

BNY Mellon Efficient U.S. Fallen Angels Beta Fund

GESTORA ESPECIALISTA



Insight : es líder en gestión de riesgos, renta fija y soluciones de inversión multiactivos.

El Fondo cambió de gestor de inversiones el 1 de septiembre de 2021. Antes de esta fecha era gestionado por Mellon Investments Corporation, LLC.

INDICADOR DE REFERENCIA

el Fondo medirá su rentabilidad comparándola con el Bloomberg US HY Fallen Angel 3% Cap TR Index (el «Índice de referencia»). La Gestora de Inversiones utilizará el Índice de referencia para conformar el universo de inversión. El Fondo se gestiona de manera activa y no pretende reproducir todos los componentes del Índice de referencia. La Gestora de Inversiones cuenta con una potestad limitada para invertir fuera del Índice de referencia cuando el valor de deuda o relacionado con la deuda cumpla con los requisitos del Índice de referencia y se espere que se incluya en un futuro en el Índice de referencia. La mayoría de las posiciones del Fondo serán componentes del Índice de referencia y, como resultado, el Fondo será similar en sus exposiciones a divisas, duración y sectores, así como en términos del perfil de calidad crediticia, sujeto a las limitaciones de inversión. Con todo, la Gestora de Inversiones no pretenderá reflejar el perfil de vencimientos del Índice de referencia. La estrategia de inversión ofrece una volatilidad similar a la del Índice de referencia a medio y a largo plazo.

Publicado por Bloomberg / www.bloomberg.com/indexdisclaimers

INFORMACIÓN GENERAL

Activos netos totales (millones) \$ 246,01
Indicador de referencia Bloomberg US HY Fallen Angel 3% Cap TR Index
Sector Lipper Lipper Global - Bond Global High Yield USD
Tipo de fondo OEIC
Domicilio del fondo Irlanda
Gestor del fondo Paul Benson/Stephanie Shu
Divisa base USD
Divisas disponibles USD, EUR, GBP, CHF, JPY, HKD
Lanzamiento del fondo 21 sep 2020
Nombre del vehículo de inversión BNY Mellon Global Funds, plc
Categorización SFDR Article 8

DETALLES DE LA CLASE USD W (ACC.)

Fecha de lanzamiento 21 sep 2020
Inversión mínima inicial \$ 15.000.000
Comisión de gestión anual 0,30%
ISIN IE00BM94ZR83
Registrado para su venta en: AT, BE, CH, DE, DK, ES, FI, FR, GB, GG, IE, IT, JE, KR, LU, NL, NO, PT, SE, SG

Los costes incurridos al comprar, mantener en cartera, convertir o vender cualquier inversión afectarán a su rentabilidad. Los costes pueden aumentar o disminuir como resultado de fluctuaciones de los tipos de cambio.

NEGOCIACIÓN (HORARIO DE DUBLIN)

De 09:00 a 17:00 cada día hábil
Punto de valoración: 22:00

CALIFICACIONES DEL FONDO



Fuente y Copyright: Ratings Morningstar : © 2026 Morningstar. Todos los derechos reservados. Los ratings son recogidos el primer día laborable del mes.

OBJETIVO DE INVERSIÓN

Generar una rentabilidad superior a la del Índice de referencia que se detalla a continuación con unos niveles de volatilidad similares de medio a largo plazo, antes de deducir comisiones y gastos, al tiempo que tiene en cuenta los factores ambientales, sociales y de gobernanza («ASG»).

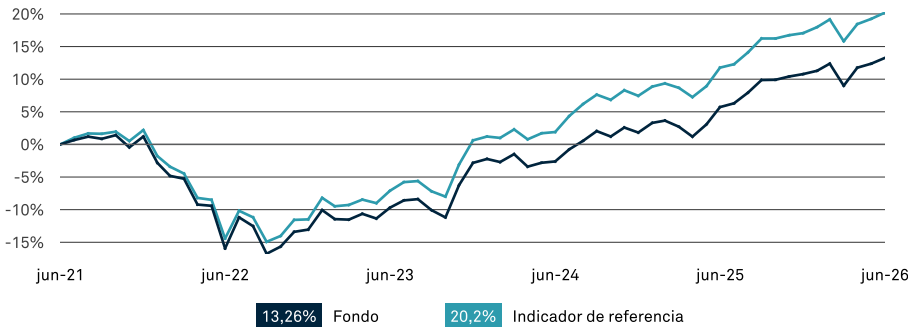
NOTA DE RENDIMIENTO

Las rentabilidades obtenidas en el pasado no constituyen necesariamente una indicación de rentabilidades futuras. El valor de las inversiones puede bajar. Los inversores podrían no recuperar la suma invertida.

Consulte el Folleto informativo y el Documento de Datos Fundamentales para el Inversor KID antes de tomar cualquier decisión de inversión. La documentación está disponible en inglés y en un idioma oficial de las jurisdicciones en las que el Fondo está registrado para su venta al público. Visite www.bny.com.

Las rentabilidades pueden aumentar o disminuir como resultado de fluctuaciones de los tipos de cambio.

RENDIMIENTO ACUMULADO (%) 5 AÑOS



RESUMEN DE RENDIMIENTO (%)

	1M	3M	En el año hasta la fecha			1 año	Anualizado			
							2 años	3 años	5 años	
USD W (Acc.)	0,79	3,91	2,24	7,13		7,84	7,84	2,52		
Indicador de referencia	0,80	3,79	2,68	7,55		8,61	8,96	3,75		
Euro W (Inc.) (hedged)	0,66	3,45	1,31	4,88		5,70	5,80	0,59		
Indicador de referencia	0,80	3,79	2,68	7,55		8,61	8,96	3,75		
	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023	2024	2025
Fondo	-	-	-	-	-	5,35	-14,10	11,76	4,79	8,79
Indicador de referencia	26,74	9,86	-4,11	16,86	16,64	6,57	-13,40	13,68	6,79	8,94

RENDIMIENTO ANUAL HASTA FIN DEL TRIMESTRE (%)

Desde	jun 2021	jun 2022	jun 2023	jun 2024	jun 2025
Hasta	jun 2022	jun 2023	jun 2024	jun 2025	jun 2026
Fondo	-15,94	7,43	7,85	8,56	7,13

Fuente: Lipper. La rentabilidad del fondo de esta clase de acciones se calcula como la rentabilidad total, basada en el valor liquidativo, incluidos los gastos, pero excluida la comisión inicial, los ingresos reinvertidos brutos de impuestos, expresada en la moneda de la clase de acciones.

La rentabilidad del índice de referencia se muestra en la divisa base del Fondo.

CALIFICACIONES DE RIESGO ESG DE MORNINGSTAR



Extraído de los fondos de categoría global 3707 US Fixed Income ,a fecha de 30/04/2026. Basado en 86.97 % de activos bajo gestión. Los datos se basan únicamente en las posiciones largas. La Calificaciones de riesgo ESG de Morningstar™ es una medida de lo bien que las empresas o países emisores de las inversiones incluidas en la cartera de un fondo gestionan sus riesgos medioambientales, sociales y de gobierno corporativo (ESG) con materialidad financiera en comparación con otros fondos pertenecientes a la misma Categoría Morningstar. El Rating se expresa en “globos” en una escala de 1 (la calificación más baja) a 5 (la más alta). Una calificación mayor indica que las inversiones del Fondo conllevan un riesgo ESG más bajo que sus homólogos. Para obtener información detallada sobre la metodología de calificación, consulte: www.morningstar.com. © 2024 Morningstar. Todos los derechos reservados. La siguiente información: (1) es propiedad de Morningstar y/o de sus proveedores de contenido; (2) no puede ser copiada ni distribuida; y (3) no se garantiza que sea correcta, completa o actualizada. Ni Morningstar ni sus proveedores de contenido se hacen responsables de cualquier perjuicio o pérdida resultante del uso de esta información. Cuando sea relevante, información adicional relacionada con las metodologías subyacentes a las calificaciones ESG referenciadas en este material, o enlaces a dicha información, está disponible en: <https://www.bny.com/eu-esg-ratings>.

† Aunque en la mayoría de casos, el cargo inicial no es aplicable en España, la gestora (BNY MGM) podría decidir aplicar un cargo inicial en ciertas situaciones de inversión.

DESGLOSE POR CALIDAD CREDITICIA (%)

Años	Fondo	Indicador de ref.
IG	2,1	0,0
BB	75,7	77,0
B	15,4	16,2
CCC	5,6	5,5
CC	1,0	1,2
Liquidez	0,3	0,0

EMISOR (%)

	Fondo
Huntsman International LLC	5,09
FMC Corp	4,58
Paramount Global	4,00
FS KKR Capital Corp	3,91
Centene Corp	3,76
Whirlpool Corp	3,58
Vodafone Group PLC	3,27
Telecom Italia Capital SA	2,86
Aptiv Swiss Holdings Ltd	2,78
Rockies Express Pipeline LLC	2,74

DESGLOSE POR INDUSTRIA (%)

	Fondo	Indicador de ref.
Bienes de consumo cíclicos	20,0	21,6
Industrias básicas	16,0	13,0
Comunicaciones	15,7	13,9
Seguros	8,9	7,6
REITS	8,9	9,5
Bienes de consumo no duraderos	8,4	8,6
Otros	22,2	25,8

ESTADÍSTICAS DEL FONDO - 3 AÑOS

Jensen Alfa	-0,10
Beta	1,04
Correlación con el Índice	0,99
Ratio de información anualizado	-1,54
Ratio de Sharpe anualizado	0,57
Tracking error anualizado	0,68
R²	0,99
Desviación estándar anualizada	5,54
Máximo retroceso (drawdown)	-3,06
VaR normal a 95%	-2,02

DISTRIBUCIÓN POR VENCIMIENTO (%)

Años	Fondo	Indicador de ref.
0-1 año	0,3	0,0
1-3 años	24,9	29,6
3-5 años	30,5	27,3
5-7 años	7,9	5,9
7-10 años	11,2	12,6
10 - 15 anos	10,7	11,2
15-25 años	13,4	12,7
> 25 anos	1,0	0,7

CARACTERÍSTICAS DE LA CARTERA

	Fondo	Indicador de ref.
Rendimiento yield to worst (%)*	6,74	6,79
Rendimiento a vencimiento (%)	6,75	6,81
Rendimiento actual (%)	6,10	6,09
Duración efeciva (años)	4,78	4,77
Modified duration (years)	4,78	4,77
Cupón medio (%)	5,62	5,59
Average life / maturity	6,97	6,90
Average rating (average)	BB	BB
Convexidad	0,40	0,39
Spread to Government (bp)	238,13	243,38
Número de activos	154	155
Número de emisores	62	62
Spread to swaps (bp)	240,02	240,36
Diferencial ajustado por opciones (OAS)	238,13	243,38
Effective spread duration (years)	4,82	4,72
Maturity (years)	6,98	6,92
Beta	0,99	

DESGLOSE POR DIVISAS (%)

	Fondo	Indicador de ref.
USD	100,0	100,00
EUR	0,0	0,00

DISTRIBUCIÓN POR DURACIÓN (%)

Años	Fondo	Indicador de ref.
0-1 año	0,8	0,8
1-3 años	35,2	35,8
3-5 años	25,4	24,8
5-7 años	13,5	14,3
7-10 años	15,1	14,9
10 - 15 anos	9,9	9,5
> 15 anos	0,0	0,0

DESGLOSE DE RENTA FIJA POR REGIONES (%)

	Fondo	Indicador de ref.
Estados Unidos	86,9	86,9
Canadá	3,3	3,8
Reino Unido	3,3	3,0
Italia	2,9	3,0
Japón	2,1	2,0
Otros	1,5	1,2

PARTICIPACIONES (%)

	Fondo
Vodafone Group Plc 7% 04apr2079 (callable 04jan29)	3,27
Aptiv Swiss Holdings Ltd 6.875% 15dec2054 (callable 15sep29)	2,78
Huntsman International L 4.5% 01may2029 (callable 01feb29)	2,77
Gfl Environmental Inc 6.75% 15jan2031 (callable 15jan27) 144a	1,85
Pacificorp 7.375% 15sep2055 (callable 17jun30)	1,79
Fmc Corp 3.45% 01oct2029 (callable 01jul29)	1,56
Newell Brands Inc 7.5% 01apr2046 (callable 01oct45)	1,52
Vf Corp 2.95% 23apr2030 (callable 23jan30)	1,47
Methanex Corp 5.25% 15dec2029 (callable 15sep29)	1,38
Horizon Mutual Holdings 6.2% 15nov2034 (callable 15aug34) 144a	1,36

Fuente: BNY Mellon Investment Management EMEA Limited

INDICADOR SINTÉTICO DE RIESGO (ISR) - USD W (ACC.)

Menor riesgo

Mayor riesgo

Potencialmente menor remuneración

Potencialmente mayor remuneración

1

2

3

4

5

6

7

El indicador resumido de riesgo (IRR) es una cifra comprendida entre 1 y 7 mostrada en todos documentos de datos fundamentales (DDF/KID) de PRIIPs para permitir a los inversores comparar los perfiles de riesgo y rentabilidad de distintos fondos. 1 es el valor más bajo, y 7 el más alto.

La categoría de riesgo se calcula en base a datos de rentabilidad históricos (o de rentabilidad indicativa del fondo durante periodos de suspensión) y podría no ser una guía fiable del perfil de riesgo futuro de un fondo. No se garantiza que la categoría de riesgo del fondo vaya a permanecer fija. Si desea información adicional, consulte el DDF/KID de PRIIPs.

DATOS POR CLASES DISPONIBLES

	CGA	ISIN	Bloomberg	Inversión mínima inicial
Euro W (Inc.) (hedged)	0,30%	IE00BM94ZV20	BUSFWEH	€ 15.000.000
Euro W (Acc.) (hedged)	0,30%	IE00BM94ZT08	BNFABEW	€ 15.000.000
USD W (Inc.)	0,30%	IE00BM94ZS90	BNFABWU ID	\$ 15.000.000

RENTABILIDAD BRUTA AL VENCIMIENTO (A 31 MAYO 2026)

Clases	Rendimiento
USD W (Acc.)	5,98%
Euro W (Inc.) (hedged)	5,98%
Euro W (Acc.) (hedged)	5,98%
USD W (Inc.)	-

La rentabilidad de la distribución refleja el importe que cabe esperar que un fondo distribuya en los próximos doce meses como porcentaje del precio del fondo en la fecha indicada. Los rendimientos se muestran sobre una base neta, no incluyen ningún cargo inicial y los inversores pueden estar sujetos a impuestos sobre la distribución.

INFORMACION IMPORTANTE

Dirigido exclusivamente a Clientes Profesionales. BNY Mellon Investment Management EMEA Limited (BNYMIM EMEA), BNY Mellon Fund Managers Limited (BNYMFML), BNY Mellon Fund Management (Luxembourg) S.A. (BNY MFML) o las compañías afiliadas de operación de fondos nombran a las gestoras de inversiones para que presten servicios de gestión de cartera en el marco de los productos y servicios ofrecidos por BNYMIM EMEA, BNY MFML o por las compañías afiliadas de operación de fondos. Las tenencias de las carteras pueden sufrir cambios en cualquier momento y sin previo aviso, se proporcionan únicamente a efectos informativos y no deben interpretarse como recomendaciones de inversión. Las llamadas pueden ser grabadas. Para obtener más información, visite nuestra Política de privacidad. BNY, BNY Mellon y Bank of New York Mellon son marcas corporativas de The Bank of New York Mellon Corporation y sus filiales y podrían utilizarse en referencia a sus subsidiarias.

BNY Mellon Global Funds, plc (BNYMGF), es una sociedad de inversión de capital variable (ICVC), con responsabilidad segregada entre subfondos. Constituida con responsabilidad limitada conforme a las leyes de Irlanda y autorizada por el Banco Central de Irlanda como Fondo OICVM. La Sociedad Gestora es BNY Mellon Fund Management (Luxembourg) S.A. (BNY MFML), regulada por la Comisión de Vigilancia del Sector Financiero (CSSF). Domicilio social: 2-4 rue Eugène Ruppert L-2453 Luxemburgo. La información sobre los derechos de los inversores, incluida la política de tramitación de reclamaciones y los mecanismos de reparación de los inversores, está disponible en bny.com/investments.

The Manager may terminate the arrangements made for the marketing of one or more sub-funds of BNYMGF in one or more EU Member States and shareholders will receive prior notification in this event.

BNYMGF está autorizado en el extranjero, pero no en el Reino Unido. Es poco probable que el Servicio del Defensor del Pueblo Financiero pueda examinar las reclamaciones relacionadas con BNYMGF, sus subfondos, su operador o su depositario. Es poco probable que las reclamaciones por pérdidas relacionadas con el operador y el depositario de BNYMGF estén cubiertas por el plan de compensación. Un posible inversor debe considerar obtener asesoramiento financiero antes de decidirse a invertir y debe consultar el prospecto de BNYMGF para obtener más información.

Emitido en **España** por BNY Mellon Fund Management (Luxembourg) S.A. (BNY MFML), una sociedad anónima (“Société Anonyme”) constituida conforme a las leyes de Luxemburgo, con número de registro B28166 y domicilio social en 2-4 Rue Eugène Ruppert L-2453 Luxemburgo, regulada por la Commission de Surveillance du Secteur Financier (Comisión de Vigilancia del Sector Financiero, CSSF).

MIS0044-311226

Emitido a 10/07/2026