

BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund GBP W Acc Hedged

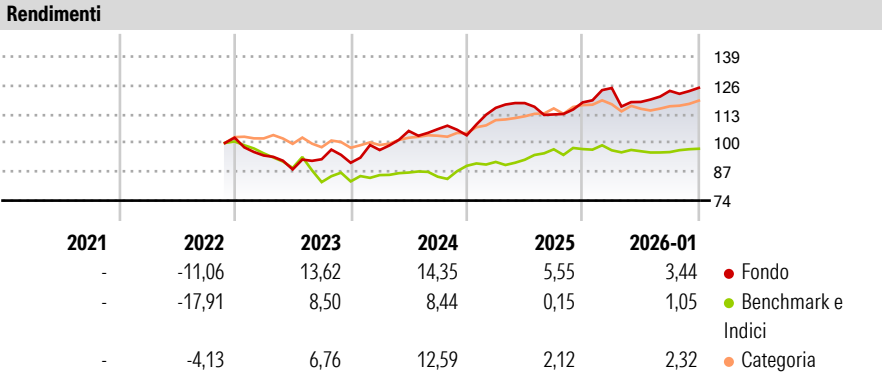
Categoria Morningstar™  
Category\_EUCA001009

Benchmark Morningstar  
Morningstar UK Cautious Target Allocation  
NR GBP  
Usato nel Report

Benchmark Dichiarato  
ICE BofA US 3M Trsy Bill TR USD

Morningstar Rating™  
★★★★

**Obiettivo d'Investimento Dichiarato**  
The Sub-Fund aims to achieve a total return in excess of a cash benchmark over an investment horizon of 3-5 years with a target volatility of 10% through a multi-asset approach to asset allocation and security selection. However, there is no guarantee that this will be achieved over that, or any time period.



| Misure di Rischio |       |                 |      |
|-------------------|-------|-----------------|------|
| 3Y Alpha          | 5,76  | 3Y Sharpe Ratio | 0,96 |
| 3Y Beta           | -1,08 | 3Y Std Dev      | 8,56 |
| 3Y R-Squared      | 30,84 | 3Y Risk         | +Med |
| 3Y Info Ratio     | 0,60  | 5Y Risk         | -    |
| 3Y Tracking Error | 10,69 | 10Y Risk        | -    |

Basati su Morningstar UK Cautious Target Allocation NR GBP (dove applicabile)

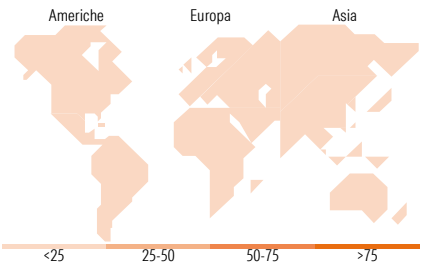
| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk  | Cat  | Rendimenti Trimestrali % | Q1    | Q2    | Q3    | Q4    |
|------------------|-------|------|------|--------------------------|-------|-------|-------|-------|
| 3-Mesi           | 10,81 | 2,46 | 4,75 | 2026                     | -     | -     | -     | -     |
| 6-Mesi           | 13,62 | 3,45 | 7,73 | 2025                     | 5,48  | -5,03 | 4,21  | 1,11  |
| 1-Anno           | 12,83 | 1,27 | 5,26 | 2024                     | 11,96 | 1,85  | -4,34 | 4,83  |
| 3-Anni Ann.ti    | 13,69 | 5,39 | 8,49 | 2023                     | 6,30  | 8,91  | 0,76  | -2,61 |
| 5-Anni Ann.ti    | -     | -    | -    | 2022                     | -7,85 | -6,67 | 5,21  | -1,71 |
| 10-Anni Ann.ti   | -     | -    | -    |                          |       |       |       |       |

Rendimenti aggiornati al 03/02/2026

Portafoglio 31/12/2025



| Fixed Income Style   |       | Fondo                 |
|----------------------|-------|-----------------------|
| Box™                 |       |                       |
| Qualità Credito      | Alto  | Duration Effettiva    |
|                      | Med   | Maturità effettiva    |
|                      | Basso | Qualità Credito Media |
|                      |       |                       |
| Sensibilità ai Tassi |       |                       |
| Bassa                | Med   | Alta                  |



| Titoli principali                           |         |       |
|---------------------------------------------|---------|-------|
| Nome                                        | Settore | %     |
| United States Treasury Bills...             | —       | 16,63 |
| United States Treasury Bills...             | —       | 16,60 |
| United States Treasury Bills...             | —       | 16,39 |
| United States Treasury Bills...             | —       | 12,08 |
| United States Treasury Bills...             | —       | 9,26  |
| United States Treasury Bills...             | —       | 8,75  |
| United States Treasury Bills...             | —       | 8,73  |
| United States Treasury Bills...             | —       | 8,72  |
| United States Treasury Bills...             | —       | 1,93  |
| Otc Goldman Sachs Commodi                   | —       | 1,21  |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio            | 100,30  |       |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari       | 1       |       |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | 39      |       |

| Fixed Income Sector Weightings % | Fondo  |
|----------------------------------|--------|
| ■ Governativo                    | 100,12 |
| ■ Societario                     | 0,00   |
| ■ Cartolarizzazioni              | 0,00   |
| ■ Enti Locali                    | 0,00   |
| ■ Liquidità ed equivalenti       | 0,00   |
| ■ Derivati                       | -0,12  |
| Coupon Range %                   | Fondo  |
| 0 coupon                         | 100,00 |
| Da 0 a 4 cedole                  | 0,00   |
| Da 4 a 6 cedole                  | 0,00   |
| Da 6 a 8 cedole                  | 0,00   |
| Da 8 a 10 cedole                 | 0,00   |
| Da 10 a 12 cedole                | 0,00   |
| Oltre 12 cedole                  | 0,00   |

| Ripartizione Geografica %     | Fondo       |
|-------------------------------|-------------|
| <b>America</b>                | <b>0,00</b> |
| Stati Uniti                   | -           |
| Canada                        | -           |
| America Latina e Centrale     | -           |
| <b>Europa</b>                 | <b>0,00</b> |
| Regno Unito                   | -           |
| Europa Occidentale - Euro     | -           |
| Europa Occidentale - Non Euro | -           |
| Europa dell'Est               | -           |
| Africa                        | -           |
| Medio Oriente                 | -           |
| <b>Asia</b>                   | <b>0,00</b> |
| Giappone                      | -           |
| Australasia                   | -           |
| Asia - Paesi Sviluppati       | -           |
| Asia - Emergente              | -           |

Anagrafica

|                      |                                       |                         |              |                              |                |
|----------------------|---------------------------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|----------------|
| Società di Gestione  | BNY Mellon Fund Management (Lux) S.A. | Patrimonio Classe (Mln) | 0,23 GBP     | Investimento Min. Ingresso   | 15.000.000 GBP |
| Telefono             | -                                     | (04/02/2026)            |              | Investimento Min. Successivo | -              |
| Web                  | http://www.bnymellonam.com            | Domicilio               | IRLANDA      | T.E.R.                       | 0,64%          |
| Data di Partenza     | 18/11/2021                            | Valuta del Fondo        | GBP          | Spese correnti               | 0,64%          |
| Nome del Gestore     | Ryan Arita                            | UCITS                   | Si           | Commissione di incentivo     | -              |
|                      | James Stavens                         | Inc/Acc                 | Acc          |                              |                |
|                      | Torrey Zaches                         | ISIN                    | IE000Y4VDQ23 |                              |                |
| Data Inizio Gestione | 12/10/2023                            |                         |              |                              |                |

# BNY Mellon Dynamic Factor Premia V10 Fund GBP W Acc Hedged

|                        |           |
|------------------------|-----------|
| NAV (03/02/2026)       | GBP 1,34  |
| Patrimonio Netto (Mln) | 40,86 USD |
| (31/12/2025)           |           |