Este material es una comunicación de marketing. Preparado exclusivamente para Clientes Profesionales.

BNY Mellon Absolute Return Bond Fund

GESTORA DE BNY MELLON

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

OBJETIVO DE INVERSIÓN

Para generar una rentabilidad absoluta positiva en cualquier condición de mercado en periodos sucesivos de 12 meses, invirtiendo principalmente en valores de deuda y relacionados con la deuda e instrumentos de todo el mundo y en instrumentos derivados financieros relacionados con estos valores e instrumentos.

INDICADOR DE REFERENCIA

El Fondo medirá su rentabilidad con respecto al EURIBOR a 3 meses (el «Índice de referencia basado en el efectivo»). EURIBOR (Euro Interbank Offer Rate) es el tipo europeo de oferta interbancaria, un tipo de referencia que se calcula como el promedio de los tipos de interés con los que los bancos de la Zona del euro ofrecen préstamos a corto plazo no garantizados en el mercado interbancario.

El Índice de referencia basado en el efectivo se utiliza como objetivo respecto del cual medir su rentabilidad en periodos sucesivos de 12 meses, tras deducir comisiones. El Fondo utiliza el Índice de referencia basado en el efectivo + 3% anual como objetivo respecto del cual medir su rentabilidad en periodos sucesivos anualizados de 3 años, antes de deducir comisiones.

El Fondo se gestiona de manera activa, lo que implica que la Gestora de inversiones tendrá potestad sobre la selección de inversiones, siempre que se respeten el objetivo y las políticas de inversión que se indican en el Folleto.

INFORMACIÓN GENERAL

Activos netos totales (millones)	€ 297,63
Indicador de referencia 1	Cash (3mth EURIBOR)
Indicador de referencia 2	Cash (3mth EURIBOR) + 3%
Sector Lipper	Lipper Global - Absolute Return Other
Tipo de fondo	SICAV
Domicilio del fondo	Irlanda
Gestor del fondo	Gareth Colesmith / Peter Bentley
Gestor alternativo	Shaun Casey / Harvey Bradley
Divisa base	EUR
Divisas disponibles	CHF, EUR, GBP, USD
Lanzamiento del fondo	09 mar 2012

DETALLES DE LA CLASE EURO S (ACC.)

Fecha de lanzamiento	22 may 2012
Inversión mínima inicial	€ 5.000.000
Comisión inicial†	5,00%
Comisión de gestión anual	0,50%
Comisión de rendimiento	10,00%
ISIN	IE00B706BP88

Registrado para su venta en: AT, BE, CH, CO, DE, DK, ES, FI, FR, GB, GG, IE, IL, IT, JE, LU, NL, NO, PE, PT, SE, SG, UY

NEGOCIACIÓN (HORARIO DE DUBLIN)

De 09:00 a 17:00 cada día laborable

Punto de valoración: 12:00

Los costes incurridos al comprar, mantener en cartera, convertir o vender cualquier inversión afectarán a su rentabilidad. Para más información, consulte el documento KID.

† 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.

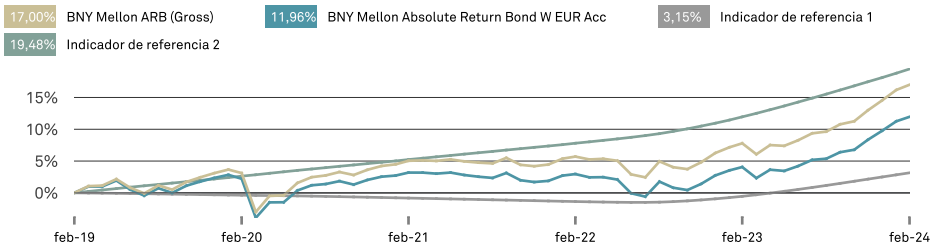
NOTA DE RENDIMIENTO

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. La renta generada por las inversiones puede variar y no está garantizada.

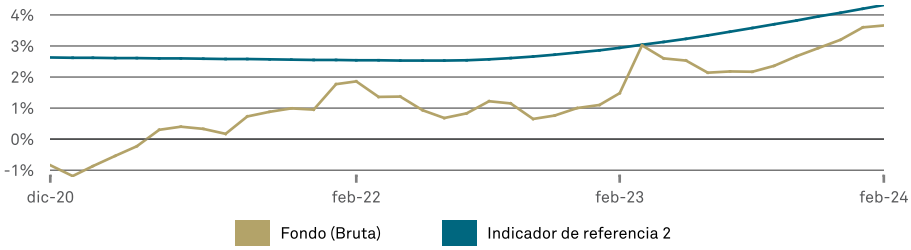
Consulte el Folleto informativo y el Documento de Datos Fundamentales para el Inversor, e o KID/KIID antes de tomar cualquier decisión de inversión. La documentación está disponible en inglés y en un idioma oficial de las jurisdicciones en las que el Fondo está registrado para su venta al público. Visite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

Si desea una lista completa de los riesgos aplicables a este fondo consulte el Folleto informativo u otra documentación ofrecida.

RENTABILIDAD ACUMULADA A 5 AÑOS (%)



RENTABILIDAD ANUALIZADA BRUTA EN PERIODOS MÓVILES DE 3 AÑOS



Fuente de los rendimientos acumulados y a 3 años: Lipper IM. La rentabilidad se calcula como rendimiento total, ingresos reinvertidos, en divisa base.

RESUMEN DE RENDIMIENTO (%)

	1M	3M	En el año hasta la fecha	1 año	Anualizado 2 años	Anualizado 3 años	Anualizado 5 años
Euro S (Acc.)	0,62	3,35	2,00	7,82	4,52	3,00	2,55
Euro R (Acc.)	0,61	3,26	1,96	7,32	4,02	2,50	2,04
Indicador de referencia 1	0,31	0,98	0,64	3,72	2,26	1,32	0,62

	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023
Fondo	0,76	1,05	1,29	-0,07	-5,59	0,92	0,51	-0,39	1,09	7,11
Indicador de referencia 1	0,22	-0,01	-0,26	-0,33	-0,32	-0,36	-0,43	-0,55	0,34	3,47

RENDIMIENTO ANUAL HASTA FIN DEL TRIMESTRE (%)

Desde	dic 2018	dic 2019	dic 2020	dic 2021	dic 2022
Hasta	dic 2019	dic 2020	dic 2021	dic 2022	dic 2023
Fondo	0,92	0,51	-0,39	1,09	7,11

EURO S (ACC.) RENTABILIDADES MENSUALES (%)

	enero	feb.	marzo	abr.	mayo	jun.	jul.	agosto	sept.	oct.	nov.	dic.	En el año hasta la fecha
2024	1,37	0,62	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	2,00
2023	0,80	0,53	-1,65	1,31	-0,16	0,75	0,96	0,20	0,98	0,39	1,50	1,32	7,11
2022	0,83	0,26	-0,48	0,05	-0,35	-2,09	-0,51	2,39	-0,92	-0,35	0,98	1,33	1,09
2021	0,20	0,47	0,02	-0,14	0,18	-0,35	-0,24	-0,17	0,78	-1,09	-0,26	0,20	-0,39
2020	0,49	-0,58	-5,93	2,55	0,04	1,90	0,83	0,22	0,47	-0,51	0,74	0,52	0,51

Fuente: Lipper, a 29 febrero 2024. La rentabilidad del fondo Euro S (Acc.) se calcula como rendimiento total, en base al valor liquidativo, expresado en la divisa de la clase correspondiente, incluyendo cargo anual de gestión pero excluyendo cargo inicial, ingresos brutos reinvertidos. El impacto del cargo inicial (que puede alcanzar el 5%) sobre el rendimiento de su inversión puede ser sustancial. Si lo desea puede solicitar cifras de rendimiento incluyendo dicho cargo inicial.

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

El índice de referencia se actualizó el 01/11/2021, con lo que la rentabilidad previa al cambio se muestra en base al indicador previo. La clase de acciones puede ser distinta a la correspondiente a la divisa base del fondo. Para el CHF se emplea la tasa SARON CHF, para el EUR el EURIBOR, para la GBP el SONIA GBP, para el USD el SOFR USD, y para el SGD el SIBOR SGD.

BNY Mellon Investment Management - Equipo de atención al cliente
Tel: +34 91 744 5800
Email:
Nieves.picallonogueira@bnymellon.com
Web: www.bnymellonim.com/es

DURACIÓN POR REGIONES (AÑOS)

	Posición de compra (larga)	Posición de venta (corta)	Neto
EE.UU.	6,0	-5,1	0,9
Otros Bloque Dólar	0,0	-1,1	-1,1
Eurozona	4,7	-4,7	0,1
Reino Unido	4,4	-4,7	-0,3
Japón	0,0	-0,8	-0,8
Emerging Markets	0,5	0,0	0,5
Otros	1,5	-0,4	1,1
Total	17,1	-16,7	0,5

DURACIÓN POR VENCIMIENTOS (AÑOS)

	Posición de compra (larga)	Posición de venta (corta)	Neto
1 año	0,1	-0,1	0,0
1-5 años	2,4	-1,7	0,7
5-10 años	5,1	-5,1	0,0
10-15 años	0,8	-1,0	-0,2
15+ años	8,7	-8,7	0,0
Total	17,1	-16,7	0,5

EXPOSICIÓN CAMBIARIA NO CUBIERTA (%)

	Fondo
NZD	0,9
GBP	0,9
AUD	0,8
KRW	0,5
NOK	0,5
EUR	0,4
CAD	0,4
Otros	-4,4
Total	0,0

DURACIÓN DE DIFERENCIAL POR SECTORES (AÑOS)

	Posición de compra (larga)	Posición de venta (corta)	Neto
Organización supranacional	0,0	0,0	0,0
Sociedades no financieras	1,7	-1,4	0,4
Finanzas	1,1	-0,4	0,7
ABS/MBS	0,1	0,0	0,1
Indices CDS	0,4	-1,3	-1,0
Instrumentos del mercado monetario	0,5	-0,1	0,4
Total	3,7	-3,2	0,5

DURACIÓN DE DIFERENCIAL (MÁXIMA) POR CALIFICACIONES

	Posición de compra (larga)	Posición de venta (corta)	Neto
AAA	0,0	0,0	0,0
AA	0,1	0,0	0,0
A	0,6	-1,3	-0,7
BBB	1,5	-0,9	0,6
BB	0,7	-0,5	0,2
B	0,8	-0,4	0,5
CCC e inferior	0,0	0,0	0,0
No calificado	0,0	0,0	0,0
Total	3,7	-3,2	0,6

ESTADÍSTICAS DEL FONDO - 3 AÑOS

Ratio de Sharpe anualizado	0,55
Desviación estándar anualizada	3,13

CALIFICACIONES DEL FONDO

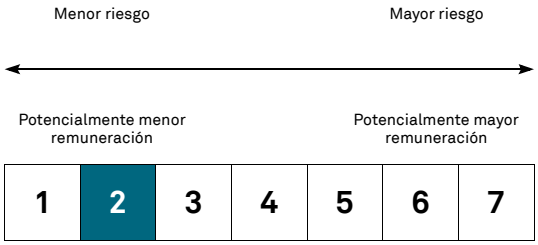
Fuente y Copyright: Ratings Morningstar : © 2024 Morningstar. Todos los derechos reservados. Los ratings son recogidos el primer día laborable del mes.

DOMICILIO DEL EMISOR

	Neto %	Duración de diferencial neta
Unión Europea	58,8	0,0
Reino Unido	15,6	0,7
Francia	6,1	0,2
Alemania	5,3	0,2
Países Bajos	4,7	0,3
España	3,6	0,2
Austria	2,9	0,1
Irlanda	2,6	0,0
Canadá	2,2	0,0
Portugal	1,0	0,0
Nueva Zelanda	0,9	0,0
Bélgica	0,9	0,0
Bermudas	0,9	0,0
Italia	0,8	-0,1
Chipre	0,8	0,0
Dinamarca	0,8	0,0
Saudi Arabia	0,8	0,0
Australia	0,7	0,0
Otros	-9,3	-1,2
Total	100,0	0,6

Fuente: BNY Mellon Investment Management EMEA Limited

NIVEL DE RIESGO - EURO S (ACC.)



El indicador resumido de riesgo es una guía del nivel de riesgo de este producto en comparación con otros productos. Muestra las probabilidades de que el producto pierda dinero debido a la evolución de los mercados o porque no podamos pagarle.
Hemos clasificado este producto en la clase de riesgo 2 en una escala de 7, lo que significa un riesgo bajo. Esta evaluación califica la posibilidad de sufrir pérdidas en rentabilidades futuras como un nivel bajo, y la probabilidad de que una mala coyuntura de mercado influya en la capacidad de BNY Mellon Fund Management (Luxembourg) S.A. de pagarle como muy improbable.

DATOS POR CLASES DISPONIBLES

	CGA	Gastos corrientes	ISIN	Bloomberg	Inversión mínima inicial		CGA	Gastos corrientes	ISIN	Bloomberg	Inversión mínima inicial
GBP T (Acc.) (Hdg.)	0,50%	0,64%	IE00B8G10T17	**BMARTHG**	£ 5.000.000	Euro R (Acc.)	1,00%	1,14%	IE00B6VXJV34	BMARBER	€ 5.000

RENTABILIDAD BRUTA AL VENCIMIENTO (A 31 ENERO 2024)

Clases	Rendimiento
Euro S (Acc.)	-
GBP T (Acc.) (Hdg.)	4,27%
Euro R (Acc.)	-

Renta estimada a 12 meses - Refleja las cantidades que cabe esperar que un fondo reparta en los próximos 12 meses como porcentaje de la cotización actual del fondo en la fecha mostrada. La renta estimada a 12 meses se basa en una instantánea de la cartera en la fecha mostrada. Esta cifra no incluye el impacto de cargos iniciales, y los inversores podrían tener que pagar impuestos sobre el reparto de dividendos.

Los costes corrientes se toman del archivo EMT más reciente, la cifra de gastos corrientes procede del Documento de Datos Fundamentales para el Inversor (DFI o KIID) más reciente.

INFORMACION IMPORTANTE

Dirigido exclusivamente a Clientes Profesionales. BNY Mellon Investment Management EMEA Limited (BNYMIM EMEA), BNY Mellon Fund Managers Limited (BNYMFM), 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. Es posible que grabemos llamadas telefónicas. Si desea información adicional, lea nuestra política de privacidad www.bnymellonim.com. BNY Mellon es la marca corporativa de The Bank of New York Mellon Corporation y sus filiales. Los Fondos son subfondos de BNY Mellon Global Funds, plc, una sociedad de inversión mobiliaria de capital variable (ICVC) con responsabilidad segregada entre subfondos, fundada con responsabilidad limitada de conformidad con la ley irlandesa y autorizada por el Central Bank of Ireland como Fondo UCITS (OICVM). La Sociedad Gestora es BNY Mellon Fund Management (Luxembourg) S.A. (BNY MFML), regulada por la Commission de Surveillance du Secteur Financier (Comisión de Vigilancia del Sector Financiero, CSSF). Domicilio social: 2-4 Rue Eugène Ruppert L-2453 Luxemburgo. En www.bnymellonim.com encontrará información sobre los derechos del inversor, incluida la política de tramitación de reclamaciones y los mecanismos de indemnización. El Gestor puede rescindir las disposiciones realizadas para la comercialización de uno o más subfondos de BNYMGF en uno o más Estados miembros de la UE, de lo cual se notificará con anterioridad a los accionistas. En **España**, BNY Mellon Global Funds está registrada en la CNMV bajo el nº 267. 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).

MIS0044-300624
Emitido a 12/03/2024