US-Dollar	1.319.906	1.470.000	17-Aug.-20	Bank of America Merrill Lynch	9.808
US-Dollar	Südafrikanischer Rand	700.000	12.138.356	16-Jul.-20	BNP Paribas	1.086	US-Dollar	Euro	800.000	711.019	17-Aug.-20	Lloyds Bank plc	1.960
US-Dollar	Sterling	2.341.262	1.844.702	16-Jul.-20	HSBC Bank plc	69.127	US-Dollar	Euro	1.210.000	1.074.221	17-Aug.-20	Bank of America Merrill Lynch	4.159
Russischer Rubel	US-Dollar	30.800.000	417.521	17-Jul.-20	Barclays Bank PLC	13.897	US-Dollar	Euro	1.230.000	1.089.659	17-Aug.-20	Bank of America Merrill Lynch	6.545
US-Dollar	Chilenischer Peso	668.619	525.000.000	17-Jul.-20	Bank of America Merrill Lynch	26.191	US-Dollar	Euro	360.000	318.091	17-Aug.-20	Bank of America Merrill Lynch	2.749
US-Dollar	Chilenischer Peso	76.979	63.000.000	17-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	240	US-Dollar	Euro	469.000	417.232	11-Sept.-20	Morgan Stanley	517
US-Dollar	Peruanischer Nuevo Sol	961.763	3.300.000	17-Jul.-20	BNP Paribas	24.013							EUR 4.556.470
Tschechische Krone	US-Dollar	12.260.000	479.872	27-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	29.195	Südafrikanischer Rand	US-Dollar	8.250.000	479.459	01-Jul.-20	Goldman Sachs	(3.345)
Euro	US-Dollar	7.927.312	8.600.000	27-Jul.-20	Lloyds Bank plc	259.245	Brasilianischer Real	US-Dollar	7.571.496	1.428.315	02-Jul.-20	Goldman Sachs	(24.703)
Euro	US-Dollar	7.926.283	8.600.000	27-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	258.215	Brasilianischer Real	US-Dollar	3.250.000	613.092	02-Jul.-20	Goldman Sachs	(10.604)
Euro	US-Dollar	7.834.267	8.500.000	27-Jul.-20	Lloyds Bank plc	255.364	Brasilianischer Real	US-Dollar	2.440.633	481.303	02-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(26.602)
Polnischer Zloty	US-Dollar	2.042.000	482.147	27-Jul.-20	BNP Paribas	27.520	Brasilianischer Real	US-Dollar	2.400.000	468.894	02-Jul.-20	BNP Paribas	(22.238)
Rumänischer Leu	Euro	450.000	92.298	27-Jul.-20	Goldman Sachs	432	US-Dollar	Brasilianischer Real	403.217	2.196.122	02-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(2.708)
Rumänischer Leu	Euro	460.000	94.336	27-Jul.-20	HSBC Bank plc	454	Euro	US-Dollar	2.613.594	2.940.000	15-Jul.-20	Lloyds Bank plc	(8.526)
Rumänischer Leu	Euro	460.000	94.333	27-Jul.-20	HSBC Bank plc	458	Euro	US-Dollar	1.499.008	1.700.000	15-Jul.-20	Bank of America Merrill Lynch	(17.183)
Rumänischer Leu	US-Dollar	1.350.000	304.473	27-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	6.711	US-Dollar	Euro	3.243.000	2.952.812	15-Jul.-20	Lloyds Bank plc	(60.453)
Rumänischer Leu	US-Dollar	1.350.000	304.404	27-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	6.772	Australischer Dollar	US-Dollar	1.011.271	700.000	16-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(6.540)
Rumänischer Leu	US-Dollar	1.350.000	304.418	27-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	6.760	Australischer Dollar	US-Dollar	1.016.406	700.000	16-Jul.-20	Goldman Sachs	(3.402)
Südafrikanischer Rand	US-Dollar	350.000	20.035	27-Jul.-20	Bank of America Merrill Lynch	79	Australischer Dollar	US-Dollar	1.010.508	700.000	16-Jul.-20	BNP Paribas	(7.006)
Thailändischer Baht	US-Dollar	12.000.000	380.644	27-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	6.758	Euro	Polnischer Zloty	200.000	894.924	16-Jul.-20	HSBC Bank plc	(511)
Thailändischer Baht	US-Dollar	46.600.000	1.482.424	27-Jul.-20	Goldman Sachs	22.450	Euro	Polnischer Zloty	200.000	894.972	16-Jul.-20	HSBC Bank plc	(521)
Thailändischer Baht	US-Dollar	11.500.000	365.784	27-Jul.-20	Natwest Markets Plc	5.585	Euro	Polnischer Zloty	200.000	894.870	16-Jul.-20	BNP Paribas	(498)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	954.324	20.851.470	27-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	50.928	Euro	US-Dollar	1.469.731	1.650.000	16-Jul.-20	BNP Paribas	(1.833)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	243.073	5.600.000	27-Jul.-20	BNP Paribas	1.885	Euro	US-Dollar	1.050.000	1.177.675	16-Jul.-20	Goldman Sachs	(319)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	752.755	16.981.384	27-Jul.-20	BNP Paribas	19.681	Euro	US-Dollar	530.000	595.567	16-Jul.-20	Bank of America Merrill Lynch	(1.161)

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte Forts.							Devisenterminkontrakte Forts.							
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund Forts.							BNY Mellon Absolute Return Bond Fund Forts.							
Euro	US-Dollar	2.439.559	2.780.000	16-Jul.-20	Bank of America Merrill Lynch	(39.804)	Euro	US-Dollar	1.247.737	1.410.000	30-Jul.-20	Bank of America Merrill Lynch	(9.384)	
Euro	US-Dollar	35.227	40.124	16-Jul.-20	Bank of America Merrill Lynch	(557)	Sterling	Euro	26.000	29.161	03-Aug.-20	RBC Capital Markets	(714)	
Euro	US-Dollar	1.679.021	1.900.000	16-Jul.-20	Bank of America Merrill Lynch	(15.508)	Sterling	Euro	860.000	951.692	03-Aug.-20	Lloyds Bank plc	(10.731)	
Koreanischer Won	US-Dollar	2.400.000.000	2.017.264	16-Jul.-20	HSBC Bank plc	(19.728)	Sterling	Euro	458.000	507.212	03-Aug.-20	UBS AG	(6.096)	
Mexikanischer Peso	US-Dollar	15.572.421	700.000	16-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(25.769)	Sterling	Euro	630.000	698.419	03-Aug.-20	Bank of America Merrill Lynch	(9.111)	
Mexikanischer Peso	US-Dollar	28.148.926	1.260.882	16-Jul.-20	RBC Capital Markets	(42.613)	Sterling	Euro	860.000	958.570	03-Aug.-20	Bank of America Merrill Lynch	(17.610)	
Polnischer Zloty	US-Dollar	2.635.622	670.186	16-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(7.191)	Sterling	Euro	391.000	439.435	03-Aug.-20	Lloyds Bank plc	(11.627)	
Russischer Rubel	US-Dollar	49.000.000	701.307	16-Jul.-20	BNP Paribas	(10.877)	Sterling	Euro	100.000	111.434	03-Aug.-20	Lloyds Bank plc	(2.020)	
Russischer Rubel	US-Dollar	91.000.000	1.318.525	16-Jul.-20	HSBC Bank plc	(34.557)	Sterling	Euro	1.140.000	1.271.796	03-Aug.-20	Lloyds Bank plc	(24.477)	
Sterling	Euro	538.220	600.000	16-Jul.-20	BNP Paribas	(10.942)	Sterling	Euro	106.000	118.830	03-Aug.-20	Lloyds Bank plc	(2.852)	
Sterling	Euro	261.669	292.000	16-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(5.614)	Sterling	Euro	400.000	444.892	03-Aug.-20	Bank of America Merrill Lynch	(7.236)	
Sterling	Euro	814.206	908.000	16-Jul.-20	BNP Paribas	(16.887)	Sterling	Euro	207.000	230.952	03-Aug.-20	Lloyds Bank plc	(4.465)	
Sterling	US-Dollar	500.000	620.626	16-Jul.-20	Bank of America Merrill Lynch	(6.282)	Sterling	Euro	1.660.000	1.854.318	03-Aug.-20	Bank of America Merrill Lynch	(38.046)	
US-Dollar	Australischer Dollar	700.000	1.022.447	16-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(288)	Sterling	Euro	800.000	881.765	03-Aug.-20	Bank of America Merrill Lynch	(6.453)	
US-Dollar	Australischer Dollar	700.000	1.022.159	16-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(112)	Euro	US-Dollar	27.567.782	31.390.000	28-Aug.-20	Bank of America Merrill Lynch	(400.975)	
US-Dollar	Indische Rupie	692.822	52.500.000	16-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(1.021)	Euro	US-Dollar	1.472.236	1.678.000	28-Aug.-20	RBC Capital Markets	(22.876)	
US-Dollar	Koreanischer Won	692.475	840.000.000	16-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(5.195)	Euro	US-Dollar	29.513.027	33.354.000	11-Sept.-20	Bank of America Merrill Lynch	(196.137)	
US-Dollar	Koreanischer Won	692.881	840.000.000	16-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(4.834)	Euro	US-Dollar	1.366.214	1.545.000	11-Sept.-20	Lloyds Bank plc	(9.952)	
Chilenischer Peso	US-Dollar	388.000.000	473.080	17-Jul.-20	HSBC Bank plc	(573)							EUR (1.970.740)	
Chilenischer Peso	US-Dollar	490.000.000	601.541	17-Jul.-20	BNP Paribas	(4.375)							Netto EUR 2.585.730	
Chilenischer Peso	US-Dollar	388.000.000	472.928	17-Jul.-20	BNP Paribas	(437)								
Kolumbianischer Peso	US-Dollar	880.000.000	235.038	17-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(379)								
Kolumbianischer Peso	US-Dollar	860.000.000	229.784	17-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(450)								
Kolumbianischer Peso	US-Dollar	860.000.000	229.926	17-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(576)								
US-Dollar	Chilenischer Peso	2.792.703	2.302.835.000	17-Jul.-20	Barclays Bank PLC	(10.061)								
US-Dollar	Kolumbianischer Peso	359.695	1.420.000.000	17-Jul.-20	Barclays Bank PLC	(16.842)							EUR 294	
US-Dollar	Kolumbianischer Peso	835.167	3.274.022.565	17-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(33.625)							CHF 313	
US-Dollar	Indonesische Rupiah	2.257.268	34.305.954.301	17-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(105.488)								
US-Dollar	Indonesische Rupiah	493.879	7.500.000.000	17-Jul.-20	Bank of America Merrill Lynch	(22.711)								
US-Dollar	Russischer Rubel	2.872.962	212.728.483	17-Jul.-20	Goldman Sachs	(105.574)								
Euro	US-Dollar	5.331.262	6.000.000	27-Jul.-20	Bank of America Merrill Lynch	(18.552)								
Mexikanischer Peso	US-Dollar	9.918.269	440.785	27-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(12.498)							EUR 26	
Mexikanischer Peso	US-Dollar	1.615.000	71.430	27-Jul.-20	BNP Paribas	(1.729)							EUR 26	
Mexikanischer Peso	US-Dollar	9.918.270	440.273	27-Jul.-20	BNP Paribas	(12.042)							GBP 24	
Südafrikanischer Rand	US-Dollar	7.715.000	444.006	27-Jul.-20	Goldman Sachs	(389)								
Südafrikanischer Rand	US-Dollar	12.577.068	736.382	27-Jul.-20	BNP Paribas	(11.833)	Sterling	Euro	100.000	112.037	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(2.590)	
Südafrikanischer Rand	US-Dollar	13.554.000	815.492	27-Jul.-20	Morgan Stanley	(32.288)	Sterling	Euro	9.190.031	10.310.536	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(252.291)	
Südafrikanischer Rand	US-Dollar	11.528.000	683.064	27-Jul.-20	Bank of America Merrill Lynch	(18.072)	Sterling	Euro	2.389	2.641	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(26)	
Südafrikanischer Rand	US-Dollar	7.800.000	450.600	27-Jul.-20	Bank of America Merrill Lynch	(1.911)								
US-Dollar	Mexikanischer Peso	1.475.487	36.236.000	27-Jul.-20	Barclays Bank PLC	(74.623)								
US-Dollar	Rumänischer Leu	1.201.238	5.420.000	27-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(45.814)							EUR (254.907)	
US-Dollar	Südafrikanischer Rand	1.926.341	36.158.000	27-Jul.-20	RBC Capital Markets	(136.013)							GBP (232.855)	
US-Dollar	Thailändischer Baht	2.171.667	69.770.000	27-Jul.-20	UBS AG	(76.263)								
Euro	US-Dollar	542.933	610.000	30-Jul.-20	Bank of America Merrill Lynch	(928)							Netto EUR (254.881)	
														Netto GBP (232.831)

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte Forts.							Nicht
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Gewinn/(Verlust)	
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)							
Euro	Sterling	23.079	20.875	01-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	227	
Euro	Sterling	24.441	21.985	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	379	
Euro	Sterling	4.573	4.092	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	95	
Euro	Sterling	17.001	15.217	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	347	
Euro	Sterling	1.634	1.455	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	41	
Euro	Sterling	98.311	87.748	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	2.273	
Euro	Sterling	3.690.146	3.338.521	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	36.223	
Euro	Sterling	89.749	81.426	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	630	
Sterling	Euro	1.000	1.091	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	3	
						EUR 40.218	
						GBP 36.739	
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund Anteilsklasse Sterling X (Inc) (Hedged)							
Sterling	Euro	181.775	203.938	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(4.990)	
						EUR (4.990)	
						GBP (4.558)	
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund Anteilsklasse Sterling X (Acc) (Hedged)							
Sterling	Euro	9.873.673	11.077.532	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(271.059)	
						EUR (271.059)	
						GBP (247.610)	
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund Anteilsklasse USD R (Hedged)							
Sterling	Euro	3.667.919	3.230.072	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	41.263	
						EUR 41.263	
						USD 46.252	
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund Anteilsklasse USD T (Hedged)							
US-Dollar	Euro	9.148.189	8.056.150	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	102.914	
						EUR 102.914	
						USD 115.356	
Euro	US-Dollar	25.900	29.135	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(85)	
						EUR (85)	
						USD (95)	
						Netto EUR 102.829	
						Netto USD 115.261	
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund Anteilsklasse USD W (Acc) (Hedged)							
US-Dollar	Euro	50.443	44.608	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	381	
US-Dollar	Euro	2.507.685	2.208.338	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	28.211	
						EUR 28.592	
						USD 32.049	

BNY MELLON ABSOLUTE RETURN EQUITY FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in GBP	Summe der Netto- vermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in GBP	Summe der Netto- vermögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen				Einlagenzertifikat Forts.			
	Guernsey - 3.277.358				Großbritannien Forts.		
	(31. Dezember 2019: 5.602.322)	3.277.358	1,21	8.000.000	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd		
9.337.203	Sherborne Investors Guernsey C Ltd	3.277.358	1,21		0,170 % 09-Sept.-2020 CD	8.000.631	2,94
Großbritannien - 26.141.675				Summe der Anlagen in Einlagenzertifikate			
(31. Dezember 2019: 41.789.262)						85.049.206	31,27
425.892	Electra Private Equity Plc	813.454	0,30	Commercial Paper			
25.328.221	Insight Liquidity Funds Plc - GBP Liquidity Fund	25.328.221	9,31		Finnland - 8.999.749		
Summe der Anlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen					(31. Dezember 2019: -)	8.999.749	3,31
		29.419.033	10,82	9.000.000	Nordea Bank Abp 0,000 % 15-Jul.-2020 CP	8.999.749	3,31
Variabel verzinsliche Schuldtitel				Frankreich - 19.999.490			
	Australien - 12.005.220				(31. Dezember 2019: 29.984.123)	19.999.490	7,36
12.000.000	National Australia Bank Ltd 'GMTN' FRN	12.005.220	4,41	10.000.000	Agence Centrale des Organismes de Securite	9.999.769	3,68
	1,060 % 17-Jul.-2020	12.005.220	4,41	10.000.000	Sociale 0,000 % 13-Jul.-2020 CP	9.999.721	3,68
Kanada - 12.992.460				Spanien - 7.998.620			
(31. Dezember 2019: 15.015.600)					(31. Dezember 2019: 14.987.491)	7.998.620	2,94
13.000.000	Bank of Nova Scotia/The 'EMTN' FRN	12.992.460	4,78	8.000.000	Banco Santander SA 0,000 % 24-Aug.-2020 CP	7.998.620	2,94
	0,584 % 11-Jun.-2021	12.992.460	4,78	Großbritannien - 7.999.777			
Finnland - 13.033.280					(31. Dezember 2019: -)	7.999.777	2,94
(31. Dezember 2019: 15.015.675)				8.000.000	Transport For London 0,000 % 15-Jul.-2020 CP	7.999.777	2,94
13.000.000	OP Corporate Bank plc 'EMTN' FRN	13.033.280	4,79	Summe der Anlagen in Commercial Paper			
	0,568 % 30-Mai-2021	13.033.280	4,79			44.997.636	16,55
Überstaatlich - 3.004.785				Aktien			
(31. Dezember 2019: 17.013.540)					Deutschland - 1.388.251		
3.000.000	European Investment Bank 'EMTN' FRN	3.004.785	1,11		(31. Dezember 2019: 2.391.929)	1.388.251	0,51
	0,465 % 21-Mai-2021	3.004.785	1,11	34.226	Dermapharm Holding SE	1.388.251	0,51
Summe der Anlagen in variabel verzinslichen Schuldtiteln				Guernsey - 923.756			
		41.035.745	15,09		(31. Dezember 2019: 1.527.361)	923.756	0,34
Einlagenzertifikat				17.595.350	Sherborne Investors Guernsey B Ltd	923.756	0,34
	Belgien - 9.999.876			Spanien - 9.470.549			
	(31. Dezember 2019: 16.497.798)	9.999.876	3,68		(31. Dezember 2019: 18.277.778)	9.470.549	3,48
10.000.000	Euroclear Bank SA/NV 0,000 % 08-Jul.-2020 CD	9.999.876	3,68	622.601	Grifols SA ADR	9.470.549	3,48
Frankreich - 18.000.074				Schweiz - 977.732			
(31. Dezember 2019: -)					(31. Dezember 2019: -)	977.732	0,36
10.000.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA	18.000.074	6,62	3.466	Roche Holding AG	977.732	0,36
	0,000 % 07-Aug.-2020 CD	9.999.000	3,68	Großbritannien - 2.730.959			
8.000.000	BNP Paribas SA 0,880 % 07-Jul.-2020 CD	8.001.074	2,94		(31. Dezember 2019: 2.975.351)	2.730.959	1,01
Schweiz - 18.036.420				2.609.141	Applied Graphene Materials Plc	430.508	0,16
(31. Dezember 2019: 10.005.252)				26.000	Blue Prism Group plc	295.880	0,11
10.000.000	Credit Suisse 1,020 % 13-Nov.-2020 CD	10.029.538	3,69	21.000	Dechra Pharmaceuticals Plc	595.770	0,22
8.000.000	UBS AG 0,820 % 14-Aug.-2020 CD	8.006.882	2,94	400.000	Johnson Service Group Plc	465.200	0,17
Vereinigte Arabische Emirate - 4.002.622				257.143	National Express Group Plc	500.401	0,19
(31. Dezember 2019: -)				20.000	Whitbread Plc	443.200	0,16
4.000.000	National Bank of Abu Dhabi	4.002.622	1,47	Summe der Anlagen in Aktien			
	0,420 % 18-Dez.-2020 CD	4.002.622	1,47			15.491.247	5,70
Großbritannien - 35.010.214				Anleihen			
(31. Dezember 2019: 21.972.008)					Großbritannien - 26.030.030		
9.000.000	Barclays Plc 0,360 % 24-Aug.-2020 CD	9.003.240	3,31		(31. Dezember 2019: 30.070.509)	26.030.030	9,57
8.000.000	Mizuho Bank Ltd 0,000 % 28-Aug.-2020 CD	7.998.464	2,94	26.000.000	United Kingdom Gilt 2,000 % 22-Jul.-2020	26.030.030	9,57
10.000.000	MUFG Bank Ltd 0,540 % 09-Sept.-2020 CD	10.007.879	3,68	Summe der Anlagen in Anleihen			
						26.030.030	9,57

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in GBP	Summe der Netto- vermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in GBP	Summe der Netto- vermögen %
Aktienindexswaps				Aktienindexswaps			
Europa - 201.602 (31. Dezember 2019: 84.874)				Deutschland - 1.184.524 (31. Dezember 2019: 1.404.280)			
(28.050)	Euro STOXX Banks 16-Okt.-2020	152.355	0,06	(11.160)	Allianz SE 13-Jan.-2021	81.718	0,03
(1.058)	STOXX 600 - Auto & Parts 13-Jan.-2021	34.777	0,01	33.297	Deutsche Boerse AG 16-Okt.-2020	190.864	0,07
(1.155)	STOXX 600 - Health Care 13-Jan.-2021	2.502	0,00	(30.000)	Evonik Industries AG 16-Okt.-2020	20.770	0,01
(6.610)	STOXX 600 - Insurance 04-Nov.-2020	9.416	0,00	10.165	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen 13-Jan.-2021	418.253	0,15
(3.628)	STOXX 600 - Oil & Gas 16-Okt.-2020	2.552	0,00	25.982	Rheinmetall AG 25-Jun.-2021	14.003	0,01
Überstaatlich - 17.125 (31. Dezember 2019: -)				5.000	SAP SE 04-Nov.-2020	48.465	0,02
16.677	MS Telecommunications Europe 25-Jun.-2021	17.125	0,01	11.962	Siemens AG 25-Jun.-2021	22.729	0,01
Großbritannien - 340.858 (31. Dezember 2019: 26.717)				8.809	Siltronic AG 25-Jun.-2021	8.530	0,00
(203)	FTSE 250 Index 13-Jan.-2021	86.469	0,03	100.562	Takkt AG 16-Okt.-2020	78.083	0,03
(210)	FTSE 350 Aerospace & Defense Index 16-Okt.-2020	470	0,00	19.265	Volkswagen AG - Preference 13-Jan.-2021	301.109	0,11
(41.248)	JPINF3RT 04-Nov.-2020	130.861	0,05	Irland - 609.399 (31. Dezember 2019: 559.486)			
(15.300)	JPINHOME 04-Nov.-2020	59.449	0,02	72.000	CRH Plc 13-Jan.-2021	369.964	0,14
(4.500)	JPMorgan Index CMNT 04-Nov.-2020	16.493	0,01	12.830	Linde Plc 25-Jun.-2021	57.722	0,02
(10.000)	JPMorgan Index UKFM 04-Nov.-2020	47.116	0,02	134.000	Ryanair Holdings Plc 13-Jan.-2021	168.005	0,06
USA - 88.059 (31. Dezember 2019: 40.547)				78.000	Smurfit Kappa Group Plc 04-Nov.-2020	13.708	0,00
(10.900)	JPMorgan Index AIR 04-Nov.-2020	84.263	0,03	Italien - 762.232 (31. Dezember 2019: 1.649.686)			
(5.746)	JPMorgan Index LVO 04-Nov.-2020	3.796	0,00	520.117	Anima Holding SpA '144A' 13-Jan.-2021	447.780	0,17
Summe der Anlagen in Aktienindexswaps				73.100	Assicurazioni Generali SpA 25-Jun.-2021	1.836	0,00
		647.644	0,24	58.806	Banca Generali SpA 25-Jun.-2021	34.917	0,01
Aktienindexswaps				(93.799)	Eni SpA 16-Okt.-2020	10.668	0,00
Belgien - 11.448 (31. Dezember 2019: 192.485)				116.694	FinecoBank Banca Fineco SpA 25-Jun.-2021	19.721	0,01
100.258	D'ieteren SA/NV 25-Jun.-2021	11.448	0,00	39.215	Recordati SpA 13-Jan.-2021	244.131	0,09
Dänemark - 110.531 (31. Dezember 2019: -)				3.663.680	Telecom Italia SpA/Milano 25-Jun.-2021	3.179	0,00
7.895	Carlsberg A/S 13-Jan.-2021	61.549	0,02	Japan - 96.646 (31. Dezember 2019: 327.505)			
212.255	Danske Bank A/S 25-Jun.-2021	36.164	0,01	22.667	Sony Corp ADR 04-Nov.-2020	96.646	0,04
40.220	Topdanmark A/S 25-Jun.-2021	12.818	0,01	Jersey - 115.758 (31. Dezember 2019: 655.349)			
Finnland - 46.424 (31. Dezember 2019: 181.490)				130.986	boohoo Group Plc 04-Nov.-2020	83.445	0,03
22.727	Neste Oyj 16-Okt.-2020	38.200	0,02	115.404	Sanne Group Plc 13-Jan.-2021	32.313	0,01
60.020	Sampo Oyj - A-Klasse 25-Jun.-2021	8.224	0,00	Niederlande - 292.436 (31. Dezember 2019: 952.280)			
Frankreich - 984.822 (31. Dezember 2019: 1.495.683)				60.497	EXOR NV 25-Jun.-2021	81.790	0,03
(119.750)	AXA SA 16-Okt.-2020	138.495	0,05	245.119	ING Groep NV 16-Okt.-2020	182.373	0,07
57.029	Bureau Veritas SA 25-Jun.-2021	1.823	0,00	211.219	Marel HF 16-Okt.-2020	28.273	0,01
116.010	Credit Agricole SA 25-Jun.-2021	32.004	0,01	Spanien - 1.169.774 (31. Dezember 2019: 1.066.042)			
51.639	Edenred 13-Jan.-2021	201.960	0,08	51.706	Endesa SA 16-Okt.-2020	71.558	0,03
(8.335)	EssilorLuxottica SA 16-Okt.-2020	31.270	0,01	(373.084)	Grifols SA 04-Nov.-2020	984.938	0,36
3.876	L'Oreal SA 16-Okt.-2020	93.861	0,04	178.139	Merlin Properties Socimi SA (REIT) 16-Okt.-2020	61.837	0,02
40.289	Nexity SA 25-Jun.-2021	6.993	0,00	13.272	Red Electrica Corp SA 13-Jan.-2021	14.185	0,01
(9.351)	Orpea 16-Okt.-2020	18.770	0,01	94.582	Repsol SA (Right) 16-Okt.-2020	37.256	0,01
54.070	SCOR SE 16-Okt.-2020	29.833	0,01	Schweden - 211.777 (31. Dezember 2019: 485.681)			
8.372	SEB SA 25-Jun.-2021	7.265	0,00	78.154	Atlas Copco AB 16-Okt.-2020	148.541	0,06
12.057	Trigano SA 16-Okt.-2020	254.147	0,09	231.600	Swedbank AB 25-Jun.-2021	63.236	0,02
9.793	Ubisoft Entertainment SA 13-Jan.-2021	33.818	0,01				
49.439	Vivendi SA 13-Jan.-2021	134.583	0,05				

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener	Summe			Zugrunde	Angemessener	Summe
		Wert	der Netto-			liegendes Engagement	Wert	der Netto-
Bestände	Beschreibung	in GBP	vermögen %	Bestände	Beschreibung	in GBP	in GBP	vermögen %
Aktien swaps Forts.				Offene Terminkontrakte - 129.507 (31. Dezember 2019: 54.531)				
Schweiz - 631.721 (31. Dezember 2019: 472.361)				(14)	DAX Index			
40.011	Cie Financiere Richemont SA 04-Nov.-2020	275.802	0,10		Short Futures Contracts			
2.239	Geberit AG 13-Jan.-2021	9.361	0,00		Exp Sep.-2020	(3.918.994)	45.081	0,02
13.411	Novartis AG 04-Nov.-2020	19.647	0,01	(60)	FTSE 100 Index			
(4.089)	Temenos AG 04-Nov.-2020	3.741	0,00		Short Futures Contracts			
152.500	UBS Group AG 16-Okt.-2020	65.972	0,02		Exp Sep.-2020	(3.691.500)	26.612	0,01
6.603	Zurich Insurance Group AG 16-Okt.-2020	257.198	0,10	(35)	FTSE MIB Index			
					Short Futures Contracts			
					Exp Sep.-2020	(3.086.117)	36.768	0,01
Großbritannien - 3.051.851 (31. Dezember 2019: 4.217.553)				(6)	IBEX 35 Index			
51.945	Admiral Group Plc 16-Okt.-2020	25.669	0,01		Short Futures Contracts			
222.580	Ashmore Group Plc 04-Nov.-2020	102.164	0,04		Exp Juli-2020	(395.725)	9.098	0,00
(125.000)	Babcock International Group Plc 13-Jan.-2021	80.437	0,03	(8)	MDAX Index			
332.772	Balfour Beatty Plc 13-Jan.-2021	75.956	0,03		Short Futures Contracts			
31.474	Berkeley Group Holdings Plc 13-Jan.-2021	44.980	0,02		Exp Sep.-2020	(942.650)	11.948	0,01
(450.000)	BP Plc 13-Jan.-2021	53.269	0,02	Summe der offenen Terminkontrakte				
420.000	Chemring Group Plc 16-Okt.-2020	150.150	0,06	129.507				
1.110.278	ConvaTec Group Plc '144A' 13-Jan.-2021	155.439	0,06	0,05				
18.000	Dechra Pharmaceuticals Plc 16-Okt.-2020	40.809	0,01	Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 4.424.682 (siehe unten) (31. Dezember 2019: 2.662.866)				
266.000	Direct Line Insurance Group Plc 13-Jan.-2021	11.974	0,00	4.424.682				
(120.000)	DS Smith Plc 16-Okt.-2020	13.255	0,00	1,63				
(100.000)	Equiniti Group Plc '144A' 04-Nov.-2020	14.100	0,01	Summe der Vermögenswerte				
30.000	Gamma Communications Plc 13-Jan.-2021	5.815	0,00	zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert				
49.379	GlaxoSmithKline Plc 16-Okt.-2020	1.083	0,00	256.504.073				
(46.111)	Greggs Plc 16-Okt.-2020	112.636	0,04	94,33				
170.000	Howden Joinery Group Plc 04-Nov.-2020	39.838	0,01	Aktienindexswaps				
30.000	IMI Plc 13-Jan.-2021	2.040	0,00	Europa - (515.111) (31. Dezember 2019: (886.480))				
119.233	Intermediate Capital Group Plc 04-Nov.-2020	250.666	0,09	(14.877)	Euro STOXX Banks 16-Okt.-2020		(515.111)	(0,19)
(20.204)	Intertek Group Plc 25-Jun.-2021	8.890	0,00	(2.022)	STOXX 600 - Insurance 04-Nov.-2020		(31.911)	(0,01)
180.000	JD Sports Fashion Plc 04-Nov.-2020	184.860	0,07	(4.235)	STOXX 600 - Auto & Parts 13-Jan.-2021		(55.659)	(0,02)
(235.000)	Legal & General Group Plc 16-Okt.-2020	32.858	0,01	(19.150)	STOXX 600 - Banks 04-Nov.-2020		(211.959)	(0,08)
3.000.000	Lloyds Banking Group Plc 16-Okt.-2020	282	0,00	(1.701)	STOXX 600 - Health Care 13-Jan.-2021		(17.250)	(0,01)
(480.000)	Marks & Spencer Group Plc 16-Okt.-2020	42.569	0,02	(1.915)	STOXX 600 - Industrial Goods & Service 13-Jan.-2021		(9.261)	(0,00)
1.280.116	Melrose Industries Plc 04-Nov.-2020	280.281	0,10	(10.400)	STOXX 600 - Insurance 04-Nov.-2020		(149.743)	(0,06)
(55.000)	Mondi Plc 16-Okt.-2020	2.396	0,00	Summe der offenen Terminkontrakte				
252.831	National Grid Plc 13-Jan.-2021	192.705	0,07	129.507				
(20.000)	Next Plc 16-Okt.-2020	105.956	0,04	0,05				
80.000	Persimmon Plc 13-Jan.-2021	42.419	0,02	Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 4.424.682 (siehe unten) (31. Dezember 2019: 2.662.866)				
751.000	Quilter Plc '144A' 13-Jan.-2021	106.437	0,04	4.424.682				
20.000	Reckitt Benckiser Group Plc 16-Okt.-2020	63.290	0,02	1,63				
(115.000)	Royal Dutch Shell Plc 13-Jan.-2021	31.273	0,01	Summe der Vermögenswerte				
323.170	RSA Insurance Group Plc 13-Jan.-2021	33.887	0,01	zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert				
(27.550)	Schroders Plc 13-Jan.-2021	31.566	0,01	256.504.073				
977.702	Serco Group Plc 13-Jan.-2021	239.523	0,09	94,33				
(62.000)	Smith & Nephew Plc 13-Jan.-2021	53.559	0,02	Aktienindexswaps				
(191.600)	Standard Chartered Plc 16-Okt.-2020	44.922	0,02	Europa - (515.111) (31. Dezember 2019: (886.480))				
45.000	Tate & Lyle Plc 13-Jan.-2021	9.033	0,00	(14.877)	Euro STOXX Banks 16-Okt.-2020		(515.111)	(0,19)
63.000	Travis Perkins Plc 13-Jan.-2021	30.060	0,01	(2.022)	STOXX 600 - Insurance 04-Nov.-2020		(31.911)	(0,01)
231.144	UNITE Group Plc/The (REIT) 16-Okt.-2020	46.019	0,02	(4.235)	STOXX 600 - Auto & Parts 13-Jan.-2021		(55.659)	(0,02)
(300.000)	Vodafone Group Plc 13-Jan.-2021	24.665	0,01	(19.150)	STOXX 600 - Banks 04-Nov.-2020		(211.959)	(0,08)
19.500	Whitbread Plc 13-Jan.-2021	139.620	0,05	(1.701)	STOXX 600 - Health Care 13-Jan.-2021		(17.250)	(0,01)
(490.493)	William Hill Plc 13-Jan.-2021	105.516	0,04	(1.915)	STOXX 600 - Industrial Goods & Service 13-Jan.-2021		(9.261)	(0,00)
183.431	Wm Morrison Supermarkets Plc 13-Jan.-2021	18.985	0,01	(10.400)	STOXX 600 - Insurance 04-Nov.-2020		(149.743)	(0,06)
Summe der Anlagen in Aktien swaps				Summe der offenen Terminkontrakte				
9.279.343				129.507				
3,41				0,05				
				Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 4.424.682 (siehe unten) (31. Dezember 2019: 2.662.866)				
				4.424.682				
				1,63				
				Summe der Vermögenswerte				
				zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert				
				256.504.073				
				94,33				
				Aktienindexswaps				
				Europa - (515.111) (31. Dezember 2019: (886.480))				
				(14.877)	Euro STOXX Banks 16-Okt.-2020		(515.111)	(0,19)
				(2.022)	STOXX 600 - Insurance 04-Nov.-2020		(31.911)	(0,01)
				(4.235)	STOXX 600 - Auto & Parts 13-Jan.-2021		(55.659)	(0,02)
				(19.150)	STOXX 600 - Banks 04-Nov.-2020		(211.959)	(0,08)
				(1.701)	STOXX 600 - Health Care 13-Jan.-2021		(17.250)	(0,01)
				(1.915)	STOXX 600 - Industrial Goods & Service 13-Jan.-2021		(9.261)	(0,00)
				(10.400)	STOXX 600 - Insurance 04-Nov.-2020		(149.743)	(0,06)
				Summe der offenen Terminkontrakte				
				129.507				
				0,05				
				Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 4.424.682 (siehe unten) (31. Dezember 2019: 2.662.866)				
				4.424.682				
				1,63				
				Summe der Vermögenswerte				
				zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert				
				256.504.073				
				94,33				
				Aktienindexswaps				
				Europa - (515.111) (31. Dezember 2019: (886.480))				
				(14.877)	Euro STOXX Banks 16-Okt.-2020		(515.111)	(0,19)
				(2.022)	STOXX 600 - Insurance 04-Nov.-2020		(31.911)	(0,01)
				(4.235)	STOXX 600 - Auto & Parts 13-Jan.-2021		(55.659)	(0,02)
				(19.150)	STOXX 600 - Banks 04-Nov.-2020		(211.959)	(0,08)
				(1.701)	STOXX 600 - Health Care 13-Jan.-2021		(17.250)	(0,01)
				(1.915)	STOXX 600 - Industrial Goods & Service 13-Jan.-2021		(9.261)	(0,00)
				(10.400)	STOXX 600 - Insurance 04-Nov.-2020		(149.743)	(0,06)
				Summe der offenen Terminkontrakte				
				129.507				
				0,05				
				Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 4.424.682 (siehe unten) (31. Dezember 2019: 2.662.866)				
				4.424.682				
				1,63				
				Summe der Vermögenswerte				
				zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert				
				256.504.073				
				94,33				
				Aktienindexswaps				
				Europa - (515.111) (31. Dezember 2019: (886.480))				
				(14.877)	Euro STOXX Banks 16-Okt.-2020		(515.111)	(0,19)
				(2.022)	STOXX 600 - Insurance 04-Nov.-2020		(31.911)	(0,01)
				(4.235)	STOXX 600 - Auto & Parts 13-Jan.-2021		(55.659)	(0,02)
				(19.150)	STOXX 600 - Banks 04-Nov.-2020		(211.959)	(0,08)
				(1.701)	STOXX 600 - Health Care 13-Jan.-2021		(17.250)	(0,01)
				(1.915)	STOXX 600 - Industrial Goods & Service 13-Jan.-2021		(9.261)	(0,00)
				(10.400)	STOXX 600 - Insurance 04-Nov.-2020		(149.743)	(0,06)
				Summe der offenen Terminkontrakte				
				129.507				
				0,05				
				Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 4.424.682 (siehe unten) (31. Dezember 2019: 2.662.866)				
				4.424.682				
				1,63				
				Summe der Vermögenswerte				
				zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert				
				256.504.073				
				94,33				
				Aktienindexswaps				
				Europa - (515.111) (31. Dezember 2019: (886.480))				
				(14.877)	Euro STOXX Banks 16-Okt.-2020		(515.111)	(0,19)
				(2.022)	STOXX 600 - Insurance 04-Nov.-2020		(31.911)	(0,01)
				(4.235)	STOXX 600 - Auto & Parts 13-Jan.-2021		(55.659)	(0,02)
				(19.150)	STOXX 600 - Banks 04-Nov.-2020		(211.959)	(0,08)
				(1.701)	STOXX 600 - Health Care 13-Jan.-2021		(17.250)	(0,01)
				(1.915)	STOXX 600 - Industrial Goods & Service 13-Jan.-2021		(9.261)	(0,00)
				(10.400)	STOXX 600 - Insurance 04-Nov.-2020		(149.743)	(0,06)
				Summe der offenen Terminkontrakte				
				129.507				
				0,05				
				Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 4.424.682 (siehe unten) (31. Dezember 2019: 2.662.866)				
				4.424.682				
				1,63				
				Summe der Vermögenswerte				
				zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert				
				256.504.073				
				94,33				
				Aktienindexswaps				
				Europa - (515.111) (31. Dezember 2019: (886.480))				
				(14.877)	Euro STOXX Banks 16-Okt.-2020		(515.111)	(0,19)
				(2.022)	STOXX 600 - Insurance 04-Nov.-2020		(31.911)	(0,01)
				(4.235)	STOXX 600 - Auto & Parts 13-Jan.-2021		(55.659)	(0,02)
				(19.150)	STOXX 600 - Banks 04-Nov.-2020		(211.959)	(0,08)
				(1.701)	STOXX 600 - Health Care 13-Jan.-2021		(17.250)	(0,01)
				(1.915)	STOXX 600 - Industrial Goods & Service 13-Jan.-2021		(9.261)	(0,00)
				(10.400)	STOXX 600 - Insurance 04-Nov.-2020		(149.743)	(0,06)
				Summe der offenen Terminkontrakte				
				129.507				
				0,05				
				Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 4.424.682 (siehe unten) (31. Dezember 2019: 2.662.866)				
				4.424.682				
				1,63				
				Summe der Vermögenswerte				
				zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert				
				256.504.073				
				94,33				
				Aktienindexswaps				
				Europa - (515.111) (31. Dezember 2019: (886.480))				
				(14.877)	Euro STOXX Banks 16-Okt.-2020		(515.111)	(0,19)
				(2.022)	STOXX 600 - Insurance 04-Nov.-2020		(31.911)	(0,01)
				(4.235)	STOXX 600 - Auto & Parts 13-Jan.-2021		(55.659)	(0,02)
				(19.150)	STOXX 600 - Banks 04-Nov.-2020		(211.959)	(0,08)
				(1.701)	STOXX 600 - Health Care 13-Jan.-2021		(17.250)	(0,01)
				(1.915)	STOXX 600 - Industrial Goods & Service 13-Jan.-2021		(9.261)	(0,00)
				(10.400)	STOXX 600 - Insurance 04-Nov.-2020		(149.743)	(0,06)
				Summe der offenen Terminkontrakte				
				129.507				
				0,05				
				Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 4.424.682 (siehe unten) (31. Dezember 2019: 2.662.866)				
				4.424.682				
				1,63				
				Summe der Vermögenswerte				
				zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert				
				256.504.073				
				94,33				
				Aktienindexswaps				
				Europa - (515.111) (31. Dezember 2019: (886.480))				
				(14.877)	Euro STOXX Banks 16-Okt.-2020		(515.111)	(0,19)
				(2.022)	STOXX 600 - Insurance 04-Nov.-2020		(31.911)	(0,01)
				(4.235)	STOXX 600 - Auto & Parts 13-Jan.-2021		(55.659)	(0,02)
				(19.150)	STOXX 600 - Banks 04-Nov.-2020		(211.959)	(0,08)
				(1.701)	STOXX 600 - Health Care 13-Jan.-2021		(17.250)	(0,01)
				(1.915)	STOXX 600 - Industrial Goods & Service 13-Jan.-2021		(9.261)	(0,00)
				(10.400)	STOXX 600 - Insurance 04-Nov.-2020		(149.743)	(0,06)
				Summe der offenen Terminkontrakte				
				129.507				
				0,05				
				Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 4.424.682 (siehe unten) (31. Dezember 2019: 2.662.866)				
				4.424.682				
				1,63				
				Summe der Vermögenswerte				
				zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert				
				256.504.073				
				94,33				
				Aktienindexswaps				
				Europa - (515.111) (31. Dezember 2019: (886.480))				
				(14.877)	Euro STOXX Banks 16-Okt.-2020		(515.111)	(0,19)
				(2.022)	STOXX 600 - Insurance 04-Nov.-2020		(31.911)	(0,01)
				(4.235)	STOXX 600 - Auto & Parts 13-Jan.-2021		(55.659)	(0,02)
				(19.150)	STOXX 600 - Banks 04-Nov.-2020		(211.959)	(0,08)
				(1.701)	STOXX 600 - Health Care 13-Jan.-2021		(17.250)	(0,01)
				(1.915)	STOXX 600 - Industrial Goods & Service 13-Jan.-2021		(9.261)	(0,00)
				(10.400)	STOXX 600 - Insurance 04-Nov.-2020		(149.743)	(0,06)
				Summe der offenen Terminkontrakte				
				129.507				
				0,05				
				Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 4.424.682 (siehe unten) (31. Dezember 2019: 2.662.866)				
				4.424.682				
				1,63				
				Summe der Vermögenswerte				
				zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert				
				256.504.073				
				94,33				
				Aktienindexswaps				
				Europa - (515.111) (31. Dezember 2019: (886.480))				
				(14.877)	Euro STOXX Banks 16-Okt.-2020		(515.111)	(0,19)
				(2.022)	STOXX 600 - Insurance 04-Nov.-2020		(31.911)	(0,01)

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in GBP	Summe der Netto- vermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in GBP	Summe der Netto- vermögen %
Aktienwaps				Aktienwaps Forts.			
	Belgien - (16.295)				Schweden - (239.951)		
	(31. Dezember 2019: (53.753))	(16.295)	(0,01)		(31. Dezember 2019: (211.542))	(239.951)	(0,09)
17.000	Solvay SA 16-Okt.-2020	(16.295)	(0,01)	(67.628)	Atlas Copco AB 16-Okt.-2020	(216.185)	(0,08)
	Dänemark - (28.278)			(67.217)	Electrolux AB 25-Jun.-2021	(3.654)	(0,00)
	(31. Dezember 2019: –)	(28.278)	(0,01)	(38.535)	EQT AB 25-Jun.-2021	(20.112)	(0,01)
(6.832)	Carlsberg A/S 16-Okt.-2020	(23.448)	(0,01)		Schweiz - (737.844)		
(3.582)	ROCKWOOL International A/S 25-Jun.-2021	(4.830)	(0,00)		(31. Dezember 2019: (607.312))	(737.844)	(0,27)
	Frankreich - (218.611)			(83.550)	Credit Suisse Group AG 16-Okt.-2020	(20.642)	(0,01)
	(31. Dezember 2019: (1.557.982))	(218.611)	(0,08)	1.019	Geberit AG 13-Jan.-2021	(2.813)	(0,00)
(11.623)	Air Liquide SA 25-Jun.-2021	(15.661)	(0,01)	3.465	Roche Holding AG 16-Okt.-2020	(66.916)	(0,02)
13.576	Edenred 13-Jan.-2021	(4.115)	(0,00)	(8.120)	Sika AG 16-Okt.-2020	(100.934)	(0,04)
(83.623)	Klepierre SA (REIT) 13-Jan.-2021	(142.656)	(0,05)	(2.924)	Straumann Holding AG 04-Nov.-2020	(272.814)	(0,10)
615.000	Natixis SA 16-Okt.-2020	(38.274)	(0,02)	(12.693)	Swatch Group AG/The 04-Nov.-2020	(71.824)	(0,03)
15.320	SCOR SE 16-Okt.-2020	(9.204)	(0,00)	(9.467)	Temenos AG 04-Nov.-2020	(201.901)	(0,07)
(10.353)	TOTAL SA 16-Okt.-2020	(8.701)	(0,00)		Großbritannien - (1.992.793)		
	Deutschland - (239.366)				(31. Dezember 2019: (2.944.707))	(1.992.793)	(0,73)
	(31. Dezember 2019: (172.507))	(239.366)	(0,09)	(16.000)	ASOS Plc 04-Nov.-2020	(106.982)	(0,04)
(38.394)	BASF SE 25-Jun.-2021	(41.473)	(0,01)	(223.820)	Aviva Plc 13-Jan.-2021	(68.981)	(0,03)
74.280	Bayer AG 25-Jun.-2021	(43.427)	(0,02)	(1.871.233)	Barclays Plc 16-Okt.-2020	(177.206)	(0,07)
(162.200)	Deutsche Bank AG 25-Jun.-2021	(14.927)	(0,01)	17.585	Bellway Plc 04-Nov.-2020	(14.683)	(0,01)
42.276	GEA Group AG 25-Jun.-2021	(1.352)	(0,00)	33.000	Blue Prism Group plc 13-Jan.-2021	(28.558)	(0,01)
(7.097)	HeidelbergCement AG 04-Nov.-2020	(38.023)	(0,01)	(40.443)	CNH Industrial N.V. 13-Jan.-2021	(38.738)	(0,01)
(17.698)	Volkswagen AG 16-Okt.-2020	(79.218)	(0,03)	270.000	ConvaTec Group Plc '144A' 13-Jan.-2021	(17.012)	(0,01)
(13.488)	Wacker Chemie AG 25-Jun.-2021	(20.946)	(0,01)	34.617	Cranswick Plc 13-Jan.-2021	(6.650)	(0,00)
	Irland - (117.105)			(25.000)	Croda International Plc 16-Okt.-2020	(31.291)	(0,01)
	(31. Dezember 2019: –)	(117.105)	(0,04)	131.730	Direct Line Insurance Group Plc 13-Jan.-2021	(1.833)	(0,00)
12.000	CRH Plc 13-Jan.-2021	(17.044)	(0,00)	57.783	Gamma Communications Plc 13-Jan.-2021	(4.334)	(0,00)
(81.371)	Glanbia Plc 13-Jan.-2021	(99.233)	(0,04)	(25.670)	Genus Plc 16-Okt.-2020	(35.128)	(0,01)
16.779	Smurfit Kappa Group Plc 04-Nov.-2020	(828)	(0,00)	(39.240)	Halma Plc 13-Jan.-2021	(119.290)	(0,04)
	Insel Man - (20.000)			70.000	Howden Joinery Group Plc 04-Nov.-2020	(27.005)	(0,01)
	(31. Dezember 2019: –)	(20.000)	(0,01)	245.000	HSBC Holdings Plc 16-Okt.-2020	(14.297)	(0,01)
175.000	GVC Holdings Plc 13-Jan.-2021	(20.000)	(0,01)	45.000	IMI Plc 13-Jan.-2021	(5.387)	(0,00)
	Italien - (86.516)			45.767	Intermediate Capital Group Plc 04-Nov.-2020	(28.558)	(0,01)
	(31. Dezember 2019: (155.729))	(86.516)	(0,03)	(76.177)	J D Wetherspoon Plc 13-Jan.-2021	(106.019)	(0,04)
(28.974)	Amplifon SpA 16-Okt.-2020	(45.945)	(0,02)	70.000	JD Sports Fashion Plc 04-Nov.-2020	(15.951)	(0,01)
(5.256)	Ferrari NV 13-Jan.-2021	(40.571)	(0,01)	(580.300)	M&G Plc 13-Jan.-2021	(149.715)	(0,05)
	Jersey - (41.283)			(25.000)	Mondi Plc 16-Okt.-2020	(3.375)	(0,00)
	(31. Dezember 2019: (8.028))	(41.283)	(0,01)	130.000	National Express Group Plc 04-Nov.-2020	(27.857)	(0,01)
145.000	boohoo Group Plc 04-Nov.-2020	(23.814)	(0,01)	665.000	QinetiQ Group Plc 13-Jan.-2021	(127.015)	(0,05)
24.000	Wizz Air Holdings Plc '144A' 16-Okt.-2020	(17.469)	(0,00)	(305.784)	Restaurant Group Plc/The 13-Jan.-2021	(10.382)	(0,00)
	Luxemburg - (31.409)			267.452	Royal Dutch Shell Plc 13-Jan.-2021	(364.598)	(0,13)
	(31. Dezember 2019: –)	(31.409)	(0,01)	48.000	Softcat Plc 16-Okt.-2020	(55.440)	(0,02)
600	Eurofins Scientific SE 16-Okt.-2020	(31.409)	(0,01)	(321.500)	Standard Life Aberdeen Plc 04-Nov.-2020	(169.825)	(0,06)
	Niederlande - (147.015)			92.723	Tate & Lyle Plc 13-Jan.-2021	(7.934)	(0,00)
	(31. Dezember 2019: (100.383))	(147.015)	(0,05)	264.714	Tesco Plc 04-Nov.-2020	(19.409)	(0,01)
(88.815)	Fiat Chrysler Automobiles NV 13-Jan.-2021	(147.015)	(0,05)	(645.510)	Vodafone Group Plc 16-Okt.-2020	(19.135)	(0,01)
	Spanien - (189.525)			39.000	Whitbread Plc 13-Jan.-2021	(184.069)	(0,07)
	(31. Dezember 2019: (2.213.248))	(189.525)	(0,07)	381.135	Wm Morrison Supermarkets Plc 13-Jan.-2021	(6.136)	(0,00)
(72.913)	CaixaBank SA 25-Jun.-2021	(3.363)	(0,00)		USA - (124.716)		
(53.326)	Enagas SA 13-Jan.-2021	(105.220)	(0,04)		(31. Dezember 2019: –)	(124.716)	(0,05)
94.582	Repsol SA 16-Okt.-2020	(74.995)	(0,03)	(2.349)	Apple Inc 04-Nov.-2020	(109.849)	(0,04)
(140.000)	Telefonica SA 25-Jun.-2021	(5.947)	(0,00)	(2.058)	Netflix Inc 04-Nov.-2020	(14.867)	(0,01)
	Summe der Anlagen in Aktienwaps				Summe der Anlagen in Aktienwaps	(4.230.707)	(1,55)

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

					Devisenterminkontrakte							Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	
Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement in GBP	Angemessener Wert in GBP	Summe der Nettovermögen %	Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent			
Offene Terminkontrakte - (7.585) (31. Dezember 2019: (16.487))					BNY Mellon Absolute Return Equity Fund								
(81)	CAC 40 10 Euro Index Short Futures Contracts Exp Juli-2020	(3.645.627)	(3.848)	(0,01)	Schweizer Franken	Sterling	560.000	468.218	12-Aug.-20	Bank of America Merrill Lynch	12.358		
											GBP	12.358	
(11)	Eurex SMI Index Short Futures Contracts Exp Sep.-2020	(945.263)	(1.415)	(0,00)	Euro	Sterling	2.000.000	1.833.393	12-Aug.-20	Goldman Sachs	(5.197)		
(235)	Euro STOXX 50 Index Short Futures Contracts Exp Sep.-2020	(6.901.658)	(2.322)	(0,00)	Sterling	Euro	1.339.745	1.500.000	12-Aug.-20	Goldman Sachs	(31.402)		
											Sterling	(8.664)	
											Sterling	(51.800)	
											Sterling	(443.609)	
											Sterling	(7.527)	
Summe der offenen Terminkontrakte											GBP	(548.199)	
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften - (598.089) (siehe unten) (31. Dezember 2019: (115.097))											Netto GBP	(535.841)	
Summe der finanziellen Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert													
Nettoumlaufvermögen													
Summe der Nettovermögen													
Die Gegenparteien für Aktienindex-Swaps sind Bank of America Merrill Lynch, Barclays Bank PLC und JPMorgan Chase Bank.													
Die Gegenparteien für Aktienswaps sind Bank of American Merrill Lynch, Barclays Bank PLC, JPMorgan Chase Bank und Morgan Stanley.													
Der Kontrahent für Futures ist Goldman Sachs.													
Portfolioanalyse					% des Gesamtvermögens								
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente					39,31								
Nicht an einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente					45,66								
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate					0,05								
OTC-Finanzderivate					5,04								
Sonstiges Umlaufvermögen					9,94								
Summe der Aktiva					100,00								

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte Forts.							Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund							BNY Mellon Absolute Return Equity Fund						
Anteilsklasse EUR R (Hedged) Forts.							Anteilsklasse EUR R (Inc) (Hedged) Forts.						
Euro	Sterling	64.744.432	57.720.947	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	1.434.833	Sterling	Euro	10.757	12.020	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(225)
Sterling	Euro	8.621	9.407	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	25							
						GBP 1.443.823						GBP (225)	
						EUR 1.580.554						EUR (246)	
												Netto GBP 79.034	
												Netto EUR 86.519	
Euro	Sterling	9.407	8.619	02-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(26)							
Sterling	Euro	21.381	23.602	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(184)							
Sterling	Euro	7.606	8.403	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(71)							
Sterling	Euro	114.788	127.609	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1.806)							
Sterling	Euro	124.599	139.252	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(2.633)							
Sterling	Euro	28.038	31.330	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(587)							
Sterling	Euro	87.847	97.679	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1.401)							
Sterling	Euro	87.938	98.156	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1.746)							
Sterling	Euro	45.095	50.272	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(837)							
Sterling	Euro	50.059	56.213	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1.302)							
Sterling	Euro	120.046	134.497	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(2.841)							
Sterling	Euro	100.950	111.587	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1.005)							
Sterling	Euro	179.148	198.842	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(2.530)							
Sterling	Euro	52.558	58.170	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(591)							
Sterling	Euro	79.321	87.428	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(561)							
						GBP (18.121)							
						EUR (19.837)							
						Netto GBP 1.425.702							
						Netto EUR 1.560.717							
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund							BNY Mellon Absolute Return Equity Fund						
Anteilsklasse EUR R (Inc) (Hedged)							Anteilsklasse EUR T (Hedged)						
Euro	Sterling	3.576.426	3.188.455	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	79.259	Euro	Sterling	20.456	18.502	01-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	184
						GBP 79.259	Sterling	Euro	6.620	7.225	02-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	20
						EUR 86.765	Euro	Sterling	1.384	1.252	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	12
							Euro	Sterling	1.235	1.102	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	26
							Euro	Sterling	1.389	1.237	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	32
							Euro	Sterling	1.298	1.164	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	22
							Euro	Sterling	875	784	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	16
							Euro	Sterling	37.008	33.283	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	531
							Euro	Sterling	872	780	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	16
							Euro	Sterling	1.103	992	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	16
							Euro	Sterling	47.079.119	41.971.969	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	1.043.343
							Euro	Sterling	457	414	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	4
							Euro	Sterling	885	802	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	7
							Euro	Sterling	1.663	1.509	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	11
							Euro	Sterling	758	685	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	8
							Euro	Sterling	336	303	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	4
							Euro	Sterling	32	29	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	1
							Sterling	Euro	74.850	81.680	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	220
												GBP 1.044.473	
												EUR 1.143.385	
							Sterling	Euro	1.252	1.384	01-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(12)
							Euro	Sterling	81.680	74.837	02-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(223)
							Euro	Sterling	7.225	6.621	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(20)

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte Forts.							Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund							BNY Mellon Absolute Return Equity Fund						
Anteilsklasse EUR T (Hedged) Forts.							Anteilsklasse EUR U (Hedged) Forts.						
Sterling	Euro	107.689	119.527	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1.521)	Euro	Sterling	8.755	7.888	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	111
Sterling	Euro	18.506	20.456	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(184)	Euro	Sterling	5.143	4.646	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	52
Sterling	Euro	444.242	497.718	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(10.513)	Sterling	Euro	20.079	21.911	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	59
Sterling	Euro	73.230	82.233	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1.904)							GBP 1.555.975
Sterling	Euro	37.847	42.191	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(703)							EUR 1.703.327
Sterling	Euro	69.983	78.115	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1.389)							
Sterling	Euro	26.432	29.390	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(421)	Sterling	Euro	223	246	01-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(2)
Sterling	Euro	31.232	34.899	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(654)	Euro	Sterling	21.911	20.076	02-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(60)
Sterling	Euro	32.140	35.920	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(679)	Euro	Sterling	1.279	1.172	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(3)
Sterling	Euro	179.668	199.736	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(2.827)	Sterling	Euro	115.818	129.760	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(2.741)
Sterling	Euro	11.124	12.290	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(104)	Sterling	Euro	16.007	17.975	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(416)
Sterling	Euro	1.030	1.137	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(9)	Sterling	Euro	4.304	4.798	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(80)
Sterling	Euro	214.549	237.456	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(2.411)	Sterling	Euro	4.480	5.000	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(89)
Sterling	Euro	13.784	15.193	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(98)	Sterling	Euro	16.061	17.859	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(256)
GBP (23.672)							Sterling	Euro	24.347	27.206	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(510)
EUR (25.914)							Sterling	Euro	34.692	38.567	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(546)
Netto GBP 1.020.801							Sterling	Euro	13.498	14.912	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(127)
Netto EUR 1.117.471							Sterling	Euro	108.692	119.802	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(769)
							Sterling	Euro	5.799	6.418	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(65)
							Sterling	Euro	14.980	16.627	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(212)
							Sterling	Euro	12.280	13.573	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(122)
							Sterling	Euro	12.012	13.425	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(254)
							Sterling	Euro	6.947	7.668	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(60)
													GBP (6.312)
													EUR (6.910)
													Netto GBP 1.549.663
													Netto EUR 1.696.417
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund							BNY Mellon Absolute Return Equity Fund						
Anteilsklasse EUR U (Hedged)							Anteilsklasse EUR U (Inc) (Hedged)						
Euro	Sterling	13.573	12.277	01-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	122	Euro	Sterling	17	15	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	-
Sterling	Euro	1.172	1.279	02-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	3							GBP -
Euro	Sterling	5.258	4.729	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	74							EUR -
Euro	Sterling	1.797	1.608	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	34							
Euro	Sterling	1.274	1.140	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	24							
Euro	Sterling	10.114	9.061	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	180							
Euro	Sterling	31.701	28.437	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	528							
Euro	Sterling	1.728	1.539	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	40							
Euro	Sterling	10.074	8.991	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	213							
Euro	Sterling	70.145.669	62.536.257	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	1.554.533							
Euro	Sterling	246	223	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	2							

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte Forts.							Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund							BNY Mellon Absolute Return Equity Fund						
Anteilsklasse USD R (Hedged)							Anteilsklasse USD U (Hedged)						
Sterling	US-Dollar	19	23	02-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	-	US-Dollar	Sterling	32.175	25.495	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	724
US-Dollar	Sterling	23	19	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	-	US-Dollar	Sterling	2.343.653	1.839.983	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	69.840
US-Dollar	Sterling	5	4	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	-						GBP	70.564
US-Dollar	Sterling	21	17	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	-						USD	86.586
US-Dollar	Sterling	2.266	1.830	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	17							
US-Dollar	Sterling	3	2	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	-	Sterling	US-Dollar	69.148	85.635	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(635)
US-Dollar	Sterling	21	17	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	1						GBP	(635)
US-Dollar	Sterling	93	74	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	3						USD	(779)
US-Dollar	Sterling	63	49	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	2						Netto GBP	69.929
US-Dollar	Sterling	6.531.146	5.127.551	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	194.627						Netto USD	85.807
						GBP	194.650						
						USD	238.845						
Sterling	US-Dollar	20.709	25.926	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(418)							
Sterling	US-Dollar	90	115	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(3)							
Sterling	US-Dollar	25	32	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1)							
Sterling	US-Dollar	16.403	20.746	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(503)							
						GBP	(925)						
						USD	(1.135)						
						Netto GBP	193.725						
						Netto USD	237.710						
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund													
Anteilsklasse USD T (Hedged)													
US-Dollar	Sterling	632.374	496.472	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	18.845							
						GBP	18.845						
						USD	23.124						

BNY MELLON ABSOLUTE RETURN GLOBAL CONVERTIBLE FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in EUR	Summe der Netto- vermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in EUR	Summe der Netto- vermögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen				Aktienwaps			
Irland - 2.594.748 (31. Dezember 2019: 1.894.992)				Deutschland - 8.225 (31. Dezember 2019: -)			
2.643.386	Insight Liquidity Funds Plc - EUR Cash Fund	2.594.748	9,08	(1.500)	LEG Immobilien AG 15-Jun.-2021	2.732	0,01
				(3.250)	Puma SE 15-Jun.-2021	5.493	0,02
Summe der Anlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen 2.594.748 9,08				Japan - 86.930 (31. Dezember 2019: 9.893)			
Anleihen				(11.800)	GMO Payment Gateway Inc 15-Jun.-2021	86.571	0,30
Frankreich - 19.771.313 (31. Dezember 2019: 15.159.482)				(1.000)	Nipro Corp 15-Jun.-2021	359	0,00
3.400.000	France Treasury Bill BTF (Null-Coupon) 0,000 % 01-Jul.-2020	3.400.068	11,90	Schweiz - 6.204 (31. Dezember 2019: -)			
1.500.000	France Treasury Bill BTF (Null-Coupon) 0,000 % 08-Jul.-2020	1.500.150	5,25	(2.675)	Cembra Money Bank AG 15-Jun.-2021	6.204	0,02
1.900.000	France Treasury Bill BTF (Null-Coupon) 0,000 % 29-Jul.-2020	1.900.902	6,65	USA - 134.035 (31. Dezember 2019: 82.179)			
2.900.000	France Treasury Bill BTF (Null-Coupon) 0,000 % 19-Aug.-2020	2.902.668	10,16	(350)	Booking Holdings Inc 15-Jun.-2021	11.519	0,04
3.000.000	France Treasury Bill BTF (Null-Coupon) 0,000 % 26-Aug.-2020	3.002.760	10,51	(30.000)	Boston Scientific Corp 15-Jun.-2021	20.959	0,07
2.400.000	France Treasury Bill BTF (Null-Coupon) 0,000 % 16-Sept.-2020	2.402.916	8,41	(600)	Euronet Worldwide Inc 15-Jun.-2021	1.247	0,00
10.000	France Treasury Bill BTF (Null-Coupon) 0,000 % 23-Sept.-2020	10.012	0,04	(5.800)	Inphi Corp 15-Jun.-2021	11.177	0,04
2.000.000	French Republic Government Bond OAT 2,500 % 25-Okt.-2020	2.018.900	7,07	(15.100)	PagerDuty Inc 15-Jun.-2021	15.859	0,06
1.000.000	Kering SA (Null-Coupon) 0,000 % 30-Sept.-2022	1.041.400	3,64	(8.500)	Pioneer Natural Resources Co 15-Jun.-2021	25.345	0,09
9.000	Safran SA 0,875 % 15-Mai-2027	1.083.537	3,79	(27.300)	Southwest Airlines Co 15-Jun.-2021	12.528	0,04
500.000	Selena Sarl (Null-Coupon) 0,000 % 25-Jun.-2025	508.000	1,78	(2.900)	Teladoc Health Inc 15-Jun.-2021	8.724	0,03
Deutschland - 1.594.735 (31. Dezember 2019: 1.719.179)				(5.850)	T-Mobile US Inc 15-Jun.-2021	24.846	0,09
500.000	HelloFresh SE 0,750 % 13-Mai-2025	596.235	2,09	(3.400)	Workiva Inc - A-Klasse 15-Jun.-2021	1.831	0,01
1.000.000	LEG Immobilien AG 0,400 % 30-Jun.-2028	998.500	3,49	Summe der Anlagen in Aktienwaps 244.051 0,85			
Italien - 1.146.000 (31. Dezember 2019: -)				Offene Terminkontrakte - 14.419 (31. Dezember 2019: 4.298)			
1.000.000	Nexi SpA 1,750 % 24-Apr.-2027	1.146.000	4,01	(7)	E-mini S&P 500 Index Short Futures Contracts Exp Sep.-2020	(962.694)	14.419 0,05
Spanien - 847.480 (31. Dezember 2019: -)				Summe der offenen Terminkontrakte 14.419 0,05			
500.000	Cellnex Telecom SA 1,500 % 16-Jan.-2026	847.480	2,97	Total Return Swaps - 2.337.624 (31. Dezember 2019: 1.275.729)			
Summe der Anlagen in Anleihen 23.359.528 81,76				(462.020)	TRS Bandwidth Inc 0,250 % 01-März-2026	29.533	0,10
Preferred Bonds				(175.270)	TRS Barclays Bank Plc 0,000 % 04-Feb.-2025	14.499	0,05
USA - 2.307.341 (31. Dezember 2019: 4.032.654)				(52.500)	TRS Barclays Bank Plc 0,000 % 18-Feb.-2025	12.528	0,04
1.000	2020 Cash Mandatory Exchangeable Trust - Preferred Stock '144A' 5,250 % 01-Jun.-2023	910.146	3,19	(107.047)	TRS Booking Holdings Inc 0,900 % 15-Sept.-2021	20.406	0,07
15.000	Boston Scientific Corp - Preferred Stock 5,500 % 01-Jun.-2023	1.397.195	4,89	(121.384)	TRS Callaway Golf Co 2,750 % 01-Mai-2026	102.485	0,36
Summe der Anlagen in Preferred Bonds 2.307.341 8,08				(29.839)	TRS Cerence Inc 3,000 % 01-Jun.-2025	115.217	0,40
Aktienwaps				43.360	TRS Citigroup Global Markets Limited 0,000 % 25-Jul.-2024	18.907	0,07
Frankreich - 8.657 (31. Dezember 2019: 16.970)				(480.781)	TRS Coupa Software Inc 0,125 % 15-Jun.-2025	234.846	0,82
(5.400)	Safran SA 15-Jun.-2021	8.657	0,03	249	TRS Coupa Software Inc 0,375 % 15-Jun.-2026	142.421	0,50
				(46.001)	TRS Datadog Inc 0,125 % 15-Jun.-2025	124.212	0,43
				(3.753)	TRS DexCom Inc 0,250 % 15-Nov.-2025	35.030	0,12
				(235.415)	TRS Dick's Sporting Good 3,250 % 15-Apr.-2025	136.849	0,48
				(905.000)	TRS Docusign Inc 0,500 % 15-Sept.-2023	472.456	1,65
				36.027	TRS Euronet Worldwide Inc 0,750 % 15-März-2049	19.550	0,07
				(63.750)	TRS Five9 Inc 0,500 % 01-Jun.-2025	10.570	0,04
				(287.500)	TRS Ocado Group Plc 0,875 % 09-Dez.-2025	36.032	0,13
				(45.000)	TRS ON Semiconductor Corp 1,000 % 01-Dez.-2020	108.952	0,38

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in EUR	Summe der Nettovermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in EUR	Summe der Nettovermögen %
Total Return Swaps Forts.				Aktienwaps Forts.			
(207.730)	TRS Pioneer Natural Resources Co 0,250 % 15-Mai-2025	61.816	0,22	USA Forts.			
(118.750)	TRS Sea Ltd 2,375 % 01-Dez.-2025	241.830	0,85	(2.500)	Splunk Inc 15-Jun.-2021	(11.704)	(0,04)
(143.500)	TRS Sika AG 0,150 % 05-Jun.-2025	28.183	0,10	(9.500)	Square Inc 15-Jun.-2021	(59.740)	(0,21)
(232.649)	TRS Snap-on Inc 0,250 % 01-Mai-2025	46.500	0,16	(14.900)	Teradyne Inc 15-Jun.-2021	(65.183)	(0,23)
(271.251)	TRS Southwest Airlines Co 1,250 % 01-Mai-2025	33.641	0,12	(7.900)	Varonis Systems Inc 15-Jun.-2021	(6.188)	(0,02)
(51.785)	TRS Splunk Inc 1,125 % 15-Jun.-2027	16.528	0,06	(1.400)	Visa Inc - A-Klasse 15-Jun.-2021	(2.586)	(0,01)
(410.000)	TRS Square Inc 0,500 % 15-Mai-2023	71.034	0,25	(11.000)	Winnebago Industries Inc 15-Jun.-2021	(84.152)	(0,29)
(770.558)	TRS Teradyne Inc 1,250 % 15-Dez.-2023	64.235	0,23	(3.000)	Zscaler Inc 15-Jun.-2021	(7.893)	(0,03)
(155.260)	TRS Varonis System Inc 1,250 % 15-Aug.-2025	12.386	0,04	Summe der Anlagen in Aktienwaps			
(88.750)	TRS Winnebago Industries 1,500 % 01-Apr.-2025	125.723	0,44			(1.875.470)	(6,56)
(25.000)	TRS Zscaler Inc 0,125 % 01-Jul.-2025	1.255	0,00				
Summe der Total Return Swaps		2.337.624	8,18				
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 37.686 (siehe unten) (31. Dezember 2019: 50.991)							
		37.686	0,13				
Summe der Vermögenswerte zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert		30.895.397	108,13				
Aktienwaps							
Cayman-Inseln - (230.381) (31. Dezember 2019: (39.990))							
(71.000)	Longfor Group Holdings Ltd '144A' 15-Jun.-2021	(27.519)	(0,09)				
(8.500)	Sea Ltd ADR 15-Jun.-2021	(202.862)	(0,71)				
Deutschland - (44.955) (31. Dezember 2019: (55.917))							
(5.400)	HelloFresh SE 15-Jun.-2021	(44.955)	(0,16)				
Italien - (8.513) (31. Dezember 2019: -)							
(30.800)	Nexi SpA '144A' 15-Jun.-2021	(8.513)	(0,03)				
Spanien - (39.215) (31. Dezember 2019: (113.696))							
(11.500)	Cellnex Telecom SA '144A' 15-Jun.-2021	(39.215)	(0,14)				
Schweiz - (10.505) (31. Dezember 2019: (91.431))							
(2.100)	Sika AG 15-Jun.-2021	(10.505)	(0,04)				
Großbritannien - (23.392) (31. Dezember 2019: -)							
(42.000)	Ocado Group Plc 15-Jun.-2021	(23.392)	(0,08)				
USA - (1.518.509) (31. Dezember 2019: (633.346))							
(9.300)	Bandwidth Inc - A-Klasse 15-Jun.-2021	(25.123)	(0,09)				
(42.600)	Callaway Golf Co 15-Jun.-2021	(64.270)	(0,22)				
(9.300)	Cerence Inc 15-Jun.-2021	(80.287)	(0,28)				
(6.500)	Coupa Software Inc 15-Jun.-2021	(305.340)	(1,07)				
(6.800)	Datadog Inc 15-Jun.-2021	(95.483)	(0,33)				
(1.440)	DexCom Inc 15-Jun.-2021	(29.947)	(0,10)				
(21.200)	Dick's Sporting Goods Inc 15-Jun.-2021	(95.763)	(0,34)				
(12.100)	DocuSign Inc - A-Klasse 15-Jun.-2021	(421.534)	(1,48)				
(4.700)	Five9 Inc 15-Jun.-2021	(8.806)	(0,03)				
(2.800)	Microsoft Corp 15-Jun.-2021	(46.068)	(0,16)				
(32.000)	ON Semiconductor Corp 15-Jun.-2021	(76.090)	(0,27)				
(33.500)	Snap Inc 15-Jun.-2021	(32.352)	(0,11)				

Aktienwaps Forts.

USA Forts.

(2.500)	Splunk Inc 15-Jun.-2021	(11.704)	(0,04)
(9.500)	Square Inc 15-Jun.-2021	(59.740)	(0,21)
(14.900)	Teradyne Inc 15-Jun.-2021	(65.183)	(0,23)
(7.900)	Varonis Systems Inc 15-Jun.-2021	(6.188)	(0,02)
(1.400)	Visa Inc - A-Klasse 15-Jun.-2021	(2.586)	(0,01)
(11.000)	Winnebago Industries Inc 15-Jun.-2021	(84.152)	(0,29)
(3.000)	Zscaler Inc 15-Jun.-2021	(7.893)	(0,03)

Summe der Anlagen in Aktienwaps **(1.875.470)** **(6,56)**

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement in EUR	Angemessener Wert in EUR	Summe der Nettovermögen %

Offene Terminkontrakte - (10.347) (31. Dezember 2019: -)

(31)	U.S. 5 Year Treasury Note			
	Short Futures Contracts			
	Exp Sep.-2020	(3.469.519)	(10.347)	(0,04)

Summe der offenen Terminkontrakte **(10.347)** **(0,04)**

Total Return Swaps - (127.150) (31. Dezember 2019: (70.096))

19.500	TRS Cembra Money Bank AG 0,000 % 09-Jul.-2026	(10.804)	(0,04)
(63.125.000)	TRS GMO Internet Inc 0,000 % 19-Jun.-2023	(58.896)	(0,20)
(227.156)	TRS Inphi Corp 0,750 % 15-Apr.-2025	(19.655)	(0,07)
425.000	TRS Nipro Corporation 0,000 % 29-Jan.-2021	(932)	(0,00)
(30.000)	TRS Pagerduty Inc 1,250 % 01-Jul.-2025	(33.378)	(0,12)
(109.930)	TRS Teladoc Health Inc 1,250 % 01-Jun.-2027	(61)	(0,00)
36.353	TRS Workiva Inc 1,125 % 15-Aug.-2026	(3.424)	(0,01)

Summe der Total Return Swaps **(127.150)** **(0,44)**

Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften - (4.594) (siehe unten) (31. Dezember 2019: (39.971))

Summe der finanziellen Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert **(2.017.561)** **(7,05)**

Laufende Nettoverbindlichkeiten **(307.204)** **(1,08)**

Summe der Nettovermögen **28.570.632** **100,00**

Der Kontrahent für Aktienwaps ist BNP Paribas.

Der Kontrahent für Futures ist Goldman Sachs.

Der Kontrahent für Total Return Swaps ist BNP Paribas.

Portfolioanalyse **% des Gesamtvermögens**

An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	82,37
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,04
OTC-Finanzderivate	7,63
Sonstiges Umlaufvermögen	9,96

Summe der Aktiva **100,00**

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte							Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund							
Euro	US-Dollar	2.750.000	3.077.339	09-Jul.-20	BNP Paribas		11.383
							EUR 11.383
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund							
Anteilsklasse Sterling F (Acc) (Hedged)							
Sterling	Euro	101.686	113.806	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		(1.680)
							EUR (1.680)
							GBP (1.523)
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund							
Anteilsklasse Sterling U (Acc) (Hedged)							
Euro	Sterling	16	15	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		-
Euro	Sterling	114.302	103.270	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		430
							EUR 430
							GBP 390
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund							
Sterling	Euro	103.285	115.595	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		(1.707)
							EUR (1.707)
							GBP (1.548)
							Netto EUR (1.277)
							Netto GBP (1.158)
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund							
Anteilsklasse USD F (Acc) (Hedged)							
US-Dollar	Euro	2.618.357	2.305.595	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		24.236
							EUR 24.236
							USD 27.229
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund							
Euro	US-Dollar	10.316	11.679	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		(76)
							EUR (76)
							USD (85)
							Netto EUR 24.160
							Netto USD 27.144

Devisenterminkontrakte Forts.							Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund							
Anteilsklasse USD U (Acc) (Hedged)							
US-Dollar	Euro	150.717	132.714	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		1.395
US-Dollar	Euro	170.000	151.025	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		242
							EUR 1.637
							USD 1.839
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund							
US-Dollar	Euro	485.000	432.686	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		(1.131)
							EUR (1.131)
							USD (1.271)
							Netto EUR 506
							Netto USD 568

BNY MELLON ASIA RISING STARS FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Nettovermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Nettovermögen %
Aktien				Aktien Forts.			
Werkstoffe - 390.738 (31. Dezember 2019: 474.679)				Verbrauchsgüter Forts.			
7.600	Birla Carbon Thailand PCL NVDR	9.744	0,13	24.000	China Feihe Ltd '144A'	48.030	0,65
64.763	Chevron Lubricants Lanka Plc	23.443	0,32	3.000	Chlitina Holding Ltd	22.039	0,30
141.100	Diamond Building Products PCL NVDR	24.766	0,34	27.000	Ginebra San Miguel Inc	16.785	0,23
4.700	Dowa Holdings Co Ltd	142.649	1,95	11.500	Hengan International Group Co Ltd	90.033	1,23
523	KPX Chemical Co Ltd	20.859	0,28	1.187.700	Industri Jamu Dan Farmasi Sido Muncul Tbk PT	101.227	1,38
16.900	Sakata INX Corp	161.408	2,20	250	KT&G Corp	16.264	0,22
575.000	Waskita Beton Precast Tbk PT	7.869	0,11	1.000	NeoPharm Co Ltd	27.331	0,37
Kommunikationsdienstleistungen - 1.082.680 (31. Dezember 2019: 1.309.008)				400	Orion Corp/Republic of Korea	44.478	0,61
80.100	ABS-CBN Holdings Corp Receipt	22.957	0,31	33.700	Sappe PCL NVDR	20.771	0,28
102.500	APT Satellite Holdings Ltd	26.385	0,36	30.000	Tingyi Cayman Islands Holding Corp	46.683	0,64
3.700	Atrae Inc	108.091	1,47	100.000	Tsit Wing International Holdings Ltd	13.484	0,18
510	Baidu Inc ADR	61.896	0,85	56.700	Uni-Charm Indonesia Tbk PT	5.527	0,08
2.000	China Mobile Ltd	13.484	0,18	30.000	Want Want China Holdings Ltd	22.684	0,31
84.000	China Telecom Corp Ltd 'H'	23.411	0,32	Energie - 47.251 (31. Dezember 2019: 55.954)			
72.000	China Unicom Hong Kong Ltd	38.973	0,53	20.000	China Shenhua Energy Co Ltd 'H'	31.303	0,42
760.425	Dialog Axiata Plc	47.782	0,65	48.000	PetroChina Co Ltd 'H'	15.948	0,22
158.000	Hutchison Telecommunications Hong Kong Holdings Ltd	24.872	0,34	Finanzwerte - 653.871 (31. Dezember 2019: 741.308)			
8.100	Itokuro Inc	100.555	1,37	2.800	Anicom Holdings Inc	119.027	1,62
3.571	KT Skylife Co Ltd	23.557	0,32	770.600	Bank OCBC Nisp Tbk PT	39.919	0,55
2.521	LG HelloVision Co Ltd	8.399	0,12	280.671	Bank Permata Tbk PT	24.904	0,34
153.300	Link Net Tbk PT	24.200	0,33	7.600	Dah Sing Financial Holdings Ltd	21.304	0,29
195	NAVER Corp	43.244	0,59	6.200	eGuarantee Inc	147.001	2,01
12.000	Singapore Telecommunications Ltd	21.170	0,29	138.000	First Pacific Co Ltd	26.175	0,36
88	SK Telecom Co Ltd	15.418	0,21	334.400	GMA Holdings Inc Receipt	30.940	0,42
26.649	SmarTone Telecommunications Holdings Ltd	14.201	0,19	500	Hana Financial Group Inc	11.213	0,15
1.900	Tencent Holdings Ltd	122.211	1,67	34.917	Metropolitan Bank & Trust Co	25.912	0,35
20.200	Vector Inc	163.396	2,23	716.200	Panin Financial Tbk PT	9.200	0,13
17.700	Vision Inc/Tokyo Japan	111.467	1,52	37.370	Philippine National Bank	15.169	0,21
200	Weibo Corp ADR	6.659	0,09	29.022	Rizal Commercial Banking Corp	9.838	0,13
311.800	XL Axiata Tbk PT	60.352	0,82	30.000	Sun Hung Kai & Co Ltd	11.729	0,16
Luxusgüter - 829.680 (31. Dezember 2019: 1.242.770)				4.300	Zenkoku Hoshio Co Ltd	161.540	2,20
220	Alibaba Group Holding Ltd ADR	47.299	0,64	Gesundheitswesen - 142.992 (31. Dezember 2019: 77.399)			
2.600	Arata Corp	117.041	1,60	20.000	China Medical System Holdings Ltd	23.548	0,32
100.000	China Maple Leaf Educational Systems Ltd	30.580	0,42	27.000	Consun Pharmaceutical Group Ltd	10.957	0,15
22.000	Dongfeng Motor Group Co Ltd 'H'	13.129	0,18	20.000	Mega Lifesciences PCL NVDR	23.942	0,32
400	Fila Holdings Corp	11.689	0,16	6.100	Prodia Widyahusada Tbk PT	1.337	0,02
106	Hyundai Mobis Co Ltd	16.964	0,23	20.000	Rajthanee Hospital PCL NVDR	13.751	0,19
13.500	Lii Hen Industries BHD	7.672	0,10	81.000	Tianjin ZhongXin Pharmaceutical Group Corp Ltd	69.457	0,95
2.000	momo.com Inc	48.772	0,66	Industriewerte - 803.036 (31. Dezember 2019: 976.691)			
6.100	Nifco Inc/Japan	129.966	1,77	5.000	A-Living Services Co Ltd 'H' '144A'	25.209	0,34
20.000	Oishi Group PCL NVDR	25.479	0,35	809.600	Arwana Citramulia Tbk PT	21.707	0,30
134.000	Qingling Motors Co Ltd 'H'	24.466	0,33	116.800	Astra Graphia Tbk PT	5.580	0,08
5.600	RE&S Holdings Ltd	363	0,00	1.800	BayCurrent Consulting Inc	149.443	2,04
11.100	Resorttrust Inc	143.566	1,96	15.600	Hong Leong Industries Bhd	29.161	0,40
1.200	Saha Pathanapibul PCL NVDR	2.334	0,03	59.900	HRnetgroup Ltd	21.114	0,29
87.400	Somboon Advance Technology PCL NVDR	30.540	0,42	5.100	Insource Co Ltd	125.086	1,70
86.200	Straco Corp Ltd	31.309	0,43	197.600	LT Group Inc	31.687	0,43
800	Tomy Co Ltd	6.319	0,09	16.200	Penta-Ocean Construction Co Ltd	87.285	1,19
26.300	Yonex Co Ltd	142.192	1,94	20.000	Precision Tsugami China Corp Ltd	15.974	0,22
Verbrauchsgüter - 663.705 (31. Dezember 2019: 489.254)				20.500	Sembcorp Industries Ltd	25.749	0,35
2.500	Ain Holdings Inc	163.820	2,23	757.900	Surya Semesta Internusa Tbk PT	20.639	0,28
24.800	Bumitama Agri Ltd	7.765	0,11	6.100	Takeuchi Manufacturing Co Ltd	101.403	1,38
5.000	Carabao Group PCL NVDR	16.784	0,23	36.000	TK Group Holdings Ltd	10.312	0,14

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Nettovermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Nettovermögen %
Aktien Forts.				Genussscheine Forts.			
Industriewerte Forts.				Zyklische Konsumwerte - 10.985			
390.000	Total Bangun Persada Tbk PT	8.982	0,12	(31. Dezember 2019: 7.556)		10.985	0,15
4.900	Totetsu Kogyo Co Ltd	123.705	1,69	15.739	HSIL Ltd P-Note 12-Okt.-2021	10.985	0,15
Informationstechnologie - 1.191.845				Basiskonsumwerte - 9.567			
(31. Dezember 2019: 1.208.535)		1.191.845	16,25	(31. Dezember 2019: 12.866)		9.567	0,13
4.900	Anritsu Corp	116.383	1,59	1.890	Security and Intelligence SE P-Note 30-Jan.-2023	9.567	0,13
2.100	BrainPad Inc	89.319	1,22	Elektrische Bauteile - 37.747			
2.000	Catcher Technology Co Ltd	15.066	0,21	(31. Dezember 2019: 51.415)		37.747	0,51
4.000	Hon Hai Precision Industry Co Ltd	11.707	0,16	10.009	Finolex Cables Ltd P-Note 27-Mai-2021	37.747	0,51
13.600	MCJ Co Ltd	108.179	1,47	Energie - 23.470			
15.200	Osaki Electric Co Ltd	71.316	0,97	(31. Dezember 2019: 38.956)		23.470	0,32
4.400	RS Technologies Co Ltd	140.895	1,92	30.000	Gujarat Mineral Development Corp Ltd P-Note 13-Aug.-2020	15.863	0,22
440	Samsung Electronics Co Ltd	19.332	0,26	6.128	Oil India Ltd P-Note 24-Jun.-2021	7.607	0,10
6.600	Sanken Electric Co Ltd	130.113	1,77	Finanzwerte - 101.485			
2.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	21.234	0,29	(31. Dezember 2019: 195.012)		101.485	1,38
600	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	33.843	0,46	29.429	Bank of Baroda P-Note 25-Nov.-2020	18.972	0,26
1.600	TeamSpirit Inc	39.606	0,54	7.150	Bank of Baroda P-Note 08-Apr.-2024	4.609	0,06
11.000	TechMatrix Corp	190.821	2,60	26.000	IDFC Ltd P-Note 21-Mai-2021	6.362	0,09
5.300	Venture Corp Ltd	61.354	0,84	26.567	JM Financial Ltd P-Note 25-Jun.-2021	24.666	0,33
28.000	Wacom Co Ltd	142.677	1,95	374.992	South Indian Bank Ltd/The P-Note 22-Jan.-2021	39.981	0,55
Immobilien - 187.052				54.800	SREI Infrastructure Finance Ltd P-Note 05-Feb.-2021	6.895	0,09
(31. Dezember 2019: 213.475)		187.052	2,55	Gesundheitswesen - 187.360			
109.200	APAC Realty Ltd	29.894	0,41	(31. Dezember 2019: 170.317)		187.360	2,56
1.037.400	Jaya Real Property Tbk PT	29.702	0,40	6.500	Eris Lifesciences Limited P-Note 03-Sept.-2021	39.321	0,54
1.135.400	Puradelta Lestari Tbk PT	13.710	0,19	10.295	FDC Limited P-Note 06-Aug.-2021	38.345	0,52
8.000	Sichuan Languang Justbon Services Group Co Ltd 'H'	51.148	0,70	4.500	JB Chemicals & Pharmaceuticals Limited P-Note 20-Nov.-2021	42.167	0,58
205.200	Sinarmas Land Ltd	26.435	0,36	500	Pfizer Limited P-Note 20-Aug.-2021	26.260	0,36
7.000	United Industrial Corp Ltd	11.047	0,15	234	Sanofi India Ltd P-Note 09-Nov.-2021	24.375	0,33
112.300	Yoma Strategic Holdings Ltd	25.116	0,34	1.000	Zyduz Wellness Limited P-Note 06-Aug.-2021	16.892	0,23
Versorger - 180.254				Industriewerte - 49.274			
(31. Dezember 2019: 241.412)		180.254	2,46	(31. Dezember 2019: 58.607)		49.274	0,67
28.000	Kunlun Energy Co Ltd	18.173	0,25	30.385	Ircon International Ltd P-Note 15-Okt.-2020	35.243	0,48
3.200	Nippon Gas Co Ltd	137.813	1,88	6.276	Transport Corp of India Ltd P-Note 28-Aug.-2020	14.031	0,19
53.814	Towngas China Co Ltd	24.268	0,33	Informationstechnologie - 2.717			
Summe der Anlagen in Aktien				(31. Dezember 2019: 3.552)		2.717	0,04
		6.173.104	84,17	14.500	Digicontent Limited P-Note 30-Jan.-2023	262	0,01
Genussscheine				249	Vindhya Telelinks Ltd P-Note 11-Feb.-2021	2.455	0,03
Werkstoffe - 99.739				Immobilien - 38.553			
(31. Dezember 2019: 109.167)		99.739	1,36	(31. Dezember 2019: 96.186)		38.553	0,53
725	Bayer CropScience Ltd P-Note 22-Nov.-2021	57.284	0,78	6.979	Mahindra Lifespace Developers Ltd P-Note 27-Nov.-2023	19.635	0,27
2.365	Insecticides India Ltd P-Note 11-Jan.-2021	13.891	0,19	35.400	Puravankara Ltd P-Note 07-Jun.-2021	18.918	0,26
25.366	NMDC Ltd P-Note 27-Jan.-2021	27.364	0,37	Telekommunikationsdienste - 10.025			
94	Vinati Organics Ltd P-Note 06-Aug.-2020	1.200	0,02	(31. Dezember 2019: 11.726)		10.025	0,14
Kommunikationsdienstleistungen - 13.216				58.000	HT Media Ltd P-Note 30-Jan.-2023	10.025	0,14
(31. Dezember 2019: 14.955)		13.216	0,18	Textilien und Textilprodukte - 27.180			
14.621	GSPL Hathway Ltd P-Note 06-Jul.-2020	13.216	0,18	(31. Dezember 2019: 29.805)		27.180	0,37
Mischkonzern - 10.595				60.627	Vardhman Acrylics Ltd P-Note 13-Jan.-2022	27.180	0,37
(31. Dezember 2019: -)		10.595	0,14				
1.221	Hinduja Ltd P-Note 03-Jan.-2025	10.595	0,14				
Luxusgüter - 45.997							
(31. Dezember 2019: 62.283)		45.997	0,63				
3.000	Future Lifestyle Fashions Limited P-Note 05-Feb.-2024	5.939	0,08				
5.000	ITC Limited P-Note 06-Aug.-2021	12.928	0,18				
12.000	Somany Home Innovation Limited P-Note	27.130	0,37				

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %	Devisenterminkontrakte						Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Bestände	Beschreibung			Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	
Genussscheine Forts.				BNY Mellon Asia Rising Stars Fund						
	Transport - 26.515 (31. Dezember 2019: 32.951)	26.515	0,36	US-Dollar	Hongkong-Dollar	2.707	21.001	02-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(3)
8.125	Rites Ltd P-Note 31-Mai-2021	26.515	0,36							
									USD	(3)
Versorger - 14.692 (31. Dezember 2019: 17.781)				BNY Mellon Asia Rising Stars Fund						
50.594	SJVN Ltd P-Note 30-Mai-2022	14.692	0,20							
Summe der Anlagen in Genussscheinen				Anteilsklasse SGD H (Acc) (Hedged)						
				US-Dollar	Singapur-Dollar	37.498	52.214	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	128
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 128 (siehe unten) (31. Dezember 2019: 11.466)									USD	128
									SGD	179
Summe der Vermögenswerte zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert				Singapur-Dollar	US-Dollar	37.803	27.121	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(65)
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften - (8.289) (siehe unten) (31. Dezember 2019: -)				Singapur-Dollar	US-Dollar	1.801.256	1.297.399	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(8.221)
									USD	8.286
Summe der finanziellen Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert									SGD	11.578
Nettoumlaufvermögen									Netto USD	8.158
Summe der Nettovermögen									Netto SGD	11.399
Portfolioanalyse		% des Gesamtvermögens								
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten										
Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			83,63							
Nicht an einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten										
Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			9,61							
OTC-Finanzderivate			0,00							
Sonstiges Umlaufvermögen			6,76							
Summe der Aktiva				100,00						

BNY MELLON ASIAN EQUITY FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener		Summe	Bestände	Beschreibung	Angemessener		Summe
		Wert	der Netto-				Wert	der Netto-	
		in USD	vermögen %				in USD	vermögen %	
Aktien					Aktien Forts.				
Australien - 2.215.576 (31. Dezember 2019: 3.001.063)					Taiwan - 2.215.814 (31. Dezember 2019: 2.718.334)				
5.918	CSL Ltd	1.163.320	3,02		84.000	Elite Material Co Ltd	453.388	1,18	
707.717	Galaxy Resources Ltd	374.443	0,97		166.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	1.762.426	4,57	
27.071	IDP Education Ltd	287.106	0,74						
234.837	Orocobre Ltd	372.345	0,97						
7.083	Qantas Airways Ltd	18.362	0,05						
China - 16.681.925 (31. Dezember 2019: 13.007.576)					Thailand - 190.330 (31. Dezember 2019: 200.807)				
5.229	51job Inc ADR	366.082	0,95		63.000	Kasikornbank PCL (Foreign Market)	190.330	0,49	
12.065	Alibaba Group Holding Ltd ADR	2.593.915	6,73						
15.620	Autohome Inc ADR	1.190.712	3,09						
10.000.000	Boshiwa International Holding Ltd*	-	0,00						
616.000	China Harmony New Energy Auto Holding Ltd	304.817	0,79						
439.500	China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd	527.677	1,37						
140.000	Greentown Service Group Co Ltd	164.746	0,43						
33.089	GSX Techedu Inc ADR	1.927.600	5,00						
120.773	Meituan Dianping	2.679.568	6,95						
16.965	New Oriental Education & Technology Group Inc ADR	2.227.080	5,78						
79.000	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	789.480	2,05						
48.760	Tencent Holdings Ltd	3.136.328	8,14						
58.387	Tencent Music Entertainment Group ADR	773.920	2,01						
Hongkong - 1.431.434 (31. Dezember 2019: 2.015.505)									
153.600	AIA Group Ltd	1.431.434	3,71						
Indien - 7.354.624 (31. Dezember 2019: 9.595.974)									
14.332	Apollo Hospitals Enterprise Ltd	256.910	0,67						
44.751	Asian Paints Ltd	1.000.476	2,59						
62.251	Housing Development Finance Corp Ltd	1.452.314	3,77						
36.428	Info Edge India Ltd	1.332.571	3,46						
37.500	IRB InvIT Fund '144A'	19.345	0,05						
34.193	Jubilant Foodworks Ltd	783.117	2,03						
10.136	Maruti Suzuki India Ltd	782.933	2,03						
116.796	Nippon Life India Asset Management Ltd '144A'	489.939	1,27						
26.627	PVR Ltd	353.204	0,92						
70.072	Titan Co Ltd	883.815	2,29						
Indonesien - 581.042 (31. Dezember 2019: -)									
136.900	Bank Central Asia Tbk PT	273.009	0,71						
1.568.714	Vale Indonesia Tbk PT	308.033	0,80						
Niederlande - 545.300 (31. Dezember 2019: 389.441)									
1.503	ASML Holding NV	545.300	1,41						
Neuseeland - 847.107 (31. Dezember 2019: 1.277.151)									
13.722	Xero Ltd	847.107	2,20						
Republik Korea - 5.544.484 (31. Dezember 2019: 4.561.539)									
35.740	Iljin Materials Co Ltd	1.473.010	3,82						
727	LG Household & Health Care Ltd	813.822	2,11						
10.716	Samsung SDI Co Ltd	3.240.591	8,41						
241	SK Hynix Inc	17.061	0,05						
Summe der Anlagen in Aktien							37.607.636	97,58	
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 148 (siehe unten) (31. Dezember 2019: -)							148	0,00	
Summe der Vermögenswerte zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert							37.607.784	97,58	
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften - (568) (siehe unten) (31. Dezember 2019: (6))							(568)	(0,00)	
Summe der finanziellen Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert							(568)	(0,00)	
Nettoumlaufvermögen							931.440	2,42	
Summe der Nettovermögen							38.538.656	100,00	
* Die Gesellschaft unterliegt an der Hong Kong Stock Exchange einer Handelsaussetzung.									
Portfolioanalyse					% des Gesamtvermögens				
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente					95,82				
OTC-Finanzderivate					0,00				
Sonstiges Umlaufvermögen					4,18				
Summe der Aktiva					100,00				

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte							Nicht
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent		realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Asian Equity Fund							
Indonesische Rupiah	US-Dollar	62.818.692	4.333	01-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		64
Indonesische Rupiah	US-Dollar	56.112.829	3.871	01-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		57
US-Dollar	Euro	485.611	433.215	01-Jul.-20	Barclays Bank PLC		21
Hongkong-Dollar	US-Dollar	1.028.188	132.662	02-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited		6
USD							148
Australischer Dollar	US-Dollar	63.517	43.695	01-Jul.-20	UBS AG		(193)
Koreanischer Won	US-Dollar	55.200.654	46.188	01-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		(296)
Koreanischer Won	US-Dollar	13.142.628	10.997	01-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		(71)
Thailändischer Baht	US-Dollar	90.348	2.931	01-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		(8)
USD							(568)
Netto USD							(420)

BNY MELLON ASIAN INCOME FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen				Aktien Forts.			
Republik Korea - 1.076.297 (31. Dezember 2019: 1.257.223)				Singapur Forts.			
113.315	Macquarie Korea Infrastructure Fund	1.076.297	3,65	261.300	SATS Ltd	535.784	1,81
Summe der Anlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen 1.076.297 3,65				425.700	Singapore Technologies Engineering Ltd	1.003.887	3,40
Aktien				279.200	Singapore Telecommunications Ltd	492.559	1,67
Australien - 3.867.619 (31. Dezember 2019: 5.085.012)				91.500	United Overseas Bank Ltd	1.324.450	4,49
137.073	Dexus (Units) (REIT)	864.178	2,93	74.500	Venture Corp Ltd	862.435	2,92
342.814	Insurance Australia Group Ltd	1.353.584	4,58	Taiwan - 3.508.168 (31. Dezember 2019: 3.716.484)			
93.510	Qantas Airways Ltd	242.411	0,82	107.000	Delta Electronics Inc	608.356	2,06
205.652	Scentre Group (REIT)	304.943	1,03	75.000	Elite Material Co Ltd	404.811	1,37
215.231	Star Entertainment Grp Ltd/The	417.912	1,42	235.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	2.495.001	8,45
44.991	Suncorp Group Ltd	284.262	0,96	Thailand - 1.031.355 (31. Dezember 2019: 1.315.548)			
41.381	Transurban Group	400.329	1,36	218.600	Bangkok Bank PCL (Foreign Market)	758.549	2,57
China - 1.792.019 (31. Dezember 2019: 908.131)				90.300	Kasikornbank PCL (Foreign Market)	272.806	0,92
133.000	China Mobile Ltd	896.666	3,04	Großbritannien - 762.777 (31. Dezember 2019: 720.193)			
141.467	Jiangsu Expressway Co Ltd 'H'	165.834	0,56	37.810	BHP Group Plc	762.777	2,58
73.000	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	729.519	2,47	Summe der Anlagen in Aktien 27.395.777 92,80			
Hongkong - 4.176.430 (31. Dezember 2019: 4.037.420)				Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 5 (siehe unten) (31. Dezember 2019: -)			
18.900	ASM Pacific Technology Ltd	198.387	0,67			5	0,00
118.500	CLP Holdings Ltd	1.160.138	3,93	Summe der Vermögenswerte zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert 28.472.079 96,45			
17.096	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	727.508	2,47	Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften - (3) (siehe unten) (31. Dezember 2019: (43))			
162.000	Link REIT (Units) (REIT)	1.323.680	4,48			(3)	(0,00)
146.977	Samsonite International SA '144A'	148.018	0,50	Summe der finanziellen Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert (3) (0,00)			
157.600	Sands China Ltd	618.699	2,10	Nettoumlaufvermögen 1.047.422 3,55			
Indien - 657.663 (31. Dezember 2019: 690.468)				Summe der Nettovermögen 29.519.498 100,00			
254.908	ITC Ltd GDR	657.663	2,23	Portfolioanalyse % des Gesamtvermögens			
Indonesien - 402.935 (31. Dezember 2019: 437.509)				An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten			
1.884.100	Telekomunikasi Indonesia Persero Tbk PT	402.935	1,37	Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			
Neuseeland - 1.839.914 (31. Dezember 2019: 2.127.868)				OTC-Finanzderivate			
141.895	Mercury NZ Ltd	425.497	1,44	Sonstiges Umlaufvermögen			
198.713	Meridian Energy Ltd	617.191	2,09	Summe der Aktiva 100,00			
186.094	SKYCITY Entertainment Group Ltd	293.765	0,99				
172.594	Spark New Zealand Ltd	503.461	1,71				
Republik Korea - 2.634.771 (31. Dezember 2019: 2.551.799)							
59.426	Samsung Electronics Co Ltd - Preference	2.299.772	7,79				
1.912	SK Telecom Co Ltd	334.999	1,14				
Singapur - 6.722.126 (31. Dezember 2019: 7.330.983)							
204.200	ComfortDelGro Corp Ltd	212.640	0,72				
84.100	DBS Group Holdings Ltd	1.252.246	4,24				
532.900	Mapletree North Asia Commercial Trust (Units) (REIT)	353.741	1,20				
284.600	Parkway Life Real Estate Investment Trust (Units) (REIT)	684.384	2,32				

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte						
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Asian Income Fund						
US-Dollar	Euro	13.252	11.822	01-Jul.-20	Barclays Bank PLC	-
US-Dollar	Singapur-Dollar	1.271	1.769	01-Jul.-20	UBS AG	5
USD						5
US-Dollar	Singapur-Dollar	48.628	67.950	02-Jul.-20	State Street Bank	(3)
USD						(3)
Netto USD						2

BNY MELLON BRAZIL EQUITY FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %
Aktien				Aktien Forts.			
	Werkstoffe - 9.156.125 (31. Dezember 2019: 15.291.086)	9.156.125	15,02		Einkaufszentren - 1.127.606 (31. Dezember 2019: 2.420.201)	1.127.606	1,85
134.543	Gerdau SA - Preference	396.348	0,65	607.433	BR Malls Participacoes SA	1.127.606	1,85
1.156.500	Gerdau SA ADR	3.417.457	5,61				
955.431	Usinas Siderurgicas de Minas Gerais SA				Technologie - 1.132.692 (31. Dezember 2019: 2.408.896)	1.132.692	1,86
	Usiminas - Preference	1.279.038	2,10	243.466	Linx SA	1.132.692	1,86
375.484	Vale SA	3.862.139	6,33				
19.500	Vale SA ADR - B-Klasse	201.143	0,33				
	Kommunikation - 1.554.130 (31. Dezember 2019: 2.842.369)	1.554.130	2,55		Versorger - 7.789.004 (31. Dezember 2019: 14.580.286)	7.789.004	12,77
20.285	Telefonica Brasil SA - Preference	179.701	0,30	164.254	AES Tiete Energia SA	472.848	0,77
155.040	Telefonica Brasil SA ADR	1.374.429	2,25	259.300	Cia Energetica de Sao Paulo - Preference	1.381.589	2,27
				233.542	Cia Paranaense de Energia ADR	2.651.869	4,35
	Zyklische Konsumwerte - 7.777.491 (31. Dezember 2019: 10.062.275)	7.777.491	12,75	86.856	CPFL Energia SA	490.173	0,80
264.703	B2W Cia Digital	5.232.388	8,58	508.751	EDP - Energias do Brasil SA	1.633.437	2,68
507.816	Lojas Americanas SA	2.545.103	4,17	67.634	Engie Brasil Energia SA	524.720	0,86
				207.942	Light SA	634.368	1,04
	Basiskonsumwerte - 8.462.426 (31. Dezember 2019: 13.963.646)	8.462.426	13,88		Summe der Anlagen in Aktien	59.679.782	97,86
626.224	Atacadao SA	2.281.219	3,74		Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 7152 (siehe unten) (31. Dezember 2019: 79.467)	7152	0,01
126.416	Cia Brasileira de Distribuicao	1.650.259	2,71				
179.555	JBS SA	700.311	1,15		Summe der Vermögenswerte zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert	59.686.934	97,87
901.507	Marfrig Global Foods SA	2.090.437	3,43		Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften - (68.926) (siehe unten) (31. Dezember 2019: (867))	(68.926)	(0,11)
376.043	Petrobras Distribuidora SA	1.488.793	2,44				
2.600	Ultrapar Participacoes SA	8.792	0,01		Summe der finanziellen Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert	(68.926)	(0,11)
71.886	Ultrapar Participacoes SA ADR	242.615	0,40		Nettoumlaufvermögen	1.365.094	2,24
	Bildung - 994.775 (31. Dezember 2019: -)	994.775	1,63		Summe der Nettovermögen	60.983.102	100,00
160.644	YDUQS Participacoes SA	994.775	1,63				
	Energie - 3.721.904 (31. Dezember 2019: 8.002.313)	3.721.904	6,10				
629.571	Petroleo Brasileiro SA - Preference	2.497.746	4,09		Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens	
129.550	Petroleo Brasileiro SA ADR	1.072.026	1,76		An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten		
19.100	Petroleo Brasileiro SA ADR	152.132	0,25		Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		93,83
					OTC-Finanzderivate		0,01
	Finanzwerte - 12.040.605 (31. Dezember 2019: 20.803.727)	12.040.605	19,74		Sonstiges Umlaufvermögen		6,16
353.891	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	3.585.049	5,88		Summe der Aktiva		100,00
685.142	Banco Bradesco SA ADR	2.603.540	4,27				
418.767	Banco do Brasil SA	2.476.517	4,06				
113.500	Bradespar SA - Preference	761.905	1,25				
304.754	Itau Unibanco Holding SA - Preference	1.427.352	2,34				
253.200	Itau Unibanco Holding SA ADR	1.186.242	1,94				
	Gesundheitswesen - 3.544.184 (31. Dezember 2019: 6.059.702)	3.544.184	5,81				
207.904	Hapvida Participacoes e Investimentos SA '144A'	2.383.130	3,91				
140.045	Sul America SA (Units)	1.161.054	1,90				
	Industriewerte - 2.378.840 (31. Dezember 2019: 9.264.086)	2.378.840	3,90				
42	Embraer SA	62	0,00				
158.130	Embraer SA ADR	944.827	1,55				
1.407.575	Santos Brasil Participacoes SA	1.433.951	2,35				

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte							Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Brazil Equity Fund							BNY Mellon Brazil Equity Fund						
Anteilsklasse EUR G (Acc) (Hedged)							Anteilsklasse EUR H (Hedged) Forts.						
US-Dollar	Euro	1.948	1.728	15	The Bank of New York Mellon	6	Euro	US-Dollar	53.077	59.822	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(172)
US-Dollar	Euro	3.597	3.187	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	15	Euro	US-Dollar	4.990	5.610	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(2)
US-Dollar	Euro	4.069	3.574	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	52	Euro	US-Dollar	6.000	6.757	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(14)
US-Dollar	Euro	2	2	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	-	Euro	US-Dollar	174.990	199.460	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(2.799)
US-Dollar	Euro	94.627	83.680	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	585	Euro	US-Dollar	1.005	1.140	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(11)
						USD							(24)
						EUR							(20.687)
Euro	US-Dollar	89.572	101.756	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1.092)	US-Dollar	Euro	14.600	13.000	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(10)
Euro	US-Dollar	2.599	2.929	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(8)	US-Dollar	Euro	77.192	68.795	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(122)
						USD							USD
						(1.100)							(23.841)
						EUR							EUR
						(979)							(21.220)
						Netto USD							Netto USD
						(442)							(21.510)
						Netto EUR							Netto EUR
						(393)							(19.145)
BNY Mellon Brazil Equity Fund							BNY Mellon Brazil Equity Fund						
Anteilsklasse EUR H (Hedged)							Anteilsklasse EUR I (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	1	1	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	-	Euro	US-Dollar	83.943	94.108	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	231
Euro	US-Dollar	31.594	35.414	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	92	US-Dollar	Euro	118.337	104.524	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	869
Euro	US-Dollar	42.617	47.777	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	117	US-Dollar	Euro	74.322	65.923	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	236
US-Dollar	Euro	17.565	15.624	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	6	US-Dollar	Euro	137.262	121.615	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	586
US-Dollar	Euro	27.004	23.972	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	63	US-Dollar	Euro	155.248	136.374	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	1.985
US-Dollar	Euro	53.367	47.137	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	392	US-Dollar	Euro	125.723	111.641	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	256
US-Dollar	Euro	41.260	36.597	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	131							USD
US-Dollar	Euro	75.731	67.098	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	323							EUR
US-Dollar	Euro	77.369	67.963	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	989							4.163
US-Dollar	Euro	64.655	57.413	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	132	Euro	US-Dollar	210.523	238.344	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1.750)
US-Dollar	Euro	29	26	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	-	Euro	US-Dollar	3.417.788	3.882.714	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(41.667)
US-Dollar	Euro	8.032	7.136	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	13	Euro	US-Dollar	102.568	115.602	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(332)
US-Dollar	Euro	11.810	10.444	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	73	US-Dollar	Euro	149.569	133.298	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(236)
						USD							USD
						2.331							(43.985)
						EUR							EUR
						2.075							(39.822)
													Netto EUR
													(35.445)

BNY MELLON DIGITAL ASSETS FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Nettovermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Nettovermögen %
Aktien				Aktien Forts.			
Australien - 282.794 (31. Dezember 2019: 390.989)				USA Forts.			
4.799	ASX Ltd	282.794	2,57	519	Humana Inc	201.198	1,83
China - 1.397.423 (31. Dezember 2019: 165.516)				5.133	Intel Corp	307.056	2,80
1.546	Alibaba Group Holding Ltd ADR	333.519	3,04	2.571	International Business Machines Corp	310.358	2,83
4.278	JD.com Inc ADR	257.471	2,34	2.394	JPMorgan Chase & Co	225.012	2,05
36.102	OneConnect Financial Technology Co Ltd ADR	658.501	5,99	2.674	Merck & Co Inc	206.727	1,88
2.300	Tencent Holdings Ltd	147.932	1,35	2.028	Microsoft Corp	412.668	3,76
Dänemark - 222.720 (31. Dezember 2019: 159.158)				2.639	Nasdaq Inc	315.202	2,87
191	AP Moller - Maersk A/S - B-Klasse	222.720	2,03	1.222	NVIDIA Corp	463.712	4,22
Frankreich - 428.056 (31. Dezember 2019: 775.730)				4.130	Quest Diagnostics Inc	470.923	4,29
10.325	Carrefour SA	159.589	1,45	2.967	salesforce.com Inc	556.179	5,06
612	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	268.467	2,45	679	Splunk Inc	134.822	1,23
Italien - 425.186 (31. Dezember 2019: 478.146)				5.438	Square Inc	570.202	5,19
49.261	Enel SpA	425.186	3,87	3.891	Starbucks Corp	286.261	2,61
Japan - 109.911 (31. Dezember 2019: 352.374)				551	SVB Financial Group	118.771	1,08
5.100	SBI Holdings Inc/Japan	109.911	1,00	2.807	Walmart Inc	335.942	3,06
Niederlande - 116.413 (31. Dezember 2019: 226.168)				Summe der Anlagen in Aktien			
16.719	ING Groep NV	116.413	1,06			10.938.881	99,59
Republik Korea - 100.028 (31. Dezember 2019: 266.906)				Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 151 (siehe unten) (31. Dezember 2019: 4.410)			
713	Samsung SDS Co Ltd	100.028	0,91			151	0,00
Singapur-Dollar - 176.331 (31. Dezember 2019: 281.107)				Summe der Vermögenswerte zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert			
29.500	Singapore Exchange Ltd	176.331	1,61			10.939.032	99,59
Schweiz - 748.233 (31. Dezember 2019: 1.044.833)				Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften - (5.869) (siehe unten) (31. Dezember 2019: (21))			
3.433	Nestle SA	379.588	3,46			(5.869)	(0,05)
567	Swiss Life Holding AG	210.085	1,91	Summe der finanziellen Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert			
303	Swisscom AG	158.560	1,44			(5.869)	(0,05)
Taiwan - 137.485 (31. Dezember 2019: 233.466)				Nettoumlaufvermögen			
2.422	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	137.485	1,25			50.727	0,46
USA - 6.794.301 (31. Dezember 2019: 6.277.533)				Summe der Nettovermögen			
327	Alphabet Inc - A-Klasse	463.658	4,22			10.983.890	100,00
835	Broadridge Financial Solutions Inc	105.352	0,96	Portfolioanalyse			
15.282	Change Healthcare Inc	171.235	1,56	% des Gesamtvermögens			
893	CyberArk Software Ltd	88.688	0,81	An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten			
1.061	DocuSign Inc - A-Klasse	182.641	1,66	Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			
3.162	Emerson Electric Co	196.076	1,78	OTC-Finanzderivate			
437	EPAM Systems Inc	110.126	1,00	Sonstiges Umlaufvermögen			
1.739	Facebook Inc - A-Klasse	394.849	3,59	Summe der Aktiva			
6.588	General Motors Co	166.643	1,52			100,00	

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte							Nicht
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs-	Kontrahent	Gewinn/(Verlust)	realisierter
				datum			
BNY Mellon Digital Assets Fund							
Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)							
US-Dollar	Euro	23.966	21.190	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	151	
						USD	151
						EUR	134
Euro	US-Dollar	14.779	16.663	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(54)	
Euro	US-Dollar	471.319	535.433	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(5.746)	
Euro	US-Dollar	13.934	15.705	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(45)	
US-Dollar	Euro	15.526	13.837	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(24)	
						USD	(5.869)
						EUR	(5.224)
						Netto USD	(5.718)
						Netto EUR	(5.090)

BNY MELLON DYNAMIC TOTAL RETURN FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Nettovermögen %	Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement in USD	Angemessener Wert in USD	Summe der Nettovermögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen				Offene Terminkontrakte Forts.				
	Irland - 1.081.315			1	DAX Index			
	(31. Dezember 2019: 1.279.813)	1.081.315	4,49		Long Futures Contracts			
113.844	iShares Diversified Commodity Swap UCITS ETF - ETF	462.947	1,92		Exp Sep.-2020	346.193	6.868	0,03
18.434	SPDR Bloomberg Barclays 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF - ETF	618.368	2,57	48	E-mini S&P 500 Index			
					Long Futures Contracts			
					Exp Sep.-2020	7.416.600	159.906	0,66
				(2)	FTSE 100 Index			
					Short Futures Contracts			
					Exp Sep.-2020	(152.347)	2.514	0,01
				(4)	FTSE MIB Index			
					Short Futures Contracts			
					Exp Sep.-2020	(433.424)	3.514	0,01
				(3)	IBEX 35 Index			
					Short Futures Contracts			
					Exp Juli-2020	(243.007)	3.681	0,02
				10	MSCI Emerging Markets Index			
					Long Futures Contracts			
					Exp Sep.-2020	492.850	461	0,00
				1	S&P TSX 60 Index			
					Long Futures Contracts			
					Exp Sep.-2020	136.785	1.113	0,01
				63	SFE 10 Year Australian Treasury Bond			
					Long Futures Contracts			
					Exp Sep.-2020	6.468.769	28.268	0,12
				5	SPI 200 Index			
					Long Futures Contracts			
					Exp Sep.-2020	508.259	134	0,00
				(7)	TOPIX Index			
					Short Futures Contracts			
					Exp Sep.-2020	(1.010.373)	11.600	0,05
				(6)	U.S. 10 Year Treasury Note			
					Short Futures Contracts			
					Exp Sep.-2020	(835.031)	373	0,00
				(41)	UK Long Gilt			
					Short Futures Contracts			
					Exp Sep.-2020	(6.992.542)	3.273	0,01
				Summe der offenen Terminkontrakte			222.601	0,92
				Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 120.229 (siehe unten) (31. Dezember 2019: 171.752)				
							120.229	0,50
				Summe der Vermögenswerte zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert			22.079.836	91,56
				Indexoptionen - (103.200)				
					(31. Dezember 2019: (32.750))			
				(10)	E-mini S&P 500 Index Call 07-Aug.-2020 3.170,000		(27.000)	(0,11)
				(10)	E-mini S&P 500 Index Call 17-Jul.-2020 3.160,000		(15.000)	(0,06)
				(10)	E-mini S&P 500 Index Put 07-Aug.-2020 2.870,000		(20.875)	(0,09)
				(10)	E-mini S&P 500 Index Put 17-Jul.-2020 2.860,000		(8.125)	(0,03)
				(9)	E-mini S&P 500 Index Put 17-Jul.-2020 2.965,000		(13.950)	(0,06)
				(10)	E-mini S&P 500 Index Put 24-Jul.-2020 2.940,000		(18.250)	(0,08)
				Summe der Indexoptionen			(103.200)	(0,43)
				Offene Terminkontrakte - 222.601				
					(31. Dezember 2019: 172.119)			
1	AEX Index				Long Futures Contracts			
	Exp Juli-2020	125.731	896					

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

					Devisenterminkontrakte							Nicht	
		liegendes Engagement	Angemessener	Summe				Abrechnungs-			realisierter		
Bestände	Beschreibung	in USD	Wert in USD	der Netto- vermögen %	Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	datum	Kontrahent	Gewinn/(Verlust)		
Offene Terminkontrakte - (84.197) (31. Dezember 2019: (22.617))					BNY Mellon Dynamic Total Return Fund								
(2)	CAC 40 10 Euro Index				Australischer Dollar	US-Dollar	451.000	309.747	16-Sept.-20	Citigroup Global Markets Limited	1.571		
	Short Futures Contracts				Australischer Dollar	US-Dollar	241.000	166.154	16-Sept.-20	Citigroup Global Markets Limited	205		
	Exp Juli-2020	(110.406)	(322)	(0,00)	Kanadischer Dollar	US-Dollar	288.000	211.549	16-Sept.-20	Citigroup Global Markets Limited	622		
1	Canadian 10 Year Treasury Bond				Neuseeländischer Dollar	US-Dollar	2.195.000	1.411.137	16-Sept.-20	Goldman Sachs	5.204		
	Long Futures Contracts				Neuseeländischer Dollar	US-Dollar	259.000	166.793	16-Sept.-20	Citigroup Global Markets Limited	328		
	Exp Sep.-2020	113.303	(76)	(0,00)	Schweizer Franken	US-Dollar	272.307	287.766	16-Sept.-20	Goldman Sachs	311		
10	Eurex SMI Index				Schweizer Franken	US-Dollar	272.307	287.764	16-Sept.-20	Citigroup Global Markets Limited	313		
	Long Futures Contracts				Schweizer Franken	US-Dollar	272.307	287.948	16-Sept.-20	Morgan Stanley	129		
	Exp Sep.-2020	1.056.309	(7.860)	(0,03)	Schweizer Franken	US-Dollar	207.476	219.338	16-Sept.-20	Royal Bank of Canada	154		
(28)	Euro-Bund				Schweizer Franken	US-Dollar	272.307	287.856	16-Sept.-20	Bank of Montreal	221		
	Short Futures Contracts				US-Dollar	Australischer Dollar	620.857	890.660	16-Sept.-20	Bank of Montreal	6.048		
	Exp Sep.-2020	(5.552.970)	(49.615)	(0,21)	US-Dollar	Australischer Dollar	584.632	838.269	16-Sept.-20	Citigroup Global Markets Limited	5.988		
13	Hang Seng Index				US-Dollar	Australischer Dollar	620.773	890.660	16-Sept.-20	Royal Bank of Canada	5.965		
	Long Futures Contracts				US-Dollar	Kanadischer Dollar	546.616	733.597	16-Sept.-20	Bank of Montreal	6.170		
	Exp Juli-2020	2.033.488	(18.844)	(0,08)	US-Dollar	Kanadischer Dollar	514.317	690.446	16-Sept.-20	Citigroup Global Markets Limited	5.661		
55	SGX 10 Year Mini Japanese Government Bond				US-Dollar	Kanadischer Dollar	546.637	733.597	16-Sept.-20	Royal Bank of Canada	6.191		
	Long Futures Contracts				US-Dollar	Euro	1.107.783	973.533	16-Sept.-20	Morgan Stanley	12.134		
	Exp Sep.-2020	7.736.420	(7.480)	(0,03)	US-Dollar	Euro	1.107.832	973.533	16-Sept.-20	Goldman Sachs	12.183		
Summe der offenen Terminkontrakte					(84.197)	(0,35)	US-Dollar	Euro	844.484	741.744	16-Sept.-20	Royal Bank of Canada	9.699
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften - (159.607) (siehe unten) (31. Dezember 2019: (202.197))					(159.607)	(0,66)	US-Dollar	Euro	1.108.474	973.533	16-Sept.-20	Bank of Montreal	12.825
Summe der finanziellen Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert					(347.004)	(1,44)	US-Dollar	Euro	163.438	145.000	16-Sept.-20	Goldman Sachs	250
Nettoumlaufvermögen					2.380.484	9,88	US-Dollar	Euro	1.107.846	973.533	16-Sept.-20	Citigroup Global Markets Limited	12.197
Summe der Nettovermögen					24.113.316	100,00	US-Dollar	Japanischer Yen	141.446	15.246.000	16-Sept.-20	Citigroup Global Markets Limited	99
* Wird von JPMorgan Chase Bank als Sicherheit im Zusammenhang mit den vom Fonds gehaltenen Futures, Futures-Optionen und Indexoptionen gehalten.					US-Dollar	Neuseeländischer Dollar	81.286	124.562	16-Sept.-20	Royal Bank of Canada	912		
Der Kontrahent für Futures-Optionen ist JPMorgan Chase Bank.					US-Dollar	Neuseeländischer Dollar	81.292	124.562	16-Sept.-20	Bank of Montreal	917		
Der Kontrahent für Indexoptionen ist JPMorgan Chase Bank.					US-Dollar	Neuseeländischer Dollar	76.459	117.236	16-Sept.-20	Citigroup Global Markets Limited	812		
Der Kontrahent für Futures ist JPMorgan Chase Bank.					US-Dollar	Sterling	430.595	346.000	16-Sept.-20	Goldman Sachs	1.672		
					US-Dollar	Sterling	556.667	448.000	16-Sept.-20	Citigroup Global Markets Limited	1.299		
					US-Dollar	Sterling	1.039.066	830.000	16-Sept.-20	Goldman Sachs	10.149		
Portfolioanalyse					% des Gesamtvermögens				USD 120.229				
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten					75,93	Kanadischer Dollar	US-Dollar	455.000	335.486	16-Sept.-20	Citigroup Global Markets Limited	(285)	
Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente					8,25	Kanadischer Dollar	US-Dollar	856.000	630.674	16-Sept.-20	Goldman Sachs	(53)	
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate					0,46	Euro	US-Dollar	80.000	90.052	16-Sept.-20	Citigroup Global Markets Limited	(17)	
OTC-Finanzderivate					15,36	Euro	US-Dollar	291.000	328.704	16-Sept.-20	Goldman Sachs	(1.202)	
Sonstiges Umlaufvermögen						Euro	US-Dollar	230.000	258.890	16-Sept.-20	Citigroup Global Markets Limited	(40)	
Summe der Aktiva					100,00	Japanischer Yen	US-Dollar	30.601.000	287.015	16-Sept.-20	Citigroup Global Markets Limited	(3.311)	
						Japanischer Yen	US-Dollar	112.418.586	1.045.351	16-Sept.-20	Goldman Sachs	(3.110)	
						Japanischer Yen	US-Dollar	112.418.586	1.045.783	16-Sept.-20	Morgan Stanley	(3.543)	
						Japanischer Yen	US-Dollar	85.652.256	796.564	16-Sept.-20	Bank of Montreal	(2.476)	
						Japanischer Yen	US-Dollar	112.418.586	1.045.380	16-Sept.-20	Royal Bank of Canada	(3.139)	
						Japanischer Yen	US-Dollar	112.418.586	1.045.343	16-Sept.-20	Citigroup Global Markets Limited	(3.102)	
						Japanischer Yen	US-Dollar	3.614.000	33.700	16-Sept.-20	Goldman Sachs	(194)	
						Norwegische Krone	US-Dollar	3.345.095	361.124	16-Sept.-20	Bank of Montreal	(13.491)	
						Norwegische Krone	US-Dollar	3.345.095	361.222	16-Sept.-20	Goldman Sachs	(13.589)	

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte Forts.							Nicht
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent		realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Dynamic Total Return Fund Forts.							
Norwegische Krone	US-Dollar	3.345.095	361.233	16-Sept.-20	Citigroup Global Markets Limited		(13.601)
Norwegische Krone	US-Dollar	1.337.000	140.670	16-Sept.-20	Citigroup Global Markets Limited		(1.725)
Norwegische Krone	US-Dollar	2.548.647	275.166	16-Sept.-20	Royal Bank of Canada		(10.303)
Norwegische Krone	US-Dollar	3.345.095	360.770	16-Sept.-20	Morgan Stanley		(13.137)
Sterling	US-Dollar	233.174	297.285	16-Sept.-20	Bank of Montreal		(8.229)
Sterling	US-Dollar	233.174	296.806	16-Sept.-20	Goldman Sachs		(7.749)
Sterling	US-Dollar	233.174	297.005	16-Sept.-20	Morgan Stanley		(7.949)
Sterling	US-Dollar	177.658	226.477	16-Sept.-20	Royal Bank of Canada		(6.241)
Sterling	US-Dollar	233.174	296.803	16-Sept.-20	Citigroup Global Markets Limited		(7.746)
Schwedische Krone	US-Dollar	3.280.581	358.324	16-Sept.-20	Citigroup Global Markets Limited		(5.928)
Schwedische Krone	US-Dollar	2.499.491	272.970	16-Sept.-20	Royal Bank of Canada		(4.478)
Schwedische Krone	US-Dollar	3.280.581	358.320	16-Sept.-20	Goldman Sachs		(5.924)
Schwedische Krone	US-Dollar	3.280.581	358.007	16-Sept.-20	Morgan Stanley		(5.611)
Schwedische Krone	US-Dollar	3.280.581	358.283	16-Sept.-20	Bank of Montreal		(5.887)
US-Dollar	Australischer Dollar	369.715	540.000	16-Sept.-20	Goldman Sachs		(3.038)
US-Dollar	Euro	631.991	562.000	16-Sept.-20	Citigroup Global Markets Limited		(504)
US-Dollar	Schweizer Franken	168.664	160.000	16-Sept.-20	Citigroup Global Markets Limited		(602)
US-Dollar	Schweizer Franken	506.630	479.000	16-Sept.-20	Goldman Sachs		(110)
US-Dollar	Schweizer Franken	558.296	528.000	16-Sept.-20	Citigroup Global Markets Limited		(282)
US-Dollar	Schweizer Franken	317.024	301.000	16-Sept.-20	Goldman Sachs		(1.408)
USD							(158.004)
Netto USD							(37.775)
BNY Mellon Dynamic Total Return Fund							
Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)							
Euro	US-Dollar	131.499	149.387	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		(1.603)
USD							(1.603)
EUR							(1.427)

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

87

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener		Summe				Angemessener		Summe	
		Wert		der Netto-				Wert		der Netto-	
Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %	Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %	Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %
Aktien Forts.				Aktien Forts.							
Zyklische Konsumwerte Forts.				Basiskonsumwerte Forts.							
1.750	Leggett & Platt Inc	61.469	0,02	30.320	Bristol-Myers Squibb Co	1.782.058	0,44				
3.677	Lennar Corp	226.485	0,06	2.420	Brown-Forman Corp	154.009	0,04				
1.875	Live Nation Entertainment Inc	83.091	0,02	2.299	Campbell Soup Co	114.088	0,03				
4.167	LKQ Corp	109.155	0,03	3.933	Cardinal Health Inc	205.185	0,05				
10.097	Lowe's Cos Inc	1.363.751	0,34	7.699	Centene Corp	489.464	0,12				
3.585	Marriott International Inc/MD	307.270	0,08	3.248	Church & Dwight Co Inc	251.087	0,06				
9.941	McDonald's Corp	1.832.126	0,45	4.933	Cigna Corp	925.184	0,23				
6.629	MGM Resorts International	111.467	0,03	1.124	Cintas Corp	299.243	0,07				
798	Mohawk Industries Inc	81.200	0,02	1.658	Clorox Co/The	363.707	0,09				
4.998	Newell Brands Inc	79.343	0,02	51.598	Coca-Cola Co/The	2.303.077	0,57				
16.570	NIKE Inc	1.624.357	0,40	11.417	Colgate-Palmolive Co	836.295	0,21				
3.248	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd	53.348	0,01	6.446	Conagra Brands Inc	226.803	0,06				
46	NVR Inc	149.512	0,04	2.241	Constellation Brands Inc - A-Klasse	390.774	0,10				
998	O'Reilly Automotive Inc	420.527	0,10	667	Cooper Cos Inc/The	189.191	0,05				
4.570	PACCAR Inc	341.996	0,08	9.903	Corteva Inc	265.252	0,07				
3.459	PulteGroup Inc	117.727	0,03	3.622	Coty Inc	16.172	0,00				
889	PVH Corp	42.712	0,01	17.446	CVS Health Corp	1.132.769	0,28				
643	Ralph Lauren Corp - A-Klasse	46.621	0,01	8.403	Danaher Corp	1.485.230	0,37				
4.772	Ross Stores Inc	406.598	0,10	1.140	DaVita Inc	90.197	0,02				
2.284	Royal Caribbean Cruises Ltd	114.874	0,03	2.961	DENTSPLY SIRONA Inc	130.402	0,03				
7.137	Southwest Airlines Co	243.764	0,06	1.230	DexCom Inc	498.544	0,12				
15.615	Starbucks Corp	1.148.796	0,28	8.247	Edwards Lifesciences Corp	569.744	0,14				
3.842	Tapestry Inc	51.041	0,01	11.236	Eli Lilly and Co	1.842.704	0,45				
6.686	Target Corp	801.484	0,20	1.603	Equifax Inc	275.395	0,07				
1.454	Tiffany & Co	177.170	0,04	2.996	Estee Lauder Cos Inc/The - A-Klasse	565.210	0,14				
16.017	TJX Cos Inc/The	809.739	0,20	1.122	FleetCor Technologies Inc	282.441	0,07				
1.570	Tractor Supply Co	206.855	0,05	1.177	Gartner Inc	142.817	0,04				
754	Ulta Beauty Inc	153.311	0,04	8.084	General Mills Inc	497.853	0,12				
2.386	Under Armour Inc	21.104	0,01	16.760	Gilead Sciences Inc	1.289.682	0,32				
2.298	Under Armour Inc - A-Klasse	22.371	0,01	4.005	Global Payments Inc	679.228	0,17				
3.363	United Airlines Holdings Inc	116.410	0,03	2.548	H&R Block Inc	36.373	0,01				
4.267	VF Corp	259.988	0,06	3.492	HCA Healthcare Inc	338.672	0,08				
9.896	Walgreens Boots Alliance Inc	419.392	0,10	1.915	Henry Schein Inc	111.817	0,03				
18.909	Walmart Inc	2.263.029	0,56	1.961	Hershey Co/The	254.155	0,06				
833	Whirlpool Corp	107.857	0,03	3.465	Hologic Inc	197.522	0,05				
572	WW Grainger Inc	179.694	0,04	3.729	Hormel Foods Corp	180.017	0,04				
1.314	Wynn Resorts Ltd	97.893	0,02	1.765	Humana Inc	684.229	0,17				
3.994	Yum! Brands Inc	347.099	0,09	1.133	IDEXX Laboratories Inc	373.901	0,09				
Basiskonsumwerte - 77.021.823											
(31. Dezember 2019: 30.962.580)				77.021.823 18,97							
23.616	Abbott Laboratories	2.158.975	0,53	1.959	Illumina Inc	725.124	0,18				
23.532	AbbVie Inc	2.309.901	0,57	2.406	Incyte Corp	250.188	0,06				
613	ABIOMED Inc	148.076	0,04	1.556	Intuitive Surgical Inc	886.383	0,22				
2.925	Alexion Pharmaceuticals Inc	328.112	0,08	2.383	IQVIA Holdings Inc	338.064	0,08				
963	Align Technology Inc	264.421	0,07	1.518	J M Smucker Co/The	160.597	0,04				
24.872	Altria Group Inc	976.102	0,24	35.171	Johnson & Johnson	4.939.064	1,22				
1.988	AmerisourceBergen Corp - A-Klasse	200.182	0,05	3.299	Kellogg Co	217.882	0,05				
7.862	Amgen Inc	1.852.877	0,46	4.546	Kimberly-Clark Corp	642.168	0,16				
3.376	Anthem Inc	886.875	0,22	8.240	Kraft Heinz Co/The	262.650	0,06				
7.363	Archer-Daniels-Midland Co	293.673	0,07	10.592	Kroger Co/The	358.486	0,09				
5.764	Automatic Data Processing Inc	858.144	0,21	1.285	Laboratory Corp of America Holdings	213.522	0,05				
1.113	Avery Dennison Corp	126.988	0,03	1.982	Lamb Weston Holdings Inc	126.650	0,03				
6.790	Baxter International Inc	584.313	0,14	501	MarketAxess Holdings Inc	251.086	0,06				
3.926	Becton Dickinson and Co	939.610	0,23	1.633	McCormick & Co Inc/MD	292.944	0,07				
2.202	Biogen Inc	588.760	0,14	2.159	McKesson Corp	331.137	0,08				
257	Bio-Rad Laboratories Inc	116.029	0,03	17.906	Medtronic Plc	1.640.279	0,40				
19.034	Boston Scientific Corp	668.189	0,16	33.730	Merck & Co Inc	2.607.666	0,64				
				2.500	Molson Coors Beverage Co - B-Klasse	85.887	0,02				
				19.079	Mondelez International Inc	975.128	0,24				

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener	Summe			Angemessener	Summe
		Wert	der Netto-			Wert	der Netto-
Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %	Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %
Aktien Forts.				Aktien Forts.			
Basiskonsumwerte Forts.				Energie Forts.			
5.041	Monster Beverage Corp	349.165	0,09	5.556	TechnipFMC Plc	38.031	0,01
2.153	Moody's Corp	591.440	0,15	5.423	Valero Energy Corp	318.954	0,08
7.017	Mylan NV	112.939	0,03	16.014	Williams Cos Inc/The	304.186	0,08
4.665	Nielsen Holdings Plc	69.299	0,02				
15.677	PayPal Holdings Inc	2.731.560	0,67	Finanzwerte - 49.793.935			
18.534	PepsiCo Inc	2.450.658	0,60	(31. Dezember 2019: 24.896.239)			
1.812	Perrigo Co Plc	100.140	0,02	9.596	Aflac Inc	345.696	0,09
74.138	Pfizer Inc	2.423.942	0,60	1.680	Alexandria Real Estate Equities Inc (REIT)	272.462	0,07
20.790	Philip Morris International Inc	1.455.300	0,36	4.204	Allstate Corp/The	407.725	0,10
33.077	Procter & Gamble Co/The	3.951.875	0,97	8.830	American Express Co	840.351	0,21
1.913	Quanta Services Inc	75.037	0,02	11.491	American International Group Inc	358.232	0,09
1.811	Quest Diagnostics Inc	206.499	0,05	5.919	American Tower Corp (REIT)	1.529.440	0,38
1.343	Regeneron Pharmaceuticals Inc	836.857	0,21	1.641	Ameriprise Financial Inc	246.175	0,06
1.930	ResMed Inc	370.357	0,09	3.123	Aon Plc	601.224	0,15
1.569	Robert Half International Inc	82.875	0,02	1.994	Apartment Investment and Management Co (REIT)	75.024	0,02
1.795	Rollins Inc	76.045	0,02	2.527	Arthur J Gallagher & Co	246.307	0,06
3.221	S&P Global Inc	1.060.337	0,26	808	Assurant Inc	83.495	0,02
1.143	STERIS Plc	175.359	0,04	1.877	AvalonBay Communities Inc (REIT)	290.344	0,07
4.289	Stryker Corp	772.749	0,19	104.633	Bank of America Corp	2.483.464	0,61
6.738	Sysco Corp	368.131	0,09	10.531	Bank of New York Mellon Corp/The	407.076	0,10
623	Teleflex Inc	226.750	0,06	25.985	Berkshire Hathaway Inc - B-Klasse	4.636.893	1,14
5.282	Thermo Fisher Scientific Inc	1.911.635	0,47	2.058	BlackRock Inc	1.118.667	0,28
3.907	Tyson Foods Inc - A-Klasse	233.228	0,06	1.926	Boston Properties Inc (REIT)	174.081	0,04
966	United Rentals Inc	143.958	0,04	6.089	Capital One Financial Corp	381.019	0,09
12.661	UnitedHealth Group Inc	3.730.564	0,92	1.473	Cboe Global Markets Inc	137.173	0,03
1.043	Universal Health Services Inc	96.921	0,02	4.504	CBRE Group Inc - A-Klasse	203.626	0,05
1.194	Varian Medical Systems Inc	146.396	0,04	15.283	Charles Schwab Corp/The	515.572	0,13
2.164	Verisk Analytics Inc - A-Klasse	368.356	0,09	6.039	Chubb Ltd	763.933	0,19
3.460	Vertex Pharmaceuticals Inc	1.004.974	0,25	2.062	Cincinnati Financial Corp	131.999	0,03
981	West Pharmaceutical Services Inc	222.839	0,05	27.933	Citigroup Inc	1.427.237	0,35
2.758	Zimmer Biomet Holdings Inc	329.126	0,08	5.717	Citizens Financial Group Inc	144.268	0,04
6.344	Zoetis Inc	870.143	0,21	4.772	CME Group Inc	775.426	0,19
				1.938	Comerica Inc	73.828	0,02
Energie - 9.650.104				5.564	Crown Castle International Corp (REIT)	930.662	0,23
(31. Dezember 2019: 6.139.523)				3.572	Digital Realty Trust Inc (REIT)	507.581	0,12
5.002	Apache Corp	67.552	0,02	4.105	Discover Financial Services	205.640	0,05
8.649	Baker Hughes Co - A-Klasse	133.151	0,03	4.879	Duke Realty Corp (REIT)	172.692	0,04
5.175	Cabot Oil & Gas Corp	88.881	0,02	1.181	Equinix Inc (REIT)	828.832	0,20
24.959	Chevron Corp	2.227.092	0,55	4.616	Equity Residential (REIT)	271.467	0,07
2.671	Concho Resources Inc	137.503	0,03	888	Essex Property Trust Inc (REIT)	203.348	0,05
14.356	ConocoPhillips	603.167	0,15	519	Everest Re Group Ltd	106.943	0,03
5.203	Devon Energy Corp	58.976	0,01	1.721	Extra Space Storage Inc (REIT)	158.909	0,04
2.134	Diamondback Energy Inc	89.319	0,02	940	Federal Realty Investment Trust (REIT)	80.032	0,02
7.765	EOG Resources Inc	393.258	0,10	9.560	Fifth Third Bancorp	184.365	0,05
56.458	Exxon Mobil Corp	2.522.826	0,62	2.285	First Republic Bank/CA	242.256	0,06
11.479	Halliburton Co	149.055	0,04	3.654	Franklin Resources Inc	76.643	0,02
3.473	Hess Corp	179.884	0,04	1.357	Globe Life Inc	100.784	0,02
2.053	HollyFrontier Corp	59.917	0,02	4.145	Goldman Sachs Group Inc/The	818.617	0,20
25.954	Kinder Morgan Inc	393.463	0,10	4.853	Hartford Financial Services Group Inc/The	186.913	0,05
10.775	Marathon Oil Corp	65.889	0,02	7.128	Healthpeak Properties Inc (REIT)	196.269	0,05
8.675	Marathon Petroleum Corp	324.141	0,08	9.449	Host Hotels & Resorts Inc (REIT)	102.002	0,02
5.176	National Oilwell Varco Inc	63.380	0,02	13.594	Huntington Bancshares Inc/OH	122.822	0,03
6.118	Noble Energy Inc	54.848	0,01	7.321	Intercontinental Exchange Inc	670.164	0,16
11.974	Occidental Petroleum Corp	219.064	0,05	4.965	Invesco Ltd	53.399	0,01
5.554	ONEOK Inc	184.337	0,05	3.827	Iron Mountain Inc (REIT)	99.866	0,02
5.862	Phillips 66	421.243	0,10	40.801	JPMorgan Chase & Co	3.834.886	0,94
2.166	Pioneer Natural Resources Co	211.607	0,05	12.951	KeyCorp	157.678	0,04
18.514	Schlumberger Ltd	340.380	0,08	5.683	Kimco Realty Corp (REIT)	72.941	0,02

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener		Bestände	Beschreibung	Angemessener	
		Wert	Summe			Wert	Summe
		in USD	der Netto-			in USD	der Netto-
			vermögen %				vermögen %
Aktien Forts.				Aktien Forts.			
Finanzwerte Forts.				Industriewerte Forts.			
2.523	Lincoln National Corp	92.834	0,02	10.239	CSX Corp	714.426	0,18
3.257	Loews Corp	111.699	0,03	4.176	Deere & Co	656.112	0,16
1.712	M&T Bank Corp	178.005	0,04	1.903	Dover Corp	183.830	0,05
6.807	Marsh & McLennan Cos Inc	730.527	0,18	5.354	Eaton Corp Plc	468.073	0,12
11.795	Mastercard Inc	3.486.071	0,86	8.036	Emerson Electric Co	498.312	0,12
10.323	MetLife Inc	376.944	0,09	2.199	Expeditors International of Washington Inc	167.157	0,04
1.513	Mid-America Apartment Communities Inc (REIT)	173.503	0,04	3.207	FedEx Corp	449.333	0,11
15.950	Morgan Stanley	770.465	0,19	1.781	FLIR Systems Inc	72.219	0,02
1.503	Nasdaq Inc	179.518	0,04	1.835	Flowserve Corp	52.352	0,01
2.786	Northern Trust Corp	220.902	0,05	3.912	Fortive Corp	264.901	0,07
5.963	People's United Financial Inc	68.962	0,02	1.889	Fortune Brands Home & Security Inc	120.764	0,03
5.684	PNC Financial Services Group Inc/The	597.815	0,15	1.918	Garmin Ltd	186.938	0,05
3.411	Principal Financial Group Inc	141.744	0,03	3.092	General Dynamics Corp	461.914	0,11
7.808	Progressive Corp/The	625.187	0,15	116.341	General Electric Co	794.027	0,20
9.830	Prologis Inc (REIT)	917.090	0,23	9.389	Honeywell International Inc	1.358.260	0,33
5.313	Prudential Financial Inc	323.509	0,08	5.200	Howmet Aerospace Inc	82.394	0,02
2.006	Public Storage (REIT)	384.841	0,09	557	Huntington Ingalls Industries Inc	97.213	0,02
1.677	Raymond James Financial Inc	115.445	0,03	999	IDEX Corp	157.822	0,04
4.536	Realty Income Corp (REIT)	269.733	0,07	3.847	Illinois Tool Works Inc	671.859	0,17
2.253	Regency Centers Corp (REIT)	103.334	0,03	4.606	Ingersoll Rand Inc	129.544	0,03
12.841	Regions Financial Corp	142.728	0,04	1.744	Jacobs Engineering Group Inc	147.882	0,04
1.486	SBA Communications Corp (REIT) - A-Klasse	442.471	0,11	1.136	JB Hunt Transport Services Inc	136.729	0,03
4.063	Simon Property Group Inc (REIT)	277.808	0,07	9.963	Johnson Controls International plc	340.037	0,08
985	SL Green Realty Corp (REIT)	48.565	0,01	1.275	Kansas City Southern	190.338	0,05
4.713	State Street Corp	299.653	0,07	2.482	Keysight Technologies Inc	250.111	0,06
687	SVB Financial Group	148.086	0,04	2.887	L3Harris Technologies Inc	489.823	0,12
7.199	Synchrony Financial	159.494	0,04	3.303	Lockheed Martin Corp	1.205.215	0,30
3.045	T Rowe Price Group Inc	376.240	0,09	831	Martin Marietta Materials Inc	171.639	0,04
3.409	Travelers Cos Inc/The	388.779	0,10	3.543	Masco Corp	177.859	0,04
17.968	Truist Financial Corp	674.609	0,17	322	Mettler-Toledo International Inc	259.384	0,06
3.853	UDR Inc (REIT)	143.987	0,04	3.436	Norfolk Southern Corp	603.533	0,15
2.691	Unum Group	44.657	0,01	2.073	Northrop Grumman Corp	637.313	0,16
18.374	US Bancorp	676.439	0,17	1.252	Old Dominion Freight Line Inc	212.258	0,05
4.947	Ventas Inc (REIT)	181.060	0,04	5.431	Otis Worldwide Corp	308.698	0,08
22.557	Visa Inc - A-Klasse	4.352.035	1,07	1.284	Packaging Corp of America	128.137	0,03
2.108	Vornado Realty Trust (REIT)	80.515	0,02	1.699	Parker-Hannifin Corp	311.495	0,08
1.895	W R Berkley Corp	108.536	0,03	2.237	Pentair Plc	84.995	0,02
49.977	Wells Fargo & Co	1.278.162	0,31	1.461	PerkinElmer Inc	143.317	0,04
5.556	Welltower Inc (REIT)	287.384	0,07	19.635	Raytheon Technologies Corp	1.209.418	0,30
5.510	Western Union Co/The	119.154	0,03	2.789	Republic Services Inc - A-Klasse	228.796	0,06
10.018	Weyerhaeuser Co (REIT)	224.904	0,06	1.545	Rockwell Automation Inc	329.039	0,08
1.718	Willis Towers Watson Plc	338.205	0,08	1.393	Roper Technologies Inc	540.853	0,13
2.232	Zions Bancorp NA	75.888	0,02	2.079	Sealed Air Corp	68.326	0,02
Industriewerte - 26.743.067				724	Snap-on Inc	100.220	0,02
(31. Dezember 2019: 12.453.557)				2.054	Stanley Black & Decker Inc	286.235	0,07
26.743.067 6,58				4.417	TE Connectivity Ltd	360.206	0,09
7.681	3M Co	1.197.506	0,29	441	Teledyne Technologies Inc	137.050	0,03
1.825	A O Smith Corp	86.021	0,02	3.040	Textron Inc	100.062	0,02
4.087	Agilent Technologies Inc	361.127	0,09	3.168	Trane Technologies Plc	281.857	0,07
1.238	Allegion plc	126.530	0,03	671	TransDigm Group Inc	296.485	0,07
21.106	Amcor Plc	215.387	0,05	9.082	Union Pacific Corp	1.534.313	0,38
3.024	AMETEK Inc	270.089	0,07	9.399	United Parcel Service Inc - B-Klasse	1.044.652	0,26
3.915	Amphenol Corp - A-Klasse	374.724	0,09	1.782	Vulcan Materials Co	206.454	0,05
4.325	Ball Corp	300.479	0,07	5.183	Waste Management Inc	548.595	0,14
7.157	Boeing Co/The	1.310.590	0,32	846	Waters Corp	152.589	0,04
10.907	Carrier Global Corp	242.299	0,06	2.395	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	137.892	0,03
7.243	Caterpillar Inc	915.769	0,23	3.445	Westrock Co	97.287	0,02
1.779	CH Robinson Worldwide Inc	140.603	0,03	2.393	Xylem Inc/NY	155.401	0,04

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener		Bestände	Beschreibung	Angemessener	
		Wert	Summe			Wert	Summe
		in USD	der Netto-			in USD	der Netto-
			vermögen %				vermögen %
Aktien Forts.							
Technologie - 78.261.297				Versorger - 10.464.685			
(31. Dezember 2019: 26.463.825)		78.261.297	19,27	(31. Dezember 2019: 4.675.669)		10.464.685	2,58
8.504	Accenture Plc - A-Klasse	1.824.703	0,45	9.019	AES Corp/The	130.640	0,03
10.287	Activision Blizzard Inc	780.526	0,19	3.319	Alliant Energy Corp	158.681	0,04
6.434	Adobe Inc	2.799.884	0,69	3.257	Ameren Corp	229.163	0,06
15.579	Advanced Micro Devices Inc	819.066	0,20	6.609	American Electric Power Co Inc	526.275	0,13
2.140	Akamai Technologies Inc	229.237	0,06	2.389	American Water Works Co Inc	307.261	0,08
4.915	Analog Devices Inc	602.923	0,15	1.627	Atmos Energy Corp	162.025	0,04
1.146	ANSYS Inc	334.540	0,08	7.230	CenterPoint Energy Inc	134.948	0,03
54.524	Apple Inc	19.880.541	4,90	3.815	CMS Energy Corp	222.853	0,05
12.250	Applied Materials Inc	740.267	0,18	4.456	Consolidated Edison Inc	320.431	0,08
2.925	Autodesk Inc	699.397	0,17	11.186	Dominion Energy Inc	907.408	0,22
5.334	Broadcom Inc	1.682.797	0,41	2.541	DTE Energy Co	273.132	0,07
1.545	Broadridge Financial Solutions Inc	194.933	0,05	9.806	Duke Energy Corp	783.254	0,19
3.707	Cadence Design Systems Inc	355.650	0,09	5.018	Edison International	272.503	0,07
4.075	Cerner Corp	279.219	0,07	2.670	Entergy Corp	250.486	0,06
1.524	Citrix Systems Inc	225.301	0,06	2.985	Evergy Inc	176.981	0,04
7.228	Cognizant Technology Solutions Corp	410.478	0,10	4.472	Eversource Energy	372.138	0,09
3.362	DXC Technology Co	55.490	0,01	12.997	Exelon Corp	471.596	0,12
3.851	Electronic Arts Inc	508.371	0,13	7.228	FirstEnergy Corp	280.338	0,07
8.246	Fidelity National Information Services Inc	1.105.582	0,27	6.534	NextEra Energy Inc	1.569.140	0,39
7.521	Fiserv Inc	733.561	0,18	4.980	NiSource Inc	113.270	0,03
1.800	Fortinet Inc	247.014	0,06	3.276	NRG Energy Inc	106.683	0,03
17.117	Hewlett Packard Enterprise Co	166.634	0,04	1.528	Pinnacle West Capital Corp	111.995	0,03
19.149	HP Inc	333.671	0,08	10.155	PPL Corp	262.354	0,06
56.684	Intel Corp	3.390.837	0,84	6.681	Public Service Enterprise Group Inc	328.338	0,08
11.853	International Business Machines Corp	1.430.835	0,35	3.889	Sempra Energy	455.732	0,11
3.482	Intuit Inc	1.031.334	0,25	14.093	Southern Co/The (Units)	730.511	0,18
465	IPG Photonics Corp	74.623	0,02	4.209	WEC Energy Group Inc	368.772	0,09
1.035	Jack Henry & Associates Inc	190.368	0,05	7.005	Xcel Energy Inc	437.777	0,11
2.083	KLA Corp	404.769	0,10				
1.936	Lam Research Corp	625.657	0,15	Summe der Anlagen in Aktien		342.199.156	84,27
1.793	Leidos Holdings Inc	167.941	0,04				
3.570	Maxim Integrated Products Inc	216.288	0,05	Termin-Optionen - 2.365.781			
3.265	Microchip Technology Inc	343.853	0,09	(31. Dezember 2019: -)			
14.847	Micron Technology Inc	764.546	0,19	98	U.S. Treasury Bond Future Call 21-Aug.-2020 168,000	1.051.969	0,26
101.301	Microsoft Corp	20.613.234	5,08	196	U.S. Treasury Bond Future Call 24-Jul.-2020 172,000	1.313.812	0,32
1.134	MSCI Inc - A-Klasse	378.546	0,09				
3.001	NetApp Inc	133.079	0,03	Summe der Termin-Optionen		2.365.781	0,58
8.209	NVIDIA Corp	3.115.069	0,77				
27.905	Oracle Corp	1.542.030	0,38	Indexoptionen - 971.800			
4.260	Paychex Inc	322.652	0,08	(31. Dezember 2019: 2.896.950)			
651	Paycom Software Inc	201.628	0,05	86	E-mini S&P 500 Index Call 17-Jul.-2020 3.150,000	146.200	0,03
1.543	Qorvo Inc	170.478	0,04	86	E-mini S&P 500 Index Call 18-Sept.-2020 3.150,000	475.150	0,12
15.044	QUALCOMM Inc	1.371.862	0,34	86	E-mini S&P 500 Index Call 21-Aug.-2020 3.150,000	350.450	0,09
12.012	salesforce.com Inc	2.251.709	0,55				
3.071	Seagate Technology Plc	148.606	0,04	Summe der Indexoptionen		971.800	0,24
2.544	ServiceNow Inc	1.030.358	0,25				
2.253	Skyworks Solutions Inc	287.798	0,07				
2.011	Synopsys Inc	392.155	0,10				
1.523	Take-Two Interactive Software Inc	212.398	0,05				
12.277	Texas Instruments Inc	1.558.504	0,38				
478	Tyler Technologies Inc	165.723	0,04				
3.947	Western Digital Corp	174.181	0,04				
2.423	Xerox Holdings Corp	37.060	0,01				
3.256	Xilinx Inc	320.195	0,08				
716	Zebra Technologies Corp	183.196	0,05				

Bestände	Beschreibung	Zugrunde		Bestände	Beschreibung	Zugrunde	
		liegendes Engagement	Angemessener			liegendes Engagement	Angemessener
		in USD	Wert			in USD	Wert
			der Netto-				der Netto-
			vermögen %				vermögen %
Offene Terminkontrakte - 266.364							
(31. Dezember 2019: 382.208)							
87	E-mini S&P 500 Index						
	Long Futures Contracts						
	Exp Sep.-2020	13.442.588	266.364				
			0,07				
Summe der offenen Terminkontrakte			266.364				0,07

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

				Devisenterminkontrakte								
Beschreibung			Angemessener Wert in USD	Summe der Nettovermögen %	Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 78 (siehe unten) (31.Dezember 2019: 1.372)				78	0,00							
Summe der Vermögenswerte zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert				376.292.003	92,67							
		Zugrunde liegendes Engagement	Angemessener Wert	Summe der Nettovermögen %								
Bestände	Beschreibung	in USD	in USD	in USD								
Offene Terminkontrakte - (2.212) (31. Dezember 2019: (514.632))												
36	U.S.Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Sep.-2020	6.428.250	(2.212)	(0,00)								
Summe der offenen Terminkontrakte				(2.212)	(0,00)							
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften - (1.383) (siehe unten) (31. Dezember 2019: -)				(1.383)	(0,00)							
Summe der finanziellen Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert				(3.595)	(0,00)							
Nettoumlaufvermögen				29.767.999	7,33							
Summe der Nettovermögen				406.056.407	100,00							
Der Kontrahent für Futures-Optionen ist Citigroup Global Markets Limited.												
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 geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente				91,73								
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate				0,89								
OTC-Finanzderivate				0,00								
Sonstiges Umlaufvermögen				7,38								
Summe der Aktiva				100,00								

BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund											
US-Dollar	Euro	44.962	40.000	02-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	21					
						USD	21				
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund											
Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)											
Euro	US-Dollar	3.797	4.261	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	6					
US-Dollar	Euro	8.046	7.114	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	51					
						USD	57				
						EUR	51				
Euro	US-Dollar	113.133	128.523	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1.379)					
US-Dollar	Euro	2.674	2.383	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(4)					
						USD	(1.383)				
						EUR	(1.231)				
						Netto USD	(1.326)				
						Netto EUR	(1.180)				

BNY MELLON EFFICIENT GLOBAL IG CORPORATE BETA FUND^

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %
Anleihen				Anleihen Forts.			
	Kanadischer Dollar - 1.884.313	1.884.313	3,02		Kanadischer Dollar Forts.		
5.000	407 International Inc 3,830 % 11-Mai-2046	4.496	0,01	10.000	CU Inc 2,963 % 07-Sept.-2049	7.881	0,01
5.000	407 International Inc 5,750 % 14-Feb.-2036	4.968	0,01	15.000	CU Inc 3,964 % 27-Jul.-2045	13.738	0,02
50.000	407 International Inc 'MTN' 2,840 % 07-März-2050	38.482	0,06	10.000	CU Inc 4,085 % 02-Sept.-2044	9.278	0,02
5.000	407 International Inc 'MTN' 4,680 % 07-Okt.-2053	5.322	0,01	5.000	CU Inc 4,543 % 24-Okt.-2041	4.823	0,01
15.000	407 International Inc 'MTN' 5,960 % 03-Dez.-2035	16.040	0,03	5.000	CU Inc 4,722 % 09-Sept.-2043	4.993	0,01
10.000	Algonquin Power Co 4,090 % 17-Feb.-2027	8.115	0,01	50.000	Daimler Canada Finance Inc 'EMTN'		
10.000	AltaGas Ltd 'MTN' 3,720 % 28-Sept.-2021	7.581	0,01		3,300 % 16-Aug.-2022	37.832	0,06
10.000	AltaLink LP 'MTN' 2,747 % 29-Mai-2026	7.966	0,01	50.000	Emera Inc 2,900 % 16-Jun.-2023	38.032	0,06
15.000	AltaLink LP 'MTN' 4,090 % 30-Jun.-2045	14.237	0,02	5.000	Enbridge Gas Inc 'MTN' 4,200 % 02-Jun.-2044	4.710	0,01
5.000	Anheuser-Busch InBev Finance Inc			5.000	Enbridge Gas Inc 'MTN' 4,500 % 23-Nov.-2043	4.856	0,01
	4,320 % 15-Mai-2047	3.823	0,01	5.000	Energir Inc 3,530 % 16-Mai-2047	4.463	0,01
10.000	Bank of America Corp FRN 2,932 % 25-Apr.-2025	7.693	0,01	5.000	EPCOR Utilities Inc 6,800 % 28-Jun.-2029	5.142	0,01
10.000	Bank of Montreal 1,610 % 28-Okt.-2021	7.446	0,01	5.000	First Capital Real Estate Investment Trust		
25.000	Bank of Montreal 2,270 % 11-Jul.-2022	18.918	0,03		4,790 % 30-Aug.-2024	3.866	0,01
30.000	Bank of Montreal 2,700 % 11-Sept.-2024	23.509	0,04	10.000	Greater Toronto Airports Authority 'MTN'		
15.000	Bank of Montreal 2,890 % 20-Jun.-2023	11.663	0,02		5,300 % 25-Feb.-2041	10.511	0,02
50.000	Bank of Montreal 3,190 % 01-März-2028	41.648	0,07	10.000	Great-West Lifeco Inc 3,337 % 28-Feb.-2028	8.269	0,01
25.000	Bank of Montreal FRN 2,880 % 17-Sept.-2029	19.047	0,03	5.000	Great-West Lifeco Inc 6,740 % 24-Nov.-2031	5.138	0,01
10.000	Bank of Montreal 'MTN' 2,370 % 03-Feb.-2025	7.663	0,01	10.000	Honda Canada Finance Inc 1,823 % 07-Dez.-2021	7.432	0,01
25.000	Bank of Montreal 'MTN' FRN 2,570 % 01-Jun.-2027	18.808	0,03	15.000	Honda Canada Finance Inc 2,500 % 04-Jun.-2024	11.472	0,02
10.000	Bank of Nova Scotia/The 1,900 % 02-Dez.-2021	7.483	0,01	15.000	Husky Energy Inc 3,550 % 12-März-2025	11.101	0,02
50.000	Bank of Nova Scotia/The 2,160 % 03-Feb.-2025	37.974	0,06	5.000	Hydro One Inc 7,350 % 03-Jun.-2030	5.354	0,01
50.000	Bank of Nova Scotia/The 2,290 % 28-Jun.-2024	38.583	0,06	50.000	Hydro One Inc 'MTN' 2,540 % 05-Apr.-2024	38.682	0,06
50.000	Bank of Nova Scotia/The 2,380 % 01-Mai-2023	38.038	0,06	50.000	Hydro One Inc 'MTN' 3,200 % 13-Jan.-2022	38.105	0,06
15.000	Bank of Nova Scotia/The 3,100 % 02-Feb.-2028	12.412	0,02	10.000	Hydro One Inc 'MTN' 3,630 % 25-Jun.-2049	8.982	0,01
50.000	Bank of Nova Scotia/The FRN 2,836 % 03-Jul.-2029	38.127	0,06	15.000	Hydro One Inc 'MTN' 3,720 % 18-Nov.-2047	13.586	0,02
50.000	Bell Canada Inc 'MTN' 3,350 % 12-März-2025	39.719	0,06	15.000	Hydro One Inc 'MTN' 6,590 % 22-Apr.-2043	18.658	0,03
15.000	Bell Canada Inc 'MTN' 6,170 % 26-Feb.-2037	15.305	0,02	5.000	IGM Financial Inc 4,206 % 21-März-2050	4.034	0,01
10.000	BMW Canada Inc 2,150 % 26-Nov.-2021	7.436	0,01	15.000	Inter Pipeline Ltd 'MTN' 2,608 % 13-Sept.-2023	11.066	0,02
10.000	Brookfield Asset Management Inc 'MTN'			15.000	Inter Pipeline Ltd 'MTN' 4,637 % 30-Mai-2044	10.664	0,02
	4,540 % 31-März-2023	7.911	0,01	25.000	John Deere Financial Inc 2,410 % 14-Jan.-2025	19.273	0,03
30.000	Brookfield Infrastructure Finance ULC 'MTN'			10.000	Laurentian Bank of Canada 2,550 % 20-Jun.-2022	7.417	0,01
	3,410 % 09-Okt.-2029	22.943	0,04	10.000	Laurentian Bank of Canada 3,000 % 12-Sept.-2022	7.456	0,01
10.000	Brookfield Renewable Partners ULC 'MTN'			5.000	Loblaws Cos Ltd 4,488 % 11-Dez.-2028	4.401	0,01
	3,630 % 15-Jan.-2027	7.974	0,01	20.000	Loblaw Cos Ltd 'MTN' 5,900 % 18-Jan.-2036	19.682	0,03
10.000	Bruce Power LP 3,969 % 23-Jun.-2026	8.188	0,01	10.000	Molson Coors International LP 3,440 % 15-Jul.-2026	7.588	0,01
20.000	Canadian Imperial Bank of Commerce			10.000	Mondelez International Inc 3,250 % 07-März-2025	7.872	0,01
	2,300 % 11-Jul.-2022	15.143	0,02	10.000	National Bank of Canada 2,983 % 04-März-2024	7.803	0,01
10.000	Canadian Imperial Bank of Commerce			50.000	North West Redwater Partnership /		
	2,350 % 28-Aug.-2024	7.638	0,01		NWR Financing Co Ltd 4,350 % 10-Jan.-2039	42.437	0,07
20.000	Canadian Imperial Bank of Commerce			20.000	Pembina Pipeline Corp 4,020 % 27-März-2028	16.237	0,03
	2,470 % 05-Dez.-2022	15.280	0,02	20.000	Pembina Pipeline Corp 'MTN' 3,310 % 01-Feb.-2030	15.426	0,03
15.000	Canadian Imperial Bank of Commerce			10.000	Pembina Pipeline Corp 'MTN' 3,430 % 10-Nov.-2021	7.551	0,01
	2,970 % 11-Jul.-2023	11.682	0,02	30.000	Pembina Pipeline Corp 'MTN' 4,740 % 21-Jan.-2047	24.471	0,04
10.000	Canadian Imperial Bank of Commerce			10.000	RioCan Real Estate Investment Trust		
	3,290 % 15-Jan.-2024	7.856	0,01		3,287 % 12-Feb.-2024	7.551	0,01
30.000	Canadian Imperial Bank of Commerce			20.000	Rogers Communications Inc 3,250 % 01-Mai-2029	16.102	0,03
	3,300 % 26-Mai-2025	24.307	0,04	20.000	Rogers Communications Inc 4,000 % 13-März-2024	16.012	0,03
5.000	Canadian National Railway Co 3,050 % 08-Feb.-2050	4.010	0,01	10.000	Rogers Communications Inc 'MTN'		
50.000	Canadian National Railway Co 3,600 % 01-Aug.-2047	43.920	0,07		6,560 % 22-März-2041	10.991	0,02
50.000	Canadian Pacific Railway Co 'MTN'			50.000	Royal Bank of Canada 1,968 % 02-März-2022	37.610	0,06
	6,450 % 17-Nov.-2039	57.351	0,09	15.000	Royal Bank of Canada 2,328 % 28-Jan.-2027	11.519	0,02
10.000	Canadian Tire Corp Ltd 'MTN' 6,445 % 24-Feb.-2034	8.860	0,01	50.000	Royal Bank of Canada 2,352 % 02-Jul.-2024	38.202	0,06
10.000	Canadian Western Bank 2,597 % 06-Sept.-2024	7.427	0,01	25.000	Royal Bank of Canada 2,360 % 05-Dez.-2022	19.028	0,03
10.000	Canadian Western Bank 2,833 % 14-März-2022	7.463	0,01	20.000	Royal Bank of Canada 3,296 % 26-Sept.-2023	15.762	0,03
50.000	Choice Properties Real Estate Investment Trust			20.000	Shaw Communications Inc 4,350 % 31-Jan.-2024	16.111	0,03
	2,981 % 04-März-2030	37.213	0,06	5.000	Sun Life Assurance Co of Canada 6,300 % 15-Mai-2028	4.799	0,01
10.000	Choice Properties Real Estate Investment Trust			30.000	Sun Life Financial Inc 'MTN' FRN		
	4,293 % 08-Feb.-2024	7.941	0,01		5,400 % 29-Mai-2042	28.094	0,05

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener	Summe			Angemessener	Summe
		Wert	der Netto-			Wert	der Netto-
Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %	Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
Kanadischer Dollar Forts.				Euro Forts.			
10.000	Sysco Canada Inc 3,650 % 25-Apr.-2025	7.686	0,01	10.000	BASF SE 2,000 % 05-Dez.-2022	11.790	0,02
20.000	TELUS Corp 3,150 % 19-Feb.-2030	15.915	0,03	5.000	BASF SE 'EMTN' 0,875 % 06-Okt.-2031	5.833	0,01
10.000	TELUS Corp 4,850 % 05-Apr.-2044	9.048	0,01	100.000	BAT International Finance Plc 'EMTN'		
15.000	TELUS Corp 5,150 % 26-Nov.-2043	14.111	0,02		2,250 % 16-Jan.-2030	116.457	0,19
15.000	TELUS Corp 'MTN' 3,350 % 01-Apr.-2024	11.777	0,02	25.000	Bayer AG FRN 2,375 % 02-Apr.-2075	27.933	0,04
15.000	TELUS Corp 'MTN' 4,400 % 29-Jan.-2046	12.826	0,02	15.000	Bayer AG FRN 3,750 % 01-Jul.-2074	17.486	0,03
5.000	TMX Group Ltd 4,461 % 03-Okt.-2023	4.019	0,01	100.000	BHP Billiton Finance Ltd 3,250 % 24-Sept.-2027	133.132	0,21
15.000	Toronto-Dominion Bank/The 1,909 % 18-Jul.-2023	11.353	0,02	10.000	BMW Finance NV 'EMTN' 0,250 % 14-Jan.-2022	11.268	0,02
50.000	Toronto-Dominion Bank/The 1,943 % 13-März-2025	37.730	0,06	10.000	BMW Finance NV 'EMTN' 0,375 % 24-Sept.-2027	11.022	0,02
10.000	Toronto-Dominion Bank/The 1,994 % 23-März-2022	7.506	0,01	60.000	BMW Finance NV 'EMTN' 1,000 % 21-Jan.-2025	69.437	0,11
15.000	Toronto-Dominion Bank/The 3,005 % 30-Mai-2023	11.708	0,02	10.000	BMW Finance NV 'EMTN' 1,250 % 05-Sept.-2022	11.495	0,02
50.000	Toronto-Dominion Bank/The 'MTN' FRN			10.000	BMW Finance NV 'EMTN' 1,500 % 06-Feb.-2029	11.818	0,02
	3,224 % 25-Jul.-2029	38.670	0,06	10.000	BMW US Capital LLC 'EMTN' 1,125 % 18-Sept.-2021	11.391	0,02
50.000	TransCanada PipeLines Ltd 'MTN'			100.000	BNP Paribas SA 'EMTN' 1,000 % 27-Jun.-2024	114.335	0,18
	3,390 % 15-März-2028	39.908	0,06	20.000	BNP Paribas SA 'EMTN' 2,375 % 20-Mai-2024	24.539	0,04
15.000	TransCanada PipeLines Ltd 'MTN'			10.000	BNP Paribas SA 'EMTN' 2,875 % 24-Okt.-2022	11.973	0,02
	3,690 % 19-Jul.-2023	11.733	0,02	20.000	BNP Paribas SA 'EMTN' 2,875 % 26-Sept.-2023	24.563	0,04
20.000	TransCanada PipeLines Ltd 'MTN'			15.000	BNP Paribas SA 'EMTN' 4,125 % 14-Jan.-2022	17.907	0,03
	4,350 % 06-Jun.-2046	16.673	0,03	100.000	BNP Paribas SA 'EMTN' FRN 2,125 % 23-Jan.-2027	120.139	0,19
10.000	United Parcel Service Inc 2,125 % 21-Mai-2024	7.589	0,01	30.000	Borealis AG 1,750 % 10-Dez.-2025	35.707	0,06
10.000	Ventas Canada Finance Ltd 2,800 % 12-Apr.-2024	7.234	0,01	100.000	BP Capital Markets Plc 'EMTN'		
5.000	Ventas Canada Finance Ltd 4,125 % 30-Sept.-2024	3.788	0,01		0,831 % 08-Nov.-2027	110.860	0,18
15.000	VW Credit Canada Inc 2,850 % 26-Sept.-2024	11.358	0,02	100.000	CaixaBank SA 'EMTN' 1,125 % 27-März-2026	114.430	0,18
20.000	Wells Fargo & Co 2,509 % 27-Okt.-2023	15.162	0,02	100.000	Cie de Saint-Gobain 'EMTN' 1,000 % 17-März-2025	115.511	0,18
20.000	Wells Fargo & Co 2,975 % 19-Mai-2026	15.454	0,03	100.000	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA		
10.000	Wells Fargo & Co 3,184 % 08-Feb.-2024	7.767	0,01		0,875 % 03-Sept.-2025	116.233	0,19
10.000	Westcoast Energy Inc 'MTN' 3,883 % 28-Okt.-2021	7.626	0,01	100.000	Citigroup Inc 1,250 % 10-Apr.-2029	117.004	0,19
				15.000	Citigroup Inc 'EMTN' FRN 4,250 % 25-Feb.-2030	19.136	0,03
Euro - 14.442.390				100.000	CK Hutchison Finance 16 Ltd 1,250 % 06-Apr.-2023	113.723	0,18
100.000	3M Co 'EMTN' 1,750 % 15-Mai-2030	127.213	0,20	100.000	Coca-Cola Co/The 1,625 % 09-März-2035	123.885	0,20
100.000	AbbVie Inc 2,125 % 17-Nov.-2028	124.578	0,20	100.000	Coca-Cola European Partners Plc		
10.000	ABN AMRO Bank NV 'EMTN' 0,625 % 31-Mai-2022	11.385	0,02		1,500 % 08-Nov.-2027	120.112	0,19
10.000	ABN AMRO Bank NV 'EMTN' 1,000 % 16-Apr.-2025	11.779	0,02	10.000	Commerzbank AG 'EMTN' 0,500 % 28-Aug.-2023	11.254	0,02
10.000	ABN AMRO Bank NV 'EMTN' 2,500 % 29-Nov.-2023	12.194	0,02	15.000	Commerzbank AG 'EMTN' 0,500 % 13-Sept.-2023	16.559	0,03
10.000	ABN AMRO Bank NV 'EMTN' 4,125 % 28-März-2022	12.046	0,02	10.000	Commerzbank AG 'EMTN' 0,500 % 04-Dez.-2026	11.085	0,02
100.000	Allianz SE FRN 3,099 % 06-Jul.-2047	124.558	0,20	50.000	Commerzbank AG 'EMTN' 0,625 % 28-Aug.-2024	56.241	0,09
100.000	Aptiv Plc 1,600 % 15-Sept.-2028	108.796	0,17	10.000	Commerzbank AG 'EMTN' 1,000 % 04-März-2026	11.418	0,02
100.000	Aroundtown SA 'EMTN' 1,875 % 19-Jan.-2026	116.801	0,19	25.000	Commerzbank AG 'EMTN' 1,125 % 24-Mai-2024	28.040	0,04
100.000	ASTM SpA 'EMTN' 3,375 % 13-Feb.-2024	118.085	0,19	10.000	Commerzbank AG 'EMTN' 1,500 % 21-Sept.-2022	11.398	0,02
100.000	AT&T Inc 0,800 % 04-März-2030	107.459	0,17	10.000	Commerzbank AG 'EMTN' 1,500 % 28-Aug.-2028	11.850	0,02
100.000	AT&T Inc 2,400 % 15-März-2024	119.026	0,19	100.000	Compass Group Plc 'EMTN' 1,875 % 27-Jan.-2023	116.357	0,19
100.000	Australia Pacific Airports Melbourne Pty Ltd 'EMTN'			15.000	Continental AG 0,000 % 12-Sept.-2023	16.486	0,03
	3,125 % 26-Sept.-2023	119.748	0,19	15.000	Continental AG 'EMTN' 0,375 % 27-Jun.-2025	16.104	0,02
100.000	Autoliv Inc 0,750 % 26-Jun.-2023	109.807	0,17	15.000	Cooperatieve Rabobank UA 4,125 % 14-Jul.-2025	20.390	0,03
50.000	Autoroutes du Sud de la France SA 'EMTN'			10.000	Cooperatieve Rabobank UA 'EMTN'		
	5,625 % 04-Jul.-2022	62.225	0,10		4,750 % 06-Jun.-2022	12.296	0,02
100.000	AXA SA 'EMTN' FRN 5,125 % 04-Jul.-2043	125.362	0,20	15.000	Cooperatieve Rabobank UA 'GMTN'		
100.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 'GMTN' FRN				1,375 % 03-Feb.-2027	18.395	0,03
	2,575 % 22-Feb.-2029	114.433	0,18	15.000	Cooperatieve Rabobank UA 'GMTN'		
100.000	Banco Santander SA 'EMTN' 1,375 % 14-Dez.-2022	115.920	0,18		4,000 % 11-Jan.-2022	17.924	0,03
100.000	Bank of America Corp 'EMTN' 0,750 % 26-Jul.-2023	113.626	0,18	55.000	Covestro AG 1,750 % 25-Sept.-2024	64.650	0,10
100.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN'			100.000	Credit Agricole SA/London 'EMTN'		
	0,125 % 05-Feb.-2024	112.161	0,18		1,750 % 05-März-2029	121.044	0,19
100.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN'			100.000	Credit Agricole SA/London 'EMTN'		
	1,875 % 18-Jun.-2029	115.805	0,18		3,125 % 17-Jul.-2023	123.324	0,20
50.000	Barclays Bank Plc 'EMTN' 6,625 % 30-März-2022	61.362	0,10	10.000	Daimler AG 'EMTN' 1,375 % 11-Mai-2028	11.279	0,02
100.000	Barclays Plc 'EMTN' FRN 3,375 % 02-Apr.-2025	120.621	0,19	15.000	Daimler AG 'EMTN' 1,500 % 03-Jul.-2029	17.054	0,03
10.000	BASF SE 0,875 % 15-Nov.-2027	11.846	0,02	25.000	Daimler AG 'EMTN' 2,125 % 03-Jul.-2037	29.350	0,05
5.000	BASF SE 1,625 % 15-Nov.-2037	6.256	0,01	10.000	Daimler AG 'EMTN' 2,375 % 08-März-2023	11.750	0,02

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener	Summe			Angemessener	Summe
		Wert	der Netto-			Wert	der Netto-
Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %	Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
Euro Forts.				Euro Forts.			
25.000	Daimler International Finance BV 'EMTN' 0,625 % 27-Feb.-2023	28.058	0,04	10.000	GE Capital European Funding Unlimited Co 'EMTN' 2,625 % 15-März-2023	11.770	0,02
10.000	Daimler International Finance BV 'EMTN' 0,625 % 06-Mai-2027	10.653	0,02	50.000	GE Capital European Funding Unlimited Co 'EMTN' 4,625 % 22-Feb.-2027	64.565	0,10
100.000	Danske Bank A/S 'EMTN' FRN 2,500 % 21-Jun.-2029	114.968	0,18	50.000	GE Capital European Funding Unlimited Co 'EMTN' 6,025 % 01-März-2038	73.229	0,12
100.000	Dassault Systemes SE 0,000 % 16-Sept.-2024	111.885	0,18	100.000	Gecina SA 'EMTN' 1,625 % 29-Mai-2034	116.326	0,19
20.000	Deutsche Bank AG 'MTN' 1,125 % 30-Aug.-2023	22.973	0,04	100.000	General Electric Co 1,250 % 26-Mai-2023	113.437	0,18
15.000	Deutsche Post AG 'EMTN' 1,250 % 01-Apr.-2026	17.883	0,03	10.000	General Electric Co 'EMTN' 4,125 % 19-Sept.-2035	12.664	0,02
10.000	Deutsche Post AG 'EMTN' 1,625 % 05-Dez.-2028	12.339	0,02	100.000	GlaxoSmithKline Capital Plc 'EMTN' 1,375 % 02-Dez.-2024	118.551	0,19
15.000	Deutsche Post AG 'EMTN' 2,750 % 09-Okt.-2023	18.486	0,03	30.000	GlaxoSmithKline Capital Plc 'EMTN' 4,000 % 16-Jun.-2025	40.138	0,06
15.000	Deutsche Telekom AG 'EMTN' 1,750 % 09-Dez.-2049	16.504	0,03	15.000	Goldman Sachs Group Inc/The 4,750 % 12-Okt.-2021	17.767	0,03
10.000	Deutsche Telekom AG 'EMTN' 2,250 % 29-März-2039	12.711	0,02	75.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 0,125 % 19-Aug.-2024	82.258	0,13
10.000	Deutsche Telekom International Finance BV 'EMTN' 0,625 % 03-Apr.-2023	11.381	0,02	25.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 1,375 % 15-Mai-2024	28.635	0,04
50.000	Deutsche Telekom International Finance BV 'EMTN' 0,875 % 30-Jan.-2024	57.719	0,09	15.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 2,000 % 27-Jul.-2023	17.579	0,03
15.000	Deutsche Telekom International Finance BV 'EMTN' 1,375 % 01-Dez.-2025	17.827	0,03	15.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 2,000 % 22-März-2028	18.199	0,03
15.000	Deutsche Telekom International Finance BV 'EMTN' 1,375 % 30-Jan.-2027	17.858	0,03	15.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' 2,000 % 01-Nov.-2028	18.259	0,03
60.000	Deutsche Telekom International Finance BV 'EMTN' 2,750 % 24-Okt.-2024	74.900	0,12	30.000	Grenke Finance Plc 'EMTN' 1,500 % 05-Okt.-2023	33.587	0,05
5.000	Deutsche Telekom International Finance BV 'EMTN' 4,500 % 28-Okt.-2030	7.611	0,01	20.000	HBOS Plc 'EMTN' FRN 4,500 % 18-März-2030	24.408	0,04
100.000	DH Europe Finance II Sarl 0,750 % 18-Sept.-2031	108.494	0,17	100.000	Heineken NV 'EMTN' 1,250 % 17-März-2027	117.688	0,19
100.000	DH Europe Finance II Sarl 1,350 % 18-Sept.-2039	107.600	0,17	10.000	Heineken NV 'EMTN' 3,500 % 19-März-2024	12.582	0,02
100.000	Digital Dutch Finco BV 0,625 % 15-Jul.-2025	111.105	0,18	40.000	Hella GmbH & Co KGaA 1,000 % 17-Mai-2024	45.858	0,07
100.000	Dow Chemical Co/The 1,125 % 15-März-2032	102.887	0,16	20.000	Henkel AG & Co KGaA 'EMTN' 0,000 % 13-Sept.-2021	22.495	0,04
5.000	E.ON SE 'EMTN' 0,000 % 29-Sept.-2022	5.603	0,01	10.000	HOCHTIEF AG 'EMTN' 0,500 % 03-Sept.-2027	11.144	0,02
5.000	E.ON SE 'EMTN' 0,000 % 18-Dez.-2023	5.571	0,01	20.000	HOCHTIEF AG 'EMTN' 1,750 % 03-Jul.-2025	23.711	0,04
5.000	E.ON SE 'EMTN' 0,250 % 24-Okt.-2026	5.582	0,01	100.000	HSBC France SA 'EMTN' 0,200 % 04-Sept.-2021	112.656	0,18
25.000	E.ON SE 'EMTN' 0,350 % 28-Feb.-2030	27.233	0,04	100.000	HSBC Holdings Plc 'EMTN' FRN 1,500 % 04-Dez.-2024	116.465	0,19
5.000	E.ON SE 'EMTN' 0,750 % 18-Dez.-2030	5.649	0,01	100.000	Iberdrola Finanzas SA 'EMTN' 1,000 % 07-März-2025	116.461	0,19
100.000	Edenred 1,875 % 06-März-2026	118.828	0,19	10.000	innogy Finance BV 'EMTN' 1,250 % 19-Okt.-2027	11.888	0,02
100.000	EDP Finance BV 'EMTN' 1,875 % 29-Sept.-2023	118.050	0,19	10.000	innogy Finance BV 'EMTN' 1,500 % 31-Jul.-2029	12.056	0,02
10.000	Enel Finance International NV 'EMTN' 5,250 % 29-Sept.-2023	13.067	0,02	10.000	innogy Finance BV 'EMTN' 3,000 % 17-Jan.-2024	12.339	0,02
50.000	Enel SpA 'EMTN' 5,625 % 21-Jun.-2027	76.228	0,12	5.000	innogy Finance BV 'EMTN' 5,750 % 14-Feb.-2033	8.822	0,01
15.000	Engie SA 'EMTN' 2,625 % 20-Jul.-2022	17.714	0,03	100.000	Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' 1,000 % 19-Nov.-2026	110.063	0,18
5.000	Engie SA 'EMTN' 3,000 % 01-Feb.-2023	6.040	0,01	100.000	JPMorgan Chase & Co 'EMTN' 2,750 % 24-Aug.-2022	118.483	0,19
10.000	Engie SA 'EMTN' 3,500 % 18-Okt.-2022	12.087	0,02	100.000	JPMorgan Chase & Co 'EMTN' FRN 1,638 % 18-Mai-2028	118.719	0,19
5.000	Engie SA 'EMTN' 5,950 % 16-März-2111	11.662	0,02	100.000	Koninklijke Ahold Delhaize NV 1,125 % 19-März-2026	116.808	0,19
100.000	Equinix Inc 2,875 % 15-März-2024	114.751	0,18	10.000	LANXESS AG 0,250 % 07-Okt.-2021	11.245	0,02
100.000	EssilorLuxottica SA 'EMTN' 0,125 % 27-Mai-2025	111.874	0,18	10.000	LANXESS AG 'EMTN' 1,000 % 07-Okt.-2026	11.533	0,02
15.000	Evonik Finance BV 'EMTN' 0,375 % 07-Sept.-2024	16.944	0,03	20.000	LANXESS AG 'EMTN' 1,125 % 16-Mai-2025	23.142	0,04
15.000	Evonik Finance BV 'EMTN' 0,750 % 07-Sept.-2028	17.018	0,03	10.000	LANXESS AG 'EMTN' 2,625 % 21-Nov.-2022	11.872	0,02
15.000	Evonik Industries AG 'EMTN' 1,000 % 23-Jan.-2023	17.184	0,03	100.000	Liberty Mutual Group Inc 'REGS' 2,750 % 04-Mai-2026	124.149	0,20
100.000	Fidelity National Information Services Inc 0,125 % 03-Dez.-2022	111.872	0,18	40.000	Linde Finance BV 'EMTN' 0,250 % 18-Jan.-2022	45.188	0,07
100.000	Fidelity National Information Services Inc 1,500 % 21-Mai-2027	116.343	0,19	10.000	Linde Finance BV 'EMTN' 1,875 % 22-Mai-2024	12.111	0,02
10.000	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA 'EMTN' 0,250 % 29-Nov.-2023	11.169	0,02	100.000	Lloyds Banking Group Plc 'EMTN' FRN 0,625 % 15-Jan.-2024	111.747	0,18
10.000	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA 'EMTN' 0,625 % 30-Nov.-2026	11.233	0,02	100.000	Luminor Bank AS/Estonia 'EMTN' 1,500 % 18-Okt.-2021	111.971	0,18
20.000	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA 'EMTN' 1,250 % 29-Nov.-2029	23.112	0,04	60.000	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE 'EMTN' 0,375 % 26-Mai-2022	67.785	0,11
20.000	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA 'EMTN' 1,500 % 11-Jul.-2025	23.610	0,04	30.000	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE 'EMTN' 0,750 % 26-Mai-2024	34.470	0,05

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener	Summe			Angemessener	Summe
		Wert	der Netto-			Wert	der Netto-
Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %	Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
Euro Forts.				Euro Forts.			
30.000	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE 'EMTN'			10.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 'EMTN'		
	1,000 % 24-Sept.-2021	34.068	0,05		0,375 % 06-Sept.-2023	11.370	0,02
100.000	McDonald's Corp 'GMTN' 1,750 % 03-Mai-2028	121.020	0,19	10.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 'EMTN'		
100.000	Merck & Co Inc 2,500 % 15-Okt.-2034	140.791	0,22		0,500 % 05-Sept.-2034	10.821	0,02
15.000	Merck KGaA FRN 2,625 % 12-Dez.-2074	16.963	0,03	100.000	Snam SpA 0,000 % 12-Mai-2024	111.149	0,18
30.000	Merck KGaA FRN 3,375 % 12-Dez.-2074	36.335	0,06	100.000	Societe Generale SA 'EMTN' 1,375 % 13-Jan.-2028	114.370	0,18
100.000	Metropolitan Life Global Funding I 0,375 % 09-Apr.-2024	113.157	0,18	100.000	Societe Generale SA 'EMTN' FRN		
100.000	Mondelez International Inc 1,625 % 08-März-2027	118.858	0,19		1,375 % 23-Feb.-2028	111.929	0,18
100.000	Morgan Stanley 'GMTN' 1,750 % 30-Jan.-2025	118.424	0,19	100.000	Storebrand Livsforsikring AS FRN		
100.000	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG				6,875 % 04-Apr.-2043	124.147	0,20
	in Muenchen FRN 3,250 % 26-Mai-2049	128.546	0,21	100.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 'EMTN'		
10.000	National Australia Bank Ltd 'EMTN'				0,465 % 30-Mai-2024	112.497	0,18
	2,750 % 08-Aug.-2022	11.905	0,02	100.000	Svenska Handelsbanken AB 'EMTN'		
10.000	National Australia Bank Ltd 'GMTN'				2,625 % 23-Aug.-2022	118.719	0,19
	0,625 % 10-Nov.-2023	11.471	0,02	25.000	Telefonica Europe BV 'EMTN' 5,875 % 14-Feb.-2033	43.396	0,07
10.000	National Australia Bank Ltd 'GMTN'			20.000	Telekom Finanzmanagement GmbH		
	0,875 % 20-Jan.-2022	11.405	0,02		4,000 % 04-Apr.-2022	23.962	0,04
5.000	National Australia Bank Ltd 'GMTN'			50.000	Telia Co AB 'EMTN' 3,875 % 01-Okt.-2025	65.934	0,10
	1,250 % 18-Mai-2026	5.998	0,01	100.000	Terna Rete Elettrica Nazionale SpA 'EMTN'		
100.000	Naturgy Finance BV 'EMTN' 3,875 % 17-Jan.-2023	122.571	0,20		1,000 % 23-Jul.-2023	114.744	0,18
10.000	Nestle Finance International Ltd 'EMTN'			100.000	Thermo Fisher Scientific Inc 0,125 % 01-März-2025	110.903	0,18
	0,375 % 18-Jan.-2024	11.415	0,02	100.000	Thermo Fisher Scientific Inc 1,750 % 15-Apr.-2027	120.034	0,19
10.000	Nestle Finance International Ltd 'EMTN'			100.000	TLG Immobilien AG 1,500 % 28-Mai-2026	112.641	0,18
	0,750 % 08-Nov.-2021	11.357	0,02	100.000	Total Capital International SA 'EMTN'		
10.000	Nestle Finance International Ltd 'EMTN'				0,750 % 12-Jul.-2028	114.720	0,18
	1,250 % 02-Nov.-2029	12.380	0,02	10.000	Total Capital SA 'EMTN' 3,125 % 16-Sept.-2022	11.989	0,02
5.000	Nestle Finance International Ltd 'EMTN'			50.000	Total Capital SA 'EMTN' 5,125 % 26-März-2024	66.571	0,11
	1,750 % 02-Nov.-2037	6.707	0,01	10.000	Toyota Motor Credit Corp 'EMTN'		
100.000	Nordea Bank Abp 'EMTN' 1,125 % 27-Sept.-2027	120.304	0,19		0,750 % 21-Jul.-2022	11.358	0,02
50.000	OMV AG 'EMTN' 0,000 % 03-Jul.-2025	55.465	0,09	10.000	Toyota Motor Credit Corp 'EMTN'		
10.000	OMV AG 'EMTN' 0,750 % 04-Dez.-2023	11.459	0,02		1,000 % 10-Sept.-2021	11.342	0,02
10.000	OMV AG 'EMTN' 1,000 % 14-Dez.-2026	11.721	0,02	10.000	Toyota Motor Credit Corp 'EMTN'		
10.000	OMV AG 'EMTN' 1,000 % 03-Jul.-2034	11.015	0,02		2,375 % 01-Feb.-2023	11.846	0,02
10.000	OMV AG 'EMTN' 1,875 % 04-Dez.-2028	12.381	0,02	100.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE 'EMTN'		
10.000	OMV AG 'EMTN' 4,250 % 12-Okt.-2021	11.830	0,02		2,500 % 12-Jun.-2023	116.769	0,19
100.000	Pernod Ricard SA 1,500 % 18-Mai-2026	118.840	0,19	100.000	UniCredit SpA 'EMTN' FRN 1,250 % 25-Jun.-2025	112.371	0,18
35.000	Peugeot SA 'EMTN' 2,000 % 23-März-2024	39.876	0,06	100.000	Veolia Environnement SA 'EMTN'		
15.000	Peugeot SA 'EMTN' 2,375 % 14-Apr.-2023	17.160	0,03		0,892 % 14-Jan.-2024	114.783	0,18
100.000	Philip Morris International Inc 3,125 % 03-Jun.-2033	131.794	0,21	5.000	Veolia Environnement SA 'EMTN'		
5.000	PSA Tresorerie GIE 6,000 % 19-Sept.-2033	7.345	0,01		5,125 % 24-Mai-2022	6.124	0,01
100.000	Raiffeisen Bank International AG 'EMTN'			5.000	Veolia Environnement SA 'EMTN'		
	0,250 % 05-Jul.-2021	112.346	0,18		6,125 % 25-Nov.-2033	9.205	0,01
100.000	Richemont International Holding SA			100.000	Verizon Communications Inc 1,875 % 26-Okt.-2029	123.169	0,20
	1,000 % 26-März-2026	117.661	0,19	100.000	Vivendi SA 'EMTN' 0,000 % 13-Jun.-2022	111.572	0,18
100.000	Sanofi 1,000 % 21-März-2026	118.545	0,19	15.000	Volkswagen Bank GmbH 'EMTN' 1,250 % 15-Dez.-2025	16.755	0,03
100.000	Santander Consumer Finance SA 'EMTN'			25.000	Volkswagen Financial Services AG 'EMTN'		
	1,000 % 27-Feb.-2024	113.866	0,18		0,750 % 14-Okt.-2021	28.090	0,04
100.000	SAP SE 1,250 % 10-März-2028	121.126	0,19	10.000	Volkswagen Financial Services AG 'EMTN'		
10.000	SAP SE 'EMTN' 1,000 % 01-Apr.-2025	11.750	0,02		2,250 % 01-Okt.-2027	11.845	0,02
10.000	SAP SE 'EMTN' 1,125 % 20-Feb.-2023	11.556	0,02	10.000	Volkswagen International Finance NV 'EMTN'		
10.000	SAP SE 'EMTN' 1,750 % 22-Feb.-2027	12.370	0,02		1,625 % 16-Jan.-2030	11.192	0,02
50.000	Schaeffler AG 'EMTN' 1,125 % 26-März-2022	54.771	0,09	20.000	Volkswagen International Finance NV FRN (Immerwährend)		
30.000	Schaeffler AG 'EMTN' 1,875 % 26-März-2024	32.752	0,05		2,500 % 20-März-2022	22.092	0,03
20.000	Schaeffler AG 'EMTN' 2,875 % 26-März-2027	22.369	0,03	35.000	Volkswagen International Finance NV FRN (Immerwährend)		
100.000	Schneider Electric SE 'EMTN' 1,500 % 08-Sept.-2023	117.195	0,19		4,625 % 24-März-2026	41.086	0,06
10.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV			15.000	Volkswagen Leasing GmbH 'EMTN'		
	0,125 % 05-Sept.-2029	10.954	0,02		0,500 % 20-Jun.-2022	16.682	0,03
10.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV			20.000	Volkswagen Leasing GmbH 'EMTN'		
	0,900 % 28-Feb.-2028	11.742	0,02		1,125 % 04-Apr.-2024	22.405	0,03

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener		Summe	Bestände	Beschreibung	Angemessener		Summe
		Wert	der Netto-				Wert	der Netto-	
		in USD	vermögen %				in USD	vermögen %	
Anleihen Forts.					Anleihen Forts.				
Euro Forts.					Sterling Forts.				
15.000	Volkswagen Leasing GmbH 'EMTN'				30.000	Legal & General Finance Plc 'EMTN'			
	2,125 % 04-Apr.-2022	17.196	0,03			5,875 % 11-Dez.-2031	54.399	0,09	
15.000	Vonovia Finance BV 1,500 % 31-März-2025	17.696	0,03		100.000	Liberty Living Finance Plc 2,625 % 28-Nov.-2024	125.510	0,20	
60.000	Vonovia Finance BV 2,125 % 09-Jul.-2022	69.881	0,11		5.000	Lloyds Bank Plc 'EMTN' 6,500 % 17-Sept.-2040	7.420	0,01	
100.000	Vonovia Finance BV 'EMTN' 0,500 % 14-Sept.-2029	108.414	0,17		15.000	Lloyds Bank Plc 'EMTN' 7,625 % 22-Apr.-2025	23.034	0,04	
100.000	Wells Fargo & Co 'EMTN' 1,375 % 26-Okt.-2026	116.126	0,19		50.000	London & Quadrant Housing Trust			
100.000	Westpac Banking Corp 'EMTN' 0,875 % 17-Apr.-2027	118.108	0,19			5,500 % 27-Jan.-2040	94.973	0,15	
100.000	WPC Eurobond BV 2,250 % 09-Apr.-2026	117.982	0,19		8.000	McDonald's Corp 'EMTN' 5,875 % 23-Apr.-2032	14.421	0,02	
20.000	Würth Finance International BV 'EMTN'				50.000	Motability Operations Group Plc 'EMTN'			
	1,000 % 26-Mai-2025	23.293	0,04			5,375 % 28-Jun.-2022	67.529	0,11	
Sterling - 2.888.888					50.000	Orange SA 'EMTN' 5,375 % 22-Nov.-2050	107.996	0,17	
50.000	Affinity Sutton Capital Markets Plc 'EMTN'				10.000	Prudential Plc 'EMTN' 6,125 % 19-Dez.-2031	15.998	0,03	
	5,981 % 17-Sept.-2038	101.851	0,16		5.000	Severn Trent Utilities Finance Plc			
5.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN'					6,250 % 07-Jun.-2029	8.808	0,01	
	1,750 % 07-März-2025	6.398	0,01		50.000	Sky Ltd 'EMTN' 6,000 % 21-Mai-2027	82.564	0,13	
5.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN'				10.000	South Eastern Power Networks Plc 'EMTN'			
	2,250 % 24-Mai-2029	6.425	0,01			5,500 % 05-Jun.-2026	15.347	0,03	
5.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN'				15.000	SSE Plc 5,875 % 22-Sept.-2022	20.631	0,03	
	2,850 % 25-Mai-2037	6.624	0,01		10.000	Sunderland SHG Finance Plc 6,380 % 31-März-2042	18.153	0,03	
50.000	AT&T Inc 'EMTN' 7,000 % 30-Apr.-2040	100.896	0,16		50.000	Thames Water Utilities Finance Plc 'EMTN'			
10.000	Aviva Plc FRN 6,125 % 14-Nov.-2036	14.648	0,02			5,125 % 28-Sept.-2037	88.627	0,14	
10.000	Aviva Plc FRN (Immerwährend) 6,125 % 29-Sept.-2022	13.258	0,02		10.000	Thames Water Utilities Finance Plc 'EMTN'			
50.000	AXA SA 'EMTN' FRN (Immerwährend) 6,686 % 06-Jul.-2026	73.637	0,12			6,750 % 16-Nov.-2028	17.326	0,03	
20.000	Barclays Bank Plc 9,500 % 07-Aug.-2021	26.674	0,04		20.000	THFC Funding No 1 Plc 5,125 % 21-Dez.-2035	36.293	0,06	
35.000	Barclays Bank Plc 'EMTN' 5,750 % 14-Sept.-2026	50.703	0,08		5.000	United Utilities Water Ltd 'EMTN' 5,625 % 20-Dez.-2027	8.216	0,01	
50.000	BAT International Finance Plc 'EMTN'				100.000	Verizon Communications Inc 2,500 % 08-Apr.-2031	136.169	0,22	
	7,250 % 12-März-2024	75.146	0,12		5.000	Vodafone Group Plc 'EMTN' 5,625 % 04-Dez.-2025	7.683	0,01	
20.000	Citigroup Inc 'EMTN' 5,150 % 21-Mai-2026	29.938	0,05		10.000	Volkswagen Financial Services NV 'EMTN'			
50.000	Cooperatieve Rabobank UA 'EMTN'					1,750 % 12-Sept.-2022	12.461	0,02	
	4,875 % 10-Jan.-2023	68.253	0,11		5.000	Volkswagen Financial Services NV 'EMTN'			
100.000	Credit Suisse Group AG FRN 2,125 % 12-Sept.-2025	126.475	0,20			2,250 % 12-Apr.-2025	6.325	0,01	
5.000	E.ON International Finance BV 'EMTN'				10.000	Walmart Inc 5,250 % 28-Sept.-2035	19.519	0,03	
	6,375 % 07-Jun.-2032	9.277	0,02		50.000	Wellcome Trust Finance Plc 4,625 % 25-Jul.-2036	98.747	0,16	
50.000	Enel Finance International NV 'EMTN'				50.000	Wells Fargo Bank NA 'EMTN' 5,250 % 01-Aug.-2023	68.904	0,11	
	5,625 % 14-Aug.-2024	73.043	0,12		5.000	Wessex Water Services Finance Plc			
50.000	Enel Finance International NV 'EMTN'					5,375 % 10-März-2028	8.056	0,01	
	5,750 % 14-Sept.-2040	96.060	0,15		US-Dollar - 42.922.067				
50.000	Enel SpA 'EMTN' 5,750 % 22-Jun.-2037	93.133	0,15		60.000	3M Co 2,375 % 26-Aug.-2029	64.897	0,10	
50.000	Engie SA 'EMTN' 5,000 % 01-Okt.-2060	119.336	0,19		50.000	3M Co 2,650 % 15-Apr.-2025	54.109	0,09	
20.000	Freshwater Finance Plc 5,182 % 20-Apr.-2035	34.468	0,06		50.000	3M Co 3,050 % 15-Apr.-2030	56.677	0,09	
5.000	General Electric Co 'EMTN' 5,250 % 07-Dez.-2028	7.148	0,01		5.000	3M Co 'MTN' 2,250 % 15-März-2023	5.228	0,01	
100.000	GlaxoSmithKline Capital Plc 'EMTN'				30.000	3M Co 'MTN' 2,250 % 19-Sept.-2026	32.336	0,05	
	4,250 % 18-Dez.-2045	190.466	0,31		30.000	3M Co 'MTN' 3,000 % 07-Aug.-2025	33.241	0,05	
15.000	GlaxoSmithKline Capital Plc 'EMTN'				5.000	3M Co 'MTN' 5,700 % 15-März-2037	7.108	0,01	
	5,250 % 19-Dez.-2033	27.669	0,05		10.000	ABB Finance USA Inc 2,875 % 08-Mai-2022	10.390	0,02	
5.000	Goldman Sachs Group Inc/The 5,500 % 12-Okt.-2021	6.498	0,01		50.000	Abbott Laboratories 1,150 % 30-Jan.-2028	50.168	0,08	
50.000	Goldman Sachs Group Inc/The 7,125 % 07-Aug.-2025	79.409	0,13		50.000	Abbott Laboratories 1,400 % 30-Jun.-2030	49.822	0,08	
15.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN'				15.000	Abbott Laboratories 3,400 % 30-Nov.-2023	16.347	0,03	
	3,125 % 25-Jul.-2029	20.587	0,03		40.000	Abbott Laboratories 3,875 % 15-Sept.-2025	46.076	0,07	
5.000	Hammerson Plc 6,000 % 23-Feb.-2026	6.151	0,01		20.000	Abbott Laboratories 6,000 % 01-Apr.-2039	30.074	0,05	
50.000	Heathrow Funding Ltd 'EMTN' 6,750 % 03-Dez.-2026	77.632	0,13		10.000	Abbott Laboratories 6,150 % 30-Nov.-2037	15.219	0,02	
30.000	HSBC Bank Capital Funding Sterling 1 LP FRN				35.000	AbbVie Inc 2,900 % 06-Nov.-2022	36.735	0,06	
	(Immerwährend) 5,844 % 05-Nov.-2031	49.580	0,08		15.000	AbbVie Inc 3,375 % 14-Nov.-2021	15.544	0,02	
15.000	HSBC Bank Plc 'EMTN' 6,500 % 07-Jul.-2023	21.002	0,03		60.000	AbbVie Inc 3,600 % 14-Mai-2025	66.389	0,11	
30.000	HSBC Bank Plc 'EMTN' FRN 5,375 % 04-Nov.-2030	43.127	0,07		40.000	AbbVie Inc 3,750 % 14-Nov.-2023	43.504	0,07	
10.000	HSBC Holdings Plc 'EMTN' 5,750 % 20-Dez.-2027	14.863	0,02		40.000	AbbVie Inc 4,250 % 14-Nov.-2028	46.851	0,08	
10.000	innogy Finance BV 'EMTN' 5,625 % 06-Dez.-2023	14.320	0,02		10.000	AbbVie Inc 4,400 % 06-Nov.-2042	11.986	0,02	
10.000	innogy Finance BV 'EMTN' 6,250 % 03-Jun.-2030	17.587	0,03						

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener	Summe			Angemessener	Summe
		Wert	der Netto-			Wert	der Netto-
Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %	Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.				US-Dollar Forts.			
15.000	AbbVie Inc 4,450 % 14-Mai-2046	18.363	0,03	15.000	Allstate Corp/The 3,280 % 15-Dez.-2026	17.091	0,03
20.000	AbbVie Inc 4,700 % 14-Mai-2045	25.179	0,04	60.000	Allstate Corp/The FRN 5,750 % 15-Aug.-2053	62.098	0,10
20.000	AbbVie Inc 4,875 % 14-Nov.-2048	26.309	0,04	45.000	Allstate Corp/The FRN 6,500 % 15-Mai-2057	54.635	0,09
50.000	AbbVie Inc '144A' 2,150 % 19-Nov.-2021	50.961	0,08	30.000	Ally Financial Inc 4,125 % 13-Feb.-2022	30.838	0,05
35.000	AbbVie Inc '144A' 2,300 % 21-Nov.-2022	36.220	0,06	20.000	Alphabet Inc 1,998 % 15-Aug.-2026	21.445	0,03
60.000	AbbVie Inc '144A' 2,600 % 21-Nov.-2024	63.736	0,10	40.000	Alphabet Inc 3,375 % 25-Feb.-2024	44.033	0,07
45.000	AbbVie Inc '144A' 2,950 % 21-Nov.-2026	48.986	0,08	25.000	Altera Corp 4,100 % 15-Nov.-2023	28.027	0,04
45.000	AbbVie Inc '144A' 3,200 % 21-Nov.-2029	49.716	0,08	65.000	Altria Group Inc 2,350 % 06-Mai-2025	68.380	0,11
50.000	AbbVie Inc '144A' 3,250 % 01-Okt.-2022	52.423	0,08	40.000	Altria Group Inc 2,850 % 09-Aug.-2022	41.691	0,07
60.000	AbbVie Inc '144A' 3,450 % 15-März-2022	62.427	0,10	20.000	Altria Group Inc 3,490 % 14-Feb.-2022	20.875	0,03
15.000	AbbVie Inc '144A' 3,800 % 15-März-2025	16.660	0,03	40.000	Altria Group Inc 3,800 % 14-Feb.-2024	43.764	0,07
40.000	AbbVie Inc '144A' 3,850 % 15-Jun.-2024	43.860	0,07	20.000	Altria Group Inc 3,875 % 16-Sept.-2046	20.007	0,03
25.000	AbbVie Inc '144A' 4,050 % 21-Nov.-2039	29.276	0,05	45.000	Altria Group Inc 4,000 % 31-Jan.-2024	49.607	0,08
40.000	AbbVie Inc '144A' 4,250 % 21-Nov.-2049	48.704	0,08	10.000	Altria Group Inc 4,250 % 09-Aug.-2042	10.622	0,02
20.000	AbbVie Inc '144A' 4,550 % 15-März-2035	24.320	0,04	45.000	Altria Group Inc 4,800 % 14-Feb.-2029	52.576	0,08
5.000	AbbVie Inc '144A' 4,625 % 01-Okt.-2042	6.104	0,01	40.000	Altria Group Inc 5,375 % 31-Jan.-2044	48.243	0,08
5.000	Activision Blizzard Inc 2,300 % 15-Sept.-2021	5.098	0,01	15.000	Altria Group Inc 5,800 % 14-Feb.-2039	18.572	0,03
5.000	Adobe Inc 1,700 % 01-Feb.-2023	5.179	0,01	10.000	Altria Group Inc 5,950 % 14-Feb.-2049	13.136	0,02
45.000	Adobe Inc 1,900 % 01-Feb.-2025	47.550	0,08	15.000	Altria Group Inc 6,200 % 14-Feb.-2059	20.077	0,03
20.000	Adobe Inc 2,150 % 01-Feb.-2027	21.489	0,03	50.000	Amazon.com Inc 1,500 % 03-Jun.-2030	50.719	0,08
25.000	Adobe Inc 2,300 % 01-Feb.-2030	27.034	0,04	25.000	Amazon.com Inc 2,500 % 03-Jun.-2050	25.800	0,04
45.000	Adobe Inc 3,250 % 01-Feb.-2025	50.060	0,08	30.000	Amazon.com Inc 2,700 % 03-Jun.-2060	30.703	0,05
30.000	Advance Auto Parts Inc 4,500 % 15-Jan.-2022	31.473	0,05	10.000	Amazon.com Inc 2,800 % 22-Aug.-2024	10.871	0,02
50.000	AerCap Ireland Capital DAC /			10.000	Amazon.com Inc 4,250 % 22-Aug.-2057	13.376	0,02
	AerCap Global Aviation Trust 4,125 % 03-Jul.-2023	48.930	0,08	15.000	Amazon.com Inc 5,200 % 03-Dez.-2025	18.432	0,03
50.000	AerCap Ireland Capital DAC /			20.000	Ancor Finance USA Inc 4,500 % 15-Mai-2028	23.019	0,04
	AerCap Global Aviation Trust 5,000 % 01-Okt.-2021	50.586	0,08	10.000	Ameren Corp 2,500 % 15-Sept.-2024	10.609	0,02
25.000	Aetna Inc 2,800 % 15-Jun.-2023	26.377	0,04	25.000	Ameren Illinois Co 2,700 % 01-Sept.-2022	25.993	0,04
20.000	Aetna Inc 3,875 % 15-Aug.-2047	22.621	0,04	15.000	Ameren Illinois Co 3,250 % 01-März-2025	16.413	0,03
10.000	Aetna Inc 6,625 % 15-Jun.-2036	14.177	0,02	10.000	America Movil SAB de CV 6,375 % 01-März-2035	14.604	0,02
5.000	Affiliated Managers Group Inc 4,250 % 15-Feb.-2024	5.436	0,01	20.000	American Electric Power Co Inc		
30.000	Aflac Inc 3,250 % 17-März-2025	33.642	0,05		4,300 % 01-Dez.-2028	23.536	0,04
30.000	Aflac Inc 3,625 % 15-Jun.-2023	32.835	0,05	35.000	American Express Co 2,650 % 02-Dez.-2022	36.672	0,06
10.000	Agilent Technologies Inc 3,200 % 01-Okt.-2022	10.459	0,02	50.000	American Express Co 2,750 % 20-Mai-2022	51.926	0,08
5.000	Ahold Finance USA LLC 6,875 % 01-Mai-2029	6.935	0,01	20.000	American Express Co 3,400 % 27-Feb.-2023	21.405	0,03
30.000	Air Lease Corp 3,375 % 01-Jun.-2021	30.125	0,05	20.000	American Express Co 3,700 % 03-Aug.-2023	21.763	0,03
25.000	Air Lease Corp 3,625 % 01-Apr.-2027	24.556	0,04	45.000	American Express Credit Corp 'MTN'		
50.000	Air Lease Corp 3,625 % 01-Dez.-2027	48.855	0,08		2,700 % 03-März-2022	46.602	0,07
50.000	Air Lease Corp 3,750 % 01-Feb.-2022	50.592	0,08	50.000	American Homes 4 Rent LP 4,250 % 15-Feb.-2028	53.540	0,09
30.000	Air Lease Corp 3,875 % 03-Jul.-2023	30.550	0,05	10.000	American Homes 4 Rent LP 4,900 % 15-Feb.-2029	11.168	0,02
55.000	Air Lease Corp 4,250 % 15-Sept.-2024	55.907	0,09	30.000	American Tower Corp 2,250 % 15-Jan.-2022	30.755	0,05
65.000	Air Lease Corp 'MTN' 2,300 % 01-Feb.-2025	62.297	0,10	10.000	American Tower Corp 2,400 % 15-März-2025	10.569	0,02
50.000	Air Lease Corp 'MTN' 4,250 % 01-Feb.-2024	51.484	0,08	30.000	American Tower Corp 2,750 % 15-Jan.-2027	32.247	0,05
20.000	Air Products and Chemicals Inc			10.000	American Tower Corp 2,900 % 15-Jan.-2030	10.695	0,02
	2,700 % 15-Mai-2040	21.091	0,03	20.000	American Tower Corp 2,950 % 15-Jan.-2025	21.768	0,03
20.000	Aircastle Ltd 4,125 % 01-Mai-2024	18.812	0,03	15.000	American Tower Corp 3,375 % 15-Okt.-2026	16.697	0,03
30.000	Albemarle Corp 4,150 % 01-Dez.-2024	32.187	0,05	5.000	American Tower Corp 3,450 % 15-Sept.-2021	5.175	0,01
20.000	Alexandria Real Estate Equities Inc			20.000	American Tower Corp 3,800 % 15-Aug.-2029	22.679	0,04
	2,750 % 15-Dez.-2029	21.370	0,03	20.000	American Tower Corp 3,950 % 15-März-2029	22.797	0,04
20.000	Alexandria Real Estate Equities Inc			10.000	American Tower Corp 4,000 % 01-Jun.-2025	11.233	0,02
	3,950 % 15-Jan.-2028	22.845	0,04	10.000	American Tower Corp 4,400 % 15-Feb.-2026	11.568	0,02
10.000	Alexandria Real Estate Equities Inc			50.000	American Tower Corp 4,700 % 15-März-2022	53.478	0,09
	4,000 % 01-Feb.-2050	12.231	0,02	15.000	American Tower Corp 5,000 % 15-Feb.-2024	17.121	0,03
10.000	Alexandria Real Estate Equities Inc			50.000	American Water Capital Corp 3,400 % 01-März-2025	55.602	0,09
	4,850 % 15-Apr.-2049	13.141	0,02	20.000	American Water Capital Corp 3,450 % 01-Jun.-2029	22.942	0,04
50.000	Alibaba Group Holding Ltd 3,125 % 28-Nov.-2021	51.453	0,08	50.000	American Water Capital Corp 3,850 % 01-März-2024	55.468	0,09
75.000	Alibaba Group Holding Ltd 3,400 % 06-Dez.-2027	83.375	0,13	20.000	American Water Capital Corp 4,150 % 01-Jun.-2049	24.852	0,04
100.000	Alibaba Group Holding Ltd 3,600 % 28-Nov.-2024	109.135	0,17	30.000	Amgen Inc 1,900 % 21-Feb.-2025	31.367	0,05
30.000	Allstate Corp/The 3,150 % 15-Jun.-2023	32.201	0,05	45.000	Amgen Inc 2,200 % 21-Feb.-2027	47.527	0,08

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener	Summe			Angemessener	Summe
Bestände	Beschreibung	Wert in USD	der Netto- vermögen %	Bestände	Beschreibung	Wert in USD	der Netto- vermögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.				US-Dollar Forts.			
15.000	Amgen Inc 2,650 % 11-Mai-2022	15.536	0,02	20.000	AT&T Inc 3,600 % 15-Jul.-2025	22.232	0,04
5.000	Amgen Inc 2,700 % 01-Mai-2022	5.173	0,01	50.000	AT&T Inc 3,800 % 15-Feb.-2027	56.362	0,09
40.000	Amgen Inc 3,125 % 01-Mai-2025	44.010	0,07	10.000	AT&T Inc 3,875 % 15-Jan.-2026	11.275	0,02
10.000	Amgen Inc 3,150 % 21-Feb.-2040	10.779	0,02	15.000	AT&T Inc 3,900 % 11-März-2024	16.580	0,03
15.000	Amgen Inc 3,375 % 21-Feb.-2050	16.807	0,03	35.000	AT&T Inc 3,950 % 15-Jan.-2025	39.217	0,06
10.000	Amgen Inc 3,625 % 15-Mai-2022	10.467	0,02	45.000	AT&T Inc 4,100 % 15-Feb.-2028	51.511	0,08
50.000	Amgen Inc 3,625 % 22-Mai-2024	54.860	0,09	30.000	AT&T Inc 4,125 % 17-Feb.-2026	34.213	0,05
16.571	Amgen Inc 3,875 % 15-Nov.-2021	17.194	0,03	15.000	AT&T Inc 4,250 % 01-März-2027	17.097	0,03
10.000	Amgen Inc 4,400 % 01-Mai-2045	12.462	0,02	15.000	AT&T Inc 4,300 % 15-Feb.-2030	17.593	0,03
20.000	Amgen Inc 4,563 % 15-Jun.-2048	26.134	0,04	10.000	AT&T Inc 4,300 % 15-Dez.-2042	11.208	0,02
40.000	Amgen Inc 4,663 % 15-Jun.-2051	53.423	0,09	35.000	AT&T Inc 4,350 % 01-März-2029	40.838	0,07
10.000	Amgen Inc 4,950 % 01-Okt.-2041	12.987	0,02	15.000	AT&T Inc 4,350 % 15-Jun.-2045	16.906	0,03
10.000	Amgen Inc 5,750 % 15-März-2040	13.811	0,02	30.000	AT&T Inc 4,450 % 01-Apr.-2024	33.722	0,05
15.000	Amgen Inc 6,400 % 01-Feb.-2039	21.906	0,04	40.000	AT&T Inc 4,500 % 09-März-2048	47.362	0,08
50.000	Amphenol Corp 2,800 % 15-Feb.-2030	53.274	0,09	35.000	AT&T Inc 4,550 % 09-März-2049	41.335	0,07
50.000	Amphenol Corp 3,200 % 01-Apr.-2024	53.599	0,09	10.000	AT&T Inc 4,650 % 01-Jun.-2044	11.465	0,02
15.000	Analog Devices Inc 2,875 % 01-Jun.-2023	15.719	0,03	20.000	AT&T Inc 4,750 % 15-Mai-2046	24.014	0,04
5.000	Analog Devices Inc 3,500 % 05-Dez.-2026	5.594	0,01	15.000	AT&T Inc 4,800 % 15-Jun.-2044	17.790	0,03
30.000	Analog Devices Inc 5,300 % 15-Dez.-2045	40.561	0,06	10.000	AT&T Inc 4,850 % 01-März-2039	12.077	0,02
40.000	Anthem Inc 2,375 % 15-Jan.-2025	42.481	0,07	25.000	AT&T Inc 4,850 % 15-Jul.-2045	29.821	0,05
50.000	Anthem Inc 3,300 % 15-Jan.-2023	53.287	0,09	20.000	AT&T Inc 4,900 % 15-Aug.-2037	24.093	0,04
50.000	Anthem Inc 4,375 % 01-Dez.-2047	62.320	0,10	10.000	AT&T Inc 5,150 % 15-März-2042	12.500	0,02
10.000	Anthem Inc 4,550 % 01-März-2048	12.739	0,02	10.000	AT&T Inc 5,150 % 15-Nov.-2046	12.406	0,02
35.000	Anthem Inc 6,375 % 15-Jun.-2037	48.430	0,08	20.000	AT&T Inc 5,150 % 15-Feb.-2050	25.689	0,04
5.000	Aon Corp 3,750 % 02-Mai-2029	5.733	0,01	20.000	AT&T Inc 5,250 % 01-März-2037	24.757	0,04
25.000	Aon Plc 3,500 % 14-Jun.-2024	27.177	0,04	10.000	AT&T Inc 5,450 % 01-März-2047	13.106	0,02
5.000	Aon Plc 4,000 % 27-Nov.-2023	5.471	0,01	10.000	AT&T Inc 5,550 % 15-Aug.-2041	12.937	0,02
10.000	Aon Plc 4,750 % 15-Mai-2045	12.532	0,02	10.000	AT&T Inc 5,650 % 15-Feb.-2047	13.095	0,02
25.000	Appalachian Power Co 3,300 % 01-Jun.-2027	27.024	0,04	15.000	AT&T Inc 5,700 % 01-März-2057	20.592	0,03
45.000	Appalachian Power Co 7,000 % 01-Apr.-2038	67.114	0,11	10.000	AT&T Inc 6,000 % 15-Aug.-2040	13.601	0,02
5.000	Apple Inc 2,150 % 09-Feb.-2022	5.146	0,01	25.000	AT&T Inc 6,100 % 15-Jul.-2040	33.416	0,05
50.000	Apple Inc 2,200 % 11-Sept.-2029	53.621	0,09	15.000	AT&T Inc 6,375 % 01-März-2041	21.308	0,03
30.000	Apple Inc 2,400 % 03-Mai-2023	31.725	0,05	25.000	AutoZone Inc 2,875 % 15-Jan.-2023	25.852	0,04
10.000	Apple Inc 2,500 % 09-Feb.-2022	10.341	0,02	30.000	AutoZone Inc 3,125 % 18-Apr.-2024	31.652	0,05
5.000	Apple Inc 2,500 % 09-Feb.-2025	5.386	0,01	5.000	AutoZone Inc 3,700 % 15-Apr.-2022	5.232	0,01
25.000	Apple Inc 2,750 % 13-Jan.-2025	27.170	0,04	25.000	AutoZone Inc 3,750 % 01-Jun.-2027	28.058	0,04
25.000	Apple Inc 3,200 % 13-Mai-2025	27.911	0,04	25.000	AutoZone Inc 3,750 % 18-Apr.-2029	28.453	0,05
30.000	Apple Inc 3,250 % 23-Feb.-2026	33.627	0,05	20.000	AvalonBay Communities Inc 'GMTN'		
20.000	Apple Inc 3,350 % 09-Feb.-2027	22.804	0,04		4,200 % 15-Dez.-2023	22.000	0,04
20.000	Apple Inc 3,450 % 06-Mai-2024	22.080	0,04	5.000	AvalonBay Communities Inc 'MTN'		
10.000	Apple Inc 4,500 % 23-Feb.-2036	13.222	0,02		2,300 % 01-März-2030	5.260	0,01
25.000	Applied Materials Inc 5,100 % 01-Okt.-2035	34.880	0,06	10.000	AvalonBay Communities Inc 'MTN'		
20.000	APT Pipelines Ltd '144A' 4,200 % 23-März-2025	21.954	0,04		3,200 % 15-Jan.-2028	11.118	0,02
15.000	Aptiv Corp 4,150 % 15-März-2024	16.020	0,03	10.000	AvalonBay Communities Inc 'MTN'		
25.000	Aptiv Plc 4,350 % 15-März-2029	26.800	0,04		3,300 % 01-Jun.-2029	11.288	0,02
10.000	Ares Capital Corp 3,250 % 15-Jul.-2025	9.716	0,02	35.000	Avangrid Inc 3,200 % 15-Apr.-2025	38.319	0,06
10.000	Ares Capital Corp 4,250 % 01-März-2025	10.236	0,02	25.000	Avery Dennison Corp 4,875 % 06-Dez.-2028	29.910	0,05
10.000	Arizona Public Service Co 2,600 % 15-Aug.-2029	10.580	0,02	10.000	Aviation Capital Group LLC '144A'		
65.000	AstraZeneca Plc 2,375 % 12-Jun.-2022	67.323	0,11		2,875 % 20-Jan.-2022	9.559	0,02
30.000	AstraZeneca Plc 3,125 % 12-Jun.-2027	33.463	0,05	30.000	Aviation Capital Group LLC '144A'		
15.000	AstraZeneca Plc 3,375 % 16-Nov.-2025	16.871	0,03		3,875 % 01-Mai-2023	28.525	0,05
10.000	AstraZeneca Plc 4,000 % 17-Jan.-2029	12.261	0,02	25.000	Aviation Capital Group LLC '144A'		
20.000	AstraZeneca Plc 4,000 % 18-Sept.-2042	24.508	0,04		4,375 % 30-Jan.-2024	23.513	0,04
20.000	AstraZeneca Plc 4,375 % 16-Nov.-2045	26.100	0,04	25.000	Aviation Capital Group LLC '144A'		
20.000	AstraZeneca Plc 6,450 % 15-Sept.-2037	30.449	0,05		4,875 % 01-Okt.-2025	22.927	0,04
30.000	AT&T Inc 2,625 % 01-Dez.-2022	31.276	0,05	10.000	Avolon Holdings Funding Ltd '144A'		
30.000	AT&T Inc 3,000 % 30-Jun.-2022	31.341	0,05		2,875 % 15-Feb.-2025	8.409	0,01
55.000	AT&T Inc 3,400 % 15-Mai-2025	60.482	0,10	10.000	Avolon Holdings Funding Ltd '144A'		
20.000	AT&T Inc 3,600 % 17-Feb.-2023	21.482	0,03		3,950 % 01-Jul.-2024	8.696	0,01

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener	Summe			Angemessener	Summe
		Wert	der Netto-			Wert	der Netto-
Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %	Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.				US-Dollar Forts.			
10.000	Avolon Holdings Funding Ltd '144A' 5,125 % 01-Okt.-2023	9.262	0,01	50.000	Berkshire Hathaway Finance Corp 1,850 % 12-März-2030	51.476	0,08
10.000	AXIS Specialty Finance LLC FRN 4,900 % 15-Jan.-2040	9.404	0,01	35.000	Berkshire Hathaway Finance Corp 5,750 % 15-Jan.-2040	53.147	0,09
50.000	Bank of America Corp 3,950 % 21-Apr.-2025	55.402	0,09	45.000	Berkshire Hathaway Inc 2,750 % 15-März-2023	47.674	0,08
50.000	Bank of America Corp 4,183 % 25-Nov.-2027	57.288	0,09	20.000	Berkshire Hathaway Inc 3,000 % 11-Feb.-2023	21.351	0,03
40.000	Bank of America Corp 4,750 % 21-Apr.-2045	52.997	0,08	20.000	Berkshire Hathaway Inc 3,125 % 15-März-2026	22.388	0,04
50.000	Bank of America Corp FRN 3,004 % 20-Dez.-2023	52.546	0,08	50.000	Berkshire Hathaway Inc 3,750 % 15-Aug.-2021	51.906	0,08
50.000	Bank of America Corp FRN 3,366 % 23-Jan.-2026	54.645	0,09	20.000	Biogen Inc 2,250 % 01-Mai-2030	20.207	0,03
20.000	Bank of America Corp FRN 3,419 % 20-Dez.-2028	22.292	0,04	35.000	Biogen Inc 5,200 % 15-Sept.-2045	45.961	0,07
25.000	Bank of America Corp FRN 3,550 % 05-März-2024	26.734	0,04	5.000	Black Hills Corp 3,050 % 15-Okt.-2029	5.301	0,01
15.000	Bank of America Corp FRN 4,244 % 24-Apr.-2038	18.250	0,03	10.000	Black Hills Corp 4,250 % 30-Nov.-2023	10.900	0,02
50.000	Bank of America Corp 'GMTN' 3,300 % 11-Jan.-2023	53.383	0,09	30.000	BlackRock Inc 2,400 % 30-Apr.-2030	32.404	0,05
35.000	Bank of America Corp 'MTN' 2,503 % 21-Okt.-2022	35.841	0,06	30.000	BlackRock Inc 3,250 % 30-Apr.-2029	34.525	0,06
50.000	Bank of America Corp 'MTN' 3,248 % 21-Okt.-2027	55.175	0,09	45.000	Booking Holdings Inc 3,600 % 01-Jun.-2026	49.422	0,08
50.000	Bank of America Corp 'MTN' 3,875 % 01-Aug.-2025	56.678	0,09	20.000	Booking Holdings Inc 3,650 % 15-März-2025	21.976	0,04
25.000	Bank of America Corp 'MTN' 4,125 % 22-Jan.-2024	27.781	0,04	50.000	Booking Holdings Inc 4,100 % 13-Apr.-2025	56.180	0,09
50.000	Bank of America Corp 'MTN' 4,200 % 26-Aug.-2024	55.542	0,09	50.000	Booking Holdings Inc 4,500 % 13-Apr.-2027	57.512	0,09
50.000	Bank of America Corp 'MTN' 4,250 % 22-Okt.-2026	57.401	0,09	50.000	Booking Holdings Inc 4,625 % 13-Apr.-2030	59.133	0,09
20.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN 3,559 % 23-Apr.-2027	22.333	0,04	15.000	Boston Properties LP 3,650 % 01-Feb.-2026	16.622	0,03
55.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN 3,824 % 20-Jan.-2028	62.462	0,10	20.000	Boston Properties LP 3,800 % 01-Feb.-2024	21.716	0,03
20.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN 3,864 % 23-Jul.-2024	21.683	0,03	30.000	Boston Scientific Corp 3,375 % 15-Mai-2022	31.362	0,05
50.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN 3,970 % 05-März-2029	57.361	0,09	20.000	Boston Scientific Corp 3,750 % 01-März-2026	22.728	0,04
50.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN 3,974 % 07-Feb.-2030	58.260	0,09	10.000	Boston Scientific Corp 3,850 % 15-Mai-2025	11.259	0,02
10.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN 4,078 % 23-Apr.-2040	12.175	0,02	20.000	Boston Scientific Corp 4,000 % 01-März-2029	22.901	0,04
15.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN 4,271 % 23-Jul.-2029	17.704	0,03	15.000	Boston Scientific Corp 4,550 % 01-März-2039	18.465	0,03
50.000	Bank of Montreal 3,300 % 05-Feb.-2024	54.343	0,09	20.000	Boston Scientific Corp 4,700 % 01-März-2049	25.559	0,04
50.000	Bank of Montreal FRN 4,338 % 05-Okt.-2028	53.427	0,09	50.000	BP Capital Markets America Inc 2,112 % 16-Sept.-2021	50.966	0,08
10.000	Bank of Montreal 'MTN' 1,900 % 27-Aug.-2021	10.173	0,02	35.000	BP Capital Markets America Inc 2,750 % 10-Mai-2023	36.996	0,06
20.000	Bank of Montreal 'MTN' 2,050 % 01-Nov.-2022	20.668	0,03	20.000	BP Capital Markets America Inc 2,937 % 06-Apr.-2023	21.161	0,03
65.000	Bank of Montreal 'MTN' 2,350 % 11-Sept.-2022	67.958	0,11	20.000	BP Capital Markets America Inc 3,119 % 04-Mai-2026	21.877	0,03
50.000	Bank of Montreal 'MTN' 2,500 % 28-Jun.-2024	53.060	0,08	5.000	BP Capital Markets America Inc 3,245 % 06-Mai-2022	5.247	0,01
20.000	Bank of Montreal 'MTN' 2,550 % 06-Nov.-2022	20.981	0,03	35.000	BP Capital Markets America Inc 3,410 % 11-Feb.-2026	38.767	0,06
20.000	Bank of Nova Scotia/The 1,950 % 01-Feb.-2023	20.609	0,03	5.000	BP Capital Markets America Inc 3,633 % 06-Apr.-2030	5.685	0,01
20.000	Bank of Nova Scotia/The 2,375 % 18-Jan.-2023	20.833	0,03	20.000	BP Capital Markets America Inc 3,796 % 21-Sept.-2025	22.601	0,04
50.000	Bank of Nova Scotia/The 2,700 % 07-März-2022	51.823	0,08	30.000	BP Capital Markets America Inc 3,937 % 21-Sept.-2028	34.376	0,06
20.000	Bank of Nova Scotia/The 'BKNT' 2,450 % 19-Sept.-2022	20.885	0,03	25.000	BP Capital Markets America Inc 4,234 % 06-Nov.-2028	29.069	0,05
10.000	Barrick North America Finance LLC 5,700 % 30-Mai-2041	13.479	0,02	20.000	BP Capital Markets Plc 3,062 % 17-März-2022	20.826	0,03
10.000	Barrick North America Finance LLC 5,750 % 01-Mai-2043	14.168	0,02	5.000	BP Capital Markets Plc 3,279 % 19-Sept.-2027	5.446	0,01
25.000	BAT Capital Corp 4,390 % 15-Aug.-2037	27.310	0,04	5.000	BP Capital Markets Plc 3,506 % 17-März-2025	5.534	0,01
10.000	BAT Capital Corp 4,540 % 15-Aug.-2047	10.875	0,02	20.000	BP Capital Markets Plc 3,561 % 01-Nov.-2021	20.802	0,03
25.000	Baxter International Inc '144A' 3,750 % 01-Okt.-2025	28.504	0,05	5.000	BP Capital Markets Plc 3,814 % 10-Feb.-2024	5.496	0,01
50.000	Bayer US Finance II LLC '144A' 4,875 % 25-Jun.-2048	64.034	0,10	10.000	Bristol-Myers Squibb Co 2,000 % 01-Aug.-2022	10.293	0,02
70.000	Becton Dickinson and Co 2,894 % 06-Jun.-2022	72.510	0,12	10.000	Bristol-Myers Squibb Co 7,150 % 15-Jun.-2023	11.841	0,02
30.000	Becton Dickinson and Co 3,125 % 08-Nov.-2021	30.830	0,05	20.000	Bristol-Myers Squibb Co '144A' 2,750 % 15-Feb.-2023	21.103	0,03
35.000	Becton Dickinson and Co 3,363 % 06-Jun.-2024	37.795	0,06	60.000	Bristol-Myers Squibb Co '144A' 2,900 % 26-Jul.-2024	64.978	0,10
25.000	Becton Dickinson and Co 3,700 % 06-Jun.-2027	27.959	0,04	20.000	Bristol-Myers Squibb Co '144A' 3,250 % 20-Feb.-2023	21.299	0,03
45.000	Becton Dickinson and Co 3,734 % 15-Dez.-2024	49.671	0,08	35.000	Bristol-Myers Squibb Co '144A' 3,400 % 26-Jul.-2029	40.808	0,07
10.000	Becton Dickinson and Co 4,669 % 06-Jun.-2047	12.282	0,02	20.000	Bristol-Myers Squibb Co '144A' 3,550 % 15-Aug.-2022	21.254	0,03
10.000	Becton Dickinson and Co 4,685 % 15-Dez.-2044	12.343	0,02	25.000	Bristol-Myers Squibb Co '144A' 3,875 % 15-Aug.-2025	28.459	0,05
10.000	Bell Canada Inc 4,464 % 01-Apr.-2048	12.696	0,02	15.000	Bristol-Myers Squibb Co '144A' 4,000 % 15-Aug.-2023	16.555	0,03
25.000	Berkshire Hathaway Energy Co 3,250 % 15-Apr.-2028	28.312	0,05	30.000	Bristol-Myers Squibb Co '144A' 4,125 % 15-Jun.-2039	38.299	0,06
20.000	Berkshire Hathaway Energy Co 3,500 % 01-Feb.-2025	22.319	0,04	10.000	British Telecommunications Plc 9,625 % 15-Dez.-2030	16.327	0,03
10.000	Berkshire Hathaway Energy Co 3,750 % 15-Nov.-2023	11.002	0,02	25.000	Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd 2,650 % 15-Jan.-2023	25.948	0,04
10.000	Berkshire Hathaway Energy Co 6,125 % 01-Apr.-2036	14.464	0,02	35.000	Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd 3,125 % 15-Jan.-2025	37.410	0,06
35.000	Berkshire Hathaway Energy Co '144A' 4,050 % 15-Apr.-2025	40.086	0,06	40.000	Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd 3,500 % 15-Jan.-2028	42.371	0,07

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener	Summe			Angemessener	Summe
		Wert	der Netto-			Wert	der Netto-
Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %	Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.				US-Dollar Forts.			
50.000	Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd 3,625 % 15-Jan.-2024	53.784	0,09	50.000	CC Holdings GS V LLC / Crown Castle GS III Corp 3,849 % 15-Apr.-2023	54.045	0,09
50.000	Broadcom Corp / Broadcom Cayman Finance Ltd 3,875 % 15-Jan.-2027	54.076	0,09	55.000	Celanese US Holdings LLC 3,500 % 08-Mai-2024	58.088	0,09
40.000	Broadcom Inc '144A' 3,125 % 15-Okt.-2022	41.698	0,07	5.000	Cenovus Energy Inc 5,400 % 15-Jun.-2047	4.298	0,01
35.000	Broadcom Inc '144A' 3,625 % 15-Okt.-2024	38.038	0,06	15.000	Cenovus Energy Inc 6,750 % 15-Nov.-2039	14.620	0,02
35.000	Broadcom Inc '144A' 4,250 % 15-Apr.-2026	38.981	0,06	25.000	CH Robinson Worldwide Inc 4,200 % 15-Apr.-2028	28.518	0,05
55.000	Broadcom Inc '144A' 4,700 % 15-Apr.-2025	62.039	0,10	30.000	Charles Schwab Corp/The 3,000 % 10-März-2025	32.827	0,05
30.000	Broadcom Inc '144A' 4,750 % 15-Apr.-2029	34.078	0,05	30.000	Charles Schwab Corp/The 3,550 % 01-Feb.-2024	32.920	0,05
45.000	Broadcom Inc '144A' 5,000 % 15-Apr.-2030	51.822	0,08	50.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 2,800 % 01-Apr.-2031	50.789	0,08
25.000	Broadridge Financial Solutions Inc 2,900 % 01-Dez.-2029	26.766	0,04	35.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 3,750 % 15-Feb.-2028	38.216	0,06
25.000	Brown & Brown Inc 4,200 % 15-Sept.-2024	27.123	0,04	40.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 4,200 % 15-März-2028	44.896	0,07
5.000	Brown-Forman Corp 3,500 % 15-Apr.-2025	5.609	0,01	50.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 4,464 % 23-Jul.-2022	53.349	0,09
50.000	Burlington Northern Santa Fe LLC 3,050 % 15-März-2022	52.025	0,08	40.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 4,500 % 01-Feb.-2024	44.285	0,07
50.000	Burlington Northern Santa Fe LLC 3,050 % 01-Sept.-2022	52.481	0,08	15.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 4,800 % 01-März-2050	16.670	0,03
50.000	Burlington Northern Santa Fe LLC 3,250 % 15-Jun.-2027	56.603	0,09	35.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 4,908 % 23-Jul.-2025	40.139	0,06
25.000	Burlington Northern Santa Fe LLC 3,400 % 01-Sept.-2024	27.537	0,04	70.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 5,050 % 30-März-2029	82.687	0,13
50.000	Burlington Northern Santa Fe LLC 3,750 % 01-Apr.-2024	55.324	0,09	10.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 5,125 % 01-Jul.-2049	11.567	0,02
50.000	Burlington Northern Santa Fe LLC 3,850 % 01-Sept.-2023	54.785	0,09	20.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 5,375 % 01-Mai-2047	23.654	0,04
10.000	Burlington Resources LLC 5,950 % 15-Okt.-2036	13.491	0,02	50.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 5,750 % 01-Apr.-2048	62.337	0,10
20.000	Cadence Design Systems Inc 4,375 % 15-Okt.-2024	22.306	0,04	20.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 6,384 % 23-Okt.-2035	26.484	0,04
5.000	Camden Property Trust 2,800 % 15-Mai-2030	5.421	0,01	40.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 6,484 % 23-Okt.-2045	53.075	0,08
20.000	Campbell Soup Co 2,375 % 24-Apr.-2030	20.760	0,03	25.000	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital 6,834 % 23-Okt.-2055	33.766	0,05
5.000	Campbell Soup Co 2,500 % 02-Aug.-2022	5.153	0,01	10.000	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC 5,875 % 31-März-2025	11.218	0,02
10.000	Campbell Soup Co 3,950 % 15-März-2025	11.245	0,02	40.000	Chevron Corp 1,995 % 11-Mai-2027	41.924	0,07
20.000	Canadian Imperial Bank of Commerce 2,250 % 28-Jan.-2025	20.891	0,03	30.000	Chevron Corp 2,236 % 11-Mai-2030	31.459	0,05
20.000	Canadian Imperial Bank of Commerce 2,550 % 16-Jun.-2022	20.843	0,03	10.000	Chevron Corp 2,355 % 05-Dez.-2022	10.418	0,02
20.000	Canadian Imperial Bank of Commerce 'BKNT' 3,500 % 13-Sept.-2023	21.830	0,03	50.000	Chevron Corp 2,954 % 16-Mai-2026	55.421	0,09
30.000	Canadian National Railway Co 2,850 % 15-Dez.-2021	30.861	0,05	50.000	Chevron Corp 3,191 % 24-Jun.-2023	53.631	0,09
25.000	Canadian National Railway Co 2,950 % 21-Nov.-2024	27.043	0,04	20.000	Chevron Corp 3,326 % 17-Nov.-2025	22.435	0,04
25.000	Canadian Pacific Railway Co 2,900 % 01-Feb.-2025	27.124	0,04	10.000	Chubb INA Holdings Inc 3,350 % 03-Mai-2026	11.405	0,02
5.000	Canadian Pacific Railway Co 4,000 % 01-Jun.-2028	5.810	0,01				
10.000	Canadian Pacific Railway Co 6,125 % 15-Sept.-2115	15.409	0,02				
90.000	Capital One Financial Corp 3,050 % 09-März-2022	93.444	0,15				
50.000	Capital One Financial Corp 3,200 % 30-Jan.-2023	52.697	0,08				
30.000	Capital One Financial Corp 3,200 % 05-Feb.-2025	32.252	0,05				
35.000	Capital One Financial Corp 3,300 % 30-Okt.-2024	37.682	0,06				
60.000	Capital One Financial Corp 3,500 % 15-Jun.-2023	64.266	0,10				
20.000	Capital One Financial Corp 3,750 % 28-Jul.-2026	21.871	0,03				
20.000	Capital One Financial Corp 3,800 % 31-Jan.-2028	22.281	0,04				
50.000	Capital One Financial Corp 3,900 % 29-Jan.-2024	54.410	0,09				
20.000	Capital One Financial Corp 4,200 % 29-Okt.-2025	22.243	0,04				
25.000	Capital One Financial Corp 4,250 % 30-Apr.-2025	28.122	0,04				
25.000	Carlisle Cos Inc 2,750 % 01-März-2030	25.785	0,04				
15.000	Carlisle Cos Inc 3,500 % 01-Dez.-2024	16.251	0,03				
25.000	Carlisle Cos Inc 3,750 % 15-Nov.-2022	26.066	0,04				
50.000	Carrier Global Corp '144A' 2,242 % 15-Feb.-2025	51.176	0,08				
50.000	Carrier Global Corp '144A' 2,722 % 15-Feb.-2030	50.321	0,08				
10.000	Carrier Global Corp '144A' 3,577 % 05-Apr.-2050	9.888	0,02				

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener		Summe	Bestände	Beschreibung	Angemessener		Summe
		Wert	der Netto-				Wert	der Netto-	
		in USD	vermögen %				in USD	vermögen %	
Anleihen Forts.					Anleihen Forts.				
US-Dollar Forts.					US-Dollar Forts.				
30.000	Church & Dwight Co Inc 2,450 % 01-Aug.-2022	31.393	0,05		10.000	Comcast Corp 3,250 % 01-Nov.-2039	11.109	0,02	
15.000	Church & Dwight Co Inc 3,950 % 01-Aug.-2047	17.086	0,03		25.000	Comcast Corp 3,550 % 01-Mai-2028	28.829	0,05	
15.000	Cigna Corp 3,400 % 17-Sept.-2021	15.502	0,02		30.000	Comcast Corp 3,700 % 15-Apr.-2024	33.221	0,05	
45.000	Cigna Corp 4,375 % 15-Okt.-2028	53.294	0,09		10.000	Comcast Corp 4,049 % 01-Nov.-2052	12.305	0,02	
20.000	Cigna Corp 4,900 % 15-Dez.-2048	26.407	0,04		20.000	Comcast Corp 4,150 % 15-Okt.-2028	23.992	0,04	
45.000	Cigna Corp '144A' 3,400 % 01-März-2027	49.613	0,08		10.000	Comcast Corp 4,250 % 15-Okt.-2030	12.264	0,02	
15.000	Cigna Corp '144A' 3,875 % 15-Okt.-2047	17.239	0,03		30.000	Comcast Corp 4,250 % 15-Jan.-2033	36.860	0,06	
30.000	Cigna Corp '144A' 3,900 % 15-Feb.-2022	31.542	0,05		20.000	Comcast Corp 4,600 % 15-Okt.-2038	25.466	0,04	
10.000	Cincinnati Financial Corp 6,125 % 01-Nov.-2034	14.007	0,02		10.000	Comcast Corp 4,950 % 15-Okt.-2058	14.266	0,02	
30.000	Cintas Corp No 2 2,900 % 01-Apr.-2022	31.171	0,05		10.000	Comcast Corp 6,500 % 15-Nov.-2035	15.227	0,02	
30.000	Cintas Corp No 2 3,250 % 01-Jun.-2022	31.427	0,05		10.000	Comcast Corp 6,950 % 15-Aug.-2037	15.569	0,02	
30.000	Cintas Corp No 2 3,700 % 01-Apr.-2027	34.122	0,05		20.000	Commonwealth Bank of Australia '144A'			
20.000	Cisco Systems Inc 2,500 % 20-Sept.-2026	22.147	0,04			2,000 % 06-Sept.-2021	20.383	0,03	
10.000	Cisco Systems Inc 5,500 % 15-Jan.-2040	14.600	0,02		20.000	Commonwealth Bank of Australia '144A'			
10.000	Cisco Systems Inc 5,900 % 15-Feb.-2039	14.930	0,02			2,625 % 06-Sept.-2026	21.880	0,03	
50.000	Citigroup Inc 2,750 % 25-Apr.-2022	51.832	0,08		20.000	Commonwealth Bank of Australia '144A'			
20.000	Citigroup Inc 3,400 % 01-Mai-2026	22.194	0,04			3,150 % 19-Sept.-2027	22.365	0,04	
55.000	Citigroup Inc 3,500 % 15-Mai-2023	58.625	0,09		20.000	Commonwealth Bank of Australia '144A'			
50.000	Citigroup Inc 3,875 % 26-März-2025	54.542	0,09			3,350 % 04-Jun.-2024	21.951	0,04	
75.000	Citigroup Inc 4,050 % 30-Jul.-2022	79.567	0,13		25.000	Commonwealth Bank of Australia '144A'			
50.000	Citigroup Inc 4,400 % 10-Jun.-2025	56.028	0,09			4,500 % 09-Dez.-2025	28.261	0,05	
50.000	Citigroup Inc 4,500 % 14-Jan.-2022	53.002	0,08		25.000	Conagra Brands Inc 3,200 % 25-Jan.-2023	26.354	0,04	
15.000	Citigroup Inc 4,650 % 23-Jul.-2048	19.667	0,03		15.000	Conagra Brands Inc 5,300 % 01-Nov.-2038	19.664	0,03	
35.000	Citigroup Inc 4,750 % 18-Mai-2046	44.592	0,07		20.000	Conagra Brands Inc 5,400 % 01-Nov.-2048	27.661	0,04	
10.000	Citigroup Inc 5,300 % 06-Mai-2044	13.286	0,02		25.000	Consolidated Edison Co of New York Inc			
50.000	Citigroup Inc 5,500 % 13-Sept.-2025	59.359	0,10			3,125 % 15-Nov.-2027	27.888	0,04	
20.000	Citigroup Inc 6,625 % 15-Jun.-2032	27.447	0,04		10.000	Consolidated Edison Co of New York Inc			
30.000	Citigroup Inc 6,675 % 13-Sept.-2043	46.374	0,07			3,700 % 15-Nov.-2059	11.193	0,02	
5.000	Citigroup Inc 8,125 % 15-Jul.-2039	8.669	0,01		10.000	Consolidated Edison Co of New York Inc			
10.000	Citigroup Inc FRN 3,142 % 24-Jan.-2023	10.345	0,02			4,500 % 15-Mai-2058	12.715	0,02	
20.000	Citigroup Inc FRN 3,668 % 24-Jul.-2028	22.313	0,04		10.000	Consolidated Edison Co of New York Inc			
15.000	Citigroup Inc FRN 3,878 % 24-Jan.-2039	17.348	0,03			5,300 % 01-März-2035	13.559	0,02	
10.000	Citigroup Inc FRN 4,044 % 01-Jun.-2024	10.877	0,02		10.000	Consolidated Edison Co of New York Inc			
40.000	Citigroup Inc FRN 4,075 % 23-Apr.-2029	45.666	0,07			5,500 % 01-Dez.-2039	13.338	0,02	
20.000	Citigroup Inc FRN 4,412 % 31-März-2031	23.759	0,04		25.000	Consumers Energy Co 2,850 % 15-Mai-2022	26.039	0,04	
30.000	Citrix Systems Inc 3,300 % 01-März-2030	32.135	0,05		10.000	Consumers Energy Co 3,100 % 15-Aug.-2050	11.171	0,02	
30.000	Citrix Systems Inc 4,500 % 01-Dez.-2027	34.463	0,06		120.000	Cooperatieve Rabobank UA 3,875 % 08-Feb.-2022	126.711	0,20	
5.000	Clorox Co/The 3,050 % 15-Sept.-2022	5.264	0,01		50.000	Cooperatieve Rabobank UA 3,950 % 09-Nov.-2022	52.943	0,08	
25.000	Clorox Co/The 3,900 % 15-Mai-2028	29.238	0,05		50.000	Cooperatieve Rabobank UA 4,625 % 01-Dez.-2023	55.199	0,09	
20.000	CME Group Inc 3,000 % 15-Sept.-2022	21.110	0,03		250.000	Cooperatieve Rabobank UA 'BKNT'			
10.000	CME Group Inc 3,000 % 15-März-2025	11.045	0,02			3,750 % 21-Jul.-2026	275.823	0,44	
15.000	CME Group Inc 3,750 % 15-Jun.-2028	18.034	0,03		5.000	Corning Inc 4,375 % 15-Nov.-2057	5.757	0,01	
60.000	CMS Energy Corp 5,050 % 15-März-2022	63.280	0,10		10.000	Corning Inc 5,450 % 15-Nov.-2079	11.986	0,02	
20.000	Coca-Cola Co/The 2,125 % 06-Sept.-2029	21.382	0,03		5.000	Corporate Office Properties LP 3,700 % 15-Jun.-2021	5.083	0,01	
5.000	Coca-Cola Co/The 2,500 % 01-Apr.-2023	5.302	0,01		50.000	Costco Wholesale Corp 1,375 % 20-Jun.-2027	51.176	0,08	
50.000	Coca-Cola Co/The 2,500 % 01-Jun.-2040	51.822	0,08		50.000	Costco Wholesale Corp 1,600 % 20-Apr.-2030	50.603	0,08	
50.000	Coca-Cola Co/The 2,750 % 01-Jun.-2060	50.715	0,08		50.000	Costco Wholesale Corp 1,750 % 20-Apr.-2032	50.849	0,08	
10.000	Coca-Cola Co/The 3,200 % 01-Nov.-2023	10.894	0,02		50.000	Crown Castle International Corp 3,200 % 01-Sept.-2024	54.318	0,09	
50.000	Coca-Cola Femsa SAB de CV 2,750 % 22-Jan.-2030	53.033	0,08		15.000	Crown Castle International Corp 3,800 % 15-Feb.-2028	16.882	0,03	
10.000	Colgate-Palmolive Co 'MTN' 1,950 % 01-Feb.-2023	10.436	0,02		30.000	Crown Castle International Corp 4,000 % 01-März-2027	34.146	0,05	
30.000	Colgate-Palmolive Co 'MTN' 2,300 % 03-Mai-2022	31.058	0,05		35.000	Crown Castle International Corp 4,300 % 15-Feb.-2029	40.615	0,07	
45.000	Colgate-Palmolive Co 'MTN' 3,250 % 15-März-2024	49.421	0,08		20.000	Crown Castle International Corp 4,450 % 15-Feb.-2026	22.942	0,04	
20.000	Colonial Pipeline Co '144A' 3,750 % 01-Okt.-2025	22.002	0,04		30.000	Crown Castle International Corp 5,200 % 15-Feb.-2049	39.885	0,06	
10.000	Columbia Pipeline Group Inc 4,500 % 01-Jun.-2025	11.371	0,02		45.000	Crown Castle International Corp 5,250 % 15-Jan.-2023	50.092	0,08	
30.000	Comcast Cable Communications Holdings Inc				25.000	CSX Corp 3,400 % 01-Aug.-2024	27.502	0,04	
	9,455 % 15-Nov.-2022	36.441	0,06		25.000	CSX Corp 3,800 % 01-März-2028	28.764	0,05	
15.000	Comcast Corp 2,350 % 15-Jan.-2027	16.044	0,03		10.000	CSX Corp 3,800 % 01-Nov.-2046	11.690	0,02	
10.000	Comcast Corp 2,650 % 01-Feb.-2030	10.885	0,02		15.000	CSX Corp 3,800 % 15-Apr.-2050	17.857	0,03	
25.000	Comcast Corp 3,150 % 15-Feb.-2028	27.936	0,04		15.000	CSX Corp 3,950 % 01-Mai-2050	18.138	0,03	

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener	Summe			Angemessener	Summe
		Wert	der Netto-			Wert	der Netto-
Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %	Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.				US-Dollar Forts.			
10.000	CSX Corp 4,250 % 01-Nov.-2066	12.160	0,02	10.000	Dow Chemical Co/The 9,400 % 15-Mai-2039	16.704	0,03
10.000	CSX Corp 4,300 % 01-März-2048	12.521	0,02	20.000	DR Horton Inc 5,750 % 15-Aug.-2023	22.627	0,04
10.000	CSX Corp 4,400 % 01-März-2043	12.336	0,02	40.000	DTE Energy Co 2,529 % 01-Okt.-2024	41.906	0,07
15.000	CSX Corp 4,750 % 15-Nov.-2048	19.949	0,03	10.000	Duke Energy Carolinas LLC 5,300 % 15-Feb.-2040	13.886	0,02
10.000	CSX Corp 6,000 % 01-Okt.-2036	13.666	0,02	10.000	Duke Realty LP 3,050 % 01-März-2050	10.498	0,02
10.000	CSX Corp 6,220 % 30-Apr.-2040	14.576	0,02	20.000	Duke Realty LP 3,375 % 15-Dez.-2027	22.359	0,04
45.000	CVS Health Corp 3,625 % 01-Apr.-2027	50.609	0,08	40.000	DuPont de Nemours Inc 2,169 % 01-Mai-2023	40.798	0,07
55.000	CVS Health Corp 4,100 % 25-März-2025	62.241	0,10	45.000	DuPont de Nemours Inc 4,205 % 15-Nov.-2023	49.355	0,08
15.000	CVS Health Corp 4,250 % 01-Apr.-2050	18.005	0,03	10.000	DuPont de Nemours Inc 5,319 % 15-Nov.-2038	12.694	0,02
65.000	CVS Health Corp 4,300 % 25-März-2028	76.071	0,12	30.000	DuPont de Nemours Inc 5,419 % 15-Nov.-2048	39.579	0,06
45.000	CVS Health Corp 5,050 % 25-März-2048	59.042	0,09	30.000	Eastman Chemical Co 3,800 % 15-März-2025	32.591	0,05
20.000	CVS Health Corp 5,125 % 20-Jul.-2045	25.809	0,04	10.000	Eastman Chemical Co 4,650 % 15-Okt.-2044	11.512	0,02
15.000	CVS Health Corp 6,125 % 15-Sept.-2039	21.404	0,03	35.000	eBay Inc 2,600 % 15-Jul.-2022	36.178	0,06
45.000	CVS Health Corp 6,250 % 01-Jun.-2027	56.560	0,09	20.000	eBay Inc 2,700 % 11-März-2030	21.223	0,03
10.000	Daimler Finance North America LLC			10.000	eBay Inc 3,450 % 01-Aug.-2024	10.925	0,02
	8,500 % 18-Jan.-2031	15.248	0,02	60.000	eBay Inc 3,800 % 09-März-2022	63.039	0,10
25.000	Danaher Corp 3,350 % 15-Sept.-2025	27.907	0,04	5.000	eBay Inc 4,000 % 15-Jul.-2042	5.450	0,01
10.000	Deutsche Telekom International Finance BV			45.000	Ecolab Inc 2,700 % 01-Nov.-2026	50.024	0,08
	8,750 % 15-Jun.-2030	15.655	0,03	15.000	Ecolab Inc 4,800 % 24-März-2030	19.038	0,03
20.000	DH Europe Finance II Sarl 2,050 % 15-Nov.-2022	20.665	0,03	35.000	Edison International 2,950 % 15-März-2023	35.839	0,06
25.000	DH Europe Finance II Sarl 2,200 % 15-Nov.-2024	26.292	0,04	35.000	Edison International 3,550 % 15-Nov.-2024	36.931	0,06
5.000	DH Europe Finance II Sarl 2,600 % 15-Nov.-2029	5.332	0,01	25.000	Edwards Lifesciences Corp 4,300 % 15-Jun.-2028	29.845	0,05
10.000	DH Europe Finance II Sarl 3,250 % 15-Nov.-2039	11.063	0,02	10.000	El Paso Electric Co 5,000 % 01-Dez.-2044	11.880	0,02
10.000	DH Europe Finance II Sarl 3,400 % 15-Nov.-2049	11.299	0,02	25.000	Eli Lilly and Co 2,750 % 01-Jun.-2025	27.529	0,04
20.000	Discover Financial Services 3,950 % 06-Nov.-2024	21.896	0,04	10.000	Eli Lilly and Co 3,375 % 15-März-2029	11.577	0,02
20.000	Discover Financial Services 4,100 % 09-Feb.-2027	21.878	0,03	15.000	Emera US Finance LP 2,700 % 15-Jun.-2021	15.277	0,02
5.000	Discover Financial Services 5,200 % 27-Apr.-2022	5.339	0,01	40.000	Emera US Finance LP 3,550 % 15-Jun.-2026	44.984	0,07
40.000	Dollar General Corp 3,500 % 03-Apr.-2030	45.022	0,07	5.000	Emerson Electric Co 2,625 % 01-Dez.-2021	5.151	0,01
25.000	Dollar General Corp 3,875 % 15-Apr.-2027	28.763	0,05	20.000	Enbridge Energy Partners LP 4,200 % 15-Sept.-2021	20.679	0,03
10.000	Dollar General Corp 4,125 % 01-Mai-2028	11.711	0,02	20.000	Enbridge Inc 2,500 % 15-Jan.-2025	20.799	0,03
10.000	Dollar General Corp 4,150 % 01-Nov.-2025	11.552	0,02	25.000	Enbridge Inc 2,900 % 15-Jul.-2022	25.945	0,04
20.000	Dominion Energy Gas Holdings LLC			20.000	Enbridge Inc 4,000 % 01-Okt.-2023	21.700	0,03
	3,000 % 15-Nov.-2029	21.464	0,03	5.000	Enbridge Inc 4,000 % 15-Nov.-2049	5.443	0,01
40.000	Dominion Energy Gas Holdings LLC			10.000	Enbridge Inc 4,500 % 10-Jun.-2044	11.390	0,02
	3,550 % 01-Nov.-2023	43.003	0,07	25.000	Enbridge Inc 5,500 % 01-Dez.-2046	32.341	0,05
20.000	Dominion Energy Gas Holdings LLC			5.000	Enstar Group Ltd 4,950 % 01-Jun.-2029	5.285	0,01
	3,600 % 15-Dez.-2024	21.999	0,04	10.000	Entergy Louisiana LLC 4,050 % 01-Sept.-2023	10.949	0,02
30.000	Dominion Energy Gas Holdings LLC			15.000	Enterprise Products Operating LLC		
	4,600 % 15-Dez.-2044	33.997	0,05		3,350 % 15-März-2023	15.896	0,03
20.000	Dominion Energy Inc 2,750 % 15-Sept.-2022	20.731	0,03	30.000	Enterprise Products Operating LLC		
5.000	Dominion Energy Inc 2,850 % 15-Aug.-2026	5.375	0,01		3,500 % 01-Feb.-2022	31.288	0,05
50.000	Dominion Energy Inc 3,375 % 01-Apr.-2030	55.305	0,09	10.000	Enterprise Products Operating LLC		
20.000	Dominion Energy Inc 4,600 % 15-März-2049	25.277	0,04		3,700 % 31-Jan.-2051	10.522	0,02
15.000	Dominion Energy Inc 4,700 % 01-Dez.-2044	18.577	0,03	15.000	Enterprise Products Operating LLC		
5.000	Dominion Energy Inc 7,000 % 15-Jun.-2038	7.132	0,01		3,750 % 15-Feb.-2025	16.604	0,03
20.000	Dominion Energy Inc '144A' 2,450 % 15-Jan.-2023	20.656	0,03	5.000	Enterprise Products Operating LLC		
55.000	Dominion Energy Inc FRN 5,750 % 01-Okt.-2054	56.131	0,09		3,950 % 31-Jan.-2060	5.205	0,01
50.000	Dominion Energy Inc Step-Up Coupon			30.000	Enterprise Products Operating LLC		
	2,715 % 15-Aug.-2021	51.121	0,08		4,050 % 15-Feb.-2022	31.690	0,05
20.000	Dominion Energy Inc Step-Up Coupon			15.000	Enterprise Products Operating LLC		
	3,071 % 15-Aug.-2024	21.526	0,03		4,200 % 31-Jan.-2050	16.810	0,03
10.000	Dominion Energy South Carolina Inc			10.000	Enterprise Products Operating LLC		
	6,050 % 15-Jan.-2038	14.554	0,02		4,850 % 15-Aug.-2042	11.562	0,02
15.000	Dover Corp 5,375 % 01-März-2041	19.321	0,03	20.000	Enterprise Products Operating LLC		
5.000	Dow Chemical Co/The 4,250 % 01-Okt.-2034	5.589	0,01		4,850 % 15-März-2044	23.237	0,04
10.000	Dow Chemical Co/The 4,375 % 15-Nov.-2042	11.189	0,02	10.000	Enterprise Products Operating LLC		
10.000	Dow Chemical Co/The 4,625 % 01-Okt.-2044	11.603	0,02		5,100 % 15-Feb.-2045	11.932	0,02
10.000	Dow Chemical Co/The 4,800 % 15-Mai-2049	11.917	0,02	15.000	Enterprise Products Operating LLC		
10.000	Dow Chemical Co/The 5,250 % 15-Nov.-2041	12.105	0,02		6,875 % 01-März-2033	19.871	0,03

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener	Summe			Angemessener	Summe
		Wert	der Netto-			Wert	der Netto-
Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %	Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.				US-Dollar Forts.			
35.000	Enterprise Products Operating LLC FRN 4,875 % 16-Aug.-2077	30.502	0,05	15.000	Flowserve Corp 4,000 % 15-Nov.-2023	15.446	0,02
50.000	Enterprise Products Operating LLC FRN 5,250 % 16-Aug.-2077	46.837	0,07	25.000	FMC Corp 3,450 % 01-Okt.-2029	27.214	0,04
35.000	Enterprise Products Operating LLC FRN 5,375 % 15-Feb.-2078	31.386	0,05	30.000	FMC Corp 4,100 % 01-Feb.-2024	32.419	0,05
10.000	EOG Resources Inc 3,900 % 01-Apr.-2035	11.690	0,02	30.000	FNB Corp/PA 2,200 % 24-Feb.-2023	29.863	0,05
15.000	Equifax Inc 3,300 % 15-Dez.-2022	15.743	0,03	10.000	Fortune Brands Home & Security Inc 3,250 % 15-Sept.-2029	10.682	0,02
35.000	Equinix Inc 2,625 % 18-Nov.-2024	37.331	0,06	10.000	Fox Corp 5,576 % 25-Jan.-2049	13.949	0,02
15.000	Equinix Inc 2,900 % 18-Nov.-2026	16.204	0,03	30.000	Franklin Resources Inc 2,850 % 30-März-2025	32.536	0,05
45.000	Equinix Inc 3,200 % 18-Nov.-2029	49.016	0,08	50.000	GATX Corp 3,250 % 30-März-2025	52.321	0,08
30.000	Equinix Inc 5,375 % 15-Mai-2027	32.799	0,05	50.000	GATX Corp 3,850 % 30-März-2027	53.623	0,09
70.000	Equinix Inc 5,875 % 15-Jan.-2026	73.830	0,12	30.000	GATX Corp 5,200 % 15-März-2044	35.309	0,06
5.000	ERP Operating LP 2,500 % 15-Feb.-2030	5.344	0,01	50.000	GE Capital International Funding Co Unlimited Co 4,418 % 15-Nov.-2035	50.894	0,08
10.000	ERP Operating LP 3,500 % 01-März-2028	11.337	0,02	30.000	General Dynamics Corp 3,500 % 15-Mai-2025	33.583	0,05
10.000	ERP Operating LP 4,150 % 01-Dez.-2028	11.862	0,02	25.000	General Electric Co 3,450 % 01-Mai-2027	25.611	0,04
15.000	ERP Operating LP 4,625 % 15-Dez.-2021	15.721	0,03	30.000	General Electric Co 3,625 % 01-Mai-2030	30.096	0,05
20.000	Essex Portfolio LP 3,250 % 01-Mai-2023	21.076	0,03	15.000	General Electric Co 4,350 % 01-Mai-2050	14.860	0,02
40.000	Essex Portfolio LP 3,625 % 15-Aug.-2022	41.963	0,07	10.000	General Electric Co 4,500 % 11-März-2044	10.015	0,02
15.000	Essex Portfolio LP 3,875 % 01-Mai-2024	16.339	0,03	10.000	General Electric Co 6,750 % 15-März-2032	12.176	0,02
15.000	Essex Portfolio LP 4,000 % 01-März-2029	17.462	0,03	10.000	General Electric Co 'GMTN' 6,150 % 07-Aug.-2037	11.681	0,02
25.000	Essex Portfolio LP 4,500 % 15-März-2048	31.564	0,05	10.000	General Electric Co 'GMTN' 6,875 % 10-Jan.-2039	12.299	0,02
20.000	Estee Lauder Cos Inc/The 2,600 % 15-Apr.-2030	21.787	0,03	20.000	General Electric Co 'MTN' 4,650 % 17-Okt.-2021	20.942	0,03
45.000	Every Inc 2,450 % 15-Sept.-2024	47.585	0,08	10.000	General Electric Co 'MTN' 5,875 % 14-Jan.-2038	11.300	0,02
15.000	Eversource Energy 2,750 % 15-März-2022	15.550	0,02	10.000	General Mills Inc 3,150 % 15-Dez.-2021	10.309	0,02
85.000	Eversource Energy 2,800 % 01-Mai-2023	89.050	0,14	20.000	General Mills Inc 3,200 % 10-Feb.-2027	22.581	0,04
50.000	Eversource Energy 2,900 % 01-Okt.-2024	53.691	0,09	20.000	General Mills Inc 3,650 % 15-Feb.-2024	22.010	0,04
10.000	Eversource Energy 3,150 % 15-Jan.-2025	10.872	0,02	10.000	General Mills Inc 4,150 % 15-Feb.-2043	12.174	0,02
35.000	Eversource Energy 3,800 % 01-Dez.-2023	38.352	0,06	25.000	General Mills Inc 4,200 % 17-Apr.-2028	29.613	0,05
10.000	Exxon Mobil Corp 2,610 % 15-Okt.-2030	10.729	0,02	20.000	General Mills Inc 4,550 % 17-Apr.-2038	25.264	0,04
20.000	Exxon Mobil Corp 3,043 % 01-März-2026	21.996	0,04	15.000	Genpact Luxembourg Sarl 3,700 % 01-Apr.-2022	15.409	0,02
10.000	Exxon Mobil Corp 3,452 % 15-Apr.-2051	11.128	0,02	20.000	Georgia Power Co 2,650 % 15-Sept.-2029	21.019	0,03
10.000	Exxon Mobil Corp 4,227 % 19-März-2040	12.052	0,02	10.000	Georgia Power Co 3,250 % 30-März-2027	10.847	0,02
15.000	Federal Realty Investment Trust 3,200 % 15-Jun.-2029	15.633	0,02	10.000	Georgia-Pacific LLC 8,875 % 15-Mai-2031	16.037	0,03
5.000	FedEx Corp 3,400 % 14-Jan.-2022	5.209	0,01	5.000	Gilead Sciences Inc 4,400 % 01-Dez.-2021	5.236	0,01
40.000	FedEx Corp 4,050 % 15-Feb.-2048	41.177	0,07	5.000	GlaxoSmithKline Capital Inc 2,800 % 18-März-2023	5.297	0,01
10.000	FedEx Corp 4,100 % 15-Apr.-2043	10.417	0,02	5.000	GlaxoSmithKline Capital Inc 3,375 % 15-Mai-2023	5.393	0,01
10.000	FedEx Corp 4,400 % 15-Jan.-2047	10.633	0,02	5.000	GlaxoSmithKline Capital Inc 3,625 % 15-Mai-2025	5.651	0,01
15.000	FedEx Corp 4,550 % 01-Apr.-2046	16.197	0,03	10.000	GlaxoSmithKline Capital Inc 6,375 % 15-Mai-2038	15.193	0,02
15.000	FedEx Corp 4,750 % 15-Nov.-2045	16.564	0,03	45.000	GlaxoSmithKline Capital Plc 3,375 % 01-Jun.-2029	51.827	0,08
20.000	FedEx Corp 5,250 % 15-Mai-2050	24.627	0,04	75.000	Glencore Funding LLC '144A' 4,125 % 30-Mai-2023	80.244	0,13
20.000	Fidelity National Information Services Inc 3,500 % 15-Apr.-2023	21.428	0,03	20.000	Global Payments Inc 2,650 % 15-Feb.-2025	21.213	0,03
10.000	Fidelity National Information Services Inc 3,750 % 21-Mai-2029	11.726	0,02	10.000	Global Payments Inc 3,200 % 15-Aug.-2029	10.733	0,02
20.000	Fidelity National Information Services Inc 4,500 % 15-Aug.-2046	24.764	0,04	15.000	Global Payments Inc 3,750 % 01-Jun.-2023	16.164	0,03
5.000	Fidelity National Information Services Inc 5,000 % 15-Okt.-2025	5.995	0,01	15.000	Global Payments Inc 4,800 % 01-Apr.-2026	17.578	0,03
15.000	First American Financial Corp 4,600 % 15-Nov.-2024	16.184	0,03	30.000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 4,000 % 15-Jan.-2030	29.806	0,05
35.000	FirstEnergy Corp 4,250 % 15-März-2023	37.871	0,06	10.000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 5,250 % 01-Jun.-2025	10.905	0,02
10.000	FirstEnergy Corp 7,375 % 15-Nov.-2031	14.623	0,02	40.000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 5,300 % 15-Jan.-2029	43.399	0,07
20.000	Fiserv Inc 2,750 % 01-Jul.-2024	21.338	0,03	25.000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 5,375 % 01-Nov.-2023	26.688	0,04
10.000	Fiserv Inc 3,500 % 01-Okt.-2022	10.576	0,02	25.000	GLP Capital LP / GLP Financing II Inc 5,375 % 15-Apr.-2026	27.373	0,04
25.000	Fiserv Inc 3,500 % 01-Jul.-2029	28.157	0,05	40.000	Goldman Sachs Capital I 6,345 % 15-Feb.-2034	55.135	0,09
10.000	Fiserv Inc 3,850 % 01-Jun.-2025	11.301	0,02	50.000	Goldman Sachs Group Inc/The 2,600 % 07-Feb.-2030	52.495	0,08
20.000	Fiserv Inc 4,400 % 01-Jul.-2049	24.448	0,04	20.000	Goldman Sachs Group Inc/The 3,500 % 23-Jan.-2025	21.799	0,03
40.000	Flowers Foods Inc 4,375 % 01-Apr.-2022	41.703	0,07	35.000	Goldman Sachs Group Inc/The 3,500 % 01-Apr.-2025	38.419	0,06
				20.000	Goldman Sachs Group Inc/The 3,500 % 16-Nov.-2026	22.011	0,04

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener		Summe		Bestände	Beschreibung	Angemessener		Summe	
		Wert	der Netto-					Wert	der Netto-		
		in USD	vermögen %					in USD	vermögen %		
Anleihen Forts.						Anleihen Forts.					
US-Dollar Forts.						US-Dollar Forts.					
50.000	Goldman Sachs Group Inc/The 3,625 % 22-Jan.-2023	53.607	0,09			10.000	Home Depot Inc/The 5,875 % 16-Dez.-2036	14.952	0,02		
20.000	Goldman Sachs Group Inc/The 3,750 % 22-Mai-2025	22.174	0,04			5.000	Honeywell International Inc 5,700 % 15-März-2036	7.161	0,01		
20.000	Goldman Sachs Group Inc/The 3,750 % 25-Feb.-2026	22.322	0,04			200.000	HSBC Holdings Plc FRN 3,262 % 13-März-2023	207.243	0,33		
55.000	Goldman Sachs Group Inc/The 3,800 % 15-März-2030	62.559	0,10			100.000	HSBC USA Inc 3,500 % 23-Jun.-2024	109.088	0,17		
45.000	Goldman Sachs Group Inc/The 3,850 % 26-Jan.-2027	50.799	0,08			20.000	Hubbell Inc 3,150 % 15-Aug.-2027	20.825	0,03		
25.000	Goldman Sachs Group Inc/The 4,250 % 21-Okt.-2025	28.163	0,05			10.000	Hubbell Inc 3,350 % 01-März-2026	10.738	0,02		
20.000	Goldman Sachs Group Inc/The 4,750 % 21-Okt.-2045	26.165	0,04			25.000	Humana Inc 2,900 % 15-Dez.-2022	26.115	0,04		
30.000	Goldman Sachs Group Inc/The 5,150 % 22-Mai-2045	39.618	0,06			25.000	Humana Inc 3,850 % 01-Okt.-2024	27.416	0,04		
20.000	Goldman Sachs Group Inc/The 5,250 % 27-Jul.-2021	21.005	0,03			20.000	Humana Inc 4,800 % 15-März-2047	26.156	0,04		
40.000	Goldman Sachs Group Inc/The 5,750 % 24-Jan.-2022	43.163	0,07			80.000	Huntington Bancshares Inc/OH 2,300 % 14-Jan.-2022	82.130	0,13		
20.000	Goldman Sachs Group Inc/The 5,950 % 15-Jan.-2027	24.812	0,04			25.000	Huntington Ingalls Industries Inc 3,483 % 01-Dez.-2027	26.974	0,04		
20.000	Goldman Sachs Group Inc/The 6,450 % 01-Mai-2036	27.622	0,04			50.000	IHS Markit Ltd 4,125 % 01-Aug.-2023	54.749	0,09		
30.000	Goldman Sachs Group Inc/The 6,750 % 01-Okt.-2037	43.726	0,07			30.000	Illinois Tool Works Inc 3,375 % 15-Sept.-2021	30.824	0,05		
25.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN					30.000	Intel Corp 2,700 % 17-Jun.-2024	32.276	0,05		
	2,876 % 31-Okt.-2022	25.637	0,04			50.000	Intel Corp 3,750 % 25-März-2027	58.298	0,09		
50.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN					5.000	Intel Corp 4,950 % 25-März-2060	7.383	0,01		
	2,905 % 24-Jul.-2023	51.966	0,08			10.000	Intercontinental Exchange Inc 3,100 % 15-Sept.-2027	11.139	0,02		
45.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN					10.000	Intercontinental Exchange Inc				
	2,908 % 05-Jun.-2023	46.662	0,07				3,750 % 21-Sept.-2028	11.660	0,02		
25.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN					100.000	International Business Machines Corp				
	3,691 % 05-Jun.-2028	28.023	0,04				3,500 % 15-Mai-2029	115.433	0,18		
55.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN					10.000	International Business Machines Corp				
	3,814 % 23-Apr.-2029	62.217	0,10				5,875 % 29-Nov.-2032	14.151	0,02		
10.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN					30.000	International Business Machines Corp				
	4,017 % 31-Okt.-2038	11.620	0,02				7,000 % 30-Okt.-2025	39.461	0,06		
70.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN					15.000	International Business Machines Corp				
	4,223 % 01-Mai-2029	81.499	0,13				7,125 % 01-Dez.-2096	26.316	0,04		
40.000	Goldman Sachs Group Inc/The FRN					20.000	International Flavors & Fragrances Inc				
	4,411 % 23-Apr.-2039	48.232	0,08				4,375 % 01-Jun.-2047	21.653	0,03		
20.000	Goldman Sachs Group Inc/The 'MTN'					20.000	International Flavors & Fragrances Inc				
	3,850 % 08-Jul.-2024	22.063	0,04				5,000 % 26-Sept.-2048	23.371	0,04		
5.000	Goodman US Finance Three LLC '144A'					10.000	Interstate Power and Light Co 3,250 % 01-Dez.-2024	10.866	0,02		
	3,700 % 15-März-2028	5.414	0,01			15.000	Interstate Power and Light Co 3,600 % 01-Apr.-2029	16.892	0,03		
30.000	Grupo Televisa SAB 6,625 % 15-Jan.-2040	38.985	0,06			15.000	Interstate Power and Light Co 4,100 % 26-Sept.-2028	17.398	0,03		
55.000	Gulf Power Co 3,300 % 30-Mai-2027	61.083	0,10			10.000	J M Smucker Co/The 3,375 % 15-Dez.-2027	11.051	0,02		
10.000	Hartford Financial Services Group Inc/The					15.000	J M Smucker Co/The 3,500 % 15-März-2025	16.646	0,03		
	4,300 % 15-Apr.-2043	11.538	0,02			5.000	J M Smucker Co/The 4,250 % 15-März-2035	5.909	0,01		
10.000	Hartford Financial Services Group Inc/The					4.939	JetBlue 2019-1 Class AA Pass Through Trust				
	4,400 % 15-März-2048	12.094	0,02				2,750 % 15-Mai-2032	4.707	0,01		
25.000	Hasbro Inc 3,000 % 19-Nov.-2024	26.210	0,04			50.000	Johnson & Johnson 2,050 % 01-März-2023	52.112	0,08		
10.000	Hasbro Inc 3,900 % 19-Nov.-2029	10.434	0,02			20.000	Johnson & Johnson 2,450 % 01-März-2026	21.873	0,03		
25.000	HBOS Plc '144A' 6,000 % 01-Nov.-2033	33.579	0,05			20.000	Johnson & Johnson 3,375 % 05-Dez.-2023	22.127	0,04		
20.000	HCA Inc 4,750 % 01-Mai-2023	21.709	0,03			5.000	Johnson & Johnson 3,400 % 15-Jan.-2038	5.943	0,01		
10.000	HCA Inc 5,250 % 15-Jun.-2049	12.009	0,02			5.000	Johnson & Johnson 3,625 % 03-März-2037	5.981	0,01		
10.000	HCA Inc 5,500 % 15-Jun.-2047	12.206	0,02			5.000	Johnson & Johnson 5,850 % 15-Jul.-2038	7.650	0,01		
15.000	Healthcare Trust of America Holdings LP					20.000	Johnson & Johnson 6,950 % 01-Sept.-2029	29.121	0,05		
	3,750 % 01-Jul.-2027	15.851	0,03			20.000	JPMorgan Chase & Co 2,950 % 01-Okt.-2026	21.984	0,04		
5.000	Healthpeak Properties Inc 3,000 % 15-Jan.-2030	5.231	0,01			20.000	JPMorgan Chase & Co 2,972 % 15-Jan.-2023	20.714	0,03		
30.000	Healthpeak Properties Inc 3,400 % 01-Feb.-2025	32.372	0,05			50.000	JPMorgan Chase & Co 3,200 % 15-Jun.-2026	55.542	0,09		
15.000	Healthpeak Properties Inc 4,200 % 01-März-2024	16.364	0,03			50.000	JPMorgan Chase & Co 3,250 % 23-Sept.-2022	52.821	0,08		
50.000	Hershey Co/The 1,700 % 01-Jun.-2030	51.139	0,08			20.000	JPMorgan Chase & Co 3,300 % 01-Apr.-2026	22.372	0,04		
55.000	Hershey Co/The 3,200 % 21-Aug.-2025	60.284	0,10			20.000	JPMorgan Chase & Co 3,875 % 10-Sept.-2024	22.188	0,04		
20.000	Hershey Co/The 3,375 % 15-Mai-2023	21.611	0,03			50.000	JPMorgan Chase & Co 4,125 % 15-Dez.-2026	58.277	0,09		
50.000	Highwoods Realty LP 3,200 % 15-Jun.-2021	50.806	0,08			50.000	JPMorgan Chase & Co 4,250 % 01-Okt.-2027	58.264	0,09		
20.000	Highwoods Realty LP 4,200 % 15-Apr.-2029	21.524	0,03			20.000	JPMorgan Chase & Co FRN 2,739 % 15-Okt.-2030	21.474	0,03		
15.000	Home Depot Inc/The 2,950 % 15-Jun.-2029	16.882	0,03			25.000	JPMorgan Chase & Co FRN 2,776 % 25-Apr.-2023	25.896	0,04		
10.000	Home Depot Inc/The 3,000 % 01-Apr.-2026	11.257	0,02			25.000	JPMorgan Chase & Co FRN 3,207 % 01-Apr.-2023	26.036	0,04		
10.000	Home Depot Inc/The 3,350 % 15-Sept.-2025	11.267	0,02			50.000	JPMorgan Chase & Co FRN 3,509 % 23-Jan.-2029	55.907	0,09		
10.000	Home Depot Inc/The 3,900 % 06-Dez.-2028	11.970	0,02			15.000	JPMorgan Chase & Co FRN 3,540 % 01-Mai-2028	16.762	0,03		

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Angemessener				Summe			
		Wert	der Netto-			Wert	der Netto-
Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %	Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.				US-Dollar Forts.			
35.000	JPMorgan Chase & Co FRN 3,559 % 23-Apr.-2024	37.483	0,06	10.000	Laboratory Corp of America Holdings		
50.000	JPMorgan Chase & Co FRN 3,797 % 23-Jul.-2024	54.263	0,09		2,950 % 01-Dez.-2029	10.629	0,02
10.000	JPMorgan Chase & Co FRN 3,882 % 24-Jul.-2038	11.759	0,02	20.000	Laboratory Corp of America Holdings		
20.000	JPMorgan Chase & Co FRN 3,960 % 29-Jan.-2027	22.798	0,04		3,200 % 01-Feb.-2022	20.750	0,03
10.000	JPMorgan Chase & Co FRN 4,005 % 23-Apr.-2029	11.551	0,02	10.000	Laboratory Corp of America Holdings		
50.000	JPMorgan Chase & Co FRN 4,023 % 05-Dez.-2024	55.121	0,09		3,600 % 01-Sept.-2027	11.221	0,02
50.000	JPMorgan Chase & Co 'MTN' 2,295 % 15-Aug.-2021	50.106	0,08	10.000	Las Vegas Sands Corp 2,900 % 25-Jun.-2025	9.724	0,02
35.000	Kansas City Southern 2,875 % 15-Nov.-2029	37.017	0,06	10.000	Lazard Group LLC 3,625 % 01-März-2027	10.513	0,02
20.000	Kellogg Co 3,250 % 01-Apr.-2026	22.299	0,04	10.000	Lazard Group LLC 3,750 % 13-Feb.-2025	10.631	0,02
25.000	Kellogg Co 4,300 % 15-Mai-2028	29.505	0,05	10.000	Lazard Group LLC 4,500 % 19-Sept.-2028	11.294	0,02
15.000	Kellogg Co 4,500 % 01-Apr.-2046	18.556	0,03	10.000	Legg Mason Inc 4,750 % 15-März-2026	11.331	0,02
5.000	Kennametal Inc 3,875 % 15-Feb.-2022	5.190	0,01	35.000	Lennox International Inc 3,000 % 15-Nov.-2023	36.148	0,06
20.000	Keurig Dr Pepper Inc 3,130 % 15-Dez.-2023	21.503	0,03	25.000	Life Storage LP 3,875 % 15-Dez.-2027	27.299	0,04
20.000	Keurig Dr Pepper Inc 3,800 % 01-Mai-2050	22.704	0,04	30.000	Lockheed Martin Corp 3,550 % 15-Jan.-2026	34.515	0,06
20.000	Keurig Dr Pepper Inc 4,057 % 25-Mai-2023	21.814	0,03	5.000	Lockheed Martin Corp 3,600 % 01-März-2035	6.013	0,01
10.000	Keurig Dr Pepper Inc 4,420 % 15-Dez.-2046	11.952	0,02	5.000	Lockheed Martin Corp 4,090 % 15-Sept.-2052	6.542	0,01
85.000	Keurig Dr Pepper Inc 4,597 % 25-Mai-2028	102.121	0,16	30.000	Lowe's Cos Inc 2,500 % 15-Apr.-2026	32.646	0,05
35.000	Keurig Dr Pepper Inc 4,985 % 25-Mai-2038	44.852	0,07	10.000	Lowe's Cos Inc 3,700 % 15-Apr.-2046	11.165	0,02
10.000	Kilroy Realty LP 3,450 % 15-Dez.-2024	10.495	0,02	10.000	Lowe's Cos Inc 4,375 % 15-Sept.-2045	12.082	0,02
15.000	Kilroy Realty LP 4,750 % 15-Dez.-2028	16.844	0,03	10.000	Lowe's Cos Inc 4,550 % 05-Apr.-2049	12.607	0,02
20.000	Kimberly-Clark Corp 2,400 % 01-Jun.-2023	21.035	0,03	5.000	Lowe's Cos Inc 4,650 % 15-Apr.-2042	6.279	0,01
25.000	Kimberly-Clark Corp 3,050 % 15-Aug.-2025	27.665	0,04	25.000	Lowe's Cos Inc 6,500 % 15-März-2029	33.658	0,05
20.000	Kinder Morgan Energy Partners LP			10.000	LYB International Finance III LLC 4,200 % 15-Okt.-2049	10.802	0,02
	3,500 % 01-Sept.-2023	21.368	0,03	10.000	LyondellBasell Industries NV 4,625 % 26-Feb.-2055	11.223	0,02
40.000	Kinder Morgan Energy Partners LP			5.000	Magellan Midstream Partners LP 3,950 % 01-März-2050	5.022	0,01
	3,950 % 01-Sept.-2022	42.190	0,07	25.000	Magellan Midstream Partners LP 4,200 % 03-Okt.-2047	25.536	0,04
30.000	Kinder Morgan Energy Partners LP			10.000	Markel Corp 4,300 % 01-Nov.-2047	11.368	0,02
	4,150 % 01-Feb.-2024	32.562	0,05	10.000	Markel Corp 5,000 % 05-Apr.-2046	12.373	0,02
25.000	Kinder Morgan Energy Partners LP			30.000	Marriott International Inc/MD 3,600 % 15-Apr.-2024	30.180	0,05
	4,250 % 01-Sept.-2024	27.542	0,04	35.000	Marriott International Inc/MD 5,750 % 01-Mai-2025	38.062	0,06
20.000	Kinder Morgan Energy Partners LP			30.000	Marsh & McLennan Cos Inc 3,300 % 14-März-2023	31.982	0,05
	4,300 % 01-Mai-2024	21.953	0,04	30.000	Marsh & McLennan Cos Inc 3,500 % 03-Jun.-2024	32.911	0,05
30.000	Kinder Morgan Energy Partners LP			30.000	Marsh & McLennan Cos Inc 3,500 % 10-März-2025	33.239	0,05
	5,000 % 01-Okt.-2021	31.192	0,05	35.000	Marsh & McLennan Cos Inc 3,875 % 15-März-2024	38.764	0,06
10.000	Kinder Morgan Energy Partners LP			130.000	Marsh & McLennan Cos Inc 4,375 % 15-März-2029	154.905	0,25
	5,500 % 01-März-2044	11.864	0,02	20.000	Martin Marietta Materials Inc 3,450 % 01-Jun.-2027	21.556	0,03
10.000	Kinder Morgan Energy Partners LP			25.000	Martin Marietta Materials Inc 3,500 % 15-Dez.-2027	27.567	0,04
	6,375 % 01-März-2041	12.319	0,02	10.000	Masco Corp 4,450 % 01-Apr.-2025	11.333	0,02
10.000	Kinder Morgan Energy Partners LP			15.000	Massachusetts Institute of Technology		
	6,550 % 15-Sept.-2040	12.719	0,02		3,885 % 01-Jul.-2116	18.727	0,03
40.000	Kinder Morgan Inc 3,150 % 15-Jan.-2023	41.912	0,07	10.000	Mastercard Inc 2,950 % 01-Jun.-2029	11.251	0,02
15.000	Kinder Morgan Inc 4,300 % 01-Jun.-2025	16.840	0,03	25.000	Maxim Integrated Products Inc		
10.000	Kinder Morgan Inc 5,050 % 15-Feb.-2046	11.524	0,02		3,375 % 15-März-2023	25.984	0,04
15.000	Kinder Morgan Inc 5,550 % 01-Jun.-2045	18.337	0,03	20.000	McCormick & Co Inc/MD 2,500 % 15-Apr.-2030	20.908	0,03
15.000	Kinder Morgan Inc 'GMTN' 7,750 % 15-Jan.-2032	20.991	0,03	10.000	McCormick & Co Inc/MD 2,700 % 15-Aug.-2022	10.424	0,02
5.000	KLA Corp 3,300 % 01-März-2050	5.189	0,01	25.000	McCormick & Co Inc/MD 3,150 % 15-Aug.-2024	27.102	0,04
5.000	KLA Corp 4,100 % 15-März-2029	5.905	0,01	10.000	McCormick & Co Inc/MD 3,400 % 15-Aug.-2027	11.153	0,02
40.000	KLA Corp 4,650 % 01-Nov.-2024	45.900	0,07	15.000	McCormick & Co Inc/MD 4,200 % 15-Aug.-2047	17.904	0,03
5.000	Koninklijke Philips NV 5,000 % 15-März-2042	6.474	0,01	30.000	McDonald's Corp 'MTN' 1,450 % 01-Sept.-2025	30.794	0,05
20.000	Kroger Co/The 2,200 % 01-Mai-2030	20.847	0,03	15.000	McDonald's Corp 'MTN' 2,625 % 15-Jan.-2022	15.507	0,02
5.000	Kroger Co/The 3,400 % 15-Apr.-2022	5.213	0,01	30.000	McDonald's Corp 'MTN' 3,250 % 10-Jun.-2024	32.991	0,05
15.000	Kroger Co/The 3,950 % 15-Jan.-2050	17.268	0,03	10.000	McDonald's Corp 'MTN' 3,350 % 01-Apr.-2023	10.722	0,02
10.000	L3Harris Technologies Inc 3,832 % 27-Apr.-2025	11.172	0,02	10.000	McDonald's Corp 'MTN' 3,375 % 26-Mai-2025	11.103	0,02
25.000	L3Harris Technologies Inc 3,950 % 28-Mai-2024	27.414	0,04	25.000	McDonald's Corp 'MTN' 3,500 % 01-März-2027	28.331	0,05
25.000	L3Harris Technologies Inc 4,400 % 15-Jun.-2028	29.622	0,05	5.000	McDonald's Corp 'MTN' 3,625 % 01-Mai-2043	5.504	0,01
10.000	L3Harris Technologies Inc 4,400 % 15-Jun.-2028	11.849	0,02	20.000	McDonald's Corp 'MTN' 3,700 % 30-Jan.-2026	22.690	0,04
10.000	L3Harris Technologies Inc 4,854 % 27-Apr.-2035	12.777	0,02	10.000	McDonald's Corp 'MTN' 3,700 % 15-Feb.-2042	11.233	0,02
15.000	L3Harris Technologies Inc 5,054 % 27-Apr.-2045	19.768	0,03	10.000	McDonald's Corp 'MTN' 3,800 % 01-Apr.-2028	11.699	0,02
15.000	L3Harris Technologies Inc 6,150 % 15-Dez.-2040	21.143	0,03	15.000	McDonald's Corp 'MTN' 4,200 % 01-Apr.-2050	18.269	0,03

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener	Summe			Angemessener	Summe
		Wert	der Netto-			Wert	der Netto-
Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %	Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.				US-Dollar Forts.			
10.000	McDonald's Corp 'MTN' 4,450 % 01-Sept.-2048	12.376	0,02	50.000	Morgan Stanley 'GMTN' 3,875 % 27-Jan.-2026	56.603	0,09
25.000	McDonald's Corp 'MTN' 4,600 % 26-Mai-2045	30.806	0,05	30.000	Morgan Stanley 'GMTN' 4,000 % 23-Jul.-2025	34.039	0,05
15.000	McDonald's Corp 'MTN' 4,700 % 09-Dez.-2035	18.870	0,03	45.000	Morgan Stanley 'GMTN' 4,350 % 08-Sept.-2026	51.931	0,08
30.000	McDonald's Corp 'MTN' 4,875 % 09-Dez.-2045	38.511	0,06	25.000	Morgan Stanley 'GMTN' FRN 3,772 % 24-Jan.-2029	28.481	0,05
20.000	Merck & Co Inc 2,400 % 15-Sept.-2022	20.833	0,03	10.000	Morgan Stanley 'GMTN' FRN 4,431 % 23-Jan.-2030	11.923	0,02
15.000	Merck & Co Inc 2,750 % 10-Feb.-2025	16.299	0,03	50.000	Morgan Stanley 'MTN' 3,125 % 27-Jul.-2026	55.161	0,09
20.000	Merck & Co Inc 2,800 % 18-Mai-2023	21.320	0,03	80.000	Morgan Stanley 'MTN' 4,100 % 22-Mai-2023	86.493	0,14
15.000	Merck & Co Inc 2,900 % 07-März-2024	16.192	0,03	15.000	Motorola Solutions Inc 3,500 % 01-März-2023	15.939	0,03
10.000	Merck & Co Inc 3,400 % 07-März-2029	11.547	0,02	40.000	Motorola Solutions Inc 4,000 % 01-Sept.-2024	44.150	0,07
10.000	Merck & Co Inc 3,900 % 07-März-2039	12.102	0,02	30.000	Motorola Solutions Inc 4,600 % 23-Feb.-2028	34.141	0,05
20.000	Merck Sharp & Dohme Corp 5,950 % 01-Dez.-2028	27.052	0,04	25.000	Motorola Solutions Inc 4,600 % 23-Mai-2029	28.871	0,05
50.000	MetLife Inc 3,000 % 01-März-2025	54.906	0,09	15.000	MPLX LP 4,500 % 15-Apr.-2038	15.021	0,02
10.000	MetLife Inc 4,368 % 15-Sept.-2023	11.180	0,02	10.000	MPLX LP 4,700 % 15-Apr.-2048	10.110	0,02
15.000	MetLife Inc 4,550 % 23-März-2030	18.768	0,03	15.000	MPLX LP 4,875 % 01-Dez.-2024	16.669	0,03
5.000	MetLife Inc 5,700 % 15-Jun.-2035	7.207	0,01	15.000	MPLX LP 4,875 % 01-Jun.-2025	16.762	0,03
10.000	MetLife Inc 6,375 % 15-Jun.-2034	14.966	0,02	5.000	MPLX LP 4,900 % 15-Apr.-2058	5.040	0,01
25.000	Microsoft Corp 2,000 % 08-Aug.-2023	26.196	0,04	10.000	MPLX LP 5,500 % 15-Feb.-2049	11.099	0,02
25.000	Microsoft Corp 2,375 % 12-Feb.-2022	25.810	0,04	10.000	Nasdaq Inc 3,850 % 30-Jun.-2026	11.218	0,02
25.000	Microsoft Corp 2,375 % 01-Mai-2023	26.335	0,04	25.000	Nasdaq Inc 4,250 % 01-Jun.-2024	27.687	0,04
30.000	Microsoft Corp 2,400 % 06-Feb.-2022	30.971	0,05	20.000	National Fuel Gas Co 3,750 % 01-März-2023	20.399	0,03
11.000	Microsoft Corp 2,675 % 01-Jun.-2060	11.515	0,02	30.000	National Fuel Gas Co 3,950 % 15-Sept.-2027	29.462	0,05
10.000	Microsoft Corp 2,875 % 06-Feb.-2024	10.785	0,02	20.000	National Fuel Gas Co 4,750 % 01-Sept.-2028	20.327	0,03
20.000	Microsoft Corp 3,300 % 06-Feb.-2027	22.905	0,04	40.000	National Fuel Gas Co 4,900 % 01-Dez.-2021	41.382	0,07
10.000	Microsoft Corp 3,450 % 08-Aug.-2036	12.100	0,02	20.000	National Fuel Gas Co 5,200 % 15-Jul.-2025	21.203	0,03
25.000	Microsoft Corp 3,625 % 15-Dez.-2023	27.625	0,04	10.000	National Retail Properties Inc 3,100 % 15-Apr.-2050	8.559	0,01
5.000	Microsoft Corp 3,950 % 08-Aug.-2056	6.447	0,01	20.000	National Retail Properties Inc 3,900 % 15-Jun.-2024	21.306	0,03
15.000	Microsoft Corp 4,000 % 12-Feb.-2055	19.323	0,03	10.000	National Retail Properties Inc 4,800 % 15-Okt.-2048	10.743	0,02
30.000	Microsoft Corp 4,100 % 06-Feb.-2037	38.779	0,06	10.000	National Rural Utilities Cooperative Finance Corp		
10.000	Microsoft Corp 4,500 % 06-Feb.-2057	14.223	0,02		2,950 % 07-Feb.-2024	10.713	0,02
25.000	Mid-America Apartments LP 3,750 % 15-Jun.-2024	26.926	0,04	10.000	National Rural Utilities Cooperative Finance Corp		
25.000	MidAmerican Energy Co 3,500 % 15-Okt.-2024	27.785	0,04		4,023 % 01-Nov.-2032	11.869	0,02
10.000	MidAmerican Energy Co 6,750 % 30-Dez.-2031	14.896	0,02	20.000	National Rural Utilities Cooperative Finance Corp FRN		
15.000	MidAmerican Energy Co 'MTN' 5,750 % 01-Nov.-2035	21.483	0,03		5,250 % 20-Apr.-2046	21.263	0,03
10.000	Midwest Connector Capital Co LLC '144A'			30.000	Nevada Power Co 3,700 % 01-Mai-2029	34.815	0,06
	3,900 % 01-Apr.-2024	10.520	0,02	10.000	Nevada Power Co 6,750 % 01-Jul.-2037	15.108	0,02
50.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc			5.000	New York and Presbyterian Hospital/The		
	2,193 % 25-Feb.-2025	51.712	0,08		3,954 % 01-Aug.-2119	5.395	0,01
50.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc			50.000	New York Community Bancorp Inc FRN		
	3,761 % 26-Jul.-2023	54.275	0,09		5,900 % 06-Nov.-2028	49.670	0,08
5.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc			25.000	NewMarket Corp 4,100 % 15-Dez.-2022	26.588	0,04
	4,153 % 07-März-2039	6.013	0,01	35.000	Newmont Corp 2,800 % 01-Okt.-2029	36.985	0,06
100.000	Mizuho Financial Group Inc 4,018 % 05-März-2028	114.685	0,18	30.000	Newmont Corp 3,500 % 15-März-2022	30.928	0,05
45.000	Moody's Corp 2,625 % 15-Jan.-2023	47.190	0,08	40.000	Newmont Corp 3,625 % 09-Jun.-2021	40.844	0,07
5.000	Moody's Corp 2,750 % 15-Dez.-2021	5.148	0,01	10.000	Newmont Corp 4,875 % 15-März-2042	12.924	0,02
30.000	Moody's Corp 3,250 % 15-Jan.-2028	33.315	0,05	20.000	Newmont Corp 6,250 % 01-Okt.-2039	28.766	0,05
30.000	Moody's Corp 4,250 % 01-Feb.-2029	35.684	0,06	35.000	NextEra Energy Capital Holdings Inc		
20.000	Moody's Corp 4,875 % 17-Dez.-2048	26.555	0,04		2,403 % 01-Sept.-2021	35.799	0,06
50.000	Moody's Corp 5,250 % 15-Jul.-2044	69.387	0,11	60.000	NextEra Energy Capital Holdings Inc		
35.000	Morgan Stanley 2,750 % 19-Mai-2022	36.398	0,06		2,750 % 01-Mai-2025	65.055	0,10
25.000	Morgan Stanley 3,625 % 20-Jan.-2027	28.251	0,05	25.000	NextEra Energy Capital Holdings Inc		
50.000	Morgan Stanley 3,875 % 29-Apr.-2024	55.319	0,09		2,750 % 01-Nov.-2029	26.953	0,04
30.000	Morgan Stanley 3,950 % 23-Apr.-2027	33.795	0,05	50.000	NextEra Energy Capital Holdings Inc		
45.000	Morgan Stanley 4,875 % 01-Nov.-2022	48.974	0,08		2,800 % 15-Jan.-2023	52.703	0,08
45.000	Morgan Stanley 5,000 % 24-Nov.-2025	52.619	0,08	20.000	NextEra Energy Capital Holdings Inc		
50.000	Morgan Stanley 7,250 % 01-Apr.-2032	75.308	0,12		2,900 % 01-Apr.-2022	20.823	0,03
45.000	Morgan Stanley FRN 3,591 % 22-Jul.-2028	50.665	0,08	35.000	NextEra Energy Capital Holdings Inc		
45.000	Morgan Stanley FRN 3,737 % 24-Apr.-2024	48.467	0,08		3,150 % 01-Apr.-2024	38.029	0,06
10.000	Morgan Stanley FRN 3,971 % 22-Jul.-2038	11.841	0,02	30.000	NextEra Energy Capital Holdings Inc		
50.000	Morgan Stanley 'GMTN' 3,750 % 25-Feb.-2023	53.980	0,09		3,500 % 01-Apr.-2029	33.987	0,05

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener	Summe			Angemessener	Summe
		Wert	der Netto-			Wert	der Netto-
Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %	Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.				US-Dollar Forts.			
20.000	NextEra Energy Capital Holdings Inc			10.000	O'Reilly Automotive Inc 3,600% 01-Sept.-2027	11.256	0,02
	3,550 % 01-Mai-2027	22.705	0,04	25.000	O'Reilly Automotive Inc 3,900% 01-Jun.-2029	28.794	0,05
20.000	NextEra Energy Capital Holdings Inc FRN			10.000	O'Reilly Automotive Inc 4,350% 01-Jun.-2028	11.675	0,02
	4,800 % 01-Dez.-2077	20.766	0,03	50.000	ORIX Corp 3,250 % 04-Dez.-2024	53.958	0,09
65.000	NextEra Energy Capital Holdings Inc FRN			50.000	ORIX Corp 4,050 % 16-Jan.-2024	54.967	0,09
	5,650 % 01-Mai-2079	71.061	0,11	10.000	Otis Worldwide Corp '144A' 3,362 % 15-Feb.-2050	10.640	0,02
30.000	NiSource Inc 2,650 % 17-Nov.-2022	31.352	0,05	10.000	Owl Rock Capital Corp 3,750 % 22-Jul.-2025	9.783	0,02
10.000	NiSource Inc 3,650 % 15-Jun.-2023	10.810	0,02	25.000	PACCAR Financial Corp 'MTN' 2,850 % 01-März-2022	26.005	0,04
20.000	NiSource Inc 4,375 % 15-Mai-2047	24.206	0,04	15.000	PacifiCorp 3,600 % 01-Apr.-2024	16.433	0,03
30.000	NiSource Inc 5,250 % 15-Feb.-2043	38.620	0,06	15.000	PacifiCorp 5,250 % 15-Jun.-2035	20.714	0,03
25.000	Norfolk Southern Corp 2,550 % 01-Nov.-2029	26.686	0,04	25.000	PacifiCorp 6,250 % 15-Okt.-2037	36.439	0,06
50.000	Norfolk Southern Corp 3,000 % 01-Apr.-2022	51.985	0,08	10.000	PacifiCorp 7,700 % 15-Nov.-2031	15.325	0,02
5.000	Norfolk Southern Corp 3,850 % 15-Jan.-2024	5.540	0,01	35.000	Packaging Corp of America 3,000 % 15-Dez.-2029	38.054	0,06
10.000	Norfolk Southern Corp 3,942 % 01-Nov.-2047	11.808	0,02	10.000	Packaging Corp of America 3,400 % 15-Dez.-2027	11.030	0,02
5.000	Norfolk Southern Corp 3,950 % 01-Okt.-2042	5.843	0,01	30.000	Packaging Corp of America 3,650 % 15-Sept.-2024	32.762	0,05
10.000	Norfolk Southern Corp 4,650 % 15-Jan.-2046	13.088	0,02	30.000	Park Aerospace Holdings Ltd '144A'		
5.000	Norfolk Southern Corp 4,837 % 01-Okt.-2041	6.507	0,01		4,500 % 15-März-2023	27.386	0,04
25.000	Northern States Power Co/MN 2,150 % 15-Aug.-2022	25.706	0,04	35.000	Park Aerospace Holdings Ltd '144A'		
15.000	Northrop Grumman Corp 2,550 % 15-Okt.-2022	15.681	0,03		5,250 % 15-Aug.-2022	32.870	0,05
10.000	Northrop Grumman Corp 2,930 % 15-Jan.-2025	10.823	0,02	10.000	Park Aerospace Holdings Ltd '144A'		
15.000	Northrop Grumman Corp 4,030 % 15-Okt.-2047	18.214	0,03		5,500 % 15-Feb.-2024	9.156	0,01
20.000	Northrop Grumman Corp 4,750 % 01-Jun.-2043	25.975	0,04	5.000	Parker-Hannifin Corp 4,100 % 01-März-2047	5.724	0,01
10.000	Northrop Grumman Corp 5,250 % 01-Mai-2050	14.407	0,02	15.000	PartnerRe Finance B LLC 3,700 % 02-Jul.-2029	16.503	0,03
10.000	Novartis Capital Corp 3,400 % 06-Mai-2024	11.008	0,02	10.000	PayPal Holdings Inc 1,350 % 01-Jun.-2023	10.202	0,02
25.000	NSTAR Electric Co 3,200 % 15-Mai-2027	28.129	0,04	10.000	PayPal Holdings Inc 1,650 % 01-Jun.-2025	10.349	0,02
10.000	Nucor Corp 4,000 % 01-Aug.-2023	10.866	0,02	5.000	PayPal Holdings Inc 2,300 % 01-Jun.-2030	5.234	0,01
10.000	Nucor Corp 5,200 % 01-Aug.-2043	12.850	0,02	25.000	Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp '144A'		
25.000	NVIDIA Corp 2,850 % 01-Apr.-2030	27.871	0,04		3,350 % 01-Nov.-2029	25.533	0,04
20.000	NVIDIA Corp 3,200 % 16-Sept.-2026	22.685	0,04	20.000	Pentair Finance Sarl 4,500 % 01-Jul.-2029	21.931	0,04
10.000	Occidental Petroleum Corp 4,200 % 15-März-2048	6.784	0,01	40.000	People's United Financial Inc 3,650 % 06-Dez.-2022	41.589	0,07
5.000	Occidental Petroleum Corp 4,625 % 15-Jun.-2045	3.525	0,01	10.000	PepsiCo Inc 2,625 % 29-Jul.-2029	11.064	0,02
20.000	Occidental Petroleum Corp 6,450 % 15-Sept.-2036	17.003	0,03	20.000	PepsiCo Inc 2,750 % 01-März-2023	21.243	0,03
20.000	Omega Healthcare Investors Inc 4,375 % 01-Aug.-2023	20.784	0,03	45.000	PepsiCo Inc 2,750 % 30-Apr.-2025	49.136	0,08
25.000	Omega Healthcare Investors Inc 4,500 % 15-Jan.-2025	25.774	0,04	25.000	PepsiCo Inc 2,750 % 19-März-2030	27.902	0,04
10.000	Omega Healthcare Investors Inc 4,500 % 01-Apr.-2027	10.491	0,02	35.000	PepsiCo Inc 3,500 % 17-Jul.-2025	39.545	0,06
50.000	Omega Healthcare Investors Inc 4,750 % 15-Jan.-2028	52.989	0,08	15.000	PepsiCo Inc 3,600 % 01-März-2024	16.517	0,03
15.000	Omega Healthcare Investors Inc 4,950 % 01-Apr.-2024	15.813	0,03	5.000	PepsiCo Inc 5,500 % 15-Jan.-2040	7.315	0,01
50.000	ONE Gas Inc 2,000 % 15-Mai-2030	50.929	0,08	20.000	PepsiCo Inc 7,000 % 01-März-2029	28.866	0,05
5.000	ONEOK Inc 3,400 % 01-Sept.-2029	4.882	0,01	10.000	PerkinElmer Inc 3,300 % 15-Sept.-2029	10.739	0,02
20.000	ONEOK Inc 4,000 % 13-Jul.-2027	20.305	0,03	5.000	Pfizer Inc 2,550 % 28-Mai-2040	5.185	0,01
5.000	ONEOK Inc 4,450 % 01-Sept.-2049	4.647	0,01	20.000	Pfizer Inc 2,625 % 01-Apr.-2030	22.060	0,04
10.000	ONEOK Inc 5,200 % 15-Jul.-2048	10.015	0,02	5.000	Pfizer Inc 3,000 % 15-Jun.-2023	5.366	0,01
10.000	ONEOK Partners LP 3,375 % 01-Okt.-2022	10.357	0,02	10.000	Pfizer Inc 3,450 % 15-März-2029	11.694	0,02
20.000	ONEOK Partners LP 5,000 % 15-Sept.-2023	21.635	0,03	20.000	Pfizer Inc 3,600 % 15-Sept.-2028	23.597	0,04
25.000	Oracle Corp 2,400 % 15-Sept.-2023	26.157	0,04	10.000	Pfizer Inc 3,900 % 15-März-2039	12.332	0,02
35.000	Oracle Corp 2,500 % 01-Apr.-2025	37.527	0,06	10.000	Pfizer Inc 5,800 % 12-Aug.-2023	11.619	0,02
20.000	Oracle Corp 2,650 % 15-Jul.-2026	21.663	0,03	30.000	Pfizer Inc 7,200 % 15-März-2039	50.789	0,08
45.000	Oracle Corp 2,950 % 15-Nov.-2024	48.806	0,08	50.000	Philip Morris International Inc 2,100 % 01-Mai-2030	51.587	0,08
35.000	Oracle Corp 2,950 % 01-Apr.-2030	39.059	0,06	20.000	Philip Morris International Inc 2,125 % 10-Mai-2023	20.917	0,03
30.000	Oracle Corp 3,600 % 01-Apr.-2040	34.174	0,05	20.000	Philip Morris International Inc 2,375 % 17-Aug.-2022	20.776	0,03
25.000	Oracle Corp 3,625 % 15-Jul.-2023	27.268	0,04	5.000	Philip Morris International Inc 2,625 % 18-Feb.-2022	5.158	0,01
10.000	Oracle Corp 3,800 % 15-Nov.-2037	11.554	0,02	5.000	Philip Morris International Inc 3,250 % 10-Nov.-2024	5.539	0,01
25.000	Oracle Corp 3,850 % 15-Jul.-2036	29.209	0,05	25.000	Philip Morris International Inc 3,375 % 11-Aug.-2025	27.877	0,04
20.000	Oracle Corp 3,850 % 01-Apr.-2060	23.537	0,04	30.000	Philip Morris International Inc 3,375 % 15-Aug.-2029	34.138	0,05
10.000	Oracle Corp 3,900 % 15-Mai-2035	12.090	0,02	20.000	Phillips 66 4,300 % 01-Apr.-2022	21.208	0,03
50.000	Oracle Corp 4,300 % 08-Jul.-2034	62.073	0,10	10.000	Phillips 66 4,650 % 15-Nov.-2034	11.843	0,02
5.000	Oracle Corp 4,375 % 15-Mai-2055	6.292	0,01	15.000	Phillips 66 4,875 % 15-Nov.-2044	18.627	0,03
30.000	Orange SA 9,000 % 01-März-2031	48.983	0,08	20.000	Phillips 66 5,875 % 01-Mai-2042	27.126	0,04
10.000	O'Reilly Automotive Inc 3,550 % 15-März-2026	11.338	0,02	15.000	Phillips 66 Partners LP 2,450 % 15-Dez.-2024	15.458	0,02

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener		Summe	Bestände	Beschreibung	Angemessener		Summe
		Wert	der Netto-				Wert	der Netto-	
		in USD	vermögen %				in USD	vermögen %	
Anleihen Forts.					Anleihen Forts.				
US-Dollar Forts.					US-Dollar Forts.				
35.000	Phillips 66 Partners LP 3,605 % 15-Feb.-2025	37.401	0,06		10.000	Realty Income Corp 3,650 % 15-Jan.-2028	11.013	0,02	
5.000	Phillips 66 Partners LP 4,680 % 15-Feb.-2045	5.331	0,01		35.000	Regions Financial Corp 2,750 % 14-Aug.-2022	36.467	0,06	
10.000	Phillips 66 Partners LP 4,900 % 01-Okt.-2046	10.847	0,02		20.000	Reliance Steel & Aluminum Co 4,500 % 15-Apr.-2023	21.458	0,03	
20.000	Physicians Realty LP 3,950 % 15-Jan.-2028	20.424	0,03		10.000	RenaissanceRe Holdings Ltd 3,600 % 15-Apr.-2029	10.981	0,02	
15.000	Plains All American Pipeline LP / PAA Finance Corp 5,150 % 01-Jun.-2042	14.569	0,02		20.000	Republic Services Inc 2,300 % 01-März-2030	20.884	0,03	
50.000	PNC Financial Services Group Inc/The 2,550 % 22-Jan.-2030	54.105	0,09		25.000	Republic Services Inc 2,500 % 15-Aug.-2024	26.608	0,04	
25.000	PNC Financial Services Group Inc/The 3,300 % 08-März-2022	26.091	0,04		10.000	Republic Services Inc 2,900 % 01-Jul.-2026	10.940	0,02	
50.000	PNC Financial Services Group Inc/The 3,450 % 23-Apr.-2029	57.532	0,09		5.000	Republic Services Inc 3,050 % 01-März-2050	5.133	0,01	
25.000	PNC Financial Services Group Inc/The 3,500 % 23-Jan.-2024	27.348	0,04		25.000	Republic Services Inc 3,375 % 15-Nov.-2027	28.057	0,04	
35.000	PNC Financial Services Group Inc/The Step-Up Coupon 2,854 % 09-Nov.-2022	36.881	0,06		10.000	Republic Services Inc 3,550 % 01-Jun.-2022	10.510	0,02	
10.000	Precision Castparts Corp 2,500 % 15-Jan.-2023	10.487	0,02		15.000	Republic Services Inc 4,750 % 15-Mai-2023	16.637	0,03	
10.000	Precision Castparts Corp 3,250 % 15-Jun.-2025	11.104	0,02		5.000	Reynolds American Inc 5,700 % 15-Aug.-2035	6.156	0,01	
10.000	Principal Financial Group Inc 3,100 % 15-Nov.-2026	10.923	0,02		10.000	Reynolds American Inc 5,850 % 15-Aug.-2045	12.326	0,02	
50.000	Principal Financial Group Inc 3,700 % 15-Mai-2029	56.972	0,09		45.000	Rio Tinto Finance USA Ltd 3,750 % 15-Jun.-2025	50.928	0,08	
30.000	Procter & Gamble Co/The 2,150 % 11-Aug.-2022	31.156	0,05		30.000	Rockwell Automation Inc 2,875 % 01-März-2025	32.208	0,05	
5.000	Procter & Gamble Co/The 2,300 % 06-Feb.-2022	5.164	0,01		5.000	Rogers Communications Inc 3,700 % 15-Nov.-2049	5.530	0,01	
45.000	Procter & Gamble Co/The 2,450 % 25-März-2025	48.871	0,08		10.000	Rogers Communications Inc 4,350 % 01-Mai-2049	12.307	0,02	
35.000	Procter & Gamble Co/The 2,700 % 02-Feb.-2026	39.191	0,06		10.000	Rogers Communications Inc 5,000 % 15-März-2044	12.807	0,02	
10.000	Procter & Gamble Co/The 2,850 % 11-Aug.-2027	11.272	0,02		35.000	Roper Technologies Inc 2,350 % 15-Sept.-2024	36.910	0,06	
30.000	Procter & Gamble Co/The 3,000 % 25-März-2030	34.391	0,06		15.000	Roper Technologies Inc 3,125 % 15-Nov.-2022	15.721	0,03	
25.000	Procter & Gamble Co/The 3,100 % 15-Aug.-2023	27.307	0,04		45.000	Roper Technologies Inc 3,650 % 15-Sept.-2023	48.960	0,08	
5.000	Procter & Gamble Co/The 3,550 % 25-März-2040	6.025	0,01		25.000	Roper Technologies Inc 4,200 % 15-Sept.-2028	29.337	0,05	
15.000	Progressive Corp/The 2,450 % 15-Jan.-2027	16.038	0,03		20.000	Royal Bank of Canada 'GMTN' 1,950 % 17-Jan.-2023	20.640	0,03	
15.000	Progressive Corp/The 4,000 % 01-März-2029	17.967	0,03		20.000	Royal Bank of Canada 'GMTN' 2,250 % 01-Nov.-2024	21.056	0,03	
10.000	Prologis LP 3,875 % 15-Sept.-2028	11.865	0,02		20.000	Royal Bank of Canada 'GMTN' 2,550 % 16-Jul.-2024	21.251	0,03	
10.000	Prologis LP 4,375 % 01-Feb.-2029	12.170	0,02		5.000	Royal Bank of Canada 'GMTN' 2,750 % 01-Feb.-2022	5.188	0,01	
50.000	Prudential Financial Inc 'MTN' 2,100 % 10-März-2030	50.969	0,08		15.000	Royal Bank of Canada 'GMTN' 3,700 % 05-Okt.-2023	16.399	0,03	
10.000	Prudential Financial Inc 'MTN' 3,700 % 13-März-2051	10.986	0,02		20.000	Royal Bank of Canada 'GMTN' 4,650 % 27-Jan.-2026	23.322	0,04	
20.000	Prudential Financial Inc 'MTN' 6,625 % 01-Dez.-2037	29.291	0,05		20.000	RPM International Inc 4,250 % 15-Jan.-2048	19.730	0,03	
25.000	Public Service Co of Colorado 6,500 % 01-Aug.-2038	38.492	0,06		15.000	RPM International Inc 4,550 % 01-März-2029	16.890	0,03	
35.000	Public Service Enterprise Group Inc 2,875 % 15-Jun.-2024	37.409	0,06		10.000	RPM International Inc 5,250 % 01-Jun.-2045	11.315	0,02	
10.000	Public Storage 3,094 % 15-Sept.-2027	11.171	0,02		65.000	S&P Global Inc 2,500 % 01-Dez.-2029	70.383	0,11	
10.000	Public Storage 3,385 % 01-Mai-2029	11.559	0,02		10.000	S&P Global Inc 2,950 % 22-Jan.-2027	11.019	0,02	
40.000	Puget Energy Inc 3,650 % 15-Mai-2025	42.791	0,07		20.000	Sabine Pass Liquefaction LLC 4,200 % 15-März-2028	21.483	0,03	
10.000	Puget Sound Energy Inc 5,757 % 01-Okt.-2039	13.996	0,02		20.000	Sabine Pass Liquefaction LLC 5,625 % 01-März-2025	22.872	0,04	
10.000	QUALCOMM Inc 4,650 % 20-Mai-2035	13.322	0,02		100.000	Sabine Pass Liquefaction LLC 5,750 % 15-Mai-2024	112.671	0,18	
5.000	Quest Diagnostics Inc 2,950 % 30-Jun.-2030	5.286	0,01		10.000	Sabine Pass Liquefaction LLC 5,875 % 30-Jun.-2026	11.758	0,02	
10.000	QVC Inc 4,450 % 15-Feb.-2025	9.853	0,02		10.000	San Diego Gas & Electric Co 3,600 % 01-Sept.-2023	10.797	0,02	
5.000	Raytheon Technologies Corp 3,750 % 01-Nov.-2046	5.720	0,01		50.000	Sands China Ltd 4,600 % 08-Aug.-2023	52.765	0,08	
30.000	Raytheon Technologies Corp 3,950 % 16-Aug.-2025	34.159	0,05		20.000	Santander Holdings USA Inc 3,400 % 18-Jan.-2023	20.811	0,03	
25.000	Raytheon Technologies Corp 4,125 % 16-Nov.-2028	29.468	0,05		25.000	Santander Holdings USA Inc 3,500 % 07-Jun.-2024	26.311	0,04	
25.000	Raytheon Technologies Corp 4,500 % 01-Jun.-2042	31.204	0,05		20.000	Santander Holdings USA Inc 4,500 % 17-Jul.-2025	21.651	0,03	
5.000	Raytheon Technologies Corp 4,625 % 16-Nov.-2048	6.503	0,01		50.000	Santander UK Plc 4,000 % 13-März-2024	55.152	0,09	
10.000	Raytheon Technologies Corp 5,700 % 15-Apr.-2040	13.863	0,02		20.000	Schlumberger Finance Canada Ltd '144A' 2,650 % 20-Nov.-2022	20.630	0,03	
10.000	Raytheon Technologies Corp 6,050 % 01-Jun.-2036	14.178	0,02		20.000	Schlumberger Investment SA '144A' 2,400 % 01-Aug.-2022	20.504	0,03	
10.000	Raytheon Technologies Corp '144A' 3,500 % 15-März-2027	11.269	0,02		50.000	Seagate HDD Cayman 4,750 % 01-Jan.-2025	53.683	0,09	
5.000	Raytheon Technologies Corp '144A' 4,350 % 15-Apr.-2047	6.086	0,01		25.000	Seagate HDD Cayman 4,875 % 01-März-2024	26.813	0,04	
10.000	Raytheon Technologies Corp '144A' 4,875 % 15-Okt.-2040	12.779	0,02		10.000	Selective Insurance Group Inc 5,375 % 01-März-2049	11.559	0,02	
10.000	Realty Income Corp 3,250 % 15-Jun.-2029	10.825	0,02		35.000	Sempra Energy 3,550 % 15-Jun.-2024	37.678	0,06	
					35.000	Sempra Energy 4,050 % 01-Dez.-2023	38.153	0,06	
					5.000	Sempra Energy 6,000 % 15-Okt.-2039	6.916	0,01	
					20.000	Service Properties Trust 4,950 % 01-Okt.-2029	16.975	0,03	
					15.000	Shell International Finance BV 2,375 % 07-Nov.-2029	15.841	0,03	
					35.000	Shell International Finance BV 2,875 % 10-Mai-2026	38.455	0,06	
					5.000	Shell International Finance BV 3,250 % 11-Mai-2025	5.543	0,01	
					5.000	Shell International Finance BV 3,500 % 13-Nov.-2023	5.443	0,01	

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Angemessener				Summe	Angemessener				Summe
		Wert	der Netto-				Wert	der Netto-	
Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %		Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %	
Anleihen Forts.					Anleihen Forts.				
US-Dollar Forts.					US-Dollar Forts.				
15.000	Shell International Finance BV 3,875 % 13-Nov.-2028	17.454	0,03		100.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc			
15.000	Shell International Finance BV 6,375 % 15-Dez.-2038	22.532	0,04			3,040 % 16-Jul.-2029	107.755	0,17	
10.000	Sherwin-Williams Co/The 2,950 % 15-Aug.-2029	10.771	0,02		25.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc			
40.000	Sherwin-Williams Co/The 3,125 % 01-Jun.-2024	43.031	0,07			3,364 % 12-Jul.-2027	27.659	0,04	
30.000	Sherwin-Williams Co/The 3,450 % 01-Aug.-2025	33.136	0,05		25.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc			
10.000	Sherwin-Williams Co/The 4,500 % 01-Jun.-2047	12.194	0,02			3,446 % 11-Jan.-2027	27.796	0,04	
10.000	Sherwin-Williams Co/The 4,550 % 01-Aug.-2045	11.692	0,02		25.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc			
25.000	Shire Acquisitions Investments Ireland DAC					3,544 % 17-Jan.-2028	27.926	0,04	
	2,875 % 23-Sept.-2023	26.511	0,04		25.000	SVB Financial Group 3,500 % 29-Jan.-2025	26.463	0,04	
30.000	Shire Acquisitions Investments Ireland DAC				20.000	Synchrony Financial 2,850 % 25-Jul.-2022	20.349	0,03	
	3,200 % 23-Sept.-2026	33.315	0,05		55.000	Synchrony Financial 4,250 % 15-Aug.-2024	57.788	0,09	
15.000	Simon Property Group LP 2,350 % 30-Jan.-2022	15.293	0,02		5.000	Sysco Corp 2,600 % 12-Jun.-2022	5.156	0,01	
15.000	Simon Property Group LP 2,625 % 15-Jun.-2022	15.422	0,02		50.000	Sysco Corp 3,300 % 15-Jul.-2026	53.591	0,09	
50.000	Societe Generale SA '144A' 4,750 % 14-Sept.-2028	58.281	0,09		10.000	Sysco Corp 4,500 % 01-Apr.-2046	10.877	0,02	
15.000	Sonoco Products Co 5,750 % 01-Nov.-2040	18.436	0,03		30.000	Sysco Corp 6,600 % 01-Apr.-2050	41.708	0,07	
20.000	Southern California Edison Co 6,650 % 01-Apr.-2029	24.821	0,04		30.000	Target Corp 2,250 % 15-Apr.-2025	32.121	0,05	
50.000	Southern California Gas Co 2,550 % 01-Feb.-2030	53.949	0,09		25.000	TCI Communications Inc 7,125 % 15-Feb.-2028	34.813	0,06	
10.000	Southern California Gas Co 2,600 % 15-Jun.-2026	10.827	0,02		50.000	Telstra Corp Ltd '144A' 3,125 % 07-Apr.-2025	54.249	0,09	
30.000	Southern Co Gas Capital Corp 2,450 % 01-Okt.-2023	31.506	0,05		30.000	Tennessee Gas Pipeline Co LLC 7,000 % 15-Okt.-2028	38.004	0,06	
40.000	Southern Co Gas Capital Corp 4,400 % 01-Jun.-2043	45.401	0,07		5.000	Texas Eastern Transmission LP 7,000 % 15-Jul.-2032	6.724	0,01	
50.000	Southern Co Gas Capital Corp 5,875 % 15-März-2041	66.567	0,11		25.000	Texas Instruments Inc 1,375 % 12-März-2025	25.682	0,04	
35.000	Southern Co/The 2,350 % 01-Jul.-2021	35.601	0,06		5.000	Texas Instruments Inc 1,750 % 04-Mai-2030	5.087	0,01	
20.000	Southern Co/The 2,950 % 01-Jul.-2023	21.158	0,03		25.000	Texas Instruments Inc 2,250 % 04-Sept.-2029	26.633	0,04	
30.000	Southern Co/The 3,250 % 01-Jul.-2026	33.272	0,05		10.000	Texas Instruments Inc 2,625 % 15-Mai-2024	10.755	0,02	
20.000	Southern Co/The FRN 5,500 % 15-März-2057	20.287	0,03		10.000	Texas Instruments Inc 3,875 % 15-März-2039	12.440	0,02	
10.000	Southern Copper Corp 3,500 % 08-Nov.-2022	10.499	0,02		15.000	Thermo Fisher Scientific Inc 4,100 % 15-Aug.-2047	18.734	0,03	
10.000	Southern Copper Corp 5,250 % 08-Nov.-2042	11.884	0,02		50.000	Thermo Fisher Scientific Inc 4,150 % 01-Feb.-2024	55.533	0,09	
35.000	Southern Copper Corp 5,875 % 23-Apr.-2045	44.770	0,07		40.000	Thermo Fisher Scientific Inc 4,497 % 25-März-2030	49.637	0,08	
20.000	Southern Copper Corp 6,750 % 16-Apr.-2040	27.173	0,04		20.000	Thomson Reuters Corp 5,500 % 15-Aug.-2035	24.880	0,04	
20.000	Southwestern Electric Power Co 2,750 % 01-Okt.-2026	21.320	0,03		25.000	Thomson Reuters Corp 5,850 % 15-Apr.-2040	31.164	0,05	
30.000	Southwestern Electric Power Co 3,850 % 01-Feb.-2048	32.249	0,05		10.000	Time Warner Cable LLC 5,875 % 15-Nov.-2040	12.379	0,02	
15.000	Southwestern Electric Power Co 3,900 % 01-Apr.-2045	16.311	0,03		20.000	Time Warner Cable LLC 6,550 % 01-Mai-2037	26.340	0,04	
20.000	Spectra Energy Partners LP 4,500 % 15-März-2045	22.766	0,04		10.000	Time Warner Cable LLC 7,300 % 01-Jul.-2038	13.795	0,02	
10.000	Spectra Energy Partners LP 4,750 % 15-März-2024	11.182	0,02		50.000	T-Mobile USA Inc '144A' 1,500 % 15-Feb.-2026	50.121	0,08	
30.000	Spectra Energy Partners LP 5,950 % 25-Sept.-2043	37.713	0,06		50.000	T-Mobile USA Inc '144A' 2,050 % 15-Feb.-2028	50.148	0,08	
20.000	Standard Chartered Bank '144A' 8,000 % 30-Mai-2031	26.635	0,04		50.000	T-Mobile USA Inc '144A' 2,550 % 15-Feb.-2031	50.301	0,08	
60.000	Stanley Black & Decker Inc FRN 4,000 % 15-März-2060	60.094	0,10		55.000	T-Mobile USA Inc '144A' 3,500 % 15-Apr.-2025	59.965	0,10	
25.000	Starbucks Corp 2,000 % 12-März-2027	26.352	0,04		30.000	T-Mobile USA Inc '144A' 3,750 % 15-Apr.-2027	33.283	0,05	
20.000	Starbucks Corp 2,250 % 12-März-2030	20.588	0,03		90.000	T-Mobile USA Inc '144A' 3,875 % 15-Apr.-2030	100.335	0,16	
50.000	Starbucks Corp 2,550 % 15-Nov.-2030	52.565	0,08		20.000	T-Mobile USA Inc '144A' 4,500 % 15-Apr.-2050	23.855	0,04	
35.000	Starbucks Corp 3,100 % 01-März-2023	37.264	0,06		20.000	Toronto-Dominion Bank/The 'GMTN'			
15.000	Starbucks Corp 3,350 % 12-März-2050	15.569	0,02			3,500 % 19-Jul.-2023	21.879	0,03	
10.000	Starbucks Corp 3,500 % 01-März-2028	11.269	0,02		20.000	Toronto-Dominion Bank/The 'MTN'			
50.000	Starbucks Corp 3,500 % 15-Nov.-2050	52.929	0,08			1,900 % 01-Dez.-2022	20.660	0,03	
10.000	Starbucks Corp 3,750 % 01-Dez.-2047	10.790	0,02		20.000	Toronto-Dominion Bank/The 'MTN'			
15.000	Starbucks Corp 3,800 % 15-Aug.-2025	16.917	0,03			2,650 % 12-Jun.-2024	21.414	0,03	
15.000	Starbucks Corp 4,300 % 15-Jun.-2045	17.592	0,03		5.000	Total Capital SA 4,250 % 15-Dez.-2021	5.283	0,01	
10.000	Starbucks Corp 4,500 % 15-Nov.-2048	11.807	0,02		15.000	Toyota Motor Corp 3,669 % 20-Jul.-2028	17.462	0,03	
30.000	Steel Dynamics Inc 2,800 % 15-Dez.-2024	31.260	0,05		15.000	Toyota Motor Credit Corp 3,350 % 08-Jan.-2024	16.273	0,03	
30.000	Steel Dynamics Inc 4,125 % 15-Sept.-2025	30.684	0,05		50.000	Toyota Motor Credit Corp 'GMTN' 3,450 % 20-Sept.-2023	54.381	0,09	
15.000	Steel Dynamics Inc 5,000 % 15-Dez.-2026	15.882	0,03		40.000	Toyota Motor Credit Corp 'MTN' 1,800 % 13-Feb.-2025	41.489	0,07	
30.000	Steel Dynamics Inc 5,500 % 01-Okt.-2024	30.844	0,05		30.000	Toyota Motor Credit Corp 'MTN' 2,150 % 08-Sept.-2022	31.022	0,05	
40.000	Stifel Financial Corp 4,250 % 18-Jul.-2024	42.535	0,07		15.000	Toyota Motor Credit Corp 'MTN' 2,250 % 18-Okt.-2023	15.726	0,03	
5.000	Stryker Corp 3,375 % 01-Nov.-2025	5.600	0,01		35.000	Toyota Motor Credit Corp 'MTN' 3,000 % 01-Apr.-2025	38.065	0,06	
20.000	Stryker Corp 3,500 % 15-März-2026	22.509	0,04		20.000	Toyota Motor Credit Corp 'MTN' 3,300 % 12-Jan.-2022	20.842	0,03	
200.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc				15.000	Toyota Motor Credit Corp 'MTN' 3,375 % 01-Apr.-2030	17.300	0,03	
	2,724 % 27-Sept.-2029	210.625	0,34		15.000	Trane Technologies Global Holding Co Ltd			
50.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc					5,750 % 15-Jun.-2043	19.701	0,03	
	2,750 % 15-Jan.-2030	53.033	0,08		25.000	TransCanada PipeLines Ltd 2,500 % 01-Aug.-2022	25.788	0,04	

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener	Summe			Angemessener	Summe
		Wert	der Netto-			Wert	der Netto-
Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %	Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.				US-Dollar Forts.			
20.000	TransCanada PipeLines Ltd 3,750 % 16-Okt.-2023	21.619	0,03	5.000	US Bancorp 'MTN' 3,000 % 15-März-2022	5.220	0,01
10.000	TransCanada PipeLines Ltd 4,625 % 01-März-2034	11.512	0,02	30.000	US Bancorp 'MTN' 3,100 % 27-Apr.-2026	33.336	0,05
10.000	TransCanada PipeLines Ltd 4,750 % 15-Mai-2038	11.777	0,02	20.000	US Bancorp 'MTN' 3,600 % 11-Sept.-2024	22.277	0,04
35.000	TransCanada PipeLines Ltd 5,000 % 16-Okt.-2043	41.133	0,07	20.000	Vale Overseas Ltd 6,875 % 21-Nov.-2036	26.216	0,04
20.000	TransCanada PipeLines Ltd 5,100 % 15-März-2049	25.666	0,04	10.000	Valero Energy Corp 6,625 % 15-Jun.-2037	13.313	0,02
10.000	TransCanada PipeLines Ltd 5,850 % 15-März-2036	13.121	0,02	25.000	Valmont Industries Inc 5,000 % 01-Okt.-2044	26.059	0,04
20.000	TransCanada PipeLines Ltd 6,100 % 01-Jun.-2040	26.285	0,04	30.000	Ventas Realty LP 3,500 % 01-Feb.-2025	31.001	0,05
10.000	TransCanada PipeLines Ltd 7,625 % 15-Jan.-2039	15.501	0,02	5.000	Ventas Realty LP 4,000 % 01-März-2028	5.305	0,01
30.000	Transcanada Trust FRN 5,500 % 15-Sept.-2079	29.977	0,05	25.000	VEREIT Operating Partnership LP 3,100 % 15-Dez.-2029	24.115	0,04
10.000	Travelers Cos Inc/The 'MTN' 6,250 % 15-Jun.-2037	14.864	0,02	45.000	VEREIT Operating Partnership LP 4,625 % 01-Nov.-2025	48.695	0,08
10.000	Travelers Property Casualty Corp 6,375 % 15-März-2033	14.759	0,02	50.000	Verisk Analytics Inc 3,625 % 15-Mai-2050	56.765	0,09
10.000	Trimble Inc 4,150 % 15-Jun.-2023	10.668	0,02	25.000	Verisk Analytics Inc 4,125 % 15-März-2029	29.231	0,05
25.000	Trimble Inc 4,900 % 15-Jun.-2028	28.734	0,05	10.000	Verisk Analytics Inc 5,500 % 15-Jun.-2045	13.756	0,02
45.000	Trinity Acquisition Plc 4,400 % 15-März-2026	51.339	0,08	10.000	Verizon Communications Inc 2,450 % 01-Nov.-2022	10.396	0,02
10.000	Truist Bank 3,200 % 01-Apr.-2024	10.848	0,02	15.000	Verizon Communications Inc 2,625 % 15-Aug.-2026	16.335	0,03
20.000	Truist Bank 'BKNT' 2,450 % 01-Aug.-2022	20.733	0,03	20.000	Verizon Communications Inc 3,150 % 22-März-2030	22.481	0,04
20.000	Truist Bank 'BKNT' 3,000 % 02-Feb.-2023	21.161	0,03	40.000	Verizon Communications Inc 3,376 % 15-Feb.-2025	44.535	0,07
50.000	Truist Bank 'BKNT' FRN 3,502 % 02-Aug.-2022	51.595	0,08	20.000	Verizon Communications Inc 3,500 % 01-Nov.-2024	22.150	0,04
15.000	TWDC Enterprises 18 Corp 'MTN' 2,550 % 15-Feb.-2022	15.477	0,02	20.000	Verizon Communications Inc 3,875 % 08-Feb.-2029	23.672	0,04
5.000	Tyco Electronics Group SA 3,500 % 03-Feb.-2022	5.201	0,01	50.000	Verizon Communications Inc 4,016 % 03-Dez.-2029	59.746	0,10
25.000	Tyson Foods Inc 3,550 % 02-Jun.-2027	27.698	0,04	50.000	Verizon Communications Inc 4,125 % 16-März-2027	59.011	0,09
25.000	Tyson Foods Inc 3,950 % 15-Aug.-2024	27.712	0,04	10.000	Verizon Communications Inc 4,125 % 15-Aug.-2046	12.541	0,02
20.000	Tyson Foods Inc 4,000 % 01-März-2026	22.898	0,04	20.000	Verizon Communications Inc 4,272 % 15-Jan.-2036	24.763	0,04
10.000	Tyson Foods Inc 4,550 % 02-Jun.-2047	12.311	0,02	30.000	Verizon Communications Inc 4,329 % 21-Sept.-2028	36.131	0,06
20.000	Tyson Foods Inc 5,100 % 28-Sept.-2048	25.766	0,04	25.000	Verizon Communications Inc 4,400 % 01-Nov.-2034	31.162	0,05
25.000	UDR Inc 3,100 % 01-Nov.-2034	26.728	0,04	15.000	Verizon Communications Inc 4,500 % 10-Aug.-2033	18.704	0,03
15.000	UDR Inc 'MTN' 3,200 % 15-Jan.-2030	16.361	0,03	40.000	Verizon Communications Inc 4,522 % 15-Sept.-2048	53.006	0,08
100.000	Unilever Capital Corp 3,500 % 22-März-2028	115.585	0,19	40.000	Verizon Communications Inc 4,672 % 15-März-2055	54.482	0,09
25.000	Union Pacific Corp 2,400 % 05-Feb.-2030	26.690	0,04	20.000	Verizon Communications Inc 4,812 % 15-März-2039	26.160	0,04
5.000	Union Pacific Corp 2,950 % 01-März-2022	5.198	0,01	20.000	Verizon Communications Inc 4,862 % 21-Aug.-2046	27.204	0,04
25.000	Union Pacific Corp 2,950 % 15-Jan.-2023	26.430	0,04	10.000	Verizon Communications Inc 5,012 % 15-Apr.-2049	13.983	0,02
25.000	Union Pacific Corp 3,150 % 01-März-2024	27.156	0,04	5.000	Verizon Communications Inc 5,012 % 21-Aug.-2054	7.277	0,01
25.000	Union Pacific Corp 3,250 % 15-Jan.-2025	27.518	0,04	30.000	Verizon Communications Inc 5,150 % 15-Sept.-2023	34.182	0,05
10.000	Union Pacific Corp 3,250 % 05-Feb.-2050	11.009	0,02	20.000	Verizon Communications Inc 5,250 % 16-März-2037	26.807	0,04
10.000	Union Pacific Corp 3,375 % 01-Feb.-2035	11.280	0,02	10.000	Verizon Communications Inc 5,500 % 16-März-2047	14.848	0,02
10.000	Union Pacific Corp 3,646 % 15-Feb.-2024	10.948	0,02	10.000	Virginia Electric and Power Co 3,500 % 15-März-2027	11.357	0,02
25.000	Union Pacific Corp 3,750 % 15-März-2024	27.585	0,04	10.000	Virginia Electric and Power Co 6,000 % 15-Jan.-2036	13.841	0,02
40.000	Union Pacific Corp 3,750 % 15-Jul.-2025	45.311	0,07	25.000	Virginia Electric and Power Co 8,875 % 15-Nov.-2038	45.008	0,07
20.000	Union Pacific Corp 3,750 % 05-Feb.-2070	22.411	0,04	5.000	Visa Inc 2,700 % 15-Apr.-2040	5.366	0,01
20.000	Union Pacific Corp 3,799 % 01-Okt.-2051	23.838	0,04	20.000	Visa Inc 2,750 % 15-Sept.-2027	22.080	0,04
10.000	Union Pacific Corp 3,839 % 20-März-2060	11.619	0,02	40.000	Visa Inc 3,150 % 14-Dez.-2025	44.590	0,07
40.000	Union Pacific Corp 4,000 % 15-Apr.-2047	48.348	0,08	30.000	Vistra Operations Co LLC '144A' 3,550 % 15-Jul.-2024	30.982	0,05
10.000	Union Pacific Corp 4,050 % 01-März-2046	11.933	0,02	35.000	VMware Inc 2,950 % 21-Aug.-2022	36.217	0,06
15.000	Union Pacific Corp 4,300 % 01-März-2049	19.214	0,03	45.000	VMware Inc 3,900 % 21-Aug.-2027	47.784	0,08
15.000	Union Pacific Corp 4,500 % 10-Sept.-2048	19.374	0,03	30.000	VMware Inc 4,500 % 15-Mai-2025	32.858	0,05
5.000	Union Pacific Corp 'MTN' 3,550 % 15-Aug.-2039	5.625	0,01	5.000	Vodafone Group Plc 4,250 % 17-Sept.-2050	5.981	0,01
50.000	United Parcel Service Inc 4,450 % 01-Apr.-2030	62.555	0,10	10.000	Vodafone Group Plc 4,375 % 19-Feb.-2043	11.656	0,02
5.000	UnitedHealth Group Inc 2,750 % 15-Mai-2040	5.361	0,01	10.000	Vodafone Group Plc 4,875 % 19-Jun.-2049	12.660	0,02
35.000	UnitedHealth Group Inc 2,875 % 15-März-2023	37.328	0,06	10.000	Vodafone Group Plc 5,000 % 30-Mai-2038	12.584	0,02
30.000	UnitedHealth Group Inc 3,500 % 15-Jun.-2023	32.700	0,05	15.000	Vodafone Group Plc 5,250 % 30-Mai-2048	19.621	0,03
30.000	UnitedHealth Group Inc 3,500 % 15-Feb.-2024	33.023	0,05	15.000	Vodafone Group Plc 6,150 % 27-Feb.-2037	21.049	0,03
10.000	UnitedHealth Group Inc 3,500 % 15-Aug.-2039	11.645	0,02	5.000	Vornado Realty LP 3,500 % 15-Jan.-2025	5.001	0,01
30.000	UnitedHealth Group Inc 3,700 % 15-Dez.-2025	34.435	0,06	20.000	Vulcan Materials Co 3,900 % 01-Apr.-2027	21.909	0,04
40.000	UnitedHealth Group Inc 3,750 % 15-Jul.-2025	45.605	0,07	5.000	Vulcan Materials Co 4,500 % 15-Jun.-2047	5.599	0,01
10.000	UnitedHealth Group Inc 3,875 % 15-Aug.-2059	12.278	0,02	10.000	W R Berkley Corp 4,750 % 01-Aug.-2044	11.779	0,02
60.000	UnitedHealth Group Inc 6,875 % 15-Feb.-2038	93.554	0,15	10.000	Wachovia Corp 5,500 % 01-Aug.-2035	13.078	0,02
15.000	University of Chicago/The 4,003 % 01-Okt.-2053	19.126	0,03	25.000	Walmart Inc 2,850 % 08-Jul.-2024	27.222	0,04
5.000	University of Southern California 3,226 % 01-Okt.-2120	5.224	0,01	25.000	Walmart Inc 3,300 % 22-Apr.-2024	27.508	0,04
25.000	US Bancorp 'MTN' 2,950 % 15-Jul.-2022	26.211	0,04	35.000	Walmart Inc 3,400 % 26-Jun.-2023	38.149	0,06

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener				Angemessener	
		Wert	Summe			Wert	Summe
Bestände	Beschreibung	in USD	der Netto-	Bestände	Beschreibung	in USD	der Netto-
		vermögen %				vermögen %	
Anleihen Forts.							
US-Dollar Forts.							
35.000	Walmart Inc 3,550% 26-Jun.-2025	39.715	0,06	15.000	Williams Cos Inc/The 4,550% 24-Jun.-2024	16.650	0,03
20.000	Walmart Inc 3,700% 26-Jun.-2028	23.699	0,04	10.000	Williams Cos Inc/The 4,900% 15-Jan.-2045	10.607	0,02
45.000	Walmart Inc 3,950% 28-Jun.-2038	57.246	0,09	15.000	Williams Cos Inc/The 5,100% 15-Sept.-2045	16.510	0,03
10.000	Walmart Inc 4,875% 08-Jul.-2040	14.006	0,02	20.000	Williams Cos Inc/The 6,300% 15-Apr.-2040	24.116	0,04
10.000	Walmart Inc 5,250% 01-Sept.-2035	14.576	0,02	5.000	Williams Cos Inc/The 7,875% 01-Sept.-2021	5.377	0,01
35.000	Walmart Inc 5,625% 01-Apr.-2040	53.209	0,09	5.000	Willis North America Inc 2,950% 15-Sept.-2029	5.303	0,01
15.000	Walmart Inc 5,875% 05-Apr.-2027	19.297	0,03	15.000	Wisconsin Electric Power Co 2,050% 15-Dez.-2024	15.802	0,03
35.000	Walmart Inc 6,200% 15-Apr.-2038	54.011	0,09	15.000	Wisconsin Electric Power Co 5,625% 15-Mai-2033	21.922	0,04
35.000	Walmart Inc 6,500% 15-Aug.-2037	56.253	0,09	20.000	WP Carey Inc 3,850% 15-Jul.-2029	20.828	0,03
50.000	Walt Disney Co/The 3,000% 15-Sept.-2022	52.766	0,08	50.000	WP Carey Inc 4,000% 01-Feb.-2025	52.256	0,08
50.000	Walt Disney Co/The 3,500% 13-Mai-2040	54.805	0,09	10.000	WP Carey Inc 4,600% 01-Apr.-2024	10.658	0,02
50.000	Walt Disney Co/The 3,600% 13-Jan.-2051	55.963	0,09	10.000	WW Grainger Inc 1,850% 15-Feb.-2025	10.458	0,02
10.000	Walt Disney Co/The 3,800% 13-Mai-2060	11.595	0,02	10.000	Wyeth LLC 5,950% 01-Apr.-2037	14.617	0,02
25.000	Waste Connections Inc 3,050% 01-Apr.-2050	25.296	0,04	5.000	Wyeth LLC 6,500% 01-Feb.-2034	7.797	0,01
5.000	Waste Management Inc 2,400% 15-Mai-2023	5.228	0,01	20.000	Xcel Energy Inc 4,000% 15-Jun.-2028	23.568	0,04
5.000	Waste Management Inc 2,900% 15-Sept.-2022	5.229	0,01	20.000	Xilinx Inc 2,950% 01-Jun.-2024	21.477	0,03
25.000	Waste Management Inc 2,950% 15-Jun.-2024	25.607	0,04	15.000	XLIT Ltd 4,450% 31-März-2025	16.915	0,03
10.000	Waste Management Inc 3,125% 01-März-2025	10.927	0,02	5.000	Xylem Inc/NY 4,875% 01-Okt.-2021	5.265	0,01
25.000	Waste Management Inc 3,150% 15-Nov.-2027	28.003	0,04	30.000	Zimmer Biomet Holdings Inc 3,150% 01-Apr.-2022	31.133	0,05
40.000	Waste Management Inc 3,450% 15-Jun.-2029	41.234	0,07	20.000	Zimmer Biomet Holdings Inc 3,375% 30-Nov.-2021	20.612	0,03
25.000	Waste Management Inc 3,500% 15-Mai-2024	27.264	0,04	50.000	Zimmer Biomet Holdings Inc 3,550% 01-Apr.-2025	54.363	0,09
10.000	Waste Management Inc 3,900% 01-März-2035	11.862	0,02	45.000	Zoetis Inc 3,250% 01-Feb.-2023	47.532	0,08
35.000	Waste Management Inc 4,100% 01-März-2045	41.991	0,07	25.000	Zoetis Inc 3,900% 20-Aug.-2028	29.484	0,05
5.000	Waste Management Inc 4,150% 15-Jul.-2049	6.281	0,01	15.000	Zoetis Inc 3,950% 12-Sept.-2047	18.026	0,03
20.000	Waste Management Inc 7,000% 15-Jul.-2028	26.791	0,04	20.000	Zoetis Inc 4,450% 20-Aug.-2048	25.874	0,04
5.000	WEA Finance LLC '144A' 2,875% 15-Jan.-2027	4.886	0,01	10.000	Zoetis Inc 4,500% 13-Nov.-2025	11.685	0,02
20.000	Wells Fargo & Co 3,000% 22-Apr.-2026	21.858	0,03	20.000	Zoetis Inc 4,700% 01-Feb.-2043	26.407	0,04
20.000	Wells Fargo & Co 3,000% 23-Okt.-2026	21.814	0,03				
15.000	Wells Fargo & Co 3,069% 24-Jan.-2023	15.547	0,02	Summe der Anlagen in Anleihen 62.137.658 99,61			
50.000	Wells Fargo & Co 4,125% 15-Aug.-2023	54.365	0,09				
20.000	Wells Fargo & Co 5,950% 15-Dez.-2036	24.095	0,04				
20.000	Wells Fargo & Co FRN 3,068% 30-Apr.-2041	20.940	0,03				
20.000	Wells Fargo & Co 'MTN' 2,625% 22-Jul.-2022	20.845	0,03				
35.000	Wells Fargo & Co 'MTN' 3,750% 24-Jan.-2024	38.268	0,06				
50.000	Wells Fargo & Co 'MTN' FRN 2,406% 30-Okt.-2025	52.082	0,08				
10.000	Welltower Inc 3,100% 15-Jan.-2030	10.389	0,02				
15.000	Welltower Inc 4,000% 01-Jun.-2025	16.590	0,03				
20.000	Western Midstream Operating LP						
	4,500% 01-März-2028	18.800	0,03				
30.000	Western Midstream Operating LP						
	5,375% 01-Jun.-2021	30.075	0,05				
20.000	Western Union Co/The 2,850% 10-Jan.-2025	20.865	0,03				
30.000	Western Union Co/The 3,600% 15-März-2022	31.144	0,05				
10.000	Western Union Co/The 6,200% 17-Nov.-2036	11.355	0,02				
30.000	Westinghouse Air Brake Technologies Corp						
	4,400% 15-März-2024	31.842	0,05				
25.000	Westinghouse Air Brake Technologies Corp						
	4,950% 15-Sept.-2028	27.901	0,04				
20.000	Westpac Banking Corp 2,000% 13-Jan.-2023	20.714	0,03				
20.000	Westpac Banking Corp 2,350% 19-Feb.-2025	21.257	0,03				
20.000	Westpac Banking Corp 2,500% 28-Jun.-2022	20.800	0,03				
20.000	Westpac Banking Corp 2,700% 19-Aug.-2026	21.894	0,04				
15.000	Westpac Banking Corp 2,750% 11-Jan.-2023	15.827	0,03				
20.000	Westpac Banking Corp 3,350% 08-März-2027	22.704	0,04				
5.000	William Marsh Rice University 3,774% 15-Mai-2055	6.160	0,01				
45.000	Williams Cos Inc/The 3,600% 15-März-2022	46.786	0,07				
40.000	Williams Cos Inc/The 3,700% 15-Jan.-2023	42.323	0,07				
30.000	Williams Cos Inc/The 4,000% 15-Nov.-2021	30.993	0,05				
10.000	Williams Cos Inc/The 4,300% 04-März-2024	10.884	0,02				

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Nettovermögen %	Devisenterminkontrakte					Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
			Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungsdatum Kontrahent	
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 246.594 (siehe unten)	246.594	0,40						

Summe der Vermögenswerte zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert **62.390.626** **100,02**

Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement in USD	Angemessener Wert in USD	Summe der Nettovermögen %
Offene Terminkontrakte - (14.171)				
(1)	Euro-Bobl Short Futures Contracts Exp Sep.-2020	(151.650)	(1.080)	(0,00)
1	Euro-Bund Long Futures Contracts Exp Sep.-2020	198.320	(11)	(0,00)
3	SGX 10 Year Mini Japanese Government Bond Long Futures Contracts Exp Sep.-2020	421.986	(410)	(0,00)
(9)	U.S. 10 Year Ultra Treasury Note Short Futures Contracts Exp Sep.-2020	(1.417.359)	(5.205)	(0,01)
(2)	U.S. 2 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Sep.-2020	(441.656)	(57)	(0,00)
(20)	U.S. 5 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Sep.-2020	(2.514.844)	(3.892)	(0,01)
16	U.S. Treasury Ultra Bond Long Futures Contracts Exp Sep.-2020	3.490.500	(3.516)	(0,00)

Summe der offenen Terminkontrakte **(14.171)** **(0,02)**

Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften - (1.583.800) (siehe unten) (1.583.800) (2,54)

Summe der finanziellen Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert **(1.597.971)** **(2,56)**

Nettoumlaufvermögen **1.585.880** **2,54**

Summe der Nettovermögen **62.378.535** **100,00**

^ Siehe Erläuterung 18 zum Halbjahresabschluss.
Der Kontrahent für Futures ist Goldman Sachs.

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	97,10
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,01
OTC-Finanzderivate	0,39
Sonstiges Umlaufvermögen	2,50
Summe der Aktiva	100,00

BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund

US-Dollar	Kanadischer Dollar	1.846.458	2.481.000	15-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	18.898
US-Dollar	Euro	14.533.727	12.799.700	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	148.909
US-Dollar	Sterling	2.953.766	2.320.000	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	78.787
USD						246.594

US-Dollar	Kanadischer Dollar	77.094	105.000	15-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(252)
US-Dollar	Euro	224.686	200.000	15-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(82)
US-Dollar	Sterling	86.497	70.000	15-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(248)
USD						(582)
Netto USD						246.012

BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)

Euro	US-Dollar	100.453	114.117	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1.225)
USD						(1.225)
EUR						(1.090)

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

Sterling	US-Dollar	49.659.209	63.117.240	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1.578.802)
USD						(1.578.802)
GBP						(1.274.152)

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

Sterling	US-Dollar	100.370	127.571	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(3.191)
USD						(3.191)
GBP						(2.575)

BNY MELLON EFFICIENT U.S. HIGH YIELD BETA FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener	Summe			Angemessener	Summe
		Wert	der Netto-			Wert	der Netto-
Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %	Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen - 11.262.180 (31. Dezember 2019: -)				Anleihen Forts.			
138.000	iShares iBoxx High Yield Corporate Bond ETF - ETF	11.262.180	1,25	Werkstoffe Forts.			
Summe der Anlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen 11.262.180 1,25				260.000	Commercial Metals Co 5,750 % 15-Apr.-2026	267.271	0,03
				185.000	Compass Minerals International Inc '144A'		
					4,875 % 15-Jul.-2024	186.137	0,02
				370.000	Compass Minerals International Inc '144A'		
					6,750 % 01-Dez.-2027	389.125	0,04
				230.000	Consolidated Energy Finance SA '144A'		
					6,500 % 15-Mai-2026	194.019	0,02
				645.000	Consolidated Energy Finance SA '144A'		
					6,875 % 15-Jun.-2025	550.259	0,06
				450.000	Constellium SE '144A' 5,625 % 15-Jun.-2028	442.125	0,05
				500.000	Constellium SE '144A' 5,875 % 15-Feb.-2026	502.913	0,06
				422.000	Constellium SE '144A' 6,625 % 01-März-2025	428.070	0,05
				485.000	Cornerstone Chemical Co '144A' 6,750 % 15-Aug.-2024	438.268	0,05
				776.000	CVR Partners LP / CVR Nitrogen Finance Corp '144A'		
					9,250 % 15-Jun.-2023	762.501	0,08
				593.000	Element Solutions Inc '144A' 5,875 % 01-Dez.-2025	600.592	0,07
				585.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd '144A'		
					4,500 % 15-Sept.-2027	586.205	0,07
				695.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd '144A'		
					4,750 % 15-Mai-2022	709.939	0,08
				370.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd '144A'		
					5,125 % 15-März-2023	381.328	0,04
				554.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd '144A'		
					5,125 % 15-Mai-2024	572.063	0,06
				1.200.000	Freeport-McMoRan Inc 3,550 % 01-März-2022	1.202.670	0,13
				1.655.000	Freeport-McMoRan Inc 3,875 % 15-März-2023	1.658.310	0,18
				520.000	Freeport-McMoRan Inc 4,125 % 01-März-2028	505.614	0,06
				443.000	Freeport-McMoRan Inc 4,250 % 01-März-2030	430.126	0,05
				525.000	Freeport-McMoRan Inc 4,550 % 14-Nov.-2024	534.899	0,06
				645.000	Freeport-McMoRan Inc 5,000 % 01-Sept.-2027	648.681	0,07
				500.000	Freeport-McMoRan Inc 5,250 % 01-Sept.-2029	513.345	0,06
				601.000	Freeport-McMoRan Inc 5,400 % 14-Nov.-2034	595.797	0,07
				1.590.000	Freeport-McMoRan Inc 5,450 % 15-März-2043	1.563.582	0,17
				250.000	GCP Applied Technologies Inc '144A'		
					5,500 % 15-Apr.-2026	250.265	0,03
				240.000	HB Fuller Co 4,000 % 15-Feb.-2027	233.694	0,03
				351.000	Hecla Mining Co 7,250 % 15-Feb.-2028	357.143	0,04
				16.000	Hexion Inc '144A' 7,875 % 15-Jul.-2027	14.600	0,00
				115.000	Hudbay Minerals Inc '144A' 7,250 % 15-Jan.-2023	113.694	0,01
				30.000	IAMGOLD Corp '144A' 7,000 % 15-Apr.-2025	30.266	0,00
				409.000	INEOS Group Holdings SA '144A' 5,625 % 01-Aug.-2024	396.867	0,04
				100.000	Infrabuild Australia Pty Ltd '144A'		
					12,000 % 01-Okt.-2024	90.750	0,01
				275.000	Innophos Holdings Inc '144A' 9,375 % 15-Feb.-2028	270.359	0,03
				398.000	Joseph T Ryerson & Son Inc '144A'		
					11,000 % 15-Mai-2022	407.705	0,05
				130.000	JW Aluminum Continuous Cast Co '144A'		
					10,250 % 01-Jun.-2026	135.663	0,02
				300.000	Kaiser Aluminum Corp '144A' 4,625 % 01-März-2028	287.403	0,03
				148.000	Kaiser Aluminum Corp '144A' 6,500 % 01-Mai-2025	153.457	0,02
				150.000	Kraton Polymers LLC / Kraton Polymers Capital		
					Corp '144A' 7,000 % 15-Apr.-2025	151.277	0,02
				400.000	Mercer International Inc 5,500 % 15-Jan.-2026	377.262	0,04
				185.000	Mercer International Inc 6,500 % 01-Feb.-2024	182.476	0,02
				405.000	Mercer International Inc 7,375 % 15-Jan.-2025	404.198	0,04
				492.000	Methanex Corp 4,250 % 01-Dez.-2024	449.565	0,05
				350.000	Methanex Corp 5,250 % 15-Dez.-2029	310.520	0,03
				710.000	Mineral Resources Ltd '144A' 8,125 % 01-Mai-2027	756.438	0,08
				100.000	Mountain Province Diamonds Inc '144A'		
					8,000 % 15-Dez.-2022	55.969	0,01

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener		Bestände	Beschreibung	Angemessener	
		Wert	Summe			Wert	Summe
		in USD	der Netto-			in USD	der Netto-
			vermögen %				vermögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
	Werkstoffe Forts.				Kommunikation Forts.		
193.000	Neon Holdings Inc '144A' 10,125 % 01-Apr.-2026	192.517	0,02	75.000	Belo Corp 7,250 % 15-Sept.-2027	80.142	0,01
300.000	New Gold Inc '144A' 6,250 % 15-Nov.-2022	303.338	0,03	410.000	Belo Corp 7,750 % 01-Jun.-2027	455.848	0,05
270.000	New Gold Inc '144A' 6,375 % 15-Mai-2025	273.684	0,03	1.109.000	C&W Senior Financing DAC '144A'		
1.130.000	Novelis Corp '144A' 4,750 % 30-Jan.-2030	1.081.952	0,12		6,875 % 15-Sept.-2027	1.103.904	0,12
1.209.000	Novelis Corp '144A' 5,875 % 30-Sept.-2026	1.211.757	0,14	615.000	C&W Senior Financing DAC '144A'		
590.000	Nufarm Australia Ltd / Nufarm Americas Inc '144A'				7,500 % 15-Okt.-2026	630.624	0,07
	5,750 % 30-Apr.-2026	571.450	0,06	395.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A'		
420.000	OCI NV '144A' 5,250 % 01-Nov.-2024	404.775	0,05		4,000 % 01-März-2023	397.218	0,04
510.000	OCI NV '144A' 6,625 % 15-Apr.-2023	515.100	0,06	2.035.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A'		
513.000	Olin Corp 5,000 % 01-Feb.-2030	455.193	0,05		4,500 % 15-Aug.-2030	2.083.138	0,23
245.000	Olin Corp 5,125 % 15-Sept.-2027	229.787	0,03	1.125.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A'		
880.000	Olin Corp 5,625 % 01-Aug.-2029	810.722	0,09		4,500 % 01-Mai-2032	1.140.469	0,13
550.000	Olin Corp '144A' 9,500 % 01-Jun.-2025	614.281	0,07	2.590.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A'		
456.000	PolyOne Corp 5,250 % 15-März-2023	493.900	0,06		4,750 % 01-März-2030	2.654.025	0,30
217.000	PolyOne Corp '144A' 5,750 % 15-Mai-2025	223.646	0,02	2.215.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A'		
352.000	PQ Corp '144A' 5,750 % 15-Dez.-2025	355.923	0,04		5,000 % 01-Feb.-2028	2.289.203	0,26
719.000	Rain CII Carbon LLC / CII Carbon Corp '144A'			2.695.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A'		
	7,250 % 01-Apr.-2025	692.480	0,08		5,125 % 01-Mai-2027	2.792.155	0,31
351.000	Rayonier AM Products Inc '144A' 5,500 % 01-Jun.-2024	209.321	0,02	50.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A'		
45.000	Resolute Forest Products Inc 5,875 % 15-Mai-2023	41.339	0,00		5,375 % 01-Mai-2025	51.380	0,01
105.000	Schweitzer-Mauduit International Inc '144A'			840.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A'		
	6,875 % 01-Okt.-2026	107.736	0,01		5,375 % 01-Jun.-2029	887.158	0,10
300.000	Smurfit Kappa Treasury Funding DAC			1.610.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A'		
	7,500 % 20-Nov.-2025	349.410	0,04		5,500 % 01-Mai-2026	1.670.625	0,19
65.000	SPCM SA '144A' 4,875 % 15-Sept.-2025	65.708	0,01	1.731.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A'		
1.010.000	Starfruit Finco BV / Starfruit US Holdco LLC '144A'				5,750 % 15-Feb.-2026	1.794.259	0,20
	8,000 % 01-Okt.-2026	1.037.113	0,12	1.059.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A'		
246.000	Taseko Mines Ltd '144A' 8,750 % 15-Jun.-2022	206.275	0,02		5,875 % 01-Apr.-2024	1.093.153	0,12
290.000	TPC Group Inc '144A' 10,500 % 01-Aug.-2024	260.124	0,03	938.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A'		
581.000	Trinseo Materials Operating SCA / Trinseo Materials				5,875 % 01-Mai-2027	979.694	0,11
	Finance Inc '144A' 5,375 % 01-Sept.-2025	552.313	0,06	460.000	Cengage Learning Inc '144A' 9,500 % 15-Jun.-2024	323.677	0,04
335.000	Tronox Finance Plc '144A' 5,750 % 01-Okt.-2025	311.096	0,03	540.000	CenturyLink Inc 5,625 % 01-Apr.-2025	559.767	0,06
130.000	Tronox Inc '144A' 6,500 % 01-Mai-2025	131.544	0,01	1.036.000	CenturyLink Inc 5,800 % 15-März-2022	1.066.795	0,12
714.000	Tronox Inc '144A' 6,500 % 15-Apr.-2026	669.304	0,07	660.000	CenturyLink Inc 6,450 % 15-Jun.-2021	677.044	0,08
790.000	United States Steel Corp 6,250 % 15-März-2026	501.504	0,06	555.000	CenturyLink Inc 6,750 % 01-Dez.-2023	597.954	0,07
845.000	United States Steel Corp 6,875 % 15-Aug.-2025	576.801	0,06	300.000	CenturyLink Inc 6,875 % 15-Jan.-2028	320.178	0,04
325.000	Valvoline Inc '144A' 4,250 % 15-Feb.-2030	320.684	0,04	381.000	CenturyLink Inc 7,500 % 01-Apr.-2024	419.351	0,05
197.000	Venator Finance Sarl / Venator Materials LLC '144A'			575.000	CenturyLink Inc 7,600 % 15-Sept.-2039	620.120	0,07
	5,750 % 15-Jul.-2025	140.710	0,02	274.000	CenturyLink Inc 7,650 % 15-März-2042	295.042	0,03
82.000	WR Grace & Co-Conn '144A' 5,125 % 01-Okt.-2021	86.412	0,01	112.000	CenturyLink Inc '144A' 4,000 % 15-Feb.-2027	109.036	0,01
190.000	WR Grace & Co-Conn '144A' 5,625 % 01-Okt.-2024	200.668	0,02	250.000	CenturyLink Inc '144A' 5,125 % 15-Dez.-2026	249.764	0,03
				535.000	Cincinnati Bell Inc '144A' 7,000 % 15-Jul.-2024	547.367	0,06
				421.000	Cincinnati Bell Inc '144A' 8,000 % 15-Okt.-2025	440.953	0,05
	Kommunikation - 176.376.789			1.044.000	Clear Channel Worldwide Holdings Inc		
	(31. Dezember 2019: 145.463.206)	176.376.789	19,67		9,250 % 15-Feb.-2024	971.134	0,11
890.000	Altice Financing SA '144A' 5,000 % 15-Jan.-2028	885.510	0,10	85.000	Clear Channel Worldwide Holdings Inc '144A'		
2.550.000	Altice Financing SA '144A' 7,500 % 15-Mai-2026	2.677.564	0,30		5,125 % 15-Aug.-2027	81.750	0,01
200.000	Altice Finco SA '144A' 7,625 % 15-Feb.-2025	208.731	0,02	335.000	Cogent Communications Group Inc '144A'		
855.000	Altice France Holding SA '144A'				5,375 % 01-März-2022	345.809	0,04
	6,000 % 15-Feb.-2028	813.323	0,09	925.000	CommScope Inc '144A' 5,500 % 01-März-2024	936.563	0,10
760.000	Altice France Holding SA '144A'			645.000	CommScope Inc '144A' 5,500 % 15-Jun.-2024	656.823	0,07
	10,500 % 15-Mai-2027	840.503	0,09	1.125.000	CommScope Inc '144A' 6,000 % 01-März-2026	1.156.084	0,13
430.000	Altice France SA/France '144A'			355.000	CommScope Inc '144A' 7,125 % 01-Jul.-2028	355.923	0,04
	5,500 % 15-Jan.-2028	435.027	0,05	716.000	CommScope Inc '144A' 8,250 % 01-März-2027	737.093	0,08
4.054.000	Altice France SA/France '144A'			555.000	CommScope Technologies LLC '144A'		
	7,375 % 01-Mai-2026	4.231.768	0,47		5,000 % 15-März-2027	501.559	0,06
1.242.000	Altice France SA/France '144A'			1.210.000	CommScope Technologies LLC '144A'		
	8,125 % 01-Feb.-2027	1.359.860	0,15		6,000 % 15-Jun.-2025	1.171.643	0,13
159.000	AMC Networks Inc 4,750 % 15-Dez.-2022	158.956	0,02	1.261.000	Connect Finco SARL / Connect US Finco LLC '144A'		
500.000	AMC Networks Inc 4,750 % 01-Aug.-2025	493.403	0,05		6,750 % 01-Okt.-2026	1.197.193	0,13
915.000	AMC Networks Inc 5,000 % 01-Apr.-2024	908.709	0,10				

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener	Summe			Angemessener	Summe
		Wert	der Netto-			Wert	der Netto-
Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %	Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
Kommunikation Forts.				Kommunikation Forts.			
617.000	Consolidated Communications Inc 6,500 % 01-Okt.-2022	569.445	0,06	374.000	iHeartCommunications Inc '144A' 4,750 % 15-Jan.-2028	345.647	0,04
1.096.000	CSC Holdings LLC 5,250 % 01-Jun.-2024	1.156.395	0,13	370.000	iHeartCommunications Inc '144A' 5,250 % 15-Aug.-2027	354.900	0,04
480.000	CSC Holdings LLC 5,875 % 15-Sept.-2022	502.668	0,06	1.105.000	Intrado Corp '144A' 8,500 % 15-Okt.-2025	881.928	0,10
746.000	CSC Holdings LLC 6,750 % 15-Nov.-2021	785.184	0,09	485.000	Koninklijke KPN NV '144A' FRN 7,000 % 28-März-2073	522.221	0,06
1.400.000	CSC Holdings LLC '144A' 4,625 % 01-Dez.-2030	1.366.904	0,15	169.000	Lamar Media Corp 5,000 % 01-Mai-2023	170.371	0,02
675.000	CSC Holdings LLC '144A' 5,375 % 15-Jul.-2023	685.260	0,08	572.000	Lamar Media Corp 5,750 % 01-Feb.-2026	591.411	0,07
825.000	CSC Holdings LLC '144A' 5,375 % 01-Feb.-2028	864.522	0,10	445.000	Lamar Media Corp '144A' 3,750 % 15-Feb.-2028	420.937	0,05
1.200.000	CSC Holdings LLC '144A' 5,500 % 15-Mai-2026	1.235.130	0,14	600.000	Lamar Media Corp '144A' 4,000 % 15-Feb.-2030	575.820	0,06
1.025.000	CSC Holdings LLC '144A' 5,500 % 15-Apr.-2027	1.067.537	0,12	130.000	LCPR Senior Secured Financing DAC '144A' 6,750 % 15-Okt.-2027	132.820	0,01
100.000	CSC Holdings LLC '144A' 5,750 % 15-Jan.-2030	104.291	0,01	32.000	Level 3 Financing Inc 5,125 % 01-Mai-2023	32.083	0,00
1.700.000	CSC Holdings LLC '144A' 6,500 % 01-Feb.-2029	1.862.563	0,21	993.000	Level 3 Financing Inc 5,250 % 15-März-2026	1.022.606	0,11
270.000	CSC Holdings LLC '144A' 6,625 % 15-Okt.-2025	281.304	0,03	525.000	Level 3 Financing Inc 5,375 % 15-Jan.-2024	530.851	0,06
575.000	CSC Holdings LLC '144A' 7,500 % 01-Apr.-2028	629.139	0,07	469.000	Level 3 Financing Inc 5,375 % 01-Mai-2025	480.188	0,05
150.000	CSC Holdings LLC '144A' 7,750 % 15-Jul.-2025	156.482	0,02	575.000	Level 3 Financing Inc '144A' 4,625 % 15-Sept.-2027	580.948	0,06
1.255.000	CSC Holdings LLC '144A' 10,875 % 15-Okt.-2025	1.352.068	0,15	880.000	Liberty Interactive LLC 8,250 % 01-Feb.-2030	858.304	0,10
480.000	Cumulus Media New Holdings Inc '144A' 6,750 % 01-Jul.-2026	444.223	0,05	524.000	Liberty Interactive LLC 8,500 % 15-Jul.-2029	509.690	0,06
2.260.000	Diamond Sports Group LLC / Diamond Sports Finance Co '144A' 5,375 % 15-Aug.-2026	1.647.156	0,18	870.000	Match Group Inc/old '144A' 5,000 % 15-Dez.-2027	908.376	0,10
46.000	Diamond Sports Group LLC / Diamond Sports Finance Co '144A' 12,750 % 01-Dez.-2026	43.700	0,00	215.000	Match Group Inc/old '144A' 5,625 % 15-Feb.-2029	227.403	0,03
1.168.000	DISH DBS Corp 5,000 % 15-März-2023	1.166.850	0,13	1.133.000	McGraw-Hill Global Education Holdings LLC / McGraw-Hill Global Education Finance '144A' 7,875 % 15-Mai-2024	757.575	0,08
1.675.000	DISH DBS Corp 5,875 % 15-Jul.-2022	1.706.867	0,19	665.000	MDC Partners Inc '144A' 6,500 % 01-Mai-2024	620.528	0,07
1.952.000	DISH DBS Corp 5,875 % 15-Nov.-2024	1.945.588	0,22	1.045.000	Meredith Corp 6,875 % 01-Feb.-2026	872.711	0,10
1.340.000	DISH DBS Corp 6,750 % 01-Jun.-2021	1.367.336	0,15	100.000	Meredith Corp '144A' 6,500 % 01-Jul.-2025	99.500	0,01
1.875.000	DISH DBS Corp 7,750 % 01-Jul.-2026	1.991.006	0,22	480.000	Metropolitan Light Co Ltd '144A' 5,500 % 21-Nov.-2022	485.784	0,05
87.000	DISH DBS Corp '144A' 7,375 % 01-Jul.-2028	86.891	0,01	65.000	Midcontinent Communications / Midcontinent Finance Corp '144A' 5,375 % 15-Aug.-2027	66.231	0,01
225.000	DKT Finance ApS '144A' 9,375 % 17-Jun.-2023	226.969	0,03	319.000	National CineMedia LLC 5,750 % 15-Aug.-2026	221.246	0,02
100.000	E*TRADE Financial Corp FRN (Immerwährend) 5,875 % 15-Sept.-2026	104.179	0,01	294.000	National CineMedia LLC '144A' 5,875 % 15-Apr.-2028	242.678	0,03
364.000	EIG Investors Corp 10,875 % 01-Feb.-2024	354.407	0,04	858.000	Netflix Inc 4,375 % 15-Nov.-2026	895.537	0,10
1.260.000	Embarq Corp 7,995 % 01-Jun.-2036	1.417.777	0,16	1.300.000	Netflix Inc 4,875 % 15-Apr.-2028	1.392.170	0,16
280.000	Entercom Media Corp '144A' 6,500 % 01-Mai-2027	252.297	0,03	520.000	Netflix Inc 5,500 % 15-Feb.-2022	543.855	0,06
371.000	Entercom Media Corp '144A' 7,250 % 01-Nov.-2024	324.122	0,04	145.000	Netflix Inc 5,750 % 01-März-2024	157.491	0,02
326.000	EW Scripps Co/The '144A' 5,125 % 15-Mai-2025	310.888	0,03	785.000	Netflix Inc 5,875 % 15-Feb.-2025	869.470	0,10
296.000	GCI LLC 6,875 % 15-Apr.-2025	305.959	0,03	1.405.000	Netflix Inc 5,875 % 15-Nov.-2028	1.602.452	0,18
65.000	GCI LLC '144A' 6,625 % 15-Jun.-2024	68.216	0,01	660.000	Netflix Inc 6,375 % 15-Mai-2029	766.715	0,09
220.000	Getty Images Inc '144A' 9,750 % 01-März-2027	208.056	0,02	540.000	Netflix Inc '144A' 3,625 % 15-Jun.-2025	546.412	0,06
446.000	Go Daddy Operating Co LLC / GD Finance Co Inc '144A' 5,250 % 01-Dez.-2027	454.837	0,05	175.000	Netflix Inc '144A' 4,875 % 15-Jun.-2030	188.158	0,02
615.000	Gogo Intermediate Holdings LLC / Gogo Finance Co Inc '144A' 9,875 % 01-Mai-2024	524.352	0,06	856.000	Netflix Inc '144A' 5,375 % 15-Nov.-2029	938.672	0,10
391.000	Gray Television Inc '144A' 5,125 % 15-Okt.-2024	392.019	0,04	865.000	Nexstar Broadcasting Inc '144A' 5,625 % 01-Aug.-2024	873.741	0,10
717.000	Gray Television Inc '144A' 5,875 % 15-Jul.-2026	715.340	0,08	909.000	Nexstar Broadcasting Inc '144A' 5,625 % 15-Jul.-2027	904.482	0,10
753.000	Gray Television Inc '144A' 7,000 % 15-Mai-2027	773.820	0,09	170.000	Nokia of America Corp 6,450 % 15-März-2029	175.100	0,02
430.000	GrubHub Holdings Inc '144A' 5,500 % 01-Jul.-2027	440.645	0,05	374.000	Nokia Oyj 3,375 % 12-Jun.-2022	382.630	0,04
360.000	GTT Communications Inc '144A' 7,875 % 31-Dez.-2024	190.125	0,02	450.000	Nokia Oyj 4,375 % 12-Jun.-2027	476.521	0,05
68.000	HC2 Holdings Inc '144A' 11,500 % 01-Dez.-2021	64.982	0,01	287.000	Nokia Oyj 6,625 % 15-Mai-2039	342.361	0,04
35.000	Houghton Mifflin Harcourt Publishers Inc '144A' 9,000 % 15-Feb.-2025	33.939	0,00	330.000	NortonLifeLock Inc 3,950 % 15-Jun.-2022	336.187	0,04
910.000	Hughes Satellite Systems Corp 5,250 % 01-Aug.-2026	944.362	0,11	765.000	NortonLifeLock Inc '144A' 5,000 % 15-Apr.-2025	780.300	0,09
1.084.000	Hughes Satellite Systems Corp 6,625 % 01-Aug.-2026	1.128.921	0,13	160.000	ORBCOMM Inc '144A' 8,000 % 01-Apr.-2024	152.750	0,02
481.000	Hughes Satellite Systems Corp 7,625 % 15-Jun.-2021	496.524	0,06	575.000	Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp '144A' 4,625 % 15-März-2030	521.347	0,06
960.332	iHeartCommunications Inc 6,375 % 01-Mai-2026	952.976	0,11	340.000	Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp '144A' 5,000 % 15-Aug.-2027	306.575	0,03
1.339.886	iHeartCommunications Inc 8,375 % 01-Mai-2027	1.230.263	0,14	100.000	Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital Corp '144A' 6,250 % 15-Jun.-2025	101.093	0,01

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener		Summe			Angemessener		Summe		
Bestände	Beschreibung	Wert in USD	der Netto- vermögen %		Bestände	Beschreibung	Wert in USD	der Netto- vermögen %			
Anleihen Forts.					Anleihen Forts.						
Kommunikation Forts.					Kommunikation Forts.						
160.000	Photo Holdings Merger Sub Inc '144A'				269.000	T-Mobile USA Inc 5,125 % 15-Apr.-2025	275.890		0,03		
	8,500 % 01-Okt.-2026	151.275	0,02		699.000	T-Mobile USA Inc 5,375 % 15-Apr.-2027	737.728		0,08		
282.000	Plantronics Inc '144A' 5,500 % 31-Mai-2023	246.571	0,03		200.000	T-Mobile USA Inc 6,000 % 01-März-2023	201.174		0,02		
294.000	Qualitytech LP / QTS Finance Corp '144A'				362.000	T-Mobile USA Inc 6,000 % 15-Apr.-2024	370.983		0,04		
	4,750 % 15-Nov.-2025	301.102	0,03		665.000	T-Mobile USA Inc 6,500 % 15-Jan.-2024	681.502		0,08		
610.000	Quebecor Media Inc 5,750 % 15-Jan.-2023	640.564	0,07		1.113.000	T-Mobile USA Inc 6,500 % 15-Jan.-2026	1.164.671		0,13		
993.000	Qwest Corp 6,750 % 01-Dez.-2021	1.049.694	0,12		292.000	Townsquare Media Inc '144A' 6,500 % 01-Apr.-2023	252.184		0,03		
104.000	Qwest Corp 7,250 % 15-Sept.-2025	118.110	0,01		404.000	Trilogy International Partners LLC / Trilogy International Finance Inc '144A'					
295.000	Radiate Holdco LLC / Radiate Finance Inc '144A'					8,875 % 01-Mai-2022	358.960		0,04		
	6,625 % 15-Feb.-2025	294.662	0,03		625.000	Twitter Inc '144A' 3,875 % 15-Dez.-2027	626.625		0,07		
215.000	Radiate Holdco LLC / Radiate Finance Inc '144A'				574.000	Uber Technologies Inc '144A' 7,500 % 01-Nov.-2023	581.528		0,06		
	6,875 % 15-Feb.-2023	218.471	0,02		1.326.000	Uber Technologies Inc '144A' 7,500 % 15-Mai-2025	1.341.746		0,15		
50.000	Salem Media Group Inc '144A' 6,750 % 01-Jun.-2024	41.000	0,00		1.050.000	Uber Technologies Inc '144A' 7,500 % 15-Sept.-2027	1.055.035		0,12		
370.000	Scripps Escrow Inc '144A' 5,875 % 15-Jul.-2027	351.200	0,04		1.310.000	Uber Technologies Inc '144A' 8,000 % 01-Nov.-2026	1.334.235		0,15		
515.000	Sinclair Television Group Inc '144A'				309.000	United States Cellular Corp 6,700 % 15-Dez.-2033	360.113		0,04		
	5,125 % 15-Feb.-2027	470.483	0,05		360.000	Univision Communications Inc '144A'					
370.000	Sinclair Television Group Inc '144A'					5,125 % 15-Mai-2023	364.437		0,04		
	5,500 % 01-März-2030	342.875	0,04		1.597.000	Univision Communications Inc '144A'					
290.000	Sinclair Television Group Inc '144A'					5,125 % 15-Feb.-2025	1.509.173		0,17		
	5,625 % 01-Aug.-2024	279.155	0,03		400.000	Univision Communications Inc '144A'					
218.000	Sinclair Television Group Inc '144A'					9,500 % 01-Mai-2025	426.000		0,05		
	5,875 % 15-März-2026	215.506	0,02		1.024.000	UPC Holding BV '144A' 5,500 % 15-Jan.-2028	985.789		0,11		
928.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 3,875 % 01-Aug.-2022	936.050	0,10		170.000	Urban One Inc '144A' 7,375 % 15-Apr.-2022	151.898		0,02		
132.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 4,625 % 15-Mai-2023	133.070	0,01		350.000	VEON Holdings BV '144A' 4,000 % 09-Apr.-2025	362.476		0,04		
1.619.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 4,625 % 15-Jul.-2024	1.662.486	0,19		510.000	VEON Holdings BV 'REGS' 5,950 % 13-Feb.-2023	552.899		0,06		
1.603.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 5,000 % 01-Aug.-2027	1.640.727	0,18		400.000	VEON Holdings BV 'REGS' 7,250 % 26-Apr.-2023	443.790		0,05		
350.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 5,375 % 15-Apr.-2025	360.362	0,04		60.000	VeriSign Inc 4,625 % 01-Mai-2023	60.531		0,01		
630.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 5,375 % 15-Jul.-2026	652.614	0,07		710.000	VeriSign Inc 4,750 % 15-Jul.-2027	747.492		0,08		
693.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 5,500 % 01-Jul.-2029	731.032	0,08		660.000	VeriSign Inc 5,250 % 01-Apr.-2025	732.669		0,08		
2.237.000	Sprint Capital Corp 6,875 % 15-Nov.-2028	2.729.699	0,30		399.000	ViacomCBS Inc FRN 5,875 % 28-Feb.-2057	394.150		0,04		
1.623.000	Sprint Capital Corp 8,750 % 15-März-2032	2.324.542	0,26		440.000	ViacomCBS Inc FRN 6,250 % 28-Feb.-2057	451.053		0,05		
2.258.000	Sprint Communications Inc 6,000 % 15-Nov.-2022	2.384.708	0,27		540.000	ViaSat Inc '144A' 5,625 % 15-Sept.-2025	518.457		0,06		
61.000	Sprint Communications Inc 9,250 % 15-Apr.-2022	67.619	0,01		493.000	ViaSat Inc '144A' 5,625 % 15-Apr.-2027	505.850		0,06		
740.000	Sprint Communications Inc 11,500 % 15-Nov.-2021	821.234	0,09		900.000	ViaSat Inc '144A' 6,500 % 15-Jul.-2028	902.439		0,10		
2.295.000	Sprint Corp 7,125 % 15-Jun.-2024	2.595.507	0,29		670.000	Videotron Ltd 5,000 % 15-Jul.-2022	693.862		0,08		
1.713.000	Sprint Corp 7,250 % 15-Sept.-2021	1.797.802	0,20		814.000	Videotron Ltd '144A' 5,125 % 15-Apr.-2027	846.995		0,09		
1.190.000	Sprint Corp 7,625 % 15-Feb.-2025	1.375.533	0,15		500.000	Videotron Ltd '144A' 5,375 % 15-Jun.-2024	534.057		0,06		
1.112.000	Sprint Corp 7,625 % 01-März-2026	1.315.146	0,15		752.000	Virgin Media Secured Finance Plc '144A'					
3.435.000	Sprint Corp 7,875 % 15-Sept.-2023	3.872.945	0,43			5,500 % 15-Aug.-2026	771.435		0,09		
110.000	TEGNA Inc '144A' 4,625 % 15-März-2028	101.841	0,01		1.249.000	Virgin Media Secured Finance Plc '144A'					
367.000	TEGNA Inc '144A' 5,000 % 15-Sept.-2029	343.919	0,04			5,500 % 15-Mai-2029	1.307.459		0,15		
385.000	TEGNA Inc '144A' 5,500 % 15-Sept.-2024	389.453	0,04		1.484.000	Vodafone Group Plc FRN 7,000 % 04-Apr.-2079	1.739.757		0,19		
615.000	Telecom Italia Capital SA 6,000 % 30-Sept.-2034	670.292	0,07		369.000	Zayo Group Holdings Inc '144A' 4,000 % 01-März-2027	351.760		0,04		
559.000	Telecom Italia Capital SA 6,375 % 15-Nov.-2033	631.567	0,07		799.000	Zayo Group Holdings Inc '144A' 6,125 % 01-März-2028	778.402		0,09		
739.000	Telecom Italia Capital SA 7,200 % 18-Jul.-2036	881.812	0,10		126.000	Ziggo Bond Co BV '144A' 5,125 % 28-Feb.-2030	125.234		0,01		
516.000	Telecom Italia Capital SA 7,721 % 04-Jun.-2038	650.929	0,07		690.000	Ziggo Bond Co BV '144A' 6,000 % 15-Jan.-2027	702.354		0,08		
1.115.000	Telecom Italia SpA/Milano '144A'				100.000	Ziggo BV '144A' 4,875 % 15-Jan.-2030	100.770		0,01		
	5,303 % 30-Mai-2024	1.167.054	0,13		1.956.000	Ziggo BV '144A' 5,500 % 15-Jan.-2027	1.984.176		0,22		
668.000	Telefonaktiebolaget LM Ericsson				Zyklische Konsumwerte - 205.149.148 (31. Dezember 2019: 116.079.946)					205.149.148	22,88
	4,125 % 15-Mai-2022	701.477	0,08		297.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc '144A'					
600.000	Telenet Finance Luxembourg Notes Sarl '144A'					3,875 % 15-Jan.-2028	288.642		0,03		
	5,500 % 01-März-2028	630.000	0,07		1.770.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc '144A'					
80.000	Telesat Canada / Telesat LLC '144A'					4,250 % 15-Mai-2024	1.774.903		0,20		
	4,875 % 01-Jun.-2027	78.650	0,01		215.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc '144A'					
405.000	Telesat Canada / Telesat LLC '144A'					4,375 % 15-Jan.-2028	211.104		0,02		
	6,500 % 15-Okt.-2027	397.714	0,04		2.594.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc '144A'					
240.000	Terrier Media Buyer Inc '144A' 8,875 % 15-Dez.-2027	230.700	0,03			5,000 % 15-Okt.-2025	2.583.118		0,29		
375.000	T-Mobile USA Inc 4,000 % 15-Apr.-2022	385.176	0,04								
742.000	T-Mobile USA Inc 4,500 % 01-Feb.-2026	752.410	0,08								
1.605.000	T-Mobile USA Inc 4,750 % 01-Feb.-2028	1.698.082	0,19								

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener	Summe			Angemessener	Summe
		Wert	der Netto-			Wert	der Netto-
Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %	Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
Zyklische Konsumwerte Forts.				Zyklische Konsumwerte Forts.			
14.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc '144A'			540.000	Beazer Homes USA Inc 5,875 % 15-Okt.-2027	517.404	0,06
	5,750 % 15-Apr.-2025	14.726	0,00	170.000	Beazer Homes USA Inc 6,750 % 15-März-2025	168.920	0,02
215.000	24 Hour Fitness Worldwide Inc '144A' (Defaulted)			500.000	Beazer Homes USA Inc 7,250 % 15-Okt.-2029	486.577	0,05
	8,000 % 01-Jun.-2022	5.913	0,00	185.000	Bed Bath & Beyond Inc 3,749 % 01-Aug.-2024	154.013	0,02
269.000	AAG FH LP / AAG FH Finco Inc '144A'			110.000	Bed Bath & Beyond Inc 4,915 % 01-Aug.-2034	66.550	0,01
	9,750 % 15-Jul.-2024	252.860	0,03	336.000	Bed Bath & Beyond Inc 5,165 % 01-Aug.-2044	191.654	0,02
750.000	Adient Global Holdings Ltd '144A' 4,875 % 15-Aug.-2026	618.064	0,07	735.000	Boyd Gaming Corp 6,000 % 15-Aug.-2026	689.621	0,08
215.000	Adient US LLC '144A' 7,000 % 15-Mai-2026	222.877	0,02	570.000	Boyd Gaming Corp 6,375 % 01-Apr.-2026	542.577	0,06
400.000	Adient US LLC '144A' 9,000 % 15-Apr.-2025	432.630	0,05	1.010.000	Boyd Gaming Corp '144A' 4,750 % 01-Dez.-2027	870.782	0,10
160.000	Allen Media LLC / Allen Media Co-Issuer Inc '144A'			300.000	Boyd Gaming Corp '144A' 8,625 % 01-Jun.-2025	314.063	0,03
	10,500 % 15-Feb.-2028	146.879	0,02	434.000	Boyne USA Inc '144A' 7,250 % 01-Mai-2025	456.197	0,05
715.000	Allison Transmission Inc '144A' 4,750 % 01-Okt.-2027	712.183	0,08	230.000	Brinker International Inc 3,875 % 15-Mai-2023	213.469	0,02
715.000	Allison Transmission Inc '144A' 5,000 % 01-Okt.-2024	715.436	0,08	268.000	Brinker International Inc '144A'		
285.000	Allison Transmission Inc '144A' 5,875 % 01-Jun.-2029	297.228	0,03		5,000 % 01-Okt.-2024	250.887	0,03
35.000	AMC Entertainment Holdings Inc 5,875 % 15-Nov.-2026	11.463	0,00	370.000	Brookfield Residential Properties Inc /		
172.000	AMC Entertainment Holdings Inc 6,125 % 15-Mai-2027	54.610	0,01		Brookfield Residential US Corp '144A'		
408.121	American Airlines 2013-2 Class A Pass Through Trust				4,875 % 15-Feb.-2030	309.520	0,03
	4,950 % 15-Jan.-2023	331.556	0,04	284.000	Brookfield Residential Properties Inc /		
100.000	American Airlines Group Inc '144A'				Brookfield Residential US Corp '144A'		
	3,750 % 01-März-2025	46.661	0,01		6,250 % 15-Sept.-2027	272.250	0,03
555.000	American Airlines Group Inc '144A'			435.000	Brookfield Residential Properties Inc /		
	5,000 % 01-Jun.-2022	323.587	0,04		Brookfield Residential US Corp '144A'		
545.000	American Axle & Manufacturing Inc				6,375 % 15-Mai-2025	432.236	0,05
	6,250 % 15-März-2026	526.503	0,06	359.000	Buena Vista Gaming Authority '144A'		
604.000	American Axle & Manufacturing Inc				13,000 % 01-Apr.-2023	299.279	0,03
	6,500 % 01-Apr.-2027	587.387	0,07	135.000	Burlington Coat Factory Warehouse Corp '144A'		
59.000	American Axle & Manufacturing Inc				6,250 % 15-Apr.-2025	141.328	0,02
	6,625 % 15-Okt.-2022	59.904	0,01	1.565.000	Caesars Resort Collection LLC / CRC Finco Inc '144A'		
1.480.000	American Axle & Manufacturing Inc				5,250 % 15-Okt.-2025	1.363.913	0,15
	6,875 % 01-Jul.-2028	1.470.750	0,16	270.000	Carlson Travel Inc '144A' 6,750 % 15-Dez.-2023	176.484	0,02
250.000	American Builders & Contractors Supply Co Inc '144A'			115.000	Carlson Travel Inc '144A' 9,500 % 15-Dez.-2024	51.019	0,01
	4,000 % 15-Jan.-2028	243.365	0,03	300.000	Carnival Corp '144A' 11,500 % 01-Apr.-2023	326.250	0,04
445.000	American Builders & Contractors Supply Co Inc '144A'			645.000	Carvana Co '144A' 8,875 % 01-Okt.-2023	648.828	0,07
	5,875 % 15-Mai-2026	441.580	0,05	277.000	CCM Merger Inc '144A' 6,000 % 15-März-2022	275.096	0,03
152.000	American Greetings Corp '144A' 8,750 % 15-Apr.-2025	129.754	0,01	371.000	Cedar Fair LP / Canada's Wonderland Co /		
121.000	Anixter Inc 5,125 % 01-Okt.-2021	127.425	0,01		Magnum Management Corp 5,375 % 01-Jun.-2024	352.645	0,04
580.000	Aramark Services Inc 4,750 % 01-Jun.-2026	559.935	0,06	610.000	Cedar Fair LP / Canada's Wonderland Co /		
650.000	Aramark Services Inc '144A' 5,000 % 01-Apr.-2025	642.275	0,07		Magnum Management Corp / Millennium Op		
1.061.000	Aramark Services Inc '144A' 5,000 % 01-Feb.-2028	1.010.385	0,11		5,375 % 15-Apr.-2027	547.722	0,06
487.000	Aramark Services Inc '144A' 6,375 % 01-Mai-2025	503.804	0,06	1.450.000	Cedar Fair LP / Canada's Wonderland Co /		
25.000	Arrow Bidco LLC '144A' 9,500 % 15-März-2024	19.591	0,00		Magnum Management Corp / Millennium Op '144A'		
205.000	Asbury Automotive Group Inc '144A'				5,500 % 01-Mai-2025	1.463.594	0,16
	4,500 % 01-März-2028	199.491	0,02	805.000	Cedar Fair LP '144A' 5,250 % 15-Jul.-2029	729.885	0,08
140.000	Asbury Automotive Group Inc '144A'			333.000	Century Communities Inc 5,875 % 15-Jul.-2025	332.549	0,04
	4,750 % 01-März-2030	136.850	0,02	495.000	Century Communities Inc 6,750 % 01-Jun.-2027	498.913	0,06
25.000	Ashton Woods USA LLC /			830.000	Churchill Downs Inc '144A' 4,750 % 15-Jan.-2028	802.871	0,09
	Ashton Woods Finance Co '144A' 6,625 % 15-Jan.-2028	24.625	0,00	655.000	Churchill Downs Inc '144A' 5,500 % 01-Apr.-2027	642.630	0,07
376.000	Ashton Woods USA LLC /			388.000	Cinemark USA Inc 4,875 % 01-Jun.-2023	329.069	0,04
	Ashton Woods Finance Co '144A' 6,750 % 01-Aug.-2025	370.791	0,04	520.000	Cinemark USA Inc 5,125 % 15-Dez.-2022	460.728	0,05
277.000	Ashton Woods USA LLC /			505.000	Cirsa Finance International Sarl '144A'		
	Ashton Woods Finance Co '144A' 9,875 % 01-Apr.-2027	295.299	0,03		7,875 % 20-Dez.-2023	468.387	0,05
1.050.000	Aston Martin Capital Holdings Ltd '144A'			661.000	Clarios Global LP / Clarios US Finance Co '144A'		
	6,500 % 15-Apr.-2022	949.200	0,11		6,250 % 15-Mai-2026	684.578	0,08
225.000	Banijay Entertainment SASU '144A'			2.085.000	Clarios Global LP / Clarios US Finance Co '144A'		
	5,375 % 01-März-2025	220.641	0,02		8,500 % 15-Mai-2027	2.100.585	0,23
498.000	BCD Acquisition Inc '144A' 9,625 % 15-Sept.-2023	477.141	0,05	38.000	Clarios Global LP '144A' 6,750 % 15-Mai-2025	39.639	0,00
75.000	Beacon Roofing Supply Inc '144A'			535.000	Colt Merger Sub Inc '144A' 8,125 % 01-Jul.-2027	518.281	0,06
	4,500 % 15-Nov.-2026	73.430	0,01	122.000	Conn's Inc 7,250 % 15-Jul.-2022	98.210	0,01
1.190.000	Beacon Roofing Supply Inc '144A'			30.000	Constellation Merger Sub Inc '144A'		
	4,875 % 01-Nov.-2025	1.065.252	0,12		8,500 % 15-Sept.-2025	24.109	0,00

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener		Summe	Bestände	Beschreibung	Angemessener		Summe
		Wert	der Netto-				Wert	der Netto-	
		in USD	vermögen %				in USD	vermögen %	
Anleihen Forts.					Anleihen Forts.				
Zyklische Konsumwerte Forts.					Zyklische Konsumwerte Forts.				
191.000	Cooper-Standard Automotive Inc '144A'				700.000	Ford Motor Credit Co LLC 4,250 % 20-Sept.-2022	688.772	0,08	
	5,625 % 15-Nov.-2026	122.920	0,01		785.000	Ford Motor Credit Co LLC 4,271 % 09-Jan.-2027	734.479	0,08	
234.000	Core & Main Holdings LP '144A' 8,625 % 15-Sept.-2024	235.081	0,03		100.000	Ford Motor Credit Co LLC 4,375 % 06-Aug.-2023	98.488	0,01	
555.000	Core & Main LP '144A' 6,125 % 15-Aug.-2025	554.870	0,06		430.000	Ford Motor Credit Co LLC 4,542 % 01-Aug.-2026	409.037	0,05	
265.000	Dana Financing Luxembourg Sarl '144A'				340.000	Ford Motor Credit Co LLC 4,687 % 09-Jun.-2025	333.302	0,04	
	5,750 % 15-Apr.-2025	269.941	0,03		1.170.000	Ford Motor Credit Co LLC 5,113 % 03-Mai-2029	1.141.821	0,13	
477.000	Dana Financing Luxembourg Sarl '144A'				1.295.000	Ford Motor Credit Co LLC 5,125 % 16-Jun.-2025	1.298.755	0,14	
	6,500 % 01-Jun.-2026	495.424	0,06		335.000	Ford Motor Credit Co LLC 5,584 % 18-März-2024	338.941	0,04	
165.000	Dana Inc 5,375 % 15-Nov.-2027	165.101	0,02		1.000.000	Ford Motor Credit Co LLC 5,596 % 07-Jan.-2022	1.010.625	0,11	
185.000	Dana Inc 5,500 % 15-Dez.-2024	187.062	0,02		1.335.000	Ford Motor Credit Co LLC 5,875 % 02-Aug.-2021	1.350.646	0,15	
260.000	Dealer Tire LLC / DT Issuer LLC '144A'				1.050.000	Ford Motor Credit Co LLC 'GMTN'			
	8,000 % 01-Feb.-2028	241.475	0,03			4,389 % 08-Jan.-2026	1.001.270	0,11	
550.000	Delphi Technologies Plc '144A' 5,000 % 01-Okt.-2025	591.690	0,07		680.000	Ford Motor Credit Co LLC 'MTN' 3,550 % 07-Okt.-2022	662.711	0,07	
1.410.000	Delta Air Lines Inc 2,900 % 28-Okt.-2024	1.144.649	0,13		140.000	Forestar Group Inc '144A' 5,000 % 01-März-2028	137.528	0,02	
1.284.000	Delta Air Lines Inc 3,625 % 15-März-2022	1.216.656	0,14		260.000	Forestar Group Inc '144A' 8,000 % 15-Apr.-2024	271.375	0,03	
745.000	Delta Air Lines Inc 3,750 % 28-Okt.-2029	597.249	0,07		25.000	Gap Inc/The '144A' 8,375 % 15-Mai-2023	27.328	0,00	
740.000	Delta Air Lines Inc 3,800 % 19-Apr.-2023	661.430	0,07		600.000	Gap Inc/The '144A' 8,625 % 15-Mai-2025	637.875	0,07	
630.000	Delta Air Lines Inc 4,375 % 19-Apr.-2028	519.272	0,06		100.000	Gap Inc/The '144A' 8,875 % 15-Mai-2027	107.429	0,01	
1.900.000	Delta Air Lines Inc 7,375 % 15-Jan.-2026	1.840.104	0,21		435.000	Gateway Casinos & Entertainment Ltd '144A'			
575.000	Diamond Resorts International Inc '144A'					8,250 % 01-März-2024	358.286	0,04	
	7,750 % 01-Sept.-2023	552.354	0,06		156.000	Golden Entertainment Inc '144A' 7,625 % 15-Apr.-2026	143.983	0,02	
250.000	Diamond Resorts International Inc '144A'				1.580.000	Golden Nugget Inc '144A' 6,750 % 15-Okt.-2024	1.137.600	0,13	
	10,750 % 01-Sept.-2024	225.911	0,03		834.000	Golden Nugget Inc '144A' 8,750 % 01-Okt.-2025	473.808	0,05	
422.000	Downstream Development Authority of the Quapaw				111.000	Goodyear Tire & Rubber Co/The 4,875 % 15-März-2027	102.162	0,01	
	Tribe of Oklahoma '144A' 10,500 % 15-Feb.-2023	358.128	0,04		966.000	Goodyear Tire & Rubber Co/The 5,000 % 31-Mai-2026	903.215	0,10	
765.000	eG Global Finance Plc '144A' 6,750 % 07-Feb.-2025	748.346	0,08		1.350.000	Goodyear Tire & Rubber Co/The 5,125 % 15-Nov.-2023	1.295.581	0,14	
300.000	eG Global Finance Plc '144A' 8,500 % 30-Okt.-2025	308.094	0,03		35.000	Goodyear Tire & Rubber Co/The 7,000 % 15-März-2028	34.886	0,00	
117.000	Eldorado Resorts Inc 6,000 % 01-Apr.-2025	122.687	0,01		1.500.000	Goodyear Tire & Rubber Co/The 9,500 % 31-Mai-2025	1.607.812	0,18	
765.000	Eldorado Resorts Inc 6,000 % 15-Sept.-2026	828.235	0,09		405.000	Group 1 Automotive Inc 5,000 % 01-Jun.-2022	403.738	0,04	
241.000	Eldorado Resorts Inc 7,000 % 01-Aug.-2023	249.711	0,03		285.000	Guitar Center Inc '144A' 9,500 % 15-Okt.-2021	210.990	0,02	
327.000	Enterprise Development Authority/The '144A'				675.000	H&E Equipment Services Inc 5,625 % 01-Sept.-2025	683.367	0,08	
	12,000 % 15-Jul.-2024	329.827	0,04		870.000	Hanesbrands Inc '144A' 4,625 % 15-Mai-2024	867.916	0,10	
2.000	Ferrellgas LP / Ferrellgas Finance Corp				865.000	Hanesbrands Inc '144A' 4,875 % 15-Mai-2026	873.490	0,10	
	6,750 % 15-Jun.-2023	1.657	0,00		270.844	Hawaiian Airlines 2013-1 Class A Pass Through			
1.575.000	Fiat Chrysler Automobiles NV 5,250 % 15-Apr.-2023	1.631.220	0,18			Certificates 3,900 % 15-Jan.-2026	237.450	0,03	
135.000	FirstCash Inc '144A' 5,375 % 01-Jun.-2024	136.167	0,02		755.000	HD Supply Inc '144A' 5,375 % 15-Okt.-2026	773.237	0,09	
320.000	Ford Holdings LLC 9,300 % 01-März-2030	361.504	0,04		950.000	Hilton Domestic Operating Co Inc			
1.191.000	Ford Motor Co 4,346 % 08-Dez.-2026	1.115.169	0,12			4,250 % 01-Sept.-2024	925.153	0,10	
2.115.000	Ford Motor Co 4,750 % 15-Jan.-2043	1.675.598	0,19		905.000	Hilton Domestic Operating Co Inc			
866.000	Ford Motor Co 5,291 % 08-Dez.-2046	716.199	0,08			4,875 % 15-Jan.-2030	893.488	0,10	
600.000	Ford Motor Co 6,375 % 01-Feb.-2029	588.780	0,07		920.000	Hilton Domestic Operating Co Inc			
470.000	Ford Motor Co 6,625 % 01-Okt.-2028	475.015	0,05			5,125 % 01-Mai-2026	919.255	0,10	
435.000	Ford Motor Co 7,400 % 01-Nov.-2046	425.756	0,05		100.000	Hilton Domestic Operating Co Inc '144A'			
1.800.000	Ford Motor Co 7,450 % 16-Jul.-2031	1.901.385	0,21			5,375 % 01-Mai-2025	100.437	0,01	
2.000.000	Ford Motor Co 8,500 % 21-Apr.-2023	2.118.750	0,24		78.000	Hilton Domestic Operating Co Inc '144A'			
2.600.000	Ford Motor Co 9,000 % 22-Apr.-2025	2.818.595	0,31			5,750 % 01-Mai-2028	79.121	0,01	
1.000.000	Ford Motor Co 9,625 % 22-Apr.-2030	1.186.175	0,13		310.000	Hilton Grand Vacations Borrower LLC /			
514.000	Ford Motor Credit Co LLC 2,979 % 03-Aug.-2022	494.571	0,06			Hilton Grand Vacations Borrower Inc			
1.610.000	Ford Motor Credit Co LLC 3,087 % 09-Jan.-2023	1.537.051	0,17			6,125 % 01-Dez.-2024	312.680	0,03	
850.000	Ford Motor Credit Co LLC 3,096 % 04-Mai-2023	808.733	0,09		695.000	Hilton Worldwide Finance LLC /			
370.000	Ford Motor Credit Co LLC 3,219 % 09-Jan.-2022	361.753	0,04			Hilton Worldwide Finance Corp 4,625 % 01-Apr.-2025	682.042	0,08	
850.000	Ford Motor Credit Co LLC 3,339 % 28-März-2022	826.370	0,09		650.000	Hilton Worldwide Finance LLC /			
730.000	Ford Motor Credit Co LLC 3,350 % 01-Nov.-2022	701.917	0,08			Hilton Worldwide Finance Corp 4,875 % 01-Apr.-2027	636.067	0,07	
430.000	Ford Motor Credit Co LLC 3,664 % 08-Sept.-2024	406.978	0,05		120.000	IAA Inc '144A' 5,500 % 15-Jun.-2027	124.072	0,01	
1.012.000	Ford Motor Credit Co LLC 3,810 % 09-Jan.-2024	975.619	0,11		535.000	IHO Verwaltungs GmbH '144A' 4,750 % 15-Sept.-2026	525.854	0,06	
2.600.000	Ford Motor Credit Co LLC 3,813 % 12-Okt.-2021	2.584.530	0,29		240.000	IHO Verwaltungs GmbH '144A' 6,000 % 15-Mai-2027	244.604	0,03	
430.000	Ford Motor Credit Co LLC 3,815 % 02-Nov.-2027	392.592	0,04		140.000	Installed Building Products Inc '144A'			
1.000.000	Ford Motor Credit Co LLC 4,063 % 01-Nov.-2024	957.005	0,11			5,750 % 01-Feb.-2028	140.498	0,02	
963.000	Ford Motor Credit Co LLC 4,134 % 04-Aug.-2025	916.367	0,10		690.000	International Game Technology Plc '144A'			
210.000	Ford Motor Credit Co LLC 4,140 % 15-Feb.-2023	206.524	0,02			6,250 % 15-Feb.-2022	698.004	0,08	

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener		Summe			Angemessener		Summe
		Wert	der Netto-			Wert	der Netto-		
Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %		Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %	
Anleihen Forts.					Anleihen Forts.				
Zyklische Konsumwerte Forts.					Zyklische Konsumwerte Forts.				
450.000	International Game Technology Plc '144A'				575.000	LTF Merger Sub Inc '144A' 8,500 % 15-Jun.-2023	477.908		0,05
	6,500 % 15-Feb.-2025	461.531		0,05	5.000	M/I Homes Inc 4,950 % 01-Feb.-2028	4.984		0,00
408.000	IRB Holding Corp '144A' 6,750 % 15-Feb.-2026	391.092		0,04	297.000	M/I Homes Inc 5,625 % 01-Aug.-2025	301.053		0,03
415.000	IRB Holding Corp '144A' 7,000 % 15-Jun.-2025	428.519		0,05	668.000	Macy's Retail Holdings Inc 2,875 % 15-Feb.-2023	528.174		0,06
410.000	Jacobs Entertainment Inc '144A'				130.000	Macy's Retail Holdings Inc 3,625 % 01-Jun.-2024	94.699		0,01
	7,875 % 01-Feb.-2024	362.704		0,04	630.000	Macy's Retail Holdings Inc 3,875 % 15-Jan.-2022	559.314		0,06
830.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc '144A'				590.000	Macy's Retail Holdings Inc 4,375 % 01-Sept.-2023	439.550		0,05
	4,500 % 01-Okt.-2027	653.961		0,07	90.000	Macy's Retail Holdings Inc 4,500 % 15-Dez.-2034	53.757		0,01
550.000	Jaguar Land Rover Automotive Plc '144A'				231.000	Macy's Retail Holdings Inc 6,375 % 15-März-2037	148.995		0,02
	5,625 % 01-Feb.-2023	485.713		0,05	410.000	Marks & Spencer Plc '144A' 7,125 % 01-Dez.-2037	411.025		0,05
249.000	JB Poindexter & Co Inc '144A' 7,125 % 15-Apr.-2026	252.376		0,03	756.000	Marriott Ownership Resorts Inc / ILG LLC			
100.000	K Hovnanian Enterprises Inc '144A'					6,500 % 15-Sept.-2026	762.970		0,08
	7,750 % 15-Feb.-2026	99.500		0,01	220.000	Marriott Ownership Resorts Inc '144A'			
780.000	KAR Auction Services Inc '144A' 5,125 % 01-Jun.-2025	770.332		0,09		4,750 % 15-Jan.-2028	200.517		0,02
221.000	KB Home 4,800 % 15-Nov.-2029	217.823		0,02	100.000	Marriott Ownership Resorts Inc '144A'			
220.000	KB Home 6,875 % 15-Jun.-2027	240.583		0,03		6,125 % 15-Sept.-2025	102.687		0,01
300.000	KB Home 7,000 % 15-Dez.-2021	314.753		0,03	390.000	Mattamy Group Corp '144A' 4,625 % 01-März-2030	375.071		0,04
473.000	KB Home 7,500 % 15-Sept.-2022	517.233		0,06	315.000	Mattamy Group Corp '144A' 5,250 % 15-Dez.-2027	314.409		0,03
449.000	KB Home 7,625 % 15-Mai-2023	491.047		0,05	685.000	Mattel Inc 3,150 % 15-März-2023	653.247		0,07
428.000	KFC Holding Co/Pizza Hut Holdings LLC/				650.000	Mattel Inc 5,450 % 01-Nov.-2041	542.084		0,06
	Taco Bell of America LLC '144A' 4,750 % 01-Jun.-2027	439.943		0,05	590.000	Mattel Inc 6,200 % 01-Okt.-2040	512.884		0,06
620.000	KFC Holding Co/Pizza Hut Holdings LLC/				310.000	Mattel Inc '144A' 5,875 % 15-Dez.-2027	320.261		0,04
	Taco Bell of America LLC '144A' 5,000 % 01-Jun.-2024	633.240		0,07	1.050.000	Mattel Inc '144A' 6,750 % 31-Dez.-2025	1.091.197		0,12
1.315.000	KFC Holding Co/Pizza Hut Holdings LLC/				240.000	MDC Holdings Inc 3,850 % 15-Jan.-2030	229.613		0,03
	Taco Bell of America LLC '144A' 5,250 % 01-Jun.-2026	1.352.024		0,15	370.000	MDC Holdings Inc 5,500 % 15-Jan.-2024	397.249		0,04
278.000	KGA Escrow LLC '144A' 7,500 % 15-Aug.-2023	278.666		0,03	630.000	MDC Holdings Inc 6,000 % 15-Jan.-2043	664.474		0,07
421.000	L Brands Inc 5,250 % 01-Feb.-2028	334.056		0,04	515.000	Melco Resorts Finance Ltd '144A'			
797.000	L Brands Inc 5,625 % 15-Feb.-2022	780.841		0,09		5,375 % 04-Dez.-2029	517.910		0,06
380.000	L Brands Inc 5,625 % 15-Okt.-2023	360.120		0,04	757.000	Melco Resorts Finance Ltd 'REGS'			
452.000	L Brands Inc 6,694 % 15-Jan.-2027	383.549		0,04		4,875 % 06-Jun.-2025	763.577		0,09
755.000	L Brands Inc 6,750 % 01-Jul.-2036	621.554		0,07	360.000	Melco Resorts Finance Ltd 'REGS'			
985.000	L Brands Inc 6,875 % 01-Nov.-2035	823.411		0,09		5,250 % 26-Apr.-2026	363.532		0,04
125.000	L Brands Inc 6,950 % 01-März-2033	87.320		0,01	125.000	Melco Resorts Finance Ltd 'REGS'			
600.000	L Brands Inc 7,500 % 15-Jun.-2029	524.514		0,06		5,625 % 17-Jul.-2027	126.625		0,01
110.000	L Brands Inc 7,600 % 15-Jul.-2037	75.272		0,01	292.000	Men's Wearhouse Inc/The 7,000 % 01-Jul.-2022	44.826		0,00
200.000	LBC Tank Terminals Holding Netherlands BV '144A'				262.000	Meritage Homes Corp 5,125 % 06-Jun.-2027	270.793		0,03
	6,875 % 15-Mai-2023	202.583		0,02	621.000	Meritage Homes Corp 6,000 % 01-Jun.-2025	662.983		0,07
760.000	Lennar Corp 4,125 % 15-Jan.-2022	771.191		0,09	220.000	Meritage Homes Corp 7,000 % 01-Apr.-2022	232.323		0,03
675.000	Lennar Corp 4,500 % 30-Apr.-2024	703.617		0,08	335.000	Meritor Inc 6,250 % 15-Feb.-2024	338.734		0,04
620.000	Lennar Corp 4,750 % 15-Nov.-2022	643.079		0,07	425.000	Merlin Entertainments Ltd '144A'			
370.000	Lennar Corp 4,750 % 30-Mai-2025	395.939		0,04		5,750 % 15-Jun.-2026	410.865		0,05
524.000	Lennar Corp 4,750 % 29-Nov.-2027	569.693		0,06	350.000	MGM China Holdings Ltd '144A' 5,375 % 15-Mai-2024	356.162		0,04
569.000	Lennar Corp 4,875 % 15-Dez.-2023	602.369		0,07	270.000	MGM China Holdings Ltd '144A' 5,875 % 15-Mai-2026	278.651		0,03
761.000	Lennar Corp 5,000 % 15-Jun.-2027	824.589		0,09	680.000	MGM Resorts International 4,625 % 01-Sept.-2026	620.775		0,07
829.000	Lennar Corp 5,250 % 01-Jun.-2026	898.271		0,10	450.000	MGM Resorts International 5,500 % 15-Apr.-2027	433.757		0,05
223.000	Lennar Corp 5,375 % 01-Okt.-2022	235.213		0,03	645.000	MGM Resorts International 5,750 % 15-Jun.-2025	639.766		0,07
500.000	Lennar Corp 5,875 % 15-Nov.-2024	548.198		0,06	1.130.000	MGM Resorts International 6,000 % 15-März-2023	1.144.244		0,13
334.000	Levi Strauss & Co 5,000 % 01-Mai-2025	336.473		0,04	1.130.000	MGM Resorts International 6,750 % 01-Mai-2025	1.123.734		0,13
333.000	LGI Homes Inc '144A' 6,875 % 15-Jul.-2026	340.013		0,04	669.000	MGM Resorts International 7,750 % 15-März-2022	683.869		0,08
530.000	Lions Gate Capital Holdings LLC '144A'				200.000	Michaels Stores Inc '144A' 8,000 % 15-Jul.-2027	174.338		0,02
	5,875 % 01-Nov.-2024	508.082		0,06	139.000	Mobile Mini Inc 5,875 % 01-Jul.-2024	143.160		0,02
410.000	Lions Gate Capital Holdings LLC '144A'				1.080.000	Mohegan Gaming & Entertainment '144A'			
	6,375 % 01-Feb.-2024	401.027		0,04		7,875 % 15-Okt.-2024	900.337		0,10
20.000	Lithia Motors Inc '144A' 5,250 % 01-Aug.-2025	20.073		0,00	165.000	Motion Bondco DAC '144A' 6,625 % 15-Nov.-2027	145.812		0,02
550.000	Live Nation Entertainment Inc '144A'				400.000	Murphy Oil USA Inc 4,750 % 15-Sept.-2029	409.926		0,05
	4,750 % 15-Okt.-2027	474.433		0,05	525.000	Murphy Oil USA Inc 5,625 % 01-Mai-2027	543.932		0,06
665.000	Live Nation Entertainment Inc '144A'				1.195.000	Navistar International Corp '144A'			
	4,875 % 01-Nov.-2024	600.571		0,07		6,625 % 01-Nov.-2025	1.135.375		0,13
250.000	Live Nation Entertainment Inc '144A'				75.000	Navistar International Corp '144A'			
	5,625 % 15-März-2026	228.390		0,03		9,500 % 01-Mai-2025	80.694		0,01

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener	Summe			Angemessener	Summe
		Wert	der Netto-			Wert	der Netto-
Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %	Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
Zyklische Konsumwerte Forts.				Zyklische Konsumwerte Forts.			
440.000	New Home Co Inc/The 7,250% 01-Apr.-2022	410.747	0,05	25.000	Shea Homes LP / Shea Homes Funding Corp '144A'		
125.000	Newell Brands Inc 4,000% 15-Jun.-2022	128.437	0,01		6,125% 01-Apr.-2025	25.216	0,00
248.000	Newell Brands Inc 4,000% 01-Dez.-2024	249.240	0,03	1.120.000	Six Flags Entertainment Corp '144A'		
670.000	Newell Brands Inc 4,350% 01-Apr.-2023	693.316	0,08		4,875% 31-Jul.-2024	1.005.894	0,11
1.900.000	Newell Brands Inc 4,700% 01-Apr.-2026	1.999.522	0,22	555.000	Six Flags Entertainment Corp '144A'		
15.000	Newell Brands Inc 4,875% 01-Jun.-2025	15.737	0,00		5,500% 15-Apr.-2027	496.725	0,06
500.000	Newell Brands Inc 5,875% 01-Apr.-2036	535.625	0,06	400.000	Six Flags Theme Parks Inc '144A'		
750.000	Newell Brands Inc 6,000% 01-Apr.-2046	797.100	0,09		7,000% 01-Jul.-2025	415.250	0,05
284.000	Party City Holdings Inc '144A' 6,125% 15-Aug.-2023	59.640	0,01	283.000	Sonic Automotive Inc 6,125% 15-März-2027	281.177	0,03
250.000	Party City Holdings Inc '144A' 6,625% 01-Aug.-2026	52.500	0,01	15.000	Speedway Motorsports LLC /		
40.000	Penn National Gaming Inc '144A'				Speedway Funding II Inc '144A'		
	5,625% 15-Jan.-2027	37.458	0,00		4,875% 01-Nov.-2027	13.687	0,00
221.000	Penske Automotive Group Inc 5,375% 01-Dez.-2024	221.253	0,02	200.000	SRS Distribution Inc '144A' 8,250% 01-Jul.-2026	203.712	0,02
782.000	Penske Automotive Group Inc 5,500% 15-Mai-2026	781.855	0,09	1.308.000	Staples Inc '144A' 7,500% 15-Apr.-2026	1.030.541	0,11
411.000	Performance Food Group Inc '144A'			1.590.000	Staples Inc '144A' 10,750% 15-Apr.-2027	937.806	0,10
	5,500% 01-Jun.-2024	408.388	0,05	550.000	Stars Group Holdings BV /		
400.000	Performance Food Group Inc '144A'				Stars Group US Co-Borrower LLC '144A'		
	5,500% 15-Okt.-2027	386.732	0,04		7,000% 15-Jul.-2026	581.039	0,06
760.000	PetSmart Inc '144A' 5,875% 01-Jun.-2025	764.260	0,09	355.000	Station Casinos LLC '144A' 4,500% 15-Feb.-2028	301.528	0,03
2.075.000	PetSmart Inc '144A' 7,125% 15-März-2023	2.049.768	0,23	630.000	Station Casinos LLC '144A' 5,000% 01-Okt.-2025	556.369	0,06
555.000	PetSmart Inc '144A' 8,875% 01-Jun.-2025	557.070	0,06	550.000	Studio City Finance Ltd 'REGS'		
181.000	PriSo Acquisition Corp '144A' 9,000% 15-Mai-2023	161.995	0,02		7,250% 11-Feb.-2024	564.484	0,06
635.000	PulteGroup Inc 5,000% 15-Jan.-2027	681.295	0,08	318.000	Suburban Propane Partners LP/		
776.000	PulteGroup Inc 5,500% 01-März-2026	848.560	0,09		Suburban Energy Finance Corp		
270.000	PulteGroup Inc 6,000% 15-Feb.-2035	312.146	0,03		5,500% 01-Jun.-2024	315.811	0,04
250.000	PulteGroup Inc 6,375% 15-Mai-2033	293.506	0,03	25.000	Suburban Propane Partners LP/		
222.000	PulteGroup Inc 7,875% 15-Jun.-2032	284.565	0,03		Suburban Energy Finance Corp		
770.000	QVC Inc 4,375% 15-März-2023	773.773	0,09		5,750% 01-März-2025	25.091	0,00
900.000	QVC Inc 4,450% 15-Feb.-2025	886.770	0,10	348.000	Suburban Propane Partners LP/		
675.000	QVC Inc 4,750% 15-Feb.-2027	655.678	0,07		Suburban Energy Finance Corp		
500.000	QVC Inc 4,850% 01-Apr.-2024	505.800	0,06		5,875% 01-März-2027	345.759	0,04
885.000	QVC Inc 5,125% 02-Jul.-2022	898.098	0,10	255.000	Sugarhouse HSP Gaming Prop Mezz LP /		
380.000	QVC Inc 5,450% 15-Aug.-2034	345.523	0,04		Sugarhouse HSP Gaming Finance Corp '144A'		
360.000	QVC Inc 5,950% 15-März-2043	300.600	0,03		5,875% 15-Mai-2025	249.554	0,03
510.000	Resideo Funding Inc '144A' 6,125% 01-Nov.-2026	500.134	0,06	407.000	Superior Plus LP / Superior General Partner Inc '144A'		
178.000	Rite Aid Corp 7,700% 15-Feb.-2027	151.150	0,02		7,000% 15-Jul.-2026	427.781	0,05
852.000	Rite Aid Corp '144A' 6,125% 01-Apr.-2023	829.955	0,09	255.000	Taylor Morrison Communities Inc /		
448.000	Rite Aid Corp '144A' 7,500% 01-Jul.-2025	449.120	0,05		Taylor Morrison Holdings II Inc '144A'		
345.000	Royal Caribbean Cruises Ltd 3,700% 15-März-2028	217.396	0,02		5,625% 01-März-2024	262.304	0,03
980.000	Royal Caribbean Cruises Ltd 5,250% 15-Nov.-2022	762.656	0,08	257.000	Taylor Morrison Communities Inc /		
563.000	Royal Caribbean Cruises Ltd 7,500% 15-Okt.-2027	427.741	0,05		Taylor Morrison Holdings II Inc '144A'		
525.000	Sabre GLBL Inc '144A' 5,250% 15-Nov.-2023	484.635	0,05		5,875% 15-Apr.-2023	265.004	0,03
780.000	Sabre GLBL Inc '144A' 5,375% 15-Apr.-2023	730.193	0,08	200.000	Taylor Morrison Communities Inc '144A'		
575.000	Sabre GLBL Inc '144A' 9,250% 15-Apr.-2025	608.422	0,07		5,750% 15-Jan.-2028	206.712	0,02
292.000	Sally Holdings LLC / Sally Capital Inc			221.000	Taylor Morrison Communities Inc '144A'		
	5,500% 01-Nov.-2023	284.882	0,03		5,875% 31-Jan.-2025	225.351	0,03
450.000	Sally Holdings LLC / Sally Capital Inc			200.000	Taylor Morrison Communities Inc '144A'		
	5,625% 01-Dez.-2025	438.444	0,05		5,875% 15-Jun.-2027	207.604	0,02
1.267.000	Scientific Games International Inc '144A'			240.000	Taylor Morrison Communities Inc '144A'		
	5,000% 15-Okt.-2025	1.174.230	0,13		6,000% 01-Sept.-2023	246.526	0,03
125.000	Scientific Games International Inc '144A'			40.000	Taylor Morrison Communities Inc '144A'		
	7,000% 15-Mai-2028	100.211	0,01		6,625% 15-Jul.-2027	42.071	0,00
95.000	Scientific Games International Inc '144A'			443.000	Tempur Sealy International Inc		
	7,250% 15-Nov.-2029	76.161	0,01		5,500% 15-Jun.-2026	448.456	0,05
285.000	Scientific Games International Inc '144A'			565.000	Tempur Sealy International Inc		
	8,250% 15-März-2026	256.095	0,03		5,625% 15-Okt.-2023	572.709	0,06
398.000	Scotts Miracle-Gro Co/The 4,500% 15-Okt.-2029	410.698	0,05	53.000	Tenneco Inc 5,000% 15-Jul.-2026	35.147	0,00
184.000	Scotts Miracle-Gro Co/The 5,250% 15-Dez.-2026	191.785	0,02	175.000	Tenneco Inc 5,375% 15-Dez.-2024	119.419	0,01
90.000	Shea Homes LP / Shea Homes Funding Corp '144A'			1.785.000	Tesla Inc '144A' 5,300% 15-Aug.-2025	1.787.044	0,20
	4,750% 15-Feb.-2028	85.711	0,01	210.000	Titan International Inc 6,500% 30-Nov.-2023	137.898	0,02

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener		Bestände	Beschreibung	Angemessener	
		Wert	Summe			Wert	Summe
		in USD	der Netto-			in USD	der Netto-
			vermögen %				vermögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
Zyklische Konsumwerte Forts.				Zyklische Konsumwerte Forts.			
275.000	Toll Brothers Finance Corp 3,800 % 01-Nov.-2029	277.208	0,03	380.000	Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts		
120.000	Toll Brothers Finance Corp 4,350 % 15-Feb.-2028	124.927	0,01		Capital Corp '144A' 7,750 % 15-Apr.-2025	384.398	0,04
490.000	Toll Brothers Finance Corp 4,375 % 15-Apr.-2023	510.161	0,06	153.000	Yum! Brands Inc 3,750 % 01-Nov.-2021	154.702	0,02
20.000	Toll Brothers Finance Corp 4,875 % 15-Nov.-2025	21.402	0,00	75.000	Yum! Brands Inc 3,875 % 01-Nov.-2023	77.073	0,01
335.000	Toll Brothers Finance Corp 4,875 % 15-März-2027	362.155	0,04	91.000	Yum! Brands Inc 5,350 % 01-Nov.-2043	88.270	0,01
450.000	Toll Brothers Finance Corp 5,625 % 15-Jan.-2024	483.140	0,05	530.000	Yum! Brands Inc 6,875 % 15-Nov.-2037	572.026	0,06
425.000	Toll Brothers Finance Corp 5,875 % 15-Feb.-2022	443.957	0,05	100.000	Yum! Brands Inc '144A' 4,750 % 15-Jan.-2030	101.772	0,01
15.000	TPro Acquisition Corp '144A' 11,000 % 15-Okt.-2024	14.727	0,00	725.000	Yum! Brands Inc '144A' 7,750 % 01-Apr.-2025	783.453	0,09
372.000	TRI Pointe Group Inc 5,250 % 01-Jun.-2027	371.464	0,04	670.000	ZF North America Capital Inc '144A'		
580.000	TRI Pointe Group Inc / TRI Pointe Homes Inc				4,500 % 29-Apr.-2022	690.267	0,08
	5,875 % 15-Jun.-2024	597.780	0,07	895.000	ZF North America Capital Inc '144A'		
58.000	Truck Hero Inc '144A' 8,500 % 21-Apr.-2024	58.211	0,01		4,750 % 29-Apr.-2025	898.249	0,10
190.000	Twin River Worldwide Holdings Inc '144A'			Basiskonsumwerte - 178.312.254			
	6,750 % 01-Jun.-2027	181.176	0,02	(31. Dezember 2019: 110.325.607)			
58.344	UAL 2007-1 Pass Through Trust			640.000	Acadia Healthcare Co Inc 5,125 % 01-Jul.-2022	640.512	0,07
	6,636 % 02-Jul.-2022	50.510	0,01	480.000	Acadia Healthcare Co Inc 5,625 % 15-Feb.-2023	481.418	0,05
818.000	Under Armour Inc 3,250 % 15-Jun.-2026	726.139	0,08	269.000	Acadia Healthcare Co Inc 6,500 % 01-März-2024	274.736	0,03
530.000	United Airlines Holdings Inc 4,250 % 01-Okt.-2022	451.329	0,05	287.000	ACCO Brands Corp '144A' 5,250 % 15-Dez.-2024	291.634	0,03
195.000	United Airlines Holdings Inc 4,875 % 15-Jan.-2025	156.320	0,02	150.000	ACE Cash Express Inc '144A' 12,000 % 15-Dez.-2022	108.750	0,01
535.000	United Airlines Holdings Inc 5,000 % 01-Feb.-2024	437.028	0,05	200.000	Adani Abbot Point Terminal Pty Ltd '144A'		
100.000	Univar Solutions USA Inc/Washington '144A'				4,450 % 15-Dez.-2022	173.492	0,02
	5,125 % 01-Dez.-2027	101.331	0,01	940.000	ADT Security Corp/The 3,500 % 15-Jul.-2022	937.288	0,10
160.000	Vail Resorts Inc '144A' 6,250 % 15-Mai-2025	168.100	0,02	525.000	ADT Security Corp/The 4,125 % 15-Jun.-2023	527.680	0,06
610.000	Viking Cruises Ltd '144A' 5,875 % 15-Sept.-2027	364.588	0,04	548.000	ADT Security Corp/The 6,250 % 15-Okt.-2021	562.947	0,06
295.000	Viking Cruises Ltd '144A' 6,250 % 15-Mai-2025	169.225	0,02	581.000	ADT Security Corp/The '144A' 4,875 % 15-Jul.-2032	530.543	0,06
281.000	Vista Outdoor Inc 5,875 % 01-Okt.-2023	275.702	0,03	854.000	Ahern Rentals Inc '144A' 7,375 % 15-Mai-2023	413.033	0,05
390.000	VOC Escrow Ltd '144A' 5,000 % 15-Feb.-2028	290.478	0,03	395.000	AHP Health Partners Inc '144A' 9,750 % 15-Jul.-2026	407.269	0,05
394.000	Wabash National Corp '144A' 5,500 % 01-Okt.-2025	362.931	0,04	229.000	Air Medical Group Holdings Inc '144A'		
100.000	William Carter Co/The '144A' 5,500 % 15-Mai-2025	103.312	0,01		6,375 % 15-Mai-2023	211.515	0,02
563.000	William Carter Co/The '144A' 5,625 % 15-März-2027	581.526	0,06	430.000	Air Methods Corp '144A' 8,000 % 15-Mai-2025	304.717	0,03
365.000	Williams Scotsman International Inc '144A'			650.000	Ajecorp BV '144A' 6,500 % 14-Mai-2022	642.535	0,07
	6,875 % 15-Aug.-2023	375.988	0,04	1.444.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc /		
120.000	Williams Scotsman International Inc '144A'				New Albertsons LP / Albertsons LLC		
	7,875 % 15-Dez.-2022	124.726	0,01		5,750 % 15-März-2025	1.480.858	0,17
46.000	WMG Acquisition Corp '144A' 5,000 % 01-Aug.-2023	46.743	0,01	1.135.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc /		
177.000	WMG Acquisition Corp '144A' 5,500 % 15-Apr.-2026	183.772	0,02		New Albertsons LP / Albertsons LLC		
150.000	Wolverine Escrow LLC '144A' 8,500 % 15-Nov.-2024	114.750	0,01		6,625 % 15-Jun.-2024	1.164.510	0,13
225.000	Wolverine Escrow LLC '144A' 9,000 % 15-Nov.-2026	163.125	0,02	250.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc /		
390.000	Wolverine Escrow LLC '144A' 13,125 % 15-Nov.-2027	273.975	0,03		New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A'		
100.000	Wolverine World Wide Inc '144A' 6,375 % 15-Mai-2025	105.187	0,01		3,500 % 15-Feb.-2023	253.375	0,03
305.000	Wyndham Destinations Inc 3,900 % 01-März-2023	285.448	0,03	140.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc /		
400.000	Wyndham Destinations Inc 4,250 % 01-März-2022	394.326	0,04		New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A'		
350.000	Wyndham Destinations Inc 5,400 % 01-Apr.-2024	339.026	0,04		4,625 % 15-Jan.-2027	140.148	0,02
505.000	Wyndham Destinations Inc 5,750 % 01-Apr.-2027	487.860	0,05	369.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc /		
167.000	Wyndham Destinations Inc 6,350 % 01-Okt.-2025	169.279	0,02		New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A'		
65.000	Wyndham Destinations Inc '144A'				4,875 % 15-Feb.-2030	377.904	0,04
	4,625 % 01-März-2030	59.912	0,01	325.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc /		
514.000	Wyndham Hotels & Resorts Inc '144A'				New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A'		
	5,375 % 15-Apr.-2026	496.218	0,06		5,875 % 15-Feb.-2028	335.875	0,04
630.000	Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital			630.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc /		
	Corp '144A' 4,250 % 30-Mai-2023	594.162	0,07		New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A'		
895.000	Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital				7,500 % 15-März-2026	681.874	0,08
	Corp '144A' 5,250 % 15-Mai-2027	775.634	0,09	590.000	Algeco Global Finance Plc '144A' 8,000 % 15-Feb.-2023	568.238	0,06
1.550.000	Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital			743.000	Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal		
	Corp '144A' 5,500 % 01-März-2025	1.423.202	0,16		Finance Corp '144A' 6,625 % 15-Jul.-2026	782.561	0,09
650.000	Wynn Macau Ltd '144A' 4,875 % 01-Okt.-2024	635.443	0,07	325.000	Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal		
375.000	Wynn Macau Ltd '144A' 5,125 % 15-Dez.-2029	364.688	0,04		Finance Corp '144A' 9,750 % 15-Jul.-2027	343.034	0,04
760.000	Wynn Macau Ltd '144A' 5,500 % 01-Okt.-2027	754.608	0,08	230.000	AMN Healthcare Inc '144A' 4,625 % 01-Okt.-2027	224.638	0,03
555.000	Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts			242.000	AMN Healthcare Inc '144A' 5,125 % 01-Okt.-2024	242.882	0,03
	Capital Corp '144A' 5,125 % 01-Okt.-2029	496.986	0,06				

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener		Summe		Bestände	Beschreibung	Angemessener		Summe	
		Wert	der Netto-					Wert	der Netto-		
		in USD	vermögen %					in USD	vermögen %		
Anleihen Forts.						Anleihen Forts.					
Basiskonsumwerte Forts.						Basiskonsumwerte Forts.					
125.000	Aptim Corp '144A' 7,750 % 15-Jun.-2025	49.831	0,01			575.000	Charles River Laboratories International Inc '144A'				
515.000	APX Group Inc 7,625 % 01-Sept.-2023	475.677	0,05				4,250 % 01-Mai-2028	575.679	0,06		
965.000	APX Group Inc 7,875 % 01-Dez.-2022	963.181	0,11			130.000	Charles River Laboratories International Inc '144A'				
285.000	APX Group Inc 8,500 % 01-Nov.-2024	278.914	0,03				5,500 % 01-Apr.-2026	135.578	0,02		
215.000	APX Group Inc '144A' 6,750 % 15-Feb.-2027	203.276	0,02			830.000	Chobani LLC / Chobani Finance Corp Inc '144A'				
605.000	ASGN Inc '144A' 4,625 % 15-Mai-2028	591.878	0,07				7,500 % 15-Apr.-2025	803.535	0,09		
110.000	Atento Luxco 1 SA '144A' 6,125 % 10-Aug.-2022	89.925	0,01			2.169.000	CHS/Community Health Systems Inc				
1.107.000	Avantor Inc '144A' 6,000 % 01-Okt.-2024	1.157.922	0,13				6,250 % 31-März-2023	2.045.801	0,23		
5.000	Avantor Inc '144A' 9,000 % 01-Okt.-2025	5.381	0,00			400.000	CHS/Community Health Systems Inc				
25.000	Avis Budget Car Rental LLC /						6,875 % 01-Feb.-2022	321.250	0,04		
	Avis Budget Finance Inc '144A' 5,250 % 15-März-2025	20.125	0,00			760.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A'				
100.000	Avis Budget Car Rental LLC /						6,625 % 15-Feb.-2025	716.300	0,08		
	Avis Budget Finance Inc '144A' 5,750 % 15-Jul.-2027	76.804	0,01			100.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A'				
230.000	Avis Budget Car Rental LLC /						6,875 % 01-Apr.-2028	39.636	0,00		
	Avis Budget Finance Inc '144A' 6,375 % 01-Apr.-2024	189.726	0,02			1.555.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A'				
295.000	Avon International Capital Plc '144A'						8,000 % 15-März-2026	1.471.341	0,16		
	6,500 % 15-Aug.-2022	289.953	0,03			40.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A'				
370.000	Avon International Operations Inc '144A'						8,000 % 15-Dez.-2027	38.333	0,00		
	7,875 % 15-Aug.-2022	371.708	0,04			1.115.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A'				
308.000	Avon Products Inc 7,000 % 15-März-2023	305.328	0,03				8,125 % 30-Jun.-2024	750.523	0,08		
289.000	Avon Products Inc 8,950 % 15-März-2043	328.042	0,04			1.095.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A'				
425.000	B&G Foods Inc 5,250 % 01-Apr.-2025	428.612	0,05				8,625 % 15-Jan.-2024	1.074.190	0,12		
406.000	B&G Foods Inc 5,250 % 15-Sept.-2027	407.397	0,05			715.000	CHS/Community Health Systems Inc Step-Up				
1.420.000	Bausch Health Americas Inc '144A'						Coupon '144A' 9,875 % 30-Jun.-2023	558.840	0,06		
	8,500 % 31-Jan.-2027	1.509.779	0,17			665.000	Cimpress Plc '144A' 7,000 % 15-Jun.-2026	615.830	0,07		
1.540.000	Bausch Health Americas Inc '144A'					20.000	Clearwater Seafoods Inc '144A'				
	9,250 % 01-Apr.-2026	1.672.748	0,19				6,875 % 01-Mai-2025	19.873	0,00		
400.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 5,000 % 30-Jan.-2028	377.096	0,04			483.000	Cooke Omega Investments Inc / Alpha VesselCo				
925.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 5,250 % 30-Jan.-2030	878.630	0,10				Holdings Inc '144A' 8,500 % 15-Dez.-2022	482.283	0,05		
692.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 5,500 % 01-März-2023	694.522	0,08			925.000	Cott Holdings Inc '144A' 5,500 % 01-Apr.-2025	932.118	0,10		
1.365.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 5,500 % 01-Nov.-2025	1.400.490	0,16			429.000	Coty Inc '144A' 6,500 % 15-Apr.-2026	366.004	0,04		
175.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 5,750 % 15-Aug.-2027	185.904	0,02			249.000	Darling Ingredients Inc '144A' 5,250 % 15-Apr.-2027	256.641	0,03		
800.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 5,875 % 15-Mai-2023	798.624	0,09			1.137.000	DaVita Inc 5,000 % 01-Mai-2025	1.163.720	0,13		
2.733.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 6,125 % 15-Apr.-2025	2.775.853	0,31			730.000	DaVita Inc 5,125 % 15-Jul.-2024	743.505	0,08		
1.200.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 6,250 % 15-Feb.-2029	1.208.250	0,14			115.000	DaVita Inc '144A' 4,625 % 01-Jun.-2030	114.520	0,01		
771.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 7,000 % 15-März-2024	801.508	0,09			215.000	Del Monte Foods Inc '144A' 11,875 % 15-Mai-2025	217.553	0,02		
460.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 7,000 % 15-Jan.-2028	474.577	0,05			170.000	Dole Food Co Inc '144A' 7,250 % 15-Jun.-2025	163.395	0,02		
555.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 7,250 % 30-Mai-2029	583.685	0,07			400.000	Edgewell Personal Care Co 4,700 % 24-Mai-2022	415.254	0,05		
991.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 9,000 % 15-Dez.-2025	1.068.704	0,12			265.000	Elanco Animal Health Inc 4,662 % 27-Aug.-2021	271.459	0,03		
460.000	Brink's Co/The '144A' 4,625 % 15-Okt.-2027	442.936	0,05			746.000	Elanco Animal Health Inc 5,022 % 28-Aug.-2023	786.564	0,09		
305.000	Capitol Investment Merger Sub 2 LLC '144A'					723.000	Elanco Animal Health Inc 5,650 % 28-Aug.-2028	804.826	0,09		
	10,000 % 01-Aug.-2024	305.250	0,03			165.000	Emeco Pty Ltd 9,250 % 31-März-2022	166.650	0,02		
572.000	Cardtronics Inc / Cardtronics USA Inc '144A'					715.000	Encompass Health Corp 4,500 % 01-Feb.-2028	686.979	0,08		
	5,500 % 01-Mai-2025	556.925	0,06			955.000	Encompass Health Corp 4,750 % 01-Feb.-2030	913.639	0,10		
89.000	Carriage Services Inc '144A' 6,625 % 01-Jun.-2026	93.878	0,01			185.000	Encompass Health Corp 5,125 % 15-März-2023	186.599	0,02		
565.000	Catalent Pharma Solutions Inc '144A'					520.000	Encompass Health Corp 5,750 % 01-Nov.-2024	521.355	0,06		
	4,875 % 15-Jan.-2026	575.599	0,06			297.000	Encompass Health Corp 5,750 % 15-Sept.-2025	304.023	0,03		
52.000	Catalent Pharma Solutions Inc '144A'					100.000	Endo Dac / Endo Finance LLC / Endo Finco Inc '144A'				
	5,000 % 15-Jul.-2027	54.071	0,01				5,875 % 15-Okt.-2024	97.135	0,01		
1.950.000	Centene Corp 3,375 % 15-Feb.-2030	1.971.986	0,22			875.000	Endo Dac / Endo Finance LLC / Endo Finco Inc '144A'				
2.235.000	Centene Corp 4,250 % 15-Dez.-2027	2.311.493	0,26				6,000 % 15-Jul.-2023	658.976	0,07		
2.825.000	Centene Corp 4,625 % 15-Dez.-2029	2.987.438	0,33			400.000	Endo Dac / Endo Finance LLC / Endo Finco Inc '144A'				
350.000	Centene Corp 4,750 % 15-Mai-2022	354.716	0,04				6,000 % 01-Feb.-2025	310.404	0,03		
1.390.000	Centene Corp 4,750 % 15-Jan.-2025	1.424.833	0,16			25.000	Endo Finance LLC / Endo Finco Inc '144A'				
1.300.000	Centene Corp 4,750 % 15-Jan.-2025	1.332.578	0,15				5,375 % 15-Jan.-2023	24.279	0,00		
529.000	Centene Corp '144A' 5,250 % 01-Apr.-2025	545.444	0,06			50.000	Envision Healthcare Corp '144A' 8,750 % 15-Okt.-2026	23.928	0,00		
1.790.000	Centene Corp '144A' 5,375 % 01-Jun.-2026	1.862.898	0,21			500.000	FAGE International SA / FAGE USA Dairy				
552.000	Centene Corp '144A' 5,375 % 15-Aug.-2026	576.440	0,06				Industry Inc '144A' 5,625 % 15-Aug.-2026	471.780	0,05		
109.000	Central Garden & Pet Co 5,125 % 01-Feb.-2028	113.108	0,01			580.000	Fresh Market Inc/The '144A' 9,750 % 01-Mai-2023	495.900	0,06		
						100.000	Garda World Security Corp '144A' 4,625 % 15-Feb.-2027	98.812	0,01		

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener	Summe			Angemessener	Summe
		Wert	der Netto-			Wert	der Netto-
Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %	Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
Basiskonsumwerte Forts.				Basiskonsumwerte Forts.			
337.000	Garda World Security Corp '144A' 8,750 % 15-Mai-2025	342.262	0,04	1.073.000	Kraft Heinz Foods Co 6,500 % 09-Feb.-2040	1.295.357	0,14
240.000	Garda World Security Corp '144A' 9,500 % 01-Nov.-2027	254.206	0,03	523.000	Kraft Heinz Foods Co 6,875 % 26-Jan.-2039	648.013	0,07
570.000	Gartner Inc '144A' 5,125 % 01-Apr.-2025	585.193	0,07	1.025.000	Kraft Heinz Foods Co '144A' 3,750 % 01-Apr.-2030	1.059.226	0,12
380.000	Graham Holdings Co '144A' 5,750 % 01-Jun.-2026	394.322	0,04	1.480.000	Kraft Heinz Foods Co '144A' 3,875 % 15-Mai-2027	1.548.841	0,17
342.000	Hadrian Merger Sub Inc '144A' 8,500 % 01-Mai-2026	310.857	0,04	1.130.000	Kraft Heinz Foods Co '144A' 4,250 % 01-März-2031	1.200.665	0,13
2.415.000	HCA Inc 3,500 % 01-Sept.-2030	2.329.009	0,26	244.000	Kraft Heinz Foods Co '144A' 4,625 % 01-Okt.-2039	245.781	0,03
2.120.000	HCA Inc 5,375 % 01-Feb.-2025	2.276.997	0,25	1.243.000	Kraft Heinz Foods Co '144A' 4,875 % 01-Okt.-2049	1.267.733	0,14
875.000	HCA Inc 5,375 % 01-Sept.-2026	954.800	0,11	825.000	Kraft Heinz Foods Co '144A' 5,500 % 01-Jun.-2050	882.724	0,10
884.000	HCA Inc 5,625 % 01-Sept.-2028	988.807	0,11	690.000	Kraft Heinz Foods Co '144A' 7,125 % 01-Aug.-2039	870.936	0,10
1.005.000	HCA Inc 5,875 % 01-Mai-2023	1.088.144	0,12	767.000	Kronos Acquisition Holdings Inc '144A'		
1.293.000	HCA Inc 5,875 % 15-Feb.-2026	1.419.346	0,16	9.000	15-Aug.-2023	733.363	0,08
920.000	HCA Inc 5,875 % 01-Feb.-2029	1.042.631	0,12	255.000	Lamb Weston Holdings Inc '144A'		
420.000	HCA Inc 7,050 % 01-Dez.-2027	471.057	0,05		4,625 % 01-Nov.-2024	265.227	0,03
295.000	HCA Inc 7,500 % 15-Nov.-2095	347.892	0,04	865.000	Lamb Weston Holdings Inc '144A'		
20.000	HCA Inc 7,690 % 15-Jun.-2025	22.873	0,00		4,875 % 01-Nov.-2026	897.277	0,10
600.000	Herbalife Nutrition Ltd / HLF Financing Inc '144A'			595.000	Laureate Education Inc '144A' 8,250 % 01-Mai-2025	619.166	0,07
	7,875 % 01-Sept.-2025	620.625	0,07	140.000	LifePoint Health Inc '144A' 4,375 % 15-Feb.-2027	132.650	0,02
750.000	Herc Holdings Inc '144A' 5,500 % 15-Jul.-2027	753.510	0,08	250.000	LifePoint Health Inc '144A' 6,750 % 15-Apr.-2025	258.750	0,03
180.000	H-Food Holdings LLC /			465.000	Magellan Health Inc 4,900 % 22-Sept.-2024	472.275	0,05
	Hearthside Finance Co Inc '144A'			105.000	Mallinckrodt International Finance SA /		
	8,500 % 01-Jun.-2026	168.454	0,02		Mallinckrodt CB LLC '144A' 5,500 % 15-Apr.-2025	17.653	0,00
25.000	Hill-Rom Holdings Inc '144A' 4,375 % 15-Sept.-2027	25.667	0,00	190.000	Mallinckrodt International Finance SA /		
137.000	Hill-Rom Holdings Inc '144A' 5,000 % 15-Feb.-2025	141.638	0,02		Mallinckrodt CB LLC '144A' 5,625 % 15-Okt.-2023	38.000	0,00
495.000	HLF Financing Sarl LLC /			25.000	Mallinckrodt International Finance SA /		
	Herbalife International Inc '144A'				Mallinckrodt CB LLC '144A' 5,750 % 01-Aug.-2022	6.313	0,00
	7,250 % 15-Aug.-2026	498.250	0,06	850.000	MEDNAX Inc '144A' 5,250 % 01-Dez.-2023	847.964	0,09
905.000	Hologic Inc '144A' 4,375 % 15-Okt.-2025	916.217	0,10	942.000	MEDNAX Inc '144A' 6,250 % 15-Jan.-2027	945.255	0,11
450.000	Hologic Inc '144A' 4,625 % 01-Feb.-2028	468.477	0,05	336.000	Midas Intermediate Holdco II LLC /		
100.000	Horizon Therapeutics USA Inc '144A'				Midas Intermediate Holdco II Finance Inc '144A'		
	5,500 % 01-Aug.-2027	104.206	0,01		7,875 % 01-Okt.-2022	291.317	0,03
275.000	Immucor Inc '144A' 11,125 % 15-Feb.-2022	246.813	0,03	593.000	Molina Healthcare Inc 5,375 % 15-Nov.-2022	606.179	0,07
159.000	Ingles Markets Inc 5,750 % 15-Jun.-2023	160.290	0,02	371.000	Molina Healthcare Inc '144A' 4,875 % 15-Jun.-2025	374.207	0,04
920.000	IQVIA Inc '144A' 5,000 % 15-Okt.-2026	950.774	0,11	1.424.000	MPH Acquisition Holdings LLC '144A'		
540.000	IQVIA Inc '144A' 5,000 % 15-Mai-2027	554.562	0,06		7,125 % 01-Jun.-2024	1.329.639	0,15
115.000	Jaguar Holding Co II / PPD Development LP '144A'			260.000	Nathan's Famous Inc '144A' 6,625 % 01-Nov.-2025	263.250	0,03
	4,625 % 15-Jun.-2025	117.251	0,01	740.000	Nielsen Co Luxembourg SARL/The '144A'		
115.000	Jaguar Holding Co II / PPD Development LP '144A'				5,000 % 01-Feb.-2025	729.355	0,08
	5,000 % 15-Jun.-2028	117.947	0,01	340.000	Nielsen Co Luxembourg SARL/The '144A'		
365.000	JBS Investments II GmbH '144A' 5,750 % 15-Jan.-2028	361.441	0,04		5,500 % 01-Okt.-2021	341.195	0,04
1.045.000	JBS Investments II GmbH '144A' 7,000 % 15-Jan.-2026	1.099.105	0,12	1.705.000	Nielsen Finance LLC / Nielsen Finance Co '144A'		
165.000	JBS USA LUX SA / JBS USA Finance Inc '144A'				5,000 % 15-Apr.-2022	1.700.669	0,19
	5,750 % 15-Jun.-2025	167.475	0,02	605.000	Ortho-Clinical Diagnostics Inc / Ortho-Clinical		
580.000	JBS USA LUX SA / JBS USA Finance Inc '144A'				Diagnostics SA '144A' 7,250 % 01-Feb.-2028	616.483	0,07
	5,875 % 15-Jul.-2024	588.883	0,07	4.000	Owens & Minor Inc 3,875 % 15-Sept.-2021	3.975	0,00
515.000	JBS USA LUX SA / JBS USA Finance Inc '144A'			1.495.000	Par Pharmaceutical Inc '144A'		
	6,750 % 15-Feb.-2028	545.164	0,06		7,500 % 01-Apr.-2027	1.539.170	0,17
630.000	JBS USA LUX SA / JBS USA Food Co /			913.000	Pilgrim's Pride Corp '144A' 5,750 % 15-März-2025	911.667	0,10
	JBS USA Finance Inc '144A' 5,500 % 15-Jan.-2030	646.815	0,07	834.000	Pilgrim's Pride Corp '144A' 5,875 % 30-Sept.-2027	836.098	0,09
1.066.000	JBS USA LUX SA / JBS USA Food Co /			1.194.000	Polaris Intermediate Corp '144A'		
	JBS USA Finance Inc '144A' 6,500 % 15-Apr.-2029	1.133.755	0,13		8,500 % 01-Dez.-2022	1.054.439	0,12
65.000	KeHE Distributors LLC / KeHE Finance Corp '144A'			1.470.000	Post Holdings Inc '144A' 4,625 % 15-Apr.-2030	1.441.555	0,16
	8,625 % 15-Okt.-2026	69.377	0,01	1.457.000	Post Holdings Inc '144A' 5,000 % 15-Aug.-2026	1.465.268	0,16
25.000	Korn Ferry '144A' 4,625 % 15-Dez.-2027	24.375	0,00	400.000	Post Holdings Inc '144A' 5,500 % 15-Dez.-2029	414.324	0,05
1.950.000	Kraft Heinz Foods Co 3,000 % 01-Jun.-2026	1.966.891	0,22	841.000	Post Holdings Inc '144A' 5,625 % 15-Jan.-2028	872.382	0,10
1.900.000	Kraft Heinz Foods Co 3,950 % 15-Jul.-2025	2.017.281	0,23	860.000	Post Holdings Inc '144A' 5,750 % 01-März-2027	890.448	0,10
2.595.000	Kraft Heinz Foods Co 4,375 % 01-Jun.-2046	2.555.040	0,29	100.000	Prestige Brands Inc '144A' 5,125 % 15-Jan.-2028	98.750	0,01
1.305.000	Kraft Heinz Foods Co 4,625 % 30-Jan.-2029	1.407.770	0,16	1.115.000	Prime Security Services Borrower LLC /		
565.000	Kraft Heinz Foods Co 5,000 % 15-Jul.-2035	622.314	0,07		Prime Finance Inc '144A' 5,250 % 15-Apr.-2024	1.142.992	0,13
1.365.000	Kraft Heinz Foods Co 5,000 % 04-Jun.-2042	1.440.114	0,16	1.135.000	Prime Security Services Borrower LLC /		
1.670.000	Kraft Heinz Foods Co 5,200 % 15-Jul.-2045	1.813.647	0,20		Prime Finance Inc '144A' 5,750 % 15-Apr.-2026	1.179.651	0,13

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener		Bestände	Beschreibung	Angemessener	
		Wert	Summe			Wert	Summe
		in USD	der Netto-			in USD	der Netto-
			vermögen %				vermögen %
Anleihen Forts.							
Basiskonsumwerte Forts.							
600.000	Prime Security Services Borrower LLC /			526.000	United Rentals North America Inc		
	Prime Finance Inc '144A' 6,250 % 15-Jan.-2028	567.174	0,06		5,500 % 15-Jul.-2025	540.415	0,06
505.000	Radiology Partners Inc '144A' 9,250 % 01-Feb.-2028	477.225	0,05	644.000	United Rentals North America Inc		
1.605.000	Refinitiv US Holdings Inc '144A'				5,500 % 15-Mai-2027	665.854	0,07
	6,250 % 15-Mai-2026	1.705.016	0,19	755.000	United Rentals North America Inc		
1.773.000	Refinitiv US Holdings Inc '144A'				5,875 % 15-Sept.-2026	792.082	0,09
	8,250 % 15-Nov.-2026	1.921.905	0,21	1.010.000	United Rentals North America Inc		
995.000	RegionalCare Hospital Partners Holdings Inc /				6,500 % 15-Dez.-2026	1.062.419	0,12
	LifePoint Health Inc '144A' 9,750 % 01-Dez.-2026	1.027.989	0,12	800.000	US Foods Inc '144A' 5,875 % 15-Jun.-2024	762.084	0,09
370.000	Ritchie Bros Auctioneers Inc '144A'			1.475.000	US Foods Inc '144A' 6,250 % 15-Apr.-2025	1.507.266	0,17
	5,375 % 15-Jan.-2025	381.601	0,04	455.000	US Renal Care Inc '144A' 10,625 % 15-Jul.-2027	469.985	0,05
500.000	RR Donnelley & Sons Co 8,250 % 01-Jul.-2027	496.250	0,06	995.000	Vector Group Ltd '144A' 6,125 % 01-Feb.-2025	958.299	0,11
500.000	Safeway Inc 7,250 % 01-Feb.-2031	534.280	0,06	610.000	Vector Group Ltd '144A' 10,500 % 01-Nov.-2026	613.925	0,07
630.000	Select Medical Corp '144A' 6,250 % 15-Aug.-2026	638.303	0,07	815.000	Verscend Escrow Corp '144A' 9,750 % 15-Aug.-2026	877.898	0,10
315.000	Service Corp International/US 4,625 % 15-Dez.-2027	329.303	0,04	80.000	Vizient Inc '144A' 6,250 % 15-Mai-2027	84.085	0,01
755.000	Service Corp International/US 5,125 % 01-Jun.-2029	813.656	0,09	570.000	West Street Merger Sub Inc '144A'		
2.000	Service Corp International/US 7,500 % 01-Apr.-2027	2.277	0,00		6,375 % 01-Sept.-2025	553.251	0,06
347.000	Service Corp International/US 8,000 % 15-Nov.-2021	369.078	0,04	210.000	WEX Inc '144A' 4,750 % 01-Feb.-2023	209.266	0,02
555.000	ServiceMaster Co LLC/The '144A'			253.000	WW International Inc '144A' 8,625 % 01-Dez.-2025	261.381	0,03
	5,125 % 15-Nov.-2024	564.077	0,06				
305.000	Sigma Holdco BV '144A' 7,875 % 15-Mai-2026	304.181	0,03	Diversifiziert - 492.388			
1.064.000	Simmons Foods Inc '144A' 5,750 % 01-Nov.-2024	1.013.572	0,11	(31. Dezember 2019: 988.240)			
380.000	Simmons Foods Inc '144A' 7,750 % 15-Jan.-2024	397.801	0,04			492.388	0,05
450.000	Sotheby's '144A' 7,375 % 15-Okt.-2027	426.010	0,05	300.000	Stena AB '144A' 7,000 % 01-Feb.-2024	283.094	0,03
1.055.000	Spectrum Brands Inc 5,750 % 15-Jul.-2025	1.086.001	0,12	200.000	Stena International SA '144A' 5,750 % 01-März-2024	186.729	0,02
39.000	Spectrum Brands Inc 6,125 % 15-Dez.-2024	40.215	0,00	25.000	VistaJet Malta Finance Plc / XO Management		
75.000	Spectrum Brands Inc '144A' 5,000 % 01-Okt.-2029	74.329	0,01		Holding Inc '144A' 10,500 % 01-Jun.-2024	22.565	0,00
300.000	Surgery Center Holdings Inc '144A'						
	6,750 % 01-Jul.-2025	271.843	0,03	Energie - 134.495.162			
320.000	Surgery Center Holdings Inc '144A'					134.495.162	15,00
	10,000 % 15-Apr.-2027	321.139	0,04	675.000	AI Candelaria Spain SLU '144A'		
731.000	Team Health Holdings Inc '144A' 6,375 % 01-Feb.-2025	426.645	0,05		7,500 % 15-Dez.-2028	684.153	0,08
425.000	Teleflex Inc 4,625 % 15-Nov.-2027	450.298	0,05	65.000	Aker BP ASA '144A' 5,875 % 31-März-2025	66.146	0,01
285.000	Teleflex Inc 4,875 % 01-Jun.-2026	294.565	0,03	235.000	Alliance Resource Operating Partners LP /		
115.000	Teleflex Inc '144A' 4,250 % 01-Jun.-2028	118.091	0,01		Alliance Resource Finance Corp '144A'		
1.525.000	Tenet Healthcare Corp 4,625 % 15-Jul.-2024	1.498.313	0,17		7,500 % 01-Mai-2025	159.212	0,02
1.405.000	Tenet Healthcare Corp 5,125 % 01-Mai-2025	1.357.525	0,15	310.000	American Midstream Partners LP /		
1.465.000	Tenet Healthcare Corp 6,750 % 15-Jun.-2023	1.455.477	0,16		American Midstream Finance Corp '144A'		
205.000	Tenet Healthcare Corp 6,875 % 15-Nov.-2031	182.155	0,02		9,500 % 15-Dez.-2021	283.224	0,03
263.000	Tenet Healthcare Corp 7,000 % 01-Aug.-2025	257.202	0,03	465.000	Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream		
2.075.000	Tenet Healthcare Corp 8,125 % 01-Apr.-2022	2.182.485	0,24		Finance Corp 5,375 % 15-Sept.-2024	397.628	0,04
235.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 4,625 % 01-Sept.-2024	229.933	0,03	835.000	Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream		
1.555.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 4,875 % 01-Jan.-2026	1.516.545	0,17		Finance Corp '144A' 5,750 % 01-März-2027	662.284	0,07
1.073.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 5,125 % 01-Nov.-2027	1.061.841	0,12	350.000	Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream		
1.200.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 6,250 % 01-Feb.-2027	1.194.744	0,13		Finance Corp '144A' 5,750 % 15-Jan.-2028	277.386	0,03
515.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 7,500 % 01-Apr.-2025	550.084	0,06	393.000	Antero Resources Corp 5,000 % 01-März-2025	233.098	0,03
356.000	Tms International Holding Corp '144A'			435.000	Antero Resources Corp 5,125 % 01-Dez.-2022	315.255	0,04
	7,250 % 15-Aug.-2025	291.920	0,03	500.000	Antero Resources Corp 5,375 % 01-Nov.-2021	464.160	0,05
210.000	TreeHouse Foods Inc 4,875 % 15-März-2022	210.738	0,02	745.000	Apache Corp 3,250 % 15-Apr.-2022	721.088	0,08
445.000	TreeHouse Foods Inc '144A' 6,000 % 15-Feb.-2024	455.059	0,05	1.145.000	Apache Corp 4,250 % 15-Jan.-2030	991.680	0,11
761.000	United Rentals North America Inc			670.000	Apache Corp 4,250 % 15-Jan.-2044	510.440	0,06
	3,875 % 15-Nov.-2027	760.384	0,09	1.355.000	Apache Corp 4,375 % 15-Okt.-2028	1.197.354	0,13
555.000	United Rentals North America Inc			1.720.000	Apache Corp 4,750 % 15-Apr.-2043	1.387.395	0,15
	4,000 % 15-Jul.-2030	537.498	0,06	1.540.000	Apache Corp 5,100 % 01-Sept.-2040	1.267.399	0,14
470.000	United Rentals North America Inc			435.000	Apache Corp 5,250 % 01-Feb.-2042	355.431	0,04
	4,625 % 15-Okt.-2025	473.276	0,05	380.000	Apache Corp 5,350 % 01-Jul.-2049	303.610	0,03
1.265.000	United Rentals North America Inc			485.000	Apache Corp 6,000 % 15-Jan.-2037	436.768	0,05
	4,875 % 15-Jan.-2028	1.298.605	0,15	370.000	Archrock Partners LP / Archrock Partners		
750.000	United Rentals North America Inc				Finance Corp '144A' 6,250 % 01-Apr.-2028	337.625	0,04
	5,250 % 15-Jan.-2030	776.111	0,09	641.000	Archrock Partners LP / Archrock Partners		
					Finance Corp '144A' 6,875 % 01-Apr.-2027	605.684	0,07

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener		Bestände	Beschreibung	Angemessener	
		Wert	Summe			Wert	Summe
		in USD	der Netto-			in USD	der Netto-
			vermögen %				vermögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
Energie Forts.				Energie Forts.			
750.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC / ARU Finance Corp '144A' 7,000 % 01-Nov.-2026	482.670	0,05	1.150.000	Continental Resources Inc/OK 5,000 % 15-Sept.-2022	1.131.456	0,13
721.000	Ascent Resources Utica Holdings LLC / ARU Finance Corp '144A' 10,000 % 01-Apr.-2022	616.898	0,07	354.000	Crestwood Midstream Partners LP / Crestwood Midstream Finance Corp 5,750 % 01-Apr.-2025	306.877	0,03
191.000	Athabasca Oil Corp '144A' 9,875 % 24-Feb.-2022	78.504	0,01	500.000	Crestwood Midstream Partners LP / Crestwood Midstream Finance Corp 6,250 % 01-Apr.-2023	446.303	0,05
195.000	Basic Energy Services Inc '144A' 10,750 % 15-Okt.-2023	79.463	0,01	370.000	Crestwood Midstream Partners LP / Crestwood Midstream Finance Corp '144A' 5,625 % 01-Mai-2027	309.633	0,03
146.000	Baytex Energy Corp '144A' 5,625 % 01-Jun.-2024	89.592	0,01	885.000	CrownRock LP / CrownRock Finance Inc '144A' 5,625 % 15-Okt.-2025	795.938	0,09
100.000	Baytex Energy Corp '144A' 8,750 % 01-Apr.-2027	49.925	0,01	412.000	CSI Compressco LP / CSI Compressco Finance Inc 7,250 % 15-Aug.-2022	218.360	0,02
550.000	Berry Petroleum Co LLC '144A' 7,000 % 15-Feb.-2026	447.458	0,05	309.000	CSI Compressco LP / CSI Compressco Finance Inc '144A' 7,500 % 01-Apr.-2025	263.423	0,03
630.000	Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp '144A' 6,125 % 15-Nov.-2022	628.252	0,07	100.000	CVR Energy Inc '144A' 5,250 % 15-Feb.-2025	92.313	0,01
575.000	Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp '144A' 6,625 % 15-Jul.-2026	513.797	0,06	385.000	CVR Energy Inc '144A' 5,750 % 15-Feb.-2028	337.838	0,04
262.000	Buckeye Partners LP 3,950 % 01-Dez.-2026	247.701	0,03	95.000	DCP Midstream Operating LP 3,875 % 15-März-2023	92.445	0,01
340.000	Buckeye Partners LP 4,125 % 01-Dez.-2027	324.913	0,04	257.000	DCP Midstream Operating LP 4,950 % 01-Apr.-2022	259.309	0,03
550.000	Buckeye Partners LP 4,150 % 01-Jul.-2023	536.759	0,06	925.000	DCP Midstream Operating LP 5,125 % 15-Mai-2029	888.990	0,10
875.000	Buckeye Partners LP 4,350 % 15-Okt.-2024	829.609	0,09	650.000	DCP Midstream Operating LP 5,375 % 15-Jul.-2025	647.150	0,07
210.000	Buckeye Partners LP 5,600 % 15-Okt.-2044	168.656	0,02	200.000	DCP Midstream Operating LP 5,600 % 01-Apr.-2044	160.859	0,02
220.000	Buckeye Partners LP 5,850 % 15-Nov.-2043	191.604	0,02	125.000	DCP Midstream Operating LP 8,125 % 16-Aug.-2030	131.695	0,01
90.000	Buckeye Partners LP '144A' 4,125 % 01-März-2025	86.559	0,01	300.000	DCP Midstream Operating LP '144A' 4,750 % 30-Sept.-2021	305.825	0,03
585.000	Buckeye Partners LP '144A' 4,500 % 01-März-2028	548.437	0,06	4.000	DCP Midstream Operating LP '144A' 6,450 % 03-Nov.-2036	3.617	0,00
295.000	Buckeye Partners LP FRN 6,375 % 22-Jan.-2078	216.617	0,02	240.000	DCP Midstream Operating LP '144A' 6,750 % 15-Sept.-2037	216.380	0,02
446.000	Callon Petroleum Co 6,125 % 01-Okt.-2024	168.755	0,02	137.000	Delek Logistics Partners LP / Delek Logistics Finance Corp 6,750 % 15-Mai-2025	127.224	0,01
270.000	Callon Petroleum Co 6,250 % 15-Apr.-2023	103.109	0,01	100.000	Denbury Resources Inc '144A' 7,750 % 15-Feb.-2024	38.302	0,00
587.000	Callon Petroleum Co 6,375 % 01-Jul.-2026	195.800	0,02	165.000	Denbury Resources Inc '144A' 9,250 % 31-März-2022	66.580	0,01
85.000	Callon Petroleum Co 8,250 % 15-Jul.-2025	30.060	0,00	1.040.000	Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc '144A' 5,500 % 30-Jan.-2026	998.821	0,11
257.000	Calumet Specialty Products Partners LP / Calumet Finance Corp 7,625 % 15-Jan.-2022	246.338	0,03	948.000	Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc '144A' 5,750 % 30-Jan.-2028	912.275	0,10
241.000	Calumet Specialty Products Partners LP / Calumet Finance Corp 7,750 % 15-Apr.-2023	225.008	0,03	52.000	Energy Ventures Gom LLC / EnVen Finance Corp '144A' 11,000 % 15-Feb.-2023	43.610	0,00
409.000	Calumet Specialty Products Partners LP / Calumet Finance Corp '144A' 11,000 % 15-Apr.-2025	395.703	0,04	485.000	EnLink Midstream LLC 5,375 % 01-Jun.-2029	365.159	0,04
605.000	Cenovus Energy Inc 3,000 % 15-Aug.-2022	588.567	0,07	815.000	EnLink Midstream Partners LP 4,150 % 01-Jun.-2025	629.673	0,07
950.000	Cenovus Energy Inc 3,800 % 15-Sept.-2023	893.854	0,10	405.000	EnLink Midstream Partners LP 4,400 % 01-Apr.-2024	337.614	0,04
935.000	Cenovus Energy Inc 4,250 % 15-Apr.-2027	847.550	0,09	350.000	EnLink Midstream Partners LP 4,850 % 15-Jul.-2026	260.122	0,03
750.000	Cenovus Energy Inc 5,250 % 15-Jun.-2037	649.266	0,07	292.000	EnLink Midstream Partners LP 5,050 % 01-Apr.-2045	183.112	0,02
615.000	Cenovus Energy Inc 5,400 % 15-Jun.-2047	528.656	0,06	55.000	EnLink Midstream Partners LP 5,450 % 01-Jun.-2047	34.268	0,00
695.000	Cenovus Energy Inc 6,750 % 15-Nov.-2039	677.414	0,08	245.000	EnLink Midstream Partners LP 5,600 % 01-Apr.-2044	150.502	0,02
325.000	CGG Holding US Inc '144A' 9,000 % 01-Mai-2023	329.063	0,04	100.000	Ensign Drilling Inc '144A' 9,250 % 15-Apr.-2024	44.812	0,00
388.000	ChampionX Corp 6,375 % 01-Mai-2026	361.938	0,04	185.000	Enviva Partners LP / Enviva Partners Finance Corp '144A' 6,500 % 15-Jan.-2026	192.747	0,02
150.000	Chaparral Energy Inc '144A' 8,750 % 15-Jul.-2023	16.500	0,00	613.000	EQM Midstream Partners LP 4,000 % 01-Aug.-2024	581.648	0,06
1.383.000	Cheniere Energy Partners LP 5,250 % 01-Okt.-2025	1.379.819	0,15	1.010.000	EQM Midstream Partners LP 4,125 % 01-Dez.-2026	927.619	0,10
815.000	Cheniere Energy Partners LP 5,625 % 01-Okt.-2026	813.394	0,09	1.135.000	EQM Midstream Partners LP 4,750 % 15-Jul.-2023	1.144.625	0,13
1.065.000	Cheniere Energy Partners LP '144A' 4,500 % 01-Okt.-2029	1.034.988	0,12	1.215.000	EQM Midstream Partners LP 5,500 % 15-Jul.-2028	1.159.997	0,13
564.063	Chesapeake Energy Corp (Defaulted) 4,875 % 15-Apr.-2022	19.742	0,00	635.000	EQM Midstream Partners LP 6,500 % 15-Jul.-2048	580.622	0,06
490.000	CNX Midstream Partners LP / CNX Midstream Finance Corp '144A' 6,500 % 15-März-2026	452.544	0,05	1.170.000	EQT Corp 3,000 % 01-Okt.-2022	1.091.756	0,12
146.000	CNX Resources Corp 5,875 % 15-Apr.-2022	144.536	0,02	1.616.000	EQT Corp 3,900 % 01-Okt.-2027	1.319.472	0,15
590.000	CNX Resources Corp '144A' 7,250 % 14-März-2027	543.549	0,06	335.000	EQT Corp 4,875 % 15-Nov.-2021	329.246	0,04
340.000	Comstock Resources Inc 9,750 % 15-Aug.-2026	317.900	0,04	1.055.000	EQT Corp 6,125 % 01-Feb.-2025	1.053.164	0,12
485.000	Comstock Resources Inc 9,750 % 15-Aug.-2026	454.913	0,05	825.000	EQT Corp 7,000 % 01-Feb.-2030	850.880	0,09
375.000	Comstock Resources Inc '144A' 7,500 % 15-Mai-2025	342.656	0,04	380.000	Exterran Energy Solutions LP / EES Finance Corp 8,125 % 01-Mai-2025	315.835	0,04
30.000	CONSOL Energy Inc '144A' 11,000 % 15-Nov.-2025	12.791	0,00				
506.000	Continental Resources Inc/OK 3,800 % 01-Jun.-2024	474.471	0,05				
1.150.000	Continental Resources Inc/OK 4,375 % 15-Jan.-2028	1.014.311	0,11				
1.425.000	Continental Resources Inc/OK 4,500 % 15-Apr.-2023	1.366.618	0,15				
1.000.000	Continental Resources Inc/OK 4,900 % 01-Jun.-2044	798.415	0,09				

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener	Summe			Angemessener	Summe
		Wert	der Netto-			Wert	der Netto-
Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %	Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
Energie Forts.				Energie Forts.			
500.000	Extraction Oil & Gas Inc '144A' (Defaulted) 5,625 % 01-Feb.-2026	98.030	0,01	325.000	Nabors Industries Inc 5,750 % 01-Feb.-2025	132.810	0,01
273.000	FTS International Inc 6,250 % 01-Mai-2022	90.090	0,01	100.000	Natural Resource Partners LP / NRP Finance Corp '144A' 9,125 % 30-Jun.-2025	83.364	0,01
260.000	Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp 5,625 % 15-Jun.-2024	227.148	0,03	400.000	Neptune Energy Bondco Plc '144A' 6,625 % 15-Mai-2025	349.246	0,04
510.000	Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp 6,000 % 15-Mai-2023	460.859	0,05	286.000	NGL Energy Partners LP / NGL Energy Finance Corp 6,125 % 01-März-2025	216.972	0,02
833.000	Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp 6,250 % 15-Mai-2026	717.580	0,08	700.000	NGL Energy Partners LP / NGL Energy Finance Corp 7,500 % 01-Nov.-2023	583.181	0,06
1.004.000	Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp 6,500 % 01-Okt.-2025	861.547	0,10	335.000	NGL Energy Partners LP / NGL Energy Finance Corp 7,500 % 15-Apr.-2026	255.384	0,03
832.000	Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp 7,750 % 01-Feb.-2028	741.262	0,08	275.000	Nine Energy Service Inc '144A' 8,750 % 01-Nov.-2023	135.180	0,02
202.000	Global Partners LP / GLP Finance Corp 7,000 % 15-Jun.-2023	194.909	0,02	254.000	Noble Holding International Ltd 5,250 % 15-März-2042	8.890	0,00
215.000	Global Partners LP / GLP Finance Corp 7,000 % 01-Aug.-2027	199.506	0,02	50.000	Noble Holding International Ltd 6,050 % 01-März-2041	1.625	0,00
550.000	Great Western Petroleum LLC / Great Western Finance Corp '144A' 9,000 % 30-Sept.-2021	335.500	0,04	63.000	Noble Holding International Ltd 6,200 % 01-Aug.-2040	1.171	0,00
100.000	Gulfport Energy Corp 6,000 % 15-Okt.-2024	51.312	0,01	140.000	Noble Holding International Ltd 7,750 % 15-Jan.-2024	3.310	0,00
385.000	Gulfport Energy Corp 6,375 % 15-Mai-2025	193.443	0,02	610.000	Noble Holding International Ltd 7,950 % 01-Apr.-2025	20.523	0,00
160.000	Gulfport Energy Corp 6,625 % 01-Mai-2023	95.762	0,01	395.000	Noble Holding International Ltd '144A' 7,875 % 01-Feb.-2026	104.106	0,01
240.000	Hess Midstream Operations LP '144A' 5,625 % 15-Feb.-2026	238.025	0,03	224.000	NuStar Logistics LP 4,750 % 01-Feb.-2022	220.307	0,02
483.000	HighPoint Operating Corp 7,000 % 15-Okt.-2022	117.618	0,01	615.000	NuStar Logistics LP 5,625 % 28-Apr.-2027	594.899	0,07
205.000	HighPoint Operating Corp 8,750 % 15-Jun.-2025	50.225	0,01	515.000	NuStar Logistics LP 6,000 % 01-Jun.-2026	500.433	0,06
610.000	Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co '144A' 5,000 % 01-Dez.-2024	526.823	0,06	1.399.000	Occidental Petroleum Corp 2,600 % 13-Aug.-2021	1.370.985	0,15
370.000	Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co '144A' 5,750 % 01-Okt.-2025	315.849	0,04	595.000	Occidental Petroleum Corp 2,600 % 15-Apr.-2022	569.891	0,06
620.000	Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co '144A' 6,250 % 01-Nov.-2028	499.757	0,06	1.754.000	Occidental Petroleum Corp 2,700 % 15-Aug.-2022	1.636.122	0,18
370.000	Holly Energy Partners LP / Holly Energy Finance Corp '144A' 5,000 % 01-Feb.-2028	353.293	0,04	1.102.000	Occidental Petroleum Corp 2,700 % 15-Feb.-2023	1.009.707	0,11
1.025.000	Indigo Natural Resources LLC '144A' 6,875 % 15-Feb.-2026	956.484	0,11	2.450.000	Occidental Petroleum Corp 2,900 % 15-Aug.-2024	2.098.352	0,23
325.000	Ithaca Energy North Sea Plc '144A' 9,375 % 15-Jul.-2024	261.622	0,03	690.000	Occidental Petroleum Corp 3,000 % 15-Feb.-2027	538.338	0,06
465.000	Jagged Peak Energy LLC 5,875 % 01-Mai-2026	452.429	0,05	400.000	Occidental Petroleum Corp 3,125 % 15-Feb.-2022	385.080	0,04
445.000	Laredo Petroleum Inc 9,500 % 15-Jan.-2025	308.025	0,03	1.045.000	Occidental Petroleum Corp 3,200 % 15-Aug.-2026	853.634	0,10
295.000	Laredo Petroleum Inc 10,125 % 15-Jan.-2028	204.287	0,02	1.100.000	Occidental Petroleum Corp 3,400 % 15-Apr.-2026	899.250	0,10
60.000	Lonestar Resources America Inc '144A' 11,250 % 01-Jan.-2023	6.300	0,00	840.000	Occidental Petroleum Corp 3,500 % 15-Jun.-2025	714.000	0,08
287.000	Magnolia Oil & Gas Operating LLC / Magnolia Oil & Gas Finance Corp '144A' 6,000 % 01-Aug.-2026	272.650	0,03	1.570.000	Occidental Petroleum Corp 3,500 % 15-Aug.-2029	1.151.124	0,13
825.000	Matador Resources Co 5,875 % 15-Sept.-2026	612.455	0,07	110.000	Occidental Petroleum Corp 4,100 % 15-Feb.-2047	74.663	0,01
736.000	MEG Energy Corp '144A' 6,500 % 15-Jan.-2025	687.350	0,08	600.000	Occidental Petroleum Corp 4,200 % 15-März-2048	407.070	0,05
745.000	MEG Energy Corp '144A' 7,000 % 31-März-2024	640.778	0,07	495.000	Occidental Petroleum Corp 4,300 % 15-Aug.-2039	343.572	0,04
890.000	MEG Energy Corp '144A' 7,125 % 01-Feb.-2027	742.037	0,08	600.000	Occidental Petroleum Corp 4,400 % 15-Apr.-2046	419.535	0,05
790.000	Montage Resources Corp 8,875 % 15-Jul.-2023	626.561	0,07	845.000	Occidental Petroleum Corp 4,400 % 15-Aug.-2049	585.978	0,07
400.000	Moss Creek Resources Holdings Inc '144A' 7,500 % 15-Jan.-2026	201.424	0,02	400.000	Occidental Petroleum Corp 4,500 % 15-Jul.-2044	277.750	0,03
405.000	Murphy Oil Corp 4,000 % 01-Jun.-2022	390.062	0,04	120.000	Occidental Petroleum Corp 4,625 % 15-Jun.-2045	84.600	0,01
331.000	Murphy Oil Corp 4,950 % 01-Dez.-2022	320.446	0,04	1.490.000	Occidental Petroleum Corp 5,550 % 15-März-2026	1.362.970	0,15
250.000	Murphy Oil Corp 5,750 % 15-Aug.-2025	224.401	0,02	465.000	Occidental Petroleum Corp 6,200 % 15-März-2040	391.472	0,04
405.000	Murphy Oil Corp 5,875 % 01-Dez.-2027	356.781	0,04	930.000	Occidental Petroleum Corp 6,450 % 15-Sept.-2036	790.658	0,09
142.000	Murphy Oil Corp 6,375 % 01-Dez.-2042	110.788	0,01	75.000	Occidental Petroleum Corp 6,600 % 15-März-2046	65.613	0,01
509.000	Murphy Oil Corp 6,875 % 15-Aug.-2024	477.241	0,05	790.000	Occidental Petroleum Corp 6,950 % 01-Jul.-2024	778.150	0,09
120.000	Murphy Oil Corp 7,050 % 01-Mai-2029	108.427	0,01	670.000	Occidental Petroleum Corp 7,500 % 01-Mai-2031	625.837	0,07
32.000	Nabors Industries Inc 4,625 % 15-Sept.-2021	25.040	0,00	675.000	Occidental Petroleum Corp 7,875 % 15-Sept.-2031	642.097	0,07
				200.000	Occidental Petroleum Corp 7,950 % 15-Jun.-2039	180.875	0,02
				361.000	Oceaneering International Inc 4,650 % 15-Nov.-2024	273.683	0,03
				435.000	Oceaneering International Inc 6,000 % 01-Feb.-2028	306.049	0,03
				370.000	Pacific Drilling SA '144A' 8,375 % 01-Okt.-2023	93.653	0,01
				313.000	Par Petroleum LLC / Par Petroleum Finance Corp '144A' 7,750 % 15-Dez.-2025	271.169	0,03
				200.000	Parkland Corp/Canada '144A' 5,875 % 15-Jul.-2027	207.963	0,02
				365.000	Parkland Corp/Canada '144A' 6,000 % 01-Apr.-2026	374.970	0,04
				175.000	Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp '144A' 4,125 % 15-Feb.-2028	158.812	0,02
				610.000	Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp '144A' 5,250 % 15-Aug.-2025	588.037	0,07

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
	Energie Forts.				Energie Forts.		
603.000	Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp '144A' 5,375 % 15-Jan.-2025	588.474	0,07	238.000	Summit Midstream Holdings LLC / Summit Midstream Finance Corp 5,500 % 15-Aug.-2022	157.917	0,02
399.000	Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp '144A' 5,625 % 15-Okt.-2027	393.939	0,04	720.000	SunCoke Energy Partners LP / SunCoke Energy Partners Finance Corp '144A' 7,500 % 15-Jun.-2025	610.787	0,07
233.000	Pattern Energy Group Inc '144A' 5,875 % 01-Feb.-2024	235.014	0,03	275.000	Suncor Energy Ventures Corp '144A' 4,500 % 01-Apr.-2022	279.149	0,03
650.000	Patterson-UTI Energy Inc 3,950 % 01-Feb.-2028	491.560	0,05	215.000	Suncor Energy Ventures Corp '144A' 6,000 % 01-Apr.-2042	219.570	0,02
300.000	Patterson-UTI Energy Inc 5,150 % 15-Nov.-2029	227.709	0,03	940.000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 4,875 % 15-Jan.-2023	929.326	0,10
760.000	PBF Holding Co LLC / PBF Finance Corp 7,250 % 15-Jun.-2025	691.680	0,08	800.000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 5,500 % 15-Feb.-2026	778.848	0,09
740.000	PBF Holding Co LLC / PBF Finance Corp '144A' 6,000 % 15-Feb.-2028	616.050	0,07	450.000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 5,875 % 15-März-2028	448.299	0,05
90.000	PBF Holding Co LLC / PBF Finance Corp '144A' 9,250 % 15-Mai-2025	96.244	0,01	396.000	Sunoco LP / Sunoco Finance Corp 6,000 % 15-Apr.-2027	392.943	0,04
487.000	PBF Logistics LP / PBF Logistics Finance Corp 6,875 % 15-Mai-2023	465.382	0,05	370.000	Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp '144A' 4,750 % 01-Okt.-2023	341.553	0,04
445.000	PDC Energy Inc 5,750 % 15-Mai-2026	406.354	0,05	555.000	Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp '144A' 5,500 % 15-Sept.-2024	502.933	0,06
295.000	PDC Energy Inc 6,125 % 15-Sept.-2024	275.425	0,03	780.000	Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp '144A' 5,500 % 15-Jan.-2028	676.966	0,08
273.000	Peabody Energy Corp '144A' 6,000 % 31-März-2022	178.303	0,02	100.000	Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp '144A' 6,000 % 01-März-2027	89.000	0,01
50.000	Peabody Energy Corp '144A' 6,375 % 31-März-2025	26.656	0,00	525.000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 4,250 % 15-Nov.-2023	502.743	0,06
84.000	Precision Drilling Corp 5,250 % 15-Nov.-2024	56.419	0,01	620.000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 5,000 % 15-Jan.-2028	584.837	0,07
43.000	Precision Drilling Corp 7,750 % 15-Dez.-2023	29.612	0,00	627.000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 5,125 % 01-Feb.-2025	605.441	0,07
28.000	Precision Drilling Corp '144A' 7,125 % 15-Jan.-2026	17.180	0,00	140.000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 5,250 % 01-Mai-2023	136.865	0,02
300.000	Puma International Financing SA '144A' 5,000 % 24-Jan.-2026	251.250	0,03	680.000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 5,375 % 01-Feb.-2027	657.774	0,07
300.000	Puma International Financing SA '144A' 5,125 % 06-Okt.-2024	254.250	0,03	703.000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 5,875 % 15-Apr.-2026	697.615	0,08
350.000	QEP Resources Inc 5,250 % 01-Mai-2023	232.094	0,03	719.000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 6,500 % 15-Jul.-2027	722.595	0,08
140.000	QEP Resources Inc 5,375 % 01-Okt.-2022	106.892	0,01	515.000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 6,750 % 15-März-2024	515.317	0,06
370.000	QEP Resources Inc 5,625 % 01-März-2026	236.117	0,03	700.000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp 6,875 % 15-Jan.-2029	735.438	0,08
599.000	Range Resources Corp 4,875 % 15-Mai-2025	454.117	0,05	704.000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp '144A' 5,500 % 01-März-2030	680.458	0,08
417.000	Range Resources Corp 5,000 % 15-Aug.-2022	380.773	0,04	311.000	Teine Energy Ltd '144A' 6,875 % 30-Sept.-2022	308.206	0,03
605.000	Range Resources Corp 5,000 % 15-März-2023	522.185	0,06	495.000	TerraForm Power Operating LLC '144A' 4,250 % 31-Jan.-2023	502.729	0,06
565.000	Range Resources Corp '144A' 9,250 % 01-Feb.-2026	508.941	0,06	655.000	TerraForm Power Operating LLC '144A' 4,750 % 15-Jan.-2030	666.338	0,07
295.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 3,600 % 15-Mai-2025	273.517	0,03	710.000	TerraForm Power Operating LLC '144A' 5,000 % 31-Jan.-2028	741.819	0,08
405.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 4,950 % 15-Jul.-2029	378.796	0,04	104.000	TransMontaigne Partners LP / TLP Finance Corp 6,125 % 15-Feb.-2026	100.730	0,01
320.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 6,875 % 15-Apr.-2040	304.832	0,03	459.250	Transocean Guardian Ltd '144A' 5,875 % 15-Jan.-2024	406.317	0,05
145.000	Rockies Express Pipeline LLC '144A' 7,500 % 15-Jul.-2038	140.650	0,02	285.000	Transocean Inc 5,800 % 15-Okt.-2022	155.325	0,02
115.909	Ruby Pipeline LLC '144A' 7,000 % 01-Apr.-2022	107.889	0,01	965.000	Transocean Inc 6,800 % 15-März-2038	291.855	0,03
135.000	SESI LLC 7,125 % 15-Dez.-2021	49.275	0,01	316.000	Transocean Inc 7,500 % 15-Apr.-2031	93.220	0,01
140.000	SESI LLC 7,750 % 15-Sept.-2024	51.610	0,01	409.000	Transocean Inc 8,375 % 15-Dez.-2021	290.390	0,03
520.000	Seven Generations Energy Ltd '144A' 5,375 % 30-Sept.-2025	459.220	0,05				
315.000	Seven Generations Energy Ltd '144A' 6,750 % 01-Mai-2023	303.548	0,03				
335.000	Seven Generations Energy Ltd '144A' 6,875 % 30-Jun.-2023	325.334	0,04				
95.000	SM Energy Co 5,000 % 15-Jan.-2024	51.646	0,01				
100.000	SM Energy Co 6,625 % 15-Jan.-2027	49.291	0,01				
310.000	SM Energy Co 6,750 % 15-Sept.-2026	156.996	0,02				
129.000	SM Energy Co '144A' 10,000 % 15-Jan.-2025	122.793	0,01				
689.000	Southwestern Energy Co 4,950 % 23-Jan.-2025	592.099	0,07				
685.000	Southwestern Energy Co 7,500 % 01-Apr.-2026	601.742	0,07				
162.000	Southwestern Energy Co 7,750 % 01-Okt.-2027	141.451	0,02				

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener	Summe			Angemessener	Summe
		Wert	der Netto-			Wert	der Netto-
Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %	Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
Energie Forts.				Finanzwerte - 92.969.788			
114.000	Transocean Inc 9,600% 15-Dez.-2041	34.772	0,00	(31. Dezember 2019: 77.312.845)			
490.000	Transocean Inc '144A' 7,250% 01-Nov.-2025	274.400	0,03	900.000	Acrisure LLC / Acrisure Finance Inc '144A'	92.969.788	10,37
555.000	Transocean Inc '144A' 7,500% 15-Jan.-2026	308.025	0,03		7,000% 15-Nov.-2025	863.429	0,10
100.000	Transocean Inc '144A' 8,000% 01-Feb.-2027	56.625	0,01	855.000	Acrisure LLC / Acrisure Finance Inc '144A'		
328.250	Transocean Phoenix 2 Ltd '144A' 7,750% 15-Okt.-2024	311.017	0,03		8,125% 15-Feb.-2024	890.948	0,10
417.500	Transocean Pontus Ltd '144A' 6,125% 01-Aug.-2025	367.400	0,04	250.000	Acrisure LLC / Acrisure Finance Inc '144A'		
475.000	Transocean Poseidon Ltd '144A' 6,875% 01-Feb.-2027	410.875	0,05		10,125% 01-Aug.-2026	269.335	0,03
65.000	Transocean Proteus Ltd '144A' 6,250% 01-Dez.-2024	60.125	0,01	257.000	Advisor Group Holdings Inc '144A'		
385.000	Transocean Sentry Ltd '144A' 5,375% 15-Mai-2023	331.100	0,04		10,750% 01-Aug.-2027	252.614	0,03
535.000	USA Compression Partners LP / USA Compression Finance Corp 6,875% 01-Apr.-2026	518.196	0,06	450.000	AerCap Holdings NV FRN 5,875% 10-Okt.-2079	325.843	0,04
585.000	USA Compression Partners LP / USA Compression Finance Corp 6,875% 01-Sept.-2027	562.589	0,06	391.000	AG Issuer LLC '144A' 6,250% 01-März-2028	364.607	0,04
190.000	Vantage Drilling International '144A'			690.000	Alliant Holdings Intermediate LLC / Alliant Holdings Co-Issuer '144A' 6,750% 15-Okt.-2027	688.834	0,08
	9,250% 15-Nov.-2023	127.993	0,01	965.000	Ally Financial Inc 5,750% 20-Nov.-2025	1.033.770	0,12
172.000	Vermilion Energy Inc '144A' 5,625% 15-März-2025	145.967	0,02	605.000	AmWINS Group Inc '144A' 7,750% 01-Jul.-2026	637.404	0,07
395.000	Vine Oil & Gas LP / Vine Oil & Gas Finance Corp '144A'			375.000	Ardonagh Midco 3 Plc '144A' 8,625% 15-Jul.-2023	392.625	0,04
	8,750% 15-Apr.-2023	240.950	0,03	145.000	Assurant Inc FRN 7,000% 27-März-2048	149.020	0,02
328.000	Vine Oil & Gas LP / Vine Oil & Gas Finance Corp '144A'			645.000	AssuredPartners Inc '144A' 7,000% 15-Aug.-2025	647.009	0,07
	9,750% 15-Apr.-2023	201.720	0,02	983.000	Brookfield Property REIT Inc / BPR Cumulus LLC / BPR Nimbus LLC / GGSI Sellco LL '144A'		
300.000	Viper Energy Partners LP '144A'				5,750% 15-Mai-2026	832.935	0,09
	5,375% 01-Nov.-2027	294.783	0,03	65.000	CBL & Associates LP 5,250% 01-Dez.-2023	18.762	0,00
600.000	W&T Offshore Inc '144A' 9,750% 01-Nov.-2023	377.469	0,04	47.000	CBL & Associates LP 5,950% 15-Dez.-2026	13.649	0,00
189.000	Warrior Met Coal Inc '144A'			570.000	CIT Group Inc 4,750% 16-Feb.-2024	579.026	0,06
	8,000% 01-Nov.-2024	184.422	0,02	880.000	CIT Group Inc 5,000% 15-Aug.-2022	901.441	0,10
1.365.000	Weatherford International Ltd '144A'			840.000	CIT Group Inc 5,000% 01-Aug.-2023	858.904	0,10
	11,000% 01-Dez.-2024	955.500	0,11	277.000	CIT Group Inc 5,250% 07-März-2025	287.705	0,03
1.175.000	Western Midstream Operating LP			155.000	CIT Group Inc 6,125% 09-März-2028	167.623	0,02
	3,100% 01-Feb.-2025	1.117.496	0,12	98.000	CNG Holdings Inc '144A' 12,500% 15-Jun.-2024	86.536	0,01
368.000	Western Midstream Operating LP			665.000	Commerzbank AG '144A' 8,125% 19-Sept.-2023	750.192	0,08
	3,950% 01-Jun.-2025	346.553	0,04	445.000	Compass Group Diversified Holdings LLC '144A'		
750.000	Western Midstream Operating LP				8,000% 01-Mai-2026	454.118	0,05
	4,000% 01-Jul.-2022	751.350	0,08	254.000	CoreCivic Inc 4,625% 01-Mai-2023	244.634	0,03
1.700.000	Western Midstream Operating LP			5.000	CoreCivic Inc 4,750% 15-Okt.-2027	4.166	0,00
	4,050% 01-Feb.-2030	1.642.838	0,18	106.000	CoreCivic Inc 5,000% 15-Okt.-2022	104.253	0,01
600.000	Western Midstream Operating LP			495.000	Credit Acceptance Corp 6,625% 15-März-2026	499.170	0,06
	4,500% 01-März-2028	564.000	0,06	100.000	Credit Acceptance Corp '144A'		
1.017.000	Western Midstream Operating LP				5,125% 31-Dez.-2024	96.820	0,01
	4,650% 01-Jul.-2026	979.168	0,11	220.000	CTR Partnership LP / CareTrust Capital Corp		
300.000	Western Midstream Operating LP				5,250% 01-Jun.-2025	223.002	0,02
	4,750% 15-Aug.-2028	288.750	0,03	630.000	Curo Group Holdings Corp '144A'		
761.000	Western Midstream Operating LP				8,250% 01-Sept.-2025	505.773	0,06
	5,250% 01-Feb.-2050	662.256	0,07	515.000	Cushman & Wakefield US Borrower LLC '144A'		
520.000	Western Midstream Operating LP				6,750% 15-Mai-2028	539.141	0,06
	5,300% 01-März-2048	424.450	0,05	1.110.000	Deutsche Bank AG 4,500% 01-Apr.-2025	1.089.465	0,12
470.000	Western Midstream Operating LP			710.000	Deutsche Bank AG FRN 4,296% 24-Mai-2028	649.411	0,07
	5,375% 01-Jun.-2021	471.175	0,05	740.000	Deutsche Bank AG/New York NY FRN		
644.000	Western Midstream Operating LP				4,875% 01-Dez.-2032	688.056	0,08
	5,450% 01-Apr.-2044	539.543	0,06	616.000	Diversified Healthcare Trust 4,750% 15-Feb.-2028	511.644	0,06
630.000	Western Midstream Operating LP			230.000	Diversified Healthcare Trust 6,750% 15-Dez.-2021	232.645	0,03
	5,500% 15-Aug.-2048	513.450	0,06	745.000	Dresdner Funding Trust I '144A' 8,151% 30-Jun.-2031	1.026.738	0,11
615.000	WPX Energy Inc 4,500% 15-Jan.-2030	542.396	0,06	75.000	Enova International Inc '144A' 8,500% 01-Sept.-2024	67.211	0,01
260.000	WPX Energy Inc 5,250% 15-Sept.-2024	256.910	0,03	50.000	Enova International Inc '144A' 8,500% 15-Sept.-2025	45.281	0,01
215.000	WPX Energy Inc 5,250% 15-Okt.-2027	201.214	0,02	825.000	ESH Hospitality Inc '144A' 4,625% 01-Okt.-2027	773.801	0,09
330.000	WPX Energy Inc 5,750% 01-Jun.-2026	321.059	0,04	1.678.000	ESH Hospitality Inc '144A' 5,250% 01-Mai-2025	1.613.355	0,18
370.000	WPX Energy Inc 5,875% 15-Jun.-2028	356.476	0,04	202.000	Fairstone Financial Inc '144A' 7,875% 15-Jul.-2024	198.570	0,02
366.000	WPX Energy Inc 8,250% 01-Aug.-2023	407.594	0,05	450.000	FelCor Lodging LP 6,000% 01-Jun.-2025	438.140	0,05
				285.000	Fidelity & Guaranty Life Holdings Inc '144A'		
					5,500% 01-Mai-2025	308.688	0,03

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener	Summe			Angemessener	Summe
		Wert	der Netto-			Wert	der Netto-
Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %	Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
Finanzwerte Forts.				Finanzwerte Forts.			
326.000	Five Point Operating Co LP / Five Point Capital Corp '144A' 7,875 % 15-Nov.-2025	309.085	0,03	195.000	Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp '144A' 5,875 % 01-Aug.-2021	193.757	0,02
510.000	Freedom Mortgage Corp '144A' 8,125 % 15-Nov.-2024	496.559	0,06	445.000	Liberty Mutual Group Inc '144A' 7,800 % 15-März-2037	534.190	0,06
574.000	Freedom Mortgage Corp '144A' 8,250 % 15-Apr.-2025	570.048	0,06	155.000	LPL Holdings Inc '144A' 4,625 % 15-Nov.-2027	153.547	0,02
128.000	Freedom Mortgage Corp '144A' 10,750 % 01-Apr.-2024	132.360	0,01	690.000	LPL Holdings Inc '144A' 5,750 % 15-Sept.-2025	700.774	0,08
465.000	FS Energy and Power Fund '144A' 7,500 % 15-Aug.-2023	397.624	0,04	370.000	Mack-Cali Realty LP 3,150 % 15-Mai-2023	322.977	0,04
283.000	Genworth Holdings Inc 4,800 % 15-Feb.-2024	226.577	0,03	25.000	Mack-Cali Realty LP 4,500 % 18-Apr.-2022	23.198	0,00
280.000	Genworth Holdings Inc 4,900 % 15-Aug.-2023	224.875	0,03	120.000	MBIA Inc 5,700 % 01-Dez.-2034	78.878	0,01
10.000	Genworth Holdings Inc 6,500 % 15-Jun.-2034	7.900	0,00	366.000	MGIC Investment Corp 5,750 % 15-Aug.-2023	379.229	0,04
515.000	Genworth Holdings Inc 7,625 % 24-Sept.-2021	483.670	0,05	328.000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc 4,500 % 01-Sept.-2026	325.771	0,04
250.000	GEO Group Inc/The 5,125 % 01-Apr.-2023	217.031	0,02	557.000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc 4,500 % 15-Jan.-2028	531.133	0,06
290.000	GEO Group Inc/The 5,875 % 15-Jan.-2022	272.169	0,03	865.000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc 5,625 % 01-Mai-2024	897.546	0,10
253.000	GEO Group Inc/The 5,875 % 15-Okt.-2024	199.704	0,02	920.000	MGM Growth Properties Operating Partnership LP / MGP Finance Co-Issuer Inc 5,750 % 01-Feb.-2027	944.440	0,11
85.000	GEO Group Inc/The 6,000 % 15-Apr.-2026	65.607	0,01	669.000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 4,625 % 01-Aug.-2029	673.496	0,08
795.000	Global Aircraft Leasing Co Ltd '144A' 6,500 % 15-Sept.-2024	534.637	0,06	438.000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 5,000 % 15-Okt.-2027	451.427	0,05
215.000	goeasy Ltd '144A' 5,375 % 01-Dez.-2024	208.976	0,02	905.000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 5,250 % 01-Aug.-2026	941.567	0,10
640.000	Greystar Real Estate Partners LLC '144A' 5,750 % 01-Dez.-2025	646.528	0,07	370.000	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp 6,375 % 01-März-2024	381.679	0,04
405.000	GTCR AP Finance Inc '144A' 8,000 % 15-Mai-2027	418.337	0,05	10.000	Nationstar Mortgage Holdings Inc '144A' 6,000 % 15-Jan.-2027	9.517	0,00
370.000	HAT Holdings I LLC / HAT Holdings II LLC '144A' 5,250 % 15-Jul.-2024	378.133	0,04	705.000	Nationstar Mortgage Holdings Inc '144A' 8,125 % 15-Jul.-2023	725.308	0,08
65.000	HAT Holdings I LLC / HAT Holdings II LLC '144A' 6,000 % 15-Apr.-2025	68.209	0,01	735.000	Nationstar Mortgage Holdings Inc '144A' 9,125 % 15-Jul.-2026	777.950	0,09
955.000	Howard Hughes Corp/The '144A' 5,375 % 15-März-2025	891.698	0,10	550.000	Navient Corp 5,000 % 15-März-2027	463.207	0,05
1.850.000	HUB International Ltd '144A' 7,000 % 01-Mai-2026	1.847.974	0,21	314.000	Navient Corp 5,500 % 25-Jan.-2023	302.029	0,03
664.000	Hunt Cos Inc '144A' 6,250 % 15-Feb.-2026	606.169	0,07	250.000	Navient Corp 5,875 % 25-Okt.-2024	235.624	0,03
915.000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 4,750 % 15-Sept.-2024	861.715	0,10	630.000	Navient Corp 6,500 % 15-Jun.-2022	620.944	0,07
1.050.000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 5,250 % 15-Mai-2027	1.016.531	0,11	161.000	Navient Corp 6,625 % 26-Jul.-2021	158.232	0,02
925.000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 6,250 % 15-Mai-2026	927.812	0,10	335.000	Navient Corp 6,750 % 25-Jun.-2025	320.553	0,04
555.000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp 6,375 % 15-Dez.-2025	550.896	0,06	370.000	Navient Corp 6,750 % 15-Jun.-2026	343.107	0,04
1.940.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' 5,017 % 26-Jun.-2024	1.988.915	0,22	907.000	Navient Corp 7,250 % 25-Sept.-2023	889.318	0,10
845.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' 5,710 % 15-Jan.-2026	891.057	0,10	250.000	Navient Corp 'MTN' 5,625 % 01-Aug.-2033	193.226	0,02
972.000	Iron Mountain Inc 5,750 % 15-Aug.-2024	984.359	0,11	62.000	Navient Corp 'MTN' 6,125 % 25-März-2024	59.093	0,01
719.000	Iron Mountain Inc '144A' 4,875 % 15-Sept.-2027	702.531	0,08	397.000	Navient Corp 'MTN' 7,250 % 25-Jan.-2022	398.876	0,04
435.000	Iron Mountain Inc '144A' 4,875 % 15-Sept.-2029	423.473	0,05	645.000	Newmark Group Inc 6,125 % 15-Nov.-2023	641.998	0,07
815.000	Iron Mountain Inc '144A' 5,250 % 15-März-2028	812.812	0,09	712.000	NFP Corp '144A' 6,875 % 15-Jul.-2025	704.577	0,08
460.000	Iron Mountain US Holdings Inc '144A' 5,375 % 01-Jun.-2026	463.938	0,05	265.000	NFP Corp '144A' 8,000 % 15-Jul.-2025	259.838	0,03
405.000	iStar Inc 4,250 % 01-Aug.-2025	367.537	0,04	13.000	Ocwen Loan Servicing LLC '144A' 8,375 % 15-Nov.-2022	9.796	0,00
409.000	iStar Inc 4,750 % 01-Okt.-2024	382.714	0,04	442.000	Oxford Finance LLC / Oxford Finance Co-Issuer II Inc '144A' 6,375 % 15-Dez.-2022	408.194	0,05
501.000	iStar Inc 5,250 % 15-Sept.-2022	487.731	0,05	115.000	Park Intermediate Holdings LLC / PK Domestic Property LLC / PK Finance Co-Issuer '144A' 7,500 % 01-Jun.-2025	118.091	0,01
175.000	Jefferies Finance LLC / JFIN Co-Issuer Corp '144A' 6,250 % 03-Jun.-2026	164.937	0,02	317.000	Provident Funding Associates LP / PFG Finance Corp '144A' 6,375 % 15-Jun.-2025	297.550	0,03
652.000	Jefferies Finance LLC / JFIN Co-Issuer Corp '144A' 7,250 % 15-Aug.-2024	576.137	0,06	975.000	Quicken Loans LLC '144A' 5,250 % 15-Jan.-2028	1.008.915	0,11
855.000	Kennedy-Wilson Inc 5,875 % 01-Apr.-2024	853.388	0,10	1.170.000	Quicken Loans LLC '144A' 5,750 % 01-Mai-2025	1.199.127	0,13
208.000	Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp '144A' 4,250 % 01-Feb.-2027	166.920	0,02	541.000	Radian Group Inc 4,500 % 01-Okt.-2024	524.037	0,06
570.000	Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp '144A' 5,250 % 15-März-2022	543.276	0,06	430.000	Radian Group Inc 4,875 % 15-März-2027	405.462	0,05
530.000	Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp '144A' 5,250 % 01-Okt.-2025	458.898	0,05	1.000.000	Radian Group Inc 6,625 % 15-März-2025	1.026.875	0,11

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener		Summe	Bestände	Beschreibung	Angemessener		Summe
		Wert	der Netto-				Wert	der Netto-	
		in USD	vermögen %				in USD	vermögen %	
Anleihen Forts.					Anleihen Forts.				
Finanzwerte Forts.					Finanzwerte Forts.				
300.000	Realogy Group LLC / Realogy Co-Issuer Corp '144A' 4,875 % 01-Jun.-2023	281.437	0,03		670.000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc '144A' 3,500 % 15-Feb.-2025	631.371	0,07	
510.000	Realogy Group LLC / Realogy Co-Issuer Corp '144A' 5,250 % 01-Dez.-2021	517.140	0,06		590.000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc '144A' 3,750 % 15-Feb.-2027	555.615	0,06	
375.000	Realogy Group LLC / Realogy Co-Issuer Corp '144A' 9,375 % 01-Apr.-2027	350.912	0,04		547.000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc '144A' 4,125 % 15-Aug.-2030	522.557	0,06	
129.000	RHP Hotel Properties LP / RHP Finance Corp 5,000 % 15-Apr.-2023	120.763	0,01		1.140.000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc '144A' 4,250 % 01-Dez.-2026	1.093.345	0,12	
610.000	Royal Bank of Scotland Group Plc FRN (Immerwährend) 7,648 % 30-Sept.-2031	883.719	0,10		690.000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc '144A' 4,625 % 01-Dez.-2029	673.916	0,08	
650.000	Ryman Hospitality Properties Inc '144A' 4,750 % 15-Okt.-2027	579.598	0,06		648.000	Voyager Aviation Holdings LLC / Voyager Finance Co '144A' 8,500 % 15-Aug.-2021	475.389	0,05	
420.000	SBA Communications Corp 4,000 % 01-Okt.-2022	425.151	0,05		1.056.000	Washington Prime Group LP 6,450 % 15-Aug.-2024	598.440	0,07	
815.000	SBA Communications Corp 4,875 % 01-Sept.-2024	835.375	0,09		670.000	WeWork Cos Inc '144A' 7,875 % 01-Mai-2025	327.037	0,04	
1.605.000	SBA Communications Corp '144A' 3,875 % 15-Feb.-2027	1.602.520	0,18						
470.000	Service Properties Trust 3,950 % 15-Jan.-2028	379.059	0,04			Industriewerte - 90.766.427			
1.010.000	Service Properties Trust 4,350 % 01-Okt.-2024	910.832	0,10			(31. Dezember 2019: 72.493.909)	90.766.427	10,12	
475.000	Service Properties Trust 4,375 % 15-Feb.-2030	382.128	0,04		72.000	Advanced Drainage Systems Inc '144A' 5,000 % 30-Sept.-2027	72.796	0,01	
785.000	Service Properties Trust 4,500 % 15-Jun.-2023	751.889	0,08		930.000	AECOM 5,125 % 15-März-2027	1.003.061	0,11	
410.000	Service Properties Trust 4,500 % 15-März-2025	369.648	0,04		459.000	AECOM 5,875 % 15-Okt.-2024	496.916	0,06	
485.000	Service Properties Trust 4,650 % 15-März-2024	438.589	0,05		231.000	AECOM Global II LLC / URS Fox US LP 5,000 % 01-Apr.-2022	236.197	0,03	
560.000	Service Properties Trust 4,750 % 01-Okt.-2026	495.826	0,06		370.000	AerCap Global Aviation Trust '144A' FRN 6,500 % 15-Jun.-2045	278.703	0,03	
525.000	Service Properties Trust 4,950 % 15-Feb.-2027	461.124	0,05		745.000	Altera Infrastructure LP/Teekay Offshore Finance Corp '144A' 8,500 % 15-Jul.-2023	657.541	0,07	
490.000	Service Properties Trust 4,950 % 01-Okt.-2029	415.877	0,05		213.000	American Woodmark Corp '144A' 4,875 % 15-März-2026	208.966	0,02	
605.000	Service Properties Trust 5,000 % 15-Aug.-2022	594.359	0,07		70.000	Amsted Industries Inc '144A' 4,625 % 15-Mai-2030	69.396	0,01	
468.000	Service Properties Trust 5,250 % 15-Feb.-2026	423.698	0,05		82.000	Amsted Industries Inc '144A' 5,625 % 01-Jul.-2027	84.854	0,01	
200.000	SLM Corp 5,125 % 05-Apr.-2022	198.625	0,02		12.000	Apex Tool Group LLC / BC Mountain Finance Inc '144A' 9,000 % 15-Feb.-2023	8.714	0,00	
555.000	Springleaf Finance Corp 5,375 % 15-Nov.-2029	522.366	0,06		465.000	ARD Finance SA '144A' 6,500 % 30-Jun.-2027	460.845	0,05	
610.000	Springleaf Finance Corp 5,625 % 15-März-2023	618.781	0,07		1.619.000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 4,125 % 15-Aug.-2026	1.595.638	0,18	
440.000	Springleaf Finance Corp 6,125 % 15-Mai-2022	449.462	0,05		610.000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 5,250 % 30-Apr.-2025	626.388	0,07	
1.160.000	Springleaf Finance Corp 6,125 % 15-März-2024	1.181.234	0,13		600.000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 5,250 % 15-Aug.-2027	590.442	0,07	
700.000	Springleaf Finance Corp 6,625 % 15-Jan.-2028	694.183	0,08		115.000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 5,250 % 15-Aug.-2027	113.168	0,01	
1.120.000	Springleaf Finance Corp 6,875 % 15-März-2025	1.151.643	0,13		519.000	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A' 6,000 % 15-Feb.-2025	532.712	0,06	
1.372.000	Springleaf Finance Corp 7,125 % 15-März-2026	1.421.728	0,16		100.000	Associated Materials LLC / AMH New Finance Inc '144A' 9,000 % 01-Jan.-2024	86.099	0,01	
105.000	Springleaf Finance Corp 7,750 % 01-Okt.-2021	109.486	0,01		66.000	ATS Automation Tooling Systems Inc '144A' 6,500 % 15-Jun.-2023	66.488	0,01	
275.000	Springleaf Finance Corp 8,250 % 01-Okt.-2023	295.252	0,03		740.000	Ball Corp 4,000 % 15-Nov.-2023	770.055	0,09	
445.000	Springleaf Finance Corp 8,875 % 01-Jun.-2025	476.562	0,05		795.000	Ball Corp 4,875 % 15-März-2026	865.890	0,10	
600.000	Standard Chartered Plc '144A' FRN (Immerwährend) 7,014 % 30-Jul.-2037	669.819	0,07		430.000	Ball Corp 5,000 % 15-März-2022	447.748	0,05	
406.000	Starwood Property Trust Inc 4,750 % 15-März-2025	370.940	0,04		600.000	Ball Corp 5,250 % 01-Jul.-2025	657.813	0,07	
520.000	Starwood Property Trust Inc 5,000 % 15-Dez.-2021	505.864	0,06		720.000	Berry Global Inc 5,125 % 15-Jul.-2023	726.743	0,08	
2.078	Stearns Holdings LLC / Stearns Co-Issuer Inc '144A' 5,000 % 05-Nov.-2024	11.180	0,00		664.000	Berry Global Inc 6,000 % 15-Okt.-2022	666.905	0,07	
79.000	Stearns Holdings, Inc 9,375 % 15-Aug.-2020	–	–		575.000	Berry Global Inc '144A' 4,500 % 15-Feb.-2026	567.804	0,06	
325.000	Synovus Financial Corp FRN 5,900 % 07-Feb.-2029	318.713	0,04		275.000	Berry Global Inc '144A' 4,875 % 15-Jul.-2026	279.412	0,03	
291.000	TMX Finance LLC / TitleMax Finance Corp '144A' 11,125 % 01-Apr.-2023	244.046	0,03		213.000	Berry Global Inc '144A' 5,625 % 15-Jul.-2027	218.997	0,02	
570.000	UniCredit SpA '144A' FRN 5,861 % 19-Jun.-2032	599.722	0,07		460.000	BMC East LLC '144A' 5,500 % 01-Okt.-2024	465.127	0,05	
864.000	UniCredit SpA '144A' FRN 7,296 % 02-Apr.-2034	982.217	0,11		90.000	Boise Cascade Co '144A' 5,625 % 01-Sept.-2024	91.003	0,01	
340.000	Uniti Group LP / Uniti Fiber Holdings Inc / CSL Capital LLC '144A' 7,125 % 15-Dez.-2024	312.159	0,03		350.000	Bombardier Inc '144A' 5,750 % 15-März-2022	259.096	0,03	
375.000	Uniti Group LP / Uniti Fiber Holdings Inc / CSL Capital LLC '144A' 7,875 % 15-Feb.-2025	381.238	0,04		771.000	Bombardier Inc '144A' 6,000 % 15-Okt.-2022	545.444	0,06	
300.000	Uniti Group LP / Uniti Group Finance Inc / CSL Capital LLC 8,250 % 15-Okt.-2023	284.437	0,03						
840.000	Uniti Group LP / Uniti Group Finance Inc / CSL Capital LLC '144A' 6,000 % 15-Apr.-2023	821.625	0,09						
455.000	USI Inc/NY '144A' 6,875 % 01-Mai-2025	460.399	0,05						

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener		Summe		Bestände	Beschreibung	Angemessener		Summe	
		Wert	der Netto-					Wert	der Netto-		
		in USD	vermögen %					in USD	vermögen %		
Anleihen Forts.						Anleihen Forts.					
	Industriewerte Forts.						Industriewerte Forts.				
754.000	Bombardier Inc '144A' 6,125 % 15-Jan.-2023	519.355	0,06			94.000	Graphic Packaging International LLC				
100.000	Bombardier Inc '144A' 7,450 % 01-Mai-2034	61.403	0,01				4,125 % 15-Aug.-2024	97.398	0,01		
740.000	Bombardier Inc '144A' 7,500 % 01-Dez.-2024	486.628	0,05			185.000	Graphic Packaging International LLC				
575.000	Bombardier Inc '144A' 7,500 % 15-März-2025	377.042	0,04				4,875 % 15-Nov.-2022	191.663	0,02		
1.446.000	Bombardier Inc '144A' 7,875 % 15-Apr.-2027	949.567	0,11			100.000	Graphic Packaging International LLC '144A'				
800.000	Bombardier Inc '144A' 8,750 % 01-Dez.-2021	653.828	0,07				3,500 % 15-März-2028	99.470	0,01		
960.000	Brand Industrial Services Inc '144A'					240.000	Great Lakes Dredge & Dock Corp 8,000 % 15-Mai-2022	246.844	0,03		
	8,500 % 15-Jul.-2025	866.990	0,10			520.000	Greif Inc '144A' 6,500 % 01-März-2027	530.496	0,06		
405.000	Builders FirstSource Inc '144A' 5,000 % 01-März-2030	381.650	0,04			250.000	Griffon Corp 5,750 % 01-März-2028	247.500	0,03		
773.000	Builders FirstSource Inc '144A' 6,750 % 01-Jun.-2027	793.628	0,09			988.000	Grinding Media Inc / Moly-Cop AltaSteel Ltd '144A'				
580.000	BWX Technologies Inc '144A' 4,125 % 30-Jun.-2028	580.725	0,06				7,375 % 15-Dez.-2023	986.138	0,11		
350.000	BWX Technologies Inc '144A' 5,375 % 15-Jul.-2026	361.879	0,04			450.000	Harsco Corp '144A' 5,750 % 31-Jul.-2027	452.263	0,05		
135.000	Cargo Aircraft Management Inc '144A'					1.253.000	Hillenbrand Inc 4,500 % 15-Sept.-2026	1.259.653	0,14		
	4,750 % 01-Feb.-2028	134.156	0,02			244.000	Hillman Group Inc/The '144A' 6,375 % 15-Jul.-2022	226.062	0,03		
150.000	Cascades Inc/Cascades USA Inc '144A'					295.000	Husky III Holding Ltd '144A' 13,000 % 15-Feb.-2025	284.859	0,03		
	5,125 % 15-Jan.-2026	152.719	0,02			437.000	Ingram Micro Inc 5,000 % 10-Aug.-2022	437.219	0,05		
45.000	Clean Harbors Inc '144A' 4,875 % 15-Jul.-2027	46.314	0,01			485.000	Ingram Micro Inc 5,450 % 15-Dez.-2024	489.437	0,05		
120.000	Clean Harbors Inc '144A' 5,125 % 15-Jul.-2029	124.811	0,01			268.000	Itron Inc '144A' 5,000 % 15-Jan.-2026	267.949	0,03		
351.000	Cleaver-Brooks Inc '144A' 7,875 % 01-März-2023	298.752	0,03			100.000	James Hardie International Finance DAC '144A'				
300.000	Colfax Corp '144A' 6,000 % 15-Feb.-2024	310.156	0,03				4,750 % 15-Jan.-2025	102.115	0,01		
460.000	Colfax Corp '144A' 6,375 % 15-Feb.-2026	481.420	0,05			85.000	JELD-WEN Inc '144A' 4,625 % 15-Dez.-2025	81.910	0,01		
455.000	Cornerstone Building Brands Inc '144A'					292.000	JELD-WEN Inc '144A' 4,875 % 15-Dez.-2027	281.360	0,03		
	8,000 % 15-Apr.-2026	459.848	0,05			511.000	Kenan Advantage Group Inc/The '144A'				
33.000	Covanta Holding Corp 5,875 % 01-März-2024	33.409	0,00				7,875 % 31-Jul.-2023	451.543	0,05		
200.000	Covanta Holding Corp 5,875 % 01-Jul.-2025	203.229	0,02			669.000	Koppers Inc '144A' 6,000 % 15-Feb.-2025	652.683	0,07		
179.000	Covanta Holding Corp 6,000 % 01-Jan.-2027	181.893	0,02			220.000	Kratos Defense & Security Solutions Inc '144A'				
918.000	Crown Americas LLC / Crown Americas Capital						6,500 % 30-Nov.-2025	229.052	0,03		
	Corp IV 4,500 % 15-Jan.-2023	943.810	0,11			140.000	LABL Escrow Issuer LLC '144A' 6,750 % 15-Jul.-2026	145.972	0,02		
492.000	Crown Americas LLC / Crown Americas Capital					490.000	LABL Escrow Issuer LLC '144A' 10,500 % 15-Jul.-2027	521.742	0,06		
	Corp V 4,250 % 30-Sept.-2026	504.822	0,06			275.000	Leonardo US Holdings Inc '144A' 6,250 % 15-Jan.-2040	306.519	0,03		
846.000	Crown Americas LLC / Crown Americas Capital					249.000	Louisiana-Pacific Corp 4,875 % 15-Sept.-2024	251.827	0,03		
	Corp VI 4,750 % 01-Feb.-2026	865.111	0,10			530.000	LSB Industries Inc '144A' 9,625 % 01-Mai-2023	512.168	0,06		
260.000	Crown Cork & Seal Co Inc 7,375 % 15-Dez.-2026	305.126	0,03			230.000	Manitowoc Co Inc/The '144A' 9,000 % 01-Apr.-2026	228.382	0,03		
685.000	Energizer Holdings Inc '144A' 5,500 % 15-Jun.-2025	708.225	0,08			78.000	Masonite International Corp '144A'				
494.000	Energizer Holdings Inc '144A' 6,375 % 15-Jul.-2026	512.016	0,06				5,375 % 01-Feb.-2028	79.887	0,01		
300.000	Energizer Holdings Inc '144A' 7,750 % 15-Jan.-2027	320.576	0,04			313.000	Masonite International Corp '144A'				
405.000	EnerSys '144A' 5,000 % 30-Apr.-2023	416.601	0,05				5,750 % 15-Sept.-2026	323.504	0,04		
345.000	EnPro Industries Inc 5,750 % 15-Okt.-2026	346.228	0,04			314.000	MasTec Inc 4,875 % 15-März-2023	312.790	0,03		
345.000	F-Brasile SpA / F-Brasile US LLC '144A'					244.000	Matthews International Corp '144A'				
	7,375 % 15-Aug.-2026	266.409	0,03				5,250 % 01-Dez.-2025	220.489	0,02		
670.000	Flex Acquisition Co Inc '144A' 6,875 % 15-Jan.-2025	648.637	0,07			935.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co '144A'				
576.000	Flex Acquisition Co Inc '144A' 7,875 % 15-Jul.-2026	560.393	0,06				5,500 % 15-Apr.-2024	920.379	0,10		
730.000	Fluor Corp 3,500 % 15-Dez.-2024	619.405	0,07			1.228.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co '144A'				
795.000	Fluor Corp 4,250 % 15-Sept.-2028	684.694	0,08				7,250 % 15-Apr.-2025	1.117.161	0,12		
375.000	Fly Leasing Ltd 5,250 % 15-Okt.-2024	305.117	0,03			601.000	Maxim Crane Works Holdings Capital LLC '144A'				
555.000	Fortress Transportation and Infrastructure						10,125 % 01-Aug.-2024	592.619	0,07		
	Investors LLC '144A' 6,500 % 01-Okt.-2025	501.640	0,06			285.000	Moog Inc '144A' 4,250 % 15-Dez.-2027	277.163	0,03		
740.000	Fortress Transportation and Infrastructure					217.000	Mueller Water Products Inc '144A'				
	Investors LLC '144A' 6,750 % 15-März-2022	712.387	0,08				5,500 % 15-Jun.-2026	225.368	0,03		
330.000	frontdoor Inc '144A' 6,750 % 15-Aug.-2026	351.800	0,04			560.000	New Enterprise Stone & Lime Co Inc '144A'				
377.000	FXI Holdings Inc '144A' 7,875 % 01-Nov.-2024	325.394	0,04				6,250 % 15-März-2026	564.794	0,06		
172.000	FXI Holdings Inc '144A' 12,250 % 15-Nov.-2026	167.350	0,02			105.000	New Enterprise Stone & Lime Co Inc '144A'				
420.000	Gates Global LLC / Gates Corp '144A'						10,125 % 01-Apr.-2022	104.844	0,01		
	6,250 % 15-Jan.-2026	413.351	0,05			275.000	Norbord Inc '144A' 5,750 % 15-Jul.-2027	281.479	0,03		
225.000	GFL Environmental Inc '144A' 4,250 % 01-Jun.-2025	227.391	0,03			426.000	Norbord Inc '144A' 6,250 % 15-Apr.-2023	448.942	0,05		
215.000	GFL Environmental Inc '144A' 5,125 % 15-Dez.-2026	223.063	0,02			85.000	Northwest Hardwoods Inc '144A'				
529.000	GFL Environmental Inc '144A' 7,000 % 01-Jun.-2026	549.398	0,06				7,500 % 01-Aug.-2021	31.025	0,00		
297.000	GFL Environmental Inc '144A' 8,500 % 01-Mai-2027	323.675	0,04			207.000	OI European Group BV '144A' 4,000 % 15-März-2023	204.635	0,02		
20.000	Global Ship Lease Inc '144A' 9,875 % 15-Nov.-2022	18.833	0,00			25.000	Owens-Brockway Glass Container Inc '144A'				
223.000	Granite US Holdings Corp '144A' 11,000 % 01-Okt.-2027	217.522	0,02				5,375 % 15-Jan.-2025	25.341	0,00		

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener	Summe			Angemessener	Summe
		Wert	der Netto-			Wert	der Netto-
Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %	Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
Industriewerte Forts.				Industriewerte Forts.			
520.000	Owens-Brockway Glass Container Inc '144A' 5,875 % 15-Aug.-2023	536.955	0,06	351.000	Tennant Co 5,625 % 01-Mai-2025	355.789	0,04
100.000	Owens-Brockway Glass Container Inc '144A' 6,375 % 15-Aug.-2025	106.062	0,01	1.036.000	Terex Corp '144A' 5,625 % 01-Feb.-2025	947.940	0,11
100.000	Owens-Brockway Glass Container Inc '144A' 6,625 % 13-Mai-2027	104.187	0,01	270.000	Tervita Corp '144A' 7,625 % 01-Dez.-2021	212.710	0,02
395.000	Pactiv LLC 7,950 % 15-Dez.-2025	422.115	0,05	1.120.000	Titan Acquisition Ltd / Titan Co-Borrower LLC '144A' 7,750 % 15-Apr.-2026	1.063.054	0,12
370.000	Pactiv LLC 8,375 % 15-Apr.-2027	402.767	0,04	495.000	TopBuild Corp '144A' 5,625 % 01-Mai-2026	501.712	0,06
288.000	Park-Ohio Industries Inc 6,625 % 15-Apr.-2027	237.185	0,03	2.160.000	TransDigm Inc 5,500 % 15-Nov.-2027	1.891.026	0,21
180.000	Patrick Industries Inc '144A' 7,500 % 15-Okt.-2027	185.928	0,02	1.258.000	TransDigm Inc 6,375 % 15-Jun.-2026	1.150.114	0,13
300.000	PGT Innovations Inc '144A' 6,750 % 01-Aug.-2026	304.068	0,03	888.000	TransDigm Inc 6,500 % 15-Jul.-2024	850.167	0,09
1.020.000	Plastipak Holdings Inc '144A' 6,250 % 15-Okt.-2025	992.587	0,11	780.000	TransDigm Inc 6,500 % 15-Mai-2025	731.402	0,08
115.000	PowerTeam Services LLC '144A' 9,033 % 04-Dez.-2025	117.803	0,01	975.000	TransDigm Inc 7,500 % 15-März-2027	937.160	0,10
600.000	RBS Global Inc / Rexnord LLC '144A' 4,875 % 15-Dez.-2025	604.869	0,07	3.463.000	TransDigm Inc '144A' 6,250 % 15-März-2026	3.460.385	0,39
1.698.000	Reynolds Group Issuer Inc / Reynolds Group Issuer LLC / Reynolds Group Issuer Lu '144A' 5,125 % 15-Jul.-2023	1.713.307	0,19	341.000	TransDigm Inc '144A' 8,000 % 15-Dez.-2025	359.879	0,04
630.000	Reynolds Group Issuer Inc / Reynolds Group Issuer LLC / Reynolds Group Issuer Lu '144A' 7,000 % 15-Jul.-2024	633.248	0,07	850.000	TransDigm UK Holdings Plc 6,875 % 15-Mai-2026	793.526	0,09
510.000	Sealed Air Corp '144A' 4,875 % 01-Dez.-2022	525.818	0,06	70.000	Trident TPI Holdings Inc '144A' 6,625 % 01-Nov.-2025	66.755	0,01
440.000	Sealed Air Corp '144A' 5,125 % 01-Dez.-2024	471.075	0,05	195.000	Trident TPI Holdings Inc '144A' 9,250 % 01-Aug.-2024	200.464	0,02
354.000	Sealed Air Corp '144A' 5,250 % 01-Apr.-2023	371.383	0,04	76.000	TriMas Corp '144A' 4,875 % 15-Okt.-2025	76.345	0,01
410.000	Sealed Air Corp '144A' 5,500 % 15-Sept.-2025	442.244	0,05	499.000	Trinity Industries Inc 4,550 % 01-Okt.-2024	501.037	0,06
500.000	Sealed Air Corp '144A' 6,875 % 15-Jul.-2033	593.030	0,07	200.000	Triumph Group Inc 5,250 % 01-Jun.-2022	171.703	0,02
718.000	Sensata Technologies BV '144A' 4,875 % 15-Okt.-2023	747.535	0,08	630.000	Triumph Group Inc 7,750 % 15-Aug.-2025	476.437	0,05
215.000	Sensata Technologies BV '144A' 5,000 % 01-Okt.-2025	229.471	0,03	292.000	Triumph Group Inc '144A' 6,250 % 15-Sept.-2024	248.778	0,03
125.000	Sensata Technologies BV '144A' 5,625 % 01-Nov.-2024	132.956	0,01	680.000	Trivium Packaging Finance BV '144A' 5,500 % 15-Aug.-2026	689.350	0,08
215.000	Sensata Technologies Inc '144A' 4,375 % 15-Feb.-2030	213.394	0,02	315.000	Trivium Packaging Finance BV '144A' 8,500 % 15-Aug.-2027	337.385	0,04
360.000	Signature Aviation US Holdings Inc '144A' 4,000 % 01-März-2028	325.958	0,04	225.000	TTM Technologies Inc '144A' 5,625 % 01-Okt.-2025	223.993	0,03
291.000	Signature Aviation US Holdings Inc '144A' 5,375 % 01-Mai-2026	292.049	0,03	283.000	Tutor Perini Corp '144A' 6,875 % 01-Mai-2025	270.442	0,03
621.000	Silgan Holdings Inc '144A' 4,125 % 01-Feb.-2028	617.119	0,07	442.000	US Concrete Inc 6,375 % 01-Jun.-2024	437.626	0,05
220.000	Spirit AeroSystems Inc 3,850 % 15-Jun.-2026	201.300	0,02	305.000	Waste Pro USA Inc '144A' 5,500 % 15-Feb.-2026	292.005	0,03
430.000	Spirit AeroSystems Inc 3,950 % 15-Jun.-2023	365.500	0,04	750	Watco Cos LLC / Watco Finance Corp '144A' 6,375 % 01-Apr.-2023	760	0,00
850.000	Spirit AeroSystems Inc 4,600 % 15-Jun.-2028	689.626	0,08	206.000	Weekley Homes LLC / Weekley Finance Corp 6,000 % 01-Feb.-2023	205.206	0,02
100.000	Spirit AeroSystems Inc '144A' 7,500 % 15-Apr.-2025	99.062	0,01	385.000	Weekley Homes LLC / Weekley Finance Corp 6,625 % 15-Aug.-2025	389.291	0,04
231.000	SPX FLOW Inc '144A' 5,625 % 15-Aug.-2024	237.039	0,03	315.000	Welbilt Inc 9,500 % 15-Feb.-2024	302.400	0,03
205.000	SPX FLOW Inc '144A' 5,875 % 15-Aug.-2026	210.342	0,02	20.000	Werner FinCo LP / Werner FinCo Inc '144A' 8,750 % 15-Jul.-2025	17.073	0,00
630.000	SSL Robotics LLC '144A' 9,750 % 31-Dez.-2023	675.675	0,08	401.000	WESCO Distribution Inc 5,375 % 15-Jun.-2024	400.541	0,04
940.000	Standard Industries Inc/NJ '144A' 4,750 % 15-Jan.-2028	955.656	0,11	509.000	XPO CNW Inc 6,700 % 01-Mai-2034	525.148	0,06
540.000	Standard Industries Inc/NJ '144A' 5,000 % 15-Feb.-2027	548.319	0,06	396.000	XPO Logistics Inc '144A' 6,125 % 01-Sept.-2023	401.982	0,04
350.000	Standard Industries Inc/NJ '144A' 5,375 % 15-Nov.-2024	360.715	0,04	1.392.000	XPO Logistics Inc '144A' 6,250 % 01-Mai-2025	1.460.730	0,16
1.350.000	Standard Industries Inc/NJ '144A' 6,000 % 15-Okt.-2025	1.393.720	0,16	250.000	XPO Logistics Inc '144A' 6,500 % 15-Jun.-2022	250.869	0,03
410.000	Stericycle Inc '144A' 5,375 % 15-Jul.-2024	421.275	0,05	930.000	XPO Logistics Inc '144A' 6,750 % 15-Aug.-2024	976.691	0,11
501.000	Stevens Holding Co Inc '144A' 6,125 % 01-Okt.-2026	525.329	0,06	Technologie - 40.090.230 (31. Dezember 2019: 30.789.588)			
250.000	Summit Materials LLC / Summit Materials Finance Corp 6,125 % 15-Jul.-2023	249.279	0,03	270.000	ACI Worldwide Inc '144A' 5,750 % 15-Aug.-2026	282.234	0,03
284.000	Summit Materials LLC / Summit Materials Finance Corp '144A' 5,125 % 01-Jun.-2025	281.485	0,03	250.000	Advanced Micro Devices Inc 7,500 % 15-Aug.-2022	277.129	0,03
195.000	Summit Materials LLC / Summit Materials Finance Corp '144A' 6,500 % 15-März-2027	200.082	0,02	346.000	Amkor Technology Inc '144A' 6,625 % 15-Sept.-2027	371.149	0,04
300.000	Teekav Corp '144A' 9,250 % 15-Nov.-2022	289.054	0,03	875.000	Ascend Learning LLC '144A' 6,875 % 01-Aug.-2025	884.643	0,10
				300.000	Ascend Learning LLC '144A' 6,875 % 01-Aug.-2025	302.594	0,03
				1.145.000	Banff Merger Sub Inc '144A' 9,750 % 01-Sept.-2026	1.154.801	0,13
				259.000	Blackboard Inc '144A' 10,375 % 15-Nov.-2024	253.334	0,03
				358.000	Booz Allen Hamilton Inc '144A' 5,125 % 01-Mai-2025	364.675	0,04
				115.000	Boxer Parent Co Inc '144A' 7,125 % 02-Okt.-2025	120.793	0,01
				215.000	Camelot Finance SA '144A' 4,500 % 01-Nov.-2026	215.503	0,02
				383.000	Castle US Holding Corp '144A' 9,500 % 15-Feb.-2028	355.173	0,04
				535.000	CDK Global Inc 4,875 % 01-Jun.-2027	550.437	0,06
				285.000	CDK Global Inc 5,000 % 15-Okt.-2024	302.986	0,03

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener		Bestände	Beschreibung	Angemessener	
		Wert	Summe			Wert	Summe
		in USD	der Netto-			in USD	der Netto-
			vermögen %				vermögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
Technologie Forts.				Technologie Forts.			
565.000	CDK Global Inc 5,875 % 15-Jun.-2026	588.128	0,07	201.000	RP Crown Parent LLC '144A' 7,375 % 15-Okt.-2024	201.230	0,02
320.000	CDK Global Inc '144A' 5,250 % 15-Mai-2029	332.595	0,04	125.000	Science Applications International Corp '144A'		
510.000	CDW LLC / CDW Finance Corp 4,125 % 01-Mai-2025	512.869	0,06		4,875 % 01-Apr.-2028	124.472	0,01
538.000	CDW LLC / CDW Finance Corp 4,250 % 01-Apr.-2028	549.161	0,06	810.000	Sensata Technologies UK Financing Co Plc '144A'		
245.000	CDW LLC / CDW Finance Corp 5,000 % 01-Sept.-2025	252.682	0,03		6,250 % 15-Feb.-2026	842.250	0,09
550.000	CDW LLC / CDW Finance Corp 5,500 % 01-Dez.-2024	599.442	0,07	2.075.000	Solera LLC / Solera Finance Inc '144A'		
1.015.000	Change Healthcare Holdings LLC / Change				10,500 % 01-März-2024	2.115.535	0,24
	Healthcare Finance Inc '144A' 5,750 % 01-März-2025	1.004.667	0,11	1.605.000	SS&C Technologies Inc '144A' 5,500 % 30-Sept.-2027	1.635.808	0,18
253.000	Dell Inc 5,400 % 10-Sept.-2040	256.364	0,03	905.000	Tempo Acquisition LLC / Tempo Acquisition		
860.000	Dell Inc 6,500 % 15-Apr.-2038	931.058	0,10		Finance Corp '144A' 6,750 % 01-Jun.-2025	919.132	0,10
250.000	Dell International LLC / EMC Corp '144A'			720.000	Vericast Corp '144A' 8,375 % 15-Aug.-2022	611.269	0,07
	5,875 % 15-Jun.-2021	250.466	0,03	385.550	Vericast Corp/Harland Clarke/Checks in the Mail/		
450.000	Dell International LLC / EMC Corp '144A'				Valassis Comm/Valassis Direct '144A'		
	7,125 % 15-Jun.-2024	466.622	0,05		12,500 % 01-Mai-2024	396.153	0,04
310.000	Diebold Nixdorf Inc 8,500 % 15-Apr.-2024	246.805	0,03	290.000	Veritas US Inc / Veritas Bermuda Ltd '144A'		
306.000	Donnelley Financial Solutions Inc				7,500 % 01-Feb.-2023	286.707	0,03
	8,250 % 15-Okt.-2024	302.553	0,03	710.000	Veritas US Inc / Veritas Bermuda Ltd '144A'		
851.000	Dun & Bradstreet Corp/The '144A'				10,500 % 01-Feb.-2024	638.038	0,07
	6,875 % 15-Aug.-2026	899.001	0,10	1.704.000	Western Digital Corp 4,750 % 15-Feb.-2026	1.763.623	0,20
647.000	Dun & Bradstreet Corp/The '144A'			927.000	Xerox Corp 3,800 % 15-Mai-2024	904.886	0,10
	10,250 % 15-Feb.-2027	719.668	0,08	160.000	Xerox Corp 4,070 % 17-März-2022	159.362	0,02
609.000	EMC Corp 3,375 % 01-Jun.-2023	617.901	0,07	1.100.000	Xerox Corp 4,125 % 15-März-2023	1.101.771	0,12
303.000	Entegris Inc '144A' 4,375 % 15-Apr.-2028	309.818	0,03	400.000	Xerox Corp 4,800 % 01-März-2035	374.634	0,04
405.000	Entegris Inc '144A' 4,625 % 10-Feb.-2026	412.011	0,05	175.000	Xerox Corp 6,750 % 15-Dez.-2039	182.139	0,02
108.000	Everi Payments Inc '144A' 7,500 % 15-Dez.-2025	103.804	0,01				
625.000	Exela Intermediate LLC / Exela Finance Inc '144A'						
	10,000 % 15-Jul.-2023	154.687	0,02				
632.000	Fair Isaac Corp '144A' 4,000 % 15-Jun.-2028	635.160	0,07				
180.000	Fair Isaac Corp '144A' 5,250 % 15-Mai-2026	196.841	0,02				
275.000	Genesys Telecommunications Laboratories Inc/						
	Greeneden Lux 3 Sarl/Greeneden US Ho '144A'						
	10,000 % 30-Nov.-2024	286.716	0,03				
170.000	Granite Merger Sub 2 Inc '144A' 11,000 % 15-Jul.-2027	176.726	0,02				
690.000	j2 Cloud Services LLC / j2 Cloud Co-Obligor Inc '144A'						
	6,000 % 15-Jul.-2025	703.872	0,08				
440.000	Marble II Pte Ltd 'REGS' 5,300 % 20-Jun.-2022	435.584	0,05				
85.000	MSCI Inc '144A' 3,625 % 01-Sept.-2030	84.721	0,01				
740.000	MSCI Inc '144A' 4,000 % 15-Nov.-2029	756.051	0,08				
567.000	MSCI Inc '144A' 4,750 % 01-Aug.-2026	588.203	0,07				
466.000	MSCI Inc '144A' 5,375 % 15-Mai-2027	495.896	0,05				
190.000	MTS Systems Corp '144A' 5,750 % 15-Aug.-2027	175.001	0,02				
445.000	NCR Corp 5,000 % 15-Jul.-2022	445.140	0,05				
405.000	NCR Corp 6,375 % 15-Dez.-2023	412.636	0,05				
414.000	NCR Corp '144A' 5,750 % 01-Sept.-2027	414.944	0,05				
300.000	NCR Corp '144A' 6,125 % 01-Sept.-2029	299.757	0,03				
410.000	NCR Corp '144A' 8,125 % 15-Apr.-2025	436.394	0,05				
565.000	Nuance Communications Inc 5,625 % 15-Dez.-2026	589.241	0,07				
825.000	Open Text Corp '144A' 5,875 % 01-Jun.-2026	857.938	0,10				
115.000	Open Text Holdings Inc '144A' 4,125 % 15-Feb.-2030	113.257	0,01				
222.000	Pitney Bowes Inc 4,625 % 15-März-2024	155.978	0,02				
448.000	Pitney Bowes Inc 5,125 % 15-Mai-2022	368.935	0,04				
34.000	Pitney Bowes Inc 5,700 % 01-Apr.-2023	25.284	0,00				
254.000	Presidio Holdings Inc '144A' 4,875 % 01-Feb.-2027	248.722	0,03				
255.000	Presidio Holdings Inc '144A' 8,250 % 01-Feb.-2028	255.797	0,03				
535.000	PTC Inc '144A' 3,625 % 15-Feb.-2025	532.325	0,06				
325.000	PTC Inc '144A' 4,000 % 15-Feb.-2028	322.602	0,04				
735.000	Qorvo Inc 5,500 % 15-Jul.-2026	765.664	0,09				
400.000	Qorvo Inc '144A' 4,375 % 15-Okt.-2029	410.320	0,05				
1.575.000	Rackspace Hosting Inc '144A' 8,625 % 15-Nov.-2024	1.584.450	0,18				
185.000	Riverbed Technology Inc '144A' 8,875 % 01-März-2023	113.313	0,01				
				Versorger - 19.538.586			
				(31. Dezember 2019: 16.329.380)			
				19.538.586			
				2,18			
				365.000	AES Corp/The 5,125 % 01-Sept.-2027	379.532	0,04
				26.000	AES Corp/The 5,500 % 15-Apr.-2025	26.765	0,00
				515.000	AES Corp/The 6,000 % 15-Mai-2026	536.148	0,06
				250.000	AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp		
					5,500 % 20-Mai-2025	258.279	0,03
				694.000	AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp		
					5,625 % 20-Mai-2024	721.975	0,08
				579.000	AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp		
					5,750 % 20-Mai-2027	613.974	0,07
				70.000	AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp		
					5,875 % 20-Aug.-2026	74.012	0,01
				505.000	Calpine Corp 5,500 % 01-Feb.-2024	505.311	0,06
				876.000	Calpine Corp 5,750 % 15-Jan.-2025	887.314	0,10
				339.000	Calpine Corp '144A' 4,500 % 15-Feb.-2028	331.095	0,04
				920.000	Calpine Corp '144A' 5,125 % 15-März-2028	903.555	0,10
				862.000	Calpine Corp '144A' 5,250 % 01-Jun.-2026	872.874	0,10
				258.000	Clearway Energy Operating LLC 5,000 % 15-Sept.-2026	262.143	0,03
				639.000	Clearway Energy Operating LLC 5,750 % 15-Okt.-2025	661.432	0,07
				100.000	Clearway Energy Operating LLC '144A'		
					4,750 % 15-März-2028	102.088	0,01
				274.000	DPL Inc 4,350 % 15-Apr.-2029	277.917	0,03
				97.000	DPL Inc 7,250 % 15-Okt.-2021	103.414	0,01
				470.000	Drax Finco Plc '144A' 6,625 % 01-Nov.-2025	482.974	0,05
				465.000	InterGen NV '144A' 7,000 % 30-Jun.-2023	450.469	0,05
				68.374	Midland Cogeneration Venture LP '144A'		
					6,000 % 15-März-2025	70.503	0,01
				235.000	NextEra Energy Operating Partners LP '144A'		
					3,875 % 15-Okt.-2026	235.210	0,03
				359.000	NextEra Energy Operating Partners LP '144A'		
					4,250 % 15-Jul.-2024	363.750	0,04
				481.000	NextEra Energy Operating Partners LP '144A'		
					4,250 % 15-Sept.-2024	485.120	0,05

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener	Summe
Bestände	Beschreibung	Wert in USD	der Netto- vermögen %
Anleihen Forts.			
Versorger Forts.			
600.000	NextEra Energy Operating Partners LP '144A' 4,500 % 15-Sept.-2027	628.941	0,07
643.000	NRG Energy Inc 5,750 % 15-Jan.-2028	679.854	0,08
1.167.000	NRG Energy Inc 6,625 % 15-Jan.-2027	1.219.807	0,14
697.000	NRG Energy Inc 7,250 % 15-Mai-2026	736.949	0,08
736.000	NRG Energy Inc '144A' 5,250 % 15-Jun.-2029	774.504	0,09
700.000	Rockpoint Gas Storage Canada Ltd '144A' 7,000 % 31-März-2023	644.059	0,07
730.000	Talen Energy Supply LLC 6,500 % 01-Jun.-2025	484.461	0,05
100.000	Talen Energy Supply LLC '144A' 6,625 % 15-Jan.-2028	98.168	0,01
400.000	Talen Energy Supply LLC '144A' 7,250 % 15-Mai-2027	398.676	0,04
781.000	Talen Energy Supply LLC '144A' 10,500 % 15-Jan.-2026	619.259	0,07
275.000	Terraform Global Operating LLC '144A' 6,125 % 01-März-2026	271.854	0,03
255.000	TransAlta Corp 4,500 % 15-Nov.-2022	258.390	0,03
421.000	TransAlta Corp 6,500 % 15-März-2040	420.371	0,05
692.000	Vistra Operations Co LLC '144A' 5,000 % 31-Jul.-2027	700.477	0,08
937.000	Vistra Operations Co LLC '144A' 5,500 % 01-Sept.-2026	958.874	0,11
1.010.000	Vistra Operations Co LLC '144A' 5,625 % 15-Feb.-2027	1.038.088	0,11
Summe der Anlagen in Anleihen		992.008.064	110,62
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 185.862 (siehe unten) (31. Dezember 2019: 4.523.271)		185.862	0,02
Summe der Vermögenswerte zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert		1.003.456.106	111,89
Kreditverzugsswaps - (128.895) (31. Dezember 2019: 1.430.980)			
(19.760.000)	CDS CDX North America High Yield Index Series 34 5,000 % 20-Jun.-2025	(128.895)	(0,01)
Summe der Kreditverzugsswaps		(128.895)	(0,01)
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften - (10.946.757) (siehe unten) (31. Dezember 2019: (15.359))		(10.946.757)	(1,22)
Summe der finanziellen Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert		(11.075.652)	(1,23)
Laufende Nettoverbindlichkeiten		(95.599.105)	(10,66)
Summe der Nettovermögen		896.781.349	100,00
Der Kontrahent für Kreditverzugsswaps ist Goldman Sachs.			
Portfolioanalyse		% des Gesamtvermögens	
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten			
Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			97,45
OTC-Finanzderivate			0,02
Sonstiges Umlaufvermögen			2,53
Summe der Aktiva			100,00

Devisenterminkontrakte							Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent		
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund							
Anteilsklasse CHF W (Inc) (Hedged)							
US-Dollar	Sterling	7.493.467	5.951.089	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	118.788	
						USD 118.788	
						CHF 112.546	
Sterling	US-Dollar	4.246.800	5.273.559	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(10.861)	
Sterling	US-Dollar	2.549.900	3.212.121	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(52.246)	
Sterling	US-Dollar	842.900	1.076.386	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(31.851)	
Sterling	US-Dollar	2.446.000	3.114.109	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(82.989)	
Sterling	US-Dollar	255.946.144	325.309.537	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(8.137.230)	
Sterling	US-Dollar	14.300	17.765	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(45)	
						USD (8.315.222)	
						CHF (7.878.257)	
						Netto USD (8.196.434)	
						Netto CHF (7.765.711)	
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund							
Anteilsklasse EUR E (Acc) (Hedged)							
US-Dollar	Euro	1.089.919	963.687	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	6.889	
						USD 6.889	
						EUR 6.132	
Euro	US-Dollar	450.000	506.916	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1.188)	
Euro	US-Dollar	740.000	836.687	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(5.046)	
Euro	US-Dollar	41.054.542	46.639.248	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(500.504)	
						USD (506.738)	
						EUR (451.035)	
						Netto USD (499.849)	
						Netto EUR (444.903)	

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte Forts.							Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund							BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund						
Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)							Anteilsklasse EUR L (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	49.538	55.584	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	88	Euro	US-Dollar	136.800	153.108	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	633
US-Dollar	Euro	210.245	184.452	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	2.950	Euro	US-Dollar	55.610	62.334	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	162
US-Dollar	Euro	2.123.855	1.872.104	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	19.909	Euro	US-Dollar	30.265	33.973	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	40
US-Dollar	Euro	761.777	677.609	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	253	US-Dollar	Euro	852.231	753.527	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	5.386
US-Dollar	Euro	2.512.626	2.230.511	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	5.889							
US-Dollar	Euro	80.273	70.976	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	507							
						USD 29.596						USD 6.221	
						EUR 26.343						EUR 5.537	
Euro	US-Dollar	5.024.500	5.707.990	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(61.255)	Euro	US-Dollar	65.313	73.551	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(150)
US-Dollar	Euro	893	797	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(2)	Euro	US-Dollar	43.190	48.555	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(16)
						USD (61.257)	Euro	US-Dollar	98.097	110.468	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(223)
						EUR (54.523)	Euro	US-Dollar	171.000	193.995	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1.818)
							Euro	US-Dollar	36.607	41.390	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(250)
						Netto USD (31.661)	Euro	US-Dollar	32.471.514	36.888.659	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(395.866)
						Netto EUR (28.180)						USD (398.323)	
												EUR (354.537)	
												Netto USD (392.102)	
												Netto EUR (349.000)	
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund							BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund						
Anteilsklasse EUR K (Acc) (Hedged)							Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged)						
US-Dollar	Euro	2.620	2.316	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	17	US-Dollar	Euro	41.941	37.084	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	265
						USD 17						USD 265	
						EUR 15						EUR 236	
Euro	US-Dollar	100.370	114.024	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1.224)	Euro	US-Dollar	1.607.543	1.826.220	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(19.598)
						USD (1.224)						USD (19.598)	
						EUR (1.089)						EUR (17.444)	
						Netto USD (1.207)						Netto USD (19.333)	
						Netto EUR (1.074)						Netto EUR (17.208)	

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte Forts.							Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund							
Anteilsklasse Sterling E (Inc) (Hedged)							
US-Dollar	Sterling	115.953	92.087	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		1.838
						USD	1.838
						GBP	1.483
Sterling	US-Dollar	4.006.844	5.092.730	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		(127.388)
						USD	(127.388)
						GBP	(102.807)
						Netto USD	(125.550)
						Netto GBP	(101.324)
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund							
Anteilsklasse Sterling L (Acc) (Hedged)							
US-Dollar	Sterling	2.804	2.227	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		44
						USD	44
						GBP	36
Sterling	US-Dollar	96.885	123.141	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		(3.080)
						USD	(3.080)
						GBP	(2.486)
						Netto USD	(3.036)
						Netto GBP	(2.450)
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund							
Anteilsklasse Sterling L (Inc) (Hedged)							
US-Dollar	Sterling	472.016	374.861	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		7.483
US-Dollar	Sterling	1.311	1.027	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		39
						USD	7.522
						GBP	6.071
Sterling	US-Dollar	16.310.207	20.730.400	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		(518.546)
						USD	(518.546)
						GBP	(418.486)
						Netto USD	(511.024)
						Netto GBP	(412.415)
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund							
Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)							
US-Dollar	Sterling	2.860	2.271	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		45
						USD	45
						GBP	36
Sterling	US-Dollar	98.798	125.573	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		(3.141)
						USD	(3.141)
						GBP	(2.535)
						Netto USD	(3.096)
						Netto GBP	(2.499)
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund							
Anteilsklasse Sterling W (Inc) (Hedged)							
Sterling	US-Dollar	100.000	123.598	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		324
						USD	324
						GBP	261
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund							
Anteilsklasse Sterling X (Acc) (Hedged)							
US-Dollar	Sterling	902.927	717.078	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		14.313
						USD	14.313
						GBP	11.551
Sterling	US-Dollar	31.209.633	39.667.685	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		(992.240)
						USD	(992.240)
						GBP	(800.774)
						Netto USD	(977.927)
						Netto GBP	(789.223)

BNY MELLON EMERGING MARKETS CORPORATE DEBT FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen				Anleihen Forts.			
Überstaatlich - 28.701.024				Kolumbien Forts.			
(31. Dezember 2019: 17.201.452)				4.000.000			
28.701.024	Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	28.701.024	9,30	2.000.000	Geopark Ltd 'REGS' 5,500 % 17-Jan.-2027	3.460.000	1,12
Summe der Anlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen 28.701.024 9,30				500.000	Geopark Ltd 'REGS' 6,500 % 21-Sept.-2024	1.846.230	0,60
Anleihen				1.865.000	Grupo Energia Bogota SA ESP 'REGS' 4,875 % 15-Mai-2030	526.563	0,17
Argentinien - 7.958.386				5.550.000	Transportadora de Gas Internacional SA ESP 'REGS' 5,550 % 01-Nov.-2028	2.041.839	0,66
(31. Dezember 2019: 8.830.675)				Tschechische Republik - 3.545.105			
2.008.000	Banco Macro SA 'REGS' FRN 6,750 % 04-Nov.-2026	1.646.580	0,54	(31. Dezember 2019: -)			
3.400.000	YPF Energia Electrica SA 'REGS' 10,000 % 25-Jul.-2026	2.601.034	0,84	3.100.000	PPF Telecom Group BV 'EMTN' 3,500 % 20-Mai-2024	3.545.105	1,15
4.980.000	YPF SA 'REGS' 8,500 % 27-Jun.-2029	3.710.772	1,20	Ägypten - 5.045.404			
Brasilien - 23.358.657				(31. Dezember 2019: 3.661.790)			
(31. Dezember 2019: 33.694.254)				5.100.000	African Export-Import Bank/The 'REGS' 3,994 % 21-Sept.-2029	5.045.404	1,64
6.200.000	Braskem Netherlands Finance BV 'REGS' 4,500 % 31-Jan.-2030	5.652.850	1,83	Ghana - 3.994.492			
6.829.000	BRF SA 'REGS' 4,875 % 24-Jan.-2030	6.496.086	2,11	(31. Dezember 2019: 7.883.789)			
3.530.000	CSN Islands XI Corp 'REGS' 6,750 % 28-Jan.-2028	2.982.850	0,97	4.489.000	Kosmos Energy Ltd 'REGS' 7,125 % 04-Apr.-2026	3.994.492	1,29
2.900.000	Petrobras Global Finance BV 5,600 % 03-Jan.-2031	2.905.583	0,94	Hongkong - 2.848.086			
1.600.000	Petrobras Global Finance BV 6,750 % 03-Jun.-2050	1.640.528	0,53	(31. Dezember 2019: -)			
3.700.000	Petrobras Global Finance BV 6,850 % 05-Jun.-2115	3.680.760	1,19	1.200.000	CK Hutchison International 20 Ltd 'REGS' 2,500 % 08-Mai-2030	1.225.812	0,40
Chile - 11.696.308				1.500.000	CK Hutchison International 20 Ltd 'REGS' 3,375 % 08-Mai-2050	1.622.274	0,52
(31. Dezember 2019: 16.723.800)				Indien - 2.008.852			
1.074.000	AES Gener SA 'REGS' FRN 6,350 % 07-Okt.-2079	1.074.671	0,35	(31. Dezember 2019: -)			
4.100.000	Celulosa Arauco y Constitucion SA 'REGS' 5,150 % 29-Jan.-2050	4.090.037	1,32	500.000	Bharti Airtel International Netherlands BV 'REGS' 5,350 % 20-Mai-2024	536.298	0,17
2.000.000	Colbun SA 'REGS' 3,150 % 06-März-2030	2.025.000	0,66	1.500.000	Oil & Natural Gas Corp Ltd 'EMTN' 3,375 % 05-Dez.-2029	1.472.554	0,48
2.000.000	Embotelladora Andina SA 'REGS' 3,950 % 21-Jan.-2050	2.008.000	0,65	Indonesien - 5.264.684			
1.000.000	Kenbourne Invest SA 'REGS' 6,875 % 26-Nov.-2024	1.009.190	0,33	(31. Dezember 2019: 9.012.705)			
1.500.000	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA 'REGS' 4,250 % 22-Jan.-2050	1.489.410	0,48	1.100.000	Medco Platinum Road Pte Ltd 'REGS' 6,750 % 30-Jan.-2025	1.037.950	0,34
China - 26.992.534				2.150.000	Pertamina Persero PT 'REGS' 4,175 % 21-Jan.-2050	2.171.734	0,70
(31. Dezember 2019: 29.648.647)				2.000.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 'REGS' 4,375 % 05-Feb.-2050	2.055.000	0,67
2.400.000	China Evergrande Group 11,500 % 22-Jan.-2023	2.264.886	0,73	Israel - 4.332.354			
1.000.000	China Evergrande Group 12,000 % 22-Jan.-2024	919.917	0,30	(31. Dezember 2019: 11.038.808)			
3.500.000	Kaisa Group Holdings Ltd 10,500 % 15-Jan.-2025	3.320.134	1,08	3.300.000	Altice Finco SA 'REGS' 4,750 % 15-Jan.-2028	3.384.560	1,09
3.000.000	Kaisa Group Holdings Ltd 10,875 % 23-Jul.-2023	3.003.540	0,97	800.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 'REGS' 6,000 % 31-Jan.-2025	947.794	0,31
3.000.000	Kaisa Group Holdings Ltd 'REGS' 11,950 % 22-Okt.-2022	3.126.675	1,01	Kasachstan - 1.898.163			
3.135.000	Ronshine China Holdings Ltd 8,100 % 09-Jun.-2023	3.228.820	1,05	(31. Dezember 2019: 2.098.113)			
2.000.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd 'REGS' 3,350 % 13-Mai-2050	2.135.584	0,69	475.000.000	Development Bank of Kazakhstan JSC 9,500 % 14-Dez.-2020	1.120.218	0,36
1.400.000	Tencent Holdings Ltd 'REGS' 2,390 % 03-Jun.-2030	1.414.328	0,46	350.000.000	Development Bank of Kazakhstan JSC 'REGS' 8,950 % 04-Mai-2023	777.945	0,25
800.000	Tencent Holdings Ltd 'REGS' 3,240 % 03-Jun.-2050	813.032	0,26	Kuwait - 2.262.704			
500.000	Yuzhou Properties Co Ltd 6,000 % 25-Okt.-2023	483.082	0,16	(31. Dezember 2019: -)			
2.100.000	Yuzhou Properties Co Ltd 7,375 % 13-Jan.-2026	1.977.259	0,64	2.000.000	MEGlobal Canada ULC 'REGS' 5,875 % 18-Mai-2030	2.262.704	0,73
1.950.000	Yuzhou Properties Co Ltd 8,375 % 30-Okt.-2024	1.976.527	0,64	Summe der Anlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen 28.701.024 9,30			
2.300.000	Zhenro Properties Group Ltd 9,150 % 06-Mai-2023	2.328.750	0,76	Anleihen			
Kolumbien - 17.770.601				Argentinien - 7.958.386			
(31. Dezember 2019: 15.034.533)				(31. Dezember 2019: 8.830.675)			
3.500.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria Colombia SA 'REGS' 4,875 % 21-Apr.-2025	3.718.558	1,21	2.008.000	Banco Macro SA 'REGS' FRN 6,750 % 04-Nov.-2026	1.646.580	0,54
1.200.000	Ecopetrol SA 6,875 % 29-Apr.-2030	1.371.000	0,44	3.400.000	YPF Energia Electrica SA 'REGS' 10,000 % 25-Jul.-2026	2.601.034	0,84
17.000.000.000	Empresas Publicas de Medellin ESP 'REGS' 8,375 % 08-Nov.-2027	4.806.411	1,56	4.980.000	YPF SA 'REGS' 8,500 % 27-Jun.-2029	3.710.772	1,20

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener	Summe			Angemessener	Summe
		Wert	der Netto-			Wert	der Netto-
Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %	Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %
Anleihen Forts.							
	Macao - 6.252.750				Russland Forts.		
	(31. Dezember 2019: –)	6.252.750	2,03	2.000.000	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC		
3.200.000	MGM China Holdings Ltd 'REGS'				'REGS' 3,050 % 23-Jan.-2025	2.022.550	0,65
	5,250 % 18-Jun.-2025	3.264.000	1,06	2.500.000	Russian Railways Via RZD Capital Plc		
3.000.000	Wynn Macau Ltd 'REGS' 5,500 % 15-Jan.-2026	2.988.750	0,97		2,200 % 23-Mai-2027	2.871.832	0,93
	Mexiko - 21.707.946				Saudi Arabien - 8.332.787		
	(31. Dezember 2019: 29.395.522)	21.707.946	7,04		(31. Dezember 2019: 14.091.917)	8.332.787	2,70
7.800.000	Braskem Idesa SAPI 'REGS' 7,450 % 15-Nov.-2029	7.314.918	2,37	7.406.000	Dar Al-Arkan Sukuk Co Ltd		
500.000	Cemex SAB de CV 'REGS' 7,375 % 05-Jun.-2027	510.625	0,17		6,875 % 26-Feb.-2027	6.325.287	2,05
1.500.000	Credito Real SAB de CV SOFOM ER 'REGS'			2.000.000	Riyad Bank FRN 3,174 % 25-Feb.-2030	2.007.500	0,65
	5,000 % 01-Feb.-2027	1.424.424	0,46				
2.700.000	Orbia Advance Corp SAB de CV 'REGS'			Serbien - 3.169.347			
	5,500 % 15-Jan.-2048	2.860.097	0,93	(31. Dezember 2019: –)			
6.900.000	Petroleos Mexicanos 'REGS' 6,840 % 23-Jan.-2030	6.001.758	1,94	3.000.000	United Group BV 'REGS' 3,625 % 15-Feb.-2028	3.169.347	1,03
4.730.000	Petroleos Mexicanos 'REGS' 6,950 % 28-Jan.-2060	3.596.124	1,17				
	Moldawien - 3.135.000				Südafrika - 6.089.169		
	(31. Dezember 2019: 3.210.000)	3.135.000	1,02	4.350.000	Eskom Holdings SOC Ltd 'REGS'		
3.000.000	Aragvi Finance International DAC 'REGS'				8,450 % 10-Aug.-2028	4.103.029	1,33
	12,000 % 09-Apr.-2024	3.135.000	1,02	2.000.000	Liquid Telecommunications Financing Plc 'REGS'		
	Nigeria - 12.059.370				Tansania - 2.689.074		
	(31. Dezember 2019: 11.800.197)	12.059.370	3,91		(31. Dezember 2019: –)	2.689.074	0,87
8.400.000	Africa Finance Corp 3,750 % 30-Okt.-2029	8.492.820	2,75	2.650.000	HTA Group Ltd/Mauritius 'REGS'		
1.200.000	IHS Netherlands Holdco BV 'REGS'				7,000 % 18-Dez.-2025	2.689.074	0,87
	7,125 % 18-März-2025	1.224.000	0,40				
2.300.000	IHS Netherlands Holdco BV 'REGS'			Thailand - 3.593.053			
	8,000 % 18-Sept.-2027	2.342.550	0,76	(31. Dezember 2019: 7.673.591)			
	Panama - 10.775.213			1.000.000	PTTEP Treasury Center Co Ltd 'REGS'		
	(31. Dezember 2019: 13.258.254)	10.775.213	3,49		2,587 % 10-Jun.-2027	1.024.877	0,33
1.500.000	C&W Senior Financing DAC 'REGS'			2.400.000	PTTEP Treasury Center Co Ltd 'REGS'		
	6,875 % 15-Sept.-2027	1.485.383	0,48		3,903 % 06-Dez.-2059	2.568.176	0,83
2.000.000	Cable Onda SA 'REGS' 4,500 % 30-Jan.-2030	2.017.230	0,65				
7.130.000	Global Bank Corp 'REGS' FRN			Türkei - 15.329.812			
	5,250 % 16-Apr.-2029	7.272.600	2,36	(31. Dezember 2019: 15.872.060)			
	Peru - 2.484.569			200.000	Akbank T.A.S. 'REGS' FRN		
	(31. Dezember 2019: 15.298.873)	2.484.569	0,81		6,797 % 27-Apr.-2028	182.602	0,06
2.520.000	Camposol SA 'REGS' 6,000 % 03-Feb.-2027	2.484.569	0,81	3.500.000	Türkcell İletişim Hizmetleri AS 'REGS'		
	Philippinen - 4.558.519				5,800 % 11-Apr.-2028	3.482.664	1,13
	(31. Dezember 2019: –)	4.558.519	1,48	6.200.000	Türkiye Garanti Bankası AS 'REGS' FRN		
2.000.000	PLDT Inc 2,500 % 23-Jan.-2031	2.029.150	0,66		6,125 % 24-Mai-2027	5.844.120	1,89
2.500.000	PLDT Inc 3,450 % 23-Jun.-2050	2.529.369	0,82	1.900.000	Türkiye İş Bankası AS FRN 7,750 % 22-Jan.-2030	1.801.717	0,58
	Qatar - 2.558.925			2.100.000	Türkiye Sise ve Cam Fabrikaları AS 'REGS'		
	(31. Dezember 2019: 4.011.040)	2.558.925	0,83		6,950 % 14-März-2026	2.176.709	0,71
500.000	ABQ Finance Ltd 'EMTN' 3,125 % 24-Sept.-2024	508.665	0,17	2.000.000	Türkiye Vakıflar Bankası TAO 'REGS'		
2.000.000	QNB Finance Ltd 'EMTN' 2,625 % 12-Mai-2025	2.050.260	0,66		5,250 % 05-Feb.-2025	1.842.000	0,60
	Republik Korea - 9.652.238			Ukraine - 9.276.870			
	(31. Dezember 2019: 7.262.732)	9.652.238	3,13	(31. Dezember 2019: 19.559.700)			
3.500.000	Kookmin Bank 'REGS' FRN (Immerwährend)			7.400.000	Metinvest BV 'REGS' 5,625 % 17-Jun.-2025	7.589.620	2,46
	4,350 % 02-Jul.-2024	3.608.933	1,17	1.700.000	VF Ukraine PAT via VFU Funding Plc 'REGS'		
5.500.000	Shinhan Bank Co Ltd 'REGS' 4,000 % 23-Apr.-2029	6.043.305	1,96		6,200 % 11-Feb.-2025	1.687.250	0,55
	Russland - 7.353.693			Vereinigte Arabische Emirate - 21.651.671			
	(31. Dezember 2019: 24.651.495)	7.353.693	2,38	(31. Dezember 2019: 15.202.975)			
2.100.000	Gazprom PJSC via Gaz Finance Plc			2.700.000	Aldar Sukuk No 2 Ltd 3,875 % 22-Okt.-2029	2.774.790	0,90
	2,950 % 15-Apr.-2025	2.459.311	0,80	4.300.000	DP World Plc 'REGS' 4,700 % 30-Sept.-2049	4.243.425	1,38
				7.700.000	DP World Salaam FRN (Immerwährend)		
					6,000 % 01-Okt.-2025	7.634.781	2,47
				7.120.000	MAF Sukuk Ltd 'EMTN' 3,933 % 28-Feb.-2030	6.998.675	2,27

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %	Devisenterminkontrakte						Nicht realisierter
Bestände	Beschreibung			Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Gewinn/(Verlust)
Anleihen Forts.										
Sambia - 573.585										
	(31. Dezember 2019: 7169.474)	573.585	0,19							
600.000	First Quantum Minerals Ltd 'REGS'									
	7,250 % 01-Apr.-2023	573.585	0,19							
Summe der Anlagen in Anleihen		270.219.921	87,59							
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 28.903										
(siehe unten) (31. Dezember 2019: 1.170.429)		28.903	0,01							
Summe der Vermögenswerte zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert										
		298.949.848	96,90							
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften - (3.262.058)										
(siehe unten) (31. Dezember 2019: (488.963))		(3.262.058)	(1,06)							
Summe der finanziellen Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert										
		(3.262.058)	(1,06)							
Nettoumlaufvermögen		12.812.219	4,16							
Summe der Nettovermögen		308.500.009	100,00							
Portfolioanalyse		% des Gesamtvermögens								
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten										
Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			93,50							
OTC-Finanzderivate			0,01							
Sonstiges Umlaufvermögen			6,49							
Summe der Aktiva			100,00							
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund										
Anteilsklasse CHF W (Acc) (Hedged)										
US-Dollar	Kolumbianischer Peso	4.649.755	18.227.969.000	17-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(209.913)				
Euro	US-Dollar	1.590.000	1.789.908	27-Jul.-20	BNP Paribas	(6.669)				
Euro	US-Dollar	1.250.000	1.406.658	27-Jul.-20	Natwest Markets Plc	(4.740)				
US-Dollar	Euro	30.601.061	28.200.000	27-Jul.-20	Bank of America Merrill Lynch	(1.026.206)				
						USD	(1.247.528)			
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund										
Anteilsklasse CHF W (Inc) (Hedged)										
Schweizer Franken	US-Dollar	403.612	425.081	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(310)				
Schweizer Franken	US-Dollar	40.045	42.154	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(10)				
Schweizer Franken	US-Dollar	12.893.910	13.608.803	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(38.920)				
US-Dollar	Schweizer Franken	312.188	296.788	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(159)				
						USD	(39.399)			
						CHF	(37.451)			
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund										
Anteilsklasse CHF W (Inc) (Hedged)										
Schweizer Franken	US-Dollar	5.802.177	6.123.874	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(17.514)				
US-Dollar	Schweizer Franken	140.483	133.553	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(72)				
						USD	(17.586)			
						CHF	(16.716)			
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund										
Anteilsklasse EUR H (Hedged)										
US-Dollar	Euro	8.294	7.392	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	6				
US-Dollar	Euro	100.861	89.663	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	328				
US-Dollar	Euro	51.787	45.735	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	508				
US-Dollar	Euro	444.164	394.452	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	1.893				
US-Dollar	Euro	39.670	34.874	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	568				
US-Dollar	Euro	24.149	21.390	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	165				
US-Dollar	Euro	5.292	4.720	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	-				
US-Dollar	Euro	11.258	9.965	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	86				
						USD	3.554			
						EUR	3.171			

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

[illegible]

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte Forts.							Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund							BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund						
Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged) Forts.							Anteilsklasse Sterling X (Acc) (Hedged)						
US-Dollar	Sterling	1.860	1.470	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	56	US-Dollar	Sterling	541.516	432.301	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	11.015
US-Dollar	Sterling	170	135	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	5						USD	11.015
US-Dollar	Sterling	114.898	91.725	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	2.337						GBP	8.977
US-Dollar	Sterling	7.437	5.862	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	244							
US-Dollar	Sterling	18.538	14.515	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	726	Sterling	US-Dollar	18.851.371	24.016.409	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(882.820)
US-Dollar	Sterling	23	18	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	1						USD	(882.820)
US-Dollar	Sterling	961	767	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	19						GBP	(719.465)
US-Dollar	Sterling	115.538	92.332	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	2.233						Netto USD	(871.805)
US-Dollar	Sterling	271	220	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	1						Netto GBP	(710.488)
					USD	5.852							
					GBP	4.769							
Sterling	US-Dollar	4.277	5.309	01-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(61)							
Sterling	US-Dollar	220	271	02-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1)							
Sterling	US-Dollar	363	449	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(4)							
Sterling	US-Dollar	721	903	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(18)							
Sterling	US-Dollar	3.870	4.865	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(116)							
Sterling	US-Dollar	3.182	4.025	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(121)							
Sterling	US-Dollar	13.401	16.770	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(324)							
Sterling	US-Dollar	5.008	6.321	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(175)							
Sterling	US-Dollar	16.523	21.103	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(827)							
Sterling	US-Dollar	30.000	37.939	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1.124)							
Sterling	US-Dollar	3.965.544	5.052.053	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(185.709)							
Sterling	US-Dollar	398	490	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(2)							
Sterling	US-Dollar	388	482	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(6)							
Sterling	US-Dollar	100	125	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(2)							
Sterling	US-Dollar	38	47	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1)							
					USD	(188.491)							
					GBP	(153.613)							
					Netto USD	(182.639)							
					Netto GBP	(148.844)							

BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Nettovermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Nettovermögen %
Anleihen				Anleihen Forts.			
	Argentinien - 433.825 (31. Dezember 2019: 955.486)	433.825	1,47		Ecuador - 655.965 (31. Dezember 2019: 1.624.255)	655.965	2,23
610.000	Argentine Republic Government International Bond 5,875 % 11-Jan.-2028	244.342	0,83	220.000	Ecuador Government International Bond 'REGS' 7,950 % 20-Jun.-2024	108.902	0,37
160.000	Argentine Republic Government International Bond 6,875 % 26-Jan.-2027	64.440	0,22	420.000	Ecuador Government International Bond 'REGS' 8,875 % 23-Okt.-2027	177.975	0,60
320.000	Argentine Republic Government International Bond 6,875 % 11-Jan.-2048	125.043	0,42	210.000	Ecuador Government International Bond 'REGS' 9,500 % 27-März-2030	90.038	0,31
	Aserbaidshjan - 230.526 (31. Dezember 2019: 474.982)	230.526	0,78	200.000	Ecuador Government International Bond 'REGS' 10,650 % 31-Jan.-2029	83.050	0,28
200.000	Southern Gas Corridor CJSC 'REGS' 6,875 % 24-März-2026	230.526	0,78	400.000	Ecuador Government International Bond 'REGS' 10,750 % 28-März-2022	196.000	0,67
	Bahrain - 908.137 (31. Dezember 2019: 958.749)	908.137	3,08		Ägypten - 392.601 (31. Dezember 2019: 1.501.669)	392.601	1,33
260.000	Bahrain Government International Bond 'REGS' 5,625 % 30-Sept.-2031	263.640	0,89	200.000	Egypt Government International Bond 'REGS' 7,625 % 29-Mai-2032	195.718	0,66
210.000	Bahrain Government International Bond 'REGS' 6,000 % 19-Sept.-2044	208.357	0,71	200.000	Egypt Government International Bond 'REGS' 8,700 % 01-März-2049	196.883	0,67
200.000	Bahrain Government International Bond 'REGS' 7,000 % 12-Okt.-2028	223.614	0,76		El Salvador - 95.739 (31. Dezember 2019: 319.607)	95.739	0,33
200.000	CBB International Sukuk Programme Co SPC 'REGS' 6,250 % 14-Nov.-2024	212.526	0,72	111.000	El Salvador Government International Bond 'REGS' 6,375 % 18-Jan.-2027	95.739	0,33
	Brasilien - 1.623.617 (31. Dezember 2019: 2.594.145)	1.623.617	5,51		Georgien - 513.589 (31. Dezember 2019: 948.766)	513.589	1,74
500.000	BRF SA 'REGS' 4,875 % 24-Jan.-2030	471.875	1,60	525.000	Bank of Georgia JSC 'REGS' 6,000 % 26-Jul.-2023	513.589	1,74
395.000	Cosan Ltd 'REGS' 5,500 % 20-Sept.-2029	375.155	1,27		Ghana - 608.690 (31. Dezember 2019: 306.599)	608.690	2,07
200.000	Globo Comunicacao e Participacoes SA 'REGS' 4,875 % 22-Jan.-2030	181.200	0,62	450.000	Ghana Government International Bond 'REGS' 7,625 % 16-Mai-2029	426.690	1,45
450.000	NBM US Holdings Inc 'REGS' 7,000 % 14-Mai-2026	451.868	1,53	200.000	Ghana Government International Bond 'REGS' 7,875 % 11-Feb.-2035	182.000	0,62
150.000	Petrobras Global Finance BV 5,625 % 20-Mai-2043	143.519	0,49		Indien - 593.200 (31. Dezember 2019: 685.457)	593.200	2,01
	Chile - 640.496 (31. Dezember 2019: 408.281)	640.496	2,17	240.000	Export-Import Bank of India 'EMTN' 4,000 % 14-Jan.-2023	251.168	0,85
400.000	Banco Santander Chile 'REGS' 2,700 % 10-Jan.-2025	411.502	1,39	345.000	Export-Import Bank of India 'REGS' 3,250 % 15-Jan.-2030	342.032	1,16
200.000	Corp Nacional del Cobre de Chile 'REGS' 4,375 % 05-Feb.-2049	228.994	0,78		Indonesien - 2.339.716 (31. Dezember 2019: 3.610.478)	2.339.716	7,94
	China - 859.581 (31. Dezember 2019: 1.620.883)	859.581	2,92	200.000	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 'REGS' 6,757 % 15-Nov.-2048	245.033	0,83
765.000	Tencent Holdings Ltd 'REGS' 3,975 % 11-Apr.-2029	859.581	2,92	430.000	Indonesia Government International Bond 'REGS' 3,750 % 14-Jun.-2028	552.552	1,88
	Kolumbien - 750.613 (31. Dezember 2019: 1.014.614)	750.613	2,55	200.000	Pertamina Persero PT 'REGS' 4,300 % 20-Mai-2023	211.755	0,72
200.000	Colombia Government International Bond 3,125 % 15-Apr.-2031	198.850	0,68	200.000	Pertamina Persero PT 'REGS' 6,500 % 27-Mai-2041	249.028	0,84
310.000	Empresas Publicas de Medellin ESP 'REGS' 4,250 % 18-Jul.-2029	311.685	1,06	140.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 'REGS' 1,875 % 05-Nov.-2031	145.269	0,49
225.000	Millicom International Cellular SA 'REGS' 6,625 % 15-Okt.-2026	240.078	0,81	200.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 'REGS' 3,875 % 17-Jul.-2029	209.412	0,71
	Dominikanische Republik - 393.870 (31. Dezember 2019: 251.831)	393.870	1,34	250.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 'REGS' 4,875 % 17-Jul.-2049	272.949	0,93
200.000	Dominican Republic International Bond 'REGS' 4,500 % 30-Jan.-2030	181.900	0,62	400.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 'REGS' 5,250 % 24-Okt.-2042	453.718	1,54
220.000	Dominican Republic International Bond 'REGS' 6,850 % 27-Jan.-2045	211.970	0,72				

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Nettovermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Nettovermögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
	Elfenbeinküste - 316.969 (31. Dezember 2019: 1.053.787)	316.969	1,08		Oman - 421.625 (31. Dezember 2019: 1.515.050)	421.625	1,43
320.625	Ivory Coast Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 5,750 % 31-Dez.-2032	316.969	1,08	265.000	Oman Government International Bond 'REGS' 6,000 % 01-Aug.-2029	247.775	0,84
	Kasachstan - 495.064 (31. Dezember 2019: 2.043.508)	495.064	1,68	200.000	Oman Government International Bond 'REGS' 6,750 % 17-Jan.-2048	173.850	0,59
475.000	Development Bank of Kazakhstan JSC 'REGS' 4,125 % 10-Dez.-2022	495.064	1,68		Pakistan - 197.740 (31. Dezember 2019: 208.883)	197.740	0,67
	Kenia - 640.013 (31. Dezember 2019: 217.949)	640.013	2,17	200.000	Pakistan Government International Bond 'REGS' 6,875 % 05-Dez.-2027	197.740	0,67
200.000	Kenya Government International Bond 'REGS' 6,875 % 24-Jun.-2024	203.735	0,69		Panama - 246.202 (31. Dezember 2019: 233.187)	246.202	0,84
440.000	Kenya Government International Bond 'REGS' 7,250 % 28-Feb.-2028	436.278	1,48	200.000	Panama Government International Bond 4,500 % 01-Apr.-2056	246.202	0,84
	Kuwait - 502.033 (31. Dezember 2019: 503.450)	502.033	1,70		Peru - 619.419 (31. Dezember 2019: 1.893.460)	619.419	2,10
260.000	Equate Petrochemical BV 'REGS' 4,250 % 03-Nov.-2026	275.299	0,93	625.000	Orazul Energy Egenor SCA 'REGS' 5,625 % 28-Apr.-2027	619.419	2,10
200.000	MEGlobal Canada ULC 'REGS' 5,875 % 18-Mai-2030	226.734	0,77		Qatar - 527.446 (31. Dezember 2019: 496.179)	527.446	1,79
	Mexiko - 3.483.582 (31. Dezember 2019: 5.430.278)	3.483.582	11,83	400.000	Qatar Government International Bond 'REGS' 4,817 % 14-März-2049	527.446	1,79
415.000	Axtel SAB de CV 'REGS' 6,375 % 14-Nov.-2024	432.067	1,47		Republik Serbien - 347.654 (31. Dezember 2019: -)	347.654	1,18
165.000	Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand 'REGS' 5,375 % 17-Apr.-2025	180.885	0,62	150.000	Serbia International Bond 'REGS' 1,500 % 26-Jun.-2029	158.808	0,54
200.000	Comision Federal de Electricidad 'REGS' 5,750 % 14-Feb.-2042	213.002	0,72	160.000	Serbia International Bond 'REGS' 3,125 % 15-Mai-2027	188.846	0,64
246.000	Mexico Government International Bond 3,250 % 16-Apr.-2030	244.017	0,83		Rumänien - 316.546 (31. Dezember 2019: 230.950)	316.546	1,08
270.000	Mexico Government International Bond 4,500 % 22-Apr.-2029	293.861	1,00	65.000	Romanian Government International Bond 'REGS' 3,624 % 26-Mai-2030	79.126	0,27
222.000	Mexico Government International Bond 4,500 % 31-Jan.-2050	229.548	0,78	200.000	Romanian Government International Bond 'REGS' 5,125 % 15-Jun.-2048	237.420	0,81
435.000	Mexico Government International Bond 'MTN' 4,750 % 08-März-2044	462.968	1,57		Russland - 1.502.652 (31. Dezember 2019: 3.093.046)	1.502.652	5,10
305.000	Petroleos Mexicanos 5,625 % 23-Jan.-2046	217.206	0,74	285.000	Gazprom PJSC Via Gaz Capital SA 2,500 % 21-März-2026	329.547	1,12
190.000	Petroleos Mexicanos 6,500 % 23-Jan.-2029	165.954	0,56	600.000	Russian Foreign Bond - Eurobond 'REGS' 5,100 % 28-März-2035	742.535	2,52
575.000	Petroleos Mexicanos 'REGS' 5,950 % 28-Jan.-2031	475.212	1,61	402.000	Vnesheconombank Via VEB Finance Plc 'REGS' 6,025 % 05-Jul.-2022	430.570	1,46
325.000	Petroleos Mexicanos 'REGS' 6,490 % 23-Jan.-2027	297.014	1,01		Saudi Arabien - 974.654 (31. Dezember 2019: 2.246.313)	974.654	3,31
325.000	Petroleos Mexicanos 'REGS' 7,690 % 23-Jan.-2050	271.848	0,92	630.000	Saudi Arabian Oil Co 'REGS' 3,500 % 16-Apr.-2029	680.642	2,31
	Mongolei - 208.500 (31. Dezember 2019: 256.490)	208.500	0,71	255.000	Saudi Government International Bond 'REGS' 4,500 % 26-Okt.-2046	294.012	1,00
200.000	Mongolia Government International Bond 'REGS' 10,875 % 06-Apr.-2021	208.500	0,71		Senegal - 614.015 (31. Dezember 2019: 865.320)	614.015	2,08
	Marokko - 243.681 (31. Dezember 2019: 255.029)	243.681	0,83	385.000	Senegal Government International Bond 'REGS' 4,750 % 13-März-2028	420.140	1,42
200.000	OCP SA 'REGS' 6,875 % 25-Apr.-2044	243.681	0,83				
	Nigeria - 238.625 (31. Dezember 2019: 873.337)	238.625	0,81				
250.000	Nigeria Government International Bond 'REGS' 6,500 % 28-Nov.-2027	238.625	0,81				

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %			Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %
Bestände	Beschreibung			Bestände	Beschreibung		
Anleihen Forts.							
Senegal Forts.							
200.000	Senegal Government International Bond 'REGS' 6,750 % 13-März-2048	193.875	0,66				
Südafrika - 364.536 (31. Dezember 2019: 395.677)							
200.000	Republic of South Africa Government International Bond 4,850 % 30-Sept.-2029	190.074	0,65				
200.000	Republic of South Africa Government International Bond 5,750 % 30-Sept.-2049	174.462	0,59				
Spanien - 253.125 (31. Dezember 2019: 558.412)							
250.000	Al Candelaria Spain SLU 'REGS' 7,500 % 15-Dez.-2028	253.125	0,86				
Sri Lanka - 230.143 (31. Dezember 2019: 526.343)							
350.000	Sri Lanka Government International Bond 'REGS' 6,200 % 11-Mai-2027	230.143	0,78				
Überstaatlich - 794.846 (31. Dezember 2019: 1.686.955)							
760.000	Banque Ouest Africaine de Developpement 'REGS' 5,000 % 27-Jul.-2027	794.846	2,70				
Türkei - 1.406.348 (31. Dezember 2019: 3.604.626)							
240.000	TC Ziraat Bankasi AS 'REGS' 4,750 % 29-Apr.-2021	241.031	0,82				
400.000	Türk Telekomunikasyon AS 'REGS' 6,875 % 28-Feb.-2025	422.701	1,43				
310.000	Turkey Government International Bond 5,125 % 17-Feb.-2028	285.884	0,97				
200.000	Turkey Government International Bond 5,750 % 11-Mai-2047	163.915	0,56				
300.000	Turkey Government International Bond 6,875 % 17-März-2036	292.817	0,99				
Ukraine - 1.455.892 (31. Dezember 2019: 1.519.286)							
200.000	MHP Lux SA 'REGS' 6,250 % 19-Sept.-2029	191.264	0,65				
215.000	Ukraine Government International Bond FRN 0,000 % 31-Mai-2040	199.623	0,68				
185.000	Ukraine Government International Bond 'REGS' 4,375 % 27-Jan.-2030	179.747	0,61				
100.000	Ukraine Government International Bond 'REGS' 6,750 % 20-Jun.-2026	114.406	0,39				
200.000	Ukraine Government International Bond 'REGS' 7,375 % 25-Sept.-2032	201.547	0,68				
425.000	Ukraine Government International Bond 'REGS' 7,750 % 01-Sept.-2026	444.212	1,51				
120.000	Ukraine Government International Bond 'REGS' 7,750 % 01-Sept.-2027	125.093	0,42				
Vereinigte Arabische Emirate - 1.167.507 (31. Dezember 2019: 1.225.353)							
280.000	DP World Plc 'REGS' 6,850 % 02-Jul.-2037	342.650	1,16				
200.000	DP World Salaam FRN (Immerwährend) 6,000 % 01-Okt.-2025	198.524	0,67				
400.000	MDGH - GMTN BV 'REGS' 3,700 % 07-Nov.-2049	424.364	1,44				
200.000	Sharjah Sukuk Program Ltd 3,234 % 23-Okt.-2029	201.969	0,69				

Anleihen Forts.							
USA - 149.985 (31. Dezember 2019: 209.073)							
150.000	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 30-Jul.-2020*	149.985	0,51				
Uruguay - 175.393 (31. Dezember 2019: 508.146)							
40.000	Uruguay Government International Bond 4,375 % 23-Jan.-2031	46.863	0,16				
100.000	Uruguay Government International Bond 4,975 % 20-Apr.-2055	128.530	0,44				
Summe der Anlagen in Anleihen						28.934.360	98,22
		Zugrunde liegendes Engagement in USD	Angemessener Wert in USD	Summe der Netto-vermögen %			
Bestände	Beschreibung						
Offene Terminkontrakte - 14.563 (31. Dezember 2019: 64.104)							
2	U.S. 10 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Sep.-2020	278.344	500	0,00			
3	U.S. 2 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Sep.-2020	662.484	72	0,00			
12	U.S. 5 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Sep.-2020	1.508.906	5.211	0,02			
2	U.S. Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Sep.-2020	357.125	978	0,00			
8	U.S. Treasury Ultra Bond Long Futures Contracts Exp Sep.-2020	1.745.250	7.802	0,03			
Summe der offenen Terminkontrakte						14.563	0,05
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 8.503 (siehe unten) (31. Dezember 2019: 40.417)							
						8.503	0,03
Summe der Vermögenswerte zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert						28.957.426	98,30
		Zugrunde liegendes Engagement in USD	Angemessener Wert in USD	Summe der Netto-vermögen %			
Bestände	Beschreibung						
Offene Terminkontrakte - (23.818) (31. Dezember 2019: (83.461))							
(2)	Euro-Bobl Short Futures Contracts Exp Sep.-2020	(303.300)	(1.303)	(0,00)			
(7)	Euro-Bund Short Futures Contracts Exp Sep.-2020	(1.388.242)	(8.101)	(0,03)			
(15)	U.S. 10 Year Ultra Treasury Note Short Futures Contracts Exp Sep.-2020	(2.362.266)	(14.414)	(0,05)			
Summe der offenen Terminkontrakte						(23.818)	(0,08)

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Beschreibung	Angemessener Wert	Summe der Nettovermögen %	Devisenterminkontrakte						Nicht realisierter
	in USD		Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Gewinn/(Verlust)
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften - (34.624)									
(siehe unten) (31. Dezember 2019: (40.535))	(34.624)	(0,12)							
Summe der finanziellen Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert									
	(58.442)	(0,20)							
Nettoumlaufvermögen									
	560.977	1,90							
Summe der Nettovermögen									
	29.459.961	100,00							
* Wird von Bank of America Merrill Lynch als Sicherheit im Zusammenhang mit den vom Fonds gehaltenen Futures gehalten.									
Der Kontrahent für Terminkontrakte ist Bank of America Merrill Lynch.									
Portfolioanalyse									
% des Gesamtvermögens									
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente									
	96,38								
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate									
	0,05								
OTC-Finanzderivate									
	0,03								
Sonstiges Umlaufvermögen									
	3,54								
Summe der Aktiva									
	100,00								

BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund									
US-Dollar	Euro	2.138.954	1.896.604	31-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited				
						6.682			
						USD	6.682		
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund									
Anteilsklasse EUR H (Hedged)									
Euro	US-Dollar	11.630	13.016	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		54		
US-Dollar	Euro	22.113	19.492	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		207		
US-Dollar	Euro	111.138	97.504	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		1.560		
						USD	1.821		
						EUR	1.621		
Euro	US-Dollar	8.488	9.558	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		(20)		
Euro	US-Dollar	5.000	5.672	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		(53)		
Euro	US-Dollar	2.834.070	3.219.592	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		(34.551)		
						USD	(34.624)		
						EUR	(30.818)		
						Netto USD	(32.803)		
						Netto EUR	(29.197)		

BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT LOCAL CURRENCY FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %
Anleihen				Anleihen Forts.			
	Argentinien - 2.814.264 (31. Dezember 2019: 8.649.882)	2.814.264	1,11		Kasachstan - 1.084.821 (31. Dezember 2019: 1.606.549)	1.084.821	0,43
13.241.300	Argentine Republic Government International Bond FRN 5,830 % 31-Dez.-2033	2.814.264	1,11	487.750.000	Development Bank of Kazakhstan JSC 'REGS' 8,950 % 04-Mai-2023	1.084.821	0,43
	Brasilien - 14.777.146 (31. Dezember 2019: 38.075.053)	14.777.146	5,85		Malaysia - 7.789.911 (31. Dezember 2019: 19.200.481)	7.789.911	3,08
18.590.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,000 % 01-Jan.-2025	4.003.367	1,59	5.950.000	Malaysia Government Bond 3,885 % 15-Aug.-2029	1.498.640	0,59
14.050.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,000 % 01-Jan.-2027	3.063.964	1,21	7.295.000	Malaysia Government Bond 4,181 % 15-Jul.-2024	1.817.048	0,72
13.360.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,000 % 01-Jan.-2029	2.950.204	1,17	6.865.000	Malaysia Government Bond 4,893 % 08-Jun.-2038	1.869.396	0,74
21.400.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,000 % 01-Jan.-2031	4.759.611	1,88	9.700.000	Malaysia Government Bond 4,921 % 06-Jul.-2048	2.604.827	1,03
	Chile - 9.515.840 (31. Dezember 2019: 11.811.788)	9.515.840	3,76		Mexiko - 33.164.718 (31. Dezember 2019: 36.600.187)	33.164.718	13,12
2.940.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 5,000 % 01-März-2035	4.528.011	1,79	132.500.000	Mexican Bonos 7,500 % 03-Jun.-2027	6.426.433	2,54
3.385.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos '144A' 4,700 % 01-Sept.-2030	4.987.829	1,97	83.200.000	Mexican Bonos 7,750 % 13-Nov.-2042	3.957.308	1,57
	China - 14.210.808 (31. Dezember 2019: -)	14.210.808	5,62	200.600.000	Mexican Bonos 8,500 % 31-Mai-2029	10.339.351	4,09
18.000.000	China Government Bond 3,120 % 05-Dez.-2026	2.587.535	1,02	5.341.914	Mexican Udibonos 4,500 % 04-Dez.-2025	266.247	0,10
26.100.000	China Government Bond 3,250 % 06-Jun.-2026	3.794.754	1,50	328.465.000	Petroleos Mexicanos 'REGS' 7,190 % 12-Sept.-2024	12.175.379	4,82
53.830.000	China Government Bond 3,290 % 23-Mai-2029	7.828.519	3,10		Peru - 8.367.221 (31. Dezember 2019: 19.195.068)	8.367.221	3,31
	Kolumbien - 18.144.815 (31. Dezember 2019: 40.601.314)	18.144.815	7,18	8.590.000	Peru Government Bond '144A' 5,350 % 12-Aug.-2040	2.438.568	0,97
7.413.500.000	Colombian TES 7,000 % 04-Mai-2022	2.109.728	0,84	3.515.000	Peru Government Bond '144A' 5,400 % 12-Aug.-2034	1.047.751	0,41
2.736.000.000	Colombian TES 7,000 % 30-Jun.-2032	751.066	0,30	3.885.000	Peru Government Bond '144A' 5,940 % 12-Feb.-2029	1.267.507	0,50
11.057.000.000	Colombian TES 7,750 % 18-Sept.-2030	3.233.831	1,28	11.180.000	Peru Government Bond '144A' 6,150 % 12-Aug.-2032	3.613.395	1,43
16.569.000.000	Empresas Publicas de Medellin ESP 'REGS' 7,625 % 10-Sept.-2024	4.606.823	1,82		Polen - 12.899.318 (31. Dezember 2019: 22.295.313)	12.899.318	5,10
26.415.000.000	Empresas Publicas de Medellin ESP 'REGS' 8,375 % 08-Nov.-2027	7.443.367	2,94	11.495.000	Republic of Poland Government Bond 2,500 % 25-Jul.-2026	3.172.099	1,25
	Tschechische Republik - 3.514.408 (31. Dezember 2019: 2.819.586)	3.514.408	1,39	23.400.000	Republic of Poland Government Bond 2,500 % 25-Jul.-2027	6.461.580	2,56
50.110.000	Czech Republic Government Bond 2,500 % 25-Aug.-2028	2.416.552	0,96	11.470.000	Republic of Poland Government Bond 2,750 % 25-Okt.-2029	3.265.639	1,29
22.080.000	Czech Republic Government Bond 2,750 % 23-Jul.-2029	1.097.856	0,43		Rumänien - 4.957.218 (31. Dezember 2019: 11.617.407)	4.957.218	1,96
	Dominikanische Republik - 476.096 (31. Dezember 2019: 557.239)	476.096	0,19	10.760.000	Romania Government Bond 4,750 % 24-Feb.-2025	2.618.017	1,04
29.700.000	Dominican Republic International Bond 'REGS' 8,900 % 15-Feb.-2023	476.096	0,19	5.350.000	Romania Government Bond 5,800 % 26-Jul.-2027	1.402.599	0,55
	Indonesien - 25.616.064 (31. Dezember 2019: 43.625.823)	25.616.064	10,13	3.790.000	Romania Government Bond 5,850 % 26-Apr.-2023	936.602	0,37
58.113.000.000	Indonesia Treasury Bond 6,125 % 15-Mai-2028	3.820.365	1,51		Russland - 36.116.206 (31. Dezember 2019: 58.302.588)	36.116.206	14,29
53.790.000.000	Indonesia Treasury Bond 7,000 % 15-Mai-2027	3.776.785	1,49	488.580.000	Russian Federal Bond - OFZ 7,000 % 16-Aug.-2023	7.317.355	2,89
24.110.000.000	Indonesia Treasury Bond 7,000 % 15-Sept.-2030	1.664.493	0,66	696.510.000	Russian Federal Bond - OFZ 7,050 % 19-Jan.-2028	10.688.824	4,23
33.297.000.000	Indonesia Treasury Bond 7,500 % 15-Aug.-2032	2.301.537	0,91	409.481.000	Russian Federal Bond - OFZ 7,700 % 23-März-2033	6.591.426	2,61
36.450.000.000	Indonesia Treasury Bond 7,500 % 15-Jun.-2035	2.526.877	1,00	710.500.000	Russian Federal Bond - OFZ 8,150 % 03-Feb.-2027	11.518.601	4,56
40.469.000.000	Indonesia Treasury Bond 8,250 % 15-Jun.-2032	2.949.407	1,17		Südafrika - 30.319.771 (31. Dezember 2019: 66.506.029)	30.319.771	12,00
51.527.000.000	Indonesia Treasury Bond 8,250 % 15-Mai-2036	3.757.485	1,49	179.210.000	Republic of South Africa Government Bond 7,000 % 28-Feb.-2031	8.506.343	3,37
65.246.000.000	Indonesia Treasury Bond 8,375 % 15-März-2034	4.819.115	1,90	164.850.000	Republic of South Africa Government Bond 8,750 % 28-Feb.-2048	7.493.657	2,96
				131.791.735	Republic of South Africa Government Bond 10,500 % 21-Dez.-2026	8.668.900	3,43
				96.460.000	Transnet SOC Ltd 'REGS' 9,500 % 13-Mai-2021	5.650.871	2,24

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Nettovermögen %	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Nettovermögen %
Anleihen Forts.				Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften - (3.086.226) (siehe unten) (31. Dezember 2019: (3.356.348))		
	Überstaatlich - 3.616.493 (31. Dezember 2019: 4.338.196)	3.616.493	1,43		(3.086.226)	(1,22)
265.880.000	International Finance Corp 'GMTN' 6,300 % 25-Nov.-2024	3.616.493	1,43	Summe der finanziellen Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert	(3.456.911)	(1,37)
	Thailand - 16.572.954 (31. Dezember 2019: 37.754.667)	16.572.954	6,56	Nettoumlaufvermögen	5.226.811	2,07
26.700.000	Thailand Government Bond 2,875 % 17-Jun.-2046	1.018.866	0,40	Summe der Nettovermögen	252.780.212	100,00
165.295.000	Thailand Government Bond 3,400 % 17-Jun.-2036	6.697.264	2,65	* Ein Teil der Beteiligung wird von Citigroup Global Markets Limited, Goldman Sachs und JPMorgan Chase Bank als Sicherheit im Zusammenhang mit den vom Fonds gehaltenen Währungsoptionen und Devisentermingeschäften gehalten.		
156.900.000	Thailand Government Bond 3,650 % 20-Jun.-2031	6.210.137	2,46	Die Gegenparteien für Währungsoptionen sind Bank of America Merrill Lynch, Citigroup Global Markets Limited und Goldman Sachs.		
62.785.000	Thailand Government Bond 4,875 % 22-Jun.-2029	2.646.687	1,05			
	Türkei - 2.171.976 (31. Dezember 2019: 12.758.436)	2.171.976	0,86	Portfolioanalyse % des Gesamtvermögens		
8.320.000	Turkey Government Bond 10,600 % 11-Feb.-2026	1.198.196	0,47	An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		
6.810.000	Turkey Government Bond 11,000 % 24-Feb.-2027	973.780	0,39	OTC-Finanzderivate		
	USA - 2.410.767 (31. Dezember 2019: 2.070.823)	2.410.767	0,95	Sonstiges Umlaufvermögen		
2.411.000	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 30-Jul.-2020*	2.410.767	0,95	Summe der Aktiva		100,00
	Uruguay - 908.015 (31. Dezember 2019: 1.066.079)	908.015	0,36			
23.780.000	Uruguay Government International Bond 3,875 % 02-Jul.-2040	565.688	0,22			
15.745.000	Uruguay Government International Bond 'REGS' 8,500 % 15-März-2028	342.327	0,14			
Summe der Anlagen in Anleihen		249.448.830	98,68			
	Devisenoptionen - 20.750 (31. Dezember 2019: 718.204)					
2.660.000	US dollar/Mexican peso Put 09-Sept.-2020 21,350	10.095	0,00			
2.660.000	US dollar/Russian rouble Call 09-Sept.-2020 67,500	10.404	0,01			
4.540.000	US dollar/Russian rouble Put 31-Jul.-2020 62,500	251	0,00			
Summe der Devisenoptionen		20.750	0,01			
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 1.540.732 (siehe unten) (31. Dezember 2019: 3.788.873)						
		1.540.732	0,61			
Summe der Vermögenswerte zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert		251.010.312	99,30			
	Devisenoptionen - (370.685) (31. Dezember 2019: (184.498))					
(2.660.000)	US dollar/Mexican peso Call 09-Sept.-2020 23,000	(96.021)	(0,04)			
(4.540.000)	US dollar/Russian rouble Call 31-Jul.-2020 68,200	(214.928)	(0,09)			
(2.660.000)	US dollar/Russian rouble Put 09-Sept.-2020 72,000	(59.736)	(0,02)			
Summe der Devisenoptionen		(370.685)	(0,15)			

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte							Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund							BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund						
Anteilsklasse EUR H (Hedged)							Anteilsklasse EUR H (Hedged)						
Euro	US-Dollar	100.000	112.309	01-Jul.-20	UBS AG	41	Euro	US-Dollar	294.640	330.807	01-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	221
Sterling	US-Dollar	6.560.000	8.103.617	01-Jul.-20	Barclays Bank PLC	24.882	US-Dollar	Euro	6.620	5.878	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	13
Sterling	US-Dollar	50.000	61.885	02-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	71	US-Dollar	Euro	22.066	19.589	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	52
US-Dollar	Peruanischer Nuevo Sol	10.540.462	36.080.000	14-Jul.-20	Barclays Bank PLC	355.276	US-Dollar	Euro	20.916	18.573	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	42
US-Dollar	Euro	7.945.217	7.045.000	31-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	24.820	US-Dollar	Euro	98.798	87.366	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	613
US-Dollar	Chilenischer Peso	1.276.516	1.017.000.000	01-Sept.-20	HSBC Bank plc	37.277	US-Dollar	Euro	11.345	10.000	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	106
Thailändischer Baht	US-Dollar	27.910.000	901.180	17-Sept.-20	Morgan Stanley	1.710	US-Dollar	Euro	16.859	15.000	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	1
Türkische Lira	US-Dollar	17.600.000	2.511.953	17-Sept.-20	Citigroup Global Markets Limited	779	US-Dollar	Euro	41.585	36.968	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	39
Türkische Lira	US-Dollar	13.600.000	1.940.639	17-Sept.-20	Morgan Stanley	1.018	US-Dollar	Euro	18.519	16.452	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	30
US-Dollar	Chinesischer Yuan	2.261.165	16.000.000	17-Sept.-20	Barclays Bank PLC	8.005	US-Dollar	Euro	26.847	23.741	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	166
US-Dollar	Chinesischer Yuan	4.551.044	32.200.000	17-Sept.-20	HSBC Bank plc	16.561							
US-Dollar	Kolumbianischer Peso	1.396.091	5.175.450.000	17-Sept.-20	Citigroup Global Markets Limited	27.842							
US-Dollar	Indonesische Rupiah	756.911	10.924.500.000	17-Sept.-20	JPMorgan Chase Bank	16.001							
US-Dollar	Mexikanischer Peso	10.108.915	228.442.271	17-Sept.-20	Morgan Stanley	272.377							
US-Dollar	Russischer Rubel	10.361.901	727.250.000	17-Sept.-20	JPMorgan Chase Bank	234.147							
US-Dollar	Südafrikanischer Rand	12.203.289	204.414.000	17-Sept.-20	Barclays Bank PLC	518.237							
						USD 1.539.044							USD 1.283
													EUR 1.142
Peruanischer Nuevo Sol	US-Dollar	600.000	175.541	14-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(6.165)	Euro	US-Dollar	15.000	16.855	02-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(2)
Peruanischer Nuevo Sol	US-Dollar	4.350.000	1.276.034	14-Jul.-20	Barclays Bank PLC	(48.053)	Euro	US-Dollar	9.007	10.143	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(21)
Peruanischer Nuevo Sol	US-Dollar	4.350.000	1.279.036	14-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(51.054)	Euro	US-Dollar	5.114	5.783	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(36)
Peruanischer Nuevo Sol	US-Dollar	13.430.000	3.893.092	14-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(101.877)	Euro	US-Dollar	27.298.777	31.012.268	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(332.805)
Peruanischer Nuevo Sol	US-Dollar	13.000.000	3.839.338	14-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(169.510)	US-Dollar	Euro	15.911	14.216	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(66)
Peruanischer Nuevo Sol	US-Dollar	610.000	178.624	14-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(6.424)	US-Dollar	Euro	98.352	87.742	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(256)
Brasilianischer Real	US-Dollar	49.035.000	9.081.565	04-Aug.-20	Citigroup Global Markets Limited	(80.195)	US-Dollar	Euro	687.009	612.144	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(943)
Chilenischer Peso	US-Dollar	2.089.000.000	2.712.776	01-Sept.-20	Citigroup Global Markets Limited	(167.279)	US-Dollar	Euro	330.898	294.640	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(230)
Chilenischer Peso	US-Dollar	3.035.760.000	3.934.625	01-Sept.-20	Barclays Bank PLC	(235.479)	US-Dollar	Euro	48.468	43.177	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(57)
US-Dollar	Taiwanesischer Dollar	297.483	8.840.000	08-Sept.-20	JPMorgan Chase Bank	(2.250)							
US-Dollar	Taiwanesischer Dollar	339.850	10.070.000	08-Sept.-20	Citigroup Global Markets Limited	(1.587)							
US-Dollar	Taiwanesischer Dollar	4.571.620	136.760.000	08-Sept.-20	Barclays Bank PLC	(65.418)							
Tschechische Krone	US-Dollar	62.110.000	2.653.712	17-Sept.-20	Bank of America Securities Ltd	(34.198)							
Tschechische Krone	US-Dollar	270.460.000	11.575.433	17-Sept.-20	UBS AG	(168.672)							
Ungarischer Forint	US-Dollar	3.012.000.000	9.969.549	17-Sept.-20	Citigroup Global Markets Limited	(417.451)							
Malaysischer Ringgit	US-Dollar	42.675.000	10.015.255	17-Sept.-20	Morgan Stanley	(91.449)							
Polnischer Zloty	US-Dollar	39.310.000	10.004.276	17-Sept.-20	HSBC Bank plc	(65.798)							
Polnischer Zloty	US-Dollar	16.220.000	4.125.389	17-Sept.-20	JPMorgan Chase Bank	(24.598)							
Thailändischer Baht	US-Dollar	177.760.000	5.750.890	17-Sept.-20	JPMorgan Chase Bank	(344)							
US-Dollar	Indische Rupie	1.123.550	85.810.000	17-Sept.-20	JPMorgan Chase Bank	(2.803)							
US-Dollar	Philippinischer Peso	843.301	42.300.000	17-Sept.-20	Barclays Bank PLC	(3.467)							
US-Dollar	Hongkong-Dollar	11.846.824	92.500.000	15-Jan.-21	JPMorgan Chase Bank	(68.254)							
						USD (1.812.325)							USD (22.241)
						Netto USD (273.281)							EUR (19.796)
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund							BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund						
Anteilsklasse EUR I (Hedged)							Anteilsklasse EUR I (Hedged)						
Euro	US-Dollar	1.819.191	2.066.658	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(22.178)	Euro	US-Dollar	1.819.191	2.066.658	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(22.178)
US-Dollar	Euro	45.609	40.639	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(63)	US-Dollar	Euro	45.609	40.639	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(63)
						USD (22.241)							EUR (19.796)
						Netto USD (22.241)							EUR (19.796)

150

BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT OPPORTUNISTIC FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %
Anleihen				Anleihen Forts.			
Argentinien - 290.506 (31. Dezember 2019: 424.346) 380.000 Argentine Republic Government International Bond 3,750 % 31-Dez.-2038 149.832 0,51 360.000 Argentine Republic Government International Bond 6,875 % 11-Jan.-2048 140.674 0,47				Kolumbien Forts. 1.630.000.000 Empresas Publicas de Medellin ESP 'REGS' 8,375 % 08-Nov.-2027 459.310 1,56 200.000 Millicom International Cellular SA 'REGS' 6,250 % 25-März-2029 213.963 0,72			
Aserbaidsschan - 230.526 (31. Dezember 2019: 237.491) 200.000 Southern Gas Corridor CJSC 'REGS' 6,875 % 24-März-2026 230.526 0,78				Dominikanische Republik - 136.425 (31. Dezember 2019: 167.116) 150.000 Dominican Republic International Bond 'REGS' 4,500 % 30-Jan.-2030 136.425 0,46			
Bahrain - 432.137 (31. Dezember 2019: 234.134) 200.000 Bahrain Government International Bond 'REGS' 6,750 % 20-Sept.-2029 219.610 0,74 200.000 CBB International Sukuk Programme Co SPC 'REGS' 6,250 % 14-Nov.-2024 212.527 0,72				Ecuador - 321.350 (31. Dezember 2019: 667.902) 200.000 Ecuador Government International Bond 'REGS' 9,500 % 27-März-2030 85.750 0,29 320.000 Ecuador Government International Bond 'REGS' 9,625 % 02-Jun.-2027 137.600 0,47 200.000 Ecuador Government International Bond 'REGS' 10,750 % 28-März-2022 98.000 0,33			
Brasilien - 1.810.476 (31. Dezember 2019: 2.099.197) 360.000 Aegea Finance Sarl 'REGS' 5,750 % 10-Okt.-2024 365.888 1,24 190.000 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,000 % 01-Jan.-2023 39.705 0,13 1.050.000 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,000 % 01-Jan.-2025 226.118 0,77 1.400.000 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,000 % 01-Jan.-2027 305.306 1,03 1.100.000 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,000 % 01-Jan.-2029 242.906 0,82 300.000 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,000 % 01-Jan.-2031 66.723 0,23 200.000 BRF SA 'REGS' 4,875 % 24-Jan.-2030 188.750 0,64 200.000 Cosan Ltd 'REGS' 5,500 % 20-Sept.-2029 189.952 0,64 210.000 Rede D'or Finance Sarl 'REGS' 4,500 % 22-Jan.-2030 185.128 0,63				Ägypten - 196.883 (31. Dezember 2019: 443.536) 200.000 Egypt Government International Bond 'REGS' 8,700 % 01-März-2049 196.883 0,67			
Chile - 1.613.657 (31. Dezember 2019: 758.161) 60.000.000 Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 4,500 % 01-März-2026 85.665 0,29 215.000.000 Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 5,000 % 01-März-2035 331.130 1,12 285.000.000 Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos '144A' 4,700 % 01-Sept.-2030 419.950 1,42 200.000 VTR Comunicaciones SpA 'REGS' 5,125 % 15-Jan.-2028 205.100 0,70 559.000 VTR Finance NV 'REGS' 6,875 % 15-Jan.-2024 571.812 1,94				El Salvador - 24.150 (31. Dezember 2019: 53.268) 28.000 El Salvador Government International Bond 'REGS' 6,375 % 18-Jan.-2027 24.150 0,08			
China - 1.078.760 (31. Dezember 2019: -) 1.000.000 China Government Bond 3,120 % 05-Dez.-2026 143.752 0,49 1.000.000 China Government Bond 3,250 % 06-Jun.-2026 145.393 0,49 3.870.000 China Government Bond 3,290 % 23-Mai-2029 562.815 1,90 200.000 Prosus NV 'REGS' 5,500 % 21-Jul.-2025 226.800 0,77				Georgien - 450.002 (31. Dezember 2019: 484.925) 460.000 Bank of Georgia JSC 'REGS' 6,000 % 26-Jul.-2023 450.002 1,52			
Kolumbien - 1.186.272 (31. Dezember 2019: 1.202.093) 346.100.000 Colombian TES 7,750 % 18-Sept.-2030 101.224 0,34 1.481.000.000 Empresas Publicas de Medellin ESP 'REGS' 7,625 % 10-Sept.-2024 411.775 1,40				Ghana - 371.640 (31. Dezember 2019: 382.180) 200.000 Ghana Government International Bond 'REGS' 7,625 % 16-Mai-2029 189.640 0,64 200.000 Ghana Government International Bond 'REGS' 7,875 % 11-Feb.-2035 182.000 0,62			
				Guatemala - 161.402 (31. Dezember 2019: 169.057) 160.000 Central American Bottling Corp 'REGS' 5,750 % 31-Jan.-2027 161.402 0,55			
				Indien - 198.279 (31. Dezember 2019: 370.051) 200.000 Export-Import Bank of India 'REGS' 3,250 % 15-Jan.-2030 198.279 0,67			
				Indonesien - 2.806.686 (31. Dezember 2019: 2.231.698) 250.000 Adaro Indonesia PT 'REGS' 4,250 % 31-Okt.-2024 237.187 0,80 2.294.000.000 Indonesia Treasury Bond 6,125 % 15-Mai-2028 150.808 0,51 5.160.000.000 Indonesia Treasury Bond 7,000 % 15-Mai-2027 362.302 1,23 1.930.000.000 Indonesia Treasury Bond 7,500 % 15-Aug.-2032 133.404 0,45 4.900.000.000 Indonesia Treasury Bond 7,500 % 15-Jun.-2035 339.690 1,15 1.064.000.000 Indonesia Treasury Bond 8,250 % 15-Jun.-2032 77.545 0,26 4.785.000.000 Indonesia Treasury Bond 8,250 % 15-Mai-2036 348.935 1,18			

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Nettovermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Nettovermögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
Indonesien Forts.				Oman - 187.000			
3.272.000.000	Indonesia Treasury Bond 8,375 % 15-Sept.-2026	247.490	0,84	(31. Dezember 2019: 230.314)		187.000	0,63
1.754.000.000	Indonesia Treasury Bond 8,375 % 15-März-2034	129.552	0,44	200.000	Oman Government International Bond 'REGS'		
1.615.000.000	Indonesia Treasury Bond 9,000 % 15-März-2029	125.514	0,43		6,000 % 01-Aug.-2029	187.000	0,63
1.527.000.000	Indonesia Treasury Bond 11,000 % 15-Sept.-2025	126.778	0,43	Pakistan - 197.740			
200.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 'REGS' 3,000 % 30-Jun.-2030	198.535	0,67	(31. Dezember 2019: -)		197.740	0,67
290.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 'REGS' 5,250 % 24-Okt.-2042	328.946	1,12	200.000	Pakistan Government International Bond 'REGS'		
Israel - 334.931					6,875 % 05-Dez.-2027	197.740	0,67
(31. Dezember 2019: 574.560)		334.931	1,13	Panama - 246.202			
280.000	ICL Group Ltd '144A' 6,375 % 31-Mai-2038	334.931	1,13	(31. Dezember 2019: -)		246.202	0,83
Elfenbeinküste - 212.194				200.000	Panama Government International Bond		
(31. Dezember 2019: 347.988)		212.194	0,72		4,500 % 01-Apr.-2056	246.202	0,83
200.000	Ivory Coast Government International Bond 'REGS'			Peru - 937.499			
	5,875 % 17-Okt.-2031	212.194	0,72	(31. Dezember 2019: 1.511.605)		937.499	3,18
Kasachstan - 332.425				400.000	Orazul Energy Egenor SCA 'REGS'		
(31. Dezember 2019: 411.292)		332.425	1,13		5,625 % 28-Apr.-2027	396.428	1,34
200.000	Development Bank of Kazakhstan JSC 'REGS'			560.000	Peru Government Bond '144A'		
	4,125 % 10-Dez.-2022	208.448	0,71		5,350 % 12-Aug.-2040	158.975	0,54
120.000	Kazakhstan Government International Bond 'REGS'			235.000	Peru Government Bond '144A'		
	1,500 % 30-Sept.-2034	123.977	0,42		5,940 % 12-Feb.-2029	76.670	0,26
Kenia - 198.308				945.000	Peru Government Bond '144A'		
(31. Dezember 2019: -)		198.308	0,67		6,150 % 12-Aug.-2032	305.426	1,04
200.000	Kenya Government International Bond 'REGS'			Polen - 815.570			
	7,250 % 28-Feb.-2028	198.308	0,67	(31. Dezember 2019: 758.667)		815.570	2,76
Malaysia - 668.989				1.675.000	Republic of Poland Government Bond		
(31. Dezember 2019: 842.151)		668.989	2,27		2,500 % 25-Jul.-2027	462.528	1,57
540.000	Malaysia Government Bond 3,885 % 15-Aug.-2029	136.011	0,46	1.240.000	Republic of Poland Government Bond		
280.000	Malaysia Government Bond 3,900 % 30-Nov.-2026	69.817	0,24		2,750 % 25-Okt.-2029	353.042	1,19
1.050.000	Malaysia Government Bond 4,181 % 15-Jul.-2024	261.535	0,89	Rumänien - 158.152			
415.000	Malaysia Government Bond 4,893 % 08-Jun.-2038	113.008	0,38	(31. Dezember 2019: 529.257)		158.152	0,54
330.000	Malaysia Government Bond 4,921 % 06-Jul.-2048	88.618	0,30	650.000	Romania Government Bond 4,750 % 24-Feb.-2025	158.152	0,54
Mexiko - 3.051.069				Russland - 3.194.068			
(31. Dezember 2019: 2.325.238)		3.051.069	10,33	(31. Dezember 2019: 2.773.141)		3.194.068	10,82
250.000	Axtel SAB de CV 'REGS' 6,375 % 14-Nov.-2024	260.281	0,88	245.000	Gazprom PJSC Via Gaz Capital SA		
4.850.000	Mexican Bonos 7,500 % 03-Jun.-2027	235.232	0,80		2,500 % 21-März-2026	283.295	0,96
5.800.000	Mexican Bonos 7,750 % 13-Nov.-2042	275.870	0,93	17.655.000	Russian Federal Bond - OFZ 7,000 % 16-Aug.-2023	264.415	0,90
14.650.000	Mexican Bonos 8,500 % 31-Mai-2029	755.092	2,56	84.540.000	Russian Federal Bond - OFZ 7,050 % 19-Jan.-2028	1.297.373	4,39
1.288.761	Mexican Udibonos 4,500 % 04-Dez.-2025	64.233	0,22	28.423.000	Russian Federal Bond - OFZ 7,700 % 23-März-2033	457.526	1,55
250.000	Orbia Advance Corp SAB de CV 'REGS'			9.800.000	Russian Federal Bond - OFZ 8,150 % 03-Feb.-2027	158.877	0,54
	5,875 % 17-Sept.-2044	276.076	0,93	200.000	Russian Foreign Bond - Eurobond 'REGS'		
120.000	Petroleos Mexicanos 5,625 % 23-Jan.-2046	85.458	0,29		5,250 % 23-Jun.-2047	264.500	0,90
65.000	Petroleos Mexicanos 6,500 % 23-Jan.-2029	56.774	0,19	200.000	Vnesheconombank Via VEB Finance Plc 'REGS'		
2.725.000	Petroleos Mexicanos 7,470 % 12-Nov.-2026	93.113	0,32		5,942 % 21-Nov.-2023	222.466	0,75
21.200.000	Petroleos Mexicanos 'REGS'			245.000	Vnesheconombank Via VEB Finance Plc 'REGS'		
	7,190 % 12-Sept.-2024	785.831	2,66		6,902 % 09-Jul.-2020	245.616	0,83
195.000	Petroleos Mexicanos 'REGS'			Saudi Arabien - 216.077			
	7,690 % 23-Jan.-2050	163.109	0,55	(31. Dezember 2019: -)		216.077	0,73
Nigeria - 190.900				200.000	Saudi Arabian Oil Co 'REGS' 3,500 % 16-Apr.-2029	216.077	0,73
(31. Dezember 2019: 486.337)		190.900	0,65	Senegal - 403.443			
200.000	Nigeria Government International Bond 'REGS'			(31. Dezember 2019: 627.392)		403.443	1,37
	6,500 % 28-Nov.-2027	190.900	0,65	395.000	Senegal Government International Bond 'REGS'		
					6,250 % 23-Mai-2033	403.443	1,37

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

				Angemessener Wert in USD		Summe der Netto- vermögen %	
Bestände	Beschreibung			Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %
Anleihen Forts.							
	Südafrika - 1.850.910 (31. Dezember 2019: 2.396.064)		1.850.910		6,27		
18.815.000	Republic of South Africa Government Bond 7,000 % 28-Feb.-2031		893.069		3,02		
8.650.000	Republic of South Africa Government Bond 8,750 % 28-Feb.-2048		393.207		1,33		
4.790.000	Republic of South Africa Government Bond 10,500 % 21-Dez.-2026		315.073		1,07		
4.260.000	Transnet SOC Ltd 'REGS' 9,500 % 13-Mai-2021		249.561		0,85		
	Spanien - 253.125 (31. Dezember 2019: -)		253.125		0,86		
250.000	Al Candelaria Spain SLU 'REGS' 7,500 % 15-Dez.-2028		253.125		0,86		
	Überstaatlich - 675.255 (31. Dezember 2019: 691.622)		675.255		2,29		
230.000	African Export-Import Bank/The 'REGS' 3,994 % 21-Sept.-2029		227.538		0,77		
245.000	Banque Ouest Africaine de Developpement 'REGS' 4,700 % 22-Okt.-2031		247.768		0,84		
14.700.000	International Finance Corp 'GMTN' 6,300 % 25-Nov.-2024		199.949		0,68		
	Thailand - 1.074.807 (31. Dezember 2019: 1.234.120)		1.074.807		3,64		
3.395.000	Thailand Government Bond 2,125 % 17-Dez.-2026		117.753		0,40		
7.250.000	Thailand Government Bond 3,400 % 17-Jun.-2036		293.749		0,99		
15.735.000	Thailand Government Bond 4,875 % 22-Jun.-2029		663.305		2,25		
	Türkei - 714.283 (31. Dezember 2019: 1.217.744)		714.283		2,42		
200.000	Türk Telekomunikasyon AS 'REGS' 6,875 % 28-Feb.-2025		211.350		0,72		
400.000	Turkey Government Bond 11,000 % 24-Feb.-2027		57.197		0,19		
200.000	Turkey Government International Bond 4,250 % 13-März-2025		186.952		0,63		
260.000	Turkey Government International Bond 5,750 % 22-März-2024		258.784		0,88		
	Ukraine - 606.288 (31. Dezember 2019: 516.840)		606.288		2,05		
200.000	MHP Lux SA 'REGS' 6,950 % 03-Apr.-2026		203.853		0,69		
115.000	Ukraine Government International Bond FRN 0,000 % 31-Mai-2040		106.775		0,36		
100.000	Ukraine Government International Bond 'REGS' 4,375 % 27-Jan.-2030		97.160		0,33		
200.000	VF Ukraine PAT via VFU Funding Plc 'REGS' 6,200 % 11-Feb.-2025		198.500		0,67		
	Vereinigte Arabische Emirate - 867.638 (31. Dezember 2019: 831.551)		867.638		2,94		
200.000	DP World Plc 'REGS' 6,850 % 02-Jul.-2037		244.750		0,83		
200.000	DP World Salaam FRN (Immerwährend) 6,000 % 01-Okt.-2025		198.524		0,67		
400.000	MDGH - GMTN BV 'REGS' 3,700 % 07-Nov.-2049		424.364		1,44		

Anleihen Forts.							
	USA - 19.998 (31. Dezember 2019: 19.912)		19.998		0,07		
20.000	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 30-Jul.-2020*		19.998		0,07		
	Uruguay - 101.806 (31. Dezember 2019: 56.218)		101.806		0,34		
1.060.000	Uruguay Government International Bond 3,875 % 02-Jul.-2040		25.216		0,08		
20.000	Uruguay Government International Bond 4,375 % 23-Jan.-2031		23.431		0,08		
2.445.000	Uruguay Government International Bond 'REGS' 8,500 % 15-März-2028		53.159		0,18		
Summe der Anlagen in Anleihen			28.817.828		97,61		
	Devisenoptionen - 2.328 (31. Dezember 2019: 47.933)						
300.000	US dollar/Mexican peso Put 09-Sept.-2020 21,350		1.139		0,00		
300.000	US dollar/Russian rouble Call 09-Sept.-2020 67,500		1.173		0,01		
290.000	US dollar/Russian rouble Put 31-Jul.-2020 62,500		16		0,00		
Summe der Devisenoptionen			2.328		0,01		
		Zugrunde liegendes Engagement in USD	Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %			
Bestände	Beschreibung						
	Offene Terminkontrakte - 250 (31. Dezember 2019: 4.666)						
1	U.S. 10 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Sep.-2020	139.172	250		0,00		
Summe der offenen Terminkontrakte			250		0,00		
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 134.312 (siehe unten) (31. Dezember 2019: 107.376)							
Summe der Vermögenswerte zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert			28.954.718		98,07		
	Devisenoptionen - (31.296) (31. Dezember 2019: (13.256))						
(300.000)	US dollar/Mexican peso Call 09-Sept.-2020 23,000		(10.830)		(0,04)		
(290.000)	US dollar/Russian rouble Call 31-Jul.-2020 68,200		(13.729)		(0,05)		
(300.000)	US dollar/Russian rouble Put 09-Sept.-2020 72,000		(6.737)		(0,02)		
Summe der Devisenoptionen			(31.296)		(0,11)		
		Zugrunde liegendes Engagement in USD	Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %			
Bestände	Beschreibung						
	Offene Terminkontrakte - (3.472) (31. Dezember 2019: (1.079))						
(3)	Euro-Bund Short Futures Contracts Exp Sep.-2020	(594.961)	(3.472)		(0,01)		
Summe der offenen Terminkontrakte			(3.472)		(0,01)		

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Nettovermögen %
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften - (siehe unten) (31. Dezember 2019: (172.735))	(150.817)	(0,51)
Summe der finanziellen Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert	(185.585)	(0,63)
Nettoumlaufvermögen	753.333	2,56
Summe der Nettovermögen	29.522.466	100,00
* Wird von Bank of America Merrill Lynch als Sicherheit im Zusammenhang mit den vom Fonds gehaltenen Futures gehalten. Die Gegenparteien für Währungsoptionen sind Bank of America Merrill Lynch, Citigroup Global Markets Limited und Goldman Sachs. Der Kontrahent für Terminkontrakte ist Bank of America Merrill Lynch.		

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	95,47
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,00
OTC-Finanzderivate	0,45
Sonstiges Umlaufvermögen	4,08
Summe der Aktiva	100,00

Devisenterminkontrakte							Nicht
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs-	Kontrahent	realisierter	
				datum		Gewinn/(Verlust)	
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund							
US-Dollar	Peruanischer Nuevo Sol	1.142.273	3.910.000	14-Jul.-20	Barclays Bank PLC	38.501	
US-Dollar	Euro	1.516.865	1.345.000	31-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	4.739	
US-Dollar	Chilenischer Peso	141.835	113.000.000	01-Sept.-20	HSBC Bank plc	4.142	
Indische Rupie	US-Dollar	6.200.000	81.179	17-Sept.-20	JPMorgan Chase Bank	203	
Thailändischer Baht	US-Dollar	4.630.000	149.571	17-Sept.-20	JPMorgan Chase Bank	210	
Türkische Lira	US-Dollar	750.000	107.043	17-Sept.-20	Citigroup Global Markets Limited	33	
Türkische Lira	US-Dollar	410.000	58.499	17-Sept.-20	JPMorgan Chase Bank	36	
Türkische Lira	US-Dollar	460.000	65.639	17-Sept.-20	Morgan Stanley	34	
US-Dollar	Chinesischer Yuan	440.971	3.120.000	17-Sept.-20	HSBC Bank plc	1.605	
US-Dollar	Indonesische Rupiah	605.501	8.739.200.000	17-Sept.-20	JPMorgan Chase Bank	12.800	
US-Dollar	Mexikanischer Peso	95.260	2.150.000	17-Sept.-20	Goldman Sachs	2.683	
US-Dollar	Mexikanischer Peso	853.767	19.293.523	17-Sept.-20	Morgan Stanley	23.004	
US-Dollar	Rumänischer Leu	98.094	420.000	17-Sept.-20	JPMorgan Chase Bank	1.018	
US-Dollar	Russischer Rubel	446.534	31.340.000	17-Sept.-20	JPMorgan Chase Bank	10.090	
US-Dollar	Südafrikanischer Rand	829.218	13.890.000	17-Sept.-20	Barclays Bank PLC	35.214	
USD						134.312	
Peruanischer Nuevo Sol	US-Dollar	1.410.000	416.421	14-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(18.385)	
Peruanischer Nuevo Sol	US-Dollar	1.020.000	295.678	14-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(7.738)	
Peruanischer Nuevo Sol	US-Dollar	480.000	141.135	14-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(5.634)	
Peruanischer Nuevo Sol	US-Dollar	490.000	143.737	14-Jul.-20	Barclays Bank PLC	(5.413)	
Peruanischer Nuevo Sol	US-Dollar	140.000	40.960	14-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(1.439)	
Peruanischer Nuevo Sol	US-Dollar	150.000	43.924	14-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(1.580)	
Brasilianischer Real	US-Dollar	2.650.000	490.795	04-Aug.-20	Citigroup Global Markets Limited	(4.334)	
Chilenischer Peso	US-Dollar	164.870.000	214.100	01-Sept.-20	Citigroup Global Markets Limited	(13.202)	
Chilenischer Peso	US-Dollar	356.020.000	461.435	01-Sept.-20	Barclays Bank PLC	(27.616)	
US-Dollar	Taiwanesischer Dollar	300.852	9.000.000	08-Sept.-20	Barclays Bank PLC	(4.305)	
US-Dollar	Taiwanesischer Dollar	265.177	7.880.000	08-Sept.-20	JPMorgan Chase Bank	(2.005)	
Kolumbianischer Peso	US-Dollar	546.595.000	147.445	17-Sept.-20	Citigroup Global Markets Limited	(2.941)	
Tschechische Krone	US-Dollar	3.780.000	161.504	17-Sept.-20	Bank of America Securities Ltd	(2.081)	
Tschechische Krone	US-Dollar	19.800.000	847.421	17-Sept.-20	UBS AG	(12.348)	
Tschechische Krone	US-Dollar	2.740.000	117.094	17-Sept.-20	Barclays Bank PLC	(1.534)	
Tschechische Krone	US-Dollar	3.690.000	157.769	17-Sept.-20	Morgan Stanley	(2.141)	
Ungarischer Forint	US-Dollar	40.500.000	134.053	17-Sept.-20	Citigroup Global Markets Limited	(5.613)	
Ungarischer Forint	US-Dollar	123.440.000	408.520	17-Sept.-20	UBS AG	(17.049)	
Malaysischer Ringgit	US-Dollar	1.365.000	320.347	17-Sept.-20	Morgan Stanley	(2.925)	
Polnischer Zloty	US-Dollar	1.290.000	328.301	17-Sept.-20	HSBC Bank plc	(2.159)	
Polnischer Zloty	US-Dollar	2.780.000	707.064	17-Sept.-20	JPMorgan Chase Bank	(4.216)	
Thailändischer Baht	US-Dollar	3.760.000	121.643	17-Sept.-20	JPMorgan Chase Bank	(7)	
US-Dollar	Philippinischer Peso	121.711	6.105.000	17-Sept.-20	Barclays Bank PLC	(500)	
US-Dollar	Hongkong-Dollar	981.045	7.660.000	15-Jan.-21	JPMorgan Chase Bank	(5.652)	
USD						(150.817)	
Netto USD						(16.505)	

BNY MELLON EMERGING MARKETS DEBT TOTAL RETURN FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen				Anleihen Forts.			
Irland - 9.750.123 (31. Dezember 2019: 4.800.000)				Costa Rica - 1.734.500 (31. Dezember 2019: 1.709.496)			
9.750.123	Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	9.750.123	5,07	2.000.000	Costa Rica Government International Bond 'REGS' 6,125 % 19-Feb.-2031	1.734.500	0,90
Summe der Anlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen 9.750.123 5,07				Elfenbeinküste - 2.705.480 (31. Dezember 2019: 3.794.684)			
Anleihen				2.550.000	Ivory Coast Government International Bond 'REGS' 5,875 % 17-Okt.-2031	2.705.480	1,41
Angola - 1.723.901 (31. Dezember 2019: 3.926.750)				Dominikanische Republik - 5.608.586 (31. Dezember 2019: 3.707.886)			
700.000	Angolan Government International Bond 'REGS' 8,000 % 26-Nov.-2029	578.900	0,30	600.000	Dominican Republic International Bond 'REGS' 6,000 % 19-Jul.-2028	605.736	0,32
1.400.000	Angolan Government International Bond 'REGS' 9,375 % 08-Mai-2048	1.145.001	0,60	1.300.000	Dominican Republic International Bond 'REGS' 6,400 % 05-Jun.-2049	1.196.000	0,62
Argentinien - 2.045.568 (31. Dezember 2019: 2.035.050)				4.100.000	Dominican Republic International Bond 'REGS' 6,500 % 15-Feb.-2048	3.806.850	1,98
4.280.000	Argentine Republic Government International Bond 7,625 % 22-Apr.-2046	1.674.785	0,87	Ecuador - 2.045.087 (31. Dezember 2019: 2.610.991)			
500.000	YPF SA 'REGS' 8,500 % 27-Jun.-2029	370.783	0,19	2.500.000	Ecuador Government International Bond 'REGS' 7,775 % 23-Jan.-2028	1.037.525	0,54
Weißrussland - 3.341.003 (31. Dezember 2019: -)				2.350.000	Ecuador Government International Bond 'REGS' 9,500 % 27-März-2030	1.007.562	0,52
1.554.000	Republic of Belarus Ministry of Finance 'REGS' 5,875 % 24-Feb.-2026	1.509.944	0,79	Ägypten - 7.432.467 (31. Dezember 2019: 8.187.045)			
1.892.000	Republic of Belarus Ministry of Finance 'REGS' 6,378 % 24-Feb.-2031	1.831.059	0,95	1.350.000	Egypt Government International Bond 'REGS' 5,750 % 29-Mai-2024	1.356.001	0,71
Brasilien - 13.479.600 (31. Dezember 2019: 12.590.649)				1.100.000	Egypt Government International Bond 'REGS' 5,875 % 11-Jun.-2025	1.111.000	0,58
1.795.000	Braskem Netherlands Finance BV 'REGS' 4,500 % 31-Jan.-2030	1.645.566	0,86	2.600.000	Egypt Government International Bond 'REGS' 7,625 % 29-Mai-2032	2.544.334	1,32
6.000.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,000 % 01-Jan.-2023	1.253.829	0,65	900.000	Egypt Government International Bond 'REGS' 8,875 % 29-Mai-2050	891.747	0,46
22.000.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,000 % 01-Jan.-2025	4.737.712	2,47	25.000.000	Egypt Treasury Bills (Null-Coupon) 0,000 % 18-Aug.-2020	1.529.385	0,80
12.000.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,000 % 01-Jan.-2027	2.616.909	1,36	El Salvador - 1.035.012 (31. Dezember 2019: -)			
925.000	Petrobras Global Finance BV 5,600 % 03-Jan.-2031	929.972	0,48	1.200.000	El Salvador Government International Bond 'REGS' 6,375 % 18-Jan.-2027	1.035.012	0,54
900.000	Petrobras Global Finance BV 6,750 % 03-Jun.-2050	927.900	0,48	Hongkong - 816.298 (31. Dezember 2019: -)			
1.375.000	Petrobras Global Finance BV 6,850 % 05-Jun.-2115	1.367.712	0,71	800.000	CK Hutchison International 20 Ltd 'REGS' 2,500 % 08-Mai-2030	816.298	0,42
Chile - 8.440.555 (31. Dezember 2019: 7.770.825)				Ungarn - 1.324.891 (31. Dezember 2019: -)			
3.240.000.000	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 4,500 % 01-März-2026	4.625.912	2,41	1.200.000	Hungary Government International Bond 1,750 % 05-Jun.-2035	1.324.891	0,69
1.900.000	Colbun SA 'REGS' 3,150 % 06-März-2030	1.924.700	1,00	Indonesien - 19.740.776 (31. Dezember 2019: 10.807.256)			
1.080.000	Kenbourne Invest SA 'REGS' 6,875 % 26-Nov.-2024	1.095.865	0,57	1.810.000	Indonesia Government International Bond 3,850 % 15-Okt.-2030	2.017.973	1,05
770.000	VTR Finance NV 'REGS' 6,375 % 15-Jul.-2028	794.078	0,41	1.400.000	Indonesia Government International Bond 'REGS' 4,125 % 15-Jan.-2025	1.523.650	0,79
China - 1.304.448 (31. Dezember 2019: 6.010.096)				26.536.000.000	Indonesia Treasury Bond 6,125 % 15-Mai-2028	1.744.484	0,91
900.000	Tencent Holdings Ltd 'REGS' 2,390 % 03-Jun.-2030	902.317	0,47	Kolumbien - 8.562.809 (31. Dezember 2019: 6.100.899)			
400.000	Tencent Holdings Ltd 'REGS' 3,240 % 03-Jun.-2050	402.131	0,21	2.800.000	Colombia Government International Bond 4,125 % 15-Mai-2051	2.819.600	1,46
Kolumbien - 8.562.809 (31. Dezember 2019: 6.100.899)				14.400.000.000	Colombian TES 6,000 % 28-Apr.-2028	3.902.428	2,03
2.800.000	Colombia Government International Bond 4,125 % 15-Mai-2051	2.819.600	1,46	1.750.000	Grupo Energia Bogota SA ESP 'REGS' 4,875 % 15-Mai-2030	1.840.781	0,96

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Nettovermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Nettovermögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
Indonesien Forts.				Mexiko Forts.			
10.500.000.000	Indonesia Treasury Bond 7,000 % 15-Mai-2027	737.242	0,38	1.700.000	Mexico Government International Bond 3,250 % 16-Apr.-2030	1.686.298	0,88
10.148.000.000	Indonesia Treasury Bond 7,500 % 15-Mai-2038	698.958	0,36	3.500.000	Mexico Government International Bond 3,900 % 27-Apr.-2025	3.753.750	1,95
63.000.000.000	Indonesia Treasury Bond 8,125 % 15-Mai-2024	4.668.218	2,43	700.000	Mexico Government International Bond 5,000 % 27-Apr.-2051	756.700	0,39
25.000.000.000	Indonesia Treasury Bond 8,250 % 15-Mai-2029	1.868.744	0,97	300.000	Orbia Advance Corp SAB de CV 'REGS'		
14.700.000.000	Indonesia Treasury Bond 8,375 % 15-Sept.-2026	1.111.890	0,58		5,500 % 15-Jan.-2048	316.288	0,17
18.000.000.000	Indonesia Treasury Bond 9,000 % 15-März-2029	1.398.922	0,73	1.489.000	Petroleos Mexicanos 'REGS' 6,840 % 23-Jan.-2030	1.313.194	0,68
4.000.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 'REGS' 3,000 % 30-Jun.-2030	3.970.695	2,07				
Kasachstan - 2.898.907 (31. Dezember 2019: 940.610)				Moldawien - 1.358.500 (31. Dezember 2019: 1.391.000)			
163.000.000	Development Bank of Kazakhstan JSC 9,500 % 14-Dez.-2020	388.614	0,20	1.300.000	Aragvi Finance International DAC 'REGS'		
210.000.000	Development Bank of Kazakhstan JSC 'REGS' 8,950 % 04-Mai-2023	467.068	0,25		12,000 % 09-Apr.-2024	1.358.500	0,71
1.800.000	KazMunayGas National Co JSC 'REGS' 5,375 % 24-Apr.-2030	2.043.225	1,06				
Kenia - 3.690.446 (31. Dezember 2019: 2.793.827)				Peru - 5.128.273 (31. Dezember 2019: 1.528.450)			
1.000.000	Kenya Government International Bond 'REGS' 6,875 % 24-Jun.-2024	1.018.675	0,53	1.390.000	Banco de Credito del Peru 'REGS' FRN 3,125 % 01-Jul.-2030	1.383.397	0,72
1.200.000	Kenya Government International Bond 'REGS' 8,000 % 22-Mai-2032	1.188.384	0,62	5.000.000	Peru Government Bond '144A' 5,400 % 12-Aug.-2034	1.490.400	0,78
1.500.000	Kenya Government International Bond 'REGS' 8,250 % 28-Feb.-2048	1.483.387	0,77	2.500.000	Peruvian Government International Bond 'REGS' 5,940 % 12-Feb.-2029	813.961	0,42
				500.000	Peruvian Government International Bond 'REGS' 6,850 % 12-Feb.-2042	166.792	0,09
Kuwait - 2.494.074 (31. Dezember 2019: -)				3.700.000	Peruvian Government International Bond 'REGS' 6,950 % 12-Aug.-2031	1.273.723	0,66
2.200.000	MEGlobal Canada ULC 'REGS' 5,875 % 18-Mai-2030	2.494.074	1,30				
Libanon - 303.582 (31. Dezember 2019: -)				Polen - 2.618.008 (31. Dezember 2019: 2.594.683)			
400.000	Lebanon Government International Bond (Defaulted) 8,200 % 17-Mai-2033	67.400	0,04	9.200.000	Republic of Poland Government Bond 3,250 % 25-Jul.-2025	2.618.008	1,36
400.000	Lebanon Government International Bond (Defaulted) 8,250 % 17-Mai-2034	67.200	0,03				
600.000	Lebanon Government International Bond 'GMTN' (Defaulted) 7,000 % 20-März-2028	100.782	0,05	Qatar - 5.347.918 (31. Dezember 2019: 2.459.604)			
400.000	Lebanon Government International Bond 'GMTN' (Defaulted) 7,150 % 20-Nov.-2031	68.200	0,04	3.750.000	Qatar Government International Bond 'REGS'		
					4,000 % 14-März-2029	4.322.396	2,25
Macao - 1.857.060 (31. Dezember 2019: -)				1.000.000	QNB Finance Ltd 'EMTN' 2,625 % 12-Mai-2025	1.025.522	0,53
1.800.000	Sands China Ltd 'REGS' 3,800 % 08-Jan.-2026	1.857.060	0,97				
Mexiko - 24.468.222 (31. Dezember 2019: 13.763.077)				Republik Korea - 1.067.056 (31. Dezember 2019: -)			
700.000	Braskem Idesa SAPI 'REGS' 7,450 % 15-Nov.-2029	656.467	0,34	1.000.000	Shinhan Bank Co Ltd 'REGS' 3,750 % 20-Sept.-2027	1.067.056	0,55
200.000	Cemex SAB de CV 'REGS' 7,375 % 05-Jun.-2027	203.700	0,11				
800.000	Credito Real SAB de CV SOFOM ER 'REGS'			Rumänien - 5.082.459 (31. Dezember 2019: -)			
	9,500 % 07-Feb.-2026	820.372	0,43	1.162.000	Romanian Government International Bond 'REGS'		
93.900.000	Mexican Bonos 5,750 % 05-März-2026	4.197.668	2,18		2,000 % 28-Jan.-2032	1.221.610	0,64
37.030.000	Mexican Bonos 7,750 % 29-Mai-2031	1.822.219	0,95	1.550.000	Romanian Government International Bond 'REGS'		
35.000.000	Mexican Bonos 8,000 % 07-Dez.-2023	1.679.016	0,87		2,750 % 26-Feb.-2026	1.815.698	0,94
74.000.000	Mexican Bonos 8,500 % 31-Mai-2029	3.814.117	1,99	700.000	Romanian Government International Bond 'REGS'		
32.310.000	Mexican Bonos 10,000 % 05-Dez.-2024	1.692.738	0,88		3,375 % 28-Jan.-2050	766.966	0,40
1.600.000	Mexico Government International Bond 1,625 % 08-Apr.-2026	1.755.695	0,91	1.050.000	Romanian Government International Bond 'REGS'		
					3,624 % 26-Mai-2030	1.278.185	0,66
				Russland - 11.282.923 (31. Dezember 2019: 11.942.012)			
				42.800.000	Russian Federal Bond - OFZ 7,000 % 25-Jan.-2023	636.093	0,33
				222.000.000	Russian Federal Bond - OFZ 7,150 % 12-Nov.-2025	3.397.995	1,77
				150.000.000	Russian Federal Bond - OFZ 7,400 % 17-Jul.-2024	2.294.846	1,19
				310.000.000	Russian Federal Bond - OFZ 7,950 % 07-Okt.-2026	4.953.989	2,58

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Nettovermögen %	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Nettovermögen %
Anleihen Forts.				Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 1.229.122 (siehe unten) (31. Dezember 2019: 2.147.691)		
	Saudi Arabien - 3.839.393				1.229.122	0,64
	(31. Dezember 2019: 674.205)	3.839.393	2,00			
2.229.000	Dar Al-Arkan Sukuk Co Ltd 6,875 % 26-Feb.-2027	1.880.162	0,98	Summe der Vermögenswerte zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert	196.700.666	102,33
1.700.000	Saudi Government International Bond 'REGS' 4,500 % 22-Apr.-2060	1.959.231	1,02			
	Südafrika - 6.923.675			Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften - (5.803.453) (siehe unten) (31. Dezember 2019: (1.735.918))		
	(31. Dezember 2019: 4.060.008)	6.923.675	3,60		(5.803.453)	(3,02)
300.000	Eskom Holdings SOC Ltd 'REGS' 8,450 % 10-Aug.-2028	281.438	0,15	Summe der finanziellen Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert	(5.803.453)	(3,02)
38.000.000	Republic of South Africa Government Bond 8,875 % 28-Feb.-2035	1.884.894	0,98	Nettoumlaufvermögen	1.319.753	0,69
72.325.032	Republic of South Africa Government Bond 10,500 % 21-Dez.-2026	4.757.343	2,47	Summe der Nettovermögen	192.216.966	100,00
	Überstaatlich - 1.879.661					
	(31. Dezember 2019: -)	1.879.661	0,98	Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens	
1.900.000	African Export-Import Bank/The 'REGS' 3,994 % 21-Sept.-2029	1.879.661	0,98	An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		94,73
	Tansania - 862.712			OTC-Finanzderivate		0,60
	(31. Dezember 2019: -)	862.712	0,45	Sonstiges Umlaufvermögen		4,67
850.000	HTA Group Ltd/Mauritius 'REGS' 7,000 % 18-Dez.-2025	862.712	0,45	Summe der Aktiva		100,00
	Thailand - 4.955.437					
	(31. Dezember 2019: 5.396.007)	4.955.437	2,58			
1.900.000	PTTEP Treasury Center Co Ltd 'REGS' 2,587 % 10-Jun.-2027	1.947.266	1,01			
76.802.000	Thailand Government Bond 2,125 % 17-Dez.-2026	2.663.816	1,39			
9.026.000	Thailand Government Bond 3,580 % 17-Dez.-2027	344.355	0,18			
	Tunesien - 2.632.784					
	(31. Dezember 2019: -)	2.632.784	1,37			
1.800.000	Banque Centrale de Tunisie International Bond 5,625 % 17-Feb.-2024	1.868.101	0,97			
750.000	Banque Centrale de Tunisie International Bond 'REGS' 6,375 % 15-Jul.-2026	764.683	0,40			
	Ukraine - 5.424.018					
	(31. Dezember 2019: 7.071.848)	5.424.018	2,82			
9.000.000	Ukraine Government Bond 18,000 % 24-März-2021	358.983	0,19			
1.700.000	Ukraine Government International Bond 'REGS' 7,750 % 01-Sept.-2025	1.779.567	0,92			
800.000	Ukraine Government International Bond 'REGS' 8,994 % 01-Feb.-2024	861.843	0,45			
1.600.000	Ukraine Government International Bond 'REGS' 9,750 % 01-Nov.-2028	1.828.125	0,95			
600.000	VF Ukraine PAT via VFU Funding Plc 'REGS' 6,200 % 11-Feb.-2025	595.500	0,31			
	Vereinigte Arabische Emirate - 10.265.332					
	(31. Dezember 2019: 1.022.540)	10.265.332	5,34			
3.900.000	Abu Dhabi Government International Bond 'REGS' 2,500 % 30-Sept.-2029	4.098.003	2,13			
1.400.000	DP World Crescent Ltd 'REGS' 3,908 % 31-Mai-2023	1.457.960	0,76			
950.000	DP World Plc 'REGS' 4,700 % 30-Sept.-2049	937.413	0,49			
3.800.000	DP World Salaam FRN (Immerwährend) 6,000 % 01-Okt.-2025	3.771.956	1,96			
	Summe der Anlagen in Anleihen	185.721.421	96,62			

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte							Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund							BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund Forts.						
US-Dollar	Brasilianischer Real	2.987.078	16.042.551	02-Jul.-20	Goldman Sachs	37.049	Südafrikanischer Rand	US-Dollar	49.224.000	2.961.619	27-Jul.-20	Morgan Stanley	(133.244)
US-Dollar	Brasilianischer Real	1.845.887	9.716.011	02-Jul.-20	BNP Paribas	59.232	Südafrikanischer Rand	US-Dollar	16.400.000	947.415	27-Jul.-20	Bank of America Merrill Lynch	(5.083)
Russischer Rubel	US-Dollar	77.600.000	1.051.935	17-Jul.-20	Barclays Bank PLC	36.135	Südafrikanischer Rand	US-Dollar	15.079.000	867.813	27-Jul.-20	Goldman Sachs	(1.384)
US-Dollar	Chilenischer Peso	2.443.793	2.000.000.000	17-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	8.191	Südafrikanischer Rand	US-Dollar	30.842.000	1.827.469	27-Jul.-20	Bank of America Merrill Lynch	(55.311)
US-Dollar	Peruanischer Nuevo Sol	2.710.422	9.300.000	17-Jul.-20	BNP Paribas	85.231	US-Dollar	Euro	2.828.831	2.594.000	27-Jul.-20	BNP Paribas	(87.223)
Tschechische Krone	US-Dollar	62.341.000	2.440.108	27-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	188.163	US-Dollar	Euro	1.868.027	1.665.000	27-Jul.-20	Natwest Markets Plc	(3.689)
Ungarischer Forint	US-Dollar	697.393.000	2.120.474	27-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	91.589	US-Dollar	Euro	1.774.029	1.579.000	27-Jul.-20	Natwest Markets Plc	(1.010)
Polnischer Zloty	US-Dollar	12.506.000	2.952.855	27-Jul.-20	BNP Paribas	208.445	US-Dollar	Euro	1.308.702	1.168.000	27-Jul.-20	Natwest Markets Plc	(4.309)
Rumänischer Leu	US-Dollar	779.000	172.650	27-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	8.008	US-Dollar	Euro	8.681.152	8.000.000	27-Jul.-20	Bank of America Merrill Lynch	(312.076)
Südafrikanischer Rand	US-Dollar	5.226.000	299.145	27-Jul.-20	Bank of America Merrill Lynch	1.137	US-Dollar	Mexikanischer Peso	4.099.000	100.666.000	27-Jul.-20	Barclays Bank PLC	(265.097)
Thailändischer Baht	US-Dollar	43.900.000	1.396.533	27-Jul.-20	Goldman Sachs	23.720	US-Dollar	Südafrikanischer Rand	5.130.127	96.294.000	27-Jul.-20	RBC Capital Markets	(402.855)
Thailändischer Baht	US-Dollar	63.263.000	1.969.129	27-Jul.-20	UBS AG	77.555							
US-Dollar	Mexikanischer Peso	2.937.543	64.183.733	27-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	155.034							
US-Dollar	Mexikanischer Peso	2.585.307	58.321.862	27-Jul.-20	BNP Paribas	56.924							USD (2.583.975)
US-Dollar	Mexikanischer Peso	1.254.430	28.900.000	27-Jul.-20	BNP Paribas	1.550							
US-Dollar	Südafrikanischer Rand	1.916.008	32.461.063	27-Jul.-20	Morgan Stanley	50.820							Netto USD (1.363.117)
US-Dollar	Südafrikanischer Rand	927.525	15.659.467	27-Jul.-20	Bank of America Merrill Lynch	27.743							
US-Dollar	Südafrikanischer Rand	1.108.273	19.272.492	27-Jul.-20	Bank of America Merrill Lynch	890							
US-Dollar	Südafrikanischer Rand	1.996.397	34.449.000	27-Jul.-20	Goldman Sachs	16.983							
US-Dollar	Brasilianischer Real	3.344.979	17.750.800	04-Aug.-20	Goldman Sachs	86.459							
						USD 1.220.858							
Südafrikanischer Rand	US-Dollar	34.449.000	2.002.046	01-Jul.-20	Goldman Sachs	(16.799)							
Brasilianischer Real	US-Dollar	17.750.800	3.348.576	02-Jul.-20	Goldman Sachs	(84.421)							
Brasilianischer Real	US-Dollar	8.000.000	1.562.980	02-Jul.-20	BNP Paribas	(91.878)							
Brasilianischer Real	US-Dollar	9.624.625	1.898.015	02-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(128.164)							
US-Dollar	Brasilianischer Real	1.765.696	9.616.863	02-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(2.727)							
Chilenischer Peso	US-Dollar	730.000.000	930.041	17-Jul.-20	Goldman Sachs	(41.046)							
Chilenischer Peso	US-Dollar	1.100.000.000	1.354.063	17-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(14.482)							
Chilenischer Peso	US-Dollar	1.750.000.000	2.148.359	17-Jul.-20	BNP Paribas	(17.207)							
Chilenischer Peso	US-Dollar	450.000.000	548.499	17-Jul.-20	BNP Paribas	(489)							
Chilenischer Peso	US-Dollar	449.000.000	547.456	17-Jul.-20	HSBC Bank plc	(664)							
Kolumbianischer Peso	US-Dollar	3.500.000.000	935.169	17-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(5.065)							
Kolumbianischer Peso	US-Dollar	3.500.000.000	935.744	17-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(5.640)							
Kolumbianischer Peso	US-Dollar	3.500.000.000	934.809	17-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(4.705)							
US-Dollar	Chilenischer Peso	6.235.636	5.141.843.000	17-Jul.-20	Barclays Bank PLC	(26.106)							
US-Dollar	Kolumbianischer Peso	1.194.754	4.683.675.628	17-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(49.904)							
US-Dollar	Indonesische Rupiah	5.170.795	78.585.737.380	17-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(270.325)							
US-Dollar	Indonesische Rupiah	2.232.334	33.900.000.000	17-Jul.-20	Bank of America Merrill Lynch	(114.834)							
US-Dollar	Russischer Rubel	7.359.648	544.945.162	17-Jul.-20	Goldman Sachs	(281.313)							
Euro	US-Dollar	1.000.000	1.139.737	27-Jul.-20	BNP Paribas	(15.584)							
Euro	US-Dollar	765.000	861.182	27-Jul.-20	BNP Paribas	(1.205)							
Euro	US-Dollar	240.000	270.078	27-Jul.-20	Natwest Markets Plc	(281)							
Euro	US-Dollar	1.900.000	2.145.070	27-Jul.-20	Bank of America Merrill Lynch	(9.178)							
Mexikanischer Peso	US-Dollar	7.722.000	341.536	27-Jul.-20	BNP Paribas	(6.770)							
Mexikanischer Peso	US-Dollar	41.889.073	1.859.461	27-Jul.-20	BNP Paribas	(43.476)							
Mexikanischer Peso	US-Dollar	41.889.073	1.861.623	27-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(45.638)							
Südafrikanischer Rand	US-Dollar	31.910.348	1.868.338	27-Jul.-20	BNP Paribas	(34.793)							

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte Forts.

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

BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund

Anteilsklasse Sterling E (Inc) (Hedged) Forts.

Sterling	US-Dollar	1.649	2.055	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(12)
Sterling	US-Dollar	7.500.000	9.429.072	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(134.960)
Sterling	US-Dollar	1.200	1.528	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(41)
Sterling	US-Dollar	96.656.230	122.850.819	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(3.072.967)
US-Dollar	Sterling	9.270	7.500	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(24)

USD (3.208.004)

GBP (2.588.978)

Netto USD (3.200.156)

Netto GBP (2.582.644)

BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund

Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)

US-Dollar	Sterling	39.193	31.292	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	416
						USD 416
						GBP 336

Sterling	US-Dollar	320.658	407.559	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(10.195)
						USD (10.195)
						GBP (8.228)
						Netto USD (9.779)
						Netto GBP (7.892)

BNY MELLON EUROLAND BOND FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in EUR	Summe der Netto- vermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in EUR	Summe der Netto- vermögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen				Anleihen Forts.			
Irland - 15.454.797 (31. Dezember 2019: 30.612.679)				Frankreich - 91.419.495 (31. Dezember 2019: 163.890.704)			
5.087.338	BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund ^	4.806.138	0,89	7.000.000	Airbus SE 2,000 % 07-Apr.-2028	7.392.140	1,38
2.576.582	BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund ^	2.235.100	0,42	4.100.000	AXA SA 'EMTN' FRN (Immerwährend)		
7.976.912	BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund ^	8.413.559	1,57		3,875 % 08-Okt.-2025	4.476.540	0,83
Summe der Anlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen 15.454.797 2,88				5.030.000	BNP Paribas SA 'EMTN' 1,125 % 10-Okt.-2023	5.131.909	0,96
Anleihen				2.000.000	BNP Paribas SA 'EMTN' 1,375 % 28-Mai-2029	2.088.328	0,39
Australien - 3.435.880 (31. Dezember 2019: 11.016.548)				4.200.000	Credit Agricole SA/London 'EMTN'		
2.241.749	Driver Australia Five Trust 1,020 % 21-Jul.-2026	1.375.236	0,26		1,750 % 05-März-2029	4.524.998	0,84
3.385.000	Queensland Treasury Corp '144A'	2.060.644	0,38	1.400.000	Engie SA 'EMTN' 1,750 % 27-März-2028	1.515.836	0,28
Belgien - 19.652.289				2.400.000	Engie SA FRN (Immerwährend) 1,375 % 16-Jan.-2023	2.339.736	0,44
4.300.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV	5.247.118	0,98	3.800.000	Engie SA FRN (Immerwährend) 3,875 % 02-Jun.-2024	4.061.902	0,76
2.250.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN'			14.609.203	French Republic Government Bond OAT '144A'		
	1,650 % 28-März-2031	2.324.894	0,43		0,700 % 25-Jul.-2030	17.103.724	3,19
9.425.000	Kingdom of Belgium Government Bond '144A'	12.080.277	2,25	4.100.000	Orange SA 'EMTN' 0,000 % 04-Sept.-2026	3.999.489	0,74
	1,900 % 22-Jun.-2038			3.800.000	Orange SA 'EMTN' 1,625 % 07-Apr.-2032	4.133.925	0,77
Brasilien - 1.719.714				2.000.000	Orange SA 'EMTN' FRN (Immerwährend)		
2.000.000	Brazilian Government International Bond	1.719.714	0,32		5,000 % 01-Okt.-2026	2.323.258	0,43
	3,875 % 12-Jun.-2030			1.200.000	Sanofi 'EMTN' 1,000 % 01-Apr.-2025	1.253.010	0,23
Kanada - 904.289				4.300.000	Sanofi 'EMTN' 1,500 % 01-Apr.-2030	4.775.795	0,89
475.000	Nutrien Ltd 1,900 % 13-Mai-2023	436.600	0,08	7.100.000	Societe Du Grand Paris EPIC 'EMTN'		
480.000	Teck Resources Ltd 6,250 % 15-Jul.-2041	467.689	0,09		1,700 % 25-Mai-2050	8.786.962	1,64
Chile - 593.302				2.500.000	Societe Generale SA 'EMTN' 1,000 % 01-Apr.-2022	2.522.870	0,47
650.000	VTR Comunicaciones SpA 'REGS'	593.302	0,11	4.800.000	Societe Generale SA 'EMTN' 1,125 % 23-Jan.-2025	4.843.864	0,90
	5,125 % 15-Jan.-2028			2.900.000	Total Capital International SA 'EMTN'		
Kroatien - 1.837.123					1,994 % 08-Apr.-2032	3.263.530	0,61
850.000	Croatia Government International Bond	851.751	0,16	3.765.000	TOTAL SA 'EMTN' FRN (Immerwährend)		
	1,500 % 17-Jun.-2031				1,750 % 04-Apr.-2024	3.722.769	0,69
875.000	Croatia Government International Bond	985.372	0,18	3.000.000	Veolia Environnement SA 'EMTN'		
	2,750 % 27-Jan.-2030				1,250 % 15-Apr.-2028	3.158.910	0,59
Zypern - 9.176.742				Deutschland - 33.576.522			
1.265.000	Cyprus Government International Bond 'EMTN'	1.238.365	0,23	3.900.000	Allianz SE 'EMTN' FRN (Immerwährend)		
4.125.000	Cyprus Government International Bond 'EMTN'	4.618.680	0,86		4,750 % 24-Okt.-2023	4.291.436	0,80
2.680.000	Cyprus Government International Bond 'EMTN'	3.319.697	0,62	3.600.000	Allianz SE FRN 5,625 % 17-Okt.-2042	3.962.074	0,74
	2,750 % 03-Mai-2049			3.800.000	Allianz SE FRN (Immerwährend)		
Estland - 1.504.470					3,375 % 18-Sept.-2024	4.037.086	0,75
1.500.000	Estonia Government International Bond	1.504.470	0,28	2.235.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe		
	0,125 % 10-Jun.-2030				2,500 % 15-Aug.-2046	3.754.275	0,70
Griechenland - 5.593.989				3.000.000	Daimler AG 'EMTN' 1,000 % 15-Nov.-2027	2.910.581	0,54
500.000	Hellenic Republic Government Bond '144A'			3.675.000	E.ON SE 'EMTN' 1,000 % 07-Okt.-2025	3.811.177	0,71
	1,500 % 18-Jun.-2030	514.898	0,09	3.970.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 'EMTN'		
4.725.000	Hellenic Republic Government Bond '144A'	5.079.091	0,95		0,375 % 23-Apr.-2030	4.206.133	0,78
	2,000 % 22-Apr.-2027			4.300.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 'EMTN'		
Ungarn - 3.444.113					0,250 % 20-Feb.-2029	4.242.423	0,79
2.275.000	Hungary Government International Bond	2.290.151	0,42	2.300.000	Volkswagen International Finance NV		
	1,625 % 28-Apr.-2032				1,875 % 30-März-2027	2.361.337	0,44

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in EUR	Summe der Nettovermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in EUR	Summe der Nettovermögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
Ungarn Forts.				Kasachstan - 324.685			
150.000	Hungary Government International Bond				(31. Dezember 2019: 5.969.672)	324.685	0,06
	1,750 % 05-Jun.-2035	147.407	0,03	350.000	Development Bank of Kazakhstan JSC 'REGS'		
1.000.000	MFB Magyar Fejlesztési Bank Zrt				4,125 % 10-Dez.-2022	324.685	0,06
	1,375 % 24-Jun.-2025	1.006.555	0,19				
Indonesien - 1.541.583				Lettland - 10.329.250			
	(31. Dezember 2019: 3.964.832)	1.541.583	0,29		(31. Dezember 2019: -)	10.329.250	1,92
435.000	Indonesia Government International Bond			10.000.000	Latvia Government International Bond		
	1,400 % 30-Okt.-2031	413.848	0,08		0,375 % 07-Okt.-2026	10.329.250	1,92
340.000	Indonesia Government International Bond 'REGS'						
	3,750 % 14-Jun.-2028	388.875	0,07	Litauen - 3.106.938			
800.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan				(31. Dezember 2019: -)	3.106.938	0,58
	Listrik Negara 'REGS' 1,875 % 05-Nov.-2031	738.860	0,14	2.915.000	Lithuania Government International Bond 'EMTN'		
					0,750 % 06-Mai-2030	3.106.938	0,58
Irland - 11.274.784							
	(31. Dezember 2019: 10.460.036)	11.274.784	2,10	Luxemburg - 1.680.130			
500.000	AerCap Ireland Capital DAC /				(31. Dezember 2019: 3.457.752)	1.680.130	0,31
	AerCap Global Aviation Trust 2,875 % 14-Aug.-2024	418.320	0,08	1.550.000	Prologis International Funding II SA 'EMTN'		
470.000	AerCap Ireland Capital DAC /				1,750 % 15-März-2028	1.680.130	0,31
	AerCap Global Aviation Trust 4,450 % 01-Okt.-2025	402.212	0,07				
800.000	AerCap Ireland Capital DAC /			Macao - 977.990			
	AerCap Global Aviation Trust 6,500 % 15-Jul.-2025	747.387	0,14		(31. Dezember 2019: -)	977.990	0,18
1.250.000	Ireland Government Bond 0,200 % 18-Okt.-2030	1.276.500	0,24	1.050.000	Sands China Ltd 'REGS' 4,375 % 18-Jun.-2030	977.990	0,18
6.780.000	Ireland Government Bond 2,400 % 15-Mai-2030	8.430.365	1,57				
Israel - 1.929.211				Mexiko - 1.129.262			
	(31. Dezember 2019: 1.147.314)	1.929.211	0,36		(31. Dezember 2019: 2.540.614)	1.129.262	0,21
525.000	Israel Government International Bond 'EMTN'			410.000	Infraestructura Energetica Nova SAB de CV 'REGS'		
	1,500 % 16-Jan.-2029	562.398	0,11		4,875 % 14-Jan.-2048	347.340	0,06
1.250.000	Israel Government International Bond 'EMTN'			795.000	Petroleos Mexicanos 'EMTN' 5,125 % 15-März-2023	781.922	0,15
	2,875 % 29-Jan.-2024	1.366.813	0,25				
Italien - 56.549.457				Niederlande - 39.051.487			
	(31. Dezember 2019: 110.189.558)	56.549.457	10,53		(31. Dezember 2019: 44.679.009)	39.051.487	7,27
3.550.000	Assicurazioni Generali SpA 'EMTN' FRN			1.600.000	ABN AMRO Bank NV 'EMTN' FRN		
	5,500 % 27-Okt.-2047	4.057.181	0,76		2,875 % 18-Jan.-2028	1.663.413	0,31
4.250.000	Enel Finance International NV 'EMTN'			3.905.000	Cooperatieve Rabobank UA FRN		
	0,375 % 17-Jun.-2027	4.205.471	0,78		2,500 % 26-Mai-2026	3.945.436	0,73
6.925.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro			3.700.000	Heineken NV 'EMTN' 2,250 % 30-März-2030	4.196.189	0,78
	0,950 % 15-März-2023	7.061.665	1,32	3.130.000	ING Bank NV 'EMTN' 3,625 % 31-Aug.-2021	3.277.012	0,61
18.505.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro			4.700.000	ING Groep NV 'EMTN' FRN 2,500 % 15-Feb.-2029	4.893.432	0,91
	1,350 % 15-Apr.-2022	18.925.804	3,52	2.300.000	ING Groep NV 'EMTN' FRN 3,000 % 11-Apr.-2028	2.415.466	0,45
4.025.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A'			1.200.000	ING Groep NV FRN 2,000 % 22-März-2030	1.228.895	0,23
	1,650 % 01-Dez.-2030	4.155.526	0,77	12.650.000	Netherlands Government Bond '144A'		
3.125.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A'				2,000 % 15-Jul.-2024	14.015.924	2,61
	2,800 % 01-März-2067	3.485.649	0,65	3.100.000	Shell International Finance BV 'EMTN'		
6.420.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A'				1,875 % 07-Apr.-2032	3.415.720	0,64
	3,250 % 01-Sept.-2046	7.831.135	1,46				
5.025.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A'			Norwegen - 876.718			
	4,000 % 01-Feb.-2037	6.606.413	1,23		(31. Dezember 2019: 2.140.995)	876.718	0,16
220.714	SME Grecale 2017 Srl '2017-1 A' FRN			925.000	Equinor ASA 3,250 % 18-Nov.-2049	876.718	0,16
	0,000 % 22-März-2056	220.613	0,04				
Japan - 2.465.807				Peru - 426.949			
	(31. Dezember 2019: 24.528.797)	2.465.807	0,46		(31. Dezember 2019: 840.503)	426.949	0,08
1.700.000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd			375.000	Southern Copper Corp 5,875 % 23-Apr.-2045	426.949	0,08
	2,000 % 09-Jul.-2040	1.701.419	0,32				
650.000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd 'REGS'			Philippinen - 2.101.124			
	3,000 % 21-Nov.-2030	764.388	0,14		(31. Dezember 2019: 1.070.155)	2.101.124	0,39
				1.250.000	Philippine Government International Bond		
					0,000 % 03-Feb.-2023	1.227.200	0,23
				350.000	Philippine Government International Bond		
					3,700 % 02-Feb.-2042	357.563	0,07
				525.000	Philippine Government International Bond 'EMTN'		
					0,875 % 17-Mai-2027	516.361	0,09

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener	Summe			Angemessener	Summe
Bestände	Beschreibung	Wert in EUR	der Netto- vermögen %	Bestände	Beschreibung	Wert in EUR	der Netto- vermögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
	Polen - 1.044.862 (31. Dezember 2019: 2.198.881)	1.044.862	0,20		Spanien Forts.		
975.000	Republic of Poland Government International Bond 'EMTN' 1,125 % 07-Aug.-2026	1.044.862	0,20	4.000.000	Iberdrola International BV 'EMTN' FRN (Immerwährend) 2,625 % 26-März-2024	4.126.020	0,77
	Portugal - 21.298.868 (31. Dezember 2019: 8.925.808)	21.298.868	3,97	11.900.000	Repsol International Finance BV 'EMTN' 2,625 % 15-Apr.-2030	13.288.611	2,48
3.375.000	EDP Finance BV 'EMTN' 0,375 % 16-Sept.-2026	3.326.907	0,62	1.600.000	Repsol International Finance BV FRN 4,500 % 25-März-2075	1.668.149	0,31
3.925.000	EDP Finance BV 'EMTN' 1,500 % 22-Nov.-2027	4.159.736	0,77	5.900.000	Spain Government Bond '144A' 0,600 % 31-Okt.-2029	6.038.973	1,12
7.325.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT '144A' 3,875 % 15-Feb.-2030	9.698.610	1,81	3.400.000	Spain Government Bond '144A' 1,200 % 31-Okt.-2040	3.492.395	0,65
2.575.000	Portugal Obrigacoes do Tesouro OT '144A' 4,100 % 15-Feb.-2045	4.113.615	0,77	2.275.000	Spain Government Bond '144A' 1,250 % 31-Okt.-2030	2.467.738	0,46
	Republik Serbien - 1.575.817 (31. Dezember 2019: –)	1.575.817	0,29	2.025.000	Spain Government Bond '144A' 2,350 % 30-Jul.-2033	2.455.148	0,46
1.500.000	Serbia International Bond 'REGS' 3,125 % 15-Mai-2027	1.575.817	0,29	16.330.000	Spain Government Bond '144A' 2,900 % 31-Okt.-2046	22.650.035	4,22
	Rumänien - 1.386.455 (31. Dezember 2019: 2.649.146)	1.386.455	0,26		Überstaatlich - 1.828.726 (31. Dezember 2019: 9.092.027)	1.828.726	0,34
475.000	Romanian Government International Bond 'EMTN' 2,875 % 11-März-2029	492.563	0,09	975.000	African Export-Import Bank/The 'EMTN' 5,250 % 11-Okt.-2023	925.768	0,17
825.000	Romanian Government International Bond 'REGS' 3,624 % 26-Mai-2030	893.892	0,17	970.000	Banque Ouest Africaine de Developpement 'REGS' 5,000 % 27-Jul.-2027	902.958	0,17
	Russland - 720.440 (31. Dezember 2019: 26.194.874)	720.440	0,14		Schweiz - 6.583.238 (31. Dezember 2019: 50.875)	6.583.238	1,23
700.000	Gazprom PJSC Via Gaz Capital SA 2,500 % 21-März-2026	720.440	0,14	50.000	Credit Suisse AG/Guernsey 'EMTN' 0,750 % 17-Sept.-2021	50.648	0,01
	Singapur - 1.924.848 (31. Dezember 2019: 3.673.656)	1.924.848	0,36	4.500.000	Nestle Finance International Ltd 0,375 % 12-Mai-2032	4.434.637	0,83
1.800.000	Temasek Financial I Ltd 'GMTN' 1,250 % 20-Nov.-2049	1.924.848	0,36	1.900.000	Novartis Finance SA 1,375 % 14-Aug.-2030	2.097.953	0,39
	Slowakei - 805.475 (31. Dezember 2019: –)	805.475	0,15		Ukraine - 2.205.088 (31. Dezember 2019: 4.459.060)	2.205.088	0,41
725.000	Slovakia Government Bond 1,000 % 14-Mai-2032	805.475	0,15	575.000	Ukraine Government International Bond FRN 0,000 % 31-Mai-2040	475.189	0,09
	Slowenien - 3.599.110 (31. Dezember 2019: –)	3.599.110	0,67	1.025.000	Ukraine Government International Bond 'REGS' 7,750 % 01-Sept.-2020	916.423	0,17
3.300.000	Slovenia Government Bond 1,188 % 14-März-2029	3.599.110	0,67	875.000	Ukraine Government International Bond 'REGS' 7,750 % 01-Sept.-2022	813.476	0,15
	Südafrika - 783.565 (31. Dezember 2019: 1.547.862)	783.565	0,15		Großbritannien - 23.151.474 (31. Dezember 2019: 13.914.108)	23.151.474	4,31
280.000	Anglo American Capital Plc 'EMTN' 1,625 % 18-Sept.-2025	281.284	0,05	1.535.000	Barclays Plc 'EMTN' FRN 2,000 % 07-Feb.-2028	1.507.356	0,28
505.000	Anglo American Capital Plc 'EMTN' 1,625 % 11-März-2026	502.281	0,10	3.150.000	Barclays Plc 'EMTN' FRN 3,375 % 02-Apr.-2025	3.381.887	0,63
	Spanien - 64.912.289 (31. Dezember 2019: 94.553.121)	64.912.289	12,09	2.775.000	BP Capital Markets Plc 2,822 % 07-Apr.-2032	3.188.059	0,59
400.000	Adif Alta Velocidad 'EMTN' 0,550 % 30-Apr.-2030	396.618	0,07	1.700.000	BP Capital Markets Plc 'EMTN' 1,231 % 08-Mai-2031	1.684.384	0,31
4.800.000	Banco Santander SA 'EMTN' 2,500 % 18-März-2025	5.015.991	0,93	4.200.000	BP Capital Markets Plc FRN (Immerwährend) 4,375 % 22-Jun.-2025	3.803.735	0,71
2.200.000	Iberdrola Finanzas SA 'EMTN' 0,875 % 16-Jun.-2025	2.266.616	0,42	1.425.000	CK Hutchison Group Telecom Finance SA 1,125 % 17-Okt.-2028	1.407.632	0,26
1.000.000	Iberdrola International BV 'EMTN' 3,000 % 31-Jan.-2022	1.045.995	0,20	506.362	DLL UK Equipment Finance 2019-1 Plc '2019-1UK A' FRN 0,929 % 25-März-2028	557.391	0,11
				3.825.000	Lloyds Bank Corporate Markets Plc 'EMTN' 2,375 % 09-Apr.-2026	4.113.367	0,77
				1.725.000	Sky Ltd 'EMTN' 2,500 % 15-Sept.-2026	1.945.451	0,36
				960.000	Unilever NV 1,750 % 25-März-2030	1.090.373	0,20
				470.000	Vodafone Group Plc FRN 3,100 % 03-Jan.-2079	471.839	0,09

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

				Angemessener		Summe					Angemessener		Summe		
		Wert	der Netto-						Wert	der Netto-					
Bestände	Beschreibung	in EUR	vermögen %	Bestände	Beschreibung	in EUR	vermögen %	Bestände	Beschreibung	in EUR	vermögen %	Bestände	Beschreibung	in EUR	vermögen %
Anleihen Forts.															
USA - 62.299.768															
(31. Dezember 2019: 67.356.395)															
		62.299.768	11,60												
390.000	AbbVie Inc 'REGS' 4,250 % 21-Nov.-2049	422.661	0,08												
290.000	AES Corp/The 6,000 % 15-Mai-2026	268.722	0,05												
1.900.000	Air Products and Chemicals Inc 'EMTN'														
	0,500 % 05-Mai-2028	1.910.916	0,36												
525.000	Air Products and Chemicals Inc 'EMTN'														
	0,800 % 05-Mai-2032	528.937	0,10												
675.000	American Electric Power Co Inc														
	3,250 % 01-März-2050	625.817	0,12												
2.250.000	Amgen Inc 2,300 % 25-Feb.-2031	2.100.657	0,39												
630.000	AT&T Inc 1,800 % 14-Sept.-2039	592.974	0,11												
800.000	AT&T Inc 2,050 % 19-Mai-2032	832.568	0,15												
525.000	AT&T Inc 2,350 % 05-Sept.-2029	573.344	0,11												
650.000	Bank of America Corp 'EMTN' FRN														
	1,662 % 25-Apr.-2028	686.552	0,13												
950.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN														
	4,083 % 20-März-2051	1.064.508	0,20												
1.095.000	Berkshire Hathaway Inc 0,000 % 12-März-2025	1.084.461	0,20												
625.000	Carrier Global Corp 'REGS' 2,722 % 15-Feb.-2030	559.864	0,10												
280.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp														
	4,500 % 15-Aug.-2030	255.116	0,05												
430.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 'REGS'														
	4,500 % 15-Aug.-2030	391.786	0,07												
500.000	Centene Corp 3,375 % 15-Feb.-2030	450.055	0,08												
125.000	CenturyLink Inc 'REGS' 4,000 % 15-Feb.-2027	108.315	0,02												
1.425.000	CGDB Commercial Mortgage Trust 2019-MOB														
	'2019-MOBX A' FRN 1,135 % 15-Nov.-2036	1.270.112	0,24												
900.000	Cigna Corp 3,400 % 15-März-2050	866.155	0,16												
800.000	Comcast Corp 0,750 % 20-Feb.-2032	777.128	0,14												
1.425.000	Crown Americas LLC / Crown Americas Capital Corp VI														
	4,750 % 01-Feb.-2026	1.297.009	0,24												
275.000	CVS Health Corp 5,125 % 20-Jul.-2045	315.869	0,06												
400.000	CyrusOne LP / CyrusOne Finance Corp														
	1,450 % 22-Jan.-2027	384.220	0,07												
175.000	CyrusOne LP / CyrusOne Finance Corp														
	2,900 % 15-Nov.-2024	163.838	0,03												
500.000	CyrusOne LP / CyrusOne Finance Corp														
	3,450 % 15-Nov.-2029	464.012	0,09												
325.000	Danaher Corp 2,500 % 30-März-2030	373.802	0,07												
1.035.000	DH Europe Finance II Sarl 0,200 % 18-März-2026	1.020.165	0,19												
525.000	Diamondback Energy Inc 2,875 % 01-Dez.-2024	468.041	0,09												
550.000	Diamondback Energy Inc 5,375 % 31-Mai-2025	504.258	0,09												
1.250.000	Digital Dutch Finco BV 1,500 % 15-März-2030	1.280.938	0,24												
420.000	Edison International 4,125 % 15-März-2028	395.645	0,07												
300.000	Elanco Animal Health Inc 5,650 % 28-Aug.-2028	297.243	0,05												
450.000	Enterprise Products Operating LLC														
	2,800 % 31-Jan.-2030	417.987	0,08												
1.285.000	EQT Corp 3,000 % 01-Okt.-2022	1.067.258	0,20												
1.450.000	Fidelity National Information Services Inc														
	1,500 % 21-Mai-2027	1.501.533	0,28												
200.000	FirstEnergy Corp 2,050 % 01-März-2025	184.044	0,03												
1.375.000	General Electric Co FRN (Immerwährend)														
	5,000 % 21-Jan.-2021	957.805	0,18												
646.000	Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp														
	7,750 % 01-Feb.-2028	512.280	0,09												
371.000	HCA Inc 3,500 % 01-Sept.-2030	318.460	0,06												
275.000	HCA Inc 5,875 % 01-Feb.-2029	277.397	0,05												
460.000	Healthcare Trust of America Holdings LP														
	3,500 % 01-Aug.-2026	442.934	0,08												
Anleihen Forts.															
USA Forts.															
850.000	InTown Hotel Portfolio Trust														
	2018-STAY '2018-STYX B' FRN 1,235 % 15-Jan.-2033	706.400	0,13												
1.650.000	John Deere Cash Management SA 'EMTN'														
	2,200 % 02-Apr.-2032	1.869.524	0,35												
1.175.000	JPMorgan Chase & Co FRN 2,956 % 13-Mai-2031	1.111.582	0,21												
425.000	Kraft Heinz Foods Co 4,625 % 30-Jan.-2029	408.072	0,08												
410.000	Kraft Heinz Foods Co 'REGS' 3,875 % 15-Mai-2027	381.905	0,07												
335.000	Kraft Heinz Foods Co 'REGS' 4,250 % 01-März-2031	316.822	0,06												
215.000	Kraft Heinz Foods Co 'REGS' 4,875 % 01-Okt.-2049	195.174	0,04												
175.000	Lamar Media Corp 'REGS' 3,750 % 15-Feb.-2028	147.340	0,03												
1.090.000	Lennar Corp 4,750 % 29-Nov.-2027	1.054.782	0,20												
1.170.000	Marsh & McLennan Cos Inc 1,979 % 21-März-2030	1.292.779	0,24												
300.000	Medtronic Global Holdings SCA														
	1,625 % 07-März-2031	327.634	0,06												
415.000	Microsoft Corp 2,525 % 01-Jun.-2050	387.293	0,07												
700.000	Molina Healthcare Inc 'REGS'														
	4,375 % 15-Jun.-2028	623.442	0,12												
1.425.000	Occidental Petroleum Corp 8,875 % 15-Jul.-2030	1.269.942	0,24												
875.000	PayPal Holdings Inc 2,300 % 01-Jun.-2030	815.190	0,15												
325.000	Prologis LP 2,250 % 15-Apr.-2030	304.998	0,06												
1.175.000	Quicken Loans LLC 'REGS' 5,750 % 01-Mai-2025	1.071.874	0,20												
1.080.000	SCF Equipment Trust 2016-1 LLC '2019-1X A2'														
	3,230 % 20-Okt.-2024	955.966	0,18												
400.000	Sherwin-Williams Co/The 2,300 % 15-Mai-2030	364.190	0,07												
875.000	Southern California Edison Co														
	3,650 % 01-Feb.-2050	858.670	0,16												
1.025.000	Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC /														
	Sprint Spectrum Co III LLC '144A'														
	4,738 % 20-März-2025	993.401	0,18												
2.125.000	Starbucks Corp 2,550 % 15-Nov.-2030	1.988.428	0,37												
320.000	Starbucks Corp 3,500 % 15-Nov.-2050	301.507	0,06												
320.000	Steel Dynamics Inc 2,400 % 15-Jun.-2025	293.677	0,05												
400.000	Steel Dynamics Inc 3,250 % 15-Jan.-2031	363.924	0,07												
375.000	Steel Dynamics Inc 3,450 % 15-Apr.-2030	349.632	0,06												
1.125.000	T-Mobile USA Inc 4,750 % 01-Feb.-2028	1.059.407	0,20												
300.000	United Rentals North America Inc														
	4,000 % 15-Jul.-2030	258.602	0,05												
14.530.000	United States Treasury Bill (Null-Coupon)														
	0,000 % 30-Jul.-2020*	12.931.540	2,41												
131.000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc 'REGS'														
	3,500 % 15-Feb.-2025	109.877	0,02												
280.000	Western Midstream Operating LP														
	3,100 % 01-Feb.-2025	237.024	0,04												
370.000	Western Midstream Operating LP														
	4,050 % 01-Feb.-2030	318.254	0,06												
285.000	Western Midstream Operating LP														
	4,650 % 01-Jul.-2026	244.235	0,04												
375.000	Xcel Energy Inc 3,500 % 01-Dez.-2049	371.295	0,07												
Summe der Anlagen in Anleihen												500.743.326	93,26		
Kreditverzugs- und Wapss - 91.146															
(31. Dezember 2019: 1.691.286)															
(8.750.000)	CDS CDX North America Investment Grade Index														
	Series 34 Version 1 1,000 % 20-Jun.-2025	91.146	0,02												
Summe der Kreditverzugs- und Wapss												91.146	0,02		

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener	Summe			Zugrunde	Angemessener	Summe
Bestände	Beschreibung	Wert in EUR	der Netto- vermögen %	Bestände	Beschreibung	liegendes Engagement in EUR	Wert in EUR	der Netto- vermögen %
Devisenoptionen - 491 (31. Dezember 2019: 171.704)				Offene Terminkontrakte - (1.600.252) (31. Dezember 2019: (571.150))				
9.990.000	US dollar/Russian rouble Put 31-Jul.-2020 62,500	491	0,00	(16)	Canadian 10 Year Treasury Bond Short Futures Contracts Exp Sep.-2020	(1.613.569)	(5.665)	(0,00)
Summe der Devisenoptionen				(327)	Euro-Bund Short Futures Contracts Exp Sep.-2020	(57.722.040)	(325.250)	(0,06)
Zinsswaps - 2.492.707 (31. Dezember 2019: 1.507.737)				(93)	Euro-Buxl 30 Year Bond Short Futures Contracts Exp Sep.-2020	(20.456.280)	(933.100)	(0,18)
61.400.000	IRS Receive Fixed 0,131 % Pay Euro EURIBOR-Reuters Index 6 Months 06-März-2022	546.556	0,10	(485)	U.S. 10 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Sep.-2020	(60.078.602)	(126.999)	(0,02)
27100.000	IRS Receive Fixed 0,748 % Pay Euro EURIBOR-Reuters Index 6 Months 06-März-2027	1.946.151	0,36	(19)	U.S. 10 Year Ultra Treasury Note Short Futures Contracts Exp Sep.-2020	(2.663.285)	(24.481)	(0,01)
Summe der Zinsswaps				(64)	U.S. 2 Year Treasury Note Short Futures Contracts Exp Sep.-2020	(12.579.430)	(87)	(0,00)
		Zugrunde	Angemessener	Summe				
		liegendes Engagement	Wert	der Netto-				
		in EUR	in EUR	vermögen %				
Bestände	Beschreibung							
Offene Terminkontrakte - 1.622.386 (31. Dezember 2019: 3.626.095)								
110	Euro-Bobl Long Futures Contracts Exp Sep.-2020	14.847.800	77.252	0,01	(4)	U.S. Treasury Bond Short Futures Contracts Exp Sep.-2020	(635.736)	(3.115)
202	Euro-BTP Long Futures Contracts Exp Sep.-2020	29.063.760	630.150	0,12	(112)	U.S. Treasury Ultra Bond Short Futures Contracts Exp Sep.-2020	(21.747.648)	(167.791)
100	Euro-OAT Long Futures Contracts Exp Sep.-2020	16.765.000	223.000	0,04	(78)	UK Long Gilt Short Futures Contracts Exp Sep.-2020	(11.840.565)	(13.764)
141	Euro-Schatz Long Futures Contracts Exp Sep.-2020	15.811.740	11.985	0,00	Summe der offenen Terminkontrakte			
(1)	Japanese 10 Year Bond Short Futures Contracts Exp Sep.-2020	(1.252.576)	82	0,00	(1.600.252)			
449	SFE 10 Year Australian Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Sep.-2020	41.034.964	470.792	0,09	(0,30)			
759	U.S. 5 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Sep.-2020	84.947.263	209.125	0,04	Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften - (877.792) (siehe unten) (31. Dezember 2019: (1.806.177))			
Summe der offenen Terminkontrakte				1.622.386	0,30	(877.792)		
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 204.079 (siehe unten) (31. Dezember 2019: 2.292.120)				204.079	0,04	(0,17)		
Summe der Vermögenswerte zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert				520.608.932	96,96	Summe der finanziellen Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert		
						(2.976.244)		
						(0,56)		
						Nettoumlaufvermögen		
						19.266.442		
						3,60		
						Summe der Nettovermögen		
						536.899.130		
						100,00		
						* Ein Teil der Beteiligung wird von Bank of America Merrill Lynch im Hinblick auf Terminkontrakte als Sicherheit gehalten, die vom Fonds und UBS AG im Zusammenhang mit den vom Fonds gehaltenen Devisenterminkontrakten und Währungsoptionen gehalten werden.		
						^ Investitionen in andere Fonds der Gesellschaft. Der Kontrahent für Kreditverzugsswaps ist Bank of America Merrill Lynch. Der Kontrahent für Währungsoptionen ist Citigroup Global Markets Limited. Der Kontrahent für Zinsswaps ist Bank of America Merrill Lynch. Der Kontrahent für Terminkontrakte ist Bank of America Merrill Lynch.		

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte							Devisenterminkontrakte Forts.														
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)								
BNY Mellon Euroland Bond Fund							BNY Mellon Euroland Bond Fund														
US-Dollar	Euro	650.000	577.046	01-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	1.502	Schweizer Franken	Euro	4.964.650	4.605.802	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	58.705								
Kanadischer Dollar	Euro	3.500.000	2.283.226	31-Jul.-20	Goldman Sachs	10.109															
Euro	Sterling	1.790.413	1.620.000	31-Jul.-20	Goldman Sachs	4.563															
Euro	Schweizer Franken	1.992.652	2.120.000	31-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	555															
Schwedische Krone	Euro	64.500.000	6.132.251	31-Jul.-20	UBS AG	26.976															
Schweizer Franken	Euro	4.100.000	3.833.240	31-Jul.-20	Morgan Stanley	19.400															
US-Dollar	Euro	960.000	853.755	31-Jul.-20	HSBC Bank plc	142															
US-Dollar	Euro	2.840.000	2.520.615	31-Jul.-20	UBS AG	5.496															
US-Dollar	Euro	2.230.000	1.983.353	31-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	178															
Polnischer Zloty	Euro	49.900.000	11.158.318	17-Sept.-20	Morgan Stanley	51.192															
US-Dollar	Koreanischer Won	638.247	758.110.000	17-Sept.-20	UBS AG	5.273	Euro	Schweizer Franken	92.784	99.984	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1.156)								
						EUR								125.386							
Euro	US-Dollar	852.467	957.952	01-Jul.-20	HSBC Bank plc	(181)															
Euro	Australischer Dollar	10.398.008	16.945.000	31-Jul.-20	UBS AG	(5.134)															
Euro	Kanadischer Dollar	4.561.365	6.985.000	31-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(15.476)															
Euro	Sterling	1.387.851	1.260.000	31-Jul.-20	HSBC Bank plc	(1.144)															
Euro	Schweizer Franken	2.531.930	2.700.000	31-Jul.-20	UBS AG	(5.174)															
Euro	US-Dollar	1.267.049	1.430.000	31-Jul.-20	Morgan Stanley	(4.901)															
Euro	US-Dollar	576.669	650.000	31-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(1.491)															
Euro	US-Dollar	10.000.000	11.274.400	31-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(28.304)															
Euro	US-Dollar	102.790.392	115.890.000	31-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(290.943)															
Euro	US-Dollar	2.307.665	2.600.000	31-Jul.-20	Goldman Sachs	(4.972)															
Euro	US-Dollar	346.001	390.000	31-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(894)															
Japanischer Yen	Euro	2.137.940.000	17.764.140	31-Jul.-20	HSBC Bank plc	(145.468)															
Neuseeländischer Dollar	Euro	8.190.000	4.707.627	31-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(6.414)															
Norwegische Krone	Euro	72.270.000	6.717.936	31-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(38.660)															
US-Dollar	Euro	8.700.000	7.744.377	31-Jul.-20	Morgan Stanley	(5.939)															
US-Dollar	Euro	510.000	454.013	31-Jul.-20	Morgan Stanley	(380)															
US-Dollar	Euro	2.000.000	1.782.241	31-Jul.-20	UBS AG	(3.289)															
Indische Rupie	US-Dollar	236.560.000	3.105.481	17-Sept.-20	Barclays Bank PLC	(324)															
Indische Rupie	US-Dollar	243.040.000	3.191.386	17-Sept.-20	HSBC Bank plc	(1.077)															
Mexikanischer Peso	Euro	160.000.000	6.196.175	17-Sept.-20	Barclays Bank PLC	(74.715)															
Russischer Rubel	US-Dollar	845.000.000	12.039.610	17-Sept.-20	JPMorgan Chase Bank	(241.731)															
Thailändischer Baht	US-Dollar	14.270.000	461.663	17-Sept.-20	JPMorgan Chase Bank	(25)															
						EUR	(876.636)														
						Netto EUR	(751.250)														
BNY Mellon Euroland Bond Fund							BNY Mellon Euroland Bond Fund														
Anteilsklasse CHF H (Hedged)							Anteilsklasse CHF I (Hedged)														
Schweizer Franken	Euro						Schweizer Franken	Euro	1.690.364	1.568.184	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	19.988								
						EUR								19.988							
						CHF								21.276							
						Netto EUR								57.549							
						Netto CHF								61.258							
BNY Mellon Euroland Bond Fund														BNY Mellon Euroland Bond Fund							
Anteilsklasse CHF I (Hedged)														Anteilsklasse CHF I (Hedged)							
Schweizer Franken	Euro													Schweizer Franken	Euro	1.690.364	1.568.184	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	19.988	
						EUR															19.988
						CHF															21.276
						Netto EUR	57.549														
						Netto CHF	61.258														

BNY MELLON EUROPEAN CREDIT FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener	Summe			Angemessener	Summe
		Wert	der Netto-			Wert	der Netto-
Bestände	Beschreibung	in EUR	vermögen %	Bestände	Beschreibung	in EUR	vermögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen				Anleihen Forts.			
Irland - 2.956.339				Frankreich - 9.888.402			
(31. Dezember 2019: 4.845.219)		2.956.339	4,05	(31. Dezember 2019: 8.591.485)		9.888.402	13,55
7.071	BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund ^	1.103.011	1,51	200.000	Aeroports de Paris 1,000 % 05-Jan.-2029	197.487	0,27
1.815.589	BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund ^	1.853.328	2,54	100.000	Aeroports de Paris 2,750 % 02-Apr.-2030	114.443	0,16
Summe der Anlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen 2.956.339 4,05				226.000	Airbus SE 'EMTN' 2,375 % 07-Apr.-2032	248.493	0,34
Anleihen				300.000	ALD SA 'EMTN' 0,875 % 18-Jul.-2022	294.636	0,40
Australien - 1.410.912				200.000	APRR SA 'EMTN' 1,250 % 18-Jan.-2028	211.558	0,29
(31. Dezember 2019: 860.022)		1.410.912	1,93	220.000	AXA SA 'EMTN' FRN (Immerwährend)		
108.000	Glencore Finance Europe Ltd 'EMTN'				3,875 % 08-Okt.-2025	240.048	0,33
	1,250 % 17-März-2021	108.161	0,15	600.000	BNP Paribas SA 'EMTN' 0,125 % 04-Sept.-2026	576.502	0,79
350.000	Glencore Finance Europe Ltd 'EMTN'			230.000	BNP Paribas SA 'EMTN' 1,125 % 11-Jun.-2026	234.329	0,32
	1,750 % 17-März-2025	352.068	0,48	300.000	BPCE SA 0,250 % 15-Jan.-2026	298.060	0,41
312.000	Scentre Group Trust 1 / Scentre Group Trust 2 'REGS'			600.000	BPCE SA 0,625 % 28-Apr.-2025	609.489	0,84
	4,375 % 28-Mai-2030	307.168	0,42	200.000	Capgemini SE 2,375 % 15-Apr.-2032	220.822	0,30
300.000	SGSP Australia Assets Pty Ltd 'EMTN'			50.000	CNP Assurances FRN 6,000 % 14-Sept.-2040	50.313	0,07
	2,000 % 30-Jun.-2022	307.389	0,42	100.000	Credit Agricole SA 2,625 % 17-März-2027	107.943	0,15
222.000	Telstra Corp Ltd 1,000 % 23-Apr.-2030	228.950	0,31	500.000	Credit Agricole SA 'EMTN' FRN		
100.000	Telstra Corp Ltd 'EMTN' 1,375 % 26-März-2029	107.176	0,15		1,625 % 05-Jun.-2030	503.915	0,69
Österreich - 402.586				400.000	Credit Agricole SA/London 'EMTN'		
(31. Dezember 2019: 1.203.015)		402.586	0,55		0,500 % 24-Jun.-2024	399.024	0,55
300.000	Erste Group Bank AG 'EMTN'			100.000	Credit Mutuel Arkea SA 'EMTN'		
	0,875 % 22-Mai-2026	303.227	0,41		0,875 % 05-Okt.-2023	101.874	0,14
100.000	Raiffeisen Bank International AG 'EMTN'			200.000	Credit Mutuel Arkea SA 'EMTN' FRN		
	0,375 % 25-Sept.-2026	99.359	0,14		1,250 % 11-Jun.-2029	200.258	0,27
Belgien - 1.440.600				400.000	Credit Mutuel Arkea SA 'EMTN' FRN		
(31. Dezember 2019: 2.918.545)		1.440.600	1,97		1,875 % 25-Okt.-2029	400.974	0,55
499.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV			300.000	Dassault Systemes SE 0,125 % 16-Sept.-2026	297.222	0,41
	3,700 % 02-Apr.-2040	608.705	0,83	100.000	Electricite de France SA 'EMTN' 2,000 % 09-Dez.-2049	98.503	0,13
110.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN'			250.000	Electricite de France SA 'EMTN' 4,500 % 12-Nov.-2040	366.568	0,50
	2,750 % 17-März-2036	122.129	0,17	200.000	Engie SA 'EMTN' 0,500 % 24-Okt.-2030	195.656	0,27
200.000	Elia Transmission Belgium SA 'EMTN'			300.000	Iliad SA 0,625 % 25-Nov.-2021	296.845	0,41
	0,875 % 28-Apr.-2030	204.899	0,28	100.000	La Mondiale SAM 2,125 % 23-Jun.-2031	98.951	0,14
300.000	Groupe Bruxelles Lambert SA 1,375 % 23-Mai-2024	301.970	0,41	200.000	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE		
200.000	KBC Group NV 'EMTN' 0,750 % 18-Okt.-2023	202.897	0,28		0,125 % 11-Feb.-2028	196.675	0,27
Bermuda - 990.071				400.000	Orange SA 1,200 % 11-Jul.-2034	401.010	0,55
(31. Dezember 2019: 1.031.512)		990.071	1,36	427.000	RCI Banque SA 'EMTN' 1,125 % 15-Jan.-2027	401.239	0,55
70.000	XLIT Ltd 5,250 % 15-Dez.-2043	84.353	0,12	200.000	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR 'EMTN'		
100.000	XLIT Ltd 5,500 % 31-März-2045	120.116	0,16		1,500 % 27-Sept.-2030	222.343	0,30
740.000	XLIT Ltd FRN 3,250 % 29-Jun.-2047	785.602	1,08	200.000	SapphireOne Mortgages FCT 2016-2 '2016-2 C' FRN		
Tschechische Republik - 722.992					1,091 % 25-Jun.-2061	200.468	0,27
(31. Dezember 2019: 735.709)		722.992	0,99	200.000	SapphireOne Mortgages FCT 2016-3 '2016-3 C' FRN		
150.000	CEZ AS 'EMTN' 0,875 % 21-Nov.-2022	151.091	0,21		1,341 % 27-Jun.-2061	200.747	0,28
569.000	EP Infrastructure AS 1,659 % 26-Apr.-2024	571.901	0,78	300.000	Societe Generale SA 0,750 % 25-Jan.-2027	292.758	0,40
Dänemark - 944.057				200.000	TDF Infrastructure SASU 2,500 % 07-Apr.-2026	205.078	0,28
(31. Dezember 2019: 1.072.337)		944.057	1,29	200.000	Total Capital International SA 'EMTN'		
200.000	Carlsberg Breweries A/S 'EMTN'				0,696 % 31-Mai-2028	203.419	0,28
	0,500 % 06-Sept.-2023	201.736	0,27	100.000	Total Capital International SA 'EMTN'		
759.000	Nykredit Realkredit A/S 'EMTN'				0,952 % 18-Mai-2031	102.679	0,14
	0,625 % 17-Jan.-2025	742.321	1,02	200.000	Total Capital International SA 'EMTN'		
Finnland - 266.349					1,618 % 18-Mai-2040	208.976	0,29
(31. Dezember 2019: 269.335)		266.349	0,37	220.000	TOTAL SA 'EMTN' FRN (Immerwährend)		
269.000	OP Corporate Bank plc 'EMTN'				2,708 % 05-Mai-2023	223.850	0,31
	0,375 % 19-Jun.-2024	266.349	0,37	222.000	TOTAL SA 'EMTN' FRN (Immerwährend)		
					3,875 % 18-Mai-2022	229.484	0,31
				100.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE 'EMTN'		
					1,125 % 28-Apr.-2027	97.873	0,13
				120.000	Unibail-Rodamco-Westfield SE 'EMTN'		
					2,500 % 04-Jun.-2026	127.004	0,17
				200.000	Veolia Environnement SA 'EMTN'		
					1,250 % 15-Apr.-2028	210.886	0,29

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in EUR	Summe der Nettovermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in EUR	Summe der Nettovermögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
	Deutschland - 9.515.697				Italien - 3.388.201		
	(31. Dezember 2019: 8.396.023)	9.515.697	13,04		(31. Dezember 2019: 4.898.933)	3.388.201	4,64
200.000	Allianz SE FRN 2,121 % 08-Jul.-2050	202.770	0,28	100.000	Assicurazioni Generali SpA 'EMTN' FRN		
100.000	Aroundtown SA 'EMTN' 1,875 % 19-Jan.-2026	103.961	0,14		5,000 % 08-Jun.-2048	111.865	0,15
200.000	Bayer AG FRN 2,375 % 12-Nov.-2079	194.584	0,27	314.000	Assicurazioni Generali SpA 'EMTN' FRN		
360.000	BMW Finance NV 'EMTN' 0,125 % 13-Jul.-2022	359.357	0,49		5,500 % 27-Okt.-2047	358.745	0,49
462.000	Commerzbank AG 'EMTN' 0,500 % 28-Aug.-2023	462.737	0,63	651.000	Banco BPM SpA 'EMTN' 1,625 % 18-Feb.-2025	600.857	0,82
300.000	Commerzbank AG 'EMTN' FRN 4,000 % 05-Dez.-2030	301.070	0,41	200.000	FCA Bank SpA/Ireland 'EMTN'		
243.000	Continental AG 'EMTN' 2,500 % 27-Aug.-2026	256.698	0,35		1,000 % 21-Feb.-2022	198.974	0,27
296.000	Daimler AG 'EMTN' 1,125 % 06-Nov.-2031	282.599	0,39	440.000	Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN'		
171.000	Daimler AG 'EMTN' 2,000 % 22-Aug.-2026	177.808	0,24		1,375 % 18-Jan.-2024	444.051	0,61
231.000	Daimler International Finance BV 'EMTN'			250.000	Mediobanca Banca di Credito Finanziario		
	0,625 % 06-Mai-2027	218.976	0,30		SpA 'EMTN' 1,125 % 23-Apr.-2025	239.720	0,33
200.000	Deutsche Bank AG 'EMTN' 1,625 % 20-Jan.-2027	197.666	0,27	249.000	Terna Rete Elettrica Nazionale SpA 'EMTN'		
149.000	Deutsche Bank AG 'EMTN' FRN 1,375 % 10-Jun.-2026	151.286	0,21		0,125 % 25-Jul.-2025	246.959	0,34
200.000	Deutsche Boerse AG FRN 1,250 % 16-Jun.-2047	199.568	0,27	100.000	Terna Rete Elettrica Nazionale SpA 'EMTN'		
300.000	Deutsche Telekom AG 'EMTN' 0,500 % 05-Jul.-2027	301.114	0,41		1,000 % 10-Apr.-2026	103.201	0,14
118.000	Deutsche Telekom AG 'EMTN' 1,375 % 05-Jul.-2034	121.467	0,17	417.000	UniCredit SpA 'EMTN' FRN (Immerwährend)		
300.000	Eurogrid GmbH 'EMTN' 1,113 % 15-Mai-2032	317.193	0,43		3,875 % 03-Jun.-2027	307.538	0,42
100.000	Eurogrid GmbH 'EMTN' 1,500 % 18-Apr.-2028	108.109	0,15	780.000	Unione di Banche Italiane SpA 'EMTN'		
200.000	Eurogrid GmbH 'EMTN' 1,625 % 03-Nov.-2023	209.472	0,29		0,750 % 17-Okt.-2022	776.291	1,07
200.000	HeidelbergCement Finance Luxembourg SA 'EMTN'						
	1,625 % 07-Apr.-2026	204.909	0,28		Japan - 470.697		
200.000	Infineon Technologies AG 'EMTN' 1,625 % 24-Jun.-2029	200.115	0,27		(31. Dezember 2019: 476.769)	470.697	0,65
100.000	Infineon Technologies AG 'EMTN' 2,000 % 24-Jun.-2032	99.924	0,14	400.000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd 'REGS'		
400.000	Merck Financial Services GmbH 'EMTN'				3,000 % 21-Nov.-2030	470.697	0,65
	0,375 % 05-Jul.-2027	402.658	0,55				
360.000	Merck KGaA FRN 2,625 % 12-Dez.-2074	362.448	0,50		Luxemburg - 1.107.972		
292.000	Roadster Finance DAC 'EMTN' 1,625 % 09-Dez.-2024	289.674	0,40		(31. Dezember 2019: 2.632.847)	1.107.972	1,52
73.000	Schaeffler AG 'EMTN' 2,875 % 26-März-2027	72.489	0,10	306.000	Blackstone Property Partners Europe Holdings		
233.000	Schaeffler Finance BV 'REGS'				Sarl 'EMTN' 0,500 % 12-Sept.-2023	302.412	0,41
	3,250 % 15-Mai-2025	233.051	0,32	255.000	Blackstone Property Partners Europe Holdings		
300.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 'EMTN'				Sarl 'EMTN' 1,750 % 12-März-2029	252.710	0,35
	0,375 % 05-Jun.-2026	302.388	0,41	100.000	Logicor Financing Sarl 'EMTN'		
163.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 'EMTN'				1,625 % 15-Jul.-2027	100.841	0,14
	1,750 % 28-Feb.-2039	182.391	0,25	445.000	SES SA FRN (Immerwährend) 4,625 % 02-Jan.-2022	452.009	0,62
100.000	Volkswagen Bank GmbH 'EMTN' 1,250 % 01-Aug.-2022	100.467	0,14				
319.000	Volkswagen Financial Services AG 'EMTN'				Niederlande - 3.316.276		
	1,375 % 16-Okt.-2023	321.069	0,44		(31. Dezember 2019: 4.495.402)	3.316.276	4,54
337.000	Volkswagen Financial Services AG 'EMTN'			400.000	ABN AMRO Bank NV 'EMTN'		
	3,375 % 06-Apr.-2028	376.471	0,52		1,250 % 28-Mai-2025	409.402	0,56
200.000	Volkswagen International Finance NV			600.000	de Volksbank NV 'EMTN' 0,750 % 25-Jun.-2023	606.798	0,83
	4,125 % 16-Nov.-2038	245.758	0,34	240.000	Enexis Holding NV 'EMTN' 0,750 % 02-Jul.-2031	245.962	0,34
790.000	Volkswagen Leasing GmbH 'EMTN'			500.000	ING Bank NV FRN 3,625 % 25-Feb.-2026	507.430	0,69
	0,500 % 20-Jun.-2022	781.476	1,07	400.000	ING Groep NV 'EMTN' 1,000 % 20-Sept.-2023	408.576	0,56
200.000	Vonovia Finance BV 1,800 % 29-Jun.-2025	212.253	0,29	100.000	ING Groep NV FRN 2,000 % 22-März-2030	102.373	0,14
100.000	Vonovia Finance BV 2,250 % 07-Apr.-2030	111.710	0,15	576.000	LeasePlan Corp NV 0,125 % 13-Sept.-2023	555.060	0,76
100.000	Vonovia Finance BV 'EMTN' 0,625 % 07-Okt.-2027	98.933	0,14	290.000	Nationale-Nederlanden Levensverzekering		
600.000	Wintershall Dea Finance BV 1,332 % 25-Sept.-2028	563.784	0,77		Maatschappij NV FRN 9,000 % 29-Aug.-2042	336.955	0,46
200.000	Wintershall Dea Finance BV 1,823 % 25-Sept.-2031	187.294	0,26	130.000	Shell International Finance BV 'EMTN'		
					1,875 % 07-Apr.-2032	143.720	0,20
	Irland - 1.148.720						
	(31. Dezember 2019: 1.419.586)	1.148.720	1,57		Portugal - 291.486		
129.000	ESB Finance DAC 'EMTN' 2,125 % 05-Nov.-2033	150.196	0,21		(31. Dezember 2019: 303.525)	291.486	0,40
94.220	European Residential Loan Securitisation			300.000	Caixa Geral de Depositos SA 'EMTN'		
	2019-NPL1 DAC '2019-NPL1 A' FRN				1,250 % 25-Nov.-2024	291.486	0,40
	1,493 % 24-Jul.-2054	77.028	0,10				
1.124.343	European Residential Loan Securitisation				Slowakei - 122.572		
	2019-NPL2 DAC '2019-NPL2 A' FRN				(31. Dezember 2019: 123.495)	122.572	0,17
	0,993 % 24-Feb.-2058	921.496	1,26	113.000	Zapadoslovenska Energetika AS		
					1,750 % 02-März-2028	122.572	0,17

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in EUR	Summe der Nettovermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in EUR	Summe der Nettovermögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
Spanien - 4.498.769				Großbritannien Forts.			
(31. Dezember 2019: 4.608.524)				550.000	Barclays Plc 'EMTN' FRN 2,000 % 07-Feb.-2028	539.763	0,74
100.000	Abertis Infraestructuras SA 'EMTN'			261.000	BAT International Finance Plc 'EMTN'		
	3,000 % 27-März-2031	103.613	0,14		2,250 % 16-Jan.-2030	271.828	0,37
200.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA 'GMTN' FRN			286.000	BP Capital Markets Plc 1,876 % 07-Apr.-2024	300.588	0,41
	1,000 % 16-Jan.-2030	188.500	0,26	200.000	BP Capital Markets Plc 'EMTN'		
400.000	Banco de Sabadell SA FRN 2,000 % 17-Jan.-2030	336.500	0,46		1,953 % 03-März-2025	212.498	0,29
100.000	Banco Santander SA 'EMTN' 1,375 % 05-Jan.-2026	101.489	0,14	165.000	BP Capital Markets Plc FRN (Immerwährend)		
300.000	Bankinter SA 0,625 % 06-Okt.-2027	283.338	0,39		3,250 % 22-März-2026	166.237	0,23
500.000	CaixaBank SA 'EMTN' 0,375 % 03-Feb.-2025	491.768	0,67	121.000	BP Capital Markets Plc FRN (Immerwährend)		
200.000	CaixaBank SA 'EMTN' 1,375 % 19-Jun.-2026	199.730	0,27		3,625 % 22-März-2029	121.908	0,17
300.000	CaixaBank SA 'EMTN' 1,750 % 24-Okt.-2023	305.055	0,42	115.000	Cadent Finance Plc 'EMTN' 0,750 % 11-März-2032	112.858	0,15
219.000	FCC Aqualia SA 2,629 % 08-Jun.-2027	228.109	0,31	310.000	CK Hutchison Group Telecom Finance SA		
400.000	Inmobiliaria Colonial Socimi SA 'EMTN'				1,500 % 17-Okt.-2031	308.022	0,42
	1,625 % 28-Nov.-2025	400.810	0,55	288.000	Diageo Finance Plc 'EMTN' 2,500 % 27-März-2032	346.270	0,47
300.000	Inmobiliaria Colonial Socimi SA 'EMTN'			717.000	Dowson 2019-1 Plc '2019-1 B' FRN		
	2,000 % 17-Apr.-2026	304.154	0,42		2,466 % 20-Sept.-2026	774.957	1,06
300.000	Kutxabank SA 0,500 % 25-Sept.-2024	286.596	0,39	200.000	Heathrow Funding Ltd 'EMTN' 1,875 % 14-März-2034	203.251	0,28
313.000	Repsol International Finance BV FRN			150.000	Imperial Brands Finance Plc 'EMTN'		
	4,500 % 25-März-2025	326.415	0,45		2,125 % 12-Feb.-2027	154.053	0,21
178.000	Repsol International Finance BV FRN (Immerwährend)			333.000	Lloyds Bank Corporate Markets Plc 'EMTN'		
	4,247 % 11-Sept.-2028	181.338	0,25		0,375 % 28-Jan.-2025	327.665	0,45
400.000	Santander Consumer Finance SA 'EMTN'			210.000	Lloyds Banking Group Plc 'EMTN' FRN		
	0,375 % 27-Jun.-2024	394.868	0,54		0,500 % 12-Nov.-2025	204.849	0,28
158.684	Silverback Finance DAC 3,126 % 25-Feb.-2037	171.486	0,24	203.000	National Grid Electricity Transmission Plc		
200.000	Telefonica Europe BV FRN (Immerwährend)				0,190 % 20-Jan.-2025	203.556	0,28
	2,625 % 07-März-2023	195.000	0,27	100.000	NatWest Markets Plc 'EMTN' 1,000 % 28-Mai-2024	99.666	0,14
Schweden - 1.088.186				185.000	NatWest Markets Plc 'EMTN' 2,750 % 02-Apr.-2025	197.942	0,27
(31. Dezember 2019: 421.919)				100.000	RELX Finance BV 0,000 % 18-März-2024	98.591	0,14
192.000	Akelius Residential Property AB 'EMTN'			209.000	Standard Chartered Plc FRN 2,500 % 09-Sept.-2030	212.371	0,29
	1,750 % 07-Feb.-2025	194.282	0,27	360.000	Tesco Corporate Treasury Services Plc 'EMTN'		
430.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB 'GMTN' FRN				0,875 % 29-Mai-2026	357.163	0,49
	2,500 % 28-Mai-2026	432.840	0,59	300.000	Tesco Corporate Treasury Services Plc 'EMTN'		
244.000	Swedbank AB 'EMTN' FRN 1,000 % 22-Nov.-2027	241.865	0,33		2,500 % 01-Jul.-2024	319.572	0,44
200.000	Telia Co AB 'EMTN' 2,125 % 20-Feb.-2034	219.199	0,30	100.000	Unilever NV 1,750 % 25-März-2030	113.775	0,16
Schweiz - 2.591.796				452.000	Vodafone Group Plc 1,625 % 24-Nov.-2030	481.972	0,66
(31. Dezember 2019: 2.177.908)				600.000	Vodafone Group Plc FRN 3,100 % 03-Jan.-2079	603.750	0,83
100.000	Argentum Netherlands BV for Givaudan SA			USA - 14.095.160			
	1,125 % 17-Sept.-2025	104.247	0,14	(31. Dezember 2019: 16.902.913)			
200.000	Coca-Cola HBC Finance BV 'EMTN'			240.000	Abbott Ireland Financing DAC 0,875 % 27-Sept.-2023	245.716	0,34
	1,625 % 14-Mai-2031	214.209	0,29	300.000	AbbVie Inc '144A' 0,500 % 01-Jun.-2021	300.164	0,41
350.000	Credit Suisse Group AG 'EMTN' FRN			100.000	Air Products and Chemicals Inc 'EMTN'		
	0,650 % 14-Jan.-2028	340.205	0,47		0,500 % 05-Mai-2028	100.773	0,14
100.000	Givaudan Finance Europe BV 1,000 % 22-Apr.-2027	103.791	0,14	100.000	Air Products and Chemicals Inc 'EMTN'		
100.000	Givaudan Finance Europe BV 1,625 % 22-Apr.-2032	107.532	0,15		0,800 % 05-Mai-2032	100.930	0,14
95.000	Nestle Finance International Ltd 'EMTN'			1.201.000	Altria Group Inc 1,000 % 15-Feb.-2023	1.212.325	1,66
	1,500 % 01-Apr.-2030	105.002	0,14	100.000	Altria Group Inc 2,200 % 15-Jun.-2027	105.496	0,14
174.000	Swisscom Finance BV 0,375 % 14-Nov.-2028	175.097	0,24	337.000	AT&T Inc 0,250 % 04-März-2026	325.264	0,45
585.000	UBS AG/London 'EMTN' 0,750 % 21-Apr.-2023	594.275	0,82	436.000	AT&T Inc 1,950 % 15-Sept.-2023	451.798	0,62
820.000	UBS Group AG 1,500 % 30-Nov.-2024	847.438	1,16	108.000	AT&T Inc 2,050 % 19-Mai-2032	112.608	0,15
Vereinigte Arabische Emirate - 97.235				351.000	AT&T Inc 3,550 % 17-Dez.-2032	423.168	0,58
(31. Dezember 2019: 107.705)				170.000	Bank of America Corp 'EMTN' FRN		
100.000	DP World Plc 'REGS' 2,375 % 25-Sept.-2026	97.235	0,13		1,379 % 07-Feb.-2025	174.994	0,24
Großbritannien - 7.755.549				149.000	Bank of America Corp 'EMTN' FRN		
(31. Dezember 2019: 8.868.029)					1,662 % 25-Apr.-2028	156.795	0,21
200.000	Aviva Plc 'EMTN' FRN 6,125 % 05-Jul.-2043	226.503	0,31	316.000	Becton Dickinson Euro Finance Sarl		
814.000	Barclays Plc 'EMTN' FRN 0,750 % 09-Jun.-2025	795.941	1,09		0,632 % 04-Jun.-2023	314.155	0,43
				200.000	Celanese US Holdings LLC 1,125 % 26-Sept.-2023	197.185	0,27
				290.000	Celanese US Holdings LLC 1,250 % 11-Feb.-2025	283.679	0,39

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener Wert in EUR	Summe der Netto- vermögen %			Zugrunde liegendes Engagement in EUR	Angemessener Wert in EUR	Summe der Netto- vermögen %
Bestände	Beschreibung			Bestände	Beschreibung			
Anleihen Forts.				Offene Terminkontrakte Forts.				
	USA Forts.			48	Euro-Schatz			
232.000	Chubb INA Holdings Inc 1,400 % 15-Jun.-2031	239.099	0,33		Long Futures Contracts			
220.000	Citigroup Inc 'EMTN' 0,750 % 26-Okt.-2023	222.814	0,31		Exp Sep.-2020	5.382.720	1.710	0,00
419.000	Citigroup Inc 'EMTN' FRN 1,250 % 06-Jul.-2026	426.925	0,59	Summe der offenen Terminkontrakte				
320.000	Danaher Corp 2,500 % 30-März-2030	368.363	0,50				40.050	0,05
255.000	DH Europe Finance II Sarl 1,350 % 18-Sept.-2039	244.605	0,34	Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 135.276				
820.000	Exxon Mobil Corp 0,142 % 26-Jun.-2024	819.861	1,12	(siehe unten) (31. Dezember 2019: 38.116)				
530.000	Fidelity National Information Services Inc 0,125 % 03-Dez.-2022	527.679	0,72					
123.000	Fidelity National Information Services Inc 0,625 % 03-Dez.-2025	122.133	0,17	Summe der Vermögenswerte zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert				
410.000	Fidelity National Information Services Inc 2,000 % 21-Mai-2030	440.076	0,60				68.697.934	94,14
300.000	Fiserv Inc 0,375 % 01-Jul.-2023	298.734	0,41					
100.000	Fiserv Inc 1,625 % 01-Jul.-2030	103.501	0,14					
200.000	General Electric Co 1,500 % 17-Mai-2029	188.957	0,26					
493.000	Goldman Sachs Group Inc/The 3,375 % 27-März-2025	548.832	0,75					
200.000	Huntsman International LLC 5,125 % 15-Apr.-2021	202.256	0,28					
175.000	International Business Machines Corp 0,950 % 23-Mai-2025	180.409	0,25					
146.000	International Flavors & Fragrances Inc 1,800 % 25-Sept.-2026	147.206	0,20					
100.000	JPMorgan Chase & Co 'EMTN' FRN 1,001 % 25-Jul.-2031	100.068	0,14					
200.000	McDonald's Corp 'GMTN' 1,000 % 15-Nov.-2023	205.171	0,28					
400.000	Morgan Stanley 'EMTN' FRN 1,342 % 23-Okt.-2026	413.105	0,57					
170.000	Mylan NV 3,125 % 22-Nov.-2028	191.419	0,26					
157.000	Oracle Corp 3,600 % 01-Apr.-2050	157.699	0,22					
342.000	PepsiCo Inc 'EMTN' 0,500 % 06-Mai-2028	345.199	0,47					
325.000	Prologis Euro Finance LLC 1,000 % 06-Feb.-2035	315.200	0,43					
100.000	Stryker Corp 2,625 % 30-Nov.-2030	115.039	0,16					
135.000	Thermo Fisher Scientific Inc 2,375 % 15-Apr.-2032	154.501	0,21					
220.000	Thermo Fisher Scientific Inc 'EMTN' 1,875 % 01-Okt.-2049	212.490	0,29					
194.000	Upjohn Finance BV 1,362 % 23-Jun.-2027	195.644	0,27					
663.000	Verizon Communications Inc 1,850 % 18-Mai-2040	681.418	0,93					
100.000	Verizon Communications Inc 2,875 % 15-Jan.-2038	120.923	0,17					
250.000	Wells Fargo & Co 0,625 % 14-Aug.-2030	236.619	0,32					
460.000	Wells Fargo & Co 'EMTN' 0,625 % 25-März-2030	434.587	0,60					
345.000	Westlake Chemical Corp 1,625 % 17-Jul.-2029	331.398	0,45					
281.000	Zimmer Biomet Holdings Inc 2,425 % 13-Dez.-2026	298.180	0,41					
Summe der Anlagen in Anleihen		65.554.285	89,83					

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte							Nicht
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent		realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon European Credit Fund							
Euro	US-Dollar	696.698	754.000	15-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited		24.222
Euro	US-Dollar	184.662	200.000	15-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited		6.286
Euro	US-Dollar	1.163.198	1.267.000	30-Jul.-20	Natwest Markets Plc		33.572
US-Dollar	Euro	419.000	369.981	30-Jul.-20	Lloyds Bank plc		3.589
Euro	Sterling	962.736	859.000	03-Aug.-20	UBS AG		22.870
Euro	US-Dollar	2.120.527	2.338.000	17-Aug.-20	RBC Capital Markets		36.848
US-Dollar	Euro	614.000	542.531	17-Aug.-20	Bank of America Merrill Lynch		4.680
US-Dollar	Euro	701.000	621.782	17-Aug.-20	Morgan Stanley		2.965
US-Dollar	Euro	221.000	196.606	11-Sept.-20	Morgan Stanley		244
EUR							135.276
Sterling	Euro	150.000	167.140	03-Aug.-20	Goldman Sachs		(3.018)
Sterling	Euro	178.000	198.411	03-Aug.-20	Natwest Markets Plc		(3.654)
US-Dollar	Euro	287.000	255.914	17-Aug.-20	BNP Paribas		(133)
Euro	US-Dollar	493.085	562.000	28-Aug.-20	RBC Capital Markets		(7.662)
Euro	US-Dollar	584.348	661.000	11-Sept.-20	JPMorgan Chase Bank		(4.420)
EUR							(18.887)
Netto EUR							116.389

BNY MELLON GLOBAL BOND FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Nettovermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Nettovermögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen				Anleihen Forts.			
US-Dollar - 16.781.381 (31. Dezember 2019: 5.873.761)				Euro Forts.			
3.273.777	iShares China CNY Bond UCITS ETF - ETF	16.781.381	2,80	5.170.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 'EMTN' 1,375 % 31-Jul.-2035	6.998.546	1,17
Summe der Anlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen 16.781.381 2,80				3.233.000	Province of British Columbia Canada 'EMTN' 0,875 % 08-Okt.-2025	3.821.682	0,64
Anleihen				4.900.000	SNCF Reseau 'EMTN' 1,125 % 25-Mai-2030	6.023.421	1,00
Australischer Dollar - 40.551.064 (31. Dezember 2019: 21.432.160)				6.360.000	Spain Government Bond 5,750 % 30-Jul.-2032	11.474.471	1,91
4.990.000	Australia Government Bond 3,000 % 20-Sept.-2025	4.997.343	0,83	7.040.000	Spain Government Bond '144A' 5,150 % 31-Okt.-2028	11.075.212	1,85
14.040.000	Australia Government Bond 3,000 % 21-März-2047	12.249.141	2,04	1.630.000	Spain Government Bond '144A' 5,150 % 31-Okt.-2044	3.400.285	0,57
8.330.000	International Bank for Reconstruction & Development 'MTN' 2,800 % 12-Jan.-2022	5.908.810	0,99	5.960.000	Spain Government Bond '144A' 5,900 % 30-Jul.-2026	9.081.198	1,52
11.430.000	New South Wales Treasury Corp 3,000 % 20-März-2028	8.952.221	1,49	Indonesische Rupiah - 7.632.749 (31. Dezember 2019: 5.994.123)			
9.150.000	Treasury Corp of Victoria 1,000 % 20-Nov.-2023	6.394.765	1,07	38.230.000.000	European Bank for Reconstruction & Development 'GMTN' 6,450 % 13-Dez.-2022	2.621.277	0,44
2.820.000	Treasury Corp of Victoria 2,250 % 20-Nov.-2034	2.048.784	0,34	72.000.000.000	European Bank for Reconstruction & Development 'GMTN' 8,300 % 02-Okt.-2020	5.011.472	0,83
Kanadischer Dollar - 15.424.888 (31. Dezember 2019: 19.135.957)				Japanischer Yen - 52.682.447 (31. Dezember 2019: 78.224.973)			
9.790.000	Canada Housing Trust No 1 '144A' 2,100 % 15-Sept.-2029	7.900.272	1,32	630.650.000	Japan Government Ten Year Bond 0,100 % 20-Dez.-2029	5.901.032	0,98
9.720.000	Canada Housing Trust No 1 '144A' 2,350 % 15-Sept.-2023	7.524.616	1,25	2.229.400.000	Japan Government Thirty Year Bond 0,500 % 20-Sept.-2046	20.554.079	3,43
Kolumbianischer Peso - 5.036.928 (31. Dezember 2019: -)				489.950.000	Japan Government Twenty Year Bond 0,400 % 20-März-2040	4.537.563	0,76
18.453.200.000	Colombia Government International Bond 'REGS' 6,000 % 28-Apr.-2028	5.036.928	0,84	686.200.000	Japan Government Twenty Year Bond 1,000 % 20-Dez.-2035	7.053.198	1,18
Tschechische Krone - 6.297.957 (31. Dezember 2019: -)				941.000.000	Japan Government Two Year Bond 0,100 % 01-Apr.-2022	8.774.253	1,46
128.170.000	Czech Republic Government Bond 2,750 % 23-Jul.-2029	6.297.957	1,05	633.933.061	Japanese Government CPI Linked Bond 0,100 % 10-März-2028	5.862.322	0,98
Dänische Krone - 15.808.434 (31. Dezember 2019: -)				Malaysischer Ringgit - 9.026.404 (31. Dezember 2019: 6.109.640)			
97.100.000	Denmark Government Bond '144A' 0,500 % 15-Nov.-2029	15.808.434	2,64	36.196.000	Malaysia Government Bond 3,906 % 15-Jul.-2026	9.026.404	1,51
Euro - 122.076.790 (31. Dezember 2019: 117.050.963)				Neuer mexikanischer Peso - 9.162.832 (31. Dezember 2019: 6.565.684)			
5.800.000	FMS Wertmanagement 'EMTN' 0,375 % 29-Apr.-2030	6.852.357	1,14	88.900.000	Mexican Bonos 7,500 % 03-Jun.-2027	4.274.133	0,71
3.310.000	French Republic Government Bond OAT 3,250 % 25-Mai-2045	6.171.964	1,03	95.710.000	Mexican Bonos 8,500 % 31-Mai-2029	4.888.699	0,82
6.300.000	German Postal Pensions Securitisation Plc 3,750 % 18-Jan.-2021	7.252.200	1,21	Neuseeländischer Dollar - 12.267.607 (31. Dezember 2019: 22.119.143)			
2.440.000	Indonesia Government International Bond 1,750 % 24-Apr.-2025	2.754.239	0,46	4.130.000	Housing New Zealand Ltd 'MTN' 3,360 % 12-Jun.-2025	2.978.673	0,50
4.870.000	Ireland Government Bond 1,000 % 15-Mai-2026	5.890.919	0,98	6.940.000	New Zealand Government Inflation Linked Bond 3,000 % 20-Sept.-2030	6.274.039	1,05
4.930.000	Ireland Government Bond 1,100 % 15-Mai-2029	6.127.496	1,02	3.860.000	New Zealand Local Government Funding Agency Bond 3,500 % 14-Apr.-2033	3.014.895	0,50
2.514.379	Ireland Government Bond 1,500 % 15-Mai-2050	3.499.570	0,58	Norwegische Krone - 6.141.770 (31. Dezember 2019: 13.647.704)			
4.780.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,500 % 01-Mai-2023	6.001.427	1,00	55.620.000	Norway Government Bond '144A' 1,375 % 19-Aug.-2030	6.141.770	1,02
10.020.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 1,850 % 01-Jul.-2025	11.872.540	1,98	Peruanischer Nuevo Sol - 4.648.375 (31. Dezember 2019: 3.035.753)			
4.990.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 2,450 % 01-Sept.-2050	5.836.017	0,97	12.680.000	Peruvian Government International Bond 'REGS' 8,200 % 12-Aug.-2026	4.648.375	0,78
4.990.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 5,000 % 01-Aug.-2034	7.943.246	1,33				

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

				Angemessener Wert in USD		Summe der Netto- vermögen %						Angemessener Wert in USD		Summe der Netto- vermögen %	
Bestände		Beschreibung						Bestände		Beschreibung					
Anleihen Forts.															
Philippinischer Peso - 5.877.003 (31. Dezember 2019: 2.998.489)				5.877.003		0,98									
290.000.000		Philippine Government International Bond		4,950 % 15-Jan.-2021	5.877.003		0,98								
Sterling - 18.871.580 (31. Dezember 2019: 39.643.040)															
2.100.000		Affordable Housing Finance Plc 'EMTN'		3,800 % 20-Mai-2042	3.847.663		0,64								
6.220.000		United Kingdom Gilt 3,250 % 22-Jan.-2044			12.025.728		2,01								
1.270.000		United Kingdom Gilt 3,750 % 22-Jul.-2052			2.998.189		0,50								
Schwedische Krone - 6.342.265 (31. Dezember 2019: 6.352.986)				6.342.265		1,06									
56.540.000		European Investment Bank 'EMTN'		1,250 % 12-Mai-2025	6.342.265		1,06								
US-Dollar - 230.411.850 (31. Dezember 2019: 210.586.743)				230.411.850		38,44									
4.031.000		Abu Dhabi Government International Bond 'REGS'		2,500 % 16-Apr.-2025	4.252.705		0,71								
2.340.000		Colombia Government International Bond		8,125 % 21-Mai-2024	2.796.639		0,47								
5.610.000		European Bank for Reconstruction		& Development 'GMTN' FRN 0,458 % 11-Mai-2022	5.603.693		0,93								
5.450.000		Export-Import Bank of Korea FRN		1,866 % 25-Jan.-2022	5.480.313		0,91								
2.732.000		Indonesia Government International Bond 'REGS'		4,750 % 08-Jan.-2026	3.082.614		0,51								
4.669.000		Inter-American Development Bank 'GMTN'		3,875 % 28-Okt.-2041	6.534.948		1,09								
5.620.000		International Bank for Reconstruction		& Development FRN 0,728 % 11-Feb.-2021	5.625.440		0,94								
2.940.000		Kommunekredit 'EMTN' 1,625 % 01-Jun.-2021			2.975.033		0,50								
4.288.000		Mexico Government International Bond		3,900 % 27-Apr.-2025	4.601.024		0,77								
3.000.000		Nederlandse Financierings- Maatschappij		voor Ontwikkelingslanden NV FRN											
		0,358 % 07-Sept.-2021			2.997.653		0,50								
5.970.000		Nordic Investment Bank 1,250 % 02-Aug.-2021			6.031.045		1,01								
5.750.000		Oesterreichische Kontrollbank AG		2,875 % 07-Sept.-2021	5.924.466		0,99								
2.731.000		Philippine Government International Bond		2,457 % 05-Mai-2030	2.870.032		0,48								
8.610.000		Province of British Columbia Canada		2,250 % 02-Jun.-2026	9.378.736		1,56								
5.288.000		Qatar Government International Bond 'REGS'		3,400 % 16-Apr.-2025	5.762.566		0,96								
3.925.763		United States Treasury Inflation Indexed Bonds		0,500 % 15-Apr.-2024	4.126.891		0,69								
22.608.672		United States Treasury Inflation Indexed Bonds		0,750 % 15-Jul.-2028	25.535.083		4,26								
4.426.531		United States Treasury Inflation Indexed Bonds		2,125 % 15-Feb.-2041	6.654.423		1,11								
11.470.000		United States Treasury Note/Bond		0,500 % 15-März-2023	11.575.066		1,93								
10.420.000		United States Treasury Note/Bond		1,125 % 28-Feb.-2022	10.588.511		1,77								
22.090.000		United States Treasury Note/Bond		1,500 % 15-Aug.-2026	23.550.882		3,93								

Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.			
2.780.000	United States Treasury Note/Bond		
	1,500 % 15-Feb.-2030	3.009.676	0,50
5.990.000	United States Treasury Note/Bond		
	2,000 % 15-Feb.-2050	6.895.285	1,15
22.305.700	United States Treasury Note/Bond		
	2,375 % 15-Mai-2029	25.778.767	4,30
9.410.000	United States Treasury Note/Bond		
	2,875 % 15-Mai-2043	12.353.749	2,06
16.270.000	United States Treasury Note/Bond		
	3,000 % 15-Nov.-2045	22.046.803	3,68
6.000.000	United States Treasury Strip Principal		
	(Null-Coupon) 0,000 % 15-Mai-2043	4.379.807	0,73
Summe der Anlagen in Anleihen		568.260.943	94,80
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 1.382.086 (siehe unten) 31. Dezember 2019: 699.600)		1.382.086	0,23
Summe der Vermögenswerte zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert		586.424.410	97,83
		Zugrunde liegendes Engagement	Angemessener Wert
Bestände	Beschreibung	in USD	in USD
Summe der Netto- vermögen %			
Offene Terminkontrakte - (328.855) (31. Dezember 2019: -)			
(73)	Euro-Bund		
	Short Futures Contracts		
	Exp Sep.-2020	(14.456.977)	(134.235)
(146)	SFE 10 Year Australian		
	Treasury Bond		
	Short Futures Contracts		
	Exp Sep.-2020	(14.878.159)	(194.620)
Summe der offenen Terminkontrakte		(328.855)	(0,05)
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften - (938.251) (siehe unten) 31. Dezember 2019: (1.824.238))		(938.251)	(0,16)
Summe der finanziellen Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert		(1.267.106)	(0,21)
Nettoumlaufvermögen		14.282.988	2,38
Summe der Nettovermögen		599.440.292	100,00
Der Kontrahent für Terminkontrakte ist UBS AB.			
Portfolioanalyse		% des Gesamtvermögens	
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten			
Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			
OTC-Finanzderivate			
Sonstiges Umlaufvermögen			
Summe der Aktiva		100,00	

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte							Nicht realisierter	Devisenterminkontrakte Forts.							Nicht realisierter
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs-	Kontrahent	Gewinn/(Verlust)		Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs-	Kontrahent	Gewinn/(Verlust)	
datum												datum			
BNY Mellon Global Bond Fund															
US-Dollar	Euro	242.541	216.371	01-Jul.-20	Barclays Bank PLC	10									
Japanischer Yen	US-Dollar	7195.489.301	66.820.282	15-Sept.-20	JPMorgan Chase Bank	33.649									
US-Dollar	Australischer Dollar	31.634.893	45.694.099	15-Sept.-20	Royal Bank of Scotland	332.258									
US-Dollar	Kanadischer Dollar	1.481.415	1.993.101	15-Sept.-20	Citigroup Global Markets Limited	24.259									
US-Dollar	Kolumbianischer Peso	5.407.348	19.862.272.000	15-Sept.-20	Royal Bank of Scotland	138.007									
US-Dollar	Dänische Krone	13.356.512	88.154.941	15-Sept.-20	Royal Bank of Scotland	75.263									
US-Dollar	Euro	1.504.036	1.338.000	15-Sept.-20	State Street Bank	1.745									
US-Dollar	Euro	6.420.701	5.692.493	15-Sept.-20	State Street Bank	29.237									
US-Dollar	Euro	1.020.350	907.000	15-Sept.-20	Canadian Imperial Bank	1.981									
US-Dollar	Indonesische Rupiah	5.717.898	82.223.374.000	15-Sept.-20	State Street Bank	138.138									
US-Dollar	Japanischer Yen	1.986.259	212.886.000	15-Sept.-20	Royal Bank of Scotland	8.316									
US-Dollar	Japanischer Yen	776.984	82.967.000	15-Sept.-20	Barclays Bank PLC	6.130									
US-Dollar	Neuseeländischer Dollar	12.666.580	19.558.532	15-Sept.-20	JPMorgan Chase Bank	142.126									
US-Dollar	Norwegische Krone	137.844	1.290.538	15-Sept.-20	Citigroup Global Markets Limited	5.212									
US-Dollar	Norwegische Krone	6.267.727	58.036.000	15-Sept.-20	UBS AG	303.178									
US-Dollar	Sterling	2.633.281	2.075.000	15-Sept.-20	Citigroup Global Markets Limited	86.042									
US-Dollar	Schwedische Krone	5.048.470	46.783.158	15-Sept.-20	UBS AG	50.540									
						USD	1.376.091								
Kolumbianischer Peso	US-Dollar	19.862.272.000	5.275.238	15-Sept.-20	State Street Bank	(5.896)									
Tschechische Krone	US-Dollar	66.093.909	2.794.001	15-Sept.-20	Citigroup Global Markets Limited	(29.349)									
Euro	US-Dollar	671.326	755.725	15-Sept.-20	Royal Bank of Scotland	(1.967)									
Euro	US-Dollar	953.663	1.071.968	15-Sept.-20	Canadian Imperial Bank	(1.206)									
Euro	US-Dollar	364.448	413.194	15-Sept.-20	State Street Bank	(3.995)									
Euro	US-Dollar	427.536	486.598	15-Sept.-20	Canadian Imperial Bank	(6.566)									
Euro	US-Dollar	34.007.667	38.436.486	15-Sept.-20	The Bank of New York Mellon	(253.077)									
Euro	US-Dollar	483.564	545.939	15-Sept.-20	Barclays Bank PLC	(2.999)									
Sterling	US-Dollar	2.219.013	2.759.579	15-Sept.-20	State Street Bank	(35.551)									
Sterling	US-Dollar	10.784.043	13.654.593	15-Sept.-20	The Bank of New York Mellon	(416.263)									
US-Dollar	Philippinischer Peso	5.621.167	282.562.000	15-Sept.-20	State Street Bank	(20.766)									
						USD	(777.635)								
						Netto USD	598.456								
BNY Mellon Global Bond Fund															
Anteilsklasse EUR H (Hedged)															
US-Dollar	Euro	8.416	7.501	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	7									
US-Dollar	Euro	37.546	32.989	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	558									
						USD	565								
						EUR	504								
BNY Mellon Global Bond Fund															
Anteilsklasse EUR H (Hedged) Forts.															
Euro	US-Dollar	12.056	13.577	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(59)									
Euro	US-Dollar	2.278.237	2.587.940	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(33.511)									
						USD	(33.570)								
						EUR	(29.949)								
						Netto USD	(33.005)								
						Netto EUR	(29.445)								
BNY Mellon Global Bond Fund															
Anteilsklasse EUR I (Hedged)															
US-Dollar	Euro	302	268	02-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	2									
Euro	US-Dollar	2.008	2.251	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	-									
US-Dollar	Euro	50.861	45.050	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	349									
US-Dollar	Euro	7.017	6.248	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	12									
US-Dollar	Euro	8.739	7.794	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	-									
US-Dollar	Euro	1.354	1.197	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	12									
US-Dollar	Euro	9.835	8.705	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	75									
US-Dollar	Euro	8.584	7.650	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	7									
US-Dollar	Euro	13.275	11.788	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	58									
US-Dollar	Euro	4.191	3.725	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	14									
US-Dollar	Euro	3.692	3.261	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	36									
US-Dollar	Euro	16.647	14.791	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	63									
US-Dollar	Euro	11.077	9.796	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	94									
US-Dollar	Euro	1.983	1.742	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	29									
US-Dollar	Euro	4.457	3.918	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	64									
US-Dollar	Euro	2.094	1.855	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	14									
						USD	829								
						EUR	740								
Euro	US-Dollar	6.248	7.015	01-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(12)									
Euro	US-Dollar	45.050	50.847	02-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(350)									
Euro	US-Dollar	268	302	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(2)									
Euro	US-Dollar	7.498	8.413	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(7)									
Euro	US-Dollar	723	815	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(4)									
Euro	US-Dollar	2.248	2.529	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(8)									
Euro	US-Dollar	17.327	19.620	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(192)									

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte Forts.							Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Global Bond Fund							BNY Mellon Global Bond Fund						
Anteilsklasse EUR I (Hedged) Forts.							Anteilsklasse Sterling W (Inc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	4.350	4.919	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(42)	US-Dollar	Sterling	128.670	103.330	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	1.867
Euro	US-Dollar	5.887	6.646	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(45)						USD	1.867
Euro	US-Dollar	7.187.485	8.164.548	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(105.722)						GBP	1.522
US-Dollar	Euro	6.540	5.834	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1)							
					USD	(106.385)							
					EUR	(94.910)							
					Netto USD	(105.556)							
					Netto EUR	(94.170)							
BNY Mellon Global Bond Fund													
Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)													
US-Dollar	Euro	113.934	100.843	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	867							
					USD	867							
					EUR	773							
Euro	US-Dollar	972	1.100	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(10)							
Euro	US-Dollar	99.870	113.447	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1.469)							
					USD	(1.479)							
					EUR	(1.319)							
					Netto USD	(612)							
					Netto EUR	(546)							
BNY Mellon Global Bond Fund													
Anteilsklasse Sterling Z (Acc) (Hedged)													
Sterling	US-Dollar	101.953	129.887	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(4.775)							
					USD	(4.775)							
					GBP	(3.891)							
BNY Mellon Global Bond Fund													
Anteilsklasse Sterling Z (Inc) (Hedged)													
Sterling	US-Dollar	101.953	129.887	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(4.775)							
					USD	(4.775)							
					GBP	(3.891)							
BNY Mellon Global Bond Fund													
Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)													
US-Dollar	Sterling	128.670	103.330	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	1.867							
					USD	1.867							
					GBP	1.522							
Sterling	US-Dollar	1.029	1.288	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(25)							
Sterling	US-Dollar	102.301	130.330	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(4.791)							
					USD	(4.816)							
					GBP	(3.925)							
					Netto USD	(2.949)							
					Netto GBP	(2.403)							

BNY MELLON GLOBAL CREDIT FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Nettovermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Nettovermögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen				Anleihen Forts.			
Überstaatlich - 16.193.685				Frankreich Forts.			
(31. Dezember 2019: 3.970.242)				7.900.000			
16.193.685	Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	16.193.685	2,65	6.189.000	BPCE SA 'MTN' FRN 1,243 % 31-Mai-2022	7.943.482	1,30
					WEA Finance LLC '144A' 2,875 % 15-Jan.-2027	6.047.630	0,99
Summe der Anlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen 16.193.685 2,65				Deutschland - 40.277.564			
Anleihen				(31. Dezember 2019: 18.324.023)			
Australien - 12.257.270				40.277.564 6,58			
(31. Dezember 2019: 14.696.709)				1.563.000	BMW US Capital LLC '144A' 4,150 % 09-Apr.-2030	1.799.679	0,29
3.589.000	Australia & New Zealand Banking Group Ltd '144A' FRN 0,864 % 21-Nov.-2022	3.596.388	0,59	954.000	BMW US Capital LLC 'REGS' 4,150 % 09-Apr.-2030	1.098.461	0,18
4.170.000	Australia Government Bond 3,000 % 21-März-2047	3.665.721	0,60	25.377.777	Bundesobligation 0,000 % 11-Apr.-2025	29.496.044	4,82
125.639	Pepper Residential Securities Trust NO 18 FRN 2,190 % 12-Aug.-2058	86.822	0,01	5.500.000	Eurogrid GmbH 'EMTN' 1,113 % 15-Mai-2032	6.522.512	1,07
4.458.000	Scentre Group Trust 1 / Scentre Group Trust 2 '144A' 4,375 % 28-Mai-2030	4.908.339	0,80	1.300.000	IKB Deutsche Industriebank AG FRN 4,000 % 31-Jan.-2028	1.360.868	0,22
Belgien - 7.682.877				Indonesien - 4.742.831			
(31. Dezember 2019: -)				(31. Dezember 2019: 4.714.936)			
5.604.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 3,700 % 02-Apr.-2040	7.682.877	1,26	2.670.000	Indonesia Government International Bond 'REGS' 5,250 % 08-Jan.-2047	3.351.199	0,55
Bermuda - 789.145				19.820.000.000	Indonesia Treasury Bond 7,000 % 15-Mai-2027	1.391.632	0,22
(31. Dezember 2019: 749.007)				Irland - 7.879.912			
588.000	XLIT Ltd 5,500 % 31-März-2045	789.145	0,13	(31. Dezember 2019: 4.178.994)			
Brasilien - 5.675.218				7.879.912 1,29			
(31. Dezember 2019: 7.918.697)				2.957.000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 6,500 % 15-Jul.-2025	3.103.704	0,51
2.430.000	Braskem Netherlands Finance BV 'REGS' 4,500 % 31-Jan.-2030	2.227.702	0,37	323.022	Arrow CMBS 2018 DAC '2018-1 C' FRN 2,050 % 22-Mai-2030	342.520	0,06
3.000.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,000 % 01-Jan.-2027	654.227	0,11	1.097.938	European Loan Conduit No 37 DAC 2,118 % 02-Mai-2030	1.260.147	0,21
1.833.000	BRF SA 'REGS' 4,875 % 24-Jan.-2030	1.729.894	0,28	698.688	European Loan Conduit No 37 DAC FRN 2,868 % 02-Mai-2030	796.230	0,13
1.059.000	NBM US Holdings Inc 'REGS' 7,000 % 14-Mai-2026	1.063.395	0,17	140.128	European Residential Loan Securitisation 2018-1 DAC '2018-1 A' FRN 0,493 % 24-März-2061	157.971	0,02
Kanada - 714.449				1.873.905	European Residential Loan Securitisation 2019-NPL2 DAC '2019-NPL2 A' FRN 0,993 % 24-Feb.-2058	1.728.166	0,28
(31. Dezember 2019: 5.327.095)				460.000	Toro European CLO 4 DAC FRN 2,100 % 15-Jul.-2030	491.174	0,08
801.338	Air Canada 2017-1 Class AA Pass Through Trust '144A' 3,300 % 15-Jan.-2030	714.449	0,12	Italien - 12.002.827			
Kolumbien - 4.673.880				(31. Dezember 2019: 9.086.318)			
(31. Dezember 2019: 4.803.782)				12.002.827 1,96			
1.500.000	Colombia Government International Bond 4,500 % 15-März-2029	1.653.090	0,27	2.598.000	Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' 1,750 % 04-Jul.-2029	2.937.011	0,48
1.065.000	Colombia Government International Bond 5,200 % 15-Mai-2049	1.255.300	0,20	1.057.000	Intesa Sanpaolo SpA FRN (Immerwährend) 3,750 % 27-Feb.-2025	961.908	0,16
1.614.000	Transportadora de Gas Internacional SA ESP 'REGS' 5,550 % 01-Nov.-2028	1.765.490	0,29	3.664.780	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 1,300 % 15-Mai-2028	4.280.795	0,70
Dänemark - 3.626.251				2.623.000	UniCredit SpA FRN 2,731 % 15-Jan.-2032	2.678.034	0,44
(31. Dezember 2019: 4.716.232)				995.000	Unipol Gruppo SpA 'EMTN' 3,500 % 29-Nov.-2027	1.145.079	0,18
3.346.000	Danske Bank A/S 'EMTN' FRN 1,375 % 12-Feb.-2030	3.626.251	0,59	Japan - 16.739.018			
Ägypten - 3.107.589				(31. Dezember 2019: 9.651.075)			
(31. Dezember 2019: 3.271.358)				16.739.018 2,74			
3.020.000	Egypt Government International Bond 'REGS' 6,200 % 01-März-2024	3.107.589	0,51	6.750.000	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc FRN 1,781 % 25-Jul.-2022	6.775.303	1,11
Frankreich - 18.157.800				903.000	Mizuho Financial Group Inc FRN 1,311 % 28-Feb.-2022	908.854	0,15
(31. Dezember 2019: 40.572.412)				1.922.000	Mizuho Financial Group Inc FRN 1,453 % 13-Sept.-2021	1.939.768	0,32
2.958.000	Airbus SE 'EMTN' 1,625 % 09-Jun.-2030	3.368.064	0,55	3.327.000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd 1,375 % 09-Jul.-2032	3.775.509	0,62
687.000	Airbus SE 'EMTN' 2,375 % 09-Jun.-2040	798.624	0,13	2.970.000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd 2,000 % 09-Jul.-2040	3.339.584	0,54

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener		Summe			Angemessener		Summe
Bestände	Beschreibung	Wert in USD	der Netto- vermögen %		Bestände	Beschreibung	Wert in USD	der Netto- vermögen %	
Anleihen Forts.					Anleihen Forts.				
	Mexiko - 6.469.165 (31. Dezember 2019: 4.693.050)	6.469.165	1,06			Schweden - 6.726.238 (31. Dezember 2019: 2.257.054)	6.726.238	1,10	
26.500.000	Mexican Bonos 7,500 % 03-Jun.-2027	1.285.287	0,21		6.700.000	Skandinaviska Enskilda Banken AB 'REGS' FRN 0,963 % 12-Dez.-2022	6.726.238	1,10	
5.226.000	Mexico Government International Bond 3,250 % 16-Apr.-2030	5.183.878	0,85						
	Marokko - 2.029.312 (31. Dezember 2019: 623.150)	2.029.312	0,33			Schweiz - 5.843.557 (31. Dezember 2019: 4.629.349)	5.843.557	0,95	
1.936.000	Morocco Government International Bond 'REGS' 1,500 % 27-Nov.-2031	2.029.312	0,33		5.112.000	Credit Suisse Group AG 'REGS' FRN 4,194 % 01-Apr.-2031	5.843.557	0,95	
	Niederlande - 12.298.781 (31. Dezember 2019: 18.037.767)	12.298.781	2,01			Großbritannien - 50.487.159 (31. Dezember 2019: 65.684.629)	50.487.159	8,25	
380.000	Barings Euro CLO 2017-1 BV '2017-1X C' FRN 2,000 % 15-Okt.-2030	410.229	0,07		4.151.000	AA Bond Co Ltd 'EMTN' 4,875 % 31-Jul.-2024	5.045.066	0,82	
790.000	Dryden XXVII-R Euro CLO 2017 BV '2017-27X B1' FRN 1,500 % 15-Mai-2030	880.347	0,15		1.500.000	Aggregator of Loans Backed by Assets 2015-1 Plc '2015-1 B' FRN 1,750 % 24-Apr.-2049	1.898.033	0,31	
2.122.000	Heineken NV 'EMTN' 1,750 % 07-Mai-2040	2.405.442	0,39		1.353.200	Alba 2007-1 Plc '2007-1 B' FRN 0,412 % 17-März-2039	1.489.924	0,24	
1.603.000	Heineken NV 'EMTN' 2,250 % 30-März-2030	2.042.491	0,33		2.700.000	Barclays Plc FRN 1,822 % 15-Feb.-2023	2.693.150	0,44	
5.043.000	ING Groep NV FRN 1,456 % 29-März-2022	5.080.706	0,83		6.000.000	Barclays Plc FRN 2,558 % 10-Aug.-2021	6.093.510	1,00	
1.432.000	Lincoln Financing SARL 'REGS' 3,625 % 01-Apr.-2024	1.479.566	0,24		3.708.000	BAT Capital Corp 4,906 % 02-Apr.-2030	4.345.007	0,71	
	Portugal - 1.253.827 (31. Dezember 2019: 2.846.315)	1.253.827	0,20		2.446.000	BP Capital Markets Plc FRN (Immerwährend) 3,250 % 22-März-2026	2.761.933	0,45	
1.200.000	Banco Comercial Portugues SA 'EMTN' FRN 3,871 % 27-März-2030	1.253.827	0,20		3.054.000	BP Capital Markets Plc FRN (Immerwährend) 3,625 % 22-März-2029	3.450.386	0,56	
	Qatar - 1.752.071 (31. Dezember 2019: 1.723.262)	1.752.071	0,29		837.660	British Airways 2018-1 Class AA Pass Through Trust '144A' 3,800 % 20-Sept.-2031	797.980	0,13	
1.630.000	Qatar Government International Bond 'REGS' 3,875 % 23-Apr.-2023	1.752.071	0,29		3.364.000	Channel Link Enterprises Finance Plc FRN 1,761 % 30-Jun.-2050	3.768.912	0,62	
	Rumänien - 2.048.982 (31. Dezember 2019: -)	2.048.982	0,33		1.010.000	Dukinfield Plc FRN 2,092 % 15-Aug.-2045	1.257.138	0,21	
1.949.000	Romanian Government International Bond 'REGS' 2,000 % 28-Jan.-2032	2.048.982	0,33		2.037.959	Finsbury Square 2017-2 Plc '2017-2 C' FRN 1,898 % 12-Sept.-2065	2.457.726	0,40	
	Saudi Arabien - 4.653.736 (31. Dezember 2019: 2.616.517)	4.653.736	0,76		496.000	Newday Funding 2017-1 Plc '2017-1 D' FRN 2,344 % 15-Jul.-2025	609.627	0,10	
2.300.000	Saudi Government International Bond 'REGS' 4,500 % 17-Apr.-2030	2.720.923	0,44		799.000	Newday Funding 2018-2 Plc '2018-2X C' FRN 2,494 % 15-Dez.-2026	979.082	0,16	
1.500.000	Saudi Government International Bond 'REGS' 5,250 % 16-Jan.-2050	1.932.813	0,32		250.000	Newday Partnership Funding 2015-1 Plc '2015-1 B' FRN 2,594 % 15-Apr.-2025	308.643	0,05	
	Spanien - 24.868.808 (31. Dezember 2019: 11.784.913)	24.868.808	4,06		500.000	Newday Partnership Funding 2015-1 Plc '2015-1 D' FRN 3,494 % 15-Apr.-2025	618.384	0,10	
400.000	Abanca Corp Bancaria SA FRN 4,625 % 07-Apr.-2030	426.953	0,07		1.054.000	Phoenix Group Holdings Plc 'EMTN' 5,625 % 28-Apr.-2031	1.408.514	0,23	
1.700.000	Abanca Corp Bancaria SA FRN 6,125 % 18-Jan.-2029	1.926.663	0,31		3.345.000	RAC Bond Co Plc 'EMTN' 4,870 % 06-Mai-2026	4.142.097	0,68	
3.900.000	Bankia SA 'EMTN' FRN 3,750 % 15-Feb.-2029	4.332.184	0,71		144.979	Ribbon Finance 2018 Plc '2018-1 D' FRN 2,402 % 20-Apr.-2028	137.720	0,02	
3.600.000	Cellnex Telecom SA 1,875 % 26-Jun.-2029	4.001.366	0,65		554.237	RMAC Securities No 1 Plc '2006-NS4X M1C' FRN 0,000 % 12-Jun.-2044	566.672	0,09	
2.400.000	Ibercaja Banco SA FRN 2,750 % 23-Jul.-2030	2.379.575	0,39		2.170.000	Rothsay Life Plc 3,375 % 12-Jul.-2026	2.663.997	0,44	
5.200.000	Inmobiliaria Colonial Socimi SA 'EMTN' 2,000 % 17-Apr.-2026	5.921.612	0,97		500.000	Salus European Loan Conduit NO 33 DAC FRN 3,222 % 23-Jan.-2029	598.337	0,10	
1.900.000	Liberbank SA FRN 6,875 % 14-März-2027	2.200.068	0,36		113.369	THRONES 2015-1 Plc '2015-1 A' FRN 1,358 % 18-März-2050	138.341	0,02	
840.000	Spain Government Bond '144A' 2,700 % 31-Okt.-2048	1.276.172	0,21		500.000	THRONES 2015-1 Plc '2015-1 B' FRN 1,558 % 18-März-2050	621.258	0,10	
1.250.000	Spain Government Bond '144A' 4,900 % 30-Jul.-2040	2.404.215	0,39		1.086.224	United Kingdom Gilt 1,500 % 22-Jul.-2047	1.635.722	0,27	
						USA - 339.838.557 (31. Dezember 2019: 179.245.157)	339.838.557	55,54	
					2.014.000	Air Lease Corp 3,250 % 01-März-2025	2.020.345	0,33	
					1.634.000	Air Lease Corp 3,375 % 01-Jul.-2025	1.638.636	0,27	
					944.000	Air Lease Corp 4,625 % 01-Okt.-2028	967.040	0,16	

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener	Summe			Angemessener	Summe	
Bestände	Beschreibung	Wert in USD	der Netto- vermögen %	Bestände	Beschreibung	Wert in USD	der Netto- vermögen %	
Devisenoptionen - 38.990 (31. Dezember 2019: 16.236)				Kreditverzugsswaps Forts.				
1.100.000	US dollar/Australian dollar Put 20-Jul.-2020 0,685	8.078	0,00	12.050.000	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 33 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	(144.973)	(0,02)	
1.000.000	US dollar/Brazilian real Put 02-Jul.-2020 5,450	9.348	0,00	99.425.000	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 33 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	(1.196.176)	(0,20)	
1.100.000	US dollar/Japanese yen Call 17-Aug.-2020 106,000	3.765	0,00	6.100.000	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 34 Version 1 1,000 % 20-Jun.-2025	(72.016)	(0,01)	
1.100.000	US dollar/Mexican peso Put 08-Jul.-2020 20,900	55	0,00	14.640.000	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 34 Version 1 1,000 % 20-Jun.-2025	(172.838)	(0,03)	
1.100.000	US dollar/South African rand Call 16-Jul.-2020 17,300	17.744	0,00	12.080.000	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 34 Version 1 1,000 % 20-Jun.-2025	(142.615)	(0,02)	
Summe der Devisenoptionen		38.990	0,00	12.080.000	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 34 Version 1 1,000 % 20-Jun.-2025	(142.615)	(0,02)	
		Zugrunde	Angemessener	Summe				
		liegendes Engagement	Wert	der Netto-				
Bestände	Beschreibung	in USD	in USD	vermögen %				
Offene Terminkontrakte - 229.747 (31. Dezember 2019: 1.158.877)				Kreditverzugsswaps Forts.				
116	Canadian 10 Year Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Sep.-2020	13.143.135	23.505	0,00	56.575.000	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 34 Version 1 1,000 % 20-Jun.-2025	(667.919)	(0,11)
25	Euro-Bobl Long Futures Contracts Exp Sep.-2020	3.791.254	9.774	0,00	2.700.000	CDS iTraxx Europe Crossover Series 32 Version 1 5,000 % 20-Dez.-2024	(167.598)	(0,03)
173	Euro-Schatz Long Futures Contracts Exp Sep.-2020	21.796.163	8.261	0,00	9.100.000	CDS iTraxx Europe Crossover Series 33 Version 1 5,000 % 20-Jun.-2025	(527.945)	(0,09)
2	Japanese 10 Year Bond Long Futures Contracts Exp Sep.-2020	2.814.540	–	–	9.000.000	CDS iTraxx Europe Senior Financials Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	(132.143)	(0,02)
132	U.S. 10 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Sep.-2020	18.370.687	63.668	0,01	12.200.000	CDS iTraxx Europe Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	(226.724)	(0,04)
160	U.S. 2 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Sep.-2020	35.332.500	8.750	0,00	18.300.000	CDS iTraxx Europe Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	(340.086)	(0,06)
127	U.S. 5 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Sep.-2020	15.969.258	26.742	0,01	82.700.000	CDS iTraxx Europe Series 33 Version 1 1,000 % 20-Jun.-2025	(1.546.622)	(0,25)
131	U.S. Treasury Bond Long Futures Contracts Exp Sep.-2020	23.391.687	88.874	0,02	15.400.000	CDS iTraxx Europe Series 33 Version 1 1,000 % 20-Jun.-2025	(288.005)	(0,05)
37	UK Long Gilt Long Futures Contracts Exp Sep.-2020	6.310.343	173	0,00	(492.000)	CDS iTraxx Europe Sub Financials Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	(12.730)	(0,00)
Summe der offenen Terminkontrakte		229.747	0,04	(954.000)	CDS iTraxx Europe Sub Financials Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	(24.683)	(0,00)	
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 1.708.121 (siehe unten) 31. Dezember 2019: 8.892.272)		1.708.121	0,28	(2.600.000)	CDS iTraxx Europe Sub Financials Series 32 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	(67.270)	(0,01)	
Summe der Vermögenswerte zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert		621.220.801	101,51	(2.600.000)	CDS iTraxx Europe Sub Financials Series 33 Version 1 1,000 % 20-Jun.-2025	(93.516)	(0,01)	
Kreditverzugsswaps - (6.924.496) (31. Dezember 2019: (8.235.966))				4.550.000	CDS Kinder Morgan Inc/DE 1,000 % 20-Jun.-2025	(85.193)	(0,01)	
(950.000)	CDS Airbus SE 1,000 % 20-Jun.-2025	(7.748)	(0,00)	4.100.000	CDS Lloyds Banking Group Plc 1,000 % 20-Jun.-2025	(59.431)	(0,01)	
2.620.000	CDS Barrick Gold Corp 1,000 % 20-Jun.-2025	(103.184)	(0,02)	1.260.000	CDS Newmont Corp 1,000 % 20-Jun.-2025	(51.024)	(0,01)	
3.280.000	CDS Barrick Gold Corp 1,000 % 20-Jun.-2025	(129.177)	(0,02)	3.170.000	CDS Newmont Corp 1,000 % 20-Jun.-2025	(128.370)	(0,02)	
3.300.000	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 33 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	(39.702)	(0,01)	4.150.000	CDS Sherwin-Williams Co/The 1,000 % 20-Jun.-2025	(132.413)	(0,02)	
3.100.000	CDS CDX North America Investment Grade Index Series 33 Version 1 1,000 % 20-Dez.-2024	(37.296)	(0,01)	(2.400.000)	CDS Southern Water Services Ltd 1,000 % 20-Jun.-2021	(7.307)	(0,00)	
Summe der Kreditverzugsswaps				1.050.000	CDS United Rentals North America Inc 5,000 % 20-Jun.-2025	(177.177)	(0,03)	
(6.924.496)				(1,13)				
Devisenoptionen - (18.094) (31. Dezember 2019: (7.382))				Summe der Devisenoptionen				
(2.200.000)	US dollar/Australian dollar Put 20-Jul.-2020 0,665	(4.172)	(0,00)	(18.094)		(0,00)		
(1.500.000)	US dollar/Brazilian real Put 02-Jul.-2020 5,650	(1.842)	(0,00)					
(1.100.000)	US dollar/Japanese yen Call 17-Aug.-2020 102,000	(698)	(0,00)					
(1.100.000)	US dollar/Japanese yen Call 17-Aug.-2020 104,000	(1.530)	(0,00)					
(1.650.000)	US dollar/South African rand Call 16-Jul.-2020 17,800	(9.852)	(0,00)					

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

					Devisenterminkontrakte							Nicht
Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement in USD	Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %	Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	realisierter Gewinn/(Verlust)	
Offene Terminkontrakte - (460.407) (31. Dezember 2019: (1.028.254))					BNY Mellon Global Credit Fund							
(11)	Euro-BTP				US-Dollar	Brasilianischer Real	488.355	2.500.000	02-Jul.-20	BNP Paribas	28.635	
	Short Futures Contracts				US-Dollar	Brasilianischer Real	746.278	4.008.000	02-Jul.-20	Goldman Sachs	9.256	
	Exp Sep.-2020	(1.778.142)	(34.941)	(0,01)	Euro	US-Dollar	1.640.000	1.839.691	10-Jul.-20	Lloyds Bank plc	3.193	
(35)	Euro-Bund				Euro	US-Dollar	1.620.000	1.815.351	10-Jul.-20	HSBC Bank plc	5.059	
	Short Futures Contracts				Japanischer Yen	US-Dollar	134.627.000	1.230.739	10-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	16.228	
	Exp Sep.-2020	(6.941.213)	(16.606)	(0,00)	Sterling	US-Dollar	3.710.000	4.568.001	10-Jul.-20	Lloyds Bank plc	29.324	
(16)	Euro-Buxl 30 Year Bond				US-Dollar	Euro	119.049.096	105.655.000	10-Jul.-20	Natwest Markets Plc	323.551	
	Short Futures Contracts				US-Dollar	Euro	3.420.551	3.040.000	10-Jul.-20	BNP Paribas	4.474	
	Exp Sep.-2020	(3.954.004)	(14.533)	(0,00)	US-Dollar	Euro	29.375.422	26.040.000	10-Jul.-20	Goldman Sachs	114.022	
(68)	SFE 10 Year Australian Treasury Bond				US-Dollar	Euro	3.366.781	2.983.000	10-Jul.-20	Bank of America Merrill Lynch	14.755	
	Short Futures Contracts				US-Dollar	Mexikanischer Peso	1.121.244	24.403.000	10-Jul.-20	Goldman Sachs	60.741	
	Exp Sep.-2020	(6.982.164)	(73.126)	(0,01)	US-Dollar	Sterling	13.391.531	10.624.000	10-Jul.-20	Toronto Dominion Bank	226.578	
(381)	U.S. 10 Year Ultra Treasury Note				US-Dollar	Sterling	13.385.828	10.623.000	10-Jul.-20	HSBC Bank plc	222.114	
	Short Futures Contracts				US-Dollar	Sterling	13.390.161	10.624.000	10-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	225.209	
	Exp Sep.-2020	(60.001.547)	(280.701)	(0,05)	US-Dollar	Sterling	3.264.232	2.600.000	10-Jul.-20	Natwest Markets Plc	42.388	
(10)	U.S. Treasury Ultra Bond				Australischer Dollar	US-Dollar	798.605	550.000	16-Jul.-20	Goldman Sachs	1.164	
	Short Futures Contracts				Koreanischer Won	US-Dollar	120.000.000	99.695	16-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	208	
	Exp Sep.-2020	(2.181.562)	(40.500)	(0,01)	Mexikanischer Peso	US-Dollar	3.744.676	161.317	16-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	1.279	
Summe der offenen Terminkontrakte					(460.407)			(0,08)				
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften - (5.102.579) (siehe unten) 31. Dezember 2019: (2.636.877))					(5.102.579)			(0,83)				
Summe der finanziellen Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert					(12.505.576)			(2,04)				
Nettoumlaufvermögen					3.244.653			0,53				
Summe der Nettovermögen					611.959.878			100,00				
Die Gegenparteien für Credit Default Swaps sind Bank of America Merrill Lynch, Barclays Bank PLC, BNP Paribas, Citigroup Global Markets Limited, Goldman Sachs, JPMorgan Chase Bank und Morgan Stanley. Die Kontrahenten für Währungsoptionen sind Barclays Bank PLC, BNP Paribas und Goldman Sachs. Der Kontrahent für Futures ist Goldman Sachs.												
Portfolioanalyse					% des Gesamtvermögens							
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente					96,54							
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate					0,04							
OTC-Finanzderivate					1,29							
Sonstiges Umlaufvermögen					2,13							
Summe der Aktiva					100,00							
					USD 1.704.239							
	Brasilianischer Real	US-Dollar	6.508.000	1.227.693	02-Jul.-20	Goldman Sachs	(30.951)					
	Euro	US-Dollar	2.095.000	2.356.714	10-Jul.-20	Bank of America Merrill Lynch	(2.542)					
	Euro	US-Dollar	3.590.000	4.084.575	10-Jul.-20	BNP Paribas	(50.457)					
	Euro	US-Dollar	2.240.000	2.551.611	10-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(34.501)					
	Euro	US-Dollar	8.470.000	9.567.717	10-Jul.-20	Goldman Sachs	(49.896)					
	Euro	US-Dollar	1.781.000	2.010.078	10-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(8.751)					
	Sterling	US-Dollar	3.015.000	3.741.329	10-Jul.-20	Lloyds Bank plc	(5.228)					
	Sterling	US-Dollar	740.000	918.351	10-Jul.-20	Lloyds Bank plc	(1.365)					
	Sterling	US-Dollar	1.687.000	2.107.768	10-Jul.-20	Lloyds Bank plc	(17.287)					
	US-Dollar	Australischer Dollar	3.319.996	4.817.000	10-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(4.378)					
	US-Dollar	Euro	5.168.630	4.600.000	10-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(434)					
	US-Dollar	Japanischer Yen	401.344	43.621.000	10-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(2.691)					

Portfolioanalyse		% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		
		96,54
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		
OTC-Finanzderivate		0,04
Sonstiges Umlaufvermögen		1,29
		2,13
Summe der Aktiva		100,00

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte Forts.							Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Global Credit Fund Forts.							BNY Mellon Global Credit Fund						
Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged) Forts.							Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged) Forts.						
Australischer Dollar	US-Dollar	794.570	550.000	16-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(1.620)	Euro	US-Dollar	406.933	457.480	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(152)
Australischer Dollar	US-Dollar	793.971	550.000	16-Jul.-20	BNP Paribas	(2.034)	Euro	US-Dollar	13.536	15.325	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(113)
Euro	Polnischer Zloty	166.000	742.742	16-Jul.-20	BNP Paribas	(1.184)	Euro	US-Dollar	113.168	127.440	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(257)
Euro	Polnischer Zloty	167.000	747.302	16-Jul.-20	HSBC Bank plc	(1.212)	Euro	US-Dollar	49.988	56.528	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(351)
Euro	Polnischer Zloty	167.000	747.262	16-Jul.-20	HSBC Bank plc	(1.202)	Euro	US-Dollar	29.972	34.163	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(479)
Koreanischer Won	US-Dollar	1.860.000.000	1.563.380	16-Jul.-20	HSBC Bank plc	(14.887)	Euro	US-Dollar	39.986	45.363	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(425)
Mexikanischer Peso	US-Dollar	21.653.020	969.909	16-Jul.-20	RBC Capital Markets	(29.722)	Euro	US-Dollar	30.505	34.490	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(208)
Mexikanischer Peso	US-Dollar	12.235.473	550.000	16-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(18.729)	Euro	US-Dollar	9.816.515	11.151.869	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(119.675)
Polnischer Zloty	US-Dollar	1.976.716	502.639	16-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(2.978)	Euro	US-Dollar	8.988	10.163	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(63)
Russischer Rubel	US-Dollar	38.500.000	551.027	16-Jul.-20	BNP Paribas	(11.122)	Euro	US-Dollar	14.988	16.845	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(2)
Russischer Rubel	US-Dollar	70.000.000	1.014.250	16-Jul.-20	HSBC Bank plc	(32.604)	Euro	US-Dollar	50.000	56.282	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(90)
Sterling	Euro	448.517	500.000	16-Jul.-20	BNP Paribas	(6.121)	Euro	US-Dollar	159.936	180.109	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(367)
Sterling	Euro	678.804	757.000	16-Jul.-20	BNP Paribas	(9.576)							USD (122.182)
Sterling	Euro	217.759	243.000	16-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(3.247)							EUR (108.751)
US-Dollar	Australischer Dollar	550.000	800.881	16-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(2.735)							Netto USD (118.300)
US-Dollar	Australischer Dollar	550.000	803.351	16-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(4.440)							Netto EUR (105.296)
US-Dollar	Australischer Dollar	550.000	803.125	16-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(4.284)							
US-Dollar	Australischer Dollar	550.000	800.291	16-Jul.-20	BNP Paribas	(2.328)							
US-Dollar	Indische Rupie	395.898	30.000.000	16-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(759)							
US-Dollar	Koreanischer Won	544.088	660.000.000	16-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(5.378)							
US-Dollar	Koreanischer Won	544.406	660.000.000	16-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(5.059)							
US-Dollar	Mexikanischer Peso	550.000	12.715.784	16-Jul.-20	BNP Paribas	(2.127)							
						USD (371.829)							
						Netto USD 1.332.410							
BNY Mellon Global Credit Fund							BNY Mellon Global Credit Fund						
Anteilsklasse CAD X (Acc) (Hedged)							Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)						
Kanadischer Dollar	US-Dollar	600.931.672	447.252.759	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(4.593.145)	Sterling	US-Dollar	12.606	15.653	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(32)
						USD (4.593.145)	Sterling	US-Dollar	14.843	18.661	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(267)
						CAD (6.235.654)	Sterling	US-Dollar	114.606	146.352	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(4.331)
							Sterling	US-Dollar	339.465	431.463	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(10.793)
													USD (15.423)
													GBP (12.447)
BNY Mellon Global Credit Fund							BNY Mellon Global Credit Fund						
Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)							Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)						
US-Dollar	Euro	16.841	14.988	02-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	2							
Euro	US-Dollar	35.000	39.288	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	46							
Euro	US-Dollar	74.974	83.911	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	347							
Euro	US-Dollar	89.933	100.808	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	263							
US-Dollar	Euro	534.669	472.883	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	3.224							
						USD 3.882							
						EUR 3.455							

BNY MELLON GLOBAL DYNAMIC BOND FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen				Anleihen Forts.			
Sterling - 5.108.233 (31. Dezember 2019: 8.541.856)				Euro Forts.			
3.120.000	BNY Mellon Investments Funds - BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	5.108.233	1,38	1.600.000	Covivio 1,625 % 23-Jun.-2030	1.797.082	0,49
US-Dollar - 1.810.749 (31. Dezember 2019: 22.411.413)				1.715.000	CRH Finland Services Oyj 'EMTN' 0,875 % 05-Nov.-2023	1.953.381	0,53
353.248	iShares China CNY Bond UCITS ETF - ETF	1.810.749	0,49	619.000	DH Europe Finance II Sarl 0,450 % 18-März-2028	680.069	0,18
Summe der Anlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen 6.918.982 1,87				2.115.000	Digital Euro Finco LLC 1,125 % 09-Apr.-2028	2.380.176	0,64
Anleihen				831.000	Fidelity National Information Services Inc 0,625 % 03-Dez.-2025	924.902	0,25
Australischer Dollar - 17.541.328 (31. Dezember 2019: 23.795.567)				1.350.000	Fomento Economico Mexicano SAB de CV 1,750 % 20-März-2023	1.560.111	0,42
3.130.000	Australia Government Bond 3,000 % 20-Sept.-2025	3.134.606	0,85	3.500.000	German Postal Pensions Securitisation Plc 3,750 % 18-Jan.-2021	4.029.000	1,09
5.250.000	Australia Government Bond 3,000 % 21-März-2047	4.580.341	1,24	800.000	Infineon Technologies AG 'EMTN' FRN (Immerwährend) 2,875 % 01-Jan.-2025	878.105	0,24
8.010.000	Treasury Corp of Victoria 1,000 % 20-Nov.-2023	5.598.040	1,51	500.000	Infineon Technologies AG FRN (Immerwährend) 3,625 % 01-Jan.-2028	557.687	0,15
5.820.000	Treasury Corp of Victoria 2,250 % 20-Nov.-2034	4.228.341	1,14	994.000	Informa Plc 'EMTN' 1,500 % 05-Jul.-2023	1.094.527	0,30
Kanadischer Dollar - 9.515.105 (31. Dezember 2019: 13.865.586)				1.132.000	IQVIA Inc 'REGS' 2,875 % 15-Jun.-2028	1.267.274	0,34
4.980.000	Canada Housing Trust No 1 '144A' 2,100 % 15-Sept.-2029	4.018.729	1,09	7.280.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,500 % 01-Mai-2023	9.140.249	2,47
7.100.000	Canada Housing Trust No 1 '144A' 2,350 % 15-Sept.-2023	5.496.376	1,48	6.280.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 1,850 % 01-Jul.-2025	7.441.073	2,01
Kolumbianischer Peso - 3.198.263 (31. Dezember 2019: -)				1.500.000	JCDecaux SA 2,000 % 24-Okt.-2024	1.701.444	0,46
11.717.100.000	Colombia Government International Bond 'REGS' 6,000 % 28-Apr.-2028	3.198.263	0,86	1.600.000	Linde Finance BV 0,250 % 19-Mai-2027	1.809.394	0,49
Tschechische Krone - 3.799.873 (31. Dezember 2019: -)				1.015.000	Lloyds Banking Group Plc FRN (Immerwährend) 4,947 % 27-Jun.-2025	1.110.307	0,30
87.750.000	Czech Republic Government Bond 1,250 % 14-Feb.-2025	3.799.873	1,03	1.280.000	Motability Operations Group Plc 'EMTN' 1,625 % 09-Jun.-2023	1.502.574	0,41
Dänische Krone - 2.191.358 (31. Dezember 2019: 4.097.107)				1.265.000	Nestle Finance International Ltd 'EMTN' 0,125 % 12-Nov.-2027	1.414.161	0,38
14.420.000	Jyske Realkredit A/S 1,000 % 01-Apr.-2021	2.191.358	0,59	1.092.000	Nokia Oyj 'EMTN' 2,375 % 15-Mai-2025	1.260.310	0,34
Euro - 87.360.094 (31. Dezember 2019: 74.927.586)				246.000	Orange SA 'EMTN' FRN (Immerwährend) 4,000 % 01-Okt.-2021	284.947	0,08
497.000	Air Products and Chemicals Inc 'EMTN' 0,500 % 05-Mai-2028	561.394	0,15	723.000	PepsiCo Inc 0,250 % 06-Mai-2024	816.283	0,22
892.000	Akelius Residential Property AB FRN 2,249 % 17-Mai-2081	925.015	0,25	300.000	Prologis International Funding II SA 'EMTN' 1,625 % 17-Jun.-2032	352.203	0,10
1.299.000	Allied Irish Banks Plc 'EMTN' FRN 4,125 % 26-Nov.-2025	1.462.049	0,40	3.930.000	Province of British Columbia Canada 'EMTN' 0,875 % 08-Okt.-2025	4.645.595	1,26
1.319.000	AT&T Inc 1,600 % 19-Mai-2028	1.515.334	0,41	1.529.000	Reckitt Benckiser Treasury Services Nederland BV 'REGS' 0,375 % 19-Mai-2026	1.725.400	0,47
1.200.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN (Immerwährend) 5,875 % 24-Mai-2022	1.310.647	0,35	2.017.000	SELP Finance Sarl 1,250 % 25-Okt.-2023	2.280.188	0,62
800.000	Banco Santander SA FRN (Immerwährend) 5,250 % 29-Sept.-2023	847.401	0,23	1.160.000	Shell International Finance BV 'EMTN' 1,125 % 07-Apr.-2024	1.350.383	0,36
524.000	Banijay Entertainment SASU 'REGS' 3,500 % 01-März-2025	563.071	0,15	592.000	SIG Combibloc PurchaseCo Sarl 'REGS' 1,875 % 18-Jun.-2023	673.361	0,18
1.100.000	CA Immobilien Anlagen AG 0,875 % 05-Feb.-2027	1.166.126	0,32	1.952.564	Silverback Finance DAC 3,126 % 25-Feb.-2037	2.365.206	0,64
1.000.000	Cellnex Telecom SA 1,875 % 26-Jun.-2029	1.109.053	0,30	892.000	Societe Generale SA FRN (Immerwährend) 6,750 % 07-Apr.-2021	997.924	0,27
1.063.000	Cirsa Finance International Sarl 'REGS' 4,750 % 22-Mai-2025	1.063.227	0,29	4.800.000	Spain Government Bond '144A' 5,150 % 31-Okt.-2028	7.551.281	2,04
1.000.000	Coventry Building Society 2,500 % 18-Nov.-2020	1.131.297	0,31	1.628.000	Summer BC Holdco B SARL 'REGS' 5,750 % 31-Okt.-2026	1.760.958	0,48
				342.000	Synlab Bondco Plc 'REGS' FRN 4,750 % 01-Jul.-2025	383.176	0,10
				171.000	Synthomer Plc 'REGS' 3,875 % 01-Jul.-2025	193.852	0,05
				1.000.000	Telefonica Europe BV FRN (Immerwährend) 4,375 % 14-Dez.-2024	1.158.731	0,31
				1.820.000	UBS AG 'EMTN' FRN 4,750 % 12-Feb.-2026	2.079.596	0,56
				1.260.000	UniCredit SpA 'EMTN' FRN (Immerwährend) 3,875 % 03-Jun.-2027	1.041.597	0,28

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
Euro Forts.				Singapur-Dollar - 4.275.973 (31. Dezember 2019: 2.450.058)			
300.000	Volkswagen International Finance NV 0,500 % 30-März-2021	335.996	0,09	5.870.000	Singapore Government Bond 2,250 % 01-Jun.-2021	4.275.973	1,16
1.700.000	Volkswagen International Finance NV FRN (Immerwährend) 3,875 % 17-Jun.-2029	1.868.193	0,50	Sterling - 27.166.894 (31. Dezember 2019: 26.324.834)			
1.282.000	Whirlpool EMEA Finance Sarl 0,500 % 20-Feb.-2028	1.338.784	0,36	928.000	Anglian Water Services Financing Plc 'EMTN' 1,625 % 10-Aug.-2025	1.165.104	0,32
Indische Rupie - 683.670 (31. Dezember 2019: 860.905)				899.000	Bank of Ireland Group Plc 'EMTN' FRN 3,125 % 19-Sept.-2027	1.091.823	0,30
50.000.000	Housing Development Finance Corp Ltd 'EMTN' 8,220 % 28-März-2022	683.670	0,19	1.390.000	BUPA Finance Plc FRN (Immerwährend) 6,125 % 16-Sept.-2020	1.706.155	0,46
Indonesische Rupiah - 3.162.606 (31. Dezember 2019: 2.384.513)				1.323.000	Close Brothers Finance Plc 'EMTN' 2,750 % 19-Okt.-2026	1.704.696	0,46
46.125.000.000	European Bank for Reconstruction & Development 'GMTN' 6,450 % 13-Dez.-2022	3.162.606	0,86	629.000	CPUK Finance Ltd 'REGS' 4,250 % 28-Aug.-2022	743.837	0,20
Japanischer Yen - 15.725.427 (31. Dezember 2019: 41.345.970)				3.000.000	Dexia Credit Local SA 0,500 % 22-Jul.-2023	3.694.700	1,00
293.850.000	Japan Government Two Year Bond 0,100 % 01-Jun.-2021	2.735.077	0,74	354.000	Hiscox Ltd 2,000 % 14-Dez.-2022	435.440	0,12
1.170.000.000	Japan Government Two Year Bond 0,100 % 01-Apr.-2022	10.909.539	2,95	1.055.000	Iceland Bondco Plc 'REGS' 4,625 % 15-März-2025	1.164.334	0,31
225.012.404	Japanese Government CPI Linked Bond 0,100 % 10-März-2028	2.080.811	0,56	868.000	Investec Plc 'EMTN' FRN (Immerwährend) 6,750 % 05-Dez.-2024	880.214	0,24
Malaysischer Ringgit - 5.503.972 (31. Dezember 2019: 4.964.400)				592.000	Jerrold Finco Plc 'REGS' 4,875 % 15-Jan.-2026	661.052	0,18
22.071.000	Malaysia Government Bond 3,906 % 15-Jul.-2026	5.503.972	1,49	1.130.000	Lloyds Banking Group Plc FRN (Immerwährend) 5,125 % 27-Dez.-2024	1.270.616	0,34
Neuer mexikanischer Peso - 5.733.142 (31. Dezember 2019: 5.216.878)				1.519.272	Mitchells & Butlers Finance Plc 6,013 % 15-Dez.-2028	2.003.606	0,54
41.500.000	Mexican Bonos 7,500 % 03-Jun.-2027	1.995.236	0,54	1.600.000	Nationwide Building Society FRN (Immerwährend) 5,875 % 20-Dez.-2024	1.975.022	0,53
73.180.000	Mexican Bonos 8,500 % 31-Mai-2029	3.737.906	1,01	815.000	UBS AG/London 'EMTN' 1,250 % 10-Dez.-2020	1.002.342	0,27
Neuseeländischer Dollar - 5.728.217 (31. Dezember 2019: 16.454.305)				1.260.000	UNITE USAF II Plc 3,374 % 30-Jun.-2023	1.606.010	0,43
4.280.000	New Zealand Government Inflation Linked Bond 3,000 % 20-Sept.-2030	3.869.292	1,05	844.200	Virgin Media Secured Finance Plc 'REGS' 6,250 % 28-März-2029	1.097.309	0,30
2.380.000	New Zealand Local Government Funding Agency Bond 3,500 % 14-Apr.-2033	1.858.925	0,50	829.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 'REGS' 4,875 % 15-Jul.-2028	1.025.907	0,28
Norwegische Krone - 11.099.512 (31. Dezember 2019: 14.768.010)				1.032.000	Vodafone Group Plc FRN 4,875 % 03-Okt.-2078	1.319.819	0,36
78.225.000	Norway Government Bond '144A' 1,750 % 17-Feb.-2027	8.712.563	2,36	2.120.000	Yorkshire Building Society FRN 0,664 % 19-Nov.-2023	2.618.908	0,71
23.000.000	SpareBank 1 Boligkreditt AS 'GMTN' 1,500 % 16-Jun.-2021	2.386.949	0,64	Schwedische Krone - 4.561.070 (31. Dezember 2019: 7.281.195)			
Peruanischer Nuevo Sol - 2.866.742 (31. Dezember 2019: 2.590.509)				21.000.000	Stadshypotek AB 1,500 % 01-März-2024	2.353.595	0,63
7.820.000	Peruvian Government International Bond 'REGS' 8,200 % 12-Aug.-2026	2.866.742	0,78	20.300.000	Swedbank Hypotek AB 1,000 % 15-Jun.-2022	2.207.475	0,60
Philippinischer Peso - 4.458.416 (31. Dezember 2019: 2.598.691)				US-Dollar - 136.477.462 (31. Dezember 2019: 198.636.179)			
220.000.000	Philippine Government International Bond 4,950 % 15-Jan.-2021	4.458.416	1,21	2.666.000	Abu Dhabi Government International Bond 'REGS' 2,500 % 16-Apr.-2025	2.812.630	0,76
				1.108.000	American Airlines Inc '144A' 11,750 % 15-Jul.-2025	1.058.140	0,29
				420.000	Apple Inc 1,700 % 11-Sept.-2022	432.672	0,12
				617.000	Argentine Republic Government International Bond 6,875 % 22-Apr.-2021	261.994	0,07
				2.100.000	Bank of Montreal 'REGS' 2,100 % 15-Jun.-2022	2.164.885	0,59
				2.164.000	Best Buy Co Inc 5,500 % 15-März-2021	2.211.724	0,60
				1.050.000	Bolivian Government International Bond 'REGS' 4,500 % 20-März-2028	897.761	0,24
				1.220.000	Carnival Corp '144A' 11,500 % 01-Apr.-2023	1.296.324	0,35
				1.467.000	CEMEX Finance LLC 'REGS' 6,000 % 01-Apr.-2024	1.460.120	0,39
				1.060.000	Comcast Corp FRN 0,626 % 01-Okt.-2020	1.060.874	0,29
				1.500.000	Commonwealth Bank of Australia 'REGS' 2,125 % 22-Jul.-2020	1.501.596	0,41

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener	Summe			Angemessener	Summe
		Wert	der Netto-			Wert	der Netto-
Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %	Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
US-Dollar Forts.				US-Dollar Forts.			
1.032.000	Country Garden Holdings Co Ltd 'REGS'			2.640.000	Republic of Uzbekistan Bond 'REGS'		
	7,250 % 04-Apr.-2021	1.041.033	0,28		4,750 % 20-Feb.-2024	2.791.433	0,75
520.000	Credit Suisse Group AG 'REGS' FRN (Immerwährend)			1.557.000	Royal Bank of Scotland Group Plc FRN (Immerwährend)		
	7,250 % 12-Sept.-2025	534.011	0,14		6,000 % 29-Dez.-2025	1.575.684	0,43
1.700.000	CSC Holdings LLC '144A' 5,375 % 15-Jul.-2023	1.726.180	0,47	1.632.000	Royal Bank of Scotland Group Plc FRN (Immerwährend)		
1.750.000	CSC Holdings LLC '144A' 6,625 % 15-Okt.-2025	1.816.736	0,49		7,500 % 10-Aug.-2020	1.638.773	0,44
1.640.000	Dell International LLC / EMC Corp '144A'			153.000	Silgan Holdings Inc '144A' 4,125 % 01-Feb.-2028	152.426	0,04
	7,125 % 15-Jun.-2024	1.696.990	0,46	1.760.000	Stadshypotek AB 'REGS' 2,500 % 05-Apr.-2022	1.821.601	0,49
416.000	DH Europe Finance II Sarl 2,200 % 15-Nov.-2024	439.516	0,12	1.667.000	T-Mobile USA Inc 6,000 % 01-März-2023	1.678.769	0,45
2.090.000	DNB Boligkreditt AS 'REGS' 2,500 % 28-März-2022	2.160.074	0,58	2.200.000	UBS Group AG FRN (Immerwährend)		
766.667	Dominican Republic International Bond 'REGS'				5,000 % 31-Jan.-2023	2.074.237	0,56
	7,500 % 06-Mai-2021	792.549	0,21	2.812.774	United States Treasury Inflation Indexed Bonds		
1.950.000	Ecuador Government International Bond 'REGS'				0,500 % 15-Apr.-2024	2.956.880	0,80
	8,875 % 23-Okt.-2027	826.312	0,22	9.270.000	United States Treasury Note/Bond		
785.000	Ethiopia International Bond 'REGS'				0,500 % 15-März-2023	9.354.914	2,53
	6,625 % 11-Dez.-2024	788.611	0,21	14.300.000	United States Treasury Note/Bond		
541.000	European Bank for Reconstruction & Development				1,500 % 15-Aug.-2026	15.245.705	4,12
	1,625 % 27-Sept.-2024	567.956	0,15	10.900.000	United States Treasury Note/Bond		
3.940.000	Export-Import Bank of Korea FRN				1,500 % 15-Feb.-2030	11.800.527	3,19
	1,866 % 25-Jan.-2022	3.961.915	1,07	1.500.000	United States Treasury Note/Bond		
1.610.000	Fiji Government International Bond				2,000 % 15-Feb.-2050	1.726.699	0,47
	6,625 % 02-Okt.-2020	1.609.847	0,44	413.000	Upjohn Inc '144A' 2,300 % 22-Jun.-2027	426.502	0,12
1.293.000	GMR Hyderabad International Airport Ltd 'REGS'			2.742.000	US Bank NA/Cincinnati OH 'BKNT' FRN		
	4,250 % 27-Okt.-2027	1.157.041	0,31		1,311 % 26-Apr.-2021	2.747.916	0,74
2.716.000	HSBC Bank Canada 'REGS' 0,950 % 14-Mai-2023	2.740.201	0,74	36.000	Vietnam Government International Bond 'REGS'		
2.620.000	Inter-American Development Bank				4,800 % 19-Nov.-2024	39.509	0,01
	3,125 % 18-Sept.-2028	3.101.735	0,84	549.000	Vodafone Group Plc FRN 7,000 % 04-Apr.-2079	637.534	0,17
4.430.000	Inter-American Development Bank FRN			537.000	Volkswagen Group of America Finance LLC '144A'		
	0,341 % 16-Sept.-2022	4.417.165	1,19		3,350 % 13-Mai-2025	575.900	0,16
3.680.000	International Bank for Reconstruction & Development FRN 0,471 % 17-Jun.-2024	3.678.534	0,99	246.000	VTR Comunicaciones SpA 'REGS'		
2.700.000	JPMorgan Chase & Co FRN 2,083 % 22-Apr.-2026	2.807.175	0,76		5,125 % 15-Jan.-2028	250.612	0,07
4.020.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau			1.670.000	Westpac Banking Corp 'REGS'		
	1,500 % 15-Jun.-2021	4.069.255	1,10		2,100 % 25-Feb.-2021	1.687.815	0,46
1.074.000	Laureate Education Inc '144A'			1.100.000	Wynn Macau Ltd 'REGS' 5,500 % 15-Jan.-2026	1.095.875	0,30
	8,250 % 01-Mai-2025	1.118.480	0,30	Summe der Anlagen in Anleihen 351.049.124 94,93			
58.000	Lennar Corp 4,750 % 29-Nov.-2027	63.128	0,02	Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 3.111.056			
1.745.000	Level 3 Financing Inc 5,375 % 15-Aug.-2022	1.747.286	0,47	(siehe unten) 31. Dezember 2019: 2.557.717 3.111.056 0,84			
1.810.000	Level 3 Financing Inc 5,375 % 15-Jan.-2024	1.832.435	0,50	Summe der Vermögenswerte zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert 361.079.162 97,64			
210.000	Lloyds Banking Group Plc FRN (Immerwährend)						
	6,750 % 27-Jun.-2026	214.375	0,06				
1.239.000	Metropolitan Life Global Funding I 'REGS' FRN						
	0,650 % 07-Sept.-2020	1.239.845	0,34				
2.625.000	Mexico Government International Bond						
	3,900 % 27-Apr.-2025	2.816.625	0,76				
1.630.000	Microsoft Corp 2,000 % 08-Aug.-2023	1.700.520	0,46				
251.000	Mileage Plus Holdings LLC /						
	Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd '144A'						
	6,500 % 20-Jun.-2027	251.532	0,07				
1.550.000	Mongolia Government International Bond 'REGS'						
	10,875 % 06-Apr.-2021	1.615.875	0,44				
2.593.000	New York Life Global Funding 'REGS'						
	1,700 % 14-Sept.-2021	2.633.634	0,71				
464.000	NextEra Energy Capital Holdings Inc						
	3,250 % 01-Apr.-2026	519.192	0,14				
419.000	PG&E Corp 5,000 % 01-Jul.-2028	417.953	0,11				
1.284.000	Philippine Government International Bond						
	2,457 % 05-Mai-2030	1.349.367	0,37				
3.291.000	Qatar Government International Bond 'REGS'						
	3,400 % 16-Apr.-2025	3.586.348	0,97				
				Offene Terminkontrakte - (223.402) (31. Dezember 2019: 169.291)			
				(44)	Euro-Bund		
					Short Futures Contracts		
					Exp Sep.-2020	(8.713.794)	(80.909) (0,02)
				(91)	SFE 10 Year Australian Treasury Bond		
					Short Futures Contracts		
					Exp Sep.-2020	(9.273.373)	(121.304) (0,03)
				(33)	UK Long Gilt		
					Short Futures Contracts		
					Exp Sep.-2020	(5.580.297)	(21.189) (0,01)
				Summe der offenen Terminkontrakte (223.402) (0,06)			

Bestände	Beschreibung	Zugrunde	Angemessener	Summe
		liegendes Engagement	Wert	der Netto-
		in USD	in USD	vermögen %
	Offene Terminkontrakte - (223.402)			
	(31. Dezember 2019: 169.291)			
(44)	Euro-Bund			
	Short Futures Contracts			
	Exp Sep.-2020	(8.713.794)	(80.909)	(0,02)
(91)	SFE 10 Year Australian Treasury Bond			
	Short Futures Contracts			
	Exp Sep.-2020	(9.273.373)	(121.304)	(0,03)
(33)	UK Long Gilt			
	Short Futures Contracts			
	Exp Sep.-2020	(5.580.297)	(21.189)	(0,01)
Summe der offenen Terminkontrakte			(223.402)	(0,06)

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Nettovermögen %
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften - (2.266.757) (siehe unten) 31. Dezember 2019: (3.304.526))	(2.266.757)	(0,61)
Summe der finanziellen Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert	(2.490.159)	(0,67)
Nettoumlaufvermögen	11.226.517	3,03
Summe der Nettovermögen	369.815.520	100,00
Der Kontrahent für Terminkontrakte ist UBS AB.		

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	95,13
OTC-Finanzderivate	0,83
Sonstiges Umlaufvermögen	4,04
Summe der Aktiva	100,00

Devisenterminkontrakte

Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund						
US-Dollar	Euro	40.202	35.864	01-Jul.-20	Barclays Bank PLC	2
Euro	US-Dollar	568.554	638.121	15-Sept.-20	Royal Bank of Scotland	245
Sterling	US-Dollar	152.831	187.483	15-Sept.-20	JPMorgan Chase Bank	131
Sterling	US-Dollar	883.650	1.084.498	15-Sept.-20	Canadian Imperial Bank	258
US-Dollar	Australischer Dollar	22.171.113	32.024.418	15-Sept.-20	Royal Bank of Scotland	232.861
US-Dollar	Brasilianischer Real	5.472.632	29.295.000	15-Sept.-20	State Street Bank	68.771
US-Dollar	Kanadischer Dollar	5.004.066	6.732.488	15-Sept.-20	Citigroup Global Markets Limited	81.946
US-Dollar	Kanadischer Dollar	870.019	1.181.470	15-Sept.-20	HSBC Bank plc	6.247
US-Dollar	Kolumbianischer Peso	3.311.357	12.195.726.000	15-Sept.-20	Royal Bank of Scotland	75.904
US-Dollar	Dänische Krone	2.283.582	15.071.964	15-Sept.-20	Royal Bank of Scotland	12.870
US-Dollar	Euro	448.391	397.625	15-Sept.-20	State Street Bank	1.943
US-Dollar	Euro	80.205.119	70.967.104	15-Sept.-20	Barclays Bank PLC	524.089
US-Dollar	Euro	2.265.873	1.998.356	15-Sept.-20	State Street Bank	22.142
US-Dollar	Euro	702.151	619.326	15-Sept.-20	JPMorgan Chase Bank	6.779
US-Dollar	Euro	324.517	288.592	15-Sept.-20	Canadian Imperial Bank	489
US-Dollar	Euro	2.906.937	2.570.777	15-Sept.-20	JPMorgan Chase Bank	20.498
US-Dollar	Euro	193.065	171.000	15-Sept.-20	State Street Bank	1.068
US-Dollar	Euro	667.658	594.006	15-Sept.-20	State Street Bank	716
US-Dollar	Euro	445.040	395.334	15-Sept.-20	Barclays Bank PLC	1.164
US-Dollar	Euro	666.947	592.000	15-Sept.-20	Canadian Imperial Bank	2.256
US-Dollar	Indonesische Rupiah	1.667.267	23.941.952.500	15-Sept.-20	Royal Bank of Scotland	42.542
US-Dollar	Japanischer Yen	3.745.593	398.471.745	15-Sept.-20	State Street Bank	43.356
US-Dollar	Neuseeländischer Dollar	5.923.688	9.146.778	15-Sept.-20	JPMorgan Chase Bank	66.480
US-Dollar	Norwegische Krone	3.768.670	34.894.000	15-Sept.-20	Citigroup Global Markets Limited	182.500
US-Dollar	Norwegische Krone	7.854.910	73.539.908	15-Sept.-20	Citigroup Global Markets Limited	296.974
US-Dollar	Singapur-Dollar	4.134.192	5.756.900	15-Sept.-20	Citigroup Global Markets Limited	13.290
US-Dollar	Sterling	1.015.716	802.351	15-Sept.-20	State Street Bank	30.762
US-Dollar	Sterling	2.006.370	1.581.000	15-Sept.-20	Citigroup Global Markets Limited	65.558
US-Dollar	Sterling	40.129.940	31.694.760	15-Sept.-20	UBS AG	1.221.926
US-Dollar	Schwedische Krone	4.580.198	42.443.782	15-Sept.-20	UBS AG	45.852
USD 3.069.619						
US-Dollar	Sterling	187.407	152.831	01-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(125)
Australischer Dollar	US-Dollar	818.408	565.321	15-Sept.-20	Canadian Imperial Bank	(4.673)
Australischer Dollar	US-Dollar	1.550.458	1.068.824	15-Sept.-20	State Street Bank	(6.687)
Australischer Dollar	US-Dollar	4.135.669	2.870.411	15-Sept.-20	JPMorgan Chase Bank	(37.280)
Kolumbianischer Peso	US-Dollar	12.195.726.000	3.239.073	15-Sept.-20	State Street Bank	(3.620)
Tschechische Krone	US-Dollar	41.412.994	1.750.660	15-Sept.-20	Citigroup Global Markets Limited	(18.390)
Sterling	US-Dollar	359.292	446.062	15-Sept.-20	State Street Bank	(5.000)
Sterling	US-Dollar	893.747	1.107.051	15-Sept.-20	State Street Bank	(9.902)
US-Dollar	Indische Rupie	802.600	61.248.000	15-Sept.-20	UBS AG	(1.082)
US-Dollar	Japanischer Yen	12.073.924	1.300.166.256	15-Sept.-20	State Street Bank	(6.036)
US-Dollar	Philippinischer Peso	4.306.998	216.502.000	15-Sept.-20	State Street Bank	(15.911)
USD (108.706)						
Netto USD 2.960.913						

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte Forts.							Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund							BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund						
Anteilsklasse CHF W (Acc) (Hedged)							Anteilsklasse EUR I (Hedged)						
Schweizer Franken	US-Dollar	17.422	18.379	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(44)	US-Dollar	Euro	161	143	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	1
Schweizer Franken	US-Dollar	2.266.796	2.392.477	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(6.842)	US-Dollar	Euro	2.250	2.000	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	7
Schweizer Franken	US-Dollar	3.335	3.512	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(3)	US-Dollar	Euro	28	25	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	-
							US-Dollar	Euro	601.782	533.050	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	4.110
						USD							USD
													EUR
													4.118
													3.674
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund							BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund						
Anteilsklasse EUR H (Hedged)							Anteilsklasse EUR I (Inc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	49.970	56.273	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(245)	Euro	US-Dollar	13.295.777	15.103.197	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(195.569)
Euro	US-Dollar	14.346	16.146	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(61)							USD
Euro	US-Dollar	5.587.049	6.346.549	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(82.181)							EUR
US-Dollar	Euro	105.483	94.097	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(21)							Netto USD
													Netto EUR
						USD							(191.451)
													(170.801)
						EUR							
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund							BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund						
Anteilsklasse EUR H (Inc) (Hedged)							Anteilsklasse EUR I (Inc) (Hedged)						
US-Dollar	Euro	31.238	27.587	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	306	Euro	US-Dollar	1.622.363	1.842.906	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(23.864)
US-Dollar	Euro	33.235	29.439	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	227							USD
													EUR
						USD							(23.864)
						EUR							(21.290)
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund							BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund						
Anteilsklasse EUR W (Hedged)							Anteilsklasse EUR W (Hedged)						
US-Dollar	Euro	210.206	186.242	02-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	1.447	US-Dollar	Euro	49.310	55.286	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	2
Euro	US-Dollar	75.558	66.926	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	518	US-Dollar	Euro	23.062	20.553	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	18
US-Dollar	Euro	2.202.651	1.958.110	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	7.159	US-Dollar	Euro	223.555	197.430	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	2.191
US-Dollar	Euro	67.175	59.022	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	998							USD
													EUR
													12.333
													11.003

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte Forts.							Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund							BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund						
Anteilsklasse EUR W (Hedged) Forts.							Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	66.926	75.538	02-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(520)	US-Dollar	Sterling	22.009	17.730	01-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	253
Euro	US-Dollar	94.338	106.502	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(727)	Sterling	US-Dollar	72	88	02-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	72.906.444	82.817.303	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1.072.391)	US-Dollar	Sterling	10.214	8.247	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	94
Euro	US-Dollar	186.242	210.261	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1.441)	US-Dollar	Sterling	6.220	5.023	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	56
US-Dollar	Euro	568.218	506.800	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(21)	US-Dollar	Sterling	50.283	40.000	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	1.197
						USD (1.075.100)	US-Dollar	Sterling	88	72	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	-
						EUR (959.139)	US-Dollar	Sterling	279	225	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	3
						Netto USD (1.062.767)	US-Dollar	Sterling	72.630	57.408	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	2.182
						Netto EUR (948.136)	US-Dollar	Sterling	29	23	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	1
							US-Dollar	Sterling	102.781	80.474	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	4.027
							US-Dollar	Sterling	561.691	444.158	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	16.640
						USD 24.453							
						GBP 19.928							
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund							Sterling	US-Dollar	225	279	01-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(3)
Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged)							Sterling	US-Dollar	17.730	22.011	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(254)
Euro	US-Dollar	9.376.837	10.651.518	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(137.925)	Sterling	US-Dollar	3.483	4.335	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(60)
						USD (137.925)	Sterling	US-Dollar	1.153	1.443	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(29)
						EUR (123.048)	Sterling	US-Dollar	7.949	9.898	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(144)
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund							Sterling	US-Dollar	3.162	3.917	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(36)
Anteilsklasse JPY X (Acc) (Hedged)							Sterling	US-Dollar	647	810	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(16)
Japanischer Yen	US-Dollar	995.215.600	9.250.995	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(12.240)	Sterling	US-Dollar	17.027	21.404	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(510)
						USD (12.240)	Sterling	US-Dollar	2.680	3.391	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(102)
						JPY (1.318.738)	Sterling	US-Dollar	2.609	3.265	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(63)
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund							Sterling	US-Dollar	329	415	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(12)
Anteilsklasse NOK H (Acc) (Hedged)							Sterling	US-Dollar	33.664	42.713	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1.402)
Norwegische Krone	US-Dollar	885.650	95.432	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(4.432)	Sterling	US-Dollar	17.312	22.111	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(866)
						USD (4.432)	Sterling	US-Dollar	688	870	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(26)
						NOK (43.137)	Sterling	US-Dollar	12.536.468	15.971.302	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(587.090)
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund													USD (590.613)
Anteilsklasse NOK W (Acc) (Hedged)													GBP (481.327)
Norwegische Krone	US-Dollar	892.124	96.129	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(4.465)							Netto USD (566.160)
						USD (4.465)							Netto GBP (461.399)
						NOK (43.458)							

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte Forts.							Nicht
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent		realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund							
Anteilsklasse Sterling W (Inc) (Hedged)							
Sterling	US-Dollar	99.341	126.560	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		(4.652)
							USD (4.652)
							GBP (3.791)
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund							
Anteilsklasse Sterling Z (Acc) (Hedged)							
Sterling	US-Dollar	99.281	126.483	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		(4.649)
							USD (4.649)
							GBP (3.789)
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund							
Anteilsklasse Sterling Z (Inc) (Hedged)							
Sterling	US-Dollar	99.277	126.478	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		(4.649)
							USD (4.649)
							GBP (3.789)

BNY MELLON GLOBAL EMERGING MARKETS FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Nettovermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Nettovermögen %
Aktien				Aktien Forts.			
	Argentinien - 1.415.139 (31. Dezember 2019: 1.060.631)	1.415.139	4,65		Republik Korea - 3.576.026 (31. Dezember 2019: 4.040.751)	3.576.026	11,75
6.383	Globant SA	937.631	3,08	29.309	Iljin Materials Co Ltd	1.207.959	3,97
487	MercadoLibre Inc	477.508	1,57	601	LG Household & Health Care Ltd	672.774	2,21
	Australien - 423.201 (31. Dezember 2019: 492.391)	423.201	1,39	5.606	Samsung SDI Co Ltd	1.695.293	5,57
16.715	IDP Education Ltd	177.274	0,58		Russland - 244.962 (31. Dezember 2019: -)	244.962	0,80
155.106	Orocobre Ltd	245.927	0,81	10.561	HeadHunter Group Plc ADR	244.962	0,80
	Brasilien - 193.573 (31. Dezember 2019: 655.955)	193.573	0,64		Südafrika - 1.135.742 (31. Dezember 2019: 2.394.525)	1.135.742	3,73
4.485	Arco Platform Ltd - A-Klasse	193.573	0,64	24.041	Clicks Group Ltd	289.483	0,95
	Chile - 238.078 (31. Dezember 2019: 222.331)	238.078	0,78	60.542	Discovery Ltd	368.890	1,21
9.061	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA ADR	238.078	0,78	2.613	Naspers Ltd	477.369	1,57
	China - 11.014.005 (31. Dezember 2019: 9.456.364)	11.014.005	36,19		Taiwan - 1.905.608 (31. Dezember 2019: 1.878.524)	1.905.608	6,26
5.165	51job Inc ADR	361.602	1,19	58.000	Elite Material Co Ltd	313.054	1,03
7.925	Alibaba Group Holding Ltd ADR	1.703.835	5,60	150.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	1.592.554	5,23
10.677	Autohome Inc ADR	813.908	2,67		Thailand - 228.094 (31. Dezember 2019: 177.656)	228.094	0,75
408.000	China Harmony New Energy Auto Holding Ltd	201.891	0,66	75.500	Kasikornbank PCL (Foreign Market)	228.094	0,75
322.000	China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd	386.603	1,27		USA - 1.307.792 (31. Dezember 2019: 1.661.083)	1.307.792	4,30
7.550	GSX Techedu Inc ADR	439.825	1,45	2.865	EPAM Systems Inc	705.277	2,32
76.134	Meituan Dianping	1.689.171	5,55	19.048	Laureate Education Inc - A-Klasse	188.861	0,62
13.578	New Oriental Education & Technology Group Inc ADR	1.782.452	5,86	68.885	Livent Corp	413.654	1,36
53.000	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	529.651	1,74		Summe der Anlagen in Aktien	30.062.836	98,77
11.802	Prosus NV	1.090.059	3,58		Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 212		
23.224	Tencent Holdings Ltd	1.493.808	4,91		(siehe unten) 31. Dezember 2019: 5.902)	212	0,00
39.321	Tencent Music Entertainment Group ADR	521.200	1,71		Summe der Vermögenswerte zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert	30.063.048	98,77
	Deutschland - 783.061 (31. Dezember 2019: 795.041)	783.061	2,57		Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften - (9.635)		
7.739	Delivery Hero SE '144A'	783.061	2,57		(siehe unten) 31. Dezember 2019: -)	(9.635)	(0,03)
	Hongkong - 1.181.679 (31. Dezember 2019: 1.450.155)	1.181.679	3,88		Summe der finanziellen Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert	(9.635)	(0,03)
126.800	AIA Group Ltd	1.181.679	3,88		Nettoumlaufvermögen	384.499	1,26
	Indien - 5.685.097 (31. Dezember 2019: 7.717.801)	5.685.097	18,68		Summe der Nettovermögen	30.437.912	100,00
11.554	Apollo Hospitals Enterprise Ltd	207.112	0,68		Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens	
35.527	Asian Paints Ltd	794.260	2,61		An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten		
1.649	Hindustan Unilever Ltd	47.535	0,15		Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		98,15
48.505	Housing Development Finance Corp Ltd	1.131.620	3,72		OTC-Finanzderivate		0,00
24.854	Info Edge India Ltd	909.183	2,99		Sonstiges Umlaufvermögen		1,85
30.789	Jubilant Foodworks Ltd	705.156	2,32		Summe der Aktiva		100,00
8.814	Maruti Suzuki India Ltd	680.819	2,24				
51.370	Nippon Life India Asset Management Ltd '144A'	215.488	0,71				
21.588	PVR Ltd	286.363	0,94				
56.098	Titan Co Ltd	707.561	2,32				
	Indonesien - 235.910 (31. Dezember 2019: -)	235.910	0,77				
1.201.417	Vale Indonesia Tbk PT	235.910	0,77				
	Niederlande - 494.869 (31. Dezember 2019: 568.124)	494.869	1,63				
1.364	ASML Holding NV	494.869	1,63				

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte							Nicht
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent		realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Global Emerging Markets Fund							
Anteilsklasse EUR H (Hedged)							
Euro	US-Dollar	30	34	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	-	
US-Dollar	Euro	1.414	1.254	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	8	
						USD	8
						EUR	7
Euro	US-Dollar	743	838	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(4)	
Euro	US-Dollar	918	1.034	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(5)	
Euro	US-Dollar	35.555	40.388	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(523)	
						USD	(532)
						EUR	(475)
						Netto USD	(524)
						Netto EUR	(468)
BNY Mellon Global Emerging Markets Fund							
Anteilsklasse EUR I (Hedged)							
US-Dollar	Euro	23.927	21.216	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	140	
US-Dollar	Euro	4.319	3.795	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	64	
						USD	204
						EUR	182
Euro	US-Dollar	608.482	691.198	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(8.950)	
Euro	US-Dollar	12.746	14.361	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(70)	
Euro	US-Dollar	15.636	17.615	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(83)	
						USD	(9.103)
						EUR	(8.121)
						Netto USD	(8.899)
						Netto EUR	(7.939)

BNY MELLON GLOBAL EQUITY FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener	Summe			Angemessener	Summe			
Bestände	Beschreibung	Wert in USD	der Netto- vermögen %	Bestände	Beschreibung	Wert in USD	der Netto- vermögen %			
Aktien				Aktien Forts.						
Kanada - 5.666.035 (31. Dezember 2019: 9.055.289)				Thailand - 2.451.028 (31. Dezember 2019: -)						
60.466	Intact Financial Corp	5.666.035	1,57	811.300	Kasikornbank PCL (Foreign Market)	2.451.028	0,68			
China - 11.050.417 (31. Dezember 2019: -)				Großbritannien - 20.131.574 (31. Dezember 2019: 30.528.047)						
34.479	Alibaba Group Holding Ltd ADR	7.412.812	2,05	141.694	Associated British Foods Plc	3.327.356	0,92			
364.000	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	3.637.605	1,00	145.269	Diageo Plc	4.807.024	1,33			
Frankreich - 12.921.756 (31. Dezember 2019: 14.585.846)				USA - 176.852.773 (31. Dezember 2019: 172.872.344)						
14.605	L'Oreal SA	4.684.493	1,29	81.417	Ferguson Plc	6.609.571	1,83			
319.582	Vivendi SA	8.237.263	2,28	754.788	Informa Plc	4.357.599	1,20			
Deutschland - 28.378.650 (31. Dezember 2019: 23.719.548)				290.561				Rolls-Royce Holdings Plc	1.030.024	0,28
75.487	Bayer AG	5.597.180	1,55	115.065				Abbott Laboratories	10.243.086	2,83
89.265	Brenntag AG	4.691.183	1,29	43.260				Accenture Plc - A-Klasse	9.204.430	2,54
26.899	Continental AG	2.634.604	0,73	7.297				Alphabet Inc - A-Klasse	10.198.178	2,82
138.622	Deutsche Post AG	5.066.215	1,40	121.044				Altria Group Inc	4.749.767	1,31
75.222	SAP SE	10.389.468	2,87	5.090				Amazon.com Inc	13.648.784	3,77
Hongkong - 9.220.451 (31. Dezember 2019: 11.796.696)				43.834				Apple Inc	15.866.593	4,38
989.400	AIA Group Ltd	9.220.451	2,55	130.307				Applied Materials Inc	7.696.583	2,13
Japan - 26.708.397 (31. Dezember 2019: 29.220.736)				220.348				Cisco Systems Inc	10.172.365	2,81
53.000	Ebara Corp	1.241.127	0,34	197.920				Citigroup Inc	9.956.366	2,75
200.900	Japan Tobacco Inc	3.733.078	1,03	78.501				CMS Energy Corp	4.518.518	1,25
66.800	Seven & i Holdings Co Ltd	2.179.959	0,60	17.060				Costco Wholesale Corp	5.145.381	1,42
79.100	Sony Corp	5.417.109	1,50	42.863				Dollar General Corp	8.147.399	2,25
72.100	Sugi Holdings Co Ltd	4.881.841	1,35	48.325				Eversource Energy	4.016.049	1,11
86.900	Suntory Beverage & Food Ltd	3.385.583	0,94	433.353				General Electric Co	2.944.634	0,81
173.000	Suzuki Motor Corp	5.869.700	1,62	58.839				Gilead Sciences Inc	4.388.507	1,21
Niederlande - 24.416.484 (31. Dezember 2019: 35.295.586)				43.920				Goldman Sachs Group Inc/The	8.502.253	2,35
378.428	Relx Plc	8.699.938	2,40	55.458				Lennar Corp	3.380.720	0,94
272.595	Royal Dutch Shell Plc	4.437.837	1,22	26.643				Mastercard Inc	7.810.262	2,16
126.086	Unilever NV	6.728.010	1,86	77.343				Medtronic Plc	6.982.139	1,93
58.830	Wolters Kluwer NV	4.550.699	1,26	55.310				Merck & Co Inc	4.210.197	1,16
Norwegen - 2.146.507 (31. Dezember 2019: 4.834.116)				96.011				Microsoft Corp	19.054.823	5,26
161.391	DNB ASA	2.146.507	0,59	109.987				Verizon Communications Inc	6.015.739	1,66
Republik Korea - 7.902.192 (31. Dezember 2019: 5.031.589)				Summe der Anlagen in Aktien				356.893.169	98,58	
26.131	Samsung SDI Co Ltd	7.902.192	2,18	Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 90 (siehe unten) (31. Dezember 2019: 83.593)				90	0,00	
Schweden - 4.189.730 (31. Dezember 2019: 4.628.101)				Summe der Vermögenswerte zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert				356.893.259	98,58	
326.462	Swedbank AB	4.189.730	1,16	Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften - (378.554) (siehe unten) (31. Dezember 2019: (136.180))				(378.554)	(0,10)	
Schweiz - 21.009.282 (31. Dezember 2019: 21.176.455)				Summe der finanziellen Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert				(378.554)	(0,10)	
10.862	Lonza Group AG	5.676.968	1,57	Nettoumlaufvermögen				5.508.745	1,52	
77.470	Novartis AG	6.730.693	1,86	Summe der Nettovermögen				362.023.450	100,00	
24.850	Roche Holding AG	8.601.621	2,37	Portfolioanalyse				% des Gesamtvermögens		
Taiwan - 3.847.893 (31. Dezember 2019: -)				An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten						
68.219	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	3.847.893	1,06	Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente				97,58		
				OTC-Finanzderivate				0,00		
				Sonstiges Umlaufvermögen				2,42		
				Summe der Aktiva				100,00		

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte						
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Global Equity Fund						
Euro	US-Dollar	106.939	119.874	01-Jul.-20	Barclays Bank PLC	(5)
US-Dollar	Euro	10.710.496	9.879.000	14-Aug.-20	Barclays Bank PLC	(373.546)
USD						(373.551)
BNY Mellon Global Equity Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged)						
US-Dollar	Euro	16.135	14.329	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	69
US-Dollar	Euro	8.793	7.823	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	21
USD						90
EUR						80
Euro	US-Dollar	9.984	11.208	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(14)
Euro	US-Dollar	339.187	385.295	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(4.989)
USD						(5.003)
EUR						(4.463)
Netto USD						(4.913)
Netto EUR						(4.383)

BNY MELLON GLOBAL EQUITY INCOME FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %			Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %
Bestände	Beschreibung			Bestände	Beschreibung		
Organismen für gemeinsame Anlagen							
	Republik Korea - 15.323.634 (31. Dezember 2019: 25.124.445)	15.323.634	1,27				
1.613.307	Macquarie Korea Infrastructure Fund	15.323.634	1,27				
Summe der Anlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen		15.323.634	1,27				
Aktien							
	China - 15.329.905 (31. Dezember 2019: -)	15.329.905	1,28				
1.534.000	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	15.329.905	1,28				
Frankreich - 54.056.166 (31. Dezember 2019: 92.629.261)		54.056.166	4,50				
380.509	Sanofi	38.586.621	3,21				
405.137	TOTAL SA	15.469.545	1,29				
Deutschland - 53.867.912 (31. Dezember 2019: 59.086.920)		53.867.912	4,48				
546.378	Bayer AG	40.512.616	3,37				
136.356	Continental AG	13.355.296	1,11				
Hongkong - 15.683.554 (31. Dezember 2019: 26.865.678)		15.683.554	1,30				
1.919.449	Link REIT (Units) (REIT)	15.683.554	1,30				
Indien - 33.125.373 (31. Dezember 2019: 46.464.042)		33.125.373	2,76				
3.459.569	Infosys Ltd ADR	33.125.373	2,76				
Japan - 26.543.921 (31. Dezember 2019: -)		26.543.921	2,21				
885.400	KDDI Corp	26.543.921	2,21				
Niederlande - 13.205.070 (31. Dezember 2019: 31.775.249)		13.205.070	1,10				
811.124	Royal Dutch Shell Plc	13.205.070	1,10				
Neuseeland - 4.990.822 (31. Dezember 2019: 6.621.219)		4.990.822	0,41				
1.710.930	Spark New Zealand Ltd	4.990.822	0,41				
Norwegen - 7.887.867 (31. Dezember 2019: 31.666.011)		7.887.867	0,66				
911.036	Orkla ASA	7.887.867	0,66				
Republik Korea - 40.016.011 (31. Dezember 2019: 53.663.955)		40.016.011	3,33				
1.034.012	Samsung Electronics Co Ltd - Preference	40.016.011	3,33				
Spanien - 24.790.788 (31. Dezember 2019: 39.743.119)		24.790.788	2,06				
936.559	Industria de Diseno Textil SA	24.790.788	2,06				
Schweden - 49.579.641 (31. Dezember 2019: 82.733.873)		49.579.641	4,13				
1.548.974	Hennes & Mauritz AB	22.265.659	1,85				
2.854.820	Svenska Handelsbanken AB	27.313.982	2,28				
Schweiz - 169.083.347 (31. Dezember 2019: 225.366.812)		169.083.347	14,07				
435.298	Cie Financiere Richemont SA	27.705.569	2,31				
243.315	Nestle SA	26.923.225	2,24				
444.734	Novartis AG	38.639.059	3,22				

Aktien Forts.			
Schweiz Forts.			
102.553	Roche Holding AG	35.497.871	2,95
115.156	Zurich Insurance Group AG	40.317.623	3,35
Großbritannien - 158.830.458 (31. Dezember 2019: 244.551.780)		158.830.458	13,22
4.416.159	BAE Systems Plc	26.441.291	2,20
842.933	British American Tobacco Plc	32.379.445	2,69
294.377	British American Tobacco Plc ADR	11.517.500	0,96
136.085	Ferguson Plc	11.047.612	0,92
5.635.982	Informa Plc	32.538.076	2,71
830.149	Unilever Plc	44.906.534	3,74
USA - 502.244.545 (31. Dezember 2019: 838.493.607)		502.244.545	41,80
602.001	Brixmor Property Group Inc (REIT)	7.798.923	0,65
1.527.048	Cisco Systems Inc	70.496.171	5,87
188.130	Citigroup Inc	9.463.880	0,79
392.252	CMS Energy Corp	22.578.025	1,88
294.066	Emerson Electric Co	18.048.301	1,50
301.727	Eversource Energy	25.075.022	2,09
172.391	Gilead Sciences Inc	12.857.783	1,07
107.680	Harley-Davidson Inc	2.567.630	0,21
754.412	Maxim Integrated Products Inc	44.959.183	3,74
472.723	Merck & Co Inc	35.983.675	2,99
434.478	Omnicom Group Inc	23.589.983	1,96
293.647	Paychex Inc	21.649.125	1,80
349.770	PepsiCo Inc	45.863.591	3,82
199.149	Philip Morris International Inc	14.048.966	1,17
473.795	Principal Financial Group Inc	19.110.521	1,59
247.754	Procter & Gamble Co/The	29.148.258	2,43
632.245	QUALCOMM Inc	56.342.513	4,69
774.328	Tapestry Inc	10.348.894	0,86
249.990	Verizon Communications Inc	13.673.203	1,14
875.365	Western Union Co/The	18.640.898	1,55
Summe der Anlagen in Aktien		1.169.235.380	97,31
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 21.739 (siehe unten) 31. Dezember 2019: 691.530)		21.739	0,00
Summe der Vermögenswerte zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert		1.184.580.753	98,58
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften - (570.150) (siehe unten) 31. Dezember 2019: (4.284))		(570.150)	(0,05)
Summe der finanziellen Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert		(570.150)	(0,05)
Nettoumlaufvermögen		17.578.989	1,47
Summe der Nettovermögen		1.201.589.592	100,00
Portfolioanalyse			
% des Gesamtvermögens			
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			97,37
OTC-Finanzderivate			0,00
Sonstiges Umlaufvermögen			2,63
Summe der Aktiva			100,00

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte I							Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Global Equity Income Fund							BNY Mellon Global Equity Income Fund						
Sterling	US-Dollar	162.115	198.849	01-Jul.-20	State Street Bank	74	Anteilsklasse EUR H (Inc) (Hedged)						
						USD	Euro	US-Dollar	34.710	38.910	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	8
							US-Dollar	Euro	237.973	211.954	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	323
Euro	US-Dollar	1.394.732	1.563.423	01-Jul.-20	Barclays Bank PLC	(67)	US-Dollar	Euro	66.740	59.072	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	507
US-Dollar	Norwegische Krone	387.373	3.782.188	01-Jul.-20	UBS AG	(1.219)	US-Dollar	Euro	123.731	109.418	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	1.048
						USD	US-Dollar	Euro	488.016	433.396	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	2.080
						Netto USD							USD
													EUR
													3.966
													3.538
BNY Mellon Global Equity Income Fund							BNY Mellon Global Equity Income Fund						
Anteilsklasse EUR H (Hedged)							Anteilsklasse EUR I (Hedged)						
US-Dollar	Euro	12.569	11.211	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	-	Euro	US-Dollar	209.166	234.806	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(283)
US-Dollar	Euro	318.649	283.810	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	433	Euro	US-Dollar	7.896.889	8.970.388	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(116.156)
US-Dollar	Euro	3.334	2.946	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	30							USD
US-Dollar	Euro	645.340	573.111	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	2.750							(116.439)
US-Dollar	Euro	299.082	262.783	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	4.442							EUR
US-Dollar	Euro	276.105	244.570	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	1.886							(103.880)
US-Dollar	Euro	82.861	73.844	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	65							Netto USD
US-Dollar	Euro	10.724	9.533	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	35							(112.473)
US-Dollar	Euro	20.946	18.610	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	79							Netto EUR
US-Dollar	Euro	20.284	17.938	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	172							(100.342)
						USD							
						EUR							
Euro	US-Dollar	40.000	45.193	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(344)	US-Dollar	Euro	463.308	412.653	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	629
Euro	US-Dollar	280.239	314.591	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(379)	US-Dollar	Euro	105.273	93.046	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	948
Euro	US-Dollar	329.422	374.926	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(5.568)	US-Dollar	Euro	32.661	28.930	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	224
Euro	US-Dollar	10.642.889	12.089.677	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(156.548)	US-Dollar	Euro	167.579	149.210	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	280
US-Dollar	Euro	9.388	8.375	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(2)	US-Dollar	Euro	3.686	3.285	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	3
						USD	US-Dollar	Euro	1.252	1.112	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	5
						EUR	US-Dollar	Euro	64	56	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	1
							US-Dollar	Euro	78.653	69.883	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	299
							US-Dollar	Euro	947.283	841.260	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	4.037
							US-Dollar	Euro	11.032	9.693	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	164
							US-Dollar	Euro	90	79	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	1
													USD
													6.591
													EUR
													5.880

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte Forts.							Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Global Equity Income Fund							BNY Mellon Global Equity Income Fund						
Anteilsklasse EUR I (Hedged) Forts.							Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	149.210	167.534	01-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(285)	US-Dollar	Euro	32.263	28.736	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	44
Euro	US-Dollar	28.930	32.652	02-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(225)	US-Dollar	Euro	82.305	73.093	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	351
Euro	US-Dollar	5.494	6.180	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(20)							
Euro	US-Dollar	412.721	463.314	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(558)						USD	395
Euro	US-Dollar	15.232	17.225	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(146)						EUR	352
Euro	US-Dollar	15.357133	17.444.772	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(225.890)	Euro	US-Dollar	36.244	40.687	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(49)
					USD	(227.124)	Euro	US-Dollar	14.792	16.835	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(250)
					EUR	(202.626)	Euro	US-Dollar	1.324.510	1.504.564	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(19.482)
					Netto USD	(220.533)	US-Dollar	Euro	334.655	298.531	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(67)
					Netto EUR	(196.746)						USD	(19.848)
												EUR	(17.707)
												Netto USD	(19.453)
												Netto EUR	(17.355)
BNY Mellon Global Equity Income Fund													
Anteilsklasse EUR I (Inc) (Hedged)													
US-Dollar	Euro	84.537	75.294	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	115							
US-Dollar	Euro	165.798	147.242	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	706							
					USD	821							
					EUR	732							
Euro	US-Dollar	75.096	84.302	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(101)							
Euro	US-Dollar	1.093.288	1.243.626	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(17.799)							
Euro	US-Dollar	1.680.033	1.908.415	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(24.712)							
					USD	(42.612)							
					EUR	(38.016)							
					Netto USD	(41.791)							
					Netto EUR	(37.284)							

BNY MELLON GLOBAL HIGH YIELD BOND FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %
Anleihen				Anleihen Forts.			
Kanada - 3.907.025				Deutschland Forts.			
(31. Dezember 2019: 4.109.841)				155.000 Nidda Healthcare Holding GmbH 'REGS'			
155.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc '144A'		3,50	3,500 % 30-Sept.-2024	172.412	0,15	
	4,375 % 15-Jan.-2028	152.937	0,14	295.000 Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 'REGS'			
140.000	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc '144A'			6,000 % 30-Jul.-2026	340.586	0,31	
	5,750 % 15-Apr.-2025	147.263	0,13	270.000 WEPA Hygieneprodukte GmbH 'REGS'			
80.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 5,000 % 30-Jan.-2028	74.876	0,07	2,875 % 15-Dez.-2027	297.356	0,27	
80.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 5,250 % 30-Jan.-2030	75.054	0,07	Irland - 2.297.892			
260.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 6,125 % 15-Apr.-2025	261.667	0,23	(31. Dezember 2019: 1.556.652)			
395.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 6,250 % 15-Feb.-2029	397.597	0,36	2.297.892 2,06			
295.000	Bausch Health Cos Inc '144A' 7,250 % 30-Mai-2029	307.719	0,27	255.000 Ardagh Packaging Finance Plc /			
110.000	Bausch Health Cos Inc 'REGS' 9,000 % 15-Dez.-2025	118.528	0,11	Ardagh Holdings USA Inc '144A' 4,125 % 15-Aug.-2026	249.778	0,22	
125.000	Bombardier Inc '144A' 6,125 % 15-Jan.-2023	84.962	0,08	333.000 Ardagh Packaging Finance Plc /			
325.000	Bombardier Inc '144A' 7,500 % 15-März-2025	209.828	0,19	Ardagh Holdings USA Inc '144A' 5,250 % 30-Apr.-2025	342.033	0,31	
515.000	Clarios Global LP '144A' 6,750 % 15-Mai-2025	537.209	0,48	200.000 Ardagh Packaging Finance Plc /			
355.000	First Quantum Minerals Ltd '144A'			Ardagh Holdings USA Inc '144A' 5,250 % 15-Aug.-2027	194.898	0,18	
	7,250 % 01-Apr.-2023	339.371	0,30	500.000 Carlyle Euro CLO 2019-1 DAC '2019-1X D' FRN			
37.000	GFL Environmental Inc '144A' 7,000 % 01-Jun.-2026	38.704	0,03	6,120 % 15-März-2032	510.178	0,46	
163.000	GFL Environmental Inc '144A' 8,500 % 01-Mai-2027	177.994	0,16	500.000 Grand Harbour CLO 2019-1 DAC '2019-1X D' FRN			
295.000	Hudbay Minerals Inc '144A' 7,625 % 15-Jan.-2025	278.664	0,25	4,100 % 15-März-2032	515.614	0,46	
315.000	Husky III Holding Ltd '144A' 13,000 % 15-Feb.-2025	308.109	0,28	300.000 Harvest CLO XXI DAC FRN 6,190 % 15-Jul.-2031	305.950	0,27	
276.000	Masonite International Corp '144A'			145.000 Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 'REGS'			
	5,375 % 01-Feb.-2028	283.021	0,25	4,875 % 15-Jul.-2028	179.441	0,16	
85.000	Precision Drilling Corp '144A' 7,125 % 15-Jan.-2026	53.003	0,05	Italien - 353.902			
60.000	Reliance Intermediate Holdings LP 'REGS'			(31. Dezember 2019: 1.036.297)			
	6,500 % 01-Apr.-2023	60.519	0,05	353.902 0,32			
Cayman-Inseln - 386.854				355.000 Fire BC SpA 'REGS' FRN 4,750 % 30-Sept.-2024	353.902	0,32	
(31. Dezember 2019: 943.592)				Luxemburg - 6.516.218			
		386.854 0,35		(31. Dezember 2019: 8.995.433)			
250.000	Shelf Drilling Holdings Ltd '144A' 8,250 % 15-Feb.-2025	125.779	0,11	6.516.218 5,84			
220.000	Transocean Poseidon Ltd '144A' 6,875 % 01-Feb.-2027	194.700	0,18	295.000 Altice Financing SA '144A' 5,000 % 15-Jan.-2028	294.733	0,27	
75.000	Transocean Poseidon Ltd 'REGS' 6,875 % 01-Feb.-2027	66.375	0,06	560.000 Altice Financing SA '144A' 7,500 % 15-Mai-2026	588.132	0,53	
Dänemark - 330.666				415.000 Altice France Holding SA '144A' 6,000 % 15-Feb.-2028	392.571	0,35	
(31. Dezember 2019: -)				275.000 Altice France Holding SA '144A' 8,000 % 15-Mai-2027	326.098	0,29	
295.000	DKT Finance ApS 'REGS' 7,000 % 17-Jun.-2023	330.666	0,30	490.000 Altice France Holding SA '144A' 10,500 % 15-Mai-2027	539.919	0,48	
Frankreich - 3.634.745				275.000 Altice France Holding SA 'REGS' 4,000 % 15-Feb.-2028	279.676	0,25	
(31. Dezember 2019: 1.814.833)				115.000 ArcelorMittal SA 4,550 % 11-März-2026	116.695	0,11	
435.000	Altice France SA/France '144A' 8,125 % 01-Feb.-2027	475.464	0,43	255.000 ARD Finance SA '144A' 6,500 % 30-Jun.-2027	252.657	0,23	
385.000	Banijay Entertainment SASU '144A'			310.000 ARD Finance SA 'REGS' 5,000 % 30-Jun.-2027	336.186	0,30	
	5,375 % 01-März-2025	377.541	0,34	100.000 Cabot Financial Luxembourg SA 'REGS'			
560.000	Banijay Group SAS 'REGS' 6,500 % 01-März-2026	565.851	0,51	7,500 % 01-Okt.-2023	123.002	0,11	
145.000	Constantin Investissement 3 SASU '144A'			485.000 Connect Finco SARL / Connect US Finco LLC '144A'			
	5,375 % 15-Apr.-2025	163.824	0,15	6,750 % 01-Okt.-2026	459.246	0,41	
340.000	Constantin Investissement 3 SASU 'REGS'			595.000 Consolidated Energy Finance SA '144A'			
	5,375 % 15-Apr.-2025	384.140	0,34	6,875 % 15-Jun.-2025	506.116	0,45	
470.000	Kapla Holding SAS 'REGS' 3,375 % 15-Dez.-2026	468.214	0,42	380.000 Garfunkelux Holdco 3 SA 'REGS' 8,500 % 01-Nov.-2022	439.424	0,39	
215.000	Kapla Holding SAS 'REGS' FRN 3,250 % 15-Dez.-2026	216.865	0,19	630.000 Matterhorn Telecom SA 'REGS' 4,000 % 15-Nov.-2027	713.794	0,64	
375.000	La Financiere Atalian SASU 'REGS'			115.000 Telecom Italia Capital SA 6,000 % 30-Sept.-2034	125.489	0,11	
	5,125 % 15-Mai-2025	317.355	0,28	430.000 Telecom Italia Finance SA 'EMTN'			
290.000	Loxam SAS 'REGS' 2,875 % 15-Apr.-2026	280.118	0,25	7,750 % 24-Jan.-2033	678.718	0,61	
400.000	Renault SA 1,125 % 04-Okt.-2027	385.373	0,35	300.000 Telenet Finance Luxembourg Notes Sarl 'REGS'			
Deutschland - 1.873.547				3,500 % 01-März-2028	343.762	0,31	
(31. Dezember 2019: 876.932)				Niederlande - 4.193.239			
		1.873.547 1,68		(31. Dezember 2019: 3.381.916)			
366.000	Cheplapharm Arzneimittel GmbH 'REGS'			4.193.239 3,76			
	3,500 % 11-Feb.-2027	406.717	0,36	100.000 Energizer Gamma Acquisition BV 'REGS'			
420.000	Nidda BondCo GmbH 'REGS' 5,000 % 30-Sept.-2025	467.248	0,42	4,625 % 15-Jul.-2026	114.993	0,10	
165.000	Nidda BondCo GmbH 'REGS' 7,250 % 30-Sept.-2025	189.228	0,17	280.000 Intertrust Group BV 'REGS' 3,375 % 15-Nov.-2025	317.383	0,29	
				467.000 Samvardhana Motherson Automotive Systems			
				Group BV 'REGS' 1,800 % 06-Jul.-2024	453.882	0,41	

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener	Summe			Angemessener	Summe
Bestände	Beschreibung	Wert in USD	der Netto- vermögen %	Bestände	Beschreibung	Wert in USD	der Netto- vermögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
Niederlande Forts.				USA Forts.			
390.000	Stars Group Holdings BV / Stars Group US Co-Borrower LLC '144A' 7,000 % 15-Jul.-2026	411.397	0,37	390.000	Allen Media LLC / Allen Media Co-Issuer Inc '144A' 10,500 % 15-Feb.-2028	358.018	0,32
235.969	Summer BidCo BV 'REGS' 9,750 % 15-Nov.-2025	250.040	0,22	305.000	American Airlines Inc '144A' 11,750 % 15-Jul.-2025	291.275	0,26
285.000	Summer BidCo BV 'REGS' 9,750 % 15-Nov.-2025	293.900	0,26	300.000	American Axle & Manufacturing Inc 6,250 % 01-Apr.-2025	294.629	0,26
200.000	Telefonica Europe BV FRN (Immerwährend) 2,875 % 24-Jun.-2027	213.432	0,19	115.000	American Axle & Manufacturing Inc 6,875 % 01-Jul.-2028	113.131	0,10
300.000	Telefonica Europe BV FRN (Immerwährend) 3,875 % 22-Jun.-2026	336.691	0,30	365.000	AMN Healthcare Inc '144A' 4,625 % 01-Okt.-2027	356.264	0,32
200.000	Trivium Packaging Finance BV '144A' 8,500 % 15-Aug.-2027	213.963	0,19	505.000	AmWINS Group Inc '144A' 7,750 % 01-Jul.-2026	528.361	0,47
135.000	Trivium Packaging Finance BV 'REGS' 3,750 % 15-Aug.-2026	149.809	0,13	145.000	Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp '144A' 5,750 % 01-März-2027	117.907	0,11
395.000	United Group BV 'REGS' 4,875 % 01-Jul.-2024	440.542	0,40	243.000	Apache Corp 4,375 % 15-Okt.-2028	214.047	0,19
130.000	Volkswagen International Finance NV FRN (Immerwährend) 3,500 % 20-März-2030	142.426	0,13	324.000	Apache Corp 5,100 % 01-Sept.-2040	263.793	0,24
200.000	Volkswagen International Finance NV FRN (Immerwährend) 4,625 % 27-Jun.-2028	233.531	0,21	80.000	Apache Corp 5,350 % 01-Jul.-2049	63.639	0,06
400.000	ZF Europe Finance BV 3,000 % 23-Okt.-2029	403.092	0,36	445.000	APX Group Inc '144A' 6,750 % 15-Feb.-2027	418.300	0,38
205.000	Ziggo Bond Co BV 'REGS' 3,375 % 28-Feb.-2030	218.158	0,20	160.000	Arconic Corp '144A' 6,000 % 15-Mai-2025	165.100	0,15
Schweden - 833.242 (31. Dezember 2019: -)				515.000	Arconic Corp '144A' 6,125 % 15-Feb.-2028	499.563	0,45
110.000	Verisure Holding AB 'REGS' FRN 5,000 % 15-Apr.-2025	125.001	0,11	535.000	Ascend Learning LLC '144A' 6,875 % 01-Aug.-2025	538.288	0,48
165.000	Verisure Midholding AB '144A' 5,750 % 01-Dez.-2023	186.976	0,17	355.000	Ashtead Capital Inc '144A' 4,250 % 01-Nov.-2029	355.692	0,32
460.000	Verisure Midholding AB 'REGS' 5,750 % 01-Dez.-2023	521.265	0,47	205.000	Ashton Woods USA LLC / Ashton Woods Finance Co '144A' 6,625 % 15-Jan.-2028	202.437	0,18
Großbritannien - 6.122.463 (31. Dezember 2019: 3.771.209)				215.000	Avantor Inc '144A' 9,000 % 01-Okt.-2025	231.394	0,21
451.000	Centrica Plc FRN 5,250 % 10-Apr.-2075	552.708	0,50	100.000	Avantor Inc 'REGS' 4,750 % 01-Okt.-2024	116.013	0,10
295.000	INEOS Finance Plc 'REGS' 2,875 % 01-Mai-2026	316.302	0,28	150.000	Axalta Coating Systems LLC / Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV '144A' 4,750 % 15-Jun.-2027	151.500	0,14
200.000	International Game Technology Plc '144A' 5,250 % 15-Jan.-2029	195.860	0,18	450.000	Banff Merger Sub Inc '144A' 9,750 % 01-Sept.-2026	453.573	0,41
265.000	Jerrold Finco Plc 'REGS' 4,875 % 15-Jan.-2026	295.910	0,26	210.000	Banff Merger Sub Inc 'REGS' 8,375 % 01-Sept.-2026	236.842	0,21
490.000	Pinewood Finance Co Ltd 'REGS' 3,250 % 30-Sept.-2025	593.664	0,53	200.000	Bank of America Corp FRN (Immerwährend) 5,200 % 01-Jun.-2023	193.758	0,17
545.000	Synlab Bondco Plc 'REGS' FRN 4,750 % 01-Jul.-2025	610.616	0,55	235.000	Berry Global Inc 5,125 % 15-Jul.-2023	235.509	0,21
390.000	Synlab Unsecured Bondco Plc 'REGS' 8,250 % 01-Jul.-2023	449.073	0,40	230.000	Block Communications Inc '144A' 4,875 % 01-März-2028	226.514	0,20
315.000	Titan Acquisition Ltd / Titan Co-Borrower LLC '144A' 7,750 % 15-Apr.-2026	299.283	0,27	395.000	Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp '144A' 6,625 % 15-Jul.-2026	358.162	0,32
405.000	Venator Finance Sarl / Venator Materials LLC '144A' 5,750 % 15-Jul.-2025	289.277	0,26	150.000	Boxer Parent Co Inc '144A' 7,125 % 02-Okt.-2025	157.875	0,14
395.000	Venator Finance Sarl / Venator Materials LLC '144A' 9,500 % 01-Jul.-2025	408.825	0,37	85.000	Boyd Gaming Corp 6,375 % 01-Apr.-2026	80.872	0,07
640.000	Virgin Media Secured Finance Plc 'REGS' 4,250 % 15-Jan.-2030	778.190	0,70	92.000	Boyd Gaming Corp '144A' 8,625 % 01-Jun.-2025	94.215	0,08
430.000	Viridian Group FinanceCo Plc / Viridian Power & Energy 'REGS' 4,750 % 15-Sept.-2024	520.947	0,47	245.000	Brand Industrial Services Inc '144A' 8,500 % 15-Jul.-2025	226.163	0,20
275.000	Vodafone Group Plc FRN 4,875 % 03-Okt.-2078	351.696	0,31	240.000	Brink's Co/The '144A' 4,625 % 15-Okt.-2027	229.897	0,21
375.000	William Hill Plc 4,750 % 01-Mai-2026	460.112	0,41	235.000	Brookfield Property REIT Inc / BPR Cumulus LLC / BPR Nimbus LLC / GGSI Sellco LL '144A' 5,750 % 15-Mai-2026	198.540	0,18
USA - 76.715.994 (31. Dezember 2019: 82.450.548)				205.000	Burlington Coat Factory Warehouse Corp '144A' 6,250 % 15-Apr.-2025	214.609	0,19
250.000	AES Corp/The 6,000 % 15-Mai-2026	261.801	0,23	180.000	Calpine Corp '144A' 4,500 % 15-Feb.-2028	177.040	0,16
165.000	Ahern Rentals Inc '144A' 7,375 % 15-Mai-2023	80.249	0,07	170.000	Calpine Corp '144A' 5,125 % 15-März-2028	166.035	0,15
215.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC 6,625 % 15-Jun.-2024	221.128	0,20	290.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4,500 % 15-Aug.-2030	294.786	0,26
145.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A' 5,875 % 15-Feb.-2028	149.233	0,13	300.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4,750 % 01-März-2030	307.509	0,28
320.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc / New Albertsons LP / Albertsons LLC 'REGS' 7,500 % 15-März-2026	343.053	0,31	245.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5,000 % 01-Feb.-2028	253.820	0,23
				120.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5,125 % 01-Mai-2027	124.230	0,11
				345.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5,500 % 01-Mai-2026	358.315	0,32

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener		Summe		Bestände	Beschreibung	Angemessener		Summe	
		Wert	der Netto-					Wert	der Netto-		
		in USD	vermögen %					in USD	vermögen %		
Anleihen Forts.						Anleihen Forts.					
USA Forts.						USA Forts.					
230.000	CDK Global Inc '144A' 5,250% 15-Mai-2029	238.395	0,21			415.000	Dealer Tire LLC / DT Issuer LLC '144A'				
385.000	Centene Corp 4,250% 15-Dez.-2027	396.575	0,36				8,000% 01-Feb.-2028	385.431	0,35		
85.000	Centene Corp 4,625% 15-Dez.-2029	89.888	0,08			145.000	Dell International LLC / EMC Corp '144A'				
165.000	CenturyLink Inc 5,625% 01-Apr.-2025	170.801	0,15				6,100% 15-Jul.-2027	167.458	0,15		
105.000	CenturyLink Inc 6,875% 15-Jan.-2028	111.320	0,10			145.000	Dell International LLC / EMC Corp '144A'				
305.000	CenturyLink Inc 7,500% 01-Apr.-2024	336.824	0,30				6,200% 15-Jul.-2030	169.562	0,15		
550.000	Change Healthcare Holdings LLC /					135.000	Delta Air Lines Inc '144A' 7,000% 01-Mai-2025	139.728	0,13		
	Change Healthcare Finance Inc '144A'					495.000	Diamond Sports Group LLC /				
	5,750% 01-März-2025	542.861	0,49				Diamond Sports Finance Co '144A'				
430.000	Cheniere Energy Partners LP 5,250% 01-Okt.-2025	426.130	0,38				5,375% 15-Aug.-2026	366.389	0,33		
320.000	Cheniere Energy Partners LP '144A'					175.000	Diamond Sports Group LLC /				
	4,500% 01-Okt.-2029	310.646	0,28				Diamond Sports Finance Co '144A'				
464.000	CHS/Community Health Systems Inc '144A'						6,625% 15-Aug.-2027	96.255	0,09		
	6,625% 15-Feb.-2025	444.280	0,40			205.000	DISH DBS Corp 5,000% 15-März-2023	205.803	0,18		
170.000	Cincinnati Bell Inc '144A' 7,000% 15-Jul.-2024	174.355	0,16			215.000	DISH DBS Corp 5,875% 15-Jul.-2022	219.017	0,20		
250.000	Cincinnati Bell Inc '144A' 8,000% 15-Okt.-2025	260.286	0,23			310.000	Dun & Bradstreet Corp/The 'REGS'				
275.000	CIT Group Inc 5,000% 15-Aug.-2022	281.637	0,25				10,250% 15-Feb.-2027	341.718	0,31		
270.000	CIT Group Inc 6,125% 09-März-2028	291.211	0,26			303.000	Edgewell Personal Care Co '144A'				
200.000	Citigroup Inc FRN (Immerwährend) 5,950% 30-Jan.-2023	200.500	0,18				5,500% 01-Jun.-2028	311.143	0,28		
365.000	Clarios Global LP / Clarios US Finance Co '144A'					145.000	Encompass Health Corp 4,500% 01-Feb.-2028	137.867	0,12		
	8,500% 15-Mai-2027	364.991	0,33			275.000	Encompass Health Corp 4,750% 01-Feb.-2030	264.635	0,24		
260.000	Clarios Global LP / Clarios US Finance Co 'REGS'					340.000	Energizer Holdings Inc '144A' 4,750% 15-Jun.-2028	334.050	0,30		
	8,500% 15-Mai-2027	259.993	0,23			60.000	Energizer Holdings Inc '144A' 6,375% 15-Jul.-2026	62.185	0,06		
85.000	Clark Equipment Co '144A' 5,875% 01-Jun.-2025	87.284	0,08			260.000	Energizer Holdings Inc 'REGS' 6,375% 15-Jul.-2026	269.467	0,24		
370.000	Clearway Energy Operating LLC 5,750% 15-Okt.-2025	382.989	0,34			75.000	Energizer Holdings Inc 'REGS' 7,750% 15-Jan.-2027	80.236	0,07		
115.000	Colt Merger Sub Inc '144A' 5,750% 01-Jul.-2025	115.287	0,10			255.000	Energy Transfer Operating LP 5,500% 01-Jun.-2027	282.136	0,25		
630.000	Colt Merger Sub Inc '144A' 6,250% 01-Jul.-2025	628.425	0,56			410.000	EnLink Midstream Partners LP 4,150% 01-Jun.-2025	319.720	0,29		
345.000	Colt Merger Sub Inc '144A' 8,125% 01-Jul.-2027	335.081	0,30			145.000	EnLink Midstream Partners LP 4,850% 15-Jul.-2026	109.171	0,10		
365.000	Commercial Metals Co 5,750% 15-Apr.-2026	372.470	0,33			400.000	EnPro Industries Inc 5,750% 15-Okt.-2026	402.424	0,36		
190.000	CommScope Inc '144A' 7,125% 01-Jul.-2028	190.475	0,17			520.000	Enviva Partners LP / Enviva Partners Finance				
500.000	CommScope Inc '144A' 8,250% 01-März-2027	513.067	0,46				Corp '144A' 6,500% 15-Jan.-2026	538.239	0,48		
350.000	CommScope Inc 'REGS' 6,000% 01-März-2026	359.566	0,32			160.000	EQM Midstream Partners LP 4,750% 15-Jul.-2023	158.760	0,14		
75.000	CommScope Technologies LLC '144A'					180.000	EQM Midstream Partners LP 5,500% 15-Jul.-2028	170.955	0,15		
	6,000% 15-Jun.-2025	71.902	0,06			115.000	EQM Midstream Partners LP '144A'				
215.000	Compass Group Diversified Holdings LLC '144A'						6,000% 01-Jul.-2025	116.979	0,11		
	8,000% 01-Mai-2026	218.388	0,20			145.000	EQM Midstream Partners LP '144A'				
245.000	Continental Resources Inc/OK 4,500% 15-Apr.-2023	235.364	0,21				6,500% 01-Jul.-2027	148.595	0,13		
385.000	Core & Main Holdings LP '144A' 8,625% 15-Sept.-2024	387.626	0,35			320.000	EQT Corp 6,125% 01-Feb.-2025	319.757	0,29		
354.000	Core & Main LP '144A' 6,125% 15-Aug.-2025	353.917	0,32			245.000	Everi Payments Inc '144A' 7,500% 15-Dez.-2025	235.481	0,21		
655.000	Cornerstone Building Brands Inc '144A'					75.000	Flex Acquisition Co Inc '144A' 6,875% 15-Jan.-2025	72.249	0,06		
	8,000% 15-Apr.-2026	660.342	0,59			225.000	Flex Acquisition Co Inc '144A' 7,875% 15-Jul.-2026	218.386	0,20		
595.000	Covanta Holding Corp 6,000% 01-Jan.-2027	603.812	0,54			150.000	Ford Motor Co 8,500% 21-Apr.-2023	158.239	0,14		
220.000	Crestwood Midstream Partners LP /					150.000	Ford Motor Co 9,000% 22-Apr.-2025	162.371	0,15		
	Crestwood Midstream Finance Corp					200.000	Ford Motor Credit Co LLC 3,219% 09-Jan.-2022	194.810	0,17		
	5,750% 01-Apr.-2025	200.885	0,18			200.000	Ford Motor Credit Co LLC 3,813% 12-Okt.-2021	198.190	0,18		
465.000	Crestwood Midstream Partners LP /					200.000	Ford Motor Credit Co LLC 3,815% 02-Nov.-2027	182.625	0,16		
	Crestwood Midstream Finance Corp '144A'					200.000	Ford Motor Credit Co LLC 4,063% 01-Nov.-2024	191.825	0,17		
	5,625% 01-Mai-2027	401.367	0,36			200.000	Ford Motor Credit Co LLC 4,271% 09-Jan.-2027	187.131	0,17		
395.000	CrownRock LP / CrownRock Finance Inc '144A'					200.000	Ford Motor Credit Co LLC 4,542% 01-Aug.-2026	190.816	0,17		
	5,625% 15-Okt.-2025	368.580	0,33			400.000	Ford Motor Credit Co LLC 5,113% 03-Mai-2029	392.834	0,35		
200.000	CSC Holdings LLC '144A' 4,625% 01-Dez.-2030	195.500	0,18			315.000	Ford Motor Credit Co LLC 'EMTN'				
285.000	CSC Holdings LLC '144A' 5,500% 15-Mai-2026	293.680	0,26				3,021% 06-März-2024	340.281	0,31		
200.000	CSC Holdings LLC '144A' 7,500% 01-Apr.-2028	219.435	0,20			325.000	Freeport-McMoRan Inc 5,000% 01-Sept.-2027	326.956	0,29		
235.000	CSC Holdings LLC '144A' 10,875% 15-Okt.-2025	253.470	0,23			355.000	Freeport-McMoRan Inc 5,450% 15-März-2043	349.102	0,31		
325.000	CSC Holdings LLC 'REGS' 6,500% 01-Feb.-2029	354.047	0,32			445.000	FS Energy and Power Fund '144A'				
430.000	CVR Energy Inc '144A' 5,750% 15-Feb.-2028	378.529	0,34				7,500% 15-Aug.-2023	378.573	0,34		
35.000	DaVita Inc 5,000% 01-Mai-2025	35.867	0,03			600.000	Gates Global LLC / Gates Corp '144A'				
140.000	DaVita Inc '144A' 4,625% 01-Jun.-2030	139.037	0,12				6,250% 15-Jan.-2026	592.422	0,53		
155.000	DCP Midstream Operating LP 5,375% 15-Jul.-2025	154.708	0,14								

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener	Summe			Angemessener	Summe
		Wert	der Netto-			Wert	der Netto-
Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %	Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
USA Forts.				USA Forts.			
405.000	General Electric Co FRN (Immerwährend)			245.000	Matador Resources Co 5,875 % 15-Sept.-2026	181.881	0,16
	5,000 % 21-Jan.-2021	316.932	0,28	225.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co '144A'		
460.000	Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp				7,250 % 15-Apr.-2025	201.413	0,18
	6,000 % 15-Mai-2023	424.877	0,38	245.000	Mauser Packaging Solutions Holding Co '144A'		
130.000	Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp				8,500 % 15-Apr.-2024	251.125	0,23
	6,500 % 01-Okt.-2025	111.233	0,10	125.000	Mercer International Inc 5,500 % 15-Jan.-2026	117.894	0,11
100.000	Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp			245.000	Mercer International Inc 7,375 % 15-Jan.-2025	246.891	0,22
	7,750 % 01-Feb.-2028	90.094	0,08	218.000	Meredith Corp '144A' 6,500 % 01-Jul.-2025	218.272	0,20
350.000	Genesys Telecommunications Laboratories Inc/			290.000	Midcontinent Communications /		
	Greeneden Lux 3 Sarl/Greeneden US Ho '144A'				Midcontinent Finance Corp '144A'		
	10,000 % 30-Nov.-2024	364.807	0,33		5,375 % 15-Aug.-2027	296.745	0,27
110.000	Gray Television Inc '144A' 7,000 % 15-Mai-2027	113.228	0,10	115.000	Minerals Technologies Inc '144A'		
345.000	Greystar Real Estate Partners LLC '144A'				5,000 % 01-Jul.-2028	116.437	0,10
	5,750 % 01-Dez.-2025	348.519	0,31	520.000	MPH Acquisition Holdings LLC '144A'		
555.000	Griffon Corp 5,750 % 01-März-2028	549.284	0,49		7,125 % 01-Jun.-2024	486.200	0,44
435.000	GTCR AP Finance Inc '144A' 8,000 % 15-Mai-2027	445.249	0,40	355.000	Mueller Water Products Inc '144A'		
90.000	H&E Equipment Services Inc 5,625 % 01-Sept.-2025	90.684	0,08		5,500 % 15-Jun.-2026	368.689	0,33
480.000	Harsco Corp '144A' 5,750 % 31-Jul.-2027	483.614	0,43	405.000	Nationstar Mortgage Holdings Inc '144A'		
300.000	HCA Inc 5,875 % 01-Mai-2023	325.506	0,29		6,000 % 15-Jan.-2027	389.314	0,35
190.000	HUB International Ltd '144A' 7,000 % 01-Mai-2026	190.191	0,17	330.000	Nationstar Mortgage Holdings Inc '144A'		
415.000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises				8,125 % 15-Jul.-2023	340.760	0,31
	Finance Corp 5,250 % 15-Mai-2027	399.074	0,36	150.000	Nationstar Mortgage Holdings Inc 'REGS'		
520.000	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises				8,125 % 15-Jul.-2023	154.891	0,14
	Finance Corp 6,250 % 15-Mai-2026	526.417	0,47	660.000	Navient Corp 5,500 % 25-Jan.-2023	632.362	0,57
330.000	Innophos Holdings Inc '144A'			365.000	Navient Corp 7,250 % 25-Sept.-2023	357.742	0,32
	9,375 % 15-Feb.-2028	324.431	0,29	210.000	Netflix Inc 4,625 % 15-Mai-2029	261.868	0,23
255.000	Intrado Corp '144A' 8,500 % 15-Okt.-2025	203.101	0,18	190.000	Netflix Inc 5,875 % 15-Feb.-2025	210.834	0,19
385.000	Iron Mountain Inc '144A' 5,250 % 15-Jul.-2030	380.428	0,34	185.000	Netflix Inc 'REGS' 3,625 % 15-Jun.-2030	214.660	0,19
340.000	Jagged Peak Energy LLC 5,875 % 01-Mai-2026	330.920	0,30	270.000	New Albertsons LP 8,000 % 01-Mai-2031	303.075	0,27
90.000	Jaguar Holding Co II / PPD Development LP '144A'			265.000	Novelis Corp '144A' 4,750 % 30-Jan.-2030	253.080	0,23
	4,625 % 15-Jun.-2025	91.631	0,08	495.000	NRG Energy Inc 5,750 % 15-Jan.-2028	523.307	0,47
150.000	Jaguar Holding Co II / PPD Development LP '144A'			200.000	NRG Energy Inc 7,250 % 15-Mai-2026	212.441	0,19
	5,000 % 15-Jun.-2028	153.844	0,14	285.000	Occidental Petroleum Corp 2,900 % 15-Aug.-2024	242.874	0,22
475.000	Kaiser Aluminum Corp '144A' 4,625 % 01-März-2028	459.178	0,41	145.000	Occidental Petroleum Corp 3,400 % 15-Apr.-2026	118.900	0,11
60.000	Kaiser Aluminum Corp '144A' 6,500 % 01-Mai-2025	61.976	0,06	350.000	Occidental Petroleum Corp 3,500 % 15-Aug.-2029	257.810	0,23
195.000	Kraft Heinz Foods Co 4,625 % 30-Jan.-2029	210.002	0,19	280.000	Occidental Petroleum Corp 4,400 % 15-Apr.-2046	195.077	0,18
180.000	Kraft Heinz Foods Co 5,000 % 15-Jul.-2035	197.749	0,18	135.000	Occidental Petroleum Corp 5,550 % 15-März-2026	124.756	0,11
105.000	Kraft Heinz Foods Co 5,000 % 04-Jun.-2042	108.606	0,10	285.000	Occidental Petroleum Corp 6,450 % 15-Sept.-2036	242.298	0,22
330.000	Kraft Heinz Foods Co 5,200 % 15-Jul.-2045	352.912	0,32	320.000	Occidental Petroleum Corp 6,950 % 01-Jul.-2024	314.200	0,28
140.000	Kraft Heinz Foods Co '144A' 3,875 % 15-Mai-2027	146.606	0,13	220.000	Occidental Petroleum Corp 8,875 % 15-Jul.-2030	220.550	0,20
185.000	Kraft Heinz Foods Co '144A' 4,250 % 01-März-2031	195.187	0,18	245.000	Open Text Holdings Inc '144A' 4,125 % 15-Feb.-2030	241.336	0,22
325.000	Kraft Heinz Foods Co '144A' 4,625 % 01-Okt.-2039	326.052	0,29	470.000	Ortho-Clinical Diagnostics Inc / Ortho-Clinical		
160.000	Kraton Polymers LLC / Kraton Polymers				Diagnostics SA '144A' 7,250 % 01-Feb.-2028	481.750	0,43
	Capital Corp '144A' 7,000 % 15-Apr.-2025	161.362	0,14	170.000	Ortho-Clinical Diagnostics Inc / Ortho-Clinical		
575.000	LABL Escrow Issuer LLC '144A' 6,750 % 15-Jul.-2026	598.026	0,54		Diagnostics SA '144A' 7,375 % 01-Jun.-2025	173.719	0,16
85.000	LABL Escrow Issuer LLC '144A' 10,500 % 15-Jul.-2027	90.506	0,08	105.000	Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital		
205.000	Ladder Capital Finance Holdings LLLP /				Corp '144A' 4,625 % 15-März-2030	96.025	0,09
	Ladder Capital Finance Corp '144A'			200.000	Outfront Media Capital LLC / Outfront Media Capital		
	4,250 % 01-Feb.-2027	164.082	0,15		Corp '144A' 5,000 % 15-Aug.-2027	179.778	0,16
575.000	Ladder Capital Finance Holdings LLLP /			155.000	Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp 'REGS'		
	Ladder Capital Finance Corp '144A'				5,375 % 15-Jan.-2025	151.336	0,14
	5,250 % 01-Okt.-2025	500.046	0,45	290.000	PBF Holding Co LLC / PBF Finance Corp '144A'		
180.000	Laredo Petroleum Inc 9,500 % 15-Jan.-2025	127.105	0,11		6,000 % 15-Feb.-2028	247.225	0,22
45.000	Laredo Petroleum Inc 10,125 % 15-Jan.-2028	32.962	0,03	221.000	PBF Holding Co LLC / PBF Finance Corp '144A'		
330.000	Level 3 Financing Inc 5,375 % 01-Mai-2025	337.872	0,30		9,250 % 15-Mai-2025	234.162	0,21
245.000	LifePoint Health Inc '144A' 6,750 % 15-Apr.-2025	252.350	0,23	360.000	PDC Energy Inc 5,750 % 15-Mai-2026	328.743	0,29
540.000	Lions Gate Capital Holdings LLC '144A'			230.000	PetSmart Inc '144A' 7,125 % 15-März-2023	226.713	0,20
	6,375 % 01-Feb.-2024	528.182	0,47	63.000	Picasso Finance Sub Inc '144A' 6,125 % 15-Jun.-2025	64.247	0,06
340.000	Macy's Inc '144A' 8,375 % 15-Jun.-2025	338.937	0,30	705.000	Polaris Intermediate Corp '144A' 8,500 % 01-Dez.-2022	624.359	0,56

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener		Summe	Bestände	Beschreibung	Angemessener		Summe
		Wert	der Netto-				Wert	der Netto-	
		in USD	vermögen %				in USD	vermögen %	
Anleihen Forts.					Anleihen Forts.				
	USA Forts.					USA Forts.			
240.000	Post Holdings Inc '144A' 4,625 % 15-Apr.-2030	234.396	0,21		20.000	Tenet Healthcare Corp 'REGS' 6,250 % 01-Feb.-2027	19.812	0,02	
380.000	Post Holdings Inc '144A' 5,750 % 01-März-2027	393.454	0,35		320.000	TerraForm Power Operating LLC '144A'			
170.000	Prestige Brands Inc '144A' 5,125 % 15-Jan.-2028	170.425	0,15			4,750 % 15-Jan.-2030	325.757	0,29	
255.000	Prime Security Services Borrower LLC /				260.000	Terrier Media Buyer Inc '144A' 8,875 % 15-Dez.-2027	248.950	0,22	
	Prime Finance Inc '144A' 6,250 % 15-Jan.-2028	241.049	0,22		100.000	TransDigm Inc 5,500 % 15-Nov.-2027	88.057	0,08	
75.000	Prime Security Services Borrower LLC /				550.000	TransDigm Inc 6,500 % 15-Mai-2025	508.808	0,46	
	Prime Finance Inc 'REGS' 5,750 % 15-Apr.-2026	77.637	0,07		460.000	TransDigm Inc '144A' 6,250 % 15-März-2026	460.246	0,41	
375.000	Quicken Loans LLC '144A' 5,250 % 15-Jan.-2028	387.639	0,35		125.000	TRI Pointe Group Inc 5,700 % 15-Jun.-2028	127.812	0,11	
225.000	Quicken Loans LLC '144A' 5,750 % 01-Mai-2025	230.581	0,21		380.000	Tronox Inc '144A' 6,500 % 01-Mai-2025	381.187	0,34	
260.000	Rackspace Hosting Inc '144A' 8,625 % 15-Nov.-2024	260.013	0,23		310.000	TTM Technologies Inc '144A' 5,625 % 01-Okt.-2025	308.030	0,28	
405.000	Radiate Holdco LLC / Radiate Finance Inc '144A'				137.000	Ulti 4,750 % 03-Mai-2026	134.945	0,12	
	6,625 % 15-Feb.-2025	402.471	0,36		315.000	United Rentals North America Inc			
230.000	Radiate Holdco LLC / Radiate Finance Inc '144A'					5,500 % 15-Mai-2027	324.902	0,29	
	6,875 % 15-Feb.-2023	233.713	0,21		100.000	United Rentals North America Inc			
80.000	Realogy Group LLC / Realogy Co-Issuer Corp '144A'					5,875 % 15-Sept.-2026	104.861	0,09	
	7,625 % 15-Jun.-2025	80.024	0,07		335.000	US Foods Inc '144A' 6,250 % 15-Apr.-2025	341.842	0,31	
395.000	Reynolds Group Issuer Inc / Reynolds Group				298.000	USA Compression Partners LP / USA Compression			
	Issuer LLC / Reynolds Group Issuer Lu '144A'					Finance Corp 6,875 % 01-Apr.-2026	291.992	0,26	
	7,000 % 15-Jul.-2024	396.302	0,36		120.000	USA Compression Partners LP / USA Compression			
200.000	RP Crown Parent LLC '144A' 7,375 % 15-Okt.-2024	200.229	0,18			Finance Corp 6,875 % 01-Sept.-2027	116.096	0,10	
211.000	SBA Communications Corp '144A'				390.000	USI Inc/NY '144A' 6,875 % 01-Mai-2025	394.627	0,35	
	3,875 % 15-Feb.-2027	209.480	0,19		535.000	Verscend Escrow Corp '144A' 9,750 % 15-Aug.-2026	576.636	0,52	
240.000	Scientific Games International Inc 'REGS'				165.000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc '144A'			
	8,250 % 15-März-2026	215.209	0,19			4,125 % 15-Aug.-2030	157.627	0,14	
351.000	Scotts Miracle-Gro Co/The 4,500 % 15-Okt.-2029	362.199	0,32		170.000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc '144A'			
335.000	Scripps Escrow Inc '144A' 5,875 % 15-Jul.-2027	321.329	0,29			4,250 % 01-Dez.-2026	162.618	0,15	
315.000	Select Medical Corp '144A' 6,250 % 15-Aug.-2026	317.671	0,29		125.000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc '144A'			
160.000	Signature Aviation US Holdings Inc '144A'					4,625 % 01-Dez.-2029	121.784	0,11	
	4,000 % 01-März-2028	145.470	0,13		235.000	Vistra Operations Co LLC '144A' 5,625 % 15-Feb.-2027	240.659	0,22	
70.000	Sinclair Television Group Inc '144A'				165.000	Vistra Operations Co LLC 'REGS' 5,500 % 01-Sept.-2026	169.238	0,15	
	5,125 % 15-Feb.-2027	64.299	0,06		70.000	Vistra Operations Co LLC 'REGS' 5,625 % 15-Feb.-2027	71.686	0,06	
455.000	Sirius XM Radio Inc '144A' 5,500 % 01-Jul.-2029	480.485	0,43		420.000	Waste Pro USA Inc '144A' 5,500 % 15-Feb.-2026	402.627	0,36	
360.000	Southwestern Energy Co 7,500 % 01-Apr.-2026	319.628	0,29		225.000	WESCO Distribution Inc '144A' 7,125 % 15-Jun.-2025	237.656	0,21	
135.000	Spectrum Brands Inc '144A' 5,500 % 15-Jul.-2030	135.551	0,12		405.000	WESCO Distribution Inc '144A' 7,250 % 15-Jun.-2028	431.325	0,39	
80.000	Sprint Capital Corp 6,875 % 15-Nov.-2028	97.021	0,09		995.000	West Street Merger Sub Inc '144A'			
65.000	Sprint Capital Corp 8,750 % 15-März-2032	92.862	0,08			6,375 % 01-Sept.-2025	968.249	0,87	
220.000	Sprint Corp 7,875 % 15-Sept.-2023	248.324	0,22		180.000	Western Midstream Operating LP			
220.000	Staples Inc '144A' 7,500 % 15-Apr.-2026	174.202	0,16			3,100 % 01-Feb.-2025	170.329	0,15	
112.000	Station Casinos LLC '144A' 4,500 % 15-Feb.-2028	96.110	0,09		300.000	Western Midstream Operating LP			
260.000	Stevens Holding Co Inc 'REGS'					4,500 % 01-März-2028	283.500	0,25	
	6,125 % 01-Okt.-2026	273.276	0,25		310.000	Williams Scotsman International Inc 'REGS'			
55.000	Surgery Center Holdings Inc '144A'					6,875 % 15-Aug.-2023	319.333	0,29	
	10,000 % 15-Apr.-2027	54.921	0,05		145.000	WMG Acquisition Corp '144A' 3,875 % 15-Jul.-2030	146.812	0,13	
50.000	Targa Resources Partners LP / Targa Resources				135.000	WPX Energy Inc 5,750 % 01-Jun.-2026	131.005	0,12	
	Partners Finance Corp 6,500 % 15-Jul.-2027	50.375	0,05		155.000	WW International Inc '144A' 8,625 % 01-Dez.-2025	162.459	0,15	
105.000	Taylor Morrison Communities Inc '144A'				215.000	WW International Inc 'REGS' 8,625 % 01-Dez.-2025	225.347	0,20	
	5,875 % 31-Jan.-2025	106.701	0,10		415.000	Zayo Group Holdings Inc '144A'			
190.000	Taylor Morrison Communities Inc '144A'					4,000 % 01-März-2027	392.889	0,35	
	5,875 % 15-Jun.-2027	196.648	0,18		230.000	ZF North America Capital Inc '144A'			
157.000	TEGNA Inc '144A' 4,625 % 15-März-2028	144.915	0,13			4,750 % 29-Apr.-2025	229.713	0,21	
725.000	TEGNA Inc '144A' 5,000 % 15-Sept.-2029	671.089	0,60						
90.000	Tempo Acquisition LLC / Tempo Acquisition								
	Finance Corp '144A' 5,750 % 01-Jun.-2025	92.756	0,08						
500.000	Tempo Acquisition LLC / Tempo Acquisition								
	Finance Corp '144A' 6,750 % 01-Jun.-2025	504.057	0,45						
155.000	Tenet Healthcare Corp 8,125 % 01-Apr.-2022	162.157	0,15						
645.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 6,250 % 01-Feb.-2027	638.950	0,57						
65.000	Tenet Healthcare Corp '144A' 7,500 % 01-Apr.-2025	68.616	0,06						
					Summe der Anlagen in Anleihen				
					107.165.787 96,11				
					Leveraged Loans				
					Luxemburg - 31.421				
					(31. Dezember 2019: -)				
					31.421 0,02				
					34.912	Auris Luxembourg III Sarl Term Loan			
						0,000 % 21-Feb.-2026	31.421	0,02	

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %	Devisenterminkontrakte						Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Bestände	Beschreibung			Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	
Leveraged Loans Forts.				BNY Mellon Global High Yield Bond Fund						
	USA - 890.331			US-Dollar	Euro	15.495.979	13.800.000	31-Jul.-20	Goldman Sachs	17.407
	(31. Dezember 2019: 5.035.813)	890.331	0,80	US-Dollar	Euro	2.140.000	1.905.494	31-Jul.-20	Goldman Sachs	2.730
245.000	Asurion LLC Term Loan 7,880 % 04-Aug.-2025	243.775	0,22	US-Dollar	Sterling	310.624	250.000	31-Jul.-20	Goldman Sachs	3.802
521	AVSC Holding Corp Term Loan 0,000 % 15-Okt.-2026	380	0,00	US-Dollar	Sterling	234.714	190.000	31-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	1.530
491.252	Mayfield Agency Borrower Inc Term Loan 0,000 % 31-Jan.-2025	429.026	0,39	US-Dollar	Sterling	5.016.287	4.050.000	31-Jul.-20	Goldman Sachs	45.775
16.730	Pathway Vet Alliance LLC Term Loan 0,000 % 31-März-2022	16.312	0,01						USD	71.244
205.856	Pathway Vet Alliance LLC Term Loan 0,000 % 31-März-2027	200.838	0,18	Sterling	US-Dollar	900.000	1.109.020	31-Jul.-20	Goldman Sachs	(4.461)
Summe der Anlagen in Leveraged Loans		921.752	0,82						USD	(4.461)
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 74.188 (siehe unten) 31. Dezember 2019: 436.070)		74.188	0,07						Netto USD	66.783
Summe der Vermögenswerte zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert		108.161.727	97,00	BNY Mellon Global High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged)						
				US-Dollar	Euro	27.714	24.658	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	67
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften - (469.320) (siehe unten) 31. Dezember 2019: (248.982))		(469.320)	(0,42)						USD	67
Summe der finanziellen Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert		(469.320)	(0,42)						EUR	60
Nettoumlaufvermögen		3.814.126	3,42	Euro	US-Dollar	49.975	56.878	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(845)
Summe der Nettovermögen		111.506.533	100,00	Euro	US-Dollar	1.017.158	1.155.429	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(14.962)
				Euro	US-Dollar	29.988	33.770	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(147)
				Euro	US-Dollar	89.963	101.253	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(384)
				Euro	US-Dollar	30.975	35.027	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(297)
									USD	(16.635)
									EUR	(14.841)
									Netto USD	(16.568)
									Netto EUR	(14.781)
Portfolioanalyse % des Gesamtvermögens				BNY Mellon Global High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged)						
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten				US-Dollar	Euro	2.530	2.253	01-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	4
Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente				US-Dollar	Euro	1.893	1.677	02-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	13
Nicht an einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten				Euro	US-Dollar	770	863	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	-
Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente				US-Dollar	Euro	276	244	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	3
OTC-Finanzderivate				US-Dollar	Euro	302	267	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	2
Sonstiges Umlaufvermögen				US-Dollar	Euro	6.518	5.756	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	64
Summe der Aktiva			100,00							

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte Forts.							Nicht realisierter
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Gewinn/(Verlust)	
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged) Forts.							
US-Dollar	Euro	2.761	2.453	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	11	
US-Dollar	Euro	208.873	185.496	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	890	
US-Dollar	Euro	1.128	992	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	16	
						USD 1.003	
						EUR 895	
Euro	US-Dollar	1.678	1.883	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(2)	
Euro	US-Dollar	9.407.633	10.686.501	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(138.378)	
Euro	US-Dollar	1.677	1.894	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(13)	
Euro	US-Dollar	2.253	2.531	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(4)	
Euro	US-Dollar	2.924	3.303	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(25)	
						USD (138.422)	
						EUR (123.492)	
						Netto USD (137.419)	
						Netto EUR (122.597)	
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)							
US-Dollar	Euro	2.153	1.912	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	9	
US-Dollar	Euro	108.858	96.350	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	828	
						USD 837	
						EUR 747	
Euro	US-Dollar	841	951	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(9)	
Euro	US-Dollar	97.421	110.665	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1.433)	
						USD (1.442)	
						EUR (1.286)	
						Netto USD (605)	
						Netto EUR (539)	

Devisenterminkontrakte Forts.							Nicht realisierter
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Gewinn/(Verlust)	
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund Anteilsklasse EUR X (Inc) (Hedged)							
US-Dollar	Euro	425.000	378.136	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	1.023	
						USD 1.023	
						EUR 913	
Euro	US-Dollar	17.394.252	19.758.817	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(255.854)	
						USD (255.854)	
						EUR (228.257)	
						Netto USD (254.831)	
						Netto EUR (227.344)	
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)							
US-Dollar	Sterling	30.475	24.822	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	14	
						USD 14	
						GBP 11	
Sterling	US-Dollar	1.121.186	1.428.377	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(52.506)	
						USD (52.506)	
						GBP (42.790)	
						Netto USD (52.492)	
						Netto GBP (42.779)	

BNY MELLON GLOBAL INFRASTRUCTURE INCOME FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %
Aktien				Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 269.707 (siehe unten) 31. Dezember 2019: 390.155)	269.707	0,18
	Belgien - 2.689.352 (31. Dezember 2019: 1.623.678)	2.689.352	1,83	Summe der Vermögenswerte zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert	148.358.700	100,78
131.922	Proximus SADP	2.689.352	1,83	Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften - (3.365.373) (siehe unten) 31. Dezember 2019: (2.433))	(3.365.373)	(2,28)
	Kanada - 11.766.112 (31. Dezember 2019: 6.947.794)	11.766.112	7,99	Summe der finanziellen Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert	(3.365.373)	(2,28)
274.905	Enbridge Inc	8.368.038	5,68	Nettoumlaufvermögen	2.211.745	1,50
364.826	Inter Pipeline Ltd	3.398.074	2,31	Summe der Nettovermögen	147.205.072	100,00
	China - 2.956.244 (31. Dezember 2019: 680.446)	2.956.244	2,01	Portfolioanalyse % des Gesamtvermögens		
2.522.000	Jiangsu Expressway Co Ltd 'H'	2.956.244	2,01	An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten		
	Frankreich - 22.736.638 (31. Dezember 2019: 6.351.395)	22.736.638	15,45	Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		98,10
214.672	Bouygues SA	7.330.793	4,98	OTC-Finanzderivate		0,18
27.922	Eiffage SA	2.554.805	1,74	Sonstiges Umlaufvermögen		1,72
610.758	Orange SA	7.302.746	4,96	Summe der Aktiva		100,00
60.173	Vinci SA	5.548.294	3,77			
	Deutschland - 4.489.298 (31. Dezember 2019: 2.152.812)	4.489.298	3,05			
122.477	Deutsche Post AG	4.489.298	3,05			
	Italien - 16.655.667 (31. Dezember 2019: 14.271.293)	16.655.667	11,31			
289.382	Atlantia SpA	4.649.229	3,16			
608.566	Enel SpA	5.252.713	3,57			
1.163.294	Italgas SpA	6.753.725	4,58			
	Norwegen - 6.050.087 (31. Dezember 2019: 2.637.663)	6.050.087	4,11			
651.598	SFL Corp Ltd	6.050.087	4,11			
	Spanien - 36.317.667 (31. Dezember 2019: 12.823.462)	36.317.667	24,67			
274.004	ACS Actividades de Construcción y Servicios SA	6.909.552	4,69			
245.627	ACS Actividades de Construcción y Servicios SA					
	Rights 11-Jul-2020	382.829	0,26			
45.784	Aena SME SA '144A'	6.113.449	4,15			
356.059	Enagas SA	8.710.710	5,92			
314.223	Endesa SA	7.740.178	5,26			
346.273	Red Electrica Corp SA	6.460.949	4,39			
	Großbritannien - 3.611.653 (31. Dezember 2019: 6.149.464)	3.611.653	2,45			
213.573	SSE Plc	3.611.653	2,45			
	USA - 40.816.275 (31. Dezember 2019: 35.087.243)	40.816.275	27,73			
53.219	Clearway Energy Inc	1.226.698	0,83			
45.483	Dominion Energy Inc	3.689.581	2,51			
149.737	Exelon Corp	5.433.207	3,69			
306.365	Medical Properties Trust Inc (REIT)	5.758.130	3,91			
274.271	ONEOK Inc	9.103.055	6,18			
471.619	PPL Corp	12.184.277	8,28			
69.617	Public Service Enterprise Group Inc	3.421.327	2,33			
Summe der Anlagen in Aktien		148.088.993	100,60			

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte							Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund							BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund						
Euro	US-Dollar	228.350	256.108	01-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	444	Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)						
						USD	Euro	US-Dollar	3.663	4.111	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	5
							US-Dollar	Euro	3.651	3.245	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	4
							US-Dollar	Euro	13.489	11.926	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	85
							US-Dollar	Euro	5.450	4.792	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	65
												USD	159
												EUR	142
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund							BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund						
Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)							Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	6.142	6.893	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	9	Euro	US-Dollar	340.898	382.613	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	502
US-Dollar	Euro	6.157	5.473	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	6	US-Dollar	Euro	339.798	302.051	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	341
US-Dollar	Euro	22.671	20.045	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	143	US-Dollar	Euro	1.255.470	1.110.065	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	7.935
US-Dollar	Euro	9.162	8.055	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	109	US-Dollar	Euro	507.235	445.974	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	6.033
						USD						USD	14.811
						EUR						EUR	13.183
						Netto USD						Netto USD	(1.995)
						EUR						Netto EUR	(1.776)
						(3.352)						Netto USD	(1.836)
						(2.984)						Netto EUR	(1.634)
						(3.085)	BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund						
						(2.746)	Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	5.084	5.732	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(19)	Euro	US-Dollar	283.509	319.650	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1.032)
Euro	US-Dollar	272.626	309.711	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(3.324)	Euro	US-Dollar	15.109.290	17.164.627	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(184.200)
US-Dollar	Euro	5.873	5.234	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(9)	US-Dollar	Euro	323.192	288.033	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(511)
						USD						USD	(185.743)
						(2.984)						EUR	(165.325)
						(3.085)						Netto USD	(170.932)
						(2.746)						Netto EUR	(152.142)
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund							BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund						
Anteilsklasse EUR H (Inc) (Hedged)							Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	19.880	22.313	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	29	Euro	US-Dollar	283.509	319.650	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1.032)
US-Dollar	Euro	19.930	17.716	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	20	Euro	US-Dollar	15.109.290	17.164.627	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(184.200)
US-Dollar	Euro	73.386	64.887	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	464	US-Dollar	Euro	323.192	288.033	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(511)
US-Dollar	Euro	29.658	26.076	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	353						USD	(185.743)
						USD						EUR	(165.325)
						866						Netto USD	(170.932)
						EUR						Netto EUR	(152.142)
						771							
Euro	US-Dollar	16.456	18.554	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(60)							
Euro	US-Dollar	882.496	1.002.543	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(10.759)							
US-Dollar	Euro	19.012	16.944	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(30)							
						USD							
						(10.849)							
						EUR							
						(9.656)							
						Netto USD							
						(9.983)							
						Netto EUR							
						(8.885)							

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte Forts.							Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund							BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund						
Anteilsklasse SGD J (Acc) (Hedged)							Anteilsklasse SGD J (Inc) (Hedged) Forts.						
US-Dollar	Singapur-Dollar	1.795	2.500	01-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	1	Singapur-Dollar	US-Dollar	1.500	1.078	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(2)
Singapur-Dollar	US-Dollar	1.000	717	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	-	Singapur-Dollar	US-Dollar	150.000	107.650	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(12)
Singapur-Dollar	US-Dollar	2.687	1.927	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	1	Singapur-Dollar	US-Dollar	49.675	35.700	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(54)
US-Dollar	Singapur-Dollar	5.103	7.101	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	7	Singapur-Dollar	US-Dollar	10.494	7.543	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(13)
US-Dollar	Singapur-Dollar	6.329	8.795	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	18	Singapur-Dollar	US-Dollar	200.975	145.385	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1.168)
US-Dollar	Singapur-Dollar	2.554	3.536	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	17	Singapur-Dollar	US-Dollar	1.984	1.429	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(5)
							Singapur-Dollar	US-Dollar	343.294	247.212	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(870)
						USD						USD	(2.124)
						SGD						SGD	(2.960)
Singapur-Dollar	US-Dollar	2.500	1.795	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1)						Netto USD	(1.984)
Singapur-Dollar	US-Dollar	4.959	3.564	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(5)						Netto SGD	(2.765)
Singapur-Dollar	US-Dollar	69.650	49.987	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(7)							
Singapur-Dollar	US-Dollar	2.272	1.633	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(3)							
Singapur-Dollar	US-Dollar	119.799	86.270	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(303)							
						USD						USD	252.976
						SGD						GBP	204.161
						Netto USD							
						Netto SGD							
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund							BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund						
Anteilsklasse SGD J (Inc) (Hedged)							Anteilsklasse Sterling E (Inc) (Hedged)						
Singapur-Dollar	US-Dollar	12.421	8.908	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	5	US-Dollar	Sterling	2.431.535	1.958.773	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	4.194
US-Dollar	Singapur-Dollar	8.637	12.019	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	13	US-Dollar	Sterling	2.557.036	2.057.411	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	7.461
US-Dollar	Singapur-Dollar	7.938	11.061	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	1	US-Dollar	Sterling	1	1	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Singapur-Dollar	1.361	1.897	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	-	US-Dollar	Sterling	8.735.533	6.937.501	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	138.477
US-Dollar	Singapur-Dollar	26.873	37.345	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	74	US-Dollar	Sterling	109.099	85.693	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	2.908
US-Dollar	Singapur-Dollar	7.318	10.132	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	47	US-Dollar	Sterling	3.530.977	2.768.721	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	99.936
						USD						USD	(3.160.991)
						SGD						GBP	(2.551.037)
												Netto USD	(2.908.015)
												Netto GBP	(2.346.876)

BNY MELLON GLOBAL LEADERS FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Nettovermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Nettovermögen %
Aktien				Aktien Forts.			
	Australien - 1.861.817				USA Forts.		
	(31. Dezember 2019: 3.678.378)	1.861.817	2,93	29.100	NIKE Inc	2.852.673	4,49
9.400	CSL Ltd	1.861.817	2,93	14.200	Texas Instruments Inc	1.802.619	2,84
	Dänemark - 1.836.780			44.000	TJX Cos Inc/The	2.224.420	3,50
	(31. Dezember 2019: 3.142.843)	1.836.780	2,89		Summe der Anlagen in Aktien	62.584.169	98,50
28.300	Novo Nordisk A/S	1.836.780	2,89		Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 222		
	Frankreich - 5.383.799				(siehe unten) 31. Dezember 2019: 15.537)	222	0,00
	(31. Dezember 2019: 8.792.785)	5.383.799	8,47		Summe der Vermögenswerte		
4.500	Air Liquide SA	648.653	1,02		zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert	62.584.391	98,50
7.100	L'Oreal SA	2.278.589	3,58		Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften - (14.845)		
5.600	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	2.456.557	3,87		(siehe unten) 31. Dezember 2019: (168))	(14.845)	(0,02)
	Deutschland - 2.374.642				Summe der finanziellen Verbindlichkeiten		
	(31. Dezember 2019: 2.963.511)	2.374.642	3,74		zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert	(14.845)	(0,02)
17.000	SAP SE	2.374.642	3,74		Nettoumlaufvermögen	968.354	1,52
	Hongkong - 2.603.660				Summe der Nettovermögen	63.537.900	100,00
	(31. Dezember 2019: 3.339.239)	2.603.660	4,10				
279.400	AIA Group Ltd	2.603.660	4,10		Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens	
	Japan - 5.939.440				An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten		
	(31. Dezember 2019: 7.153.219)	5.939.440	9,35		Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		98,36
13.200	FANUC Corp	2.356.073	3,71		OTC-Finanzderivate		0,00
8.600	Keyence Corp	3.583.367	5,64		Sonstiges Umlaufvermögen		1,64
	Niederlande - 1.983.119				Summe der Aktiva		100,00
	(31. Dezember 2019: -)	1.983.119	3,12				
5.400	ASML Holding NV	1.983.119	3,12				
	Spanien - 2.240.761						
	(31. Dezember 2019: 3.407.395)	2.240.761	3,53				
84.600	Industria de Diseno Textil SA	2.240.761	3,53				
	Schweiz - 1.836.498						
	(31. Dezember 2019: 3.342.072)	1.836.498	2,89				
5.300	Roche Holding AG	1.836.498	2,89				
	Taiwan - 3.371.841						
	(31. Dezember 2019: 4.381.117)	3.371.841	5,31				
59.400	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	3.371.841	5,31				
	Großbritannien - 663.137						
	(31. Dezember 2019: 2.110.633)	663.137	1,04				
7.200	Reckitt Benckiser Group Plc	663.137	1,04				
	USA - 32.488.675						
	(31. Dezember 2019: 40.723.592)	32.488.675	51,13				
6.600	Adobe Inc	2.872.122	4,52				
1.740	Alphabet Inc	2.460.447	3,87				
28.000	Amphenol Corp - A-Klasse	2.680.020	4,22				
9.300	Automatic Data Processing Inc	1.384.584	2,18				
37.700	Cognizant Technology Solutions Corp	2.140.983	3,37				
8.600	Colgate-Palmolive Co	629.950	0,99				
4.500	Ecolab Inc	894.893	1,41				
16.800	Edwards Lifesciences Corp	1.160.628	1,83				
35.800	EOG Resources Inc	1.813.091	2,85				
6.300	Illumina Inc	2.331.945	3,67				
4.300	Intuitive Surgical Inc	2.449.516	3,85				
9.600	Mastercard Inc	2.837.328	4,47				
9.600	Microsoft Corp	1.953.456	3,07				

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte							Nicht realisierter
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Gewinn/(Verlust)	realisierter
BNY Mellon Global Leaders Fund Anteilsklasse DKK H (Acc) (Hedged)							
Dänische Krone	US-Dollar	15.586	2.346	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	4	
US-Dollar	Dänische Krone	4.878	32.155	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	28	
					USD	32	
					DKK	212	
Dänische Krone	US-Dollar	721.660	109.952	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1.115)	
					USD	(1.115)	
					DKK	(7.395)	
					Netto USD	(1.083)	
					Netto DKK	(7.183)	
BNY Mellon Global Leaders Fund Anteilsklasse DKK W (Acc) (Hedged)							
Dänische Krone	US-Dollar	16.771	2.525	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	5	
US-Dollar	Dänische Krone	5.196	34.254	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	30	
					USD	35	
					DKK	232	
Dänische Krone	US-Dollar	770.499	117.393	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1.191)	
					USD	(1.191)	
					DKK	(7.899)	
					Netto USD	(1.156)	
					Netto DKK	(7.667)	
BNY Mellon Global Leaders Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)							
Euro	US-Dollar	2.338	2.624	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	3	
US-Dollar	Euro	5.452	4.821	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	34	
					USD	37	
					EUR	33	

Devisenterminkontrakte Forts.							Nicht realisierter
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Gewinn/(Verlust)	realisierter
BNY Mellon Global Leaders Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged) Forts.							
Euro	US-Dollar	108.620	123.395	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1.324)	
					USD	(1.324)	
					EUR	(1.178)	
					Netto USD	(1.287)	
					Netto EUR	(1.145)	
BNY Mellon Global Leaders Fund Anteilsklasse NOK H (Acc) (Hedged)							
US-Dollar	Norwegische Krone	4.498	43.058	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	24	
					USD	24	
					NOK	231	
Norwegische Krone	US-Dollar	20.498	2.141	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(12)	
Norwegische Krone	US-Dollar	943.632	101.840	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(3.798)	
					USD	(3.810)	
					NOK	(36.672)	
					Netto USD	(3.786)	
					Netto NOK	(36.441)	
BNY Mellon Global Leaders Fund Anteilsklasse NOK W (Acc) (Hedged)							
US-Dollar	Norwegische Krone	4.545	43.511	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	24	
					USD	24	
					NOK	231	
Norwegische Krone	US-Dollar	20.919	2.185	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(12)	
Norwegische Krone	US-Dollar	955.713	103.144	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(3.847)	
					USD	(3.859)	
					NOK	(37.144)	
					Netto USD	(3.835)	
					Netto NOK	(36.913)	

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte Forts.							Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent		
BNY Mellon Global Leaders Fund							
Anteilsklasse SEK H (Acc) (Hedged)							
Schwedische Krone	US-Dollar	22.753	2.427	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	16	
US-Dollar	Schwedische Krone	5.019	46.584	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	19	
							USD 35
							SEK 326
Schwedische Krone	US-Dollar	1.040.715	113.468	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1.762)	
							USD (1.762)
							SEK (16.419)
							Netto USD (1.727)
							Netto SEK (16.093)
BNY Mellon Global Leaders Fund							
Anteilsklasse SEK W (Acc) (Hedged)							
Schwedische Krone	US-Dollar	23.208	2.475	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	16	
US-Dollar	Schwedische Krone	5.068	47.045	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	19	
							USD 35
							SEK 326
Schwedische Krone	US-Dollar	1.053.407	114.851	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1.784)	
							USD (1.784)
							SEK (16.624)
							Netto USD (1.749)
							Netto SEK (16.298)

BNY MELLON GLOBAL MULTI-ASSET INCOME FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in EUR	Summe der Netto- vermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in EUR	Summe der Netto- vermögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen				Anleihen Forts.			
Niederlande - 85.269 (31. Dezember 2019: 110.045)				Deutschland Forts.			
18.638	Volta Finance Ltd	85.269	0,41	100.000	Infineon Technologies AG FRN (Immerwährend) 3,625 % 01-Jan.-2028	99.507	0,48
Norwegen - 76.453 (31. Dezember 2019: 85.666)				Indonesien - 94.315 (31. Dezember 2019: 97.746)			
76.073	Aquila European Renewables Income Fund Plc/ The Fund	76.453	0,37	1.450.000.000	Indonesia Treasury Bond 8,250 % 15-Mai-2036	94.315	0,46
Großbritannien - 1.665.879 (31. Dezember 2019: 5.649.234)				Italien - 147.500 (31. Dezember 2019: -)			
148.211	Blackstone/GSO Loan Financing Ltd	99.301	0,48	200.000	UniCredit SpA 'EMTN' FRN (Immerwährend) 3,875 % 03-Jun.-2027	147.500	0,72
391.341	GCP Infrastructure Investments Ltd	481.523	2,34	Luxemburg - 111.940 (31. Dezember 2019: -)			
286.614	Gresham House Energy Storage Fund Plc/The Fund	341.995	1,66	116.000	Summer BC Holdco B SARL 'REGS' 5,750 % 31-Okt.-2026	111.940	0,54
48.575	Octopus Renewables Infrastructure Trust Plc	58.971	0,28	Mexiko - 577.394 (31. Dezember 2019: 453.959)			
359.180	Tufton Oceanic Assets Ltd/The Fund	293.201	1,42	200.000	Cemex SAB de CV 'REGS' 6,125 % 05-Mai-2025	173.280	0,84
103.139	US Solar Fund Plc/Fund	86.494	0,42	8.868.200	Mexican Bonos 8,500 % 31-Mai-2029	404.114	1,96
414.399	VPC Specialty Lending Investments Plc/Fund	304.394	1,48	Niederlande - 183.022 (31. Dezember 2019: -)			
Summe der Anlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen				200.000	ING Groep NV FRN (Immerwährend) 6,750 % 16-Apr.-2024 183.022	183.022	0,89
Anleihen				Peru - 202.071 (31. Dezember 2019: 210.649)			
Argentinien - 56.824 (31. Dezember 2019: 72.866)				316.000	Peruvian Government International Bond 'REGS' 5,700 % 12-Aug.-2024	92.193	0,45
150.000	Argentine Republic Government International Bond 6,875 % 22-Apr.-2021	56.824	0,28	370.000	Peruvian Government International Bond 'REGS' 6,350 % 12-Aug.-2028	109.878	0,53
Australien - 317.096 (31. Dezember 2019: 380.247)				Schweden - 92.516 (31. Dezember 2019: -)			
212.000	Australia Government Bond 3,250 % 21-Apr.-2029	156.525	0,76	100.000	Akelius Residential Property AB FRN 2,249 % 17-Mai-2081	92.516	0,45
229.800	New South Wales Treasury Corp 3,000 % 20-März-2028	160.571	0,78	Schweiz - 101.939 (31. Dezember 2019: 105.250)			
Brasilien - 285.526 (31. Dezember 2019: 126.341)				100.000	UBS AG 'EMTN' FRN 4,750 % 12-Feb.-2026	101.939	0,49
226.000	CSN Islands XI Corp 'REGS' 6,750 % 28-Jan.-2028	170.372	0,83	Großbritannien - 372.569 (31. Dezember 2019: 538.814)			
73.000	Petrobras Global Finance BV 6,875 % 20-Jan.-2040	69.314	0,33	100.000	B&M European Value Retail SA 'REGS' 4,125 % 01-Feb.-2022	109.675	0,53
46.000	Petrobras Global Finance BV 7,375 % 17-Jan.-2027	45.840	0,22	53.000	BUPA Finance Plc FRN (Immerwährend) 6,125 % 16-Sept.-2020	58.038	0,28
China - 154.916 (31. Dezember 2019: 87.960)				48.189	Tesco Property Finance 3 Plc 5,744 % 13-Apr.-2040	71.365	0,35
175.000	Trip.com Group Ltd 1,000 % 01-Jul.-2020	154.916	0,75	117.000	Vodafone Group Plc FRN 4,875 % 03-Okt.-2078	133.491	0,65
Kolumbien - 164.711 (31. Dezember 2019: 181.152)				USA - 1.306.073 (31. Dezember 2019: 1.569.851)			
609.200.000	Colombia Government International Bond 'REGS' 7,500 % 26-Aug.-2026	164.711	0,80	116.000	American Airlines Inc '144A' 11,750 % 15-Jul.-2025	98.831	0,48
Ecuador - 75.609 (31. Dezember 2019: 163.947)				81.000	Best Buy Co Inc 5,500 % 15-März-2021	73.857	0,36
200.000	Ecuador Government International Bond 'REGS' 8,875 % 23-Okt.-2027	75.609	0,37	74.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5,500 % 01-Mai-2026	68.566	0,33
Frankreich - 100.806 (31. Dezember 2019: 107.959)				86.000	Citigroup Inc 5,500 % 13-Sept.-2025	90.970	0,44
101.000	Societe Generale SA FRN (Immerwährend) 6,750 % 07-Apr.-2021	100.806	0,49	125.000	Redwood Trust Inc 4,750 % 15-Aug.-2023	100.659	0,49
Deutschland - 197.431 (31. Dezember 2019: 208.296)				71.000	Sprint Capital Corp 8,750 % 15-März-2032	90.494	0,44
100.000	Infineon Technologies AG 'EMTN' FRN (Immerwährend) 2,875 % 01-Jan.-2025	97.924	0,48	68.000	T-Mobile USA Inc 6,000 % 01-März-2023	61.094	0,30

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener	Summe			Angemessener	Summe
		Wert	der Netto-			Wert	der Netto-
Bestände	Beschreibung	in EUR	vermögen %	Bestände	Beschreibung	in EUR	vermögen %
Anleihen Forts.							
USA Forts.							
410.900	United States Treasury Inflation Indexed Bonds						
	0,750 % 15-Jul.-2028	414.029	2,01	58.969	Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV	79.249	0,38
299.442	United States Treasury Inflation Indexed Bonds			85.500	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	182.872	0,89
	2,375 % 15-Jan.-2025	307.573	1,49				
Summe der Anlagen in Anleihen		4.542.258	22,05				
Aktien							
Australien - 289.392							
(31. Dezember 2019: 357.687)		289.392	1,40				
27.651	Insurance Australia Group Ltd	97.402	0,47				
110.832	Star Entertainment Grp Ltd/The	191.990	0,93				
Brasilien - 48.128							
(31. Dezember 2019: 139.396)		48.128	0,23				
20.092	Ambev SA ADR	48.128	0,23				
Kanada - 73.063							
(31. Dezember 2019: 140.948)		73.063	0,36				
4.827	Suncor Energy Inc	73.063	0,36				
China - 982.718							
(31. Dezember 2019: 442.871)		982.718	4,77				
494.000	China Harmony New Energy Auto Holding Ltd	218.081	1,06				
7.005	Hollysys Automation Technologies Ltd	82.586	0,40				
250.241	Jiangsu Expressway Co Ltd 'H'	261.703	1,27				
200.000	Man Wah Holdings Ltd	170.713	0,83				
28.000	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	249.635	1,21				
Georgien - 189.511							
(31. Dezember 2019: 328.214)		189.511	0,92				
6.453	Bank of Georgia Group Plc	75.586	0,37				
11.667	TBC Bank Group Plc	113.925	0,55				
Deutschland - 1.097.111							
(31. Dezember 2019: 834.593)		1.097.111	5,32				
3.241	Bayer AG	214.392	1,04				
2.935	Brenntag AG	137.607	0,67				
1.680	Continental AG	146.798	0,71				
1.531	HeidelbergCement AG	72.899	0,35				
2.345	Hella GmbH & Co KGaA	86.413	0,42				
109.697	Telefonica Deutschland Holding AG	289.984	1,41				
1.110	Volkswagen AG - Preference	149.018	0,72				
Hongkong - 690.320							
(31. Dezember 2019: 910.499)		690.320	3,35				
48.600	AIA Group Ltd	404.063	1,96				
8.500	Link REIT (Units) (REIT)	61.961	0,30				
82.804	Samsonite International SA '144A'	74.396	0,36				
42.800	Sands China Ltd	149.900	0,73				
Irland - 588.689							
(31. Dezember 2019: 614.900)		588.689	2,86				
5.209	CRH Plc	158.797	0,77				
356.757	Greencoat Renewables Plc	429.892	2,09				
Japan - 188.437							
(31. Dezember 2019: 235.789)		188.437	0,91				
4.100	Ebara Corp	85.656	0,41				
6.200	Japan Tobacco Inc	102.781	0,50				
Aktien Forts.							
Mexiko - 262.121							
(31. Dezember 2019: 338.253)						262.121	1,27
58.969	Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV					79.249	0,38
85.500	Wal-Mart de Mexico SAB de CV					182.872	0,89
Neuseeland - 330.071							
(31. Dezember 2019: 419.035)						330.071	1,60
154.716	SKYCITY Entertainment Group Ltd					217.890	1,06
43.107	Spark New Zealand Ltd					112.181	0,54
Norwegen - 122.719							
(31. Dezember 2019: 171.264)						122.719	0,60
7.401	Mowi ASA					122.719	0,60
Republik Korea - 399.596							
(31. Dezember 2019: 361.386)						399.596	1,94
5.893	Samsung Electronics Co Ltd - Preference					203.459	0,99
727	Samsung SDI Co Ltd					196.137	0,95
Singapur - 100.551							
(31. Dezember 2019: 112.684)						100.551	0,49
59.300	Mapletree North Asia Commercial Trust (Units) (REIT)					35.118	0,17
30.500	Parkway Life Real Estate Investment Trust (Units) (REIT)					65.433	0,32
Südafrika - 129.454							
(31. Dezember 2019: -)						129.454	0,63
6.366	Anglo American Plc					129.454	0,63
Schweiz - 501.212							
(31. Dezember 2019: 567.272)						501.212	2,43
8.906	ABB Ltd					178.166	0,86
1.762	Novartis AG					136.573	0,66
597	Zurich Insurance Group AG					186.473	0,91
Taiwan - 217.853							
(31. Dezember 2019: 226.367)						217.853	1,06
23.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd					217.853	1,06
Thailand - 89.752							
(31. Dezember 2019: -)						89.752	0,44
33.300	Kasikornbank PCL (Foreign Market)					89.752	0,44
Großbritannien - 2.679.250							
(31. Dezember 2019: 3.673.921)						2.679.250	13,00
30.641	Ascential Plc '144A'					97.475	0,47
57.190	B&M European Value Retail SA					246.667	1,20
35.450	BAE Systems Plc					189.359	0,92
53.838	Barclays Plc					67.583	0,33
7.375	British American Tobacco Plc					252.738	1,22
222.994	Civitas Social Housing Plc (REIT)					268.523	1,30
4.055	Diageo Plc					119.709	0,58
187.989	Doric Nimrod Air Three Ltd - Preference					72.027	0,35
166.420	Doric Nimrod Air Two Ltd - Preference					114.773	0,56
106.690	EJF Investments Ltd					116.794	0,57
3.704	Ferguson Plc					268.264	1,30
8.289	Imperial Brands Plc					141.282	0,68
53.568	Informa Plc					275.906	1,34
288.220	Lloyds Banking Group Plc					98.314	0,48
13.092	Prudential Plc					175.207	0,85
77.287	Royal Bank of Scotland Group Plc					102.860	0,50
5.271	Royal Dutch Shell Plc					71.769	0,35

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

				Devisenterminkontrakte						Nicht
		Angemessener	Summe							realisierter
Bestände	Beschreibung	Wert in EUR	der Netto- vermögen %	Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Gewinn/(Verlust)
Aktien Forts.				BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund						
	USA - 1.444.913			Euro	US-Dollar	4.461	5.000	01-Jul.-20	Barclays Bank PLC	-
	(31. Dezember 2019: 1.846.579)	1.444.913	7,01	Euro	Japanischer Yen	70.328	8.299.000	15-Jul.-20	State Street Bank	1.617
2.695	Albemarle Corp	183.581	0,89	Euro	Sterling	72.359	64.817	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	1.418
1.253	Apple Inc	404.628	1,96							
3.811	Applied Materials Inc	200.818	0,98	Euro	Sterling	5.377.830	4.730.618	15-Jul.-20	State Street Bank	200.294
3.255	Citigroup Inc	146.081	0,71	Euro	Sterling	30.016	27.143	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	309
17.442	General Electric Co	105.735	0,51	Euro	US-Dollar	4.491.209	4.864.661	15-Jul.-20	State Street Bank	152.527
1.502	Las Vegas Sands Corp	59.851	0,29							
1.173	Microsoft Corp	207.690	1,01							
22.163	Redwood Trust Inc (REIT)	136.529	0,66							
Summe der Anlagen in Aktien		10.424.861	50,59						EUR	356.165
Instrumente für Aktienanlagen										
	Großbritannien - 3.241.635			Euro	Sterling	127.285	116.334	01-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(66)
	(31. Dezember 2019: -)	3.241.635	15,74	Euro	Australischer Dollar	293.001	523.318	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(26.687)
214.827	BBGI SICAV SA/Fund	384.505	1,87	Euro	US-Dollar	101.979	114.840	15-Jul.-20	Barclays Bank PLC	(444)
279.697	Greencoat UK Wind Plc/Funds	438.763	2,13	Sterling	Euro	1.013	1.156	15-Jul.-20	State Street Bank	(47)
438.121	Hipgnosis Songs Fund Ltd/The Fund	556.349	2,70	Sterling	Euro	19.913	22.768	15-Jul.-20	Barclays Bank PLC	(973)
206.810	International Public Partnerships Ltd	381.476	1,85	Sterling	Euro	18.772	21.481	15-Jul.-20	State Street Bank	(936)
419.746	JLEN Environmental Assets Group Ltd	544.503	2,64	Sterling	Euro	1.918	2.194	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(94)
97.624	NextEnergy Solar Fund Ltd	114.991	0,56	Sterling	Euro	5.291	6.048	15-Jul.-20	State Street Bank	(257)
409.173	Renewables Infrastructure Group Ltd/The	566.173	2,75	Sterling	Euro	5.989	6.840	15-Jul.-20	State Street Bank	(285)
219.647	Sdcl Energy Efficiency Income Trust Plc	254.875	1,24	Sterling	Euro	4.148	4.743	15-Jul.-20	Barclays Bank PLC	(204)
Summe der Anlagen in Instrumente für Aktienanlagen		3.241.635	15,74	Sterling	Euro	1.472	1.687	15-Jul.-20	HSBC Bank plc	(76)
Preferred Bonds				Sterling	Euro	1.372	1.568	15-Jul.-20	Royal Bank of Scotland	(67)
	Großbritannien - 28.547			Sterling	Euro	4.206	4.781	15-Jul.-20	State Street Bank	(178)
	(31. Dezember 2019: 31.753)	28.547	0,14	Sterling	Euro	7.894	8.826	15-Jul.-20	Royal Bank of Scotland	(186)
26.077	Balfour Beatty Plc - Preferred Stock								EUR	(30.500)
	9,675 % 01-Jul.-2020	28.547	0,14						Netto EUR	325.665
Summer der Anlagen in Preferred Bonds		28.547	0,14							
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 356.165 (siehe unten) 31. Dezember 2019: 63.698)										
		356.165	1,73							
Summe der Vermögenswerte zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert		20.421.067	99,11							
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften - (30.500) (siehe unten) 31. Dezember 2019: (243.325))										
		(30.500)	(0,15)							
Summe der finanziellen Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert		(30.500)	(0,15)							
Nettoumlaufvermögen		214.895	1,04							
Summe der Nettovermögen		20.605.462	100,00							
Portfolioanalyse				% des Gesamtvermögens						
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten										
Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente				96,58						
OTC-Finanzderivate				1,71						
Sonstiges Umlaufvermögen				1,71						
Summe der Aktiva			100,00							

BNY MELLON GLOBAL OPPORTUNITIES FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Nettovermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Nettovermögen %
Anleihen				Aktien Forts.			
	USA - 1.274.657 (31. Dezember 2019: 1.820.030)	1.274.657	3,78		Schweiz - 2.322.722 (31. Dezember 2019: 3.292.312)	2.322.722	6,89
1.275.000	United States Treasury Bill (Null-Coupon)			1.284	Lonza Group AG	671.076	1,99
	0,000 % 17-Sept.-2020	1.274.657	3,78	10.349	Novartis AG	899.134	2,67
				2.174	Roche Holding AG	752.512	2,23
Summe der Anlagen in Anleihen				Thailand - 332.020 (31. Dezember 2019: -)			
		1.274.657	3,78	109.900	Kasikornbank PCL (Foreign Market)	332.020	0,98
Aktien				Großbritannien - 2.865.057 (31. Dezember 2019: 5.489.983)			
	Kanada - 670.374 (31. Dezember 2019: 1.236.055)	670.374	1,99	24.100	Associated British Foods Plc	565.933	1,68
7.154	Intact Financial Corp	670.374	1,99	25.625	Diageo Plc	847.944	2,52
				9.898	Ferguson Plc	803.536	2,38
	China - 1.177.752 (31. Dezember 2019: -)	1.177.752	3,49	81.792	Informa Plc	472.208	1,40
3.642	Alibaba Group Holding Ltd ADR	783.012	2,32	49.489	Rolls-Royce Holdings Plc	175.436	0,52
39.500	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	394.740	1,17				
					USA - 13.344.938 (31. Dezember 2019: 19.194.909)	13.344.938	39,58
	Frankreich - 945.122 (31. Dezember 2019: 1.461.988)	945.122	2,80	4.558	Accenture Plc - A-Klasse	969.806	2,88
36.668	Vivendi SA	945.122	2,80	1.121	Alphabet Inc - A-Klasse	1.566.693	4,65
				15.567	Altria Group Inc	610.849	1,81
	Deutschland - 3.327.229 (31. Dezember 2019: 3.634.641)	3.327.229	9,87	4.792	Apple Inc	1.734.560	5,14
12.438	Bayer AG	922.248	2,73	12.311	Applied Materials Inc	727.149	2,16
13.580	Brenntag AG	713.676	2,12	22.547	Cisco Systems Inc	1.040.882	3,09
7.301	Continental AG	715.091	2,12	15.605	Citigroup Inc	785.010	2,33
7.068	SAP SE	976.214	2,90	1.445	Costco Wholesale Corp	435.819	1,29
				7.242	Eversource Energy	601.846	1,79
	Hongkong - 939.379 (31. Dezember 2019: 1.351.377)	939.379	2,79	1.998	Gilead Sciences Inc	149.021	0,44
100.800	AIA Group Ltd	939.379	2,79	3.785	Goldman Sachs Group Inc/The	732.719	2,17
				3.678	Mastercard Inc	1.078.187	3,20
	Japan - 1.661.932 (31. Dezember 2019: 3.014.799)	1.661.932	4,93	9.835	Medtronic Plc	887.855	2,63
19.600	Ebara Corp	458.983	1,36	10.201	Microsoft Corp	2.024.542	6,00
11.000	Japan Tobacco Inc	204.400	0,61				
8.300	Suntory Beverage & Food Ltd	323.364	0,96		Summe der Anlagen in Aktien	32.141.121	95,32
19.900	Suzuki Motor Corp	675.185	2,00		Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 22.330 (siehe unten) 31. Dezember 2019: 6.918)	22.330	0,07
	Niederlande - 3.105.907 (31. Dezember 2019: 4.629.652)	3.105.907	9,21		Summe der Vermögenswerte zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert	33.438.108	99,17
38.684	Relx Plc	889.333	2,64		Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften - (6.469) (siehe unten) 31. Dezember 2019: (15.236))	(6.469)	(0,02)
33.405	Royal Dutch Shell Plc	543.832	1,61				
16.782	Unilever NV	895.496	2,66		Summe der finanziellen Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert	(6.469)	(0,02)
10.048	Wolters Kluwer NV	777.246	2,30		Nettoumlaufvermögen	287.972	0,85
	Norwegen - 135.315 (31. Dezember 2019: 1.063.466)	135.315	0,40		Summe der Nettovermögen	33.719.611	100,00
10.174	DNB ASA	135.315	0,40				
	Republik Korea - 732.429 (31. Dezember 2019: 835.608)	732.429	2,17				
2.422	Samsung SDI Co Ltd	732.429	2,17				
	Schweden - 580.945 (31. Dezember 2019: 813.816)	580.945	1,72				
45.267	Swedbank AB	580.945	1,72				
				Portfolioanalyse % des Gesamtvermögens			
				An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			
				OTC-Finanzderivate			
				Sonstiges Umlaufvermögen			
				Summe der Aktiva			
				100,00			

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte						
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Global Opportunities Fund						
US-Dollar	Euro	2.695	2.404	01-Jul.-20	Barclays Bank PLC	-
US-Dollar	Euro	1.533.524	1.346.040	15-Sept.-20	Canadian Imperial Bank	22.206
USD						22.206
BNY Mellon Global Opportunities Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged)						
US-Dollar	Euro	402	357	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	2
US-Dollar	Euro	20.084	17.836	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	86
US-Dollar	Euro	12.233	10.884	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	29
USD						117
EUR						104
Euro	US-Dollar	1.521	1.713	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(7)
Euro	US-Dollar	11.803	13.249	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(16)
Euro	US-Dollar	219	249	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(4)
Euro	US-Dollar	414.187	470.491	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(6.092)
Euro	US-Dollar	447	505	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(4)
USD						(6.123)
EUR						(5.463)
Netto USD						(6.006)
Netto EUR						(5.359)
BNY Mellon Global Opportunities Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged)						
US-Dollar	Euro	1.133	1.006	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	5
US-Dollar	Euro	681	606	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	2
USD						7
EUR						6
Euro	US-Dollar	670	752	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1)
Euro	US-Dollar	23.421	26.605	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(345)
USD						(346)
EUR						(309)
Netto USD						(339)
Netto EUR						(303)

BNY MELLON GLOBAL REAL RETURN FUND (EUR)

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in EUR	Summe der Netto- vermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in EUR	Summe der Netto- vermögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen				Anleihen Forts.			
Irland - 488.316.694 (31. Dezember 2019: 485.246.460)				Griechenland - 65.011.250 (31. Dezember 2019: 140.380.980)			
2.130.036	Amundi Physical Gold ETC	134.303.893	4,85	15.000.000	Hellenic Republic Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 07-Aug.-2020	14.996.250	0,54
470.916	Invesco Physical Gold ETC	72.090.966	2,60	50.000.000	Hellenic Republic Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 28-Aug.-2020	50.015.000	1,81
11.819	iShares EUR Corp Bond 1-5yr UCITS ETF - ETF	1.299.558	0,05	Ungarn - 18.573.785 (31. Dezember 2019: 65.344.287)			
15.678	iShares EUR High Yield Corp Bond UCITS ETF - ETF	1.522.961	0,06	6.141.210.000	Hungary Government Bond 3,000 % 21-Aug.-2030	18.573.785	0,67
5.459.336	iShares Physical Gold ETC	168.543.282	6,08	Indien - 4.270.799 (31. Dezember 2019: 4.740.075)			
967.841	iShares USD Corp Bond UCITS ETF - ETF	110.556.034	3,99	360.000.000	National Highways Authority of India 7,300 % 18-Mai-2022	4.270.799	0,15
Jersey - 16.502.823 (31. Dezember 2019: 13.547.168)				Indonesien - 3.876.670 (31. Dezember 2019: 4.701.634)			
89.089	WisdomTree Physical Swiss Gold ETC	13.579.524	0,49	59.600.000.000	Indonesia Treasury Bond 8,250 % 15-Mai-2036	3.876.670	0,14
19.043	Xtrackers Physical Gold ETC	2.923.299	0,11	Irland - 12.382.671 (31. Dezember 2019: 14.036.769)			
Großbritannien - 3.881.593 (31. Dezember 2019: 80.693.662)				8.175.000	AIB Group Plc FRN (Immerwährend) 5,250 % 09-Okt.-2024 7.678.369	12.382.671	0,45
6.128.002	Riverstone Credit Opportunities Income Plc/The Fund	3.881.593	0,14	4.685.000	Allied Irish Banks Plc 'EMTN' FRN 4,125 % 26-Nov.-2025	4.704.302	0,17
Summe der Anlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen 508.701.110 18,36				Italien - 22.634.625 (31. Dezember 2019: 17.713.102)			
Anleihen				11.036.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' FRN (Immerwährend) 7,700 % 17-Sept.-2025	9.825.191	0,35
Australien - 111.667.693 (31. Dezember 2019: 133.357.731)				9.962.000	UniCredit SpA 'EMTN' FRN (Immerwährend) 3,875 % 03-Jun.-2027	7.346.975	0,27
37.994.000	Australia Government Bond 3,000 % 21-März-2047	29.572.383	1,07	6.100.000	UniCredit SpA FRN (Immerwährend) 8,000 % 03-Jun.-2024 5.462.459	0,20	
48.270.000	Australia Government Bond 3,250 % 21-Jun.-2039	37.945.365	1,37	Jersey - 4.562.952 (31. Dezember 2019: 5.194.143)			
8.186.000	Australia Government Bond 3,750 % 21-Apr.-2037	6.790.957	0,24	4.325.000	CPUK Finance Ltd 'REGS' 4,250 % 28-Aug.-2022	4.562.952	0,16
34.148.000	New South Wales Treasury Corp 2,750 % 20-Nov.-2025	31.556.110	1,14	Luxemburg - 17.417.619 (31. Dezember 2019: 19.369.085)			
4.398.000	Treasury Corp of Victoria 4,250 % 20-Dez.-2032	3.519.328	0,13	11.242.000	SELP Finance Sarl 1,250 % 25-Okt.-2023	11.338.119	0,41
2.890.000	Treasury Corp of Victoria 5,500 % 17-Nov.-2026	2.283.550	0,08	6.300.000	Summer BC Holdco B SARL 'REGS' 5,750 % 31-Okt.-2026	6.079.500	0,22
Chile - 553.500 (31. Dezember 2019: -)				Mexiko - 26.692.282 (31. Dezember 2019: 49.264.006)			
609.000	VTR Comunicaciones SpA 'REGS' 5,125 % 15-Jan.-2028	553.500	0,02	183.791.200	Mexican Bonos 7,500 % 03-Jun.-2027	7.883.222	0,28
Ecuador - 3.546.432 (31. Dezember 2019: 8.958.062)				245.393.200	Mexican Bonos 7,750 % 29-Mai-2031	10.674.081	0,39
9.381.000	Ecuador Government International Bond 'REGS' 8,875 % 23-Okt.-2027	3.546.432	0,13	175.610.500	Mexican Bonos 10,000 % 05-Dez.-2024	8.134.979	0,29
Frankreich - 37.097.821 (31. Dezember 2019: 39.957.370)				Niederlande - 19.600.768 (31. Dezember 2019: 21.050.287)			
2.192.000	Altice France SA/France 'REGS' 3,375 % 15-Jan.-2028	2.098.840	0,08	15.841.000	ING Groep NV FRN (Immerwährend) 4,875 % 16-Mai-2029 13.320.123	19.600.768	0,71
1.987.000	Banijay Entertainment SASU 'REGS' 3,500 % 01-März-2025	1.904.857	0,07	4.086.000	ING Groep NV FRN (Immerwährend) 6,750 % 16-Apr.-2024 3.739.145	0,14	
3.389.000	BNP Paribas SA FRN (Immerwährend) 6,125 % 17-Jun.-2022 3.473.725	0,12		2.600.000	Telefonica Europe BV FRN (Immerwährend) 3,000 % 04-Sept.-2023	2.541.500	0,09
10.323.000	BNP Paribas SA 'REGS' FRN (Immerwährend) 7,375 % 19-Aug.-2025	10.090.865	0,36	Neuseeland - 20.558.322 (31. Dezember 2019: 49.974.911)			
8.559.000	Societe Generale SA '144A' FRN (Immerwährend) 8,000 % 29-Sept.-2025	8.517.624	0,31	10.290.000	New Zealand Government Bond 2,750 % 15-Apr.-2037	7.227.609	0,26
11.780.000	Societe Generale SA 'REGS' FRN (Immerwährend) 7,875 % 18-Dez.-2023	11.011.910	0,40	15.620.000	New Zealand Government Inflation Linked Bond 2,500 % 20-Sept.-2040	13.330.713	0,48
Deutschland - 12.441.319 (31. Dezember 2019: 20.175.294)							
6.100.000	Infineon Technologies AG 'EMTN' FRN (Immerwährend) 2,875 % 01-Jan.-2025	5.973.364	0,22				
6.500.000	Infineon Technologies AG FRN (Immerwährend) 3,625 % 01-Jan.-2028	6.467.955	0,23				

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in EUR	Summe der Nettovermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in EUR	Summe der Nettovermögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
	Norwegen - 7.610.036 (31. Dezember 2019: 8.252.301)	7.610.036	0,27		USA - 76.131.093 (31. Dezember 2019: 248.430.550)	76.131.093	2,75
8.671.000	DNB Bank ASA FRN (Immerwährend)			6.245.000	American Airlines Inc '144A' 11,750 % 15-Jul.-2025	5.320.698	0,19
	4,875 % 12-Nov.-2024	7.610.036	0,27	7.298.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings		
					Capital Corp '144A' 5,500 % 01-Mai-2026	6.762.120	0,25
	Philippinen - 6.900.422 (31. Dezember 2019: -)	6.900.422	0,25	3.765.000	CEMEX Finance LLC 'REGS' 6,000 % 01-Apr.-2024	3.343.152	0,12
7.360.000	Philippine Government International Bond			18.735.000	Equinix Inc 2,875 % 01-Feb.-2026	19.203.937	0,69
	2,457 % 05-Mai-2030	6.900.422	0,25	4.781.000	General Motors Co 5,400 % 02-Okt.-2023	4.621.291	0,17
				3.266.000	Laureate Education Inc '144A'		
	Portugal - 15.773.140 (31. Dezember 2019: 102.827.870)	15.773.140	0,57		8,250 % 01-Mai-2025	3.034.400	0,11
12.944.507	Portugal Obrigaçoes do Tesouro OT '144A'			2.343.000	Refinitiv US Holdings Inc 'REGS' 6,875 % 15-Nov.-2026	2.509.095	0,09
	5,650 % 15-Feb.-2024	15.773.140	0,57	5.512.000	Sprint Capital Corp 8,750 % 15-März-2032	7.025.348	0,25
				4.493.000	Sprint Corp 7,125 % 15-Jun.-2024	4.504.621	0,16
	Qatar - 7.827.212 (31. Dezember 2019: -)	7.827.212	0,28	6.558.000	T-Mobile USA Inc 6,000 % 01-März-2023	5.891.956	0,21
8.051.000	Qatar Government International Bond 'REGS'			8.093.000	T-Mobile USA Inc 6,000 % 15-Apr.-2024	7.362.212	0,27
	3,400 % 16-Apr.-2025	7.827.212	0,28	6.601.000	T-Mobile USA Inc '144A' 3,875 % 15-Apr.-2030	6.552.263	0,24
	Spanien - 31.606.399 (31. Dezember 2019: 139.183.933)	31.606.399	1,14	Summe der Anlagen in Anleihen			
6.600.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN					624.486.921	22,54
	(Immerwährend) 5,875 % 24-Sept.-2023	6.454.272	0,23	Aktien			
8.600.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN				Australien - 7.425.050 (31. Dezember 2019: 9.876.814)	7.425.050	0,27
	(Immerwährend) 6,000 % 29-März-2024	8.519.246	0,31	385.281	Newcrest Mining Ltd	7.425.050	0,27
8.400.000	Banco Santander SA FRN (Immerwährend)						
	4,750 % 19-März-2025	7.602.000	0,27		Kanada - 25.319.280 (31. Dezember 2019: 50.262.574)	25.319.280	0,91
5.200.000	Banco Santander SA FRN (Immerwährend)			365.537	Barrick Gold Corp	8.526.146	0,31
	5,250 % 29-Sept.-2023	4.914.000	0,18	156.005	Intact Financial Corp	13.041.854	0,47
4.037.000	Spain Government Bond '144A' 0,250 % 30-Jul.-2024	4.116.881	0,15	99.304	Wheaton Precious Metals Corp	3.751.280	0,13
	Vereinigte Arabische Emirate - 8.470.865 (31. Dezember 2019: -)	8.470.865	0,31		Cayman-Inseln - 51.923.673 (31. Dezember 2019: -)	51.923.673	1,87
9.000.000	Abu Dhabi Government International Bond 'REGS'			94.977	Alibaba Group Holding Ltd ADR	18.217.114	0,66
	2,500 % 16-Apr.-2025	8.470.865	0,31	109.867	New Oriental Education & Technology Group Inc ADR	12.867.141	0,46
				258.378	Tencent Holdings Ltd	14.826.757	0,53
				508.457	Tencent Music Entertainment Group ADR	6.012.661	0,22
	Großbritannien - 89.279.246 (31. Dezember 2019: 89.177.650)	89.279.246	3,22		China - 7.805.541 (31. Dezember 2019: -)	7.805.541	0,28
689.000	Anglian Water Services Financing Plc			875.500	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	7.805.541	0,28
	3,666 % 30-Jul.-2024	1.495.645	0,05				
853.000	Anglian Water Services Financing Plc 'EMTN'				Dänemark - 19.712.701 (31. Dezember 2019: 21.493.565)	19.712.701	0,71
	4,125 % 28-Jul.-2020	1.643.261	0,06	191.560	Orsted A/S '144A'	19.712.701	0,71
2.381.000	British Telecommunications Plc 'EMTN'						
	3,500 % 25-Apr.-2025	5.401.479	0,20		Frankreich - 85.293.257 (31. Dezember 2019: 67.494.682)	85.293.257	3,08
3.491.280	DWR Cymru Financing UK Plc 'EMTN'			48.940	L'Oréal SA	14.004.181	0,50
	1,859 % 31-März-2048	7.359.005	0,27	32.740	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	12.832.443	0,46
1.680.779	High Speed Rail Finance 1 Plc 'EMTN'			90.998	Sanofi	8.232.589	0,30
	1,566 % 01-Nov.-2038	2.678.434	0,10	201.264	Thales SA	14.631.893	0,53
20.000.000	Lloyds Banking Group Plc FRN (Immerwährend)			362.713	TOTAL SA	12.355.818	0,45
	4,947 % 27-Jun.-2025	19.518.200	0,70	1.010.495	Vivendi SA	23.236.333	0,84
3.615.550	Network Rail Infrastructure Finance Plc						
	1,750 % 22-Nov.-2027	5.388.505	0,19		Deutschland - 165.288.276 (31. Dezember 2019: 156.875.452)	165.288.276	5,97
4.390.000	Royal Bank of Scotland Group Plc FRN			570.147	Bayer AG	37.715.224	1,36
	(Immerwährend) 6,000 % 29-Dez.-2025	3.963.490	0,14	139.313	Continental AG	12.173.170	0,44
5.840.000	Tesco Plc 'EMTN' 3,322 % 05-Nov.-2025	12.934.423	0,47	1.020.096	Deutsche Wohnen SE	40.752.835	1,47
290.000	Tesco Plc 'EMTN' 6,125 % 24-Feb.-2022	343.227	0,01	331.199	LEG Immobilien AG	37.998.461	1,37
7.498.205	Tesco Property Finance 3 Plc			297.424	SAP SE	36.648.586	1,33
	5,744 % 13-Apr.-2040	11.104.420	0,40				
2.524.000	Vodafone Group Plc FRN 4,875 % 03-Okt.-2078	2.879.762	0,10				
14.063.000	Vodafone Group Plc FRN 7,000 % 04-Apr.-2079	14.569.395	0,53				

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in EUR	Summe der Netto- vermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in EUR	Summe der Netto- vermögen %
Aktien Forts.				Aktien Forts.			
	Guernsey - 4.115.044 (31. Dezember 2019: 10.328.980)	4.115.044	0,15		USA - 269.069.334 (31. Dezember 2019: 242.224.800)	269.069.334	9,71
11.056.054	Amedeo Air Four Plus Ltd	4.115.044	0,15	184.567	Abbott Laboratories	14.657.990	0,53
	Hongkong - 49.520.854 (31. Dezember 2019: 69.992.286)	49.520.854	1,79	10.714	Alphabet Inc - A-Klasse	13.358.652	0,48
4.075.600	AIA Group Ltd	33.884.772	1,22	6.629	Amazon.com Inc	15.858.312	0,57
2.145.000	Link REIT (Units) (REIT)	15.636.082	0,57	54.073	Apple Inc	17.461.671	0,63
	Indien - 8.040.392 (31. Dezember 2019: 21.447.819)	8.040.392	0,29	148.872	CMS Energy Corp	7.644.808	0,28
386.305	Housing Development Finance Corp Ltd	8.040.392	0,29	95.011	Ecolab Inc	16.574.570	0,60
	Irland - 78.196.833 (31. Dezember 2019: 58.716.029)	78.196.833	2,82	214.534	Eversource Energy	15.905.820	0,57
157.683	Accenture Plc - A-Klasse	29.931.469	1,08	86.169	Fidelity National Information Services Inc	10.084.048	0,36
5.359.198	Greencoat Renewables Plc	6.457.834	0,23	1.360.084	General Electric Co	8.244.949	0,30
161.326	Linde Plc	30.399.901	1,10	152.077	Goldman Sachs Group Inc/The	26.264.432	0,95
141.643	Medtronic Plc	11.407.629	0,41	155.172	Lennar Corp	8.439.002	0,30
	Japan - 10.506.478 (31. Dezember 2019: 19.754.742)	10.506.478	0,38	24.407	Lockheed Martin Corp	7.999.279	0,29
347.100	Suzuki Motor Corp	10.506.478	0,38	95.264	Mastercard Inc	24.914.035	0,90
	Jersey - 14.811.284 (31. Dezember 2019: 32.967.223)	14.811.284	0,54	194.378	Microsoft Corp	34.416.271	1,24
204.504	Ferguson Plc	14.811.284	0,54	112.628	Newmont Corp	5.981.065	0,22
	Niederlande - 40.172.066 (31. Dezember 2019: 18.524.344)	40.172.066	1,45	147.941	NIKE Inc	12.657.926	0,46
43.067	ASML Holding NV	13.939.711	0,50	116.418	PepsiCo Inc	13.618.786	0,49
551.042	Unilever NV	26.232.355	0,95	42.027	salesforce.com Inc	6.876.015	0,25
	Republik Korea - 41.785.063 (31. Dezember 2019: 51.157.854)	41.785.063	1,51	16.073	Sherwin-Williams Co/The	8.111.703	0,29
583.059	Samsung Electronics Co Ltd - Preference	20.130.448	0,73		Summe der Anlagen in Aktien	1.143.599.410	41,28
80.265	Samsung SDI Co Ltd	21.654.615	0,78		Instrumente für Aktienanlagen		
	Schweiz - 93.997.779 (31. Dezember 2019: 78.777.828)	93.997.779	3,39		Guernsey - 95.193.680 (31. Dezember 2019: -)	95.193.680	3,43
338.527	Alcon Inc	17.300.115	0,62	8.538.675	Bluefield Solar Income Fund Ltd	12.572.110	0,45
30.018	Lonza Group AG	13.996.554	0,50	3.392.646	Hipgnosis Songs Fund Ltd/The Fund	4.308.161	0,15
318.952	Novartis AG	24.722.040	0,89	17.419.008	International Public Partnerships Ltd	32.130.593	1,16
24.729	Roche Holding AG	7.636.481	0,28	6.750.834	JLEN Environmental Assets Group Ltd	8.757.319	0,32
97.143	Zurich Insurance Group AG	30.342.589	1,10	2.313.427	NextEnergy Solar Fund Ltd	2.724.981	0,10
	Großbritannien - 170.616.505 (31. Dezember 2019: 213.999.439)	170.616.505	6,16	25.078.032	Renewables Infrastructure Group Ltd/The	34.700.516	1,25
785.782	Anglo American Plc	15.979.003	0,58		Jersey - 10.929.432 (31. Dezember 2019: -)	10.929.432	0,39
581.948	Associated British Foods Plc	12.191.715	0,44	9.035.244	Foresight Solar Fund Ltd	10.929.432	0,39
1.533.478	BAE Systems Plc	8.191.214	0,30		Luxemburg - 11.308.189 (31. Dezember 2019: -)	11.308.189	0,41
1.036.389	Diageo Plc	30.595.594	1,10	6.318.004	BBGI SICAV SA/Fund	11.308.189	0,41
5.295.643	Impact Healthcare Reit Plc (REIT)	5.472.504	0,20		Großbritannien - 69.223.902 (31. Dezember 2019: -)	69.223.902	2,50
2.061.819	Informa Plc	10.619.537	0,38	28.566.514	BioPharma Credit Plc/The Fund	25.001.095	0,90
349.628	Persimmon Plc	8.818.284	0,32	23.074.011	Greencoat UK Wind Plc/Funds	36.196.343	1,31
2.472.978	Prudential Plc	33.095.164	1,19	6.917.083	Sdcl Energy Efficiency Income Trust Plc	8.026.464	0,29
1.195.048	Relx Plc	24.510.435	0,88		Summe der Anlagen in Instrumente für Aktienanlagen	186.655.203	6,74
926.409	Royal Dutch Shell Plc	12.613.881	0,46		Indexoptionen - 58.053.694 (31. Dezember 2019: 43.686.228)		
688.280	Travis Perkins Plc	8.529.174	0,31	1.969	CBOE S&P 500 Index Call	43.775.037	1,58
				17-Dez.-2020 3.000.000			
				1.340	CBOE S&P 500 Index Put	14.278.657	0,51
				17-Dez.-2020 2.650.000			
					Summe der Indexoptionen	58.053.694	2,09

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Zugrunde liegendes Engagement	Angemessener Wert	Summe der Netto- vermögen %	Devisenterminkontrakte						Nicht realisierter
Bestände	Beschreibung	in EUR	in EUR		Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	realisierter Gewinn/(Verlust)
Offene Terminkontrakte - 6.471.273 (31. Dezember 2019: (3.246.464))					BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)						
5.636	U.S. 10 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Sep.-2020	700.555.498	6.471.273	0,23	Sterling	Euro	8.218.347	8.989.985	01-Jul.-20	Royal Bank of Scotland	6.646
					Euro	Sterling	343.877.461	302.789.263	15-Jul.-20	State Street Bank	12.482.645
					Euro	Sterling	778.208	680.180	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	33.769
					Euro	Sterling	1.793.340	1.569.876	15-Jul.-20	HSBC Bank plc	75.152
					Euro	Sterling	635.742	569.505	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	12.434
					Euro	Sterling	3.165.630	2.794.490	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	107.135
					Euro	Sterling	5.641.263	4.995.663	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	173.643
					Euro	Sterling	1.571.555	1.410.114	15-Jul.-20	UBS AG	28.223
					Euro	Sterling	804.163	701.056	15-Jul.-20	HSBC Bank plc	36.875
					Euro	Sterling	608.866	531.690	15-Jul.-20	HSBC Bank plc	26.945
					Euro	Sterling	788.575	699.346	15-Jul.-20	Barclays Bank PLC	23.159
					Euro	Sterling	1.672.936	1.461.918	15-Jul.-20	Canadian Imperial Bank	72.906
					Euro	Sterling	2.783.979	2.434.282	15-Jul.-20	Canadian Imperial Bank	119.721
					Euro	Sterling	253.287	221.760	15-Jul.-20	Canadian Imperial Bank	10.577
					Euro	Sterling	332.494	289.795	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	15.321
					Euro	Sterling	630.114	552.090	15-Jul.-20	HSBC Bank plc	25.866
					Euro	Sterling	1.295.762	1.130.752	15-Jul.-20	HSBC Bank plc	58.184
					Euro	Sterling	913.475	794.640	15-Jul.-20	UBS AG	43.762
					Euro	Sterling	3.539.618	3.106.820	15-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	139.286
					Euro	Sterling	2.427.395	2.195.600	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	24.368
					Euro	Sterling	2.369.833	2.123.043	15-Jul.-20	State Street Bank	46.218
					Euro	Sterling	695.700	607.530	15-Jul.-20	Canadian Imperial Bank	30.775
					Euro	Sterling	928.550	833.133	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	16.708
					Sterling	Euro	17.581.000	19.224.833	15-Jul.-20	Canadian Imperial Bank	17.105
					Sterling	Euro	12.558.000	13.711.403	15-Jul.-20	UBS AG	32.995
					Schwedische Krone	Euro	23.272.954	2.119.857	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	95.954
					Schwedische Krone	Euro	44.236.584	4.039.095	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	172.655
					Schwedische Krone	Euro	15.481.721	1.419.330	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	54.680
					Euro	Kanadischer Dollar	48.342.472	73.490.468	14-Aug.-20	HSBC Bank plc	457.442
					Euro	Hongkong-Dollar	65.111.054	546.129.907	14-Aug.-20	HSBC Bank plc	2.318.808
					Euro	Hongkong-Dollar	6.566.226	55.738.000	14-Aug.-20	HSBC Bank plc	157.651
					Euro	Koreanischer Won	38.792.665	51.376.618.060	14-Aug.-20	State Street Bank	720.542
					Euro	Schweizer Franken	82.309.113	86.560.987	14-Aug.-20	Barclays Bank PLC	1.042.787
					Euro	US-Dollar	11.018.902	12.106.534	14-Aug.-20	Royal Bank of Scotland	228.572
					Euro	US-Dollar	4.402.124	4.806.477	14-Aug.-20	State Street Bank	118.200
					Euro	US-Dollar	1.468.466	1.592.342	14-Aug.-20	Canadian Imperial Bank	49.241
					Euro	US-Dollar	11.013.374	12.248.000	14-Aug.-20	Barclays Bank PLC	96.959
					Euro	US-Dollar	8.236.260	9.186.000	14-Aug.-20	The Bank of New York Mellon	48.949
					Euro	US-Dollar	2.436.091	2.675.060	14-Aug.-20	JPMorgan Chase Bank	51.859
					Euro	US-Dollar	6.819.805	7.597.000	14-Aug.-20	State Street Bank	48.739
					Euro	US-Dollar	42.148.689	45.664.315	14-Aug.-20	Barclays Bank PLC	1.448.930
					Euro	US-Dollar	8.235.385	9.186.000	14-Aug.-20	State Street Bank	48.073
					Euro	US-Dollar	13.975.660	15.662.000	14-Aug.-20	State Street Bank	16.410
					Euro	US-Dollar	1.939.052	2.168.220	14-Aug.-20	JPMorgan Chase Bank	6.557
					Euro	US-Dollar	13.471.707	14.588.000	14-Aug.-20	UBS AG	469.693
					Euro	US-Dollar	14.334.181	15.738.171	14-Aug.-20	Royal Bank of Scotland	307.040

Portfolioanalyse		% des Gesamtvermögens
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten		
Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		85,42
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate		2,24
OTC-Finanzderivate		2,09
Sonstiges Umlaufvermögen		10,25
Summe der Aktiva		100,00

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte Forts.							Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) Forts.							BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) Forts.						
Euro	US-Dollar	7.323.705	7.921.388	14-Aug.-20	State Street Bank	263.518	Ungarischer Forint	Euro	2.271.492.944	6.435.757	15-Jul.-20	Canadian Imperial Bank	(64.800)
Euro	US-Dollar	3.165.158	3.436.131	14-Aug.-20	JPMorgan Chase Bank	102.599	Ungarischer Forint	Euro	7.121.426.939	20.378.958	15-Jul.-20	Barclays Bank PLC	(405.178)
Euro	US-Dollar	3.595.812	3.969.432	14-Aug.-20	Royal Bank of Scotland	57.931	Ungarischer Forint	Euro	750.243.768	2.146.998	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(42.757)
Euro	US-Dollar	2.368.031	2.569.743	14-Aug.-20	State Street Bank	77.666	Ungarischer Forint	Euro	1.195.600.888	3.369.526	15-Jul.-20	State Street Bank	(16.171)
Euro	US-Dollar	6.812.881	7.597.000	14-Aug.-20	State Street Bank	41.815	Ungarischer Forint	Euro	750.377.983	2.138.545	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(33.927)
Euro	US-Dollar	13.386.846	14.473.000	14-Aug.-20	State Street Bank	487.329	Ungarischer Forint	Euro	1.749.689.856	4.931.984	15-Jul.-20	UBS AG	(24.552)
Euro	US-Dollar	3.013.646	3.258.082	14-Aug.-20	Barclays Bank PLC	109.778	Sterling	Euro	625.342	692.354	15-Jul.-20	Barclays Bank PLC	(7.933)
Euro	US-Dollar	2.017.005	2.261.589	14-Aug.-20	HSBC Bank plc	1.293	Sterling	Euro	297.570	338.140	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(12.457)
Euro	US-Dollar	1.014.602.903	1.100.000.000	14-Aug.-20	Barclays Bank PLC	34.193.253	Sterling	Euro	4.797.477	5.431.526	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(180.814)
Euro	US-Dollar	6.367.399	7.021.430	14-Aug.-20	Canadian Imperial Bank	109.328	Sterling	Euro	1.178.340	1.350.548	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(60.886)
Euro	US-Dollar	10.816.765	11.989.000	14-Aug.-20	The Bank of New York Mellon	131.192	Sterling	Euro	352.247	402.631	15-Jul.-20	State Street Bank	(17.107)
Euro	US-Dollar	6.816.345	7.363.000	14-Aug.-20	JPMorgan Chase Bank	253.840	Sterling	Euro	697.620	791.135	15-Jul.-20	State Street Bank	(27.608)
Euro	US-Dollar	4.888.504	5.443.256	14-Aug.-20	Royal Bank of Scotland	37.030	Sterling	Euro	5.607.214	6.429.674	15-Jul.-20	State Street Bank	(292.727)
Euro	US-Dollar	1.671.443	1.809.987	14-Aug.-20	Barclays Bank PLC	58.234	Sterling	Euro	207.849	237.926	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(10.440)
Euro	US-Dollar	3.474.445	3.765.471	14-Aug.-20	Royal Bank of Scotland	118.350	Sterling	Euro	127.231	144.729	15-Jul.-20	State Street Bank	(5.478)
Hongkong-Dollar	Euro	3.632.169	416.009	14-Aug.-20	Citigroup Global Markets Limited	1.606	Sterling	Euro	204.585	229.081	15-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(5.168)
Koreanischer Won	Euro	7.478.852.000	5.512.735	14-Aug.-20	State Street Bank	29.393	Sterling	Euro	728.763	811.241	15-Jul.-20	State Street Bank	(13.628)
Neuseeländischer Dollar	Euro	16.887.273	9.468.754	14-Aug.-20	State Street Bank	170.323	Sterling	Euro	164.150	187.854	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(8.196)
Neuseeländischer Dollar	Euro	5.623.124	3.116.530	14-Aug.-20	Citigroup Global Markets Limited	93.090	Sterling	Euro	4.317.254	4.903.518	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(178.398)
Neuseeländischer Dollar	Euro	10.019.853	5.557.952	14-Aug.-20	Citigroup Global Markets Limited	161.274	Kanadischer Dollar	Euro	8.703.248	5.727.923	14-Aug.-20	State Street Bank	(57.047)
Norwegische Krone	Euro	148.923.000	13.461.966	14-Aug.-20	State Street Bank	177.703	Kanadischer Dollar	Euro	5.217.781	3.423.465	14-Aug.-20	JPMorgan Chase Bank	(23.656)
US-Dollar	Euro	1.164.929	1.029.849	14-Aug.-20	State Street Bank	8.431	Kanadischer Dollar	Euro	18.881.706	12.382.841	14-Aug.-20	State Street Bank	(79.870)
US-Dollar	Euro	1.301.048	1.147.294	14-Aug.-20	HSBC Bank plc	12.306	Kanadischer Dollar	Euro	426.231	281.600	14-Aug.-20	State Street Bank	(3.875)
US-Dollar	Euro	62.291.602	54.948.824	14-Aug.-20	Citigroup Global Markets Limited	570.529	Kanadischer Dollar	Euro	3.488.927	2.289.048	14-Aug.-20	JPMorgan Chase Bank	(15.728)
US-Dollar	Euro	31.531.587	27.843.599	14-Aug.-20	Citigroup Global Markets Limited	259.921	Kanadischer Dollar	Euro	5.167.365	3.375.891	14-Aug.-20	UBS AG	(8.932)
US-Dollar	Euro	1.747.099	1.544.459	14-Aug.-20	State Street Bank	12.698	Kanadischer Dollar	Euro	8.130.994	5.320.437	14-Aug.-20	State Street Bank	(22.432)
US-Dollar	Euro	704.500	627.716	14-Aug.-20	Citigroup Global Markets Limited	192	Kanadischer Dollar	Euro	3.771.924	2.477.185	14-Aug.-20	State Street Bank	(19.469)
US-Dollar	Euro	5.115.480	4.504.044	14-Aug.-20	State Street Bank	55.289	Euro	Hongkong-Dollar	1.459.281	12.828.326	14-Aug.-20	The Bank of New York Mellon	(15.678)
US-Dollar	Euro	3.218.352	2.829.538	14-Aug.-20	State Street Bank	38.921	Euro	Japanischer Yen	10.907.496	1.323.749.000	14-Aug.-20	UBS AG	(49.297)
US-Dollar	Euro	6.523.503	5.763.186	14-Aug.-20	HSBC Bank plc	51.091	Euro	Neuseeländischer Dollar	34.728.247	62.207.671	14-Aug.-20	JPMorgan Chase Bank	(779.233)
US-Dollar	Euro	1.821.580	1.612.771	14-Aug.-20	State Street Bank	10.769	Euro	Schweizer Franken	4.533.203	4.840.580	14-Aug.-20	State Street Bank	(11.294)
US-Dollar	Euro	2.522.591	2.246.373	14-Aug.-20	Citigroup Global Markets Limited	1.966	Euro	Schweizer Franken	6.853.481	7.335.000	14-Aug.-20	UBS AG	(32.860)
US-Dollar	Euro	3.488.453	3.107.025	14-Aug.-20	Royal Bank of Scotland	2.168	Euro	US-Dollar	4.053.012	4.581.613	14-Aug.-20	State Street Bank	(30.495)
US-Dollar	Euro	251.280	223.870	14-Aug.-20	Barclays Bank PLC	91	Euro	US-Dollar	7.092.130	8.001.483	14-Aug.-20	Royal Bank of Scotland	(39.444)
US-Dollar	Euro	1.929.942	1.710.724	14-Aug.-20	UBS AG	9.399	Euro	US-Dollar	350.784	397.533	14-Aug.-20	Royal Bank of Scotland	(3.530)
US-Dollar	Euro	238.366	210.088	14-Aug.-20	Citigroup Global Markets Limited	2.363	Euro	US-Dollar	1.679.854	1.896.814	14-Aug.-20	UBS AG	(10.741)
US-Dollar	Euro	5.710.602	5.012.860	14-Aug.-20	State Street Bank	76.894	Euro	US-Dollar	7.046.772	7.934.211	14-Aug.-20	JPMorgan Chase Bank	(24.844)
Euro	Australischer Dollar	104.422.925	170.000.000	15-Sept.-20	Royal Bank of Scotland	700.697	Euro	US-Dollar	46.639.137	52.514.204	14-Aug.-20	State Street Bank	(165.801)
Euro	Australischer Dollar	13.365.531	21.761.410	15-Sept.-20	The Bank of New York Mellon	88.226	Euro	US-Dollar	1.990.595	2.255.829	14-Aug.-20	State Street Bank	(19.983)
EUR 60.198.655							Euro	US-Dollar	5.622.058	6.362.000	14-Aug.-20	The Bank of New York Mellon	(48.275)
Euro	Ungarischer Forint	48.369.672	177.165.822.558	15-Jul.-20	State Street Bank	(1.320.808)	Euro	US-Dollar	2.048.507	2.303.337	14-Aug.-20	State Street Bank	(4.414)
Euro	Sterling	8.988.156	8.218.347	15-Jul.-20	Royal Bank of Scotland	(6.607)	Euro	US-Dollar	1.849.636	2.084.465	14-Aug.-20	State Street Bank	(8.209)
Euro	Schwedische Krone	9.977.025	109.791.497	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(476.187)	Euro	US-Dollar	8.389.648	9.429.000	14-Aug.-20	UBS AG	(14.245)
Ungarischer Forint	Euro	3.502.172.119	9.988.512	15-Jul.-20	State Street Bank	(165.816)	Koreanischer Won	Euro	7.239.744.000	5.388.719	14-Aug.-20	State Street Bank	(23.780)
Ungarischer Forint	Euro	375.577.761	1.065.883	15-Jul.-20	UBS AG	(12.483)	US-Dollar	Euro	1.930.706	1.721.221	14-Aug.-20	Citigroup Global Markets Limited	(418)
							US-Dollar	Euro	9.216.690	8.460.143	14-Aug.-20	JPMorgan Chase Bank	(245.478)
							US-Dollar	Euro	720.747	665.529	14-Aug.-20	Canadian Imperial Bank	(23.141)

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

[illegible]

BNY MELLON GLOBAL REAL RETURN FUND (GBP)

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in GBP	Summe der Netto- vermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in GBP	Summe der Netto- vermögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen				Anleihen Forts.			
Irland - 11.242.956 (31. Dezember 2019: 9.083.500)				Irland - 171.599 (31. Dezember 2019: 184.320)			
54.500	Amundi Physical Gold ETC	3.139.083	5,02	200.000	AIB Group Plc FRN (Immerwährend) 5,250 % 09-Okt.-2024	171.599	0,27
12.138	Invesco Physical Gold ETC	1.697.419	2,72				
77.367	iShares China CNY Bond UCITS ETF - ETF	323.200	0,52				
126.160	iShares Physical Gold ETC	3.557.934	5,70				
24.201	iShares USD Corp Bond UCITS ETF - ETF	2.525.319	4,04				
Jersey - 597.132 (31. Dezember 2019: 294.156)				Italien - 517.588 (31. Dezember 2019: 329.759)			
3.793	WisdomTree Physical Swiss Gold ETC	528.139	0,85	200.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' FRN (Immerwährend) 7,700 % 17-Sept.-2025	162.654	0,26
492	Xtrackers Physical Gold ETC	68.993	0,11	284.000	UniCredit SpA 'EMTN' FRN (Immerwährend) 3,875 % 03-Jun.-2027	191.331	0,31
				200.000	UniCredit SpA FRN (Immerwährend) 8,000 % 03-Jun.-2024	163.603	0,26
Summe der Anlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen 11.840.088 18,96				Jersey - 96.375 (31. Dezember 2019: 102.080)			
Anleihen				100.000	CPUK Finance Ltd 'REGS' 4,250 % 28-Aug.-2022	96.375	0,15
Australien - 2.838.236 (31. Dezember 2019: 2.911.183)				Luxemburg - 175.422 (31. Dezember 2019: 176.499)			
1.046.000	Australia Government Bond 3,000 % 21-März-2047	743.717	1,19	199.000	Summer BC Holdco B SARL 'REGS' 5,750 % 31-Okt.-2026	175.422	0,28
1.278.000	Australia Government Bond 3,250 % 21-Jun.-2039	917.734	1,47				
240.000	Australia Government Bond 3,750 % 21-Apr.-2037	181.876	0,29				
828.100	New South Wales Treasury Corp 2,750 % 20-Nov.-2025	699.046	1,12				
149.000	Treasury Corp of Victoria 4,250 % 20-Dez.-2032	108.917	0,18				
259.000	Treasury Corp of Victoria 5,500 % 17-Nov.-2026	186.946	0,30				
Ecuador - 72.867 (31. Dezember 2019: 147.017)				Mexiko - 837.716 (31. Dezember 2019: 1.060.166)			
211.000	Ecuador Government International Bond 'REGS' 8,875 % 23-Okt.-2027	72.867	0,12	5.484.600	Mexican Bonos 7,500 % 03-Jun.-2027	214.896	0,35
				8.233.300	Mexican Bonos 7,750 % 29-Mai-2031	327.150	0,52
				6.987.100	Mexican Bonos 10,000 % 05-Dez.-2024	295.670	0,47
Frankreich - 946.618 (31. Dezember 2019: 937.410)				Niederlande - 473.355 (31. Dezember 2019: 314.308)			
200.000	BNP Paribas SA FRN (Immerwährend) 6,125 % 17-Jun.-2022	187.266	0,30	500.000	ING Groep NV FRN (Immerwährend) 4,875 % 16-Mai-2029	384.061	0,62
206.000	BNP Paribas SA 'REGS' FRN (Immerwährend) 7,375 % 19-Aug.-2025	183.948	0,30	100.000	Telefonica Europe BV FRN (Immerwährend) 3,000 % 04-Sept.-2023	89.294	0,14
400.000	Societe Generale SA '144A' FRN (Immerwährend) 8,000 % 29-Sept.-2025	363.630	0,58				
248.000	Societe Generale SA 'REGS' FRN (Immerwährend) 7,875 % 18-Dez.-2023	211.774	0,34				
Deutschland - 180.352 (31. Dezember 2019: 295.127)				Neuseeland - 555.152 (31. Dezember 2019: 1.348.423)			
100.000	Infineon Technologies AG 'EMTN' FRN (Immerwährend) 2,875 % 01-Jan.-2025	89.453	0,14	395.000	New Zealand Government Bond 2,750 % 15-Apr.-2037	253.443	0,41
100.000	Infineon Technologies AG FRN (Immerwährend) 3,625 % 01-Jan.-2028	90.899	0,15	387.000	New Zealand Government Inflation Linked Bond 2,500 % 20-Sept.-2040	301.709	0,48
Ungarn - 511.258 (31. Dezember 2019: 1.367.781)				Norwegen - 188.404 (31. Dezember 2019: 178.106)			
185.050.000	Hungary Government Bond 3,000 % 21-Aug.-2030	511.258	0,82	235.000	DNB Bank ASA FRN (Immerwährend) 4,875 % 12-Nov.-2024	188.404	0,30
Indien - 108.371 (31. Dezember 2019: 106.027)				Qatar - 189.165 (31. Dezember 2019: -)			
10.000.000	National Highways Authority of India 7,300 % 18-Mai-2022	108.371	0,17	213.000	Qatar Government International Bond 'REGS' 3,400 % 16-Apr.-2025	189.165	0,30
Indonesien - 143.910 (31. Dezember 2019: 138.776)				Spanien - 524.989 (31. Dezember 2019: 552.613)			
2.422.000.000	Indonesia Treasury Bond 8,250 % 15-Mai-2036	143.910	0,23	200.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN (Immerwährend) 5,875 % 24-Sept.-2023	178.664	0,29
				200.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN (Immerwährend) 6,000 % 29-März-2024	180.983	0,29
				200.000	Banco Santander SA FRN (Immerwährend) 4,750 % 19-März-2025	165.342	0,26

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in GBP	Summe der Nettovermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in GBP	Summe der Nettovermögen %
Anleihen Forts.				Aktien Forts.			
Großbritannien - 7.334.752 (31. Dezember 2019: 12.442.014)				Frankreich - 1.907.593 (31. Dezember 2019: 1.285.255)			
34.000	Anglian Water Services Financing Plc			1.129	L'Oreal SA	295.116	0,47
	3,666 % 30-Jul.-2024	67.421	0,11	809	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	289.657	0,47
37.000	Anglian Water Services Financing Plc 'EMTN'			2.059	Sanofi	170.163	0,27
	4,125 % 28-Jul.-2020	65.112	0,10	4.960	Thales SA	329.398	0,53
45.000	British Telecommunications Plc 'EMTN'			9.273	TOTAL SA	288.558	0,46
	3,500 % 25-Apr.-2025	93.255	0,15	25.455	Vivendi SA	534.701	0,86
276.000	Lloyds Banking Group Plc FRN (Immerwährend)			Deutschland - 3.642.219 (31. Dezember 2019: 2.942.135)			
	4,947 % 27-Jun.-2025	246.050	0,39	13.938	Bayer AG	842.238	1,35
88.393	Network Rail Infrastructure Finance Plc			3.523	Continental AG	281.209	0,45
	1,750 % 22-Nov.-2027	120.341	0,19	24.392	Deutsche Wohnen SE	890.162	1,43
50.000	Scotland Gas Networks Plc 2,127 % 21-Okt.-2022	82.237	0,13	7.536	LEG Immobilien AG	789.810	1,26
139.000	Tesco Plc 'EMTN' 3,322 % 05-Nov.-2025	281.225	0,45	7.452	SAP SE	838.800	1,34
50.000	Tesco Plc 'EMTN' 6,125 % 24-Feb.-2022	54.058	0,09	Guernsey - 79.750 (31. Dezember 2019: 196.147)			
185.046	Tesco Property Finance 3 Plc 5,744 % 13-Apr.-2040	250.335	0,40	234.558	Amedeo Air Four Plus Ltd	79.750	0,13
3.597.700	United Kingdom Gilt 2,000 % 22-Jul.-2020	3.601.855	5,77	Hongkong - 1.108.494 (31. Dezember 2019: 1.444.304)			
2.000.000	United Kingdom Gilt 3,750 % 07-Sept.-2020	2.013.910	3,23	100.800	AIA Group Ltd	765.558	1,23
118.000	Vodafone Group Plc FRN 4,875 % 03-Okt.-2078	122.986	0,20	51.500	Link REIT (Units) (REIT)	342.936	0,55
355.000	Vodafone Group Plc FRN 7,000 % 04-Apr.-2079	335.967	0,54	Indien - 190.758 (31. Dezember 2019: 410.940)			
USA - 1.163.861 (31. Dezember 2019: 2.946.387)				10.033	Housing Development Finance Corp Ltd	190.758	0,31
199.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp			Irland - 1.723.383 (31. Dezember 2019: 1.182.912)			
	'144A' 5,500 % 01-Mai-2026	168.437	0,27	3.972	Accenture Plc - A-Klasse	688.743	1,10
123.000	General Motors Co 5,400 % 02-Okt.-2023	108.606	0,17	118.479	Greencoat Renewables Plc	130.416	0,21
99.000	Laureate Education Inc '144A' 8,250 % 01-Mai-2025	84.023	0,13	3.728	Linde Plc	641.724	1,03
150.000	Sprint Capital Corp 8,750 % 15-März-2032	174.644	0,28	3.568	Medtronic Plc	262.500	0,42
131.000	Sprint Corp 7,125 % 15-Jun.-2024	119.977	0,19	Japan - 251.622 (31. Dezember 2019: 363.296)			
182.000	T-Mobile USA Inc 6,000 % 01-März-2023	149.370	0,24	9.100	Suzuki Motor Corp	251.622	0,40
231.000	T-Mobile USA Inc 6,000 % 15-Apr.-2024	191.962	0,31	Jersey - 315.517 (31. Dezember 2019: 610.783)			
184.000	T-Mobile USA Inc '144A' 3,875 % 15-Apr.-2030	166.841	0,27	4.769	Ferguson Plc	315.517	0,51
Summe der Anlagen in Anleihen				Niederlande - 914.872 (31. Dezember 2019: 358.411)			
		17.029.989	27,27	1.051	ASML Holding NV	310.754	0,50
Aktien				13.892	Unilever NV	604.118	0,97
Australien - 196.168 (31. Dezember 2019: 190.842)				Republik Korea - 980.444 (31. Dezember 2019: 997.138)			
11.143	Newcrest Mining Ltd	196.168	0,31	15.271	Samsung Electronics Co Ltd - Preference	481.629	0,77
Kanada - 621.692 (31. Dezember 2019: 924.394)				2.024	Samsung SDI Co Ltd	498.815	0,80
9.684	Barrick Gold Corp	206.339	0,33	Schweiz - 2.075.856 (31. Dezember 2019: 1.485.156)			
3.997	Intact Financial Corp	305.239	0,49	8.172	Alcon Inc	381.495	0,61
3.191	Wheaton Precious Metals Corp	110.114	0,18	751	Lonza Group AG	319.878	0,51
Cayman-Inseln - 1.125.624 (31. Dezember 2019: -)				7.288	Novartis AG	516.026	0,83
2.259	Alibaba Group Holding Ltd ADR	395.806	0,63	559	Roche Holding AG	157.689	0,25
2.617	New Oriental Education & Technology Group Inc ADR	279.977	0,45	2.456	Zurich Insurance Group AG	700.768	1,12
5.904	Tencent Holdings Ltd	309.486	0,50				
12.993	Tencent Music Entertainment Group ADR	140.355	0,22				
China - 183.246 (31. Dezember 2019: -)							
22.500	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	183.246	0,29				
Dänemark - 453.945 (31. Dezember 2019: 410.886)							
4.829	Orsted A/S '144A'	453.945	0,73				

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

				Angemessener Wert		Summe				
Bestände	Beschreibung			in GBP	der Netto- vermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert	Summe	
								in GBP	der Netto- vermögen %	
Aktien Forts.										
Großbritannien - 3.717.519						Großbritannien - 1.917.729				
(31. Dezember 2019: 4.415.962)				3.717.519	5,95	(31. Dezember 2019: -)				1.917.729 3,07
17.966	Anglo American Plc		333.737	0,53	759.661	BioPharma Credit Plc/The Fund		607.332	0,97	
13.505	Associated British Foods Plc		258.452	0,41	499.912	Greencoat UK Wind Plc/Funds		716.374	1,15	
34.603	BAE Systems Plc		168.845	0,27	560.399	Sdcl Energy Efficiency Income Trust Plc		594.023	0,95	
23.961	Diageo Plc		646.168	1,04						
232.631	Impact Healthcare Reit Plc (REIT)		219.604	0,35						
55.146	Informa Plc		259.462	0,42						
8.408	Persimmon Plc		193.720	0,31						
54.204	Prudential Plc		662.644	1,06						
27.455	Relx Plc		514.389	0,82						
22.165	Royal Dutch Shell Plc		275.688	0,44						
16.326	Travis Perkins Plc		184.810	0,30						
USA - 6.264.757						Indexoptionen - 1.316.353				
(31. Dezember 2019: 4.786.242)				6.264.757	10,03	(31. Dezember 2019: 852.453)				
5.030	Abbott Laboratories		364.916	0,58	49	CBOE S&P 500 Index Call 17-Dez.-2020 3.000,000		995.134	1,59	
270	Alphabet Inc - A-Klasse		307.524	0,49	33	CBOE S&P 500 Index Put 17-Dez.-2020 2.650,000		321.219	0,52	
171	Amazon.com Inc		373.689	0,60						
1.253	Apple Inc		369.625	0,59						
3.881	CMS Energy Corp		182.055	0,29						
2.546	Ecolab Inc		405.725	0,65						
5.331	Eversource Energy		361.055	0,58						
2.071	Fidelity National Information Services Inc		221.395	0,35						
37.558	General Electric Co		207.984	0,33						
3.777	Goldman Sachs Group Inc/The		595.876	0,95						
3.961	Lennar Corp		196.783	0,32						
617	Lockheed Martin Corp		184.725	0,30						
2.400	Mastercard Inc		573.365	0,92						
5.043	Microsoft Corp		815.662	1,31						
2.930	Newmont Corp		142.136	0,23						
3.928	NIKE Inc		307.008	0,49						
3.075	PepsiCo Inc		328.600	0,53						
1.038	salesforce.com Inc		155.135	0,25						
372	Sherwin-Williams Co/The		171.499	0,27						
Summe der Anlagen in Aktien				25.753.459	41,25	Summe der Anlagen in Instrumente für Aktienanlagen				4.722.821 7,56
Instrumente für Aktienanlagen										
Guernsey - 2.310.706						Indexoptionen - 1.316.353				
(31. Dezember 2019: -)				2.310.706	3,70	(31. Dezember 2019: 852.453)				
173.475	Bluefield Solar Income Fund Ltd		233.324	0,37	49	CBOE S&P 500 Index Call 17-Dez.-2020 3.000,000		995.134	1,59	
183.415	Hipgnosis Songs Fund Ltd/The Fund		212.761	0,34	33	CBOE S&P 500 Index Put 17-Dez.-2020 2.650,000		321.219	0,52	
422.482	International Public Partnerships Ltd		711.882	1,14						
166.386	JLEN Environmental Assets Group Ltd		197.168	0,32						
67.546	NextEnergy Solar Fund Ltd		72.680	0,12						
698.490	Renewables Infrastructure Group Ltd/The		882.891	1,41						
Jersey - 235.994						Summe der Indexoptionen				1.316.353 2,11
(31. Dezember 2019: -)				235.994	0,38	Summe der offenen Terminkontrakte				147.361 0,24
213.569	Foresight Solar Fund Ltd		235.994	0,38						
Luxemburg - 258.392						Summe der Vermögenswerte zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert				61.020.664 97,73
(31. Dezember 2019: -)				258.392	0,41					
158.038	BBGI SICAV SA/Fund		258.392	0,41						
Instrumente für Aktienanlagen Forts.										
Großbritannien - 1.917.729						Offene Terminkontrakte - 147.361				
(31. Dezember 2019: -)						(31. Dezember 2019: (66.559))				
759.661	BioPharma Credit Plc/The Fund		607.332	0,97	138	U.S. 10 Year Treasury Note				
499.912	Greencoat UK Wind Plc/Funds		716.374	1,15		Long Futures Contracts				
560.399	Sdcl Energy Efficiency Income Trust Plc		594.023	0,95		Exp Sep.-2020	15.669.504	147.361	0,24	
Summe der offenen Terminkontrakte										147.361 0,24
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 210.593 (siehe unten) 31. Dezember 2019: 1.481.737)										210.593 0,34
Summe der Vermögenswerte zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert										61.020.664 97,73
Rohstoffoptionen - (30.370)						Rohstoffoptionen				(30.370) (0,05)
(31. Dezember 2019: -)						(31. Dezember 2019: -)				
(408)	iShares Physical Gold ETC Call 17-Jul.-2020 35,250		(9.975)	(0,02)	(49)	CBOE S&P 500 Index Call 17-Dez.-2020 3.300,000		(355.405)	(0,57)	
(275)	iShares Physical Gold ETC Call 21-Aug.-2020 34,750		(20.395)	(0,03)	(14)	CBOE S&P 500 Index Put 20-Aug.-2020 2.650,000		(44.497)	(0,07)	
Summe Rohstoffoptionen										(30.370) (0,05)
Indexoptionen - (399.902)						Indexoptionen - (399.902)				
(31. Dezember 2019: (363.168))						(31. Dezember 2019: (363.168))				
(49)	CBOE S&P 500 Index Call 17-Dez.-2020 3.300,000		(355.405)	(0,57)	(49)	CBOE S&P 500 Index Call 17-Dez.-2020 3.300,000		(355.405)	(0,57)	
(14)	CBOE S&P 500 Index Put 20-Aug.-2020 2.650,000		(44.497)	(0,07)	(14)	CBOE S&P 500 Index Put 20-Aug.-2020 2.650,000		(44.497)	(0,07)	
Summe der Indexoptionen										(399.902) (0,64)

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Beschreibung	Angemessener Wert in GBP	Summe der Netto- vermögen %	Devisenterminkontrakte					Abrechnungs- datum Kontrahent		Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
			Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)				
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften - (939.461) (siehe unten) 31. Dezember 2019: (413.007))										
	(939.461)	(1,51)								
Summe der finanziellen Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert	(1.369.733)	(2,20)								
Nettoumlaufvermögen	2.791.556	4,47								
Summe der Nettovermögen	62.442.487	100,00								
Der Kontrahent für die Indexoptionen ist UBS AG. Der Kontrahent für Terminkontrakte ist UBS AB. Der Kontrahent für Rohstoffoptionen ist UBS AG.										
Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens									
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	92,62									
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	2,28									
OTC-Finanzderivate	0,33									
Sonstiges Umlaufvermögen	4,77									
Summe der Aktiva	100,00									
			BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)							
Sterling	Euro	6.764	7.399	01-Jul.-20	Royal Bank of Scotland	5				
Euro	Sterling	55.996	49.680	15-Jul.-20	HSBC Bank plc	1.482				
Euro	Sterling	210.199	190.022	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	2.033				
Euro	Sterling	129.396	116.109	15-Jul.-20	UBS AG	2.117				
Euro	Sterling	8.501	7.688	15-Jul.-20	UBS AG	79				
Euro	Sterling	12.930	11.547	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	267				
Euro	Sterling	5.876	5.166	15-Jul.-20	UBS AG	202				
Euro	Sterling	67.749	60.744	15-Jul.-20	UBS AG	1.158				
Euro	Sterling	9.300	8.187	15-Jul.-20	Canadian Imperial Bank	310				
Euro	Sterling	203.889	177.814	15-Jul.-20	Royal Bank of Scotland	8.476				
Euro	Sterling	25.118	22.525	15-Jul.-20	Canadian Imperial Bank	425				
Ungarischer Forint	Sterling	97.908.095	250.285	15-Jul.-20	HSBC Bank plc	618				
Ungarischer Forint	Sterling	67.540.106	166.928	15-Jul.-20	HSBC Bank plc	6.153				
Ungarischer Forint	Sterling	11.322.837	28.097	15-Jul.-20	HSBC Bank plc	920				
Ungarischer Forint	Sterling	33.416.141	82.337	15-Jul.-20	HSBC Bank plc	3.296				
Ungarischer Forint	Sterling	20.970.587	53.396	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	344				
Ungarischer Forint	Sterling	48.915.016	123.107	15-Jul.-20	HSBC Bank plc	2.245				
Ungarischer Forint	Sterling	121.599.000	309.775	15-Jul.-20	State Street Bank	1.840				
Schwedische Krone	Sterling	453.527	36.323	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	3.130				
Schwedische Krone	Sterling	1.295.911	103.578	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	9.155				
Schwedische Krone	Sterling	681.835	54.803	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	4.510				
Kanadischer Dollar	Sterling	534.899	306.087	14-Aug.-20	Royal Bank of Scotland	12.515				
Kanadischer Dollar	Sterling	133.352	78.093	14-Aug.-20	The Bank of New York Mellon	1.335				
Kanadischer Dollar	Sterling	89.032	52.169	14-Aug.-20	State Street Bank	861				
Kanadischer Dollar	Sterling	482.299	279.651	14-Aug.-20	State Street Bank	7.620				
Kanadischer Dollar	Sterling	227.572	133.564	14-Aug.-20	State Street Bank	1.985				
Kanadischer Dollar	Sterling	133.078	77.316	14-Aug.-20	State Street Bank	1.949				
Kanadischer Dollar	Sterling	132.488	76.751	14-Aug.-20	State Street Bank	2.163				
Hongkong-Dollar	Sterling	94.046	9.774	14-Aug.-20	Citigroup Global Markets Limited	110				
Neuseeländischer Dollar	Sterling	315.537	154.628	14-Aug.-20	Citigroup Global Markets Limited	10.011				
Neuseeländischer Dollar	Sterling	178.085	87.096	14-Aug.-20	Citigroup Global Markets Limited	5.824				
Neuseeländischer Dollar	Sterling	531.054	261.703	14-Aug.-20	HSBC Bank plc	15.388				
Sterling	Hongkong-Dollar	142.023	1.346.000	14-Aug.-20	HSBC Bank plc	553				
Sterling	US-Dollar	311.617	380.000	14-Aug.-20	Canadian Imperial Bank	2.013				
Sterling	US-Dollar	154.124	189.000	14-Aug.-20	The Bank of New York Mellon	137				
Sterling	US-Dollar	151.862	186.000	14-Aug.-20	Barclays Bank PLC	319				
Sterling	US-Dollar	109.000	132.789	14-Aug.-20	Citigroup Global Markets Limited	811				
Sterling	US-Dollar	250.451	306.000	14-Aug.-20	Canadian Imperial Bank	1.138				
Sterling	US-Dollar	148.435	182.087	14-Aug.-20	Citigroup Global Markets Limited	81				
Sterling	US-Dollar	153.575	186.000	14-Aug.-20	Barclays Bank PLC	2.033				
Sterling	US-Dollar	153.159	186.000	14-Aug.-20	Canadian Imperial Bank	1.616				
Sterling	US-Dollar	152.854	186.000	14-Aug.-20	Canadian Imperial Bank	1.311				
Sterling	US-Dollar	183.313	224.000	14-Aug.-20	Royal Bank of Scotland	809				
Sterling	US-Dollar	59.248	72.644	14-Aug.-20	Royal Bank of Scotland	62				
Sterling	US-Dollar	142.950	174.409	14-Aug.-20	HSBC Bank plc	851				
Sterling	US-Dollar	122.996	150.000	14-Aug.-20	State Street Bank	784				

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte Forts.							Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP) Forts.							BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP) Forts.						
Sterling	US-Dollar	38.077	46.462	14-Aug.-20	Citigroup Global Markets Limited	223	Sterling	Euro	49.270	55.346	15-Jul.-20	Barclays Bank PLC	(1.298)
Sterling	US-Dollar	294.111	360.246	14-Aug.-20	Canadian Imperial Bank	602	Sterling	Euro	17.805	20.349	15-Jul.-20	State Street Bank	(788)
US-Dollar	Sterling	32.277	26.062	14-Aug.-20	Citigroup Global Markets Limited	236	Sterling	Euro	21.622	24.541	15-Jul.-20	State Street Bank	(801)
US-Dollar	Sterling	805.821	634.956	14-Aug.-20	State Street Bank	21.583	Sterling	Euro	87.475	100.031	15-Jul.-20	State Street Bank	(3.922)
US-Dollar	Sterling	364.783	288.542	14-Aug.-20	State Street Bank	8.663	Sterling	Euro	42.885	47.801	15-Jul.-20	Canadian Imperial Bank	(790)
US-Dollar	Sterling	1.394.564	1.097.632	14-Aug.-20	HSBC Bank plc	38.583	Sterling	Euro	60.771	69.416	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(2.653)
US-Dollar	Sterling	21.036	16.653	14-Aug.-20	HSBC Bank plc	486	Sterling	Euro	31.168	35.669	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(1.422)
US-Dollar	Sterling	107.381	86.706	14-Aug.-20	State Street Bank	782	Sterling	Euro	40.222	45.952	15-Jul.-20	Royal Bank of Scotland	(1.764)
US-Dollar	Sterling	67.347	54.533	14-Aug.-20	State Street Bank	338	Sterling	Euro	36.550	41.080	15-Jul.-20	Royal Bank of Scotland	(984)
US-Dollar	Sterling	216.602	175.575	14-Aug.-20	Royal Bank of Scotland	901	Sterling	Euro	153.698	172.000	15-Jul.-20	State Street Bank	(3.456)
US-Dollar	Sterling	40.839	32.209	14-Aug.-20	Barclays Bank PLC	1.064	Sterling	Euro	8.460	9.497	15-Jul.-20	Royal Bank of Scotland	(217)
US-Dollar	Sterling	44.082	35.279	14-Aug.-20	State Street Bank	637	Sterling	Euro	311.566	349.000	15-Jul.-20	Barclays Bank PLC	(7.309)
US-Dollar	Sterling	164.518	130.486	14-Aug.-20	State Street Bank	3.554	Sterling	Euro	187.560	209.000	15-Jul.-20	HSBC Bank plc	(3.399)
US-Dollar	Sterling	39.768	31.456	14-Aug.-20	UBS AG	945	Sterling	Euro	5.048	5.736	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(193)
US-Dollar	Sterling	62.450	50.106	14-Aug.-20	Barclays Bank PLC	775	Sterling	Euro	52.273	58.625	15-Jul.-20	UBS AG	(1.292)
US-Dollar	Sterling	133.118	104.084	14-Aug.-20	UBS AG	4.374	Sterling	Euro	20.386	22.486	15-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(159)
US-Dollar	Sterling	78.577	63.302	14-Aug.-20	Citigroup Global Markets Limited	718	Sterling	Euro	23.869	26.351	15-Jul.-20	State Street Bank	(207)
US-Dollar	Sterling	73.905	59.670	14-Aug.-20	Citigroup Global Markets Limited	543	Sterling	Euro	315.838	348.000	15-Jul.-20	State Street Bank	(2.123)
US-Dollar	Sterling	60.078	48.751	14-Aug.-20	UBS AG	197	Sterling	Euro	6.582	7.296	15-Jul.-20	HSBC Bank plc	(84)
US-Dollar	Sterling	109.465	88.763	14-Aug.-20	Citigroup Global Markets Limited	423	Sterling	Euro	8.140	9.138	15-Jul.-20	State Street Bank	(209)
US-Dollar	Sterling	119.070	94.072	14-Aug.-20	State Street Bank	2.940	Sterling	Euro	108.110	120.485	15-Jul.-20	UBS AG	(1.975)
US-Dollar	Sterling	72.123	57.811	14-Aug.-20	Citigroup Global Markets Limited	951	Sterling	Euro	22.009	24.850	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(696)
Australischer Dollar	Sterling	23.934	13.325	15-Sept.-20	JPMorgan Chase Bank	31	Sterling	Euro	17.955	20.289	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(582)
GBP						210.593	Sterling	Euro	3.487	3.882	15-Jul.-20	State Street Bank	(60)
Euro	Sterling	7.399	6.765	15-Jul.-20	Royal Bank of Scotland	(5)	Sterling	Ungarischer Forint	1.674.848	696.103.303	15-Jul.-20	HSBC Bank plc	(109.016)
Ungarischer Forint	Sterling	20.966.836	53.839	15-Jul.-20	HSBC Bank plc	(109)	Sterling	Schwedische Krone	256.627	3.194.081	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(21.231)
Ungarischer Forint	Sterling	10.501.037	27.179	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(269)	Sterling	Kanadischer Dollar	73.937	126.000	14-Aug.-20	State Street Bank	(1.113)
Ungarischer Forint	Sterling	21.013.736	54.364	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(513)	Sterling	Kanadischer Dollar	1.320.954	2.300.382	14-Aug.-20	Royal Bank of Scotland	(49.221)
Ungarischer Forint	Sterling	3.501.949	9.053	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(78)	Sterling	Hongkong-Dollar	1.415.716	13.602.696	14-Aug.-20	Barclays Bank PLC	(13.975)
Ungarischer Forint	Sterling	82.108.110	213.328	15-Jul.-20	UBS AG	(2.915)	Sterling	Japanischer Yen	252.430	34.345.000	14-Aug.-20	UBS AG	(7.435)
Ungarischer Forint	Sterling	69.954.585	180.240	15-Jul.-20	UBS AG	(972)	Sterling	Neuseeländischer Dollar	91.458	187.000	14-Aug.-20	Citigroup Global Markets Limited	(6.114)
Sterling	Euro	182.907	207.156	15-Jul.-20	HSBC Bank plc	(6.367)	Sterling	Neuseeländischer Dollar	833.222	1.708.730	14-Aug.-20	JPMorgan Chase Bank	(58.350)
Sterling	Euro	10.110	11.503	15-Jul.-20	UBS AG	(400)	Sterling	Schweizer Franken	107.857	128.205	14-Aug.-20	State Street Bank	(2.171)
Sterling	Euro	490.280	555.000	15-Jul.-20	State Street Bank	(16.813)	Sterling	Schweizer Franken	183.460	216.000	14-Aug.-20	State Street Bank	(1.915)
Sterling	Euro	246.010	277.000	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(7.080)	Sterling	Schweizer Franken	1.748.025	2.105.558	14-Aug.-20	Barclays Bank PLC	(58.995)
Sterling	Euro	15.629	17.651	15-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(498)	Sterling	US-Dollar	7.767	9.704	14-Aug.-20	Royal Bank of Scotland	(139)
Sterling	Euro	98.124	112.797	15-Jul.-20	Barclays Bank PLC	(4.937)	Sterling	US-Dollar	153.056	189.000	14-Aug.-20	Canadian Imperial Bank	(931)
Sterling	Euro	215.295	241.000	15-Jul.-20	Canadian Imperial Bank	(4.902)	Sterling	US-Dollar	78.895	99.887	14-Aug.-20	Barclays Bank PLC	(2.487)
Sterling	Euro	246.186	275.000	15-Jul.-20	Barclays Bank PLC	(5.077)	Sterling	US-Dollar	33.381	41.913	14-Aug.-20	Barclays Bank PLC	(767)
Sterling	Euro	18.120	20.318	15-Jul.-20	State Street Bank	(444)	Sterling	US-Dollar	249.271	306.000	14-Aug.-20	UBS AG	(41)
Sterling	Euro	41.726	46.594	15-Jul.-20	State Street Bank	(846)	Sterling	US-Dollar	50.594	63.482	14-Aug.-20	Barclays Bank PLC	(1.128)
Sterling	Euro	74.495	83.029	15-Jul.-20	Royal Bank of Scotland	(1.367)	Sterling	US-Dollar	46.823	58.900	14-Aug.-20	Royal Bank of Scotland	(1.165)
Sterling	Euro	249.335	277.000	15-Jul.-20	State Street Bank	(3.754)	Sterling	US-Dollar	311.389	383.000	14-Aug.-20	The Bank of New York Mellon	(658)
Sterling	Euro	246.863	276.000	15-Jul.-20	State Street Bank	(5.313)	Sterling	US-Dollar	161.506	202.790	14-Aug.-20	Royal Bank of Scotland	(3.716)
Sterling	Euro	101.842	113.637	15-Jul.-20	Barclays Bank PLC	(1.986)	Sterling	US-Dollar	45.847	57.516	14-Aug.-20	Barclays Bank PLC	(1.014)
Sterling	Euro	38.301	43.738	15-Jul.-20	State Street Bank	(1.661)	Sterling	US-Dollar	65.208	80.536	14-Aug.-20	Royal Bank of Scotland	(409)
Sterling	Euro	122.587	140.361	15-Jul.-20	HSBC Bank plc	(5.658)	Sterling	US-Dollar	184.089	226.000	14-Aug.-20	Citigroup Global Markets Limited	(43)
Sterling	Euro	5.174.102	5.880.484	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(198.786)	Sterling	US-Dollar	23.464.115	29.051.690	14-Aug.-20	JPMorgan Chase Bank	(205.629)

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte Forts.							Nicht
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent		realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP) Forts.							
Sterling	US-Dollar	183.190	227.000	14-Aug.-20	UBS AG		(1.757)
Sterling	US-Dollar	67.759	83.948	14-Aug.-20	UBS AG		(637)
Sterling	US-Dollar	62.646	77.566	14-Aug.-20	JPMorgan Chase Bank		(550)
Sterling	US-Dollar	152.231	187.000	14-Aug.-20	State Street Bank		(127)
Sterling	US-Dollar	50.836	62.732	14-Aug.-20	State Street Bank		(275)
Sterling	US-Dollar	33.193	40.957	14-Aug.-20	Royal Bank of Scotland		(177)
Sterling	US-Dollar	183.553	226.000	14-Aug.-20	JPMorgan Chase Bank		(579)
Sterling	US-Dollar	111.543	137.707	14-Aug.-20	UBS AG		(654)
Sterling	US-Dollar	155.607	192.000	14-Aug.-20	State Street Bank		(824)
Sterling	US-Dollar	190.274	236.000	14-Aug.-20	Canadian Imperial Bank		(2.006)
Sterling	US-Dollar	158.698	197.000	14-Aug.-20	The Bank of New York Mellon		(1.807)
Sterling	US-Dollar	189.981	236.000	14-Aug.-20	The Bank of New York Mellon		(2.299)
Sterling	US-Dollar	87.645	108.093	14-Aug.-20	Royal Bank of Scotland		(423)
Sterling	US-Dollar	157.491	195.962	14-Aug.-20	JPMorgan Chase Bank		(2.169)
US-Dollar	Sterling	52.829	43.139	14-Aug.-20	HSBC Bank plc		(96)
US-Dollar	Sterling	305.452	249.746	14-Aug.-20	State Street Bank		(880)
US-Dollar	Sterling	40.531	33.039	14-Aug.-20	State Street Bank		(16)
US-Dollar	Sterling	132.008	108.199	14-Aug.-20	State Street Bank		(646)
Sterling	Australischer Dollar	2.886.340	5.266.793	15-Sept.-20	HSBC Bank plc		(52.767)
Sterling	Dänische Krone	386.678	3.231.075	15-Sept.-20	Royal Bank of Scotland		(9.863)
Sterling	Koreanischer Won	205.034	311.652.000	15-Sept.-20	State Street Bank		(6.113)
							GBP (939.461)
							Netto GBP (728.868)

BNY MELLON GLOBAL REAL RETURN FUND (USD)

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen				Anleihen Forts.			
Irland - 51.724.851 (31. Dezember 2019: 42.173.540)				Indien - 398.928 (31. Dezember 2019: 420.152)			
208.502	Amundi Physical Gold ETC	14.735.983	5,05	30.000.000	National Highways Authority of India 7,300 % 18-Mai-2022	398.928	0,14
35.568	Invesco Physical Gold ETC	6.103.291	2,09	Indonesien - 494.029			
298.345	iShares China CNY Bond UCITS ETF - ETF	1.529.316	0,52	(31. Dezember 2019: 512.843)			
1.454	iShares EUR High Yield Corp Bond UCITS ETF - ETF	158.318	0,05	6.776.000.000	Indonesia Treasury Bond 8,250 % 15-Mai-2036	494.029	0,17
498.661	iShares Physical Gold ETC	17.256.164	5,91	Irland - 740.123			
93.266	iShares USD Corp Bond UCITS ETF - ETF	11.941.779	4,09	(31. Dezember 2019: 855.792)			
Jersey - 3.050.562				703.000	AIB Group Plc FRN (Immerwährend) 5,250 % 09-Okt.-2024 740.123	740.123	0,25
16.058	WisdomTree Physical Swiss Gold ETC	2.743.589	0,94	Italien - 2.254.684			
1.784	Xtrackers Physical Gold ETC	306.973	0,10	(31. Dezember 2019: 1.645.470)			
Summe der Anlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen				945.000	Intesa Sanpaolo SpA '144A' FRN (Immerwährend) 7,700 % 17-Sept.-2025	943.036	0,32
		54.775.413	18,75	897.000	UniCredit SpA 'EMTN' FRN (Immerwährend) 3,875 % 03-Jun.-2027	741.518	0,25
Anleihen				568.000	UniCredit SpA FRN (Immerwährend) 8,000 % 03-Jun.-2024 570.130	570.130	0,20
Australien - 13.805.119 (31. Dezember 2019: 12.815.396)				Jersey - 510.870			
4.610.000	Australia Government Bond 3,000 % 21-März-2047	4.021.976	1,38	(31. Dezember 2019: 582.498)			
5.632.000	Australia Government Bond 3,250 % 21-Jun.-2039	4.962.623	1,70	432.000	CPUK Finance Ltd 'REGS' 4,250 % 28-Aug.-2022	510.870	0,18
1.061.000	Australia Government Bond 3,750 % 21-Apr.-2037	986.602	0,34	Luxemburg - 626.287			
2.943.100	New South Wales Treasury Corp 2,750 % 20-Nov.-2025	3.048.530	1,04	(31. Dezember 2019: 678.325)			
531.000	Treasury Corp of Victoria 4,250 % 20-Dez.-2032	476.284	0,16	579.000	Summer BC Holdco B SARL 'REGS' 5,750 % 31-Okt.-2026	626.287	0,21
349.000	Treasury Corp of Victoria 5,500 % 17-Nov.-2026	309.104	0,11	Mexiko - 3.846.304			
Ecuador - 233.910				(31. Dezember 2019: 5.221.928)			
552.000	Ecuador Government International Bond 'REGS' 8,875 % 23-Okt.-2027	233.910	0,08	21.666.000	Mexican Bonos 7,500 % 03-Jun.-2027	1.041.658	0,36
Frankreich - 4.355.437				30.225.200	Mexican Bonos 7,750 % 29-Mai-2031	1.473.684	0,50
622.000	Altice France SA/France '144A' 7,375 % 01-Mai-2026	646.103	0,22	25.632.600	Mexican Bonos 10,000 % 05-Dez.-2024	1.330.962	0,46
179.000	Banijay Entertainment SASU 'REGS' 3,500 % 01-März-2025	192.347	0,07	Niederlande - 1.445.121			
331.000	BNP Paribas SA FRN (Immerwährend) 6,125 % 17-Jun.-2022	380.294	0,13	(31. Dezember 2019: 1.050.093)			
1.015.000	BNP Paribas SA 'REGS' FRN (Immerwährend) 7,375 % 19-Aug.-2025	1.112.130	0,38	747.000	ING Groep NV FRN (Immerwährend) 4,875 % 16-Mai-2029 704.066	704.066	0,24
746.000	Societe Generale SA '144A' FRN (Immerwährend) 8,000 % 29-Sept.-2025	832.150	0,28	402.000	ING Groep NV FRN (Immerwährend) 6,750 % 16-Apr.-2024 412.351	412.351	0,14
1.138.000	Societe Generale SA 'REGS' FRN (Immerwährend) 7,875 % 18-Dez.-2023	1.192.413	0,41	300.000	Telefonica Europe BV FRN (Immerwährend) 3,000 % 04-Sept.-2023	328.704	0,11
Deutschland - 1.327.804				Neuseeland - 3.208.536			
600.000	Infineon Technologies AG 'EMTN' FRN (Immerwährend) 2,875 % 01-Jan.-2025	658.579	0,22	(31. Dezember 2019: 5.738.312)			
600.000	Infineon Technologies AG FRN (Immerwährend) 3,625 % 01-Jan.-2028	669.225	0,23	1.305.000	New Zealand Government Bond 2,750 % 15-Apr.-2037	1.027.442	0,35
Ungarn - 2.148.041				2.280.000	New Zealand Government Inflation Linked Bond 2,500 % 20-Sept.-2040	2.181.094	0,75
633.620.000	Hungary Government Bond 3,000 % 21-Aug.-2030	2.148.041	0,74	Norwegen - 791.919			
				(31. Dezember 2019: 805.894)			
				805.000	DNB Bank ASA FRN (Immerwährend) 4,875 % 12-Nov.-2024 791.919	791.919	0,27
				Philippinen - 881.713			
				(31. Dezember 2019: -)			
				839.000	Philippine Government International Bond 2,457 % 05-Mai-2030	881.713	0,30
				Qatar - 895.770			
				(31. Dezember 2019: -)			
				822.000	Qatar Government International Bond 'REGS' 3,400 % 16-Apr.-2025	895.770	0,31

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener	Summe			Angemessener	Summe
		Wert	der Netto-			Wert	der Netto-
Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %	Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %
Anleihen Forts.				Aktien			
	Spanien - 2.993.074 (31. Dezember 2019: 3.392.933)	2.993.074	1,02		Australien - 1.966.853 (31. Dezember 2019: 986.027)	1.966.853	0,67
600.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN (Immerwährend) 5,875 % 24-Sept.-2023	657.691	0,22	36.697	Newcrest Mining Ltd	792.720	0,27
800.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN (Immerwährend) 6,000 % 29-März-2024	888.300	0,30	604.696	Star Entertainment Grp Ltd/The	1.174.133	0,40
800.000	Banco Santander SA FRN (Immerwährend) 4,750 % 19-März-2025	811.532	0,28		Kanada - 2.787.076 (31. Dezember 2019: 4.903.678)	2.787.076	0,95
600.000	Banco Santander SA FRN (Immerwährend) 5,250 % 29-Sept.-2023	635.551	0,22	36.543	Barrick Gold Corp	955.417	0,33
				15.147	Intact Financial Corp	1.419.367	0,48
				9.737	Wheaton Precious Metals Corp	412.292	0,14
	Vereinigte Arabische Emirate - 890.420 (31. Dezember 2019: -)	890.420	0,31		Cayman-Inseln - 5.344.186 (31. Dezember 2019: -)	5.344.186	1,83
844.000	Abu Dhabi Government International Bond 'REGS' 2,500 % 16-Apr.-2025	890.420	0,31	8.596	Alibaba Group Holding Ltd ADR	1.848.097	0,63
				9.667	New Oriental Education & Technology Group Inc ADR	1.269.035	0,44
	Großbritannien - 7.908.245 (31. Dezember 2019: 8.223.292)	7.908.245	2,71	24.436	Tencent Holdings Ltd	1.571.766	0,54
44.000	Anglian Water Services Financing Plc 3,666 % 30-Jul.-2024	107.061	0,04	49.437	Tencent Music Entertainment Group ADR	655.288	0,22
60.000	Anglian Water Services Financing Plc 'EMTN' 4,125 % 28-Jul.-2020	129.562	0,04		China - 854.437 (31. Dezember 2019: -)	854.437	0,29
238.000	British Telecommunications Plc 'EMTN' 3,500 % 25-Apr.-2025	605.198	0,21	85.500	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	854.437	0,29
537.120	DWR Cymru Financing UK Plc 'EMTN' 1,859 % 31-März-2048	1.269.033	0,43		Dänemark - 2.305.222 (31. Dezember 2019: 2.106.700)	2.305.222	0,79
291.224	High Speed Rail Finance 1 Plc 'EMTN' 1,566 % 01-Nov.-2038	520.193	0,18	19.985	Orsted A/S '144A'	2.305.222	0,79
243.793	Network Rail Infrastructure Finance Plc 1,750 % 22-Nov.-2027	407.270	0,14		Frankreich - 9.277.688 (31. Dezember 2019: 6.417.940)	9.277.688	3,18
150.000	Scotland Gas Networks Plc 2,127 % 21-Okt.-2022	302.729	0,10	4.595	L'Oreal SA	1.473.827	0,51
550.000	Tesco Plc 'EMTN' 3,322 % 05-Nov.-2025	1.365.413	0,47	2.975	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	1.307.028	0,45
62.000	Tesco Plc 'EMTN' 6,125 % 24-Feb.-2022	82.251	0,03	8.393	Sanofi	851.116	0,29
782.589	Tesco Property Finance 3 Plc 5,744 % 13-Apr.-2040	1.299.091	0,44	20.490	Thales SA	1.669.720	0,57
263.000	Vodafone Group Plc FRN 4,875 % 03-Okt.-2078	336.349	0,12	37.347	TOTAL SA	1.426.039	0,49
1.278.000	Vodafone Group Plc FRN 7,000 % 04-Apr.-2079	1.484.095	0,51	98.931	Vivendi SA	2.549.958	0,87
	USA - 14.695.647 (31. Dezember 2019: 38.732.833)	14.695.647	5,03		Deutschland - 16.325.050 (31. Dezember 2019: 13.498.041)	16.325.050	5,59
707.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5,500 % 01-Mai-2026	734.287	0,25	53.184	Bayer AG	3.943.466	1,35
395.000	CEMEX Finance LLC 'REGS' 6,000 % 01-Apr.-2024	393.148	0,13	13.586	Continental AG	1.330.671	0,46
471.000	General Motors Co 5,400 % 02-Okt.-2023	510.309	0,18	81.230	Deutsche Wohnen SE	3.637.479	1,24
637.000	Laureate Education Inc '144A' 8,250 % 01-Mai-2025	663.381	0,23	26.373	LEG Immobilien AG	3.391.593	1,16
250.000	Refinitiv US Holdings Inc 'REGS' 6,875 % 15-Nov.-2026	300.090	0,10	29.119	SAP SE	4.021.841	1,38
513.000	Sprint Capital Corp 8,750 % 15-März-2032	732.898	0,25		Guernsey - 416.413 (31. Dezember 2019: 1.008.590)	416.413	0,14
468.000	Sprint Corp 7,125 % 15-Jun.-2024	525.938	0,18	998.120	Amedeo Air Four Plus Ltd	416.413	0,14
724.000	T-Mobile USA Inc 6,000 % 01-März-2023	729.111	0,25		Hongkong - 5.171.114 (31. Dezember 2019: 6.988.707)	5.171.114	1,77
844.000	T-Mobile USA Inc 6,000 % 15-Apr.-2024	860.614	0,29	382.600	AIA Group Ltd	3.565.539	1,22
647.000	T-Mobile USA Inc '144A' 3,875 % 15-Apr.-2030	719.868	0,25	196.500	Link REIT (Units) (REIT)	1.605.575	0,55
8.470.900	United States Treasury Note/Bond 2,750 % 30-Sept.-2020	8.526.003	2,92		Indien - 928.253 (31. Dezember 2019: 2.040.697)	928.253	0,32
				39.788	Housing Development Finance Corp Ltd	928.253	0,32
					Irland - 8.261.241 (31. Dezember 2019: 5.697.589)	8.261.241	2,83
				15.438	Accenture Plc - A-Klasse	3.284.743	1,12
				508.904	Greencoat Renewables Plc	687.369	0,24

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %
Aktien Forts.				Aktien Forts.			
	Irland Forts.				USA Forts.		
14.487	Linde Plc	3.059.944	1,05	10.556	Newmont Corp	628.346	0,22
13.616	Medtronic Plc	1.229.185	0,42	13.414	NIKE Inc	1.286.470	0,44
	Japan - 1.173.940			11.410	PepsiCo Inc	1.496.136	0,51
	(31. Dezember 2019: 1.864.791)	1.173.940	0,40	3.914	salesforce.com Inc	717.788	0,25
34.600	Suzuki Motor Corp	1.173.940	0,40	1.410	Sherwin-Williams Co/The	797.630	0,27
	Jersey - 1.401.927			Summe der Anlagen in Aktien	121.687.728	41,67	
	(31. Dezember 2019: 3.015.712)	1.401.927	0,48	Instrumente für Aktienanlagen			
17.269	Ferguson Plc	1.401.927	0,48		Guernsey - 10.893.014		
	Niederlande - 4.325.456				(31. Dezember 2019: -)	10.893.014	3,73
	(31. Dezember 2019: 1.803.238)	4.325.456	1,48	869.373	Bluefield Solar Income Fund Ltd	1.434.799	0,49
4.108	ASML Holding NV	1.490.413	0,51	758.117	Hipgnosis Songs Fund Ltd/The Fund	1.079.088	0,37
53.130	Unilever NV	2.835.043	0,97	1.548.989	International Public Partnerships Ltd	3.202.661	1,10
	Republik Korea - 4.604.262			548.389	JLEN Environmental Assets Group Ltd	797.388	0,27
	(31. Dezember 2019: 4.790.541)	4.604.262	1,58	252.062	NextEnergy Solar Fund Ltd	332.799	0,11
58.500	Samsung Electronics Co Ltd - Preference	2.263.936	0,78	2.608.832	Renewables Infrastructure Group Ltd/The	4.046.279	1,39
7.739	Samsung SDI Co Ltd	2.340.326	0,80		Jersey - 1.172.530		
	Schweiz - 10.035.246				(31. Dezember 2019: -)	1.172.530	0,40
	(31. Dezember 2019: 7.359.381)	10.035.246	3,44	864.767	Foresight Solar Fund Ltd	1.172.530	0,40
33.303	Alcon Inc	1.907.684	0,65		Luxemburg - 1.193.901		
2.812	Lonza Group AG	1.469.677	0,51		(31. Dezember 2019: -)	1.193.901	0,41
30.164	Novartis AG	2.620.687	0,90	595.097	BBGI SICAV SA/Fund	1.193.901	0,41
2.281	Roche Holding AG	789.549	0,27		Großbritannien - 8.642.334		
9.276	Zurich Insurance Group AG	3.247.649	1,11		(31. Dezember 2019: -)	8.642.334	2,96
	Großbritannien - 17.725.682			2.754.663	BioPharma Credit Plc/The Fund	2.702.325	0,93
	(31. Dezember 2019: 20.918.159)	17.725.682	6,07	1.800.758	Greencoat UK Wind Plc/Funds	3.166.388	1,08
69.281	Anglo American Plc	1.579.170	0,54	2.132.449	Sdcl Energy Efficiency Income Trust Plc	2.773.621	0,95
51.413	Associated British Foods Plc	1.207.316	0,41	Summe der Anlagen in Instrumente für Aktienanlagen	21.901.779	7,50	
139.297	BAE Systems Plc	834.026	0,29		Indexoptionen - 6.191.968		
91.364	Diageo Plc	3.023.280	1,04		(31. Dezember 2019: 4.252.147)		
860.394	Impact Healthcare Reit Plc (REIT)	996.626	0,34	190	CBOE S&P 500 Index Call 17-Dez.-2020 3.000,000	4.734.800	1,62
207.279	Informa Plc	1.196.679	0,41	122	CBOE S&P 500 Index Put 17-Dez.-2020 2.650,000	1.457.168	0,50
32.059	Persimmon Plc	906.348	0,31	Summe der Indexoptionen	6.191.968	2,12	
210.667	Prudential Plc	3.160.152	1,08				
115.845	Relx Plc	2.663.239	0,91				
84.566	Royal Dutch Shell Plc	1.290.652	0,44				
62.504	Travis Perkins Plc	868.194	0,30				
	USA - 28.783.682						
	(31. Dezember 2019: 23.327.856)	28.783.682	9,86				
19.263	Abbott Laboratories	1.714.792	0,59				
1.030	Alphabet Inc - A-Klasse	1.439.513	0,49				
639	Amazon.com Inc	1.713.472	0,59				
5.000	Apple Inc	1.809.850	0,62				
14.270	CMS Energy Corp	821.381	0,28				
8.533	Ecolab Inc	1.668.543	0,57				
20.089	Eversource Energy	1.669.496	0,57				
8.037	Fidelity National Information Services Inc	1.054.254	0,36				
142.245	General Electric Co	966.555	0,33				
14.358	Goldman Sachs Group Inc/The	2.779.493	0,95				
14.199	Lennar Corp	865.571	0,30				
2.331	Lockheed Martin Corp	856.340	0,29				
9.327	Mastercard Inc	2.734.163	0,94				
18.965	Microsoft Corp	3.763.889	1,29				
	Offene Terminkontrakte - 660.018						
	(31. Dezember 2019: (313.055))						
	506 U.S. 10 Year Treasury Note						
	Long Futures Contracts						
	Exp Sep.-2020	70.500.031	660.018	0,23			
	Summe der offenen Terminkontrakte	660.018	0,23				
	Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 902.415						
	(siehe unten) 31. Dezember 2019: 425.999)						
	Summe der Vermögenswerte	270.571.302	92,65				
	zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert						

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %	Devisenterminkontrakte					Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Bestände	Beschreibung			Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum Kontrahent	
Rohstoffoptionen - (135.217) (31. Dezember 2019: –)				BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)					
(1.483)	iShares Physical Gold ETC Call 17-Jul.-2020 35,250	(44.490)	(0,02)	US-Dollar	Euro	22.280	19.875	01-Jul.-20 Barclays Bank PLC	2
(997)	iShares Physical Gold ETC Call 21-Aug.-2020 34,750	(90.727)	(0,03)	Euro	US-Dollar	215.824	235.648	15-Jul.-20 The Bank of New York Mellon	6.340
Summe Rohstoffoptionen (135.217) (0,05)				Euro	US-Dollar	835.742	907.854	15-Jul.-20 Royal Bank of Scotland	29.204
Indexoptionen - (1.901.600) (31. Dezember 2019: (1.798.005))				Euro	US-Dollar	23.749	25.638	15-Jul.-20 UBS AG	990
(190)	CBOE S&P 500 Index Call 17-Dez.-2020 3.300,000	(1.691.000)	(0,58)	Euro	US-Dollar	112.561	123.522	15-Jul.-20 UBS AG	2.685
(54)	CBOE S&P 500 Index Put 20-Aug.-2020 2.650,000	(210.600)	(0,07)	Euro	US-Dollar	2.748.000	3.056.916	15-Jul.-20 Citigroup Global Markets Limited	24.225
Summe der Indexoptionen (1.901.600) (0,65)				Euro	US-Dollar	227.299	246.006	15-Jul.-20 HSBC Bank plc	8.849
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften - (2.598.021) (siehe unten) 31. Dezember 2019: (5.145.422))				Ungarischer Forint	US-Dollar	38.747.150	120.468	15-Jul.-20 HSBC Bank plc	1.383
				Ungarischer Forint	US-Dollar	117.746.781	364.770	15-Jul.-20 State Street Bank	5.516
				Ungarischer Forint	US-Dollar	172.298.968	525.241	15-Jul.-20 HSBC Bank plc	16.599
				Ungarischer Forint	US-Dollar	73.895.762	230.878	15-Jul.-20 State Street Bank	1.507
				Ungarischer Forint	US-Dollar	344.872.917	1.079.687	15-Jul.-20 State Street Bank	4.857
				Ungarischer Forint	US-Dollar	1.370.525.413	4.308.135	15-Jul.-20 State Street Bank	1.844
				Ungarischer Forint	US-Dollar	73.882.544	232.124	15-Jul.-20 State Street Bank	220
				Ungarischer Forint	US-Dollar	232.379.726	724.114	15-Jul.-20 HSBC Bank plc	6.666
Summe der finanziellen Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert (4.634.838) (1,59)				Sterling	US-Dollar	91.624	112.373	15-Jul.-20 Citigroup Global Markets Limited	64
Nettoumlaufvermögen 26.127.342 8,94				Sterling	US-Dollar	20.642	25.002	15-Jul.-20 Barclays Bank PLC	329
Summe der Nettovermögen 292.063.806 100,00				Schwedische Krone	US-Dollar	2.183.181	216.649	15-Jul.-20 JPMorgan Chase Bank	16.410
Der Kontrahent für die Indexoptionen ist UBS AG. Der Kontrahent für Terminkontrakte ist UBS AB. Der Kontrahent für Rohstoffoptionen ist UBS AG.				Schwedische Krone	US-Dollar	4.149.854	412.527	15-Jul.-20 JPMorgan Chase Bank	30.478
Portfolioanalyse % des Gesamtvermögens				Schwedische Krone	US-Dollar	1.452.362	146.137	15-Jul.-20 JPMorgan Chase Bank	8.905
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten				US-Dollar	Euro	459.778	406.488	15-Jul.-20 HSBC Bank plc	4.011
Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente 88,27				US-Dollar	Euro	208.244	182.921	15-Jul.-20 State Street Bank	3.148
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate 2,30				US-Dollar	Euro	236.635	209.331	15-Jul.-20 State Street Bank	1.926
OTC-Finanzderivate 0,30				US-Dollar	Euro	60.137	53.318	15-Jul.-20 State Street Bank	356
Sonstiges Umlaufvermögen 9,13				US-Dollar	Euro	29.949	26.495	15-Jul.-20 HSBC Bank plc	242
Summe der Aktiva 100,00				US-Dollar	Euro	92.613	81.777	15-Jul.-20 Royal Bank of Scotland	922
				US-Dollar	Sterling	553.984	449.194	15-Jul.-20 JPMorgan Chase Bank	2.752
				US-Dollar	Sterling	35.699.742	29.031.967	15-Jul.-20 JPMorgan Chase Bank	72.966
				US-Dollar	Sterling	76.778	61.060	15-Jul.-20 JPMorgan Chase Bank	1.848
				US-Dollar	Sterling	83.813	67.028	15-Jul.-20 JPMorgan Chase Bank	1.559
				US-Dollar	Sterling	4.419.215	3.594.000	15-Jul.-20 JPMorgan Chase Bank	8.814
				US-Dollar	Sterling	281.640	228.352	15-Jul.-20 JPMorgan Chase Bank	1.416
				US-Dollar	Sterling	138.522	110.981	15-Jul.-20 Barclays Bank PLC	2.330
				US-Dollar	Sterling	62.102	50.095	15-Jul.-20 Royal Bank of Scotland	628
				US-Dollar	Sterling	280.108	226.698	15-Jul.-20 JPMorgan Chase Bank	1.914
				US-Dollar	Sterling	92.575	73.960	15-Jul.-20 Citigroup Global Markets Limited	1.814
				US-Dollar	Sterling	97.557	77.882	15-Jul.-20 Barclays Bank PLC	1.984
				US-Dollar	Sterling	113.757	91.510	15-Jul.-20 HSBC Bank plc	1.460
				US-Dollar	Sterling	183.255	147.462	15-Jul.-20 JPMorgan Chase Bank	2.296
				US-Dollar	Sterling	197.300	158.635	15-Jul.-20 Citigroup Global Markets Limited	2.630
				Kanadischer Dollar	US-Dollar	788.995	563.121	14-Aug.-20 JPMorgan Chase Bank	13.684
				Kanadischer Dollar	US-Dollar	56.266	39.884	14-Aug.-20 Royal Bank of Scotland	1.250
				Kanadischer Dollar	US-Dollar	436.102	309.818	14-Aug.-20 Citigroup Global Markets Limited	9.000
				Kanadischer Dollar	US-Dollar	1.695.000	1.222.300	14-Aug.-20 JPMorgan Chase Bank	16.850
				Kanadischer Dollar	US-Dollar	2.882.703	2.058.525	14-Aug.-20 UBS AG	48.908
				Kanadischer Dollar	US-Dollar	798.470	567.330	14-Aug.-20 Canadian Imperial Bank	16.401

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte Forts.							Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD) Forts.							BNY Mellon Global Real Return Fund (USD) Forts.						
Kanadischer Dollar	US-Dollar	1.332.130	959.549	14-Aug.-20	Royal Bank of Scotland	14.320	US-Dollar	Euro	141.907	130.343	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(4.238)
Kanadischer Dollar	US-Dollar	534.189	383.990	14-Aug.-20	JPMorgan Chase Bank	6.535	US-Dollar	Euro	175.095	160.395	15-Jul.-20	Canadian Imperial Bank	(4.744)
Kanadischer Dollar	US-Dollar	49.280	35.294	14-Aug.-20	State Street Bank	733	US-Dollar	Euro	289.469	268.378	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(11.446)
Hongkong-Dollar	US-Dollar	356.966	46.046	14-Aug.-20	Canadian Imperial Bank	3	US-Dollar	Euro	150.733	135.264	15-Jul.-20	State Street Bank	(929)
Neuseeländischer Dollar	US-Dollar	1.970.289	1.198.142	14-Aug.-20	HSBC Bank plc	63.659	US-Dollar	Euro	32.269	28.878	15-Jul.-20	State Street Bank	(110)
Neuseeländischer Dollar	US-Dollar	655.967	395.069	14-Aug.-20	Citigroup Global Markets Limited	25.021	US-Dollar	Euro	236.244	215.529	15-Jul.-20	State Street Bank	(5.414)
Neuseeländischer Dollar	US-Dollar	1.169.600	706.740	14-Aug.-20	Citigroup Global Markets Limited	42.288	US-Dollar	Euro	85.267	78.755	15-Jul.-20	State Street Bank	(3.035)
US-Dollar	Australischer Dollar	15.876.573	22.701.532	15-Sept.-20	HSBC Bank plc	324.942	US-Dollar	Euro	102.394	94.540	15-Jul.-20	State Street Bank	(3.607)
US-Dollar	Dänische Krone	1.782.358	11.667.000	15-Sept.-20	Royal Bank of Scotland	24.631	US-Dollar	Euro	32.722	30.224	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(1.167)
US-Dollar	Indonesische Rupiah	487.214	7.001.272.000	15-Sept.-20	State Street Bank	12.101	US-Dollar	Euro	57.385	52.915	15-Jul.-20	Royal Bank of Scotland	(1.945)
						USD							
						902.415	US-Dollar	Euro	26.261.018	24.241.141	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(918.884)
US-Dollar	Sterling	112.365	91.624	01-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(62)	US-Dollar	Euro	337.898	306.985	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(6.303)
Euro	US-Dollar	19.639	22.097	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(78)	US-Dollar	Euro	32.566	30.145	15-Jul.-20	Canadian Imperial Bank	(1.234)
Euro	US-Dollar	113.909	127.998	15-Jul.-20	UBS AG	(279)	US-Dollar	Euro	52.556	46.903	15-Jul.-20	Royal Bank of Scotland	(33)
Euro	US-Dollar	48.838	55.123	15-Jul.-20	Royal Bank of Scotland	(365)	US-Dollar	Euro	239.904	219.601	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(6.319)
Euro	US-Dollar	85.716	97.285	15-Jul.-20	Canadian Imperial Bank	(1.177)	US-Dollar	Ungarischer Forint	7.161.053	2.424.349.260	15-Jul.-20	HSBC Bank plc	(462.954)
Euro	US-Dollar	579.963	657.256	15-Jul.-20	Royal Bank of Scotland	(6.984)	US-Dollar	Sterling	565.941	464.329	15-Jul.-20	Barclays Bank PLC	(3.864)
Euro	US-Dollar	19.875	22.287	15-Jul.-20	Barclays Bank PLC	(2)	US-Dollar	Sterling	164.482	134.101	15-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(81)
Euro	US-Dollar	68.311	76.624	15-Jul.-20	UBS AG	(31)	US-Dollar	Schwedische Krone	82.812	67.866	15-Jul.-20	State Street Bank	(470)
Euro	US-Dollar	535.251	600.530	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(390)	US-Dollar	Schwedische Krone	96.962	79.230	15-Jul.-20	HSBC Bank plc	(265)
Euro	US-Dollar	53.946	60.701	15-Jul.-20	State Street Bank	(215)	US-Dollar	Kanadischer Dollar	1.000.577	10.132.101	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(81.044)
Sterling	US-Dollar	19.729	24.416	15-Jul.-20	Canadian Imperial Bank	(205)	US-Dollar	Hongkong-Dollar	7.908.157	11.121.249	14-Aug.-20	HSBC Bank plc	(222.159)
Sterling	US-Dollar	1.112.000	1.372.067	15-Jul.-20	State Street Bank	(7.469)	US-Dollar	Hongkong-Dollar	922.041	7.166.000	14-Aug.-20	The Bank of New York Mellon	(2.384)
Sterling	US-Dollar	63.531	78.858	15-Jul.-20	State Street Bank	(896)	US-Dollar	Neuseeländischer Dollar	6.503.361	50.467.229	14-Aug.-20	Barclays Bank PLC	(6.994)
Sterling	US-Dollar	372.564	464.116	15-Jul.-20	State Street Bank	(6.922)	US-Dollar	Schweizer Franken	5.377.329	8.908.027	14-Aug.-20	State Street Bank	(327.500)
Sterling	US-Dollar	1.641.000	2.039.364	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(25.600)	US-Dollar	Schweizer Franken	404.213	391.411	14-Aug.-20	State Street Bank	(8.080)
Sterling	US-Dollar	55.609	69.137	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(896)	US-Dollar	Schweizer Franken	8.532.455	8.298.614	14-Aug.-20	State Street Bank	(208.907)
Sterling	US-Dollar	13.816	17.353	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(399)	Australischer Dollar	US-Dollar	102.804	71.504	15-Sept.-20	JPMorgan Chase Bank	(1.078)
Sterling	US-Dollar	149.257	183.618	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(456)	US-Dollar	Indische Rupie	1.324.131	100.965.000	15-Sept.-20	Citigroup Global Markets Limited	(708)
US-Dollar	Euro	5.121.140	4.700.000	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(148.642)							USD (2.598.021)
US-Dollar	Euro	87.673	79.662	15-Jul.-20	Canadian Imperial Bank	(1.646)							Netto USD (1.695.606)
US-Dollar	Euro	184.076	167.537	15-Jul.-20	State Street Bank	(3.772)							
US-Dollar	Euro	207.344	188.374	15-Jul.-20	State Street Bank	(3.867)							
US-Dollar	Euro	496.169	455.645	15-Jul.-20	Barclays Bank PLC	(14.714)							
US-Dollar	Euro	186.480	172.419	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(6.841)							
US-Dollar	Euro	98.788	90.206	15-Jul.-20	State Street Bank	(2.354)							
US-Dollar	Euro	592.666	548.962	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(22.846)							
US-Dollar	Euro	117.388	107.516	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(3.162)							
US-Dollar	Euro	892.217	817.958	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(24.902)							
US-Dollar	Euro	296.600	272.385	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(8.806)							
US-Dollar	Euro	155.902	142.050	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	(3.368)							
US-Dollar	Euro	188.110	172.033	15-Jul.-20	State Street Bank	(4.779)							

BNY MELLON GLOBAL SHORT-DATED HIGH YIELD BOND FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen				Anleihen Forts.			
	Überstaatlich - 40.036.541 (31. Dezember 2019: 62.778.833)	40.036.541	5,59		Frankreich Forts.		
40.036.541	Insight Liquidity Funds Plc			500.000	SPCM SA 'REGS' 2,875 % 15-Jun.-2023	560.142	0,08
	- ILF USD Liquidity Fund	40.036.541	5,59	3.000.000	Vallourec SA 'REGS' 6,625 % 15-Okt.-2022	2.137.741	0,30
Summe der Anlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen 40.036.541 5,59				Deutschland - 28.703.217 (31. Dezember 2019: 11.659.489) 28.703.217 4,00			
Anleihen				7.000.000	CeramTec BondCo GmbH 'REGS'		
	Australien - 26.282.748 (31. Dezember 2019: 30.117.745)	26.282.748	3,67		5,250 % 15-Dez.-2025	7.706.233	1,08
10.025.000	Barmingo Finance Pty Ltd 'REGS'			2.000.000	Nidda BondCo GmbH 'REGS' 5,000 % 30-Sept.-2025	2.225.895	0,31
	6,625 % 15-Mai-2022	9.931.016	1,39	1.000.000	Nidda BondCo GmbH 'REGS' 7,250 % 30-Sept.-2025	1.149.611	0,16
12.650.000	Emeco Pty Ltd 9,250 % 31-März-2022	12.776.500	1,78	7.000.000	Nidda Healthcare Holding GmbH 'REGS'		
3.500.000	FMG Resources August 2006 Pty Ltd '144A'				3,500 % 30-Sept.-2024	7.773.443	1,08
	4,750 % 15-Mai-2022	3.575.232	0,50	5.000.000	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 'REGS'		
Brasilien - 15.780.698 (31. Dezember 2019: 16.399.985) 15.780.698 2,20					6,000 % 30-Jul.-2026	5.760.048	0,80
15.700.000	MARB BondCo Plc 'REGS' 7,000 % 15-März-2024	15.780.698	2,20	1.100.000	thyssenkrupp AG 'EMTN' 1,750 % 25-Nov.-2020	1.237.285	0,17
Kanada - 6.794.305 (31. Dezember 2019: 34.920.894) 6.794.305 0,95				2.767.000	ZF North America Capital Inc '144A'		
7.000.000	NOVA Chemicals Corp '144A'				4,500 % 29-Apr.-2022	2.850.702	0,40
	5,250 % 01-Aug.-2023	6.794.305	0,95	Ghana - 2.158.140 (31. Dezember 2019: 13.872.525) 2.158.140 0,30			
Chile - 10.380.592 (31. Dezember 2019: 6.811.441) 10.380.592 1,45				2.945.000	Tullow Oil Plc 'REGS' 6,250 % 15-Apr.-2022	2.158.140	0,30
6.648.000	VTR Finance NV '144A' 6,875 % 15-Jan.-2024	6.800.372	0,95	Hongkong - 14.690.912 (31. Dezember 2019: 16.765.286) 14.690.912 2,05			
3.500.000	VTR Finance NV 'REGS' 6,875 % 15-Jan.-2024	3.580.220	0,50	14.516.000	Metropolitan Light Co Ltd 'REGS'		
China - 16.640.331 (31. Dezember 2019: -) 16.640.331 2,32					5,500 % 21-Nov.-2022	14.690.912	2,05
3.500.000	China Evergrande Group 6,250 % 28-Jun.-2021	3.370.937	0,47	Indonesien - 8.053.003 (31. Dezember 2019: 5.302.393) 8.053.003 1,12			
7.786.000	Kaisa Group Holdings Ltd 6,750 % 18-Feb.-2021	7.776.269	1,08	8.000.000	Medco Strait Services Pte Ltd 'REGS'		
5.500.000	Kaisa Group Holdings Ltd 7,875 % 09-Jun.-2021	5.493.125	0,77		8,500 % 17-Aug.-2022	8.053.003	1,12
Demokratische Republik Kongo - 7.561.415 (31. Dezember 2019: 7.246.211) 7.561.415 1,05				Italien - 14.498.127 (31. Dezember 2019: 8.806.319) 14.498.127 2,02			
7.450.000	HTA Group Ltd/Mauritius 'REGS'			5.000.000	Fabric BC SpA 'REGS' FRN 4,125 % 31-Aug.-2026	5.505.154	0,77
	7,000 % 18-Dez.-2025	7.561.415	1,05	9.000.000	Fire BC SpA 'REGS' FRN 4,750 % 30-Sept.-2024	8.992.973	1,25
Dänemark - 12.110.321 (31. Dezember 2019: 7.468.650) 12.110.321 1,69				Luxemburg - 58.323.595 (31. Dezember 2019: 26.724.775) 58.323.595 8,14			
7.000.000	DKT Finance ApS '144A' 9,375 % 17-Jun.-2023	7.061.250	0,99	5.000.000	Altice Financing SA '144A'		
4.500.000	DKT Finance ApS 'REGS' 7,000 % 17-Jun.-2023	5.049.071	0,70		7,500 % 15-Mai-2026	5.250.125	0,73
Frankreich - 44.615.014 (31. Dezember 2019: 36.990.401) 44.615.014 6,22				10.000.000	Altice Financing SA 'REGS' 2,250 % 15-Jan.-2025	10.603.039	1,48
5.000.000	Altice France SA/France 'REGS'			14.000.000	Altice France Holding SA '144A'		
	2,500 % 15-Jan.-2025	5.369.091	0,75		8,000 % 15-Mai-2027	16.644.204	2,32
9.000.000	Casino Guichard Perrachon SA 'EMTN'			2.300.000	Altice France Holding SA '144A'		
	1,865 % 13-Jun.-2022	9.766.970	1,36		10,500 % 15-Mai-2027	2.543.627	0,36
1.500.000	CGG Holding US Inc 'REGS' 7,875 % 01-Mai-2023	1.716.060	0,24	6.240.000	Altice France Holding SA 'REGS'		
5.000.000	Constantin Investissement 3 SASU 'REGS'				8,000 % 15-Mai-2027	7.438.435	1,04
	5,375 % 15-Apr.-2025	5.660.442	0,79	3.900.000	Groupe Ecore Holding SAS 'REGS' FRN		
8.000.000	Parts Europe SA 'REGS' 4,375 % 01-Mai-2022	8.719.715	1,21		6,250 % 15-Nov.-2023	2.782.350	0,39
4.350.000	Parts Europe SA 'REGS' FRN			3.640.000	INEOS Group Holdings SA '144A'		
	5,500 % 01-Mai-2022	4.721.942	0,66		5,625 % 01-Aug.-2024	3.532.019	0,49
3.500.000	Rubis Terminal Infra SAS 'REGS'			8.626.000	INEOS Group Holdings SA 'REGS'		
	5,625 % 15-Mai-2025	4.072.556	0,57		5,375 % 01-Aug.-2024	9.529.796	1,33
1.870.000	SPCM SA '144A' 4,875 % 15-Sept.-2025	1.890.355	0,26	Mexiko - 16.023.003 (31. Dezember 2019: 11.453.646) 16.023.003 2,23			
				4.926.000	Axtel SAB de CV 'REGS' 6,375 % 14-Nov.-2024	5.128.582	0,71
				4.772.000	CEMEX Finance LLC '144A' 6,000 % 01-Apr.-2024	4.737.689	0,66
				5.530.000	Petroleos Mexicanos 'REGS'		
					3,125 % 27-Nov.-2020	6.156.732	0,86

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Nettovermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Nettovermögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
	Niederlande - 23.909.581				USA Forts.		
	(31. Dezember 2019: 50.715.093)	23.909.581	3,34	2.640.000	Bausch Health Cos Inc '144A'		
2.052.000	Lincoln Financing SARL 'REGS'				5,500 % 01-März-2023	2.649.623	0,37
	3,625 % 01-Apr.-2024	2.120.160	0,30	3.000.000	Bausch Health Cos Inc '144A'		
6.000.000	Lincoln Financing SARL 'REGS' FRN				7,000 % 15-März-2024	3.118.710	0,43
	3,875 % 01-Apr.-2024	6.239.755	0,87	6.500.000	Bausch Health Cos Inc 'REGS'		
3.050.000	Summer BidCo BV 'REGS' 9,750 % 15-Nov.-2025	3.221.077	0,45		4,500 % 15-Mai-2023	7.245.540	1,01
6.816.875	Summer BidCo BV 'REGS' 9,750 % 15-Nov.-2025	7.239.064	1,01	5.000.000	Calpine Corp 5,500 % 01-Feb.-2024	5.003.075	0,70
5.000.000	Ziggo Bond Co BV '144A' 6,000 % 15-Jan.-2027	5.089.525	0,71	7.000.000	CCO Holdings LLC /		
					CCO Holdings Capital Corp '144A'		
	Norwegen - 10.563.147				4,000 % 01-März-2023	7.039.305	0,98
	(31. Dezember 2019: 21.933.712)	10.563.147	1,47	5.000.000	Cincinnati Bell Inc '144A'		
5.000.000	Aker BP ASA '144A' 5,875 % 31-März-2025	5.088.147	0,71		7,000 % 15-Jul.-2024	5.115.575	0,71
6.000.000	DNO ASA '144A' 8,750 % 31-Mai-2023	5.475.000	0,76	5.000.000	Cincinnati Bell Inc '144A'		
					8,000 % 15-Okt.-2025	5.236.975	0,73
	Schweden - 7.566.174			5.000.000	CITGO Petroleum Corp '144A'		
	(31. Dezember 2019: -)	7.566.174	1,06		6,250 % 15-Aug.-2022	4.984.425	0,69
3.900.000	Unilabs Subholding AB 'REGS'			14.000.000	CITGO Petroleum Corp '144A'		
	5,750 % 15-Mai-2025	4.347.696	0,61		7,000 % 15-Jun.-2025	14.052.500	1,96
2.850.000	Verisure Holding AB 'REGS'			7.000.000	Clarios Global LP '144A'		
	3,500 % 15-Mai-2023	3.218.478	0,45		6,750 % 15-Mai-2025	7.301.875	1,02
	Großbritannien - 69.172.717			10.000.000	Cleveland-Cliffs Inc '144A'		
	(31. Dezember 2019: 80.304.557)	69.172.717	9,65		4,875 % 15-Jan.-2024	9.436.450	1,32
10.399.000	CPUK Finance Ltd 'REGS' 4,250 % 28-Aug.-2022	12.450.524	1,74	10.000.000	Cogent Communications Group Inc		
4.233.150	EnQuest Plc '144A' EMTN 7,000 % 15-Apr.-2022	2.582.856	0,36		4,375 % 30-Jun.-2024	11.303.654	1,58
890.000	EnQuest Plc 'EMTN' 7,000 % 15-Apr.-2022	710.071	0,10	3.000.000	Constellium SE '144A' 5,750 % 15-Mai-2024	3.010.935	0,42
3.850.000	INEOS Styrolution Group GmbH 'REGS'			5.554.667	Constellium SE 'REGS' 4,625 % 15-Mai-2021	6.303.080	0,88
	2,250 % 16-Jan.-2027	3.973.752	0,55	7.000.000	CVR Energy Inc '144A' 5,250 % 15-Feb.-2025	6.461.875	0,90
12.800.000	Ithaca Energy North Sea Plc 'REGS'			6.255.000	Global Partners LP / GLP Finance Corp		
	9,375 % 15-Jul.-2024	10.303.872	1,44		7,000 % 15-Jun.-2023	6.035.418	0,84
4.972.067	Punch Taverns Finance B Ltd 'REGS'			3.500.000	Hanesbrands Inc '144A' 5,375 % 15-Mai-2025	3.545.938	0,49
	7,369 % 30-Sept.-2021	6.071.536	0,85	10.600.000	Iron Mountain Inc 5,750 % 15-Aug.-2024	10.734.779	1,50
6.147.000	RAC Bond Co Plc 'REGS' 5,000 % 06-Nov.-2022	7.151.749	1,00	3.000.000	JBS Investments GmbH 'REGS'		
4.150.000	Synlab Bondco Plc 'REGS' FRN				6,250 % 05-Feb.-2023	2.988.435	0,42
	4,750 % 01-Jul.-2025	4.659.778	0,65	13.815.000	JBS USA LUX SA / JBS USA Finance Inc '144A'		
10.245.000	Synlab Unsecured Bondco Plc 'REGS'				5,875 % 15-Jul.-2024	14.026.577	1,96
	8,250 % 01-Jul.-2023	11.860.448	1,65	5.000.000	Kraton Polymers LLC /		
8.222.000	Synthomer Plc 'REGS' 3,875 % 01-Jul.-2025	9.408.131	1,31		Kraton Polymers Capital Corp '144A'		
					7,000 % 15-Apr.-2025	5.042.550	0,70
	USA - 258.809.484			3.500.000	Levi Strauss & Co '144A' 5,000 % 01-Mai-2025	3.525.917	0,49
	(31. Dezember 2019: 206.191.131)	258.809.484	36,10	10.000.000	Nielsen Finance LLC / Nielsen Finance Co '144A'		
5.000.000	Albertsons Cos Inc / Safeway Inc /				5,000 % 15-Apr.-2022	9.974.600	1,39
	New Albertsons LP / Albertsons LLC '144A'			7.615.000	Ovintiv Inc 3,900 % 15-Nov.-2021	7.597.662	1,06
	3,500 % 15-Feb.-2023	5.067.500	0,71	5.000.000	Owens-Brockway Glass Container Inc '144A'		
6.900.000	Alcoa Nederland Holding BV '144A'				5,875 % 15-Aug.-2023	5.163.025	0,72
	6,750 % 30-Sept.-2024	7.068.118	0,99	6.000.000	PBF Holding Co LLC / PBF Finance Corp '144A'		
5.300.000	Ardagh Packaging Finance Plc /				9,250 % 15-Mai-2025	6.416.250	0,89
	Ardagh Holdings USA Inc '144A'			5.000.000	Refinitiv US Holdings Inc '144A'		
	5,250 % 30-Apr.-2025	5.442.385	0,76		8,250 % 15-Nov.-2026	5.419.925	0,76
4.722.000	Ardagh Packaging Finance Plc /			8.220.000	Reynolds Group Issuer Inc /		
	Ardagh Holdings USA Inc '144A'				Reynolds Group Issuer LLC /		
	6,000 % 15-Feb.-2025	4.846.755	0,68		Reynolds Group Issuer Lu '144A' FRN		
7.000.000	Avantor Inc '144A' 6,000 % 01-Okt.-2024	7.322.000	1,02		4,719 % 15-Jul.-2021	8.181.489	1,14
7.300.000	Avantor Inc '144A' 9,000 % 01-Okt.-2025	7.856.625	1,10	1.950.000	Transocean Proteus Ltd '144A'		
5.000.000	Avantor Inc 'REGS' 4,750 % 01-Okt.-2024	5.806.668	0,81		6,250 % 01-Dez.-2024	1.803.750	0,25
4.497.000	Axalta Coating Systems LLC 'REGS'			4.350.000	USG Corp '144A' 5,500 % 01-März-2025	4.392.151	0,61
	4,250 % 15-Aug.-2024	5.029.490	0,70	8.192.000	XPO Logistics Inc '144A' 6,500 % 15-Jun.-2022	8.220.467	1,15
8.500.000	Bausch Health Americas Inc '144A'						
	8,500 % 31-Jan.-2027	9.037.413	1,26				
				Summe der Anlagen in Anleihen		652.636.524	91,03

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %	Devisenterminkontrakte						Nicht realisierter
Bestände	Beschreibung			Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Gewinn/(Verlust)
Leveraged Loans				BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund						
1.000.000	Niederlande - 1.117.181 (31. Dezember 2019: –)	1.117.181	0,16	Euro	US-Dollar	1.844.000	2.066.364	01-Jul.-20	Morgan Stanley	5.371
	Nielsen Holding & Finance BV Term Loan			Euro	US-Dollar	12.526.000	13.805.090	01-Jul.-20	Goldman Sachs	267.881
	0,000 % 30-Jun.-2025	1.117.181	0,16	Euro	US-Dollar	6.621.000	7.151.614	01-Jul.-20	Bank of America Merrill Lynch	287.085
7.000.000	Norwegen - 7.864.506 (31. Dezember 2019: 7.851.904)	7.864.506	1,10	US-Dollar	Euro	4.095.114	3.636.000	01-Jul.-20	Goldman Sachs	10.065
	INEOS Rafnes AS 0,000 % 08-Nov.-2024	7.864.506	1,10	Euro	US-Dollar	2.236.000	2.505.134	20-Jul.-20	Bank of America Merrill Lynch	8.065
				US-Dollar	Euro	2.292.116	2.027.000	20-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	13.827
5.000.000	Schweden - 5.483.499 (31. Dezember 2019: –)	5.483.499	0,76	US-Dollar	Euro	3.425.185	3.006.000	20-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	46.529
	Verisure Holding AB Term Loan			US-Dollar	Euro	950.972	840.000	20-Jul.-20	Bank of America Merrill Lynch	6.836
	0,000 % 10-Okt.-2022	5.483.499	0,76	US-Dollar	Euro	9.437.243	8.347.000	20-Jul.-20	Bank of America Merrill Lynch	55.460
5.000.000 3.753.906	Großbritannien - 9.696.805 (31. Dezember 2019: 4.489.607)	9.696.805	1,35	US-Dollar	Euro	235.164	208.000	20-Jul.-20	Morgan Stanley	1.379
	Froneri Plc Term Loan 0,000 % 31-Jan.-2028	5.584.726	0,78	US-Dollar	Sterling	2.411.574	1.905.000	03-Aug.-20	Goldman Sachs	50.561
	INEOS Enterprises Holdings II Ltd			US-Dollar	Euro	3.343.802	2.943.000	06-Aug.-20	Citigroup Global Markets Limited	34.672
7.500.000				US-Dollar	Euro	5.526.143	4.863.000	06-Aug.-20	Bank of America Merrill Lynch	58.150
	0,000 % 03-Sept.-2024	4.112.079	0,57	US-Dollar	Euro	3.288.850	2.921.000	19-Aug.-20	Bank of America Merrill Lynch	3.520
				US-Dollar	Euro	2.359.470	2.090.000	19-Aug.-20	Barclays Bank PLC	8.789
7.000.000	USA - 19.810.361 (31. Dezember 2019: 12.683.110)	19.810.361	2,76	US-Dollar	Euro	55.032.782	48.573.000	19-Aug.-20	Barclays Bank PLC	401.372
	Berry Global Inc Term Loan			US-Dollar	Euro	61.142.350	54.134.000	14-Sept.-20	Barclays Bank PLC	220.788
	0,000 % 01-Okt.-2022	7.331.662	1,02							
4.974.811	PG&E Corp Term Loan 0,000 % 31-Dez.-2020	6.985.405	0,97							
	Refinitiv US Holdings Inc 0,000 % 01-Okt.-2025	5.493.294	0,77							
Summe der Anlagen in Leveraged Loans		43.972.352	6,13							
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 1.614.579 (siehe unten) 31. Dezember 2019: 4.062.199)		1.614.579	0,23							
Summe der Vermögenswerte zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert		738.259.996	102,98							
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften - (14.315.792) (siehe unten) 31. Dezember 2019: (3.527.822))		(14.315.792)	(2,00)							
Summe der finanziellen Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert		(14.315.792)	(2,00)							
Laufende Nettoverbindlichkeiten		(6.989.561)	(0,98)							
Summe der Nettovermögen		716.954.643	100,00							
Portfolioanalyse		% des Gesamtvermögens								
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten										
Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		91,05								
Nicht an einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten										
Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		5,78								
OTC-Finanzderivate		0,21								
Sonstiges Umlaufvermögen		2,96								
Summe der Aktiva		100,00								

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte Forts.							Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund							BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund						
Anteilsklasse CHF W (Acc) (Hedged)							Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged) Forts.						
Schweizer Franken	US-Dollar	23.768.483	25.046.737	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	50.336	US-Dollar	Euro	106.369	94.714	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(74)
							US-Dollar	Euro	78.866	70.258	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(92)
						USD						USD	(961.949)
						CHF						EUR	(856.207)
												Netto USD	(953.702)
												Netto EUR	(848.867)
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund							BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund						
Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)							Anteilsklasse EUR H (Inc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	94.714	106.340	01-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	71	US-Dollar	Euro	23.918	21.239	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	48
US-Dollar	Euro	33.695	29.988	02-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	4						USD	48
Euro	US-Dollar	89.804	100.510	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	416						EUR	43
Euro	US-Dollar	7.500	8.419	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	10							
US-Dollar	Euro	241.805	213.830	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	1.494	Euro	US-Dollar	1.876.446	2.131.702	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(22.876)
US-Dollar	Euro	170.570	151.465	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	348						USD	(22.876)
US-Dollar	Euro	253.294	225.307	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	84						EUR	(20.361)
US-Dollar	Euro	308.004	273.422	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	722						Netto USD	(22.828)
US-Dollar	Euro	39.488	34.879	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	290						Netto EUR	(20.318)
US-Dollar	Euro	47.439	42.127	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	96							
US-Dollar	Euro	153.104	134.321	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	2.149							
US-Dollar	Euro	31.098	27.412	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	292							
US-Dollar	Euro	314.514	278.169	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	1.897							
US-Dollar	Euro	103.793	92.348	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	9							
US-Dollar	Euro	228.235	202.760	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	365							
						USD							
						EUR							
Euro	US-Dollar	92.348	103.767	02-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(14)							
Euro	US-Dollar	19.990	22.518	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(53)						USD	197
Euro	US-Dollar	34.636	39.213	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(288)						EUR	175
Euro	US-Dollar	69.748	78.874	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(489)							
Euro	US-Dollar	15.000	16.960	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(102)	Euro	US-Dollar	61.224	69.236	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(429)
Euro	US-Dollar	78.770.066	89.485.267	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(960.301)	Euro	US-Dollar	14.201.790	16.133.679	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(173.137)
Euro	US-Dollar	29.988	33.704	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(3)						USD	(173.566)
US-Dollar	Euro	84.715	75.692	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(350)						EUR	(154.487)
US-Dollar	Euro	70.162	62.593	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(183)						Netto USD	(173.369)
												Netto EUR	(154.312)

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte Forts.							Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund							BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund						
Anteilsklasse EUR I (Inc) (Hedged)							Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged) Forts.						
Euro	US-Dollar	619.271	703.512	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(7.550)	Euro	US-Dollar	1.536	1.751	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(25)
						USD (7.550)	Euro	US-Dollar	7.342	8.329	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(78)
						EUR (6.720)	Euro	US-Dollar	104	118	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1)
							Euro	US-Dollar	63.797.909	72.476.426	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(777.772)
							US-Dollar	Euro	1.563	1.397	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(6)
							US-Dollar	Euro	36.542	32.600	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(95)
							US-Dollar	Euro	74.410	66.256	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(52)
							US-Dollar	Euro	7.561	6.736	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(9)
												USD (779.908)	
												EUR (694.177)	
												Netto USD (736.785)	
												Netto EUR (655.794)	
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund							BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund						
Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)							Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	66.256	74.389	01-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	50	Euro	US-Dollar	1.101.583	1.251.433	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(13.430)
Euro	US-Dollar	7.896	8.868	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	6						USD (13.430)	
Euro	US-Dollar	20.020	22.473	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	26						EUR (11.954)	
Euro	US-Dollar	5.037	5.638	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	23							
US-Dollar	Euro	41.877	37.186	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	85							
US-Dollar	Euro	102.989	91.610	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	34							
US-Dollar	Euro	57.905	51.404	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	136							
US-Dollar	Euro	5.537.030	4.890.711	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	40.653							
US-Dollar	Euro	61.462	54.579	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	124							
US-Dollar	Euro	14.764	13.056	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	92							
US-Dollar	Euro	71.122	62.396	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	998							
US-Dollar	Euro	61.983	54.636	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	581							
US-Dollar	Euro	18.975	16.883	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	2							
US-Dollar	Euro	33.315	29.597	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	53							
US-Dollar	Euro	42.144	37.269	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	260							
						USD 43.123							
						EUR 38.383							
							BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund						
							Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)						
							Sterling	US-Dollar	5.514	6.804	01-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	28
							Sterling	US-Dollar	8.149	10.017	02-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	80
							Sterling	US-Dollar	25.469	31.310	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	251
							Sterling	US-Dollar	39.996	49.435	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	129
							Sterling	US-Dollar	17.985	22.196	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	92
							US-Dollar	Sterling	17.673	14.226	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	44
							US-Dollar	Sterling	19.423	15.252	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	522
							US-Dollar	Sterling	59.521	46.751	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	1.586
							US-Dollar	Sterling	22.737	17.805	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	673
							US-Dollar	Sterling	9.763	7.750	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	159
							US-Dollar	Sterling	248.641	197.410	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	4.008
							US-Dollar	Sterling	34.508	27.786	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	76

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte Forts.							Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund							BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund						
Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged) Forts.							Anteilsklasse Sterling W (Inc) (Hedged)						
US-Dollar	Sterling	74.819	59.512	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	1.071	Sterling	US-Dollar	1	2	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	-
US-Dollar	Sterling	52.842	42.102	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	669	US-Dollar	Sterling	13.267	10.570	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	168
US-Dollar	Sterling	86.762	69.869	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	179	US-Dollar	Sterling	136.402	108.978	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	1.355
US-Dollar	Sterling	11.764	9.439	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	68							USD 1.523
US-Dollar	Sterling	10.822	8.641	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	115							GBP 1.229
US-Dollar	Sterling	15.424	12.323	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	153							
						USD 9.903							
						GBP 7.992							
US-Dollar	Sterling	22.194	17.985	01-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(92)							
US-Dollar	Sterling	31.308	25.469	02-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(251)							Netto USD (77.478)
Sterling	US-Dollar	15.052	18.699	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(47)							Netto GBP (62.528)
Sterling	US-Dollar	8.171	10.148	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(22)							
Sterling	US-Dollar	49.240	61.631	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(612)							
Sterling	US-Dollar	23.451	29.229	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(168)							
Sterling	US-Dollar	13.907	17.710	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(476)							USD (1.917.413)
Sterling	US-Dollar	29.005	36.405	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(461)							GBP (1.547.423)
Sterling	US-Dollar	53.892	66.922	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(138)							
Sterling	US-Dollar	120.122	151.295	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(2.439)							
Sterling	US-Dollar	46.830	58.655	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(622)							
Sterling	US-Dollar	1.018.397	1.282.879	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(20.867)							USD 1.910
Sterling	US-Dollar	1.519.554	1.940.475	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(57.421)							GBP 1.541
Sterling	US-Dollar	26.725	34.025	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(907)							
Sterling	US-Dollar	28.483	35.809	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(513)							
Sterling	US-Dollar	34.421.039	43.749.408	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1.094.339)	Sterling	US-Dollar	8.041.529	10.220.846	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(255.662)
US-Dollar	Sterling	6.804	5.514	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(28)							USD (255.662)
US-Dollar	Sterling	10.018	8.149	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(80)							GBP (206.329)
US-Dollar	Sterling	8.834	7.147	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(23)							Netto USD (253.752)
						USD (1.179.506)							Netto GBP (204.788)
						GBP (951.905)							
						Netto USD (1.169.603)							
						Netto GBP (943.913)							

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte Forts.							Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund							BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund						
Anteilsklasse Sterling Z (Acc) (Hedged)							Anteilsklasse Sterling Z (Inc) (Hedged) Forts.						
Sterling	US-Dollar	18.461	22.695	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	182	US-Dollar	Sterling	39.925	32.152	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	82
Sterling	US-Dollar	13.526	16.692	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	69	US-Dollar	Sterling	124.234	99.676	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	714
US-Dollar	Sterling	12.429	9.868	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	200	US-Dollar	Sterling	63.146	50.451	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	627
					USD	451	US-Dollar	Sterling	28.687	23.099	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	63
					GBP	364	US-Dollar	Sterling	14.116	11.363	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	35
							US-Dollar	Sterling	68.079	53.460	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	1.831
US-Dollar	Sterling	16.691	13.526	01-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(69)						USD	18.491
US-Dollar	Sterling	22.693	18.461	02-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(182)						GBP	14.923
Sterling	US-Dollar	3.127	3.885	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(10)							
Sterling	US-Dollar	356	446	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(4)	US-Dollar	Sterling	35.699	28.930	01-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(148)
Sterling	US-Dollar	1.389	1.731	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(10)	US-Dollar	Sterling	15.756	12.818	02-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(126)
Sterling	US-Dollar	21.067	26.161	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(54)	Sterling	US-Dollar	45.525	56.557	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(142)
Sterling	US-Dollar	22.097	28.133	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(750)	Sterling	US-Dollar	61.551	76.442	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(167)
Sterling	US-Dollar	2.336.379	2.969.556	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(74.280)	Sterling	US-Dollar	19.994	25.025	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(248)
					USD	(75.359)	Sterling	US-Dollar	36.055	44.938	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(258)
					GBP	(60.818)	Sterling	US-Dollar	34.302	43.683	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1.175)
					Netto USD	(74.908)	Sterling	US-Dollar	43.481	54.573	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(691)
					Netto GBP	(60.454)	Sterling	US-Dollar	66.442	82.506	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(170)
							Sterling	US-Dollar	35.459	44.661	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(720)
							Sterling	US-Dollar	37.332	46.759	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(496)
							Sterling	US-Dollar	101.537	127.906	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(2.080)
							Sterling	US-Dollar	97.536	124.554	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(3.686)
							Sterling	US-Dollar	118.717	151.144	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(4.028)
							Sterling	US-Dollar	99.414	124.984	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1.789)
							Sterling	US-Dollar	71.966.185	91.469.580	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(2.288.002)
							US-Dollar	Sterling	10.484	8.483	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(27)
							US-Dollar	Sterling	7.411	6.005	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(31)
							US-Dollar	Sterling	10.574	8.602	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(85)
												USD (2.304.069)	
												GBP (1.859.469)	
												Netto USD (2.285.578)	
												Netto GBP (1.844.546)	
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund													
Anteilsklasse Sterling Z (Inc) (Hedged)													
Sterling	US-Dollar	6.005	7.411	01-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	31							
Sterling	US-Dollar	8.602	10.573	02-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	85							
Sterling	US-Dollar	28.930	35.702	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	148							
Sterling	US-Dollar	12.818	15.757	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	126							
Sterling	US-Dollar	22.879	28.278	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	74							
US-Dollar	Sterling	303.307	238.234	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	8.083							
US-Dollar	Sterling	111.996	87.702	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	3.314							
US-Dollar	Sterling	48.012	38.114	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	781							
US-Dollar	Sterling	91.683	73.200	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	973							
US-Dollar	Sterling	44.527	35.352	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	718							
US-Dollar	Sterling	24.012	19.099	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	344							
US-Dollar	Sterling	36.455	29.045	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	462							

BNY MELLON GLOBAL UNCONSTRAINED FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Nettovermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Nettovermögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen				Anleihen Forts.			
	Irland - 1.675.623				USA Forts.		
	(31. Dezember 2019: 1.258.661)	1.675.623	7,18	375.199	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,500 % 15-Apr.-2024	394.422	1,69
42.260	iShares Physical Gold ETC	1.462.407	6,27	452.357	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 3,375 % 15-Apr.-2032	674.747	2,89
839	iShares USD Corp Bond UCITS ETF - ETF	107.425	0,46	100.000	United States Treasury Note/Bond 1,500 % 15-Aug.-2026	106.613	0,46
1.014	iShares USD Short Duration Corp Bond UCITS ETF - ETF	105.791	0,45	280.000	United States Treasury Note/Bond 1,500 % 15-Feb.-2030	303.133	1,30
Norwegen - 90.015				625.900	United States Treasury Note/Bond 2,000 % 15-Feb.-2025	675.886	2,89
	(31. Dezember 2019: 96.667)	90.015	0,38	332.000	United States Treasury Note/Bond 2,375 % 15-Mai-2029	383.694	1,64
79.906	Aquila European Renewables Income Fund Plc/The Fund	90.015	0,38	60.000	United States Treasury Note/Bond 2,875 % 15-Mai-2043	78.770	0,34
Summe der Anlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen 1.765.638 7,56				Summe der Anlagen in Anleihen 5.016.885 21,49			
Anleihen				Aktien			
	Australien - 588.902				Australien - 226.357		
	(31. Dezember 2019: 578.447)	588.902	2,52		(31. Dezember 2019: 308.209)	226.357	0,97
280.000	Australia Government Bond 3,000 % 21-März-2047	244.285	1,05	57.328	Insurance Australia Group Ltd	226.357	0,97
440.000	New South Wales Treasury Corp 3,000 % 20-März-2028	344.617	1,47	Kanada - 284.067			
Österreich - 361.623					(31. Dezember 2019: 704.465)	284.067	1,22
	(31. Dezember 2019: 341.139)	361.623	1,55	2.428	Intact Financial Corp	227.518	0,98
190.000	Republic of Austria Government Bond '144A' 3,150 % 20-Jun.-2044	361.623	1,55	3.333	Suncor Energy Inc	56.549	0,24
Kolumbien - 184.260				Cayman-Inseln - 338.617			
	(31. Dezember 2019: 202.988)	184.260	0,79		(31. Dezember 2019: -)	338.617	1,45
608.000.000	Colombia Government International Bond 'REGS' 7,500 % 26-Aug.-2026	184.260	0,79	1.575	Alibaba Group Holding Ltd ADR	338.617	1,45
Deutschland - 221.301				China - 327.615			
	(31. Dezember 2019: 233.865)	221.301	0,95		(31. Dezember 2019: 140.795)	327.615	1,40
100.000	Infineon Technologies AG 'EMTN' FRN (Immerwährend) 2,875 % 01-Jan.-2025	109.763	0,47	15.500	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	154.898	0,66
100.000	Infineon Technologies AG FRN (Immerwährend) 3,625 % 01-Jan.-2028	111.538	0,48	1.870	Prosus NV	172.717	0,74
Japan - 106.469				Frankreich - 542.182			
	(31. Dezember 2019: 217.738)	106.469	0,46		(31. Dezember 2019: -)	542.182	2,32
11.513.202	Japanese Government CPI Linked Bond 0,100 % 10-März-2028	106.469	0,46	6.586	Bureau Veritas SA	139.082	0,59
Mexiko - 295.465				1.771	Thales SA	144.318	0,62
	(31. Dezember 2019: 465.266)	295.465	1,26	10.040	Vivendi SA	258.782	1,11
3.790.000	Mexican Bonos 8,000 % 07-Nov.-2047	183.093	0,78	Deutschland - 930.224			
2.200.000	Mexican Bonos 8,500 % 31-Mai-2029	112.372	0,48		(31. Dezember 2019: 646.376)	930.224	3,99
Neuseeland - 289.293				1.904	Brenntag AG	100.062	0,43
	(31. Dezember 2019: 292.512)	289.293	1,24	1.678	Continental AG	164.350	0,71
320.000	New Zealand Government Inflation Linked Bond 3,000 % 20-Sept.-2030	289.293	1,24	2.036	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	173.147	0,74
Spanien - 204.514				3.567	SAP SE	492.665	2,11
	(31. Dezember 2019: 206.651)	204.514	0,88	Hongkong - 464.098			
130.000	Spain Government Bond '144A' 5,150 % 31-Okt.-2028	204.514	0,88		(31. Dezember 2019: 601.079)	464.098	1,99
USA - 2.765.058				49.800	AIA Group Ltd	464.098	1,99
	(31. Dezember 2019: 3.663.302)	2.765.058	11,84	Irland - 170.330			
100.000	American Airlines Inc '144A' 11,750 % 15-Jul.-2025	95.500	0,41		(31. Dezember 2019: 169.195)	170.330	0,73
47.000	T-Mobile USA Inc '144A' 3,875 % 15-Apr.-2030	52.293	0,22	126.106	Greencoat Renewables Plc	170.330	0,73
				Japan - 1.492.809			
					(31. Dezember 2019: 1.889.175)	1.492.809	6,39
				12.300	Ebara Corp	288.035	1,23
				4.300	M3 Inc	183.291	0,79

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener Wert				Angemessener Wert	
		in USD		Summe der Nettovermögen %		in USD	
Bestände	Beschreibung			Bestände	Beschreibung		
Aktionen Forts.							
Japan Forts.							
6.300	Recruit Holdings Co Ltd	215.097	0,92	3.602	Microsoft Corp	714.871	3,06
6.100	Sony Corp	417.754	1,79	3.217	Toll Brothers Inc	101.030	0,43
8.400	Suzuki Motor Corp	285.003	1,22				
12.900	Topcon Corp	103.629	0,44				
Neuseeland - 105.975 (31. Dezember 2019: -)							
67.133	SKYCITY Entertainment Group Ltd	105.975	0,46				
Norwegen - 163.258 (31. Dezember 2019: 229.236)							
12.275	DNB ASA	163.258	0,70				
Republik Korea - 805.958 (31. Dezember 2019: 771.443)							
11.824	Samsung Electronics Co Ltd - Preference	457.586	1,96				
1.152	Samsung SDI Co Ltd	348.372	1,49				
Südafrika - 341.630 (31. Dezember 2019: 305.148)							
1.870	Naspers Ltd	341.630	1,46				
Schweiz - 1.135.069 (31. Dezember 2019: 1.533.640)							
2.774	Alcon Inc	158.902	0,68				
4.490	Novartis AG	390.097	1,67				
1.239	Roche Holding AG	428.869	1,84				
449	Zurich Insurance Group AG	157.201	0,67				
Thailand - 86.706 (31. Dezember 2019: -)							
28.700	Kasikornbank PCL (Foreign Market)	86.706	0,37				
Großbritannien - 1.566.950 (31. Dezember 2019: 2.369.460)							
16.952	BAE Systems Plc	101.498	0,43				
5.346	CRH Plc	182.756	0,78				
4.263	Ferguson Plc	346.078	1,48				
28.107	Informa Plc	162.270	0,70				
1.332	Linde Plc	281.345	1,21				
23.503	Prudential Plc	352.561	1,51				
9.202	Royal Dutch Shell Plc	140.442	0,60				
USA - 5.888.173 (31. Dezember 2019: 4.475.603)							
4.544	Abbott Laboratories	404.507	1,73				
1.805	Accenture Plc - A-Klasse	384.050	1,64				
2.500	Albemarle Corp	190.888	0,82				
359	Alphabet Inc - A-Klasse	501.733	2,15				
126	Amazon.com Inc	337.868	1,45				
1.623	Apple Inc	587.477	2,52				
7.189	Applied Materials Inc	424.618	1,82				
7.419	Citigroup Inc	373.213	1,60				
1.033	Ecolab Inc	201.993	0,86				
1.057	Goldman Sachs Group Inc/The	204.619	0,88				
23.686	Laureate Education Inc - A-Klasse	234.847	1,00				
2.603	Lennar Corp	158.679	0,68				
1.367	Mastercard Inc	400.729	1,72				
3.179	Medtronic Plc	286.984	1,23				
4.993	Merck & Co Inc	380.067	1,63				
Summe der Anlagen in Aktien				14.870.018 63,69			
Instrumente für Aktienanlagen							
Großbritannien - 918.341 (31. Dezember 2019: -)							
126.541	Greencoat UK Wind Plc/Funds	222.505	0,95				
488.862	Hipgnosis Songs Fund Ltd/The Fund	695.836	2,98				
Summe der Anlagen in Instrumente für Aktienanlagen				918.341 3,93			
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 19.249 (siehe unten) 31. Dezember 2019: 377.800)							
				19.249 0,08			
Summe der Vermögenswerte zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert							
				22.590.131 96,75			
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften - (484.511) (siehe unten) 31. Dezember 2019: (102.650))							
				(484.511) (2,07)			
Summe der finanziellen Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert							
				(484.511) (2,07)			
Nettoumlaufvermögen				1.242.958 5,32			
Summe der Nettovermögen				23.348.578 100,00			
Portfolioanalyse % des Gesamtvermögens							
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente							
				94,65			
OTC-Finanzderivate							
				0,08			
Sonstiges Umlaufvermögen							
				5,27			
Summe der Aktiva				100,00			

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte							Nicht
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent		realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Global Unconstrained Fund							
US-Dollar	Japanischer Yen	1.023	109.650	01-Jul.-20	Royal Bank of Scotland		5
US-Dollar	Sterling	935.781	761.000	15-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank		1.914
Ungarischer Forint	US-Dollar	6.271.819	19.226	14-Aug.-20	HSBC Bank plc		492
Ungarischer Forint	US-Dollar	7.180.587	22.130	14-Aug.-20	HSBC Bank plc		446
Ungarischer Forint	US-Dollar	4.492.911	13.877	14-Aug.-20	The Bank of New York Mellon		249
Ungarischer Forint	US-Dollar	5.069.554	15.604	14-Aug.-20	State Street Bank		335
Ungarischer Forint	US-Dollar	2.786.082	8.601	14-Aug.-20	HSBC Bank plc		158
US-Dollar	Australischer Dollar	491.675	703.304	15-Sept.-20	HSBC Bank plc		9.879
US-Dollar	Japanischer Yen	223.695	23.970.889	15-Sept.-20	HSBC Bank plc		979
USD							14.457
US-Dollar	Euro	610.326	562.945	14-Aug.-20	Barclays Bank PLC		(21.286)
US-Dollar	Ungarischer Forint	79.654	25.800.952	14-Aug.-20	Barclays Bank PLC		(1.464)
US-Dollar	Neuseeländischer Dollar	247.037	409.232	14-Aug.-20	State Street Bank		(15.041)
USD							(37.791)
Netto USD							(23.334)
BNY Mellon Global Unconstrained Fund							
Anteilsklasse CAD X (Acc) (Hedged)							
US-Dollar	Kanadischer Dollar	722.263	981.469	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		4.792
USD							4.792
CAD							6.555
Kanadischer Dollar	US-Dollar	825.596	611.030	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		(7.505)
Kanadischer Dollar	US-Dollar	32.589.792	24.262.683	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		(438.981)
US-Dollar	Kanadischer Dollar	478.599	655.022	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		(234)
USD							(446.720)
CAD							(611.113)
Netto USD							(441.928)
Netto CAD							(604.558)

BNY MELLON JAPAN SMALL CAP EQUITY FOCUS FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in JPY	Summe der Netto- vermögen %	Beschreibung	Angemessener Wert in JPY	Summe der Netto- vermögen %
Aktien				Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften - (15.556.005) (siehe unten) 31. Dezember 2019: (641.256))		
	Kommunikationsdienstleistungen - 1.482.054.500 (31. Dezember 2019: 2.126.352.150)	1.482.054.500	12,04		(15.556.005)	(0,13)
113.900	Atrae Inc	358.500.250	2,91	Summe der finanziellen Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert	(15.556.005)	(0,13)
183.300	Itokuro Inc	245.163.750	1,99			
582.900	Vector Inc	507.997.350	4,13	Nettoumlaufvermögen	411.972.219	3,35
545.900	Vision Inc/Tokyo Japan	370.393.150	3,01			
	Luxusgüter - 1.774.157.950 (31. Dezember 2019: 3.013.585.650)	1.774.157.950	14,42	Summe der Nettovermögen	12.306.565.258	100,00
72.900	Arata Corp	353.565.000	2,87	Portfolioanalyse % des Gesamtvermögens		
190.900	Nifco Inc/Japan	438.210.950	3,56	An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten		
319.300	Resorttrust Inc	444.944.550	3,62	Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		96,47
50.200	Tomy Co Ltd	42.720.200	0,35	OTC-Finanzderivate		0,04
849.300	Yonex Co Ltd	494.717.250	4,02	Sonstiges Umlaufvermögen		3,49
	Verbrauchsgüter - 494.200.000 (31. Dezember 2019: 535.074.000)	494.200.000	4,02	Summe der Aktiva		100,00
70.000	Ain Holdings Inc	494.200.000	4,02			
	Finanzwerte - 1.369.854.050 (31. Dezember 2019: 1.556.690.550)	1.369.854.050	11,13			
95.000	Anicom Holdings Inc	435.100.000	3,53			
255.900	Premium Group Co Ltd	482.243.550	3,92			
111.800	Zenkoku Hoshio Co Ltd	452.510.500	3,68			
	Industriewerte - 1.793.765.900 (31. Dezember 2019: 2.079.165.750)	1.793.765.900	14,57			
52.000	BayCurrent Consulting Inc	465.140.000	3,78			
160.400	Insource Co Ltd	423.857.000	3,44			
372.000	Penta-Ocean Construction Co Ltd	215.946.000	1,76			
213.900	Takeuchi Manufacturing Co Ltd	383.094.900	3,11			
112.400	Totetsu Kogyo Co Ltd	305.728.000	2,48			
	Informationstechnologie - 3.592.469.900 (31. Dezember 2019: 3.869.357.500)	3.592.469.900	29,19			
161.500	Anritsu Corp	413.278.500	3,36			
80.800	BrainPad Inc	370.266.000	3,01			
403.000	MCJ Co Ltd	345.371.000	2,81			
179.400	m-up Holdings Inc	433.340.700	3,52			
235.000	Osaki Electric Co Ltd	118.792.500	0,96			
146.900	RS Technologies Co Ltd	506.805.000	4,12			
174.800	Sanken Electric Co Ltd	371.275.200	3,02			
280.000	TechMatrix Corp	523.320.000	4,25			
929.000	Wacom Co Ltd	510.021.000	4,14			
	Materialien - 932.286.900 (31. Dezember 2019: 1.068.275.600)	932.286.900	7,58			
124.900	Dowa Holdings Co Ltd	408.423.000	3,32			
509.100	Sakata INX Corp	523.863.900	4,26			
	Versorger - 466.784.000 (31. Dezember 2019: 661.393.500)	466.784.000	3,79			
100.600	Nippon Gas Co Ltd	466.784.000	3,79			
Summe der Anlagen in Aktien		11.905.573.200	96,74			
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 4.575.844 (siehe unten) 31. Dezember 2019: 80.379.200)						
		4.575.844	0,04			
Summe der Vermögenswerte zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert		11.910.149.044	96,78			

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte							Devisenterminkontrakte Forts.							
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse CHF E (Acc) (Hedged)							BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse EUR H (Hedged)							
Japanischer Yen	Schweizer Franken	9.833.767	86.458	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	32.120	Japanischer Yen	Euro	7.782.538	64.289	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	17.620	
Schweizer Franken	Japanischer Yen	164.770	18.642.781	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	37.033	Japanischer Yen	Euro	2.874.814	23.775	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	3.273	
Schweizer Franken	Japanischer Yen	4.200	476.116	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	19	Japanischer Yen	Euro	8.161.989	67.455	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	14.693	
						JPY							JPY	73.752
						CHF							EUR	611
Japanischer Yen	Schweizer Franken	10.881.531	96.005	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(2.460)								
Japanischer Yen	Schweizer Franken	774.792	6.839	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(540)								
Japanischer Yen	Schweizer Franken	1.039.935	9.195	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(2.504)	Euro	Japanischer Yen	109.693	13.260.903	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(12.095)	
Japanischer Yen	Schweizer Franken	11.413.576	101.007	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(37.495)	Euro	Japanischer Yen	963	117.356	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1.104)	
Japanischer Yen	Schweizer Franken	9.718.559	86.092	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(41.581)	Euro	Japanischer Yen	2.756.028	336.728.647	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(3.852.874)	
Schweizer Franken	Japanischer Yen	4.129.190	468.626.568	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(503.471)							JPY (3.866.073)	
						JPY							EUR	(32.013)
						CHF							Netto JPY (3.792.321)	
						Netto JPY							Netto EUR	(31.402)
						Netto CHF								
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse EUR G (Acc) (Hedged)							BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Anteilsklasse EUR I (Hedged)							
Japanischer Yen	Euro	2.564.852	21.187	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	5.807	Japanischer Yen	Euro	11.259.552	93.012	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	25.493	
Japanischer Yen	Euro	2.684.856	22.189	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	4.833	Japanischer Yen	Euro	11.786.360	97.409	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	21.217	
Japanischer Yen	Euro	2.316.396	19.170	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	967	Japanischer Yen	Euro	10.168.844	84.157	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	4.241	
Japanischer Yen	Euro	2.310.750	19.036	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	11.597	Japanischer Yen	Euro	10.144.043	83.566	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	50.910	
						JPY							JPY	101.861
						EUR							EUR	843
Euro	Japanischer Yen	36.226	4.379.414	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(3.995)	Euro	Japanischer Yen	159.030	19.225.372	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(17.536)	
Euro	Japanischer Yen	909.768	111.154.508	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1.271.838)	Euro	Japanischer Yen	3.993.829	487.961.832	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(5.583.294)	
						JPY (1.275.833)							JPY (5.600.830)	
						EUR (10.565)							EUR (46.378)	
						Netto JPY (1.252.629)							Netto JPY (5.498.969)	
						Netto EUR (10.373)							Netto EUR (45.535)	

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte Forts.							Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund							BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund						
Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)							Anteilsklasse NOK W (Acc) (Hedged)						
Japanischer Yen	Euro	1.832.798	15.140	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	4.150	Japanischer Yen	Norwegische Krone	250.346	22.566	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	578
Japanischer Yen	Euro	1.923.910	15.900	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	3.463	Japanischer Yen	Norwegische Krone	268.045	24.007	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	2.330
Japanischer Yen	Euro	1.660.681	13.744	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	693	Japanischer Yen	Norwegische Krone	236.380	21.219	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	1.519
Japanischer Yen	Euro	1.656.066	13.643	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	8.311	Japanischer Yen	Norwegische Krone	232.170	20.735	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	2.665
						JPY							JPY
						EUR							NOK
						138							641
Euro	Japanischer Yen	25.985	3.141.299	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(2.866)	Norwegische Krone	Japanischer Yen	38.594	432.739	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(5.574)
Euro	Japanischer Yen	652.435	79.713.799	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(912.091)	Norwegische Krone	Japanischer Yen	979.093	11.337.153	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(500.296)
						JPY							JPY
						(914.957)							(505.870)
						EUR							NOK
						(7.576)							(45.699)
						Netto JPY							Netto JPY
						(898.340)							(498.778)
						Netto EUR							Netto NOK
						(7.438)							(45.058)
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund							BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund						
Anteilsklasse NOK H (Acc) (Hedged)							Anteilsklasse SEK H (Acc) (Hedged)						
Japanischer Yen	Norwegische Krone	255.553	23.036	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	590	Japanischer Yen	Schwedische Krone	290.928	25.191	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	1.240
Japanischer Yen	Norwegische Krone	269.782	24.162	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	2.345	Japanischer Yen	Schwedische Krone	261.343	22.673	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	614
Japanischer Yen	Norwegische Krone	237.341	21.306	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	1.526	Schwedische Krone	Japanischer Yen	42.801	489.902	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	2.292
Japanischer Yen	Norwegische Krone	233.510	20.855	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	2.680							JPY
						JPY							SEK
						7.141							361
						NOK							
						645	Japanischer Yen	Schwedische Krone	303.849	26.448	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(295)
Norwegische Krone	Japanischer Yen	38.653	433.400	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(5.582)	Japanischer Yen	Schwedische Krone	262.103	22.793	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(10)
Norwegische Krone	Japanischer Yen	981.551	11.365.617	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(501.552)	Schwedische Krone	Japanischer Yen	1.076.820	12.621.716	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(238.808)
						JPY							JPY
						(507.134)							(239.113)
						NOK							SEK
						(45.814)							(20.793)
						Netto JPY							Netto JPY
						(499.993)							(234.967)
						Netto NOK							Netto SEK
						(45.169)							(20.432)

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte Forts.							Nicht realisierter
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Gewinn/(Verlust)	
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund							
Anteilsklasse SEK W (Acc) (Hedged)							
Japanischer Yen	Schwedische Krone	285.459	24.718	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	1.217	
Japanischer Yen	Schwedische Krone	260.210	22.575	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	611	
Schwedische Krone	Japanischer Yen	42.797	489.858	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	2.292	
						JPY 4.120	
						SEK 358	
Japanischer Yen	Schwedische Krone	302.323	26.316	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(294)	
Japanischer Yen	Schwedische Krone	261.420	22.734	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(9)	
Schwedische Krone	Japanischer Yen	1.075.656	12.608.071	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(238.550)	
						JPY (238.853)	
						SEK (20.771)	
						Netto JPY (234.733)	
						Netto SEK (20.413)	
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund							
Anteilsklasse SGD H (Hedged)							
Japanischer Yen	Singapur-Dollar	1.585.591	20.530	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	2.810	
Japanischer Yen	Singapur-Dollar	174.544	2.262	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	126	
Japanischer Yen	Singapur-Dollar	454.089	5.880	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	763	
Singapur-Dollar	Japanischer Yen	48.707	3.750.211	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	4.948	
						JPY 8.647	
						SGD 112	
Japanischer Yen	Singapur-Dollar	22.095.579	288.504	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(147.389)	
Japanischer Yen	Singapur-Dollar	2.294.264	29.817	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(4.532)	
Japanischer Yen	Singapur-Dollar	1.992.026	25.847	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(716)	
Japanischer Yen	Singapur-Dollar	1.978.618	25.770	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(8.190)	
Singapur-Dollar	Japanischer Yen	5.116	394.735	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(285)	
Singapur-Dollar	Japanischer Yen	105	8.170	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(42)	
Singapur-Dollar	Japanischer Yen	1.228.262	95.138.569	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(442.505)	
						JPY (603.659)	
						SGD (7.829)	
						Netto JPY (595.012)	
						Netto SGD (7.717)	

Devisenterminkontrakte Forts.							Nicht realisierter
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Gewinn/(Verlust)	
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund							
Anteilsklasse USD E (Acc) (Hedged)							
US-Dollar	Japanischer Yen	1.076.281	115.503.064	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	435.943	
US-Dollar	Japanischer Yen	26.871.066	2.891.022.785	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	3.578.028	
						JPY 4.013.971	
						USD 37.256	
Japanischer Yen	US-Dollar	66.698.399	619.278	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(11.362)	
Japanischer Yen	US-Dollar	69.593.644	648.659	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(281.068)	
Japanischer Yen	US-Dollar	60.357.383	562.465	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(232.361)	
Japanischer Yen	US-Dollar	59.438.580	557.507	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(617.131)	
						JPY (1.141.922)	
						USD (10.599)	
						Netto JPY 2.872.049	
						Netto USD 26.657	
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund							
Anteilsklasse USD H (Hedged)							
US-Dollar	Japanischer Yen	1.622	173.865	02-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	894	
US-Dollar	Japanischer Yen	518.929	55.830.920	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	69.098	
US-Dollar	Japanischer Yen	20.550	2.205.412	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	8.324	
						JPY 78.316	
						USD 727	
Japanischer Yen	US-Dollar	173.840	1.622	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(889)	
Japanischer Yen	US-Dollar	1.295.176	12.025	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(220)	
Japanischer Yen	US-Dollar	274.931	2.563	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1.187)	
Japanischer Yen	US-Dollar	1.336.507	12.457	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(5.398)	
Japanischer Yen	US-Dollar	540.579	5.035	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1.762)	
Japanischer Yen	US-Dollar	1.167.690	10.882	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(4.495)	
Japanischer Yen	US-Dollar	1.152.239	10.807	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(11.964)	
						JPY (25.915)	
						USD (241)	
						Netto JPY 52.401	
						Netto USD 486	

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte Forts.							Nicht
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent		realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund							
Anteilsklasse USD I (Hedged)							
US-Dollar	Japanischer Yen	44.980	4.827.069	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		18.219
US-Dollar	Japanischer Yen	1.123.394	120.864.488	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		149.586
							JPY 167.805
							USD 1.557
Japanischer Yen	US-Dollar	2.806.656	26.059	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		(478)
Japanischer Yen	US-Dollar	2.913.646	27.157	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		(11.767)
Japanischer Yen	US-Dollar	2.524.741	23.528	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		(9.719)
Japanischer Yen	US-Dollar	2.487.880	23.335	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		(25.831)
							JPY (47.795)
							USD (444)
							Netto JPY 120.010
							Netto USD 1.113

BNY MELLON LONG-TERM GLOBAL EQUITY FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener	Summe			Angemessener	Summe
Bestände	Beschreibung	Wert in EUR	der Netto- vermögen %	Bestände	Beschreibung	Wert in EUR	der Netto- vermögen %
Aktien				Aktien Forts.			
	Australien - 25.104.163 (31. Dezember 2019: 30.761.955)	25.104.163	1,78		USA - 671.332.915 (31. Dezember 2019: 758.932.227)	671.332.915	47,52
142.400	CSL Ltd	25.104.163	1,78	73.290	Adobe Inc	28.387.704	2,01
	Kanada - 29.733.761 (31. Dezember 2019: 26.965.547)	29.733.761	2,10	25.265	Alphabet Inc	31.798.796	2,25
1.064.098	Alimentation Couche-Tard Inc - B-Klasse	29.733.761	2,10	357.272	Amphenol Corp - A-Klasse	30.437.262	2,15
	China - 19.874.929 (31. Dezember 2019: 29.677.145)	19.874.929	1,41	204.979	Automatic Data Processing Inc	27.162.662	1,92
20.030.646	CNOOC Ltd	19.874.929	1,41	18.029	Booking Holdings Inc	25.581.503	1,81
	Dänemark - 36.365.789 (31. Dezember 2019: 36.304.786)	36.365.789	2,57	407.923	Cerner Corp	24.878.383	1,76
629.500	Novo Nordisk A/S	36.365.789	2,57	823.580	Cisco Systems Inc	34.182.027	2,42
	Finnland - 27.247.296 (31. Dezember 2019: 30.998.899)	27.247.296	1,93	264.997	Cognex Corp	14.083.631	1,00
445.800	Kone Oyj - B-Klasse	27.247.296	1,93	581.061	Cognizant Technology Solutions Corp	29.371.099	2,08
	Frankreich - 55.325.750 (31. Dezember 2019: 54.006.160)	55.325.750	3,92	444.735	Colgate- Palmolive Co	28.995.830	2,05
97.000	L'Oreal SA	27.708.050	1,96	441.606	Edwards Lifesciences Corp	27.154.720	1,92
70.733	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	27.617.700	1,96	563.281	EOG Resources Inc	25.391.495	1,80
	Deutschland - 34.377.245 (31. Dezember 2019: 29.671.237)	34.377.245	2,43	728.889	Fastenal Co	27.770.423	1,97
276.500	SAP SE	34.377.245	2,43	49.900	Illumina Inc	16.440.117	1,16
	Hongkong - 57.714.498 (31. Dezember 2019: 64.979.094)	57.714.498	4,09	58.161	Intuitive Surgical Inc	29.489.702	2,09
3.561.000	AIA Group Ltd	29.536.321	2,09	180.575	Johnson & Johnson	22.570.653	1,60
7.390.069	Hong Kong & China Gas Co Ltd	10.158.733	0,72	124.608	Mastercard Inc	32.780.143	2,32
485.023	Jardine Matheson Holdings Ltd	18.019.444	1,28	236.147	Microsoft Corp	42.770.215	3,03
	Japan - 117.185.934 (31. Dezember 2019: 111.174.809)	117.185.934	8,29	358.600	NIKE Inc	31.289.303	2,21
166.000	FANUC Corp	26.372.391	1,86	541.518	Oracle Corp	26.634.858	1,89
120.300	Keyence Corp	44.615.421	3,16	166.594	Stryker Corp	26.715.816	1,89
280.100	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	29.069.811	2,06	120.500	Texas Instruments Inc	13.615.364	0,96
37.700	SMC Corp/Japan	17.128.311	1,21	571.982	TJX Cos Inc/The	25.737.898	1,82
	Spanien - 28.112.716 (31. Dezember 2019: 37.545.233)	28.112.716	1,99	261.729	Walt Disney Co/The	25.959.724	1,84
1.192.480	Industria de Diseno Textil SA	28.112.716	1,99	137.871	Waters Corp	22.133.587	1,57
	Schweiz - 114.493.935 (31. Dezember 2019: 104.086.441)	114.493.935	8,10	Summe der Anlagen in Aktien	1.357.760.571	96,11	
301.000	Nestle SA	29.623.222	2,10	Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 80.608 (siehe unten) 31. Dezember 2019: 2.327)	80.608	0,01	
400.000	Novartis AG	30.973.426	2,19	Summe der Vermögenswerte zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert	1.357.841.179	96,12	
118.100	Roche Holding AG	36.424.289	2,58	Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften - (1.700) (siehe unten) 31. Dezember 2019: (45.196))	(1.700)	(0,00)	
8.036	SGS SA	17.472.998	1,23	Summe der finanziellen Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert	(1.700)	(0,00)	
	Taiwan - 36.268.791 (31. Dezember 2019: 37.184.539)	36.268.791	2,57	Nettoumlaufvermögen	54.875.458	3,88	
717.837	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	36.268.791	2,57	Summe der Nettovermögen	1.412.714.937	100,00	
	Großbritannien - 104.622.849 (31. Dezember 2019: 88.332.719)	104.622.849	7,41	Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens		
1.394.700	Compass Group Plc	17.112.520	1,21	An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten			
896.000	Experian Plc	27.862.063	1,97	Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente		95,85	
165.862	Linde Plc	31.316.671	2,22	OTC-Finanzderivate		0,01	
345.600	Reckitt Benckiser Group Plc	28.331.595	2,01	Sonstiges Umlaufvermögen		4,14	
				Summe der Aktiva		100,00	

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte							Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund							
Schweizer Franken	Euro	889.781	834.454	01-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		1.444
US-Dollar	Euro	19.137.240	17.000.000	01-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		33.579
							EUR 35.023
Euro	US-Dollar	116.093	130.572	01-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		(126)
Euro	US-Dollar	54.680	61.500	01-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		(59)
							EUR (185)
							Netto EUR 34.838
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund							
Anteilsklasse SGD J (Acc) (Hedged)							
Singapur-Dollar	Euro	809.985	513.615	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		3.571
							EUR 3.571
							SGD 5.591
Euro	Singapur-Dollar	25.237	39.669	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		(92)
Singapur-Dollar	Euro	19.975	12.764	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		(10)
							EUR (102)
							SGD (160)
							Netto EUR 3.469
							Netto SGD 5.431
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund							
Anteilsklasse SGD W (Acc) (Hedged)							
Singapur-Dollar	Euro	112.566	71.379	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		497
							EUR 497
							SGD 778
Euro	Singapur-Dollar	3.503	5.506	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		(13)
Singapur-Dollar	Euro	2.787	1.781	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		(1)
							EUR (14)
							SGD (22)
							Netto EUR 483
							Netto SGD 756
Devisenterminkontrakte Forts.							
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungsdatum	Kontrahent		Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund							
Anteilsklasse USD H (Acc) (Hedged)							
US-Dollar	Euro	105.363	92.777	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		975
							EUR 975
							USD 1.095
Euro	US-Dollar	4.526	5.120	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		(29)
US-Dollar	Euro	2.575	2.294	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		(3)
							EUR (32)
							USD (36)
							Netto EUR 943
							Netto USD 1.059
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund							
Anteilsklasse USD I (Acc) (Hedged)							
US-Dollar	Euro	107.415	94.584	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		994
							EUR 994
							USD 1.117
Euro	US-Dollar	4.607	5.211	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		(30)
US-Dollar	Euro	2.639	2.352	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		(3)
							EUR (33)
							USD (37)
							Netto EUR 961
							Netto USD 1.080
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund							
Anteilsklasse USD W (Hedged)							
Euro	US-Dollar	53.609	60.000	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		221
US-Dollar	Euro	9.985	8.864	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		21
US-Dollar	Euro	4.183.060	3.683.395	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		38.719
US-Dollar	Euro	106.827	94.468	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		587
							EUR 39.548
							USD 44.432

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020**Devisenterminkontrakte** Forts.

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

BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund**Anteilsklasse USD W (Hedged)** Forts.

Euro	US-Dollar	8.843	10.000	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(55)
Euro	US-Dollar	179.336	202.840	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1.153)
US-Dollar	Euro	102.918	91.703	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(126)
						EUR (1.334)
						USD (1.499)
						Netto EUR 38.214
						Netto USD 42.933

BNY MELLON MOBILITY INNOVATION FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %
Aktien				Aktien Forts.			
China - 5.460.202 (31. Dezember 2019: 4.707.340)				USA Forts.			
3.110.000	Guangzhou Automobile Group Co Ltd 'H'	2.241.062	1,15	29.306	Hubbell Inc - B-Klasse	3.672.921	1,89
145.100	Meituan Dianping	3.219.140	1,66	6.423	Littelfuse Inc	1.094.672	0,56
Frankreich - 3.678.665 (31. Dezember 2019: 1.249.046)				58.592	Lumentum Holdings Inc	4.769.389	2,45
57.803	Cie Plastic Omnium SA	1.177.718	0,60	11.314	NextEra Energy Inc	2.717.057	1,40
22.517	Schneider Electric SE	2.500.947	1,29	45.599	Nikola Corp	3.079.984	1,58
Deutschland - 9.665.564 (31. Dezember 2019: 5.990.432)				12.391	NVIDIA Corp	4.702.013	2,42
46.532	Daimler AG	1.899.417	0,98	201.308	ON Semiconductor Corp	3.988.918	2,05
158.822	Infineon Technologies AG	3.723.527	1,91	11.433	QUALCOMM Inc	1.042.575	0,54
33.560	KION Group AG	2.075.643	1,07	19.732	Rockwell Automation Inc	4.202.324	2,16
16.685	Siemens AG	1.966.977	1,01	18.409	Roper Technologies Inc	7.147.570	3,68
Japan - 16.272.489 (31. Dezember 2019: 17.598.900)				65.559	Semtech Corp	3.422.508	1,76
73.000	Anritsu Corp	1.730.095	0,89	30.033	Skyworks Solutions Inc	3.836.415	1,97
104.700	Denso Corp	4.073.579	2,10	177.474	Slack Technologies Inc	5.516.779	2,84
252.700	Mitsubishi Electric Corp	3.274.744	1,68	62.698	Splunk Inc	12.449.315	6,41
151.200	Taiyo Yuden Co Ltd	4.684.084	2,41	20.234	TE Connectivity Ltd	1.650.083	0,85
40.100	Toyota Motor Corp	2.509.987	1,29	4.715	Tesla Inc	5.089.064	2,62
Niederlande - 2.290.439 (31. Dezember 2019: -)				27.000	Twilio Inc - A-Klasse	5.917.455	3,05
20.081	NXP Semiconductors NV	2.290.439	1,18	30.969	Visteon Corp	2.121.222	1,09
Republik Korea - 9.135.671 (31. Dezember 2019: 6.289.120)				Summe der Anlagen in Aktien			
233.095	Hanon Systems	1.754.729	0,90			192.086.126	98,84
11.172	Hyundai Mobis Co Ltd	1.787.929	0,92	Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 67.176 (siehe unten) 31. Dezember 2019: 709.837)			
18.495	Samsung SDI Co Ltd	5.593.013	2,88			67.176	0,04
Russland - 5.792.502 (31. Dezember 2019: 5.831.016)				Summe der Vermögenswerte zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert			
115.769	Yandex NV - A-Klasse	5.792.502	2,98			192.153.302	98,88
Schweiz - 11.985.117 (31. Dezember 2019: 8.540.649)				Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften - (519.253) (siehe unten) 31. Dezember 2019: (3.660))			
134.556	ABB Ltd	3.028.558	1,56			(519.253)	(0,27)
31.935	Landis+Gyr Group AG	2.065.351	1,06	Summe der finanziellen Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert			
253.406	STMicroelectronics NV	6.891.208	3,55			(519.253)	(0,27)
Taiwan - 9.266.180 (31. Dezember 2019: 8.766.096)				Nettoumlaufvermögen			
473.000	MediaTek Inc	9.266.180	4,77			2.699.362	1,39
USA - 118.539.297 (31. Dezember 2019: 90.024.978)				Summe der Nettovermögen			
4.432	Alphabet Inc	6.267.070	3,22			194.333.411	100,00
18.926	Amphenol Corp - A-Klasse	1.811.502	0,93	Portfolioanalyse			
35.142	ANSYS Inc	10.258.653	5,28	% des Gesamtvermögens			
77.295	Aptiv Plc	6.020.121	3,10	An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten			
55.568	BorgWarner Inc	1.962.384	1,01	Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			
47.197	Cree Inc	2.793.354	1,44	OTC-Finanzderivate			
67.319	Diodes Inc	3.415.766	1,76	Sonstiges Umlaufvermögen			
30.244	Everbridge Inc	4.181.838	2,15	Summe der Aktiva			
100.899	FLIR Systems Inc	4.091.454	2,11				100,00
33.875	Gentherm Inc	1.316.891	0,68				

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte							Devisenterminkontrakte Forts.								
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)		
BNY Mellon Mobility Innovation Fund							BNY Mellon Mobility Innovation Fund								
US-Dollar	Euro	1.065.479	950.000	01-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(1.847)	Anteilsklasse CHF K (Acc) (Hedged)								
US-Dollar	Schweizer Franken	421.196	400.000	01-Jul.-20	UBS AG	(990)	Schweizer Franken	US-Dollar	1.200	1.265	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	2		
						USD	(2.837)	Schweizer Franken	US-Dollar	85.161	89.668	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	253	
								Schweizer Franken	US-Dollar	2.813.434	2.964.739	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	5.958	
								Schweizer Franken	US-Dollar	14.818	15.633	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	13	
								Schweizer Franken	US-Dollar	2.374	2.505	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	1	
								Schweizer Franken	US-Dollar	61.541	64.970	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	11	
								US-Dollar	Schweizer Franken	162.176	153.470	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	127	
														USD	6.365
														CHF	6.031
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse CHF E (Acc) (Hedged)															
Schweizer Franken	US-Dollar	12.141	12.810	01-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	4									
Schweizer Franken	US-Dollar	1.822	1.915	02-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	8									
Schweizer Franken	US-Dollar	71.205	74.971	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	215									
Schweizer Franken	US-Dollar	480.741	506.183	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	1.430									
Schweizer Franken	US-Dollar	30.776	32.350	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	146									
Schweizer Franken	US-Dollar	5.101	5.370	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	16									
Schweizer Franken	US-Dollar	15.543.103	16.379.002	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	32.917									
Schweizer Franken	US-Dollar	61.305	64.676	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	56									
Schweizer Franken	US-Dollar	6.700	7.071	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	4									
Schweizer Franken	US-Dollar	345.665	364.923	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	63									
US-Dollar	Schweizer Franken	12.303	11.621	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	32									
US-Dollar	Schweizer Franken	905.657	857.041	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	710									
						USD	35.601								
						CHF	33.730								
Schweizer Franken	US-Dollar	47.104	49.947	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(210)									
Schweizer Franken	US-Dollar	247.500	262.606	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1.272)									
Schweizer Franken	US-Dollar	79.446	84.109	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(222)									
US-Dollar	Schweizer Franken	1.916	1.822	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(8)									
US-Dollar	Schweizer Franken	12.815	12.141	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(5)									
US-Dollar	Schweizer Franken	384.660	364.607	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(327)									
US-Dollar	Schweizer Franken	5.743	5.442	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(3)									
US-Dollar	Schweizer Franken	5.226	4.957	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(7)									
US-Dollar	Schweizer Franken	210.734	200.150	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(604)									
US-Dollar	Schweizer Franken	32.442	30.766	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(43)									
US-Dollar	Schweizer Franken	40.893	38.841	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(119)									
						USD	(2.820)								
						CHF	(2.672)								
						Netto USD	32.781								
						Netto CHF	31.058								
							BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse CHF K (Inc) (Hedged)								
Schweizer Franken	US-Dollar						Schweizer Franken	US-Dollar	5.523	5.815	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	16		
Schweizer Franken	US-Dollar						Schweizer Franken	US-Dollar	182.459	192.272	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	386		
Schweizer Franken	US-Dollar						Schweizer Franken	US-Dollar	3.989	4.212	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	1		
US-Dollar	Schweizer Franken						US-Dollar	Schweizer Franken	10.518	9.953	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	8		
														USD	411
														CHF	389
US-Dollar	Schweizer Franken						US-Dollar	Schweizer Franken	4.466	4.233	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(4)		
														USD	(4)
														CHF	(4)
														Netto USD	407
														Netto CHF	385

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte Forts.							Devisenterminkontrakte Forts.							
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR E (Acc) (Hedged)							BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged) Forts.							
Euro	US-Dollar	42.929	48.047	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	199	US-Dollar	Euro	30.299	26.708	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	284	
Euro	US-Dollar	24.138	27.057	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	70	US-Dollar	Euro	17.348	15.435	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	2	
Euro	US-Dollar	397.225	445.832	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	585	US-Dollar	Euro	126.752	112.554	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	25	
US-Dollar	Euro	338.147	300.272	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	689	US-Dollar	Euro	621	552	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	1	
US-Dollar	Euro	67.779	59.938	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	419	US-Dollar	Euro	19.590	17.323	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	121	
US-Dollar	Euro	40.083	35.583	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	94								
US-Dollar	Euro	42.521	37.558	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	312						USD	2.964	
US-Dollar	Euro	19.762	17.475	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	123						EUR	2.638	
US-Dollar	Euro	805.251	711.989	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	5.089	US-Dollar	Euro	16.827	14.988	01-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(11)	
US-Dollar	Euro	73.210	64.532	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	686	Euro	US-Dollar	15.435	17.344	02-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(2)	
							Euro	US-Dollar	4.988	5.606	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1)	
							Euro	US-Dollar	22.959	25.962	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(160)	
							Euro	US-Dollar	105.779	119.221	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(342)	
Euro	US-Dollar	75.438	84.916	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(136)	Euro	US-Dollar	8.131	9.156	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(19)	
Euro	US-Dollar	289.204	325.954	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(935)	Euro	US-Dollar	17.475	19.685	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(46)	
Euro	US-Dollar	25.841	29.256	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(215)	Euro	US-Dollar	9.986	11.306	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(83)	
Euro	US-Dollar	58.328	66.484	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(933)	Euro	US-Dollar	24.988	28.139	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(57)	
Euro	US-Dollar	85.554	97.059	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(910)	Euro	US-Dollar	32.982	37.418	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(351)	
Euro	US-Dollar	12.930.397	14.689.337	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(157.637)	Euro	US-Dollar	4.988	5.639	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(34)	
US-Dollar	Euro	27.241	24.268	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(32)	Euro	US-Dollar	4.723.467	5.366.006	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(57.585)	
							US-Dollar	Euro	28.716	25.657	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(119)	
												USD	(58.810)	
												EUR	(52.345)	
												Netto USD	(55.846)	
												Netto EUR	(49.707)	
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)							BNY Mellon Mobility Innovation Fund Anteilsklasse EUR H (Inc) (Hedged)							
US-Dollar	Euro	5.604	4.988	02-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	1	Euro	US-Dollar	4.388	4.925	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	6	
Euro	US-Dollar	14.988	16.832	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	12	US-Dollar	Euro	8.960	7.922	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	57	
Euro	US-Dollar	5.988	6.721	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	8	US-Dollar	Euro	3.785	3.361	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	8	
Euro	US-Dollar	28.909	32.355	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	134								
Euro	US-Dollar	24.975	27.995	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	73							USD	71
Euro	US-Dollar	144.847	162.572	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	213							EUR	63
US-Dollar	Euro	293.828	259.798	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	1.857								

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte Forts.							Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund							BNY Mellon Mobility Innovation Fund						
Anteilsklasse EUR H (Inc) (Hedged) Forts.							Anteilsklasse EUR K (Acc) (Hedged) Forts.						
Euro	US-Dollar	3.169	3.572	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(10)	Euro	US-Dollar	32.852	36.995	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(75)
Euro	US-Dollar	144.352	163.988	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1.760)	Euro	US-Dollar	9.957	11.349	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(159)
						USD	Euro	US-Dollar	5.135.655	5.834.265	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(62.610)
						EUR						USD	(63.517)
						Netto USD						EUR	(56.535)
						Netto EUR						Netto USD	(60.871)
												Netto EUR	(54.180)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund							BNY Mellon Mobility Innovation Fund						
Anteilsklasse EUR J (Acc) (Hedged)							Anteilsklasse EUR K (Inc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	22.741	25.524	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	34	Euro	US-Dollar	7.718	8.663	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	11
US-Dollar	Euro	19.546	17.356	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	40	US-Dollar	Euro	14.775	13.063	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	93
US-Dollar	Euro	46.310	40.946	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	293	US-Dollar	Euro	7.061	6.270	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	14
						USD						USD	118
						EUR						EUR	105
Euro	US-Dollar	16.454	18.545	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(53)	Euro	US-Dollar	13.298	15.038	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(93)
Euro	US-Dollar	746.562	848.117	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(9.101)	Euro	US-Dollar	5.650	6.368	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(18)
						USD	Euro	US-Dollar	17.271	19.449	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(39)
						EUR	Euro	US-Dollar	238.192	270.594	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(2.904)
						Netto USD						USD	(3.054)
						Netto EUR						EUR	(2.718)
												Netto USD	(2.936)
												Netto EUR	(2.613)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund							BNY Mellon Mobility Innovation Fund						
Anteilsklasse EUR K (Acc) (Hedged)							Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	120	134	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	1	Euro	US-Dollar	7.667	8.608	01-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	6
Euro	US-Dollar	39.194	43.933	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	114	Euro	US-Dollar	336	378	02-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	-
Euro	US-Dollar	158.433	177.820	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	233	US-Dollar	Euro	51.375	45.722	02-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	7
US-Dollar	Euro	137.671	122.251	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	281	Euro	US-Dollar	346.220	388.586	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	510
US-Dollar	Euro	319.114	282.155	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	2.017	Euro	US-Dollar	54.824	61.453	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	160
						USD	Euro	US-Dollar	94.172	105.398	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	436
						EUR	Euro	US-Dollar	26.610	29.870	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	35
Euro	US-Dollar	2.454	2.775	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(17)	Euro	US-Dollar	23.100	25.943	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	18
Euro	US-Dollar	115.706	130.409	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(374)							
Euro	US-Dollar	33.885	38.363	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(282)							

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte Forts.							Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund							BNY Mellon Mobility Innovation Fund						
Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged) Forts.							Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged)						
US-Dollar	Euro	40.445	35.651	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	379	Euro	US-Dollar	4.318	4.846	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	6
US-Dollar	Euro	35.117	30.809	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	493	US-Dollar	Euro	8.757	7.743	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	55
US-Dollar	Euro	694.020	613.640	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	4.386	US-Dollar	Euro	2.644	2.339	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	16
US-Dollar	Euro	790	698	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	5	US-Dollar	Euro	3.778	3.355	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	8
US-Dollar	Euro	3.197	2.824	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	24						USD	85
US-Dollar	Euro	267	237	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	1						EUR	76
US-Dollar	Euro	48.166	42.844	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	16							
US-Dollar	Euro	300	266	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	1	Euro	US-Dollar	3.207	3.615	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(10)
US-Dollar	Euro	378	336	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	-	Euro	US-Dollar	3.232	3.640	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(9)
US-Dollar	Euro	307.978	273.482	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	628	Euro	US-Dollar	143.654	163.195	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1.751)
						USD						USD	(1.770)
						EUR						EUR	(1.575)
												Netto USD	(1.685)
												Netto EUR	(1.499)
US-Dollar	Euro	25.936	23.100	01-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(17)	BNY Mellon Mobility Innovation Fund						
Euro	US-Dollar	53.038	59.968	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(362)	Anteilsklasse SGD E (Acc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	4.705	5.337	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(50)	Singapur-Dollar	US-Dollar	3.890	2.790	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	2
Euro	US-Dollar	38.008	43.322	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(608)	US-Dollar	Singapur-Dollar	90.896	126.478	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	138
Euro	US-Dollar	57.756	65.314	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(405)	US-Dollar	Singapur-Dollar	4.981	6.921	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	14
Euro	US-Dollar	36.515	41.120	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(83)						USD	154
Euro	US-Dollar	57.009	64.543	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(474)						SGD	215
Euro	US-Dollar	40.137	45.214	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(106)							
Euro	US-Dollar	130.851	147.356	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(300)	Singapur-Dollar	US-Dollar	126.679	91.224	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(321)
Euro	US-Dollar	256.597	289.203	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(830)	Singapur-Dollar	US-Dollar	2.830	2.036	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(5)
Euro	US-Dollar	127.186	143.825	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(888)						USD	(326)
Euro	US-Dollar	24.129	27.160	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(43)						SGD	(454)
Euro	US-Dollar	45.722	51.388	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(5)						Netto USD	(172)
Euro	US-Dollar	21.106	23.728	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(8)						Netto SGD	(239)
Euro	US-Dollar	11.166.792	12.685.827	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(136.136)							
US-Dollar	Euro	8.611	7.667	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(6)							
US-Dollar	Euro	10.429	9.304	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(27)							
						USD							
						EUR							
						Netto USD							
						Netto EUR							

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte Forts.							Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund							BNY Mellon Mobility Innovation Fund						
Anteilsklasse SGD K (Inc) (Hedged)							Anteilsklasse Sterling K (Acc) (Hedged)						
Singapur-Dollar	US-Dollar	4.864	3.488	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	2	US-Dollar	Sterling	50.100	40.000	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	532
US-Dollar	Singapur-Dollar	2.638	3.676	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	-	US-Dollar	Sterling	19.527	15.508	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	310
US-Dollar	Singapur-Dollar	6.264	8.704	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	17							
					USD	19						USD	842
					SGD	26						GBP	680
Singapur-Dollar	US-Dollar	3.523	2.534	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(6)	Sterling	US-Dollar	5.303	6.612	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(40)
Singapur-Dollar	US-Dollar	159.081	114.558	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(403)	Sterling	US-Dollar	7.505	9.414	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(114)
					USD	(409)	Sterling	US-Dollar	282.124	358.581	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(8.969)
					SGD	(570)	US-Dollar	Sterling	6.878	5.591	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(51)
					Netto USD	(390)						USD	(9.174)
					Netto SGD	(544)						GBP	(7.404)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund							BNY Mellon Mobility Innovation Fund						
Anteilsklasse Sterling E (Acc) (Hedged)							Anteilsklasse Sterling E (Acc) (Hedged)						
US-Dollar	Sterling	136.356	108.290	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	2.162							
					USD	2.162							
					GBP	1.745							
Sterling	US-Dollar	43.972	54.821	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(331)							
Sterling	US-Dollar	60.196	75.510	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(914)							
Sterling	US-Dollar	1.972.939	2.507.621	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(62.725)							
US-Dollar	Sterling	56.356	45.813	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(416)							
					USD	(64.386)							
					GBP	(51.962)							
					Netto USD	(62.224)							
					Netto GBP	(50.217)							

BNY MELLON S&P 500® INDEX TRACKER

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener	Summe			Angemessener	Summe
Bestände	Beschreibung	Wert in USD	der Netto- vermögen %	Bestände	Beschreibung	Wert in USD	der Netto- vermögen %
Anleihen				Aktien Forts.			
	Regierung - 35.964 (31. Dezember 2019: 19.942)	35.964	0,11		Kommunikation Forts.		
36.000	United States Treasury Bill (Null-Coupon)			704	NortonLifeLock Inc	13.967	0,04
	0,000 % 25-Feb.-2021*	35.964	0,11	276	Omnicom Group Inc	15.063	0,05
				713	T-Mobile US Inc	74.262	0,23
				495	T-Mobile US Inc Rights 29-Jul.-2020	78	0,00
Summe der Anlagen in Anleihen				1.014	Twitter Inc	30.202	0,09
				128	VeriSign Inc	26.461	0,08
				5.256	Verizon Communications Inc	289.395	0,88
				688	ViacomCBS Inc - B-Klasse	16.034	0,05
				2.294	Walt Disney Co/The	255.632	0,78
Aktien							
	Werkstoffe - 672.123 (31. Dezember 2019: 1.095.588)	672.123	2,05		Zyklische Konsumwerte - 2.528.216 (31. Dezember 2019: 4.272.602)	2.528.216	7,69
282	Air Products & Chemicals Inc	68.041	0,21	87	Advance Auto Parts Inc	12.393	0,04
132	Albemarle Corp	10.190	0,03	147	Alaska Air Group Inc	5.330	0,02
153	Celanese Corp - A-Klasse	13.214	0,04	455	American Airlines Group Inc	5.935	0,02
274	CF Industries Holdings Inc	7.712	0,02	323	Aptiv Plc	25.157	0,08
936	Dow Inc	38.137	0,12	30	AutoZone Inc	33.864	0,10
930	DuPont de Nemours Inc	49.402	0,15	288	Best Buy Co Inc	25.129	0,08
172	Eastman Chemical Co	11.985	0,04	258	BorgWarner Inc	9.111	0,03
316	Ecolab Inc	62.841	0,19	209	CarMax Inc	18.717	0,06
167	FMC Corp	16.634	0,05	622	Carnival Corp	10.204	0,03
1.844	Freeport-McMoRan Inc	21.326	0,06	33	Chipotle Mexican Grill Inc - A-Klasse	34.725	0,11
132	International Flavors & Fragrances Inc	16.143	0,05	264	Copart Inc	21.985	0,07
498	International Paper Co	17.537	0,05	560	Costco Wholesale Corp	169.739	0,52
667	Linde Plc	141.491	0,43	187	Cummins Inc	32.388	0,10
331	LyondellBasell Industries NV	21.740	0,07	165	Darden Restaurants Inc	12.503	0,04
412	Mosaic Co/The	5.156	0,02	716	Delta Air Lines Inc	20.073	0,06
1.022	Newmont Corp	63.088	0,19	321	Dollar General Corp	61.152	0,19
385	Nucor Corp	15.937	0,05	301	Dollar Tree Inc	27.903	0,08
302	PPG Industries Inc	32.032	0,10	51	Domino's Pizza Inc	18.844	0,06
103	Sherwin-Williams Co/The	59.517	0,18	418	DR Horton Inc	23.161	0,07
	Kommunikation - 5.389.014 (31. Dezember 2019: 7.407.237)	5.389.014	16,40	732	Fastenal Co	31.333	0,10
372	Alphabet Inc	526.027	1,60	4.971	Ford Motor Co	30.249	0,09
381	Alphabet Inc - A-Klasse	540.226	1,64	229	Gap Inc/The	2.891	0,01
533	Amazon.com Inc	1.469.681	4,47	1.609	General Motors Co	40.700	0,12
70	Arista Networks Inc	14.698	0,05	188	Genuine Parts Co	16.348	0,05
9.050	AT&T Inc	273.265	0,83	423	Hanesbrands Inc	4.774	0,01
52	Booking Holdings Inc	82.895	0,25	164	Hasbro Inc	12.292	0,04
180	CDW Corp/DE	20.922	0,06	349	Hilton Worldwide Holdings Inc	25.632	0,08
1.233	CenturyLink Inc	12.361	0,04	1.366	Home Depot Inc/The	341.814	1,04
191	Charter Communications Inc	97.347	0,30	186	Kohl's Corp	3.862	0,01
5.387	Cisco Systems Inc	251.196	0,76	331	L Brands Inc	4.957	0,02
5.784	Comcast Corp	225.374	0,69	424	Las Vegas Sands Corp	19.305	0,06
971	Corning Inc	25.154	0,08	182	Leggett & Platt Inc	6.393	0,02
217	Discovery Inc - A-Klasse	4.575	0,01	343	Lennar Corp	21.127	0,06
424	Discovery Inc - C-Klasse	8.162	0,03	177	Live Nation Entertainment Inc	7.844	0,02
323	DISH Network Corp - A-Klasse	11.145	0,03	385	LKQ Corp	10.085	0,03
288	E*TRADE Financial Corp	14.327	0,04	958	Lowe's Cos Inc	129.392	0,39
840	eBay Inc	44.041	0,13	347	Marriott International Inc/MD	29.741	0,09
178	Expedia Group Inc	14.631	0,04	944	McDonald's Corp	173.979	0,53
77	F5 Networks Inc	10.735	0,03	651	MGM Resorts International	10.947	0,03
3.056	Facebook Inc - A-Klasse	693.880	2,11	73	Mohawk Industries Inc	7.428	0,02
454	Fox Corp - A-Klasse	12.174	0,04	472	Newell Brands Inc	7.493	0,02
199	Fox Corp - B-Klasse	5.338	0,02	1.574	NIKE Inc	154.299	0,47
486	Interpublic Group of Cos Inc/The	8.337	0,03	309	Norwegian Cruise Line Holdings Ltd	5.075	0,02
425	Juniper Networks Inc	9.713	0,03	4	NVR Inc	13.001	0,04
219	Motorola Solutions Inc	30.691	0,09	93	O'Reilly Automotive Inc	39.187	0,12
558	Netflix Inc	253.806	0,77	441	PACCAR Inc	33.002	0,10
477	News Corp - A-Klasse	5.655	0,02	321	PulteGroup Inc	10.925	0,03
131	News Corp - B-Klasse	1.564	0,01				

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener		Bestände	Beschreibung	Angemessener	
		Wert	Summe			Wert	Summe
		in USD	der Netto-			in USD	der Netto-
			vermögen %				vermögen %
Aktien Forts.				Aktien Forts.			
Zyklische Konsumwerte Forts.				Basiskonsumwerte Forts.			
90	PVH Corp	4.324	0,01	799	Danaher Corp	141.223	0,43
64	Ralph Lauren Corp - A-Klasse	4.640	0,01	114	DaVita Inc	9.020	0,03
448	Ross Stores Inc	38.172	0,12	284	DENTSPLY SIRONA Inc	12.507	0,04
216	Royal Caribbean Cruises Ltd	10.864	0,03	116	DexCom Inc	47.017	0,14
693	Southwest Airlines Co	23.669	0,07	786	Edwards Lifesciences Corp	54.301	0,17
1.492	Starbucks Corp	109.766	0,33	1.069	Eli Lilly and Co	175.316	0,53
364	Tapestry Inc	4.836	0,01	152	Equifax Inc	26.114	0,08
638	Target Corp	76.480	0,23	287	Estee Lauder Cos Inc/The - A-Klasse	54.144	0,16
142	Tiffany & Co	17.303	0,05	108	FleetCor Technologies Inc	27.187	0,08
1.528	TJX Cos Inc/The	77.248	0,24	114	Gartner Inc	13.833	0,04
146	Tractor Supply Co	19.236	0,06	774	General Mills Inc	47.667	0,14
72	Ulta Beauty Inc	14.640	0,04	1.591	Gilead Sciences Inc	122.427	0,37
258	Under Armour Inc	2.282	0,01	378	Global Payments Inc	64.107	0,19
205	Under Armour Inc - A-Klasse	1.996	0,01	215	H&R Block Inc	3.069	0,01
325	United Airlines Holdings Inc	11.250	0,03	338	HCA Healthcare Inc	32.781	0,10
413	VF Corp	25.164	0,08	187	Henry Schein Inc	10.919	0,03
933	Walgreens Boots Alliance Inc	39.541	0,12	186	Hershey Co/The	24.107	0,07
1.798	Walmart Inc	215.185	0,65	321	Hologic Inc	18.299	0,06
79	Whirlpool Corp	10.229	0,03	358	Hormel Foods Corp	17.282	0,05
54	WW Grainger Inc	16.964	0,05	167	Humana Inc	64.740	0,20
121	Wynn Resorts Ltd	9.015	0,03	108	IDEXX Laboratories Inc	35.641	0,11
380	Yum! Brands Inc	33.024	0,10	512	IHS Markit Ltd	38.653	0,12
Basiskonsumwerte - 7.334.126				187	Illumina Inc	69.218	0,21
(31. Dezember 2019: 11.132.837)				230	Incyte Corp	23.917	0,07
7.334.126 22,32				149	Intuitive Surgical Inc	84.879	0,26
2.246	Abbott Laboratories	205.329	0,62	223	IQVIA Holdings Inc	31.636	0,10
2.238	AbbVie Inc	219.682	0,67	143	J M Smucker Co/The	15.129	0,05
57	ABIOMED Inc	13.769	0,04	3.348	Johnson & Johnson	470.160	1,43
282	Alexion Pharmaceuticals Inc	31.633	0,10	314	Kellogg Co	20.738	0,06
93	Align Technology Inc	25.536	0,08	432	Kimberly-Clark Corp	61.024	0,19
2.372	Altria Group Inc	93.089	0,28	785	Kraft Heinz Co/The	25.022	0,08
187	AmerisourceBergen Corp - A-Klasse	18.830	0,06	1.000	Kroger Co/The	33.845	0,10
747	Amgen Inc	176.049	0,54	125	Laboratory Corp of America Holdings	20.771	0,06
322	Anthem Inc	84.589	0,26	183	Lamb Weston Holdings Inc	11.694	0,04
710	Archer-Daniels-Midland Co	28.318	0,09	48	MarketAxess Holdings Inc	24.056	0,07
548	Automatic Data Processing Inc	81.586	0,25	158	McCormick & Co Inc/MD	28.344	0,09
106	Avery Dennison Corp	12.094	0,04	207	McKesson Corp	31.749	0,10
644	Baxter International Inc	55.419	0,17	1.702	Medtronic Plc	155.912	0,47
376	Becton Dickinson and Co	89.988	0,27	3.206	Merck & Co Inc	247.856	0,75
208	Biogen Inc	55.614	0,17	244	Molson Coors Beverage Co - B-Klasse	8.383	0,03
27	Bio-Rad Laboratories Inc	12.190	0,04	1.822	Mondelez International Inc	93.122	0,28
1.813	Boston Scientific Corp	63.645	0,19	474	Monster Beverage Corp	32.832	0,10
2.873	Bristol-Myers Squibb Co	168.861	0,51	204	Moody's Corp	56.040	0,17
240	Brown-Forman Corp	15.274	0,05	657	Mylan NV	10.574	0,03
216	Campbell Soup Co	10.719	0,03	469	Nielsen Holdings Plc	6.967	0,02
364	Cardinal Health Inc	18.990	0,06	1.492	PayPal Holdings Inc	259.966	0,79
732	Centene Corp	46.537	0,14	1.762	PepsiCo Inc	232.980	0,71
312	Church & Dwight Co Inc	24.119	0,07	169	Perrigo Co Plc	9.340	0,03
471	Cigna Corp	88.336	0,27	7.054	Pfizer Inc	230.631	0,70
106	Cintas Corp	28.220	0,09	1.976	Philip Morris International Inc	138.320	0,42
158	Clorox Co/The	34.660	0,11	3.145	Procter & Gamble Co/The	375.749	1,14
4.908	Coca-Cola Co/The	219.069	0,67	179	Quanta Services Inc	7.021	0,02
1.085	Colgate-Palmolive Co	79.476	0,24	174	Quest Diagnostics Inc	19.840	0,06
608	Conagra Brands Inc	21.392	0,07	129	Regeneron Pharmaceuticals Inc	80.383	0,24
214	Constellation Brands Inc - A-Klasse	37.316	0,11	184	ResMed Inc	35.309	0,11
64	Cooper Cos Inc/The	18.153	0,06	150	Robert Half International Inc	7.923	0,02
968	Corteva Inc	25.928	0,08	173	Rollins Inc	7.329	0,02
492	Coty Inc	2.197	0,01	305	S&P Global Inc	100.404	0,31
1.669	CVS Health Corp	108.368	0,33	109	STERIS Plc	16.723	0,05

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener		Bestände	Beschreibung	Angemessener	
		Wert	Summe			Wert	Summe
		in USD	der Netto-			in USD	der Netto-
			vermögen %				vermögen %
Aktien Forts.				Aktien Forts.			
Basiskonsumwerte Forts.				Finanzwerte Forts.			
412	Stryker Corp	74.230	0,23	1.016	Bank of New York Mellon Corp/The	39.273	0,12
653	Sysco Corp	35.677	0,11	2.471	Berkshire Hathaway Inc - B-Klasse	440.938	1,34
58	Teleflex Inc	21.110	0,06	197	BlackRock Inc	107.083	0,33
501	Thermo Fisher Scientific Inc	181.319	0,55	185	Boston Properties Inc (REIT)	16.721	0,05
373	Tyson Foods Inc - A-Klasse	22.266	0,07	579	Capital One Financial Corp	36.231	0,11
95	United Rentals Inc	14.157	0,04	142	Cboe Global Markets Inc	13.224	0,04
1.205	UnitedHealth Group Inc	355.053	1,08	431	CBRE Group Inc - A-Klasse	19.486	0,06
96	Universal Health Services Inc	8.921	0,03	1.464	Charles Schwab Corp/The	49.388	0,15
116	Varian Medical Systems Inc	14.223	0,04	572	Chubb Ltd	72.358	0,22
204	Verisk Analytics Inc - A-Klasse	34.725	0,11	199	Cincinnati Financial Corp	12.739	0,04
331	Vertex Pharmaceuticals Inc	96.141	0,29	2.642	Citigroup Inc	134.993	0,41
94	West Pharmaceutical Services Inc	21.353	0,06	555	Citizens Financial Group Inc	14.005	0,04
262	Zimmer Biomet Holdings Inc	31.266	0,10	458	CME Group Inc	74.423	0,23
602	Zoetis Inc	82.570	0,25	173	Comerica Inc	6.590	0,02
Energie - 918.788				531	Crown Castle International Corp (REIT)	88.818	0,27
(31. Dezember 2019: 2.196.868)				339	Digital Realty Trust Inc (REIT)	48.172	0,15
		918.788	2,80	383	Discover Financial Services	19.186	0,06
461	Apache Corp	6.226	0,02	473	Duke Realty Corp (REIT)	16.742	0,05
829	Baker Hughes Co - A-Klasse	12.762	0,04	112	Equinix Inc (REIT)	78.602	0,24
517	Cabot Oil & Gas Corp	8.879	0,03	446	Equity Residential (REIT)	26.229	0,08
2.371	Chevron Corp	211.564	0,64	83	Essex Property Trust Inc (REIT)	19.007	0,06
257	Concho Resources Inc	13.230	0,04	51	Everest Re Group Ltd	10.509	0,03
1.367	ConocoPhillips	57.435	0,18	167	Extra Space Storage Inc (REIT)	15.420	0,05
481	Devon Energy Corp	5.452	0,02	88	Federal Realty Investment Trust (REIT)	7.492	0,02
202	Diamondback Energy Inc	8.455	0,03	906	Fifth Third Bancorp	17.472	0,05
735	EOG Resources Inc	37.224	0,11	222	First Republic Bank/CA	23.536	0,07
5.370	Exxon Mobil Corp	239.958	0,73	344	Franklin Resources Inc	7.215	0,02
1.105	Halliburton Co	14.348	0,04	126	Globe Life Inc	9.358	0,03
328	Hess Corp	16.989	0,05	395	Goldman Sachs Group Inc/The	78.011	0,24
174	HollyFrontier Corp	5.078	0,02	453	Hartford Financial Services Group Inc/The	17.447	0,05
2.472	Kinder Morgan Inc	37.476	0,11	693	Healthpeak Properties Inc (REIT)	19.082	0,06
992	Marathon Oil Corp	6.066	0,02	912	Host Hotels & Resorts Inc (REIT)	9.845	0,03
829	Marathon Petroleum Corp	30.976	0,10	1.311	Huntington Bancshares Inc/OH	11.845	0,04
477	National Oilwell Varco Inc	5.841	0,02	701	Intercontinental Exchange Inc	64.170	0,20
592	Noble Energy Inc	5.307	0,02	490	Invesco Ltd	5.270	0,02
1.134	Occidental Petroleum Corp	20.747	0,06	364	Iron Mountain Inc (REIT)	9.499	0,03
526	ONEOK Inc	17.458	0,05	3.871	JPMorgan Chase & Co	363.835	1,11
551	Phillips 66	39.595	0,12	1.263	KeyCorp	15.377	0,05
211	Pioneer Natural Resources Co	20.614	0,06	523	Kimco Realty Corp (REIT)	6.713	0,02
1.768	Schlumberger Ltd	32.505	0,10	252	Lincoln National Corp	9.272	0,03
598	TechnipFMC Plc	4.093	0,01	322	Loews Corp	11.043	0,03
525	Valero Energy Corp	30.878	0,09	166	M&T Bank Corp	17.260	0,05
1.560	Williams Cos Inc/The	29.632	0,09	650	Marsh & McLennan Cos Inc	69.758	0,21
Finanzwerte - 4.743.647				1.123	Mastercard Inc	331.908	1,01
(31. Dezember 2019: 8.913.608)				983	MetLife Inc	35.894	0,11
		4.743.647	14,44	143	Mid-America Apartment Communities Inc (REIT)	16.399	0,05
911	Aflac Inc	32.819	0,10	1.527	Morgan Stanley	73.762	0,22
161	Alexandria Real Estate Equities Inc (REIT)	26.111	0,08	147	Nasdaq Inc	17.558	0,05
396	Allstate Corp/The	38.406	0,12	270	Northern Trust Corp	21.408	0,07
836	American Express Co	79.562	0,24	551	People's United Financial Inc	6.372	0,02
1.086	American International Group Inc	33.856	0,10	541	PNC Financial Services Group Inc/The	56.900	0,17
563	American Tower Corp (REIT)	145.476	0,44	328	Principal Financial Group Inc	13.630	0,04
158	Ameriprise Financial Inc	23.702	0,07	746	Progressive Corp/The	59.732	0,18
295	Aon Plc	56.792	0,17	942	Prologis Inc (REIT)	87.884	0,27
186	Apartment Investment and Management Co (REIT)	6.998	0,02	502	Prudential Financial Inc	30.567	0,09
246	Arthur J Gallagher & Co	23.978	0,07	190	Public Storage (REIT)	36.451	0,11
76	Assurant Inc	7.853	0,02	156	Raymond James Financial Inc	10.739	0,03
178	AvalonBay Communities Inc (REIT)	27.534	0,08	443	Realty Income Corp (REIT)	26.343	0,08
9.916	Bank of America Corp	235.356	0,72	212	Regency Centers Corp (REIT)	9.723	0,03

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener		Bestände	Beschreibung	Angemessener	
		Wert	Summe			Wert	Summe
		in USD	der Netto- vermögen %			in USD	der Netto- vermögen %
Aktien Forts.				Aktien Forts.			
Finanzwerte Forts.				Industriewerte Forts.			
1.231	Regions Financial Corp	13.683	0,04	108	JB Hunt Transport Services Inc	12.999	0,04
142	SBA Communications Corp (REIT) - A-Klasse	42.282	0,13	938	Johnson Controls International plc	32.014	0,10
394	Simon Property Group Inc (REIT)	26.940	0,08	123	Kansas City Southern	18.362	0,06
101	SL Green Realty Corp (REIT)	4.980	0,02	237	Keysight Technologies Inc	23.883	0,07
446	State Street Corp	28.357	0,09	273	L3Harris Technologies Inc	46.319	0,14
66	SVB Financial Group	14.227	0,04	315	Lockheed Martin Corp	114.939	0,35
672	Synchrony Financial	14.888	0,05	81	Martin Marietta Materials Inc	16.730	0,05
289	T Rowe Price Group Inc	35.709	0,11	342	Masco Corp	17.168	0,05
322	Travelers Cos Inc/The	36.722	0,11	31	Mettler-Toledo International Inc	24.972	0,08
1.718	Truist Financial Corp	64.502	0,20	326	Norfolk Southern Corp	57.262	0,17
377	UDR Inc (REIT)	14.088	0,04	197	Northrop Grumman Corp	60.565	0,18
259	Unum Group	4.298	0,01	117	Old Dominion Freight Line Inc	19.836	0,06
1.747	US Bancorp	64.316	0,20	517	Otis Worldwide Corp	29.386	0,09
480	Ventas Inc (REIT)	17.568	0,05	121	Packaging Corp of America	12.075	0,04
2.144	Visa Inc - A-Klasse	413.653	1,26	164	Parker-Hannifin Corp	30.068	0,09
208	Vornado Realty Trust (REIT)	7.945	0,02	201	Pentair Plc	7.637	0,02
184	W R Berkley Corp	10.539	0,03	140	PerkinElmer Inc	13.733	0,04
4.734	Wells Fargo & Co	121.072	0,37	1.878	Raytheon Technologies Corp	115.675	0,35
539	Welltower Inc (REIT)	27.880	0,09	266	Republic Services Inc - A-Klasse	21.821	0,07
535	Western Union Co/The	11.569	0,04	149	Rockwell Automation Inc	31.733	0,10
960	Weyerhaeuser Co (REIT)	21.552	0,07	132	Roper Technologies Inc	51.251	0,16
164	Willis Towers Watson Plc	32.285	0,10	184	Sealed Air Corp	6.047	0,02
213	Zions Bancorp NA	7.242	0,02	70	Snap-on Inc	9.690	0,03
Industriewerte - 2.547.661 (31. Dezember 2019: 4.480.051)				194	Stanley Black & Decker Inc	27.035	0,08
734	3M Co	114.434	0,35	419	TE Connectivity Ltd	34.169	0,10
168	A O Smith Corp	7.919	0,02	45	Teledyne Technologies Inc	13.985	0,04
396	Agilent Technologies Inc	34.991	0,11	276	Textron Inc	9.085	0,03
119	Allegion plc	12.162	0,04	303	Trane Technologies Plc	26.958	0,08
2.041	Amcor Plc	20.828	0,06	64	TransDigm Group Inc	28.279	0,09
297	AMETEK Inc	26.527	0,08	861	Union Pacific Corp	145.457	0,44
379	Amphenol Corp - A-Klasse	36.276	0,11	899	United Parcel Service Inc - B-Klasse	99.919	0,30
417	Ball Corp	28.971	0,09	165	Vulcan Materials Co	19.116	0,06
681	Boeing Co/The	124.705	0,38	492	Waste Management Inc	52.076	0,16
1.037	Carrier Global Corp	23.037	0,07	80	Waters Corp	14.429	0,04
691	Caterpillar Inc	87.367	0,27	233	Westinghouse Air Brake Technologies Corp	13.415	0,04
174	CH Robinson Worldwide Inc	13.752	0,04	314	Westrock Co	8.867	0,03
976	CSX Corp	68.100	0,21	224	Xylem Inc/NY	14.547	0,04
396	Deere & Co	62.218	0,19	Technologie - 7.447.717 (31. Dezember 2019: 9.506.933)			
179	Dover Corp	17.291	0,05	809	Accenture Plc - A-Klasse	173.587	0,53
505	Eaton Corp Plc	44.150	0,14	983	Activision Blizzard Inc	74.585	0,23
761	Emerson Electric Co	47.190	0,14	612	Adobe Inc	266.324	0,81
209	Expeditors International of Washington Inc	15.887	0,05	1.494	Advanced Micro Devices Inc	78.547	0,24
303	FedEx Corp	42.453	0,13	202	Akamai Technologies Inc	21.638	0,07
169	FLIR Systems Inc	6.853	0,02	471	Analog Devices Inc	57.778	0,18
161	Flowserve Corp	4.593	0,01	109	ANSYS Inc	31.819	0,10
375	Fortive Corp	25.393	0,08	5.179	Apple Inc	1.888.367	5,75
174	Fortune Brands Home & Security Inc	11.124	0,03	1.164	Applied Materials Inc	70.340	0,21
189	Garmin Ltd	18.421	0,06	278	Autodesk Inc	66.473	0,20
295	General Dynamics Corp	44.070	0,13	507	Broadcom Inc	159.951	0,49
11.158	General Electric Co	76.153	0,23	147	Broadridge Financial Solutions Inc	18.547	0,06
890	Honeywell International Inc	128.752	0,39	359	Cadence Design Systems Inc	34.442	0,11
482	Howmet Aerospace Inc	7.637	0,02	386	Cerner Corp	26.449	0,08
51	Huntington Ingalls Industries Inc	8.901	0,03	145	Citrix Systems Inc	21.436	0,07
98	IDEX Corp	15.482	0,05	682	Cognizant Technology Solutions Corp	38.731	0,12
368	Illinois Tool Works Inc	64.269	0,20	310	DXC Technology Co	5.116	0,02
439	Ingersoll Rand Inc	12.347	0,04	365	Electronic Arts Inc	48.184	0,15
164	Jacobs Engineering Group Inc	13.906	0,04	789	Fidelity National Information Services Inc	105.785	0,32

Aktien Forts.Aktionen Forts.

Summe der Anlagen in Aktien	32.581.250	99,16

Offene Terminkontrakte - 6.655
(31. Dezember 2019: 1.757)

Summe der offenen Terminkontrakte	6.655	0.02

Summe der Vermögenswerte		
zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert	32.623.869	99,29

Nettoumlaufvermögen	234.832	0,71

Summe der Nettovermögen	32.858.701	100,00

Der Kontrahent für Futures ist Goldman Sachs.

Portfolioanalyse	% des Gesamtvermögens

An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente	98,65
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate	0,02
Sonstiges Umlaufvermögen	1,33

Summe der Aktiva	100,00

258

BNY MELLON SMALL CAP EUROLAND FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in EUR	Summe der Netto- vermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in EUR	Summe der Netto- vermögen %
Aktien				Aktien Forts.			
Österreich - 636.654 (31. Dezember 2019: 1.196.744)				Deutschland Forts.			
7.102	Schoeller-Bleckmann Oilfield Equipment AG	168.850	0,35	3.582	Sartorius AG - Preference	1.036.989	2,11
76.501	Telekom Austria AG - A-Klasse	467.804	0,95	64.330	Schaeffler AG - Preference	427.955	0,87
Belgien - 1.946.480 (31. Dezember 2019: 2.472.553)				8.126	Siltronic AG	735.240	1,50
18.786	Bekaert SA	323.495	0,66	5.372	Sixt SE	369.996	0,75
6.293	Cofinimmo SA (REIT)	780.961	1,59	16.973	Stroer SE & Co KGaA	1.017.531	2,07
17.123	D'ieteren SA/NV	842.024	1,71	15.857	Talanx AG	515.194	1,05
Dänemark - 767.270 (31. Dezember 2019: 2.011.192)				Irland - 1.171.108 (31. Dezember 2019: 1.655.229)			
6.875	GN Store Nord A/S	328.002	0,67	6.212	ICON Plc	901.319	1,84
5.873	Royal Unibrew A/S	439.268	0,89	34.253	UDG Healthcare Plc (Units)	269.789	0,55
Finnland - 3.408.461 (31. Dezember 2019: 5.399.842)				Italien - 4.172.257 (31. Dezember 2019: 6.781.347)			
33.243	Adapteo Oyj	252.129	0,51	280.048	Anima Holding SpA '144A'	1.077.065	2,19
62.674	Kemira Oyj	717.617	1,46	27.139	ASTM SpA	544.137	1,11
45.843	TietoEVRY Oyj	1.102.983	2,25	13.530	Buzzi Unicem SpA	257.442	0,53
57.699	Valmet Oyj	1.335.732	2,72	170.613	Immobiliare Grande Distribuzione SIIQ SpA (REIT)	580.937	1,18
Frankreich - 11.912.193 (31. Dezember 2019: 17.842.935)				208.205	Iren SpA	461.591	0,94
6.718	Arkema SA	573.180	1,17	64.823	Italgas SpA	340.807	0,70
369.018	CGG SA	362.929	0,74	263.467	Unipol Gruppo SpA	910.278	1,85
53.132	Cie Plastic Omnium SA	960.892	1,96	Luxemburg - 1.748.016 (31. Dezember 2019: 2.484.159)			
16.311	Covivio (REIT)	1.076.934	2,19	15.802	Corestate Capital Holding SA	292.574	0,60
24.590	Edenred	962.330	1,96	2.630	Eurofins Scientific SE	1.455.442	2,96
11.451	Eiffage SA	938.867	1,91	Malta - 626.936 (31. Dezember 2019: 823.590)			
8.760	Eramet	277.385	0,56	115.245	Kindred Group Plc SDR	626.936	1,28
3.989	Iliad SA	690.396	1,41	Niederlande - 6.066.703 (31. Dezember 2019: 10.053.484)			
28.821	Klepierre SA (REIT)	515.536	1,05	17.196	AMG Advanced Metallurgical Group NV	273.674	0,56
33.611	Korian SA	1.096.391	2,23	29.010	Arcadis NV	467.206	0,95
38.404	Maisons du Monde SA '144A'	446.831	0,91	32.371	BE Semiconductor Industries NV	1.269.914	2,59
47.949	Metropole Television SA	478.052	0,97	19.999	Euronext NV '144A'	1.776.911	3,62
21.136	Nexity SA	614.846	1,25	16.483	OCI NV	154.446	0,31
8.071	Sopra Steria Group	884.178	1,80	44.978	SBM Offshore NV	588.650	1,20
5.968	Teleperformance	1.338.622	2,73	41.500	Signify NV '144A'	940.598	1,91
9.649	Ubisoft Entertainment SA	694.824	1,42	16.807	TKH Group NV Dutch Cert	595.304	1,21
Deutschland - 11.457.814 (31. Dezember 2019: 16.646.505)				Norwegen - 424.096 (31. Dezember 2019: 630.424)			
4.553	Bechtle AG	710.268	1,45	81.659	Leroy Seafood Group ASA	424.096	0,86
22.875	Brenntag AG	1.072.494	2,18	Spanien - 3.042.178 (31. Dezember 2019: 4.626.561)			
9.060	Cewe Stiftung & Co KGAA	876.555	1,78	8.115	Acciona SA	710.265	1,45
40.384	Deutsche Pfandbriefbank AG '144A'	260.780	0,53	22.143	Almirall SA	258.630	0,53
7.396	DWS Group GmbH & Co KGaA '144A'	239.372	0,49	96.122	Bankinter SA	405.539	0,83
16.223	Hella GmbH & Co KGaA	597.818	1,22	131.827	Euskaltel SA '144A'	1.052.638	2,14
42.960	HelloFresh SE	2.056.925	4,19				
14.082	KION Group AG	770.708	1,57				
9.983	Rheinmetall AG	769.989	1,57				

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in EUR	Summe der Netto- vermögen %
Aktien Forts.			
Spanien Forts.			
79.003	Mediaset Espana Comunicacion SA	257.866	0,52
782.734	Unicaja Banco SA '144A'	357.240	0,73
Großbritannien - 589.793 (31. Dezember 2019: 424.804)			
14.890	Dialog Semiconductor Plc	589.793	1,20
Summe der Anlagen in Aktien		47.969.959	97,69
Summe der Vermögenswerte zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert		47.969.959	97,69
Nettoumlaufvermögen		1.136.424	2,31
Summe der Nettovermögen		49.106.383	100,00
Der Kontrahent für Futures ist Goldman Sachs.			
Portfolioanalyse		% des Gesamtvermögens	
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten			
Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			97,50
Sonstiges Umlaufvermögen			2,50
Summe der Aktiva		100,00	

BNY MELLON SUSTAINABLE GLOBAL DYNAMIC BOND FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in EUR	Summe der Netto- vermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in EUR	Summe der Netto- vermögen %
Anleihen				Anleihen Forts.			
	Australischer Dollar - 10.082.719 (31. Dezember 2019: 8.534.725)	10.082.719	4,58		Euro Forts.		
2.080.000	Australia Government Bond 3,000 % 20-Sept.-2025	1.858.381	0,84	1.100.000	Linde Finance BV 0,250 % 19-Mai-2027	1.109.785	0,50
3.540.000	Australia Government Bond 3,000 % 21-März-2047	2.755.336	1,25	970.000	Lloyds Bank Plc 'EMTN' 4,875 % 13-Jan.-2023	1.097.447	0,50
4.790.000	Treasury Corp of Victoria 1,000 % 20-Nov.-2023	2.986.563	1,36	1.146.000	Lloyds Banking Group Plc FRN (Immerwährend)		
3.830.000	Treasury Corp of Victoria 2,250 % 20-Nov.-2034	2.482.439	1,13		4,947 % 27-Jun.-2025	1.118.393	0,51
				1.215.000	Loxam SAS 'REGS' 2,875 % 15-Apr.-2026	1.047.014	0,48
	Kanadischer Dollar - 5.448.952 (31. Dezember 2019: 4.953.445)	5.448.952	2,47	985.000	Motability Operations Group Plc 'EMTN'		
3.530.000	Canada Housing Trust No 1 '144A'				0,375 % 03-Jan.-2026	982.336	0,45
	2,100 % 15-Sept.-2029	2.541.364	1,15	1.070.000	Motability Operations Group Plc 'EMTN'		
4.210.000	Canada Housing Trust No 1 '144A'				1,625 % 09-Jun.-2023	1.120.579	0,51
	2,350 % 15-Sept.-2023	2.907.588	1,32	1.220.000	Nationwide Building Society 'EMTN'		
					0,500 % 23-Feb.-2024	1.253.367	0,57
	Kolumbianischer Peso - 2.154.020 (31. Dezember 2019: -)	2.154.020	0,98	2.395.000	Nationwide Building Society 'EMTN'		
8.845.500.000	Colombia Government International Bond 'REGS'				6,750 % 22-Jul.-2020	2.403.227	1,09
	6,000 % 28-Apr.-2028	2.154.020	0,98	968.000	Nestle Finance International Ltd 'EMTN'		
					0,125 % 12-Nov.-2027	965.420	0,44
	Tschechische Krone - 2.315.256 (31. Dezember 2019: -)	2.315.256	1,05	580.000	Netherlands Government Bond '144A'		
59.930.000	Czech Republic Government Bond				0,500 % 15-Jan.-2040	644.945	0,29
	1,250 % 14-Feb.-2025	2.315.256	1,05	1.025.000	Orange SA 'EMTN' FRN (Immerwährend)		
					4,000 % 01-Okt.-2021	1.059.220	0,48
	Euro - 58.866.068 (31. Dezember 2019: 47.281.943)	58.866.068	26,72	1.050.000	Orsted A/S 1,500 % 26-Nov.-2029	1.153.883	0,52
869.000	Akelius Residential Property AB FRN			653.000	PepsiCo Inc 0,250 % 06-Mai-2024	657.731	0,30
	2,249 % 17-Mai-2081	803.964	0,37	225.000	Prologis International Funding II SA 'EMTN'		
1.325.000	Allied Irish Banks Plc 'EMTN' FRN				1,625 % 17-Jun.-2032	235.661	0,11
	4,125 % 26-Nov.-2025	1.330.459	0,60	950.000	Province of British Columbia Canada 'EMTN'		
2.160.000	Asian Development Bank 0,000 % 24-Okt.-2029	2.189.095	0,99		0,875 % 08-Okt.-2025	1.001.856	0,45
1.570.000	AT&T Inc 1,875 % 04-Dez.-2020	1.574.553	0,71	1.062.000	SELP Finance Sarl 1,250 % 25-Okt.-2023	1.071.080	0,49
1.100.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA			481.000	SIG Combibloc PurchaseCo Sarl 'REGS'		
	0,625 % 17-Mai-2021	1.107.991	0,50		1,875 % 18-Jun.-2023	488.095	0,22
1.000.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN (Immerwährend)			675.000	Societe Generale SA FRN (Immerwährend)		
	5,875 % 24-Mai-2022	974.400	0,44		6,750 % 07-Apr.-2021	673.704	0,31
400.000	Banco Santander SA FRN (Immerwährend)			3.180.000	Spain Government Bond '144A'		
	5,250 % 29-Sept.-2023	378.000	0,17		5,150 % 31-Okt.-2028	4.463.127	2,03
281.000	Banijay Entertainment SASU 'REGS'			1.048.000	Summer BC Holdco B SARL 'REGS'		
	3,500 % 01-März-2025	269.383	0,12		5,750 % 31-Okt.-2026	1.011.320	0,46
700.000	Cellnex Telecom SA 1,875 % 26-Jun.-2029	692.601	0,31	1.100.000	Telefonica Europe BV FRN (Immerwährend)		
2.510.000	Coventry Building Society 2,500 % 18-Nov.-2020	2.533.280	1,15		4,375 % 14-Dez.-2024	1.137.125	0,52
1.100.000	Covivio 1,625 % 23-Jun.-2030	1.102.233	0,50	210.000	UBS AG 'EMTN' FRN 4,750 % 12-Feb.-2026	214.072	0,10
1.480.000	Credit Suisse AG/Guernsey 'EMTN'			670.000	UniCredit SpA 'EMTN' FRN (Immerwährend)		
	1,750 % 15-Jan.-2021	1.496.731	0,68		3,875 % 03-Jun.-2027	494.125	0,22
890.000	Ecolab Inc 2,625 % 08-Jul.-2025	984.909	0,45	470.000	Vodafone Group Plc FRN 3,100 % 03-Jan.-2079 VAR	472.938	0,21
750.000	Fresenius Medical Care AG & Co KGaA 'EMTN'						
	1,000 % 29-Mai-2026	763.939	0,35		Indonesische Rupiah - 3.025.731 (31. Dezember 2019: 1.584.672)	3.025.731	1,37
3.200.000	German Postal Pensions Securitisation Plc			35.455.000.000	European Bank for Reconstruction		
	3,750 % 18-Jan.-2021	3.286.336	1,49		& Development 'GMTN' 6,450 % 13-Dez.-2022	2.168.801	0,98
1.185.000	Hella GmbH & Co KGaA 1,000 % 17-Mai-2024	1.209.778	0,55	13.800.000.000	European Bank for Reconstruction		
500.000	Infineon Technologies AG 'EMTN' FRN (Immerwährend)				& Development 'GMTN' 8,300 % 02-Okt.-2020	856.930	0,39
	2,875 % 01-Jan.-2025	489.620	0,22				
500.000	Infineon Technologies AG FRN (Immerwährend)				Japanischer Yen - 10.272.765 (31. Dezember 2019: 13.146.785)	10.272.765	4,66
	3,625 % 01-Jan.-2028	497.535	0,23	561.800.000	Japan Government Two Year Bond		
1.038.000	IQVIA Inc 'REGS' 2,875 % 15-Jun.-2028	1.036.703	0,47		0,100 % 01-Jun.-2021	4.665.072	2,12
3.840.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro			543.000.000	Japan Government Two Year Bond		
	4,500 % 01-Mai-2023	4.301.210	1,95		0,100 % 01-Apr.-2022	4.517.032	2,05
4.113.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A'			132.199.837	Japanese Government CPI Linked Bond		
	1,850 % 01-Jul.-2025	4.347.778	1,97		0,100 % 10-März-2028	1.090.661	0,49
1.600.000	JCDecaux SA 2,000 % 24-Okt.-2024	1.619.120	0,74				
					Malaysischer Ringgit - 3.757.208 (31. Dezember 2019: 2.239.092)	3.757.208	1,71
				16.888.000	Malaysia Government Bond 3,906 % 15-Jul.-2026	3.757.208	1,71

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in EUR	Summe der Nettovermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in EUR	Summe der Nettovermögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
	Neuer mexikanischer Peso - 3.549.597				Sterling Forts.		
	(31. Dezember 2019: 2.306.002)	3.549.597	1,61	450.000	Virgin Media Secured Finance Plc 'REGS'		
44.615.800	Mexican Bonos 7,500% 03-Jun.-2027	1.913.673	0,87		6,250 % 28-März-2029	521.830	0,24
35.900.000	Mexican Bonos 8,500% 31-Mai-2029	1.635.924	0,74	1.119.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 'REGS'		
					4,875 % 15-Jul.-2028	1.235.425	0,56
	Neuseeländischer Dollar - 3.324.085			867.000	Vodafone Group Plc FRN 4,875% 03-Okt.-2078	989.205	0,45
	(31. Dezember 2019: 5.475.940)	3.324.085	1,51	820.000	Wagamama Finance Plc 'REGS'		
2.670.000	New Zealand Government Inflation Linked Bond				4,125 % 01-Jul.-2022	803.778	0,36
	3,000 % 20-Sept.-2030	2.153.435	0,98	1.355.000	Yorkshire Building Society FRN		
1.680.000	New Zealand Local Government Funding Agency Bond				0,664 % 19-Nov.-2023	1.493.332	0,68
	3,500 % 14-Apr.-2033	1.170.650	0,53				
					Schwedische Krone - 2.199.722		
	Norwegische Krone - 9.056.430				(31. Dezember 2019: 1.797.450)	2.199.722	1,00
	(31. Dezember 2019: 7.431.047)	9.056.430	4,11	22.000.000	Stadshypotek AB 1,500 % 01-März-2024	2.199.722	1,00
52.940.000	Norway Government Bond '144A'						
	1,750 % 17-Feb.-2027	5.260.379	2,39		US-Dollar - 67.248.467		
41.000.000	SpareBank 1 Boligkredit AS 'GMTN'				(31. Dezember 2019: 58.175.438)	67.248.467	30,53
	1,500 % 16-Jun.-2021	3.796.051	1,72	568.000	Apple Inc 1,125 % 11-Mai-2025	517.523	0,24
				228.000	Apple Inc 1,700 % 11-Sept.-2022	209.545	0,10
	Peruanischer Nuevo Sol - 2.102.934			224.000	Argentine Republic Government International Bond		
	(31. Dezember 2019: 1.360.940)	2.102.934	0,95		6,875 % 22-Apr.-2021	84.857	0,04
6.430.000	Peruvian Government International Bond 'REGS'			2.130.000	Bank of England Euro Note 'REGS'		
	8,200 % 12-Aug.-2026	2.102.934	0,95		0,500 % 28-Apr.-2023	1.910.811	0,87
				1.300.000	Best Buy Co Inc 5,500 % 15-März-2021	1.185.359	0,54
	Philippinischer Peso - 2.169.562			845.000	Brixmor Operating Partnership LP		
	(31. Dezember 2019: 890.222)	2.169.562	0,99		4,050 % 01-Jul.-2030	770.600	0,35
120.000.000	Philippine Government International Bond			1.030.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A'		
	4,950 % 15-Jan.-2021	2.169.562	0,99		5,500 % 01-Mai-2026	954.369	0,43
				717.000	Comcast Corp 3,300 % 01-Apr.-2027	719.810	0,33
	Singapur-Dollar - 2.248.567			1.560.000	Commonwealth Bank of Australia 'REGS'		
	(31. Dezember 2019: 892.375)	2.248.567	1,02		2,125 % 22-Jul.-2020	1.393.219	0,63
3.460.000	Singapore Government Bond 2,250 % 01-Jun.-2021	2.248.567	1,02	600.000	Credit Suisse Group AG 'REGS' FRN (Immerwährend)		
					7,250 % 12-Sept.-2025	549.707	0,25
	Sterling - 20.470.146			1.150.000	Dell International LLC / EMC Corp '144A'		
	(31. Dezember 2019: 15.210.178)	20.470.146	9,29		7,125 % 15-Jun.-2024	1.061.612	0,48
520.000	Anglian Water Services Financing Plc 'EMTN'			1.140.000	DNB Boligkredit AS 'REGS'		
	1,625 % 10-Aug.-2025	582.442	0,26		2,500 % 28-März-2022	1.051.139	0,48
565.000	Clarion Funding Plc 'EMTN' 2,625 % 18-Jan.-2029	677.994	0,31	900.000	Dominican Republic International Bond 'REGS'		
990.000	Close Brothers Finance Plc 'EMTN'				7,450 % 30-Apr.-2044	820.999	0,37
	2,750 % 19-Okt.-2026	1.138.033	0,52	303.333	Dominican Republic International Bond 'REGS'		
455.000	Close Brothers Group Plc FRN				7,500 % 06-Mai-2021	279.752	0,13
	4,250 % 24-Jan.-2027	510.033	0,23	1.250.000	Ecuador Government International Bond 'REGS'		
600.000	CPUK Finance Ltd 'REGS' 4,250 % 28-Aug.-2022	633.011	0,29		8,875 % 23-Okt.-2027	472.555	0,21
470.000	CPUK Finance Ltd 'REGS' 4,875 % 28-Aug.-2025	481.606	0,22	634.000	Ethiopia International Bond 'REGS'		
1.135.000	European Investment Bank 'EMTN'				6,625 % 11-Dez.-2024	568.218	0,26
	0,750 % 15-Nov.-2024	1.273.641	0,58	473.000	European Bank for Reconstruction & Development		
1.155.046	Gwynt y Mor OFTO Plc 2,778 % 17-Feb.-2034	1.400.403	0,63		1,625 % 27-Sept.-2024	443.007	0,20
366.000	Hiscox Ltd 2,000 % 14-Dez.-2022	401.642	0,18	850.000	European Bank for Reconstruction & Development 'GMTN' 2,750 % 07-März-2023	807.264	0,37
780.000	Iceland Bondco Plc 'REGS' 4,625 % 15-März-2025	767.985	0,35	200.000	Fiji Government International Bond		
990.000	Informa Plc 'EMTN' 3,125 % 05-Jul.-2026	1.103.324	0,50		6,625 % 02-Okt.-2020	178.411	0,08
1.940.000	International Bank for Reconstruction & Development 'GMTN' 0,500 % 24-Jul.-2023	2.144.681	0,97	1.910.000	HSBC Bank Canada 'REGS' 0,950 % 14-Mai-2023	1.719.170	0,78
600.000	Investec Plc 'EMTN' FRN (Immerwährend)			1.620.000	Indonesia Government International Bond 'REGS'		
	6,750 % 05-Dez.-2024	542.816	0,25		5,875 % 15-Jan.-2024	1.642.302	0,75
1.080.000	Lloyds Banking Group Plc FRN (Immerwährend)			1.940.000	Inter-American Development Bank		
	5,125 % 27-Dez.-2024	1.083.409	0,49		3,125 % 18-Sept.-2028	2.048.981	0,93
370.000	National Express Group Plc 2,375 % 20-Nov.-2028	389.446	0,18	610.000	Inter-American Development Bank FRN		
1.070.000	Nationwide Building Society FRN (Immerwährend)				0,341 % 16-Sept.-2022	542.628	0,25
	5,875 % 20-Dez.-2024	1.178.334	0,53	3.140.000	International Bank for Reconstruction & Development 1,625 % 15-Jan.-2025	2.951.897	1,34
200.000	UBS AG/London 'EMTN' 1,250 % 10-Dez.-2020	219.443	0,10				
790.000	UNITE USAF II Plc 3,374 % 30-Jun.-2023	898.333	0,41				

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in EUR	Summe der Nettovermögen %	Bestände	Beschreibung	Zugrunde liegendes Engagement in EUR	Angemessener Wert in EUR	Summe der Nettovermögen %
Anleihen Forts.				Offene Terminkontrakte – (135.191) (31. Dezember 2019: 92.393)				
	US-Dollar Forts.			(29)	Euro-Bund			
2.790.000	International Bank for Reconstruction & Development FRN 0,471 % 17-Jun.-2024	2.488.078	1,13		Short Futures Contracts			
1.186.000	JPMorgan Chase & Co FRN 2,046 % 29-Okt.-2020	1.061.027	0,48		Exp Sep.-2020	(5.123.720)	(47.574)	(0,02)
2.500.000	JPMorgan Chase & Co FRN 2,083 % 22-Apr.-2026	2.318.881	1,05	(60)	SFE 10 Year Australian Treasury Bond			
2.280.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau				Short Futures Contracts			
	1,500 % 15-Jun.-2021	2.059.001	0,93		Exp Sep.-2020	(5.454.819)	(71.354)	(0,03)
1.000.000	Laureate Education Inc '144A'			(29)	UK Long Gilt			
	8,250 % 01-Mai-2025	929.087	0,42		Short Futures Contracts			
1.220.000	Level 3 Financing Inc 5,375 % 15-Aug.-2022	1.089.836	0,49		Exp Sep.-2020	(4.374.961)	(16.263)	(0,01)
1.160.000	Level 3 Financing Inc 5,375 % 15-Jan.-2024	1.047.709	0,48					
1.788.000	Mexico Government International Bond			Summe der offenen Terminkontrakte			(135.191)	(0,06)
	3,900 % 27-Apr.-2025	1.711.591	0,78		Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften - (1.673.271) (siehe unten) 31. Dezember 2019: (1.167.027))		(1.673.271)	(0,76)
1.000.000	Mexico Government International Bond			Summe der finanziellen Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert			(1.808.462)	(0,82)
	4,500 % 22-Apr.-2029	966.968	0,44	Nettoumlaufvermögen			8.014.867	3,64
1.119.000	Microsoft Corp 2,000 % 08-Aug.-2023	1.041.494	0,47	Summe der Nettovermögen			220.293.946	100,00
1.080.000	Mongolia Government International Bond 'REGS'			Der Kontrahent für Terminkontrakte ist UBS AB.				
	10,875 % 06-Apr.-2021	1.004.460	0,46	Portfolioanalyse			% des Gesamtvermögens	
625.000	NextEra Energy Capital Holdings Inc			An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten				
	3,250 % 01-Apr.-2026	623.911	0,28	Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente				
2.390.000	Paraguay Government International Bond 'REGS'			OTC-Finanzderivate				
	5,000 % 15-Apr.-2026	2.361.554	1,07	Sonstiges Umlaufvermögen				
616.000	Philippine Government International Bond			Summe der Aktiva			100,00	
	2,457 % 05-Mai-2030	577.535	0,26					
922.000	Royal Bank of Scotland Group Plc FRN (Immerwährend)							
	6,000 % 29-Dez.-2025	832.423	0,38					
1.270.000	Royal Bank of Scotland Group Plc FRN (Immerwährend)							
	7,500 % 10-Aug.-2020	1.137.719	0,52					
1.000.000	Royal Bank of Scotland Group Plc FRN (Immerwährend)							
	8,625 % 15-Aug.-2021	924.230	0,42					
1.300.000	Sprint Corp 7,875 % 15-Sept.-2023	1.309.097	0,59					
1.395.000	T-Mobile USA Inc 6,000 % 01-März-2023	1.253.321	0,57					
1.780.000	UBS Group AG FRN (Immerwährend)							
	5,000 % 31-Jan.-2023	1.497.230	0,68					
1.952.256	United States Treasury Inflation Indexed Bonds							
	0,500 % 15-Apr.-2024	1.830.916	0,83					
7.530.000	United States Treasury Note/Bond							
	1,500 % 15-Aug.-2026	7.162.081	3,25					
6.990.000	United States Treasury Note/Bond							
	1,500 % 15-Feb.-2030	6.751.260	3,06					
990.000	United States Treasury Note/Bond							
	2,000 % 15-Feb.-2050	1.016.701	0,46					
26.000	Vietnam Government International Bond 'REGS'							
	4,800 % 19-Nov.-2024	25.457	0,01					
208.000	VTR Comunicaciones SpA 'REGS'							
	5,125 % 15-Jan.-2028	189.044	0,09					
1.280.000	Westpac Banking Corp 'REGS'							
	2,100 % 25-Feb.-2021	1.154.121	0,52					
Summe der Anlagen in Anleihen		208.292.229	94,55					
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 5.795.312 (siehe unten) 31. Dezember 2019: 929.336)								
		5.795.312	2,63					
Summe der Vermögenswerte zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert		214.087.541	97,18					

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte							Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund							BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund Forts.						
Euro	US-Dollar	17.799	19.940	01-Jul.-20	State Street Bank	10	Euro	Sterling	171.615	156.880	01-Jul.-20	Barclays Bank PLC	(121)
Australischer Dollar	Euro	736.696	439.946	14-Aug.-20	State Street Bank	9.839	Australischer Dollar	Euro	562.074	343.616	14-Aug.-20	Barclays Bank PLC	(446)
Australischer Dollar	Euro	683.498	408.253	14-Aug.-20	State Street Bank	9.051	Australischer Dollar	Euro	788.096	483.349	14-Aug.-20	Citigroup Global Markets Limited	(2.182)
Tschechische Krone	Euro	90.717.617	3.359.723	14-Aug.-20	Barclays Bank PLC	21.467	Australischer Dollar	Euro	1.013.928	621.609	14-Aug.-20	State Street Bank	(2.563)
Euro	Kanadischer Dollar	2.924.271	4.468.318	14-Aug.-20	State Street Bank	12.798	Australischer Dollar	Euro	2.945.956	1.807.503	14-Aug.-20	State Street Bank	(8.870)
Euro	Kanadischer Dollar	2.378.732	3.636.591	14-Aug.-20	Royal Bank of Scotland	9.196	Kanadischer Dollar	Euro	3.311.000	2.174.389	14-Aug.-20	State Street Bank	(17.002)
Euro	Ungarischer Forint	2.932.777	1.034.842.012	14-Aug.-20	State Street Bank	32.963	Kolumbianischer Peso	US-Dollar	9.601.540.000	2.555.511	14-Aug.-20	State Street Bank	(1.766)
Euro	Japanischer Yen	6.016.493	697.091.179	14-Aug.-20	Barclays Bank PLC	246.605	Euro	Australischer Dollar	13.393.130	22.609.637	14-Aug.-20	Barclays Bank PLC	(411.026)
Euro	Japanischer Yen	4.699.764	545.951.489	14-Aug.-20	State Street Bank	180.873	Euro	Australischer Dollar	310.733	513.764	14-Aug.-20	Citigroup Global Markets Limited	(2.942)
Euro	Norwegische Krone	651.078	6.863.481	14-Aug.-20	Royal Bank of Scotland	22.460	Euro	Tschechische Krone	816.854	22.085.709	14-Aug.-20	Citigroup Global Markets Limited	(6.315)
Euro	Norwegische Krone	2.358.847	24.828.000	14-Aug.-20	State Street Bank	84.882	Euro	Tschechische Krone	1.451.324	39.282.490	14-Aug.-20	UBS AG	(12.797)
Euro	Singapur-Dollar	2.213.265	3.405.601	14-Aug.-20	Barclays Bank PLC	40.712	Euro	Neuseeländischer Dollar	304.761	546.000	14-Aug.-20	Citigroup Global Markets Limited	(6.890)
Euro	Sterling	768.808	690.000	14-Aug.-20	Citigroup Global Markets Limited	13.991	Euro	Neuseeländischer Dollar	6.658.784	11.974.032	14-Aug.-20	Royal Bank of Scotland	(175.867)
Euro	Sterling	458.670	402.182	14-Aug.-20	State Street Bank	18.708	Euro	Norwegische Krone	8.714.065	97.499.821	14-Aug.-20	Royal Bank of Scotland	(215.821)
Euro	Sterling	390.378	343.256	14-Aug.-20	State Street Bank	14.878	Euro	Schwedische Krone	2.131.918	22.821.658	14-Aug.-20	Barclays Bank PLC	(40.264)
Euro	Sterling	28.850.989	25.149.640	14-Aug.-20	Barclays Bank PLC	1.338.842	Euro	US-Dollar	179.313	201.861	14-Aug.-20	State Street Bank	(602)
Euro	Sterling	371.872	331.000	14-Aug.-20	HSBC Bank plc	9.778	Euro	US-Dollar	1.843.681	2.085.519	14-Aug.-20	Barclays Bank PLC	(15.103)
Euro	Sterling	1.247.830	1.115.539	14-Aug.-20	UBS AG	27.500	Euro	US-Dollar	3.155.715	3.575.402	14-Aug.-20	Barclays Bank PLC	(30.974)
Euro	Sterling	1.441.437	1.294.000	14-Aug.-20	Royal Bank of Scotland	25.882	Euro	US-Dollar	1.984.745	2.254.000	14-Aug.-20	State Street Bank	(24.203)
Euro	Sterling	106.565	96.570	14-Aug.-20	Barclays Bank PLC	924	Euro	US-Dollar	114.178	129.399	14-Aug.-20	Royal Bank of Scotland	(1.153)
Euro	US-Dollar	2.153.546	2.337.000	14-Aug.-20	UBS AG	70.621	Ungarischer Forint	Euro	108.150.628	308.382	14-Aug.-20	Barclays Bank PLC	(5.325)
Euro	US-Dollar	2.275.706	2.473.018	14-Aug.-20	HSBC Bank plc	71.551	Ungarischer Forint	Euro	196.859.001	560.166	14-Aug.-20	UBS AG	(8.532)
Euro	US-Dollar	493.896	533.687	14-Aug.-20	Barclays Bank PLC	18.231	Ungarischer Forint	Euro	174.316.519	496.127	14-Aug.-20	UBS AG	(7.661)
Euro	US-Dollar	1.848.583	2.031.462	14-Aug.-20	State Street Bank	37.979	Ungarischer Forint	Euro	278.840.807	793.024	14-Aug.-20	UBS AG	(11.662)
Euro	US-Dollar	166.039	182.784	14-Aug.-20	Royal Bank of Scotland	3.127	Ungarischer Forint	Euro	276.675.058	781.031	14-Aug.-20	UBS AG	(5.738)
Euro	US-Dollar	1.984.366	2.210.000	14-Aug.-20	HSBC Bank plc	14.634	Malaysischer Ringgit	US-Dollar	9.853.000	2.311.446	14-Aug.-20	State Street Bank	(17.815)
Euro	US-Dollar	2.170.322	2.352.000	14-Aug.-20	State Street Bank	74.028	Neuseeländischer Dollar	Euro	2.359.277	1.350.969	14-Aug.-20	Citigroup Global Markets Limited	(4.319)
Euro	US-Dollar	1.936.936	2.170.201	14-Aug.-20	State Street Bank	2.676	Norwegische Krone	Euro	5.891.447	542.165	14-Aug.-20	Barclays Bank PLC	(2.575)
Euro	US-Dollar	89.399.142	97.082.283	14-Aug.-20	State Street Bank	2.871.499	Sterling	Euro	109.303	119.573	14-Aug.-20	Barclays Bank PLC	(2)
Euro	US-Dollar	764.518	857.638	14-Aug.-20	HSBC Bank plc	121	Sterling	Euro	358.000	394.738	14-Aug.-20	State Street Bank	(3.108)
Indonesische Rupiah	US-Dollar	14.188.554.500	920.349	14-Aug.-20	State Street Bank	43.508	Sterling	Euro	3.816.036	4.276.822	14-Aug.-20	Barclays Bank PLC	(102.315)
Neuseeländischer Dollar	Euro	990.672	551.766	14-Aug.-20	Citigroup Global Markets Limited	13.699	Sterling	Euro	1.160.327	1.284.816	14-Aug.-20	State Street Bank	(15.490)
Neuseeländischer Dollar	Euro	1.349.378	751.142	14-Aug.-20	UBS AG	19.069	Sterling	Euro	367.389	405.335	14-Aug.-20	Barclays Bank PLC	(3.435)
Neuseeländischer Dollar	Euro	992.541	553.687	14-Aug.-20	Barclays Bank PLC	12.845	Sterling	Euro	481.527	531.777	14-Aug.-20	UBS AG	(5.015)
Neuseeländischer Dollar	Euro	821.821	459.082	14-Aug.-20	Barclays Bank PLC	10.005	US-Dollar	Kolumbianischer Peso	2.422.796	9.601.540.000	14-Aug.-20	State Street Bank	(116.520)
Norwegische Krone	Euro	23.801.000	2.150.607	14-Aug.-20	UBS AG	29.297	US-Dollar	Euro	303.333	279.710	14-Aug.-20	Barclays Bank PLC	(9.354)
Sterling	Euro	472.650	515.209	14-Aug.-20	State Street Bank	1.841	US-Dollar	Euro	236.701	211.047	14-Aug.-20	Barclays Bank PLC	(80)
Sterling	Euro	156.880	171.499	14-Aug.-20	Barclays Bank PLC	118	US-Dollar	Euro	442.520	403.452	14-Aug.-20	Barclays Bank PLC	(9.042)
US-Dollar	Euro	723.897	645.037	14-Aug.-20	State Street Bank	159	US-Dollar	Euro	775.950	703.670	14-Aug.-20	HSBC Bank plc	(12.080)
US-Dollar	Euro	11.198.847	9.970.647	14-Aug.-20	State Street Bank	10.677	US-Dollar	Euro	2.756.100	2.544.932	14-Aug.-20	State Street Bank	(88.471)
US-Dollar	Euro	230.689	204.288	14-Aug.-20	Citigroup Global Markets Limited	1.321	US-Dollar	Euro	255.829	232.284	14-Aug.-20	State Street Bank	(4.268)
US-Dollar	Euro	2.675.000	2.354.383	14-Aug.-20	State Street Bank	29.795	US-Dollar	Euro	387.249	347.608	14-Aug.-20	State Street Bank	(2.460)
US-Dollar	Euro	1.007.000	884.451	14-Aug.-20	Royal Bank of Scotland	13.070	US-Dollar	Indonesische Rupiah	3.211.855	50.079.246.000	14-Aug.-20	Royal Bank of Scotland	(186.151)
US-Dollar	Euro	167.379	148.505	14-Aug.-20	State Street Bank	677	US-Dollar	Malaysischer Ringgit	409.509	1.783.000	14-Aug.-20	Canadian Imperial Bank	(4.594)
US-Dollar	Euro	206.039	183.364	14-Aug.-20	State Street Bank	275	US-Dollar	Malaysischer Ringgit	1.866.759	8.070.000	14-Aug.-20	Royal Bank of Scotland	(8.945)
US-Dollar	Euro	145.472	128.740	14-Aug.-20	Royal Bank of Scotland	916	US-Dollar	Philippinischer Peso	2.295.189	116.871.000	14-Aug.-20	Royal Bank of Scotland	(37.239)
US-Dollar	Euro	738.635	658.154	14-Aug.-20	State Street Bank	178							
EUR 5.473.276							EUR (1.649.103)						
							Netto EUR 3.824.173						

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte Forts.							Devisenterminkontrakte Forts.							Nicht	
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)		
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund							BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund								
Anteilsklasse CHF E (Acc) (Hedged)							Anteilsklasse CHF W (Acc) (Hedged)								
Euro	Schweizer Franken	51.911	55.223	01-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	81	Euro	Schweizer Franken	1.646.875	1.751.949	01-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	2.582		
Schweizer Franken	Euro	4.982	4.667	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	9	Schweizer Franken	Euro	45	42	02-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	-		
Schweizer Franken	Euro	20.032	18.765	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	38	Euro	Schweizer Franken	180	192	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	-		
Schweizer Franken	Euro	24.985	23.311	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	141	Euro	Schweizer Franken	1.104	1.176	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	-		
Schweizer Franken	Euro	9.808	9.124	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	82	Euro	Schweizer Franken	42	45	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	-		
Schweizer Franken	Euro	40.028	37.201	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	371	Euro	Schweizer Franken	934	994	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	2		
Schweizer Franken	Euro	11.607.990	10.786.519	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	109.144	Euro	Schweizer Franken	3.110	3.312	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	1		
Schweizer Franken	Euro	25.010	23.422	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	53	Schweizer Franken	Euro	970	911	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	-		
Schweizer Franken	Euro	51.867	48.594	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	90	Schweizer Franken	Euro	1.990	1.864	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	4		
						EUR	110.009								
						CHF	117.212								
Euro	Schweizer Franken	141.789	151.073	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(13)	Schweizer Franken	Euro	3.614	3.362	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	30		
Schweizer Franken	Euro	55.223	51.918	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(84)	Schweizer Franken	Euro	1.221	1.135	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	11		
						EUR	(97)								
						CHF	(103)								
						Netto EUR	109.912								
						Netto CHF	117.109								
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund														EUR	202.799
Anteilsklasse CHF H (Acc) (Hedged)														CHF	216.077
Schweizer Franken	Euro	270.492	251.350	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	2.543	Schweizer Franken	Euro	994	934	01-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1)		
						EUR	2.543								
						CHF	2.709								
Euro	Schweizer Franken	17.812	19.015	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(36)	Euro	Schweizer Franken	31.836	33.929	02-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(8)		
						EUR	(36)								
						CHF	(38)								
						Netto EUR	2.507								
						Netto CHF	2.671								
Schweizer Franken	Euro						Euro	Schweizer Franken	493	526	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1)		
Euro	Schweizer Franken						Euro	Schweizer Franken	4.532	4.838	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(9)		
Euro	Schweizer Franken						Euro	Schweizer Franken	1.830	1.957	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(7)		
Euro	Schweizer Franken						Euro	Schweizer Franken	4.163	4.454	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(17)		
Euro	Schweizer Franken						Euro	Schweizer Franken	1.516	1.625	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(9)		
Euro	Schweizer Franken						Euro	Schweizer Franken	1.117	1.202	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(11)		
Schweizer Franken	Euro						Schweizer Franken	Euro	1.751.949	1.647.113	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(2.673)		
						EUR	(2.736)								
						CHF	(2.915)								
						Netto EUR	200.063								
						Netto CHF	213.162								

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte Forts.							Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund							BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund						
Anteilsklasse NOK H (Acc) (Hedged)							Anteilsklasse USD W (Acc) (Hedged)						
Norwegische Krone	Euro	884.207	83.879	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(2.851)	US-Dollar	Euro	60.000	53.146	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	366
							US-Dollar	Euro	548.224	482.781	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	6.167
						EUR						EUR	6.533
						NOK						USD	7.323
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund							BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund						
Anteilsklasse NOK W (Acc) (Hedged)							Anteilsklasse USD W (Acc) (Hedged)						
Norwegische Krone	Euro	890.656	84.491	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(2.872)	Euro	US-Dollar	53.160	60.000	02-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(369)
						EUR	US-Dollar	Euro	36.420	32.488	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(6)
						NOK						EUR	(375)
												USD	(420)
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund							BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund						
Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)							Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)						
Sterling	Euro	116.552	130.762	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(3.200)						Netto EUR	6.158
						EUR						Netto USD	6.903
						GBP							
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund							BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund						
Anteilsklasse Sterling W (Inc) (Hedged)							Anteilsklasse Sterling W (Inc) (Hedged)						
Euro	Sterling	55	50	02-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	-							
Euro	Sterling	64	57	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	1							
Euro	Sterling	6.539	5.836	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	151							
Sterling	Euro	50	55	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	-							
						EUR							
						GBP							
Sterling	Euro	6.000	6.623	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(57)							
Sterling	Euro	435.066	488.112	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(11.944)							
						EUR							
						GBP							
						Netto EUR							
						Netto GBP							

BNY MELLON SUSTAINABLE GLOBAL REAL RETURN FUND (EUR)^

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener Wert in EUR	Summe der Netto- vermögen %			Angemessener Wert in EUR	Summe der Netto- vermögen %
Bestände	Beschreibung			Bestände	Beschreibung		
Organismen für gemeinsame Anlagen				Anleihen Forts.			
	Irland - 3.549.450	3.549.450	14,17		Mexiko - 385.847	385.847	1,54
18.697	Amundi Physical Gold ETC	1.178.891	4,71	3.081.100	Mexican Bonos 7,500 % 03-Jun.-2027	132.155	0,53
6.885	Invesco Physical Gold ETC	1.054.002	4,21	4.067.300	Mexican Bonos 7,750 % 29-Mai-2031	176.919	0,70
42.645	iShares Physical Gold ETC	1.316.557	5,25	1.657.300	Mexican Bonos 10,000 % 05-Dez.-2024	76.773	0,31
Jersey - 455.502					Mongolei - 186.011	186.011	0,74
1.383	WisdomTree Physical Swiss Gold ETC	210.806	0,84	200.000	Mongolia Government International Bond 'REGS' 10,875 % 06-Apr.-2021	186.011	0,74
1.594	Xtrackers Physical Gold ETC	244.695	0,98	Niederlande - 97.750			
Großbritannien - 122.669				100.000	Telefonica Europe BV FRN (Immerwährend) 3,000 % 04-Sept.-2023	97.750	0,39
102.805	Gresham House Energy Storage Fund Plc/The Fund	122.669	0,49	Neuseeland - 237.951			
Summe der Anlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen				131.000	New Zealand Government Bond 2,750 % 15-Apr.-2037	92.013	0,37
				171.000	New Zealand Government Inflation Linked Bond 2,500 % 20-Sept.-2040	145.938	0,58
Anleihen				Norwegen - 175.529			
	Australien - 1.004.434	1.004.434	4,01	200.000	DNB Bank ASA FRN (Immerwährend) 4,875 % 12-Nov.-2024	175.529	0,70
419.000	Australia Government Bond 3,000 % 21-März-2047	326.126	1,30	Spanien - 198.122			
501.000	Australia Government Bond 3,250 % 21-Jun.-2039	393.840	1,57	200.000	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN (Immerwährend) 6,000 % 29-März-2024	198.122	0,79
94.000	Australia Government Bond 3,750 % 21-Apr.-2037	77.981	0,31	Großbritannien - 984.927			
152.800	New South Wales Treasury Corp 2,750 % 20-Nov.-2025	141.202	0,56	9.000	Anglian Water Services Financing Plc 'EMTN' 4,125 % 28-Jul.-2020	17.338	0,07
49.000	Treasury Corp of Victoria 4,250 % 20-Dez.-2032	39.210	0,16	19.000	British Telecommunications Plc 'EMTN' 3,500 % 25-Apr.-2025	43.103	0,17
33.000	Treasury Corp of Victoria 5,500 % 17-Nov.-2026	26.075	0,11	100.000	Iceland Bondco Plc 'REGS' 4,625 % 15-März-2025	98.459	0,39
Cayman-Inseln - 182.253				200.000	Investec Plc 'EMTN' FRN (Immerwährend) 6,750 % 05-Dez.-2024	180.939	0,72
200.000	Sable International Finance Ltd '144A' 5,750 % 07-Sept.-2027	182.253	0,73	100.000	Iron Mountain UK Plc 'REGS' 3,875 % 15-Nov.-2025	105.132	0,42
Kolumbien - 87.276				200.000	Scottish Hydro Electric Transmission Plc 'EMTN' 2,250 % 27-Sept.-2035	237.081	0,95
322.800.000	Colombia Government International Bond 'REGS' 7,500 % 26-Aug.-2026	87.276	0,35	44.000	Tesco Plc 'EMTN' 3,322 % 05-Nov.-2025	97.451	0,39
Ecuador - 75.609				56.863	Tesco Property Finance 3 Plc 5,744 % 13-Apr.-2040	84.211	0,34
200.000	Ecuador Government International Bond 'REGS' 8,875 % 23-Okt.-2027	75.609	0,30	117.000	Vodafone Group Plc FRN 7,000 % 04-Apr.-2079	121.213	0,48
Frankreich - 202.390				USA - 661.137			
200.000	JCDecaux SA 2,000 % 24-Okt.-2024	202.390	0,81	115.000	Comcast Corp 3,300 % 01-Apr.-2027	115.451	0,46
Deutschland - 199.014				120.000	Fiserv Inc 3,500 % 01-Jul.-2029	120.037	0,48
200.000	Infineon Technologies AG FRN (Immerwährend) 3,625 % 01-Jan.-2028	199.014	0,79	250.000	JPMorgan Chase & Co FRN 2,083 % 22-Apr.-2026	231.888	0,93
Ungarn - 135.828				76.000	Laureate Education Inc '144A' 8,250 % 01-Mai-2025	70.611	0,28
44.910.000	Hungary Government Bond 3,000 % 21-Aug.-2030	135.828	0,54	31.000	Sprint Capital Corp 8,750 % 15-März-2032	39.511	0,16
Indonesien - 146.871				26.000	Sprint Corp 7,125 % 15-Jun.-2024	26.067	0,10
2.258.000.000	Indonesia Treasury Bond 8,250 % 15-Mai-2036	146.871	0,59	58.000	T-Mobile USA Inc '144A' 3,875 % 15-Apr.-2030	57.572	0,23
Irland - 110.404				Summe der Anlagen in Anleihen			
100.000	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 'REGS' 4,875 % 15-Jul.-2028	110.404	0,44			5.420.855	21,64
Italien - 147.500				Aktien			
200.000	UniCredit SpA 'EMTN' FRN (Immerwährend) 3,875 % 03-Jun.-2027	147.500	0,59	Kanada - 118.042		118.042	0,47
Jersey - 105.502				1.412	Intact Financial Corp	118.042	0,47
100.000	CPUK Finance Ltd 'REGS' 4,250 % 28-Aug.-2022	105.502	0,42	Cayman-Inseln - 751.592		751.592	3,00
Luxemburg - 96.500				1.175	Alibaba Group Holding Ltd ADR	225.371	0,90
100.000	Summer BC Holdco B SARL 'REGS' 5,750 % 31-Okt.-2026	96.500	0,39	1.701	New Oriental Education & Technology Group Inc ADR	199.213	0,80
				3.799	Tencent Holdings Ltd	218.002	0,87
				9.218	Tencent Music Entertainment Group ADR	109.006	0,43

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener		Bestände	Beschreibung	Angemessener	
		Wert	Summe			Wert	Summe
		in EUR	der Netto-			in EUR	der Netto-
			vermögen %				vermögen %
Aktien Forts.				Aktien Forts.			
	China - 66.866	66.866	0,27		Großbritannien - 989.930	989.930	3,95
7.500	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	66.866	0,27	8.003	IMI Plc	81.564	0,32
	Dänemark - 334.369	334.369	1,33	228.870	Impact Healthcare Reit Plc (REIT)	236.514	0,94
1.584	Chr Hansen Holding A/S	145.022	0,58	20.523	Informa Plc	105.705	0,42
1.840	Orsted A/S '144A'	189.347	0,75	4.503	Johnson Matthey Plc	104.479	0,42
	Frankreich - 661.069	661.069	2,64	26.792	National Express Group Plc	57.075	0,23
7.984	Bureau Veritas SA	150.419	0,60	2.993	Persimmon Plc	75.489	0,30
435	L'Oreal SA	124.475	0,50	19.210	Prudential Plc	257.082	1,03
278	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	108.962	0,43	5.812	Travis Perkins Plc	72.022	0,29
771	Sanofi	69.752	0,28		USA - 2.607.000	2.607.000	10,41
9.022	Vivendi SA	207.461	0,83	1.672	Abbott Laboratories	132.787	0,53
	Deutschland - 984.318	984.318	3,93	95	Alphabet Inc - A-Klasse	118.450	0,47
1.762	Continental AG	153.963	0,62	60	Amazon.com Inc	143.536	0,57
6.608	Deutsche Wohnen SE	263.990	1,05	499	Apple Inc	161.141	0,64
2.070	LEG Immobilien AG	237.491	0,95	10.721	Brixmor Property Group Inc (REIT)	123.910	0,49
2.669	SAP SE	328.874	1,31	1.365	CMS Energy Corp	70.095	0,28
	Hongkong - 472.912	472.912	1,89	829	Ecolab Inc	144.618	0,58
35.400	AIA Group Ltd	294.318	1,18	1.928	Eversource Energy	142.944	0,57
24.500	Link REIT (Units) (REIT)	178.594	0,71	790	Fidelity National Information Services Inc	92.451	0,37
	Indien - 81.815	81.815	0,33	15.500	General Electric Co	93.962	0,38
2.010	HDFC Bank Ltd ADR	81.815	0,33	1.374	Goldman Sachs Group Inc/The	237.296	0,95
	Irland - 619.840	619.840	2,47	6.270	Laureate Education Inc - A-Klasse	55.462	0,22
1.419	Accenture Plc - A-Klasse	269.356	1,07	851	Mastercard Inc	222.559	0,89
1.321	Linde Plc	248.926	0,99	2.691	Merck & Co Inc	182.745	0,73
1.261	Medtronic Plc	101.558	0,41	1.841	Microsoft Corp	325.965	1,30
	Japan - 174.125	174.125	0,70	1.273	NIKE Inc	108.919	0,44
2.400	Ebara Corp	50.140	0,20	1.043	PepsiCo Inc	122.012	0,49
17.300	Topcon Corp	123.985	0,50	373	salesforce.com Inc	61.026	0,24
	Jersey - 121.530	121.530	0,48	133	Sherwin-Williams Co/The	67.122	0,27
1.678	Ferguson Plc	121.530	0,48		Summe der Anlagen in Aktien	9.913.727	39,58
	Niederlande - 560.539	560.539	2,24		Instrumente für Aktienanlagen		
383	ASML Holding NV	123.968	0,49		Guernsey - 863.776	863.776	3,45
9.959	Relx Plc	204.259	0,82	126.648	International Public Partnerships Ltd	233.611	0,93
4.880	Unilever NV	232.312	0,93	91.668	JLEN Environmental Assets Group Ltd	118.914	0,47
	Republik Korea - 191.820	191.820	0,77	69.177	NextEnergy Solar Fund Ltd	81.483	0,33
711	Samsung SDI Co Ltd	191.820	0,77	310.593	Renewables Infrastructure Group Ltd/The	429.768	1,72
	Südafrika - 156.465	156.465	0,62		Jersey - 215.329	215.329	0,86
960	Naspers Ltd	156.465	0,62	178.010	Foresight Solar Fund Ltd	215.329	0,86
	Schweiz - 823.884	823.884	3,29		Luxemburg - 137.372	137.372	0,55
3.430	Alcon Inc	175.287	0,70	76.751	BBGI SICAV SA/Fund	137.372	0,55
260	Lonza Group AG	121.231	0,49		Großbritannien - 1.043.728	1.043.728	4,17
1.961	Nestle SA	193.584	0,77	310.417	BioPharma Credit Plc/The Fund	271.674	1,08
210	Roche Holding AG	64.849	0,26	293.000	Greencoat UK Wind Plc/Funds	459.631	1,84
861	Zurich Insurance Group AG	268.933	1,07	269.242	Sdcl Energy Efficiency Income Trust Plc	312.424	1,25
	Taiwan - 197.611	197.611	0,79		Summe der Anlagen in Instrumente für Aktienanlagen	2.260.205	9,03
13.000	Elite Material Co Ltd	62.599	0,25		Indexoptionen - 484.503		
2.683	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	135.012	0,54	17	CBOE S&P 500 Index Call 17-Dez.-2020 3.000,000	377.946	1,51
				10	CBOE S&P 500 Index Put 17-Dez.-2020 2.650,000	106.557	0,42
					Summe der Indexoptionen	484.503	1,93

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

					Devisenterminkontrakte					Nicht		
		Zugrunde liegendes Engagement in EUR	Angemessener Wert in EUR	Summe der Netto- vermögen %					Abrechnungs- datum	Kontrahent	realisierter Gewinn/(Verlust)	
Bestände	Beschreibung				Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)				
Offene Terminkontrakte - 54.593					BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)							
46	U.S. 10 Year Treasury Note Long Futures Contracts Exp Sep.-2020	5.717.806	54.593	0,22	Euro	Sterling	5.932	5.160	15-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	284	
Summe der offenen Terminkontrakte										54.593	0,22	
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 617.894 (siehe unten)										617.894	2,47	
Summe der Vermögenswerte zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert										22.879.398	91,35	
Rohstoffoptionen - (9.895)												
(124)	iShares Physical Gold ETC Call 17-Jul.-2020 35,250		(3.319)	(0,01)								
(81)	iShares Physical Gold ETC Call 21-Aug.-2020 34,750		(6.576)	(0,03)								
Summe Rohstoffoptionen										(9.895)	(0,04)	
Indexoptionen - (148.898)												
(17)	CBOE S&P 500 Index Call 17-Dez.-2020 3.300,000		(134.981)	(0,54)								
(4)	CBOE S&P 500 Index Put 20-Aug.-2020 2.650,000		(13.917)	(0,05)								
Summe der Indexoptionen										(148.898)	(0,59)	
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften - (67.894) (siehe unten)										(67.894)	(0,27)	
Summe der finanziellen Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert										(226.687)	(0,90)	
Nettoumlaufvermögen										2.392.455	9,55	
Summe der Nettovermögen										25.045.166	100,00	
^ Siehe Erläuterung 18 zum Halbjahresabschluss. Der Kontrahent für Rohstoffoptionen ist UBS AG. Der Kontrahent für die Indexoptionen ist UBS AG. Der Kontrahent für Terminkontrakte ist UBS AB.												
Portfolioanalyse					% des Gesamtvermögens							
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten												
Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente					84,43							
An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate					2,10							
OTC-Finanzderivate					2,40							
Sonstiges Umlaufvermögen					11,07							
Summe der Aktiva					100,00							

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte Forts.							Devisenterminkontrakte Forts.							
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR) Forts.							BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR) Forts.							
Neuseeländischer Dollar	Euro	57.653	31.953	14-Aug.-20	Citigroup Global Markets Limited	955	Euro	Japanischer Yen	173.080	20.997.280	14-Aug.-20	Barclays Bank PLC	(717)	
Neuseeländischer Dollar	Euro	103.872	57.611	14-Aug.-20	Citigroup Global Markets Limited	1.678	Euro	Neuseeländischer Dollar	401.501	719.086	14-Aug.-20	Barclays Bank PLC	(8.946)	
Neuseeländischer Dollar	Euro	1.309.000	118.328	14-Aug.-20	State Street Bank	1.562	Euro	Schweizer Franken	37.610	40.161	14-Aug.-20	State Street Bank	(94)	
Neuseeländischer Dollar	Euro	16.517	14.708	14-Aug.-20	Citigroup Global Markets Limited	13	Euro	Schweizer Franken	61.669	66.000	14-Aug.-20	Canadian Imperial Bank	(294)	
US-Dollar	Euro	15.429	13.654	14-Aug.-20	Royal Bank of Scotland	97	Euro	US-Dollar	3.171	3.594	14-Aug.-20	Royal Bank of Scotland	(32)	
US-Dollar	Euro	17.633	15.612	14-Aug.-20	State Street Bank	104	Euro	US-Dollar	58.122	65.575	14-Aug.-20	Royal Bank of Scotland	(323)	
US-Dollar	Euro	44.384	39.218	14-Aug.-20	State Street Bank	340	Euro	US-Dollar	28.720	32.466	14-Aug.-20	State Street Bank	(216)	
US-Dollar	Euro	7.757	6.840	14-Aug.-20	State Street Bank	74	Euro	US-Dollar	49.487	56.000	14-Aug.-20	Citigroup Global Markets Limited	(425)	
US-Dollar	Euro	8.939	7.963	14-Aug.-20	Barclays Bank PLC	3	Euro	US-Dollar	8.710	9.816	14-Aug.-20	State Street Bank	(39)	
US-Dollar	Euro	21.965	19.470	14-Aug.-20	UBS AG	107	Euro	US-Dollar	19.656	22.101	14-Aug.-20	State Street Bank	(42)	
US-Dollar	Euro	452.927	399.537	14-Aug.-20	Citigroup Global Markets Limited	4.149	Euro	US-Dollar	74.741	84.000	14-Aug.-20	UBS AG	(127)	
US-Dollar	Euro	281.031	248.166	14-Aug.-20	Citigroup Global Markets Limited	2.312	Euro	US-Dollar	62.545	70.418	14-Aug.-20	Canadian Imperial Bank	(218)	
US-Dollar	Euro	10.511	9.292	14-Aug.-20	State Street Bank	76	Hongkong-Dollar	Euro	656.965	77.924	14-Aug.-20	Citigroup Global Markets Limited	(2.388)	
US-Dollar	Euro	37.236	32.686	14-Aug.-20	State Street Bank	501	Koreanischer Won	Euro	48.326.000	35.970	14-Aug.-20	State Street Bank	(159)	
US-Dollar	Euro	52.022	46.334	14-Aug.-20	Royal Bank of Scotland	32	Schweizer Franken	Euro	20.962	19.949	14-Aug.-20	Barclays Bank PLC	(270)	
US-Dollar	Euro	39.210	34.524	14-Aug.-20	State Street Bank	424	US-Dollar	Euro	121.590	110.406	14-Aug.-20	Canadian Imperial Bank	(2.034)	
Euro	Australischer Dollar	1.009.360	1.644.490	15-Sept.-20	Citigroup Global Markets Limited	6.006	US-Dollar	Euro	15.789	14.324	14-Aug.-20	State Street Bank	(252)	
US-Dollar	Kolumbianischer Peso	80.710	297.747.915	15-Sept.-20	Citigroup Global Markets Limited	1.531	US-Dollar	Euro	21.853	19.876	14-Aug.-20	Royal Bank of Scotland	(399)	
							US-Dollar	Euro	121.053	111.110	14-Aug.-20	Canadian Imperial Bank	(3.218)	
							Australischer Dollar	Euro	9.183	5.612	15-Sept.-20	State Street Bank	(9)	
													EUR	(62.592)
Euro	Japanischer Yen	745	90.100	01-Jul.-20	State Street Bank	(1)							Netto EUR	541.986
Euro	Sterling	1.670	1.526	01-Jul.-20	UBS AG	(1)								
Euro	Ungarischer Forint	835.065	305.520.018	15-Jul.-20	UBS AG	(21.841)								
Euro	Schwedische Krone	103.603	1.140.454	15-Jul.-20	Barclays Bank PLC	(4.979)								
Ungarischer Forint	Euro	71.206.990	203.762	15-Jul.-20	Barclays Bank PLC	(4.045)								
Ungarischer Forint	Euro	4.587.275	13.129	15-Jul.-20	Barclays Bank PLC	(263)								
Ungarischer Forint	Euro	11.939.407	34.069	15-Jul.-20	State Street Bank	(582)								
Ungarischer Forint	Euro	4.588.095	13.078	15-Jul.-20	Barclays Bank PLC	(209)								
Ungarischer Forint	Euro	10.690.033	30.129	15-Jul.-20	UBS AG	(146)								
Ungarischer Forint	Euro	186.673.361	526.126	15-Jul.-20	State Street Bank	(2.554)								
Ungarischer Forint	Euro	2.241.309	6.361	15-Jul.-20	UBS AG	(74)								
Ungarischer Forint	Euro	13.593.548	38.507	15-Jul.-20	UBS AG	(380)								
Sterling	Euro	15.166	17.236	15-Jul.-20	State Street Bank	(638)								
Sterling	Euro	1.435	1.621	15-Jul.-20	State Street Bank	(50)								
Sterling	Euro	2.871	3.251	15-Jul.-20	State Street Bank	(109)								
Sterling	Euro	25.834	29.623	15-Jul.-20	State Street Bank	(1.349)								
Sterling	Euro	1.246	1.418	15-Jul.-20	Barclays Bank PLC	(55)								
Sterling	Euro	8.209	9.178	15-Jul.-20	Royal Bank of Scotland	(193)								
Sterling	Euro	34.126	38.557	15-Jul.-20	State Street Bank	(1.207)								
Sterling	Euro	1.409	1.571	15-Jul.-20	Royal Bank of Scotland	(28)								
Sterling	Euro	4.678	5.224	15-Jul.-20	Barclays Bank PLC	(104)								
Sterling	Euro	4.391	4.861	15-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	(55)								
Sterling	Euro	28.252	32.035	15-Jul.-20	State Street Bank	(1.114)								
Sterling	Euro	3.376	3.765	15-Jul.-20	UBS AG	(70)								
Kanadischer Dollar	Euro	29.110	19.117	14-Aug.-20	State Street Bank	(150)								
Kanadischer Dollar	Euro	50.078	32.856	14-Aug.-20	Royal Bank of Scotland	(226)								
Kanadischer Dollar	Euro	66.676	43.560	14-Aug.-20	UBS AG	(115)								
Kanadischer Dollar	Euro	116.561	76.319	14-Aug.-20	State Street Bank	(369)								
Kanadischer Dollar	Euro	72.084	47.296	14-Aug.-20	Canadian Imperial Bank	(327)								
Kanadischer Dollar	Euro	260.553	170.886	14-Aug.-20	State Street Bank	(1.115)								
Kanadischer Dollar	Euro	3.267	2.159	14-Aug.-20	State Street Bank	(30)								
Kanadischer Dollar	Euro	3.742	2.449	14-Aug.-20	Royal Bank of Scotland	(11)								
													EUR	13.316
													USD	14.926
							</							

BNY MELLON TARGETED RETURN BOND FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Nettovermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Nettovermögen %
Anleihen				Anleihen Forts.			
	Belgien - 672.138 (31. Dezember 2019: –)	672.138	0,84		Deutschland Forts.		
100.000	Anheuser-Busch InBev SA/NV 3,700 % 02-Apr.-2040	136.733	0,17	675.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2,500 % 15-Aug.-2046	1.275.932	1,59
475.000	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc 3,500 % 01-Jun.-2030	535.405	0,67	175.000	E.ON SE 'EMTN' 1,000 % 07-Okt.-2025	203.481	0,25
	Brasilien - 650.531 (31. Dezember 2019: –)	650.531	0,81	200.000	Siemens Financieringsmaatschappij NV 'EMTN' 0,250 % 20-Feb.-2029	221.724	0,28
675.000	Brazilian Government International Bond 3,875 % 12-Jun.-2030	650.531	0,81		Griechenland - 797.661 (31. Dezember 2019: –)	797.661	0,99
	Kanada - 489.451 (31. Dezember 2019: –)	489.451	0,61	250.000	Hellenic Republic Government Bond '144A' 1,500 % 18-Jun.-2030	288.412	0,36
65.000	Nutrien Ltd 1,900 % 13-Mai-2023	67.027	0,08	425.000	Hellenic Republic Government Bond '144A' 2,000 % 22-Apr.-2027	509.249	0,63
425.000	Toronto-Dominion Bank/The 'MTN' FRN 0,543 % 27-Jan.-2023	422.424	0,53		Ungarn - 630.797 (31. Dezember 2019: –)	630.797	0,78
	Cayman-Inseln - 250.000 (31. Dezember 2019: –)	250.000	0,31	225.000	Hungary Government International Bond 1,625 % 28-Apr.-2032	253.984	0,32
250.000	Ballyrock CLO 2020-1 Ltd '2020-1X A1' FRN 0,000 % 20-Jul.-2030	250.000	0,31	140.000	Hungary Government International Bond 7,625 % 29-März-2041	235.633	0,29
	Chile - 254.688 (31. Dezember 2019: –)	254.688	0,32	125.000	MFB Magyar Fejlesztési Bank Zrt 1,375 % 24-Jun.-2025	141.180	0,17
250.000	VTR Comunicaciones SpA 'REGS' 5,125 % 15-Jan.-2028	254.688	0,32		Irland - 320.057 (31. Dezember 2019: –)	320.057	0,40
	China - 202.047 (31. Dezember 2019: –)	202.047	0,25	175.000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 2,875 % 14-Aug.-2024	163.724	0,20
200.000	Tencent Holdings Ltd 'REGS' 2,390 % 03-Jun.-2030	202.047	0,25	150.000	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust 6,500 % 15-Jul.-2025	156.333	0,20
	Kroatien - 332.477 (31. Dezember 2019: –)	332.477	0,41		Israel- 276.494 (31. Dezember 2019: –)	276.494	0,34
100.000	Croatia Government International Bond 1,500 % 17-Jun.-2031	112.052	0,14	250.000	Israel Government International Bond 2,750 % 03-Jul.-2030	276.494	0,34
175.000	Croatia Government International Bond 2,750 % 27-Jan.-2030	220.425	0,27		Italien - 2.460.756 (31. Dezember 2019: 2.424.717)	2.460.756	3,06
	Zypern - 979.268 (31. Dezember 2019: –)	979.268	1,22	2.125.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 1,650 % 01-Dez.-2030	2.460.756	3,06
110.000	Cyprus Government International Bond 'EMTN' 1,250 % 21-Jan.-2040	121.205	0,15		Japan - 252.474 (31. Dezember 2019: –)	252.474	0,31
400.000	Cyprus Government International Bond 'EMTN' 2,250 % 16-Apr.-2050	504.083	0,63	225.000	Takeda Pharmaceutical Co Ltd 2,000 % 09-Jul.-2040	252.474	0,31
255.000	Cyprus Government International Bond 'EMTN' 2,750 % 03-Mai-2049	353.980	0,44		Litauen - 328.977 (31. Dezember 2019: –)	328.977	0,41
	Frankreich - 2.869.659 (31. Dezember 2019: –)	2.869.659	3,57	275.000	Lithuania Government International Bond 'EMTN' 0,750 % 06-Mai-2030	328.977	0,41
675.000	Airbus SE 2,000 % 07-Apr.-2028	799.614	0,99		Macao - 207.886 (31. Dezember 2019: –)	207.886	0,26
250.000	Credit Agricole SA 'REGS' 3,250 % 14-Jan.-2030	268.833	0,34	200.000	Sands China Ltd 'REGS' 4,375 % 18-Jun.-2030	207.886	0,26
100.000	Engie SA 'EMTN' 1,750 % 27-März-2028	121.442	0,15		Malaysia - 413.734 (31. Dezember 2019: –)	413.734	0,51
100.000	Orange SA 'EMTN' 1,625 % 07-Apr.-2032	122.215	0,15	325.000	Petronas Capital Ltd 'REGS' 4,550 % 21-Apr.-2050	413.734	0,51
100.000	Sanofi 'EMTN' 1,000 % 01-Apr.-2025	117.077	0,15		Mexiko - 164.344 (31. Dezember 2019: –)	164.344	0,20
500.000	Sanofi 'EMTN' 1,500 % 01-Apr.-2030	623.886	0,78	150.000	Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand 'REGS' 5,375 % 17-Apr.-2025	164.344	0,20
425.000	Total Capital International SA 3,386 % 29-Jun.-2060	437.649	0,54				
300.000	Total Capital International SA 'EMTN' 1,994 % 08-Apr.-2032	378.943	0,47				
	Deutschland - 5.848.089 (31. Dezember 2019: –)	5.848.089	7,27				
3.600.000	Bundesobligation 0,000 % 05-Apr.-2024	4.146.952	5,15				

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Nettovermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Nettovermögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
	Niederlande - 712.541 (31. Dezember 2019: -)	712.541	0,89		Spanien Forts.		
575.000	Shell International Finance BV 'EMTN' 1,875 % 07-Apr.-2032	712.541	0,89	1.100.000	Repsol International Finance BV 'EMTN' 2,625 % 15-Apr.-2030	1.378.891	1,72
	Norwegen - 62.238 (31. Dezember 2019: -)	62.238	0,08	1.500.000	Spain Government Bond '144A' 0,600 % 31-Okt.-2029	1.723.264	2,14
60.000	Yara International ASA 'REGS' 3,148 % 04-Jun.-2030	62.238	0,08	245.000	Spain Government Bond '144A' 1,250 % 31-Okt.-2030	298.197	0,37
	Panama - 460.691 (31. Dezember 2019: -)	460.691	0,57		Ukraine - 247.359 (31. Dezember 2019: 154.594)	247.359	0,31
375.000	Panama Government International Bond 4,500 % 01-Apr.-2056	460.691	0,57	105.000	Ukraine Government International Bond FRN 0,000 % 31-Mai-2040	96.798	0,12
	Peru - 83.404 (31. Dezember 2019: 81.615)	83.404	0,10	150.000	Ukraine Government International Bond 'REGS' 7,750 % 01-Sept.-2020	150.561	0,19
65.000	Southern Copper Corp 5,875 % 23-Apr.-2045	83.404	0,10		Vereinigte Arabische Emirate - 206.750 (31. Dezember 2019: 598.907)	206.750	0,26
	Philippinen - 844.211 (31. Dezember 2019: -)	844.211	1,05	200.000	Abu Dhabi Government International Bond 'REGS' 2,125 % 30-Sept.-2024	206.750	0,26
350.000	Philippine Government International Bond 0,000 % 03-Feb.-2023	385.100	0,48		Großbritannien - 3.726.705 (31. Dezember 2019: -)	3.726.705	4,63
400.000	Philippine Government International Bond 3,700 % 02-Feb.-2042	459.111	0,57	575.000	Barclays Plc 'EMTN' FRN 3,375 % 02-Apr.-2025	691.213	0,86
	Portugal - 929.787 (31. Dezember 2019: -)	929.787	1,16	525.000	BP Capital Markets Plc 2,822 % 07-Apr.-2032	676.514	0,84
625.000	Portugal Obrigações do Tesouro OT '144A' 3,875 % 15-Feb.-2030	929.787	1,16	575.000	BP Capital Markets Plc FRN (Immerwährend) 4,375 % 22-Jun.-2025	583.338	0,72
	Qatar - 285.068 (31. Dezember 2019: -)	285.068	0,35	325.000	HSBC Holdings Plc 4,950 % 31-März-2030	391.184	0,49
250.000	Qatar Government International Bond 'REGS' 3,750 % 16-Apr.-2030	285.068	0,35	725.000	Lloyds Bank Corporate Markets Plc 'EMTN' 2,375 % 09-Apr.-2026	875.553	1,09
	Republik Serbien - 235.387 (31. Dezember 2019: -)	235.387	0,29	75.000	Royal Bank of Scotland Group Plc 6,125 % 15-Dez.-2022	81.965	0,10
200.000	Serbia International Bond 'REGS' 3,125 % 15-Mai-2027	235.387	0,29	180.000	Unilever NV 1,750 % 25-März-2030	229.554	0,28
	Rumänien - 121.237 (31. Dezember 2019: -)	121.237	0,15	175.000	Vodafone Group Plc FRN 3,100 % 03-Jan.-2079	197.384	0,25
100.000	Romanian Government International Bond 'REGS' 3,624 % 26-Mai-2030	121.237	0,15		USA - 51.145.822 (31. Dezember 2019: 71.474.603)	51.145.822	63,58
	Slowakei - 124.633 (31. Dezember 2019: -)	124.633	0,16	10.000	AES Corp/The 5,125 % 01-Sept.-2027	10.311	0,01
100.000	Slovakia Government Bond 1,000 % 14-Mai-2032	124.633	0,16	50.000	AES Corp/The 6,000 % 15-Mai-2026	52.360	0,07
	Slowenien - 395.859 (31. Dezember 2019: -)	395.859	0,49	225.000	Air Lease Corp 3,375 % 01-Jul.-2025	225.423	0,28
325.000	Slovenia Government Bond 1,188 % 14-März-2029	395.859	0,49	45.000	Air Products and Chemicals Inc 1,500 % 15-Okt.-2025	46.431	0,06
	Südafrika - 195.078 (31. Dezember 2019: 204.779)	195.078	0,24	45.000	Air Products and Chemicals Inc 1,850 % 15-Mai-2027	47.158	0,06
175.000	Anglo American Capital Plc 'EMTN' 1,625 % 11-März-2026	195.078	0,24	200.000	Ally Financial Inc 5,750 % 20-Nov.-2025	214.909	0,27
	Spanien - 3.858.408 (31. Dezember 2019: 853.214)	3.858.408	4,80	125.000	American Electric Power Co Inc 3,250 % 01-März-2050	130.233	0,16
100.000	Adif Alta Velocidad 'EMTN' 0,550 % 30-Apr.-2030	111.434	0,14	420.000	American Express Co 2,500 % 30-Jul.-2024	445.152	0,55
300.000	Iberdrola Finanzas SA 'EMTN' 0,875 % 16-Jun.-2025	346.622	0,43	375.000	American International Group Inc 4,375 % 30-Jun.-2050	434.215	0,54
				125.000	American Tower Corp 2,400 % 15-März-2025	131.588	0,16
				350.000	Amgen Inc 2,300 % 25-Feb.-2031	363.270	0,45
				100.000	AT&T Inc 2,050 % 19-Mai-2032	116.872	0,15
				600.000	Bank of America Corp 'MTN' FRN 4,083 % 20-März-2051	749.450	0,93
				200.000	Berkshire Hathaway Inc 0,000 % 12-März-2025	222.189	0,28
				425.000	Boeing Co/The 5,150 % 01-Mai-2030	472.096	0,59
				150.000	Bristol-Myers Squibb Co 'REGS' 2,875 % 15-Aug.-2020	150.448	0,19
				450.000	Broadcom Inc 'REGS' 5,000 % 15-Apr.-2030	517.616	0,64
				225.000	Cameron LNG LLC 'REGS' 2,902 % 15-Jul.-2031	241.597	0,30
				425.000	Capital One Bank USA NA FRN 2,014 % 27-Jan.-2023	430.974	0,54

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener	Summe			Angemessener	Summe
		Wert	der Netto-			Wert	der Netto-
Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %	Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
USA Forts.				USA Forts.			
155.000	Carrier Global Corp 'REGS' 2,493 % 15-Feb.-2027	157.555	0,20	40.000	Kraft Heinz Foods Co 'REGS' 4,875 % 01-Okt.-2049	40.646	0,05
50.000	Carrier Global Corp 'REGS' 2,722 % 15-Feb.-2030	50.193	0,06	15.000	Lamar Media Corp 'REGS' 3,750 % 15-Feb.-2028	14.297	0,02
50.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 4,500 % 15-Aug.-2030	50.825	0,06	155.000	Lennar Corp 4,750 % 29-Nov.-2027	168.704	0,21
79.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp 'REGS' 4,500 % 15-Aug.-2030	80.304	0,10	185.000	Level 3 Financing Inc 'REGS' 4,250 % 01-Jul.-2028	184.352	0,23
40.000	Centene Corp 3,375 % 15-Feb.-2030	40.066	0,05	200.000	Marathon Petroleum Corp 3,625 % 15-Sept.-2024	213.328	0,27
25.000	CenturyLink Inc 'REGS' 4,000 % 15-Feb.-2027	24.269	0,03	125.000	Marriott International Inc/MD 5,750 % 01-Mai-2025	136.153	0,17
225.000	Cigna Corp 3,400 % 15-März-2050	241.877	0,30	50.000	Mastercard Inc 3,300 % 26-März-2027	56.646	0,07
375.000	Citizens Bank NA/Providence RI 'BKNT' 2,250 % 28-Apr.-2025	397.337	0,49	175.000	Mastercard Inc 3,350 % 26-März-2030	203.650	0,25
150.000	Comcast Corp 0,750 % 20-Feb.-2032	163.695	0,20	250.000	Mastercard Inc 3,850 % 26-März-2050	314.310	0,39
170.000	Comcast Corp 3,750 % 01-Apr.-2040	200.210	0,25	50.000	McDonald's Corp 'MTN' 3,600 % 01-Jul.-2030	57.614	0,07
500.000	Consolidated Edison Co of New York Inc 3,950 % 01-Apr.-2050	597.743	0,74	165.000	McDonald's Corp 'MTN' 4,200 % 01-Apr.-2050	199.637	0,25
55.000	Constellation Brands Inc 2,875 % 01-Mai-2030	58.258	0,07	375.000	MetLife Inc 4,550 % 23-März-2030	468.957	0,58
15.000	Constellation Brands Inc 3,750 % 01-Mai-2050	16.453	0,02	120.000	Microsoft Corp 2,525 % 01-Jun.-2050	123.616	0,15
200.000	Crown Americas LLC / Crown Americas Capital Corp VI 4,750 % 01-Feb.-2026	204.112	0,25	100.000	Molina Healthcare Inc 'REGS' 4,375 % 15-Jun.-2028	100.687	0,13
175.000	Crown Castle International Corp 3,300 % 01-Jul.-2030	190.562	0,24	425.000	Morgan Stanley 'GMTN' FRN 0,761 % 20-Jan.-2023	423.712	0,53
200.000	CVS Health Corp 3,750 % 01-Apr.-2030	229.223	0,28	400.000	Northrop Grumman Corp 5,250 % 01-Mai-2050	576.768	0,72
150.000	CVS Health Corp 4,250 % 01-Apr.-2050	181.963	0,23	200.000	Occidental Petroleum Corp 8,875 % 15-Jul.-2030	200.500	0,25
70.000	CVS Health Corp 5,050 % 25-März-2048	91.130	0,11	125.000	O'Reilly Automotive Inc 4,200 % 01-Apr.-2030	146.870	0,18
100.000	CyrusOne LP / CyrusOne Finance Corp 1,450 % 22-Jan.-2027	107.963	0,13	125.000	PayPal Holdings Inc 2,300 % 01-Jun.-2030	130.309	0,16
100.000	Danaher Corp 2,500 % 30-März-2030	129.031	0,16	575.000	PepsiCo Inc 3,625 % 19-März-2050	700.666	0,87
200.000	Digital Dutch Finco BV 1,500 % 15-März-2030	229.949	0,29	35.000	Prologis LP 2,125 % 15-Apr.-2027	36.882	0,05
320.000	Dollar General Corp 3,500 % 03-Apr.-2030	360.829	0,45	115.000	Prologis LP 2,250 % 15-Apr.-2030	121.396	0,15
115.000	Duke Energy Indiana LLC 2,750 % 01-Apr.-2050	117.153	0,15	200.000	Quicken Loans LLC 'REGS' 5,750 % 01-Mai-2025	204.961	0,25
120.000	Elanco Animal Health Inc 5,650 % 28-Aug.-2028	132.943	0,17	75.000	Sherwin-Williams Co/The 2,300 % 15-Mai-2030	76.367	0,09
175.000	Enterprise Products Operating LLC 2,800 % 31-Jan.-2030	183.030	0,23	150.000	Southern California Edison Co 3,650 % 01-Feb.-2050	166.874	0,21
235.000	EQT Corp 3,000 % 01-Okt.-2022	221.282	0,28	200.000	Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC / Sprint Spectrum Co III LLC 'REGS' 4,738 % 20-März-2025	216.771	0,27
375.000	Equinix Inc 5,375 % 15-Mai-2027	409.892	0,51	325.000	Starbucks Corp 2,550 % 15-Nov.-2030	342.497	0,43
180.000	Exelon Generation Co LLC 3,250 % 01-Jun.-2025	194.659	0,24	40.000	Starbucks Corp 3,500 % 15-Nov.-2050	42.470	0,05
175.000	Exxon Mobil Corp 4,227 % 19-März-2040	211.569	0,26	40.000	Steel Dynamics Inc 2,400 % 15-Jun.-2025	41.198	0,05
250.000	Exxon Mobil Corp 4,327 % 19-März-2050	314.191	0,39	55.000	Steel Dynamics Inc 3,250 % 15-Jan.-2031	56.044	0,07
250.000	First Republic Bank/CA 'BKNT' FRN 1,912 % 12-Feb.-2024	256.500	0,32	65.000	Steel Dynamics Inc 3,450 % 15-Apr.-2030	68.072	0,08
40.000	FirstEnergy Corp 2,050 % 01-März-2025	41.507	0,05	215.000	Target Corp 2,650 % 15-Sept.-2030	237.101	0,29
175.000	FirstEnergy Corp 2,650 % 01-März-2030	182.111	0,23	200.000	T-Mobile USA Inc 4,750 % 01-Feb.-2028	211.097	0,26
425.000	Ford Credit Auto Lease Trust 2020-A '2020-A B' 2,050 % 15-Jun.-2023	425.139	0,53	175.000	T-Mobile USA Inc 'REGS' 3,500 % 15-Apr.-2025	191.187	0,24
225.000	General Electric Co FRN (Immerwährend) 5,000 % 21-Jan.-2021	176.073	0,22	250.000	T-Mobile USA Inc 'REGS' 3,750 % 15-Apr.-2027	276.875	0,34
114.000	Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp 7,750 % 01-Feb.-2028	102.707	0,13	125.000	United Rentals North America Inc 4,000 % 15-Jul.-2030	120.686	0,15
128.000	HCA Inc 3,500 % 01-Sept.-2030	122.793	0,15	1.880.000	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 30-Jul.-2020*	1.879.843	2,34
200.000	Home Depot Inc/The 2,700 % 15-Apr.-2030	219.130	0,27	8.340.000	United States Treasury Floating Rate Note FRN 0,193 % 31-Jul.-2020	8.340.343	10,37
425.000	Home Depot Inc/The 3,350 % 15-Apr.-2050	485.113	0,60	6.000.000	United States Treasury Note/Bond 1,125 % 28-Feb.-2025	6.241.523	7,76
350.000	John Deere Cash Management SA 'EMTN' 2,200 % 02-Apr.-2032	445.690	0,55	1.600.000	United States Treasury Note/Bond 1,125 % 28-Feb.-2027	1.670.875	2,08
150.000	JPMorgan Chase & Co FRN 2,956 % 13-Mai-2031	158.290	0,20	6.545.000	United States Treasury Note/Bond 2,875 % 30-Nov.-2023	7.142.231	8,88
500.000	JPMorgan Chase & Co FRN 4,493 % 24-März-2031	610.789	0,76	1.880.000	United States Treasury Note/Bond 3,375 % 15-Nov.-2048	2.776.048	3,45
225.000	KeyCorp 'MTN' 2,250 % 06-Apr.-2027	235.919	0,29	100.000	Verizon Communications Inc 3,150 % 22-März-2030	112.700	0,14
75.000	Kraft Heinz Foods Co 4,625 % 30-Jan.-2029	80.770	0,10	300.000	Verizon Communications Inc 4,000 % 22-März-2050	380.336	0,47
55.000	Kraft Heinz Foods Co 'REGS' 3,875 % 15-Mai-2027	57.595	0,07	105.000	Verizon Communications Inc 4,016 % 03-Dez.-2029	125.260	0,16
45.000	Kraft Heinz Foods Co 'REGS' 4,250 % 01-März-2031	47.478	0,06				

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener	Summe			Zugrunde	Angemessener	Summe
		Wert	der Netto-			liegendes Engagement	Wert	der Netto-
Bestände	Beschreibung	in USD	vermögen %	Bestände	Beschreibung	in USD	in USD	vermögen %
Anleihen Forts.				Offene Terminkontrakte - (454.525) (31. Dezember 2019: (24.316))				
USA Forts.				(67)	Euro-Bobl			
24.000	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc 'REGS'				Short Futures Contracts			
	3,500 % 15-Feb.-2025	22.484	0,03		Exp Sep.-2020	(10.138.549)	(45.060)	(0,05)
325.000	Visa Inc 1,900 % 15-Apr.-2027	339.533	0,42	(47)	Euro-Bund			
85.000	Visa Inc 2,050 % 15-Apr.-2030	89.369	0,11		Short Futures Contracts			
400.000	Walt Disney Co/The 4,700 % 23-März-2050	523.837	0,65		Exp Sep.-2020	(9.307.917)	(64.598)	(0,08)
60.000	Western Midstream Operating LP			(12)	Euro-Buxl 30 Year Bond			
	3,100 % 01-Feb.-2025	56.776	0,07		Short Futures Contracts			
350.000	Western Midstream Operating LP				Exp Sep.-2020	(2.970.746)	(78.284)	(0,10)
	4,050 % 01-Feb.-2030	334.602	0,42	(89)	U.S. 10 Year Treasury Note			
Uruguay - 64.092 (31. Dezember 2019: -)					Short Futures Contracts			
55.000	Uruguay Government International Bond	64.092	0,08		Exp Sep.-2020	(12.400.203)	(40.065)	(0,05)
	4,375 % 23-Jan.-2031	64.092	0,08	(36)	U.S. 10 Year Ultra Treasury Note			
Summe der Anlagen in Anleihen					Short Futures Contracts			
		82.100.798	102,06		Exp Sep.-2020	(5.678.437)	(45.539)	(0,06)
Kreditverzugsswaps - 8.449 (31. Dezember 2019: -)				(26)	U.S. 5 Year Treasury Note			
(825.000)	CDS CDX North America Investment Grade				Short Futures Contracts			
	Index Series 34 Version 1				Exp Sep.-2020	(3.270.109)	(8.551)	(0,01)
	1,000 % 20-Jun.-2025	8.449	0,01	(10)	U.S. Treasury Bond			
Summe der Kreditverzugsswaps					Short Futures Contracts			
		8.449	0,01		Exp Sep.-2020	(1.790.313)	(15.937)	(0,02)
				(44)	U.S. Treasury Ultra Bond			
					Short Futures Contracts			
					Exp Sep.-2020	(9.644.250)	(156.491)	(0,19)
				Summe der offenen Terminkontrakte				
						(454.525)	(0,56)	
				Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften - (3.103.223) (siehe unten) 31. Dezember 2019: (125.391))				
						(3.103.223)	(3,86)	
				Summe der finanziellen Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert				
						(3.636.338)	(4,52)	
				Nettoumlaufvermögen				
						1.749.622	2,18	
				Summe der Nettovermögen				
						80.441.328	100,00	
				* Ein Teil der Beteiligung wird von Bank of America Merrill Lynch im Hinblick auf Terminkontrakte und von JP Morgan Chase Bank im Zusammenhang mit den vom Fonds gehaltenen Devisenterminkontrakten als Sicherheit gehalten werden. Der Kontrahent für Kreditverzugsswaps ist Bank of America Merrill Lynch. Der Kontrahent für Terminkontrakte ist Bank of America Merrill Lynch.				
				Portfolioanalyse				
				% des Gesamtvermögens				
				An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente				
							96,33	
				An einem geregelten Markt gehandelte Finanzderivate				
							0,10	
				OTC-Finanzderivate				
							0,17	
				Sonstiges Umlaufvermögen				
							3,40	
				Summe der Aktiva				
							100,00	

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte						
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund						
US-Dollar	Euro	247.378	220.000	31-Jul.-20	HSBC Bank plc	618
US-Dollar	Euro	7.675.772	6.800.000	31-Jul.-20	HSBC Bank plc	48.650
US-Dollar	Euro	7.680.189	6.810.000	31-Jul.-20	Citigroup Global Markets Limited	41.850
US-Dollar	Euro	8.376.879	7.430.000	31-Jul.-20	JPMorgan Chase Bank	43.126
US-Dollar	Koreanischer Won	16.838	20.000.000	17-Sept.-20	UBS AG	204
USD						134.448
Euro	US-Dollar	223.425	251.111	09-Jul.-20	HSBC Bank plc	(674)
USD						(674)
Netto USD						133.774
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund						
Anteilsklasse Sterling W (Acc) (Hedged)						
Sterling	US-Dollar	66.250.523	84.402.329	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(3.102.549)
USD						(3.102.549)
GBP						(2.528.460)

BNY MELLON U.S. DYNAMIC VALUE FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener		Bestände	Beschreibung	Angemessener	
		Wert	Summe			Wert	Summe
		in USD	der Netto-			in USD	der Netto-
			vermögen %				vermögen %
Aktien							
Irland - 2.066.351							
(31. Dezember 2019: 870.233)							
6.457	Eaton Corp Plc	564.503	1,96	17.810	Morgan Stanley	860.312	2,99
2.688	Horizon Therapeutics Plc	149.305	0,52	10.582	Mosaic Co/The	132.434	0,46
9.333	Medtronic Plc	854.949	2,97	2.386	Newmont Corp	147.288	0,51
2.442	Trane Technologies Plc	217.265	0,75	5.562	NextEra Energy Partners LP (Units)	285.136	0,99
1.424	Willis Towers Watson Plc	280.329	0,97	794	Northrop Grumman Corp	244.103	0,85
Niederlande - 213.748							
(31. Dezember 2019: -)							
1.874	NXP Semiconductors NV	213.748	0,74	3.132	Omnicom Group Inc	170.929	0,59
Schweiz - 776.505							
(31. Dezember 2019: 420.587)							
4.354	Alcon Inc	249.506	0,87	2.851	Otis Worldwide Corp	162.051	0,56
4.166	Chubb Ltd	526.999	1,83	2.211	PepsiCo Inc	292.349	1,01
USA - 25.720.504							
(31. Dezember 2019: 26.894.022)							
5.523	AbbVie Inc	542.138	1,88	3.861	Philip Morris International Inc	270.270	0,94
359	Alphabet Inc - A-Klasse	509.031	1,77	6.319	Phillips 66	454.083	1,58
4.394	American International Group Inc	136.983	0,48	2.231	Pioneer Natural Resources Co	217.958	0,76
1.203	Anthem Inc	316.028	1,10	32.571	PPL Corp	841.472	2,92
814	Apple Inc	296.801	1,03	2.329	Proofpoint Inc	258.601	0,90
7.790	Applied Materials Inc	470.750	1,63	2.795	PVH Corp	134.286	0,47
10.769	Archer-Daniels-Midland Co	429.522	1,49	1.596	QUALCOMM Inc	145.539	0,50
4.011	Assurant Inc	414.477	1,44	8.191	Quanta Services Inc	321.292	1,11
12.066	Bank of America Corp	286.387	0,99	3.284	Raytheon Technologies Corp	202.278	0,70
3.248	Becton Dickinson and Co	777.344	2,70	4.604	State Street Corp	292.722	1,02
5.973	Berkshire Hathaway Inc - B-Klasse	1.065.852	3,70	2.575	Union Pacific Corp	435.020	1,51
872	Biogen Inc	233.151	0,81	11.703	Voya Financial Inc	546.179	1,90
6.877	Bristol-Myers Squibb Co	404.196	1,40	4.868	Vulcan Materials Co	563.982	1,96
4.002	Capital One Financial Corp	250.425	0,87	3.241	Western Digital Corp	143.025	0,50
12.922	Carrier Global Corp	287.062	1,00	6.485	Weyerhaeuser Co (REIT)	145.588	0,50
3.765	Centene Corp	239.360	0,83	860	Zebra Technologies Corp	220.040	0,76
21.346	CF Industries Holdings Inc	600.783	2,08	Summe der Anlagen in Aktien			
7.319	Charles Schwab Corp/The	246.906	0,86	28.777.108 99,88			
8.025	Cisco Systems Inc	374.206	1,30	Summe der Vermögenswerte			
8.025	Citigroup Inc	410.037	1,42	zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert			
6.816	ConocoPhillips	286.374	0,99	28.777.108 99,88			
12.103	Corning Inc	313.528	1,09	Nettoumlaufvermögen			
3.265	Dolby Laboratories Inc - A-Klasse	215.147	0,75	35.875 0,12			
1.762	Eli Lilly and Co	288.968	1,00	Summe der Nettovermögen			
55.418	Freeport-McMoRan Inc	640.909	2,22	28.812.983 100,00			
12.681	General Motors Co	320.766	1,11	Portfolioanalyse			
5.027	Goldman Sachs Group Inc/The	992.807	3,45	% des Gesamtvermögens			
10.530	Hess Corp	545.401	1,89	An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten			
861	Humana Inc	333.780	1,16	Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			
9.587	Ingersoll Rand Inc	269.634	0,94	Sonstiges Umlaufvermögen			
13.618	Intel Corp	814.629	2,83	Summe der Aktiva			
2.343	International Business Machines Corp	282.835	0,98	100,00			
12.217	JPMorgan Chase & Co	1.148.276	3,98				
1.737	L3Harris Technologies Inc	294.708	1,02				
1.368	Laboratory Corp of America Holdings	227.314	0,79				
8.797	Las Vegas Sands Corp	400.527	1,39				
6.197	Lennar Corp	381.704	1,32				
12.176	Louisiana-Pacific Corp	312.254	1,08				
3.255	Lowe's Cos Inc	439.637	1,53				
5.224	LPL Financial Holdings Inc	409.666	1,42				
12.082	Marathon Petroleum Corp	451.444	1,57				
1.389	Microchip Technology Inc	146.283	0,51				
2.775	Micron Technology Inc	142.899	0,50				
5.530	Mondelez International Inc	282.638	0,98				

BNY MELLON U.S. EQUITY INCOME FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener				Angemessener	
		Wert	Summe			Wert	Summe
Bestände	Beschreibung	in USD	der Netto- vermögen %	Bestände	Beschreibung	in USD	der Netto- vermögen %
Organismen für gemeinsame Anlagen							
USA - 2.788.194							
(31. Dezember 2019: –)		2.788.194	1,03				
9.036	SPDR S&P 500 ETF Trust - ETF	2.788.194	1,03				
Summe der Anlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen		2.788.194	1,03				
Aktien							
Irland - 17.942.281							
(31. Dezember 2019: 13.578.611)		17.942.281	6,64				
83.131	Eaton Corp Plc	7.267.728	2,69				
95.765	Medtronic Plc	8.772.553	3,25				
21.378	Trane Technologies Plc	1.902.000	0,70				
Schweiz - 4.940.331							
(31. Dezember 2019: 6.902.260)		4.940.331	1,83				
39.054	Chubb Ltd	4.940.331	1,83				
Großbritannien - 2.650.123							
(31. Dezember 2019: –)		2.650.123	0,98				
166.204	Vodafone Group Plc ADR	2.650.123	0,98				
USA - 230.002.540							
(31. Dezember 2019: 366.976.308)		230.002.540	85,09				
127.105	AbbVie Inc	12.476.627	4,62				
67.481	American International Group Inc	2.103.720	0,78				
78.442	Applied Materials Inc	4.740.250	1,75				
91.093	Archer-Daniels-Midland Co	3.633.244	1,34				
36.862	Assurant Inc	3.809.135	1,41				
90.442	AT&T Inc	2.730.896	1,01				
401.156	Bank of America Corp	9.521.438	3,52				
87.662	Bristol-Myers Squibb Co	5.152.334	1,91				
116.378	Carrier Global Corp	2.585.337	0,96				
333.607	CF Industries Holdings Inc	9.389.369	3,47				
109.481	Cisco Systems Inc	5.105.099	1,89				
146.878	Citigroup Inc	7.504.731	2,78				
124.753	Clearway Energy Inc	2.875.557	1,06				
113.719	ConocoPhillips	4.777.904	1,77				
142.258	Corning Inc	3.685.193	1,36				
66.478	CVS Health Corp	4.316.417	1,60				
67.974	Dow Inc	2.769.601	1,02				
193.031	General Motors Co	4.882.719	1,81				
56.890	Goldman Sachs Group Inc/The	11.235.491	4,16				
126.689	Hess Corp	6.561.857	2,43				
125.126	Intel Corp	7.485.037	2,77				
23.943	International Business Machines Corp	2.890.279	1,07				
125.178	JPMorgan Chase & Co	11.765.480	4,35				
23.195	L3Harris Technologies Inc	3.935.380	1,46				
29.559	Lamar Advertising Co (REIT) - A-Klasse	1.972.915	0,73				
53.169	Las Vegas Sands Corp	2.420.785	0,89				
231.925	Louisiana-Pacific Corp	5.947.717	2,20				
29.152	Lowe's Cos Inc	3.937.415	1,46				
204.965	Marathon Petroleum Corp	7.658.517	2,83				
30.806	Merck & Co Inc	2.381.612	0,88				
234.930	Morgan Stanley	11.348.294	4,20				
114.993	NextEra Energy Partners LP (Units)	5.895.116	2,18				
57.493	Omnicom Group Inc	3.137.680	1,16				
35.520	Otis Worldwide Corp	2.018.957	0,75				
25.268	PepsiCo Inc	3.341.061	1,24				
38.042	Philip Morris International Inc	2.662.940	0,98				
69.434	Phillips 66	4.989.527	1,85				
399.917	PPL Corp	10.331.856	3,82				
24.037	QUALCOMM Inc	2.191.934	0,81				
Aktien Forts.							
USA Forts.							
41.287	State Street Corp	2.625.027	0,97				
28.630	Union Pacific Corp	4.836.752	1,79				
260.954	US Bancorp	9.607.022	3,55				
40.310	Vulcan Materials Co	4.670.115	1,73				
93.283	Weyerhaeuser Co (REIT)	2.094.203	0,77				
Summe der Anlagen in Aktien		255.535.275	94,54				
Preferred Bonds							
USA - 6.526.048							
(31. Dezember 2019: 8.371.664)		6.526.048	2,41				
122.394	Becton Dickinson and Co - Preferred Stock 6,000 % 01-Jun.-2023	6.526.048	2,41				
Summer der Anlagen in Preferred Bonds		6.526.048	2,41				
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 7.518 (siehe unten) 31. Dezember 2019: 25.328)							
		7.518	0,00				
Summe der Vermögenswerte zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert		264.857.035	97,98				
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften - (57.341) (siehe unten) 31. Dezember 2019: –)							
		(57.341)	(0,02)				
Summe der finanziellen Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert		(57.341)	(0,02)				
Nettoumlaufvermögen		5.502.669	2,04				
Summe der Nettovermögen		270.302.363	100,00				
Portfolioanalyse							
% des Gesamtvermögens							
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten							
Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente						97,13	
OTC-Finanzderivate						0,00	
Sonstiges Umlaufvermögen						2,87	
Summe der Aktiva		100,00					

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte							Nicht
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent		realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund							
Anteilsklasse Sterling E (Inc) (Hedged)							
US-Dollar	Sterling	39.539	31.814	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		115
US-Dollar	Sterling	141.720	112.519	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		2.285
US-Dollar	Sterling	156.372	124.186	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		2.479
US-Dollar	Sterling	57.342	45.301	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		1.205
US-Dollar	Sterling	47.204	37.014	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		1.336
US-Dollar	Sterling	56.735	45.704	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		98
USD							7.518
GBP							6.067
Sterling	US-Dollar	50.342	63.148	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		(764)
Sterling	US-Dollar	36.149	45.443	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		(647)
Sterling	US-Dollar	1.759.196	2.235.952	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon		(55.930)
USD							(57.341)
GBP							(46.276)
Netto USD							(49.823)
Netto GBP							(40.209)

BNY MELLON U.S. MUNICIPAL INFRASTRUCTURE DEBT FUND

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %
Anleihen				Anleihen Forts.			
	Zuteilung - 15.706.970 (31. Dezember 2019: -)	15.706.970	3,13		Zugeordnete Steuern Forts.		
2.110.000	New Jersey Economic Development Authority 3,620 % 15-Jun.-2028	2.070.891	0,41	1.445.000	Riverside County Redevelopment Successor Agency 3,125 % 01-Okt.-2026	1.550.868	0,31
3.500.000	Pasco County School Board 5,000 % 01-Aug.-2035	4.514.457	0,90	2.000.000	Sales Tax Securitization Corp 2,225 % 01-Jan.-2024	2.012.550	0,40
7.395.000	Providence Public Building Authority 5,000 % 15-Sept.-2039	9.121.622	1,82	3.500.000	Sales Tax Securitization Corp 4,787 % 01-Jan.-2048	4.329.693	0,86
	Bond Bank - 8.564.412 (31. Dezember 2019: 1.026.269)	8.564.412	1,70	2.450.000	San Diego Redevelopment Agency Successor Agency 3,750 % 01-Sept.-2031	2.629.793	0,52
1.000.000	Low Income Investment Fund 3,711 % 01-Jul.-2029	1.047.147	0,21	1.000.000	San Francisco City & County Redevelopment Agency Successor Agency 3,250 % 01-Aug.-2029	1.041.655	0,21
3.000.000	Michigan Finance Authority 2,366 % 01-Sept.-2049	2.976.450	0,59	3.750.000	San Jose Redevelopment Agency Successor Agency 3,250 % 01-Aug.-2029	4.143.600	0,82
4.500.000	Michigan Finance Authority 2,988 % 01-Sept.-2049	4.540.815	0,90	1.000.000	State of Connecticut Special Tax Revenue 5,459 % 01-Nov.-2030	1.192.680	0,24
	Zugeordnete Steuern - 70.093.764 (31. Dezember 2019: 65.204.135)	70.093.764	13,95	5.000.000	State of Illinois 3,750 % 15-Jun.-2032	4.629.150	0,92
1.000.000	Atlanta & Fulton County Recreation Authority 3,379 % 15-Dez.-2027	1.087.880	0,22	5.675.000	Village Center Community Development District 4,756 % 01-Nov.-2029	6.586.717	1,31
950.000	Birmingham-Jefferson Civic Center Authority 3,375 % 01-Jul.-2022	972.919	0,19		Bildung - 69.225.257 (31. Dezember 2019: 45.247.610)	69.225.257	13,78
1.500.000	Birmingham-Jefferson Civic Center Authority 3,550 % 01-Jul.-2023	1.556.662	0,31	500.000	Brazos Higher Education Authority Inc 1,789 % 01-Apr.-2022	504.920	0,10
1.555.000	Birmingham-Jefferson Civic Center Authority 3,700 % 01-Jul.-2024	1.635.168	0,33	750.000	Brazos Higher Education Authority Inc 1,870 % 01-Apr.-2023	762.840	0,15
1.330.000	Brentwood Infrastructure Financing Authority 3,478 % 02-Sept.-2025	1.452.307	0,29	500.000	Brazos Higher Education Authority Inc 1,931 % 01-Apr.-2024	511.882	0,10
1.000.000	City of Fort Worth TX 3,755 % 01-März-2030	1.023.495	0,20	1.370.000	California Educational Facilities Authority 3,414 % 01-Apr.-2031	1.494.540	0,30
2.740.000	District of Columbia 4,996 % 01-Dez.-2026	3.291.329	0,66	1.635.000	California Educational Facilities Authority 3,431 % 01-Apr.-2030	1.746.589	0,35
5.000.000	Inland Valley Development Agency 5,500 % 01-März-2033	5.592.850	1,11	2.500.000	Delaware County Authority 5,000 % 01-Jul.-2042	2.601.050	0,52
1.000.000	Kentucky Economic Development Finance Authority 4,021 % 01-Dez.-2029	1.121.255	0,22	2.500.000	Florida Higher Educational Facilities Financial Authority 5,000 % 01-März-2037	2.676.912	0,53
1.250.000	Kentucky Economic Development Finance Authority 4,121 % 01-Dez.-2030	1.391.494	0,28	8.500.000	Illinois Finance Authority 4,000 % 01-Apr.-2050	9.812.953	1,95
1.840.000	Kentucky Economic Development Finance Authority 4,171 % 01-Dez.-2031	2.037.414	0,41	1.000.000	Illinois Finance Authority 5,450 % 01-Aug.-2038	1.077.160	0,21
750.000	Maryland Economic Development Corp 4,580 % 01-Jun.-2033	810.810	0,16	1.000.000	Kent State University 2,797 % 01-Mai-2032	1.019.270	0,20
1.000.000	Maryland Economic Development Corp 4,790 % 01-Jun.-2038	1.073.610	0,21	1.000.000	Kentucky Higher Education Student Loan Corp 3,860 % 01-Jun.-2025	1.107.245	0,22
1.000.000	Maryland Economic Development Corp 5,050 % 01-Jun.-2043	1.071.945	0,21	1.000.000	Kentucky Higher Education Student Loan Corp 3,942 % 01-Jun.-2026	1.127.990	0,23
1.000.000	Metropolitan Transportation Authority 5,989 % 15-Nov.-2030	1.275.805	0,25	2.075.000	Louisiana Public Facilities Authority 5,000 % 01-Jul.-2042	2.282.469	0,45
2.825.000	Missouri Highway & Transportation Commission 5,445 % 01-Mai-2033	3.722.531	0,74	2.730.000	Massachusetts Educational Financing Authority 3,455 % 01-Jul.-2028	2.993.527	0,60
1.000.000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 3,080 % 01-Feb.-2026	1.101.405	0,22	2.110.000	Massachusetts Educational Financing Authority 3,505 % 01-Jul.-2029	2.317.751	0,46
1.300.000	New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured Revenue 5,808 % 01-Aug.-2030	1.304.374	0,26	1.250.000	Metropolitan Government Nashville & Davidson County Health & Educational Facs Bd 4,409 % 01-Okt.-2034	1.346.513	0,27
3.500.000	New York State Urban Development Corp 3,270 % 15-März-2028	3.814.720	0,76	5.500.000	New Jersey Educational Facilities Authority 3,736 % 01-Sept.-2030	5.570.757	1,11
1.750.000	New York State Urban Development Corp 5,000 % 15-März-2036	2.297.951	0,46	1.430.000	New Jersey Higher Education Student Assistance Authority 3,350 % 01-Dez.-2029	1.473.429	0,29
2.685.000	Pomona Redevelopment Agency Successor Agency 4,506 % 01-Feb.-2041	2.891.852	0,58	3.370.000	New York State Dormitory Authority 4,850 % 01-Jul.-2048	3.877.792	0,77
1.365.000	Riverside County Redevelopment Successor Agency 3,000 % 01-Okt.-2025	1.449.282	0,29	775.000	Northern Illinois University 4,000 % 01-Apr.-2037	845.444	0,17
				1.250.000	Northern Illinois University 4,000 % 01-Apr.-2039	1.355.025	0,27
				2.870.000	Onondaga Civic Development Corp 5,000 % 01-Dez.-2029	3.875.289	0,77
				2.000.000	Red River Education Finance Corp 2,802 % 15-März-2033	2.168.230	0,43

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Netto- vermögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
	Bildung Forts.				Wohnungswesen Forts.		
1.775.000	Red River Education Finance Corp 2,892 % 15-März-2034	1.919.458	0,38	500.000	Industrial Development Authority of the City of Phoenix/The 4,125 % 01-Jul.-2023	528.367	0,10
4.185.000	Salvation Army/United States 3,801 % 01-Sept.-2027	4.730.852	0,94	2.340.000	New York City Housing Development Corp 4,249 % 01-Mai-2030	2.720.484	0,54
1.100.000	University of California 3,063 % 01-Jul.-2025	1.207.112	0,24				
2.000.000	University of California 3,349 % 01-Jul.-2029	2.294.210	0,46		Leasing - 11.303.901 (31. Dezember 2019: 16.424.220)	11.303.901	2,25
1.000.000	University of Oklahoma/The 3,466 % 01-Jul.-2028	1.103.150	0,22	5.000.000	Commonwealth Financing Authority 4,014 % 01-Jun.-2033	5.994.500	1,19
2.515.000	University of Pittsburgh-of the Commonwealth System of Higher Education 3,646 % 15-Sept.-2036	2.809.129	0,56	1.840.000	New Jersey Transportation Trust Fund Authority 5,754 % 15-Dez.-2028	2.006.566	0,40
2.500.000	University of Southern California 3,226 % 01-Okt.-2120	2.611.768	0,52	3.000.000	Oklahoma City Economic Development Trust 3,313 % 01-Aug.-2027	3.302.835	0,66
	Gesundheitswesen - 75.963.804 (31. Dezember 2019: 78.014.814)	75.963.804	15,12				
2.750.000	Adventist Health System/West 2,433 % 01-Sept.-2024	2.857.916	0,57		Lokalverwaltung - 46.050.442 (31. Dezember 2019: 39.707.540)	46.050.442	9,16
4.500.000	Adventist Health System/West 2,952 % 01-März-2029	4.654.708	0,93	3.000.000	City of New Haven CT 4,834 % 01-Aug.-2033	3.501.840	0,70
1.500.000	Advocate Health & Hospitals Corp 3,829 % 15-Aug.-2028	1.702.278	0,34	1.000.000	City of New Haven CT 5,000 % 01-Aug.-2031	1.202.445	0,24
5.000.000	City of Chillicothe OH 5,000 % 01-Dez.-2047	5.714.725	1,14	2.380.000	City of New York NY 3,450 % 01-Dez.-2027	2.620.511	0,52
5.000.000	City Of South Miami Health Facilities Authority Inc 5,000 % 15-Aug.-2047	5.788.550	1,15	1.665.000	City of New York NY 3,750 % 01-Jun.-2028	1.818.621	0,36
400.000	City of Tampa FL 4,000 % 01-Jul.-2038	452.720	0,09	4.475.000	City of New York NY 6,646 % 01-Dez.-2031	4.586.808	0,91
2.270.000	Development Authority for Fulton County 5,000 % 01-Apr.-2047	2.548.597	0,51	2.500.000	City of Philadelphia PA 2,864 % 15-Jul.-2031	2.622.200	0,52
1.000.000	Dignity Health 3,125 % 01-Nov.-2022	1.034.769	0,21	6.500.000	Clackamas County School District No 12 North Clackamas 0,000 % 15-Jun.-2039	3.282.370	0,65
3.500.000	Geisinger Authority 5,000 % 01-Apr.-2043	4.278.050	0,85	1.000.000	Clark County School District 5,000 % 15-Jun.-2035	1.284.105	0,26
3.775.000	Illinois Finance Authority 5,000 % 15-Nov.-2045	4.225.414	0,84	5.450.000	Contra Costa Community College District 2,926 % 01-Aug.-2038	5.550.226	1,11
1.000.000	Louisiana Public Facilities Authority 5,000 % 15-Mai-2046	1.129.210	0,22	1.000.000	County of Cook IL 5,000 % 15-Nov.-2033	1.042.335	0,21
1.430.000	Massachusetts Development Finance Agency 3,995 % 01-Jun.-2024	1.482.953	0,30	2.500.000	County of Tulare CA 3,859 % 01-Jun.-2026	2.740.313	0,55
4.740.000	Massachusetts Development Finance Agency 4,740 % 01-Jul.-2038	5.274.909	1,05	1.000.000	Detroit City School District 6,645 % 01-Mai-2029	1.325.635	0,26
4.000.000	Mercy Health/OH 4,302 % 01-Jul.-2028	4.531.724	0,90	1.750.000	School District of Philadelphia/The 4,000 % 01-Sept.-2038	2.008.877	0,40
2.000.000	Monroe County Hospital Authority/PA 5,000 % 01-Jul.-2041	2.299.380	0,46	3.270.000	Sycamore Community City School District 4,000 % 01-Dez.-2028	4.049.290	0,81
1.185.000	Montana Facility Finance Authority 4,368 % 15-Aug.-2038	1.421.135	0,28	4.080.000	Sycamore Community City School District 4,000 % 01-Dez.-2029	5.079.151	1,01
2.500.000	Montefiore Obligated Group 4,287 % 01-Sept.-2050	2.486.229	0,49	3.000.000	Town of Hamden CT 3,881 % 15-Aug.-2026	3.335.715	0,66
2.000.000	New Hampshire Health and Education Facilities Authority Act 5,000 % 01-Jul.-2044	2.226.190	0,44		Gemeinnützige Organisation - 2.686.330 (31. Dezember 2019: 2.495.622)	2.686.330	0,53
5.925.000	Oklahoma Development Finance Authority 5,450 % 15-Aug.-2028	6.945.729	1,38	2.500.000	Conservation Fund A Nonprofit Corp/The 3,474 % 15-Dez.-2029	2.686.330	0,53
2.000.000	Providence St Joseph Health Obligated Group 2,532 % 01-Okt.-2029	2.087.947	0,42				
3.075.000	SSM Health Care Corp 3,688 % 01-Jun.-2023	3.304.252	0,66		Energie - 12.727.581 (31. Dezember 2019: 15.070.335)	12.727.581	2,53
6.360.000	SSM Health Care Corp 3,823 % 01-Jun.-2027	7.190.099	1,43	1.500.000	American Municipal Power Inc 6,973 % 15-Feb.-2024	1.778.002	0,35
2.000.000	Washington Health Care Facilities Authority 5,000 % 01-Jul.-2042	2.326.320	0,46	1.100.000	American Municipal Power Inc 7,334 % 15-Feb.-2028	1.420.458	0,28
	Wohnungswesen - 12.765.371 (31. Dezember 2019: 12.445.626)	12.765.371	2,54	3.500.000	City of Austin TX Electric Utility Revenue 2,837 % 15-Nov.-2027	3.915.327	0,78
1.137.237	Arizona Industrial Development Authority '2019-2 A' 3,625 % 20-Mai-2033	1.183.625	0,24	1.000.000	Municipal Electric Authority of Georgia 4,430 % 01-Jan.-2022	1.040.190	0,21
2.000.000	California Housing Finance 3,656 % 01-Feb.-2029	2.158.400	0,43	1.935.000	South Carolina Public Service Authority 5,125 % 01-Dez.-2043	2.117.219	0,42
4.000.000	Chicago Housing Authority 4,322 % 01-Jan.-2033	4.689.120	0,93	1.000.000	South Carolina Public Service Authority 5,784 % 01-Dez.-2041	1.358.055	0,27
1.460.000	Industrial Development Authority of the City of Phoenix/The 3,790 % 01-Jul.-2021	1.485.375	0,30	1.000.000	Southern California Public Power Authority 4,208 % 01-Jul.-2028	1.098.330	0,22

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Nettovermögen %	Bestände	Beschreibung	Angemessener Wert in USD	Summe der Nettovermögen %
Anleihen Forts.				Anleihen Forts.			
	Vorausbezahltes Gas - 7.860.467 (31. Dezember 2019: –)	7.860.467	1,56		Transport Forts.		
3.470.000	Black Belt Energy Gas District 4,000 % 01-Okt.-2049	4.005.681	0,80	1.000.000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 3,354 % 01-Okt.-2029	997.175	0,20
1.160.000	Kentucky Public Energy Authority 4,000 % 01-Dez.-2050	1.310.516	0,26	4.400.000	County of Miami-Dade FL Aviation Revenue 3,505 % 01-Okt.-2025	4.617.734	0,92
2.245.000	Tennessee Energy Acquisition Corp 4,000 % 01-Nov.-2049	2.544.270	0,50	2.500.000	Grand Parkway Transportation Corp 4,000 % 01-Okt.-2049	2.888.163	0,57
	Im Voraus erstattet- 10.379.296 (31. Dezember 2019: 5.072.621)	10.379.296	2,07	2.470.000	Illinois State Toll Highway Authority 5,000 % 01-Jan.-2031	3.180.730	0,63
4.620.000	City of Chicago IL 7,045 % 01-Jan.-2029	4.848.251	0,97	2.000.000	Kenton County Airport Board 4,689 % 01-Jan.-2049	2.140.650	0,43
5.405.000	New Jersey Transportation Trust Fund Authority 6,104 % 15-Dez.-2028	5.531.045	1,10	1.750.000	Maryland Economic Development Corp 4,750 % 01-Jun.-2042	1.877.138	0,37
	Altersvorsorge - 8.772.476 (31. Dezember 2019: 9.642.912)	8.772.476	1,75	3.500.000	Metropolitan Washington Airports Authority Dulles Toll Road Revenue 4,000 % 01-Okt.-2049	3.777.917	0,75
265.000	Berks County Industrial Development Authority 3,200 % 15-Mai-2021	265.974	0,05	1.000.000	New Jersey Turnpike Authority 7,414 % 01-Jan.-2040	1.698.735	0,34
725.000	Berks County Industrial Development Authority 3,950 % 15-Mai-2024	746.500	0,15	3.000.000	New York State Thruway Authority 2,900 % 01-Jan.-2035	3.227.925	0,64
1.000.000	Montgomery County Industrial Development Authority/PA 5,000 % 15-Nov.-2036	1.133.110	0,23	5.000.000	New York State Thruway Authority 4,000 % 01-Jan.-2045	5.659.250	1,13
1.000.000	North Carolina Medical Care Commission 5,000 % 01-Okt.-2042	1.019.265	0,20	2.500.000	New York Transportation Development Corp 5,250 % 01-Jan.-2050	2.711.988	0,54
1.000.000	North Carolina Medical Care Commission 5,000 % 01-Okt.-2047	1.013.850	0,20	4.500.000	Pennsylvania Turnpike Commission 2,890 % 01-Dez.-2035	4.558.230	0,91
1.000.000	Sarasota County Health Facilities Authority 5,000 % 01-Jan.-2037	1.025.070	0,21	8.245.000	Pennsylvania Turnpike Commission 3,043 % 01-Dez.-2033	8.554.971	1,70
1.000.000	Sarasota County Health Facilities Authority 5,000 % 01-Jan.-2042	1.016.070	0,20	9.000.000	Pennsylvania Turnpike Commission 3,416 % 01-Dez.-2041	9.659.565	1,92
2.500.000	St Louis County Industrial Development Authority 5,000 % 01-Sept.-2048	2.552.637	0,51	2.385.000	Pennsylvania Turnpike Commission 5,000 % 01-Jun.-2042	2.738.696	0,54
	Staatsverwaltung - 7.064.625 (31. Dezember 2019: 1.175.663)	7.064.625	1,41	1.500.000	Port Authority of New York & New Jersey 4,823 % 01-Jun.-2045	1.687.688	0,34
5.000.000	State of California 5,250 % 01-Aug.-2032	7.064.625	1,41	1.295.000	Port Authority of New York & New Jersey 5,310 % 01-Aug.-2046	1.435.352	0,29
	Transport - 115.086.442 (31. Dezember 2019: 89.511.540)	115.086.442	22,90	1.080.000	Port of Corpus Christi Authority of Nueces County 3,699 % 01-Dez.-2026	1.205.501	0,24
10.000.000	Central Texas Turnpike System 3,029 % 15-Aug.-2041	9.561.800	1,90	1.135.000	Port of Corpus Christi Authority of Nueces County 3,799 % 01-Dez.-2028	1.297.174	0,26
1.250.000	Chicago Midway International Airport 3,655 % 01-Jan.-2025	1.339.019	0,27	1.250.000	State of Connecticut Bradley International Airport CFC Revenue 3,174 % 01-Jul.-2026	1.233.494	0,24
1.500.000	Chicago Midway International Airport 3,697 % 01-Jan.-2026	1.628.850	0,32	750.000	State of Connecticut Bradley International Airport CFC Revenue 3,431 % 01-Jul.-2028	738.412	0,15
1.200.000	Chicago Midway International Airport 3,747 % 01-Jan.-2027	1.317.702	0,26	2.290.000	State of Ohio 5,000 % 31-Dez.-2039	2.585.616	0,51
900.000	Chicago Midway International Airport 3,797 % 01-Jan.-2028	986.949	0,20	5.600.000	Susquehanna Area Regional Airport Authority 5,000 % 01-Jan.-2038	5.929.196	1,18
5.000.000	Chicago O'Hare International Airport 4,472 % 01-Jan.-2049	6.509.975	1,30	3.000.000	Virginia Small Business Financing Authority 5,000 % 31-Dez.-2052	3.318.210	0,66
1.500.000	City & County of Denver CO Airport System Revenue 5,000 % 01-Dez.-2036	2.046.900	0,41		Wasser - 24.559.969 (31. Dezember 2019: 49.024.331)	24.559.969	4,89
1.500.000	City of Phoenix Civic Improvement Corp 5,000 % 01-Jul.-2029	1.919.497	0,38	1.650.000	City & County Honolulu HI Wastewater System Revenue 2,316 % 01-Jul.-2025	1.728.441	0,35
2.000.000	Colorado High Performance Transportation Enterprise 5,000 % 31-Dez.-2047	2.143.940	0,43	1.000.000	City of Chicago IL Wastewater Transmission Revenue 5,000 % 01-Jan.-2039	1.094.265	0,22
10.000.000	County of Broward FL Airport System Revenue 2,384 % 01-Okt.-2026	9.912.300	1,97	5.800.000	City of Houston TX Combined Utility System Revenue 2,984 % 15-Nov.-2042	6.040.178	1,20
				5.000.000	County of Miami-Dade FL Water & Sewer System Revenue 2,911 % 01-Okt.-2032	5.276.125	1,05

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

		Angemessener Wert	Summe der Netto- vermögen %	Devisenterminkontrakte					Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	
Bestände	Beschreibung	in USD		Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	
Anleihen Forts.				BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund						
	Wasser Forts.			Anteilsklasse CHF E (Acc) (Hedged)						
3.000.000	Irvine Ranch Water District			Schweizer Franken	US-Dollar	3.519.984	3.709.286	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	7.454
	6,622 % 01-Mai-2040	4.691.430	0,93							
1.810.000	Metropolitan Water Reclamation District of Greater Chicago 5,720 % 01-Dez.-2038	2.621.487	0,52						USD	7.454
2.250.000	Ohio Water Development Authority									
	4,817 % 01-Dez.-2030	2.750.805	0,55						CHF	7.062
330.000	State of California Department of Water Resources									
	3,127 % 01-Dez.-2029	357.238	0,07							
Summe der Anlagen in Anleihen		498.811.107	99,27							
Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften - 77.682 (siehe unten) 31. Dezember 2019: 2.551.284)									USD	41.339
		77.682	0,02							
Summe der Vermögenswerte zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert									CHF	39.167
		498.888.789	99,29							
Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften - (1.998.832) (siehe unten) 31. Dezember 2019: (116.353))										
		(1.998.832)	(0,40)							
Summe der finanziellen Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert										
		(1.998.832)	(0,40)							
Nettoumlaufvermögen		5.566.377	1,11							
Summe der Nettovermögen		502.456.334	100,00							
Portfolioanalyse		% des Gesamtvermögens								
An einer amtlichen Börse zugelassene oder an einem geregelten										
Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente			98,83							
OTC-Finanzderivate			0,02							
Sonstiges Umlaufvermögen			1,15							
Summe der Aktiva				100,00						
				BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund						
				Anteilsklasse CHF W (Acc) (Hedged)						
				Schweizer Franken	US-Dollar	19.520.126	20.569.906	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	41.339
									USD	41.339
									CHF	39.167
				BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund						
				Anteilsklasse CHF W (Inc) (Hedged)						
				Schweizer Franken	US-Dollar	6.762.512	7.126.195	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	14.321
									USD	14.321
									CHF	13.568
				BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund						
				Anteilsklasse EUR E (Acc) (Hedged)						
				Euro	US-Dollar	783.720	877.148	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	3.628
									USD	3.628
									EUR	3.229
				Euro	US-Dollar	7.926.525	9.004.781	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(96.634)
									USD	(96.634)
									EUR	(86.012)
									Netto USD	(93.006)
									Netto EUR	(82.783)
				BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund						
				Anteilsklasse EUR E (Inc) (Hedged)						
				Euro	US-Dollar	166.526	186.691	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	458
									USD	458
									EUR	408

Aufstellung der Wertpapierbestände – zum 30. Juni 2020

Devisenterminkontrakte Forts.							Devisenterminkontrakte Forts.						
Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)	Kauf	Verkauf	Summe (K)	Summe (V)	Abrechnungs- datum	Kontrahent	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust)
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund							BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund						
Anteilsklasse EUR E (Inc) (Hedged) Forts.							Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged) Forts.						
Euro	US-Dollar	8.099.537	9.201.329	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(98.743)	Euro	US-Dollar	61.866	69.639	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(111)
						USD (98.743)	Euro	US-Dollar	10.816.003	12.287.319	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(131.860)
						EUR (87.889)						USD (131.971)	
						Netto USD (98.285)						EUR (117.464)	
						Netto EUR (87.481)						Netto USD (131.806)	
												Netto EUR (117.317)	
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund							BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund						
Anteilsklasse EUR H (Acc) (Hedged)							Anteilsklasse EUR W (Inc) (Hedged)						
Euro	US-Dollar	3.687	4.140	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	4	Euro	US-Dollar	2.801.490	3.140.729	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	7.698
US-Dollar	Euro	186.351	163.489	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	2.615						USD 7.698	
						USD 2.619						EUR 6.852	
						EUR 2.331							
Euro	US-Dollar	343.268	389.963	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(4.185)	Euro	US-Dollar	136.630.061	155.216.036	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1.665.683)
						USD (4.185)						USD (1.665.683)	
						EUR (3.725)						EUR (1.482.583)	
						Netto USD (1.566)						Netto USD (1.657.985)	
						Netto EUR (1.394)						Netto EUR (1.475.731)	
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund													
Anteilsklasse EUR H (Inc) (Hedged)													
Euro	US-Dollar	500	563	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1)							
Euro	US-Dollar	100	113	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1)							
Euro	US-Dollar	132.391	150.401	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	(1.614)							
						USD (1.616)							
						EUR (1.438)							
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund													
Anteilsklasse EUR W (Acc) (Hedged)													
Euro	US-Dollar	125.485	140.860	15-Jul.-20	The Bank of New York Mellon	165							
						USD 165							
						EUR 147							

GESAMTERGEBNISRECHNUNG

Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 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	BNY Mellon Asian Equity Fund
	Erläuterungen	EUR	GBP	EUR	USD	USD
Erträge						
	Bankzinserträge	4.017	3.389	579	225	3.866
	Dividendenerträge	–	2.474.896	96.740	108.338	146.788
	Erträge aus Wertpapierdarlehen	13 13.155	8.811	–	6.870	8.609
	Nettogewinne/(Nettoverluste) aus Vermögenswerten/Finanzverbindlichkeiten erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert					
	Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten	(14.593.490)	18.292.451	243.427	215.640	1.604.619
	Nicht Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten	(1.622.464)	(4.702.940)	317.728	(933.735)	510.359
	Summe der Erträge	(16.198.782)	16.076.607	658.474	(602.662)	2.274.241
Aufwendungen						
	Managementgebühren	3 594.379	1.100.124	81.913	33.171	321.598
	Erfolgsabhängige Gebühr	3 831	–	44.846	–	–
	Depotbankgebühr	5 145.916	65.477	12.434	13.860	46.907
	Betriebskosten	7 108.244	144.413	16.593	18.428	34.283
	Dividendenaufwand	–	1.929.945	33.263	–	–
	Finanzierungskosten bei Swaps	–	416.421	135.989	–	–
	Fällige Rückzahlung (von)/an den Investmentmanager	6 –	–	(11.106)	(11.938)	–
	Summe der Aufwendungen	849.370	3.656.380	313.932	53.521	402.788
	Nettoerträge/(-aufwendungen)	(17.048.152)	12.420.227	344.542	(656.183)	1.871.453
Finanzierungskosten						
	Bankzinsen	41.831	2.271	7.721	–	27
	Ausschüttungen	888.329	460.734	–	68.125	–
	Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum	(17.978.312)	11.957.222	336.821	(724.308)	1.871.426
	Quellensteuer auf Dividenden und andere Anlageerträge	(119.458)	241.948	88	(11.831)	(13.114)
	Wertsteigerung/(-minderung) des Inhabern von einlösbaren partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus Transaktionen	(18.097.770)	12.199.170	336.909	(736.139)	1.858.312

Gewinne und Verluste stammen einzig aus fortgeführten Geschäftsbereichen.

Außer den in der Gesamtergebnisrechnung behandelten Gewinnen oder Verlusten gab es keine weiteren Gewinne und Verluste.

* Siehe Erläuterung 18 zum Halbjahresabschluss.

Die beigegeführten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Finanzsatusweises.

Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020 (Forts.)

BNY Mellon Asian Income Fund	BNY Mellon Brazil Equity Fund	BNY Mellon Digital Assets Fund	BNY Mellon Dynamic Total Return Fund	BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund*	BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund
USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
5.173	5.025	88	923	9.803	9	5.453	1.712
629.606	690.885	95.202	28.684	2.432.853	–	115.354	107.241
–	–	–	103	4.156	–	47.924	39.444
27.783	(3.790.579)	107.531	(1.554.532)	1.393.683	437.902	(62.650.399)	2.036.567
(6.033.056)	(33.850.605)	246.674	165.210	800.593	609.086	(25.834.052)	(20.359.868)
(5.370.494)	(36.945.274)	449.495	(1.359.612)	4.641.088	1.046.997	(88.315.720)	(18.174.904)
110.039	526.992	49.570	90.956	460.664	12.278	311.032	940.821
–	–	–	–	–	–	–	–
51.408	127.369	11.603	10.137	36.270	9.127	75.907	47.364
14.470	49.762	14.002	12.009	118.310	13.391	287.619	159.606
–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
(52.770)	–	(18.958)	–	(29.445)	(8.089)	(90.185)	–
123.147	704.123	56.217	113.102	585.799	26.707	584.373	1.147.791
(5.493.641)	(37.649.397)	393.278	(1.472.714)	4.055.289	1.020.290	(88.900.093)	(19.322.695)
12	3.304	53	59	165	151	789	14.024
377.724	189.073	78.793	303.463	1.754.527	21.092	17.667.812	4.389.206
(5.871.377)	(37.841.774)	314.432	(1.776.236)	2.300.597	999.047	(106.568.694)	(23.725.925)
(55.928)	1.940.808	(24.781)	(8.071)	(686.384)	(2.890)	(63.812)	(45.496)
(5.927.305)	(35.900.966)	289.651	(1.784.307)	1.614.213	996.157	(106.632.506)	(23.771.421)

Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 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
	Erläuterungen	USD	USD	USD	USD	EUR
Erträge						
	Bankzinserträge	766	8.938	400	2.631	4.911
	Dividendenerträge	–	–	–	58.158	113.859
	Erträge aus Wertpapierdarlehen	13 1.828	2.897	966	4.149	55.496
	Nettogewinne/(Nettoverluste) aus Vermögenswerten/Finanzverbindlichkeiten erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert					
	Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten	43.790	(62.869.307)	(922.976)	3.254.841	8.207.655
	Nicht Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten	(2.084.340)	10.354.538	(1.333.577)	(6.244.492)	(20.961.092)
	Summe der Erträge	(2.037.956)	(52.502.934)	(2.255.187)	(2.924.713)	(12.579.171)
Aufwendungen						
	Managementgebühren	3 209.998	1.431.804	3.611	402.086	2.780.420
	Erfolgsabhängige Gebühr	3 –	–	–	–	–
	Depotbankgebühr	5 13.493	229.255	30.456	82.755	137.437
	Betriebskosten	7 24.079	166.868	6.601	83.526	323.628
	Dividendenaufwand	–	–	–	–	–
	Finanzierungskosten bei Swaps	–	–	–	–	–
	Fällige Rückzahlung (von)/an den Investmentmanager	6 –	–	–	(21.968)	–
	Summe der Aufwendungen	247.570	1.827.927	40.668	546.399	3.241.485
	Nettoerträge/(-aufwendungen)	(2.285.526)	(54.330.861)	(2.295.855)	(3.471.112)	(15.820.656)
Finanzierungskosten						
	Bankzinsen	343	3.040	218	2.516	65.175
	Ausschüttungen	199.144	4.599.994	843.480	4.895.742	1.316.610
	Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum	(2.485.013)	(58.933.895)	(3.139.553)	(8.369.370)	(17.202.441)
	Quellensteuer auf Dividenden und andere Anlageerträge	632	(629.289)	(41.387)	(302.810)	151.094
	Wertsteigerung/(-minderung) des Inhabern von einlösbaren partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus Transaktionen	(2.484.381)	(59.563.184)	(3.180.940)	(8.672.180)	(17.051.347)

Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020 (Forts.)

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	BNY Mellon Global Equity Income Fund	BNY Mellon Global High Yield Bond Fund
EUR	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
18	54.140	7.681	133.708	2.746	52.084	265.172	15.331
–	216.396	112.530	180.053	113.457	4.007.144	27.336.387	–
2.924	56.413	19.022	52.803	1.656	28.815	152.932	7.804
(133.668)	13.688.953	17.638.645	4.170.248	689.851	10.814.390	(41.184.287)	(1.334.128)
(1.203.678)	9.725.944	(2.979.249)	(4.148.703)	91.310	(28.238.226)	(226.121.405)	(5.121.118)
(1.334.404)	23.741.846	14.798.629	388.109	899.020	(13.335.793)	(239.551.201)	(6.432.111)
22.526	1.679.403	49.349	1.192.279	137.428	1.585.775	6.773.709	356.250
–	–	–	–	–	–	–	–
17.885	102.396	96.228	97.891	59.002	62.181	177.632	30.192
14.217	277.198	107.597	192.727	39.836	194.784	819.893	43.938
–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	6.874	–	(44.910)	–	–	–
54.628	2.058.997	260.048	1.482.897	191.356	1.842.740	7.771.234	430.380
(1.389.032)	21.682.849	14.538.581	(1.094.788)	707.664	(15.178.533)	(247.322.435)	(6.862.491)
10.397	434	7.783	1.730	14	258	2.059	2.587
348.768	1.605.722	12.036.242	2.372.663	9.279	2.733.382	18.132.395	1.266.958
(1.748.197)	20.076.693	2.494.556	(3.469.181)	698.371	(17.912.173)	(265.456.889)	(8.132.036)
2.729	(109.158)	(15.845)	22.414	(58.389)	(843.011)	(6.882.183)	(5.843)
(1.745.468)	19.967.535	2.478.711	(3.446.767)	639.982	(18.755.184)	(272.339.072)	(8.137.879)

Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020 (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)
	Erläuterungen	USD	USD	EUR	USD	EUR
Erträge						
		1.397	926	9	4.087	1.443
		2.768.644	652.590	389.799	466.503	25.794.901
	13	–	3.421	–	3.561	269.941
	Nettogewinne/(-Nettoluste) aus Vermögenswerten/Finanzverbindlichkeiten erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert					
	Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten	(6.857.957)	3.931.815	(15.721)	(328.660)	(44.734.325)
	Nicht Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten	(1.628.057)	(4.884.914)	(3.070.008)	(4.798.078)	(70.297.285)
Summe der Erträge		(5.715.973)	(296.162)	(2.695.921)	(4.652.587)	(88.965.325)
Aufwendungen						
	3	241.129	324.499	67.736	368.087	10.713.338
	3	–	–	–	–	–
	5	16.365	12.813	16.119	35.184	510.167
	7	53.715	37.751	11.682	21.641	1.188.729
		–	–	–	–	–
		–	–	–	–	–
	6	(5.856)	–	(14.791)	–	–
Summe der Aufwendungen		305.353	375.063	80.746	424.912	12.412.234
Nettoerträge/(-aufwendungen)		(6.021.326)	(671.225)	(2.776.667)	(5.077.499)	(101.377.559)
Finanzierungskosten						
		1.741	19	565	413	375.942
		1.786.119	378.972	446.673	10.453	26.779.139
Gewinne/(-Verluste) im Berichtszeitraum		(7.809.186)	(1.050.216)	(3.223.905)	(5.088.365)	(128.532.640)
Quellensteuer auf Dividenden und andere Anlageerträge		(544.379)	(130.027)	(26.292)	(97.314)	(2.406.649)
Wertsteigerung/(-minderung) des Inhabern von einlösbaren partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus Transaktionen		(8.353.565)	(1.180.243)	(3.250.197)	(5.185.679)	(130.939.289)

Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020 (Forts.)

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	BNY Mellon Mobility Innovation Fund	BNY Mellon S&P 500® Index Tracker
GBP	USD	USD	USD	JPY	EUR	USD	USD
1.223	44.975	10.969	7.100	98.127	151.368	1.461	150
553.363	2.555.677	350.382	175.534	131.940.502	14.482.448	919.758	399.898
2.780	11.570	153.904	1.212	30.057.465	112.924	–	1.024
(1.553.964)	336.515	(17.502.095)	(478.384)	(304.365.035)	(6.366.652)	279.309	4.867.686
(1.035.397)	(7.864.954)	(32.132.610)	(1.484.024)	(1.296.084.367)	(82.547.303)	11.381.536	(7.523.140)
(2.031.995)	(4.916.217)	(49.119.450)	(1.778.562)	(1.438.353.308)	(74.167.215)	12.582.064	(2.254.382)
143.429	1.061.998	1.484.871	21	49.912.151	6.937.321	662.871	129.137
–	–	–	–	–	46.167	–	–
55.942	97.739	73.764	11.919	2.846.105	139.186	65.904	68.021
49.369	116.474	278.188	9.385	7.494.570	633.922	82.435	29.035
–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	(1.337)	(3.239)	(271.239)	–	(44.215)	(1.384)
248.740	1.276.211	1.835.486	18.086	59.981.587	7.756.596	766.995	224.809
(2.280.735)	(6.192.428)	(50.954.936)	(1.796.648)	(1.498.334.895)	(81.923.811)	11.815.069	(2.479.191)
255	454	14.377	1	543.134	8.463	3.300	114
1.161.646	2.001.869	17.294.800	480.699	63.226.899	2.319.581	557.890	19
(3.442.636)	(8.194.751)	(68.264.113)	(2.277.348)	(1.562.104.928)	(84.251.855)	11.253.879	(2.479.324)
(56.750)	(247.803)	(34.166)	(27.812)	(19.458.097)	(2.657.248)	(195.095)	(109.011)
(3.499.386)	(8.442.554)	(68.298.279)	(2.305.160)	(1.581.563.025)	(86.909.103)	11.058.784	(2.588.335)

Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020 (Forts.)

		BNY Mellon Small Cap Euroland 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
	Erläuterungen	EUR	EUR	EUR	USD	USD
Erträge						
	Bankzinserträge	43	69	3	3.912	61
	Dividendenerträge	759.815	–	158.673	–	331.333
	Erträge aus Wertpapierdarlehen	29.372	–	–	–	753
	Nettogewinne/(Nettoverluste) aus Vermögenswerten/Finanzverbindlichkeiten erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert					
	Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten	749.384	(440.100)	(938.816)	(5.040.745)	(665.357)
	Nicht Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten	(9.316.302)	(31.501)	(325.152)	1.144.489	(4.729.397)
	Summe der Erträge	(7.777.688)	(471.532)	(1.105.292)	(3.892.344)	(5.062.607)
Aufwendungen						
	Managementgebühren	345.265	174.657	62.605	260.977	151.906
	Erfolgsabhängige Gebühr	–	–	–	–	–
	Depotbankgebühr	31.399	53.533	10.015	35.564	21.940
	Betriebskosten	23.193	75.724	10.903	38.890	15.854
	Dividendenaufwand	–	–	–	–	–
	Finanzierungskosten bei Swaps	–	–	–	–	–
	Fällige Rückzahlung (von)/an den Investmentmanager	–	(40.638)	(6.394)	–	–
	Summe der Aufwendungen	399.857	263.276	77.129	335.431	189.700
	Nettoerträge/(-aufwendungen)	(8.177.545)	(734.808)	(1.182.421)	(4.227.775)	(5.252.307)
Finanzierungskosten						
	Bankzinsen	3.250	30.421	1.722	739	7
	Ausschüttungen	112.861	1.697.370	–	386.838	40
	Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum	(8.293.656)	(2.462.599)	(1.184.143)	(4.615.352)	(5.252.354)
	Quellensteuer auf Dividenden und andere Anlageerträge	(121.698)	(15.582)	(23.023)	597	(89.717)
	Wertsteigerung/(-minderung) des Inhabern von einlösbaren partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus Transaktionen	(8.415.354)	(2.478.181)	(1.207.166)	(4.614.755)	(5.342.071)

* Siehe Erläuterung 18 zum Halbjahresabschluss.

^ Der Gesamtbetrag für die Gesellschaft wurde zum 30. Juni 2020 berichtigt und berücksichtigt Überkreuzinvestitionen durch den BNY Mellon Euroland Bond Fund und den BNY Mellon European Credit Fund.

Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020 (Forts.)

BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund	Summe am 30. Juni 2020^
USD	USD	USD
29.187	2.668	868.462
5.491.694	–	101.569.670
2.926	–	1.439.947
(21.752.245)	10.943.543	(197.315.481)
(76.649.480)	5.575.886	(689.688.471)
(92.877.918)	16.522.097	(783.125.873)
829.943	990.993	49.207.244
–	–	101.184
43.037	37.661	3.293.849
153.977	228.523	6.709.631
–	–	2.467.029
–	–	674.218
–	102	(410.168)
1.026.957	1.257.279	62.042.987
(93.904.875)	15.264.818	(845.168.860)
2.757	305	672.949
4.338.696	7.493.726	148.259.581
(98.246.328)	7.770.787	(994.101.390)
(1.346.867)	9.398	(16.341.512)
(99.593.195)	7.780.185	(1.010.442.902)

Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2019

		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	BNY Mellon Asian Equity Fund
	Erläuterungen	EUR	GBP	EUR	USD	USD
Erträge						
		29.865	11.242	–	1.133	94
		–	14.775.107	–	116.648	347.140
	13	55.642	27.086	–	3.390	382
	Nettogewinne/(Nettoverluste) aus Vermögenswerten/Finanzverbindlichkeiten erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert					
	Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten	(47.698.599)	(64.739.237)	37.030	(193.015)	397.573
	Nicht Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten	40.071.705	40.041.946	77.788	790.124	3.824.548
	Summe der Erträge	(7.541.387)	(9.883.856)	114.818	718.280	4.569.737
Aufwendungen						
	3	1.020.302	5.424.331	11.517	38.788	338.017
	3	–	–	15.300	–	–
	5	125.731	113.502	4.023	16.282	25.804
	7	230.463	497.234	2.701	32.106	39.488
		–	15.681.767	–	–	–
		–	1.657.096	–	–	–
	6	–	–	(4.420)	(27.374)	–
	Summe der Aufwendungen	1.376.496	23.373.930	29.121	59.802	403.309
	Nettoerträge/(-aufwendungen)	(8.917.883)	(33.257.786)	85.697	658.478	4.166.428
Finanzierungskosten						
		83.829	2.271	–	–	–
		901.501	1.651.720	–	84.467	27
	Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum	(9.903.213)	(34.911.777)	85.697	574.011	4.166.401
	Quellensteuer auf Dividenden und andere Anlageerträge	(17.731)	(678.574)	(47)	(13.577)	(34.691)
	Wertsteigerung/(-minderung) des Inhabern von einlösbaren partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus Transaktionen	(9.920.944)	(35.590.351)	85.650	560.434	4.131.710

Anders als bei den Fonds, die im Berichtszeitraum geschlossen wurden, stammen die Gewinne und Verluste einzig aus fortgeführten Geschäftsbereichen. Außer den in der Gesamtergebnisrechnung behandelten Gewinnen oder Verlusten gab es keine weiteren Gewinne und Verluste.

* Dieser Fonds wurde im Berichtszeitraum aufgelegt.

Die beigegeführten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Finanzsausweises.

Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2019 (Forts.)

BNY Mellon Asian Income Fund	BNY Mellon Brazil Equity Fund	BNY Mellon Digital Assets Fund*	BNY Mellon Dynamic Total Return Fund	BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund	BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund
GBP	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
51	–	210	12.609	40.363	5.034	4.130	95.286
285.797	1.884.749	91.752	37.034	980.941	110.987	–	–
–	–	–	372	4.435	34.518	3.935	19.692
90.534	1.139.453	(47.293)	2.670.314	10.010.441	8.844.069	1.618.692	(15.332.085)
2.616.696	7.897.857	308.932	424.451	16.660.487	15.609.401	3.463.866	68.587.335
2.993.078	10.922.059	353.601	3.144.780	27.696.667	24.604.009	5.090.623	53.370.228
80.795	822.895	14.758	118.452	102.226	682.499	263.071	2.158.969
–	–	–	–	–	–	–	–
5.734	94.625	5.219	7.778	28.027	31.336	6.573	353.639
10.008	54.191	8.778	15.994	47.269	105.922	24.277	310.169
–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
(6.577)	–	(11.319)	(3)	(30.122)	–	–	–
89.960	971.711	17.436	142.221	147.400	819.757	293.921	2.822.777
2.903.118	9.950.348	336.165	3.002.559	27.549.267	23.784.252	4.796.702	50.547.451
–	3.867	39	–	–	5.511	1.101	7.006
285.789	144.045	–	135.110	1.483.640	3.474.802	53.597	9.881.532
2.617.329	9.802.436	336.126	2.867.449	26.065.627	20.303.939	4.742.004	40.658.913
–	(1.385.053)	(22.034)	2.973	(347.138)	(87.137)	3.974	(671.351)
2.617.329	8.417.383	314.092	2.870.422	25.718.489	20.216.802	4.745.978	39.987.562

Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2019 (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
	Erläuterungen	USD	USD	EUR	EUR	USD
Erträge						
	Bankzinserträge	861	2.615	25.825	–	1.101
	Dividendenerträge	–	75.143	–	–	127.995
	Erträge aus Wertpapierdarlehen	13 2.838	5.299	53.425	605	37.964
	Nettogewinne/(Nettoverluste) aus Vermögenswerten/Finanzverbindlichkeiten erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert					
	Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten	1.427.043	4.717.965	6.642.452	550.845	9.847.414
	Nicht Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten	2.032.435	7.038.619	53.200.720	1.749.100	25.661.643
	Summe der Erträge	3.463.177	11.839.641	59.922.422	2.300.550	35.676.117
Aufwendungen						
	Managementgebühren	3 1.681	312.766	2.802.952	19.237	1.545.961
	Erfolgsabhängige Gebühr	3 –	–	–	–	–
	Depotbankgebühr	5 24.518	60.035	96.388	7.237	67.101
	Betriebskosten	7 7.938	71.207	440.297	10.213	289.259
	Dividendenaufwand	–	–	–	–	–
	Finanzierungskosten bei Swaps	–	–	–	–	–
	Fällige Rückzahlung (von)/an den Investmentmanager	6 –	(26.991)	–	–	–
	Summe der Aufwendungen	34.137	417.017	3.339.637	36.687	1.902.321
	Nettoerträge/(-aufwendungen)	3.429.040	11.422.624	56.582.785	2.263.863	33.773.796
Finanzierungskosten						
	Bankzinsen	145	5.748	47.506	4.890	104
	Ausschüttungen	1.185.098	3.721.729	1.517.953	211.230	620.205
	Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum	2.243.797	7.695.147	55.017.326	2.047.743	33.153.487
	Quellensteuer auf Dividenden und andere Anlageerträge	(21.587)	(84.476)	(213.053)	1.925	(76.113)
	Wertsteigerung/(-minderung) des Inhabern von einlösbaren partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus Transaktionen	2.222.210	7.610.671	54.804.273	2.049.668	33.077.374

Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2019 (Forts.)

BNY Mellon Global Credit Fund	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	BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund	BNY Mellon Global Leaders Fund
USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
2.489	50.117	–	679	12.299	3.441	987	5.038
95.882	916.224	261.920	4.671.375	31.147.620	55.570	390.800	927.179
14.696	20.888	40.093	54.697	145.572	16.971	–	3.445
16.449.729	4.678.553	(2.152.837)	2.540.171	18.196.168	1.390.864	(237.899)	147.813
31.646.616	17.293.962	7.245.700	41.944.943	161.653.078	8.265.203	1.109.807	12.284.563
48.209.412	22.959.744	5.394.876	49.211.865	211.154.737	9.732.049	1.263.695	13.368.038
55.263	1.477.890	169.962	1.425.887	5.668.770	266.425	46.051	309.564
–	–	–	–	–	–	–	–
64.795	84.367	57.309	51.592	94.571	16.840	7.860	9.187
104.940	248.188	35.393	175.624	553.703	39.705	14.362	41.877
–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
(200)	–	(17.185)	–	–	–	(13.009)	7.082
224.798	1.810.445	245.479	1.653.103	6.317.044	322.970	55.264	367.710
47.984.614	21.149.299	5.149.397	47.558.762	204.837.693	9.409.079	1.208.431	13.000.328
4.424	–	2.529	1.444	3.386	–	12	–
11.931.161	2.254.237	182.469	2.805.762	13.280.840	1.776.025	250.395	492.289
36.049.029	18.895.062	4.964.399	44.751.556	191.553.467	7.633.054	958.024	12.508.039
(13.958)	(44.653)	43	(1.019.689)	(5.938.257)	(3.546)	(80.905)	(208.162)
36.035.071	18.850.409	4.964.442	43.731.867	185.615.210	7.629.508	877.119	12.299.877

		BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund	BNY Mellon Global Opportunistic Bond Fund**	BNY Mellon Global Opportunities Fund	BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)
	Erläuterungen	EUR	USD	USD	EUR	GBP
Erträge						
	Bankzinserträge	10	88.016	–	–	1.324
	Dividendenerträge	346.491	–	725.897	29.100.627	539.376
	Erträge aus Wertpapierdarlehen	–	354	5.434	278.483	2.912
	Nettogewinne/(Nettoverluste) aus Vermögenswerten/Finanzverbindlichkeiten erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert					
	Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten	(146.871)	(986.251)	4.658	330.346	1.491.754
	Nicht Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten	1.174.536	1.659.374	6.814.653	227.098.404	3.454.597
Summe der Erträge		1.374.166	761.493	7.550.642	256.807.860	5.489.963
Aufwendungen						
	Managementgebühren	3 50.979	15.866	391.565	9.365.800	120.188
	Erfolgsabhängige Gebühr	3 –	–	–	–	–
	Depotbankgebühr	5 15.166	(10.018)	34.010	265.081	49.088
	Betriebskosten	7 13.810	32.587	28.418	1.098.936	26.629
	Dividendenaufwand	–	–	–	–	–
	Finanzierungskosten bei Swaps	–	–	–	–	–
	Fällige Rückzahlung (von)/an den Investmentmanager	6 (18.651)	(15.709)	–	–	–
Summe der Aufwendungen		61.304	22.726	453.993	10.729.817	195.905
Nettoerträge/(-aufwendungen)		1.312.862	738.767	7.096.649	246.078.043	5.294.058
Finanzierungskosten						
	Bankzinsen	190	–	152	431.513	14
	Ausschüttungen	277.390	148.255	3.487	22.082.978	991.224
Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum		1.035.282	590.512	7.093.010	223.563.552	4.302.820
Quellensteuer auf Dividenden und andere Anlageerträge		(29.396)	2.050	(148.004)	(3.820.737)	(84.407)
Wertsteigerung/(-minderung) des Inhabern von einlösbaren partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus Transaktionen		1.005.886	592.562	6.945.006	219.742.815	4.218.413

** Dieser Fonds wurde im Berichtszeitraum geschlossen.

Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2019 (Forts.)

BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	BNY Mellon Global Unconstrained Fund	BNY Mellon Japan All Cap Equity Fund**	BNY Mellon Japan REIT Alpha Fund**	BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund	BNY Mellon Mobility Innovation Fund
USD	USD	USD	JPY	JPY	JPY	EUR	USD
16.009	6.414	1.182	34.372	5.858	188.006	113.224	3.823
2.821.853	308.453	248.540	189.200	4.771.046	158.093.800	20.123.975	607.737
25.340	148.387	1.829	120.348	43.432	20.836.744	175.061	–
6.701.208	9.688.996	238.511	22.223.176	102.217.549	(572.245.070)	9.000.380	(770.203)
20.152.482	21.280.912	3.116.764	49.350.721	(44.611.442)	1.060.769.812	270.587.476	7.560.747
29.716.892	31.433.162	3.606.826	71.917.817	62.426.443	667.643.292	300.000.116	7.402.104
927.641	1.363.526	19	249.367	1.006.304	66.639.130	5.321.263	231.181
–	–	–	–	–	–	631.414	–
87.839	57.438	6.080	274.104	202.590	2.948.333	117.056	29.795
123.141	267.790	14.455	1.068.197	981.470	9.597.015	602.570	41.686
–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
–	(12.525)	(2.072)	(676.571)	–	1.837.448	–	(28.669)
1.138.621	1.676.229	18.482	915.097	2.190.364	81.021.926	6.672.303	273.993
28.578.271	29.756.933	3.588.344	71.002.720	60.236.079	586.621.366	293.327.813	7.128.111
198	–	–	32.206	48.792	610.314	7.390	3.852
1.859.597	16.709.770	399.155	13.295.848	9.186.417	37.298.442	8.610.657	33.658
26.718.476	13.047.163	3.189.189	57.674.666	51.000.870	548.712.610	284.709.766	7.090.601
(411.905)	(3.176)	(50.566)	(28.380)	(715.657)	(23.714.071)	(4.114.496)	(122.088)
26.306.571	13.043.987	3.138.623	57.646.286	50.285.213	524.998.539	280.595.270	6.968.513

Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2019 (Forts.)

		BNY Mellon S&P 500® Index Tracker	BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund*	BNY Mellon Targeted Return Bond Fund	BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund
	Erläuterungen	USD	EUR	EUR	USD	USD
Erträge						
	Bankzinserträge	2.194	7	549	7.940	807
	Dividendenerträge	769.919	1.975.508	–	–	284.489
	Erträge aus Wertpapierdarlehen	13 13.999	24.782	–	1.863	3.520
	Nettogewinne/(Nettoverluste) aus Vermögenswerten/Finanzverbindlichkeiten erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert					
	Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten	9.252.465	(988.705)	137.302	(1.895.087)	(207.133)
	Nicht Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten	2.841.001	12.959.715	3.229.564	3.730.105	3.263.450
	Summe der Erträge	12.879.578	13.971.307	3.367.415	1.844.821	3.345.133
Aufwendungen						
	Managementgebühren	3 198.297	480.709	40.470	261.011	130.756
	Erfolgsabhängige Gebühr	3 –	–	–	–	–
	Depotbankgebühr	5 37.025	25.907	27.157	29.306	19.833
	Betriebskosten	7 48.850	35.189	28.613	41.551	10.664
	Dividendenaufwand	–	–	–	–	–
	Finanzierungskosten bei Swaps	–	–	–	–	–
	Fällige Rückzahlung (von)/an den Investmentmanager	6 –	–	(24.593)	–	–
	Summe der Aufwendungen	284.172	541.805	71.647	331.868	161.253
	Nettoerträge/(-aufwendungen)	12.595.406	13.429.502	3.295.768	1.512.953	3.183.880
Finanzierungskosten						
	Bankzinsen	–	5.064	2.458	76	–
	Ausschüttungen	50	195.846	61.251	891.481	39
	Gewinne/(Verluste) im Berichtszeitraum	12.595.356	13.228.592	3.232.059	621.396	3.183.841
	Quellensteuer auf Dividenden und andere Anlageerträge	(246.096)	(381.016)	(46.285)	(27.830)	(85.540)
	Wertsteigerung/(-minderung) des Inhabern von einlösbaren partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus Transaktionen	12.349.260	12.847.576	3.185.774	593.566	3.098.301

* Dieser Fonds wurde im Berichtszeitraum aufgelegt.

^ Der Gesamtbetrag für die Gesellschaft wurde zum 30. Juni 2019 berichtet und berücksichtigt Überkreuzinvestitionen durch den BNY Mellon Euroland Bond Fund und den BNY Mellon European Credit Fund.

Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2019 (Forts.)

BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	BNY Mellon U.S. High Yield Beta Fund	BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund	BNY Mellon U.S. Opportunistic Alpha Fund	BNY Mellon US Opportunities Fund	Summe am 30. Juni 2019^
USD	USD	USD	USD	USD	USD
107.529	5.720	20.005	1.775	1.304	711.019
6.108.519	–	–	2.913	204.034	134.205.345
12.679	23.682	–	–	3.484	1.543.481
2.163.422	(1.477.617)	2.868.641	188.458	(432.781)	(30.424.004)
48.845.829	10.423.864	17.382.263	(223.093)	5.868.198	1.343.126.508
57.237.978	8.975.649	20.270.909	(29.947)	5.644.239	1.449.162.349
941.323	139.063	633.067	18.295	116.094	50.669.795
–	–	–	–	–	730.423
32.497	16.968	27.919	8.322	7.218	2.512.838
198.888	138.877	171.749	9.186	12.392	6.938.743
–	–	–	–	–	20.289.363
–	–	–	–	–	2.143.982
1.265	(36.405)	638	(13.956)	6.299	(272.051)
1.173.973	258.503	833.373	21.847	142.003	83.013.093
56.064.005	8.717.146	19.437.536	(51.794)	5.502.236	1.366.149.256
2.104	–	185	–	73	709.474
4.421.237	4.621.217	6.820.276	–	5.789	132.245.229
51.640.664	4.095.929	12.617.075	(51.794)	5.496.374	1.233.194.553
(1.713.243)	(33.357)	–	(7.751)	(58.202)	(23.897.114)
49.927.421	4.062.572	12.617.075	(59.545)	5.438.172	1.209.297.439

BILANZ

Zum 30. Juni 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	BNY Mellon Asian Equity Fund
	Erläuterungen	EUR	GBP	EUR	USD	USD
Aktiva (fällig innerhalb eines Jahres)						
	Finanzielle Vermögenswerte zum angemessenen					
	Gewinn-/Verlustwert	15 284.720.154	256.504.073	30.895.397	6.882.349	37.607.784
	Barmittel und Bargegenwerte	8 40.276.306	19.557.173	1.396.091	459.671	1.616.925
	Forderungen aus Erträgen	1.646.238	570.284	79.506	22.733	25.335
	Forderungen aus Wertpapierverkäufen	2.226.986	26.867	1.358.238	3.561	–
	Rückzahlungen von der Verwaltungsgesellschaft	6 –	–	802	2.842	–
	Einschusszahlungen auf Derivatekontrakte	8 14.653.164	2.854.394	311.360	–	–
	Vom Makler erhaltene Barsicherheiten	4.484.000	5.300.000	270.000	–	–
	Forderungen aus der Zeichnung von Anteilen	26.562	9.277	–	–	–
	Sonstige Forderungen	10.204	15.206	590	10.406	51
		348.043.614	284.837.274	34.311.984	7.381.562	39.250.095
Passiva (fällig innerhalb eines Jahres)						
	Finanzielle Verbindlichkeiten zum angemessenen					
	Gewinn-/Verlustwert	15 21.851.410	6.628.499	2.017.561	8.289	568
	Überziehungskredit	8 1.925	–	–	–	–
	Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen	433.621	176.287	3.094.047	6.133	485.031
	Verbindlichkeiten aus Rücknahmen	3.654.681	248.572	–	–	46
	Zahlbare Aufwendungen	283.168	299.891	41.704	33.384	80.512
	Zahlbare erfolgsabhängige Gebühren	3 485	–	44.543	–	–
	Einschusszahlungen auf Derivatekontrakte	8 472.762	–	254.627	–	–
	An den Makler zu zahlende Barsicherheiten	4.484.000	5.300.000	270.000	–	–
	Zahlbare Erträge aus Swaps	341.399	–	5.296	–	–
	Zahlbare Finanzierungskosten bei Swaps	–	22.812	13.574	–	–
	Zu leistende Steuern	9 –	–	–	–	–
	Sonstige Verbindlichkeiten	–	235.147	–	–	145.282
		31.523.451	12.911.208	5.741.352	47.806	711.439
Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibendes Nettovermögen		316.520.163	271.926.066	28.570.632	7.333.756	38.538.656

* Siehe Erläuterung 18 zum Halbjahresabschluss.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Finanzsatusweises.

Zum 30. Juni 2020 (Forts.)

BNY Mellon Asian Income Fund	BNY Mellon Brazil Equity Fund	BNY Mellon Digital Assets Fund	BNY Mellon Dynamic Total Return Fund	BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund*	BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund
USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
28.472.079	59.686.934	10.939.032	22.079.836	376.292.003	62.390.626	1.003.456.106	298.949.848
1.047.040	3.288.882	71.248	2.776.206	29.742.569	706.322	3.141.670	6.731.593
149.245	628.984	3.084	–	189.708	554.332	16.186.235	4.420.029
–	–	–	66.612	–	–	41.876	8.288.670
11.796	–	4.718	–	9.204	4.124	22.063	–
–	–	–	1.164.404	–	324.047	3.030.286	1.290.000
–	–	–	–	–	–	–	–
–	287	–	–	6.026	–	116.420	21.683
1.384	507	2.710	58	46.587	12.943	3.572.834	5.564
29.681.544	63.605.594	11.020.792	26.087.116	406.286.097	63.992.394	1.029.567.490	319.707.387
3	68.926	5.869	347.004	3.595	1.597.971	11.075.652	3.262.058
78.507	–	–	893.881	–	–	–	–
10.797	–	–	–	–	–	121.516.648	7.655.648
42.296	–	–	42.451	–	–	–	46.039
30.443	192.904	31.033	23.890	174.235	13.704	191.465	243.633
–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	666.574	51.860	2.184	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	2.376	–
–	–	–	–	–	–	–	–
–	2.360.662	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
162.046	2.622.492	36.902	1.973.800	229.690	1.613.859	132.786.141	11.207.378
29.519.498	60.983.102	10.983.890	24.113.316	406.056.407	62.378.535	896.781.349	308.500.009

Zum 30. Juni 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
Erläuterungen		USD	USD	USD	USD	EUR
Aktiva (fällig innerhalb eines Jahres)						
Finanzielle Vermögenswerte zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert	15	28.957.426	251.010.312	28.954.718	196.700.666	520.608.932
Barmittel und Bargegenwerte	8	525.065	8.013.781	744.641	4.952.400	20.136.581
Forderungen aus Erträgen		386.759	4.417.684	468.998	2.276.234	3.740.317
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		130.812	2.190.669	–	193.619	15.218.939
Rückzahlungen von der Verwaltungsgesellschaft	6	–	–	–	368	–
Einschusszahlungen auf Derivatekontrakte	8	22.212	–	14.358	1.960.000	27.655.488
Vom Makler erhaltene Barsicherheiten		–	290.000	–	260.000	2.074.591
Forderungen aus der Zeichnung von Anteilen		–	–	–	–	1.272.523
Sonstige Forderungen		213	54.200	930	–	342
		30.022.487	265.976.646	30.183.645	206.343.287	590.707.713
Passiva (fällig innerhalb eines Jahres)						
Finanzielle Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert	15	58.442	3.456.911	185.585	5.803.453	2.976.244
Überziehungskredit	8	–	8.048.530	–	7.817	297
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		426.866	555.400	447.170	7.912.976	3.535.006
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		–	348.500	–	–	21.221.782
Zahlbare Aufwendungen		59.317	497.093	17.618	142.075	508.779
Zahlbare erfolgsabhängige Gebühren	3	–	–	–	–	–
Einschusszahlungen auf Derivatekontrakte	8	17.901	–	10.806	–	23.491.884
An den Makler zu zahlende Barsicherheiten		–	290.000	–	260.000	2.074.591
Zahlbare Erträge aus Swaps		–	–	–	–	–
Zahlbare Finanzierungskosten bei Swaps		–	–	–	–	–
Zu leistende Steuern	9	–	–	–	–	–
Sonstige Verbindlichkeiten		–	–	–	–	–
		562.526	13.196.434	661.179	14.126.321	53.808.583
Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibendes Nettovermögen						
		29.459.961	252.780.212	29.522.466	192.216.966	536.899.130

Zum 30. Juni 2020 (Forts.)

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	BNY Mellon Global Equity Income Fund	BNY Mellon Global High Yield Bond Fund
EUR	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
68.697.934	586.424.410	621.220.801	361.079.162	30.063.048	356.893.259	1.184.580.753	108.161.727
3.839.515	10.031.702	4.814.045	7.566.683	519.702	7.142.131	26.106.497	3.393.602
372.203	4.002.898	3.406.886	2.426.717	17.743	316.339	2.266.263	1.800.438
198.444	–	–	1.451.999	–	–	3.546.198	1.946.681
–	–	128	–	26.542	–	–	–
771.755	915.674	3.450.879	734.166	–	510.000	–	–
–	1.150.000	1.870.000	1.730.000	–	–	–	–
–	983.847	16.839	252.815	–	852.853	83	113.674
1.366	1.678	1.903	1.052.841	2.888	13.387	5.236	267
73.881.217	603.510.209	634.781.481	376.294.383	30.629.923	365.727.969	1.216.505.030	115.416.389
43.127	1.267.106	12.505.576	2.490.159	9.635	378.554	570.150	469.320
–	16.695	91.932	1.324.091	–	231.881	716.465	325.781
195.736	–	7.070.553	493.863	85.225	–	3.981.637	3.010.610
–	473.924	–	132.361	35.802	2.674.018	7.555.597	–
19.828	454.617	96.727	308.389	61.349	420.066	1.468.843	104.145
–	–	–	–	–	–	–	–
649.525	–	1.064.993	–	–	–	–	–
–	1.150.000	1.870.000	1.730.000	–	–	–	–
–	–	121.822	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
–	707.575	–	–	–	–	622.746	–
908.216	4.069.917	22.821.603	6.478.863	192.011	3.704.519	14.915.438	3.909.856
72.973.001	599.440.292	611.959.878	369.815.520	30.437.912	362.023.450	1.201.589.592	111.506.533

Zum 30. Juni 2020 (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)
Erläuterungen		USD	USD	EUR	USD	EUR
Aktiva (fällig innerhalb eines Jahres)						
Finanzielle Vermögenswerte zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert	15	148.358.700	62.584.391	20.421.067	33.438.108	2.588.228.044
Barmittel und Bargegenwerte	8	1.714.693	997.563	257.115	347.092	215.982.305
Forderungen aus Erträgen		873.407	38.929	92.413	27.719	5.199.843
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		–	–	–	–	–
Rückzahlungen von der Verwaltungsgesellschaft	6	58	–	1.066	–	–
Einschusszahlungen auf Derivatekontrakte	8	–	–	–	–	8.722.334
Vom Makler erhaltene Barsicherheiten		–	–	–	–	61.110.000
Forderungen aus der Zeichnung von Anteilen		1.794	5.587	3.273	–	4.775.800
Sonstige Forderungen		7.094	187	44	3	42.759
		150.955.746	63.626.657	20.774.978	33.812.922	2.884.061.085
Passiva (fällig innerhalb eines Jahres)						
Finanzielle Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert	15	3.365.373	14.845	30.500	6.469	24.645.446
Überziehungskredit	8	–	–	84.460	–	56.741
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		256.551	–	–	–	13.600.497
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		41.907	–	27.970	4.733	11.886.688
Zahlbare Aufwendungen		86.843	73.912	26.586	82.109	2.485.465
Zahlbare erfolgsabhängige Gebühren	3	–	–	–	–	–
Einschusszahlungen auf Derivatekontrakte	8	–	–	–	–	–
An den Makler zu zahlende Barsicherheiten		–	–	–	–	61.110.000
Zahlbare Erträge aus Swaps		–	–	–	–	–
Zahlbare Finanzierungskosten bei Swaps		–	–	–	–	–
Zu leistende Steuern	9	–	–	–	–	–
Sonstige Verbindlichkeiten		–	–	–	–	–
		3.750.674	88.757	169.516	93.311	113.784.837
Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibendes Nettovermögen		147.205.072	63.537.900	20.605.462	33.719.611	2.770.276.248

Zum 30. Juni 2020 (Forts.)

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	BNY Mellon Mobility Innovation Fund	BNY Mellon S&P 500® Index Tracker
GBP	USD	USD	USD	JPY	EUR	USD	USD
61.020.664	270.571.302	738.259.996	22.590.131	11.910.149.044	1.357.841.179	192.153.302	32.623.869
2.196.229	23.565.012	524.966	1.148.442	409.076.591	29.492.940	2.894.319	283.709
164.221	576.190	9.702.221	43.595	9.819.625	1.838.606	22.228	18.311
–	–	5.395.332	63.188	10.812.677	–	–	134.917
–	–	1.000	72	5.936	–	7.642	1.384
584.942	3.004.212	5.907.232	–	–	–	–	–
–	–	750.000	–	–	–	–	–
109.149	30.252	189.584	–	–	27.234.874	3.113.023	–
1.209	5.117	9.661	245	1.686.512	90.781	–	48
64.076.414	297.752.085	760.739.992	23.845.673	12.341.550.385	1.416.498.380	198.190.514	33.062.238
1.369.733	4.634.838	14.315.792	484.511	15.556.005	1.700	519.253	–
1.159	25.038	92.742	–	–	–	–	–
26.880	41.513	27.623.201	–	6.490.883	835.898	3.061.468	–
159.824	704.427	338.600	–	174.759	1.356.933	79.211	140.426
76.331	282.463	364.719	12.584	12.763.480	1.573.919	197.171	60.708
–	–	–	–	–	14.993	–	–
–	–	300.295	–	–	–	–	2.403
–	–	750.000	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
1.633.927	5.688.279	43.785.349	497.095	34.985.127	3.783.443	3.857.103	203.537
62.442.487	292.063.806	716.954.643	23.348.578	12.306.565.258	1.412.714.937	194.333.411	32.858.701

Zum 30. Juni 2020 (Forts.)

		BNY Mellon Small Cap Euroland 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	
	Erläuterungen	EUR	EUR	EUR	USD	USD	
Aktiva (fällig innerhalb eines Jahres)							
	Finanzielle Vermögenswerte zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert	15	47.969.959	214.087.541	22.879.398	82.328.044	28.777.108
	Barmittel und Bargegenwerte	8	902.903	2.389.260	2.274.992	1.635.854	32.283
	Forderungen aus Erträgen		36.858	1.748.455	60.577	374.225	26.618
	Forderungen aus Wertpapierverkäufen		–	1.133.062	–	–	279.124
	Rückzahlungen von der Verwaltungsgesellschaft	6	–	13.173	1.736	–	–
	Einschusszahlungen auf Derivatekontrakte	8	270.946	1.203.741	75.514	889.684	–
	Vom Makler erhaltene Barsicherheiten		–	3.820.000	420.000	–	–
	Forderungen aus der Zeichnung von Anteilen		17.472	1.812.435	–	–	–
	Sonstige Forderungen		1.019	124	14.817	91	3
			49.199.157	226.207.791	25.727.034	85.227.898	29.115.136
Passiva (fällig innerhalb eines Jahres)							
	Finanzielle Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert	15	–	1.808.462	226.687	3.636.338	–
	Überziehungskredit	8	–	4.397	–	40.330	–
	Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		–	185.565	14.205	1.015.242	246.713
	Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		9.348	975	–	–	6.074
	Zahlbare Aufwendungen		83.426	94.446	20.976	94.660	49.366
	Zahlbare erfolgsabhängige Gebühren	3	–	–	–	–	–
	Einschusszahlungen auf Derivatekontrakte	8	–	–	–	–	–
	An den Makler zu zahlende Barsicherheiten		–	3.820.000	420.000	–	–
	Zahlbare Erträge aus Swaps		–	–	–	–	–
	Zahlbare Finanzierungskosten bei Swaps		–	–	–	–	–
	Zu leistende Steuern	9	–	–	–	–	–
	Sonstige Verbindlichkeiten		–	–	–	–	–
			92.774	5.913.845	681.868	4.786.570	302.153
Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibendes Nettovermögen			49.106.383	220.293.946	25.045.166	80.441.328	28.812.983

* Siehe Erläuterung 18 zum Halbjahresabschluss.

^ Der Gesamtbetrag für die Gesellschaft wurde zum 30. Juni 2020 berichtet und berücksichtigt Überkreuzinvestitionen durch den BNY Mellon Euroland Bond Fund und den BNY Mellon European Credit Fund.

Zum 30. Juni 2020 (Forts.)

BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund	Summe am 30. Juni 2020^
USD	USD	USD
264.857.035	498.888.789	14.312.469.240
5.018.605	213.675	548.603.213
436.664	5.125.078	78.877.581
2.354.858	505.827	49.349.815
–	–	110.845
–	–	87.770.725
–	–	93.709.940
–	–	45.334.630
1.478	46	5.028.578
272.668.640	504.733.415	15.221.254.567
57.341	1.998.832	142.874.023
–	–	12.061.202
2.098.511	–	212.912.188
–	3.009	56.048.051
210.425	275.240	12.792.908
–	–	67.434
–	–	30.057.131
–	–	93.709.940
–	–	513.710
–	–	43.517
–	–	2.360.662
–	–	1.766.974
2.366.277	2.277.081	565.207.740
270.302.363	502.456.334	14.656.046.827

Zum 31. Dezember 2019

		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	BNY Mellon Asian Equity Fund
Erläuterungen		EUR	GBP	EUR	USD	USD
Aktiva (fällig innerhalb eines Jahres)						
Finanzielle Vermögenswerte zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert	16	383.970.231	383.728.086	28.890.599	7.994.784	37.798.860
Barmittel und Bargegenwerte	9	13.884.036	324.193	640.948	286.710	457.887
Forderungen aus Erträgen		1.996.670	140.797	61.688	7.948	33.098
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		781.210	391.647	–	–	–
Rückzahlungen von der Verwaltungsgesellschaft	6	–	–	25.198	18.390	–
Einschusszahlungen auf Derivatekontrakte	9	16.169.915	3.668.992	22.000	–	–
Vom Makler erhaltene Barsicherheiten		2.760.000	5.220.000	–	–	–
Forderungen aus der Zeichnung von Anteilen		26.667	83.622	–	–	–
Sonstige Forderungen		5.464	154.908	–	10.388	68
		419.594.193	393.712.245	29.640.433	8.318.220	38.289.913
Passiva (fällig innerhalb eines Jahres)						
Finanzielle Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert	16	17.540.221	10.356.951	1.152.308	–	6
Überziehungskredit	9	1.005.340	5.016.328	–	–	1.413
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		–	151.156	2.232	–	–
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		24.635	770.380	–	–	24.001
Zahlbare Aufwendungen		333.003	419.395	38.090	34.657	90.754
Zahlbare erfolgsabhängige Gebühren	3	2	–	53.917	–	–
Einschusszahlungen auf Derivatekontrakte	9	588.760	–	3.685	–	–
An den Makler zu zahlende Barsicherheiten		2.760.000	5.220.000	–	–	–
Zahlbare Erträge aus Swaps		–	–	–	–	–
Zahlbare Finanzierungskosten bei Swaps		–	46.081	–	–	–
Zu leistende Steuern	10	–	–	–	–	–
Sonstige Verbindlichkeiten		–	228.615	–	–	–
		22.251.961	22.208.906	1.250.232	34.657	116.174
Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibendes Nettovermögen		397.342.232	371.503.339	28.390.201	8.283.563	38.173.739

* Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr aufgelegt.

Die beigefügten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Finanzsatusweises.

Zum 31. Dezember 2019 (Forts.)

BNY Mellon Asian Income Fund	BNY Mellon Brazil Equity Fund	BNY Mellon Digital Assets Fund*	BNY Mellon Dynamic Total Return Fund	BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund*	BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund	BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund
USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
30.178.638	105.778.054	11.058.915	24.826.343	168.591.430	697.115.602	348.695.132	50.624.111
760.875	4.101.600	50.806	2.092.643	13.457.014	6.260.423	3.808.264	1.472.332
118.499	727.561	7.263	–	100.553	11.284.397	4.275.174	785.109
–	285.615	–	–	–	–	3.546.146	–
6.556	–	18.331	461	9.246	70.647	–	–
–	–	–	529.281	163.796	2.309.638	457.259	138.765
–	–	–	–	–	–	–	–
–	555.670	5.721	–	37.211	–	326.778	–
616	18	–	262	–	–	24	22
31.065.184	111.448.518	11.141.036	27.448.990	182.359.250	717.040.707	361.108.777	53.020.339
43	867	21	257.564	514.632	15.359	711.772	123.996
–	–	–	2.502	–	–	–	–
–	–	–	–	129.857	291.629	–	–
–	308.231	–	–	–	–	8.495	18.110
33.603	205.701	28.826	28.639	82.173	241.951	267.853	76.755
–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	685.429	–	–	–	128.688
–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
–	5.339.693	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
33.646	5.854.492	28.847	974.134	726.662	548.939	988.120	347.549
31.031.538	105.594.026	11.112.189	26.474.856	181.632.588	716.491.768	360.120.657	52.672.790

Zum 31. Dezember 2019 (Forts.)

		BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund	BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund	BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund	BNY Mellon Euroland Bond Fund	BNY Mellon European Credit Fund
Erläuterungen		USD	USD	USD	EUR	EUR
Aktiva (fällig innerhalb eines Jahres)						
Finanzielle Vermögenswerte zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert	16	443.959.585	29.109.055	149.230.371	871.176.356	79.022.756
Barmittel und Bargegenwerte	9	16.381.090	152.453	1.345.983	18.536.860	2.217.013
Forderungen aus Erträgen		8.473.903	507.054	2.207.958	7.370.819	506.558
Forderungen aus Wertpapierverkäufen		–	–	–	599.594	–
Rückzahlungen von der Verwaltungsgesellschaft	6	–	–	18.418	–	–
Einschusszahlungen auf Derivatekontrakte	9	–	68.114	570.000	9.009.582	744.622
Vom Makler erhaltene Barsicherheiten		293.000	–	–	283.324	–
Forderungen aus der Zeichnung von Anteilen		33.085	–	132.460	1.108.643	760.000
Sonstige Forderungen		54.137	912	–	11.626	49
		469.194.800	29.837.588	153.505.190	908.096.804	83.250.998
Passiva (fällig innerhalb eines Jahres)						
Finanzielle Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert	16	3.540.846	202.096	1.735.918	3.081.513	251.022
Überziehungskredit	9	–	–	178	318	–
Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		92.718	–	–	976.658	–
Zahlbare Aufwendungen		701.544	17.947	133.675	891.465	24.283
Zahlbare erfolgsabhängige Gebühren	3	–	–	–	–	–
Einschusszahlungen auf Derivatekontrakte	9	–	32.294	–	12.638.233	541.628
An den Makler zu zahlende Barsicherheiten		293.000	–	–	283.324	–
Zahlbare Erträge aus Swaps		–	–	–	–	–
Zahlbare Finanzierungskosten bei Swaps		–	–	–	–	–
Zu leistende Steuern	10	–	–	–	–	–
Sonstige Verbindlichkeiten		–	–	–	–	–
		4.628.108	252.337	1.869.771	17.871.511	816.933
Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibendes Nettovermögen		464.566.692	29.585.251	151.635.419	890.225.293	82.434.065

Zum 31. Dezember 2019 (Forts.)

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	BNY Mellon Global Equity Income Fund	BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund
USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
578.137.443	462.913.372	498.887.444	32.577.234	363.872.149	1.805.477.501	117.878.418	89.115.405
5.485.281	853.294	9.633.208	564.175	8.234.030	36.345.553	2.650.809	1.721.568
3.441.224	3.391.054	3.317.518	35.979	383.831	3.332.711	1.753.038	234.260
–	–	–	–	–	–	1.127.373	–
–	13.141	–	38.435	–	–	–	10.793
750.000	8.831.218	1.264.671	–	–	–	–	–
–	460.000	–	–	–	–	–	–
47.221	–	18.354	–	1.793	673.776	–	26.300
–	116	50	47.574	12.931	8	–	–
587.861.169	476.462.195	513.121.245	33.263.397	372.504.734	1.845.829.549	123.409.638	91.108.326
1.824.238	12.431.955	3.304.526	–	136.180	4.284	248.982	2.433
137.947	–	2.144	–	102.889	1.721.346	155.006	–
–	–	–	–	42.624	–	1.348.405	–
240.422	–	13.077.784	–	–	21.959	941	6.314
500.663	118.300	446.790	69.773	410.229	1.946.919	107.988	46.503
–	–	–	–	–	–	–	–
–	667.407	15.217	–	–	–	–	–
–	460.000	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
2.703.270	13.677.662	16.846.461	69.773	691.922	3.694.508	1.861.322	55.250
585.157.899	462.784.533	496.274.784	33.193.624	371.812.812	1.842.135.041	121.548.316	91.053.076

Zum 31. Dezember 2019 (Forts.)

		BNY Mellon Global Leaders Fund	BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund	BNY Mellon Global Opportunistic Bond Fund**	BNY Mellon Global Opportunities Fund	BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	
	Erläuterungen	USD	EUR	USD	USD	EUR	
Aktiva (fällig innerhalb eines Jahres)							
	Finanzielle Vermögenswerte zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert	16	84.898.831	22.050.839	–	47.855.517	3.208.745.231
	Barmittel und Bargegenwerte	9	1.247.334	1.828.538	35.112	569.687	154.813.823
	Forderungen aus Erträgen		58.856	73.692	–	63.683	11.899.115
	Forderungen aus Wertpapierverkäufen		–	–	–	–	303.620
	Rückzahlungen von der Verwaltungsgesellschaft	6	113	8.254	–	–	–
	Einschusszahlungen auf Derivatekontrakte	9	–	–	–	–	85.917.172
	Vom Makler erhaltene Barsicherheiten		–	–	–	–	5.930.000
	Forderungen aus der Zeichnung von Anteilen		–	110	–	6.779	10.110.008
	Sonstige Forderungen		2.297	–	–	3	35.799
			86.207.431	23.961.433	35.112	48.495.669	3.477.754.768
Passiva (fällig innerhalb eines Jahres)							
	Finanzielle Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert	16	168	243.325	–	15.236	54.846.294
	Überziehungskredit	9	–	959	–	51.152	187.232
	Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		–	–	–	–	–
	Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		–	–	–	–	4.089.501
	Zahlbare Aufwendungen		88.889	25.755	35.112	102.065	2.950.159
	Zahlbare erfolgsabhängige Gebühren	3	–	–	–	–	–
	Einschusszahlungen auf Derivatekontrakte	9	–	–	–	–	–
	An den Makler zu zahlende Barsicherheiten		–	–	–	–	5.930.000
	Zahlbare Erträge aus Swaps		–	–	–	–	–
	Zahlbare Finanzierungskosten bei Swaps		–	–	–	–	–
	Zu leistende Steuern	10	–	–	–	–	–
	Sonstige Verbindlichkeiten		–	–	–	–	–
			89.057	270.039	35.112	168.453	68.003.186
Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibendes Nettovermögen			86.118.374	23.691.394	–	48.327.216	3.409.751.582

** Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr geschlossen.

Zum 31. Dezember 2019 (Forts.)

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 All Cap Equity Fund**	BNY Mellon Japan REIT Alpha Fund**	BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund
GBP	USD	USD	USD	JPY	JPY	JPY	EUR
66.965.643	285.805.646	723.241.103	23.975.559	–	–	14.990.273.900	1.440.623.118
3.316.861	31.035.695	171.687	1.252.942	1.057.940	895.061	553.405.286	44.656.316
291.896	734.621	11.261.949	51.432	–	–	8.247.550	813.877
5.880	29.872	–	–	–	–	–	–
–	–	19.330	5.430	–	–	947.129	–
1.258.225	9.105.251	2.325.786	–	–	–	–	–
1.170.000	–	–	–	–	–	–	–
88.851	3.446.065	145.200	–	–	–	416.545	1.654.275
621	311	3.547	212	–	–	293.883	120.885
73.097.977	330.157.461	737.168.602	25.285.575	1.057.940	895.061	15.553.584.293	1.487.868.471
863.370	7.346.227	3.527.822	102.650	–	–	641.256	45.196
10.147	114.631	187.935	111	–	1.548	–	–
–	–	7.428.470	–	–	–	–	–
20.100	–	88.541	–	–	–	2.041.571	475.631
67.622	310.311	468.674	9.775	1.057.940	893.513	16.190.256	1.682.733
–	–	–	–	–	–	–	310.146
–	–	299.280	–	–	–	–	–
1.170.000	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–
2.131.239	7.771.169	12.000.722	112.536	1.057.940	895.061	18.873.083	2.513.706
70.966.738	322.386.292	725.167.880	25.173.039	–	–	15.534.711.210	1.485.354.765

Zum 31. Dezember 2019 (Forts.)

		BNY Mellon Mobility Innovation Fund	BNY Mellon S&P 500® Index Tracker	BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund*	BNY Mellon Targeted Return Bond Fund	
	Erläuterungen	USD	USD	EUR	EUR	USD	
Aktiva (fällig innerhalb eines Jahres)							
	Finanzielle Vermögenswerte zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert	16	151.735.730	50.717.799	73.049.369	176.002.734	78.230.551
	Barmittel und Bargegenwerte	9	2.465.518	134.589	1.772.939	3.062.947	6.544.759
	Forderungen aus Erträgen		23.430	36.799	–	1.504.242	157.376
	Forderungen aus Wertpapierverkäufen		–	355.201	–	–	–
	Rückzahlungen von der Verwaltungsgesellschaft	6	45.517	–	–	31.444	–
	Einschusszahlungen auf Derivatekontrakte	9	–	–	222.482	826.605	236.051
	Vom Makler erhaltene Barsicherheiten		–	–	–	–	–
	Forderungen aus der Zeichnung von Anteilen		610.437	61.884	24.688	–	–
	Sonstige Forderungen		–	48	7.110	1.938	–
			154.880.632	51.306.320	75.076.588	181.429.910	85.168.737
Passiva (fällig innerhalb eines Jahres)							
	Finanzielle Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert	16	3.660	–	3.076	1.167.027	149.707
	Überziehungskredit	9	–	–	–	678	–
	Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen		–	–	–	–	–
	Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		5.243	433.563	108.011	–	–
	Zahlbare Aufwendungen		163.893	66.646	115.218	78.779	92.915
	Zahlbare erfolgsabhängige Gebühren	3	–	–	–	–	–
	Einschusszahlungen auf Derivatekontrakte	9	–	1.378	–	–	421.014
	An den Makler zu zahlende Barsicherheiten		–	–	–	–	–
	Zahlbare Erträge aus Swaps		–	–	–	–	–
	Zahlbare Finanzierungskosten bei Swaps		–	–	–	–	–
	Zu leistende Steuern	10	–	–	–	–	–
	Sonstige Verbindlichkeiten		–	–	–	–	–
			172.796	501.587	226.305	1.246.484	663.636
Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibendes Nettovermögen			154.707.836	50.804.733	74.850.283	180.183.426	84.505.101

* Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr aufgelegt.

** Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr geschlossen.

^ Der Gesamtbetrag für die Gesellschaft wurde zum 31. Dezember 2019 berichtet und berücksichtigt Überkreuzinvestitionen durch den BNY Mellon Euroland Bond Fund und den BNY Mellon European Credit Fund.

Zum 31. Dezember 2019 (Forts.)

BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund	BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund	BNY Mellon U.S. Opportunistic Alpha Fund**	BNY Mellon US Opportunities Fund**	Summe am 31. Dezember 2019^
USD	USD	USD	USD	USD	USD
28.821.073	402.302.323	432.614.522	–	–	16.109.642.131
97.121	20.773.359	2.379.890	2.789	6.261	463.560.470
21.577	522.989	3.984.807	–	–	89.159.763
133.219	–	1.580	–	–	7.894.990
–	16.041	9.813	6.870	4.251	393.294
–	–	–	–	–	159.930.310
–	–	–	–	–	19.282.587
–	–	–	–	–	21.710.815
420	6.620	7	–	–	554.436
29.073.410	423.621.332	438.990.619	9.659	10.512	16.872.128.796
–	–	116.353	–	–	139.048.685
–	–	–	930	1.033	10.477.210
162.813	4.179.346	–	–	–	13.785.869
–	–	–	–	–	21.757.200
45.048	317.132	268.496	8.729	9.479	15.277.140
–	–	–	–	–	408.372
–	–	–	–	–	17.699.111
–	–	–	–	–	19.282.587
–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	61.039
–	–	–	–	–	5.339.693
–	–	–	–	–	302.824
207.861	4.496.478	384.849	9.659	10.512	243.439.730
28.865.549	419.124.854	438.605.770	–	–	16.628.689.066

AUFSTELLUNG DER ÄNDERUNGEN DES NETTOVERMÖGENS, DAS INHABERN VON EINLÖSBAREN PARTIZIPIERENDEN ANTEILEN ZUZUSCHREIBEN IST

Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 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	BNY Mellon Asian Equity Fund
	EUR	GBP	EUR	USD	USD
Nettovermögen, das beteiligten zurückgebenden Anteilsinhabern am Beginn des Berichtszeitraums zugewiesen wird	397.342.232	371.503.339	28.390.201	8.283.563	38.173.739
Fiktiver Währungsausgleich (Erläuterung 1)	–	–	–	–	–
Wertsteigerung/(-minderung) des Inhabern von einlösaren partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus Transaktionen	(18.097.770)	12.199.170	336.909	(736.139)	1.858.312
Erlöse aus umlaufenden einlösaren partizipierenden Anteilen	11.977.422	9.860.571	821.211	89.929	8.453.031
Kosten der eingelösten einlösaren partizipierenden Anteile	(74.701.721)	(121.637.014)	(977.689)	(303.597)	(9.946.426)
Wertsteigerung/(-minderung) des Nettovermögens aus Anlagetransaktionen	(62.724.299)	(111.776.443)	(156.478)	(213.668)	(1.493.395)
Nettovermögen, das beteiligten zurückgebenden Anteilsinhabern am Ende des Berichtszeitraums zugewiesen wird	316.520.163	271.926.066	28.570.632	7.333.756	38.538.656

	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
	USD	USD	USD	EUR	EUR
Nettovermögen, das beteiligten zurückgebenden Anteilsinhabern am Beginn des Berichtszeitraums zugewiesen wird	464.566.692	29.585.251	151.635.419	890.225.293	82.434.065
Fiktiver Währungsausgleich (Erläuterung 1)	–	–	–	–	–
Wertsteigerung/(-minderung) des Inhabern von einlösaren partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus Transaktionen	(59.563.184)	(3.180.940)	(8.672.180)	(17.051.347)	(1.745.468)
Erlöse aus umlaufenden einlösaren partizipierenden Anteilen	14.016.977	5.460.165	68.641.321	68.498.451	1.403.499
Kosten der eingelösten einlösaren partizipierenden Anteile	(166.240.273)	(2.342.010)	(19.387.594)	(404.773.267)	(9.119.095)
Wertsteigerung/(-minderung) des Nettovermögens aus Anlagetransaktionen	(152.223.296)	3.118.155	49.253.727	(336.274.816)	(7.715.596)
Nettovermögen, das beteiligten zurückgebenden Anteilsinhabern am Ende des Berichtszeitraums zugewiesen wird	252.780.212	29.522.466	192.216.966	536.899.130	72.973.001

* Siehe Erläuterung 18 zum Halbjahresabschluss.

Die beigegefügtten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Finanzs ausweises.

BNY MELLON GLOBAL FUNDS, PLC

AUFSTELLUNG DER ÄNDERUNGEN DES NETTOVERMÖGENS,
DAS INHABERN VON EINLÖSBAREN PARTIZIPIERENDEN ANTEILEN ZUZUSCHREIBEN IST

Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020 (Forts.)

BNY Mellon Asian Income Fund*	BNY Mellon Brazil Equity Fund	BNY Mellon Digital Assets Fund	BNY Mellon Dynamic Total Return Fund	BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund*	BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund	BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund
USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
31.031.538	105.594.026	11.112.189	26.474.856	181.632.588	–	716.491.768	360.120.657	52.672.790
–	–	–	–	–	–	–	–	–
(5.927.305)	(35.900.966)	289.651	(1.784.307)	1.614.213	996.157	(106.632.506)	(23.771.421)	(2.484.381)
6.451.065	33.852.792	823.991	1.685.731	228.443.971	61.596.464	585.038.431	112.823.557	3.739.621
(2.035.800)	(42.562.750)	(1.241.941)	(2.262.964)	(5.634.365)	(214.086)	(298.116.344)	(140.672.784)	(24.468.069)
4.415.265	(8.709.958)	(417.950)	(577.233)	222.809.606	61.382.378	286.922.087	(27.849.227)	(20.728.448)
29.519.498	60.983.102	10.983.890	24.113.316	406.056.407	62.378.535	896.781.349	308.500.009	29.459.961
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	BNY Mellon Global Equity Income Fund	BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund	BNY Mellon Global Leaders Fund
USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
585.157.899	462.784.533	496.274.784	33.193.624	371.812.812	1.842.135.041	121.548.316	91.053.076	86.118.374
–	–	–	–	–	–	–	–	–
19.967.535	2.478.711	(3.446.767)	639.982	(18.755.184)	(272.339.072)	(8.137.879)	(8.353.565)	(1.180.243)
104.954.171	161.982.611	28.364.889	4.655.978	107.442.981	322.464.070	31.953.414	105.039.987	6.511.547
(110.639.313)	(15.285.977)	(151.377.386)	(8.051.672)	(98.477.159)	(690.670.447)	(33.857.318)	(40.534.426)	(27.911.778)
(5.685.142)	146.696.634	(123.012.497)	(3.395.694)	8.965.822	(368.206.377)	(1.903.904)	64.505.561	(21.400.231)
599.440.292	611.959.878	369.815.520	30.437.912	362.023.450	1.201.589.592	111.506.533	147.205.072	63.537.900

AUFSTELLUNG DER ÄNDERUNGEN DES NETTOVERMÖGENS,
DAS INHABERN VON EINLÖSBAREN PARTIZIPIERENDEN ANTEILEN ZUZUSCHREIBEN IST

Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 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)
	EUR	USD	EUR	GBP	USD
Nettovermögen, das beteiligten zurückgebenden Anteilsinhabern am Beginn des Berichtszeitraums zugewiesen wird	23.691.394	48.327.216	3.409.751.582	70.966.738	322.386.292
Fiktiver Währungsausgleich (Erläuterung 1)	–	–	–	–	–
Wertsteigerung/(-minderung) des Inhabern von einlösaren partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus Transaktionen	(3.250.197)	(5.185.679)	(130.939.289)	(3.499.386)	(8.442.554)
Erlöse aus umlaufenden einlösaren partizipierenden Anteilen	2.105.957	11.502.906	532.184.133	16.394.750	26.349.842
Kosten der eingelösten einlösaren partizipierenden Anteile	(1.941.692)	(20.924.832)	(1.040.720.178)	(21.419.615)	(48.229.774)
Wertsteigerung/(-minderung) des Nettovermögens aus Anlagetransaktionen	164.265	(9.421.926)	(508.536.045)	(5.024.865)	(21.879.932)
Nettovermögen, das beteiligten zurückgebenden Anteilsinhabern am Ende des Berichtszeitraums zugewiesen wird	20.605.462	33.719.611	2.770.276.248	62.442.487	292.063.806

	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	Summe am 30. Juni 2020^
	USD	USD	USD	USD	USD
Nettovermögen, das beteiligten zurückgebenden Anteilsinhabern am Beginn des Berichtszeitraums zugewiesen wird	84.505.101	28.865.549	419.124.854	438.605.770	16.628.689.066
Fiktiver Währungsausgleich (Erläuterung 1)	–	–	–	–	(47.165.727)
Wertsteigerung/(-minderung) des Inhabern von einlösaren partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus Transaktionen	(4.614.755)	(5.342.071)	(99.593.195)	7.780.185	(1.010.442.902)
Erlöse aus umlaufenden einlösaren partizipierenden Anteilen	550.982	7.501.639	33.372.255	116.246.731	3.772.967.971
Kosten der eingelösten einlösaren partizipierenden Anteile	–	(2.212.134)	(82.601.551)	(60.176.352)	(4.688.001.581)
Wertsteigerung/(-minderung) des Nettovermögens aus Anlagetransaktionen	550.982	5.289.505	(49.229.296)	56.070.379	(915.033.610)
Nettovermögen, das beteiligten zurückgebenden Anteilsinhabern am Ende des Berichtszeitraums zugewiesen wird	80.441.328	28.812.983	270.302.363	502.456.334	14.656.046.827

* Siehe Erläuterung 18 zum Halbjahresabschluss.

^ Der Gesamtbetrag für die Gesellschaft wurde zum 30. Juni 2020 berichtigt und berücksichtigt Überkreuzinvestitionen durch den BNY Mellon Euroland Bond Fund und den BNY Mellon European Credit Fund.

AUFSTELLUNG DER ÄNDERUNGEN DES NETTOVERMÖGENS,
DAS INHABERN VON EINLÖSBAREN PARTIZIPIERENDEN ANTEILEN ZUZUSCHREIBEN IST

Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020 (Forts.)

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	BNY Mellon Mobility Innovation Fund	BNY Mellon S&P 500® Index Tracker	BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund	BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)*
USD	USD	JPY	EUR	USD	USD	EUR	EUR	EUR
725.167.880	25.173.039	15.534.711.210	1.485.354.765	154.707.836	50.804.733	74.850.283	180.183.426	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–
(68.298.279)	(2.305.160)	(1.581.563.025)	(86.909.103)	11.058.784	(2.588.335)	(8.415.354)	(2.478.181)	(1.207.166)
242.512.864	480.699	2.115.250.086	372.942.537	68.882.862	3.005.974	2.588.346	73.388.850	29.971.215
(182.427.822)	–	(3.761.833.013)	(358.673.262)	(40.316.071)	(18.363.671)	(19.916.892)	(30.800.149)	(3.718.883)
60.085.042	480.699	(1.646.582.927)	14.269.275	28.566.791	(15.357.697)	(17.328.546)	42.588.701	26.252.332
716.954.643	23.348.578	12.306.565.258	1.412.714.937	194.333.411	32.858.701	49.106.383	220.293.946	25.045.166

AUFSTELLUNG DER ÄNDERUNGEN DES NETTOVERMÖGENS,
DAS INHABERN VON EINLÖSBAREN PARTIZIPIERENDEN ANTEILEN ZUZUSCHREIBEN IST

Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2019

	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	BNY Mellon Asian Equity Fund
	EUR	GBP	EUR	USD	USD
Nettovermögen, das beteiligten zurückgebenden Anteilsinhabern am Beginn des Berichtszeitraums zugewiesen wird	998.363.169	1.633.298.086	–	12.686.883	36.483.227
Fiktiver Währungsausgleich (Erläuterung 1)	–	–	–	–	–
Wertsteigerung/(-minderung) des Inhabern von einlösbaren partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus Transaktionen	(9.920.944)	(35.590.351)	85.650	560.434	4.131.710
Erlöse aus umlaufenden einlösbaren partizipierenden Anteilen	69.697.099	110.747.538	19.999.905	412.239	4.011.216
Kosten der eingelösten einlösbaren partizipierenden Anteile	(473.669.622)	(910.117.402)	–	(5.842.074)	(7.697.111)
Wertsteigerung/(-minderung) des Nettovermögens aus Anlagetransaktionen	(403.972.523)	(799.369.864)	19.999.905	(5.429.835)	(3.685.895)
Nettovermögen, das beteiligten zurückgebenden Anteilsinhabern am Ende des Berichtszeitraums zugewiesen wird	584.469.702	798.337.871	20.085.555	7.817.482	36.929.042
	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
	USD	EUR	EUR	USD	USD
Nettovermögen, das beteiligten zurückgebenden Anteilsinhabern am Beginn des Berichtszeitraums zugewiesen wird	127.332.704	962.053.446	42.163.584	497.707.995	404.522.874
Fiktiver Währungsausgleich (Erläuterung 1)	–	–	–	–	–
Wertsteigerung/(-minderung) des Inhabern von einlösbaren partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus Transaktionen	7.610.671	54.804.273	2.049.668	33.077.374	36.035.071
Erlöse aus umlaufenden einlösbaren partizipierenden Anteilen	4.835.506	79.709.609	949.536	179.418.970	12.170.199
Kosten der eingelösten einlösbaren partizipierenden Anteile	(11.839.994)	(121.672.106)	(8.985.559)	(96.498.346)	(11.583.152)
Wertsteigerung/(-minderung) des Nettovermögens aus Anlagetransaktionen	(7.004.488)	(41.962.497)	(8.036.023)	82.920.624	587.047
Nettovermögen, das beteiligten zurückgebenden Anteilsinhabern am Ende des Berichtszeitraums zugewiesen wird	127.938.887	974.895.222	36.177.229	613.705.993	441.144.992

* Dieser Fonds wurde im Berichtszeitraum aufgelegt.

** Dieser Fonds wurde im Berichtszeitraum geschlossen.

Die beigegeführten Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil des Finanzausweises.

AUFSTELLUNG DER ÄNDERUNGEN DES NETTOVERMÖGENS,
DAS INHABERN VON EINLÖSBAREN PARTIZIPIERENDEN ANTEILEN ZUZUSCHREIBEN IST

Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2019 (Forts.)

BNY Mellon Asian Income Fund	BNY Mellon Brazil Equity Fund	BNY Mellon Digital Assets Fund*	BNY Mellon Dynamic Total Return Fund	BNY Mellon Dynamic U.S. Equity 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
GBP	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
20.730.559	88.425.348	–	33.158.038	143.723.236	237.470.364	49.332.577	715.966.982	33.145.193
–	–	–	–	–	–	–	–	–
2.617.329	8.417.383	314.092	2.870.422	25.718.489	20.216.802	4.745.978	39.987.562	2.222.210
1.589.016	78.880.560	7.647.210	1.117.720	15.821.567	124.736.320	17.765.857	166.643.067	1.841.459
(1.850.582)	(74.725.616)	–	(11.705.813)	(57.973.667)	(54.458.208)	(33.574.264)	(325.416.073)	(1.810.197)
(261.566)	4.154.944	7.647.210	(10.588.093)	(42.152.100)	70.278.112	(15.808.407)	(158.773.006)	31.262
23.086.322	100.997.675	7.961.302	25.440.367	127.289.625	327.965.278	38.270.148	597.181.538	35.398.665

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	BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund	BNY Mellon Global Leaders Fund	BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund	BNY Mellon Global Opportunistic Bond Fund**
USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	EUR	USD
537.303.757	49.709.170	295.039.594	920.730.755	85.317.396	11.715.822	68.801.755	14.318.867	26.073.901
–	–	–	–	–	–	–	–	–
18.850.409	4.964.442	43.731.867	185.615.210	7.629.508	877.119	12.299.877	1.005.886	592.562
76.252.712	4.949.090	42.301.129	809.417.812	56.113.383	3.732.407	8.070.605	4.597.746	148.255
(156.079.692)	(26.026.991)	(38.021.479)	(338.476.897)	(20.851.177)	(757.381)	(5.179.171)	(87.746)	(26.814.718)
(79.826.980)	(21.077.901)	4.279.650	470.940.915	35.262.206	2.975.026	2.891.434	4.510.000	(26.666.463)
476.327.186	33.595.711	343.051.111	1.577.286.880	128.209.110	15.567.967	83.993.066	19.834.753	–

AUFSTELLUNG DER ÄNDERUNGEN DES NETTOVERMÖGENS,
DAS INHABERN VON EINLÖSBAREN PARTIZIPIERENDEN ANTEILEN ZUZUSCHREIBEN IST

Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2019 (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
	USD	EUR	GBP	USD	USD
Nettovermögen, das beteiligten zurückgebenden Anteilsinhabern am Beginn des Berichtszeitraums zugewiesen wird	45.295.654	2.900.593.648	59.435.370	317.882.822	641.584.834
Fiktiver Währungsausgleich (Erläuterung 1)	–	–	–	–	–
Wertsteigerung/(-minderung) des Inhabern von einlösaren partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus Transaktionen	6.945.006	219.742.815	4.218.413	26.306.571	13.043.987
Erlöse aus umlaufenden einlösaren partizipierenden Anteilen	5.814.478	711.131.790	11.329.746	29.701.244	218.703.161
Kosten der eingelösten einlösaren partizipierenden Anteile	(8.841.271)	(549.528.902)	(9.555.828)	(54.950.752)	(162.648.943)
Wertsteigerung/(-minderung) des Nettovermögens aus Anlagetransaktionen	(3.026.793)	161.602.888	1.773.918	(25.249.508)	56.054.218
Nettovermögen, das beteiligten zurückgebenden Anteilsinhabern am Ende des Berichtszeitraums zugewiesen wird	49.213.867	3.281.939.351	65.427.701	318.939.885	710.683.039

	BNY Mellon Targeted Return Bond Fund	BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund	BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	BNY Mellon U.S. High Yield Beta Fund	BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund
	USD	USD	USD	USD	USD
Nettovermögen, das beteiligten zurückgebenden Anteilsinhabern am Beginn des Berichtszeitraums zugewiesen wird	79.396.243	22.164.085	333.162.016	39.253.799	342.360.937
Fiktiver Währungsausgleich (Erläuterung 1)	–	–	–	–	–
Wertsteigerung/(-minderung) des Inhabern von einlösaren partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens aus Transaktionen	593.566	3.098.301	49.927.421	4.062.572	12.617.075
Erlöse aus umlaufenden einlösaren partizipierenden Anteilen	1.140.703	2.767.148	65.713.674	303.411.967	47.064.854
Kosten der eingelösten einlösaren partizipierenden Anteile	(84.041)	(4.448.803)	(55.909.839)	(19.874.075)	(63.903.998)
Wertsteigerung/(-minderung) des Nettovermögens aus Anlagetransaktionen	1.056.662	(1.681.655)	9.803.835	283.537.892	(16.839.144)
Nettovermögen, das beteiligten zurückgebenden Anteilsinhabern am Ende des Berichtszeitraums zugewiesen wird	81.046.471	23.580.731	392.893.272	326.854.263	338.138.868

* Dieser Fonds wurde im Berichtszeitraum aufgelegt.

** Dieser Fonds wurde im Berichtszeitraum geschlossen.

^ Der Gesamtbetrag für die Gesellschaft wurde zum 30. Juni 2019 berichtigt und berücksichtigt Überkreuzinvestitionen durch den BNY Mellon Euroland Bond Fund und den BNY Mellon European Credit Fund.

AUFSTELLUNG DER ÄNDERUNGEN DES NETTOVERMÖGENS,
DAS INHABERN VON EINLÖSBAREN PARTIZIPIERENDEN ANTEILEN ZUZUSCHREIBEN IST

Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2019 (Forts.)

BNY Mellon Global Unconstrained Fund	BNY Mellon Japan All Cap Equity Fund**	BNY Mellon Japan REIT Alpha 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 Sustainable Global Dynamic Bond Fund*
USD	JPY	JPY	JPY	EUR	USD	USD	EUR	EUR
19.675.797	997.259.890	1.504.017.944	17.781.724.574	1.319.111.050	31.986.385	71.877.432	77.665.450	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–
3.138.623	57.646.286	50.285.213	524.998.539	280.595.270	6.968.513	12.349.260	12.847.576	3.185.774
399.155	141.051	3.396	1.991.743.434	485.404.003	72.067.796	4.080.595	12.532.887	162.718.503
–	(1.055.047.227)	(1.554.306.553)	(6.064.254.390)	(170.095.722)	(9.470.587)	(12.198.991)	(37.047.688)	(3)
399.155	(1.054.906.176)	(1.554.303.157)	(4.072.510.956)	315.308.281	62.597.209	(8.118.396)	(24.514.801)	162.718.500
23.213.575	–	–	14.234.212.157	1.915.014.601	101.552.107	76.108.296	65.998.225	165.904.274
BNY Mellon U.S. Opportunistic Alpha Fund	BNY Mellon US Opportunities Fund	Summe am 30. Juni 2019^						
USD	USD	USD						
4.811.580	32.803.448	15.938.141.728						
–	–	(35.042.424)						
(59.545)	5.438.172	1.209.297.439						
–	2.922.934	4.287.033.099						
–	(30.641.912)	(4.531.420.053)						
–	(27.718.978)	(244.386.954)						
4.752.035	10.522.642	16.868.009.789						

BNY MELLON GLOBAL FUNDS, PLC

ERLÄUTERUNGEN ZUM HALBJAHRESABSCHLUSS

1. ZUSAMMENFASSUNG DER HAUPT BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE

Die Hauptbilanzierungsgrundsätze und Bewertungsmethoden zur Erstellung dieses Finanzausweises sind nachstehend dargelegt:

ENTSPRECHENSERKLÄRUNG

Der verkürzte Abschluss für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020 wurde gemäß dem Financial Reporting Standard („FRS“) 104: „Vorgaben für die Erstellung von Zwischenberichten (Interim Financial Reporting)“ und der irischen Gesetzgebung unter Einbeziehung der Richtlinien der Europäischen Gemeinschaften (über die Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren) von 2011 (in der jeweils gültigen Fassung) (die „OGAW-Richtlinien“) sowie der Zentralbank (Supervision and Enforcement) Act 2013 (Section 48(1)) (Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren) Vorschriften 2019 (die „Zentralbank OGAW-Vorschriften“) erstellt. Der verkürzte Abschluss sollte in Verbindung mit dem Jahresbericht und dem geprüften Jahresabschluss für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2019 gelesen werden, der gemäß FRS 102: „The Financial Reporting Standard applicable in the United Kingdom and the Republic of Ireland (Der im Vereinigten Königreich und der Republik Irland anzuwendende Finanzberichterstattungsstandard)“ („FRS 102“) sowie gemäß der irischen Gesetzgebung erstellt wurde.

ERSTELLUNGSGRUNDLAGE

Die Finanzausweise wurden auf Basis des Fortführungsprinzips der Gesellschaft gemäß der Anschaffungskostenregel 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 von 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 zu einem beizulegenden Zeitwert getätigt werden. Die Gesellschaft stellt eine Aufstellung über die Entwicklung des Inhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens bereit.

WESENTLICHE BILANZIELLE SCHÄTZUNGEN UND ERMESSENSENTSCHEIDUNGEN

Bei der Erstellung des Abschlusses muss auf bestimmte wichtige Bilanzierungsschätzungen zurückgegriffen werden. Ferner muss der Verwaltungsrat bei der Anwendung der Bilanzierungsgrundsätze der Gesellschaft seinen Ermessensspielraum nutzen. 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 Vermögenswerten und Verbindlichkeiten beinhalten, werden nachstehend unter „Finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten zum beizulegenden Zeitwert durch Gewinne oder Verluste – Bewertung des beizulegenden Zeitwerts“ erörtert. Die Annahmen und Schätzungen der Gesellschaft basieren auf Parametern, die zum Zeitpunkt der Erstellung des Jahresabschlusses zur Verfügung standen. Vorherrschende Umstände und Annahmen über künftige Entwicklungen können sich aufgrund von Marktbewegungen oder des Eintretens von Umständen ändern, die außerhalb der Kontrolle der Gesellschaft liegen. Diese Änderungen werden in den Annahmen wiedergegeben, wenn sie eintreten und prospektiv erkannt werden.

WECHSELKURSUMRECHNUNG – FUNKTIONALE UND DARSTELLUNGSWÄHRUNG

Die in den Abschlüssen der Gesellschaft enthaltenen Positionen sind in der Währung des Wirtschaftsraums ausgewiesen, in denen der jeweilige Fonds vorwiegend tätig ist (die „funktionale Währung“). Die funktionale Währung der einzelnen Fonds wurde vom Verwaltungsrat auf Grundlage der Währung neu bewertet, die getreu die wirtschaftlichen Auswirkungen der zugrunde liegenden Transaktionen, Ereignisse, des Kreises der Investoren und der Bedingungen darstellt. Die Finanzausweise der Gesellschaft werden 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.

1. ZUSAMMENFASSUNG DER HAUPT BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE Forts.

WECHSELKURSUMRECHNUNG – FUNKTIONALE UND DARSTELLUNGSWÄHRUNG Forts.

Vermögenswerte und Verbindlichkeiten in Fremdwährungen, einschließlich des Anteilinhabern von einlösbaren, partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens, werden zu dem am Ende des Berichtszeitraums 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 Anteilen 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 und Verbindlichkeiten“ ausgewiesen.

Zur Ermittlung von Gesamtsummen werden die gesamten Vermögenswerte und Verbindlichkeiten zusammen mit Erträgen und Kosten sämtlicher Anteilklassen unter Anwendung des Schlusskurses für Vermögenswerte und Verbindlichkeiten und dem durchschnittlichen Kurs für Erträge und Aufwendungen, einschließlich Zeichnungen und Rücknahmen, in US-Dollar umgerechnet, da dies die Währung des primären wirtschaftlichen Umfelds ist, in dem die Gesellschaft tätig ist. Ein Währungsausgleich wird erforderlich, wenn das Eröffnungsnettovermögen zu den am Ende des Berichtszeitraums geltenden Umrechnungskursen erneut umgerechnet wird, wie in der Aufstellung der Änderungen des den Inhabern von einlösbaren partizipierenden Anteilen zuzuschreibenden Nettovermögens angegeben. Diese Zuweisungsmethode wirkt sich nicht auf den Wert des Nettovermögens aus, das den einzelnen Fonds zugewiesen wird.

FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN ZUM ANGEMESSENEN GEWINN-/VERLUSTWERT – KLASSIFIZIERUNG

Diese Kategorie setzt sich aus zwei Unterkategorien zusammen: Finanzanlagen und -verbindlichkeiten, die zu Handelszwecken gehalten werden, und solche, die bei der Auflegung erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert ausgewiesen werden.

Finanzanlagen oder -verbindlichkeiten werden als zu Handelszwecken gehalten eingestuft, wenn sie gekauft oder eingegangen werden, um sie kurzfristig zu verkaufen oder zurückzukaufen, oder wenn sie bei der Erstabibilisierung Teil eines aus identifizierbaren, gemeinsam verwalteten Finanzinstrumenten bestehenden Portfolios sind, bei dem sich derzeit ein Vorgehensmuster abzeichnet, das auf kurzfristige Gewinnmitnahmen abzielt. Derivative werden ebenfalls als zu Handelszwecken gehalten eingestuft. Die Gesellschaft weist keine Derivate als Absicherung für Hedginggeschäfte aus.

Finanzanlagen und -verbindlichkeiten, die bei der Auflegung 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 Verkaufsprospekt genannten Anlagestrategie der Fonds bewertet wird.

FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN ZUM ANGEMESSENEN GEWINN-/VERLUSTWERT – ANSATZ 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. Finanzanlagen und -verbindlichkeiten zum beizulegenden Zeitwert in der Aufwands- und Ertragsrechnung werden anfänglich zum beizulegenden Zeitwert ausgewiesen. Die Transaktionskosten werden als Aufwendung in der Gesamtergebnisrechnung verbucht.

Finanzanlagen werden nicht mehr ausgewiesen, wenn der Anspruch auf Cashflow von der Anlage abgelaufen ist oder die Gesellschaft so gut wie alle Risiken und Erträge aus dem Besitz des Wertpapiers übertragen hat.

Danach werden alle Finanzanlagen und -verbindlichkeiten zum beizulegenden Zeitwert erfolgswirksam mit dem Zeitwert bewertet. Gewinne und Verluste aus Veränderungen des beizulegenden Zeitwerts der zum beizulegenden Zeitwert zu erfassenden Finanzanlagen oder -verbindlichkeiten werden in „Nettogewinne/(-verluste) aus Finanzanlagen oder

1. ZUSAMMENFASSUNG DER HAUPT BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE Forts.

FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN ZUM ANGEMESSENEN GEWINN-/VERLUSTWERT – ANSATZ UND BEWERTUNG Forts.

-verbindlichkeiten zum beizulegenden Zeitwert“ in der Gesamtergebnisrechnung im Berichtszeitraum ihres Entstehens anhand der Durchschnittskostenmethode verbucht.

Bei Devisenterminkontrakten auf der Ebene abgesicherter Anteilklassen werden realisierte und nicht realisierte Gewinne oder Verluste ausschließlich den entsprechenden Anteilklassen zugewiesen. Die nicht realisierten Gewinne oder Verluste aus Absicherungstätigkeiten werden in der Kategorie „Finanzvermögen oder Finanzverbindlichkeiten zum beizulegenden Zeitwert durch Gewinn oder Verlust“ in der Bilanz ausgewiesen.

FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN ZUM ANGEMESSENEN GEWINN-/VERLUSTWERT – BEWERTUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS

Der beizulegende Zeitwert von finanziellen Vermögenswerten und finanziellen Verbindlichkeiten, die an aktiven Märkten gehandelt werden (wie börsengehandelte Derivate und Wertpapiere), basiert auf den angegebenen Marktkursen am Enddatum des Berichtszeitraums. 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. Soweit 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 Berichtszeitraums 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 des 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 Marktpreise gelten können.

Der beizulegende Zeitwert von Finanzinstrumenten, die nicht an einem aktiven Markt gehandelt werden (beispielsweise im Freiverkehr gehandelte Derivate), wird mit Hilfe von Bewertungsmethoden ermittelt. Die Gesellschaft verwendet eine Vielzahl von Methoden und geht von Annahmen aus, die auf den zum jeweiligen Bilanzstichtag herrschenden Marktbedingungen basieren. Zu den eingesetzten Bewertungsmethoden gehören unter anderem die Verwendung vergleichbarer Transaktionen mit unabhängigen Parteien, die Bezugnahme auf im Wesentlichen identische Instrumente, die diskontierte Cashflow-Analyse, Optionspreis-Modelle und andere unter Marktteilnehmern übliche Bewertungsmethoden. Dies geschieht unter größtmöglicher Nutzung von Marktdaten und weitestgehendem Verzicht auf unternehmensspezifische Daten.

Der Buchwert abzüglich der Wertberichtigung sonstiger Forderungen und Verbindlichkeiten entspricht in etwa ihrem beizulegenden Zeitwert.

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 Geld- und Briefkurs der Hauptbörse des Marktes für die betreffende Anlage bewertet.
- (b) Sind die finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten an mehreren anerkannten Börsen notiert, so wird der Kurs der anerkannten Börse verwendet, die nach Meinung des Verwaltungsrats nach Rücksprache mit dem jeweiligen Investment Manager den Hauptmarkt für diese Vermögenswerte/Verbindlichkeiten darstellt.
- (c) Wenn für bestimmte Finanzanlagen oder Verbindlichkeiten der Mittelkurs gemäß (a) oder (b) oben nicht verfügbar sind oder nach Ansicht des Verwaltungsrats nach Rücksprache mit dem entsprechenden Investmentmanager, den fairen oder angemessenen Wert nicht reflektiert, ist der Wert unter Einsatz anderer Methoden mit angemessener Sorgfalt und in gutem Glauben vom Verwaltungsrat angemessen zu berechnen und von The Bank of New York Mellon SA/NV, Dublin Branch* (die „Depotbank“) zu diesem Zweck zu genehmigen, unter Rücksprache mit dem entsprechenden Investmentmanager, um den wahrscheinlichen Realisierungswert solcher Anlagen zu bestimmen.

1. ZUSAMMENFASSUNG DER HAUPT BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE Forts.

FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN ZUM ANGEMESSENEN GEWINN-/VERLUSTWERT – BEWERTUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

- (d) Für den Fall, dass Finanzanlagen oder -verbindlichkeiten existieren, die nicht an einer anerkannten Börse notiert oder gehandelt werden, müssen diese Anlagen vom Verwaltungsrat mit angemessener Sorgfalt und in gutem Glauben nach Rücksprache mit dem entsprechenden Investmentmanager bewertet und zum wahrscheinlichen Realisierungswert angesetzt werden. Dieser voraussichtliche Veräußerungswert kann anhand von Kursinformationen eines Maklers festgelegt werden.
- (e) Bargeld und andere liquide Mittel werden zu ihrem Nennwert bewertet, falls zutreffend zuzüglich aufgelaufener Zinsen.
- (f) Anteile an Organismen für gemeinsame Anlagen (außer solchen, die gemäß (a) oder (b) oben bewertet wurden) werden zum letzten verfügbaren ungeprüften Nettoinventarwert des entsprechenden Organismus für gemeinsame Anlagen 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 Fremdwährungsterminkontrakten wird von einer unabhängigen Quelle 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 und werden im Allgemeinen in Form von Barmitteln oder Barmitteläquivalenten geleistet. Der beizulegende Zeitwert von Futures wird auf der Basis ihres täglichen Abrechnungskurses bestimmt. Zudem werden sie täglich mittels der Bewertung durch den Kontrahenten kontrolliert. Änderungen im Wert offener Futures-Positionen werden als nicht realisierte Gewinne oder Verluste aus Futures ausgewiesen, bis die Kontrakte abgelaufen sind und die realisierten Gewinne und Verluste ausgewiesen werden. Nicht realisierte Gewinne oder Verluste aus Terminkontrakten sind in der Aufstellung der Wertpapierbestände aufgeführt. Nachschussforderungen/-verbindlichkeiten zum Bilanzstichtag werden als Forderung oder Verbindlichkeit in der Bilanz ausgewiesen.
- (j) Die Optionsprämie für ausgeübte gekaufte Verkaufsoptionen 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 Kaufoptionen 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 angesehen. Die Optionsprämie auf geschriebene Kaufoptionen, die ausgeübt wurden, wird zur Feststellung des realisierten Gewinns bzw. Verlusts zum Erlös aus dem Verkauf der zugrunde liegenden Wertpapiere bzw. Währungen hinzuaddiert. Die Optionsprämie auf verkaufte Verkaufsoptionen, 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) Zins-, Credit Default und Total Return Swaps 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 werden, werden abzüglich von Vorauszahlungen als realisierte Gewinne oder Verluste ausgewiesen. Erträge auf (im Freiverkehr gehandelte) OTC-Derivate fallen den Fonds zu und unterliegen keinen Vereinbarungen über die Aufteilung von Erträgen mit BNY Mellon Fund Management (Luxembourg) S.A.* (die „Managementgesellschaft“) oder anderen Parteien.
- (l) Der beizulegende Zeitwert von Commercial Paper, Einlagezertifikaten und Zeiteinlagen wird zu den abgeschriebenen Anschaffungskosten als beste Schätzung des beizulegenden Zeitwerts ermittelt. Die Gesellschaft darf in Finanzinstrumente anlegen, die nicht an einem aktiven Markt gehandelt werden, wobei der faire Wert anhand von Bewertungsmethoden, wie der diskontierten Cashflow-Analyse, und anderen von Marktteilnehmern verwendeten Bewertungsmethoden ermittelt werden kann.
- (m) Börsennotierte Fonds werden auf der Grundlage des von unabhängigen Kursquellen angegebenen Nettoinventarwerts je Anteil zum beizulegenden Zeitwert bewertet.
- (n) Einige Fonds können so genannte TBA-Kaufverpflichtungen (To Be Announced) eingehen. Hierbei verpflichten sie sich, Wertpapiere zu einem späteren Termin, der nach dem üblichen Abrechnungstermin liegt, zu einem festgelegten Stückpreis zu erwerben. Obwohl der Stückpreis vereinbart wurde, steht der Nennwert noch nicht fest. Die Fonds halten bis zum Abrechnungstermin Barmittel oder erstklassige Schuldtitel in ausreichender Menge, um den Kaufpreis bezahlen zu können; alternativ können die Fonds gegenläufige Kontrakte für den Terminverkauf anderer von ihnen gehaltener Sicherheiten abschließen. Die Einkünfte aus den Wertpapieren gehen erst nach dem Abrechnungstermin ein. TBA-Kaufverpflichtungen können als eigenständige Wertpapiere betrachtet werden und bergen ein Verlustrisiko,

* Siehe Erläuterung 19 zum Halbjahresabschluss.

1. ZUSAMMENFASSUNG DER HAUPT BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE Forts.

FINANZIELLE VERMÖGENSWERTE UND VERBINDLICHKEITEN ZUM ANGEMESSENEN GEWINN-/VERLUSTWERT – BEWERTUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

wenn der Wert des Wertpapiers, das erworben werden soll, vor dem Abrechnungstermin sinkt. 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) Aktienswaps 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 auf Aktienswaps fallen den Fonds zu und unterliegen keinen Vereinbarungen über die Aufteilung von Erträgen mit der Managementgesellschaft oder anderen Parteien.
- (p) Darlehen werden zum beizulegenden Zeitwert bewertet, der vom Marktmacher Markit bereitgestellt wird. Eingommene oder geleistete Gebühren sowie der Erhalt von Kapitalzahlungen werden unter „Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Nettogewinne/(-verluste) aus finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten“ in der Gesamtergebnisrechnung erfasst. In Fällen, in denen Markit kein Wert für ein Darlehen zur Verfügung steht, 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 Marktmacher zur Verfügung steht.
- (q) Einige Fonds können Genussscheine 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, Bangladesh, 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 meist 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, welche 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 der Fonds berechtigt, Kapitalzahlungen, Zinsen und Gebühren zu empfangen, 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 Forderungen aus Erträgen, Forderungen aus veräußerten Anlagen, Rückzahlungen von der Verwaltungsgesellschaft, Margins auf Derivatkontrakte, vom Makler erhaltene Barsicherheiten, Forderungen aus Zeichnungen und sonstige Forderungen. Diese Beträge werden zu Beginn zum Zeitwert erfasst und dann 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 zu Beginn zum Zeitwert erfasst und dann zu fortgeführten Anschaffungskosten bewertet.

1. ZUSAMMENFASSUNG DER HAUPT BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE Forts.

VERRECHNUNG VON FINANZINSTRUMENTEN

Es erfolgt eine Aufrechnung 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 30. Juni 2020 und zum 31. Dezember 2019 legten der BNY Mellon Euroland Bond Fund und der BNY Mellon European Credit Fund in andere Fonds der Gesellschaft an. Die Überkreuzinvestitionen wurden aus dem Abschluss der Gesellschaft herausgenommen. Investiert ein Fonds in einen oder mehrere andere Fonds der Gesellschaft, werden diese Überkreuzinvestitionen bei der Berechnung der zu leistenden Verwaltungsgebühren vom Gesamtnettointinventarwert abgezogen. Die realisierten und nicht realisierten Gewinne und Verluste, einschließlich der Veränderungen bei realisierten und 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 den aufgelaufenen Zinsen zum Bewertungszeitpunkt an dem relevanten Bewertungstag angesetzt. Bargegenwerte umfassen Einlagen, die als sofort verfügbar bei Banken gehalten werden, 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 erhaltene Sicherheiten werden in der Bilanz als „Margin auf Derivatkontrakte“ erfasst und sind nicht als Bestandteil von Barmitteln und Bargegenwerten enthalten. Von den Fonds erhaltene zahlungswirksame Sicherheitsleistungen werden in der Bilanz als „vom Makler erhaltene zahlungswirksame Sicherheitsleistungen“ erfasst. Die Verpflichtung zur Rückzahlung zahlungswirksamer Sicherheitsleistungen wird in der Bilanz als „an den Makler zu zahlende zahlungswirksame Sicherheitsleistungen“ erfasst. Erhaltene zahlungswirksame Sicherheitsleistungen sind nicht Bestandteil der Barmittel und Bargegenwerte der Fonds. Im Falle von Sicherheiten (außer Barmittel), wenn die Partei, der die Sicherheit übergeben wird, vertraglich oder Eigentümlich das Recht hat, die Sicherheiten 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 offengelegt, wenn ein „*“ angegeben ist.

TRANSAKTIONSKOSTEN

Transaktionskosten sind Kosten, die für den Erwerb von Finanzanlagen oder -verbindlichkeiten durch Gewinn oder Verlust zum beizulegenden Zeitwert entstehen. Sie umfassen die an Bevollmächtigte, Berater, Broker und Händler bezahlten Gebühren und Provisionen. Im Hinblick auf Aktien und derivativen Finanzinstrumente werden entstandene Transaktionskosten in der Gesamtergebnisrechnung sofort als ein Aufwand ausgewiesen und sind unter „Nettogewinne/-verluste aus finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten zum beizulegenden Zeitwert durch Gewinn oder Verlust“ enthalten. Hinsichtlich aller Wertpapiere ist die Spanne zwischen Geld- und Briefkurs im Kauf- und Verkaufspreis der Wertpapiere enthalten und können nicht getrennt geprüft und offengelegt werden.

DIVIDENDENERTRÄGE

Dividenden aus finanziellen Vermögenswerten zum beizulegenden Zeitwert durch Gewinne oder Verluste werden in der Gesamtergebnisrechnung als „Dividendenertrag“ ausgewiesen, sofern das Recht des Fonds auf den Erhalt dieser Zahlungen begründet ist. Dividendeneinkommen 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 gelegentlichen Fortschreibung und/oder abschließenden Veräußerung der zugrunde liegenden Swap-Instrumente Änderungen unterliegen.

1. ZUSAMMENFASSUNG DER HAUPT BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE Forts.

ZINSERTRÄGE

Zinserträge für zinstragende Finanzinstrumente werden als Teil der „Nettogewinne/-verluste aus finanziellen Vermögenswerten/Verbindlichkeiten zum angemessenen Gewinn-/Verlustwert“ ausgewiesen. Erträge aus Bankzinsen werden nach dem Prinzip der Bareingänge ausgewiesen.

BESTEuerung

Gemäß den geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Praktiken besteht kein von den Fonds zu leistende Einkommen, Gewinne oder Steuern. Der Fonds haben derzeit Quellensteuern zu tragen, die ihnen von bestimmten Ländern für ihr Einkommen aus Kapitalgewinnen entstehen. Quellensteuern werden in der Gesamtergebnisrechnung ohne Steuergutschriften ausgewiesen.

Bestimmte Fonds grenzen die Kapitalertragssteuer auf die realisierten und nicht realisierten Nettoanlageerträge periodengerecht ab. Die Kapitalertragssteuer wird in Übereinstimmung mit der Vereinbarung über die Änderung der Steuervorschriften und Steuersätze für irische Anleger ausgewiesen. Die Kapitalertragssteuer und die am Ende des Berichtszeitraums fälligen Beträge sind in den Posten „Quellensteuern auf Dividenden und andere Anlageerträge“ und „fällige Steuern“ in der Gesamtergebnisrechnung bzw. in der Bilanz aufgeführt.

AUFWENDUNGEN

Aufwendungen werden gemäß dem Prinzip der Periodenabgrenzung erfasst. Kosten in Verbindung mit der Auflösung eines Fonds werden von der Managementgesellschaft gezahlt.

WERTPAPIERLEIHE

Die Gesellschaft hat mit der The Bank of New York Mellon, Niederlassung London, und der Depotbank 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 verliehenen Wertpapiere Wertpapiere, Finanzinstrumente oder sonstige Vermögenswerte. Die Gesellschaft akzeptiert Barmittel als Sicherheit und darf Barsicherheiten nicht erneut investieren. Gehaltene (und ausstehende) Sicherheiten entsprechen mindestens 102 % des Werts der verliehenen Wertpapiere. Erträge aus Wertpapierleihe werden nach dem Prinzip der Bareingänge ausgewiesen. Einzelheiten zu der Wertpapierleihposition am Ende des Berichtszeitraums sind in Erläuterung 14 zum Abschluss enthalten.

AUSSCHÜTTUNGEN AN INHABER EINLÖSBARER PARTIZIPIERENDER ANTEILE

Ausschüttungen an Anteilsinhaber einlösbarer partizipierender Anteile werden in der Gesamtergebnisrechnung als Finanzkosten ausgewiesen, wenn sie gemäß den Bestimmungen der Euronext Dublin erklärt werden.

Bei den nicht ausschüttenden Anteilsklassen werden die gesamten eingenommenen Erträge und die realisierten Nettokapitalgewinne nach Abzug von Kosten thesauriert und spiegeln sich im Nettoinventarwert je Anteil wider.

EINLÖSBARE PARTIZIPIERENDE ANTEILE

Die Gesellschaft gibt in jedem Teilfonds mehrere Klassen einlösbare partizipierende Anteile aus, die nach Wahl des Inhabers einlösbar sind und nicht mit identischen Rechten verbunden sind. Solche Anteile werden als Finanzverbindlichkeiten eingestuft.

Einlösbare partizipierende Anteile können jederzeit gegen einen Barbetrag an den Fonds zurückgegeben werden, der dem der Anteilklasse zuzuweisenden proportionalen Anteil am Nettoinventarwert des Fonds entspricht. Die einlösbaren, partizipierenden Anteile werden zu dem Rücknahmebetrag ausgewiesen, der zum Ende des Berichtszeitraums 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 Verkaufsprospekt zur

1. ZUSAMMENFASSUNG DER HAUPT BILANZIERUNGSGRUNDSÄTZE Forts.

EINLÖSBARE PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

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 Verwässerungsauswirkungen einzudämmen, kann der Verwaltungsrat nach seinem Ermessen einen Verwässerungsausgleich für den Nettoinventarwert pro Anteil vornehmen. Der Verwaltungsrat behält die Ermessensbefugnis je nach den Umständen, unter denen ein solcher Verwässerungsausgleich vorzunehmen ist.

Die Entscheidung, einen Verwässerungsausgleich vorzunehmen, hängt von der Zahl der Anteilszeichnungen oder -rücknahmen im Fonds ab. Der Verwaltungsrat kann nach seinem Ermessen einen Verwässerungsausgleich vornehmen, falls seiner Auffassung nach die vorhandenen Anteilseigner im Falle von Anteilszeichnungen oder die verbleibenden Anteilseigner im Falle von Anteilsrücknahmen ansonsten beeinträchtigt werden könnten. Insbesondere kann unter den folgenden Umständen ein Verwässerungsausgleich erfolgen:

- wenn ein Fonds von einem beständigen Rückgang betroffen ist (u.a. wenn bei diesem Fonds ein Nettoabfluss von Rücknahmen zu verzeichnen ist);
- falls der Fonds im Verhältnis zu seiner Größe hohe Nettozeichnungen oder Nettorücknahmen verzeichnet; und
- unter allen anderen Umständen, unter denen der Verwaltungsrat der Auffassung ist, es sei im Interesse der Anteilseigner, einen Verwässerungsausgleich vorzunehmen.

Der Verwässerungsausgleich umfasst einen Aufschlag auf den Nettoinventarwert pro Anteil, wenn der Fonds in einer Nettozeichnungsposition ist, und einen Abschlag vom Nettoinventarwert pro Anteil, wenn der Fonds in einer Nettorücknahmeposition ist, insofern ein solcher Wert nach Auffassung des Verwaltungsrats einen angemessenen Wert darstellt, um Transaktionskosten zu decken, einschließlich, jedoch nicht beschränkt auf Marktspannen, Maklergebühren und Steuern, um den Wert der zugrundeliegenden Vermögenswerte des betreffenden Fonds abzusichern sowie unter allen anderen Umständen, insofern der Verwaltungsrat der Auffassung ist, dass dies im Interesse der Anteilseigner sei. Der sich daraus ergebende Betrag entspricht dem auf die Anzahl an Dezimalstellen gerundeten Preis, welche der Verwaltungsrat für angemessen hält.

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. Eine solche Verwässerungsberichtigung beträgt höchstens 2% des Nettoinventarwerts des Fonds. Da eine Verwässerung direkt mit den Zu- und Abflüssen bei einem Fond zusammenhängt, ist es nicht möglich, exakt vorherzusagen, ob eine Verwässerung zu einem beliebigen späteren Zeitpunkt eintreten wird. Folglich ist es auch nicht möglich, exakt vorherzusagen, wie oft ein Verwässerungsausgleich stattfinden wird.

2. GEZEICHNETES KAPITAL

GENEHMIGTES KAPITAL

Bei der Gründung betrug das genehmigte Anteilskapital der Gesellschaft 38.092 EUR, eingeteilt in 38.092 Zeichneranteile zu je 1,00 EUR und 25.000.000.000 Anteile ohne Nennwert, die anfangs als unklassifizierte Anteile ausgewiesen wurden. Die unklassifizierten Anteile stehen für die Ausgabe als partizipierende Anteile zur Verfügung.

ZEICHNERANTEILE

Zum 31. Mai 2019 wurden die 38.092 Zeichneranteile zu je 1,00 EUR, alle als vollständig eingezahlt ausgegeben, die vorher von BNY Mellon Global Management Limited und deren Nominees gehalten wurden, an den Manager übertragen. Die Zeichneranteile berechtigen die Inhaber zu keinerlei Ausschüttungen, sie berechtigen den Inhaber bei Liquidierung zum Empfang des einbezahlten Betrags, jedoch nicht zur anderweitigen Beteiligung am Gesellschaftsvermögen. Die Zeichneranteile sind nicht Teil des Nettoinventarwertes der Gesellschaft und werden somit in den Abschlüssen

2. GEZEICHNETES KAPITAL Forts.

ZEICHNERANTEILE Forts.

nur in dieser Anmerkung ausgewiesen. Nach Meinung des Verwaltungsrats geben diese Ausführungen die Art des Anlagegeschäfts der Gesellschaft wieder.

EINLÖSBARE PARTIZIPIERENDE ANTEILE

Einlösbare partizipierende Anteile verleihen den Anspruch auf einen anteilmäßigen Anteil an den Vermögenswerten des Fonds und berechtigen den Anteilinhaber zu einer Stimme je Anteil und Abstimmung. Partizipierende Anteile werden vom Anteilinhaber zu Preisen eingelöst, die auf dem Nettoinventarwert der entsprechenden Vermögensklasse basieren.

Die Aktivitäten bei einlösbaren partizipierenden Anteilen für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020 waren wie folgt:

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Umlaufende Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	Im Berichtszeitraum ausgegebene Anteile	Im Berichtszeitraum zurückgenommene Anteile	Umlaufende Anteile am Ende des Berichtszeitraums
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund						
	C-Klasse	EUR	3.649	–	–	3.649
	C-Klasse (Inc)	EUR	2.085	1.150	(2.000)	1.235
	D-Klasse (Acc)^	EUR	50	–	(50)	–
	R-Klasse	EUR	83.841	2.678	(16.327)	70.192
	R-Klasse (Hedged)	USD	53.073	30	(17.554)	35.549
	R-Klasse (Inc)	EUR	16.160	96	(5.525)	10.731
	S-Klasse	EUR	471.511	11.834	(404.574)	78.771
	S-Klasse (Inc)^	EUR	53	–	(53)	–
	T-Klasse (Hedged)	CHF	343	–	–	343
	T-Klasse (Hedged)	USD	71.235	17.310	(7.767)	80.778
	Sterling T (Acc) (Hedged)	GBP	77.650	9.287	(512)	86.425
	W-Klasse (Acc)	EUR	2.527	–	(1.289)	1.238
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	USD	33.918	502	(8.641)	25.779
	W-Klasse (Inc) (Hedged)^	USD	1.036	6	(1.042)	–
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	933.165	59.125	(63.155)	929.135
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	1.951	–	–	1.951
	X-Klasse	EUR	1.708.506	–	(202.232)	1.506.274
	X-Klasse (Acc) (Hedged)^	USD	1.000	–	(1.000)	–
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	86.677	–	–	86.677
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund						
	D-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	212.885	–	–	212.885
	R-Klasse (Hedged)	CHF	50.805	–	(33.779)	17.026
	R-Klasse (Hedged)	EUR	83.599.873	1.919.959	(23.605.892)	61.913.940
	R-Klasse (Hedged)	USD	6.922.055	197.278	(865.594)	6.253.739
	R-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	4.941.271	–	(980.333)	3.960.938
	Sterling R (Acc)	GBP	736.190	160.036	(138.750)	757.476
	Sterling S (Acc)	GBP	325.042	147.123	(30.008)	442.157
	T-Klasse (Hedged)	EUR	61.142.372	5.646.061	(24.490.238)	42.298.195
	T-Klasse (Hedged)	USD	7.632.464	–	(7.043.602)	588.862
	U-Klasse (Hedged)	EUR	87.518.455	1.874.324	(16.734.177)	72.658.602
	U-Klasse (Hedged)	USD	3.149.480	30.282	(1.020.927)	2.158.835
	U-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	105.616	–	(105.597)	19
	Sterling U (Acc)	GBP	6.185.440	220.087	(1.632.204)	4.773.323
	Sterling X (Acc)	GBP	108.311.163	–	(40.641.719)	67.669.444

2. GEZEICHNETES KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Umlaufende Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	Im Berichtszeitraum ausgegebene Anteile	Im Berichtszeitraum zurückgenommene Anteile	Umlaufende Anteile am Ende des Berichtszeitraums
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund						
	F-Klasse (Acc) (Hedged)	USD	3.272.563	107.240	(839.010)	2.540.793
	Sterling F (Acc) (Hedged)	GBP	100.000	–	–	100.000
	U-Klasse (Acc)	EUR	19.881.737	–	(86.600)	19.795.137
	U-Klasse (Acc) (Hedged)^	USD	–	794.568	–	794.568
	Sterling U (Acc) (Hedged)^	GBP	100.000	–	(100.000)	–
	X-Klasse (Acc)	EUR	4.936.321	–	–	4.936.321
BNY Mellon Asia Rising Stars Fund						
	A-Klasse (Acc)	USD	30.994	–	–	30.994
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	SGD	1.620.654	10.728	(73.815)	1.557.567
	W-Klasse (Acc)	USD	5.000.000	–	–	5.000.000
	X-Klasse (Acc)	USD	239.058	12.942	(226.615)	25.385
BNY Mellon Asian Equity Fund						
	A-Klasse	USD	4.679.916	1.605.181	(2.356.359)	3.928.738
	A-Klasse	EUR	2.457.055	755.486	(349.694)	2.862.847
	B-Klasse	USD	2.629.078	59.519	(63.445)	2.625.152
	B-Klasse	EUR	22.291	19.176	–	41.467
	C-Klasse	USD	249.935	28.220	(66.323)	211.832
	C-Klasse	EUR	315.694	63.957	(69.999)	309.652
	Sterling C (Inc)	GBP	8.315	–	–	8.315
	W-Klasse	USD	504.566	–	–	504.566
BNY Mellon Asian Income Fund						
	A-Klasse (Acc)	EUR	43.352	–	(23.671)	19.681
	A-Klasse (Inc)	EUR	40.398	14.560	–	54.958
	B-Klasse (Acc)	USD	107.267	400.752	(82.302)	425.717
	C-Klasse (Acc)	USD	4.589	–	–	4.589
	W-Klasse (Inc)	EUR	20.879.700	2.596.784	(1.596.698)	21.879.786
	W-Klasse (Inc)	USD	729.476	2.874.401	(51.037)	3.552.840
	Sterling W (Inc)	GBP	197.066	–	(17.500)	179.566
BNY Mellon Brazil Equity Fund						
	A-Klasse	USD	14.615.128	1.164.012	(3.888.591)	11.890.549
	A-Klasse	EUR	17.472.768	4.430.035	(8.270.664)	13.632.139
	B-Klasse	USD	1.503.886	1.270.310	(68.080)	2.706.116
	B-Klasse	EUR	80.698	24.700	–	105.398
	Sterling B (Acc)	GBP	270.930	615	(43.228)	228.317
	C-Klasse	USD	9.502.741	10.190.502	(10.846.400)	8.846.843
	C-Klasse	EUR	6.598.761	385.437	(1.159.557)	5.824.641
	Sterling C (Inc)	GBP	50.261	16.026	(5.437)	60.850
	G-Klasse (Acc)^	USD	4.566	780.000	(784.566)	–
	G-Klasse (Acc)	EUR	17.311	1.656.989	(12.806)	1.661.494
	G-Klasse (Acc) (Hedged)^	EUR	187.036	85.099	(272.135)	–
	H-Klasse (Hedged)	EUR	2.735.579	938.198	(1.567.715)	2.106.062
	I-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	4.166.415	321.477	(171.138)	4.316.754
	W-Klasse (Acc)	USD	4.219.930	633.575	(1.458.526)	3.394.979
	W-Klasse (Acc)	EUR	2.214.629	1.385.268	(3.130.214)	469.683
	Sterling W (Acc)	GBP	2.914.804	2.274.860	(2.032.205)	3.157.459

2. GEZEICHNETES KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Umlaufende Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	Im Berichtszeitraum ausgegebene Anteile	Im Berichtszeitraum zurückgenommene Anteile	Umlaufende Anteile am Ende des Berichtszeitraums
BNY Mellon Digital Assets Fund						
	A-Klasse (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	E-Klasse (Acc)	USD	196.450	–	–	196.450
	E-Klasse (Acc)	EUR	616.338	–	(88.396)	527.942
	E-Klasse (Inc)^	USD	588.955	–	(588.955)	–
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	431.066	107.620	(106.000)	432.686
	K-Klasse (Acc)	USD	1.200.119	–	(138.520)	1.061.599
	K-Klasse (Acc)	EUR	1.664.235	498.942	(219.366)	1.943.811
	W-Klasse (Acc)	USD	4.978.700	–	–	4.978.700
BNY Mellon Dynamic Total Return Fund						
	A-Klasse (Acc)	USD	11.806	–	–	11.806
	C-Klasse (Acc)	USD	11.922.329	520.824	(2.184.246)	10.258.907
	E-Klasse (Acc)	USD	12.546.652	741.840	–	13.288.492
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	114.342	40.222	(5.946)	148.618
	W-Klasse (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	X-Klasse (Acc)	USD	50.205	–	–	50.205
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund						
	A-Klasse (Acc)	EUR	5.000	16.513.651	(108.984)	16.409.667
	A-Klasse (Inc)	USD	5.127	61	(142)	5.046
	C-Klasse (Acc)	USD	49.811.680	19.131.486	(344.790)	68.598.376
	E-Klasse (Acc)	USD	10.306.250	3.518.750	–	13.825.000
	G-Klasse (Acc)	USD	5.000	1.230.085	(78.529)	1.156.556
	G-Klasse (Acc)	EUR	5.000	1.959.488	(99.152)	1.865.336
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	100.000	–	–	100.000
	W-Klasse (Acc)	USD	276.778	22.153.554	(594.818)	21.835.514
	W-Klasse (Acc)	EUR	5.000	35.454.965	(841.930)	34.618.035
	Sterling W (Acc)^	GBP	5.000	–	(5.000)	–
	W-Klasse (Inc)^	EUR	–	81.214.559	(3.016.224)	78.198.335
	X-Klasse (Acc)	USD	76.219.552	13.953.488	(55.481)	90.117.559
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund*						
	A-Klasse (Acc)^	USD	–	5.000	–	5.000
	Sterling L (Acc) (Hedged)^	GBP	–	49.611.221	(168.429)	49.442.792
	W-Klasse (Acc)^	USD	–	5.000	–	5.000
	W-Klasse (Acc) (Hedged)^	EUR	–	100.000	–	100.000
	Sterling W (Acc) (Hedged)^	GBP	–	100.000	–	100.000
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund						
	A-Klasse (Inc)	USD	34.017	90.000	–	124.017
	A-Klasse (Inc)	EUR	13.788	436.875	(28.784)	421.879
	C-Klasse (Acc)	USD	5.000	136.000	–	141.000
	C-Klasse (Inc)^	USD	–	5.000	–	5.000
	E-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	41.805.204	15.902.140	(15.935.637)	41.771.707
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	383.049.420	47.452.778	(174.057.843)	256.444.355
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	22.617.767	1.909.330	(20.262.008)	4.265.089
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	1.932.893	12.067.974	(13.961.336)	39.531
	K-Klasse (Acc)	USD	47.587	265.846	–	313.433
	K-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	100.000	–	–	100.000

2. GEZEICHNETES KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Umlaufende Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	Im Berichtszeitraum ausgegebene Anteile	Im Berichtszeitraum zurückgenommene Anteile	Umlaufende Anteile am Ende des Berichtszeitraums
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Forts.						
	L-Klasse (Acc)	USD	5.000	36.959.367	–	36.964.367
	L-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	100.000	32.791.874	–	32.891.874
	Sterling L (Acc) (Hedged)	GBP	100.000	–	–	100.000
	Sterling L (Inc) (Hedged)	GBP	38.762.752	2.843.532	(23.821.276)	17.785.008
	W-Klasse (Acc)	USD	13.893.024	50.081.122	(16.765)	63.957.381
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	101.072	–	–	101.072
	W-Klasse (Inc)^	USD	–	5.000	–	5.000
	W-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	113.300	1.762.439	(3.806)	1.871.933
	Sterling W (Inc) (Hedged)^	GBP	–	100.000	–	100.000
	X-Klasse (Acc)	USD	10.052.088	–	(4.964.750)	5.087.338
	Sterling X (Acc) (Hedged)^	GBP	–	29.047.121	–	29.047.121
	X-Klasse (Inc)^	USD	–	299.008.761	–	299.008.761
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund						
	A-Klasse	USD	22.690	9.909	(8.947)	23.652
	A-Klasse	EUR	74.406	44.563	(33.510)	85.459
	A-Klasse (Inc)^	USD	–	50	–	50
	A-Klasse (Inc) (M)^	HKD	–	50	–	50
	B-Klasse	USD	5.310	298	(2.901)	2.707
	C-Klasse	USD	452.623	46.069	(233.271)	265.421
	C-Klasse	EUR	64.171	7.678	(64.338)	7.511
	G-Klasse (Inc)	USD	17.748	1.772	(2.715)	16.805
	H-Klasse (Hedged)	EUR	118.970	216.923	(201.637)	134.256
	I-Klasse (Hedged)	EUR	111.075	114.879	(113.322)	112.632
	W-Klasse	USD	274.155	56.760	(140.088)	190.827
	W-Klasse	EUR	27.862	25.925	(26.436)	27.351
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	CHF	109.822	26.240	(10.716)	125.346
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	35.047	195.338	(49.215)	181.170
	W-Klasse (Inc) (Hedged)	CHF	66.660	–	(8.500)	58.160
	W-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	102.100	–	–	102.100
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	28.576	14.806	(16.593)	26.789
	Sterling W (Inc) (Hedged)^	GBP	1.000	22	(1.022)	–
	X-Klasse	USD	583.150	9.495	(53.609)	539.036
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	173.939	–	–	173.939
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund						
	A-Klasse	USD	1.077.184	71.933	(471.759)	677.358
	A-Klasse	EUR	5.067.485	1.004.797	(1.306.682)	4.765.600
	C-Klasse	USD	7.249.256	140.823	(5.975.688)	1.414.391
	C-Klasse	EUR	3.514.568	31.343	(342.010)	3.203.901
	C-Klasse (Inc)	USD	469.373	–	–	469.373
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	2.902.391	321.970	(761.103)	2.463.258
	W-Klasse	USD	5.000	–	–	5.000
	X-Klasse (Inc)	USD	5.603.913	252.460	(3.279.791)	2.576.582
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund						
	A-Klasse	USD	11.802.086	639.659	(1.651.363)	10.790.382
	A-Klasse	EUR	24.984.973	1.551.344	(9.333.718)	17.202.599

2. GEZEICHNETES KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Umlaufende Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	Im Berichtszeitraum ausgegebene Anteile	Im Berichtszeitraum zurückgenommene Anteile	Umlaufende Anteile am Ende des Berichtszeitraums
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund Forts.						
	A-Klasse (Inc)	USD	152.704	20	(10)	152.714
	A-Klasse (Inc)	EUR	1.833.714	180.586	(110.992)	1.903.308
	Sterling A (Acc)	GBP	154.941	993	–	155.934
	Sterling B (Acc)	GBP	2.045	–	–	2.045
	C-Klasse	USD	17.422.386	2.222.969	(18.294.238)	1.351.117
	C-Klasse	EUR	963.211	1.333	(163.606)	800.938
	C-Klasse (Inc)	USD	151.500	–	–	151.500
	C-Klasse (Inc)	EUR	53.809.499	–	(38.326.838)	15.482.661
	Sterling C (Acc)	GBP	1.615	–	–	1.615
	Sterling C (Inc)	GBP	237.890	4	(80.327)	157.567
	H-Klasse (Hedged)	EUR	38.295.447	609.578	(8.709.471)	30.195.554
	I-Klasse (Hedged)	EUR	2.061.752	7.778	(40.772)	2.028.758
	Sterling J (Inc) (Hedged)	GBP	11.000	–	–	11.000
	W-Klasse	USD	94.092.016	30.139	(3.867.940)	90.254.215
	W-Klasse	EUR	12.896.313	405.320	(4.581.585)	8.720.048
	W-Klasse (Hedged)	EUR	43.764.703	4.089.921	(34.868.632)	12.985.992
	W-Klasse (Inc)	EUR	767.287	–	–	767.287
	W-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	87.265.050	–	(25.036)	87.240.014
	Sterling W (Inc)	GBP	30.533.663	2.375.792	(24.943.644)	7.965.811
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	58.536	429	(18.362)	40.603
	X-Klasse^	USD	24.543.479	–	(24.543.479)	–
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund						
	A-Klasse	EUR	423.504	–	(400.000)	23.504
	C-Klasse	USD	256.500	–	–	256.500
	W-Klasse (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	X-Klasse (Inc)	USD	27.764.843	5.392.325	(2.113.396)	31.043.772
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund						
	A-Klasse (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	E-Klasse (Inc)^	USD	5.438	179	(5.617)	–
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	61.093.837	62.896.461	(16.362.445)	107.627.853
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	100.000	–	–	100.000
	W-Klasse (Acc)	USD	64.610.852	–	–	64.610.852
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	13.618	–	(6.269)	7.349
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	304.625	65.567	(63.431)	306.761
	X-Klasse (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
BNY Mellon Euroland Bond Fund						
	A-Klasse	EUR	231.900.850	23.512.337	(145.458.507)	109.954.680
	A-Klasse (Inc)	EUR	8.863.753	195.255	(775.433)	8.283.575
	B-Klasse	EUR	47.258	–	(744)	46.514
	B-Klasse (Inc)	EUR	51.547	–	(34.907)	16.640
	C-Klasse	EUR	55.328.003	2.386.695	(13.990.405)	43.724.293
	C-Klasse (Inc)	EUR	92.244.036	121.409	(19.817.605)	72.547.840
	G-Klasse (Acc)	EUR	512.630	1.144.479	(3.815)	1.653.294
	H-Klasse (Hedged)	CHF	5.091.303	10.000	(1.229.054)	3.872.249

2. GEZEICHNETES KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Umlaufende Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	Im Berichtszeitraum ausgegebene Anteile	Im Berichtszeitraum zurückgenommene Anteile	Umlaufende Anteile am Ende des Berichtszeitraums
BNY Mellon Euroland Bond Fund Forts.						
	I-Klasse (Hedged)	CHF	1.317.815	–	(48.170)	1.269.645
	S-Klasse	EUR	32.892.612	1.671.728	(17.502.474)	17.061.866
	W-Klasse (Acc)	EUR	123.506.634	12.288.489	(47.277.469)	88.517.654
BNY Mellon European Credit Fund						
	A-Klasse	EUR	12.672	839	(1.369)	12.142
	C-Klasse	EUR	49.536	7.669	(13.753)	43.452
	W-Klasse (Acc)	EUR	8.347	–	(7.500)	847
	X-Klasse	EUR	553.309	–	(49.438)	503.871
BNY Mellon Global Bond Fund						
	A-Klasse	USD	28.076.999	5.618.886	(2.353.233)	31.342.652
	A-Klasse	EUR	19.557.312	5.332.045	(2.725.752)	22.163.605
	B-Klasse	USD	809.520	18.540	–	828.060
	C-Klasse	USD	101.399.907	4.186.689	(18.017.661)	87.568.935
	C-Klasse	EUR	69.614.867	24.763.401	(20.014.957)	74.363.311
	C-Klasse (Inc)	USD	717.856	25.250	(197.373)	545.733
	Sterling C (Inc)	GBP	3.115.325	388.117	(435.677)	3.067.765
	H-Klasse (Hedged)	EUR	1.606.915	769.714	(578.567)	1.798.062
	I-Klasse (Hedged)	EUR	569.671	5.520.621	(723.872)	5.366.420
	W-Klasse (Acc)	USD	25.980.034	888.265	(3.921.171)	22.947.128
	W-Klasse (Acc)	EUR	4.546	–	–	4.546
	W-Klasse (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)	–
	X-Klasse	USD	9.562.811	–	–	9.562.811
	Sterling Z (Acc) (Hedged)^	GBP	–	100.000	–	100.000
	Sterling Z (Inc) (Hedged)^	GBP	–	100.000	–	100.000
BNY Mellon Global Credit Fund						
	A-Klasse (Acc)^	USD	–	5.000	–	5.000
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	7.905.494	2.052.471	(861.532)	9.096.433
	W-Klasse (Acc)	USD	526.950	1.436.044	(94.500)	1.868.494
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	100.933	289.560	–	390.493
	X-Klasse (Acc)	USD	5.000	114.580.279	–	114.585.279
	X-Klasse (Acc) (Hedged)	CAD	479.804.141	–	(16.331.863)	463.472.278
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund						
	A-Klasse	USD	4.574.656	481.288	(1.028.027)	4.027.917
	A-Klasse	EUR	1.847.701	618.717	(369.366)	2.097.052
	A-Klasse (Inc)	USD	184.772	344	–	185.116
	C-Klasse	USD	100.134.674	2.203.830	(33.173.738)	69.164.766
	G-Klasse (Acc)	EUR	71.517	–	(4.397)	67.120
	H-Klasse (Hedged)	EUR	3.923.592	2.186.155	(685.958)	5.423.789
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	NOK	88.000	–	–	88.000
	H-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	895.823	43.113	(236.350)	702.586
	I-Klasse (Hedged)	EUR	50.866.259	193.284	(39.089.599)	11.969.944

2. GEZEICHNETES KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Umlaufende Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	Im Berichtszeitraum ausgegebene Anteile	Im Berichtszeitraum zurückgenommene Anteile	Umlaufende Anteile am Ende des Berichtszeitraums
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Forts.						
	I-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	5.417.820	22.386	(3.705.075)	1.735.131
	W-Klasse	USD	140.198.900	2.742.817	(36.679.303)	106.262.414
	W-Klasse (Hedged)	EUR	66.520.694	8.496.182	(7.828.532)	67.188.344
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	CHF	2.069.915	299.309	(116.303)	2.252.921
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	NOK	88.000	–	–	88.000
	W-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	8.279.992	1.365.542	–	9.645.534
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	10.629.004	2.588.732	(2.368.319)	10.849.417
	Sterling W (Inc) (Hedged)^	GBP	–	100.464	(232)	100.232
	X-Klasse (Acc) (Hedged)	JPY	9.978.715	–	(13.573)	9.965.142
	Sterling Z (Acc)	GBP	2.923.683	143.182	(264.425)	2.802.440
	Sterling Z (Acc) (Hedged)^	GBP	–	100.000	–	100.000
	Sterling Z (Inc)	GBP	49.000	22	(5.022)	44.000
	Sterling Z (Inc) (Hedged)^	GBP	–	100.275	(138)	100.137
BNY Mellon Global Emerging Markets Fund						
	A-Klasse	USD	285.175	1.406.990	(1.456.064)	236.101
	A-Klasse	EUR	172.282	675.730	(59.640)	788.372
	A-Klasse (Inc)	EUR	108.732	1.057	(34.628)	75.161
	B-Klasse (Acc)^	USD	–	5.000	–	5.000
	B-Klasse (Acc)^	EUR	–	5.000	–	5.000
	B-Klasse (Inc)	USD	36.014	5.170	(36.014)	5.170
	B-Klasse (Inc)	EUR	33.600	–	–	33.600
	C-Klasse	USD	145.200	–	(10.200)	135.000
	C-Klasse (Acc)	USD	19.042.116	281.439	(2.910.534)	16.413.021
	C-Klasse (Acc)^	EUR	–	5.000	–	5.000
	C-Klasse (Inc)	USD	14.524	705.258	(535.203)	184.579
	Sterling C (Inc)^	GBP	–	5.000	–	5.000
	E-Klasse (Acc)	USD	2.031.546	333.612	(324.017)	2.041.141
	E-Klasse (Acc)	CHF	2.314.483	–	(473.000)	1.841.483
	G-Klasse (Acc) (Hedged)^	EUR	120.831	–	(120.831)	–
	H-Klasse (Hedged)	EUR	82.490	302	(43.877)	38.915
	I-Klasse (Hedged)	EUR	261.228	765.446	(413.397)	613.277
	W-Klasse (Acc)	USD	491.436	–	(398.622)	92.814
	W-Klasse (Acc)	EUR	200.000	–	–	200.000
	W-Klasse (Inc)	USD	802.450	44.004	(197.250)	649.204
	W-Klasse (Inc)	EUR	58.242	–	–	58.242
BNY Mellon Global Equity Fund						
	A-Klasse	USD	10.631.456	18.511.704	(14.349.588)	14.793.572
	A-Klasse	EUR	842.452	8.517.011	(7.825.121)	1.534.342
	B-Klasse	USD	3.419.993	–	(105.473)	3.314.520
	B-Klasse	EUR	16.994	–	–	16.994
	C-Klasse	USD	11.002.868	2.093.294	(3.920.882)	9.175.280
	C-Klasse^	EUR	2.456	–	(2.456)	–
	I-Klasse (Hedged)	EUR	1.617.511	–	(1.373.906)	243.605
	W-Klasse (Acc)	USD	17.769.421	5.948.349	(3.561.646)	20.156.124
	W-Klasse (Acc)	EUR	174.639.288	19.184.830	(20.308.258)	173.515.860

2. GEZEICHNETES KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Umlaufende Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	Im Berichtszeitraum ausgegebene Anteile	Im Berichtszeitraum zurückgenommene Anteile	Umlaufende Anteile am Ende des Berichtszeitraums
BNY Mellon Global Equity Income Fund						
	A-Klasse	USD	11.331.359	17.333.136	(17.209.461)	11.455.034
	A-Klasse	EUR	32.322.901	16.434.724	(18.407.567)	30.350.058
	A-Klasse (Inc)	USD	4.263.198	1.273.617	(720.215)	4.816.600
	A-Klasse (Inc)	EUR	6.431.195	1.401.832	(1.010.951)	6.822.076
	Sterling A (Acc)	GBP	215.865	–	(45.465)	170.400
	B-Klasse	USD	10.852.644	1.934.655	(5.642.034)	7.145.265
	B-Klasse	EUR	2.148.358	511.933	(1.031.527)	1.628.764
	B-Klasse (Inc)	USD	4.887.512	2.087.959	(784.430)	6.191.041
	B-Klasse (Inc)	EUR	607.167	1.064.771	(68.037)	1.603.901
	Sterling B (Inc)	GBP	2.209.438	276.523	(1.287.420)	1.198.541
	C-Klasse	USD	44.369.694	13.981.155	(8.852.622)	49.498.227
	C-Klasse	EUR	7.219.977	1.472.033	(1.261.892)	7.430.118
	C-Klasse (Inc)	USD	5.156.783	6.023.895	(2.547.472)	8.633.206
	C-Klasse (Inc)	EUR	25.442.311	10.578.087	(16.996.046)	19.024.352
	Sterling C (Inc)	GBP	1.702.260	35.824	(675.360)	1.062.724
	G-Klasse (Acc)	EUR	5.923.161	835.824	(1.356.459)	5.402.526
	H-Klasse (Hedged)	EUR	12.848.456	3.172.224	(8.120.314)	7.900.366
	H-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	8.403.991	361.858	(1.387.809)	7.378.040
	I-Klasse (Hedged)	EUR	11.958.462	455.964	(1.791.405)	10.623.021
	I-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	1.726.498	1.248.553	(495.873)	2.479.178
	W-Klasse	USD	63.581.327	16.481.778	(42.894.013)	37.169.092
	W-Klasse	EUR	75.985.225	14.760.165	(52.528.236)	38.217.154
	W-Klasse (Acc)^	CHF	5.000	–	(5.000)	–
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	1.404.490	1.135.421	(1.513.859)	1.026.052
	W-Klasse (Inc)	USD	23.459.085	2.631.506	(11.497.718)	14.592.873
	W-Klasse (Inc)	EUR	492.560.083	48.233.885	(172.142.502)	368.651.466
	Sterling W (Acc)	GBP	4.143.453	1.317.706	(2.295.775)	3.165.384
	Sterling W (Inc)	GBP	28.164.167	4.054.727	(5.569.701)	26.649.193
	Z-Klasse (Acc)	USD	14.720.039	2.552.080	(14.807.948)	2.464.171
	Z-Klasse (Acc)	EUR	4.104.633	571.328	(2.414.932)	2.261.029
	Z-Klasse (Inc)	USD	4.352.535	1.437.210	(3.709.604)	2.080.141
	Z-Klasse (Inc)	EUR	1.712.067	123.482	(1.347.899)	487.650
	Sterling Z (Acc)	GBP	5.000	–	–	5.000
	Sterling Z (Inc)	GBP	4.253.594	501.890	(1.293.032)	3.462.452
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund						
	A-Klasse	EUR	6.450.814	1.076.984	(1.711.786)	5.816.012
	C-Klasse	USD	26.990.244	14.322.199	(13.761.249)	27.551.194
	C-Klasse	EUR	735.094	15.552	(733.732)	16.914
	C-Klasse (Inc)	USD	398.288	–	–	398.288
	H-Klasse (Hedged)	EUR	802.962	453.725	(240.313)	1.016.374
	I-Klasse (Hedged)	EUR	7.396.352	680.582	(426.641)	7.650.293
	W-Klasse (Acc)	USD	403.386	6.626.353	(8.600)	7.021.139
	W-Klasse (Acc) (Hedged)^	EUR	100.000	–	(100.000)	–
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	980.220	206.660	(57.000)	1.129.880
	X-Klasse (Inc)	USD	26.105.970	138.962	(5.911.243)	20.333.689
	X-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	20.735.587	–	(891.036)	19.844.551

2. GEZEICHNETES KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Umlaufende Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	Im Berichtszeitraum ausgegebene Anteile	Im Berichtszeitraum zurückgenommene Anteile	Umlaufende Anteile am Ende des Berichtszeitraums
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund						
	A-Klasse (Acc)	USD	195.925	–	–	195.925
	A-Klasse (Inc)	USD	1.327.381	1.500	(1.500)	1.327.381
	A-Klasse (Inc)	EUR	5.381	236	(231)	5.386
	B-Klasse (Acc)	USD	5.000	83.117	–	88.117
	B-Klasse (Acc)^	SGD	–	103.469	–	103.469
	B-Klasse (Inc)	USD	5.239	1.155.570	(1.399)	1.159.410
	B-Klasse (Inc)^	SGD	–	1.120.680	–	1.120.680
	E-Klasse (Acc)	USD	3.334.753	–	(53.906)	3.280.847
	E-Klasse (Inc)	USD	24.894.194	865.252	(24.882.995)	876.451
	E-Klasse (Inc)	EUR	1.645.390	1.841.157	(450.942)	3.035.605
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	37.440.985	92.538.265	(9.476.618)	120.502.632
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	134.591	184.175	(9.845)	308.921
	H-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	330.792	739.812	–	1.070.604
	J-Klasse (Acc) (Hedged)^	SGD	–	170.262	–	170.262
	J-Klasse (Inc) (Hedged)^	SGD	–	650.547	(2.738)	647.809
	W-Klasse (Acc)	USD	4.361.369	3.369.382	(4.409.378)	3.321.373
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	158.000	22.000	–	180.000
	W-Klasse (Inc)	USD	5.238	1.286.505	(98)	1.291.645
	W-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	104.822	17.903.988	(108.810)	17.900.000
BNY Mellon Global Leaders Fund						
	A-Klasse (Acc)	USD	1.302.287	8.347	(288.267)	1.022.367
	A-Klasse (Acc)	EUR	5.000	–	–	5.000
	A-Klasse (Inc)	EUR	5.000	–	–	5.000
	B-Klasse (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	C-Klasse (Acc)	USD	27.617.195	520.725	(336.561)	27.801.359
	E-Klasse (Acc)	USD	359.181	600.000	–	959.181
	Sterling E (Acc)	GBP	14.933.384	1.567.167	(13.172.036)	3.328.515
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	DKK	67.000	–	–	67.000
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	88.020	3.284	(11.584)	79.720
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	NOK	88.000	–	–	88.000
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	SEK	97.000	–	–	97.000
	W-Klasse (Acc)	USD	630.731	498.591	(380.000)	749.322
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	DKK	67.000	–	–	67.000
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	NOK	88.000	–	–	88.000
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	SEK	97.000	–	–	97.000
	Sterling W (Acc)	GBP	5.264.676	493.193	(571.553)	5.186.316
BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund						
	A-Klasse (Acc)	EUR	5.000	–	–	5.000
	A-Klasse (Inc)^	USD	–	5.000	–	5.000
	A-Klasse (Inc)	EUR	1.931.237	735.495	(7.655)	2.659.077
	C-Klasse (Acc)	EUR	297.855	5.930	(297.855)	5.930
	E-Klasse (Inc)	EUR	9.118.379	1.108.161	(1.820.351)	8.406.189
	W-Klasse (Acc)	EUR	10.635.492	–	–	10.635.492
	W-Klasse (Inc)^	EUR	5.257	215	(5.472)	–

2. GEZEICHNETES KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Umlaufende Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	Im Berichtszeitraum ausgegebene Anteile	Im Berichtszeitraum zurückgenommene Anteile	Umlaufende Anteile am Ende des Berichtszeitraums
BNY Mellon Global Opportunities Fund						
	A-Klasse	USD	3.194.801	2.183.425	(3.222.965)	2.155.261
	A-Klasse	EUR	9.461.771	1.778.612	(2.771.699)	8.468.684
	B-Klasse	USD	788.184	–	(590)	787.594
	C-Klasse	USD	318.452	2.564	(71.285)	249.731
	C-Klasse	EUR	1.716.199	43.267	(1.707.050)	52.416
	H-Klasse (Hedged)	EUR	305.681	36.799	(59.360)	283.120
	I-Klasse (Hedged)	EUR	14.931	–	–	14.931
	W-Klasse (Acc)	USD	693.988	216.810	(170.000)	740.798
	W-Klasse (Acc)^	EUR	4.816	–	(4.816)	–
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)						
	A-Klasse	EUR	610.174.469	135.670.007	(203.997.013)	541.847.463
	A-Klasse (Inc)	EUR	16.066.802	2.749.098	(1.803.789)	17.012.111
	C-Klasse	EUR	173.479.728	47.893.750	(86.409.453)	134.964.025
	C-Klasse (Inc)	EUR	9.822.944	2.139.330	(7.282.433)	4.679.841
	G-Klasse (Acc)	EUR	6.956.341	3.156.726	(1.223.240)	8.889.827
	G-Klasse (Inc)	EUR	3.882.942	874.192	(279.453)	4.477.681
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	SGD	4.047.620	861.543	(260.334)	4.648.829
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	USD	1.807.533	1.271.311	(712.446)	2.366.398
	Sterling H (Acc) (Hedged)	GBP	911.717	240.936	(27.468)	1.125.185
	W-Klasse	EUR	830.859.336	156.861.853	(352.914.875)	634.806.314
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	CHF	2.808.037	366.736	(1.844.332)	1.330.441
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	USD	100.000	2.273.147	(2.202.472)	170.675
	W-Klasse (Inc)	EUR	996.936	47.833	(5.052)	1.039.717
	X-Klasse	EUR	773.846.007	270.36.029	(143.668.966)	657.213.070
	Z-Klasse (Acc)	EUR	68.493.755	278.370	–	68.772.125
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)						
	Sterling B (Acc)	GBP	1.074.324	85.337	(306.110)	853.551
	Sterling B (Inc)	GBP	402.024	–	–	402.024
	Sterling C (Inc)	GBP	524.357	193	(252.184)	272.366
	Sterling W (Acc)	GBP	13.210.743	7.309.988	(5.849.351)	14.671.380
	Sterling W (Inc)	GBP	17.900.675	1.109.141	(10.063.644)	8.946.172
	Sterling X (Acc)	GBP	23.697.167	4.009.337	(2.304.387)	25.402.117
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)						
	A-Klasse	USD	63.818.868	6.429.045	(7.839.815)	62.408.098
	C-Klasse	USD	28.480.624	2.845.039	(5.341.995)	25.983.668
	C-Klasse (Inc)	USD	679.894	–	(618.417)	61.477
	G-Klasse (Acc)	USD	8.500	–	(4.250)	4.250
	W-Klasse (Acc)	USD	16.138.800	2.640.030	(2.104.807)	16.674.023
	W-Klasse (Inc)	USD	19.660.559	2.960.541	(10.563.454)	12.057.646
	X-Klasse	USD	74.532.954	2.208.168	(7.773.579)	68.967.543
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund						
	A-Klasse (Acc)	USD	8.360.338	1.415.744	(4.513.440)	5.262.642
	A-Klasse (Inc)	USD	788.187	52.954	(743.666)	97.475

2. GEZEICHNETES KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Umlaufende Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	Im Berichtszeitraum ausgegebene Anteile	Im Berichtszeitraum zurückgenommene Anteile	Umlaufende Anteile am Ende des Berichtszeitraums
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Forts.						
	C-Klasse (Acc)	USD	17.364.400	6.331.262	(12.589.032)	11.106.630
	G-Klasse (Acc)	USD	40.858	193.143	(56.984)	177.017
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	95.677.185	13.855.218	(33.046.212)	76.486.191
	H-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	2.547.350	184.122	(601.896)	2.129.576
	I-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	15.645.968	3.869.412	(5.593.124)	13.922.256
	I-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	2.110.936	600.000	(2.000.000)	710.936
	W-Klasse (Acc)	USD	53.095.238	15.689.431	(16.494.008)	52.290.661
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	CHF	21.474.800	4.280.000	(2.015.050)	23.739.750
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	78.653.487	25.736.730	(46.530.905)	57.859.312
	W-Klasse (Inc)	USD	30.450.000	–	(450.000)	30.000.000
	W-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	3.158.511	108.444	(2.003.955)	1.263.000
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	6.643.996	33.863.019	(5.936.609)	34.570.406
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	2.898.078	288.261	(584.074)	2.602.265
	X-Klasse (Acc)	USD	10.749.954	4.363	(10.749.954)	4.363
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	12.447.669	47.357.300	–	59.804.969
	Y-Klasse (Acc)	USD	169.466.042	–	(899.134)	168.566.908
	Sterling Y (Acc) (Hedged)	GBP	21.084.481	700.525	(14.396.420)	7.388.586
	Sterling Z (Acc) (Hedged)	GBP	1.168.654	1.515.883	(241.468)	2.443.069
	Sterling Z (Inc) (Hedged)	GBP	49.447.095	34.073.865	(6.371.935)	77.149.025
BNY Mellon Global Unconstrained Fund						
	W-Klasse (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	X-Klasse (Acc) (Hedged)	CAD	28.492.519	–	–	28.492.519
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund						
	A-Klasse (Acc)	EUR	25.001	27.037	(27.037)	25.001
	C-Klasse	JPY	1.202.391	755.598	(723.741)	1.234.248
	E-Klasse (Acc)^	EUR	27.386	–	(27.386)	–
	E-Klasse (Acc) (Hedged)	CHF	3.943.013	697.036	(490.170)	4.149.879
	E-Klasse (Acc) (Hedged)	USD	25.597.224	–	–	25.597.224
	G-Klasse (Acc)^	EUR	–	5.000	–	5.000
	G-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	998.978	81.937	(63.141)	1.017.774
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	SGD	1.111.376	238.187	(734.175)	615.388
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	NOK	88.000	–	–	88.000
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	SEK	97.000	–	–	97.000
	H-Klasse (Hedged)	EUR	2.358.545	230.799	(1.083.378)	1.505.966
	H-Klasse (Hedged)	USD	260.357	47.762	(55.197)	252.922
	I-Klasse (Hedged)	EUR	7.918.537	5.460.674	(11.344.879)	2.034.332
	I-Klasse (Hedged)	USD	525.729	–	–	525.729
	W-Klasse	JPY	18.583.198	349.651	(416.676)	18.516.173
	W-Klasse (Acc)	EUR	25.473.131	–	(290.421)	25.182.710
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	697.680	–	(8.221)	689.459
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	NOK	88.000	–	–	88.000
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	SEK	97.000	–	–	97.000
	Sterling W (Acc)	GBP	3.726.016	609.673	(2.400.651)	1.935.038
	Sterling W (Inc)	GBP	1.489.425	1.776.523	(315.410)	2.950.538

2. GEZEICHNETES KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Umlaufende Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	Im Berichtszeitraum ausgegebene Anteile	Im Berichtszeitraum zurückgenommene Anteile	Umlaufende Anteile am Ende des Berichtszeitraums
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund						
	A-Klasse	EUR	82.971.610	27.568.817	(21.419.541)	89.120.886
	A-Klasse	USD	29.632.521	9.489.592	(7.769.909)	31.352.204
	A-Klasse (Inc)	EUR	2.773.686	1.056.991	(933.341)	2.897.336
	Sterling A (Acc)	GBP	1.177.509	81.544	(452.529)	806.524
	B-Klasse	EUR	1.454.363	681.383	(727.476)	1.408.270
	B-Klasse	USD	7.197.878	8.014.323	(5.311.536)	9.900.665
	B-Klasse (Acc)	SGD	11.640.390	9.085.172	(8.516.181)	12.209.381
	B-Klasse (Inc)^	SGD	5.000	–	(5.000)	–
	Sterling B (Inc)	GBP	337.375	104.094	(157.232)	284.237
	C-Klasse	EUR	70.722.755	21.995.592	(43.230.507)	49.487.840
	C-Klasse	USD	132.499.568	17.337.479	(33.150.993)	116.686.054
	G-Klasse (Acc)	EUR	2.396.806	2.668.334	(2.946.770)	2.118.370
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	USD	100.000	–	–	100.000
	I-Klasse (Acc) (Hedged)^	USD	–	100.000	–	100.000
	J-Klasse (Acc) (Hedged)	SGD	350.806	376.225	(82.955)	644.076
	S-Klasse	EUR	60.385.404	2.578.978	(11.599.805)	51.364.577
	S-Klasse (Acc) 1	USD	31.667.725	–	–	31.667.725
	W-Klasse	EUR	78.408.878	23.877.767	(17.906.732)	84.379.913
	W-Klasse	USD	31.583.576	5.053.003	(1.836.301)	34.800.278
	W-Klasse (Hedged)	USD	1.672.704	3.313.991	(3.208.208)	1.778.487
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	SGD	100.000	–	–	100.000
	W-Klasse (Inc)	USD	16.570.366	2.325.538	–	18.895.904
	W-Klasse (Inc)^	EUR	–	66.451.215	–	66.451.215
	Sterling W (Acc)	GBP	9.213.718	1.891.194	(551.393)	10.553.519
	Sterling W (Inc)	GBP	1.930.348	1.182.550	(413.753)	2.699.145
	X-Klasse (Acc)	USD	96.371.579	–	–	96.371.579
	Sterling X	GBP	7.181.908	–	(21.298)	7.160.610
BNY Mellon Mobility Innovation Fund						
	A-Klasse (Acc)	USD	5.978.528	8.739.836	(4.366.783)	10.351.581
	A-Klasse (Acc)	EUR	2.842.218	3.173.571	(893.803)	5.121.986
	A-Klasse (Inc)	USD	218.952	183.551	(128.724)	273.779
	A-Klasse (Inc)	EUR	1.591.852	848.398	(574.760)	1.865.490
	B-Klasse (Acc)	USD	14.122.797	613.818	(2.591.318)	12.145.297
	C-Klasse (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	C-Klasse (Acc)	EUR	5.000	2.199.886	(5.000)	2.199.886
	C-Klasse (Inc)	EUR	1.510.100	405.000	(26.100)	1.889.000
	E-Klasse (Acc)	USD	26.175.805	8.819.223	(3.796.726)	31.198.302
	E-Klasse (Acc)	CHF	8.209.932	2.271.091	(640.448)	9.840.575
	E-Klasse (Acc)	EUR	5.055.509	935.888	(1.343.520)	4.647.877
	E-Klasse (Acc) (Hedged)	CHF	12.055.197	2.174.349	(1.552.656)	12.676.890
	E-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	11.092.883	2.520.338	(3.061.877)	10.551.344
	E-Klasse (Acc) (Hedged)^	SGD	199.706	30.000	(229.706)	–
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	1.736.535	733.593	(609.094)	1.861.034
	G-Klasse (Acc)^	EUR	–	5.000	–	5.000
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	2.876.157	2.481.493	(614.158)	4.743.492
	H-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	116.167	41.416	(16.076)	141.507

2. GEZEICHNETES KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Umlaufende Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	Im Berichtszeitraum ausgegebene Anteile	Im Berichtszeitraum zurückgenommene Anteile	Umlaufende Anteile am Ende des Berichtszeitraums
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Forts.						
	J-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	615.969	–	–	615.969
	K-Klasse (Acc)	USD	5.281.336	3.203.733	(868.455)	7.616.614
	K-Klasse (Acc) (Hedged)	CHF	1.851.419	586.460	(111.908)	2.325.971
	K-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	3.777.563	971.578	(414.554)	4.334.587
	K-Klasse (Inc)	USD	363.156	33.233	–	396.389
	K-Klasse (Inc) (Hedged)	CHF	156.161	18.000	(23.567)	150.594
	K-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	139.571	93.000	(10.000)	222.571
	K-Klasse (Inc) (Hedged)	SGD	127.171	–	–	127.171
	Sterling K (Acc) (Hedged)	GBP	197.511	33.354	(34.453)	196.412
	W-Klasse (Acc)	USD	21.314.192	17.987.494	(13.167.238)	26.134.448
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	10.663.383	4.241.968	(3.505.750)	11.399.601
	Sterling W (Acc)^	GBP	5.000	–	(5.000)	–
	W-Klasse (Inc)	USD	5.004	30	(15)	5.019
	W-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	100.080	142.302	(102.975)	139.407
BNY Mellon S&P 500® Index Tracker						
	A-Klasse	USD	6.553.151	514.239	(1.655.590)	5.411.800
	A-Klasse	EUR	1.615.040	587.052	(558.309)	1.643.783
	C-Klasse	USD	6.291.236	341	(2.734.863)	3.556.714
	C-Klasse	EUR	1.829.874	7.532	(1.336.488)	500.918
	G-Klasse (Acc)^	EUR	5.000	–	(5.000)	–
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund						
	A-Klasse	EUR	3.896.276	234.863	(938.709)	3.192.430
	A-Klasse	USD	119.230	5.939	(5.939)	119.230
	B-Klasse	EUR	53.912	–	–	53.912
	C-Klasse	EUR	7.068.545	254.953	(2.546.390)	4.777.108
	C-Klasse	USD	19.787	–	–	19.787
	W-Klasse (Acc)	EUR	6.040.065	–	–	6.040.065
	Sterling W (Acc)	GBP	17.713	–	(6.449)	11.264
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund						
	A-Klasse (Acc)	EUR	5.000	–	–	5.000
	A-Klasse (Acc)^	USD	–	25.949	–	25.949
	A-Klasse (Inc)	EUR	5.029	26	(13)	5.042
	C-Klasse (Acc)	EUR	5.000	–	–	5.000
	E-Klasse (Acc)	EUR	47.562.993	37.671.598	–	85.234.591
	E-Klasse (Acc) (Hedged)	CHF	11.504.332	889.371	(629.142)	11.764.561
	G-Klasse (Acc)	EUR	191.825	–	–	191.825
	H-Klasse (Acc) (Hedged)^	CHF	–	374.279	(119.279)	255.000
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	NOK	88.000	–	–	88.000
	W-Klasse (Acc)	EUR	1.794.555	7.200.774	(108.016)	8.887.313
	W-Klasse (Acc) (Hedged)^	CHF	–	23.650.313	(281.109)	23.369.204
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	NOK	88.000	–	–	88.000
	W-Klasse (Acc) (Hedged)^	USD	–	746.142	(100.000)	646.142
	Sterling W (Acc) (Hedged)^	GBP	–	117.500	–	117.500
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	100.090	466.981	(127.755)	439.316
	X-Klasse (Acc)	EUR	113.498.518	582.000	(28.560.000)	85.520.518

2. GEZEICHNETES KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Umlaufende Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	Im Berichtszeitraum ausgegebene Anteile	Im Berichtszeitraum zurückgenommene Anteile	Umlaufende Anteile am Ende des Berichtszeitraums
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)*						
	A-Klasse (Acc)^	EUR	–	5.000	–	5.000
	A-Klasse (Inc)^	EUR	–	5.000	–	5.000
	E-Klasse (Acc)^	EUR	–	13.697.364	(4.145.465)	9.551.899
	E-Klasse (Acc) (Hedged)^	USD	–	1.311.519	(100.000)	1.211.519
	E-Klasse (Inc)^	EUR	–	5.000	–	5.000
	G-Klasse (Acc)^	EUR	–	5.000	–	5.000
	W-Klasse (Acc)^	EUR	–	14.884.560	–	14.884.560
	W-Klasse (Inc)^	EUR	–	5.000	–	5.000
	Sterling W (Acc) (Hedged)^	GBP	–	100.000	–	100.000
	Sterling W (Inc) (Hedged)^	GBP	–	100.000	–	100.000
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund						
	A-Klasse (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	65.852.584	132.381	–	65.984.965
BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund						
	A-Klasse	USD	706.599	3.133	(104.165)	605.567
	A-Klasse	EUR	492.090	54.207	(85.964)	460.333
	B-Klasse	USD	94.858	–	–	94.858
	C-Klasse	USD	6.608.970	2.631.957	(650.427)	8.590.500
	C-Klasse	EUR	583	–	–	583
	W-Klasse (Acc)^	USD	5.000	–	(5.000)	–
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund						
	A-Klasse (Acc)	EUR	4.677	–	–	4.677
	B-Klasse (Inc)	USD	5.030	130	(65)	5.095
	C-Klasse (Inc)	USD	908.914	–	–	908.914
	E-Klasse (Acc)	EUR	479.295	111.660	(363.090)	227.865
	E-Klasse (Inc)	USD	5.069.996	–	(839.459)	4.230.537
	E-Klasse (Inc)	EUR	337.310	–	(107.170)	230.140
	Sterling E (Acc)	GBP	62.820.458	3.234.529	(30.741.384)	35.313.603
	Sterling E (Inc)	GBP	138.802.914	10.444.387	(25.801.356)	123.445.945
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	2.437.935	389.360	(1.142.495)	1.684.800
	W-Klasse (Acc)	USD	19.594.548	85.051	(433.137)	19.246.462
	W-Klasse (Acc)	EUR	9.444.727	12.744.543	(5.137.281)	17.051.989
	W-Klasse (Inc)	USD	6.319.049	–	(744.049)	5.575.000
	Sterling W (Inc)	GBP	31.207.152	231.076	(5.021.789)	26.416.439
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund						
	A-Klasse (Acc)^	USD	–	5.000	–	5.000
	C-Klasse (Acc)	USD	117.766.628	41.042.327	(22.845.021)	135.963.934
	E-Klasse (Acc)	USD	27.716.258	720.000	(6.959.000)	21.477.258
	E-Klasse (Acc) (Hedged)	CHF	3.400.000	–	(50.000)	3.350.000
	E-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	2.244.788	6.435.212	(800.000)	7.880.000
	E-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	5.170.252	3.039.302	(94.651)	8.114.903
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	538.026	9.619.873	(9.990.128)	167.771
	H-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	133.496	4.859	(2.093)	136.262
	W-Klasse (Acc)	USD	16.903.757	7.776.040	(962.370)	23.717.427

2. GEZEICHNETES KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Umlaufende Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	Im Berichtszeitraum ausgegebene Anteile	Im Berichtszeitraum zurückgenommene Anteile	Umlaufende Anteile am Ende des Berichtszeitraums
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Forts.						
	W-Klasse (Acc)	EUR	30.005.000	–	(5.000)	30.000.000
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	CHF	18.916.551	1.090.000	(1.735.000)	18.271.551
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	9.019.000	1.203.628	(230.000)	9.992.628
	W-Klasse (Inc)	USD	640.000	16.392.900	(712.300)	16.320.600
	W-Klasse (Inc) (Hedged)	CHF	6.574.781	–	–	6.574.781
	W-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	130.370.454	7.075.563	–	137.446.017
	X-Klasse (Acc)	USD	15.000.000	–	(7.023.088)	7.976.912

* Siehe Erläuterung 18 zum Halbjahresabschluss.

^ Diese Anteilsklasse wurde im Berichtszeitraum aufgelegt oder geschlossen.

Die Aktivitäten bei einlösbaren partizipierenden Anteilen für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2019 waren wie folgt:

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Umlaufende Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	Im Berichtszeitraum ausgegebene Anteile	Im Berichtszeitraum zurückgenommene Anteile	Umlaufende Anteile am Ende des Berichtszeitraums
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund						
	C-Klasse	EUR	4.567	122	(676)	4.013
	C-Klasse (Inc)	EUR	2.085	–	–	2.085
	R-Klasse	EUR	193.971	11.136	(103.372)	101.735
	R-Klasse (Hedged)	USD	113.771	154	(53.048)	60.877
	R-Klasse (Inc)	EUR	18.786	4.973	(2.639)	21.120
	S-Klasse	EUR	4.414.452	430.392	(3.767.814)	1.077.030
	S-Klasse (Inc)	EUR	17.078	–	–	17.078
	T-Klasse (Hedged)	CHF	23.656	50	(23.065)	641
	T-Klasse (Hedged)	USD	367.097	14.144	(274.414)	106.827
	Sterling T (Acc) (Hedged)	GBP	100.308	711	(24.837)	76.182
	W-Klasse (Acc)	EUR	2.527	–	–	2.527
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	USD	8.750	43.238	(6.945)	45.043
	W-Klasse (Inc) (Hedged)	USD	973	1.029	(973)	1.029
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	788.280	143.739	(57.911)	874.108
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	5.061	10.268	–	15.329
	X-Klasse	EUR	3.266.897	–	(297.568)	2.969.329
	X-Klasse (Acc) (Hedged)^	USD	–	1.000	–	1.000
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	91.677	–	(5.000)	86.677
	Z-Klasse (Acc)	EUR	519	89	(554)	54
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund						
	D-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	885.661	234.073	(679.250)	440.484
	R-Klasse (Hedged)	CHF	196.726	–	(75.921)	120.805
	R-Klasse (Hedged)	EUR	401.737.652	23.990.352	(225.737.562)	199.990.442
	R-Klasse (Hedged)	USD	31.082.112	104.395	(22.289.670)	8.896.837
	R-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	8.707.844	304.555	(2.649.465)	6.362.934
	Sterling R (Acc)	GBP	982.381	6.899	(108.137)	881.143
	Sterling S (Acc)	GBP	30.830.424	30.674	(13.913.004)	16.948.094
	T-Klasse (Hedged)	EUR	288.427.387	18.471.319	(195.848.365)	111.050.341
	T-Klasse (Hedged)	USD	14.160.958	123.629	(2.971.293)	11.313.294
	U-Klasse (Hedged)	EUR	544.084.848	65.223.730	(330.822.877)	278.485.701
	U-Klasse (Hedged)	USD	28.728.474	4.120.502	(26.719.885)	6.129.091

2. GEZEICHNETES KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Umlaufende Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	Im Berichtszeitraum ausgegebene Anteile	Im Berichtszeitraum zurückgenommene Anteile	Umlaufende Anteile am Ende des Berichtszeitraums
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund Forts.						
	U-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	2.987.417	3.103.534	(5.586.446)	504.505
	Sterling U (Acc)	GBP	167.186.120	4.741.814	(122.909.265)	49.018.669
	Sterling X (Acc)	GBP	120.416.686	341.401	(7.891.450)	112.866.637
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Bond Fund*						
	U-Klasse (Acc)^	EUR	–	19.881.737	–	19.881.737
	Sterling U (Acc) (Hedged)^	GBP	–	100.000	–	100.000
	X-Klasse (Acc)^	EUR	–	5.000	–	5.000
BNY Mellon Asia Rising Stars Fund						
	A-Klasse (Acc)	USD	30.013	736	–	30.749
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	SGD	1.603.195	35.841	(9.008)	1.630.028
	W-Klasse (Acc)	USD	9.853.400	–	(4.853.400)	5.000.000
	W-Klasse (Acc) (Hedged)^	SGD	101.100	–	(101.100)	–
	X-Klasse (Acc)	USD	6.092	285.273	(19.970)	271.395
BNY Mellon Asian Equity Fund						
	A-Klasse	USD	6.180.994	1.214.410	(2.033.521)	5.361.883
	A-Klasse	EUR	2.983.479	36.596	(358.958)	2.661.117
	B-Klasse	USD	2.680.148	–	(41.766)	2.638.382
	B-Klasse	EUR	27.832	–	–	27.832
	C-Klasse	USD	274.402	–	(24.467)	249.935
	C-Klasse	EUR	311.712	3.982	–	315.694
	Sterling C (Inc)	GBP	8.306	17	(8)	8.315
	W-Klasse	USD	572.142	–	(100)	572.042
BNY Mellon Asian Income Fund						
	A-Klasse (Acc)	EUR	1.880	99.781	(900)	100.761
	A-Klasse (Inc)	EUR	40.398	–	–	40.398
	B-Klasse (Acc)	USD	107.267	–	–	107.267
	C-Klasse (Acc)	USD	4.589	–	–	4.589
	Sterling C (Acc)	GBP	5.000	–	–	5.000
	W-Klasse (Inc)	EUR	20.556.852	1.284.496	(1.757.952)	20.083.396
	W-Klasse (Inc)	USD	443.615	194.800	(50.367)	588.048
	Sterling W (Inc)	GBP	222.948	2.767	(3.882)	221.833
BNY Mellon Brazil Equity Fund						
	A-Klasse	USD	14.980.918	5.771.246	(5.750.541)	15.001.623
	A-Klasse	EUR	20.483.356	19.378.589	(17.195.926)	22.666.019
	B-Klasse	USD	1.232.007	261.125	(117.375)	1.375.757
	B-Klasse	EUR	80.698	–	–	80.698
	Sterling B (Acc)	GBP	340.999	34.363	(77.135)	298.227
	C-Klasse	USD	18.123.901	8.081.684	(17.411.055)	8.794.530
	C-Klasse	EUR	1.813.628	7.262.352	(2.742.598)	6.333.382
	Sterling C (Inc)	GBP	17.430	3.141	(11.043)	9.528
	G-Klasse (Acc)	USD	5.000	87.116	(5.000)	87.116
	G-Klasse (Acc)	EUR	5.000	93.129	(49.806)	48.323
	G-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	100.000	97.903	(40.560)	157.343

2. GEZEICHNETES KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Umlaufende Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	Im Berichtszeitraum ausgegebene Anteile	Im Berichtszeitraum zurückgenommene Anteile	Umlaufende Anteile am Ende des Berichtszeitraums
BNY Mellon Brazil Equity Fund Forts.						
	H-Klasse (Hedged)	EUR	3.323.725	6.781.495	(4.757.347)	5.347.873
	I-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	4.347.355	184.309	(335.265)	4.196.399
	W-Klasse (Acc)	USD	3.460.660	762.649	(1.438.342)	2.784.967
	W-Klasse (Acc)	EUR	950.411	1.076.105	(1.427.350)	599.166
	Sterling W (Acc)	GBP	2.116.926	3.667.055	(2.487.745)	3.296.236
BNY Mellon Digital Assets Fund*						
	A-Klasse (Acc)^	USD	–	5.000	–	5.000
	B-Klasse (Acc)^	USD	–	5.000	–	5.000
	E-Klasse (Acc)^	USD	–	49.475	–	49.475
	E-Klasse (Acc)^	EUR	–	516.700	–	516.700
	E-Klasse (Inc)^	USD	–	593.955	–	593.955
	H-Klasse (Acc) (Hedged)^	EUR	–	100.000	–	100.000
	K-Klasse (Acc)^	EUR	–	456.569	–	456.569
	K-Klasse (Acc)^	USD	–	751.999	–	751.999
	W-Klasse (Acc)^	USD	–	4.978.700	–	4.978.700
BNY Mellon Dynamic Total Return Fund						
	A-Klasse (Acc)	USD	20.364	17.064	(20.364)	17.064
	C-Klasse (Acc)	USD	21.176.116	950.135	(11.524.887)	10.601.364
	E-Klasse (Acc)	USD	14.005.000	–	(5.000)	14.000.000
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	96.526	–	–	96.526
	W-Klasse (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	X-Klasse (Acc)	USD	50.205	–	–	50.205
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund						
	A-Klasse (Inc)	USD	5.003	42	(21)	5.024
	C-Klasse (Acc)	USD	58.684.222	12.031.485	(46.002.392)	24.713.315
	E-Klasse (Acc)	USD	12.586.250	563.500	(5.137.730)	8.012.020
	H-Klasse (Acc) (Hedged)^	EUR	–	100.000	–	100.000
	G-Klasse (Inc)^	USD	5.000	44	(5.044)	–
	W-Klasse (Acc)	USD	1.359.448	–	(1.082.670)	276.778
	W-Klasse (Acc)	EUR	1.363.463	–	(1.358.463)	5.000
	Sterling W (Acc)	GBP	5.000	–	–	5.000
	X-Klasse (Acc)	USD	74.123.803	–	(10.970)	74.112.833
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund						
	A-Klasse	USD	29.004	8.567	(17.088)	20.483
	A-Klasse	EUR	43.070	28.386	(8.173)	63.283
	B-Klasse	USD	6.671	219	–	6.890
	C-Klasse	USD	357.676	143.038	(68.812)	431.902
	C-Klasse	EUR	23.739	50.904	(14.404)	60.239
	G-Klasse (Inc)	USD	5.966	2.597	(53)	8.510
	H-Klasse (Hedged)	EUR	95.250	26.190	(25.390)	96.050
	I-Klasse (Hedged)	EUR	112.979	3.432	(34.425)	81.986
	W-Klasse	USD	166.782	97.909	(74.362)	190.329
	W-Klasse	EUR	751	22.988	(178)	23.561
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	CHF	64.976	6.628	(2.581)	69.023
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	1.079	4.248	–	5.327
	W-Klasse (Inc) (Hedged)^	CHF	–	66.660	–	66.660

2. GEZEICHNETES KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Umlaufende Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	Im Berichtszeitraum ausgegebene Anteile	Im Berichtszeitraum zurückgenommene Anteile	Umlaufende Anteile am Ende des Berichtszeitraums
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund Forts.						
	W-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	100.000	5.152	–	105.152
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	12.509	15.769	(4.567)	23.711
	X-Klasse	USD	664.196	197.816	(109.026)	752.986
	Sterling X (Acc) (Hedged)^	GBP	–	134.617	–	134.617
	Y-Klasse (Acc)	USD	50	–	–	50
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund						
	A-Klasse	USD	626.027	18.832	(16.356)	628.503
	A-Klasse	EUR	2.866.819	2.371.934	(764.688)	4.474.065
	C-Klasse	USD	1.661.085	30.483	(56.473)	1.635.095
	C-Klasse	EUR	16.629.467	341.489	(12.864.147)	4.106.809
	C-Klasse (Inc)	USD	469.373	–	–	469.373
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	645.728	2.742.555	(745.609)	2.642.674
	W-Klasse	USD	5.000	–	–	5.000
	X-Klasse (Inc)^	USD	–	8.000.000	–	8.000.000
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund						
	A-Klasse	USD	14.560.273	2.497.488	(3.976.605)	13.081.156
	A-Klasse	EUR	22.056.946	13.115.118	(5.415.151)	29.756.913
	A-Klasse (Inc)	USD	186.179	23	(12)	186.190
	A-Klasse (Inc)	EUR	1.458.547	23.808	(6.723)	1.475.632
	Sterling A (Acc)	GBP	154.941	–	–	154.941
	Sterling B (Acc)	GBP	9.171	–	(7.126)	2.045
	C-Klasse	USD	23.968.316	31.150.903	(30.673.744)	24.445.475
	C-Klasse	EUR	1.418.012	544.557	(460.634)	1.501.935
	C-Klasse (Inc)	USD	176.500	–	–	176.500
	C-Klasse (Inc)	EUR	55.759.499	–	–	55.759.499
	Sterling C (Acc)	GBP	9.395.301	312	(9.393.636)	1.977
	Sterling C (Inc)	GBP	311.716	56.213	(79.438)	288.491
	H-Klasse (Hedged)	EUR	35.283.347	27.603.126	(9.990.901)	52.895.572
	I-Klasse (Hedged)	EUR	8.848.372	25.609.114	(7.018.839)	27.438.647
	Sterling J (Inc) (Hedged)	GBP	11.000	–	–	11.000
	W-Klasse	USD	87.749.421	7.909.796	(1.347.152)	94.312.065
	W-Klasse	EUR	27.145.556	10.538.004	(809.509)	36.874.051
	W-Klasse (Hedged)	EUR	26.519.308	26.147.495	(23.709.004)	28.957.799
	W-Klasse (Inc)	EUR	35.115	–	–	35.115
	W-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	87.343.123	24.878	(106.536)	87.261.465
	Sterling W (Inc)	GBP	28.132.284	2.622.981	(1.135.933)	29.619.332
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	126.391	1.180	(32.738)	94.833
	X-Klasse	USD	124.671.046	–	(65.360.000)	59.311.046
	X-Klasse (Inc)^	CHF	165.602.567	–	(165.602.567)	–
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund						
	A-Klasse	EUR	27.041	8.234	(7.329)	27.946
	C-Klasse	USD	256.500	–	–	256.500
	C-Klasse	EUR	5.000	–	–	5.000
	W-Klasse (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	X-Klasse (Inc)	USD	34.067.895	1.862.975	(1.836.239)	34.094.631

2. GEZEICHNETES KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Umlaufende Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	Im Berichtszeitraum ausgegebene Anteile	Im Berichtszeitraum zurückgenommene Anteile	Umlaufende Anteile am Ende des Berichtszeitraums
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund						
	A-Klasse (Acc)^	USD	5.000	5.000	(10.000)	–
	A-Klasse (Inc)^	USD	5.219	304	(5.523)	–
	E-Klasse (Inc)	USD	31.170.469	–	–	31.170.469
	Sterling E (Acc) (Hedged)^	GBP	5.433.946	–	(5.433.946)	–
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	22.296.896	1.758.620	(111.205)	23.944.311
	G-Klasse (Inc) (Hedged)^	EUR	103.610	6.151	(109.761)	–
	H-Klasse (Acc) (Hedged)^	EUR	100.000	100.000	(200.000)	–
	H-Klasse (Inc) (Hedged)^	EUR	103.611	6.154	(109.765)	–
	W-Klasse (Acc)	USD	64.610.852	–	–	64.610.852
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	4.326.964	250.215	(4.551.999)	25.180
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	297.583	83.456	(85.005)	296.034
	X-Klasse (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
BNY Mellon Euroland Bond Fund						
	A-Klasse	EUR	127.764.082	11.186.353	(16.108.272)	122.842.163
	A-Klasse (Inc)	EUR	10.765.817	653.455	(1.498.235)	9.921.037
	B-Klasse	EUR	89.840	–	(21.331)	68.509
	B-Klasse (Inc)	EUR	34.907	16.000	–	50.907
	C-Klasse	EUR	100.151.746	9.862.323	(9.994.907)	100.019.162
	C-Klasse (Inc)	EUR	103.061.188	70.849	(5.718.773)	97.413.264
	G-Klasse (Acc)	EUR	763.087	30.000	(250.089)	542.998
	H-Klasse (Acc) (Hedged)^	USD	177.981	–	(177.981)	–
	H-Klasse (Hedged)	CHF	5.155.416	549.698	(714.801)	4.990.313
	I-Klasse (Hedged)	CHF	4.256.339	450.000	(3.174.733)	1.531.606
	S-Klasse	EUR	260.256.360	24.848.966	(41.332.488)	243.772.838
	W-Klasse (Acc)	EUR	76.376.091	6.410.217	(8.809.584)	73.976.724
BNY Mellon European Credit Fund						
	A-Klasse	EUR	7.105	3.243	(2.522)	7.826
	C-Klasse	EUR	41.847	1.448	(4.885)	38.410
	W-Klasse (Acc)	EUR	11.197	1.650	–	12.847
	X-Klasse	EUR	283.427	–	(61.738)	221.689
BNY Mellon Global Bond Fund						
	A-Klasse	USD	28.881.146	1.107.441	(3.255.205)	26.733.382
	A-Klasse	EUR	9.602.043	10.528.689	(2.032.201)	18.098.531
	B-Klasse	USD	799.116	–	(18.990)	780.126
	C-Klasse	USD	80.174.313	31.908.685	(6.516.236)	105.566.762
	C-Klasse	EUR	52.805.842	27.059.918	(9.387.211)	70.478.549
	C-Klasse (Inc)	USD	958.087	394	(59.757)	898.724
	Sterling C (Inc)	GBP	2.723.870	383.449	(283.186)	2.824.133
	H-Klasse (Hedged)	EUR	1.811.323	172.982	(168.854)	1.815.451
	I-Klasse (Hedged)	EUR	339.161	36.459	(15.988)	359.632
	W-Klasse (Acc)	USD	20.376.759	16.635.918	(6.504.063)	30.508.614
	W-Klasse (Acc)	EUR	19.863.791	3.297.429	(22.187.978)	973.242
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	34.920.339	–	(14.794.172)	20.126.167
	X-Klasse	USD	9.562.811	–	–	9.562.811

2. GEZEICHNETES KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Umlaufende Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	Im Berichtszeitraum ausgegebene Anteile	Im Berichtszeitraum zurückgenommene Anteile	Umlaufende Anteile am Ende des Berichtszeitraums
BNY Mellon Global Credit Fund						
	B-Klasse (Acc)^	USD	4.950	–	(4.950)	–
	C-Klasse (Acc)^	USD	5.000	–	(5.000)	–
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	11.244.047	7.516	(3.223.601)	8.027.962
	W-Klasse (Acc)	USD	7.323.402	90.500	(6.992.752)	421.150
	W-Klasse (Acc) (Hedged)^	EUR	100.000	–	(100.000)	–
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	100.933	–	–	100.933
	X-Klasse (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	X-Klasse (Acc) (Hedged)	CAD	479.804.141	–	–	479.804.141
	Sterling X (Acc) (Hedged)^	GBP	–	100.000	–	100.000
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund						
	A-Klasse	USD	4.074.077	433.466	(278.129)	4.229.414
	A-Klasse	EUR	782.815	2.115.052	(328.016)	2.569.851
	A-Klasse (Inc)	USD	176.283	615	–	176.898
	C-Klasse	USD	125.936.459	12.620.916	(51.123.840)	87.433.535
	G-Klasse (Acc)	EUR	75.139	–	(5.000)	70.139
	H-Klasse (Hedged)	EUR	3.669.361	372.652	(801.817)	3.240.196
	H-Klasse (Acc) (Hedged)^	NOK	–	88.000	–	88.000
	H-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	434.029	32.010	(8.388)	457.651
	I-Klasse (Hedged)	EUR	61.342.906	6.840.932	(16.259.481)	51.924.357
	I-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	2.780.211	2.714.283	(212.004)	5.282.490
	W-Klasse	USD	145.803.358	15.425.174	(3.906.760)	157.321.772
	W-Klasse (Hedged)	EUR	91.708.915	19.654.655	(50.539.115)	60.824.455
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	CHF	5.568.050	592.929	(4.169.410)	1.991.569
	W-Klasse (Acc) (Hedged)^	NOK	–	88.000	–	88.000
	W-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	6.436.995	255.787	(482)	6.692.300
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	13.684.414	1.501.105	(2.033.823)	13.151.696
BNY Mellon Global Emerging Markets Fund						
	A-Klasse	USD	1.133.638	1.624.662	(2.561.286)	197.014
	A-Klasse	EUR	167.443	4.839	–	172.282
	A-Klasse (Inc)	EUR	137.639	1.023	(4)	138.658
	B-Klasse (Inc)	USD	36.014	–	–	36.014
	B-Klasse (Inc)	EUR	33.600	–	–	33.600
	C-Klasse	USD	143.500	10.200	–	153.700
	C-Klasse (Acc)	USD	22.247.245	2.405.822	(4.312.123)	20.340.944
	C-Klasse (Inc)	USD	18.012	2.000	(5.488)	14.524
	E-Klasse (Acc)	USD	17.322.529	138.310	(15.324.853)	2.135.986
	E-Klasse (Acc)	CHF	3.276.823	27.500	(758.987)	2.545.336
	G-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	1.804.027	–	(920.801)	883.226
	H-Klasse (Hedged)	EUR	191.090	1.846	(70.317)	122.619
	I-Klasse (Hedged)	EUR	261.228	–	–	261.228
	W-Klasse (Acc)	USD	494.989	12.926	(16.479)	491.436
	W-Klasse (Acc)	EUR	205.000	–	(5.000)	200.000
	W-Klasse (Inc)	USD	1.190.770	298.650	(97.900)	1.391.520
	W-Klasse (Inc)	EUR	58.242	–	–	58.242

2. GEZEICHNETES KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Umlaufende Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	Im Berichtszeitraum ausgegebene Anteile	Im Berichtszeitraum zurückgenommene Anteile	Umlaufende Anteile am Ende des Berichtszeitraums
BNY Mellon Global Equity Fund						
	A-Klasse	USD	10.733.792	5.109.940	(4.102.152)	11.741.580
	A-Klasse	EUR	625.472	3.147.302	(2.942.595)	830.179
	B-Klasse	USD	3.501.343	–	(69.183)	3.432.160
	B-Klasse	EUR	16.994	–	–	16.994
	C-Klasse	USD	11.068.196	486.346	(584.360)	10.970.182
	C-Klasse	EUR	2.456	47	–	2.503
	I-Klasse (Hedged)	EUR	1.262.025	404.658	(49.172)	1.617.511
	W-Klasse (Acc)	USD	18.163.040	1.974.259	(2.033.554)	18.103.745
	W-Klasse (Acc)	EUR	173.808.519	12.724.278	(13.733.198)	172.799.599
BNY Mellon Global Equity Income Fund						
	A-Klasse	USD	11.369.236	915.359	(1.816.980)	10.467.615
	A-Klasse	EUR	24.404.523	8.862.624	(6.027.938)	27.239.209
	A-Klasse (Inc)	USD	2.346.067	77.125	(424.233)	1.998.959
	A-Klasse (Inc)	EUR	1.891.816	3.142.058	(268.110)	4.765.764
	Sterling A (Acc)	GBP	202.391	2.370	(856)	203.905
	B-Klasse	USD	14.031.047	37.000	(4.015.720)	10.052.327
	B-Klasse	EUR	1.317.950	310.407	(175.310)	1.453.047
	B-Klasse (Inc)	USD	6.106.549	117.187	(796.628)	5.427.108
	B-Klasse (Inc)	EUR	134.944	562	(1.026)	134.480
	Sterling B (Inc)	GBP	2.295.385	108.797	(103.957)	2.300.225
	C-Klasse	USD	35.208.188	2.152.907	(42.292)	37.318.803
	C-Klasse	EUR	5.913.764	2.939.789	(1.258.838)	7.594.715
	C-Klasse (Inc)	USD	4.821.787	872.018	(694.438)	4.999.367
	C-Klasse (Inc)	EUR	27.553.948	2.429.946	(4.843.437)	25.140.457
	Sterling C (Inc)	GBP	2.017.530	89.933	(268.308)	1.839.155
	G-Klasse (Acc)	EUR	17.378	1.195.117	(7.485)	1.205.010
	H-Klasse (Hedged)	EUR	6.068.645	6.209.028	(1.242.377)	11.035.296
	H-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	7.376.163	546.313	(341.416)	7.581.060
	I-Klasse (Hedged)	EUR	13.041.945	627.080	(1.005.450)	12.663.575
	I-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	8.924.081	3.224.201	(10.406.697)	1.741.585
	W-Klasse	USD	46.772.608	46.439.053	(17.631.671)	75.579.990
	W-Klasse	EUR	20.511.831	12.734.158	(6.744.875)	26.501.114
	W-Klasse (Acc)^	CHF	–	5.000	–	5.000
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	3.646.621	420.767	(549.295)	3.518.093
	W-Klasse (Inc)	USD	8.712.331	8.081.383	(2.615.870)	14.177.844
	W-Klasse (Inc)	EUR	257.671.158	344.455.959	(117.875.820)	484.251.297
	Sterling W (Acc)	GBP	3.212.849	1.368.634	(243.889)	4.337.594
	Sterling W (Inc)	GBP	33.014.634	2.150.440	(8.915.263)	26.249.811
	Z-Klasse (Acc)	USD	9.951.943	4.703.924	(721.961)	13.933.906
	Z-Klasse (Acc)	EUR	471.602	830.398	(232.043)	1.069.957
	Z-Klasse (Inc)	USD	5.000	2.455.841	(48)	2.460.793
	Z-Klasse (Inc)	EUR	5.000	460.743	(48)	465.695
	Sterling Z (Inc)	GBP	5.000	4.236.637	(27.892)	4.213.745
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund						
	A-Klasse	EUR	3.112.605	1.994.434	(882.754)	4.224.285
	C-Klasse	USD	14.206.074	32.091.013	(1.311.261)	44.985.826
	C-Klasse	EUR	9.342	1.231.746	(831.354)	409.734
	C-Klasse (Inc)	USD	398.288	–	–	398.288
	H-Klasse (Hedged)	EUR	571.388	283.315	(105.080)	749.623

2. GEZEICHNETES KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Umlaufende Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	Im Berichtszeitraum ausgegebene Anteile	Im Berichtszeitraum zurückgenommene Anteile	Umlaufende Anteile am Ende des Berichtszeitraums
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund Forts.						
	I-Klasse (Hedged)	EUR	1.701.315	10.960	(447.228)	1.265.047
	W-Klasse (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	X-Klasse (Inc)	USD	33.608.465	4.440.617	(10.219.598)	27.829.484
	X-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	25.336.346	–	(3.506.817)	21.829.529
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund						
	A-Klasse (Acc)	USD	5.000	195.925	–	200.925
	A-Klasse (Inc)	USD	729.700	706.700	(5.134)	1.431.266
	A-Klasse (Inc)	EUR	5.454	850	(106)	6.198
	B-Klasse (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	B-Klasse (Inc)	USD	5.027	190	(95)	5.122
	C-Klasse (Inc)	EUR	5.026	190	(95)	5.121
	E-Klasse (Acc)	USD	5.000	604.290	(341.167)	268.123
	E-Klasse (Inc)	USD	104.527	1.088.996	(5.134)	1.188.389
	E-Klasse (Inc)	EUR	5.026	87.036	(94)	91.968
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	5.419.997	537.607	(306.471)	5.651.133
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	100.000	56.016	–	156.016
	H-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	100.690	204.190	(1.935)	302.945
	W-Klasse (Acc)	USD	4.361.369	–	–	4.361.369
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	100.000	–	–	100.000
	W-Klasse (Inc)	USD	5.027	190	(95)	5.122
	W-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	100.535	3.859	(1.930)	102.464
BNY Mellon Global Leaders Fund						
	A-Klasse (Acc)	USD	1.440.796	40.796	(225.711)	1.255.881
	A-Klasse (Acc)^	EUR	–	5.000	–	5.000
	A-Klasse (Inc)^	EUR	–	5.000	–	5.000
	B-Klasse (Acc)^	USD	–	5.000	–	5.000
	C-Klasse (Acc)	USD	27.823.730	288.779	(254.438)	27.858.071
	E-Klasse (Acc)	USD	1.569.402	–	–	1.569.402
	Sterling E (Acc)	GBP	16.095.905	3.036.395	(1.850.835)	17.281.465
	H-Klasse (Acc) (Hedged)^	DKK	–	67.000	–	67.000
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	142.796	56.615	(44.123)	155.288
	H-Klasse (Acc) (Hedged)^	NOK	–	88.000	–	88.000
	H-Klasse (Acc) (Hedged)^	SEK	–	97.000	–	97.000
	H-Klasse (Inc) (Hedged)^	EUR	100.000	–	(100.000)	–
	W-Klasse (Acc)	USD	290.761	–	(5.000)	285.761
	W-Klasse (Acc) (Hedged)^	DKK	–	67.000	–	67.000
	W-Klasse (Acc) (Hedged)^	NOK	–	88.000	–	88.000
	W-Klasse (Acc) (Hedged)^	SEK	–	97.000	–	97.000
	Sterling W (Acc)	GBP	5.494.267	871.374	(727.179)	5.638.462
BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund						
	A-Klasse (Acc)^	EUR	5.000	5.000	(10.000)	–
	A-Klasse (Inc)	EUR	233.417	1.182.358	(5.160)	1.410.615
	A-Klasse (Inc)^	USD	5.041	179	(5.220)	–
	C-Klasse (Inc)^	EUR	5.040	177	(5.217)	–
	E-Klasse (Inc)	EUR	4.577.813	3.279.934	(60.580)	7.797.167
	G-Klasse (Inc)^	EUR	5.040	177	(5.217)	–
	W-Klasse (Acc)	EUR	10.585.710	–	–	10.585.710
	W-Klasse (Inc)	EUR	5.040	178	(89)	5.129

2. GEZEICHNETES KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Umlaufende Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	Im Berichtszeitraum ausgegebene Anteile	Im Berichtszeitraum zurückgenommene Anteile	Umlaufende Anteile am Ende des Berichtszeitraums
BNY Mellon Global Opportunistic Bond Fund**						
	A-Klasse^	USD	701.776	–	(701.776)	–
	C-Klasse^	USD	1.621.146	–	(1.621.146)	–
	H-Klasse (Hedged)^	EUR	324.356	–	(324.356)	–
	Sterling I (Acc) (Hedged)^	GBP	14.840.799	–	(14.840.799)	–
	W-Klasse (Acc)^	USD	5.000	–	(5.000)	–
	X-Klasse^	USD	4.427.495	–	(4.427.495)	–
BNY Mellon Global Opportunities Fund						
	A-Klasse	USD	4.594.194	719.693	(1.799.769)	3.514.118
	A-Klasse	EUR	8.302.239	1.083.049	(927.310)	8.457.978
	B-Klasse	USD	824.212	–	(21.205)	803.007
	C-Klasse	USD	725.758	–	(142.741)	583.017
	C-Klasse	EUR	1.808.355	24.522	(65.704)	1.767.173
	H-Klasse (Hedged)	EUR	371.472	32.271	(60.444)	343.299
	I-Klasse (Hedged)	EUR	3.190.683	558.411	(472.969)	3.276.125
	W-Klasse (Acc)	USD	351.844	79.957	(5.000)	426.801
	W-Klasse (Acc)	EUR	48.630	4.816	(48.630)	4.816
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)						
	A-Klasse	EUR	440.793.235	272.302.735	(202.963.669)	510.132.301
	A-Klasse (Inc)	EUR	16.698.694	660.576	(4.151.129)	13.208.141
	C-Klasse	EUR	141.294.989	31.115.297	(16.602.053)	155.808.233
	C-Klasse (Inc)	EUR	3.695.521	4.867.899	(932.199)	7.631.221
	G-Klasse (Acc)	EUR	5.180.981	2.674.559	(2.047.209)	5.808.331
	G-Klasse (Inc)	EUR	2.968.520	57.500	(120.560)	2.905.460
	H-Klasse (Acc) (Hedged)^	SGD	–	100.000	–	100.000
	W-Klasse	EUR	775.335.978	176.923.587	(167.466.366)	784.793.199
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	CHF	3.079.314	10.055	(105.435)	2.983.934
	X-Klasse	EUR	912.818.365	51.027.116	(39.019.973)	924.825.508
	Z-Klasse (Acc)	EUR	62.452.227	1.476.814	–	63.929.041
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)						
	Sterling B (Acc)	GBP	1.184.832	355.244	(328.695)	1.211.381
	Sterling B (Inc)	GBP	583.448	12.008	(181.424)	414.032
	Sterling C (Inc)	GBP	1.350.376	9.066	(989.314)	370.128
	Sterling W (Acc)	GBP	5.315.693	3.343.355	(866.657)	7.792.391
	Sterling W (Inc)	GBP	18.584.287	1.345.196	(2.365.241)	17.564.242
	Sterling X (Acc)	GBP	26.266.461	4.032.358	(3.637.640)	26.661.179
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)						
	A-Klasse	USD	57.871.106	5.449.770	(6.391.402)	56.929.474
	C-Klasse	USD	30.009.221	3.850.710	(6.946.321)	26.913.610
	C-Klasse (Inc)	USD	1.046.574	–	–	1.046.574
	G-Klasse (Acc)	USD	5.870.198	–	(5.861.698)	8.500
	W-Klasse (Acc)	USD	12.557.978	6.963.774	(1.422.318)	18.099.434
	W-Klasse (Inc)	USD	17.216.211	3.621.071	(4.806.271)	16.031.011
	X-Klasse	USD	100.331.750	1.404.657	(13.893.108)	87.843.299

2. GEZEICHNETES KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Umlaufende Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	Im Berichtszeitraum ausgegebene Anteile	Im Berichtszeitraum zurückgenommene Anteile	Umlaufende Anteile am Ende des Berichtszeitraums
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund						
	A-Klasse (Acc)	USD	4.234.324	5.037.344	(735.804)	8.535.864
	A-Klasse (Inc)	USD	618.421	216.820	(103.946)	731.295
	C-Klasse (Acc)	USD	16.323.653	3.434.457	(3.163.903)	16.594.207
	G-Klasse (Acc)^	USD	–	5.000	–	5.000
	G-Klasse (Inc)^	USD	5.149	241	(5.390)	–
	G-Klasse (Inc) (Hedged)^	EUR	103.065	4.902	(107.967)	–
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	77.076.605	25.079.656	(11.568.618)	90.587.643
	H-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	2.278.090	1.885.739	(93.182)	4.070.647
	I-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	17.798.788	2.825.150	(4.370.878)	16.253.060
	I-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	110.936	5.300.000	–	5.410.936
	W-Klasse (Acc)	USD	35.875.223	21.085.061	(10.422.527)	46.537.757
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	CHF	15.855.012	3.718.200	(62.912)	19.510.300
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	71.841.199	37.889.147	(24.605.259)	85.125.087
	W-Klasse (Inc)	USD	30.030.000	450.000	–	30.480.000
	W-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	5.374.760	25.353	(717.963)	4.682.150
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	7.288.144	1.960.867	(3.217.308)	6.031.703
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	453.020	518.742	(161.750)	810.012
	X-Klasse (Acc)	USD	11.448.893	–	–	11.448.893
	X-Klasse (Acc) (Hedged)^	EUR	–	6.307.787	–	6.307.787
	Sterling X (Acc) (Hedged)^	GBP	–	16.789.632	–	16.789.632
	Y-Klasse (Acc)	USD	264.596.439	13.840.680	(81.786.993)	196.650.126
	Sterling Y (Acc) (Hedged)	GBP	14.998.654	–	–	14.998.654
	Sterling Z (Acc) (Hedged)^	GBP	–	641.185	(9.434)	631.751
	Sterling Z (Inc) (Hedged)^	GBP	–	23.527.979	(273.368)	23.254.611
BNY Mellon Global Unconstrained Fund						
	W-Klasse (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	X-Klasse (Acc) (Hedged)	CAD	28.492.519	–	–	28.492.519
BNY Mellon Japan All Cap Equity Fund**						
	C-Klasse^	JPY	127.442	972	(128.414)	–
	H-Klasse (Hedged)^	EUR	77.065	–	(77.065)	–
	I-Klasse (Hedged)^	USD	2.089.342	–	(2.089.342)	–
	W-Klasse^	JPY	5.000	–	(5.000)	–
	Sterling W (Acc)^	GBP	7.922	–	(7.922)	–
	X-Klasse (Inc)^	JPY	6.466.818	–	(6.466.818)	–
BNY Mellon Japan REIT Alpha Fund**						
	C-Klasse (Acc)^	JPY	5.701	–	(5.701)	–
	W-Klasse (Inc)^	JPY	14.705.035	–	(14.705.035)	–
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund						
	A-Klasse (Acc)^	JPY	4.903	–	(4.903)	–
	A-Klasse (Acc)	EUR	20.084	106	(5.000)	15.190
	C-Klasse	JPY	853.959	1.973	(299.298)	556.634
	C-Klasse	USD	13.591.856	3.291	(13.591.856)	3.291
	C-Klasse (Acc)	EUR	1.355.000	5.809	(1.355.000)	5.809
	E-Klasse (Acc)	EUR	32.386	–	(5.000)	27.386

2. GEZEICHNETES KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Umlaufende Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	Im Berichtszeitraum ausgegebene Anteile	Im Berichtszeitraum zurückgenommene Anteile	Umlaufende Anteile am Ende des Berichtszeitraums
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Forts.						
	E-Klasse (Acc) (Hedged)	CHF	3.756.249	398.070	(102.842)	4.051.477
	E-Klasse (Acc) (Hedged)	USD	20.000.000	5.597.224	–	25.597.224
	G-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	1.189.549	248.685	(509.675)	928.559
	G-Klasse (Inc) (Hedged)^	EUR	2.269.000	–	(2.269.000)	–
	H-Klasse (Acc) (Hedged)^	NOK	–	88.000	–	88.000
	H-Klasse (Acc) (Hedged)^	SEK	–	97.000	–	97.000
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	SGD	1.376.499	86.682	(267.898)	1.195.283
	H-Klasse (Hedged)	EUR	9.797.941	353.090	(7.444.880)	2.706.151
	H-Klasse (Hedged)	USD	722.578	29.877	(63.433)	689.022
	I-Klasse (Hedged)	EUR	5.460.717	1.902.208	(1.805.419)	5.557.506
	I-Klasse (Hedged)	USD	56.244	525.729	(56.244)	525.729
	W-Klasse	JPY	27.879.218	1.760.460	(2.663.501)	26.976.177
	W-Klasse (Acc)	EUR	25.478.131	–	(5.000)	25.473.131
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	2.065.927	17.023	(1.509.419)	573.531
	W-Klasse (Acc) (Hedged)^	NOK	–	88.000	–	88.000
	W-Klasse (Acc) (Hedged)^	SEK	–	97.000	–	97.000
	Sterling W (Acc)	GBP	5.015.726	819.357	(1.991.757)	3.843.326
	Sterling W (Inc)	GBP	152.500	505.975	–	658.475
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund						
	A-Klasse	EUR	47.689.940	29.031.678	(13.000.170)	63.721.448
	A-Klasse	USD	29.430.916	4.538.659	(4.484.117)	29.485.458
	A-Klasse (Inc)	EUR	968.402	587.291	(83.172)	1.472.521
	Sterling A (Acc)	GBP	767.900	476.161	(192.520)	1.051.541
	B-Klasse	EUR	92.961	672.555	(95.483)	670.033
	B-Klasse	USD	1.840.429	2.368.061	(632.465)	3.576.025
	B-Klasse (Acc)	SGD	5.000	3.248.321	(123.599)	3.129.722
	B-Klasse (Inc)	SGD	5.000	–	–	5.000
	Sterling B (Inc)	GBP	265.658	2.086	(19.708)	248.036
	C-Klasse	EUR	40.940.930	36.131.036	(12.921.690)	64.150.276
	C-Klasse	USD	115.248.632	95.534.250	(12.641.378)	198.141.504
	G-Klasse (Acc)^	EUR	–	5.000	–	5.000
	H-Klasse (Acc) (Hedged)^	USD	100.000	–	(100.000)	–
	J-Klasse (Acc) (Hedged)	SGD	100.000	180.375	–	280.375
	S-Klasse	EUR	49.794.445	7.592.708	(2.748.082)	54.639.071
	S-Klasse (Acc)^	USD	30.397.956	–	(30.397.956)	–
	S-Klasse (Acc) 1^	USD	–	31.672.725	–	31.672.725
	W-Klasse	EUR	43.633.634	25.330.745	(4.683.037)	64.281.342
	W-Klasse	USD	29.775.849	6.590.386	(9.826.183)	26.540.052
	W-Klasse (Hedged)^	CHF	336.412	–	(336.412)	–
	W-Klasse (Hedged)	USD	430.493	290.409	(6.860)	714.042
	W-Klasse (Acc) (Hedged)^	SGD	–	100.000	–	100.000
	W-Klasse (Inc)	USD	16.670.856	7.573	(659.908)	16.018.521
	Sterling W (Acc)	GBP	9.099.548	2.800.734	(1.220.610)	10.679.672
	Sterling W (Inc)	GBP	1.843.780	26.106	(24.166)	1.845.720
	X-Klasse (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Sterling X	GBP	296.862.264	–	(1.935.947)	294.926.317

2. GEZEICHNETES KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Umlaufende Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	Im Berichtszeitraum ausgegebene Anteile	Im Berichtszeitraum zurückgenommene Anteile	Umlaufende Anteile am Ende des Berichtszeitraums
BNY Mellon Mobility Innovation Fund						
	A-Klasse (Acc)	USD	5.000	4.983.387	(42.213)	4.946.174
	A-Klasse (Acc)	EUR	5.000	1.549.589	(15.975)	1.538.614
	A-Klasse (Inc)	USD	5.000	157.072	(5.054)	157.018
	A-Klasse (Inc)	EUR	5.000	1.075.483	(24.483)	1.056.000
	B-Klasse (Acc)	USD	1.765.286	9.162.728	(1.445.454)	9.482.560
	C-Klasse (Inc)	EUR	5.000	1.115.000	–	1.120.000
	E-Klasse (Acc)	USD	6.974.431	12.540.668	(682.789)	18.832.310
	E-Klasse (Acc)	CHF	1.199.028	6.070.674	(316.561)	6.953.141
	E-Klasse (Acc)	EUR	759.604	2.673.004	(102.256)	3.330.352
	E-Klasse (Acc)	SGD	5.000	–	–	5.000
	E-Klasse (Acc) (Hedged)^	CHF	–	9.489.985	(43.300)	9.446.685
	E-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	1.232.073	8.206.665	(449.224)	8.989.514
	E-Klasse (Acc) (Hedged)	SGD	99.706	35.000	–	134.706
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	100.000	926.439	–	1.026.439
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	166.440	1.357.467	(156.215)	1.367.692
	H-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	100.000	10.764	–	110.764
	J-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	160.326	–	–	160.326
	K-Klasse (Acc)	USD	174.474	3.290.769	(76.500)	3.388.743
	K-Klasse (Acc) (Hedged)	CHF	334.021	1.697.464	(251.021)	1.780.464
	K-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	448.185	2.249.677	(175.000)	2.522.862
	K-Klasse (Acc) (Hedged)	SGD	100.000	–	–	100.000
	K-Klasse (Inc)	USD	5.000	238.359	(5.000)	238.359
	K-Klasse (Inc) (Hedged)	CHF	110.000	46.161	–	156.161
	K-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	142.000	106.770	–	248.770
	K-Klasse (Inc) (Hedged)	SGD	100.000	27.171	–	127.171
	Sterling K (Acc) (Hedged)	GBP	100.000	–	–	100.000
	Sterling K (Inc) (Hedged)	GBP	100.000	–	–	100.000
	W-Klasse (Acc)	USD	24.369.274	809.355	(6.495.168)	18.683.461
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	197.356	3.481.698	(92.504)	3.586.550
	W-Klasse (Inc)	USD	5.000	7	(3)	5.004
	W-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	100.000	160	(80)	100.080
BNY Mellon S&P 500® Index Tracker						
	A-Klasse	USD	9.384.050	177.142	(2.256.414)	7.304.778
	A-Klasse	EUR	1.682.321	323.054	(455.743)	1.549.632
	C-Klasse	USD	14.744.505	933.847	(1.718.840)	13.959.512
	C-Klasse	EUR	3.616.491	71.621	(131.572)	3.556.540
	G-Klasse (Acc)^	EUR	5.000	–	(5.000)	–
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund						
	A-Klasse	EUR	5.234.896	538.774	(1.298.251)	4.475.419
	A-Klasse	USD	63.689	13.130	(10.661)	66.158
	B-Klasse	EUR	20.243	115	(1.849)	18.509
	C-Klasse	EUR	6.543.602	1.737.717	(2.036.713)	6.244.606
	C-Klasse	USD	11.040.548	–	(11.020.761)	19.787
	W-Klasse (Acc)	EUR	13.010.249	–	(6.810.703)	6.199.546
	Sterling W (Acc)	GBP	30.165	3.127	(15.579)	17.713

2. GEZEICHNETES KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Umlaufende Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	Im Berichtszeitraum ausgegebene Anteile	Im Berichtszeitraum zurückgenommene Anteile	Umlaufende Anteile am Ende des Berichtszeitraums
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund*						
	A-Klasse (Acc)^	EUR	–	5.000	–	5.000
	A-Klasse (Inc)^	EUR	–	5.006	(3)	5.003
	C-Klasse (Acc)^	EUR	–	5.000	–	5.000
	E-Klasse (Acc)^	EUR	–	47.502.712	–	47.502.712
	G-Klasse (Acc)^	EUR	–	5.000	–	5.000
	H-Klasse (Acc) (Hedged)^	NOK	–	88.000	–	88.000
	W-Klasse (Acc)^	EUR	–	5.000	–	5.000
	W-Klasse (Acc) (Hedged)^	NOK	–	88.000	–	88.000
	X-Klasse (Acc)^	EUR	–	113.503.518	–	113.503.518
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund						
	A-Klasse (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	65.588.972	197.799	(66.573)	65.720.198
BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund						
	A-Klasse	USD	763.131	104.106	(86.184)	781.053
	A-Klasse	EUR	528.152	90.710	(50.080)	568.782
	B-Klasse	USD	94.858	–	–	94.858
	C-Klasse	USD	6.251.934	683.804	(1.245.868)	5.689.870
	C-Klasse	EUR	583	–	–	583
	W-Klasse (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund						
	A-Klasse (Acc)	EUR	18.406	–	(5.000)	13.406
	A-Klasse (Inc)^	EUR	5.186	125	(5.311)	–
	B-Klasse (Inc)^	USD	–	5.000	–	5.000
	C-Klasse (Acc)^	USD	5.000	–	(5.000)	–
	C-Klasse (Inc)	USD	908.914	–	–	908.914
	C-Klasse (Inc)^	EUR	5.185	125	(5.310)	–
	E-Klasse (Acc)	EUR	437.448	16.838	(13.489)	440.797
	E-Klasse (Inc)	USD	2.970.285	2.258.236	(114.275)	5.114.246
	E-Klasse (Inc)	EUR	423.310	–	(75.000)	348.310
	Sterling E (Acc)	GBP	50.068.254	11.580.511	(4.163.367)	57.485.398
	Sterling E (Inc)	GBP	170.420.572	23.410.674	(35.134.347)	158.696.899
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	1.120.050	698.815	(6.500)	1.812.365
	H-Klasse (Inc) (Hedged)^	EUR	103.704	2.553	(106.257)	–
	I-Klasse (Inc) (Hedged)^	EUR	103.695	2.547	(106.242)	–
	W-Klasse (Acc)	USD	20.696.236	327.477	(12.799)	21.010.914
	W-Klasse (Acc)^	EUR	–	10.731.922	(849.850)	9.882.072
	W-Klasse (Inc)	USD	4.755.189	500.064	(5.253)	5.250.000
	Sterling W (Inc)	GBP	24.005.169	473.445	(698.247)	23.780.367
BNY Mellon U.S. High Yield Beta Fund						
	A-Klasse (Inc)	USD	5.297	34.868	(682)	39.483
	A-Klasse (Inc)	EUR	10.784	3.586	(5.465)	8.905
	C-Klasse (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	C-Klasse (Acc)	EUR	5.000	–	–	5.000
	E-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	6.428.477	14.729.166	(560.200)	20.597.443
	Sterling E (Acc) (Hedged)^	GBP	–	212.536.219	(2.709)	212.533.510
	H-Klasse (Acc) (Hedged)^	EUR	–	100.000	–	100.000

2. GEZEICHNETES KAPITAL Forts.

EINLÖSBARE PARTIZIPIERENDE ANTEILE Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	Umlaufende Anteile zu Beginn des Berichtszeitraums	Im Berichtszeitraum ausgegebene Anteile	Im Berichtszeitraum zurückgenommene Anteile	Umlaufende Anteile am Ende des Berichtszeitraums
BNY Mellon U.S. High Yield Beta Fund Forts.						
	I-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	100.000	–	–	100.000
	I-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	106.183	6.911	(3.455)	109.639
	K-Klasse (Acc)	USD	5.000	47.587	–	52.587
	K-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	100.000	–	–	100.000
	L-Klasse (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	L-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	100.000	–	–	100.000
	Sterling L (Inc) (Hedged)	GBP	100.866	6.525	(3.263)	104.128
	W-Klasse (Acc)	USD	31.964.130	–	(18.071.106)	13.893.024
	W-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	106.182	6.909	(3.454)	109.637
	X-Klasse (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund						
	C-Klasse (Acc)	USD	142.904.417	12.511.171	(49.388.017)	106.027.571
	C-Klasse (Inc)^	EUR	5.220	208	(5.428)	–
	E-Klasse (Acc)	USD	21.706.258	1.500.000	(700.000)	22.506.258
	E-Klasse (Acc) (Hedged)	CHF	3.370.000	180.000	–	3.550.000
	E-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	10.034.788	–	(120.000)	9.914.788
	E-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	4.971.158	205.284	(102.642)	5.073.800
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	100.943	5.194.095	–	5.295.038
	H-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	130.742	14.976	(14.369)	131.349
	I-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	1.304.428	103.185	(1.308.740)	98.873
	W-Klasse (Acc)	USD	17.368.500	1.432.719	(7.467.719)	11.333.500
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	CHF	4.700.000	291.800	–	4.991.800
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	3.400.000	50.000	–	3.450.000
	W-Klasse (Inc)^	USD	–	450.000	–	450.000
	W-Klasse (Inc) (Hedged)^	CHF	–	6.574.781	–	6.574.781
	W-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	90.443.325	10.361.622	–	100.804.947
	Sterling W (Acc) (Hedged)^	GBP	100.000	–	(100.000)	–
	Sterling W (Inc) (Hedged)^	GBP	104.430	4.343	(108.773)	–
	X-Klasse (Acc)	USD	15.000.000	–	–	15.000.000
BNY Mellon U.S. Opportunistic Alpha Fund						
	A-Klasse (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	A-Klasse (Acc)	EUR	5.000	–	–	5.000
	C-Klasse (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	E-Klasse (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	E-Klasse (Inc)	USD	5.000	–	–	5.000
	G-Klasse (Acc)	USD	5.000	–	–	5.000
	W-Klasse (Acc)	USD	4.979.350	–	–	4.979.350
BNY Mellon US Opportunities Fund						
	A-Klasse	EUR	319.585	257.114	(318.563)	258.136
	A-Klasse (Inc)	EUR	10.527	–	(6.949)	3.578
	C-Klasse	USD	20.084.225	–	(20.042.033)	42.192
	C-Klasse	EUR	3.355	1.313.402	(1.311.452)	5.305
	W-Klasse (Acc)	USD	9.552.190	–	(5.000)	9.547.190

* Dieser Fonds wurde im Berichtszeitraum aufgelegt.

** Dieser Fonds wurde im Berichtszeitraum geschlossen.

^ Diese Anteilsklasse wurde im Berichtszeitraum aufgelegt oder geschlossen.

3. MANAGEMENT- UND ERFOLGSABHÄNGIGE GEBÜHREN

MANAGEMENTGEBÜHREN

Der Manager 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	Anteilsklasse	Satz
A-Klasse	0,40 % - 2,00 %	H-Klasse	0,40 % - 2,00 %	T-Klasse	0,20 % - 2,00 %
B-Klasse	0,75 % - 1,50 %	I-Klasse	0,30 % - 1,00 %	U-Klasse	0,20 % - 1,75 %
C-Klasse	0,30 % - 1,00 %	J-Klasse	1,25 % - 1,50 %	W-Klasse	0,20 % - 1,00 %
D-Klasse	0,50 % - 1,00 %	K-Klasse	0,30 % - 1,40 %	X-Klasse	entf.
E-Klasse	0,10 % - 1,50 %	L-Klasse	0,16 %	Y-Klasse	entf.
F-Klasse	0,10 % - 0,45 %	R-Klasse	0,60 % - 2,75 %	Z-Klasse	0,40 % - 0,65 %
G-Klasse	0,30 % - 1,00 %	S-Klasse	0,20 % - 2,00 %		

Die zugunsten der Verwaltungsgesellschaft aufgelaufenen Verwaltungsgebühren und die zum Ende des Berichtszeitraums fälligen Beträge sind unter den Posten „Verwaltungsgebühr“ und „Zahlbare Aufwendungen“ in der Gesamtergebnisrechnung bzw. in der Bilanz ausgewiesen.

PERFORMANCEGEBÜHREN

Neben der jährlichen Managementgebühr, hat der Manager bei bestimmten Anteilsklassen der folgenden Fonds Anspruch auf eine jährliche Performancegebühr (die „Performancegebühr“), wie in dem betreffenden Nachtrag zum Verkaufsprospekt erläutert. Nachstehende Tabelle führt die Sätze für die Performancegebühr und die Benchmark der jeweiligen Anteilsklasse auf:

Fonds	Referenzwert	Satz
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	3 Monat EURIBOR / USD LIBOR / GBP LIBOR / CHF LIBOR	Klassen D, R, S und T – 10,00 %
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund	1 Monat EURIBOR / USD LIBOR / GBP LIBOR / CHF LIBOR	Klassen D, R, S, T und U – 15,00 %
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund	1 Monat EURIBOR / GBP LIBOR / USD LIBOR / CHF LIBOR / JPY LIBOR	Klassen F, R, U und X – 15,00 %
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	S&P 500 Net Total Return Index gemessen in USD	U-Klasse – 10,00 %
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund	MSCI World Daily (mit reinvestierten Nettodividenden) in Euro/USD ausgedrückt	S-Klasse – 15,00 %

Die zugunsten der Verwaltungsgesellschaft aufgelaufenen Performancegebühren und die zum Ende des Berichtszeitraums fälligen Beträge sind unter den Posten „Performancegebühr“ und „Zahlbare Performancegebühren“ in der Gesamtergebnisrechnung bzw. in der Bilanz ausgewiesen.

4. VERWALTUNGSGEBÜHREN

Die Managementgesellschaft zahlt an BNY Mellon Fund Services (Ireland) Designated Activity Company (die „Verwaltungsgesellschaft“) aus dem Vermögen jedes Fonds eine Jahresgebühr, die täglich aufläuft und, wie im Prospekt angegeben, monatlich rückwirkend zu zahlen ist. Die zugunsten der Verwaltungsgesellschaft aufgelaufene jährliche Gebühr wird allen Anteilsklassen zugewiesen und stellt einen Abzug vom Nettoinventarwert des Fonds und somit jeder Klasse dar. Die zugunsten der Verwaltungsgesellschaft angefallenen Gebühren und die zum Ende des Berichtszeitraums fälligen Beträge sind unter den Posten „Betriebliche Aufwendungen“ und „Zahlbare Aufwendungen“ in der Gesamtergebnisrechnung bzw. in der Bilanz ausgewiesen.

5. DEPOTGEBÜHRE

Die Gesellschaft zahlt an die Depotbank aus dem Vermögen jedes Fonds eine Jahresgebühr, die täglich aufläuft und, wie im Prospekt angegeben, monatlich rückwirkend zu zahlen ist. Die zugunsten der Depotbank aufgelaufene jährliche Gebühr wird allen Anteilsklassen zugewiesen und stellt einen Abzug vom Nettoinventarwert des Fonds und somit jeder Klasse dar. Die zugunsten der Depotbank aufgelaufenen Gebühren und die zum Ende des Berichtszeitraums fälligen Beträge sind unter den Posten „Depotgebühr“ und „Zahlbare Aufwendungen“ in der Gesamtergebnisrechnung bzw. in der Bilanz ausgewiesen.

6. NACHLASS DER VERWALTUNGSGESELLSCHAFT

Um die Gesamtkostenquote („TER“) des betreffenden Fonds im Markt konkurrenzfähig zu halten, hat sich BNY Mellon Investment Management EMEA Limited und BNY Mellon Fund Management (Luxembourg) S.A. (die „Vertriebsgesellschaften“) verpflichtet, über den Manager eine Summe zu zahlen, die gegebenenfalls dem prozentualen Betrag entspricht, um den die TER des folgenden Fonds eine vereinbarte TER-Grenze überschreitet; diese ist als jährliche Verwaltungsgebühr („JVG“) mit Vereinbarung einer Obergrenze ausgewiesen:

Fonds	Vereinbarte TER-Grenze
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund (mit Höchstgrenze ab dem Auflegungsdatum 31. Mai 2019)	TER-Grenze AMC plus 15 Basispunkte
BNY Mellon Asia Rising Stars Fund	TER-Grenze AMC plus 50 Basispunkte
BNY Mellon Asian Income Fund	TER-Grenze AMC plus 9 Basispunkte
BNY Mellon Dynamic Total Return Fund	TER-Grenze AMC plus 22 Basispunkte ¹
BNY Mellon Digital Assets Fund (mit Höchstgrenze ab dem Auflegungsdatum am 19. Februar 2019)	TER-Grenze AMC plus 13 Basispunkte
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	TER-Grenze AMC plus 10 Basispunkte ²
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund (mit Höchstgrenze ab dem Auflegungsdatum am 10. März 2020)	TER-Grenze AMC plus 10 Basispunkte
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	TER-Grenze AMC plus 9,5 Basispunkte ⁹
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund	TER-Grenze AMC plus 17 Basispunkte ³
BNY Mellon Global Credit Fund⁴	
BNY Mellon Global Emerging Markets Fund	TER-Grenze AMC plus 30 Basispunkte
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund	TER-Grenze AMC plus 13 Basispunkte
BNY Mellon Global Leaders Fund	TER-Grenze AMC plus 15 Basispunkte
BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund	TER-Grenze AMC plus 12 Basispunkte
BNY Mellon Global Opportunistic Bond Fund (mit Höchstgrenze ab dem Auflösungsdatum am 7. März 2019)	TER-Grenze AMC plus 20 Basispunkte ⁵
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	TER-Grenze AMC plus 6 Basispunkte ⁶
BNY Mellon Global Unconstrained Fund	TER-Grenze AMC plus 15 Basispunkte ⁷
BNY Mellon Japan All Cap Equity Fund (mit Höchstgrenze ab dem Auflösungsdatum am 15. Februar 2019)	TER-Grenze AMC plus 17 Basispunkte
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	TER-Grenze AMC plus 17 Basispunkte
BNY Mellon Mobility Innovation Fund	TER-Grenze AMC plus 13 Basispunkte
BNY Mellon S&P 500[®] Index Tracker (mit Höchstgrenze vom 24. Juni 2020)	TER-Grenze AMC plus 10 Basispunkte
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund (mit Höchstgrenze ab dem Auflegungsdatum am 25. Februar 2019)	TER-Grenze AMC plus 13 Basispunkte ⁸
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR) (mit Höchstgrenze ab dem Auflegungsdatum am 6. Februar 2020)	TER-Grenze AMC plus 10 Basispunkte
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	TER-Grenze AMC plus 15 Basispunkte
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund	TER-Grenze AMC plus 15 Basispunkte
BNY Mellon U.S. Opportunistic Alpha Fund (mit Höchstgrenze bis zum Auflösungsdatum am 27. September 2019)	TER-Grenze AMC plus 13 Basispunkte ¹⁰
BNY Mellon US Opportunities Fund (mit Höchstgrenze ab dem Auflösungsdatum am 29. August 2019)	TER-Grenze AMC plus 16 Basispunkte

¹ Mit Ausnahme der Anteilsklasse USD X (Acc) und der Anteilsklasse USD X (Inc) mit einer TER-Grenze der JVG plus 17 Basispunkte.

² Mit Ausnahme der geschlossenen Anteilsklasse USD X (Acc) mit einer TER-Grenze der JVG plus 6 Basispunkte.

³ Mit Ausnahme der Anteilsklasse USD X (Acc) mit einer TER-Grenze der JVG plus 13 Basispunkte.

⁴ Anteilsklasse CAD X (Acc) (Hedged) und Anteilsklasse Sterling X (Acc) (Hedged) unterliegen einem TER-Limit von 10 Basispunkten und Anteilsklasse USD X (Acc) unterliegen einem TER-Limit der JVG plus 7 Basispunkte.

⁵ Mit Ausnahme der Anteilsklasse USD X mit einer TER-Grenze der JVG plus 15 Basispunkte.

⁶ Anzuwenden auf die Anteilsklasse Sterling Y (Acc) (Hedged) und Anteilsklasse USD Y (Acc).

⁷ Anzuwenden auf die Anteilsklasse CAD X (Acc) (Hedged).

⁸ Mit Ausnahme der Anteilsklasse EUR U (Acc) mit einer TER-Grenze der JVG plus 5 Basispunkte.

⁹ Mit Ausnahme der Anteilsklassen USD L (Acc), EUR L (Acc) (Hedged), Sterling L (Inc) (Hedged) und USD X (Acc), vorbehaltlich einer TER-Grenze der JVG plus 5,8 Basispunkte.

¹⁰ Anwendbar auf die Anteilsklassen USD A (Acc), EUR A (Acc), USD C (Acc), USD G (Acc) und USD W (Acc).

6. NACHLASS DER VERWALTUNGSGESELLSCHAFT Forts.

Der im Berichtszeitraum bis zum 30. Juni 2020 der Gesellschaft rückvergütete Betrag belief sich auf 410.168 USD (30. Juni 2019: USD 272.051).

7. BETRIEBLICHE AUFWENDUNGEN

Die in der Gesamtergebnisrechnung enthaltenen betrieblichen Aufwendungen beinhalten:

Aufwendung	30. Juni 2020 USD	30. Juni 2019 USD
Verwaltungsgebühren	4.527.622	4.384.263
Prüfungshonorar*	218.774	236.218
Vergütung der Verwaltungsratsmitglieder	39.936	45.883
Sonstige Aufwendungen	1.923.299	2.272.379
Summe der Betriebskosten	6.709.631	6.938.743

* Die Prüfungsgebühr entspricht im Hinblick auf die Prüfung des Abschlusses der an die Abschlussprüfer EY zu zahlenden Gebühr.

8. BARMITTEL UND BARGEGENWERTE

Die Barmittel der Gesellschaft sind bei The Bank of New York Mellon SA/NV, Dublin Branch hinterlegt und werden von den Kontrahenten (Bank of America Merrill Lynch, Barclays Bank PLC, BNP Paribas, Canadian Imperial Bank of Commerce, Citigroup Global Markets Limited, Credit Suisse AG, Goldman Sachs, HSBC Bank plc, JPMorgan Chase Bank, Lloyds Bank Plc, Morgan Stanley, Royal Bank of Canada, Royal Bank of Scotland, State Street Bank, Toronto Dominion Bank und UBS AG) in Bezug auf die erforderlichen Sicherheiten und Margenanforderungen gehalten. Barguthaben umfassen täglich in kurzfristige Anlageinstrumente investierte Barmittel.

Geldkontovereinbarungen wurden für die Fonds infolge der Einführung neuer Anforderungen für die Sammelkonten für Zeichnungs- und Rücknahmebeträge getroffen gemäß dem (Supervision and Enforcement) Act 2013 der irischen Zentralbank (Section 48(1)) Investor Money Regulations 2015 for Fund Service Providers („Investor Money Regulations“) getroffen.

Diese Geldkonten, die bei The Bank of New York Mellon SA/NV, London Branch (die „globale Unterdepotbank“) für den Einzug von Zeichnungen und Rücknahmezahlungen sowie für Ausschüttungen der Fonds gehalten werden, gelten als Vermögenswerte der Fonds. Die Guthaben auf diesen Geldkonten am 30. Juni 2020 und 31. Dezember 2019 werden als unerheblich im Hinblick auf den jeweiligen Fonds betrachtet, dem sie zufallen, mit Ausnahme von Barmittelguthaben zum 30. Juni 2020 in Höhe von 49.455 EUR für den BNY Mellon Absolute Insight Fund (am 1. Dezember 2017 geschlossen), in Höhe von 145.282 USD für den BNY Mellon Asian Equity Fund und in Höhe von 22.226 EUR für BNY Mellon Pan European Fund (am 9. März 2017 geschlossen). Das Barmittelguthaben für den BNY Mellon Asian Equity Fund wurde in der Bilanz zum 30. Juni 2020 in „Barmittel und Barmitteläquivalente“ angepasst.

9. BESTEUERUNG

Unter dem geltenden Recht und in der gängigen Praxis ist die Gesellschaft ein Anlageorganismus im Sinne der Definition in Section 739B des Tax Consolidation Acts von 1997 in seiner neuesten 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 Anteilinhaber oder Einlösungen, Rücknahmen, Annullierungen oder Übertragungen von Anteilen und das Halten von Anteilen am Ende jedes Achtjahreszeitraums ab dem Erwerb der Anteile.

9. BESTEUERUNG Forts.

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 seiner jeweils letzten Fassung bei der Gesellschaft vorliegen; oder die Gesellschaft von der irischen Steuerbehörde die Genehmigung erhalten hat, Bruttozahlungen zu leisten, sofern keine angemessenen Erklärungen vorliegen; und
- (b) bestimmte in Irland ansässige, ausgenommene Anleger, die der Gesellschaft die gesetzlich erforderlichen, unterzeichneten eidesstattlichen 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 Kapitalertragssteuer in Brasilien und Indien auf die realisierten und nicht realisierten Nettoanlageerträge periodengerecht ab. Am 30. Juni 2020 war in der Bilanz für den BNY Mellon Brazil Equity Fund eine offene Kapitalertragssteuer in Höhe von 2.360.662 USD (31. Dezember 2019: 5.339.693 USD) ausgewiesen. Für den BNY Mellon Global Emerging Markets Fund wurde eine erstattungsfähige Kapitalertragssteuer in Höhe von 44.734 USD verbucht und unter „Sonstige Forderungen“ in der Bilanz zum 31. Dezember 2019 ausgewiesen.

10. VERBUNDENE PARTEIEN

Nach Meinung des Verwaltungsrats sind der Manager und die Anlageverwalter Mellon Investments Corporation, Newton Investment Management Limited, Walter Scott & Partners Limited, ARX Investimentos Ltda, Insight Investment Management (Global) Limited, Alcentra NY, LLC, BNY Mellon Asset Management Japan Limited, Alcentra Limited; die Untereinlageverwalter Insight North America LLC und Maybank Asset Management Singapore Pte. LTD sowie die Vertriebsgesellschaften verbundene Parteien der Gesellschaft.

Die Verwaltungsgesellschaft zahlt von den von ihr erhaltenen Gebühren die Gebühren der Anlageverwalter den Vertriebsgesellschaften in Höhe eines zwischen den Parteien vereinbarten jährlichen Satzes. Die im Zusammenhang mit allen sonstigen wesentlichen Transaktionen mit verbundenen Parteien im Berichtszeitraum gezahlten Gebühren sind in der Gesamtergebnisrechnung sowie in der Erläuterung 3 Management und Performancegebühren, der Erläuterung 4 Verwaltungsgebühren, der Erläuterung 5 Depotgebühren, der Erläuterung 6 Nachlass der Verwaltungsgesellschaft und der Erläuterung 7 Betriebliche Aufwendungen zum Abschluss vollständig ausgewiesen.

Die Verwaltungsratsmitglieder sind verbundene Parteien der Gesellschaft.

Die folgenden Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft sind auch Mitglied des Verwaltungsrats von BNY Mellon Fund Management (Luxembourg) S.A. (der Manager):

- Greg Brisk
- David Dillon (Zurückgetreten am 30. Juni 2020)
- Gerald Rehn

Greg Brisk und Gerald Rehn sind ebenfalls Verwaltungsratsmitglieder von BNY Mellon Investment Management EMEA Limited.

Greg Brisk und Gerald Rehn haben auf ihr Recht verzichtet, eine Vergütung für ihre Dienste als Verwaltungsratsmitglieder zu beziehen. Die im Berichtszeitraum anfallende Vergütung der Verwaltungsratsmitglieder wird in Anmerkung 7 des Halbjahresabschlusses offengelegt.

10. VERBUNDENE PARTEIEN Forts.

Greg Brisk ist zudem Verwaltungsratsmitglied bei den Anlageverwaltern der Fonds:

- Alcentra Limited;
- Alcentra NY, LLC;
- Newton Investment Management Limited;
- Insight Investment Management (Global) Limited;
- Mellon Investments Corporation (Zurückgetreten am 31. Dezember 2019); und
- Insight North America LLC

Greg Brisk ist außerdem Mitglied des Verwaltungsrates von BNY Mellon Investment Management Seed Capital Limited, eine verbundene Konzerneinheit der Gesellschaft. Diese Konzerneinheiten hielten am 30. Juni 2020 und am 31. Dezember 2019 ein erhebliches wirtschaftliches Eigentum an den Anteilsklassen der nachstehend aufgeführten Fonds:

Name des Anlegers	Fonds	Basiswährung	30. Juni 2020	31. Dezember 2019
BNY Mellon Investment Management Seed Capital Limited	BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund	EUR	20.489.040	20.403.141
	BNY Mellon Digital Asset Fund	USD	5.777.947	5.672.586
	BNY Mellon Dynamic Total Return Fund	USD	149.134	159.062
	BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund*	USD	249.661	k. A.
	BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	USD	844.775	754.537
	BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund	USD	–	130.273
	BNY Mellon Global Emerging Markets Fund	USD	32.723	120.234
	BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund	USD	274.590	5.111.366
	BNY Mellon Global Leaders Fund	USD	37.981.656	38.299.555
	BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund	EUR	10.405.833	11.683.801
	BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	JPY	45.370.297	51.530.721
	BNY Mellon Mobility Innovation Fund	USD	346.174	13.115.325
	BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)*	EUR	14.697.283	k. A.
	BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund	USD	128.642	126.007

* Siehe Erläuterung 18 zum Halbjahresabschluss.

Folgende Fonds investieren in Organismen für gemeinsame Anlagen, die von ihren eigenen Anlageverwaltern verwaltet werden, sowie in andere Fonds der Gesellschaft.

Fonds	Organismus für gemeinsame Anlagen	Währung	30. Juni 2020	31. Dezember 2019
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	Insight Global Funds II plc – Insight Emerging Markets Debt Fund	EUR	k. A.	14.313.456
	Insight Liquidity Funds Plc – EUR Cash Fund	EUR	5.153.938	2.459.189
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund	Insight Liquidity Funds Plc – GBP Liquidity Fund	GBP	25.328.221	40.000.499
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund	Insight Liquidity Funds Plc – EUR Cash Fund	EUR	2.594.748	1.894.992
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund	Insight Liquidity Funds Plc – ILF USD Liquidity Fund	USD	28.701.024	17.201.452
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund	Insight Liquidity Funds Plc – ILF USD Liquidity Fund	USD	9.750.123	4.800.000
BNY Mellon Euroland Bond Fund	BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	EUR	4.806.138	10.147.971
	BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	EUR	2.235.100	5.280.175
	BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund	EUR	8.413.559	15.184.533
BNY Mellon European Credit Fund	BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	EUR	1.103.011	k. A.
	BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	EUR	1.853.328	2.877.327
	Insight Global Funds II plc – Insight Emerging Markets Debt Fund	EUR	k. A.	1.967.892
BNY Mellon Global Credit Fund	Insight Liquidity Funds Plc – ILF USD Liquidity Fund	USD	16.193.685	3.970.242
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	BNY Mellon Investments Funds – BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	USD	5.108.233	8.541.856
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	Insight Liquidity Funds Plc – ILF USD Liquidity Fund	USD	40.036.541	62.778.833

10. VERBUNDENE PARTEIEN Forts.

Mit Wirkung zum 1. März 2017 wurde Greg Brisk in den Verwaltungsrat von Insight Global Funds II plc und Insight Liquidity Funds plc berufen, in die einige Fonds der Gesellschaft investiert haben, wie in der obigen Tabelle ausführlich dargestellt.

Der BNY Mellon Asian Income Fund („Feederfonds“) wurde gemäß den Bestimmungen im Prospekt als Feederfonds aufgelegt, der in den Newton Asian Income Fund (der „Masterfonds“), einen Teilfonds von BNY Mellon Investment Funds, anlegt und von Newton Investment Management Limited verwaltet wird. Der Feederfonds investierte in die Anteilsklasse X des Masterfonds, der keine jährliche Managementgebühr berechnet. Die Jahres- und Halbjahresabschlüsse des Masterfonds werden auf der Website von BNY Mellon Investment Management EMEA Limited (www.bnymellonim.com) veröffentlicht. Wie in Anmerkung 19 ausgeführt, wurde der BNY Mellon Asian Income Fund mit Wirkung vom 28. August 2019 in einen eigenständigen Fonds umgewandelt.

Im Berichtszeitraum wurden von den Anlageverwaltern mit der Depotbank und den Anlageverwaltern verbundene Unternehmen zur Ausführung der Anlage- und Umrechnungstransaktionen 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 Gegenparteien bei Devisenterminkontrakten am Ende des Berichtszeitraums, die in den Aufstellung der Wertpapierbestände ausgewiesen sind. Die Gegenparteien wurden von den Anlageverwaltern ausgewählt und die Bedingungen dieser Transaktionen wurden von den Anlageverwaltern mit den entsprechenden Unternehmen ausgehandelt.

Die Verwaltungsgesellschaft besitzt 38.092 Zeichneranteile, wie in Erläuterung 2 des Abschlusses erläutert. Für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020 bzw. dem Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2019 gab es keine oberste beherrschende Partei der Gesellschaft.

11. VERRECHNUNGSPROVISION (SOFT COMMISSION) UND MAKLERDIENSTLEISTUNGSVEREINBARUNGEN

Im Berichtszeitraum trafen Mellon Investments Corporation und ARX Investimentos Ltda („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 Güter 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.

12. WECHSELKURSE

Der Rechnungsabschluss wird in US-Dollar (USD) erstellt. Folgende Wechselkurse wurden für die Umrechnung der auf Fremdwährungen lautenden Vermögenswerte und Verbindlichkeiten in USD verwendet:

Währung	30. Juni 2020	31. Dezember 2019
Argentinischer Peso	70,4576	59,8718
Australischer Dollar	1,4491	1,4250
Brasilianischer Real	5,4381	4,0227
Kanadischer Dollar	1,3576	1,2986
Chilenischer Peso	821,4000	751,9500
Chinesischer Yuan	7,0707	6,9615
Chinesischer Yuan Renminbi	7,0741	–
Kolumbianischer Peso	3.758,0000	3.287,2300

12. WECHSELKURSE Forts.

Währung	30. Juni 2020	31. Dezember 2019
Tschechische Krone	23,7232	22,6701
Dänische Krone	6,6325	6,6619
Dominikanischer Peso	58,4750	53,3600
Ägyptisches Pfund	16,1400	16,0500
Euro	0,8901	0,8915
Hongkong-Dollar	7,7505	7,7923
Ungarischer Forint	315,1848	295,0567
Indische Rupie	75,5038	71,3782
Indonesische Rupiah	14.285,0000	13.882,5000
Israelischer Schekel	3,4640	3,4533
Japanischer Yen	107,9750	108,6550
Kasachstanische Tenge	405,7300	382,9250
Koreanischer Won	1.202,8500	1.156,4500
Malaysischer Ringgit	4,2850	4,0905
Mexikanischer Peso	22,9845	18,9075
Neuseeländischer Dollar	1,5497	1,4854
Nigerianischer Naira	–	362,9200
Norwegische Krone	9,6253	8,7793
Peruanischer Nuevo Sol	3,5416	3,3130
Philippinischer Peso	49,8250	50,6450
Polnischer Zloty	3,9563	3,7939
Rumänischer Leu	4,3047	4,2686
Russischer Rubel	71,1675	62,0663
Singapur-Dollar	1,3936	1,3450
Südafrikanischer Rand	17,3525	14,0060
Srilankische Rupie	186,2000	181,3750
Sterling	0,8070	0,7549
Schwedische Krone	9,3182	9,3664
Schweizer Franken	0,9475	0,9678
Taiwanesischer Dollar	29,5045	29,9770
Thailändischer Baht	30,9075	29,9538
Türkische Lira	6,8535	5,9490
Ukrainian hryvnia	26,6950	–
Uruguayischer Peso	42,2000	37,4250

Bei der Erstellung der Bilanz wurden für die Konsolidierung der Abschlüsse der Fonds folgende Wechselkurse gegenüber dem US-Dollar verwendet:

	Schlusskurs		Durchschnittlicher Kurs	
	30. Juni 2020	31. Dezember 2019	30. Juni 2020	30. Juni 2019
Euro	0,8901	0,8915	0,9077	0,8854
Japanischer Yen	107,9750	108,6550	108,2854	110,0632
Sterling	0,8070	0,7549	0,7941	0,7729

13. EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT

Die Gesellschaft und jeder Fonds können für Anlagezwecke in Finanzderivate („FDI“) investieren, sofern dies in der jeweiligen Ergänzung zum Prospekt niedergelegt 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.

13. EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT Forts.

Zu solchen Anlagetechniken und -instrumenten zählen u.a. 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: Risikominderung, Kostensenkung ohne Erhöhung oder mit minimaler Erhöhung des Risikos oder Erwirtschaftung zusätzlichen Kapitals oder Einkommens ohne bzw. mit annehmbar geringem Risiko (im Verhältnis zum erwarteten Ertrag). Die Gesellschaft legt derzeit in die in der jeweiligen Aufstellung der Wertpapierbestände ausgewiesenen Futures, Optionen, Swaps, Devisenterminkontrakte und Genussscheine an Einzelheiten zu den am Ende des Berichtszeitraums offenen Transaktionen enthält die Aufstellung der Wertpapierbestände.

Die Gesellschaft hat mit der The Bank of New York Mellon, Niederlassung London, und der Depotbank 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 verbundenen Sicherheiten werden in Übereinstimmung mit den dreiseitigen und bilateralen Vereinbarungen abgewickelt und abgerechnet.

Die Gesellschaft verzeichnete im Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020 die in der nachfolgenden Tabelle aufgeführten Erträge aus Wertpapierleihe:

Fonds	Basiswährung	Bruttoertrag	Direkte Kosten (die an The Bank of New York Mellon SA/NV gezahlt wurden) (20 %)	Nettoertrag der Gesellschaft (80 %)^
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	EUR	16.444	(3.289)	13.155
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund	GBP	11.013	(2.202)	8.811
BNY Mellon Asia Rising Stars Fund	USD	8.587	(1.717)	6.870
BNY Mellon Asian Equity Fund	USD	10.761	(2.152)	8.609
BNY Mellon Dynamic Total Return Fund	USD	129	(26)	103
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	USD	5.195	(1.039)	4.156
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	USD	59.905	(11.981)	47.924
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund	USD	49.304	(9.860)	39.444
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	USD	2.285	(457)	1.828
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund	USD	3.621	(724)	2.897
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund	USD	1.208	(242)	966
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund	USD	5.186	(1.037)	4.149
BNY Mellon Euroland Bond Fund	EUR	69.370	(13.874)	55.496
BNY Mellon European Credit Fund	EUR	3.655	(731)	2.924
BNY Mellon Global Bond Fund	USD	70.516	(14.103)	56.413
BNY Mellon Global Credit Fund	USD	23.778	(4.756)	19.022
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	USD	66.003	(13.200)	52.803
BNY Mellon Global Emerging Markets Fund	USD	2.070	(414)	1.656
BNY Mellon Global Equity Fund	USD	36.018	(7.203)	28.815
BNY Mellon Global Equity Income Fund	USD	191.165	(38.233)	152.932
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	USD	9.756	(1.952)	7.804
BNY Mellon Global Leaders Fund	USD	4.276	(855)	3.421
BNY Mellon Global Opportunities Fund	USD	4.451	(890)	3.561
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	EUR	337.427	(67.486)	269.941
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	GBP	3.475	(695)	2.780
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	USD	14.462	(2.892)	11.570

13. EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT Forts.

Fonds	Basiswährung	Bruttoertrag	Direkte Kosten (die an The Bank of New York Mellon SA/NV gezahlt wurden) (20 %)	Nettoertrag der Gesellschaft (80 %)^
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	USD	192.380	(38.476)	153.904
BNY Mellon Global Unconstrained Fund	USD	1.515	(303)	1.212
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	JPY	37.571.831	(7.514.366)	30.057.465
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund	EUR	141.155	(28.231)	112.924
BNY Mellon S&P 500® Index Tracker	USD	1.280	(256)	1.024
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	EUR	36.714	(7.342)	29.372
BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund	USD	942	(189)	753
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	USD	3.657	(731)	2.926

^ Ausgewiesen als „Erträge aus Wertpapierleihgeschäften“ in der Gesamtergebnisrechnung.

Die Gesellschaft verzeichnete im Berichtszeitraum zum 30. Juni 2019 die in der nachfolgenden Tabelle aufgeführten Erträge aus Wertpapierleihe:

Fonds	Basiswährung	Bruttoertrag	Direkte Kosten (die an The Bank of New York Mellon SA/NV gezahlt wurden) (20 %)	Nettoertrag der Gesellschaft (80 %)^
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	EUR	69.553	(13.911)	55.642
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund	GBP	33.858	(6.772)	27.086
BNY Mellon Asia Rising Stars Fund	USD	4.237	(847)	3.390
BNY Mellon Asian Equity Fund	USD	477	(95)	382
BNY Mellon Dynamic Total Return Fund	USD	465	(93)	372
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	USD	5.544	(1.109)	4.435
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund	USD	43.147	(8.629)	34.518
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	USD	4.919	(984)	3.935
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund	USD	24.615	(4.923)	19.692
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund	USD	3.548	(710)	2.838
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund	USD	6.624	(1.325)	5.299
BNY Mellon Euroland Bond Fund	EUR	66.781	(13.356)	53.425
BNY Mellon European Credit Fund	EUR	756	(151)	605
BNY Mellon Global Bond Fund	USD	47.455	(9.491)	37.964
BNY Mellon Global Credit Fund	USD	18.370	(3.674)	14.696
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	USD	26.110	(5.222)	20.888
BNY Mellon Global Emerging Markets Fund	USD	50.116	(10.023)	40.093
BNY Mellon Global Equity Fund	USD	68.372	(13.675)	54.697
BNY Mellon Global Equity Income Fund	USD	181.965	(36.393)	145.572
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	USD	21.214	(4.243)	16.971
BNY Mellon Global Leaders Fund	USD	4.306	(861)	3.445
BNY Mellon Global Opportunistic Bond Fund*	USD	442	(88)	354
BNY Mellon Global Opportunities Fund	USD	6.793	(1.359)	5.434
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	EUR	348.104	(69.621)	278.483
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	GBP	3.640	(728)	2.912
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	USD	31.675	(6.335)	25.340
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	USD	185.484	(37.097)	148.387
BNY Mellon Global Unconstrained Fund	USD	2.286	(457)	1.829
BNY Mellon Japan All Cap Equity Fund*	JPY	150.435	(30.087)	120.348
BNY Mellon Japan REIT Alpha Fund*	JPY	54.290	(10.858)	43.432

13. EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT Forts.

Fonds	Basiswährung	Bruttoertrag	Direkte Kosten (die an The Bank of New York Mellon SA/NV gezahlt wurden) (20 %)	Nettoertrag der Gesellschaft (80%)^
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	JPY	26.045.930	(5.209.186)	20.836.744
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund	EUR	218.826	(43.765)	175.061
BNY Mellon S&P 500® Index Tracker	USD	17.499	(3.500)	13.999
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	EUR	30.977	(6.195)	24.782
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund	USD	2.329	(466)	1.863
BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund	USD	4.400	(880)	3.520
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	USD	15.849	(3.170)	12.679
BNY Mellon U.S. High Yield Beta Fund	USD	29.603	(5.921)	23.682
BNY Mellon US Opportunities Fund*	USD	4.355	(871)	3.484

* Dieser Fonds wurde im Berichtszeitraum geschlossen.

^ Ausgewiesen als „Erträge aus Wertpapierleihgeschäften“ in der Gesamtergebnisrechnung.

Der Wert der verliehenen Wertpapiere nach Kontrahenten sowie Wert und Art der von der Gesellschaft in Bezug auf diese Wertpapiere gehaltenen Sicherheiten stellte sich zum 30. Juni 2020 wie folgt dar:

Fonds	Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamtwert der verliehenen Wertpapiere am 30. Juni 2020	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten am 30. Juni 2020	Wert der Sicherheiten gemäß % der verliehenen Wertpapiere zum 30. Juni 2020
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund				EUR	EUR	%
	HSBC Bank plc	Großbritannien	Equity Indices	11.095.534	12.205.200	110,00 %
	J.P. Morgan Securities plc	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	2.048.137	2.131.028	104,05 %
	Morgan Stanley & Co. International PLC	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	1.933.935	2.100.274	108,60 %
	Societe Generale	Frankreich	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	652.413	688.943	105,60 %
	Credit Suisse Securities (Europe) Limited	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	542.832	571.311	105,25 %
	Deutsche Bank AG	Deutschland	G10 minus Belgium (Euroclear Triparty)	479.924	489.602	102,02 %
	Goldman Sachs International	USA	Government Debt & Supranationals (TriParty)	403.686	430.989	106,76 %
	BNP Paribas Arbitrage	Niederlande	Government Debt & Supranationals (TriParty)	383.580	403.310	105,14 %
	Deutsche Bank Securities Inc	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	380.010	393.056	103,43 %
	UBS AG	Schweiz	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	193.761	197.719	102,04 %
				18.113.812	19.611.432	108,27 %
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund				GBP	GBP	%
	Citigroup Global Markets Limited	Großbritannien	Equity Indices	19.799.302	21.780.433	110,01 %
			UK Gilts (Euroclear TriParty)	5.933.791	6.044.302	101,86 %
	Barclays Capital Securities Ltd.	Großbritannien	G10 Debt (TriParty)	314.660	361.810	114,98 %
	UBS AG	Schweiz	G10 Debt (TriParty)	160.513	184.054	114,67 %
			Equity Indices (TriParty)	77.090	93.842	121,73 %
	Morgan Stanley & Co. International PLC	Großbritannien	G10 Debt (TriParty)	9.316	9.862	105,87 %
	Merrill Lynch International	Großbritannien	G10 Debt (TriParty)	443	472	106,18 %
				26.295.115	28.474.775	108,29 %

13. EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT Forts.

Fonds	Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamtwert der verliehenen Wertpapiere am 30. Juni 2020	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten am 30. Juni 2020	Wert der Sicherheiten gemäß % der verliehenen Wertpapiere zum 30. Juni 2020
BNY Mellon Asia Rising Stars Fund				USD	USD	%
	Citigroup Global Markets Limited	Großbritannien	G10 Debt (TriParty)	134.489	141.346	105,10 %
			Equity Indices (TriParty)	42.566	47.157	110,79 %
	Credit Suisse Securities (Europe) Limited	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	30.447	33.604	110,37 %
	J.P. Morgan Securities plc	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	14.227	16.022	112,62 %
	Macquarie Bank Limited	Australien	Equity Indices (TriParty)	12.589	13.915	110,53 %
	UBS AG	Schweiz	Equity Indices (TriParty)	6.666	8.115	121,74 %
				240.984	260.159	107,96 %
BNY Mellon Asian Equity Fund				USD	USD	%
	UBS AG	Schweiz	Equity Indices (TriParty)	663.937	808.217	121,73 %
	Credit Suisse Securities (Europe) Limited	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	49.997	55.181	110,37 %
				713.934	863.398	120,94 %
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund				USD	USD	%
	MUFG Securities EMEA plc	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	4.235.274	4.658.994	110,00 %
	J.P. Morgan Securities LLC	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	2.487.916	2.538.312	102,03 %
	Citigroup Global Markets Limited	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	1.640.670	1.805.784	110,06 %
	Merrill Lynch International	Großbritannien	G10 Debt (TriParty)	991.539	1.053.154	106,21 %
	Credit Suisse Securities (USA) LLC	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	503.358	513.675	102,05 %
	Citigroup Global Markets Inc	Großbritannien	U.S. Government Debt (Bilateral)	35.427	36.666	103,50 %
	J.P. Morgan Securities plc	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	1.219	1.362	111,73 %
				9.895.403	10.607.947	107,20 %
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund				USD	USD	%
	Credit Suisse Securities (USA) LLC	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	2.016.947	2.058.285	102,05 %
	BNP Paribas	Frankreich	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	210.345	221.294	105,21 %
	J.P. Morgan Securities LLC	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	209.347	213.588	102,03 %
				2.436.639	2.493.167	102,32 %
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund				USD	USD	%
	Nomura Securities International Inc.	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	6.477.629	6.691.199	103,30 %
	Credit Suisse Securities (Europe) Limited	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	4.940.460	5.199.658	105,25 %
			G10 minus Belgium (Euroclear Triparty)	694.253	730.233	105,18 %
	Goldman Sachs International	USA	Government Debt & Supranationals (TriParty)	5.386.640	5.750.982	106,76 %
	Citigroup Global Markets Limited	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	4.909.072	5.166.356	105,24 %
	Barclays Bank PLC	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	4.015.782	4.245.680	105,72 %
	Morgan Stanley & Co. International PLC	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	1.723.736	1.899.769	110,21 %
	BNP Paribas	Frankreich	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	988.727	1.040.194	105,21 %
	Morgan Stanley & Co. LLC	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	734.287	757.997	103,23 %
				29.870.586	31.482.068	105,39 %

13. EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT Forts.

Fonds	Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamtwert der verliehenen Wertpapiere am 30. Juni 2020	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten am 30. Juni 2020	Wert der Sicherheiten gemäß % der verliehenen Wertpapiere zum 30. Juni 2020
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund				USD	USD	%
	Morgan Stanley & Co. International PLC	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	677.368	746.543	110,21 %
	Nomura Securities International Inc.	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	230.935	238.550	103,30 %
	BNP Paribas	Frankreich	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	187.161	196.903	105,21 %
				1.095.464	1.181.996	107,90 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund				USD	USD	%
	J.P. Morgan Securities plc	Großbritannien	G10 minus Belgium (Euroclear Triparty)	1.098.015	1.215.865	110,73 %
				1.098.015	1.215.865	110,73 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund				USD	USD	%
	BNP Paribas	Frankreich	G10 minus Belgium (Euroclear Triparty)	1.090.255	1.144.686	104,99 %
			Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	1.023.799	1.077.092	105,21 %
			G10 Debt (TriParty)	769.195	808.372	105,09 %
	Citigroup Global Markets Limited	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	1.325.553	1.395.025	105,24 %
	Credit Suisse Securities (USA) LLC	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	375.950	383.655	102,05 %
	Credit Suisse Securities (Europe) Limited	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	320.822	337.654	105,25 %
				4.905.574	5.146.484	104,91 %
BNY Mellon Euroland Bond Fund				EUR	EUR	%
	Merrill Lynch International	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	13.866.955	14.145.537	102,01 %
	J.P. Morgan Securities plc	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	12.575.539	13.084.490	104,05 %
			Government Debt & Supranationals (TriParty)	315.556	332.947	105,51 %
	Goldman Sachs International	USA	Government Debt & Supranationals (TriParty)	6.225.654	6.646.745	106,76 %
			Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	2.587.180	2.639.880	102,04 %
			G10 Debt (TriParty)	101.195	107.278	106,01 %
	Morgan Stanley & Co. International PLC	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	8.913.882	9.729.361	109,15 %
	BNP Paribas	Frankreich	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	3.834.141	3.911.276	102,01 %
			G10 minus Belgium (Euroclear Triparty)	1.483.729	1.514.286	102,06 %
	Citigroup Global Markets Limited	Großbritannien	G10 Debt (Euroclear TriParty)	3.778.456	3.854.679	102,02 %
			Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	197.602	201.558	102,00 %
	Barclays Bank PLC	Großbritannien	U.S. Government Debt (Bilateral)	1.860.548	1.920.428	103,22 %
			Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	1.620.685	1.713.466	105,72 %
	Deutsche Bank AG	Deutschland	G10 minus Belgium (Euroclear Triparty)	3.131.692	3.194.843	102,02 %
	RBC Europe Limited	Großbritannien	G10 minus Belgium (Euroclear Triparty)	1.619.969	1.703.303	105,14 %
	Societe Generale	Frankreich	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	742.865	757.740	102,00 %

13. EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT Forts.

Fonds	Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamtwert der verliehenen Wertpapiere am 30. Juni 2020	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten am 30. Juni 2020	Wert der Sicherheiten gemäß % der verliehenen Wertpapiere zum 30. Juni 2020
BNY Mellon Euroland Bond Fund Forts.				EUR	EUR	%
	The Bank of Nova Scotia	Kanada	Government Debt & Supranationals (TriParty)	566.490	594.829	105,00 %
	Nomura International PLC	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	257.151	262.306	102,00 %
	Citigroup Global Markets Inc	Großbritannien	U.S. Government Debt (Bilateral)	36.877	39.920	108,25 %
				63.716.166	66.354.872	104,14 %
BNY Mellon European Credit Fund				EUR	EUR	%
	Deutsche Bank AG	Deutschland	G10 minus Belgium (Euroclear Triparty)	909.563	927.904	102,02 %
	RBC Europe Limited	Großbritannien	G10 minus Belgium (Euroclear Triparty)	428.265	450.295	105,14 %
	BNP Paribas	Frankreich	G10 Debt (TriParty)	201.255	211.505	105,09 %
	Credit Suisse Securities (Europe) Limited	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	99.848	101.942	102,10 %
				1.638.931	1.691.646	103,22 %
BNY Mellon Global Bond Fund				USD	USD	%
	HSBC Bank plc	Großbritannien	Equity Indices	39.561.922	43.518.513	110,00 %
	Citigroup Global Markets Limited	Großbritannien	G10 Debt (TriParty)	9.967.029	10.462.753	104,97 %
			Equity Indices	8.905.326	9.796.398	110,01 %
	UBS AG	Schweiz	Equity Indices	16.295.712	17.926.932	110,01 %
	BNP Paribas	Frankreich	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	5.507.773	5.618.579	102,01 %
	Goldman Sachs International	USA	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	5.322.750	5.431.171	102,04 %
	Societe Generale	Frankreich	Equity/FTSE/S&P/NIKKEI	3.024.708	3.327.223	110,00 %
				88.585.220	96.081.569	108,46 %
BNY Mellon Global Credit Fund				USD	USD	%
	Deutsche Bank AG	Deutschland	G10 minus Belgium (Euroclear Triparty)	4.955.703	5.205.997	105,05 %
	Citigroup Global Markets Limited	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	1.991.254	2.031.130	102,00 %
	Morgan Stanley & Co. International PLC	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	1.983.356	2.185.902	110,21 %
	Credit Suisse Securities (Europe) Limited	Großbritannien	G10 Debt (TriParty)	1.159.010	1.219.458	105,22 %
	Societe Generale	Frankreich	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	780.118	823.799	105,60 %
	J.P. Morgan Securities plc	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	682.354	709.970	104,05 %
	Credit Suisse Securities (USA) LLC	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	21.617	22.060	102,05 %
				11.573.412	12.198.316	105,40 %
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund				USD	USD	%
	HSBC Bank plc	Großbritannien	Equity Indices	14.997.343	16.497.228	110,00 %
	Deutsche Bank AG	Deutschland	G10 minus Belgium (Euroclear Triparty)	2.635.032	2.688.168	102,02 %
			Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	1.595.369	1.629.213	102,12 %
	Societe Generale	Frankreich	Equity/FTSE/S&P/NIKKEI	913.940	1.005.348	110,00 %

13. EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT Forts.

Fonds	Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamtwert der verliehenen Wertpapiere am 30. Juni 2020	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten am 30. Juni 2020	Wert der Sicherheiten gemäß % der verliehenen Wertpapiere zum 30. Juni 2020
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund Forts.				USD	USD	%
	Citigroup Global Markets Limited	Großbritannien	G10 Debt (TriParty)	760.903	798.748	104,97 %
	Barclays Bank PLC	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	224.104	236.933	105,72 %
				21.126.691	22.855.638	108,18 %
BNY Mellon Global Emerging Markets Fund				USD	USD	%
	The Bank of Nova Scotia	Kanada	Equity Indices (TriParty)	1.055.077	1.163.359	110,26 %
	J.P. Morgan Securities plc	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	314.970	354.713	112,62 %
	UBS AG	Schweiz	Equity Indices (TriParty)	214.986	261.705	121,73 %
				1.585.033	1.779.777	112,29 %
BNY Mellon Global Equity Fund				USD	USD	%
	Citigroup Global Markets Limited	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	4.851.026	5.340.418	110,09 %
			G10 Debt (TriParty)	2.043.959	2.148.183	105,10 %
	Barclays Capital Securities Ltd.	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	3.419.629	3.932.817	115,01 %
	Societe Generale	Frankreich	Equity Indices (TriParty)	2.881.479	3.178.403	110,30 %
	J.P. Morgan Securities plc	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	1.933.865	2.177.884	112,62 %
	UBS AG	Schweiz	Equity Indices (TriParty)	1.324.915	1.612.832	121,73 %
	The Bank of Nova Scotia	Kanada	Equity Indices (TriParty)	1.032.305	1.138.250	110,26 %
	Credit Suisse Securities (Europe) Limited	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	325.979	359.780	110,37 %
				17.813.157	19.888.567	111,65 %
BNY Mellon Global Equity Income Fund				USD	USD	%
	BNP Paribas Arbitrage	Niederlande	Equity Indices (TriParty)	15.741.532	17.345.591	110,19 %
	Barclays Bank PLC	Großbritannien	U.S. Government Debt (Bilateral)	7.022.426	7.248.439	103,22 %
			Government Debt & Supranationals (TriParty)	4.496.546	4.785.021	106,42 %
				27.260.504	29.379.051	107,77 %
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund				USD	USD	%
	Barclays Bank PLC	Großbritannien	U.S. Government Debt (Bilateral)	2.396.373	2.473.499	103,22 %
			Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	462.154	471.447	102,01 %
	Credit Suisse Securities (Europe) Limited	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	608.262	621.019	102,10 %
	UBS AG	Schweiz	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	557.931	569.326	102,04 %
	Morgan Stanley & Co. International PLC	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	461.103	508.192	110,21 %
	Citigroup Global Markets Limited	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	409.599	431.066	105,24 %
	Societe Generale	Frankreich	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	299.425	305.420	102,00 %
	Credit Suisse Securities (USA) LLC	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	298.602	304.722	102,05 %
				5.493.449	5.684.691	103,48 %

13. EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT Forts.

Fonds	Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamtwert der verliehenen Wertpapiere am 30. Juni 2020	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten am 30. Juni 2020	Wert der Sicherheiten gemäß % der verliehenen Wertpapiere zum 30. Juni 2020
BNY Mellon Global Leaders Fund				USD	USD	%
	Citigroup Global Markets Limited	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	2.277.703	2.506.926	110,06 %
				2.277.703	2.506.926	110,06 %
BNY Mellon Global Opportunities Fund				USD	USD	%
	Barclays Capital Securities Ltd.	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	568.973	654.359	115,01 %
	The Bank of Nova Scotia	Kanada	Equity Indices (TriParty)	174.631	192.554	110,26 %
	Citigroup Global Markets Limited	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	170.300	188.661	110,78 %
	J.P. Morgan Securities plc	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	56.006	63.073	112,62 %
				969.910	1.098.647	113,27 %
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)				EUR	EUR	%
	Morgan Stanley & Co. International PLC	Großbritannien	G10 Debt (TriParty)	47.918.799	50.727.962	105,86 %
	Merrill Lynch International	Großbritannien	G10 Debt (TriParty)	32.330.951	34.339.998	106,21 %
	Citigroup Global Markets Limited	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	13.975.958	15.382.467	110,06 %
	BNP Paribas Arbitrage	Niederlande	Equity Indices (TriParty)	12.543.960	13.822.187	110,19 %
	Barclays Capital Securities Ltd.	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	12.358.211	14.212.822	115,01 %
	UBS AG	Schweiz	Equity Indices (TriParty)	5.158.560	6.279.566	121,73 %
	Deutsche Bank AG	Deutschland	G10 minus Belgium (Euroclear TriParty)	3.458.420	3.528.159	102,02 %
	Credit Suisse Securities (Europe) Limited	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	2.633.534	2.906.610	110,37 %
				130.378.393	141.199.771	108,30 %
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)				GBP	GBP	%
	The Bank of Nova Scotia	Kanada	Government Debt & Supranationals (TriParty)	999.965	1.049.990	105,00 %
	Barclays Capital Securities Ltd.	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	316.545	364.050	115,01 %
	Citigroup Global Markets Limited	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	292.080	321.475	110,06 %
	BNP Paribas Arbitrage	Niederlande	Equity Indices (TriParty)	290.746	320.373	110,19 %
	Credit Suisse Securities (Europe) Limited	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	181.563	200.390	110,37 %
				2.080.899	2.256.278	108,43 %
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)				USD	USD	%
	Citigroup Global Markets Limited	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	1.473.978	1.622.315	110,06 %
	BNP Paribas Arbitrage	Niederlande	Equity Indices (TriParty)	1.451.076	1.598.941	110,19 %
	Credit Suisse Securities (Europe) Limited	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	854.935	943.584	110,37 %
	Deutsche Bank AG	Deutschland	G10 minus Belgium (Euroclear TriParty)	369.120	376.564	102,02 %
				4.149.109	4.541.404	109,45 %
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund				USD	USD	%
	Credit Suisse Securities (Europe) Limited	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	12.148.175	12.768.201	105,10 %
			G10 minus Belgium (Euroclear TriParty)	2.561.792	2.694.556	105,18 %
	UBS AG	Schweiz	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	8.113.464	8.316.141	102,50 %
			Government Debt & Supranationals (TriParty)	1.650.805	1.733.399	105,00 %
	BNP Paribas Arbitrage	Niederlande	Government Debt & Supranationals (TriParty)	7.807.243	8.208.823	105,14 %

13. EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT Forts.

Fonds	Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamtwert der verliehenen Wertpapiere am 30. Juni 2020	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten am 30. Juni 2020	Wert der Sicherheiten gemäß % der verliehenen Wertpapiere zum 30. Juni 2020
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Forts.				USD	USD	%
	J.P. Morgan Securities plc	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	4.105.711	4.271.875	104,05 %
	Societe Generale	Frankreich	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	1.285.256	1.310.991	102,00 %
	Morgan Stanley & Co. International PLC	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	1.159.681	1.263.042	108,91 %
	BNP Paribas	Frankreich	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	481.434	506.495	105,21 %
			G10 Debt (TriParty)	477.496	501.815	105,09 %
	The Bank of Nova Scotia	Kanada	Government Debt & Supranationals (TriParty)	515.135	540.905	105,00 %
	RBC Europe Limited	Großbritannien	G10 minus Belgium (Euroclear Triparty)	317.258	333.578	105,14 %
				40.623.450	42.449.821	104,50 %
BNY Mellon Global Unconstrained Fund				USD	USD	%
	BNP Paribas	Frankreich	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	357.826	365.025	102,01 %
	Societe Generale	Frankreich	Equity/FTSE/S&P/NIKKEI	304.647	335.116	110,00 %
	J.P. Morgan Securities LLC	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	190.825	194.690	102,03 %
	The Bank of Nova Scotia	Kanada	Equity Indices (TriParty)	167.099	184.249	110,26 %
	J.P. Morgan Securities plc	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	154.980	174.536	112,62 %
				1.175.377	1.253.616	106,66 %
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund				JPY	JPY	%
	J.P. Morgan Securities plc	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	346.133.514	389.809.186	112,62 %
	UBS AG	Schweiz	Equity Indices (TriParty)	207.722.197	252.862.334	121,73 %
			G10 Debt (TriParty)	135.721.336	155.627.283	114,67 %
	Societe Generale	Frankreich	Equity Indices (TriParty)	123.417.153	136.134.772	110,30 %
	Citigroup Global Markets Limited	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	66.133.284	73.266.760	110,79 %
			G10 Debt (TriParty)	41.048.856	43.141.951	105,10 %
	Merrill Lynch International	Großbritannien	G10 Debt (TriParty)	87.099.761	92.512.116	106,21 %
	Morgan Stanley & Co. International PLC	Großbritannien	G10 Debt (TriParty)	63.362.537	67.077.093	105,86 %
	Deutsche Bank AG	Deutschland	Equity Indices (TriParty)	60.635.305	66.970.954	110,45 %
	Macquarie Bank Limited	Australien	Equity Indices (TriParty)	46.690.334	51.609.998	110,54 %
	The Bank of Nova Scotia	Kanada	Equity Indices (TriParty)	6.295.158	6.941.281	110,26 %
	Credit Suisse Securities (Europe) Limited	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	1.333.167	1.471.483	110,37 %
				1.185.592.602	1.337.425.211	112,81 %
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund				EUR	EUR	%
	Citigroup Global Markets Limited	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	25.755.525	28.347.504	110,06 %
	Morgan Stanley & Co. International PLC	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	5.904.680	6.682.104	113,17 %
	Goldman Sachs International	USA	G10 Debt (TriParty)	4.220.141	4.473.811	106,01 %
	HSBC Bank plc	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	3.719.466	4.119.790	110,76 %
			G10 Debt (TriParty)	203.365	213.614	105,04 %
	Deutsche Bank AG	Deutschland	Equity Indices (TriParty)	476.063	525.806	110,45 %
	Merrill Lynch International	Großbritannien	G10 Debt (TriParty)	35.505	37.709	106,21 %
				40.314.745	44.400.338	110,13 %

13. EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT Forts.

Fonds	Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamtwert der verliehenen Wertpapiere am 30. Juni 2020	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten am 30. Juni 2020	Wert der Sicherheiten gemäß % der verliehenen Wertpapiere zum 30. Juni 2020
BNY Mellon S&P 500® Index Tracker				USD	USD	%
	Barclays Bank PLC	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (TriParty)	487.241	518.500	106,42 %
	Citigroup Global Markets Limited	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	295.123	324.823	110,06 %
	J.P. Morgan Securities LLC	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	217.952	222.367	102,03 %
	Credit Suisse Securities (USA) LLC	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	96.030	97.998	102,05 %
	Barclays Capital Inc	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	66.238	67.578	102,02 %
	UBS AG	Schweiz	Equity Indices (TriParty)	27.483	33.455	121,73 %
			U.S. Government Debt (Bilateral)	1.617	1.734	107,24 %
	BofA Securities Inc.	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	15.200	15.506	102,01 %
	HSBC Bank plc	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	12.213	13.527	110,76 %
	Merrill Lynch International	Großbritannien	G10 Debt (TriParty)	5.805	6.166	106,22 %
	Morgan Stanley & Co. LLC	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	4.607	4.712	102,28 %
	Citigroup Global Markets Inc	Großbritannien	U.S. Government Debt (Bilateral)	2.015	2.086	103,52 %
				1.231.524	1.308.452	106,25 %
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund				EUR	EUR	%
	Goldman Sachs International	USA	G10 Debt (TriParty)	2.341.964	2.482.738	106,01 %
			Equity Indices (TriParty)	238.011	263.093	110,54 %
			Government Debt & Supranationals (TriParty)	50.401	53.810	106,76 %
	Citigroup Global Markets Limited	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	1.295.707	1.426.614	110,10 %
			G10 Debt (TriParty)	461.979	485.536	105,10 %
	HSBC Bank plc	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	1.354.959	1.500.792	110,76 %
			G10 Debt (TriParty)	164.588	172.883	105,04 %
	Morgan Stanley & Co. International PLC	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	468.793	530.515	113,17 %
			G10 Debt (TriParty)	95.529	101.129	105,86 %
	Credit Suisse Securities (Europe) Limited	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	219.355	242.100	110,37 %
			Government Debt & Supranationals (TriParty)	67.413	71.412	105,93 %
	Barclays Capital Securities Ltd.	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	111.363	128.075	115,01 %
			G10 Debt (TriParty)	102.520	117.882	114,98 %
	The Bank of Nova Scotia	Kanada	Equity Indices (TriParty)	132.906	146.546	110,26 %
	BNP Paribas Arbitrage	Niederlande	Equity Indices (TriParty)	105.658	116.425	110,19 %
	UBS AG	Schweiz	Equity Indices (TriParty)	16.186	19.703	121,73 %
	Societe Generale	Frankreich	Equity Indices (TriParty)	13.913	15.347	110,31 %
	Merrill Lynch International	Großbritannien	G10 Debt (TriParty)	13.769	14.622	106,21 %
				7.255.014	7.889.222	108,74 %
BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund				USD	USD	%
	J.P. Morgan Securities LLC	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	325.343	331.933	102,03 %
	UBS AG	Schweiz	Government Debt & Supranationals (TriParty)	35.079	36.834	105,00 %
	BofA Securities Inc.	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	21.745	22.181	102,01 %
				382.167	390.948	102,30 %

13. EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT Forts.

Fonds	Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamtwert der verliehenen Wertpapiere am 30. Juni 2020	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten am 30. Juni 2020	Wert der Sicherheiten gemäß % der verliehenen Wertpapiere zum 30. Juni 2020
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund				USD	USD	%
	J.P. Morgan Securities LLC	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	3.257.436	3.323.420	102,03 %
	TD Prime Services LLC	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	2.648.193	2.701.319	102,01 %
	HSBC Bank plc	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	235.250	260.570	110,76 %
	Credit Suisse Securities (USA) LLC	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	102.907	105.017	102,05 %
				6.243.786	6.390.326	102,35 %

Der Wert der verliehenen Wertpapiere nach Kontrahenten sowie Wert und Art der von der Gesellschaft in Bezug auf diese Wertpapiere gehaltenen Sicherheiten stellte sich zum 31. Dezember 2019 wie folgt dar:

Fonds	Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamtwert der verliehenen Wertpapiere am 31. Dezember 2019	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten am 31. Dezember 2019	Wert der Sicherheiten gemäß % der verliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2019
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund				EUR	EUR	%
	Barclays Bank PLC	Großbritannien	Equity/FTSE/S&P/NIKKEI	8.519.790	9.371.770	110,00 %
			G10 minus Belgium (Euroclear Triparty)	451.459	461.266	102,17 %
			Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	207.209	211.359	102,00 %
	Merrill Lynch International	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (TriParty)	1.550.404	1.630.987	105,20 %
	JP Morgan Securities, Plc.	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	1.398.658	1.457.965	104,24 %
	Morgan Stanley & Co. International PLC	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	1.293.724	1.430.837	110,60 %
	Goldman Sachs International	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (TriParty)	918.967	1.011.090	110,02 %
	Deutsche Bank, AG	Deutschland	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	732.126	810.315	110,68 %
	Citigroup Global Markets Limited	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	560.621	571.835	102,00 %
				15.632.958	16.957.424	108,47 %
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund				GBP	GBP	%
	Deutsche Bank, AG	Deutschland	Equity Indices (TriParty)	156.024	177.020	113,46 %
	Citigroup Global Markets Limited	Großbritannien	G10 Debt (TriParty)	18.177	19.610	107,89 %
	Merrill Lynch International	Großbritannien	G10 Debt (TriParty)	418	442	105,41 %
				174.619	197.072	112,86 %

13. EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT Forts.

				Wert der Sicherheiten gemäß %		
				Gesamtwert der verliehenen Wertpapiere am 31. Dezember 2019	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten am 31. Dezember 2019	der verliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2019
Fonds	Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit			
BNY Mellon Asia Rising Stars Fund				USD	USD	%
	UBS AG	Schweiz	Equity Indices (TriParty)	603.294	691.912	114,69 %
			G10 Debt (TriParty)	75.592	80.430	106,40 %
	JP Morgan Securities, Plc.	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	479.682	529.952	110,48 %
	Macquarie Bank Limited	Australien	G10 Debt (TriParty)	159.611	167.994	105,25 %
	Societe Generale	Frankreich	Equity Indices (TriParty)	114.292	132.152	115,63 %
	Citigroup Global Markets Limited	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	112.456	124.881	111,05 %
	Credit Suisse Securities (Europe) Limited	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	29.839	33.787	113,23 %
				1.574.766	1.761.108	111,83 %
BNY Mellon Asian Equity Fund				USD	USD	%
	JP Morgan Securities, Plc.	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	443.507	505.837	114,05 %
	Merrill Lynch International	Großbritannien	G10 Debt (TriParty)	179.193	188.836	105,38 %
	Barclays Capital Inc.	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	113.514	115.822	102,03 %
	Barclays Bank PLC	Großbritannien	U.S. Government Debt (Bilateral)	62.213	63.464	102,01 %
	UBS AG	Schweiz	G10 Debt (TriParty)	735	782	106,39 %
				799.162	874.741	109,46 %
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund				USD	USD	%
	MUFG Securities EMEA plc	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	1.799.882	1.979.918	110,00 %
	J.P. Morgan Securities LLC	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	1.691.092	1.725.165	102,01 %
	Credit Suisse Securities (USA) LLC	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	772.469	788.068	102,02 %
	Citigroup Global Markets Limited	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	453.721	499.276	110,04 %
	Merrill Lynch International	Großbritannien	G10 Debt (TriParty)	206.175	217.270	105,38 %
			Government Debt & Supranationals (TriParty)	89.563	94.219	105,20 %
	Citigroup Global Markets Inc.	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	263.846	271.415	102,87 %
	TD Prime Services LLC	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	149.730	152.725	102,00 %
	JP Morgan Securities, Plc.	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	67.488	76.973	114,05 %
				5.493.966	5.805.029	105,66 %
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund				USD	USD	%
	Credit Suisse Securities (USA) LLC	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	3.704.539	3.779.345	102,02 %
	J.P. Morgan Securities LLC	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	3.574.859	3.646.887	102,01 %
	Citigroup Global Markets Inc.	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	1.523.383	1.614.728	106,00 %
	BNP Paribas Securities Corp.	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	858.286	876.489	102,12 %
				9.661.067	9.917.449	102,65 %

13. EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT Forts.

				Wert der Sicherheiten gemäß % der verliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2019		
Fonds	Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamtwert der verliehenen Wertpapiere am 31. Dezember 2019	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten am 31. Dezember 2019	
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund				USD	USD	%
	Citigroup Global Markets Limited	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	6.917.926	7.086.780	102,44 %
	Barclays Bank PLC	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	2.326.668	2.448.063	105,22 %
	Deutsche Bank, AG	Deutschland	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	2.167.152	2.398.597	110,68 %
	Credit Suisse Securities (USA) LLC	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	2.012.079	2.052.710	102,02 %
	Credit Suisse Securities (Europe) Limited	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	1.539.937	1.616.789	104,99 %
			G10 minus Belgium (Euroclear Triparty)	444.279	466.734	105,05 %
	BNP Paribas Arbitrage	Frankreich	Government Debt & Supranationals (TriParty)	1.155.812	1.215.298	105,15 %
	Merrill Lynch International	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	489.834	514.389	105,01 %
				17.053.687	17.799.360	104,37 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund				USD	USD	%
	Deutsche Bank, AG	Deutschland	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	1.706.495	1.888.744	110,68 %
	Morgan Stanley & Co. LLC	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	442.109	451.373	102,10 %
	Morgan Stanley & Co. International PLC	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	373.676	413.279	110,60 %
	BNP Paribas	Frankreich	G10 minus Belgium (Euroclear Triparty)	235.197	247.044	105,04 %
	Merrill Lynch International	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	218.020	228.949	105,01 %
				2.975.497	3.229.389	108,53 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund				USD	USD	%
	Citigroup Global Markets Limited	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	1.380.239	1.448.534	104,95 %
	JP Morgan Securities, Plc.	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	684.685	755.281	110,31 %
	Goldman Sachs International	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (TriParty)	587.972	617.439	105,01 %
	Societe Generale	Frankreich	Equity/FTSE/S&P/NIKKEI	1.014	1.115	109,96 %
				2.653.910	2.822.369	106,35 %
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund				USD	USD	%
	Deutsche Bank, AG	Deutschland	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	1.075.785	1.190.675	110,68 %
	Credit Suisse Securities (Europe) Limited	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	178.710	187.629	104,99 %
	JP Morgan Securities, Plc.	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	162.273	179.005	110,31 %
				1.416.768	1.557.309	109,92 %

13. EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT Forts.

				Wert der Sicherheiten gemäß % der verliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2019		
Fonds	Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamtwert der verliehenen Wertpapiere am 31. Dezember 2019	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten am 31. Dezember 2019	
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund				USD	USD	%
	JP Morgan Securities, Plc.	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	604.385	666.701	110,31 %
	BNP Paribas	Frankreich	Government Debt & Supranationals (TriParty)	370.101	399.684	107,99 %
			Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	282.519	296.772	105,04 %
				1.257.005	1.363.157	108,44 %
BNY Mellon Euroland Bond Fund				EUR	EUR	%
	Goldman Sachs International	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (TriParty)	83.530.121	87.930.009	105,27 %
			Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	2.566.370	2.638.245	102,80 %
	RBC Europe Limited	Großbritannien	G10 minus Belgium (Euroclear Triparty)	22.464.042	23.525.667	104,73 %
	Citigroup Global Markets Limited	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	6.180.425	6.304.049	102,00 %
			Equity Indices	5.996.801	6.600.576	110,07 %
	Barclays Bank PLC	Großbritannien	G10 minus Belgium (Euroclear Triparty)	2.997.890	3.063.014	102,17 %
			Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	1.382.646	1.410.342	102,00 %
			U.S. Government Debt (Bilateral)	1.174.579	1.198.202	102,01 %
	Nomura International PLC	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	2.635.566	2.706.400	102,69 %
	Societe Generale	Frankreich	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	2.377.910	2.434.270	102,37 %
	Morgan Stanley & Co. International PLC	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	1.531.190	1.693.472	110,60 %
	JP Morgan Securities, Plc.	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	1.323.868	1.380.003	104,24 %
	Deutsche Bank, AG	Deutschland	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	1.323.709	1.465.077	110,68 %
	Credit Suisse Securities (USA) LLC	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	720.062	734.602	102,02 %
	Credit Suisse Securities (Europe) Limited	Großbritannien	G10 Debt (TriParty)	599.608	629.807	105,04 %
	UBS AG	Schweiz	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	221.639	226.579	102,23 %
				137.026.426	143.940.314	105,05 %
BNY Mellon European Credit Fund				EUR	EUR	%
	UBS AG	Schweiz	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	1.930.569	1.987.450	102,95 %
	Citigroup Global Markets Limited	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	448.134	457.098	102,00 %
	Deutsche Bank, AG	Deutschland	G10 minus Belgium (Euroclear Triparty)	409.722	417.981	102,02 %
				2.788.425	2.862.529	102,66 %

13. EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT Forts.

				Wert der Sicherheiten gemäß %		
				Gesamtwert der verliehenen Wertpapiere am 31. Dezember 2019	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten am 31. Dezember 2019	der verliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2019
Fonds	Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit			
BNY Mellon Global Bond Fund				USD	USD	%
	Citigroup Global Markets Limited	Großbritannien	UK Gilts (Euroclear TriParty)	15.597.896	15.869.528	101,74 %
			G10 minus Belgium (Euroclear Triparty)	2.439.315	2.559.839	104,94 %
	HSBC Bank plc	Großbritannien	Equity Indices	9.680.635	10.648.809	110,00 %
	BNP Paribas	Frankreich	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	5.658.334	5.772.198	102,01 %
	Morgan Stanley & Co. International PLC	Großbritannien	Equity Indices	4.301.319	4.731.563	110,00 %
	ING Bank NV	Niederlande	Government Debt & Supranationals (TriParty)	3.750.936	3.938.483	105,00 %
	Nomura International PLC	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	2.975.584	3.035.178	102,00 %
	Deutsche Bank, AG	Deutschland	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	2.869.611	3.176.077	110,68 %
	RBC Europe Limited	Großbritannien	G10 minus Belgium (Euroclear Triparty)	2.372.393	2.484.509	104,73 %
	Societe Generale	Frankreich	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	725.441	742.635	102,37 %
				50.371.464	52.958.819	105,14 %
BNY Mellon Global Credit Fund				USD	USD	%
	Deutsche Bank, AG	Deutschland	G10 minus Belgium (Euroclear TriParty)	6.779.662	6.916.305	102,02 %
			Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	4.763.963	5.158.759	108,29 %
	Credit Suisse Securities (Europe) Limited	Großbritannien	G10 Debt (TriParty)	3.290.255	3.455.966	105,04 %
	Citigroup Global Markets Limited	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	1.257.699	1.282.856	102,00 %
	Credit Suisse Securities (USA) LLC	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	1.141.133	1.164.176	102,02 %
	Morgan Stanley & Co. International PLC	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	473.749	507.793	107,19 %
	Deutsche Bank Securities Inc	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	146.484	150.877	103,00 %
				17.852.945	18.636.732	104,39 %
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund				USD	USD	%
	HSBC Bank plc	Großbritannien	Equity Indices	46.108.748	50.720.151	110,00 %
	Goldman Sachs International	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (TriParty)	898.631	988.715	110,02 %
	Citigroup Global Markets Limited	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	344.088	350.970	102,00 %
				47.351.467	52.059.836	109,94 %
BNY Mellon Global Emerging Markets Fund				USD	USD	%
	JP Morgan Securities, Plc.	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	354.803	404.667	114,05 %
	The Bank of Nova Scotia	Kanada	Equity Indices (TriParty)	207.554	228.478	110,08 %
	HSBC Bank plc	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	140.659	161.803	115,03 %
	Barclays Capital Inc.	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	100.537	102.581	102,03 %
	Barclays Bank PLC	Großbritannien	U.S. Government Debt (Bilateral)	69.250	70.643	102,01 %
	Merrill Lynch International	Großbritannien	G10 Debt (TriParty)	20.633	21.743	105,38 %
				893.436	989.915	110,80 %

13. EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT Forts.

Fonds	Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamtwert der verliehenen Wertpapiere am 31. Dezember 2019	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten am 31. Dezember 2019	Wert der Sicherheiten gemäß % der verliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2019
BNY Mellon Global Equity Fund				USD	USD	%
	BNP Paribas Arbitrage	Frankreich	Equity Indices (TriParty)	8.511.524	10.010.963	117,62 %
	Citigroup Global Markets Limited	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	3.035.464	3.370.850	111,05 %
	Barclays Capital Securities Ltd.	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	1.392.720	1.535.631	110,26 %
	Nomura International PLC	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	758.866	835.219	110,06 %
				13.698.574	15.752.663	114,99 %
BNY Mellon Global Equity Income Fund				USD	USD	%
	Morgan Stanley & Co. LLC	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	36.516.527	37.251.563	102,01 %
	BNP Paribas Arbitrage	Frankreich	Equity Indices (TriParty)	3.242.119	3.813.269	117,62 %
	J.P. Morgan Securities LLC	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	1.934.234	1.973.206	102,01 %
	Citigroup Global Markets Inc.	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	1.437.366	1.478.601	102,87 %
	UBS AG	Schweiz	Equity Indices (TriParty)	607.634	696.890	114,69 %
	Barclays Bank PLC	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (TriParty)	308.117	334.295	108,50 %
	Barclays Capital Securities Ltd.	Großbritannien	G10 Debt (TriParty)	116.859	122.730	105,02 %
				44.162.856	45.670.554	103,41 %
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund				USD	USD	%
	Barclays Bank PLC	Großbritannien	U.S. Government Debt (Bilateral)	2.587.751	2.639.795	102,01 %
	Credit Suisse Securities (USA) LLC	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	1.937.867	1.976.999	102,02 %
	Morgan Stanley & Co. International PLC	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	942.464	1.042.350	110,60 %
	Goldman Sachs International	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (TriParty)	714.802	786.458	110,02 %
	Goldman Sachs & Company	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	464.382	487.334	104,94 %
	Credit Suisse Securities (Europe) Limited	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	309.830	316.058	102,01 %
	UBS AG	Schweiz	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	223.958	228.949	102,23 %
				7.181.054	7.477.943	104,13 %
BNY Mellon Global Opportunities Fund				USD	USD	%
	BNP Paribas Arbitrage	Frankreich	Equity Indices (TriParty)	1.222.204	1.437.514	117,62 %
	Barclays Capital Securities Ltd.	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	665.146	733.399	110,26 %
	Barclays Bank PLC	Großbritannien	Equity/FTSE/S&P/NIKKEI	643.937	708.330	110,00 %
				2.531.287	2.879.243	113,75 %

13. EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT Forts.

				der Sicherheiten		
				Gesamtwert der verliehenen Wertpapiere am 31. Dezember 2019	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten am 31. Dezember 2019	gemäß % der verliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2019
Fonds	Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit			
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)				EUR	EUR	%
	Barclays Bank PLC	Großbritannien	Equity/FTSE/S&P/NIKKEI	155.988.333	171.587.183	110,00 %
			G10 minus Belgium (Euroclear Triparty)	176.398	185.476	105,15 %
	JP Morgan Securities, Plc.	Großbritannien	G10 Debt (Euroclear TriParty)	3.075.850	3.200.983	104,07 %
			Government Debt & Supranationals (TriParty)	2.062.519	2.227.381	107,99 %
	BNP Paribas	Frankreich	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	3.061.230	3.122.832	102,01 %
	BNP Paribas Arbitrage	Frankreich	Equity Indices (TriParty)	1.389.791	1.634.624	117,62 %
	Deutsche Bank, AG	Deutschland	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	1.031.260	1.054.856	102,29 %
				166.785.381	183.013.335	109,73 %
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)				GBP	GBP	%
	JP Morgan Securities, Plc.	Großbritannien	G10 minus Belgium (Euroclear Triparty)	3.597.669	3.965.135	110,21 %
	BNP Paribas Arbitrage	Frankreich	Equity Indices (TriParty)	411.702	484.229	117,62 %
				4.009.371	4.449.364	110,97 %
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)				USD	USD	%
	BNP Paribas Arbitrage	Frankreich	Equity Indices (TriParty)	2.060.176	2.423.108	117,62 %
	JP Morgan Securities, Plc.	Großbritannien	G10 Debt (Euroclear TriParty)	311.602	324.279	104,07 %
	BNP Paribas	Frankreich	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	310.458	316.705	102,01 %
				2.682.236	3.064.092	114,24 %
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund				USD	USD	%
	Barclays Capital Inc.	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	11.904.028	12.146.021	102,03 %
	Credit Suisse Securities (Europe) Limited	Großbritannien	G10 minus Belgium (Euroclear Triparty)	11.029.688	11.587.163	105,05 %
			Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	8.365.814	8.747.431	104,56 %
	Morgan Stanley & Co. International PLC	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	6.699.772	7.409.839	110,60 %
	BNP Paribas Arbitrage	Frankreich	Government Debt & Supranationals (TriParty)	5.858.100	6.159.601	105,15 %
	UBS AG	Schweiz	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	3.655.997	3.896.101	106,57 %
	J.P. Morgan Securities LLC	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	1.711.217	1.745.696	102,01 %
	Citigroup Global Markets Limited	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (Euroclear TriParty)	887.278	931.181	104,95 %
	BNP Paribas	Frankreich	G10 minus Belgium (Euroclear Triparty)	796.454	836.574	105,04 %
	Morgan Stanley & Co. LLC	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	512.440	523.178	102,10 %
	UBS AG	Schweiz	Government Debt & Supranationals (TriParty)	351.486	371.420	105,67 %
	Goldman Sachs & Company	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	188.308	197.615	104,94 %
				51.960.582	54.551.820	104,99 %

13. EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT Forts.

Fonds	Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	Gesamtwert	Gesamtwert	Wert
				der verliehenen	der gehaltenen	der Sicherheiten
				Wertpapiere	Sicherheiten	gemäß %
				am 31. Dezember	am 31. Dezember	zum 31. Dezember
				2019	2019	2019
				USD	USD	%
BNY Mellon Global Unconstrained Fund						
	BNP Paribas Arbitrage	Frankreich	Equity Indices (TriParty)	425.671	500.660	117,62 %
	JP Morgan Securities, Plc.	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	163.757	180.918	110,48 %
				589.428	681.578	115,63 %
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund				JPY	JPY	%
	Merrill Lynch International	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	397.488.023	425.884.681	107,14 %
			G10 Debt (TriParty)	166.853.226	175.832.149	105,38 %
	UBS AG	Schweiz	Equity Indices (TriParty)	287.773.419	330.044.669	114,69 %
			G10 Debt (TriParty)	75.662.996	80.505.423	106,40 %
	Macquarie Bank Limited	Australien	Equity Indices (TriParty)	270.976.986	317.684.511	117,24 %
	Deutsche Bank, AG	Deutschland	Equity Indices (TriParty)	92.676.304	105.147.943	113,46 %
	JP Morgan Securities, Plc.	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	76.227.024	84.215.557	110,48 %
	Credit Suisse Securities (Europe) Limited	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	37.321.797	42.260.167	113,23 %
	Citigroup Global Markets Limited	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	28.866.700	32.056.159	111,05 %
	Morgan Stanley & Co. International PLC	Großbritannien	G10 Debt (TriParty)	9.381.382	9.928.133	105,83 %
				1.443.227.857	1.603.559.392	111,11 %
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund				EUR	EUR	%
	BNP Paribas Arbitrage	Frankreich	Equity Indices (TriParty)	16.887.049	19.861.967	117,62 %
	Morgan Stanley & Co. LLC	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	13.618.157	13.892.275	102,01 %
	J.P. Morgan Securities LLC	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	11.230.226	11.456.497	102,01 %
	HSBC Bank plc	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	10.629.562	12.227.443	115,03 %
			G10 Debt (TriParty)	229.229	261.934	114,27 %
	Goldman Sachs International	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (TriParty)	7.071.959	7.780.891	110,02 %
	Credit Suisse Securities (USA) LLC	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	4.619.936	4.713.228	102,02 %
	UBS AG	Schweiz	Equity Indices (TriParty)	2.170.989	2.489.888	114,69 %
	Deutsche Bank, AG	Deutschland	Equity Indices (TriParty)	342.649	388.760	113,46 %
	Merrill Lynch International	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (TriParty)	204.904	215.552	105,20 %
				67.004.660	73.288.435	109,38 %
BNY Mellon S&P 500® Index Tracker				USD	USD	%
	Barclays Bank PLC	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (TriParty)	654.283	709.873	108,50 %
			U.S. Government Debt (Bilateral)	2.760	2.815	101,99 %
	Morgan Stanley & Co. LLC	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	629.305	641.972	102,01 %
	J.P. Morgan Securities LLC	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	391.143	399.024	102,01 %
	Citigroup Global Markets Limited	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	246.453	271.198	110,04 %
	UBS AG	Schweiz	Equity Indices (TriParty)	86.558	99.273	114,69 %
	Citigroup Global Markets Inc.	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	85.833	88.296	102,87 %
	Credit Suisse Securities (USA) LLC	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	70.193	71.610	102,02 %
	HSBC Bank plc	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	49.911	57.414	115,03 %
			G10 Debt (TriParty)	12.322	14.080	114,27 %
	Merrill Lynch International	Großbritannien	G10 Debt (TriParty)	60.582	63.843	105,38 %
	TD Prime Services LLC	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	43.068	43.929	102,00 %

13. EFFIZIENTES PORTFOLIOMANAGEMENT Forts.

				Wert der Sicherheiten gemäß %		
				Gesamtwert der verliehenen Wertpapiere am 31. Dezember 2019	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten am 31. Dezember 2019	Gesamtwert der verliehenen Wertpapiere zum 31. Dezember 2019
Fonds	Kontrahent	Gründungsland	Art der Sicherheit	USD	USD	%
BNY Mellon S&P 500® Index Tracker Forts.						
	BofAML Securities, Inc.	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	34.017	34.698	102,00 %
	Barclays Capital Inc.	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	14.057	14.343	102,03 %
	UBS Securities, LLC	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	9.335	9.522	102,00 %
				2.389.820	2.521.890	105,53 %
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund						
	Goldman Sachs International	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	2.172.068	2.691.035	123,89 %
			Government Debt & Supranationals (TriParty)	540.253	594.411	110,02 %
			G10 Debt (TriParty)	246.612	267.228	108,36 %
	BNP Paribas Arbitrage	Frankreich	G10 Debt (TriParty)	1.534.088	1.646.199	107,31 %
			Equity Indices (TriParty)	987.640	1.161.628	117,62 %
	HSBC Bank plc	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	1.478.645	1.700.922	115,03 %
			G10 Debt (TriParty)	231.689	264.744	114,27 %
	Citigroup Global Markets Limited	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	910.966	1.005.818	110,41 %
	The Bank of Nova Scotia	Kanada	Equity Indices (TriParty)	893.714	983.810	110,08 %
	Deutsche Bank, AG	Deutschland	G10 Debt (TriParty)	396.248	430.704	108,70 %
			Equity Indices (TriParty)	249.172	282.704	113,46 %
	UBS AG	Schweiz	Equity Indices (TriParty)	587.475	673.770	114,69 %
	Barclays Capital Securities Ltd.	Großbritannien	G10 Debt (TriParty)	185.984	195.328	105,02 %
			Equity Indices (TriParty)	52.249	57.611	110,26 %
	Credit Suisse Securities (Europe) Limited	Großbritannien	Equity Indices (TriParty)	193.613	219.232	113,23 %
	Morgan Stanley & Co. International PLC	Großbritannien	G10 Debt (TriParty)	61.519	65.105	105,83 %
	Societe Generale	Frankreich	Equity Indices (TriParty)	3.958	4.577	115,63 %
				10.725.893	12.244.826	114,16 %
BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund						
	Barclays Bank PLC	Großbritannien	Government Debt & Supranationals (TriParty)	879.251	953.955	108,50 %
	J.P. Morgan Securities LLC	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	631.070	643.784	102,01 %
	BofAML Securities, Inc.	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	68.769	70.146	102,00 %
	UBS AG	Schweiz	Government Debt & Supranationals (TriParty)	27.192	28.735	105,67 %
	Morgan Stanley & Co. LLC	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	3.398	3.467	102,03 %
				1.609.680	1.700.087	105,62 %
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund						
	J.P. Morgan Securities LLC	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	2.633.135	2.686.188	102,01 %
	UBS AG	Schweiz	Equity Indices (TriParty)	272.262	312.255	114,69 %
	Credit Suisse Securities (USA) LLC	USA	U.S. Government Debt (Bilateral)	25.045	25.550	102,02 %
				2.930.442	3.023.993	103,19 %

14. NETTOINVENTARWERT

Der Nettoinventarwert jeder Anteilsklasse einlösbarer partizipierender Anteile wird errechnet, indem das Nettovermögen der Anteilsklasse durch die Anzahl der partizipierenden Anteile geteilt wird, die zum Ende des Berichtszeitraums in Umlauf sind.

Der veröffentlichte Nettoinventarwert jeder Klasse einlösbarer partizipierender Anteile beträgt wie folgt:

Fonds	Anteilsklasse	Währung	30. Juni 2020	31. Dezember 2019	30. Juni 2019
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund					
Summe der Nettovermögen		EUR	316.520.163	397.342.232	584.469.702
Nettoinventarwert zum:	C-Klasse	EUR	97,8164	99,6501	97,8252
	C-Klasse (Inc)	EUR	92,6095	94,9534	93,9367
	D-Klasse (Acc)^	EUR	–	100,3946	–
	R-Klasse	EUR	96,2751	98,2485	96,6054
	R-Klasse (Hedged)	USD	104,7863	105,9570	102,7268
	R-Klasse (Inc)	EUR	93,5544	95,9159	94,8895
	S-Klasse	EUR	102,9332	104,7596	102,7496
	S-Klasse (Inc)^	EUR	–	95,5533	94,5427
	T-Klasse (Hedged)	CHF	92,5329	94,4518	92,8976
	T-Klasse (Hedged)	USD	114,6803	115,6893	111,8678
	Sterling T (Acc) (Hedged)	GBP	109,2396	111,0150	108,2567
	W-Klasse (Acc)	EUR	93,3637	95,2036	93,5077
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	USD	100,7650	101,7687	98,5345
	W-Klasse (Inc) (Hedged)^	USD	–	99,7297	97,2566
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	98,1865	99,9024	97,5445
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	94,6290	96,8591	95,2733
	X-Klasse	EUR	109,3680	111,0339	108,6177
	X-Klasse (Acc) (Hedged)^	USD	–	105,1359	101,4000
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	115,7731	117,3278	114,0972
	Z-Klasse (Acc)	EUR	–	–	93,2000
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund					
Summe der Nettovermögen		GBP	271.926.066	371.503.339	798.337.871
Nettoinventarwert zum:	D-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	0,9155	0,9195	0,9297
	R-Klasse (Hedged)	CHF	0,8745	0,8828	0,8969
	R-Klasse (Hedged)	EUR	1,0372	1,0442	1,0585
	R-Klasse (Hedged)	USD	1,0425	1,0406	1,0396
	R-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	0,9040	0,9101	0,9224
	Sterling R (Acc)	GBP	1,1108	1,1129	1,1210
	Sterling S (Acc)	GBP	1,1628	1,1621	1,1676
	T-Klasse (Hedged)	EUR	1,0845	1,0892	1,1012
	T-Klasse (Hedged)	USD	1,0796	1,0739	1,0700
	U-Klasse (Hedged)	EUR	0,9649	0,9684	0,9783
	U-Klasse (Hedged)	USD	1,0667	1,0614	1,0568
	Class U (Inc) (Hedged)	EUR	0,9230	0,9186	0,9285
	Sterling U (Acc)	GBP	1,1730	1,1714	1,1761
	Sterling X (Acc)	GBP	1,3180	1,3103	1,3096
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund					
Summe der Nettovermögen		EUR	28.570.632	28.390.201	20.085.555
Nettoinventarwert zum:	F-Klasse (Acc) (Hedged)	USD	1,0291	1,0097	–
	Sterling F (Acc) (Hedged)	GBP	1,0198	1,0038	–
	U-Klasse (Acc)	EUR	1,0249	1,0142	1,0044
	U-Klasse (Acc) (Hedged)^	USD	1,0189	–	–

14. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	30. Juni 2020	31. Dezember 2019	30. Juni 2019
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund Forts.					
Nettoinventarwert zum:	Sterling U (Acc) (Hedged)^	GBP	–	1,0208	1,0056
	X-Klasse (Acc)	EUR	1,0377	1,0213	1,0057
BNY Mellon Asia Rising Stars Fund					
Summe der Nettovermögen		USD	7.333.756	8.283.563	7.817.482
Nettoinventarwert zum:	A-Klasse (Acc)	USD	1,1702	1,2700	1,1964
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	SGD	1,1299	1,2346	1,1668
	W-Klasse (Acc)	USD	1,2024	1,2997	1,2195
	X-Klasse (Acc)	USD	1,0168	1,0953	1,0236
BNY Mellon Asian Equity Fund					
Summe der Nettovermögen		USD	38.538.656	38.173.739	36.929.042
Nettoinventarwert zum:	A-Klasse	USD	3,8366	3,6442	3,2505
	A-Klasse	EUR	3,0156	2,8596	2,5159
	B-Klasse	USD	4,1589	3,9405	3,5058
	B-Klasse	EUR	1,5822	1,4966	1,3134
	C-Klasse	USD	4,7300	4,4703	3,9671
	C-Klasse	EUR	3,1457	2,9682	2,5981
	Sterling C (Inc)	GBP	3,4322	3,0133	2,7841
	W-Klasse	USD	1,3247	1,2505	1,1083
BNY Mellon Asian Income Fund***					
Summe der Nettovermögen		USD/GBP	29.519.498	31.031.538	23.086.322
Nettoinventarwert zum:	A-Klasse (Acc)	EUR	1,1499	1,3783	1,3200
	A-Klasse (Acc)	USD	–	–	1,1378
	A-Klasse (Inc)	EUR	0,9608	1,1674	–
	B-Klasse (Acc)	USD	0,9677	1,1590	1,1213
	C-Klasse (Acc)	USD	1,0413	1,2440	1,2004
	Sterling C (Acc)	GBP	–	–	1,4905
	W-Klasse (Inc)	EUR	1,0486	1,2661	1,2262
	W-Klasse (Inc)	USD	0,8559	1,0352	1,0154
	Sterling W (Inc)	GBP	1,1778	1,3233	1,3501
BNY Mellon Brazil Equity Fund					
Summe der Nettovermögen		USD	60.983.102	105.594.026	100.997.675
Nettoinventarwert zum:	A-Klasse	USD	0,8735	1,3152	1,1680
	A-Klasse	EUR	1,0799	1,6321	1,4273
	B-Klasse	USD	0,7488	1,1248	0,9963
	B-Klasse	EUR	0,9434	1,4216	1,2400
	Sterling B (Acc)	GBP	0,9005	1,2788	1,1688
	C-Klasse	USD	0,9922	1,4872	1,3141
	C-Klasse	EUR	1,2291	1,8476	1,6075
	Sterling C (Inc)	GBP	1,0557	1,5174	1,3833
	G-Klasse (Acc)^	USD	–	1,2899	1,1398
	G-Klasse (Acc)	EUR	0,8651	1,3014	1,1325
	G-Klasse (Acc) (Hedged)^	EUR	–	1,2167	1,0907
	H-Klasse (Hedged)	EUR	0,7567	1,1666	1,0513
	I-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	0,7251	1,1116	0,9965
	W-Klasse (Acc)	USD	0,8615	1,2895	1,1380
	W-Klasse (Acc)	EUR	1,0024	1,5059	1,3085
	Sterling W (Acc)	GBP	1,1214	1,5866	1,4446

14. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	30. Juni 2020	31. Dezember 2019	30. Juni 2019
BNY Mellon Digital Assets Fund					
Summe der Nettovermögen		USD	10.983.890	11.112.189	7.961.302
Nettoinventarwert zum:	A-Klasse (Acc)	USD	1,1284	1,0907	1,0363
	B-Klasse (Acc)	USD	–	–	1,0384
	E-Klasse (Acc)	USD	1,1625	1,1161	1,0530
	E-Klasse (Acc)	EUR	1,1737	1,1287	1,0505
	E-Klasse (Inc)^	USD	–	1,0566	0,9969
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	1,0888	1,0686	1,0291
	K-Klasse (Acc)	USD	1,1485	1,1076	1,0498
	K-Klasse (Acc)	EUR	1,1598	1,1203	1,0473
	W-Klasse (Acc)	USD	1,1594	1,1142	1,0523
BNY Mellon Dynamic Total Return Fund					
Summe der Nettovermögen		USD	24.113.316	26.474.856	25.440.367
Nettoinventarwert zum:	A-Klasse (Acc)	USD	0,9634	1,0261	0,9876
	C-Klasse (Acc)	USD	1,0142	1,0748	1,0292
	E-Klasse (Acc)	USD	1,0153	1,0732	1,0252
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	0,8810	0,9481	0,9253
	W-Klasse (Acc)	USD	1,0265	1,0865	1,0392
	X-Klasse (Acc)	USD	1,0700	1,1279	1,0744
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund					
Summe der Nettovermögen		USD	406.056.407	181.632.588	127.289.625
Nettoinventarwert zum:	A-Klasse (Acc)	EUR	0,9914	1,0095	–
	A-Klasse (Inc)	USD	1,2787	1,3057	1,1685
	C-Klasse (Acc)	USD	1,2969	1,3172	1,1778
	E-Klasse (Acc)	USD	1,3092	1,3273	1,1847
	G-Klasse (Acc)	USD	1,0031	1,0188	–
	G-Klasse (Acc)	EUR	0,9925	1,0096	–
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	1,0896	1,1249	1,0204
	W-Klasse (Acc)	USD	1,3029	1,3220	1,1809
	W-Klasse (Acc)	EUR	1,1714	1,1905	1,0490
	Sterling W (Acc)^	GBP	–	1,3060	1,2168
	W-Klasse (Inc)^	EUR	0,9610	–	–
	X-Klasse (Acc)	USD	1,3194	1,3357	1,1905
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund*					
Summe der Nettovermögen		USD	62.378.535	–	–
Nettoinventarwert zum:	A-Klasse (Acc)^	USD	1,0210	–	–
	Sterling L (Acc) (Hedged)^	GBP	1,0141	–	–
	W-Klasse (Acc)^	USD	1,0216	–	–
	W-Klasse (Acc) (Hedged)^	EUR	1,0136	–	–
	Sterling W (Acc) (Hedged)^	GBP	1,0134	–	–
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund					
Summe der Nettovermögen		USD	896.781.349	716.491.768	326.854.263
Nettoinventarwert zum:	A-Klasse (Inc)	USD	0,9015	0,9923	0,9886
	A-Klasse (Inc)	EUR	0,9480	1,0451	1,0272
	C-Klasse (Acc)	USD	1,0611	1,1279	1,0868
	C-Klasse (Acc)	EUR	–	–	1,1268
	C-Klasse (Inc)^	USD	1,0327	–	–
	E-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	0,9879	1,0638	1,0390

14. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	30. Juni 2020	31. Dezember 2019	30. Juni 2019
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund Forts.					
Nettoinventarwert zum:	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	1,0141	1,0927	1,0612
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	0,9180	1,0276	–
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	0,9557	1,0327	1,0100
	I-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	–	–	1,0345
	I-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	–	–	0,9432
	K-Klasse (Acc)	USD	1,0359	1,1013	1,0617
	K-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	0,9802	1,0565	1,0329
	L-Klasse (Acc)	USD	1,0396	1,1042	1,0635
	L-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	0,9833	1,0587	1,0341
	Sterling L (Acc) (Hedged)	GBP	0,9467	1,0197	1,0029
	Sterling L (Inc) (Hedged)	GBP	0,8961	0,9995	–
	W-Klasse (Acc)	USD	1,0632	1,1298	1,0886
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,9551	1,0291	–
	W-Klasse (Inc)^	USD	0,9876	–	–
	W-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	0,8387	0,9355	0,9448
	Sterling W (Inc) (hedged)^	GBP	0,9874	–	–
	X-Klasse (Acc)	USD	1,0668	1,1323	1,0897
	Sterling X (Acc) (Hedged)^	GBP	1,0500	–	–
	X-Klasse (Inc)^	USD	1,0511	–	–
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund					
Summe der Nettovermögen		USD	308.500.009	360.120.657	327.965.278
Nettoinventarwert zum:	A-Klasse	USD	139,0886	142,4403	135,3314
	A-Klasse	EUR	157,6467	161,1662	151,0505
	A-Klasse (Inc)^	USD	101,5880	–	–
	A-Klasse (Inc) (M)^	HKD	1.000,5330	–	–
	B-Klasse	USD	153,6000	157,0770	149,0616
	C-Klasse	USD	157,4261	160,7062	152,1887
	C-Klasse	EUR	177,3878	180,9051	168,9868
	G-Klasse (Inc)	USD	97,9188	102,4094	99,1414
	H-Klasse (Hedged)	EUR	125,9447	130,9446	126,2115
	I-Klasse (Hedged)	EUR	131,7836	136,5029	131,1614
	W-Klasse	USD	159,9348	163,1225	154,3202
	W-Klasse	EUR	189,0293	192,4222	179,5566
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	CHF	105,4441	109,3395	105,1777
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	101,2537	104,7770	100,5524
	W-Klasse (Inc) (Hedged)	CHF	98,8368	105,1012	103,4701
	W-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	91,6319	97,2623	95,5651
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	144,7029	149,8278	142,8520
	Sterling W (Inc) (Hedged)^	GBP	–	103,2061	–
	X-Klasse	USD	174,6668	177,5334	167,3701
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	107,4991	110,9318	105,3834
	Y-Klasse (Acc)	USD	–	–	111,6158
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund					
Summe der Nettovermögen		USD	29.459.961	52.672.790	38.270.148
Nettoinventarwert zum:	A-Klasse	USD	2,2573	2,3965	2,3186
	A-Klasse	EUR	2,0091	2,1365	2,0391
	C-Klasse	USD	2,4336	2,5787	2,4887
	C-Klasse	EUR	2,1615	2,2929	2,1827
	C-Klasse (Inc)	USD	0,7831	0,8483	0,8367

14. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	30. Juni 2020	31. Dezember 2019	30. Juni 2019
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund Forts.					
Nettoinventarwert zum:	H-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	1,1075	1,1938	1,1721
	W-Klasse	USD	1,2287	1,2998	1,2528
	X-Klasse (Inc)	USD	0,9751	1,0569	1,0320
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund					
Summe der Nettovermögen		USD	252.780.212	464.566.692	597.181.538
Nettoinventarwert zum:	A-Klasse	USD	1,0235	1,1309	1,1060
	A-Klasse	EUR	1,1341	1,2551	1,2108
	A-Klasse (Inc)	USD	0,5152	0,5824	0,5882
	A-Klasse (Inc)	EUR	0,7459	0,8446	0,8414
	Sterling A (Acc)	GBP	1,0788	1,1152	1,1375
	Sterling B (Acc)	GBP	1,1161	1,1521	1,1734
	C-Klasse	USD	1,3613	1,5015	1,4645
	C-Klasse	EUR	1,2135	1,3397	1,2891
	C-Klasse (Inc)	USD	0,5529	0,6252	0,6313
	C-Klasse (Inc)	EUR	0,7016	0,7946	0,7915
	Sterling C (Acc)	GBP	1,6300	1,6807	1,7102
	Sterling C (Inc)	GBP	0,8851	0,9362	0,9861
	H-Klasse (Hedged)	EUR	0,8522	0,9567	0,9490
	I-Klasse (Hedged)	EUR	0,8671	0,9709	0,9614
	Sterling J (Inc) (Hedged)	GBP	0,4670	0,5360	0,5460
	W-Klasse	USD	0,8170	0,8990	0,8753
	W-Klasse	EUR	0,9400	1,0359	0,9950
	W-Klasse (Hedged)	EUR	0,7642	0,8540	0,8432
	W-Klasse (Inc)	EUR	0,6148	0,6964	0,6938
	W-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	0,7159	0,8229	0,8433
	Sterling W (Inc)	GBP	0,6910	0,7311	0,7700
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	0,5223	0,5997	0,6108
	X-Klasse^	USD	–	1,7284	1,6770
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund					
Summe der Nettovermögen		USD	29.522.466	29.585.251	35.398.665
Nettoinventarwert zum:	A-Klasse	EUR	1,2288	1,3204	1,2624
	C-Klasse	USD	1,0598	1,1341	1,0960
	C-Klasse	EUR	–	–	1,2980
	W-Klasse (Acc)	USD	1,0040	1,0727	1,0348
	X-Klasse (Inc)	USD	0,9410	1,0323	1,0285
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund					
Summe der Nettovermögen		USD	192.216.966	151.635.419	127.938.887
Nettoinventarwert zum:	A-Klasse (Acc)	USD	0,9926	1,0325	–
	E-Klasse (Inc)^	USD	–	0,9452	0,9515
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	0,9513	1,0349	1,0501
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	0,9672	1,0225	–
	W-Klasse (Acc)	USD	1,0041	1,0423	1,0207
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	0,9269	0,9778	0,9716
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,9303	0,9813	0,9681
	X-Klasse (Acc)	USD	1,0194	1,0553	1,0301

14. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	30. Juni 2020	31. Dezember 2019	30. Juni 2019
BNY Mellon Euroland Bond Fund					
Summe der Nettovermögen		EUR	536.899.130	890.225.293	974.895.222
Nettoinventarwert zum:	A-Klasse	EUR	1,9602	1,9753	1,9732
	A-Klasse (Inc)	EUR	1,1932	1,2057	1,2074
	B-Klasse	EUR	1,3777	1,3866	1,3833
	B-Klasse (Inc)	EUR	1,2000	1,2126	1,2143
	C-Klasse	EUR	2,1310	2,1420	2,1343
	C-Klasse (Inc)	EUR	1,3034	1,3172	1,3190
	G-Klasse (Acc)	EUR	1,0373	1,0428	1,0390
	H-Klasse (Hedged)	CHF	1,2507	1,2627	1,2643
	I-Klasse (Hedged)	CHF	1,3259	1,3354	1,3336
	S-Klasse	EUR	1,1909	1,1964	1,1915
	W-Klasse (Acc)	EUR	1,0788	1,0840	1,0798
BNY Mellon European Credit Fund					
Summe der Nettovermögen		EUR	72.973.001	82.434.065	36.177.229
Nettoinventarwert zum:	A-Klasse	EUR	121,2219	123,8809	122,5014
	C-Klasse	EUR	125,7459	128,1852	126,4353
	W-Klasse (Acc)	EUR	104,2730	106,2977	104,7352
	X-Klasse	EUR	130,8848	133,0672	130,8896
BNY Mellon Global Bond Fund					
Summe der Nettovermögen		USD	599.440.292	585.157.899	613.705.993
Nettoinventarwert zum:	A-Klasse	USD	2,4123	2,3299	2,3113
	A-Klasse	EUR	1,9200	1,8513	1,8116
	B-Klasse	USD	2,4712	2,3850	2,3642
	C-Klasse	USD	2,6209	2,5251	2,4986
	C-Klasse	EUR	2,0989	2,0189	1,9705
	C-Klasse (Inc)	USD	1,0064	0,9738	0,9695
	Sterling C (Inc)	GBP	1,6374	1,4735	1,5282
	H-Klasse (Hedged)	EUR	1,2586	1,2316	1,2399
	I-Klasse (Hedged)	EUR	1,3302	1,2981	1,3034
	W-Klasse (Acc)	USD	1,1165	1,0751	1,0633
	W-Klasse (Acc)	EUR	1,1327	1,0889	1,0622
	W-Klasse (Acc) (Hedged)^	EUR	–	0,9887	0,9923
	X-Klasse	USD	2,7703	2,6617	2,6265
	Sterling Z (Acc) (Hedged)^	GBP	1,0264	–	–
	Sterling Z (Inc) (Hedged)^	GBP	1,0264	–	–
BNY Mellon Global Credit Fund					
Summe der Nettovermögen		USD	611.959.878	462.784.533	441.144.992
Nettoinventarwert zum:	A-Klasse (Acc)^	USD	1,0001	–	–
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	1,1546	1,0985	1,0725
	W-Klasse (Acc)	USD	1,3164	1,2310	1,1814
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	1,2389	1,1740	1,1349
	X-Klasse (Acc)	USD	1,3272	1,2385	1,1857
	X-Klasse (Acc) (Hedged)	CAD	1,3035	1,2239	1,1752
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	–	–	1,0699

14. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	30. Juni 2020	31. Dezember 2019	30. Juni 2019
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund					
Summe der Nettovermögen		USD	369.815.520	496.274.784	476.327.186
Nettoinventarwert zum:	A-Klasse	USD	1,2712	1,2631	1,2434
	A-Klasse	EUR	1,3195	1,3090	1,2711
	A-Klasse (Inc)	USD	1,0695	1,0664	1,0569
	C-Klasse	USD	1,3564	1,3445	1,3202
	G-Klasse (Acc)	EUR	1,1427	1,1308	1,0947
	H-Klasse (Hedged)	EUR	1,0273	1,0312	1,0297
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	NOK	10,0936	10,1020	9,9890
	H-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	0,9369	0,9437	0,9488
	I-Klasse (Hedged)	EUR	1,0692	1,0715	1,0673
	I-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	0,9377	0,9461	0,9513
	W-Klasse	USD	1,1659	1,1542	1,1319
	W-Klasse (Hedged)	EUR	1,0514	1,0514	1,0459
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	CHF	1,0183	1,0201	1,0168
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	NOK	10,1718	10,1423	9,9904
	W-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	0,9751	0,9823	0,9876
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	1,1106	1,1076	1,0947
	Sterling W (Inc) (Hedged)^	GBP	0,9945	–	–
	X-Klasse (Acc) (Hedged)	JPY	100,2156	99,9375	–
	Sterling Z (Acc)	GBP	1,0604	0,9745	–
	Sterling Z (Acc) (Hedged)^	GBP	0,9962	–	–
	Sterling Z (Inc)	GBP	1,0539	0,9745	–
	Sterling Z (Inc) (Hedged)^	GBP	0,9948	–	–
BNY Mellon Global Emerging Markets Fund					
Summe der Nettovermögen		USD	30.437.912	33.193.624	33.595.711
Nettoinventarwert zum:	A-Klasse	USD	1,0111	0,9898	0,9115
	A-Klasse	EUR	1,2410	1,2113	1,1004
	A-Klasse (Inc)	EUR	1,0990	1,0726	0,9744
	B-Klasse (Acc)^	USD	1,2378	–	–
	B-Klasse (Acc)^	EUR	1,2156	–	–
	B-Klasse (Inc)	USD	1,0102	0,9850	0,9049
	B-Klasse (Inc)	EUR	1,1458	1,1155	1,0109
	C-Klasse	USD	1,1993	1,1667	1,0690
	C-Klasse (Acc)	USD	1,3228	1,2867	1,1791
	C-Klasse (Acc)^	EUR	1,2172	–	–
	C-Klasse (Inc)	USD	1,0484	1,0193	0,9340
	Sterling C (Inc)^	GBP	1,2341	–	–
	E-Klasse (Acc)	USD	1,3145	1,2767	1,1664
	E-Klasse (Acc)	CHF	1,1966	1,1810	1,0883
	G-Klasse (Acc) (Hedged)^	EUR	–	0,8871	0,8225
	H-Klasse (Hedged)	EUR	0,9179	0,9104	0,8499
	I-Klasse (Hedged)	EUR	0,9903	0,9771	0,9075
	W-Klasse (Acc)	USD	1,5380	1,4996	1,3716
	W-Klasse (Acc)	EUR	1,0674	1,0353	0,9345
	W-Klasse (Inc)	USD	1,0586	1,0293	0,9420
	W-Klasse (Inc)	EUR	1,1795	1,1448	1,0334

14. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	30. Juni 2020	31. Dezember 2019	30. Juni 2019
BNY Mellon Global Equity Fund					
Summe der Nettovermögen		USD	362.023.450	371.812.812	343.051.111
Nettoinventarwert zum:	A-Klasse	USD	2,4968	2,6195	2,4272
	A-Klasse	EUR	2,0092	2,1046	1,9236
	B-Klasse	USD	2,6965	2,8220	2,6082
	B-Klasse	EUR	2,3838	2,4906	2,2706
	C-Klasse	USD	2,9362	3,0650	2,8256
	C-Klasse^	EUR	–	2,4330	2,2124
	I-Klasse (Hedged)	EUR	1,3492	1,4290	1,3362
	W-Klasse (Acc)	USD	1,3256	1,3821	1,2725
	W-Klasse (Acc)	EUR	1,3297	1,3841	1,2570
BNY Mellon Global Equity Income Fund					
Summe der Nettovermögen		USD	1.201.589.592	1.842.135.041	1.577.286.880
Nettoinventarwert zum:	A-Klasse	USD	1,6028	1,8451	1,7475
	A-Klasse	EUR	2,1232	2,4403	2,2797
	A-Klasse (Inc)	USD	1,1868	1,3859	1,3347
	A-Klasse (Inc)	EUR	1,0824	1,2619	1,1988
	Sterling A (Acc)	GBP	1,5622	1,6706	1,6472
	B-Klasse	USD	1,9545	2,2446	2,1205
	B-Klasse	EUR	2,1006	2,4084	2,2443
	B-Klasse (Inc)	USD	1,4435	1,6814	1,6152
	B-Klasse (Inc)	EUR	1,6711	1,9434	1,8415
	Sterling B (Inc)	GBP	1,8404	1,9914	1,9917
	C-Klasse	USD	1,8431	2,1114	1,9896
	C-Klasse	EUR	2,2775	2,6047	2,4210
	C-Klasse (Inc)	USD	1,5085	1,7527	1,6794
	C-Klasse (Inc)	EUR	1,6634	1,9295	1,8237
	Sterling C (Inc)	GBP	1,9195	2,0718	2,0668
	G-Klasse (Acc)	EUR	1,0381	1,1873	1,1036
	H-Klasse (Hedged)	EUR	1,2421	1,4511	1,3941
	H-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	0,9958	1,1799	1,1529
	I-Klasse (Hedged)	EUR	1,3390	1,5564	1,4877
	I-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	1,0623	1,2523	1,2181
	W-Klasse	USD	1,6222	1,8558	1,7465
	W-Klasse	EUR	1,8930	2,1617	2,0067
	W-Klasse (Acc)^	CHF	–	1,0487	0,9952
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	0,9532	1,1066	1,0571
	W-Klasse (Inc)	USD	1,2820	1,4876	1,4236
	W-Klasse (Inc)	EUR	1,4999	1,7381	1,6407
	Sterling W (Acc)	GBP	2,1300	2,2637	2,2179
	Sterling W (Inc)	GBP	1,6835	1,8148	1,8082
	Z-Klasse (Acc)	USD	1,3605	1,5555	1,4632
	Z-Klasse (Acc)	EUR	1,5133	1,7277	1,6030
	Z-Klasse (Inc)	USD	1,0044	1,1650	1,1143
	Z-Klasse (Inc)	EUR	1,0218	1,1832	1,1163
	Sterling Z (Acc)	GBP	0,9611	1,0210	–
	Sterling Z (Inc)	GBP	1,0485	1,1297	1,1250

14. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	30. Juni 2020	31. Dezember 2019	30. Juni 2019
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund					
Summe der Nettovermögen		USD	111.506.533	121.548.316	128.209.110
Nettoinventarwert zum:	A-Klasse	EUR	2,4751	2,6193	2,4888
	C-Klasse	USD	1,3239	1,4011	1,3481
	C-Klasse	EUR	2,5752	2,7224	2,5838
	C-Klasse (Inc)	USD	0,9072	0,9888	0,9781
	H-Klasse (Hedged)	EUR	1,1698	1,2556	1,2268
	I-Klasse (Hedged)	EUR	1,1977	1,2841	1,2528
	W-Klasse (Acc)	USD	1,0620	1,1212	1,0760
	W-Klasse (Acc) (Hedged)^	EUR	–	1,0149	–
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,9668	1,0347	–
	X-Klasse (Inc)	USD	0,9385	1,0176	1,0013
	X-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	0,8543	0,9386	0,9370
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund					
Summe der Nettovermögen		USD	147.205.072	91.053.076	15.567.967
Nettoinventarwert zum:	A-Klasse (Acc)	USD	0,8573	1,0949	1,0194
	A-Klasse (Inc)	USD	0,8010	1,0438	0,9942
	A-Klasse (Inc)	EUR	0,8126	1,0608	0,9968
	B-Klasse (Acc)	USD	0,8641	1,1012	1,0230
	B-Klasse (Acc)^	SGD	1,0733	–	–
	B-Klasse (Inc)	USD	0,8076	1,0502	0,9981
	B-Klasse (Inc)^	SGD	1,0733	–	–
	C-Klasse (Inc)	EUR	–	–	1,0048
	E-Klasse (Acc)	USD	0,8897	1,1281	1,0426
	E-Klasse (Inc)	USD	0,8232	1,0651	1,0069
	E-Klasse (Inc)	EUR	0,8352	1,0823	1,0094
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	0,7776	1,0377	0,9898
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	0,8036	1,0494	0,9915
	H-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	0,7506	1,0006	0,9673
	J-Klasse (Acc) (Hedged)^	SGD	1,0919	–	–
	J-Klasse (Inc) (Hedged)^	SGD	1,0917	–	–
	W-Klasse (Acc)	USD	0,8760	1,1124	1,0295
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	0,8218	1,0666	1,0016
	W-Klasse (Inc)	USD	0,8187	1,0608	1,0044
	W-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	0,7692	1,0169	0,9772
BNY Mellon Global Leaders Fund					
Summe der Nettovermögen		USD	63.537.900	86.118.374	83.993.066
Nettoinventarwert zum:	A-Klasse (Acc)	USD	1,4669	1,4853	1,3497
	A-Klasse (Acc)	EUR	1,2305	1,2479	1,1185
	A-Klasse (Inc)	EUR	1,2305	1,2479	1,1185
	B-Klasse (Acc)	USD	1,1273	1,1386	1,0319
	C-Klasse (Acc)	USD	1,5204	1,5318	1,3848
	E-Klasse (Acc)	USD	1,3526	1,3594	1,2260
	Sterling E (Acc)	GBP	1,5773	1,4829	1,3947
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	DKK	10,5189	10,8284	9,9935
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	1,3308	1,3678	1,2609
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	NOK	10,4614	10,9288	9,9970
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	SEK	10,4780	10,8404	9,9949
	W-Klasse (Acc)	USD	1,5342	1,5438	1,3939
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	DKK	11,2393	11,4980	10,5437
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	NOK	10,6033	11,0081	9,9994

14. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	30. Juni 2020	31. Dezember 2019	30. Juni 2019
BNY Mellon Global Leaders Fund Forts.					
Nettoinventarwert zum:	W-Klasse (Acc) (Hedged)	SEK	10,6137	10,9126	9,9973
	Sterling W (Acc)	GBP	1,5632	1,4714	1,3858
BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund					
Summe der Nettovermögen		EUR	20.605.462	23.691.394	19.834.753
Nettoinventarwert zum:	A-Klasse (Acc)	EUR	0,9627	1,0856	–
	A-Klasse (Inc)	EUR	0,9002	1,0368	0,9795
	A-Klasse (Inc)^	USD	0,9943	–	–
	C-Klasse (Acc)	EUR	0,9547	1,0739	–
	E-Klasse (Inc)	EUR	0,9228	1,0562	0,9915
	W-Klasse (Acc)	EUR	0,9816	1,1027	1,0124
	W-Klasse (Inc)^	EUR	–	1,0482	0,9866
BNY Mellon Global Opportunities Fund					
Summe der Nettovermögen		USD	33.719.611	48.327.216	49.213.867
Nettoinventarwert zum:	A-Klasse	USD	2,9626	3,2022	2,9422
	A-Klasse	EUR	2,3663	2,5521	2,3134
	B-Klasse	USD	3,2067	3,4560	3,1673
	C-Klasse	USD	3,4370	3,6943	3,3771
	C-Klasse	EUR	2,7382	2,9379	2,6490
	H-Klasse (Hedged)	EUR	1,4159	1,5498	1,4439
	I-Klasse (Hedged)	EUR	1,5122	1,6468	1,5313
	W-Klasse (Acc)	USD	1,1516	1,2362	1,1286
	W-Klasse (Acc)^	EUR	–	1,1667	1,0507
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)					
Summe der Nettovermögen		EUR	2.770.276.248	3.409.751.582	3.281.939.351
Nettoinventarwert zum:	A-Klasse	EUR	1,3276	1,3636	1,3276
	A-Klasse (Inc)	EUR	1,0805	1,1181	1,0887
	C-Klasse	EUR	1,3981	1,4323	1,3904
	C-Klasse (Inc)	EUR	1,1370	1,1792	1,1452
	G-Klasse (Acc)	EUR	1,0737	1,1001	1,0684
	G-Klasse (Inc)	EUR	1,0459	1,0848	1,0536
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	SGD	1,0120	1,0351	0,9977
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	USD	1,0040	1,0233	–
	Sterling H (Acc) (Hedged)	GBP	0,9916	1,0196	–
	W-Klasse	EUR	1,2776	1,3076	1,2683
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	CHF	1,0343	1,0609	1,0315
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	USD	1,0101	1,0212	–
	W-Klasse (Inc)	EUR	0,9961	1,0247	–
	X-Klasse	EUR	1,4160	1,4433	1,3942
	Z-Klasse (Acc)	EUR	1,0736	1,0980	1,0645
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)					
Summe der Nettovermögen		GBP	62.442.487	70.966.738	65.427.701
Nettoinventarwert zum:	Sterling B (Acc)	GBP	1,2129	1,2467	1,2161
	Sterling B (Inc)	GBP	1,1293	1,1680	1,1394
	Sterling C (Inc)	GBP	1,1492	1,1916	1,1594
	Sterling W (Acc)	GBP	1,2510	1,2818	1,2456
	Sterling W (Inc)	GBP	1,1279	1,1711	1,1381
	Sterling X (Acc)	GBP	1,2674	1,2928	1,2512

14. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	30. Juni 2020	31. Dezember 2019	30. Juni 2019
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)					
Summe der Nettovermögen		USD	292.063.806	322.386.292	318.939.885
Nettoinventarwert zum:	A-Klasse	USD	1,4955	1,5262	1,4730
	C-Klasse	USD	1,5797	1,6081	1,5482
	C-Klasse (Inc)	USD	1,2313	1,2722	1,2248
	G-Klasse (Acc)	USD	1,1454	1,1659	1,1226
	W-Klasse (Acc)	USD	1,2926	1,3142	1,2636
	W-Klasse (Inc)	USD	1,1502	1,1892	1,1434
	X-Klasse	USD	1,7716	1,7941	1,7181
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund					
Summe der Nettovermögen		USD	716.954.643	725.167.880	710.683.039
Nettoinventarwert zum:	A-Klasse (Acc)	USD	1,0913	1,1434	1,1208
	A-Klasse (Inc)	USD	0,9375	1,0033	1,0037
	C-Klasse (Acc)	USD	1,1108	1,1613	1,1354
	G-Klasse (Acc)	USD	0,9965	1,0418	1,0186
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	0,9971	1,0579	1,0518
	H-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	0,8622	0,9344	0,9488
	I-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	1,0143	1,0732	1,0643
	I-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	0,8624	0,9355	0,9498
	W-Klasse (Acc)	USD	1,1208	1,1702	1,1426
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	CHF	0,9913	1,0487	1,0408
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	1,0026	1,0600	1,0499
	W-Klasse (Inc)	USD	0,9415	1,0078	1,0082
	W-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	0,8637	0,9361	0,9502
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	1,0579	1,1174	1,0996
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	0,9001	0,9749	0,9833
	X-Klasse (Acc)	USD	1,1430	1,1902	1,1589
	X-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	–	–	1,0218
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	0,9992	1,0524	1,0328
	Y-Klasse (Acc)	USD	1,1434	1,1907	1,1592
	Sterling Y (Acc) (Hedged)	GBP	1,0786	1,1365	1,1152
	Sterling Z (Acc) (Hedged)	GBP	0,9759	1,0302	1,0132
	Sterling Z (Inc) (Hedged)	GBP	0,9246	1,0014	1,0103
BNY Mellon Global Unconstrained Fund					
Summe der Nettovermögen		USD	23.348.578	25.173.039	23.213.575
Nettoinventarwert zum:	W-Klasse (Acc)	USD	1,1285	1,1515	1,0685
	X-Klasse (Acc) (Hedged)	CAD	1,1208	1,1502	1,0663
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund					
Summe der Nettovermögen		JPY	12.306.565.258	15.534.711.210	14.234.212.157
Nettoinventarwert zum:	A-Klasse (Acc)	EUR	1,0236	1,0989	0,9432
	C-Klasse	JPY	195,3408	211,0813	180,8320
	C-Klasse	USD	–	–	1,4832
	C-Klasse (Acc)	EUR	–	–	0,8566
	E-Klasse (Acc)^	EUR	–	1,1275	0,9606
	E-Klasse (Acc) (Hedged)	CHF	0,9472	1,0297	0,8831
	E-Klasse (Acc) (Hedged)	USD	1,0034	1,0802	0,9130
	G-Klasse (Acc)^	EUR	0,9908	–	–
	G-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	0,8533	0,9289	0,7968
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	SGD	1,4427	1,5727	1,3429

14. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	30. Juni 2020	31. Dezember 2019	30. Juni 2019
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund Forts.					
Nettoinventarwert zum:	H-Klasse (Acc) (Hedged)	NOK	10,6278	11,7303	10,0275
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	SEK	10,5914	11,6353	10,0258
	H-Klasse (Hedged)	EUR	1,7314	1,8939	1,6328
	H-Klasse (Hedged)	USD	1,9232	2,0855	1,7747
	I-Klasse (Hedged)	EUR	1,8742	2,0399	1,7500
	I-Klasse (Hedged)	USD	2,0419	2,2033	1,8665
	W-Klasse	JPY	198,7223	214,4722	183,5042
	W-Klasse (Acc)	EUR	0,9554	1,0192	0,8692
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	0,9035	0,9821	0,8414
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	NOK	10,6089	11,6384	9,8862
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	SEK	10,5876	11,5413	9,8820
	Sterling W (Acc)	GBP	2,5118	2,5019	2,2443
	Sterling W (Inc)	GBP	0,9873	0,9904	0,8884
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund					
Summe der Nettovermögen		EUR	1.412.714.937	1.485.354.765	1.915.014.601
Nettoinventarwert zum:	A-Klasse	EUR	2,7128	2,8565	2,6228
	A-Klasse	USD	1,9209	2,0194	1,8796
	A-Klasse (Inc)	EUR	1,7411	1,8335	1,6834
	Sterling A (Acc)	GBP	2,8833	2,8354	2,7526
	B-Klasse	EUR	2,5462	2,6741	2,4490
	B-Klasse	USD	2,0208	2,1190	1,9673
	B-Klasse (Acc)	SGD	1,1978	1,2122	1,1321
	B-Klasse (Inc)^	SGD	–	1,2122	1,1321
	Sterling B (Inc)	GBP	2,4713	2,4246	2,3479
	C-Klasse	EUR	3,0634	3,2106	2,9328
	C-Klasse	USD	2,1708	2,2707	2,1028
	G-Klasse (Acc)	EUR	1,1204	1,1747	1,0732
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	USD	1,0259	1,0709	–
	I-Klasse (Acc) (Hedged)^	USD	1,0465	–	–
	J-Klasse (Acc) (Hedged)	SGD	1,2244	1,2839	1,1646
	S-Klasse	EUR	3,1112	3,2559	2,9637
	S-Klasse (Acc) 1	USD	1,0812	1,1297	1,0423
	W-Klasse	EUR	2,2525	2,3573	2,1506
	W-Klasse	USD	1,9510	2,0384	1,8852
	W-Klasse (Hedged)	USD	2,3179	2,4048	2,1668
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	SGD	1,0965	1,1452	1,0346
	W-Klasse (Inc)	USD	1,8531	1,9465	1,8003
	Sterling W (Acc)	GBP	2,5278	2,4706	2,3833
	W-Klasse (Inc)^	EUR	1,0039	–	–
	Sterling W (Inc)	GBP	2,4004	2,3589	2,2755
	X-Klasse (Acc)	USD	1,1813	1,2295	1,1325
	Sterling X	GBP	2,2550	2,1954	2,1093
BNY Mellon Mobility Innovation Fund					
Summe der Nettovermögen		USD	194.333.411	154.707.836	101.552.107
Nettoinventarwert zum:	A-Klasse (Acc)	USD	1,0784	1,0113	0,9212
	A-Klasse (Acc)	EUR	1,2156	1,1418	1,0260
	A-Klasse (Inc)	USD	1,0782	1,0111	0,9210
	A-Klasse (Inc)	EUR	1,1194	1,0514	0,9447
	B-Klasse (Acc)	USD	1,0877	1,0177	0,9249

14. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	30. Juni 2020	31. Dezember 2019	30. Juni 2019
BNY Mellon Mobility Innovation Fund Forts.					
Nettoinventarwert zum:	C-Klasse (Acc)	USD	1,1126	1,0385	–
	C-Klasse (Acc)	EUR	1,0953	1,0240	–
	C-Klasse (Inc)	EUR	1,1377	1,0655	0,9528
	E-Klasse (Acc)	USD	1,1087	1,0323	0,9333
	E-Klasse (Acc)	CHF	1,2201	1,1604	1,0583
	E-Klasse (Acc)	EUR	1,1507	1,0731	0,9572
	E-Klasse (Acc)	SGD	–	–	1,0683
	E-Klasse (Acc) (Hedged)	CHF	1,2351	1,1688	1,0730
	E-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	1,2225	1,1588	1,0627
	E-Klasse (Acc) (Hedged)^	SGD	–	1,1877	1,0780
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	1,0511	1,0011	0,9141
	G-Klasse (Acc)^	EUR	1,0224	–	–
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	1,0117	0,9659	0,8922
	H-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	1,0110	0,9654	0,8918
	J-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	1,2015	1,1445	1,0548
	K-Klasse (Acc)	USD	1,2692	1,1876	1,0792
	K-Klasse (Acc) (Hedged)	CHF	1,2019	1,1431	1,0548
	K-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	1,2026	1,1456	1,0557
	K-Klasse (Acc) (Hedged)	SGD	–	–	1,0711
	K-Klasse (Inc)	USD	1,2692	1,1876	1,0793
	K-Klasse (Inc) (Hedged)	CHF	1,2009	1,1421	1,0540
	K-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	1,2012	1,1442	1,0548
	K-Klasse (Inc) (Hedged)	SGD	1,2406	1,1743	1,0711
	Sterling K (Acc) (Hedged)	GBP	1,2109	1,1591	1,0635
	Sterling K (Inc) (Hedged)	GBP	–	–	1,0635
	W-Klasse (Acc)	USD	1,1022	1,0278	0,9307
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	1,0342	0,9817	0,9016
	Sterling W (Acc)^	GBP	–	1,0406	–
	W-Klasse (Inc)	USD	1,0977	1,0269	0,9299
	W-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	1,0289	0,9797	0,8998
BNY Mellon S&P 500® Index Tracker					
Summe der Nettovermögen		USD	32.858.701	50.804.733	76.108.296
Nettoinventarwert zum:	A-Klasse	USD	2,8195	2,9378	2,6716
	A-Klasse	EUR	2,5086	2,6179	2,3485
	C-Klasse	USD	3,2162	3,3395	3,0265
	C-Klasse	EUR	2,7150	2,8231	2,5236
	G-Klasse (Acc)^	EUR	–	1,1090	–
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund					
Summe der Nettovermögen		EUR	49.106.383	74.850.283	65.998.225
Nettoinventarwert zum:	A-Klasse	EUR	4,9204	5,6223	5,1197
	A-Klasse	USD	1,1814	1,3523	1,2484
	B-Klasse	EUR	2,4964	2,8456	2,5847
	C-Klasse	EUR	5,7448	6,5314	5,9170
	C-Klasse	USD	1,2982	1,4785	1,3580
	W-Klasse (Acc)	EUR	0,9356	1,0625	0,9613
	Sterling W (Acc)	GBP	1,6403	1,7332	1,6552

14. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilstklasse	Währung	30. Juni 2020	31. Dezember 2019	30. Juni 2019
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Fund					
Summe der Nettovermögen		EUR	220.293.946	180.183.426	165.904.274
Nettoinventarwert zum:	A-Klasse (Acc)	EUR	1,0169	1,0259	1,0232
	A-Klasse (Acc)^	USD	1,0036	–	–
	A-Klasse (Inc)	EUR	1,0083	1,0199	1,0225
	C-Klasse (Acc)	EUR	1,0234	1,0300	1,0246
	E-Klasse (Acc)	EUR	1,0329	1,0368	1,0286
	E-Klasse (Acc) (Hedged)	CHF	0,9940	1,0001	–
	G-Klasse (Acc)	EUR	1,0235	1,0300	1,0246
	H-Klasse (Acc) (Hedged)^	CHF	0,9861	–	–
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	NOK	10,0516	10,1131	9,9904
	W-Klasse (Acc)	EUR	1,0293	1,0346	1,0280
	W-Klasse (Acc) (Hedged)^	CHF	0,9891	–	–
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	NOK	10,1294	10,1533	9,9918
	W-Klasse (Acc) (Hedged)^	USD	0,9987	–	–
	Sterling W (Acc) (Hedged)^	GBP	0,9928	–	–
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	0,9915	1,0007	–
	X-Klasse (Acc)	EUR	1,0363	1,0388	1,0294
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund*					
Summe der Nettovermögen		EUR	25.045.166	–	–
Nettoinventarwert zum:	A-Klasse (Acc)^	EUR	0,9685	–	–
	A-Klasse (Inc)^	EUR	0,9686	–	–
	E-Klasse (Acc)^	EUR	0,9729	–	–
	E-Klasse (Acc) (Hedged)^	EUR	0,9772	–	–
	E-Klasse (Inc)^	EUR	0,9725	–	–
	G-Klasse (Acc)^	EUR	1,0354	–	–
	W-Klasse (Acc)^	EUR	0,9715	–	–
	Sterling W (Acc) (Hedged)^	GBP	0,9627	–	–
	W-Klasse (Inc)^	EUR	0,9716	–	–
	Sterling W (Inc) (Hedged)^	GBP	0,9627	–	–
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund					
Summe der Nettovermögen		USD	80.441.328	84.505.101	81.046.471
Nettoinventarwert zum:	A-Klasse (Acc)	USD	1,0154	0,9897	0,9861
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,9934	0,9714	0,9719
BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund					
Summe der Nettovermögen		USD	28.812.983	28.865.549	23.580.731
Nettoinventarwert zum:	A-Klasse	USD	2,6124	3,2641	2,9828
	A-Klasse	EUR	2,2889	2,8645	2,5822
	B-Klasse	USD	1,9197	2,3927	2,1810
	C-Klasse	USD	3,0107	3,7438	3,4037
	C-Klasse	EUR	2,8393	3,5342	3,1684
	W-Klasse (Acc)^	USD	–	1,1876	1,0784
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund					
Summe der Nettovermögen		USD	270.302.363	419.124.854	392.893.272
Nettoinventarwert zum:	A-Klasse (Acc)	EUR	0,9114	1,1773	1,0615
	B-Klasse (Inc)	USD	0,8527	1,1123	1,0206
	C-Klasse (Inc)	USD	0,9318	1,2123	1,1154
	E-Klasse (Acc)	EUR	0,9419	1,2073	1,0800

14. NETTOINVENTARWERT Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	30. Juni 2020	31. Dezember 2019	30. Juni 2019
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund Forts.					
Nettoinventarwert zum:	E-Klasse (Inc)	USD	0,9420	1,2223	1,1214
	E-Klasse (Inc)	EUR	0,9175	1,1923	1,0790
	Sterling E (Acc)	GBP	1,0246	1,2265	1,1600
	Sterling E (Inc)	GBP	0,9504	1,1535	1,1038
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	0,8752	1,1704	1,0824
	W-Klasse (Acc)	USD	1,0132	1,2985	1,1793
	W-Klasse (Acc)	EUR	0,9094	1,1673	1,0458
	W-Klasse (Inc)	USD	0,9397	1,2211	1,1220
	Sterling W (Inc)	GBP	0,9407	1,1434	1,0959
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund					
Summe der Nettovermögen		USD	502.456.334	438.605.770	338.138.868
Nettoinventarwert zum:	A-Klasse (Acc)^	USD	1,0009	–	–
	C-Klasse (Acc)	USD	1,2195	1,1713	1,1465
	E-Klasse (Acc)	USD	1,1696	1,1223	1,0973
	E-Klasse (Acc) (Hedged)	CHF	1,0711	1,0431	1,0370
	E-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	1,1257	1,0941	1,0860
	E-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	1,0178	1,0079	1,0194
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	1,0997	1,0730	1,0693
	H-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	0,9948	0,9887	1,0035
	I-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	–	–	1,0131
	W-Klasse (Acc)	USD	1,2234	1,1745	1,1490
	W-Klasse (Acc)	EUR	1,0265	0,9871	–
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	CHF	1,0889	1,0610	1,0552
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	1,1224	1,0916	1,0832
	W-Klasse (Inc)	USD	1,0829	1,0591	1,0440
	W-Klasse (Inc) (Hedged)	CHF	1,0484	1,0405	1,0470
	W-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	1,0136	1,0044	1,0163
	X-Klasse (Acc)	USD	1,1841	1,1342	1,1071
BNY Mellon U.S. Opportunistic Alpha Fund**					
Summe der Nettovermögen		USD	–	–	4.752.035
Nettoinventarwert zum:	A-Klasse (Acc)	USD	–	–	0,9420
	A-Klasse (Acc)	EUR	–	–	0,9449
	C-Klasse (Acc)	USD	–	–	0,9471
	E-Klasse (Acc)	USD	–	–	0,9933
	E-Klasse (Inc)	USD	–	–	0,9933
	G-Klasse (Acc)	USD	–	–	0,9471
	W-Klasse (Acc)	USD	–	–	0,9484
BNY Mellon US Opportunities Fund**					
Summe der Nettovermögen		USD	–	–	10.522.642
Nettoinventarwert zum:	A-Klasse	EUR	–	–	1,5405
	A-Klasse (Inc)	EUR	–	–	1,5152
	C-Klasse	USD	–	–	1,3569
	C-Klasse	EUR	–	–	1,6209
	W-Klasse (Acc)	USD	–	–	1,0471

* Siehe Erläuterung 18 zum Halbjahresabschluss.

** Dieser Fonds wurde im vorhergehenden Geschäftsjahr geschlossen.

*** Die Vergleichszahlen für den BNY Mellon Asian Income Fund zum 30. Juni 2019 sind in Pfund Sterling angegeben.

^ Diese Anteilsklasse wurde im Berichtszeitraum aufgelegt oder geschlossen.

15. ZIELE UND STRATEGIEN 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 Marktpreisrisiko (einschließlich Marktpreisrisiko, Zinsrisiko und Währungsrisiko), Kreditrisiko und das Liquiditätsrisiko. Die Gesellschaft nutzt Risikomanagementprogramme, 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 Finanzderivate verwenden. Einige Fonds können gemäß den OGAW-Richtlinien der Zentralbank Finanzderivate zu Anlagezwecken einsetzen. In dem Risikomanagementprozess („RMP“) wird erklärt, ob jeder 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. VaR für einen zuvor festgelegten Zeithorizont misst die Wertverlustschwelle eines Portfolios mit Finanzinstrumenten, die mit einer vorgegebenen Wahrscheinlichkeit (entweder Absolute^[1] oder Relative^[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 den Portfoliowert zu beurteilen.

Für eine ausführliche Erörterung steht der RMP für jeden Fonds auf Verlangen 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 Vergleichsindex oder eines Referenzportfolios.

FINANZIELLES RISIKOMANAGEMENT

Um ihre Anlageziele zu erreichen, kauft, verkauft und hält die Gesellschaft Finanzanlagen 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 Finanzderivate 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 Marktpreisrisiko (einschließlich Marktpreisrisiko, Zinsrisiko und Währungsrisiko), 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.

15. ZIELE UND STRATEGIEN DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

MARKTPREISRISIKO

Das Marktpreisrisiko bezeichnet das Risiko, dass der angemessene Wert eines Finanzinstruments aufgrund von Veränderungen der Marktpreise (die nicht auf das Zinsrisiko und das Währungsrisiko zurückzuführen sind) schwanken kann, ganz gleich, ob diese Veränderungen durch spezielle Faktoren einzelner Finanzinstrumente oder ihrer Emittenten verursacht werden oder durch andere Faktoren, die ähnliche am Markt gehandelte Finanzinstrumente betreffen.

Ein Großteil der Fonds handelt mit Finanzinstrumenten und hält Positionen in Wertpapieren, die an Aktienmärkten oder Märkten für Aktienderivate gehandelt werden. Die Anlagen der Fonds unterliegen Marktschwankungen. Daher kann nicht garantiert werden, dass der Wert der Anlagen steigen wird. Somit besteht das Risiko eines Kapitalverlusts.

Die Investment-Manager 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 Marktstrategie der Gesellschaft wird durch die Anlagerisiko- und Renditeziele der Gesellschaft bestimmt. Der Verwaltungsrat hat die Investmentmanager angewiesen, sämtliche Risiken in Übereinstimmung mit einem eingeführten Risikomanagementsystem zu verwalten.

VaR ist die Risikobewertungsmethode, die verwendet wird, um Leverage und Marktrisikovolatilität des Fonds zu beurteilen. Wird der VaR als Prozentsatz des Nettoinventarwerts des Fonds berechnet (absoluter oder relativer VaR), darf er die im Verkaufsprospekt angegebenen regulatorischen Höchstgrenzen nicht übersteigen. Der VaR wird täglich auf der Grundlage eines einseitigen Konfidenzintervalls 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 der Benchmark oder dem Referenzportfolio verglichen wird) berechnet. Der Beobachtungszeitraum darf nicht weniger als ein Jahr betragen, sofern kein kürzerer Zeitraum gerechtfertigt ist.

Nachfolgend eine Auflistung der Nachteile der VaR-Analyse:

- Die Modelle basieren auf historischen Daten und können nicht die Tatsache berücksichtigen, dass künftige Veränderungen des Marktpreises, Korrelationen zwischen Märkten und 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 und die Angaben zum Marktpreis stellen ein hypothetisches Ergebnis dar und sind nicht als Prognose zu werten.

Der 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 Bildung von gehebeltem Engagement in einem Index mittels Derivaten oder die Berücksichtigung eines Leverage-Merkmals in einem Index muss bei der Einhaltung der Offenlegungsbestimmungen des Verkaufsprospekts ebenfalls berücksichtigt werden).

ZINSRISIKO

Das Zinsrisiko wird definiert als Risiko, dass der angemessene Wert 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 Finanzanlagen 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 geldnahen Anlagen werden kurzfristig am Markt angelegt.

15. ZIELE UND STRATEGIEN DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

ZINSRISIKO Forts.

Bei jenen Fonds, die vorwiegend zinstragende Wertpapiere halten und damit dem Risiko von Schwankungen der jeweils herrschenden Marktzinsen ausgesetzt sind, überwachen die Anlageverwalter täglich das Risiko von Zinsschwankungen, dem die Fonds ausgesetzt sind. Obgleich es sich vorwiegend um eine Anlageentscheidung handelt, verwenden die Anlageverwalter eigene Systeme und Verfahren, um den Fonds optimal zu positionieren und vom Risiko von Schwankungen der vorherrschenden Marktzinsen zu profitieren bzw. dies zu begrenzen.

Die Anlageverwalter werden sich bemühen, an liquiden Märkten zinstragende Wertpapiere zu erwerben. Gleichwohl sind nicht alle Wertpapiere, in die Fonds anlegen, an einer Börse gelistet oder mit einem Rating versehen, sodass die 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. Allgemein zeichnen sich die Finanzmärkte in Schwellenländern durch eine geringere Liquidität als in den Industrienationen aus. Der Erwerb und die Veräußerung von Anlagen können unter Umständen länger dauern, als normalerweise an einem Aktienmarkt in einer Industrienation zu erwarten wäre. Zudem müssen Transaktionen möglicherweise zu ungünstigen Kursen durchgeführt werden.

WÄHRUNGSRISIKO

Währungsrisiko wird als das Risiko definiert, dass der beizulegende Zeitwert eines Finanzinstruments aufgrund von Wechselkursveränderungen schwanken könnte. Das Risiko betrifft Finanzinstrumente, die auf eine andere als die funktionale Währung lauten, in der sie gemessen werden

Die Anlageverwalter überwachen die Währungsposition der Gesellschaft auf täglicher Basis, und dürfen durch Verwendung von Derivaten, wie z.B. Devisenterminkontrakten 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.

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. Finanzanlagen, die die Gesellschaft einem potenziellen Kreditrisiko aussetzen, bestehen vorwiegend aus zinstragenden Wertpapieren wie Anleihen, Derivaten und Anlagen in Barguthaben sowie Einlagen und Forderungen im Zusammenhang mit Maklern.

Der Umfang des Kreditrisikos, dem die Gesellschaft im Zusammenhang mit diesen Finanzanlagen ausgesetzt ist, entspricht in etwa dem Buchwert, zu dem 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 des Fonds aufbauen. Daneben nehmen die Anlageverwalter bei Bedarf nur solche Schuldinstrumente in das Portfolio auf, deren Bonität mindestens den in den jeweiligen Anlagezielen des Fonds enthaltenen Angaben entspricht oder besser ist.

Im Wesentlichen werden alle Vermögenswerte der Gesellschaft von der Depotbank verwahrt. Der Konkurs oder die Insolvenz der Depotbank kann zu Verzögerungen oder Einschränkungen der Rechte der Gesellschaft an den Wertpapieren und anderen von der Depotbank verwahrten Positionen führen.

Die Gesellschaft macht nur mit solchen Depotbanken 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 kontrollieren die Verwaltungsratsmitglieder vierteljährlich die Bonität der Depotbank The Bank of New York Mellon SA/NV, Dublin Branch. Die Bewertung der langfristigen vorrangigen Verbindlichkeiten und der langfristigen Einlagen durch Standard & Poor's beträgt am Ende des Berichtszeitraums AA- (31. Dezember 2019: AA-).

15. ZIELE UND STRATEGIEN DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

KREDITRISIKO Forts.

Die Wertpapiere und sonstigen Positionen der Gesellschaft werden getrennt vom Vermögen der Depotbank und ihrer Beauftragten aufbewahrt. Im Falle der Insolvenz oder des Konkurses der Depotbank werden die Wertpapiere und sonstigen Positionen der Gesellschaft somit von dem der Depotbank oder ihren Beauftragten getrennt. Gleichwohl unterliegt die Gesellschaft jedoch mit Blick auf die von der Depotbank gehaltenen Barmittel der Gesellschaft und mit Blick auf die von der globalen Unterdepotbank gehaltenen Sammelkonten für Zeichnungs- und Rücknahmebeträge dem Kreditrisiko der Depotbank oder einer von ihr hinzugezogenen Verwahrstelle. Im Falle der Insolvenz oder des Konkurses der Depotbank wird die Gesellschaft mit Blick auf die Barmittelbestände der Gesellschaft als nicht bevorzogter Gläubiger der Depotbank behandelt.

Das Kontrahenten-/Emittentenrisiko wird wie folgt überprüft:

- Jeder Investment Manager führt eine Liste mit zugelassenen Maklern, die einer laufenden Überprüfung 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 Bemessung 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 Überprüfungen durchgeführt.

Bei Fonds, die das Cash Sweep-Management verwenden, werden die Barguthaben vor dem bezeichneten Handelszeitpunkt der Fonds automatisch kurzfristigen Tagesanlagevehikeln zugeteilt. Der Baranlage-Auto-Sweep ist Teil des täglichen Barmittelverwaltungsverfahrens. Sämtliche Marktfonds, 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 erstklassige Fonds und Schatzfonds in US-Dollar, Euro und Pfund Sterling neben einer Reihe von Fonds in weiteren Währungen zur Verfügung.

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 eingetroffen 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 Referenzvermögenswertes zu identifizieren. Als ein Verkäufer eines Schutzes auf Credit Default Swaps erhält der Fonds vom Käufer des Schutzes in der Regel einen festverzinslichen Ertrag während der Laufzeit des Swap, sofern kein Kreditereignis eintritt. Als Verkäufer würden die Fonds ihren Portfolios effektiv Hebelwirkung hinzufügen, da die Fonds neben ihrem Gesamtvermögen dem Anlageengagement auf den Nennbetrag der Swaps unterliegen würden.

Der höchstmögliche Betrag künftiger Zahlungen (nicht diskontiert), zu deren Leistung ein Fonds als Verkäufer des Schutzes im Rahmen eines Credit Default Swap aufgefordert werden könnte, entspricht dem Nennbetrag des Vertrags. Diese potentiellen 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 des eingegangenen Credit Default Swap Abschluss, von den Fonds für dieselbe Referenzeinheit oder -einheiten ausgeglichen werden.

Sofern möglich begrenzt die Gesellschaft das Risiko von Zahlungsausfällen beim Handel mit von ihr gehaltenen Derivaten 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 Aktiva und Passiva,

15. ZIELE UND STRATEGIEN DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

KREDITRISIKO Forts.

da die Transaktionen üblicherweise auf Brutto-Basis 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 Netto-Basis reguliert werden. Das Gesamtkreditrisiko der Gesellschaft im Zusammenhang mit einem Globalverrechnungsvertrag unterliegenden Derivaten kann sich innerhalb kurzer Zeit erheblich ändern, da sich jede Transaktion im Rahmen des Vertrages darauf auswirkt.

Bestimmte außerbörsliche (OTC-) Derivatgeschäfte werden über eine zentrale Clearingstelle abgewickelt. Bei dieser Vereinbarung werden mit Gegenparteien abgeschlossene außerbörsliche Transaktionen an Clearingstellen übergeben, die nach der Annahme die Gegenpartei 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 messen, zu überwachen und zu verwalten; nähere Angaben zu diesem Verfahren wurden der Zentralbank mitgeteilt.

Zur Bereitstellung von Solvabilitäts- bzw. Sicherheitsleistungen für Transaktionen mit derivativen Finanzinstrumenten sind die Fonds der Gesellschaft berechtigt, alle Anlagen oder liquiden Mittel, die Bestandteil des Vermögens des 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 Solvabilitäts- bzw. Sicherheitsleistungen im Zusammenhang mit Transaktionen in derivativen Finanzinstrumenten hinterlegen, und tragen gegebenenfalls das Ausfallrisiko von Kontrahenten.

Die Fonds können Barmittel und zulässige Sicherheiten in Sachanlagen 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.

Fonds, die Wertpapierleihgeschäfte abschließen, unterliegen ebenfalls dem Kontrahentenrisiko. Um dieses Risiko zu minimieren, werden Sicherheiten gehalten, deren Wert den Betrag der verliehenen Wertpapiere übersteigt. Einzelheiten dazu sind in Erläuterung 13 zum Finanzausweis enthalten.

Einige Fonds besitzen Anlagen in fremdfinanzierten Darlehen, die bei den kreditabwickelnden Banken nicht separat gehalten werden. Diese Darlehen werden nicht von der Depotbank gehalten. Entsprechend ist der Teilfonds dem Kreditrisiko des Schuldners ausgesetzt. Zudem gehen die Fonds das Kreditrisiko der kreditabwickelnden Bank 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 geregelten Börse gehandelt werden.

Die Investment-Manager verwenden gegebenenfalls Derivate und Schuldverschreibungen wie börsengehandelte Index-Futures, um ein Engagement an den 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.

15. ZIELE UND STRATEGIEN DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

LIQUIDITÄTSRISIKO Forts.

Um die Abrechnung sicherzustellen, kann die Gesellschaft kurzfristige Kredite aufnehmen. Ein Überziehungskredit existiert und wurde zu Abrechnungszwecken in Anspruch genommen. Die Depotbank 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 Auflösung 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.

Einlösbare Anteile werden nach Wahl des Inhabers auf Verlangen zurückgenommen. Der Verwaltungsrat beabsichtigt jedoch nicht, dass die vertragliche Fälligkeit für den tatsächlichen Kapitalabfluss repräsentativ ist, da die Inhaber dieser Instrumente üblicherweise einen mittleren bis langen Anlagehorizont aufweisen.

Um die Gesamtliquidität der Gesellschaft zu steuern und einen ordnungsgemäßen Verkauf der Wertpapiere zu ermöglichen, darf der Verwaltungsrat gemäß den Bestimmungen des Verkaufsprospekts den Rückkauf von Anteilen verweigern, die an einem Bewertungstag ein Zehntel der in Umlauf befindlichen Anteile eines Fonds übersteigen.

ANZAHL ANTEILINHABER

Die Gesellschaft wies am Ende des aktuellen Geschäftsjahres und des Vorjahres mindestens 10 Inhaber von einlösbaren, partizipierenden Anteilen auf.

MANAGEMENT DES KAPITALRISIKOS

Das Kapital der Fonds wird durch das Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums dargestellt. Der Betrag des Nettovermögens kann täglich erheblich schwanken, da die Fonds täglichen Zeichnungen und Rücknahmen im Ermessen der Anteilsinhaber unterliegen. Das Ziel der Fonds bei der Kapitalverwaltung besteht darin, seine Fähigkeit zur Unternehmensfortführung zu bewahren, um Erträge für die Anteilsinhaber und Vorteile für sonstige Interessengruppen zu liefern und eine solide Kapitalbasis zu erhalten und so die Entwicklung der Anlagetätigkeit der Fonds zu unterstützen.

Im Rahmen ihrer Politik führt die Gesellschaft unter anderem folgende Maßnahmen durch, um die Kapitalstruktur zu erhalten oder anzupassen:

- Die Gesellschaft überwacht die Menge der täglichen Zeichnungen und Rücknahmen in Bezug auf die voraussichtlich liquidierbaren Anlagen und passt die Höhe der an die Inhaber einlösbarer partizipierender Anteile zu zahlenden Ausschüttungen entsprechend an.
- Einlösbare partizipierende Anteile werden in Übereinstimmung mit dem Prospekt und den Ergänzungen der Fonds ausgegeben und zurückgenommen; dies beinhaltet die Fähigkeit, Rücknahmen zu beschränken und das Erfordernis gewisser Mindestbeteiligungen und Mindestzeichnungen.

BEWERTUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS

Die Gesellschaft hat die Bewertung zum beizulegenden Zeitwert anhand einer Bemessungshierarchie (Fair-Value-Hierarchie) eingestuft, die die Bedeutung der Inputfaktoren der Berechnung widerspiegelt: Die Hierarchie für den beizulegenden Zeitwert hat folgende Stufen:

Stufe 1: Kursnotierungen (unbereinigt) in aktiven Märkten für gleiche Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten.

Stufe 2: Abgesehen von Kursnotierungen gehören zu den Informationen der 1. Stufe solche Angaben, die für einen Vermögenswert oder eine Verbindlichkeit direkt (das heißt als Preise) oder indirekt (das heißt abgeleitet von den Preisen) beobachtbar sind.

15. ZIELE UND STRATEGIEN DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

BEWERTUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Stufe 3: Informationen zu Vermögenswerten oder Verbindlichkeiten, die nicht auf beobachtbaren Marktdaten basieren (das heißt nicht beobachtbare Informationen).

Zu den Instrumenten, deren Wert auf Kursnotierungen an aktiven Märkten basiert und die daher auf Stufe 1 eingestuft werden, gehören aktive 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 Eingaben 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 Aktien. Da Anlagen der Stufe 2 Positionen beinhalten, die nicht an aktiven Märkten gehandelt werden und/oder Übertragungsbeschränkungen unterliegen, können die Bewertungen, die üblicherweise auf den verfügbaren Marktdaten basieren, angepasst werden, um die Illiquidität und/oder Nichtübertragbarkeit zu reflektieren.

Die in Stufe 3 eingestuften Anlagen zeichnen sich durch umfangreiche nicht beobachtbare Inputs auf, da sie unregelmäßig gehandelt werden. Zu den Instrumenten der Stufe 3 zählen unter anderem fremdfinanzierte Darlehen und Unternehmensanleihen, die zum Anschaffungswert oder nach ihrem beizumessenden Zeitwert unter Anwendung der Einzelmaklerquote bewertet werden. Nicht beobachtbare Inputs werden bei der Bewertung des beizulegenden Zeitwerts verwendet, sofern keine relevanten verfügbaren Inputs 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 Parameter jene Annahmen widerspiegeln, die Marktteilnehmer bei der Preisermittlung für den Vermögenswert oder die Verbindlichkeit verwenden würden, einschließlich der Risikoannahmen. Die Sensitivität nicht beobachtbarer Eingaben, die bei der Feststellung fairer Werte der Wertpapiere der Stufe 3 verwendet wird, ist nicht unmittelbar bestimmbar.

Die nachfolgende Tabelle enthält eine Analyse von Finanzinstrumenten, die zum beizulegenden Zeitwert zum 30. Juni 2020 bewertet werden.

Fonds Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe am 30. Juni 2020
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund				
	EUR	EUR	EUR	EUR
Anleihen	70.602.461	169.987.223	–	240.589.684
Organismen für gemeinsame Anlagen	–	5.153.938	–	5.153.938
Kreditverzugsswaps	–	13.171.172	–	13.171.172
Terminkontrakte	–	4.769.777	–	4.769.777
Futures	1.288.311	–	–	1.288.311
Leveraged Loans	–	10.345.900	9.353.607	19.699.507
Optionen	–	47.765	–	47.765
Finanzielle Vermögenswerte	71.890.772	203.475.775	9.353.607	284.720.154
Kreditverzugsswaps	–	(14.004.709)	–	(14.004.709)
Terminkontrakte	–	(5.087.307)	–	(5.087.307)
Futures	(2.642.113)	–	–	(2.642.113)
Optionen	–	(117.281)	–	(117.281)
Finanzielle Verbindlichkeiten	(2.642.113)	(19.209.297)	–	(21.851.410)

15. ZIELE UND STRATEGIEN DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

BEWERTUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe am 30. Juni 2020
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund				
	GBP	GBP	GBP	GBP
Anleihen	26.030.030	–	–	26.030.030
Einlagenzertifikate	85.049.206	–	–	85.049.206
Organismen für gemeinsame Anlagen	–	29.419.033	–	29.419.033
Commercial Paper	–	44.997.636	–	44.997.636
Aktien	15.491.247	–	–	15.491.247
Aktienindexswaps	–	647.644	–	647.644
Aktienwaps	–	9.279.343	–	9.279.343
Variabel verzinsliche Schuldtitel	–	41.035.745	–	41.035.745
Terminkontrakte	–	4.424.682	–	4.424.682
Futures	129.507	–	–	129.507
Finanzielle Vermögenswerte	126.699.990	129.804.083	–	256.504.073
Aktienindexswaps	–	(1.792.118)	–	(1.792.118)
Aktienwaps	–	(4.230.707)	–	(4.230.707)
Terminkontrakte	–	(598.089)	–	(598.089)
Futures	(7.585)	–	–	(7.585)
Finanzielle Verbindlichkeiten	(7.585)	(6.620.914)	–	(6.628.499)
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund				
	EUR	EUR	EUR	EUR
Anleihen	17.138.376	6.221.152	–	23.359.528
Organismen für gemeinsame Anlagen	–	2.594.748	–	2.594.748
Aktienwaps	–	244.051	–	244.051
Terminkontrakte	–	37.686	–	37.686
Futures	14.419	–	–	14.419
Preferred Bonds	–	2.307.341	–	2.307.341
Total Return Swaps	–	2.337.624	–	2.337.624
Finanzielle Vermögenswerte	17.152.795	13.742.602	–	30.895.397
Aktienwaps	–	(1.875.470)	–	(1.875.470)
Terminkontrakte	–	(4.594)	–	(4.594)
Futures	(10.347)	–	–	(10.347)
Total Return Swaps	–	(127.150)	–	(127.150)
Finanzielle Verbindlichkeiten	(10.347)	(2.007.214)	–	(2.017.561)
BNY Mellon Asia Rising Stars Fund				
	USD	USD	USD	USD
Aktien	6.004.993	168.111	–	6.173.104
Terminkontrakte	–	128	–	128
Genussscheine	–	709.117	–	709.117
Finanzielle Vermögenswerte	6.004.993	877.356	–	6.882.349
Terminkontrakte	–	(8.289)	–	(8.289)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(8.289)	–	(8.289)

15. ZIELE UND STRATEGIEN DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

BEWERTUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe am 30. Juni 2020
BNY Mellon Asian Equity Fund				
	USD	USD	USD	USD
Aktien	37.417.306	190.330	–	37.607.636
Terminkontrakte	–	148	–	148
Finanzielle Vermögenswerte	37.417.306	190.478	–	37.607.784
Terminkontrakte	–	(568)	–	(568)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(568)	–	(568)
BNY Mellon Asian Income Fund				
	USD	USD	USD	USD
Organismen für gemeinsame Anlagen	–	1.076.297	–	1.076.297
Aktien	24.064.650	3.331.127	–	27.395.777
Terminkontrakte	–	5	–	5
Finanzielle Vermögenswerte	24.064.650	4.407.429	–	28.472.079
Terminkontrakte	–	(3)	–	(3)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(3)	–	(3)
BNY Mellon Brazil Equity Fund				
	USD	USD	USD	USD
Aktien	51.756.103	7.923.679	–	59.679.782
Terminkontrakte	–	7.152	–	7.152
Finanzielle Vermögenswerte	51.756.103	7.930.831	–	59.686.934
Terminkontrakte	–	(68.926)	–	(68.926)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(68.926)	–	(68.926)
BNY Mellon Digital Assets Fund				
	USD	USD	USD	USD
Aktien	10.938.881	–	–	10.938.881
Terminkontrakte	–	151	–	151
Finanzielle Vermögenswerte	10.938.881	151	–	10.939.032
Terminkontrakte	–	(5.869)	–	(5.869)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(5.869)	–	(5.869)

15. ZIELE UND STRATEGIEN DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

BEWERTUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe am 30. Juni 2020
BNY Mellon Dynamic Total Return Fund				
	USD	USD	USD	USD
Anleihen	17.594.381	–	–	17.594.381
Organismen für gemeinsame Anlagen	2.212.974	–	–	2.212.974
Terminkontrakte	–	120.229	–	120.229
Futures	222.601	–	–	222.601
Optionen	1.929.651	–	–	1.929.651
Finanzielle Vermögenswerte	21.959.607	120.229	–	22.079.836
Terminkontrakte	–	(159.607)	–	(159.607)
Futures	(84.197)	–	–	(84.197)
Optionen	(103.200)	–	–	(103.200)
Finanzielle Verbindlichkeiten	(187.397)	(159.607)	–	(347.004)
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund				
	USD	USD	USD	USD
Anleihen	30.488.824	–	–	30.488.824
Aktien	342.199.156	–	–	342.199.156
Terminkontrakte	–	78	–	78
Futures	266.364	–	–	266.364
Optionen	3.337.581	–	–	3.337.581
Finanzielle Vermögenswerte	376.291.925	78	–	376.292.003
Terminkontrakte	–	(1.383)	–	(1.383)
Futures	(2.212)	–	–	(2.212)
Finanzielle Verbindlichkeiten	(2.212)	(1.383)	–	(3.595)
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund*				
	USD	USD	USD	USD
Anleihen	–	62.137.658	–	62.137.658
Terminkontrakte	–	246.594	–	246.594
Futures	6.374	–	–	6.374
Finanzielle Vermögenswerte	6.374	62.384.252	–	62.390.626
Terminkontrakte	–	(1.583.800)	–	(1.583.800)
Futures	(14.171)	–	–	(14.171)
Finanzielle Verbindlichkeiten	(14.171)	(1.583.800)	–	(1.597.971)
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund				
	USD	USD	USD	USD
Anleihen	–	991.996.884	11.180	992.008.064
Organismen für gemeinsame Anlagen	11.262.180	–	–	11.262.180
Terminkontrakte	–	185.862	–	185.862
Finanzielle Vermögenswerte	11.262.180	992.182.746	11.180	1.003.456.106
Kreditverzugsswaps	–	(128.895)	–	(128.895)
Terminkontrakte	–	(10.946.757)	–	(10.946.757)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(11.075.652)	–	(11.075.652)

15. ZIELE UND STRATEGIEN DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

BEWERTUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe am 30. Juni 2020
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund	USD	USD	USD	USD
Anleihen	–	270.219.921	–	270.219.921
Organismen für gemeinsame Anlagen	–	28.701.024	–	28.701.024
Terminkontrakte	–	28.903	–	28.903
Finanzielle Vermögenswerte	–	298.949.848	–	298.949.848
Terminkontrakte	–	(3.262.058)	–	(3.262.058)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(3.262.058)	–	(3.262.058)
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	USD	USD	USD	USD
Anleihen	149.985	28.784.375	–	28.934.360
Terminkontrakte	–	8.503	–	8.503
Futures	14.563	–	–	14.563
Finanzielle Vermögenswerte	164.548	28.792.878	–	28.957.426
Terminkontrakte	–	(34.624)	–	(34.624)
Futures	(23.818)	–	–	(23.818)
Finanzielle Verbindlichkeiten	(23.818)	(34.624)	–	(58.442)
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund	USD	USD	USD	USD
Anleihen	2.410.767	247.038.063	–	249.448.830
Terminkontrakte	–	1.540.732	–	1.540.732
Optionen	–	20.750	–	20.750
Finanzielle Vermögenswerte	2.410.767	248.599.545	–	251.010.312
Terminkontrakte	–	(3.086.226)	–	(3.086.226)
Optionen	–	(370.685)	–	(370.685)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(3.456.911)	–	(3.456.911)
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund	USD	USD	USD	USD
Anleihen	19.998	28.797.830	–	28.817.828
Terminkontrakte	–	134.312	–	134.312
Futures	250	–	–	250
Optionen	–	2.328	–	2.328
Finanzielle Vermögenswerte	20.248	28.934.470	–	28.954.718
Terminkontrakte	–	(150.817)	–	(150.817)
Futures	(3.472)	–	–	(3.472)
Optionen	–	(31.296)	–	(31.296)
Finanzielle Verbindlichkeiten	(3.472)	(182.113)	–	(185.585)

15. ZIELE UND STRATEGIEN DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

BEWERTUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe am 30. Juni 2020
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund				
	USD	USD	USD	USD
Anleihen	–	185.721.421	–	185.721.421
Organismen für gemeinsame Anlagen	–	9.750.123	–	9.750.123
Terminkontrakte	–	1.229.122	–	1.229.122
Finanzielle Vermögenswerte	–	196.700.666	–	196.700.666
Terminkontrakte	–	(5.803.453)	–	(5.803.453)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(5.803.453)	–	(5.803.453)
BNY Mellon Euroland Bond Fund				
	EUR	EUR	EUR	EUR
Anleihen	81.855.731	418.887.595	–	500.743.326
Organismen für gemeinsame Anlagen	–	15.454.797	–	15.454.797
Kreditverzugsswaps	–	91.146	–	91.146
Terminkontrakte	–	204.079	–	204.079
Futures	1.622.386	–	–	1.622.386
Zinsswaps	–	2.492.707	–	2.492.707
Optionen	–	491	–	491
Finanzielle Vermögenswerte	83.478.117	437.130.815	–	520.608.932
Kreditverzugsswaps	–	(498.200)	–	(498.200)
Terminkontrakte	–	(877.792)	–	(877.792)
Futures	(1.600.252)	–	–	(1.600.252)
Finanzielle Verbindlichkeiten	(1.600.252)	(1.375.992)	–	(2.976.244)
BNY Mellon European Credit Fund				
	EUR	EUR	EUR	EUR
Anleihen	–	65.554.285	–	65.554.285
Organismen für gemeinsame Anlagen	–	2.956.339	–	2.956.339
Kreditverzugsswaps	–	11.984	–	11.984
Terminkontrakte	–	135.276	–	135.276
Futures	40.050	–	–	40.050
Finanzielle Vermögenswerte	40.050	68.657.884	–	68.697.934
Terminkontrakte	–	(18.887)	–	(18.887)
Futures	(24.240)	–	–	(24.240)
Finanzielle Verbindlichkeiten	(24.240)	(18.887)	–	(43.127)
BNY Mellon Global Bond Fund				
	USD	USD	USD	USD
Anleihen	262.026.501	306.234.442	–	568.260.943
Organismen für gemeinsame Anlagen	16.781.381	–	–	16.781.381
Terminkontrakte	–	1.382.086	–	1.382.086
Finanzielle Vermögenswerte	278.807.882	307.616.528	–	586.424.410
Terminkontrakte	–	(938.251)	–	(938.251)
Futures	(328.855)	–	–	(328.855)
Finanzielle Verbindlichkeiten	(328.855)	(938.251)	–	(1.267.106)

15. ZIELE UND STRATEGIEN DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

BEWERTUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe am 30. Juni 2020
BNY Mellon Global Credit Fund				
	USD	USD	USD	USD
Anleihen	152.224.233	444.372.591	–	596.596.824
Organismen für gemeinsame Anlagen	–	16.193.685	–	16.193.685
Kreditverzugsswaps	–	6.453.434	–	6.453.434
Terminkontrakte	–	1.708.121	–	1.708.121
Futures	229.747	–	–	229.747
Optionen	–	38.990	–	38.990
Finanzielle Vermögenswerte	152.453.980	468.766.821	–	621.220.801
Kreditverzugsswaps	–	(6.924.496)	–	(6.924.496)
Terminkontrakte	–	(5.102.579)	–	(5.102.579)
Futures	(460.407)	–	–	(460.407)
Optionen	–	(18.094)	–	(18.094)
Finanzielle Verbindlichkeiten	(460.407)	(12.045.169)	–	(12.505.576)
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund				
	USD	USD	USD	USD
Anleihen	73.391.474	277.657.650	–	351.049.124
Organismen für gemeinsame Anlagen	1.810.749	5.108.233	–	6.918.982
Terminkontrakte	–	3.111.056	–	3.111.056
Finanzielle Vermögenswerte	75.202.223	285.876.939	–	361.079.162
Terminkontrakte	–	(2.266.757)	–	(2.266.757)
Futures	(223.402)	–	–	(223.402)
Finanzielle Verbindlichkeiten	(223.402)	(2.266.757)	–	(2.490.159)
BNY Mellon Global Emerging Markets Fund				
	USD	USD	USD	USD
Aktien	29.834.742	228.094	–	30.062.836
Terminkontrakte	–	212	–	212
Finanzielle Vermögenswerte	29.834.742	228.306	–	30.063.048
Terminkontrakte	–	(9.635)	–	(9.635)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(9.635)	–	(9.635)
BNY Mellon Global Equity Fund				
	USD	USD	USD	USD
Aktien	354.442.141	2.451.028	–	356.893.169
Terminkontrakte	–	90	–	90
Finanzielle Vermögenswerte	354.442.141	2.451.118	–	356.893.259
Terminkontrakte	–	(378.554)	–	(378.554)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(378.554)	–	(378.554)

15. ZIELE UND STRATEGIEN DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

BEWERTUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe am 30. Juni 2020
BNY Mellon Global Equity Income Fund				
	USD	USD	USD	USD
Organismen für gemeinsame Anlagen	–	15.323.634	–	15.323.634
Aktien	1.129.219.369	40.016.011	–	1.169.235.380
Terminkontrakte	–	21.739	–	21.739
Finanzielle Vermögenswerte	1.129.219.369	55.361.384	–	1.184.580.753
Terminkontrakte	–	(570.150)	–	(570.150)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(570.150)	–	(570.150)
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund				
	USD	USD	USD	USD
Anleihen	–	106.515.228	650.559	107.165.787
Terminkontrakte	–	74.188	–	74.188
Leveraged Loans	–	921.752	–	921.752
Finanzielle Vermögenswerte	–	107.511.168	650.559	108.161.727
Terminkontrakte	–	(469.320)	–	(469.320)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(469.320)	–	(469.320)
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund				
	USD	USD	USD	USD
Aktien	148.088.993	–	–	148.088.993
Terminkontrakte	–	269.707	–	269.707
Finanzielle Vermögenswerte	148.088.993	269.707	–	148.358.700
Terminkontrakte	–	(3.365.373)	–	(3.365.373)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(3.365.373)	–	(3.365.373)
BNY Mellon Global Leaders Fund				
	USD	USD	USD	USD
Aktien	62.584.169	–	–	62.584.169
Terminkontrakte	–	222	–	222
Finanzielle Vermögenswerte	62.584.169	222	–	62.584.391
Terminkontrakte	–	(14.845)	–	(14.845)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(14.845)	–	(14.845)

15. ZIELE UND STRATEGIEN DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

BEWERTUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe am 30. Juni 2020
BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund				
	EUR	EUR	EUR	EUR
Anleihen	721.602	3.820.656	–	4.542.258
Organismen für gemeinsame Anlagen	–	1.827.601	–	1.827.601
Aktien	9.795.832	629.029	–	10.424.861
Instrumente für Aktienanlagen	–	3.241.635	–	3.241.635
Terminkontrakte	–	356.165	–	356.165
Preferred Bonds	–	28.547	–	28.547
Finanzielle Vermögenswerte	10.517.434	9.903.633	–	20.421.067
Terminkontrakte	–	(30.500)	–	(30.500)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(30.500)	–	(30.500)
BNY Mellon Global Opportunities Fund				
	USD	USD	USD	USD
Anleihen	1.274.657	–	–	1.274.657
Aktien	31.809.101	332.020	–	32.141.121
Terminkontrakte	–	22.330	–	22.330
Finanzielle Vermögenswerte	33.083.758	354.350	–	33.438.108
Terminkontrakte	–	(6.469)	–	(6.469)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(6.469)	–	(6.469)
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)				
	EUR	EUR	EUR	EUR
Anleihen	–	624.486.921	–	624.486.921
Organismen für gemeinsame Anlagen	504.819.517	3.881.593	–	508.701.110
Aktien	1.123.468.962	20.130.448	–	1.143.599.410
Instrumente für Aktienanlagen	–	186.655.203	–	186.655.203
Terminkontrakte	–	60.260.433	–	60.260.433
Futures	6.471.273	–	–	6.471.273
Optionen	58.053.694	–	–	58.053.694
Finanzielle Vermögenswerte	1.692.813.446	895.414.598	–	2.588.228.044
Terminkontrakte	–	(5.714.289)	–	(5.714.289)
Optionen	(18.931.157)	–	–	(18.931.157)
Finanzielle Verbindlichkeiten	(18.931.157)	(5.714.289)	–	(24.645.446)

15. ZIELE UND STRATEGIEN DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

BEWERTUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe am 30. Juni 2020
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)				
	GBP	GBP	GBP	GBP
Anleihen	5.615.765	11.414.224	–	17.029.989
Organismen für gemeinsame Anlagen	11.840.088	–	–	11.840.088
Aktien	25.271.830	481.629	–	25.753.459
Instrumente für Aktienanlagen	–	4.722.821	–	4.722.821
Terminkontrakte	–	210.593	–	210.593
Futures	147.361	–	–	147.361
Optionen	1.316.353	–	–	1.316.353
Finanzielle Vermögenswerte	44.191.397	16.829.267	–	61.020.664
Terminkontrakte	–	(939.461)	–	(939.461)
Optionen	(430.272)	–	–	(430.272)
Finanzielle Verbindlichkeiten	(430.272)	(939.461)	–	(1.369.733)
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)				
	USD	USD	USD	USD
Anleihen	8.526.003	55.925.978	–	64.451.981
Organismen für gemeinsame Anlagen	54.775.413	–	–	54.775.413
Aktien	119.423.792	2.263.936	–	121.687.728
Instrumente für Aktienanlagen	–	21.901.779	–	21.901.779
Terminkontrakte	–	902.415	–	902.415
Futures	660.018	–	–	660.018
Optionen	6.191.968	–	–	6.191.968
Finanzielle Vermögenswerte	189.577.194	80.994.108	–	270.571.302
Terminkontrakte	–	(2.598.021)	–	(2.598.021)
Optionen	(2.036.817)	–	–	(2.036.817)
Finanzielle Verbindlichkeiten	(2.036.817)	(2.598.021)	–	(4.634.838)
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund				
	USD	USD	USD	USD
Anleihen	–	652.636.524	–	652.636.524
Organismen für gemeinsame Anlagen	–	40.036.541	–	40.036.541
Terminkontrakte	–	1.614.579	–	1.614.579
Leveraged Loans	–	43.972.352	–	43.972.352
Finanzielle Vermögenswerte	–	738.259.996	–	738.259.996
Terminkontrakte	–	(14.315.792)	–	(14.315.792)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(14.315.792)	–	(14.315.792)

15. ZIELE UND STRATEGIEN DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

BEWERTUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe am 30. Juni 2020
BNY Mellon Global Unconstrained Fund				
	USD	USD	USD	USD
Anleihen	2.723.734	2.293.151	–	5.016.885
Organismen für gemeinsame Anlagen	1.675.623	90.015	–	1.765.838
Aktien	14.325.726	544.292	–	14.870.018
Instrumente für Aktienanlagen	–	918.341	–	918.341
Terminkontrakte	–	19.249	–	19.249
Finanzielle Vermögenswerte	18.725.083	3.865.048	–	22.590.131
Terminkontrakte	–	(484.511)	–	(484.511)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(484.511)	–	(484.511)
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund				
	JPY	JPY	JPY	JPY
Aktien	11.905.573.200	–	–	11.905.573.200
Terminkontrakte	–	4.575.844	–	4.575.844
Finanzielle Vermögenswerte	11.905.573.200	4.575.844	–	11.910.149.044
Terminkontrakte	–	(15.556.005)	–	(15.556.005)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(15.556.005)	–	(15.556.005)
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund				
	EUR	EUR	EUR	EUR
Aktien	1.357.760.571	–	–	1.357.760.571
Terminkontrakte	–	80.608	–	80.608
Finanzielle Vermögenswerte	1.357.760.571	80.608	–	1.357.841.179
Terminkontrakte	–	(1.700)	–	(1.700)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(1.700)	–	(1.700)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund				
	USD	USD	USD	USD
Aktien	192.086.126	–	–	192.086.126
Terminkontrakte	–	67.176	–	67.176
Finanzielle Vermögenswerte	192.086.126	67.176	–	192.153.302
Terminkontrakte	–	(519.253)	–	(519.253)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(519.253)	–	(519.253)
BNY Mellon S&P 500® Index Tracker				
	USD	USD	USD	USD
Anleihen	35.964	–	–	35.964
Aktien	32.581.250	–	–	32.581.250
Futures	6.655	–	–	6.655
Finanzielle Vermögenswerte	32.623.869	–	–	32.623.869

15. ZIELE UND STRATEGIEN DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

BEWERTUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe am 30. Juni 2020
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund				
	EUR	EUR	EUR	EUR
Aktien	46.505.015	1.464.944	–	47.969.959
Finanzielle Vermögenswerte	46.505.015	1.464.944	–	47.969.959
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund				
	EUR	EUR	EUR	EUR
Anleihen	35.682.711	172.609.518	–	208.292.229
Terminkontrakte	–	5.795.312	–	5.795.312
Finanzielle Vermögenswerte	35.682.711	178.404.830	–	214.087.541
Terminkontrakte	–	(1.673.271)	–	(1.673.271)
Futures	(135.191)	–	–	(135.191)
Finanzielle Verbindlichkeiten	(135.191)	(1.673.271)	–	(1.808.462)
BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)*				
	EUR	EUR	EUR	EUR
Anleihen	–	5.420.855	–	5.420.855
Organismen für gemeinsame Anlagen	4.004.952	122.669	–	4.127.621
Aktien	9.913.727	–	–	9.913.727
Instrumente für Aktienanlagen	–	2.260.205	–	2.260.205
Terminkontrakte	–	617.894	–	617.894
Futures	54.593	–	–	54.593
Optionen	484.503	–	–	484.503
Finanzielle Vermögenswerte	14.457.775	8.421.623	–	22.879.398
Terminkontrakte	–	(67.894)	–	(67.894)
Optionen	(158.793)	–	–	(158.793)
Finanzielle Verbindlichkeiten	(158.793)	(67.894)	–	(226.687)
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund				
	USD	USD	USD	USD
Anleihen	35.934.503	45.916.295	250.000	82.100.798
Kreditverzugsswaps	–	8.449	–	8.449
Terminkontrakte	–	134.448	–	134.448
Futures	84.349	–	–	84.349
Finanzielle Vermögenswerte	36.018.852	46.059.192	250.000	82.328.044
Kreditverzugsswaps	–	(78.590)	–	(78.590)
Terminkontrakte	–	(3.103.223)	–	(3.103.223)
Futures	(454.525)	–	–	(454.525)
Finanzielle Verbindlichkeiten	(454.525)	(3.181.813)	–	(3.636.338)
BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund				
	USD	USD	USD	USD
Aktien	28.777.108	–	–	28.777.108
Finanzielle Vermögenswerte	28.777.108	–	–	28.777.108

15. ZIELE UND STRATEGIEN DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

BEWERTUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe am 30. Juni 2020
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund				
	USD	USD	USD	USD
Organismen für gemeinsame Anlagen	2.788.194	–	–	2.788.194
Aktien	255.535.275	–	–	255.535.275
Terminkontrakte	–	7.518	–	7.518
Preferred Bonds	–	6.526.048	–	6.526.048
Finanzielle Vermögenswerte	258.323.469	6.533.566	–	264.857.035
Terminkontrakte	–	(57.341)	–	(57.341)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(57.341)	–	(57.341)
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund				
	USD	USD	USD	USD
Anleihen	–	498.811.107	–	498.811.107
Terminkontrakte	–	77.682	–	77.682
Finanzielle Vermögenswerte	–	498.888.789	–	498.888.789
Terminkontrakte	–	(1.998.832)	–	(1.998.832)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(1.998.832)	–	(1.998.832)

* Siehe Erläuterung 18 zum Halbjahresabschluss.

Die nachfolgende Tabelle enthält eine Analyse von Finanzinstrumenten, die zum beizulegenden Zeitwert zum 31. Dezember 2019 bewertet werden.

Fonds Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe am 31. Dezember 2019
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund				
	EUR	EUR	EUR	EUR
Anleihen	135.212.280	191.942.632	2.408.332	329.563.244
Organismen für gemeinsame Anlagen	–	16.772.645	–	16.772.645
Kreditverzugsswaps	–	4.985.232	–	4.985.232
Terminkontrakte	–	3.496.534	–	3.496.534
Futures	4.038.479	–	–	4.038.479
Leveraged Loans	–	13.539.017	11.398.966	24.937.983
Optionen	–	176.114	–	176.114
Finanzielle Vermögenswerte	139.250.759	230.912.174	13.807.298	383.970.231
Kreditverzugsswaps	–	(11.120.273)	–	(11.120.273)
Terminkontrakte	–	(4.463.886)	–	(4.463.886)
Futures	(1.605.562)	–	–	(1.605.562)
Optionen	–	(350.500)	–	(350.500)
Finanzielle Verbindlichkeiten	(1.605.562)	(15.934.659)	–	(17.540.221)

15. ZIELE UND STRATEGIEN DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

BEWERTUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe am 31. Dezember 2019
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund	GBP	GBP	GBP	GBP
Anleihen	30.070.509	–	–	30.070.509
Einlagenzertifikate	88.424.318	–	–	88.424.318
Organismen für gemeinsame Anlagen	–	47.391.584	–	47.391.584
Commercial Paper	–	60.933.075	–	60.933.075
Aktien	25.172.419	–	–	25.172.419
Aktienindexswaps	–	152.138	–	152.138
Aktien swaps	–	13.783.427	–	13.783.427
Variabel verzinsliche Schuldtitel	–	115.083.219	–	115.083.219
Terminkontrakte	–	2.662.866	–	2.662.866
Futures	54.531	–	–	54.531
Finanzielle Vermögenswerte	143.721.777	240.006.309	–	383.728.086
Aktienindexswaps	–	(1.954.263)	–	(1.954.263)
Aktien swaps	–	(8.271.104)	–	(8.271.104)
Terminkontrakte	–	(115.097)	–	(115.097)
Futures	(16.487)	–	–	(16.487)
Finanzielle Verbindlichkeiten	(16.487)	(10.340.464)	–	(10.356.951)
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund*	EUR	EUR	EUR	EUR
Anleihen	11.422.862	10.100.031	–	21.522.893
Organismen für gemeinsame Anlagen	–	1.894.992	–	1.894.992
Aktien swaps	–	109.042	–	109.042
Terminkontrakte	–	50.991	–	50.991
Futures	4.298	–	–	4.298
Preferred Bonds	–	4.032.654	–	4.032.654
Total Return Swaps	–	1.275.729	–	1.275.729
Finanzielle Vermögenswerte	11.427.160	17.463.439	–	28.890.599
Aktien swaps	–	(1.042.241)	–	(1.042.241)
Terminkontrakte	–	(39.971)	–	(39.971)
Total Return Swaps	–	(70.096)	–	(70.096)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(1.152.308)	–	(1.152.308)
BNY Mellon Asia Rising Stars Fund	USD	USD	USD	USD
Aktien	6.794.347	275.836	–	7.070.183
Terminkontrakte	–	11.466	–	11.466
Genussscheine	–	913.135	–	913.135
Finanzielle Vermögenswerte	6.794.347	1.200.437	–	7.994.784

15. ZIELE UND STRATEGIEN DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

BEWERTUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe am 31. Dezember 2019
	USD	USD	USD	USD
BNY Mellon Asian Equity Fund				
Aktien	37.598.053	200.807	–	37.798.860
Finanzielle Vermögenswerte	37.598.053	200.807	–	37.798.860
Terminkontrakte	–	(6)	–	(6)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(6)	–	(6)
BNY Mellon Asian Income Fund				
Organismen für gemeinsame Anlagen	–	1.257.223	–	1.257.223
Aktien	25.374.427	3.546.988	–	28.921.415
Finanzielle Vermögenswerte	25.374.427	4.804.211	–	30.178.638
Terminkontrakte	–	(43)	–	(43)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(43)	–	(43)
BNY Mellon Brazil Equity Fund				
Aktien	75.233.576	30.465.011	–	105.698.587
Terminkontrakte	–	79.467	–	79.467
Finanzielle Vermögenswerte	75.233.576	30.544.478	–	105.778.054
Terminkontrakte	–	(867)	–	(867)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(867)	–	(867)
BNY Mellon Digital Assets Fund*				
Aktien	11.054.505	–	–	11.054.505
Terminkontrakte	–	4.410	–	4.410
Finanzielle Vermögenswerte	11.054.505	4.410	–	11.058.915
Terminkontrakte	–	(21)	–	(21)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(21)	–	(21)

15. ZIELE UND STRATEGIEN DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

BEWERTUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe am 31. Dezember 2019
BNY Mellon Dynamic Total Return Fund	USD	USD	USD	USD
Anleihen	20.910.671	–	–	20.910.671
Organismen für gemeinsame Anlagen	2.513.813	–	–	2.513.813
Terminkontrakte	–	171.752	–	171.752
Futures	172.119	–	–	172.119
Optionen	1.057.988	–	–	1.057.988
Finanzielle Vermögenswerte	24.654.591	171.752	–	24.826.343
Terminkontrakte	–	(202.197)	–	(202.197)
Futures	(22.617)	–	–	(22.617)
Optionen	(32.750)	–	–	(32.750)
Finanzielle Verbindlichkeiten	(55.367)	(202.197)	–	(257.564)
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	USD	USD	USD	USD
Anleihen	24.159.866	–	–	24.159.866
Aktien	141.151.034	–	–	141.151.034
Terminkontrakte	–	1.372	–	1.372
Futures	382.208	–	–	382.208
Optionen	2.896.950	–	–	2.896.950
Finanzielle Vermögenswerte	168.590.058	1.372	–	168.591.430
Futures	(514.632)	–	–	(514.632)
Finanzielle Verbindlichkeiten	(514.632)	–	–	(514.632)
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund*	USD	USD	USD	USD
Anleihen	–	691.150.317	11.034	691.161.351
Kreditverzugsswaps	–	1.430.980	–	1.430.980
Terminkontrakte	–	4.523.271	–	4.523.271
Finanzielle Vermögenswerte	–	697.115.602	11.034	697.115.602
Terminkontrakte	–	(15.359)	–	(15.359)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(15.359)	–	(15.359)
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund	USD	USD	USD	USD
Anleihen	–	330.323.251	–	330.323.251
Organismen für gemeinsame Anlagen	–	17.201.452	–	17.201.452
Terminkontrakte	–	1.170.429	–	1.170.429
Finanzielle Vermögenswerte	–	348.695.132	–	348.695.132
Kreditverzugsswaps	–	(222.809)	–	(222.809)
Terminkontrakte	–	(488.963)	–	(488.963)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(711.772)	–	(711.772)

15. ZIELE UND STRATEGIEN DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

BEWERTUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe am 31. Dezember 2019
	USD	USD	USD	USD
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund				
Anleihen	209.073	50.310.517	–	50.519.590
Terminkontrakte	–	40.417	–	40.417
Futures	64.104	–	–	64.104
Finanzielle Vermögenswerte	273.177	50.350.934	–	50.624.111
Terminkontrakte	–	(40.535)	–	(40.535)
Futures	(83.461)	–	–	(83.461)
Finanzielle Verbindlichkeiten	(83.461)	(40.535)	–	(123.996)
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund				
Anleihen	2.070.823	437.381.685	–	439.452.508
Terminkontrakte	–	3.788.873	–	3.788.873
Optionen	–	718.204	–	718.204
Finanzielle Vermögenswerte	2.070.823	441.888.762	–	443.959.585
Terminkontrakte	–	(3.356.348)	–	(3.356.348)
Optionen	–	(184.498)	–	(184.498)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(3.540.846)	–	(3.540.846)
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund				
Anleihen	19.912	28.929.168	–	28.949.080
Terminkontrakte	–	107.376	–	107.376
Futures	4.666	–	–	4.666
Optionen	–	47.933	–	47.933
Finanzielle Vermögenswerte	24.578	29.084.477	–	29.109.055
Terminkontrakte	–	(172.735)	–	(172.735)
Futures	(1.079)	–	–	(1.079)
Zinsswaps	–	(15.026)	–	(15.026)
Optionen	–	(13.256)	–	(13.256)
Finanzielle Verbindlichkeiten	(1.079)	(201.017)	–	(202.096)
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund				
Anleihen	–	142.282.680	–	142.282.680
Organismen für gemeinsame Anlagen	–	4.800.000	–	4.800.000
Terminkontrakte	–	2.147.691	–	2.147.691
Finanzielle Vermögenswerte	–	149.230.371	–	149.230.371
Terminkontrakte	–	(1.735.918)	–	(1.735.918)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(1.735.918)	–	(1.735.918)

15. ZIELE UND STRATEGIEN DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

BEWERTUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe am 31. Dezember 2019
BNY Mellon Euroland Bond Fund				
	EUR	EUR	EUR	EUR
Anleihen	358.198.086	472.370.945	–	830.569.031
Organismen für gemeinsame Anlagen	–	30.612.679	–	30.612.679
Kreditverzugsswaps	–	1.691.286	–	1.691.286
Terminkontrakte	–	2.292.120	–	2.292.120
Futures	3.626.095	–	–	3.626.095
Zinsswaps	–	2.014.460	–	2.014.460
Optionen	78.104	292.581	–	370.685
Finanzielle Vermögenswerte	361.902.285	509.274.071	–	871.176.356
Terminkontrakte	–	(1.806.177)	–	(1.806.177)
Futures	(571.150)	–	–	(571.150)
Zinsswaps	–	(506.723)	–	(506.723)
Optionen	(76.586)	(120.877)	–	(197.463)
Finanzielle Verbindlichkeiten	(647.736)	(2.433.777)	–	(3.081.513)
BNY Mellon European Credit Fund				
	EUR	EUR	EUR	EUR
Anleihen	–	74.079.576	–	74.079.576
Organismen für gemeinsame Anlagen	–	4.845.219	–	4.845.219
Kreditverzugsswaps	–	26.176	–	26.176
Terminkontrakte	–	38.116	–	38.116
Futures	33.669	–	–	33.669
Finanzielle Vermögenswerte	33.669	78.989.087	–	79.022.756
Kreditverzugsswaps	–	(172.210)	–	(172.210)
Terminkontrakte	–	(54.727)	–	(54.727)
Futures	(24.085)	–	–	(24.085)
Finanzielle Verbindlichkeiten	(24.085)	(226.937)	–	(251.022)
BNY Mellon Global Bond Fund				
	USD	USD	USD	USD
Anleihen	293.184.838	277.762.806	–	570.947.644
Organismen für gemeinsame Anlagen	5.873.761	–	–	5.873.761
Terminkontrakte	–	699.600	–	699.600
Optionen	616.438	–	–	616.438
Finanzielle Vermögenswerte	299.675.037	278.462.406	–	578.137.443
Terminkontrakte	–	(1.824.238)	–	(1.824.238)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(1.824.238)	–	(1.824.238)

15. ZIELE UND STRATEGIEN DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

BEWERTUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe am 31. Dezember 2019
BNY Mellon Global Credit Fund				
	USD	USD	USD	USD
Anleihen	30.365.098	413.957.504	927.221	445.249.823
Organismen für gemeinsame Anlagen	–	3.970.242	–	3.970.242
Kreditverzugsswaps	–	3.381.524	–	3.381.524
Terminkontrakte	–	8.892.272	–	8.892.272
Futures	1.158.877	–	–	1.158.877
Optionen	–	260.634	–	260.634
Finanzielle Vermögenswerte	31.523.975	430.462.176	927.221	462.913.372
Kreditverzugsswaps	–	(8.235.966)	–	(8.235.966)
Terminkontrakte	–	(2.636.877)	–	(2.636.877)
Futures	(1.028.254)	–	–	(1.028.254)
Optionen	–	(530.858)	–	(530.858)
Finanzielle Verbindlichkeiten	(1.028.254)	(11.403.701)	–	(12.431.955)
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund				
	USD	USD	USD	USD
Anleihen	158.704.175	293.554.808	–	452.258.983
Organismen für gemeinsame Anlagen	34.797.050	8.541.856	–	43.338.906
Terminkontrakte	–	2.557.717	–	2.557.717
Futures	169.291	–	–	169.291
Optionen	562.547	–	–	562.547
Finanzielle Vermögenswerte	194.233.063	304.654.381	–	498.887.444
Terminkontrakte	–	(3.304.526)	–	(3.304.526)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(3.304.526)	–	(3.304.526)
BNY Mellon Global Emerging Markets Fund				
	USD	USD	USD	USD
Aktien	32.393.676	177.656	–	32.571.332
Terminkontrakte	–	5.902	–	5.902
Finanzielle Vermögenswerte	32.393.676	183.558	–	32.577.234
BNY Mellon Global Equity Fund				
	USD	USD	USD	USD
Aktien	363.788.556	–	–	363.788.556
Terminkontrakte	–	83.593	–	83.593
Finanzielle Vermögenswerte	363.788.556	83.593	–	363.872.149
Terminkontrakte	–	(136.180)	–	(136.180)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(136.180)	–	(136.180)

15. ZIELE UND STRATEGIEN DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

BEWERTUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe am 31. Dezember 2019
	USD	USD	USD	USD
BNY Mellon Global Equity Income Fund				
Organismen für gemeinsame Anlagen	–	25.124.445	–	25.124.445
Aktien	1.725.997.571	53.663.955	–	1.779.661.526
Terminkontrakte	–	691.530	–	691.530
Finanzielle Vermögenswerte	1.725.997.571	79.479.930	–	1.805.477.501
Terminkontrakte	–	(4.284)	–	(4.284)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(4.284)	–	(4.284)
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund				
Anleihen	–	109.915.159	–	109.915.159
Organismen für gemeinsame Anlagen	2.491.376	–	–	2.491.376
Terminkontrakte	–	436.070	–	436.070
Leveraged Loans	–	5.035.813	–	5.035.813
Finanzielle Vermögenswerte	2.491.376	115.387.042	–	117.878.418
Terminkontrakte	–	(248.982)	–	(248.982)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(248.982)	–	(248.982)
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund				
Aktien	88.725.250	–	–	88.725.250
Terminkontrakte	–	390.155	–	390.155
Finanzielle Vermögenswerte	88.725.250	390.155	–	89.115.405
Terminkontrakte	–	(2.433)	–	(2.433)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(2.433)	–	(2.433)
BNY Mellon Global Leaders Fund				
Aktien	84.883.294	–	–	84.883.294
Terminkontrakte	–	15.537	–	15.537
Finanzielle Vermögenswerte	84.883.294	15.537	–	84.898.831
Terminkontrakte	–	(168)	–	(168)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(168)	–	(168)

15. ZIELE UND STRATEGIEN DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

BEWERTUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe am 31. Dezember 2019
BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund				
	EUR	EUR	EUR	EUR
Anleihen	838.071	3.550.714	–	4.388.785
Organismen für gemeinsame Anlagen	–	5.844.945	–	5.844.945
Aktien	10.914.995	806.663	–	11.721.658
Terminkontrakte	–	63.698	–	63.698
Preferred Bonds	–	31.753	–	31.753
Finanzielle Vermögenswerte	11.753.066	10.297.773	–	22.050.839
Terminkontrakte	–	(243.325)	–	(243.325)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(243.325)	–	(243.325)
BNY Mellon Global Opportunities Fund				
	USD	USD	USD	USD
Anleihen	1.820.030	–	–	1.820.030
Aktien	46.018.606	–	–	46.018.606
Terminkontrakte	–	6.918	–	6.918
Optionen	9.963	–	–	9.963
Finanzielle Vermögenswerte	47.848.599	6.918	–	47.855.517
Terminkontrakte	–	(15.236)	–	(15.236)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(15.236)	–	(15.236)
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)				
	EUR	EUR	EUR	EUR
Anleihen	181.170.871	1.090.990.670	–	1.272.161.541
Organismen für gemeinsame Anlagen	485.246.460	234.215.182	–	719.461.642
Aktien	1.116.386.126	41.670.968	–	1.158.057.094
Terminkontrakte	–	13.820.040	–	13.820.040
Optionen	45.244.914	–	–	45.244.914
Finanzielle Vermögenswerte	1.828.048.371	1.380.696.860	–	3.208.745.231
Terminkontrakte	–	(31.765.155)	–	(31.765.155)
Futures	(3.246.464)	–	–	(3.246.464)
Optionen	(19.433.873)	(400.802)	–	(19.834.675)
Finanzielle Verbindlichkeiten	(22.680.337)	(32.165.957)	–	(54.846.294)

15. ZIELE UND STRATEGIEN DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

BEWERTUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe am 31. Dezember 2019
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	GBP	GBP	GBP	GBP
Anleihen	12.906.798	14.347.391	–	27.254.189
Organismen für gemeinsame Anlagen	9.083.500	5.530.347	–	14.613.847
Aktien	21.880.815	848.688	–	22.729.503
Terminkontrakte	–	1.481.737	–	1.481.737
Optionen	886.367	–	–	886.367
Finanzielle Vermögenswerte	44.757.480	22.208.163	–	66.965.643
Terminkontrakte	–	(413.007)	–	(413.007)
Futures	(66.559)	–	–	(66.559)
Optionen	(383.804)	–	–	(383.804)
Finanzielle Verbindlichkeiten	(450.363)	(413.007)	–	(863.370)
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	USD	USD	USD	USD
Anleihen	33.310.330	70.341.760	–	103.652.090
Organismen für gemeinsame Anlagen	42.173.540	25.167.660	–	67.341.200
Aktien	106.023.557	3.958.637	–	109.982.194
Terminkontrakte	–	425.999	–	425.999
Optionen	4.404.163	–	–	4.404.163
Finanzielle Vermögenswerte	185.911.590	99.894.056	–	285.805.646
Terminkontrakte	–	(5.145.422)	–	(5.145.422)
Futures	(313.055)	–	–	(313.055)
Optionen	(1.887.750)	–	–	(1.887.750)
Finanzielle Verbindlichkeiten	(2.200.805)	(5.145.422)	–	(7.346.227)
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	USD	USD	USD	USD
Anleihen	–	631.373.513	–	631.373.513
Organismen für gemeinsame Anlagen	–	62.778.833	–	62.778.833
Aktien	1.937	–	–	1.937
Terminkontrakte	–	4.062.199	–	4.062.199
Leveraged Loans	–	25.024.621	–	25.024.621
Finanzielle Vermögenswerte	1.937	723.239.166	–	723.241.103
Terminkontrakte	–	(3.527.822)	–	(3.527.822)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(3.527.822)	–	(3.527.822)

15. ZIELE UND STRATEGIEN DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

BEWERTUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe am 31. Dezember 2019
BNY Mellon Global Unconstrained Fund				
	USD	USD	USD	USD
Anleihen	3.881.040	3.130.834	–	7.011.874
Organismen für gemeinsame Anlagen	1.258.661	1.134.408	–	2.393.069
Aktien	13.607.224	536.600	–	14.143.824
Terminkontrakte	–	377.800	–	377.800
Optionen	48.992	–	–	48.992
Finanzielle Vermögenswerte	18.795.917	5.179.642	–	23.975.559
Terminkontrakte	–	(102.650)	–	(102.650)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(102.650)	–	(102.650)
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund				
	JPY	JPY	JPY	JPY
Aktien	14.909.894.700	–	–	14.909.894.700
Terminkontrakte	–	80.379.200	–	80.379.200
Finanzielle Vermögenswerte	14.909.894.700	80.379.200	–	14.990.273.900
Terminkontrakte	–	(641.256)	–	(641.256)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(641.256)	–	(641.256)
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund				
	EUR	EUR	EUR	EUR
Aktien	1.440.620.791	–	–	1.440.620.791
Terminkontrakte	–	2.327	–	2.327
Finanzielle Vermögenswerte	1.440.620.791	2.327	–	1.440.623.118
Terminkontrakte	–	(45.196)	–	(45.196)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(45.196)	–	(45.196)
BNY Mellon Mobility Innovation Fund				
	USD	USD	USD	USD
Aktien	151.025.893	–	–	151.025.893
Terminkontrakte	–	709.837	–	709.837
Finanzielle Vermögenswerte	151.025.893	709.837	–	151.735.730
Terminkontrakte	–	(3.660)	–	(3.660)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(3.660)	–	(3.660)
BNY Mellon S&P 500® Index Tracker				
	USD	USD	USD	USD
Anleihen	19.942	–	–	19.942
Aktien	50.696.100	–	–	50.696.100
Futures	1.757	–	–	1.757
Finanzielle Vermögenswerte	50.717.799	–	–	50.717.799

15. ZIELE UND STRATEGIEN DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

BEWERTUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe am 31. Dezember 2019
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund				
	EUR	EUR	EUR	EUR
Aktien	71.398.386	1.650.983	–	73.049.369
Finanzielle Vermögenswerte	71.398.386	1.650.983	–	73.049.369
Futures	(3.076)	–	–	(3.076)
Finanzielle Verbindlichkeiten	(3.076)	–	–	(3.076)
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund*				
	EUR	EUR	EUR	EUR
Anleihen	44.613.148	130.169.335	–	174.782.483
Terminkontrakte	–	929.336	–	929.336
Futures	92.393	–	–	92.393
Optionen	198.522	–	–	198.522
Finanzielle Vermögenswerte	44.904.063	131.098.671	–	176.002.734
Terminkontrakte	–	(1.167.027)	–	(1.167.027)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(1.167.027)	–	(1.167.027)
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund				
	USD	USD	USD	USD
Anleihen	70.564.109	7.092.241	–	77.656.350
Terminkontrakte	–	365.972	–	365.972
Futures	208.229	–	–	208.229
Finanzielle Vermögenswerte	70.772.338	7.458.213	–	78.230.551
Terminkontrakte	–	(125.391)	–	(125.391)
Futures	(24.316)	–	–	(24.316)
Finanzielle Verbindlichkeiten	(24.316)	(125.391)	–	(149.707)
BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund				
	USD	USD	USD	USD
Organismen für gemeinsame Anlagen	289.233	–	–	289.233
Aktien	28.531.840	–	–	28.531.840
Finanzielle Vermögenswerte	28.821.073	–	–	28.821.073
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund				
	USD	USD	USD	USD
Aktien	393.905.331	–	–	393.905.331
Terminkontrakte	–	25.328	–	25.328
Preferred Bonds	–	8.371.664	–	8.371.664
Finanzielle Vermögenswerte	393.905.331	8.396.992	–	402.302.323

15. ZIELE UND STRATEGIEN DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

BEWERTUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Fonds Klassifizierung	Stufe 1	Stufe 2	Stufe 3	Summe am 31. Dezember 2019
	USD	USD	USD	USD
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund				
Anleihen	–	430.063.238	–	430.063.238
Terminkontrakte	–	2.551.284	–	2.551.284
Finanzielle Vermögenswerte	–	432.614.522	–	432.614.522
Terminkontrakte	–	(116.353)	–	(116.353)
Finanzielle Verbindlichkeiten	–	(116.353)	–	(116.353)

* Dieser Fonds wurde im Geschäftsjahr aufgelegt.

Die nachfolgende Tabelle zeigt die Veränderungen bei Stufe-3-Anlagen für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020.

BNY Mellon Absolute Return Bond Fund

Angaben	Anleihen EUR	Leveraged Loans EUR	Summe EUR
Eröffnungsbilanz	2.408.332	11.398.966	13.807.298
Käufe	–	–	–
Verkäufe	(2.420.812)	(712.405)	(3.133.217)
Übertragungen in Stufe 3	–	–	–
Übertragungen aus Stufe 3	–	–	–
Aufstellung der Nettogewinne und (-verluste), die in anderen Änderungen des beizulegenden Zeitwerts ausgewiesen sind, aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert zu bewertenden finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten			
Realisierte Gewinne/(Verluste)	188.806	(15.917)	172.889
Nicht realisierte Verluste	(176.326)	(1.317.037)	(1.493.363)
Schlussbilanz	–	9.353.607	9.353.607

BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Bond Fund

Angaben	Anleihen USD	Summe USD
Eröffnungsbilanz	11.034	11.034
Käufe	–	–
Verkäufe	–	–
Übertragungen in Stufe 3	–	–
Übertragungen aus Stufe 3	–	–
Aufstellung der Nettogewinne und (-verluste), die in anderen Änderungen des beizulegenden Zeitwerts ausgewiesen sind, aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert zu bewertenden finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
Realisierte Gewinne/(Verluste)	–	–
Nicht realisierte Gewinne	146	146
Schlussbilanz	11.180	11.180

15. ZIELE UND STRATEGIEN DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

BEWERTUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

BNY Mellon Global Credit Fund

Angaben	Anleihen USD	Summe USD
Eröffnungsbilanz	927.221	927.221
Käufe	–	–
Verkäufe	–	–
Übertragungen in Stufe 3	–	–
Übertragungen aus Stufe 3	(927.221)	(927.221)
Aufstellung der Nettogewinne und (-verluste), die in anderen Änderungen des beizulegenden Zeitwerts ausgewiesen sind, aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert zu bewertenden finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
Realisierte Gewinne/(Verluste)	–	–
Nicht realisierte Gewinne/(Verluste)	–	–
Schlussbilanz	–	–

BNY Mellon Global High Yield Bond Fund

Angaben	Anleihen USD	Summe USD
Eröffnungsbilanz	–	–
Käufe	699.895	699.895
Verkäufe	–	–
Übertragungen in Stufe 3	–	–
Übertragungen aus Stufe 3	–	–
Aufstellung der Nettogewinne und (-verluste), die in anderen Änderungen des beizulegenden Zeitwerts ausgewiesen sind, aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert zu bewertenden finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
Realisierte Gewinne/(Verluste)	–	–
Nicht realisierte Verluste	(49.336)	(49.336)
Schlussbilanz	650.559	650.559

BNY Mellon Targeted Return Bond Fund

Angaben	Anleihen USD	Summe USD
Eröffnungsbilanz	–	–
Käufe	250.000	250.000
Verkäufe	–	–
Übertragungen in Stufe 3	–	–
Übertragungen aus Stufe 3	–	–
Aufstellung der Nettogewinne und (-verluste), die in anderen Änderungen des beizulegenden Zeitwerts ausgewiesen sind, aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert zu bewertenden finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
Realisierte Gewinne/(Verluste)	–	–
Nicht realisierte Gewinne/(Verluste)	–	–
Schlussbilanz	250.000	250.000

15. ZIELE UND STRATEGIEN DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

BEWERTUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

Die nachfolgende Tabelle zeigt die Veränderungen bei Stufe-3-Anlagen für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2019.

BNY Mellon Absolute Return Bond Fund

Angaben	Anleihen EUR	Leveraged Loans EUR	Summe EUR
Eröffnungsbilanz	4.978.178	26.686.142	31.664.320
Käufe	–	1.442.647	1.442.647
Verkäufe	(2.316.483)	(17.838.487)	(20.154.970)
Übertragungen in Stufe 3	–	–	–
Übertragungen aus Stufe 3	(326.485)	–	(326.485)
Aufstellung der Nettogewinne und (-verluste), die in anderen Änderungen des beizulegenden Zeitwerts ausgewiesen sind, aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert zu bewertenden finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten			
Realisierte Gewinne/(Verluste)	99.537	(33.058)	66.479
Nicht realisierte Gewinne/(Verluste)	(26.415)	1.141.722	1.115.307
Schlussbilanz	2.408.332	11.398.966	13.807.298

BNY Mellon Absolute Return Equity Fund

Angaben	Aktien swaps GBP	Summe GBP
Eröffnungsbilanz	35.768	35.768
Käufe	–	–
Verkäufe	(35.768)	(35.768)
Übertragungen in Stufe 3	–	–
Übertragungen aus Stufe 3	–	–
Aufstellung der Nettogewinne, die in anderen Änderungen des beizulegenden Zeitwerts ausgewiesen sind, aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert zu bewertenden finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
Realisierte Gewinne	35.768	35.768
Nicht realisierte Verluste	(35.768)	(35.768)
Schlussbilanz	–	–

BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Bond Fund

Angaben	Genussscheine USD	Summe USD
Eröffnungsbilanz	–	–
Käufe	11.037	11.037
Verkäufe	–	–
Übertragungen in Stufe 3	–	–
Übertragungen aus Stufe 3	–	–
Aufstellung der Nettoverluste, die in anderen Änderungen des beizulegenden Zeitwerts ausgewiesen sind, aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert zu bewertenden finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
Realisierte Gewinne/(Verluste)	–	–
Nicht realisierte Verluste	(3)	(3)
Schlussbilanz	11.034	11.034

15. ZIELE UND STRATEGIEN DES RISIKOMANAGEMENTS Forts.

BEWERTUNG DES BEIZULEGENDEN ZEITWERTS Forts.

BNY Mellon Global Credit Fund

Angaben	Anleihen USD	Summe USD
Eröffnungsbilanz	–	–
Käufe	922.391	922.391
Verkäufe	–	–
Übertragungen in Stufe 3	–	–
Übertragungen aus Stufe 3	–	–
Aufstellung der Nettogewinne und (-verluste), die in anderen Änderungen des beizulegenden Zeitwerts ausgewiesen sind, aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert zu bewertenden finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
Realisierte Gewinne/(-verluste)	–	–
Nicht realisierte Gewinne	4.830	4.830
Schlussbilanz	927.221	927.221

BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund

Angaben	Leveraged loans USD	Summe USD
Eröffnungsbilanz	3.746.280	3.746.280
Käufe	–	–
Verkäufe	(3.677.799)	(3.677.799)
Übertragungen in Stufe 3	–	–
Übertragungen aus Stufe 3	–	–
Aufstellung der Nettogewinne und (-verluste), die in anderen Änderungen des beizulegenden Zeitwerts ausgewiesen sind, aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert zu bewertenden finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
Realisierte Gewinne	142.906	142.906
Nicht realisierte Verluste	(211.387)	(211.387)
Schlussbilanz	–	–

BNY Mellon Targeted Return Bond Fund

Angaben	Anleihen USD	Summe USD
Eröffnungsbilanz	175.000	175.000
Käufe	–	–
Verkäufe	(175.013)	(175.013)
Übertragungen in Stufe 3	–	–
Übertragungen aus Stufe 3	–	–
Aufstellung der Nettogewinne und (-verluste), die in anderen Änderungen des beizulegenden Zeitwerts ausgewiesen sind, aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert zu bewertenden finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
Realisierte Gewinne	13	13
Nicht realisierte Gewinne/(-verluste)	–	–
Schlussbilanz	–	–

Übertragungen gelten als zum Beginn des Berichtszeitraums vollzogen.

16. EVENTUALVERBINDLICHKEITEN

Zum 30. Juni 2020 oder 31. Dezember 2019 bestanden keine Eventualverbindlichkeiten.

17. 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 allgemein nicht haftbar gegenüber Dritten, und allgemein besteht kein Potenzial für wechselseitige Haftung unter den Fonds.

18. WICHTIGE EREIGNISSE

Der BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR) wurde am 6. Februar 2020 aufgelegt.

Am 5. Februar 2020 wurden die Anteilinhaber per Nachtrag über die Wiederaufnahme des Begriffs „Long/Short“ zum 7. Februar 2020 informiert.

Der BNY Mellon Efficient EM Debt Local Currency Beta Fund wurde am 7. Februar 2020 von der Zentralbank genehmigt.

Der BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund wurde am 10. März 2020 aufgelegt.

Die Anteilsinhaber wurden am 22. Mai 2020 über zusätzliche Angaben zu den Verlustübernahmeprodukten für den BNY Mellon Emerging Corporate Debt Fund in Kenntnis gesetzt.

Am 23. Juni 2020 wurden die Anteilsinhaber des BNY Mellon Asian Rising Stars Fund über die Absicht informiert, den Teilfonds am 2. September 2020 aufzulösen.

David Dillon ist am 30. Juni 2020 als Mitglied des Verwaltungsrats des Managers zurückgetreten.

HINWEIS ZU COVID-19

Der weltweite Ausbruch von COVID-19 im ersten Quartal 2020 hatte erheblich negative Auswirkungen auf die globalen Finanzmärkte. Die Marktvolatilität hat deutlich zugenommen und dürfte sich auf absehbare Zeit auf hohem Niveau halten. Das Ausmaß der Auswirkungen auf die finanzielle Wertentwicklung der Anlagen und Teilfonds hängt von den weiteren Entwicklungen ab, einschließlich (i) Dauer und Verbreitung der Pandemie, (ii) staatlichen Maßnahmen und sonstige Beschränkungen oder Verbote, die von Aufsichtsbehörden, Börsen und Handelsplätzen auferlegt werden, (iii) Auswirkungen auf die weltweiten Finanzmärkte und (iv) Auswirkungen auf die gesamtwirtschaftliche Lage.

Außer den vorgenannten Ereignissen sind seit dem Ende des Berichtszeitraums keine weiteren bedeutenden Ereignisse im Hinblick auf die Gesellschaft eingetreten.

19. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG

Die Gesellschaft gab am 1. Juli 2020 folgende Ausschüttungen bekannt:

Fonds	Anteilsklasse	Währung	1. Juli 2020
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	C-Klasse (Inc)	EUR	0,3937
	R-Klasse (Inc)	EUR	0,3184
	T-Klasse (Hedged)	CHF	0,4278
	T-Klasse (Hedged)	USD	0,5408
	Sterling T (Acc) (Hedged)	GBP	0,5151
	W-Klasse (Acc)	EUR	0,3748

19. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	1. Juli 2020
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund Forts.	W-Klasse (Acc) (Hedged)	USD	0,4128
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,4022
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	0,3877
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	0,7030
BNY Mellon Asian Income Fund	A-Klasse (Acc)	EUR	0,0148
	A-Klasse (Inc)	EUR	0,0124
	B-Klasse (Acc)	USD	0,0124
	C-Klasse (Acc)	USD	0,0134
	W-Klasse (Inc)	EUR	0,0135
	W-Klasse (Inc)	USD	0,0110
	Sterling W (Inc)	GBP	0,0150
BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund	A-Klasse (Acc)	USD	0,0039
	Sterling L (Acc) (Hedged)	GBP	0,0046
	W-Klasse (Acc)	USD	0,0044
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	0,0043
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0043
	A-Klasse (Inc)	USD	0,0143
	A-Klasse (Inc)	EUR	0,0151
	C-Klasse (Acc)	USD	0,0169
	C-Klasse (Inc)	USD	0,0131
	E-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	0,0154
	Sterling E (Acc) (Hedged)	GBP	0,0161
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	0,0145
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	0,0149
	K-Klasse (Acc)	USD	0,0165
	K-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	0,0153
	L-Klasse (Acc)	USD	0,0165
	L-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	0,0153
	Sterling L (Acc) (Hedged)	GBP	0,0150
	Sterling L (Inc) (Hedged)	GBP	0,0142
	W-Klasse (Acc)	USD	0,0169
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0151
	W-Klasse (Inc)	USD	0,0020
	W-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	0,0131
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	0,0020
	X-Klasse (Acc)	USD	0,0170
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	0,0107
	X-Klasse (Inc)	USD	0,0107
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund	A-Klasse (Inc)	USD	0,2590
	A-Klasse (Inc) (M)	HKD	1,0928
	G-Klasse (Inc)	USD	1,1992
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	CHF	1,3177
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	1,2638
	W-Klasse (Inc) (Hedged)	CHF	1,2353
	W-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	1,1438
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	1,8401
	X-Klasse	USD	2,4962
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	1,5381
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	C-Klasse (Inc)	USD	0,0063
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	0,0075
	X-Klasse (Inc)	USD	0,0102
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund	A-Klasse (Inc)	USD	0,0061
	A-Klasse (Inc)	EUR	0,0088
	Sterling A (Acc)	GBP	0,0126
	Sterling B (Acc)	GBP	0,0138

19. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	1. Juli 2020
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund Forts.	C-Klasse (Inc)	USD	0,0072
	C-Klasse (Inc)	EUR	0,0091
	Sterling C (Acc)	GBP	0,0211
	Sterling C (Inc)	GBP	0,0114
	Sterling J (Inc) (Hedged)	GBP	0,0057
	W-Klasse (Hedged)	EUR	0,0103
	W-Klasse (Inc)	EUR	0,0085
	W-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	0,0097
	Sterling W (Inc)	GBP	0,0095
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	0,0072
BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund	W-Klasse (Acc)	USD	0,0133
	X-Klasse (Inc)	USD	0,0124
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund	A-Klasse (Acc)	USD	0,0138
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	0,0131
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	0,0131
	W-Klasse (Acc)	USD	0,0139
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	0,0126
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0128
	X-Klasse (Acc)	USD	0,0141
BNY Mellon Euroland Bond Fund	A-Klasse (Inc)	EUR	0,0025
	B-Klasse (Inc)	EUR	0,0032
	C-Klasse (Inc)	EUR	0,0043
	G-Klasse (Acc)	EUR	0,0034
	W-Klasse (Acc)	EUR	0,0037
BNY Mellon European Credit Fund	W-Klasse (Acc)	EUR	0,1641
	X-Klasse	EUR	0,3476
BNY Mellon Global Bond Fund	C-Klasse	USD	0,0101
	C-Klasse (Inc)	USD	0,0023
	Sterling C (Inc)	GBP	0,0062
	W-Klasse (Acc)	USD	0,0048
	W-Klasse (Acc)	EUR	0,0049
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	0,0036
	Sterling Z (Inc) (Hedged)	GBP	0,0036
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	A-Klasse (Inc)	USD	0,0015
	C-Klasse	USD	0,0035
	G-Klasse (Acc)	EUR	0,0029
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	NOK	0,0134
	H-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	0,0013
	I-Klasse (Hedged)	EUR	0,0027
	I-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	0,0024
	W-Klasse	USD	0,0037
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	CHF	0,0032
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	NOK	0,0314
	W-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	0,0031
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0036
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	0,0032
	X-Klasse (Acc) (Hedged)	JPY	0,4532
	Sterling Z (Acc)	GBP	0,0037
	Sterling Z (Acc) (Hedged)	GBP	0,0036
	Sterling Z (Inc)	GBP	0,0037
	Sterling Z (Inc) (Hedged)	GBP	0,0036
BNY Mellon Global Equity Income Fund	A-Klasse	EUR	0,0171
	A-Klasse (Inc)	USD	0,0095
	A-Klasse (Inc)	EUR	0,0087
	Sterling A (Acc)	GBP	0,0124

19. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	1. Juli 2020
BNY Mellon Global Equity Income Fund Forts.	B-Klasse	USD	0,0157
	B-Klasse	EUR	0,0169
	B-Klasse (Inc)	USD	0,0116
	B-Klasse (Inc)	EUR	0,0134
	Sterling B (Inc)	GBP	0,0146
	C-Klasse (Inc)	USD	0,0121
	C-Klasse (Inc)	EUR	0,0134
	Sterling C (Inc)	GBP	0,0152
	G-Klasse (Acc)	EUR	0,0083
	H-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	0,0079
	I-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	0,0084
	W-Klasse	USD	0,0130
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	0,0075
	W-Klasse (Inc)	USD	0,0103
	W-Klasse (Inc)	EUR	0,0120
	Sterling W (Acc)	GBP	0,0169
	Sterling W (Inc)	GBP	0,0134
	Z-Klasse (Acc)	USD	0,0109
	Z-Klasse (Acc)	EUR	0,0121
	Z-Klasse (Inc)	USD	0,0081
	Z-Klasse (Inc)	EUR	0,0082
	Sterling Z (Acc)	GBP	0,0076
	Sterling Z (Inc)	GBP	0,0083
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	C-Klasse (Inc)	USD	0,0128
	W-Klasse (Acc)	USD	0,0150
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0137
	X-Klasse (Inc)	USD	0,0133
	X-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	0,0119
BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund	A-Klasse (Acc)	USD	0,0104
	A-Klasse (Inc)	USD	0,0097
	A-Klasse (Inc)	EUR	0,0099
	B-Klasse (Acc)	USD	0,0105
	B-Klasse (Acc)	SGD	0,0128
	B-Klasse (Inc)	USD	0,0098
	B-Klasse (Inc)	SGD	0,0128
	E-Klasse (Acc)	USD	0,0108
	E-Klasse (Inc)	USD	0,0100
	E-Klasse (Inc)	EUR	0,0101
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	0,0094
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	0,0097
	H-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	0,0090
	J-Klasse (Acc) (Hedged)	SGD	0,0129
	J-Klasse (Inc) (Hedged)	SGD	0,0129
	W-Klasse (Acc)	USD	0,0107
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	0,0099
	W-Klasse (Inc)	USD	0,0100
	W-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	0,0092
BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund	A-Klasse (Acc)	EUR	0,0100
	A-Klasse (Inc)	EUR	0,0093
	A-Klasse (Inc)	USD	0,0010
	E-Klasse (Inc)	EUR	0,0095
	W-Klasse (Acc)	EUR	0,0101
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	A-Klasse (Acc)	USD	0,0108
	A-Klasse (Inc)	USD	0,0093
	C-Klasse (Acc)	USD	0,0124

19. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	1. Juli 2020
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund Forts.	G-Klasse (Acc)	USD	0,0111
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	0,0097
	H-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	0,0084
	I-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	0,0111
	I-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	0,0094
	W-Klasse (Acc)	USD	0,0131
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	0,0115
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	CHF	0,0114
	W-Klasse (Inc)	USD	0,0110
	W-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	0,0099
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0123
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	0,0105
	X-Klasse (Acc)	USD	0,0149
	Sterling X (Acc) (Hedged)	GBP	0,0130
	Y-Klasse (Acc)	USD	0,0149
	Sterling Y (Acc) (Hedged)	GBP	0,0140
	Sterling Z (Acc) (Hedged)	GBP	0,0116
	Sterling Z (Inc) (Hedged)	GBP	0,0110
BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund	A-Klasse (Acc)	EUR	0,0007
	A-Klasse (Acc)	USD	0,0007
	A-Klasse (Inc)	EUR	0,0007
	C-Klasse (Acc)	EUR	0,0020
	E-Klasse (Acc)	EUR	0,0033
	E-Klasse (Acc) (Hedged)	CHF	0,0032
	G-Klasse (Acc)	EUR	0,0020
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	CHF	0,0007
	H-Klasse (Acc) (Hedged)	NOK	0,0069
	W-Klasse (Acc)	EUR	0,0026
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	CHF	0,0025
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	NOK	0,0251
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	USD	0,0026
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0026
	Sterling W (Inc) (Hedged)	GBP	0,0026
	X-Klasse (Acc)	EUR	0,0040
BNY Mellon Targeted Return Bond Fund	A-Klasse (Acc)	USD	0,0006
	Sterling W (Acc) (Hedged)	GBP	0,0027
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	A-Klasse (Acc)	EUR	0,0063
	B-Klasse (Inc)	USD	0,0059
	C-Klasse (Inc)	USD	0,0064
	E-Klasse (Acc)	EUR	0,0065
	E-Klasse (Inc)	USD	0,0065
	E-Klasse (Inc)	EUR	0,0063
	Sterling E (Acc)	GBP	0,0070
	Sterling E (Inc)	GBP	0,0065
	Sterling E (Inc) (Hedged)	GBP	0,0060
	W-Klasse (Acc)	USD	0,0070
	W-Klasse (Acc)	EUR	0,0063
	W-Klasse (Inc)	USD	0,0065
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund	Sterling W (Inc)	GBP	0,0065
	C-Klasse (Acc)	USD	0,0204
	E-Klasse (Acc)	USD	0,0195
	E-Klasse (Acc) (Hedged)	CHF	0,0176
	E-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	0,0185
	E-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	0,0167
	G-Klasse (Acc)	EUR	0,0120

19. EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG Forts.

Fonds	Anteilsklasse	Währung	1. Juli 2020
BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund Forts.	H-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	0,0181
	H-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	0,0164
	W-Klasse (Acc)	USD	0,0204
	W-Klasse (Acc)	EUR	0,0171
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	CHF	0,0179
	W-Klasse (Acc) (Hedged)	EUR	0,0184
	W-Klasse (Inc)	USD	0,0181
	W-Klasse (Inc) (Hedged)	CHF	0,0173
	W-Klasse (Inc) (Hedged)	EUR	0,0167
	X-Klasse (Acc)	USD	0,0198

Außer den genannten gab es nach dem Ende des Berichtszeitraums keine wichtigen Ereignisse, die sich auf die Gesellschaft auswirken.

20. GENEHMIGUNG DES ABSCHLUSSES

Der Abschluss wurde am 18. August 2020 vom Verwaltungsrat genehmigt.

BNY MELLON GLOBAL FUNDS, PLC

WICHTIGE BEWEGUNGEN IN DEN PORTEFEUILLES

BNY Mellon Absolute Return Bond Fund für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten in EUR	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse in EUR
Insight Liquidity Funds Plc - EUR Cash Fund	82.573.834	81.210.643	Insight Liquidity Funds Plc - EUR Cash Fund	79.822.971	78.492.000
United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1,000% 15-Feb.-2049	18.544.554	19.995.212	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1,000% 15-Feb.-2049	40.227.418	46.449.852
United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000% 27-Feb.-2020	9.560.000	8.574.175	Insight Global Funds II plc - Insight Emerging Markets Debt Fund	867.581	12.577.026
France Treasury Bill BTF (Null-Coupon) 0,000% 01-Jul.-2020	7.855.000	7.872.581	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1,000% 15-Feb.-2048	10.960.624	11.568.985
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe (Null-Coupon) 0,000% 12-Jun.-2020	7.855.000	7.869.751	United States Treasury Bill 1,536% 31-Jan.-2020	12.600.000	11.416.658
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 3,000% 04-Jul.-2020	6.340.000	6.415.700	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000% 30-Jan.-2020	9.960.000	9.013.676
France Government Bond OAT 3,500% 25-Apr.-2020	6.325.000	6.376.421	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000% 27-Feb.-2020	9.560.000	8.697.574
Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' FRN 0,277% 09-Sept.-2022	5.000.000	5.024.500	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000% 09-Jan.-2020	9.560.000	8.608.732
PPL Capital Funding Inc 4,125% 15-Apr.-2030	4.302.000	3.930.121	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0,000% 12-Jun.-2020	7.855.000	7.866.154
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 0,000% 13-März-2020	3.900.000	3.903.003	France Treasury Bill BTF (Null-Coupon) 0,000% 01-Jul.-2020	7.855.000	7.862.954
Wells Fargo Bank NA 'BKNT' FRN 0,989% 27-Mai-2022	3.551.000	3.272.782	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000% 23-Jan.-2020	8.610.000	7.763.047
Spain Government Bond '144A' 2,700% 31-Okt.-2048	2.219.000	3.118.339	Credit Agricole SA/London 'EMTN' FRN 0,149% 16-Jan.-2022	7.800.000	7.640.100
BNP Paribas SA '144A' FRN (Perpetual) 4,500% 25-Feb.-2030	3.347.000	3.091.915	United States Treasury Floating Rate Note FRN 0,529% 30-Apr.-2021	7.500.000	6.755.191
Volkswagen Financial Services AG 'EMTN' 3,375% 06-Apr.-2028	2.916.000	2.900.341	France Government Bond OAT 3,500% 25-Apr.-2020	6.325.000	6.337.903
Standard Chartered PLC 'REGS' FRN 4,644% 01-Apr.-2031	3.128.000	2.854.144	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 2,800% 01-März-2067	4.636.000	5.395.748
Boeing Co/The '5,150' 01-Mai-2030	2.825.000	2.597.342	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 3,000% 04-Jul.-2020	5.124.000	5.159.819
BP Capital Markets Plc 2,822% 07-Apr.-2032	2.493.000	2.493.000	ABN AMRO Bank NV '144A' FRN 0,939% 27-Aug.-2021	5.400.000	4.991.514
Credit Suisse Group AG 'REGS' FRN 4,194% 01-Apr.-2031	2.606.000	2.367.475	PPL Capital Funding Inc 4,125% 15-Apr.-2030	4.302.000	4.396.758
Coral-U.S. Co-Borrower LLC Term Loan 0,000% 31-Jan.-2028	2.500.000	2.256.521	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe (Null-Coupon) 0,000% 13-März-2020	3.900.000	3.900.000
Banco Santander SA FRN (Perpetual) 4,375% 14-Apr.-2169	2.200.000	2.200.000	Spain Government Bond '144A' 2,700% 31-Okt.-2048	2.219.000	3.212.934

BNY Mellon Absolute Return Equity Fund für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten in GBP	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse in GBP
United Kingdom Gilt 2,000% 22-Jul.-2020	26.000.000	26.143.000	Insight Liquidity Funds Plc - GBP Liquidity Fund	20.587.794	20.587.794
United Kingdom Treasury Bond 4,750% 07-März-2020	15.000.000	15.019.800	Euroclear Bank SA/NV (Null-Coupon) 0,000% 08-Jan.-2020 CD	16.500.000	16.500.000
MUFG Bank Ltd 0,540% 09-Sept.-2020 CD	10.000.000	10.000.000	United Kingdom Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000% 17-Feb.-2020	15.100.000	15.100.000
Agence Centrale des Organismes de Securite Sociale (Null-Coupon) 0,000% 13-Jul.-2020 CP	10.000.000	9.995.601	ABN AMRO Bank NV 'EMTN' FRN 1,143% 29-Mai-2020	15.000.000	15.000.000
United Kingdom Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000% 06-Apr.-2020	10.000.000	9.995.062	ASB Finance Ltd 'EMTN' FRN 1,287% 22-Mai-2020	15.000.000	15.000.000
La Banque Postale Asset Management (Null-Coupon) 0,000% 09-Apr.-2020 CP	10.000.000	9.992.198	Banco Santander S.A. (Null-Coupon) 0,000% 12-Feb.-2020 CP	15.000.000	15.000.000
Banque Federative du Credit Mutuel SA (Null-Coupon) 0,000% 07-Aug.-2020 CD	10.000.000	9.987.665	BRED Banque Populaire SA (Null-Coupon) 0,000% 10-Feb.-2020 CP	15.000.000	15.000.000
FMS Wertmanagement (Null-Coupon) 0,000% 07-Mai-2020 CP	10.000.000	9.984.135	Regie Autonome des Transports Parisiens (Null-Coupon) 0,000% 15-Jan.-2020 CP	15.000.000	15.000.000
Overseas-Chinese Banking Corporation (Null-Coupon) 0,000% 11-Mai-2020 CD	10.000.000	9.982.974	Sumitomo Mitsui Banking Corporation (Null-Coupon) 0,000% 02-März-2020 CD	15.000.000	15.000.000
Mizuho Bank Ltd (Null-Coupon) 0,000% 28-Mai-2020 CD	10.000.000	9.980.504	Toronto-Dominion Bank (Null-Coupon) 0,000% 01-Jun.-2020 CD	15.000.000	15.000.000
Banco Santander S.A. (Null-Coupon) 0,000% 18-Mai-2020 CP	10.000.000	9.979.003	United Kingdom Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000% 24-Feb.-2020	15.000.000	15.000.000
Dexia Credit Local (Null-Coupon) 0,000% 15-Jul.-2020 CP	10.000.000	9.968.048	United Kingdom Treasury Bond 4,750% 07-März-2020	15.000.000	15.000.000
Euroclear Bank SA/NV (Null-Coupon) 0,000% 08-Jul.-2020 CD	10.000.000	9.957.795	European Investment Bank 'EMTN' FRN 1,040% 17-Feb.-2020	14.000.000	14.000.000
United Kingdom Treasury Index-Linked 2,500% 16-Apr.-2020	2.800.000	9.851.100	HSBC Bank Plc 'EMTN' FRN 0,983% 09-März-2020	12.000.000	12.000.000
Barclays Plc 0,360% 24-Aug.-2020 CD	9.000.000	9.000.000	Mizuho Bank Ltd (Null-Coupon) 0,000% 26-Feb.-2020 CD	12.000.000	12.000.000
Nordea Bank Abp (Null-Coupon) 0,000% 15-Jul.-2020 CP	9.000.000	8.964.929	Banco Santander S.A. (Null-Coupon) 0,000% 18-Mai-2020 CP	10.000.000	10.000.000
BNP Paribas SA 0,880% 07-Jul.-2020 CD	8.000.000	8.001.133	Deutsche Bank AG (Null-Coupon) 0,000% 10-März-2020 CP	10.000.000	10.000.000
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd 0,170% 09-Sept.-2020 CD	8.000.000	8.000.000	FMS Wertmanagement (Null-Coupon) 0,000% 07-Mai-2020 CP	10.000.000	10.000.000
UBS AG 0,820% 14-Aug.-2020 CD	8.000.000	8.000.000	La Banque Postale Asset Management (Null-Coupon) 0,000% 09-Apr.-2020 CP	10.000.000	10.000.000
Mizuho Bank Ltd (Null-Coupon) 0,000% 28-Aug.-2020 CD	8.000.000	7.995.163	Mizuho Bank (Null-Coupon) 0,000% 28-Mai-2020 CD	10.000.000	10.000.000
Banco Santander SA (Null-Coupon) 0,000% 24-Aug.-2020 CP	8.000.000	7.987.775	MUFG Bank Ltd (Null-Coupon) 0,000% 09-März-2020 CD	10.000.000	10.000.000
Transport For London (Null-Coupon) 0,000% 15-Jul.-2020 CP	8.000.000	7.986.758	Overseas-Chinese Banking Corporation (Null-Coupon) 0,000% 11-Mai-2020 CD	10.000.000	10.000.000
Insight Liquidity Funds Plc - GBP Liquidity Fund	5.915.517	5.915.517	Sumitomo Mitsui Trust Bank (Null-Coupon) 0,000% 09-Jun.-2020 CD	10.000.000	10.000.000
BNP Paribas 0,850% 14-Apr.-2020 CD	5.000.000	5.000.574	United Kingdom Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000% 06-Apr.-2020	10.000.000	10.000.000
United Kingdom Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000% 30-März-2020	5.000.000	4.997.561	United Kingdom Treasury Index-Linked 2,500% 16-Apr.-2020	2.800.000	9.844.540
National Bank of Abu Dhabi 0,420% 18-Dez.-2020 CD	4.000.000	4.000.000	Banque Federative du Credit Mutuel SA 'EMTN' FRN 1,014% 16-Jan.-2020	9.000.000	9.000.000
Caisse Des Depots Et Consignations (Null-Coupon) 0,000% 06-Mai-2020 CP	3.000.000	2.994.849	Grifols SA ADR	417.603	7.272.346
			DBS Bank Ltd (Null-Coupon) 0,000% 18-Jun.-2020 CP	6.000.000	6.000.000
			National Australia Bank Ltd 'GMTN' FRN 1,060% 17-Jul.-2020	5.000.000	5.005.300
			BNP Paribas 0,850% 14-Apr.-2020 CD	5.000.000	5.000.000
			United Kingdom Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000% 30-März-2020	5.000.000	5.000.000

BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten in EUR	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse in EUR
France Treasury Bill BTF (Null-Coupon) 0,000% 08-Jul.-2020	3.500.000	3.504.163	French Republic Government Bond OAT (Null-Coupon) 0,000% 25-Feb.-2020	6.685.000	6.685.220
France Treasury Bill BTF (Null-Coupon) 0,000% 01-Jul.-2020	3.400.000	3.401.892	France Treasury Bill BTF (Null-Coupon) 0,000% 05-Feb.-2020	4.600.000	4.600.821
France Treasury Bill BTF (Null-Coupon) 0,000% 26-Aug.-2020	3.000.000	3.009.003	Airbus SE (Null-Coupon) 0,000% 14-Jun.-2021	3.700.000	3.670.700
United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000% 17-März-2020	3.300.000	2.999.317	Broadcom Inc - Preferred Stock 8,000% 30-Sept.-2022	3.500	3.599.373
United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000% 28-Apr.-2020	3.300.000	2.953.272	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000% 28-Apr.-2020	3.300.000	3.056.044
France Treasury Bill BTF (Null-Coupon) 0,000% 19-Aug.-2020	2.900.000	2.902.405	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000% 17-März-2020	3.300.000	2.999.726
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe (Null-Coupon) 0,000% 12-Jun.-2020	2.800.000	2.801.064	Stanley Black & Decker Inc - Preferred Stock 5,250% 15-Nov.-2022	30.000	2.908.997
Airbus SE (Null-Coupon) 0,000% 14-Jun.-2021	2.700.000	2.738.200	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe (Null-Coupon) 0,000% 12-Jun.-2020	2.800.000	2.800.170
Insight Liquidity Funds Plc - EUR Cash Fund	2.700.721	2.655.132	France Treasury Bill BTF (Null-Coupon) 0,000% 13-Mai-2020	2.650.000	2.650.618
France Treasury Bill BTF (Null-Coupon) 0,000% 13-Mai-2020	2.650.000	2.653.156	France Treasury Bill BTF (Null-Coupon) 0,000% 10-Jun.-2020	2.500.000	2.500.275
France Treasury Bill BTF (Null-Coupon) 0,000% 10-Jun.-2020	2.500.000	2.504.402	French Republic Government Bond OAT (Null-Coupon) 0,000% 25-Mai-2020	2.500.000	2.500.084
French Republic Government Bond OAT (Null-Coupon) 0,000% 25-Mai-2020	2.500.000	2.503.575	France Treasury Bill BTF (Null-Coupon) 0,000% 11-März-2020	2.490.000	2.490.000
France Treasury Bill BTF (Null-Coupon) 0,000% 11-März-2020	2.490.000	2.491.388	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000% 10-März-2020	2.450.000	2.210.461
France Treasury Bill BTF (Null-Coupon) 0,000% 16-Sept.-2020	2.400.000	2.402.703	Bayer AG 0,050% 15-Jun.-2020	2.200.000	2.200.000
United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000% 10-März-2020	2.450.000	2.208.468	France Treasury Bill BTF (Null-Coupon) 0,000% 08-Jul.-2020	2.000.000	2.000.483
Bayer AG 0,050% 15-Jun.-2020	2.200.000	2.192.350	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe (Null-Coupon) 0,000% 13-März-2020	2.000.000	2.000.000
Eni SpA (Null-Coupon) 0,000% 13-Apr.-2022	2.000.000	2.032.500	America Movil SAB de CV (Null-Coupon) 0,000% 28-Mai-2020	2.000.000	1.999.000
French Republic Government Bond OAT 2,500% 25-Okt.-2020	2.000.000	2.025.180	Safran SA (Null-Coupon) 0,000% 21-Jun.-2023	12.000	1.966.500
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe (Null-Coupon) 0,000% 13-März-2020	2.000.000	2.001.040	Insight Liquidity Funds Plc - EUR Cash Fund	1.983.531	1.949.854
America Movil SAB de CV (Null-Coupon) 0,000% 28-Mai-2020	2.000.000	1.985.000	Eni SpA (Null-Coupon) 0,000% 13-Apr.-2022	2.000.000	1.934.000
France Treasury Bill BTF (Null-Coupon) 0,000% 29-Jul.-2020	1.900.000	1.904.993	Elliott Capital Sarl (Null-Coupon) 0,000% 30-Dez.-2022	2.000.000	1.907.000
Bilibili Inc '144A' 1,250% 15-Jun.-2027	2.000.000	1.812.397	Atos SE (Null-Coupon) 0,000% 06-Nov.-2024	1.500.000	1.860.250
Amadeus IT Group SA 1,500% 09-Apr.-2025	1.600.000	1.600.000	Bilibili Inc '144A' 1,250% 15-Jun.-2027	2.000.000	1.807.807
Broadcom Inc - Preferred Stock 8,000% 30-Sept.-2022	1.500	1.564.638	Amadeus IT Group SA 1,500% 09-Apr.-2025	1.600.000	1.600.000
Boston Scientific Corp - Preferred Stock 5,500% 01-Jun.-2023	15.000	1.419.914	adidas AG 0,050% 12-Sept.-2023	1.400.000	1.476.780
France Treasury Bill BTF (Null-Coupon) 0,000% 27-Mai-2020	1.415.000	1.417.101	JPMorgan Chase Bank NA (Null-Coupon) 0,000% 18-Sept.-2022	1.300.000	1.473.950
Slack Technologies Inc '144A' 0,500% 15-Apr.-2025	1.500.000	1.382.456	France Treasury Bill BTF (Null-Coupon) 0,000% 27-Mai-2020	1.415.000	1.415.111
United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000% 30-Apr.-2020	1.500.000	1.329.652	Slack Technologies Inc '144A' 0,500% 15-Apr.-2025	1.500.000	1.401.485
France Government Bond OAT 3,500% 25-Apr.-2020	1.300.000	1.310.452	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000% 30-Apr.-2020	1.500.000	1.389.089
			France Government Bond OAT 3,500% 25-Apr.-2020	1.300.000	1.302.820

BNY Mellon Asia Rising Stars Fund für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten in USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse in USD
BrainPad Inc	2.200	116.206	Nichias Corp	5.000	120.903
Takeuchi Manufacturing Co Ltd	6.100	102.323	TechMatrix Corp	3.600	103.776
Baidu Inc ADR	510	75.043	LG Household & Health Care Ltd	89	103.667
LG Household & Health Care Ltd	70	73.075	V-Cube Inc	12.000	101.158
Tencent Holdings Ltd	1.300	71.419	Tomy Co Ltd	10.300	85.787
Industri Jamu Dan Farmasi Sido Muncul Tbk PT	700.000	65.380	BayCurrent Consulting Inc	1.100	83.503
Vision Inc/Tokyo Japan	7.200	61.186	MCJ Co Ltd	9.500	66.548
British American Tobacco Malaysia Bhd	23.000	52.295	Anicom Holdings Inc	1.800	65.968
Tingyi Cayman Islands Holding Corp	30.000	48.727	British American Tobacco Malaysia Bhd	23.000	64.903
Orion Corp/Republic of Korea	400	44.164	Birla Carbon Thailand PCL NVDR	46.000	59.442
China Feihe Ltd '144A'	24.000	42.605	eGuarantee Inc	3.900	58.435
Insource Co Ltd	2.100	40.927	Open Door Inc	5.100	57.577
Dowa Holdings Co Ltd	1.400	40.644	ANTA Sports Products Ltd	6.000	54.169
Sichuan Languang Justbon Services Group Co Ltd 'H'	8.000	40.585	Nippon Gas Co Ltd	1.600	49.903
Nifco Inc/Japan	1.800	36.464	Arata Corp	1.200	48.384
NeoPharm Co Ltd	1.000	36.098	Saha Pathanapibul PCL NVDR	29.100	47.334
Venture Corp Ltd	3.000	35.448	Anritsu Corp	2.500	46.252
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	600	35.426	Industri Jamu Dan Farmasi Sido Muncul Tbk PT	523.500	45.940
Resorttrust Inc	3.200	34.562	China Resources Cement Holdings Ltd	34.000	42.519
TeamSpirit Inc	1.600	34.022	Baidu Inc ADR	160	35.368
Totetsu Kogyo Co Ltd	1.200	30.765	Nomura Bank International PLC	7.646	28.515
Hengan International Group Co Ltd	4.000	29.962	Uni-Charm Indonesia Tbk PT	239.300	28.201
China Maple Leaf Educational Systems Ltd	100.000	28.946	Astra Graphia Tbk PT	562.700	27.760
Sakata INX Corp	2.900	27.914	Nomura Bank International PLC	6.262	27.460
Yonex Co Ltd	5.100	26.825	Wacom Co Ltd	6.100	25.606
Vector Inc	3.500	26.403	Totetsu Kogyo Co Ltd	900	25.489
China Resources Cement Holdings Ltd	20.000	26.182	Huaneng Renewables Corp Ltd	64.000	24.919
RS Technologies Co Ltd	1.200	24.802	Sanken Electric Co Ltd	900	23.663
Zenkoku Hosho Co Ltd	700	23.663	Sarana Menara Nusantara Tbk PT	410.100	23.622
Want Want China Holdings Ltd	30.000	23.650	A-Living Services Co Ltd 'H' '144A'	5.000	23.023
China Medical System Holdings Ltd	20.000	22.772	Insource Co Ltd	700	22.149
Anicom Holdings Inc	600	21.325	XL Axiata Tbk PT	90.000	21.912
Tianjin ZhongXin Pharmaceutical Group Corp Ltd	30.000	20.870	Alibaba Group Holding Ltd ADR	100	21.901
Mega Lifesciences PCL NVDR	20.000	18.005	Zenkoku Hosho Co Ltd	500	21.744
Carabao Group PCL NVDR	5.000	15.302	Chitlita Holding Ltd	3.000	20.095

BNY Mellon Asian Equity Fund für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten in USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse in USD
Meituan Dianping	88.953	1.120.140	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	96.000	944.133
Asian Paints Ltd	28.453	658.703	Applied Materials Inc	17.024	847.035
Iljin Materials Co Ltd	19.588	626.855	Samsung SDI Co Ltd	2.806	656.927
Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	54.500	551.721	New Oriental Education & Technology Group Inc ADR	4.776	577.570
Tencent Music Entertainment Group ADR	38.599	496.092	Alibaba Group Holding Ltd ADR	2.823	574.910
Housing Development Finance Corp Ltd	19.407	461.135	Godrej Consumer Products Ltd	73.594	566.357
Tencent Holdings Ltd	7.958	436.970	CSL Ltd	2.858	561.313
Samsung SDI Co Ltd	1.794	421.204	AIA Group Ltd	59.000	551.819
Elite Material Co Ltd	93.000	375.268	Tencent Holdings Ltd	10.986	545.822
Info Edge India Ltd	10.553	347.071	Maruti Suzuki India Ltd	6.417	508.169
Alibaba Group Holding Ltd ADR	1.520	327.873	Fisher & Paykel Healthcare Corporation Limited	24.742	428.582
Kasikornbank PCL (Foreign Market)	74.900	294.729	Samsung Electronics Co Ltd	8.506	420.029
Vale Indonesia Tbk PT	1.666.755	294.395	Autohome Inc ADR	5.127	401.453
PVR Ltd	11.090	285.660	GSX Techedu Inc ADR	7.461	303.890
Bank Central Asia Tbk PT	153.500	284.860	Housing Development Finance Corp Ltd	11.643	302.159
Maruti Suzuki India Ltd	3.603	253.358	Hindustan Unilever Ltd	10.554	301.873
Titan Co Ltd	16.262	240.041	IDP Education Ltd	27.743	279.356
New Oriental Education & Technology Group Inc ADR	1.591	207.894	Meituan Dianping	19.422	252.973
AIA Group Ltd	20.800	198.689	Xero Ltd	4.795	243.297
Jubilant Foodworks Ltd	7.553	175.848	Iljin Materials Co Ltd	6.501	216.065
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	16.000	170.950	Edelweiss Financial Services Ltd	163.818	214.632
Galaxy Resources Ltd	319.428	158.671	Info Edge India Ltd	6.366	211.100
China Yongda Automobiles Services Holdings Ltd	169.500	153.813	Titan Co Ltd	14.006	203.368
IRB InvIT Fund '144A'	225.000	140.838	Kasikornbank PCL (Foreign Market)	51.800	158.315
GSX Techedu Inc ADR	3.063	132.188	Jubilant Foodworks Ltd	6.979	150.226
CSL Ltd	628	130.622	LG Household & Health Care Ltd	147	148.557
ASML Holding NV	434	127.208	Apollo Hospitals Enterprise Ltd	7.190	148.099
Autohome Inc ADR	1.540	119.802	SEEK Ltd	9.623	134.413
51job Inc ADR	1.672	104.523	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	13.000	134.188
			Asian Paints Ltd	5.825	132.300

BNY Mellon Asian Income Fund für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten in USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse in USD
Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	73.000	785.153	Quanta Computer Inc	285.000	576.170
Samsung Electronics Co Ltd - Preference	12.701	517.726	Sydney Airport	116.085	558.879
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	44.000	474.418	Samsung Electronics Co Ltd - Preference	10.084	434.944
United Overseas Bank Ltd	18.100	317.836	Spark New Zealand Ltd	167.790	405.799
Elite Material Co Ltd	75.000	309.987	Taiwan Mobile Co Ltd	115.000	379.285
Link REIT (Units) (REIT)	30.000	288.632	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	14.000	161.028
Insurance Australia Group Ltd	64.793	286.403	United Overseas Bank Ltd	8.700	156.878
DBS Group Holdings Ltd	15.600	267.227	Macquarie Korea Infrastructure Fund	15.463	145.711
CLP Holdings Ltd	23.000	240.962			
Singapore Technologies Engineering Ltd	80.600	229.720	Die vorstehenden Angaben entsprechen den vollständigen Verkaufsangaben für den Fonds im Berichtszeitraum.		
Dexus (Units) (REIT)	25.907	205.880			
China Mobile Ltd	25.000	203.139			
Jiangsu Expressway Co Ltd 'H'	141.467	188.283			
Bangkok Bank PCL (Foreign Market)	41.100	178.239			
Spark New Zealand Ltd	56.740	170.747			
Venture Corp Ltd	14.100	168.108			
BHP Group Plc	7.143	150.247			
Sands China Ltd	30.000	146.078			
SATS Ltd	49.400	145.090			
ITC Ltd GDR	48.181	138.029			
Meridian Energy Ltd	37.558	125.516			
Star Entertainment Grp Ltd/The	52.941	120.399			
Singapore Telecommunications Ltd	52.800	116.948			
Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	3.228	111.931			
SKYCITY Entertainment Group Ltd	53.745	103.191			
Telekomunikasi Indonesia Persero Tbk PT	356.120	91.240			
Scentre Group (REIT)	38.872	87.349			
Mercury NZ Ltd	26.800	87.100			
Transurban Group	7.818	81.289			
Mapletree North Asia Commercial Trust (Units) (REIT)	101.100	79.319			

BNY Mellon Brazil Equity Fund für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten in USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse in USD
Banco Bradesco SA ADR	763.505	2.870.452	B2W Cia Digital	258.063	3.900.397
Gerdau SA ADR	1.102.100	2.509.033	Metalurgica Gerdau SA - Preference	2.456.097	2.962.543
YDUQS Participacoes SA	212.944	2.497.478	Itausa - Investimentos Itau SA - Preference	1.388.185	2.459.289
Itau Unibanco Holding SA ADR	327.400	1.500.877	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	199.361	1.910.225
Banco do Brasil SA	196.789	1.500.402	Cia Paranaense de Energia ADR	120.700	1.888.887
B2W Cia Digital	74.000	1.234.563	Marfrig Global Foods SA	692.331	1.669.411
Vale SA ADR - B-Klasse	80.800	1.032.852	Vale SA ADR - B-Klasse	135.835	1.472.609
Marfrig Global Foods SA	340.194	882.593	Banco Bradesco SA - Preference	425.605	1.442.497
B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	81.700	869.392	CCR SA	261.296	1.187.716
Petroleo Brasileiro SA ADR	65.000	865.740	Embraer SA ADR	85.300	1.061.560
Petroleo Brasileiro SA ADR	93.450	834.958	Atacadao SA	204.100	1.001.195
Cia Paranaense de Energia ADR	50.300	817.001	Usinas Siderurgicas de Minas Gerais SA Usiminas - Preference	563.969	948.617
JBS SA	179.555	715.991	Banco Bradesco SA ADR	138.400	927.379
Metalurgica Gerdau SA - Preference	294.200	712.557	Banco do Brasil SA	90.800	907.161
Atacadao SA	126.600	677.608	Hapvida Participacoes e Investimentos SA '144A'	67.900	831.715
Hapvida Participacoes e Investimentos SA '144A'	42.100	644.853	Itau Unibanco Holding SA ADR	112.900	796.943
Bradespar SA - Preference	113.500	622.631	Lojas Americanas SA	165.200	794.438
BR Malls Participacoes SA	224.706	594.165	EDP - Energias do Brasil SA	165.900	771.874
Embraer SA ADR	34.550	591.523	Telefonica Brasil SA ADR	56.800	745.008
Usinas Siderurgicas de Minas Gerais SA Usiminas - Preference	384.899	588.146	Petrobras Distribuidora SA	122.400	729.450
Itausa - Investimentos Itau SA - Preference	166.300	564.993	Santos Brasil Participacoes SA	459.200	664.426
Lojas Americanas SA	102.000	524.279	Cia Brasileira de Distribuicao - Preference	33.100	636.796
Santos Brasil Participacoes SA	284.600	520.700	Petroleo Brasileiro SA - Preference	125.000	628.744
EDP - Energias do Brasil SA	102.900	513.656	Petroleo Brasileiro SA ADR	46.500	618.948
Petrobras Distribuidora SA	76.100	509.401	Cia Energetica de Sao Paulo - Preference	84.600	598.959
Telefonica Brasil SA ADR	34.200	443.741	BR Malls Participacoes SA	156.500	579.549
Cia Brasileira de Distribuicao - Preference	19.400	424.681	YDUQS Participacoes SA	52.300	572.014
Sul America SA (Units)	28.400	404.584	Sul America SA (Units)	45.700	566.049
Linx SA	49.400	397.697	Linx SA	79.400	558.491
Cia Energetica de Sao Paulo - Preference	52.400	389.056	Petroleo Brasileiro SA ADR	42.250	514.498
			Petroleo Brasileiro SA	136.399	476.492
			Tupy SA	129.853	400.406

BNY Mellon Digital Assets Fund für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten in USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse in USD
OneConnect Financial Technology Co Ltd ADR	49.013	684.998	XPO Logistics Inc	4.767	440.464
Alphabet Inc - A-Klasse	347	495.632	Continental AG	2.569	285.988
Alibaba Group Holding Ltd ADR	1.572	340.869	Nasdaq Inc	2.392	269.885
Quest Diagnostics Inc	2.264	241.098	Walmart Inc	2.304	265.880
Merck & Co Inc	2.736	225.910	Rakuten Inc	30.300	240.347
Baidu Inc ADR	1.783	211.013	Carrefour SA	12.250	200.848
Change Healthcare Inc	15.819	204.892	FleetCor Technologies Inc	905	197.741
Humana Inc	526	203.401	DocuSign Inc - A-Klasse	2.236	194.466
Emerson Electric Co	3.221	200.392	OneConnect Financial Technology Co Ltd ADR	12.911	193.323
General Motors Co	6.723	186.001	EPAM Systems Inc	796	181.198
JD.com Inc ADR	4.278	165.994	Baidu Inc ADR	1.783	180.784
Square Inc	2.462	153.830	Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	14.000	169.458
Tencent Holdings Ltd	2.300	149.253	JPMorgan Chase & Co	1.163	156.318
NVIDIA Corp	469	118.645	Square Inc	2.170	147.943
AP Moller - Maersk A/S - B-Klasse	87	107.563	Broadridge Financial Solutions Inc	1.131	132.817
Splunk Inc	697	98.396	Samsung SDS Co Ltd	876	129.656
Intel Corp	1.536	92.579	Swisscom AG	216	111.163
ING Groep NV	8.661	61.725	LV/MH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	241	106.855
Facebook Inc - A-Klasse	266	54.443	NVIDIA Corp	378	100.459
International Business Machines Corp	383	51.813	Enel SpA	11.006	93.920
			Nestle SA	877	93.124
			Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	1.596	88.361
			Singapore Exchange Ltd	13.100	78.809
			TMX Group Ltd	807	66.928
			ING Groep NV	10.800	63.761
			SVB Financial Group	370	61.896

BNY Mellon Dynamic Total Return Fund für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten in USD	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse in USD
United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 08-Okt.-2020	5.971.000	5.967.446	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 30-Jan.-2020	4.440.000	4.440.000
United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 16-Jul.-2020	4.440.000	4.408.806	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 18-Jun.-2020	3.173.000	3.172.999
United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 22-Okt.-2020	3.000.000	2.998.340	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 08-Okt.-2020	3.000.000	2.998.593
United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 13-Aug.-2020	2.845.000	2.823.289	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 13-Feb.-2020	2.845.000	2.845.000
United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 05-Nov.-2020	2.239.000	2.237.421	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 21-Mai-2020	2.579.000	2.579.042
United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 19-Nov.-2020	1.888.000	1.886.621	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 30-Apr.-2020	2.564.000	2.563.529
United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 18-Jun.-2020	1.632.000	1.627.279	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 23-Apr.-2020	2.457.000	2.456.878
United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 25-Feb.-2021	1.478.000	1.476.276	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 16-Apr.-2020	2.363.000	2.362.918
United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 17-Dez.-2020	1.382.000	1.380.781	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 07-Mai-2020	2.239.000	2.239.000
SPDR Bloomberg Barclays 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF - ETF	33.981	1.072.655	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 16-Jul.-2020	1.823.000	1.815.190
United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 07-Mai-2020	704.000	703.968	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 12-März-2020	1.082.000	1.081.671
iShares Diversified Commodity Swap UCITS ETF - ETF	113.844	455.490	iShares Diversified Commodity Swap UCITS ETF - ETF	252.242	982.034
United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 12-März-2020	414.000	413.384	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 13-Aug.-2020	688.000	686.967
United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 10-Sept.-2020	92.000	91.999	SPDR Bloomberg Barclays 1-10 Year U.S. Corporate Bond UCITS ETF - ETF	15.547	512.638
SPDR Bloomberg Barclays Short Term High Yield Bond ETF - ETF	1.748	42.970	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 25-Feb.-2021	130.000	129.850
			United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 10-Sept.-2020	92.000	91.898
			SPDR Bloomberg Barclays Short Term High Yield Bond ETF - ETF	2.646	66.612
Die vorstehenden Angaben entsprechen den vollständigen Kaufangaben für den Fonds im Berichtszeitraum.			Die vorstehenden Angaben entsprechen den vollständigen Verkaufsangaben und den Laufzeiten für den Fonds im Berichtszeitraum.		

BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten in USD	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse in USD
Microsoft Corp	61.042	10.553.085	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 30-Jan.-2020	5.853.000	5.853.000
Apple Inc	33.392	9.909.720	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 18-Jun.-2020	5.695.000	5.695.000
Amazon.com Inc	3.393	7.276.935	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 19-März-2020	5.000.000	5.000.000
United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 08-Okt.-2020	6.000.000	5.996.184	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 13-Feb.-2020	3.000.000	3.000.000
United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 16-Jul.-2020	5.853.000	5.811.879	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 16-Apr.-2020	3.000.000	3.000.000
United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 17-Sept.-2020	5.000.000	4.997.957	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 23-Apr.-2020	3.000.000	3.000.000
United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 17-Dez.-2020	5.000.000	4.995.589	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 07-Mai-2020	3.000.000	3.000.000
United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 19-März-2020	5.000.000	4.989.127	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 16-Jul.-2020	2.853.000	2.852.508
Facebook Inc - A-Klasse	19.414	3.813.738	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 10-Sept.-2020	2.625.000	2.624.202
Alphabet Inc - A-Klasse	2.425	3.265.410	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 30-Apr.-2020	2.500.000	2.500.000
Alphabet Inc	2.392	3.224.155	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 21-Mai-2020	2.500.000	2.500.000
Berkshire Hathaway Inc - B-Klasse	15.668	3.155.215	Allergan Plc	2.417	466.523
Johnson & Johnson	21.279	3.094.683	Apple Inc	937	327.682
United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 06-Aug.-2020	3.000.000	2.999.274	Nielsen Holdings Plc	4.268	95.088
United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 05-Nov.-2020	3.000.000	2.997.884	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 12-März-2020	85.000	85.000
United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 13-Aug.-2020	3.000.000	2.977.106	JPMorgan Chase & Co	869	84.997
JPMorgan Chase & Co	25.078	2.779.957	Alphabet Inc	57	81.606
United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 10-Sept.-2020	2.625.000	2.624.987	Bank of America Corp	2.959	74.720
Visa Inc - A-Klasse	13.705	2.534.191	Intel Corp	1.112	66.298
United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 19-Nov.-2020	2.500.000	2.498.174	Citigroup Inc	1.108	58.637

BNY Mellon Efficient Global IG Corporate Beta Fund* für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten in USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse in USD
Cooperative Rabobank UA 'BKNT' 3,750% 21-Jul.-2026	250.000	252.203	BAT Capital Corp 3,557% 15-Aug.-2027	155.000	158.726
International Business Machines Corp 3,500% 15-Mai-2029	200.000	227.890	GlaxoSmithKline Capital Inc 3,875% 15-Mai-2028	125.000	141.853
HSBC Holdings Plc FRN 3,262% 13-März-2023	200.000	204.542	AbbVie Inc 2,300% 14-Mai-2021	115.000	116.304
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 2,724% 27-Sept.-2029	200.000	193.042	International Business Machines Corp 3,500% 15-Mai-2029	100.000	109.266
GlaxoSmithKline Capital Plc 'EMTN' 4,250% 18-Dez.-2045	100.000	183.589	Societe Generale SA 0,750% 25-Jan.-2027	100.000	104.074
BAT Capital Corp 3,557% 15-Aug.-2027	155.000	156.023	Orange SA 'EMTN' 8,125% 20-Nov.-2028	50.000	93.548
Heathrow Funding Ltd 'EMTN' 6,750% 03-Dez.-2026	100.000	153.132	Heathrow Funding Ltd 'REGS' 6,450% 10-Dez.-2031	50.000	86.183
Marsh & McLennan Cos Inc 4,375% 15-März-2029	130.000	146.452	Corporate Office Properties LP 3,700% 15-Jun.-2021	85.000	84.856
GlaxoSmithKline Capital Inc 3,875% 15-Mai-2028	125.000	142.071	BAT Capital Corp 3,222% 15-Aug.-2024	80.000	82.876
Philip Morris International Inc 3,125% 03-Jun.-2033	100.000	134.096	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 3,748% 19-Jul.-2023	75.000	79.365
Merck & Co Inc 2,500% 15-Okt.-2034	100.000	131.103	Anthem Inc 3,125% 15-Mai-2022	75.000	77.938
AXA SA 'EMTN' FRN 5,125% 04-Jul.-2043	100.000	128.649	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc 3,944% 19-Jul.-2028	70.000	77.881
Cooperative Rabobank UA 3,875% 08-Feb.-2022	120.000	125.074	Brookfield Finance Inc 4,850% 29-März-2029	70.000	76.851
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen			Bank of Nova Scotia/The 2,200% 03-Feb.-2025	75.000	76.643
FRN 3,250% 26-Mai-2049	100.000	124.661	Northern Gas Networks Finance Plc 4,875% 30-Jun.-2027	50.000	76.387
Verizon Communications Inc 1,875% 26-Okt.-2029	100.000	124.396	Heathrow Funding Ltd 'EMTN' 6,750% 03-Dez.-2026	50.000	75.660
Liberty Living Finance Plc 2,625% 28-Nov.-2024	100.000	123.415	Royal Bank of Canada 'GMTN' 2,750% 01-Feb.-2022	70.000	72.793
BHP Billiton Finance Ltd 3,250% 24-Sept.-2027	100.000	122.891	JPMorgan Chase & Co 4,625% 10-Mai-2021	70.000	72.596
Australia Pacific Airports Melbourne Pty Ltd 'EMTN' 3,125% 26-Sept.-2023	100.000	122.744	Legal & General Group Plc 'EMTN' FRN 10,000% 23-Jul.-2041	50.000	67.307
ASTM SpA 'EMTN' 3,375% 13-Feb.-2024	100.000	121.884	Stryker Corp 3,375% 01-Nov.-2025	60.000	67.187
Credit Suisse Group AG FRN 2,125% 12-Sept.-2025	100.000	121.535			

* Siehe Erläuterung 18 zum Halbjahresabschluss.

BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten in USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse in USD
iShares iBoxx High Yield Corporate Bond ETF - ETF	620.000	50.002.326	iShares iBoxx High Yield Corporate Bond ETF - ETF	482.000	39.036.190
TransDigm Inc '144A' 6,250% 15-März-2026	3.963.000	4.027.896	TransDigm Inc '144A' 5,500% 15-Nov.-2027	2.960.000	2.712.310
Kraft Heinz Foods Co 3,950% 15-Jul.-2025	3.240.000	3.422.217	Centene Corp '144A' 4,625% 15-Dez.-2029	2.440.000	2.545.779
Kraft Heinz Foods Co 4,375% 01-Jun.-2046	3.595.000	3.365.483	TransDigm Inc '144A' 6,250% 15-März-2026	2.460.000	2.401.037
Centene Corp 4,625% 15-Dez.-2029	2.825.000	3.011.071	CSC Holdings LLC '144A' 5,750% 15-Jan.-2030	1.785.000	1.827.871
Kraft Heinz Foods Co 3,000% 01-Jun.-2026	2.755.000	2.764.764	KFC Holding Co/Pizza Hut Holdings LLC/Taco Bell of America LLC '144A'		
Ford Motor Co 9,000% 22-Apr.-2025	2.600.000	2.665.074	5,000% 01-Jun.-2024	1.480.000	1.445.149
Sprint Capital Corp 6,875% 15-Nov.-2028	2.131.000	2.619.218	Zayo Group LLC / Zayo Capital Inc '144A' 5,750% 15-Jan.-2027	1.445.000	1.443.227
Ford Motor Credit Co LLC 3,813% 12-Okt.-2021	2.600.000	2.508.326	Sprint Capital Corp 6,875% 15-Nov.-2028	1.345.000	1.428.485
Centene Corp 4,250% 15-Dez.-2027	2.235.000	2.350.421	Solera LLC / Solera Finance Inc '144A' 10,500% 01-März-2024	1.350.000	1.427.018
HCA Inc 3,500% 01-Sept.-2030	2.415.000	2.307.455	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc '144A'		
Kraft Heinz Foods Co 5,000% 04-Jun.-2042	2.285.000	2.305.733	6,000% 15-Feb.-2025	1.364.000	1.421.970
SBA Communications Corp '144A' 3,875% 15-Feb.-2027	2.195.000	2.249.647	ESH Hospitality Inc '144A' 5,250% 01-Mai-2025	1.482.000	1.408.047
Alice France SA/France '144A' 7,375% 01-Mai-2026	2.106.000	2.221.112	Barclays Plc 4,836% 09-Mai-2028	1.200.000	1.327.923
Solera LLC / Solera Finance Inc '144A' 10,500% 01-März-2024	2.075.000	2.142.394	Western Digital Corp 4,750% 15-Feb.-2026	1.450.000	1.309.790
Ford Motor Co 8,500% 21-Apr.-2023	2.000.000	2.097.690	HCA Inc 5,625% 01-Sept.-2028	1.185.000	1.293.963
Kraft Heinz Foods Co 5,200% 15-Jul.-2045	2.010.000	2.093.787	Kraft Heinz Foods Co 3,950% 15-Jul.-2025	1.340.000	1.277.139
PetSmart Inc '144A' 7,125% 15-März-2023	2.130.000	2.078.720	Alice Financing SA '144A' 6,625% 15-Feb.-2023	1.248.000	1.270.907
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 4,500% 15-Aug.-2030	2.035.000	2.076.980	Freeport-McMoRan Inc 3,550% 01-März-2022	1.238.000	1.256.190
ESH Hospitality Inc '144A' 5,250% 01-Mai-2025	2.055.000	2.033.080	Ortho-Clinical Diagnostics Inc / Ortho-Clinical Diagnostics SA '144A'		
			6,625% 15-Mai-2022	1.279.000	1.249.944
			RegionalCare Hospital Partners Holdings Inc / LifePoint Health Inc '144A'		
			9,750% 01-Dez.-2026	1.300.000	1.238.707
			WestJet Airlines Ltd '144A' 3,500% 16-Jun.-2021	1.188.000	1.211.784

BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten in USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse in USD
Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	189.764.161	189.764.161	Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	178.264.589	178.264.589
Petroleos Mexicanos 'REGS' 6,950 % 28-Jan.-2060	13.730.000	13.805.000	Petroleos Mexicanos 'REGS' 7,690 % 23-Jan.-2050	17.750.000	18.778.272
Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC 'REGS' 3,050 % 23-Jan.-2025	12.000.000	12.000.000	Petrobras Global Finance BV 6,850 % 05-Jun.-2115	11.600.000	13.327.875
Petroleos Mexicanos 'REGS' 7,690 % 23-Jan.-2050	9.875.000	10.209.663	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 'REGS' 6,000 % 31-Jan.-2025	10.000.000	11.645.876
Riyad Bank FRN 3,174 % 25-Feb.-2030	9.000.000	9.000.000	Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC 'REGS' 3,050 % 23-Jan.-2025	10.000.000	9.551.000
Türkiye Vakıflar Bankası TAO 'REGS' 5,250 % 05-Feb.-2025	9.000.000	8.854.560	MMC Norilsk Nickel OJSC Via MMC Finance DAC 'REGS' 3,375 % 28-Okt.-2024	9.000.000	8.733.750
Braskem Idesa SAPI 'REGS' 7,450 % 15-Nov.-2029	7.800.000	8.093.500	Unigel Luxembourg SA 'REGS' 8,750 % 01-Okt.-2026	8.020.000	8.308.125
Sociedad Quimica y Minera de Chile SA 'REGS' 4,250 % 22-Jan.-2050	8.000.000	8.003.000	Petroleos Mexicanos 'REGS' 6,950 % 28-Jan.-2060	9.000.000	7.065.000
DP World Salaam FRN (Perpetual) 6,000 % 01-Okt.-2025	7.700.000	7.655.648	Credito Real SAB de CV SOFOM ER 'REGS' 5,000 % 01-Feb.-2027	6.000.000	7.036.230
Petroleos Mexicanos 'REGS' 6,840 % 23-Jan.-2030	8.500.000	7.607.500	Türkiye Vakıflar Bankası TAO 'REGS' 5,250 % 05-Feb.-2025	7.000.000	6.893.500
Petrobras Global Finance BV 6,850 % 05-Jun.-2115	6.000.000	7.476.000	Riyad Bank FRN 3,174 % 25-Feb.-2030	7.000.000	6.855.750
Dar Al-Arkan Sukuk Co Ltd 6,875 % 26-Feb.-2027	7.406.000	7.355.417	First Quantum Minerals Ltd '1444A' 6,500 % 01-März-2024	7.100.000	6.682.000
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV 'REGS' 6,000 % 31-Jan.-2025	5.800.000	6.946.233	Novolipetsk Steel Via Steel Funding DAC 'REGS' 4,700 % 30-Mai-2026	6.200.000	6.581.000
Eskom Holdings SOC Ltd 'REGS' 8,450 % 10-Aug.-2028	6.250.000	6.885.625	Alicorp SAA 'REGS' 6,875 % 17-Apr.-2027	20.000.000	6.480.230
Camposol SA 'REGS' 6,000 % 03-Feb.-2027	6.370.000	6.331.859	Sociedad Quimica y Minera de Chile SA 'REGS' 4,250 % 22-Jan.-2050	6.500.000	6.478.750
Engie Energia Chile SA 'REGS' 3,400 % 28-Jan.-2030	6.000.000	5.965.840	Celulosa Arauco y Constitucion SA 'REGS' 4,200 % 29-Jan.-2030	6.000.000	6.219.300
China Evergrande Group 11,500 % 22-Jan.-2023	5.900.000	5.900.000	Mersin Uluslararası Liman İşletmeciliği AS 'REGS' 5,375 % 15-Nov.-2024	6.000.000	6.107.750
DP World Plc 'REGS' 4,700 % 30-Sept.-2049	5.800.000	5.854.681	Engie Energia Chile SA 'REGS' 3,400 % 28-Jan.-2030	6.000.000	6.104.040
Ecopetrol SA 6,875 % 29-Apr.-2030	5.208.000	5.161.753	Medco Platinum Road Pte Ltd 'REGS' 6,750 % 30-Jan.-2025	5.700.000	5.844.625
Minerva Luxembourg SA 'REGS' 5,875 % 19-Jan.-2028	4.890.000	5.123.600	Unifin Financiera SAB de CV 'REGS' 8,375 % 27-Jan.-2028	5.000.000	5.313.600
Yuzhou Properties Co Ltd 7,375 % 13-Jan.-2026	5.100.000	5.100.000	NBM US Holdings Inc 'REGS' 7,000 % 14-Mai-2026	5.200.000	5.206.800
			Chelyabinsk Pipe Plant Via Chelpipe Finance DAC 'REGS' 4,500 % 19-Sept.-2024	5.100.000	5.190.750

BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten in USD	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse in USD
Mexico Government International Bond 3,250 % 16-Apr.-2030	696.000	692.297	KazMunayGas National Co.JSC 'REGS' 5,750 % 19-Apr.-2047	830.000	900.925
Saudi Arabian Oil Co 'REGS' 3,500 % 16-Apr.-2029	630.000	665.438	Ivory Coast Government International Bond 'REGS' 5,250 % 22-März-2030	690.000	775.056
Dominican Republic International Bond 'REGS' 4,500 % 30-Jan.-2030	640.000	611.306	Turkey Government International Bond 5,750 % 22-März-2024	730.000	736.388
Petroleos Mexicanos 'REGS' 5,950 % 28-Jan.-2031	575.000	477.250	Saudi Government International Bond 'REGS' 4,500 % 26-Okt.-2046	655.000	717.974
Rede D'or Finance Sarl 'REGS' 4,500 % 22-Jan.-2030	435.000	435.000	Mexico Government International Bond 3,750 % 11-Jan.-2028	660.000	691.984
Ghana Government International Bond 'REGS' 7,625 % 16-Mai-2029	450.000	412.275	Corp Financiera de Desarrollo SA 'REGS' 4,750 % 08-Feb.-2022	630.000	652.050
Banco Santander Chile 'REGS' 2,700 % 10-Jan.-2025	400.000	400.000	Vnesheconombank Via VEB Finance Plc 6,902 % 09-Jul.-2020	630.000	638.568
Petroleos Mexicanos 'REGS' 6,950 % 28-Jan.-2060	400.000	400.000	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd 'REGS' 2,950 % 08-Aug.-2029	580.000	613.199
Philippine Government International Bond 2,457 % 05-Mai-2030	385.000	385.000	Egypt Government International Bond 'REGS' 6,588 % 21-Feb.-2028	595.000	592.173
MDGH - GMTN BV 'REGS' 3,700 % 07-Nov.-2049	400.000	361.800	African Export-Import Bank/The 'REGS' 3,994 % 21-Sept.-2029	520.000	544.433
Export-Import Bank of India 'REGS' 3,250 % 15-Jan.-2030	345.000	343.423	Mexico Government International Bond 'MTN' 4,750 % 08-März-2044	460.000	536.613
Ivory Coast Government International Bond Step-Up Coupon 'REGS' 5,750 % 31-Dez.-2032	320.625	294.275	Ecopetrol SA 5,875 % 28-Mai-2045	585.000	509.258
Petroleos Mexicanos 'REGS' 6,490 % 23-Jan.-2027	325.000	281.531	Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III 'REGS' 3,400 % 29-März-2022	500.000	507.923
Petroleos Mexicanos 'REGS' 7,690 % 23-Jan.-2050	325.000	279.988	Oman Government International Bond 'REGS' 5,625 % 17-Jan.-2028	650.000	502.225
Colombia Government International Bond 3,000 % 30-Jan.-2030	275.000	271.997	Russian Foreign Bond - Eurobond 'REGS' 2,875 % 04-Dez.-2025	400.000	497.392
Kenya Government International Bond 'REGS' 7,250 % 28-Feb.-2028	240.000	265.200	Saudi Government International Bond 'REGS' 4,375 % 16-Apr.-2029	420.000	484.355
Hungary Government International Bond 1,625 % 28-Apr.-2032	230.000	242.413	Industrias Penoles SAB de CV 'REGS' 5,650 % 12-Sept.-2049	485.000	482.575
TMK OAO Via TMK Capital SA 4,300 % 12-Feb.-2027	230.000	230.000	Saudi Government International Bond 'REGS' 0,750 % 09-Jul.-2027	420.000	478.075
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 'REGS' 5,250 % 24-Okt.-2042	200.000	228.240	Petroleos Mexicanos 'REGS' 7,690 % 23-Jan.-2050	444.000	476.821
Turkey Government International Bond 4,250 % 13-März-2025	230.000	227.919	Turkey Government International Bond 5,125 % 17-Feb.-2028	480.000	467.568
Petroleos Mexicanos 5,625 % 23-Jan.-2046	305.000	224.938	Comision Federal de Electricidad 'REGS' 4,875 % 26-Mai-2021	450.000	464.625
Oman Government International Bond 'REGS' 6,000 % 01-Aug.-2029	265.000	222.600	Petroleos Mexicanos 6,500 % 23-Jan.-2029 6,500 % 23-Jan.-2029	450.000	460.688
Pakistan Government International Bond 'REGS' 6,875 % 05-Dez.-2027	200.000	216.500	Rede D'or Finance Sarl 'REGS' 4,500 % 22-Jan.-2030	435.000	441.935
Mexico Government International Bond 4,500 % 31-Jan.-2050	200.000	215.746	Mexico Government International Bond 3,250 % 16-Apr.-2030	450.000	437.970
Millicom International Cellular SA 'REGS' 6,625 % 15-Okt.-2026	225.000	214.875	VEON Holdings BV 'REGS' 4,000 % 09-Apr.-2025	405.000	419.175
Ukraine Government International Bond FRN 31-Mai-2040	215.000	213.925	Uruguay Government International Bond 4,975 % 20-Apr.-2055	330.000	418.040
Jamaica Government International Bond 6,750 % 28-Apr.-2028	200.000	207.250	Development Bank of Kazakhstan JSC 'REGS' 4,125 % 10-Dez.-2022	400.000	408.760
Ukraine Government International Bond 'REGS' 4,375 % 27-Jan.-2030	185.000	205.211	Philippine Government International Bond 2,457 % 05-Mai-2030	385.000	404.635
CBB International Sukuk Programme Co SPC 'REGS' 6,250 % 14-Nov.-2024	200.000	200.000	Dominican Republic International Bond 'REGS' 4,500 % 30-Jan.-2030	440.000	404.078
Egypt Government International Bond 'REGS' 7,625 % 29-Mai-2032	200.000	200.000	Ukraine Government International Bond 'REGS' 7,375 % 25-Sept.-2032	360.000	401.436
Globo Comunicacao e Participacoes SA 'REGS' 4,875 % 22-Jan.-2030	200.000	200.000	Petroleos Mexicanos 'REGS' 6,950 % 28-Jan.-2060	400.000	395.248
Guatemala Government Bond 'REGS' 5,375 % 24-Apr.-2032	200.000	200.000	GUSAP III LP 'REGS' 4,250 % 21-Jan.-2030	370.000	389.518
MEGlobal Canada ULC 'REGS' 5,875 % 18-Mai-2030	200.000	200.000	Egypt Government International Bond 'REGS' 8,500 % 31-Jan.-2047	400.000	389.000
Panama Government International Bond 4,500 % 01-Apr.-2056	200.000	200.000	Nigeria Government International Bond 'REGS' 7,696 % 23-Feb.-2038	400.000	388.000
Petronas Capital Ltd 'REGS' 4,550 % 21-Apr.-2050	200.000	200.000	Banque Ouest Africaine de Developpement 'REGS' 5,000 % 27-Jul.-2027	330.000	359.766
Central American Bank for Economic Integration 'REGS' 2,000 % 06-Mai-2025	200.000	199.972	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 16-Apr.-2020	355.000	354.801
Colombia Government International Bond 3,125 % 15-Apr.-2031	200.000	199.274	Bank of Georgia JSC 'REGS' 6,000 % 26-Jul.-2023 6,000 % 26-Jul.-2023	375.000	350.625
DP World Salaam FRN (Perpetual) 6,000 % 01-Okt.-2025	200.000	198.848	Ecuador Government International Bond 'REGS' 8,875 % 23-Okt.-2027	470.000	347.985
Mongolia Government International Bond 'REGS' 10,875 % 06-Apr.-2021	200.000	198.500	Petrobras Global Finance BV 6,900 % 19-März-2049	355.000	347.545
Abu Dhabi Government International Bond 'REGS' 2,500 % 16-Apr.-2025	200.000	198.410	Oman Government International Bond 'REGS' 6,750 % 17-Jan.-2048	410.000	330.195
Ghana Government International Bond 'REGS' 7,875 % 11-Feb.-2035	200.000	197.920	GMR Hyderabad International Airport Ltd 'REGS' 4,250 % 27-Okt.-2027	460.000	330.050
Sri Lanka Government International Bond 'REGS' 7,550 % 28-März-2030	200.000	196.900			
Kenya Government International Bond 'REGS' 6,875 % 24-Jun.-2024	200.000	184.500			
Oman Government International Bond 'REGS' 6,750 % 17-Jan.-2048	200.000	174.700			
Serbia International Bond 'REGS' 3,125 % 15-Mai-2027	160.000	170.382			
Ecuador Government International Bond 'REGS' 10,750 % 28-März-2022	200.000	166.900			
Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand 'REGS' 5,375 % 17-Apr.-2025	165.000	165.000			
Serbia International Bond 'REGS' 1,500 % 26-Jun.-2029	150.000	150.788			
United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 30-Jul.-2020	150.000	149.957			
United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 16-Apr.-2020	145.000	144.868			

BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten in USD	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse in USD
Mexican Bonos 8,500 % 31-Mai-2029	200.600.000	9.401.720	Peru Government Bond '144A' 5,940 % 12-Feb.-2029	30.025.000	9.930.402
China Government Bond 3,290 % 23-Mai-2029	57.830.000	8.606.558	Colombian TES 7,000 % 04-Mai-2022	36.367.000.000	9.719.383
United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 30-Jul.-2020	7.420.000	7.418.742	Mexican Udibonos 4,500 % 04-Dez.-2025	194.815.076	9.463.209
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,000 % 01-Jan.-2031	23.100.000	6.904.752	Republic of South Africa Government Bond 7,000 % 28-Feb.-2031	173.980.000	9.043.826
Mexican Udibonos 4,000 % 15-Nov.-2040	119.042.161	6.898.022	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,000 % 01-Jan.-2025	36.450.000	8.564.514
Mexican Bonos 7,500 % 03-Jun.-2027	132.500.000	5.988.675	Republic of Poland Government Bond 2,500 % 25-Jul.-2026	31.220.000	8.277.892
United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 16-Apr.-2020	5.619.000	5.609.456	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,000 % 01-Jan.-2027	33.850.000	7.778.653
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos '144A' 4,700 % 01-Sept.-2030	3.385.000.000	5.184.943	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 16-Apr.-2020	7.699.000	7.691.500
China Government Bond 3,250 % 06-Jun.-2026	26.100.000	3.855.108	Russian Federal Bond - OFZ 7,000 % 16-Aug.-2023	542.250.000	7.633.822
Czech Republic Government Bond 2,750 % 23-Jul.-2029	74.700.000	3.294.415	Indonesia Treasury Bond 8,250 % 15-Jun.-2032	86.050.000.000	6.438.852
Mexican Bonos 7,750 % 13-Nov.-2042	83.200.000	3.288.910	Thailand Government Bond 4,875 % 22-Jun.-2029	137.890.000	5.813.164
Republic of Poland Government Bond 2,750 % 25-Okt.-2029	11.470.000	2.921.764	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 9,761 % 01-Jan.-2023	21.455.000	5.766.858
Peru Government Bond '144A' 5,940 % 12-Feb.-2029	8.850.000	2.678.977	Romania Government Bond 5,800 % 26-Jul.-2027	22.080.000	5.516.911
Romania Government Bond 4,750 % 24-Feb.-2025	10.760.000	2.642.738	Russian Federal Bond - OFZ 7,050 % 19-Jan.-2028	396.320.000	5.488.779
China Government Bond 3,120 % 05-Dez.-2026	18.000.000	2.586.416	Argentina Republic Government International Bond FRN 5,830 % 31-Dez.-2033	27.418.000	5.117.869
Indonesia Treasury Bond 7,500 % 15-Jun.-2035	36.450.000.000	2.081.260	Mexican Udibonos 4,000 % 15-Nov.-2040	119.042.161	5.060.143
Russian Federal Bond - OFZ 7,700 % 23-März-2033	127.281.000	1.973.461	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 30-Jul.-2020	5.009.000	5.006.200
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,000 % 01-Jan.-2029	5.380.000	1.595.757	Thailand Government Bond 3,400 % 17-Jun.-2036	129.685.000	4.892.297
Indonesia Treasury Bond 7,000 % 15-Sept.-2030	24.110.000.000	1.358.423	Mexican Bonos 10,000 % 20-Nov.-2036	70.921.600	4.889.802
Argentina Republic Government International Bond FRN 5,830 % 31-Dez.-2033	6.743.000	1.276.737	Indonesia Treasury Bond 8,250 % 15-Mai-2036	72.500.000.000	4.568.119
Argentina Treasury Bond BONCER 2,250 % 28-Apr.-2020	27.892.000	972.210	Thailand Government Bond 2,125 % 17-Dez.-2026	135.160.000	4.362.128
			Republic of South Africa Government Bond 10,500 % 21-Dez.-2026	70.200.000	4.360.577
			Transnet SOC Ltd 'REGS' 9,500 % 13-Mai-2021	74.300.000	4.294.495
			Argentina Treasury Bond BONCER 2,500 % 22-Jul.-2021	98.480.000	4.253.150
			Republic of South Africa Government Bond 8,750 % 28-Feb.-2048	97.550.000	4.049.606
			Turkey Government Bond 11,000 % 24-Feb.-2027	29.325.000	3.927.363
			Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 5,000 % 01-März-2035	2.800.000.000	3.847.056
			Malaysia Government Bond 4,893 % 08-Jun.-2038	14.385.000	3.770.314
			Turkey Government Bond 10,600 % 11-Feb.-2026	25.600.000	3.599.835
			Romania Government Bond 5,850 % 26-Apr.-2023	14.400.000	3.413.548
			Thailand Government Bond 3,650 % 20-Jun.-2031	83.100.000	3.267.175
			Indonesia Treasury Bond 6,125 % 15-Mai-2028	57.482.000.000	3.260.173
			Petroleos Mexicanos 'REGS' 7,190 % 12-Sept.-2024	98.650.000	3.213.613
			Peru Government Bond '144A' 6,150 % 12-Aug.-2032	9.000.000	2.700.460
			Russian Federal Bond - OFZ 8,150 % 03-Feb.-2027	167.500.000	2.657.214
			Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos 4,500 % 01-März-2026	1.910.000.000	2.636.806
			Czech Republic Government Bond 2,750 % 23-Jul.-2029	52.620.000	2.596.309
			Malaysia Government Bond 4,181 % 15-Jul.-2024	10.435.000	2.533.668
			Indonesia Treasury Bond 7,000 % 15-Mai-2027	35.810.000.000	2.507.081
			Malaysia Government Bond 3,844 % 15-Apr.-2033	11.035.000	2.408.318
			Colombian TES 7,750 % 18-Sept.-2030	9.985.000.000	2.358.835

BNY Mellon Emerging Markets Debt Opportunistic Fund für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten in USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse in USD
Mexican Bonos 8,500 % 31-Mai-2029	14.650.000	686.616	Nexa Resources SA 'REGS' 5,375 % 04-Mai-2027	400.000	430.000
China Government Bond 3,290 % 23-Mai-2029	3.870.000	575.332	Peru Government Bond '144A' 5,940 % 12-Feb.-2029	1.260.000	420.568
Russian Federal Bond - OFZ 7,700 % 23-März-2033	28.423.000	450.458	Egypt Government International Bond 'REGS' 7,600 % 01-März-2029	400.000	406.800
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos '144A' 4,700 % 01-Sept.-2030	285.000.000	435.716	Argentina Treasury Bond BONCER 2,500 % 22-Jul.-2021	7.940.000	348.452
MDGH - GMTN BV 'REGS' 3,700 % 07-Nov.-2049	400.000	361.800	HTA Group Ltd/Mauritius 'REGS' 9,125 % 08-März-2022	340.000	347.755
Indonesia Treasury Bond 7,000 % 15-Mai-2027	5.160.000.000	348.838	Romania Government Bond 5,800 % 26-Jul.-2027	1.280.000	313.266
Republic of Poland Government Bond 2,750 % 25-Okt.-2029	1.240.000	322.074	DP World Plc 'REGS' 6,850 % 02-Jul.-2037	250.000	304.375
United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 30-Jul.-2020	318.000	317.918	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 30-Jul.-2020	298.000	297.936
Mexican Udbonos 4,000 15-Nov.-2040	5.430.918	316.449	Russian Federal Bond - OFZ 7,000 % 16-Aug.-2023	21.000.000	290.473
Al Candelaria Spain SLU 'REGS' 7,500 % 15-Dez.-2028	250.000	286.600	Malaysia Government Bond 3,885 % 15-Aug.-2029	1.250.000	290.397
Indonesia Treasury Bond 7,500 % 15-Jun.-2035	4.900.000.000	279.944	GMR Hyderabad International Airport Ltd 'REGS' 4,250 % 27-Okt.-2027	390.000	279.825
Peru Government Bond '144A' 5,940 % 12-Feb.-2029	900.000	272.440	Nigeria Government International Bond 'REGS' 6,500 % 28-Nov.-2027	275.000	276.375
Thailand Government Bond 4,875 % 22-Jun.-2029	6.100.000	258.107	Argentine Republic Government International Bond FRN 5,830 % 31-Dez.-2033	1.339.000	254.295
Indonesia Treasury Bond 7,500 % 15-Aug.-2032	3.527.000.000	257.843	KazTransGas JSC 'REGS' 4,375 % 26-Sept.-2027	260.000	251.290
Malaysia Government Bond 3,885 % 15-Aug.-2029	980.000	255.202	NMC Healthcare Sukuk Ltd (Defaulted) 5,950 % 21-Nov.-2023	250.000	250.625
Russian Federal Bond - OFZ 8,150 % 03-Feb.-2027	15.400.000	231.118	Mexican Udbonos 4,000 % 15-Nov.-2040	5.430.918	228.880
Mexican Bonos 7,750 % 13-Nov.-2042	5.800.000	229.275	ICL Group Ltd '144A' 6,375 % 31-Mai-2038	200.000	220.000
Egypt Government International Bond 'REGS' 7,600 01-März-2029	200.000	227.800	Senegal Government International Bond 'REGS' 6,250 % 23-Mai-2033	200.000	216.400
Prosus NV 'REGS' 5,500 % 21-Jul.-2025	200.000	225.440	Turkey Government Bond 10,600 % 11-Feb.-2026	1.615.000	216.069
Vnesheconombank Via VEB Finance Plc 'REGS' 5,942 % 21-Nov.-2023	200.000	222.300	Turkey Government International Bond 6,350 % 10-Aug.-2024	200.000	214.146
Kenya Government International Bond 'REGS' 7,250 % 28-Feb.-2028	200.000	221.000	Industrias Penoles SAB de CV 'REGS' 5,650 % 12-Sept.-2049	215.000	213.925
Pakistan Government International Bond 'REGS' 6,875 % 05-Dez.-2027	200.000	218.000	Angolan Government International Bond 'REGS' 8,250 % 09-Mai-2028	200.000	212.300
Saudi Arabian Oil Co 'REGS' 3,500 % 16-Apr.-2029	200.000	212.678	Petronas Capital Ltd 'REGS' 3,500 % 21-Apr.-2030	200.000	212.174
Mexican Bonos 7,500 % 03-Jun.-2027	4.850.000	212.532	Mexico Government International Bond 4,500 % 22-Apr.-2029	200.000	208.106
Rede D'or Finance Sarl 'REGS' 4,500 % 22-Jan.-2030	210.000	210.000	Abu Dhabi Government International Bond 'REGS' 2,500 % 16-Apr.-2025	200.000	207.000
Development Bank of Kazakhstan JSC 'REGS' 4,125 % 10-Dez.-2022	200.000	209.200	Oman Government International Bond 'REGS' 6,000 % 01-Aug.-2029	220.000	203.500
CBB International Sukuk Programme Co SPC 'REGS' 6,250 % 14-Nov.-2024	200.000	200.000	Thailand Government Bond 4,875 % 22-Jun.-2029	4.925.000	200.999
Panama Government International Bond 4,500 % 01-Apr.-2056	200.000	200.000	Indonesia Treasury Bond 7,500 % 15-Aug.-2032	2.740.000.000	197.569
VF Ukraine PAT via VFU Funding Plc 'REGS' 6,200 % 11-Feb.-2025	200.000	200.000	MHP Lux SA 'REGS' 6,250 % 19-Sept.-2029	200.000	195.140
VTR Comunicaciones SpA 'REGS' 5,125 % 15-Jan.-2028	200.000	200.000	Tullow Oil PLC 'REGS' 7,000 % 01-März-2025	210.000	169.092
Export-Import Bank of India 'REGS' 3,250 % 15-Jan.-2030	200.000	199.086	Dominican Republic International Bond 'REGS' 6,000 % 19-Jul.-2028	150.000	167.220
DP World Salaam FRN (Perpetual) 6,000 % 01-Okt.-2025	200.000	198.848	Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero		
Abu Dhabi Government International Bond 'REGS' 2,500 % 16-Apr.-2025	200.000	198.410	Santand 'REGS' 5,375 % 17-Apr.-2025	150.000	165.000
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 'REGS'			Indonesia Treasury Bond 11,000 % 15-Sept.-2025	2.162.000.000	161.389
3,000 % 30-Jun.-2030	200.000	198.292	Czech Republic Government Bond 2,750 % 23-Jul.-2029	3.200.000	157.890
Turkey Government International Bond 4,250 % 13-März-2025	200.000	198.190	Romania Government Bond 4,750 % 24-Feb.-2025	665.000	157.041
Ghana Government International Bond 'REGS' 7,875 % 11-Feb.-2035	200.000	197.920	Serbia International Bond 'REGS' 1,500 % 26-Jun.-2029	140.000	149.998
Petronas Capital Ltd 'REGS' 3,500 % 21-Apr.-2030	200.000	197.472	Thailand Government Bond 2,125 % 17-Dez.-2026	4.350.000	148.186
Empresas Publicas de Medellin ESP 'REGS' 7,625 % 10-Sept.-2024	625.000.000	191.845	Ecuador Government International Bond 'REGS' 0,000 % 23-Jan.-2028	200.000	140.000
Ghana Government International Bond 'REGS' 7,625 % 16-Mai-2029	200.000	185.400	Indonesia Treasury Bond 6,125 % 15-Mai-2028	2.425.000.000	137.537
VTR Finance NV 'REGS' 6,875 % 15-Jan.-2024	200.000	180.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,000 % 01-Jan.-2025	450.000	126.686
Russian Federal Bond - OFZ 7,050 % 19-Jan.-2028	10.600.000	171.724	Transnet SOC Ltd 'REGS' 9,500 % 13-Mai-2021	2.200.000	121.392
Oman Government International Bond 'REGS' 6,000 % 01-Aug.-2029	200.000	168.000			
Petroleos Mexicanos 'REGS' 7,690 % 23-Jan.-2050	195.000	167.993			
Ecuador Government International Bond 'REGS' 10,750 % 28-März-2022	200.000	166.900			
Romania Government Bond 4,750 % 24-Feb.-2025	650.000	159.645			
Argentina Republic Government International Bond 3,750 % 31-Dez.-2038	380.000	151.430			
Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero					
Santand 'REGS' 5,375 % 17-Apr.-2025	150.000	150.000			
Dominican Republic International Bond 'REGS' 4,500 % 30-Jan.-2030	150.000	148.809			
China Government Bond 3,250 % 06-Jun.-2026	1.000.000	147.705			
China Government Bond 3,120 % 05-Dez.-2026	1.000.000	143.690			
Serbia International Bond 'REGS' 1,500 % 26-Jun.-2029	140.000	140.736			
Czech Republic Government Bond 2,750 % 23-Jul.-2029	3.200.000	140.536			

BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten in USD	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse in USD
Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	141.589.935	141.589.935	Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	136.639.811	136.639.811
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,000 % 01-Jan.-2025	30.000.000	6.604.938	Turkey Government International Bond 5,250 % 13-März-2030	6.200.000	5.675.768
Turkey Government International Bond 5,250 % 13-März-2030	6.200.000	5.801.022	Republic of South Africa Government Bond 8,000 % 31-Jan.-2030	111.575.016	5.405.204
Republic of South Africa Government Bond 8,000 % 31-Jan.-2030	111.575.016	5.748.078	Petrobras Global Finance BV 6,850 % 05-Jun.-2115	5.100.000	5.401.675
Romanian Government International Bond 'REGS' 3,375 % 28-Jan.-2050	4.785.000	5.260.866	Romanian Government International Bond 'REGS' 3,375 % 28-Jan.-2050	4.085.000	4.765.624
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,000 % 01-Jan.-2027	20.000.000	4.962.546	Ecopetrol SA 6,875 % 29-Apr.-2030	4.232.000	4.661.754
Republic of South Africa Government Bond 10,500 % 21-Dez.-2026	74.425.032	4.646.867	Chile Government International Bond 3,500 % 25-Jan.-2050	4.500.000	4.633.133
Petrobras Global Finance BV 6,850 % 05-Jun.-2115	4.675.000	4.623.650	Mexican Bonos 8,500 % 31-Mai-2029	85.070.000	4.323.276
Mexico Government International Bond 3,900 % 27-Apr.-2025	4.157.000	4.370.884	Colombia Government International Bond 4,500 % 15-März-2029	4.050.000	4.261.875
Indonesia Treasury Bond 8,125 % 15-Mai-2024	63.000.000.000	4.208.237	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 10,000 % 01-Jan.-2027	18.000.000	4.034.531
Ecopetrol SA 6,875 % 29-Apr.-2030	4.232.000	4.206.580	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 28-Apr.-2020	4.000.000	4.000.113
Chile Government International Bond 3,500 % 25-Jan.-2050	3.900.000	4.066.803	Egypt Government International Bond 'REGS' 8,700 % 01-März-2049	3.650.000	3.941.938
United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 28-Apr.-2020	4.000.000	4.000.030	Saudi Government International Bond 'REGS' 2,000 % 09-Jul.-2039	3.300.000	3.795.873
Dominican Republic International Bond 'REGS' 6,500 % 15-Feb.-2048	4.100.000	3.973.050	Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos '144A' 4,700 % 01-Sept.-2030	2.500.000.000	3.657.603
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 'REGS'			Angolan Government International Bond 'REGS' 8,000 % 26-Nov.-2029	3.703.000	3.546.483
3,000 % 30-Jun.-2030	4.000.000	3.965.840	Romania Government Bond 3,650 % 24-Sept.-2031	17.700.000	3.536.435
Peru Government Bond '144A' 5,350 % 12-Aug.-2040	12.500.000	3.912.768	Peru Government Bond '144A' 5,350 % 12-Aug.-2040	12.500.000	3.511.033
Abu Dhabi Government International Bond 'REGS' 2,500 % 30-Sept.-2029	3.900.000	3.883.300	Ukraine Government International Bond 'REGS' 7,750 % 01-Sept.-2025	3.100.000	3.259.250
Romania Government Bond 3,650 % 24-Sept.-2031	17.700.000	3.839.957	Ghana Government International Bond 'REGS' 7,875 % 11-Feb.-2035	3.220.000	2.985.178
Saudi Government International Bond 'REGS' 2,000 % 09-Jul.-2039	3.300.000	3.807.101	Petroleos Mexicanos 'REGS' 7,690 % 23-Jan.-2050	2.714.000	2.962.866
DP World Salaam FRN (Perpetual) 6,000 % 01-Okt.-2025	3.800.000	3.778.112			

BNY Mellon Euroland Bond Fund für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten in EUR	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse in EUR
French Republic Government Bond OAT '144A' 0,700 % 25-Jul.-2030	29.326.583	34.548.760	French Republic Government Bond OAT 0,750 % 25-Mai-2028	75.015.000	81.022.613
French Republic Government Bond OAT '144A' 2,000 % 25-Mai-2048	14.875.000	19.671.146	French Republic Government Bond OAT '144A' 2,000 % 25-Mai-2048	46.125.000	61.950.956
United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 30-Jul.-2020	17.332.000	16.018.813	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 4,750 % 04-Jul.-2028	28.075.000	40.510.790
Repsol International Finance BV 'EMTN' 2,625 % 15-Apr.-2030	11.900.000	11.887.624	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2,500 % 15-Aug.-2046	22.745.000	37.982.436
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2,500 % 15-Aug.-2046	7.300.000	11.547.870	Bundesobligation 0,000 % 05-Apr.-2024	33.300.000	34.197.174
Latvia Government International Bond 0,375 % 07-Okt.-2026	10.000.000	9.980.100	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,750 % 01-Sept.-2021	29.145.000	30.774.377
Portugal Obrigaçoes do Tesouro OT '144A' 3,875 % 15-Feb.-2030	7.325.000	9.979.903	Japanese Government CPI Linked Bond 0,100 % 10-März-2027	2.609.586.615	21.545.699
Societe Du Grand Paris EPIC 1,700 % 25-Mai-2050	8.000.000	9.399.520	Russian Federal Bond - OFZ 7,050 % 19-Jan.-2028	1.811.775.000	20.639.206
Societe Du Grand Paris EPIC 'EMTN' 1,700 % 25-Mai-2050	8.000.000	9.394.292	Spain Government Bond '144A' 4,400 31-Okt.-2023	17.280.000	19.918.658
Spain Government Bond '144A' 0,600 % 31-Okt.-2029	8.975.000	9.368.998	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,350 % 15-Apr.-2022	18.150.000	18.530.028
Lloyds Bank Corporate Markets Plc 'EMTN' 2,375 % 09-Apr.-2026	7.425.000	7.376.292	Spain Government Bond '144A' 2,900 % 31-Okt.-2046	11.550.000	15.500.686
Airbus SE 2,000 % 07-Apr.-2028	7.000.000	6.973.890	French Republic Government Bond OAT '144A' 0,700 % 25-Jul.-2030	14.717.380	15.446.429
Barclays Plc 'EMTN' FRN 3,375 % 02-Apr.-2025	6.100.000	6.079.382	Korea Treasury Bond 2,375 % 10-Dez.-2028	17.128.800.000	14.069.697
Shell International Finance BV 'EMTN' 1,875 % 07-Apr.-2032	6.000.000	5.968.140	Kingdom of Belgium Government Bond '144A' 1,600 % 22-Jun.-2047	10.135.000	12.126.138
Bank of America Corp 'MTN' FRN 4,083 % 20-März-2051	6.500.000	5.908.552	Kingdom of Belgium Government Bond '144A' 2,600 % 22-Jun.-2024	10.325.000	11.600.917
PepsiCo Inc 3,625 % 19-März-2050	6.350.000	5.741.839	Spain Government Bond 1,400 % 31-Jan.-2020	11.510.000	11.510.000
Exxon Mobil Corp 4,327 % 19-März-2050	6.300.000	5.726.750	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 16-Apr.-2020	10.700.000	9.887.975
Bundesobligation 0,000 % 05-Apr.-2024	5.300.000	5.461.809	Australia Government Bond 3,000 % 21-März-2047	12.050.000	9.444.674
BP Capital Markets Plc 2,822 % 07-Apr.-2032	5.400.000	5.400.000	Societe Du Grand Paris EPIC 1,700 % 25-Mai-2050	8.000.000	9.394.292
Hellenic Republic Government Bond '144A' 2,000 % 22-Apr.-2027	4.725.000	4.721.031	BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund	7.023.088	7.300.264
Sanofi 1,500 % 01-Apr.-2030	4.300.000	4.581.177			
Hungary Government International Bond 1,625 % 28-Apr.-2032	4.675.000	4.570.140			
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,000 % 01-Aug.-2029	4.000.000	4.475.160			
Nestle Finance International Ltd 0,375 % 12-Mai-2032	4.500.000	4.417.065			

BNY Mellon European Credit Fund für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten in EUR	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse in EUR
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	9.495	1.562.837	Insight Global Funds II plc - Insight Emerging Markets Debt Fund	119.280	1.990.054
UniCredit SpA FRN 2,731 % 15-Jan.-2032	1.112.000	1.119.608	UniCredit SpA FRN 2,731 % 15-Jan.-2032	1.112.000	1.113.390
Repsol International Finance BV FRN 4,500 % 25-März-2075	950.000	1.096.490	Repsol International Finance BV FRN (Perpetual) 3,875 % 25-März-2169	950.000	989.235
Exxon Mobil Corp 0,142 % 26-Jun.-2024	820.000	820.000	JPMorgan Chase & Co 'EMTN' FRN 1,090 % 11-März-2027	960.000	944.835
Verizon Communications Inc 1,850 % 18-Mai-2040	783.000	782.867	BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	899.134	908.968
Banco BPM SpA 'EMTN' 1,625 % 18-Feb.-2025	651.000	650.468	UniCredit SpA 'EMTN' FRN 2,000 % 23-Sept.-2029	912.000	906.063
International Business Machines Corp 1,950 % 15-Mai-2030	700.000	641.201	Coöperatieve Rabobank UA 'GMTN' 0,750 % 29-Aug.-2023	800.000	820.128
BPCE SA 0,625 % 28-Apr.-2025	600.000	597.120	Belfius Bank SA 0,375 % 13-Feb.-2026	800.000	795.400
JPMorgan Chase & Co 'EMTN' FRN 0,389 % 24-Feb.-2028	589.000	589.000	Aviva Plc 'EMTN' FRN 6,125 % 05-Jul.-2043	600.000	705.132
UBS AG/London 'EMTN' 0,750 % 21-Apr.-2023	585.000	585.020	VIVAT NV 2,375 % 17-Mai-2024	630.000	656.132
BNP Paribas SA 'EMTN' 0,125 % 04-Sept.-2026	600.000	576.492	Repsol International Finance BV FRN 4,500 % 25-März-2075	637.000	644.963
Barclays Plc 'EMTN' FRN 0,750 % 09-Jun.-2025	540.000	540.491	International Business Machines Corp 1,950 % 15-Mai-2030	700.000	630.554
Oracle Corp 3,600 % 01-Apr.-2050	587.000	528.451	Criteria Caixa SA 'EMTN' 1,375 % 10-Apr.-2024	600.000	620.052
Fidelity National Information Services Inc 0,125 % 03-Dez.-2022	530.000	527.933	Bayer Capital Corp BV 0,625 % 15-Dez.-2022	600.000	610.836
Volkswagen Financial Services AG 'EMTN' 0,250 % 16-Okt.-2020	530.000	527.505	Raytheon Technologies Corp 1,125 % 15-Dez.-2021	589.000	600.309
Anheuser-Busch InBev SA/NV 3,700 % 02-Apr.-2040	499.000	518.374	ArcelorMittal SA 6,250 % 25-Feb.-2022	620.000	598.071
Goldman Sachs Group Inc/The 3,375 % 27-März-2025	493.000	503.390	JPMorgan Chase & Co 'EMTN' FRN 0,389 % 24-Feb.-2028	589.000	570.822
ING Bank NV FRN 3,625 % 25-Feb.-2026	500.000	503.125	Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' 4,000 % 30-Okt.-2023	489.000	556.991
Engie SA 'EMTN' 0,500 % 13-März-2022	500.000	501.250	Anheuser-Busch InBev SA/NV 'EMTN' 2,875 % 25-Sept.-2024	500.000	546.400
Credit Agricole SA 'EMTN' FRN 1,625 % 05-Jun.-2030	500.000	499.975	Volkswagen Financial Services AG 'EMTN' 0,250 % 16-Okt.-2020	530.000	529.332
Siemens Finanzierungsmaatschappij NV 'EMTN' 0,250 % 20-Feb.-2029	500.000	499.200			
Credit Suisse Group AG 'EMTN' FRN 0,650 % 14-Jan.-2028	500.000	498.705			
CaixaBank SA 'EMTN' 0,375 % 03-Feb.-2025	500.000	498.530			
BMW Finance NV 'EMTN' 0,000 % 14-Apr.-2023	473.000	472.877			
Intesa Sanpaolo Vita SpA FRN (Perpetual) 4,750 % 17-Dez.-2168	400.000	454.950			

BNY Mellon Global Bond Fund für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten in USD	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse in USD
United States Treasury Note/Bond 2,375 % 15-Mai-2029	28.340.000	31.186.524	Japan Government Two Year Bond 0,100 % 01-Jun.-2021	3.107.400.000	29.329.996
United States Treasury Note/Bond 1,500 % 15-Feb.-2030	23.490.000	25.345.593	United States Treasury Note/Bond 1,500 % 15-Feb.-2030	20.710.000	22.093.909
Denmark Government Bond '144A' 0,500 % 15-Nov.-2029	97.100.000	15.228.745	United Kingdom Gilt 4,250 % 07-Dez.-2027	12.200.000	20.489.143
United States Treasury Note/Bond 1,500 % 15-Aug.-2026	12.620.000	13.334.374	United States Treasury Note/Bond 2,375 % 15-Mai-2029	1.778.400	19.838.305
United Kingdom Gilt Inflation Linked 0,125 % 22-März-2026	7.696.610	11.678.824	Canada Housing Trust No 1 '144A' 2,650 % 15-März-2028	23.800.000	19.198.631
United States Treasury Note/Bond 0,500 % 15-März-2023	11.470.000	11.452.367	Japan Government Two Year Bond 0,100 % 15-Apr.-2020	1.888.450.000	17.625.869
iShares China CNY Bond UCITS ETF - ETF	2.120.159	11.071.211	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,500 % 01-März-2024	13.170.000	15.985.663
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 1,850 % 01-Jul.-2025	10.020.000	10.902.958	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,750 % 15-Jul.-2028	13.840.005	14.851.584
United States Treasury Note/Bond 1,125 % 28-Feb.-2022	10.420.000	10.567.540	United States Treasury Note/Bond 2,875 % 15-Mai-2043	11.240.000	14.377.649
Japan Government Two Year Bond 0,100 % 01-Jun.-2021	973.500.000	8.897.556	Hungary Government Bond 2,500 % 24-Okt.-2024	4.377.210.000	13.998.812
New South Wales Treasury Corp 3,000 % 20-März-2028	11.430.000	8.855.391	Norway Government Bond '144A' 1,750 % 17-Feb.-2027	125.610.000	13.793.630
Japan Government Two Year Bond 0,100 % 01-Apr.-2022	941.000.000	8.843.861	United Kingdom Gilt Inflation Linked 0,125 % 22-März-2026	7.696.610	10.974.206
United States Treasury Note/Bond 3,000 % 15-Nov.-2045	7.190.000	8.535.251	New Zealand Local Government Funding Agency Bond 4,500 % 15-Apr.-2027	14.500.000	10.829.526
Canada Housing Trust No 1 '144A' 2,100 % 15-Sept.-2029	10.790.000	8.462.824	United States Treasury Note/Bond 3,000 % 15-Nov.-2045	8.260.000	10.428.438
Canada Housing Trust No 1 '144A' 2,350 % 15-Sept.-2023	9.720.000	7.289.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 6,500 % 01-Nov.-2027	6.970.000	10.382.621
United States Treasury Note/Bond 2,000 % 15-Feb.-2050	5.990.000	6.682.106	United States Treasury Note/Bond 0,125 % 15-Apr.-2020	9.065.925	9.075.807
Ireland Government Bond 1,100 % 15-Mai-2029	4.930.000	6.321.836	United States Treasury Note/Bond 1,500 % 15-Aug.-2026	7.730.000	8.093.254
Japan Government Ten Year Bond 0,100 % 20-Dez.-2029	630.650.000	6.181.021	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1,500 % 20-Apr.-2020	7.800.000	7.798.440
Treasury Corp of Victoria 1,000 % 20-Nov.-2023	9.150.000	6.137.522	Singapore Government Bond 2,750 % 01-März-2046	7.050.000	6.580.365
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,500 % 01-Mai-2023	4.780.000	6.022.012	Japanese Government CPI Linked Bond 0,100 % 10-März-2028	640.781.339	6.199.965
Norway Government Bond '144A' 1,375 % 19-Aug.-2030	55.620.000	6.002.247	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 3,850 % 01-Sept.-2049	4.400.000	5.520.153
Czech Republic Government Bond 2,750 % 23-Jul.-2029	128.170.000	5.879.820	Dexia Credit Local SA/New York NY 'REGS' 1,875 % 29-Jan.-2020	4.850.000	4.850.000
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 6,500 % 01-Nov.-2027	3.800.000	5.879.235	Peruvian Government International Bond 2,392 % 23-Jan.-2026	4.400.000	4.566.888
Mexican Bonos 8,500 % 31-Mai-2029	95.710.000	5.840.514	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 1,000 % 15-Feb.-2046	2.887.652	3.651.954
Spain Government Bond 5,750 % 30-Jul.-2032	3.290.000	5.761.488			
Colombia Government International Bond 'REGS' 6,000 % 28-Apr.-2028	18.453.200.000	5.540.397			
Qatar Government International Bond 'REGS' 3,400 % 16-Apr.-2025	5.288.000	5.476.625			
Peruvian Government International Bond 'REGS' 8,200 % 12-Aug.-2026	12.680.000	4.821.095			
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 2,450 % 01-Sept.-2050	4.990.000	4.754.830			
Malaysia Government Bond 3,906 % 15-Jul.-2026	18.858.000	4.698.771			
Japan Government Twenty Year Bond 0,400 % 20-März-2040	489.950.000	4.664.258			
Abu Dhabi Government International Bond 'REGS' 2,500 % 16-Apr.-2025	4.433.000	4.504.693			
Peruvian Government International Bond 2,392 % 23-Jan.-2026	4.400.000	4.430.590			
Australia Government Bond 3,000 % 20-Sept.-2025	4.990.000	4.352.240			
Mexico Government International Bond 3,900 % 27-Apr.-2025	4.288.000	4.273.006			
United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,500 % 15-Apr.-2024	3.961.283	3.925.331			

BNY Mellon Global Credit Fund für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten in USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse in USD
Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	233.126.373	233.126.373	Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	220.902.931	220.902.931
Bundesobligation (Null-Coupon) 0,000 % 11-Apr.-2025	25.377.777	29.482.750	United States Treasury Note/Bond 1,559 % 30-Apr.-2020	15.900.000	15.898.685
United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 10-Sept.-2020	27.710.000	27.703.538	Bank of Montreal 'EMTN' FRN 0,011 % 14-März-2022	10.308.000	11.165.981
United States Treasury Note/Bond 0,125 % 30-Jun.-2022	26.782.400	26.752.061	Societe Generale SA 'EMTN' FRN 0,462 % 01-Apr.-2022	7.900.000	8.880.303
United States Treasury Note/Bond 0,375 % 30-Apr.-2025	24.203.600	24.272.050	BP Capital Markets Plc 2,822 % 07-Apr.-2032	6.649.000	8.801.057
AT&T Inc 2,750 % 01-Jun.-2031	14.770.000	14.746.220	Bank of America Corp 'EMTN' FRN 0,400 % 07-Feb.-2022	8.042.000	8.621.180
United States Treasury Note/Bond 1,125 % 15-Mai-2040	13.720.900	13.584.025	BNP Paribas SA 'EMTN' FRN 0,457 % 22-Sept.-2022	8.000.000	8.461.979
United States Treasury Note/Bond 0,250 % 31-Mai-2025	11.425.700	11.301.178	Societe Generale SA 'EMTN' FRN 06-März-2023	7.900.000	8.422.531
JPMorgan Chase & Co FRN 2,522 % 22-Apr.-2031	10.919.000	10.919.000	Credit Agricole SA/London 'EMTN' FRN 0,407 % 20-Apr.-2022	7.800.000	8.318.469
Bank of Montreal 'EMTN' FRN 0,105 % 14-März-2022	8.000.000	8.830.764	BPCE SA 'MTN' FRN 1,243 % 31-Mai-2022	8.200.000	8.305.370
Societe Generale SA 'EMTN' FRN 0,057 % 06-März-2023	7.900.000	8.774.489	Wells Fargo Bank NA 'BKNT' FRN 1,659 % 09-Sept.-2022	8.500.000	8.252.395
PPL Capital Funding Inc 4,125 % 15-Apr.-2030	8.641.000	8.638.062	Goldman Sachs Group Inc/The 'EMTN' FRN 0,161 % 09-Sept.-2022	7.054.000	7.587.335
Citigroup Inc 'EMTN' FRN 0,111 % 21-März-2023	7.500.000	8.172.677	National Australia Bank Ltd 'REGS' FRN 1,182 % 13-Dez.-2022	7.000.000	6.775.650
BPCE SA 'MTN' FRN 1,243 % 31-Mai-2022	7.900.000	7.992.272	Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' 1,750 % 20-März-2028	5.300.000	6.173.471
BP Capital Markets Plc 2,822 % 07-Apr.-2032	6.649.000	7.214.501	Commonwealth Bank of Australia '144A' FRN 2,590 % 10-März-2022	6.096.000	6.156.899
National Australia Bank Ltd 'REGS' FRN 2,251 % 13-Dez.-2022	7.000.000	7.000.000	Schlumberger Holdings Corp '144A' 4,300 % 01-Mai-2029	5.520.000	6.124.661
Anheuser-Busch InBev SA/NV 3,700 % 02-Apr.-2040	5.604.000	6.644.326	European Investment Bank 'EMTN' 1,750 % 15-Sept.-2045	4.137.000	6.059.783
Intesa Sanpaolo SpA 'EMTN' 1,750 % 20-März-2028	5.300.000	6.157.548	Imperial Brands Finance Plc '144A' 3,500 % 26-Jul.-2026	5.692.000	6.052.133
Barclays Plc FRN 2,558 % 10-Aug.-2021	6.000.000	6.153.682	HSBC Holdings Plc FRN 2,256 % 13-Nov.-2026	4.395.000	5.857.428
United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 03-Sept.-2020	6.100.000	6.098.667	Walmart Inc 3,950 % 28-Jun.-2038	4.850.000	5.825.529

BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten in USD	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse in USD
United States Treasury Note/Bond 0,500 % 15-März-2023	15.170.000	15.146.679	United States Treasury Note/Bond 1,125 % 30-Sept.-2021	34.850.000	34.842.950
United States Treasury Note/Bond 1,500 % 15-Feb.-2030	12.850.000	13.860.325	Japan Government Two Year Bond 0,100 % 01-Jun.-2021	3.673.000.000	33.944.950
Japan Government Two Year Bond 0,100 % 01-Apr.-2022	1.170.000.000	10.990.178	United Kingdom Gilt Inflation Linked 0,750 % 15-Jul.-2028	20.257.136	22.030.891
United States Treasury Note/Bond 2,375 % 15-Mai-2029	9.120.000	10.061.858	United States Treasury Note/Bond 1,500 % 15-Aug.-2026	17.460.000	18.263.974
United Kingdom Gilt Inflation Linked 0,125 % 22-März-2026	6.493.434	9.867.485	SPDR Bloomberg Barclays Emerging Markets Local Bond UCITS ETF - ETF	214.978	14.411.612
United States Treasury Note/Bond 1,500 % 15-Aug.-2026	8.700.000	9.118.702	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,500 % 01-März-2024	10.880.000	13.387.556
iShares J.P. Morgan USD EM Bond UCITS ETF - ETF	67.508	7.697.714	iShares USD High Yield Corp Bond UCITS ETF	118.601	12.262.182
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 1,850 % 01-Jul.-2025	6.280.000	6.909.701	iShares EUR High Yield Corp Bond UCITS ETF - ETF	104.475	11.992.432
United States Treasury Note/Bond 1,125 % 28-Feb.-2022	6.530.000	6.609.329	United States Treasury FRN 1,641 % 31-Jan.-2021	10.120.000	10.121.702
United States Treasury Note/Bond 3,000 % 15-Nov.-2045	4.900.000	5.813.691	United States Treasury Note/Bond 2,375 % 15-Mai-2029	9.120.000	10.078.651
SPDR Bloomberg Barclays Emerging Markets Local Bond UCITS ETF - ETF	77.957	5.616.272	Hungary Government Bond 2,500 % 24-Okt.-2024	2.909.720.000	9.403.461
iShares USD Short Duration Corp Bond UCITS ETF	52.306	5.416.362	United Kingdom Gilt Inflation Linked 0,125 % 22-März-2026	6.493.434	9.379.533
Treasury Corp of Victoria 1,000 % 20-Nov.-2023	8.010.000	5.372.847	iShares J.P. Morgan USD EM Bond UCITS ETF - ETF	67.508	7.778.312
Canada Housing Trust No 1 '144A' 2,350 % 15-Sept.-2023	7.100.000	5.359.847	Vietnam Government International Bond 'REGS' 6,750 % 29-Jan.-2020	7.470.000	7.470.000
Canada Housing Trust No 1 '144A' 2,100 % 15-Sept.-2029	5.980.000	4.690.240	Canada Housing Trust No 1 '144A' 1,250 % 15-Jun.-2021	9.750.000	7.328.693
New South Wales Treasury Corp 3,000 % 20-März-2028	5.950.000	4.599.009	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,500 % 15-Apr.-2024	6.668.285	6.836.724
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 6,500 % 01-Nov.-2027	2.900.000	4.486.785	United States Treasury Note/Bond 1,125 % 28-Feb.-2022	6.530.000	6.639.345
Mexican Bonos 8,500 % 31-Mai-2029	73.180.000	4.465.665	Australia Government Bond 5,750 % 15-Mai-2021	10.370.000	6.586.846
Ireland Government Bond 1,100 % 15-Mai-2029	3.390.000	4.347.063	Canada Housing Trust No 1 '144A' 2,650 % 15-März-2028	8.000.000	6.453.740
Colombia Government International Bond 'REGS' 6,000 % 28-Apr.-2028	14.336.100.000	4.304.277	United States Treasury Note/Bond 3,000 % 15-Nov.-2045	4.900.000	6.216.980
Singapore Government Bond 2,250 % 01-Jun.-2021	5.870.000	4.268.554	New Zealand Local Government Funding Agency Bond 4,500 % 15-Apr.-2027	8.285.000	6.210.449
United States Treasury Note/Bond 2,875 % 15-Mai-2043	3.200.000	4.254.842	United States Treasury Note/Bond 0,500 % 15-März-2023	5.900.000	5.938.719
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1,500 % 15-Jun.-2021	4.020.000	4.065.393	Australia Government Bond 3,000 % 21-März-2047	6.785.000	5.626.607
United States Treasury FRN 1,665 % 31-Jan.-2022	4.050.000	4.049.610	iShares USD Short Duration Corp Bond UCITS ETF	52.306	5.391.818
iShares USD Corp Bond UCITS ETF	29.701	3.724.666	Inter-American Development Bank 'GMTN' 3,875 % 28-Okt.-2041	3.443.000	4.735.335
Dexia Credit Local SA 0,500 % 22-Jul.-2023	3.000.000	3.690.584	New South Wales Treasury Corp 3,000 % 20-März-2028	5.950.000	4.558.189
International Bank for Reconstruction & Development FRN 0,471 % 17-Jun.-2024	3.680.000	3.680.000	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 6,500 % 01-Nov.-2027	2.900.000	4.357.692
Czech Republic Government Bond 1,250 % 14-Feb.-2025	87.750.000	3.605.276			
Qatar Government International Bond 'REGS' 3,400 % 16-Apr.-2025	3.291.000	3.408.350			
United States Treasury Note/Bond 2,000 % 15-Feb.-2050	3.050.000	3.350.125			
Spain Government Bond '144A' 5,150 % 31-Okt.-2028	2.180.000	3.340.716			
United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,750 % 15-Jul.-2028	2.993.779	3.145.282			

BNY Mellon Global Emerging Markets Fund für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten in USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse in USD
Asian Paints Ltd	31.559	759.186	Samsung SDI Co Ltd	5.319	1.388.104
Ilijin Materials Co Ltd	17.894	681.252	Samsung Electronics Co Ltd	14.452	693.041
Meituan Dianping	48.228	629.647	New Oriental Education & Technology Group Inc ADR	5.109	640.507
New Oriental Education & Technology Group Inc ADR	4.029	519.906	Naspers Ltd	3.835	630.701
Prosus NV	6.884	483.738	Alibaba Group Holding Ltd ADR	3.075	622.336
Alibaba Group Holding Ltd ADR	1.872	403.944	Godrej Consumer Products Ltd	70.718	563.619
Samsung SDI Co Ltd	1.422	386.530	Globant SA	4.126	535.668
Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	30.500	337.187	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	46.000	476.456
EPAM Systems Inc	1.623	308.388	Applied Materials Inc	9.777	436.282
Globant SA	2.809	300.660	Maruti Suzuki India Ltd	4.884	399.470
Housing Development Finance Corp Ltd	10.774	289.342	AIA Group Ltd	37.800	368.404
AIA Group Ltd	26.600	281.473	Autohome Inc ADR	4.581	355.222
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	26.000	279.851	CVC Brasil Operadora e Agencia de Viagens SA	38.100	321.551
HeadHunter Group Plc ADR	11.529	254.341	Tencent Holdings Ltd	6.105	311.672
Vale Indonesia Tbk PT	1.267.976	249.067	Housing Development Finance Corp Ltd	10.003	298.529
Elite Material Co Ltd	61.000	243.184	Hindustan Unilever Ltd	10.083	294.116
Tencent Music Entertainment Group ADR	18.421	236.930	British American Tobacco Plc	6.387	282.069
Kasikornbank PCL (Foreign Market)	54.000	218.811	GSX Techedu Inc ADR	8.057	280.790
Info Edge India Ltd	6.104	209.500	Delivery Hero SE '144A'	3.113	256.505
Titan Co Ltd	12.820	206.994	Unilever NV	4.027	226.461
Tencent Holdings Ltd	3.530	186.812	LG Household & Health Care Ltd	205	212.791
Jubilant Foodworks Ltd	7.822	185.885	Ilijin Materials Co Ltd	5.070	196.895
Maruti Suzuki India Ltd	2.393	184.874	Titan Co Ltd	12.023	194.208
Livent Corp	24.257	170.198	Discovery Ltd	31.093	191.398
IDP Education Ltd	12.198	157.525	Edelweiss Financial Services Ltd	136.820	179.999
Laureate Education Inc - A-Klasse	10.243	151.219	51job Inc ADR	2.432	179.018
ASML Holding NV	454	141.155	Info Edge India Ltd	4.590	168.227
GSX Techedu Inc ADR	2.823	118.008	Clicks Group Ltd	11.147	166.945
MercadoLibre Inc	169	114.786	Meituan Dianping	12.099	157.937
Discovery Ltd	21.715	114.511	EPAM Systems Inc	684	157.493
Autohome Inc ADR	1.248	103.169	China Harmony New Energy Auto Holding Ltd	324.000	148.796
			Prosus NV	1.955	147.840
			Apollo Hospitals Enterprise Ltd	6.570	137.963
			Jubilant Foodworks Ltd	5.947	137.737

BNY Mellon Global Equity Fund für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten in USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse in USD
Alibaba Group Holding Ltd ADR	34.479	7.028.996	Wolters Kluwer NV	99.957	6.449.154
Lennar Corp	78.653	4.864.806	Alphabet Inc - A-Klasse	4.400	5.434.472
Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	374.000	4.502.608	Microsoft Corp	23.764	4.365.986
Citigroup Inc	78.278	4.094.712	Ferguson Plc	45.143	3.051.205
Goldman Sachs Group Inc/The	17.548	3.671.224	Intact Financial Corp	28.021	2.995.285
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	69.248	3.553.092	Gilead Sciences Inc	32.291	2.304.590
Kasikornbank PCL (Foreign Market)	830.300	3.465.569	Walgreens Boots Alliance Inc	42.653	2.143.945
Continental AG	27.304	2.761.253	AIA Group Ltd	231.000	2.106.223
Deutsche Post AG	91.152	2.725.214	Seven & i Holdings Co Ltd	55.900	2.034.499
Applied Materials Inc	45.213	2.488.745	L'Oreal SA	6.762	1.876.484
Mastercard Inc	7.680	2.071.502	Amazon.com Inc	814	1.876.224
Amazon.com Inc	769	1.827.931	Novartis AG	20.636	1.753.473
Lonza Group AG	3.761	1.545.410	DNB ASA	120.126	1.724.725
Cisco Systems Inc	31.603	1.413.519	Roche Holding AG	4.983	1.714.763
Suzuki Motor Corp	37.300	1.300.296	Deutsche Wohnen SE	44.696	1.407.703
Apple Inc	4.053	1.213.702	Apple Inc	4.173	1.239.878
Alphabet Inc - A-Klasse	758	1.004.010	ConocoPhillips	25.440	1.215.566
Informa Plc	175.861	982.129	Lennar Corp	23.195	1.214.790
Abbott Laboratories	10.339	939.927	Alcon Inc	18.140	1.131.587
General Electric Co	127.581	939.366	Dollar General Corp	6.045	1.058.840
AIA Group Ltd	97.800	937.162	Relx Plc	45.003	1.042.161
SAP SE	6.758	861.570	Japan Tobacco Inc	50.500	1.019.494
Roche Holding AG	2.489	843.481	Goldman Sachs Group Inc/The	3.999	964.098
Relx Plc	35.382	828.724	Costco Wholesale Corp	3.152	952.553
Accenture Plc - A-Klasse	3.889	733.961	Citigroup Inc	19.003	940.683
Novartis AG	8.090	718.509	Merck & Co Inc	11.311	894.495
Dollar General Corp	4.049	717.353	AIB Group Plc	298.856	742.495

BNY Mellon Global Equity Income Fund für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten in USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse in USD
KDDI Corp	1.141.700	34.469.182	QUALCOMM Inc	498.063	40.889.505
Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	1.581.500	16.755.839	Gilead Sciences Inc	383.572	29.476.947
Continental AG	139.412	13.372.443	Western Union Co/The	1.077.471	23.770.550
Citigroup Inc	188.130	9.700.700	Cisco Systems Inc	530.523	22.515.093
Merck & Co Inc	121.138	9.451.933	Orkla ASA	2.285.772	20.360.973
Informa Plc	1.640.053	8.886.119	Harley-Davidson Inc	801.795	19.137.538
Unilever Plc	154.484	8.703.813	Coty Inc	3.788.051	18.032.363
Principal Financial Group Inc	239.928	8.627.955	PepsiCo Inc	122.651	16.011.403
Emerson Electric Co	155.351	8.556.620	Maxim Integrated Products Inc	264.569	14.402.861
Zurich Insurance Group AG	24.116	7.285.074	Vodafone Group Plc	7.550.652	13.049.385
Cisco Systems Inc	147.546	5.858.253	Samsung Electronics Co Ltd - Preference	362.621	12.958.606
Novartis AG	54.622	4.921.989	Bayer AG	191.608	12.703.917
Ferguson Plc	56.998	4.295.890	Sanofi	133.433	12.556.757
Industria de Diseno Textil SA	136.830	4.069.217	Eversource Energy	142.522	12.188.785
QUALCOMM Inc	24.629	2.010.934	Roche Holding AG	35.952	12.036.679
PepsiCo Inc	10.294	1.474.491	Unilever Plc	229.268	11.842.171
Maxim Integrated Products Inc	22.203	1.295.018	Zurich Insurance Group AG	34.520	11.601.196
Bayer AG	16.080	1.217.742	CMS Energy Corp	188.552	11.446.325
Samsung Electronics Co Ltd - Preference	30.432	1.196.194	Novartis AG	132.428	11.417.201
Infosys Ltd ADR	101.817	1.131.525	British American Tobacco Plc	295.612	11.056.803
			Infosys Ltd ADR	1.213.231	10.941.246
			Merck & Co Inc	136.590	10.827.549
			BAE Systems Plc	1.548.697	10.284.246
			Procter & Gamble Co/The	86.881	10.054.936
			Cie Financiere Richemont SA	152.657	9.128.803
			Nestle SA	85.320	9.096.781
			Svenska Handelsbanken AB	1.001.156	8.891.752
			Industria de Diseno Textil SA	323.126	8.839.766
			Omnicom Group Inc	152.372	8.718.141
			Macquarie Korea Infrastructure Fund	886.062	8.460.548
			Informa Plc	1.316.797	8.412.743
			Principal Financial Group Inc	206.680	8.403.744
			Television Francaise 1	1.522.801	8.219.354
			Hennes & Mauritz AB	543.212	7.865.460
			KDDI Corp	256.300	7.528.548
			Paychex Inc	102.980	7.162.096
			Link REIT (Units) (REIT)	673.500	5.952.217
			TOTAL SA	142.078	5.455.143
			Royal Dutch Shell Plc	284.461	5.374.703

BNY Mellon Global High Yield Bond für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten in USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse in USD
iShares USD High Yield Corp Bond UCITS ETF - ETF	29.400	3.055.836	iShares USD High Yield Corp Bond UCITS ETF - ETF	53.455	5.512.693
Tenet Healthcare Corp '144A' 6,250% 01-Feb.-2027	850.000	873.900	ARD Finance SA 'REGS' 5,000% 30-Jun.-2027	1.245.000	1.332.688
TEGNA Inc '144A' 5,000% 15-Sept.-2029	705.000	692.288	Altice Luxembourg SA 'REGS' 8,000% 15-Mai-2027	860.000	1.066.208
INEOS Styrolution Group GmbH 'REGS' 2,250% 16-Jan.-2027	610.000	675.819	eircom Finance DAC 2,625% 15-Feb.-2027	905.000	988.055
Kraft Heinz Foods Co 5,200% 15-Jul.-2045	590.000	638.938	Eagle Holding Co II LLC '144A' 7,625% 15-Mai-2022	920.000	931.979
Lions Gate Capital Holdings LLC '144A' 6,375% 01-Feb.-2024	675.000	635.625	Sprint Corp 7,875% 15-Sept.-2023	800.000	870.625
Colt Merger Sub Inc '144A' 6,250% 01-Jul.-2025	630.000	630.000	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp '144A' 5,500% 01-Mai-2026	690.000	728.439
Covanta Holding Corp 6,000% 01-Jan.-2027	595.000	607.788	Tempur Sealy International Inc 5,500% 15-Jun.-2026	705.000	718.979
Pinewood Finance Co Ltd 'REGS' 3,250% 30-Sept.-2025	490.000	597.780	Brookfield Property REIT Inc / BPR Cumulus LLC / BPR Nimbus LLC /		
Banijay Group SAS 'REGS' 6,500% 01-März-2026	560.000	593.236	GGSI Sellco LL '144A' 5,750% 15-Mai-2026	775.000	690.777
Synlab Bondco Plc 'REGS' FRN 4,750% 01-Jul.-2025	545.000	584.630	INEOS Styrolution Group GmbH 'REGS' 2,250% 16-Jan.-2027	610.000	671.716
Grand Harbour CLO 2019-1 DAC '2019-1X D' FRN 4,100% 15-März-2032	500.000	564.950	Fire BC SpA 'REGS' FRN 4,750% 30-Sept.-2024	755.000	640.439
Centrica Plc FRN 5,250% 10-Apr.-2075	451.000	558.232	First Quality Finance Co Inc '144A' 5,000% 01-Jul.-2025	605.000	631.302
Carlyle Euro CLO 2019-1 DAC '2019-1X D' FRN 6,120% 15-März-2032	500.000	555.185	Scotts Miracle-Gro Co/The '144A' 4,500% 15-Okt.-2029	616.000	626.043
ARD Finance SA 'REGS' 5,000% 30-Jun.-2027	490.000	552.161	LSF10 Wolverine Investments SCA 'REGS' 5,000% 15-März-2024	540.000	621.546
Griffon Corp 5,750% 01-März-2028	555.000	547.000	Eldorado Resorts Inc 6,000% 01-Apr.-2025	560.000	585.913
Arconic Corp '144A' 6,125% 15-Feb.-2028	550.000	530.500	Centene Corp '144A' 5,375% 01-Jun.-2026	550.000	585.563
Clarios Global LP '144A' 6,750% 15-Mai-2025	515.000	527.875	Plantronics Inc '144A' 5,500% 31-Mai-2023	640.000	583.088
Verisure Midholding AB 'REGS' 5,750% 01-Dez.-2023	460.000	513.334	Everi Payments Inc '144A' 7,500% 15-Dez.-2025	675.000	570.033
Polaris Intermediate Corp '144A' 8,500% 01-Dez.-2022	550.000	512.738	Ortho-Clinical Diagnostics Inc / Ortho-Clinical Diagnostics SA '144A'		
			6,625% 15-Mai-2022	570.000	570.000
			Connect Finco SARL / Connect US Finco LLC '144A' 6,750% 01-Okt.-2026	515.000	546.663

BNY Mellon Global Infrastructure Income Fund für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten in USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse in USD
PPL Corp	432.250	11.568.250	Dominion Energy Inc	108.305	8.883.741
ONEOK Inc	320.208	11.354.546	Enel SpA	1.026.036	8.077.758
Aena SME SA '144A'	74.955	10.664.665	Inter Pipeline Ltd	617.768	6.455.518
Enagas SA	415.661	9.996.753	Omega Healthcare Investors Inc (REIT)	208.193	6.163.035
Orange SA	800.690	9.888.098	NextEra Energy Partners LP	118.617	5.888.308
Dominion Energy Inc	124.059	9.875.238	Enagas SA	218.353	5.089.618
Enbridge Inc	274.905	8.808.185	E.ON SE	468.624	5.002.636
SSE Plc	485.016	8.685.050	Engie SA	354.362	4.977.287
Vinci SA	102.729	8.217.912	SSE Plc	271.443	4.860.328
ACS Actividades de Construcción y Servicios SA	318.296	7.864.705	Orange SA	382.141	4.857.316
Medical Properties Trust Inc (REIT)	383.149	7.110.986	Exelon Corp	108.968	4.413.374
Exelon Corp	208.253	7.060.307	PPL Corp	137.788	4.277.677
Endesa SA	302.761	7.013.239	National Grid Plc	314.615	4.178.370
Bouygues SA	214.672	6.489.997	Vinci SA	42.556	3.949.716
Italgas SpA	1.136.348	6.326.620	Medical Properties Trust Inc (REIT)	236.637	3.927.291
Red Electrica Corp SA	367.623	6.209.691	Aena SME SA '144A'	29.171	3.737.965
Enel SpA	940.643	6.165.238	Italgas SpA	621.707	3.660.291
Deutsche Post AG	238.667	6.076.217	Atlantia SpA	203.916	3.598.732
SFL Corp Ltd	531.115	4.984.219	Deutsche Post AG	116.190	3.583.442
Inter Pipeline Ltd	582.414	4.918.744	Southern Co/The	50.188	3.499.737
Atlantia SpA	287.223	4.073.075	Royal Mail Plc	1.297.639	2.934.913
NextEra Energy Partners LP	96.892	3.783.239	Clearway Energy Inc	137.517	2.877.661
Eiffage SA	42.304	3.360.067	ACS Actividades de Construcción y Servicios SA	158.490	2.824.285
Public Service Enterprise Group Inc	82.583	3.247.968	Targa Resources Corp	119.011	2.766.450
Proximus SADP	131.922	2.926.609	Endesa SA	112.527	2.401.932
E.ON SE	267.667	2.912.619	ONEOK Inc	45.937	2.198.087
Jiangsu Expressway Co Ltd 'H'	2.190.000	2.601.932	Edison International	27.506	2.090.308
Clearway Energy Inc	131.635	2.550.770	bpost SA	140.297	1.493.276
Engie SA	136.300	2.093.459	EnLink Midstream LLC	574.450	1.468.475
Omega Healthcare Investors Inc (REIT)	65.831	2.031.020			

BNY Mellon Global Leaders Fund für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten in USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse in USD
Illumina Inc	6.300	1.574.936	Gilead Sciences Inc	34.300	2.466.109
Texas Instruments Inc	14.200	1.459.693	Air Liquide SA	14.530	2.062.160
ASML Holding NV	5.400	1.431.640	CSL Ltd	9.600	1.892.049
Edwards Lifesciences Corp	5.600	985.176	Johnson & Johnson	15.000	1.867.208
Cognizant Technology Solutions Corp	6.300	431.797	Roche Holding AG	5.000	1.748.580
Microsoft Corp	2.500	399.231	Colgate-Palmolive Co	24.100	1.746.759
Automatic Data Processing Inc	2.400	377.517	Reckitt Benckiser Group Plc	18.800	1.663.266
Die vorstehenden Angaben entsprechen den vollständigen Kaufangaben für den Fonds im Berichtszeitraum.			Novo Nordisk A/S	25.700	1.662.509
			Starbucks Corp	23.000	1.457.681
			NIKE Inc	11.100	1.136.053
			Keyence Corp	2.600	1.083.635
			Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	16.000	868.719
			Mastercard Inc	2.800	855.974
			Alphabet Inc	550	786.703
			Adobe Inc	1.900	738.520
			LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	1.600	706.209
			FANUC Corp	3.800	688.390
			TJX Cos Inc/The	12.000	673.288
			Schlumberger Ltd	46.000	671.305
			SAP SE	5.000	668.416
			L'Oreal SA	2.200	656.363
			Amphenol Corp - A-Klasse	3.800	399.702
			Industria de Diseño Textil SA	11.881	362.291
			Alia Group Ltd	38.600	354.992
			Intuitive Surgical Inc	600	350.214
			Cognizant Technology Solutions Corp	5.100	296.850

BNY Mellon Global Multi-Asset Income Fund für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten in EUR	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse in EUR
Mexican Bonos 8,500 % 31-Mai-2029	8.868.200	499.030	United States Treasury Note/Bond 2,000 % 15-Feb.-2025	558.300	532.257
United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,750 % 15-Jul.-2028	491.874	485.640	Mexican Bonos 8,000 % 07-Nov.-2047	6.555.500	372.958
Jiangsu Expressway Co Ltd 'H'	250.241	290.994	Greencoat UK Wind Plc/Funds	104.563	165.805
Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	28.000	285.671	Royal Dutch Shell Plc	5.271	157.688
CSN Islands XI Corp 'REGS' 6,750 % 28-Jan.-2028	226.000	204.503	TP ICAP Plc 'EMTN' 5,250 % 26-Jan.-2024	100.000	131.924
Bayer AG	3.241	200.073	Mexican Bonos 6,500 % 09-Jun.-2022	2.464.100	122.195
Cemex SAB de CV 'REGS' 6,125 % 05-Mai-2025	200.000	187.422	BBGI SICAV SA/Fund	64.081	121.862
ING Groep NV FRN (Perpetual) 6,750 % 16-Apr.-2024	200.000	183.426	Hikma Pharmaceuticals Plc	4.285	116.721
Continental AG	1.748	168.212	Virgin Media Receivables Financing Notes I DAC 'REGS' 5,500 % 15-Sept.-2024	101.000	114.735
UniCredit SpA 'EMTN' FRN (Perpetual) 3,875 % 03-Jun.-2027	200.000	160.500	Octopus Renewables Infrastructure Trust Plc	93.631	110.145
Royal Dutch Shell Plc	5.271	157.688	Alia Group Ltd	13.000	101.646
Informa Plc	21.133	124.327	Reynolds Group Issuer Inc / Reynolds Group Issuer LLC /		
Kasikornbank PCL (Foreign Market)	33.300	122.939	Reynolds Group Issuer Lu 5,750 % 15-Okt.-2020	110.478	100.230
Summer BC Holdco B SARL 'REGS' 5,750 % 31-Okt.-2026	116.000	122.053	Apple Inc	291	88.408
B&M European Value Retail SA 'REGS' 4,125 % 01-Feb.-2022	100.000	119.361	Royal Bank of Canada 1,875 % 05-Feb.-2020	85.000	771.15
Samsonite International SA '144A'	49.791	108.340	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,750 % 15-Jul.-2028	80.974	76.804
American Airlines Inc '144A' 11,750 % 15-Jul.-2025	116.000	101.543	Deutsche Wohnen SE	1.928	70.797
Anglo American Plc	6.366	100.355	Gilead Sciences Inc	960	57.606
Akelius Residential Property AB FRN 2,249 % 17-Mai-2081	100.000	96.775	Samsung SDI Co Ltd	183	50.373
JLEN Environmental Assets Group Ltd	68.251	95.814	Microsoft Corp	313	49.369
Imperial Brands Plc	3.973	90.570	Sprint Corp 7,125 % 15-Jun.-2024	53.000	49.146
Citigroup Inc	1.594	74.774	CCR SA	13.341	49.109
Renewables Infrastructure Group Ltd/The	54.763	73.161	Applied Materials Inc	886	46.939
Star Entertainment Grp Ltd/The	32.777	71.353	Post Holdings Inc '144A' 5,500 % 01-März-2025	49.000	45.887
GCP Infrastructure Investments Ltd	60.000	70.012	Antero Resources Corp 5,625 % 01-Jun.-2023	73.000	45.491
Trip.com Group Ltd 1,000 % 01-Jul.-2020	75.000	66.280	VPC Specialty Lending Investments Plc/Fund	57.716	45.004
Gresham House Energy Storage Fund Plc/The Fund	42.184	50.465	Schlumberger Ltd	3.363	40.727
			Centrica Plc	38.279	38.773
			United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2,375 % 15-Jan.-2025	38.818	36.241
			New South Wales Treasury Corp 3,000 % 20-März-2028	61.400	35.702
			M&G Plc	11.754	34.021

BNY Mellon Global Opportunities Fund für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten in USD	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse in USD
United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 21-Mai-2020	1.984.400	1.976.782	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 21-Mai-2020	1.984.400	1.983.116
United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 17-Sept.-2020	1.275.000	1.274.442	Gilead Sciences Inc	18.549	1.391.784
Continental AG	10.012	1.025.501	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 23-Jan.-2020	1.028.900	1.028.900
Lennar Corp	13.850	858.508	Microsoft Corp	5.723	933.387
Alibaba Group Holding Ltd ADR	4.388	841.708	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 12-März-2020	794.500	794.302
Kasikornbank PCL (Foreign Market)	155.000	666.586	Apple Inc	2.730	777.762
Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	40.000	408.048	Lennar Corp	13.850	714.529
Mastercard Inc	1.531	396.306	Alphabet Inc - A-Klasse	547	667.900
Vivendi SA	13.056	288.881	DNB ASA	51.041	612.880
Unilever NV	5.351	276.731	Goldman Sachs Group Inc/The	2.608	535.460
Diageo Plc	7.409	269.501	Accenture Plc - A-Klasse	2.841	522.114
Citigroup Inc	4.715	250.061	Novartis AG	6.049	516.579
Cisco Systems Inc	5.510	234.690	Roche Holding AG	1.522	503.979
Medtronic Plc	1.930	193.823	Intact Financial Corp	5.030	499.098
Microsoft Corp	1.107	185.155	Brenntag AG	10.721	478.787
Informa Plc	28.574	180.908	Samsung SDI Co Ltd	1.996	478.199
Bayer AG	2.625	180.754	Medtronic Plc	4.297	410.731
Alphabet Inc - A-Klasse	124	166.675	Cisco Systems Inc	9.865	401.831
Rolls-Royce Holdings Plc	22.008	153.672	Eversource Energy	4.586	392.794
AIA Group Ltd	15.600	152.447	AIA Group Ltd	43.400	388.986
Accenture Plc - A-Klasse	772	150.272	Applied Materials Inc	7.431	388.340
SAP SE	1.215	148.945	Japan Tobacco Inc	21.000	386.591
Novartis AG	1.657	146.252	Relx Plc	17.696	385.803
Apple Inc	494	145.829	Mastercard Inc	1.446	380.907
Goldman Sachs Group Inc/The	677	144.125	Ferguson Plc	5.356	364.522
			SAP SE	3.089	358.225
			Diageo Plc	10.552	345.206
			Rolls-Royce Holdings Plc	78.616	340.510
			Vivendi SA	14.865	326.543
			Bayer AG	5.117	322.731
			Wolters Kluwer NV	4.594	322.598
			Unilever NV	5.903	290.742
			Costco Wholesale Corp	983	290.421
			Suzuki Motor Corp	9.200	268.375
			Altria Group Inc	6.842	264.556
			Royal Dutch Shell Plc	15.274	264.197
			Citigroup Inc	5.522	259.527
			Associated British Foods Plc	11.023	259.228
			Valeo SA	10.691	248.847
			Lonza Group AG	576	240.797

BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR) für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten in EUR	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse in EUR
United States Treasury Note/Bond 1,750 % 31-Dez.-2026	171.305.600	155.529.248	Invesco Physical Gold ETC	1.458.754	202.652.324
iShares Physical Gold ETC	5.437.648	148.334.286	United States Treasury Note/Bond 2,375 % 15-Mai-2029	177.418.300	179.237.079
Amundi Physical Gold ETC	2.265.286	134.565.435	United States Treasury Note/Bond 1,750 % 31-Dez.-2026	171.305.600	164.693.264
iShares USD Corp Bond UCITS ETF - ETF	997.862	114.842.452	iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF - ETF	2.991.331	141.592.836
iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF - ETF	1.774.151	96.981.512	Spain Government Bond '144A' 0,250 % 30-Jul.-2024	100.963.000	102.862.006
Invesco Physical Gold ETC	631.371	91.189.844	Hellenic Republic Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 07-Feb.-2020	89.674.000	89.674.000
Hellenic Republic Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 28-Aug.-2020	70.000.000	70.017.500	Portugal Obrigações do Tesouro OT '144A' 5,650 % 15-Feb.-2024	70.055.493	86.514.002
Hellenic Republic Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 28-Feb.-2020	70.000.000	70.003.208	Hellenic Republic Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 28-Feb.-2020	70.000.000	70.000.000
Hellenic Republic Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 14-Apr.-2020	60.000.000	60.013.200	iShares J.P. Morgan USD EM Bond EUR Hedged UCITS ETF Dist - ETF	710.243	67.572.625
Hellenic Republic Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 08-Mai-2020	59.000.000	59.015.340	Hellenic Republic Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 14-Apr.-2020	60.000.000	60.000.000
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN (Perpetual) 6,750 % 29-Dez.-2049	36.000.000	36.231.114	Hellenic Republic Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 08-Mai-2020	59.000.000	59.000.000
Xtrackers Physical Gold ETC	187.387	28.214.620	SPDR Bloomberg Barclays Emerging Markets Local Bond UCITS ETF - ETF	1.012.573	57.795.983
Diageo Plc	822.556	26.281.464	Canada Housing Trust No 1 '144A' 0,000 % 15-Jun.-2027	77.875.000	55.776.111
Australia Government Bond 3,250 % 21-Jun.-2039	29.576.000	23.808.826	iShares EUR High Yield Corp Bond UCITS ETF - ETF	624.456	55.591.514
Alibaba Group Holding Ltd ADR	102.411	19.521.619	Hellenic Republic Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 31-Jan.-2020	50.714.000	50.714.000
Lennar Corp	306.069	17.408.262	Hungary Government Bond 5,500 % 24-Jun.-2025	13.617.860.000	46.530.906
Hungary Government Bond 5,500 % 24-Jun.-2025	4.796.190.000	17.243.475	Brazilian Government International Bond 4,875 % 22-Jan.-2021	38.760.000	36.040.307
Apple Inc	57.800	16.713.521	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA FRN (Perpetual) 6,750 29-Dez.-2049	36.000.000	36.000.000
Hellenic Republic Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 07-Aug.-2020	15.000.000	14.999.104	New Zealand Government Bond 4,500 % 15-Apr.-2027	37.497.000	26.638.455
ING Groep NV FRN (Perpetual) 4,875 % 16-Mai-2029	15.841.000	14.641.155	iShares EUR Corp Bond 1-5yr UCITS ETF - ETF	240.471	26.083.237
			Xtrackers Physical Gold ETC	168.344	24.989.283
			Anglo American Plc	1.001.001	24.183.052
			Australia Government Bond 3,000 % 21-März-2047	31.896.000	23.540.007

BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP) für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten in GBP	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse in GBP
United Kingdom Gilt 2,000 % 22-Jul.-2020	11.950.000	12.021.920	United Kingdom Gilt 4,750 % 07-März-2020	14.183.385	14.193.838
United Kingdom Gilt 4,750 % 07-März-2020	4.600.000	4.625.904	United Kingdom Gilt 2,000 % 22-Jul.-2020	8.352.300	8.399.577
United States Treasury Note/Bond 1,750 % 31-Dez.-2026	4.570.900	3.518.529	United States Treasury Note/Bond 1,750 % 31-Dez.-2026	4.570.900	3.997.708
Amundi Physical Gold ETC	59.951	3.187.554	Invesco Physical Gold ETC	32.120	3.883.358
iShares Physical Gold ETC	130.301	3.042.422	iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF - ETF	81.882	3.435.996
iShares USD Corp Bond UCITS ETF - ETF	24.201	2.429.949	United States Treasury Note/Bond 3,375 % 15-Nov.-2048	2.100.800	1.992.514
iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF - ETF	51.853	2.400.542	iShares J.P. Morgan USD EM Bond UCITS ETF - ETF	16.299	1.430.504
Invesco Physical Gold ETC	18.286	2.222.571	United Kingdom Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000 % 27-Jan.-2020	1.337.521	1.337.521
United Kingdom Gilt 3,750 % 07-Sept.-2020	2.000.000	2.018.360	SPDR Bloomberg Barclays Emerging Markets Local Bond UCITS ETF - ETF	25.077	1.273.583
Australia Government Bond 3,250 % 21-Jun.-2039	925.000	625.598	Canada Housing Trust No 1 '144A' 2,350 % 15-Jun.-2027	1.865.000	1.175.466
Xtrackers Physical Gold ETC	4.699	617.699	Hungary Government Bond 5,500 % 24-Jun.-2025	337.720.000	1.028.257
Diageo Plc	17.404	506.033	iShares Physical Gold ETC	34.308	863.242
WisdomTree Physical Swiss Gold ETC	3.793	498.172	New Zealand Government Bond 4,500 % 15-Apr.-2027	1.214.000	750.037
Alibaba Group Holding Ltd ADR	2.511	411.511	Brazilian Government International Bond 4,875 % 22-Jan.-2021	877.000	689.980
Lennar Corp	8.043	390.675	iShares EUR High Yield Corp Bond UCITS ETF - ETF	7.320	564.729
ING Groep NV FRN (Perpetual) 4,875 % 16-Mai-2029	500.000	387.477	Xtrackers Physical Gold ETC	4.207	557.680
Hungary Government Bond 5,500 % 24-Jun.-2025	127.990.000	381.978	Anglo American Plc	25.700	528.158
Apple Inc	1.400	375.143	Cisco Systems Inc	16.378	452.581
Anglo American Plc	21.291	340.204	Australia Government Bond 3,000 % 21-März-2047	704.000	449.068
Alphabet Inc - A-Klasse	308	330.267	Australia Government Bond 3,250 % 21-Jun.-2039	572.000	361.770

BNY Mellon Global Real Return Fund (USD) für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten in USD	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse in USD
United States Treasury Note/Bond 2,500% 31-Mai-2020	26.800.000	26.883.563	United States Treasury Note/Bond 2,500% 31-Mai-2020	26.800.000	26.867.859
United States Treasury Note/Bond 2,250% 31-März-2020	21.000.000	21.034.453	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000% 23-Jan.-2020	22.514.800	22.512.974
iShares Physical Gold ETC	512.092	15.587.000	United States Treasury Note/Bond 2,250% 31-März-2020	21.000.000	21.012.877
United States Treasury Note/Bond 1,750% 31-Dez.-2026	14.606.400	14.605.351	Invesco Physical Gold ETC	134.618	20.943.057
Amundi Physical Gold ETC	209.767	13.601.309	United States Treasury Note/Bond 1,750% 31-Dez.-2026	14.606.400	15.336.718
iShares USD Corp Bond UCITS ETF - ETF	93.266	11.709.107	iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF - ETF	258.239	13.508.533
iShares JP Morgan EM Local Government Bond UCITS ETF - ETF	153.557	9.263.648	United States Treasury Note/Bond 3,375% 15-Nov.-2048	7.127.500	8.778.335
Invesco Physical Gold ETC	57.755	9.155.137	iShares J.P. Morgan USD EM Bond UCITS ETF - ETF	56.818	6.501.674
United States Treasury Note/Bond 2,750% 30-Sept.-2020	7.000.000	7.068.813	SPDR Bloomberg Barclays Emerging Markets Local Bond UCITS ETF - ETF	89.065	5.570.336
Xtrackers Physical Gold ETC	17.149	2.803.778	Canada Housing Trust No 1 '144A' 2,350% 15-Jun.-2027	7.005.000	5.505.597
WisdomTree Physical Swiss Gold ETC	16.058	2.642.167	Hungary Government Bond 5,500% 24-Jun.-2025	1.189.750.000	4.466.471
Australia Government Bond 3,250% 21-Jun.-2039	2.501.000	2.221.433	Brazilian Government International Bond 4,875% 22-Jan.-2021	3.930.000	4.043.970
Diageo Plc	61.833	2.189.303	Xtrackers Physical Gold ETC	15.365	2.552.908
Alibaba Group Holding Ltd ADR	8.665	1.809.176	iShares EUR High Yield Corp Bond UCITS ETF - ETF	24.963	2.525.988
Lennar Corp	25.499	1.619.260	New Zealand Government Bond 4,500% 15-Apr.-2027	3.264.000	2.509.773
Hungary Government Bond 5,500% 24-Jun.-2025	404.910.000	1.575.850	Anglo American Plc	81.795	2.212.333
Apple Inc	5.000	1.575.000	Cisco Systems Inc	52.984	1.838.375
Alphabet Inc - A-Klasse	1.041	1.423.251	Macquarie Korea Infrastructure Fund	173.607	1.650.184
Anglo American Plc	69.723	1.326.407	CMS Energy Corp	25.560	1.646.512
Amazon.com Inc	646	1.275.062	Barrick Gold Corp	63.525	1.415.186

BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten in USD	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse in USD
Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	299.162.708	299.162.708	Insight Liquidity Funds Plc - ILF USD Liquidity Fund	321.905.000	321.905.000
Altice Luxembourg SA 8,000% 15-Mai-2027	14.000.000	17.570.084	Altice Luxembourg SA 8,000% 15-Mai-2027	14.000.000	17.566.242
Ypso Finance Bis SA 8,000% 15-Mai-2027	14.000.000	17.566.242	Ypso Finance Bis SA 8,000% 15-Mai-2027	14.000.000	17.153.738
Altice France Holding SA '144A' 8,000% 15-Mai-2027	14.000.000	17.153.738	Virgin Media Receivables Financing Notes I DAC 5,500% 15-Sept.-2024	12.700.000	16.657.715
CITGO Petroleum Corp '144A' 7,000% 15-Jun.-2025	14.000.000	14.216.525	Aker BP ASA 6,000% 01-Jul.-2022	11.801.000	12.149.130
Altice Financing SA 'REGS' 2,250% 15-Jan.-2025	10.000.000	11.149.906	TransDigm Inc 6,500% 15-Mai-2025	13.000.000	11.915.000
Cogent Communications Group Inc 4,375% 30-Jun.-2024	10.000.000	10.871.376	UPCB Finance IV Ltd 5,375% 15-Jan.-2025	11.079.000	11.376.804
Infor US Inc 5,750% 15-Mai-2022	10.000.000	10.817.506	Infor US Inc 5,750% 15-Mai-2022	10.000.000	10.984.002
Nidda Healthcare Holding GmbH 'REGS' 3,500% 30-Sept.-2024	9.750.000	10.438.688	Altice Luxembourg SA 7,625% 15-Feb.-2025	10.500.000	10.900.365
Fire BC SpA 'REGS' FRN 4,750% 30-Sept.-2024	9.000.000	10.055.132	Citgo Holding Inc 9,250% 01-Aug.-2024	11.000.000	10.890.000
ZF North America Capital Inc 4,000% 29-Apr.-2020	10.000.000	9.962.500	VZ Vendor Financing BV 2,500% 31-Jan.-2024	9.000.000	10.114.676
Bausch Health Americas Inc '144A' 8,500% 31-Jan.-2027	8.500.000	9.670.000	ZF North America Capital Inc 4,000% 29-Apr.-2020	10.000.000	10.000.000
INEOS Group Holdings SA 'REGS' 5,375% 01-Aug.-2024	8.626.000	9.650.894	Tullow Oil Plc 'REGS' 6,250% 15-Apr.-2022	10.055.000	9.060.015
Synthomer Plc 'REGS' 3,875% 01-Jul.-2025	8.222.000	9.341.436	Marathon Petroleum Corp 4,500% 01-Mai-2023	8.699.000	8.998.111
APX Group Inc 7,625% 01-Sept.-2023	9.000.000	8.852.500	EVOCA SpA 'REGS' FRN 01-Nov.-2026	10.000.000	8.428.138
Parts Europe SA 'REGS' 4,375% 01-Mai-2022	8.000.000	8.735.840	Altice France SA/France 5,875% 01-Feb.-2027	7.000.000	8.324.855
Marathon Petroleum Corp 4,500% 01-Mai-2023	8.699.000	8.693.868	UPC Holding BV 5,500% 15-Jan.-2028	8.300.000	8.149.875
Explorer II AS 3,375% 24-Feb.-2025	7.400.000	8.231.956	Evrax PLC 8,250% 28-Jan.-2021	7.698.000	8.118.832
Summer BidCo BV 'REGS' 9,750% 15-Nov.-2025	6.816.875	8.154.513	CITGO Petroleum Corp '144A' 6,250% 15-Aug.-2022	8.000.000	8.010.000
Delphi Technologies PLC 5,000% 01-Okt.-2025	7.000.000	7.796.250	DNO ASA 8,750% 18-Jun.-2020	8.000.000	8.000.000

BNY Mellon Global Unconstrained Fund für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten in USD	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse in USD
United States Treasury Inflation Indexed Bonds 3,375 % 15-Apr.-2032	288.348	397.168	United States Treasury Note/Bond 3,000 % 15-Mai-2045	890.000	1.114.760
United States Treasury Note/Bond 2,375 % 15-Mai-2029	332.000	378.986	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,125 % 15-Apr.-2020	867.617	866.438
United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,500 % 15-Apr.-2024	378.622	378.886	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,750 % 15-Jul.-2028	449.257	454.140
Alibaba Group Holding Ltd ADR	1.575	315.058	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 2,500 % 31-Mai-2020	450.000	450.000
United States Treasury Note/Bond 1,500 % 15-Feb.-2030	280.000	303.931	Norway Government Bond '144A' 1,500 % 19-Feb.-2026	3.270.000	333.276
Royal Dutch Shell Plc	9.202	279.481	ABB Ltd	12.336	294.542
Amazon.com Inc	126	242.459	Royal Dutch Shell Plc	9.202	279.481
United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,750 % 15-Jul.-2028	223.727	242.253	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,500 % 15-Apr.-2024	242.783	246.589
Mastercard Inc	825	211.327	Suncor Energy Inc	8.318	143.213
Vivendi SA	10.040	211.048	M&G Plc	44.812	141.323
Goldman Sachs Group Inc/The	1.057	198.286	Deutsche Wohnen SE	4.043	130.156
Thales SA	1.771	190.533	Sony Corp	1.800	128.411
Ping An Insurance Group Co of China Ltd 'H'	15.500	179.692	Gilead Sciences Inc	1.812	126.445
Lennar Corp	2.860	179.067	Hungary Government Bond 2,500 % 24-Okt.-2024	34.900.000	111.607
Laureate Education Inc - A-Klasse	11.957	173.992	Japanese Government CPI Linked Bond 0,100 % 10-März-2028	11.525.028	111.507
Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	2.036	161.581	Apple Inc	334	105.397
Continental AG	1.678	161.408	Peruvian Government International Bond 'REGS' 5,700 % 12-Aug.-2024	334.000	105.288
Bureau Veritas SA	6.586	147.749	BAE Systems Plc	16.230	101.738
Alphabet Inc - A-Klasse	98	136.043	Peruvian Government International Bond 'REGS' 6,350 % 12-Aug.-2028	328.000	100.943
Kasikornbank PCL (Foreign Market)	28.700	131.007	Applied Materials Inc	1.424	88.256
Toll Brothers Inc	3.217	123.599	Mexican Bonos 8,000 % 07-Nov.-2047	2.000.000	86.134
Apple Inc	423	122.118	Greencoat UK Wind Plc/Funds	43.263	73.447
Medtronic Plc	1.357	118.801	Alia Group Ltd	7.400	66.610
SKYCITY Entertainment Group Ltd	67.133	112.104	Argentine Republic Government International Bond 6,875 % 22-Apr.-2021	150.000	63.188
Microsoft Corp	670	110.883	Samsung Electronics Co Ltd - Preference	1.837	61.676
United States Treasury Note/Bond 1,500 % 15-Aug.-2026	100.000	106.406			
iShares USD Short Duration Corp Bond UCITS ETF - ETF	1.014	104.032			
iShares USD Corp Bond UCITS ETF - ETF	839	103.985			
American Airlines Inc '144A' 11,750 % 15-Jul.-2025	100.000	99.000			
Brenntag AG	1.904	85.950			
United States Treasury Note/Bond 2,875 % 15-Mai-2043	60.000	80.763			
Merck & Co Inc	929	75.230			
Abbott Laboratories	822	61.854			

BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten in JPY	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse in JPY
m-up Holdings Inc	179.400	495.566.411	TechMatrix Corp	147.800	464.192.825
BrainPad Inc	83.300	485.652.435	Nichias Corp	156.400	413.457.031
Takeuchi Manufacturing Co Ltd	217.600	386.825.274	MCJ Co Ltd	487.100	362.161.319
Premium Group Co Ltd	110.800	201.166.677	Arata Corp	82.100	357.952.322
Vision Inc/Tokyo Japan	195.100	192.181.674	Nippon Gas Co Ltd	99.500	342.921.220
Insource Co Ltd	76.100	168.165.878	Tomy Co Ltd	294.200	252.762.533
Resorttrust Inc	113.400	139.989.771	BayCurrent Consulting Inc	34.200	244.337.797
Vector Inc	137.700	129.480.041	Open Door Inc	193.800	241.781.682
Dowa Holdings Co Ltd	33.200	104.909.051	Anicom Holdings Inc	59.000	222.300.924
Nifco Inc/Japan	44.400	101.754.120	Anritsu Corp	105.000	206.983.803
RS Technologies Co Ltd	42.200	99.884.088	Wacom Co Ltd	429.700	178.865.004
Sakata INX Corp	84.900	96.024.433	Zenkoku Hoshio Co Ltd	36.500	148.545.860
Anicom Holdings Inc	21.700	85.328.084	Sanken Electric Co Ltd	52.400	137.528.906
Yonex Co Ltd	130.000	82.162.940	Atrae Inc	47.400	123.238.628
Atrae Inc	21.800	66.291.296	Totetsu Kogyo Co Ltd	40.700	113.605.035
Zenkoku Hoshio Co Ltd	14.100	62.432.805	V-Cube Inc	172.000	110.196.294
Ain Holdings Inc	7.500	51.946.061	Insource Co Ltd	33.000	108.906.255
Arata Corp	8.900	41.951.194	Ain Holdings Inc	14.600	91.718.326
Nippon Gas Co Ltd	11.400	41.109.609	Sakata INX Corp	89.200	81.323.939
MCJ Co Ltd	52.200	40.784.377	Yonex Co Ltd	157.000	80.587.715
Sanken Electric Co Ltd	13.400	39.443.242	Nifco Inc/Japan	33.000	76.141.488
Anritsu Corp	16.700	35.264.325	Premium Group Co Ltd	42.700	69.850.008
Wacom Co Ltd	84.900	33.626.758	Dowa Holdings Co Ltd	20.900	66.807.389
			Vector Inc	68.000	62.277.782
			Resorttrust Inc	34.600	49.374.553

BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten in EUR	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse in EUR
Illumina Inc	49.900	12.140.012	Starbucks Corp	411.434	23.962.398
Texas Instruments Inc	120.500	11.252.430	Gilead Sciences Inc	195.175	12.519.728
Cognizant Technology Solutions Corp	197.900	11.201.689	Schlumberger Ltd	561.717	7.489.895
EOG Resources Inc	135.800	9.435.937	Johnson & Johnson	56.500	6.763.395
Colgate-Palmolive Co	111.600	7.126.534	Adobe Inc	20.200	6.654.767
SGS SA	3.146	6.661.732	Fastenal Co	197.600	6.147.168
Stryker Corp	27.600	5.646.045	CSL Ltd	35.833	5.614.105
Novartis AG	57.200	5.151.314	Cognizant Technology Solutions Corp	103.200	4.474.498
Jardine Matheson Holdings Ltd	94.300	5.068.069	Cerner Corp	74.900	4.382.736
Booking Holdings Inc	2.600	4.753.680	Novo Nordisk A/S	70.200	4.258.357
Cisco Systems Inc	107.100	4.616.053	Kone Oyj - B-Klasse	86.096	4.250.155
TJX Cos Inc/The	78.000	4.584.259	Roche Holding AG	12.271	3.958.815
Keyence Corp	14.100	4.502.428	Waters Corp	19.700	3.333.145
Linde Plc	23.000	4.339.494	Shin-Etsu Chemical Co Ltd	40.500	3.156.434
Intuitive Surgical Inc	8.800	4.229.216	Booking Holdings Inc	2.200	3.118.181
Walt Disney Co/The	43.300	4.197.291	TJX Cos Inc/The	66.100	3.093.229
Nestle SA	37.692	3.722.715	Oracle Corp	68.700	2.972.084
SAP SE	29.425	3.526.646	Experian Plc	91.127	2.760.101
Amphenol Corp - A-Klasse	37.100	3.490.298	L'Oreal SA	9.300	2.621.356
L'Oreal SA	12.750	3.350.049	FANUC Corp	15.500	2.543.151
Automatic Data Processing Inc	24.500	3.275.255	Reckitt Benckiser Group Plc	33.488	2.241.636
Alimentation Couche-Tard Inc - B-Klasse	109.600	3.019.257	Cognex Corp	47.400	1.948.363

BNY Mellon Mobility Innovation Fund für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten in USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse in USD
Yandex NV - A-Klasse	168.222	6.373.268	Yandex NV - A-Klasse	186.561	7.297.655
NVIDIA Corp	12.391	3.132.634	QUALCOMM Inc	64.466	4.543.073
Slack Technologies Inc	108.526	2.967.782	Keysight Technologies Inc	31.265	2.991.087
Splunk Inc	15.757	2.590.751	Xilinx Inc	34.456	2.959.063
ANSYS Inc	9.438	2.568.949	Tesla Inc	3.563	2.540.514
Aptiv Plc	35.460	2.436.904	Suzuki Motor Corp	56.000	1.975.394
Alphabet Inc	1.752	2.397.111	Delta Electronics Inc	422.000	1.965.587
NXP Semiconductors NV	20.081	2.162.664	Prismian SpA	102.558	1.951.026
Nikola Corp	55.630	1.976.570	ANSYS Inc	6.345	1.720.564
Visteon Corp	30.969	1.957.545	MediaTek Inc	124.000	1.692.687
Daimler AG	46.532	1.841.565	Corning Inc	57.187	1.637.099
ABB Ltd	87.195	1.827.777	FleetCor Technologies Inc	6.998	1.385.587
STMicroelectronics NV	63.686	1.775.848	Hino Motors Ltd	170.100	1.021.892
Rockwell Automation Inc	8.858	1.752.950	Cubic Corp	25.881	974.007
Schneider Electric SE	22.517	1.749.889	Continental AG	10.021	959.965
Roper Technologies Inc	4.627	1.736.110	TE Connectivity Ltd	9.976	940.136
MediaTek Inc	119.000	1.727.154	Nikola Corp	10.031	682.641
Samsung SDI Co Ltd	6.520	1.702.839	Amphenol Corp - A-Klasse	6.384	660.634
KION Group AG	33.560	1.628.672	Mitsubishi Electric Corp	49.500	642.257
Hubbell Inc - B-Klasse	11.039	1.430.764	Hella GmbH & Co KGaA	20.072	463.743
Twilio Inc - A-Klasse	10.643	1.430.679			
QUALCOMM Inc	14.650	1.303.366			
Infineon Technologies AG	61.440	1.248.666			
Lumentum Holdings Inc	14.727	1.179.947			
Taiyo Yuden Co Ltd	37.900	1.170.866			
FLIR Systems Inc	22.800	1.119.327			
ON Semiconductor Corp	50.593	1.085.631			
Denso Corp	26.300	1.074.920			
Landis+Gyr Group AG	13.391	1.020.644			
Tesla Inc	1.521	1.006.973			
Mitsubishi Electric Corp	69.300	957.761			
Diodes Inc	16.920	895.272			
BorgWarner Inc	24.615	879.701			
Semtech Corp	16.477	841.875			
Guangzhou Automobile Group Co Ltd 'H'	782.000	829.285			
Everbridge Inc	8.002	816.953			
Skyworks Solutions Inc	6.790	810.076			
NextEra Energy Inc	2.995	757.031			

BNY Mellon S&P 500® Index Tracker für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten in USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse in USD
Microsoft Corp	428	70.867	Microsoft Corp	5.241	909.580
Amazon.com Inc	31	68.905	Apple Inc	2.965	876.783
Apple Inc	232	66.353	Amazon.com Inc	287	639.583
DexCom Inc	122	51.353	Facebook Inc - A-Klasse	1.667	324.572
United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000% 25-Feb.-2021	36.000	35.956	Alphabet Inc	210	279.538
T-Mobile US Inc	349	35.321	Johnson & Johnson	1.842	273.945
Facebook Inc - A-Klasse	166	31.725	Alphabet Inc - A-Klasse	205	271.962
Johnson & Johnson	207	29.250	Berkshire Hathaway Inc - B-Klasse	1.367	270.074
United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000% 18-Jun.-2020	29.000	28.973	JPMorgan Chase & Co	2.290	240.996
Paycom Software Inc	86	26.773	Visa Inc - A-Klasse	1.189	214.909
BlackRock Inc	52	26.216	Procter & Gamble Co/The	1.747	209.448
Berkshire Hathaway Inc - B-Klasse	134	25.589	UnitedHealth Group Inc	649	187.542
Alphabet Inc - A-Klasse	19	24.498	Intel Corp	3.093	185.515
JPMorgan Chase & Co	222	22.406	Mastercard Inc	606	170.622
Alphabet Inc	17	21.604	Home Depot Inc/The	767	169.855
West Pharmaceutical Services Inc	99	20.840	AT&T Inc	5.166	169.378
Procter & Gamble Co/The	172	20.067	Verizon Communications Inc	2.835	163.886
Domino's Pizza Inc	51	19.252	Bank of America Corp	5.937	155.152
Walt Disney Co/The	161	18.600	Walt Disney Co/The	1.278	148.103
UnitedHealth Group Inc	62	17.643	Merck & Co Inc	1.775	147.341
Regeneron Pharmaceuticals Inc	32	17.168			
Visa Inc - A-Klasse	93	16.571			
Tyler Technologies Inc	48	15.994			
Prologis Inc (REIT)	174	15.952			
Pfizer Inc	437	15.526			
Verizon Communications Inc	265	15.013			

BNY Mellon Small Cap Euroland Fund für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten in EUR	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse in EUR
Klepierre SA (REIT)	31.706	769.242	HelloFresh SE	45.177	1.428.312
Iren SpA	259.015	739.486	BE Semiconductor Industries NV	39.745	1.405.181
Bechtle AG	4.553	715.483	Koninklijke Vopak NV	18.304	902.442
Iliad SA	3.989	628.571	Sartorius AG - Preference	2.847	775.550
Bekaert SA	23.369	602.062	Royal Unibrew A/S	9.585	774.244
Arcadis NV	32.467	581.038	Sixt SE	10.001	752.102
Unicaja Banco SA '144A'	859.401	577.819	Stroeer SE & Co KGaA	9.531	635.959
CGG SA	159.771	466.611	Cramo Oyj	43.339	595.911
Dialog Semiconductor Plc	9.559	460.248	Talanx AG	13.052	562.834
Buzzi Unicem SpA	16.831	367.547	Siltronic AG	6.406	560.480
DWS Group GmbH & Co KGaA '144A'	7.396	242.094	Euskaltel SA '144A'	70.731	559.656
Schaeffler AG - Preference	29.466	207.671	Maire Tecnimont SpA	218.442	541.038
Die vorstehenden Angaben entsprechen den vollständigen Kaufangaben für den Fonds im Berichtszeitraum.			GN Store Nord A/S	10.934	477.620
			Euronext NV '144A'	6.074	465.243
			Covivio (REIT)	4.952	456.013
			K+S AG	42.807	441.643
			Teleperformance	1.817	397.994
			Korian SA	10.209	397.729
			OCI NV	21.804	381.346
			Eurofins Scientific SE	798	379.973
			TietoEVRY Oyj	13.930	367.364
			Valmet Oyj	17.524	363.457
			Unipol Gruppo SpA	80.037	344.108
			Edenred	7.467	339.898
			Sopra Steria Group	2.454	336.663
			Anima Holding SpA '144A'	85.073	336.104
			Cie Plastic Omnium SA	16.141	334.038
			Signify NV '144A'	12.604	330.126
			Eiffage SA	3.479	329.861
			Brenntag AG	6.946	308.489
			D'ietzen SA/NV	5.205	283.263
			Immobiliare Grande Distribuzione SIIQ SpA (REIT)	51.831	276.808
			ICON Plc	1.888	276.261
			Cewe Stiftung & Co KGaA	2.751	276.190
			Rheinmetall AG	3.031	265.718
			Cofinimmo SA (REIT)	1.915	264.357
			Nexity SA	6.416	257.382
			Acciona SA	2.467	250.261
			Kemira Oyj	19.036	230.386

BNY Mellon Sustainable Global Dynamic Bond Fund für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten in EUR	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse in EUR
United States Treasury Note/Bond 1,500 % 15-Aug.-2026	10.480.000	9.692.661	Japan Government Two Year Bond 0,100% 01-Jun.-2021	1.269.850.000	10.628.567
United States Treasury Note/Bond 1,500 % 15-Feb.-2030	9.195.000	9.094.421	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,750 % 15-Jul.-2028	9.518.276	9.597.629
United States Treasury Floating Rate Note FRN 1,665 % 31-Jan.-2022	9.810.000	8.924.214	United States Treasury Note/Bond 1,500 % 15-Aug.-2026	9.410.000	9.054.455
United States Treasury Note/Bond 3,000 % 15-Nov.-2045	4.700.000	5.193.067	United States Treasury Floating Rate Note FRN 1,312 % 31-Jan.-2022	9.810.000	8.716.303
United States Treasury Note/Bond 2,375 % 15-Mai-2029	5.130.000	5.160.645	United States Treasury Note/Bond 1,125 % 30-Sept.-2021	8.590.000	7.730.754
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 1,850 % 01-Jul.-2025	4.673.000	4.705.717	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 4,500 % 01-März-2024	5.580.000	6.213.161
Japan Government Two Year Bond 0,100 % 01-Apr.-2022	543.000.000	4.697.314	United States Treasury Note/Bond 3,000 % 15-Nov.-2045	4.700.000	5.389.434
United Kingdom Gilt Inflation Linked 0,125 % 22-März-2026	3.217.492	4.385.727	United States Treasury Note/Bond 2,375 % 15-Mai-2029	5.130.000	5.136.655
United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,750 % 15-Jul.-2028	4.074.782	3.949.266	United Kingdom Gilt Inflation Linked 0,125 % 22-März-2026	3.217.492	4.243.506
United States Treasury Note/Bond 0,500 % 15-März-2023	4.100.000	3.729.677	Hungary Government Bond 2,500 % 24-Okt.-2024	1.426.840.000	4.221.393
Japan Government Two Year Bond 0,100 % 01-Jun.-2021	447.250.000	3.696.311	United States Treasury Note/Bond 0,500 % 15-März-2023	4.100.000	3.654.158
Colombia Government International Bond 'REGS' 6,000 % 28-Apr.-2028	11.978.500.000	3.300.305	Canada Housing Trust No 1 '144A' 1,250 % 15-Jun.-2021	4.760.000	3.223.762
International Bank for Reconstruction & Development 1,625 % 15-Jan.-2025	3.670.000	3.281.958	Australia Government Bond 5,750 % 15-Mai-2021	4.980.000	2.909.421
Spain Government Bond '144A' 5,150 % 31-Okt.-2028	2.300.000	3.215.644	United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,500 % 15-Apr.-2024	3.098.271	2.900.388
Malaysia Government Bond 3,906 % 15-Jul.-2026	13.735.000	3.066.524	Canada Housing Trust No 1 '144A' 2,650 % 15-März-2028	3.890.000	2.865.816
Canada Housing Trust No 1 '144A' 2,350 % 15-Sept.-2023	4.210.000	2.925.512	United States Treasury Floating Rate Note FRN 1,641 % 31-Jan.-2021	3.160.000	2.839.735
Treasury Corp of Victoria 1,000 % 20-Nov.-2023	4.790.000	2.850.227	New Zealand Local Government Funding Agency Bond 4,500 % 15-Apr.-2027	3.870.000	2.658.587
Mexican Bonos 8,500 % 31-Mai-2029	51.480.000	2.791.642	Banco Santander SA FRN (Perpetual) 5,250 % 29-Sept.-2023	2.400.000	2.486.350
Peruvian Government International Bond 'REGS' 8,200 % 12-Aug.-2026	7.400.000	2.564.030	German Postal Pensions Securitisation Plc 3,750 % 18-Jan.-2021	2.300.000	2.353.199
Canada Housing Trust No 1 '144A' 2,100 % 15-Sept.-2029	3.530.000	2.490.019	Inter-American Development Bank 'GMTN' 3,875 % 28-Okt.-2041	1.867.000	2.332.898
International Bank for Reconstruction & Development FRN 0,471 % 17-Jun.-2024	2.790.000	2.473.293	Peruvian Government International Bond 2,392 % 23-Jan.-2026	2.450.000	2.302.255
Paraguay Government International Bond 'REGS' 5,000 % 15-Apr.-2026	2.390.000	2.356.672	Australia Government Bond 3,000 % 21-März-2047	2.980.000	2.246.501
United States Treasury Inflation Indexed Bonds 0,500 % 15-Apr.-2024	2.510.005	2.318.122	Ireland Government Bond 1,100 % 15-Mai-2029	2.050.000	2.233.865
Ireland Government Bond 1,100 % 15-Mai-2029	2.050.000	2.300.577	New South Wales Treasury Corp 3,000 % 20-März-2028	3.200.000	2.218.062
JPMorgan Chase & Co FRN 2,083 % 22-Apr.-2026	2.500.000	2.292.000	United States Treasury Note/Bond 2,875 % 15-Mai-2043	1.900.000	2.201.808
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 6,500 % 01-Nov.-2027	1.600.000	2.287.968	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 6,500 % 01-Nov.-2027	1.600.000	2.179.025
Peruvian Government International Bond 2,392 % 23-Jan.-2026	2.450.000	2.283.198	UBS Group AG FRN (Perpetual) 7,125 % 29-Dez.-2049	2.330.000	2.159.006
Singapore Government Bond 2,250 % 01-Jun.-2021	3.460.000	2.263.650	United States Treasury Note/Bond 1,500 % 15-Feb.-2030 15-Feb.-2030	2.205.000	2.099.189
Czech Republic Government Bond 1,250 % 14-Feb.-2025	59.930.000	2.259.277	Skandinaviska Enskilda Banken AB 'EMTN' 1,500 % 25-Feb.-2020	1.960.000	1.960.000
New South Wales Treasury Corp 3,000 % 20-März-2028	3.200.000	2.230.110	Georgia Government International Bond 'REGS' 6,875 % 12-Apr.-2021	1.960.000	1.908.004
United States Treasury Note/Bond 2,875 % 15-Mai-2043	1.900.000	2.229.655	Export-Import Bank of Korea FRN 1,866 % 25-Jan.-2022	2.110.000	1.878.747
International Bank for Reconstruction & Development 'GMTN' 0,500 % 24-Jul.-2023	1.940.000	2.220.660	Clarion Funding PLC 'EMTN' 1,875 % 22-Jan.-2035	1.546.000	1.877.782
United States Treasury Note/Bond 2,000 % 15-Feb.-2050	2.250.000	2.193.979	European Investment Bank FRN 1,040 % 17-Feb.-2020	1.480.000	1.761.213
JCDecaux SA 2,000 % 24-Okt.-2024	2.200.000	2.191.170			
UBS Group AG FRN (Perpetual) 5,000 % 31-Jan.-2023	2.300.000	2.156.746			
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1,500 % 15-Jun.-2021	2.280.000	2.152.789			

BNY Mellon Sustainable Global Real Return Fund (EUR)* für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten in EUR	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse in EUR
iShares Physical Gold ETC	46.870	1.309.270	United States Treasury Note/Bond 1,750% 31-Dez.-2026	1.315.700	1.267.620
Invesco Physical Gold ETC	9.440	1.307.718	Hungary Government Bond 1,500% 24-Aug.-2022	430.000.000	1.211.168
Hungary Government Bond 1,500% 24-Aug.-2022	430.000.000	1.294.957	Canada Housing Trust No 1 '144A' 2,350% 15-Jun.-2027	660.000	473.081
United States Treasury Note/Bond 1,750% 31-Dez.-2026	1.315.700	1.213.584	Xtrackers Physical Gold ETC	2.726	404.237
Amundi Physical Gold ETC	19.534	1.156.598	Invesco Physical Gold ETC	2.555	361.519
Xtrackers Physical Gold ETC	4.320	656.558	Hungary Government Bond 5,500% 24-Jun.-2025	97.820.000	331.128
Greencoat UK Wind Plc/Funds	338.060	578.551	New Zealand Government Bond 4,500% 15-Apr.-2027	321.000	225.139
Renewables Infrastructure Group Ltd/The	310.593	502.756	European Bank for Reconstruction & Development 'GMTN'		
Australia Government Bond 3,000% 21-März-2047	624.000	493.227	6,450% 13-Dez.-2022	3.475.600.000	189.428
Canada Housing Trust No 1 '144A' 2,350% 15-Jun.-2027	660.000	472.222	Morocco Government International Bond 'REGS' 4,250% 11-Dez.-2022	200.000	178.787
Microsoft Corp	2.766	462.680	Costa Rica Government International Bond 'REGS' 4,250% 26-Jan.-2023	200.000	163.071
Australia Government Bond 3,250% 21-Jun.-2039	574.000	461.241	Cisco Systems Inc	4.987	155.174
AIA Group Ltd	45.200	424.030	Microsoft Corp	925	150.318
SAP SE	2.903	355.321	Australia Government Bond 3,000% 21-März-2047	205.000	137.902
Hungary Government Bond 5,500% 24-Jun.-2025	97.820.000	354.279	Banco Santander SA FRN (Perpetual) 4,750% 19-Jun.-2169	200.000	126.000
Sdcl Energy Efficiency Income Trust Plc	269.242	348.648	Peruvian Government International Bond 'REGS' 5,700% 12-Aug.-2024	410.000	120.044
Prudential Plc	20.720	334.556	Samsung SDI Co Ltd	469	115.363
Zurich Insurance Group AG	909	323.076	iShares Physical Gold ETC	4.225	113.665
Alibaba Group Holding Ltd ADR	1.596	315.968	Malaysia Government Bond 3,906% 15-Jul.-2026	503.000	107.774
Goldman Sachs Group Inc/The	1.467	295.367	InterXion Holding NV 'REGS' 4,750% 15-Jun.-2025	100.000	107.628
			Swedbank AB	10.560	107.180
			Peruvian Government International Bond 'REGS' 6,350% 12-Aug.-2028	353.000	96.169
			Ferguson Plc	1.551	94.860
			Clicks Group Ltd	7.857	89.280
			Hungary Government Bond 3,000% 21-Aug.-2030	29.310.000	83.608

* Siehe Erläuterung 18 zum Halbjahresabschluss.

BNY Mellon Targeted Return Bond Fund für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten in USD	Wichtige Verkäufe und Fälligkeiten	Nominal	Erlöse in USD
United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000% 31-März-2020	8.300.000	8.282.670	United States Treasury Note/Bond 2,875% 30-Nov.-2023	8.350.000	9.062.016
United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000% 07-Apr.-2020	8.250.000	8.246.391	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000% 31-März-2020	8.300.000	8.300.000
United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000% 11-Feb.-2020	8.200.000	8.190.497	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000% 07-Apr.-2020	8.250.000	8.250.000
United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000% 10-März-2020	8.200.000	8.190.201	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000% 14-Jan.-2020	8.200.000	8.200.000
United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000% 21-Apr.-2020	8.000.000	7.981.580	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000% 11-Feb.-2020	8.200.000	8.200.000
United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000% 09-Apr.-2020	7.500.000	7.477.688	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000% 10-März-2020	8.200.000	8.200.000
United States Treasury Note/Bond 1,125% 28-Feb.-2025	7.025.000	7.249.561	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000% 30-Jan.-2020	8.000.000	8.000.000
Bundesobligation (Null-Coupon) 0,000% 05-Apr.-2024	3.600.000	4.005.540	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000% 27-Feb.-2020	8.000.000	8.000.000
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro '144A' 1,650% 01-Dez.-2030	2.125.000	2.369.106	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000% 21-Apr.-2020	8.000.000	8.000.000
United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000% 30-Jul.-2020	1.880.000	1.879.505	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000% 18-Feb.-2020	7.600.000	7.600.000
United States Treasury Note/Bond 1,125% 28-Feb.-2027	1.600.000	1.645.188	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000% 09-Apr.-2020	7.500.000	7.500.000
United States Treasury FRN 0,193% 31-Jul.-2020	1.375.000	1.375.017	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000% 04-Feb.-2020	7.200.000	7.200.000
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 2,500% 15-Aug.-2046	675.000	1.259.164	United States Treasury FRN 1,536% 31-Jan.-2020	3.825.000	3.825.000
Repsol International Finance BV 'EMTN' 2,625% 15-Apr.-2030	1.100.000	1.186.930	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,000% 01-Aug.-2029	1.875.000	2.371.682
Portugal Obrigações do Tesouro OT '144A' 3,875% 15-Feb.-2030	625.000	946.480	United States Treasury Note/Bond 1,125% 28-Feb.-2025	1.025.000	1.064.959
Spain Government Bond '144A' 0,600% 31-Okt.-2029	750.000	870.218	Fannie Mae Pool 2,500% 01-Sept.-2028	800.958	801.896
Lloyds Bank Corporate Markets Plc 'EMTN' 2,375% 09-Apr.-2026	725.000	786.471	United States Treasury Bill (Null-Coupon) 0,000% 16-Apr.-2020	640.000	640.001
Airbus SE 2,000% 07-Apr.-2028	675.000	736.267	Fannie Mae Pool 3,000% 01-Dez.-2049	449.352	465.779
Brazilian Government International Bond 3,875% 12-Jun.-2030	675.000	668.095	Senegal Government International Bond 'REGS' 4,750% 13-März-2028	500.000	464.080
Barclays Plc 'EMTN' FRN 3,375% 02-Apr.-2025	575.000	628.042	TJX Cos Inc/The 3,500% 15-Apr.-2025	400.000	431.398

BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten in USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse in USD
iShares Russell 1000 Value ETF - ETF	10.198	1.208.610	iShares Russell 1000 Value ETF - ETF	12.317	1.433.138
Intel Corp	13.909	884.432	AT&T Inc	15.132	568.852
Eaton Corp Plc	6.457	574.266	Edison International	6.738	481.402
Las Vegas Sands Corp	8.797	505.059	Martin Marietta Materials Inc	2.352	455.899
AbbVie Inc	5.654	497.339	Bank of America Corp	16.095	446.739
PPL Corp	16.798	480.544	E*TRADE Financial Corp	9.230	442.598
JPMorgan Chase & Co	3.859	420.607	US Bancorp	7.350	422.956
Goldman Sachs Group Inc/The	2.131	384.887	Pfizer Inc	11.030	417.737
Cisco Systems Inc	8.025	360.505	Newmont Corp	7.512	395.026
CF Industries Holdings Inc	10.782	358.629	Colgate-Palmolive Co	5.546	385.369
Lowe's Cos Inc	3.255	350.652	ConocoPhillips	6.720	384.880
State Street Corp	4.733	340.302	QUALCOMM Inc	4.432	364.918
Alphabet Inc - A-Klasse	249	340.149	Citigroup Inc	4.645	346.687
Becton Dickinson and Co	1.391	338.688	Broadcom Inc	1.164	325.074
Philip Morris International Inc	3.916	338.023	Alphabet Inc - A-Klasse	254	323.914
Morgan Stanley	7.457	329.025	Conagra Brands Inc	9.906	289.699
Union Pacific Corp	1.823	312.531	Honeywell International Inc	1.529	272.843
Louisiana-Pacific Corp	12.176	312.288	Hartford Financial Services Group Inc/The	4.512	267.154
Bristol-Myers Squibb Co	4.885	301.162	Merck & Co Inc	3.195	262.497
Proofpoint Inc	2.395	290.765	Western Digital Corp	4.870	238.299
Freeport-McMoRan Inc	31.153	283.482	Lennar Corp	3.327	224.640
NextEra Energy Partners LP (Units)	5.562	277.982	Cigna Corp	1.170	214.871
Eli Lilly and Co	1.855	273.566	Comcast Corp	4.880	214.804
Mondelez International Inc	5.582	273.317	CVS Health Corp	3.200	200.166
Alcon Inc	4.461	265.332	Gilead Sciences Inc	2.502	190.441
ConocoPhillips	6.816	259.951	Delta Air Lines Inc	8.352	180.058
Laboratory Corp of America Holdings	1.454	251.688	PepsiCo Inc	1.256	175.156
Centene Corp	3.765	244.690	American International Group Inc	5.090	167.562
Berkshire Hathaway Inc - B-Klasse	1.108	237.637	Concho Resources Inc	2.934	166.824
Hess Corp	4.726	227.338	Kellogg Co	2.793	163.092
Omnicom Group Inc	3.177	224.698	Willis Towers Watson Plc	874	163.083
NXP Semiconductors NV	1.874	220.496	Microchip Technology Inc	1.843	155.976
Western Digital Corp	4.229	220.280	Marathon Petroleum Corp	3.707	155.471
Weyerhaeuser Co (REIT)	7.585	214.119	Texas Instruments Inc	1.146	149.042
Lennar Corp	4.126	211.423	Hess Corp	3.086	145.744
Marathon Petroleum Corp	5.334	210.989	Raytheon Technologies Corp	2.500	139.761
Zebra Technologies Corp	902	203.032	Raymond James Financial Inc	1.531	139.314
Dolby Laboratories Inc - A-Klasse	3.265	197.877	Omnicom Group Inc	1.736	136.851
Kellogg Co	2.793	188.195	Valero Energy Corp	1.436	134.578

BNY Mellon U.S. Equity Income Fund für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten in USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse in USD
AbbVie Inc	137.814	12.129.353	AT&T Inc	286.483	9.785.105
Intel Corp	144.837	9.206.641	Merck & Co Inc	116.256	9.733.536
CF Industries Holdings Inc	184.185	6.845.790	Pfizer Inc	224.282	8.534.224
Western Digital Corp	119.114	6.817.809	Becton Dickinson and Co	29.727	7.339.130
Bristol-Myers Squibb Co	104.768	6.644.904	Edison International	85.898	6.095.030
Becton Dickinson and Co - Preferred Stock 6,000 % 01-Jun.-2023	122.394	6.221.291	Nutrien Ltd	135.513	5.651.175
Las Vegas Sands Corp	83.640	5.622.187	Citigroup Inc	81.222	5.283.499
SPDR S&P 500 ETF Trust - ETF	17.906	5.431.815	QUALCOMM Inc	62.068	5.237.832
Eaton Corp Plc	53.657	4.991.013	Western Digital Corp	119.114	5.130.179
International Business Machines Corp	30.021	4.288.232	Raytheon Technologies Corp	88.591	4.904.177
L3Harris Technologies Inc	23.195	4.200.781	Exxon Mobil Corp	69.192	4.584.961
Philip Morris International Inc	47.031	4.193.604	Conagra Brands Inc	148.674	4.199.095
State Street Corp	50.243	3.914.092	PepsiCo Inc	29.331	4.181.214
Gilead Sciences Inc	45.069	3.112.731	JPMorgan Chase & Co	38.017	4.110.327
JPMorgan Chase & Co	24.748	3.056.793	Comcast Corp	89.335	3.932.285
Louisiana-Pacific Corp	135.932	2.997.135	US Bancorp	91.185	3.838.250
Vodafone Group Plc ADR	166.204	2.904.731	Bank of America Corp	136.359	3.672.456
Goldman Sachs Group Inc/The	16.591	2.887.283	Target Corp	32.061	3.664.232
Lowe's Cos Inc	33.552	2.649.621	Lamar Advertising Co (REIT) - A-Klasse	37.984	3.544.931
General Motors Co	73.829	2.560.702	Gilead Sciences Inc	45.069	3.474.639
NextEra Energy Partners LP (Units)	54.313	2.383.192	Outfront Media Inc (REIT)	214.036	3.040.951
Union Pacific Corp	12.969	2.319.191	Texas Instruments Inc	23.051	2.997.880
Hess Corp	39.633	2.305.532	Capital One Financial Corp	48.493	2.969.769
Lamar Advertising Co (REIT) - A-Klasse	30.521	2.084.922	Weyerhaeuser Co (REIT)	143.798	2.908.745
Delta Air Lines Inc	31.970	1.736.624	Delta Air Lines Inc	120.787	2.875.496
Cisco Systems Inc	40.518	1.704.593	Schlumberger Ltd	180.810	2.844.838
PPL Corp	64.624	1.696.610	PPL Corp	107.606	2.759.981
Citigroup Inc	25.135	1.600.329	Applied Materials Inc	46.640	2.718.559
Morgan Stanley	33.552	1.584.529	SPDR S&P 500 ETF Trust - ETF	8.870	2.671.679
			Goldman Sachs Group Inc/The	13.737	2.647.100
			Medtronic Plc	27.266	2.451.974
			Vulcan Materials Co	18.602	2.274.034
			Morgan Stanley	44.960	1.755.886

BNY Mellon U.S. Municipal Infrastructure Debt Fund für den Berichtszeitraum zum 30. Juni 2020

Wichtige Käufe	Nominal	Kosten in USD	Wichtige Verkäufe	Nominal	Erlöse in USD
Central Texas Turnpike System 3,029 % 15-Aug.-2041	10.000.000	10.000.000	New York City Water & Sewer System 0,370 % 15-Jun.-2033	13.280.000	13.280.000
Illinois Finance Authority 4,000 % 01-Apr.-2050	8.500.000	9.593.185	Triborough Bridge & Tunnel Authority 0,460 % 01-Nov.-2032	11.090.000	11.090.000
Pennsylvania Turnpike Commission 3,416 % 01-Dez.-2041	9.000.000	9.275.400	Geisinger Authority 0,840 % 15-Mai-2035	8.000.000	8.000.000
Providence Public Building Authority 5,000 % 15-Sept.-2039	7.395.000	8.666.127	New York City Water & Sewer System 4,900 % 15-Jun.-2044	7.660.000	7.660.000
New York City Water & Sewer System 5,650 % 15-Jun.-2044	7.660.000	7.660.000	CommonSpirit Health 3,347 % 01-Okt.-2029	6.650.000	6.487.275
State of California 5,250 % 01-Aug.-2032	5.000.000	6.831.400	Toledo Hospital/The 5,325 % 15-Nov.-2028	5.000.000	5.643.450
Oklahoma Development Finance Authority 5,450 % 15-Aug.-2028	4.925.000	5.575.051	New Jersey Health Care Facilities Financing Authority 0,400 % 01-Jul.-2043	5.100.000	5.100.000
New Jersey Health Care Facilities Financing Authority 0,750 % 01-Jul.-2043	5.100.000	5.100.000	City of Houston TX Combined Utility System Revenue 2,505 % 15-Nov.-2032	5.000.000	5.043.200
Sycamore Community City School District 4,000 % 01-Dez.-2029	4.080.000	4.950.427	City of Houston TX Combined Utility System Revenue 2,984 % 15-Nov.-2042	4.000.000	4.096.760
New York State Thruway Authority 4,000 % 01-Jan.-2045	5.000.000	4.839.250	Metropolitan Washington Airports Authority Dulles Toll Road Revenue 4,000 % 01-Okt.-2053	3.500.000	3.111.255
Pennsylvania Turnpike Commission 2,890 % 01-Dez.-2035	4.500.000	4.577.085	Nebraska Public Power District 2,493 % 01-Jan.-2027	2.750.000	2.775.080
Pasco County School Board 5,000 % 01-Aug.-2035	3.500.000	4.514.345	Arizona Health Facilities Authority 1,250 % 01-Jan.-2046	2.700.000	2.700.000
Adventist Health System/West 2,952 % 01-März-2029	4.500.000	4.497.120	New York Transportation Development Corp 5,000 % 01-Jul.-2046	2.500.000	2.515.675
Geisinger Authority 5,000 % 01-Apr.-2043	3.500.000	4.248.510	Triborough Bridge & Tunnel Authority 1,100 % 01-Jan.-2032	2.500.000	2.500.000
Black Belt Energy Gas District 4,000 % 01-Okt.-2049	3.470.000	4.041.301	Ohio Water Development Authority 4,817 % 01-Dez.-2030	2.000.000	2.403.120
Sycamore Community City School District 4,000 % 01-Dez.-2028	3.270.000	3.952.645	City of New York NY 0,550 % 01-Apr.-2042	2.305.000	2.305.000
Onondaga Civic Development Corp 5,000 % 01-Dez.-2029	2.870.000	3.870.855	New Jersey Health Care Facilities Financing Authority 1,500 % 01-Jul.-2043	2.275.000	2.275.000
Metropolitan Washington Airports Authority Dulles Toll Road Revenue 4,000 % 01-Okt.-2053	3.500.000	3.467.975	Lower Alabama Gas District/The 4,000 % 01-Dez.-2050	2.245.000	2.164.539
Metropolitan Washington Airports Authority Dulles Toll Road Revenue 4,000 % 01-Okt.-2049	3.500.000	3.162.810	South Carolina Educational Facilities Authority 0,680 % 01-Okt.-2039	2.105.000	2.105.000
Grand Parkway Transportation Corp 4,000 % 01-Okt.-2049	2.500.000	2.863.875	State of Wisconsin 1,799 % 01-Mai-2024	2.000.000	2.037.580
Arizona Health Facilities Authority 1,250 % 01-Jan.-2046	2.700.000	2.700.000	University of California 3,553 % 15-Mai-2024	1.610.000	1.747.832
New York Transportation Development Corp 5,250 % 01-Jan.-2050	2.500.000	2.537.750	City of New York NY 0,850 % 01-Okt.-2046	1.610.000	1.610.000
Lower Alabama Gas District/The 4,000 % 01-Dez.-2050	2.245.000	2.531.462	New York City Water & Sewer System 6,491 % 15-Jun.-2042	1.500.000	1.508.490
City of Philadelphia PA 2,864 % 15-Jul.-2031	2.500.000	2.500.000	State of Connecticut 2,150 % 15-Aug.-2023	1.180.000	1.204.237
Montefiore Obligated Group 4,287 % 01-Sept.-2050	2.500.000	2.500.000			
Triborough Bridge & Tunnel Authority 1,100 % 01-Jan.-2032	2.500.000	2.500.000			
University of Southern California 3,226 % 01-Okt.-2120	2.500.000	2.500.000			
City of New York NY 0,060 % 01-Apr.-2042	2.305.000	2.305.000			
New Jersey Health Care Facilities Financing Authority 1,500 % 01-Jul.-2043	2.275.000	2.275.000			
New York State Urban Development Corp 5,000 % 15-März-2036	1.750.000	2.274.475			
Tennessee Energy Acquisition Corp 4,000 % 01-Nov.-2049	2.245.000	2.168.378			
New Jersey Economic Development Authority 3,620 % 15-Jun.-2028	2.110.000	2.133.716			
South Carolina Educational Facilities Authority 5,530 % 01-Okt.-2039	2.105.000	2.105.000			
Red River Education Finance Corp 2,802 % 15-März-2033	2.000.000	2.000.000			
Sales Tax Securitization Corp 2,225 % 01-Jan.-2024	2.000.000	2.000.000			
State of Wisconsin 1,799 % 01-Mai-2024	2.000.000	2.000.000			
Red River Education Finance Corp 2,892 % 15-März-2034	1.775.000	1.775.000			
City of New York NY 1,120 % 01-Okt.-2046	1.610.000	1.610.000			

ANHANG 1

OFFENLEGUNGEN GEMÄSS DER VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ VON WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN („SFTR“)

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE

Die Gesellschaft hat am 27. November 2015 mit der The Bank of New York Mellon, Niederlassung London (der „Verleiher“) eine Wertpapierleihvereinbarung (in der geänderten, abgetretenen, erneuerten und angenommenen Fassung) geschlossen.

In der nachfolgenden Tabelle sind der Gesamtwert der verliehenen Wertpapiere nach Fonds als Anteil der verleihbaren Vermögenswerte insgesamt sowie der Nettoinventarwert jedes Fonds per 30. Juni 2020 angegeben:

Fonds	Währung	Gesamtwert der verliehenen Wertpapiere	% der Summe der beleihbaren Vermögenswerte	% des Nettoinventarwerts
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	EUR	18.113.812	7,66	5,72
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund	GBP	26.295.115	27,36	9,67
BNY Mellon Asia Rising Stars Fund	USD	240.984	4,33	3,29
BNY Mellon Asian Equity Fund	USD	713.934	10,22	1,85
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	USD	9.895.403	2,69	2,44
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	USD	2.436.639	0,27	0,27
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund	USD	29.870.586	12,79	9,68
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	USD	1.095.464	4,56	3,72
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund	USD	1.098.015	0,92	0,43
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund	USD	4.905.574	4,08	2,55
BNY Mellon Euroland Bond Fund	EUR	63.716.166	13,59	11,87
BNY Mellon European Credit Fund	EUR	1.638.931	2,61	2,25
BNY Mellon Global Bond Fund	USD	88.585.220	23,89	14,78
BNY Mellon Global Credit Fund	USD	11.573.412	2,07	1,89
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	USD	21.126.691	11,13	5,71
BNY Mellon Global Emerging Markets Fund	USD	1.585.033	19,44	5,21
BNY Mellon Global Equity Fund	USD	17.813.157	7,04	4,92
BNY Mellon Global Equity Income Fund	USD	27.260.504	3,39	2,27
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	USD	5.493.449	5,26	4,93
BNY Mellon Global Leaders Fund	USD	2.277.703	3,67	3,58
BNY Mellon Global Opportunities Fund	USD	969.910	4,45	2,88
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	EUR	130.378.393	11,42	4,71
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	GBP	2.080.899	6,65	3,33
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	USD	4.149.109	3,19	1,42
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	USD	40.623.450	6,54	5,67
BNY Mellon Global Unconstrained Fund	USD	1.175.377	7,72	5,03
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	JPY	1.185.592.602	10,41	9,63
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund	EUR	40.314.745	3,00	2,85
BNY Mellon S&P 500® Index Tracker	USD	1.231.524	3,84	3,75
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	EUR	7.255.014	15,19	14,77
BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund	USD	382.167	1,36	1,33
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	USD	6.243.786	2,41	2,31

Die Sicherheiten werden im Namen des Verleihers an Order 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.

OFFENLEGUNGEN GEMÄSS DER VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ
VON WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN („SFTR“) Forts.

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Die nachfolgenden Tabellen enthalten eine Analyse der Beträge, die zum 30. Juni 2020 bei jedem Collateral Agent als nicht zahlungswirksame Sicherheit gehalten wurden, die im Zusammenhang mit Wertpapierleihgeschäften entgegengenommen wurden:

Fonds	Sicherheitentreuhänder	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten	Fonds	Sicherheitentreuhänder	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund		EUR	BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund		USD
	The Bank of New York Mellon, London Branch	13.039.499		Euroclear Triparty	5.146.484
	The Bank of New York Mellon Institutional Bank	393.056			5.146.484
	Euroclear Triparty	6.178.877			
		19.611.432	BNY Mellon Euroland Bond Fund		EUR
				The Bank of New York Mellon, London Branch	7.348.853
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund		GBP		The Bank of New York Mellon Institutional Bank	1.960.347
	The Bank of New York Mellon, London Branch	22.430.473		Euroclear Triparty	56.712.725
	Euroclear Triparty	6.044.302		JPMorgan Chase Bank, N.A.	332.947
		28.474.775			66.354.872
			BNY Mellon European Credit Fund		EUR
BNY Mellon Asia Rising Stars Fund		USD		The Bank of New York Mellon, London Branch	211.505
	The Bank of New York Mellon, London Branch	244.137		Euroclear Triparty	1.480.141
	JPMorgan Chase Bank, N.A.	16.022			1.691.646
		260.159	BNY Mellon Global Bond Fund		USD
				The Bank of New York Mellon, London Branch	85.031.818
BNY Mellon Asian Equity Fund		USD		Euroclear Triparty	11.049.751
	The Bank of New York Mellon, London Branch	863.398			96.081.569
		863.398	BNY Mellon Global Credit Fund		USD
				The Bank of New York Mellon, London Branch	1.219.458
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund		USD		The Bank of New York Mellon Institutional Bank	22.060
	The Bank of New York Mellon, London Branch	7.517.931		Euroclear Triparty	10.956.798
	The Bank of New York Mellon Institutional Bank	3.088.654			12.198.316
	JPMorgan Chase Bank, N.A.	1.362	BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund		USD
		10.607.947		The Bank of New York Mellon, London Branch	18.301.323
				Euroclear Triparty	4.554.315
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund		USD			22.855.638
	The Bank of New York Mellon Institutional Bank	2.271.873	BNY Mellon Global Emerging Markets Fund		USD
	Euroclear Triparty	221.294		The Bank of New York Mellon, London Branch	1.425.064
		2.493.167		JPMorgan Chase Bank, N.A.	354.713
					1.779.777
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund		USD	BNY Mellon Global Equity Fund		USD
	The Bank of New York Mellon, London Branch	5.750.983		The Bank of New York Mellon, London Branch	17.710.682
	The Bank of New York Mellon Institutional Bank	7.449.196		JPMorgan Chase Bank, N.A.	2.177.885
	Euroclear Triparty	18.281.889			19.888.567
		31.482.068			
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund		USD			
	The Bank of New York Mellon Institutional Bank	238.550			
	Euroclear Triparty	943.446			
		1.181.996			
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund		USD			
	Euroclear Triparty	1.215.865			
		1.215.865			

OFFENLEGUNGEN GEMÄSS DER VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ
VON WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN („SFTR“) Forts.

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Fonds	Sicherheitentreuhänder	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten	Fonds	Sicherheitentreuhänder	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten
BNY Mellon Global Equity Income Fund		USD	BNY Mellon Global Unconstrained Fund		USD
	The Bank of New York Mellon, London Branch	22.130.612		The Bank of New York Mellon, London Branch	519.365
	The Bank of New York Mellon Institutional Bank	7.248.439		The Bank of New York Mellon Institutional Bank	194.690
		29.379.051		Euroclear Triparty	365.025
				JPMorgan Chase Bank, N.A.	174.536
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund		USD			1.253.616
	The Bank of New York Mellon Institutional Bank	2.778.221	BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund		JPY
	Euroclear Triparty	2.906.470		The Bank of New York Mellon, London Branch	947.615.917
		5.684.691		JPMorgan Chase Bank, N.A.	389.809.294
BNY Mellon Global Leaders Fund		USD			1.337.425.211
	The Bank of New York Mellon, London Branch	2.506.926	BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund		EUR
		2.506.926		The Bank of New York Mellon, London Branch	44.400.338
BNY Mellon Global Opportunities Fund		USD			44.400.338
	The Bank of New York Mellon, London Branch	1.035.574	BNY Mellon S&P 500® Index Tracker		USD
	JPMorgan Chase Bank, N.A.	63.073		The Bank of New York Mellon, London Branch	896.471
		1.098.647		The Bank of New York Mellon Institutional Bank	411.981
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)		EUR			1.308.452
	The Bank of New York Mellon, London Branch	137.671.612	BNY Mellon Small Cap Euroland Fund		EUR
	Euroclear Triparty	3.528.159		The Bank of New York Mellon, London Branch	7.889.222
		141.199.771			7.889.222
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)		GBP	BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund		USD
	The Bank of New York Mellon, London Branch	2.256.278		The Bank of New York Mellon, London Branch	36.834
		2.256.278		The Bank of New York Mellon Institutional Bank	354.114
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)		USD			390.948
	The Bank of New York Mellon, London Branch	4.164.840	BNY Mellon U.S. Equity Income Fund		USD
	Euroclear Triparty	376.564		The Bank of New York Mellon, London Branch	260.570
		4.541.404		The Bank of New York Mellon Institutional Bank	6.129.756
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund		USD			6.390.326
	The Bank of New York Mellon, London Branch	10.984.943			
	Euroclear Triparty	31.464.878			
		42.449.821			

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, Österreich, Belgien, Kanada, Dänemark, Finnland, Frankreich, Deutschland, Irland, Italien, Japan, Luxemburg, Niederlande, Neuseeland, Norwegen, Portugal, Spanien, Schweden, Schweiz, Vereinigtes Königreich, Vereinigte Staaten von Amerika;

OFFENLEGUNGEN GEMÄSS DER VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ
VON WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN („SFTR“) Forts.

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

- (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 folgenden Indizes: AEX 25 (Niederlande), CAC 40 (Frankreich), DAX 30 (Deutschland), Euro 50 (Eurozone), FTSE 100 (Großbritannien), 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 britische Staatsanleihen (Klasse UBG) wie im CREST Reference Manual definiert.

Die nachfolgenden Tabellen enthalten eine Analyse der Art und Qualität der nicht zahlungswirksamen Sicherheiten, die im Rahmen von Wertpapierleihgeschäften entgegengenommen wurden, zum 30. Juni 2020:

Fonds	Art der Sicherheit	Qualität der Sicherheit	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten	Fonds	Art der Sicherheit	Qualität der Sicherheit	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund				BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund			
			EUR				USD
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	7.406.232		Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	31.482.068
	Aktien	Anerkannte Aktienindizes	12.205.200				31.482.068
			19.611.432				
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund				BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund			
			GBP				USD
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	6.600.459		Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	1.181.996
	Aktien	Anerkannte Aktienindizes	21.874.316				1.181.996
			28.474.775				
BNY Mellon Asia Rising Stars Fund				BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund			
			USD				USD
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	151.940		Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	1.215.865
	Aktien	Anerkannte Aktienindizes	108.219				1.215.865
			260.159				
BNY Mellon Asian Equity Fund				BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund			
			USD				USD
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	975		Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	5.146.484
	Aktien	Anerkannte Aktienindizes	862.423				5.146.484
			863.398				
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund				BNY Mellon Euroland Bond Fund			
			USD				EUR
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	4.056.325		Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	66.354.872
	Aktien	Anerkannte Aktienindizes	6.551.622				66.354.872
			10.607.947				
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund				BNY Mellon European Credit Fund			
			USD				EUR
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	2.493.167		Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	1.691.646
			2.493.167				1.691.646
BNY Mellon Global Bond Fund				BNY Mellon Global Bond Fund			
			USD				USD
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	2.493.167		Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	21.512.504
			2.493.167		Aktien	Anerkannte Aktienindizes	74.569.065
							96.081.569

OFFENLEGUNGEN GEMÄSS DER VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ
VON WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN („SFTR“) Forts.

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Fonds	Art der Sicherheit	Qualität der Sicherheit	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten	Fonds	Art der Sicherheit	Qualität der Sicherheit	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten
BNY Mellon Global Credit Fund				BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)			
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	12.198.316		Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	1.054.381
			12.198.316		Aktien	Anerkannte Aktienindizes	1.201.897
							2.256.278
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund				BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)			
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	5.353.062		Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	397.519
	Aktien	Anerkannte Aktienindizes	17.502.576		Aktien	Anerkannte Aktienindizes	4.143.885
			22.855.638				4.541.404
BNY Mellon Global Emerging Markets Fund				BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund			
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	218.624		Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	42.449.821
	Aktien	Anerkannte Aktienindizes	1.561.153				42.449.821
			1.779.777				
BNY Mellon Global Equity Fund				BNY Mellon Global Unconstrained Fund			
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	3.510.952		Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	667.289
	Aktien	Anerkannte Aktienindizes	16.377.615		Aktien	Anerkannte Aktienindizes	586.327
			19.888.567				1.253.616
BNY Mellon Global Equity Income Fund				BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund			
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	12.033.460		Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	600.802.053
	Aktien	Anerkannte Aktienindizes	17.345.591		Aktien	Anerkannte Aktienindizes	736.623.158
			29.379.051				1.337.425.211
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund				BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund			
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	5.684.691		Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	4.874.966
			5.684.691		Aktien	Anerkannte Aktienindizes	39.525.372
							44.400.338
BNY Mellon Global Leaders Fund				BNY Mellon S&P 500® Index Tracker			
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	6.616		Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	936.971
	Aktien	Anerkannte Aktienindizes	2.500.310		Aktien	Anerkannte Aktienindizes	371.481
			2.506.926				1.308.452
BNY Mellon Global Opportunities Fund				BNY Mellon Small Cap Euroland Fund			
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	39.372		Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	3.769.883
	Aktien	Anerkannte Aktienindizes	1.059.275		Aktien	Anerkannte Aktienindizes	4.119.339
			1.098.647				7.889.222
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)							
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	85.718.028				
	Aktien	Anerkannte Aktienindizes	55.481.743				
			141.199.771				

OFFENLEGUNGEN GEMÄSS DER VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ
VON WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN („SFTR“) Forts.

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Fonds	Art der Sicherheit	Qualität der Sicherheit	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten	Fonds	Art der Sicherheit	Qualität der Sicherheit	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten
BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund			USD	BNY Mellon U.S. Equity Income Fund			USD
	Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	390.948		Festverzinsliche Wertpapiere	Investment Grade	6.129.756
			390.948		Aktien	Anerkannte Aktienindizes	260.570
							6.390.326

Die nachfolgenden Tabellen enthalten die zehn größten Emittenten von Sicherheiten basierend auf dem Wert der nicht zahlungswirksamen Sicherheiten, die im Rahmen von Wertpapierleihgeschäften entgegengenommen wurden, per 30. Juni 2020 aufgeführt:

Sicherheitsgeber	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten	Sicherheitsgeber	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund		BNY Mellon Asian Equity Fund	
	EUR		USD
Französische Republik	2.251.573	Hologic Inc	50.714
Großbritannien	1.927.719	Credit Agricole SA	47.895
Bundesrepublik Deutschland	1.158.526	Danaher Corp	41.609
Sanofi	957.696	QUALCOMM Inc	41.238
BHP Group Plc	652.658	Waste Management Inc	36.517
National Grid Plc	642.049	Compass Group Plc	33.327
European Investment Bank	627.137	Walmart Inc	31.123
Air Liquide SA	567.671	BASF SE	27.150
USA	396.681	Schlumberger Ltd	25.190
Bank of America Corp	363.643	Walt Disney Co/The	25.183
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund		BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	
	GBP		USD
Großbritannien	6.226.483	USA	4.051.151
Prudential Plc	2.178.041	Amazon.com Inc	528.664
L'Oreal SA	2.177.953	Apple Inc	498.420
Microsoft Corp	2.098.447	NortonLifeLock Inc	354.280
T-Mobile US Inc	1.805.164	JPMorgan Chase & Co	283.417
Vinci SA	1.798.542	DuPont de Nemours Inc	266.590
Ocado Group Plc	1.652.282	Bank of America Corp	260.896
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	1.365.560	Anthem Inc	237.627
EssilorLuxottica SA	1.324.251	T-Mobile US Inc	182.329
Wolters Kluwer NV	1.252.342	Hologic Inc	174.406
BNY Mellon Asia Rising Stars Fund		BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	
	USD		USD
Französische Republik	59.719	USA	2.271.873
Großbritannien	41.414	Französische Republik	110.817
Bundesrepublik Deutschland	27.895	European Investment Bank	65.637
USA	13.667	Bundesrepublik Deutschland	16.837
Microsoft Corp	5.725	International Bank for Reconstruction & Development	11.961
Apple Inc	5.601	Republik Österreich	6.965
Amazon.com Inc	4.999	Inter-American Development Bank	5.027
L'Oreal SA	4.847	Staatsanleihe Neuseelands	4.018
E*TRADE Financial Corp	3.360	Regierung von Kanada	29
Twitter Inc	3.360	Australischer Commonwealth	2

OFFENLEGUNGEN GEMÄSS DER VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ
VON WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN („SFTR“) Forts.

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Sicherheitsgeber	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten	Sicherheitsgeber	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund	USD	BNY Mellon European Credit Fund	EUR
USA	11.906.282	Bundesrepublik Deutschland	627.259
Großbritannien	8.735.504	Königreich der Niederlande	422.088
European Investment Bank	2.822.872	Französische Republik	379.116
Französische Republik	2.583.316	USA	134.817
Republik Österreich	1.648.375	European Investment Bank	37.692
Australischer Commonwealth	1.296.670	Königreich Schweden	27.786
Bundesrepublik Deutschland	890.945	Australischer Commonwealth	24.842
Königreich der Niederlande	844.690	Republik Österreich	20.379
International Bank for Reconstruction & Development	398.910	Schweizerische Eidgenossenschaft	15.217
Regierung von Kanada	146.172	Großbritannien	1.784
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	USD	BNY Mellon Global Bond Fund	USD
Großbritannien	509.032	Französische Republik	11.272.173
USA	238.550	BHP Group Plc	4.218.434
Französische Republik	151.022	Sanofi	3.414.733
European Investment Bank	148.020	Großbritannien	3.013.661
International Bank for Reconstruction & Development	73.631	Bundesrepublik Deutschland	2.430.590
Bundesrepublik Deutschland	31.509	E*TRADE Financial Corp	2.340.369
Republik Österreich	15.184	National Grid Plc	2.289.271
Königreich der Niederlande	4.543	Ocado Group Plc	2.084.605
Inter-American Development Bank	4.534	Air Liquide SA	2.024.070
Staatsanleihe Neuseelands	3.575	Adobe Inc	1.748.914
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund^	USD	BNY Mellon Global Credit Fund	USD
USA	1.215.865	Bundesrepublik Deutschland	3.047.023
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund	USD	Königreich der Niederlande	2.460.258
Bundesrepublik Deutschland	1.467.934	Französische Republik	2.074.411
Französische Republik	1.212.017	Großbritannien	1.844.485
USA	1.035.162	USA	1.478.965
European Investment Bank	534.932	European Investment Bank	524.159
Großbritannien	348.465	International Bank for Reconstruction & Development	248.588
Königreich der Niederlande	163.347	Königreich Schweden	156.214
Republik Österreich	112.290	Republik Österreich	124.349
International Bank for Reconstruction & Development	102.915	Regierung von Kanada	87.313
Australischer Commonwealth	86.787	BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	USD
Inter-American Development Bank	38.344	Bundesrepublik Deutschland	1.974.735
BNY Mellon Euroland Bond Fund	EUR	Königreich der Niederlande	1.638.019
Französische Republik	29.143.313	Sanofi	1.294.475
Großbritannien	14.335.171	BHP Group Plc	914.179
Bundesrepublik Deutschland	8.188.299	National Grid Plc	867.829
European Investment Bank	5.306.931	Französische Republik	856.417
USA	3.370.279	Air Liquide SA	767.295
Königreich der Niederlande	2.121.509	Bank of America Corp	491.520
International Bank for Reconstruction & Development	2.101.996	NVIDIA Corp	453.869
Republik Österreich	860.502	Engie SA	439.103
Republik Finnland	401.440		
Regierung von Kanada	147.678		

OFFENLEGUNGEN GEMÄSS DER VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ
VON WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN („SFTR“) Forts.

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Sicherheitsgeber	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten	Sicherheitsgeber	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten
BNY Mellon Global Emerging Markets Fund	USD	BNY Mellon Global Leaders Fund	USD
Prudential Plc	123.941	Microsoft Corp	125.685
Royal Dutch Shell Plc	117.624	T-Mobile US Inc	120.343
USA	112.223	L'Oreal SA	108.326
Rio Tinto Plc	103.139	Facebook Inc	100.155
BHP Group Plc	103.035	Yum! Brands Inc	96.809
Toyota Motor Corp	89.981	Ocado Group Plc	93.442
AstraZeneca Plc	81.950	Amazon.com Inc	87.141
Regierung von Kanada	68.907	TE Connectivity Ltd	86.556
National Grid Plc	52.224	PayPal Holdings Inc	85.723
Anglo American Plc	47.925	Norfolk Southern Corp	71.060
BNY Mellon Global Equity Fund	USD	BNY Mellon Global Opportunities Fund	USD
Französische Republik	1.013.518	Tesco Plc	58.681
USA	819.698	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	36.371
Großbritannien	637.225	Mitsui & Co Ltd	35.345
Bundesrepublik Deutschland	524.213	ITOCHU Corp	26.408
Regierung von Kanada	423.236	Reckitt Benckiser Group Plc	26.056
Credit Suisse Group AG	378.110	Mitsui Fudosan Co Ltd	25.931
Prosus NV	355.560	Ferguson Plc	25.587
Tesco Plc	352.681	Daiichi Sankyo Co Ltd	22.197
Bayer AG	324.286	MS&AD Insurance Group Holdings Inc	21.006
Volkswagen AG	318.502	Prudential Plc	20.765
BNY Mellon Global Equity Income Fund	USD	BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	EUR
USA	7.248.441	Großbritannien	46.362.648
Großbritannien	2.799.610	USA	31.396.035
Fast Retailing Co Ltd	1.734.541	Königreich der Niederlande	5.939.657
Vinci SA	1.734.540	USA	2.970.049
Adyen NV	1.729.880	Amazon.com Inc	1.558.276
Französische Republik	1.474.360	Bundesrepublik Deutschland	1.452.616
Procter & Gamble Co/The	1.161.906	Adyen NV	1.407.127
S&P Global Inc	968.372	Fast Retailing Co Ltd	1.405.245
Amazon.com Inc	919.755	Vinci SA	1.382.204
SoftBank Group Corp	879.547	Tesco Plc	1.274.555
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	USD	BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	GBP
USA	3.201.904	Großbritannien	794.476
Französische Republik	647.041	Regierung von Kanada	259.780
Großbritannien	579.256	Amazon.com Inc	48.201
European Investment Bank	369.882	Microsoft Corp	36.156
Republik Österreich	272.682	Tesco Plc	32.647
Bundesrepublik Deutschland	246.623	Fast Retailing Co Ltd	32.627
Australischer Commonwealth	165.442	Adyen NV	32.549
Königreich der Niederlande	128.054	Vinci SA	32.037
International Bank for Reconstruction & Development	58.708	L'Oreal SA	30.641
Großherzogtum Luxemburg	7.441	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	26.433

OFFENLEGUNGEN GEMÄSS DER VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ
VON WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN („SFTR“) Forts.

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Sicherheitsgeber	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten	Sicherheitsgeber	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	USD	BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund	EUR
Amazon.com Inc	235.532	Großbritannien	4.639.742
Microsoft Corp	175.693	Microsoft Corp	1.550.950
Adyen NV	162.483	T-Mobile US Inc	1.370.861
Fast Retailing Co Ltd	159.892	Amazon.com Inc	1.295.904
Vinci SA	159.892	L'Oreal SA	1.224.921
Königreich der Niederlande	158.825	Facebook Inc	1.185.098
Bundesrepublik Deutschland	155.032	Yum! Brands Inc	1.094.681
L'Oreal SA	148.972	Ocado Group Plc	1.056.616
Apple Inc	123.575	TE Connectivity Ltd	1.038.737
S&P Global Inc	108.444	PayPal Holdings Inc	969.331
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	USD	BNY Mellon S&P 500® Index Tracker	USD
Französische Republik	8.796.884	USA	417.613
Bundesrepublik Deutschland	8.478.289	Großbritannien	304.099
Republik Österreich	6.800.481	Französische Republik	159.760
European Investment Bank	6.525.912	Regierung von Kanada	40.280
Australischer Commonwealth	3.268.350	Microsoft Corp	16.538
Königreich der Niederlande	3.234.857	T-Mobile US Inc	15.626
Großbritannien	3.113.470	Bundesrepublik Deutschland	15.217
Europäische Union	820.696	L'Oreal SA	14.036
Regierung von Kanada	672.765	Facebook Inc	12.977
Republik Finnland	250.328	Yum! Brands Inc	12.544
BNY Mellon Global Unconstrained Fund	USD	BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	EUR
USA	249.909	Großbritannien	3.247.675
Französische Republik	192.350	Französische Republik	258.978
European Investment Bank	108.269	Amazon.com Inc	196.147
SoftBank Group Corp	36.907	Microsoft Corp	124.722
Bundesrepublik Deutschland	36.665	Bundesrepublik Deutschland	119.423
Regierung von Kanada	33.953	USA	113.864
Fast Retailing Co Ltd	33.512	Citigroup Inc	100.890
Prudential Plc	32.045	L'Oreal SA	81.881
BHP Group Plc	26.988	T-Mobile US Inc	72.149
Toyota Motor Corp	25.126	TE Connectivity Ltd	71.111
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	JPY	BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund^	USD
USA	220.431.779	USA	354.114
Französische Republik	122.855.645	Republik Österreich	27.853
Regierung von Kanada	89.139.810	Republik Finnland	5.307
Großbritannien	78.179.110	European Investment Bank	3.674
Bundesrepublik Deutschland	44.885.456		
Königreich der Niederlande	37.920.117	BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	USD
Prosus NV	19.753.344	USA	6.129.756
Prudential Plc	18.133.625	Amazon.com Inc	19.550
Credit Suisse Group AG	17.227.865	Citigroup Inc	17.517
Swiss Life Holding AG	17.017.278	DuPont de Nemours Inc	10.641
		Dollar General Corp	7.566
		Intel Corp	6.750
		Eli Lilly and Co	6.420
		Laboratory Corp of America Holdings	5.785
		Imperial Brands Plc	5.723
		East Japan Railway Co	5.558

^ Sofern zum 30. Juni 2020 weniger als zehn Sicherheitsgeber bestehen, sind sämtliche Geber enthalten.

OFFENLEGUNGEN GEMÄSS DER VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ
VON WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN („SFTR“) Forts.

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Die nachfolgenden Tabellen enthalten eine Analyse der Währungen der nicht zahlungswirksamen Sicherheiten, die im Rahmen von Wertpapierleihgeschäften entgegengenommen wurden, zum 30. Juni 2020:

Fonds	Währung	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten	Fonds	Währung	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund			BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund		
		EUR			USD
	Australischer Dollar	148.251		Australischer Dollar	2
	Kanadischer Dollar	11.884		Kanadischer Dollar	40
	Euro	9.184.149		Euro	201.281
	Japanischer Yen	2.263.036		Norwegische Krone	4.165
	Sterling	3.498.554		Sterling	313
	Schweizer Franken	278.903		US-Dollar	2.287.366
	US-Dollar	4.226.655			2.493.167
		19.611.432			
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund			BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund		
		GBP			USD
	Kanadischer Dollar	15.862		Australischer Dollar	1.296.670
	Euro	10.338.250		Kanadischer Dollar	254.385
	Japanischer Yen	842		Dänische Krone	1.890
	Sterling	11.451.531		Euro	8.480.283
	Schweizer Franken	550.296		Neuseeländischer Dollar	6.531
	US-Dollar	6.117.994		Norwegische Krone	19.576
		28.474.775		Sterling	8.984.740
				US-Dollar	12.437.993
					31.482.068
BNY Mellon Asia Rising Stars Fund			BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund		
		USD			USD
	Kanadischer Dollar	3.112		Australischer Dollar	1.913
	Euro	106.686		Kanadischer Dollar	36
	Japanischer Yen	8.331		Euro	287.861
	Sterling	48.521		Norwegische Krone	3.706
	Schwedische Krone	2.935		Sterling	509.311
	Schweizer Franken	8.608		US-Dollar	379.169
	US-Dollar	81.966			1.181.996
		260.159			
BNY Mellon Asian Equity Fund			BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund		
		USD			USD
	Euro	126.118		US-Dollar	1.215.865
	Japanischer Yen	9.505			1.215.865
	Sterling	89.545			
	Schweizer Franken	41.552	BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund		
	US-Dollar	596.678			USD
		863.398		Australischer Dollar	86.787
				Kanadischer Dollar	7.218
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund				Dänische Krone	510
		USD		Euro	3.525.040
	Kanadischer Dollar	264		Neuseeländischer Dollar	1.764
	Euro	219.968		Norwegische Krone	20.271
	Japanischer Yen	582.464		Sterling	365.971
	Sterling	180.138		US-Dollar	1.138.923
	Schweizer Franken	106.672			5.146.484
	US-Dollar	9.518.441			
		10.607.947			

OFFENLEGUNGEN GEMÄSS DER VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ
VON WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN („SFTR“) Forts.

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Fonds	Währung	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten	Fonds	Währung	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten
BNY Mellon Euroland Bond Fund		EUR	BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund		USD
Australischer Dollar		28.850	Australischer Dollar		450
Kanadischer Dollar		147.874	Euro		11.072.219
Dänische Krone		33.368	Japanischer Yen		3.683.397
Euro		46.277.256	Sterling		2.541.755
Neuseeländischer Dollar		255	Schwedische Krone		16.582
Norwegische Krone		73.610	Schweizer Franken		410.213
Sterling		14.341.446	US-Dollar		5.131.022
Schweizer Franken		52.393			22.855.638
US-Dollar		5.399.820			
		66.354.872	BNY Mellon Global Emerging Markets Fund		USD
			Kanadischer Dollar		68.907
BNY Mellon European Credit Fund		EUR	Euro		150.292
Australischer Dollar		24.842	Japanischer Yen		124.046
Kanadischer Dollar		2.120	Sterling		905.733
Euro		1.479.654	Schweizer Franken		59.471
Sterling		6.608	US-Dollar		471.328
Schweizer Franken		15.217			1.779.777
US-Dollar		163.205			
		1.691.646	BNY Mellon Global Equity Fund		USD
			Kanadischer Dollar		423.080
BNY Mellon Global Bond Fund		USD	Euro		4.556.264
Australischer Dollar		48	Japanischer Yen		4.244.297
Kanadischer Dollar		1.015	Sterling		3.489.575
Euro		38.283.083	Schwedische Krone		44.596
Japanischer Yen		10.415.085	Schweizer Franken		1.241.905
Norwegische Krone		105.741	US-Dollar		5.888.850
Sterling		15.513.605			19.888.567
Schwedische Krone		217.207			
Schweizer Franken		1.618.097	BNY Mellon Global Equity Income Fund		USD
US-Dollar		29.927.688	Kanadischer Dollar		371.731
		96.081.569	Euro		8.263.022
			Japanischer Yen		4.246.360
BNY Mellon Global Credit Fund		USD	Sterling		5.027.946
Australischer Dollar		12.145	US-Dollar		11.469.992
Kanadischer Dollar		87.313			29.379.051
Dänische Krone		743			
Euro		8.120.894	BNY Mellon Global High Yield Bond Fund		USD
Neuseeländischer Dollar		2.568	Australischer Dollar		165.442
Sterling		1.844.538	Kanadischer Dollar		12.918
Schweizer Franken		85.375	Dänische Krone		158
US-Dollar		2.044.740	Euro		1.595.806
		12.198.316	Neuseeländischer Dollar		545
			Sterling		608.852
			US-Dollar		3.300.970
					5.684.691

OFFENLEGUNGEN GEMÄSS DER VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ
VON WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN („SFTR“) Forts.

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Fonds	Währung	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten	Fonds	Währung	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten
BNY Mellon Global Leaders Fund		USD	BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund		USD
Euro		288.170	Australischer Dollar		3.268.350
Japanischer Yen		268.634	Kanadischer Dollar		938.389
Sterling		188.620	Euro		33.767.491
Schweizer Franken		147.835	Norwegische Krone		9.532
US-Dollar		1.613.667	Sterling		3.891.449
		2.506.926	US-Dollar		574.610
					42.449.821
BNY Mellon Global Opportunities Fund		USD	BNY Mellon Global Unconstrained Fund		USD
Kanadischer Dollar		12.253	Australischer Dollar		3
Euro		69.796	Kanadischer Dollar		33.972
Japanischer Yen		501.322	Euro		369.601
Sterling		324.858	Japanischer Yen		239.043
Schweizer Franken		19.621	Norwegische Krone		6.870
US-Dollar		170.797	Sterling		209.610
		1.098.647	Schweizer Franken		23.507
			US-Dollar		371.010
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)		EUR			1.253.616
Euro		16.943.988	BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund		JPY
Japanischer Yen		15.210.277	Kanadischer Dollar		89.136.710
Sterling		53.535.727	Euro		365.582.727
Schweizer Franken		1.531.627	Japanischer Yen		74.747.961
US-Dollar		53.978.152	Sterling		172.390.078
		141.199.771	Schwedische Krone		895.653
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)		GBP	Schweizer Franken		100.163.009
Kanadischer Dollar		259.780	US-Dollar		534.509.073
Euro		214.870			1.337.425.211
Japanischer Yen		377.291	BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund		EUR
Sterling		950.964	Euro		4.997.529
Schweizer Franken		38.675	Japanischer Yen		5.344.684
US-Dollar		414.698	Sterling		7.418.424
		2.256.278	Schweizer Franken		2.752.807
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)		USD	US-Dollar		23.886.894
Euro		1.340.049			44.400.338
Japanischer Yen		603.874	BNY Mellon S&P 500® Index Tracker		USD
Sterling		344.148	Kanadischer Dollar		40.280
Schweizer Franken		194.686	Euro		216.969
US-Dollar		2.058.647	Japanischer Yen		36.240
		4.541.404	Sterling		332.187
			Schweizer Franken		20.650
			US-Dollar		662.126
					1.308.452

OFFENLEGUNGEN GEMÄSS DER VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ
VON WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN („SFTR“) Forts.

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Fonds	Währung	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten	Fonds	Währung	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund		EUR	BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund		USD
Euro		805.872	Euro		33.160
Japanischer Yen		576.642	Sterling		3.674
Sterling		3.624.234	US-Dollar		354.114
Schwedische Krone		10.080			
Schweizer Franken		195.420			390.948
US-Dollar		2.676.974			
		7.889.222	BNY Mellon U.S. Equity Income Fund		USD
			Japanischer Yen		21.820
			Sterling		13.842
			US-Dollar		6.354.664
					6.390.326

Die nachfolgenden Tabellen enthalten eine Analyse der Laufzeiten bis zur Fälligkeit von Wertpapierleihgeschäften und der entgegengenommenen Sicherheiten zum 30. Juni 2020:

Die Analyse der Laufzeiten bis zur Fälligkeit basiert auf dem vertraglichen Fälligkeitsdatum der entliehenen Wertpapier und bei nicht zahlungswirksamen Sicherheiten dem vertraglichen Fälligkeitstermin des als Sicherheit entgegengenommenen Wertpapiers.

Fonds	Weniger als 1 Tag	1 Tag bis 1 Woche	1 Woche bis 1 Monat	1 Monate bis 3 Monate	3 Monate is 1 Jahr	Über 1 Jahr	Offene Fälligkeit	Summe
BNY Mellon Absolute Return Bond Fund	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Verliehene Wertpapiere	–	–	–	–	802.611	17.311.201	–	18.113.812
Erhaltene nicht zahlungswirksame Sicherheiten	–	9.765	114.425	53.450	189.002	7.039.590	12.205.200	19.611.432
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP
Verliehene Wertpapiere	–	–	25.733.093	–	–	–	562.022	26.295.115
Erhaltene nicht zahlungswirksame Sicherheiten	–	–	15	2.919	17.570	6.579.955	21.874.316	28.474.775
BNY Mellon Asia Rising Stars Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	240.984	240.984
Erhaltene nicht zahlungswirksame Sicherheiten	–	306	364	–	7.361	143.909	108.219	260.159
BNY Mellon Asian Equity Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	713.934	713.934
Erhaltene nicht zahlungswirksame Sicherheiten	–	–	–	–	–	975	862.423	863.398
BNY Mellon Dynamic U.S. Equity Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	9.895.403	9.895.403
Erhaltene nicht zahlungswirksame Sicherheiten	–	–	79.319	69.086	564.026	3.343.894	6.551.622	10.607.947
BNY Mellon Efficient U.S. High Yield Beta Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	–	–	–	–	–	2.436.639	–	2.436.639
Erhaltene nicht zahlungswirksame Sicherheiten	–	–	154.682	14.553	267.025	2.056.907	–	2.493.167
BNY Mellon Emerging Markets Corporate Debt Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	–	–	–	–	–	29.870.586	–	29.870.586
Erhaltene nicht zahlungswirksame Sicherheiten	–	247	480.204	339.557	975.489	29.686.571	–	31.482.068

OFFENLEGUNGEN GEMÄSS DER VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ
VON WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN („SFTR“) Forts.

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Fonds	Weniger als 1 Tag	1 Tag bis 1 Woche	1 Woche bis 1 Monat	1 Monate bis 3 Monate	3 Monate is 1 Jahr	Über 1 Jahr	Offene Fälligkeit	Summe
BNY Mellon Emerging Markets Debt Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	–	–	–	–	–	1.095.464	–	1.095.464
Erhaltene nicht zahlungswirksame Sicherheiten	–	–	30.801	14	14.032	1.137.149	–	1.181.996
BNY Mellon Emerging Markets Debt Local Currency Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	–	–	–	–	–	1.098.015	–	1.098.015
Erhaltene nicht zahlungswirksame Sicherheiten	–	–	–	–	121.586	1.094.279	–	1.215.865
BNY Mellon Emerging Markets Debt Total Return Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	–	–	–	–	–	4.905.574	–	4.905.574
Erhaltene nicht zahlungswirksame Sicherheiten	–	–	30.080	23.279	282.321	4.810.804	–	5.146.484
BNY Mellon Euroland Bond Fund	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Verliehene Wertpapiere	–	–	–	–	–	63.716.166	–	63.716.166
Erhaltene nicht zahlungswirksame Sicherheiten	–	65.180	602.346	3.071	1.369.636	64.314.639	–	66.354.872
BNY Mellon European Credit Fund	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Verliehene Wertpapiere	–	–	–	–	–	1.638.931	–	1.638.931
Erhaltene nicht zahlungswirksame Sicherheiten	–	18.506	5.923	6.515	142.345	1.518.357	–	1.691.646
BNY Mellon Global Bond Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	–	–	–	–	–	88.585.220	–	88.585.220
Erhaltene nicht zahlungswirksame Sicherheiten	–	22.658	4.719	48	772.336	20.712.743	74.569.065	96.081.569
BNY Mellon Global Credit Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	–	–	–	–	–	11.573.412	–	11.573.412
Erhaltene nicht zahlungswirksame Sicherheiten	–	103.828	125.680	172	828.328	11.140.308	–	12.198.316
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	–	–	–	–	–	21.126.691	–	21.126.691
Erhaltene nicht zahlungswirksame Sicherheiten	–	55.356	39.496	397	510.786	4.747.027	17.502.576	22.855.638
BNY Mellon Global Emerging Markets Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	1.585.033	1.585.033
Erhaltene nicht zahlungswirksame Sicherheiten	–	–	7.755	–	22.825	188.044	1.561.153	1.779.777
BNY Mellon Global Equity Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	17.813.157	17.813.157
Erhaltene nicht zahlungswirksame Sicherheiten	–	4.652	47.818	–	236.357	3.222.125	16.377.615	19.888.567
BNY Mellon Global Equity Income Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	27.260.504	27.260.504
Erhaltene nicht zahlungswirksame Sicherheiten	–	–	–	–	989.206	11.044.254	17.345.591	29.379.051
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	–	–	–	–	–	5.493.449	–	5.493.449
Erhaltene nicht zahlungswirksame Sicherheiten	–	27	136.836	90.485	431.554	5.025.789	–	5.684.691
BNY Mellon Global Leaders Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	2.277.703	2.277.703
Erhaltene nicht zahlungswirksame Sicherheiten	–	–	–	–	–	6.616	2.500.310	2.506.926

OFFENLEGUNGEN GEMÄSS DER VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ
VON WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN („SFTR“) Forts.

WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE Forts.

Fonds	Weniger als 1 Tag	1 Tag bis 1 Woche	1 Woche bis 1 Monat	1 Monate bis 3 Monate	3 Monate is 1 Jahr	Über 1 Jahr	Offene Fälligkeit	Summe
BNY Mellon Global Opportunities Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	969.910	969.910
Erhaltene nicht zahlungswirksame Sicherheiten	–	–	1.379	–	4.059	33.934	1.059.275	1.098.647
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Verliehene Wertpapiere	–	–	–	–	–	3.458.420	126.919.973	130.378.393
Erhaltene nicht zahlungswirksame Sicherheiten	–	70.365	1.097.320	–	6.549.046	78.001.297	55.481.743	141.199.771
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP
Verliehene Wertpapiere	–	–	999.965	–	–	–	1.080.934	2.080.899
Erhaltene nicht zahlungswirksame Sicherheiten	–	–	–	–	–	1.054.381	1.201.897	2.256.278
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	–	–	–	–	–	369.120	3.779.989	4.149.109
Erhaltene nicht zahlungswirksame Sicherheiten	–	7.510	2.403	–	50.809	336.797	4.143.885	4.541.404
BNY Mellon Global Short-Dated High Yield Bond Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	–	–	–	–	4.410.758	36.212.692	–	40.623.450
Erhaltene nicht zahlungswirksame Sicherheiten	–	–	763.127	1.526.937	2.481.554	37.678.203	–	42.449.821
BNY Mellon Global Unconstrained Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	–	–	–	–	–	662.473	512.904	1.175.377
Erhaltene nicht zahlungswirksame Sicherheiten	–	–	4.666	5.131	53.455	604.037	586.327	1.253.616
BNY Mellon Japan Small Cap Equity Focus Fund	JPY	JPY	JPY	JPY	JPY	JPY	JPY	JPY
Verliehene Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	1.185.592.602	1.185.592.602
Erhaltene nicht zahlungswirksame Sicherheiten	–	93.426	11.421.769	2.468.356	43.376.744	543.441.753	736.623.163	1.337.425.211
BNY Mellon Long-Term Global Equity Fund	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Verliehene Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	40.314.745	40.314.745
Erhaltene nicht zahlungswirksame Sicherheiten	–	–	1.180	21.361	6.669	4.845.756	39.525.372	44.400.338
BNY Mellon S&P 500® Index Tracker	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	1.231.524	1.231.524
Erhaltene nicht zahlungswirksame Sicherheiten	–	–	8.213	6.282	77.383	845.093	371.481	1.308.452
BNY Mellon Small Cap Euroland Fund	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Verliehene Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	7.255.014	7.255.014
Erhaltene nicht zahlungswirksame Sicherheiten	–	1.051	504	17.288	30.030	3.721.010	4.119.339	7.889.222
BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	382.167	382.167
Erhaltene nicht zahlungswirksame Sicherheiten	–	–	1.037	8.743	48.638	332.530	–	390.948
BNY Mellon U.S. Equity Income Fund	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD	USD
Verliehene Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	6.243.786	6.243.786
Erhaltene nicht zahlungswirksame Sicherheiten	–	–	18.229	87.994	594.650	5.428.883	260.570	6.390.326

OFFENLEGUNGEN GEMÄSS DER VERORDNUNG ÜBER DIE TRANSPARENZ
VON WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTEN („SFTR“) Forts.

GESCHÄFTE MIT AKTIENSWAPS, AKTIENINDEXSWAPS UND TOTAL RETURN SWAPS

Die nachfolgenden Tabellen enthalten ausführliche Angaben zum gesamten Brutto-Nominalvolumen von Aktienswaps, Aktienindex-Swaps und Total Return Swaps sowie den absoluten Fair Value als Anteil des Nettoinventarwerts jedes Fonds, analysiert nach Kontrahenten, zum 30. Juni 2020:

Fonds	Kontrahent	Gründungsland	Gesamtbruttonominalwert	Absoluter beizulegender Zeitwert	% des Nettoinventarwerts
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund			GBP	GBP	
	Bank of America Merrill Lynch	Großbritannien	62.660.517	3.712.658	1,37
	Barclays Bank PLC	Großbritannien	101.147.266	6.795.204	2,50
	JPMorgan Chase Bank	USA	60.027.958	4.815.840	1,77
	Morgan Stanley	Großbritannien	45.757.502	626.109	0,23
Summe			269.593.243	15.949.811	5,87
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund			EUR	EUR	
	BNP Paribas	USA	27.506.107	4.584.293	16,05
Summe			27.506.107	4.584.293	16,05

Die nachfolgende Tabelle enthält eine Analyse der Währungen der vom Fonds im Rahmen von offenen Derivatgeschäften vereinnahmten/bereitgestellten Barmittel zum 30. Juni 2020:

Fonds	Währung	Erhaltene Barsicherheiten	Gestellte Barsicherheiten
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund		GBP	GBP
	Sterling	5.300.000	–
Summe		5.300.000	–
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund		EUR	EUR
	Sterling	270.000	–
Summe		270.000	–

Die nachfolgenden Tabellen enthalten eine Analyse der Laufzeiten bis zur Fälligkeit von Aktienswaps, Aktienindex-Swaps und Total Return Swaps (Nettoengagement) und der in diesem Zusammenhang vereinnahmten/bereitgestellten Barmittel zum 30. Juni 2020:

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	1 Woche bis 1 Monat	1 Monate bis 3 Monate	3 Monate bis 1 Jahr	Über 1 Jahr	Offene Fälligkeit	Summe
BNY Mellon Absolute Return Equity Fund								
	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP	GBP
Aktienindexswaps	–	–	–	–	(1.144.474)	–	–	(1.144.474)
Aktienswaps	–	–	–	–	5.048.636	–	–	5.048.636
Erhaltene/(gestellte) Barsicherheiten	5.300.000	–	–	–	–	–	–	5.300.000
BNY Mellon Absolute Return Global Convertible Fund								
	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR	EUR
Aktienswaps	–	–	–	–	(1.631.419)	–	–	(1.631.419)
Total Return Swaps	–	–	–	–	108.020	2.102.454	–	2.210.474
Erhaltene/(gestellte) Barsicherheiten	270.000	–	–	–	–	–	–	270.000

ANHANG 2

FINANZINDIZES

Die nachfolgende Tabelle enthält sämtliche Finanzindizes, die von den jeweiligen Anlageverwaltern des Fonds im Geschäftsjahr zum 30. Juni 2020 zu Anlagezwecken verwendet wurden:

Fonds	Für Anlagezwecke verwendeter Index	Markt	Website
BNY Mellon Dynamic Total Return Fund	Bloomberg Commodity SM (Total Return Index)	Global	https://www.bloomberg.com
	Bloomberg Barclays US High Yield 350mn Cash Pay 0-5 Yr 2% Capped Index	USA	https://www.bloomberg.com
BNY Mellon Global Bond Fund	Bloomberg Barclays China Treasury + Policy Bank Index	China	https://www.bloomberg.com
BNY Mellon Global Dynamic Bond Fund	Markit iBoxx Euro Liquid High Yield Index	Global	https://cdn.ihsmarkit.com
	Markit iBoxx Euro Liquid High Yield Index	Global	https://cdn.ihsmarkit.com
BNY Mellon Global High Yield Bond Fund	Bloomberg Barclays EM Local Currency Liquid Government Bond Index	Schwellenländer	https://www.bloomberg.com
	Markit iBoxx USD Liquid High Yield Capped Index	Global	https://cdn.ihs.com
BNY Mellon Global Real Return Fund (EUR)	Markit iBoxx USD Liquid Investment Grade Index	Global	https://cdn.ihsmarkit.com
	Bloomberg Barclays Euro Corporate 1-5 Year Bond Index	Global	https://www.bloomberg.com
	Markit iBoxx Euro Liquid High Yield Index	Global	https://cdn.ihsmarkit.com
	J.P. Morgan EMBI Global Core Index hedged to Euro	Schwellenländer	https://www.jpmorgan.com
	J.P. Morgan GBI-EM Global Diversified 10% Cap 1% Floor	Schwellenländer	https://www.jpmorgan.com
	The London Bullion Market Association (LBMA) Gold Price	Artikel	http://www.lbma.org.uk
	Bloomberg Barclays EM Local Currency Liquid Government Bond Index	Schwellenländer	https://www.bloomberg.com
	Markit iBoxx USD Liquid Investment Grade Index	Global	https://cdn.ihsmarkit.com
	Bloomberg Barclays China Treasury + Policy Bank Index	China	https://www.bloomberg.com
	Markit iBoxx Euro Liquid High Yield Index	Global	https://cdn.ihsmarkit.com
BNY Mellon Global Real Return Fund (GBP)	J.P. Morgan EMBI Global Core Index	Schwellenländer	https://www.jpmorgan.com
	J.P. Morgan GBI-EM Global Diversified 10% Cap 1% Floor	Schwellenländer	https://www.jpmorgan.com
	Bloomberg Barclays EM Local Currency Liquid Government Bond Index	Schwellenländer	https://www.bloomberg.com
	Markit iBoxx USD Liquid Investment Grade Index	Global	https://cdn.ihsmarkit.com
	Bloomberg Barclays China Treasury + Policy Bank Index	China	https://www.bloomberg.com
BNY Mellon Global Real Return Fund (USD)	Markit iBoxx Euro Liquid High Yield Index	Global	https://cdn.ihsmarkit.com
	J.P. Morgan EMBI Global Core Index	Schwellenländer	https://www.jpmorgan.com
	J.P. Morgan GBI-EM Global Diversified 10% Cap 1% Floor	Schwellenländer	https://www.jpmorgan.com
	Bloomberg Barclays EM Local Currency Liquid Government Bond Index	Schwellenländer	https://www.bloomberg.com
	The London Bullion Market Association (LBMA) Gold Price	Artikel	http://www.lbma.org.uk
BNY Mellon Global Unconstrained Fund			
BNY Mellon U.S. Dynamic Value Fund	Russell 1000 Value Index	USA	https://www.ftserussell.com

MANAGER UND SONSTIGE INFORMATIONEN

EINGETRAGENER SITZ

One Dockland Central, Guild Street
IFSC, Dublin 1, D01E4XO
Irland

DIE MITGLIEDER DES VERWALTUNGSRATS

The Directors of the Company are as follows:

David Dillon (Ire)*^
Gerald Rehn (Amerika)
Greg Brisk (Brite)
Michael Meagher (Ire)^

Alle aufgeführten Verwaltungsratsmitglieder sind nicht geschäftsführende Verwaltungsratsmitglieder

* Vorsitzender des Verwaltungsrats.

^ Unabhängiges Verwaltungsratsmitglied

MANAGEMENTGESELLSCHAFT

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
USA

Newton Investment Management Limited
BNY Mellon Centre
160 Queen Victoria Street
London EC4V 4LA
Großbritannien
Walter Scott & Partners Limited
One Charlotte Square
Edinburgh EH2 4DR
Schottland
Großbritannien

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
Tokio 100-0005
Japan

Insight Investment Management (Global) Limited
BNY Mellon Centre
160 Queen Victoria Street
London EC4V 4LA
Großbritannien

Alcentra NY, LLC
200 Park Avenue
New York NY 10166
USA

Insight North America LLC
200 Park Avenue
New York
NY 10166
USA

Maybank Asset Management Singapore Pte. LTD.
9 Temasek Boulevard
13-01 Suntec Tower Two
Singapur 038989
Singapur

Alcentra Limited
160 Queen Victoria Street
London EC4V 4LA
Großbritannien

VERWALTUNGS-, REGISTER- & TRANSFERSTELLE

BNY Mellon Fund Services (Ireland) Designated Activity Company
One Dockland Central, Guild Street
IFSC, Dublin 1, D01E4XO
Irland

SEKRETÄR

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

DEPOTSTELLE

The Bank of New York Mellon SA/NV
Dublin Branch
Riverside II, 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
Großbritannien

VERTRIEBSGESELLSCHAFT (INNERHALB DES EWR)

BNY Mellon Fund Management (Luxembourg) S.A.
2-4 Rue Eugène Ruppert
L-2453
Luxemburg

WICHTIGE HINWEISE

BNY MELLON S&P 500® INDEX TRACKER

S&P 500® Index ist eine Handelsmarke der McGraw-Hill Companies, Inc, welche BNY Mellon Global Funds, plc. im Rahmen einer Lizenzvereinbarung nutzen darf. Der BNY Mellon S&P 500® Index Tracker wird durch Standard & Poor's nicht finanziell unterstützt, empfohlen, vertrieben oder beworben. Darüber hinaus übernimmt Standard & Poor's keine Verantwortung dafür, dass ein Investment in den BNY Mellon S&P 500® Index Tracker für einen Kunden wirklich die richtige Wahl ist.

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 sind, berechnet BNY MGM oder die andere Gesellschaft keine Zeichnungs-, Umtausch- oder Rücknahmegebühren in Bezug auf die Investition des Fonds in die Anteile dieses anderen OGA.

