

NEW MILLENNIUM

SOCIÉTÉ D'INVESTISSEMENT À CAPITAL VARIABLE

RENDICONTO DI GESTIONE SEMESTRALE NON CERTIFICATO AL 30 GIUGNO 2022

Società d'Investimento a Capitale Variabile
a Comparti Multipli

R.C.S. Luxembourg B71.256

Le sottoscrizioni potranno essere effettuate soltanto sulla base dell'ultimo prospetto aggiornato accompagnato dall'ultima relazione annuale disponibile e dall'ultima relazione semestrale, se posteriore alla relazione annuale.

INDICE

Organizzazione del Fondo	3	NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe	64
Prospetto Comparativo dei Patrimoni Netti degli ultimi 3 anni/periodi	5	Prospetto del Patrimonio Netto	64
Prospetto del Patrimonio Netto consolidato	7	Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	65
Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto consolidato	8	Portafoglio Titoli	66
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	9	NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond	68
Prospetto del Patrimonio Netto	9	Prospetto del Patrimonio Netto	68
Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	10	Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	69
Portafoglio Titoli	11	Portafoglio Titoli	70
Impegni su acquisto/vendita di contratti futures	17	Impegni su acquisto/vendita di contratti futures	73
Contratti finanziari a termine	18	Contratti finanziari a termine	74
Contratti Swap	19	NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing	75
NEW MILLENNIUM - Euro Equities	20	Prospetto del Patrimonio Netto	75
Prospetto del Patrimonio Netto	20	Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	76
Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	21	Portafoglio Titoli	77
Portafoglio Titoli	22	NEW MILLENNIUM - VolActive	78
Impegni su acquisto/vendita di contratti futures	25	Prospetto del Patrimonio Netto	78
NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)	26	Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	79
Prospetto del Patrimonio Netto	26	Portafoglio Titoli	80
Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	27	Impegni su acquisto/vendita di contratti futures	82
Portafoglio Titoli	28	NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond	83
Impegni su acquisto/vendita di contratti futures	31	Prospetto del Patrimonio Netto	83
NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term	32	Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	84
Prospetto del Patrimonio Netto	32	Portafoglio Titoli	85
Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	33	Impegni su acquisto/vendita di contratti futures	89
Portafoglio Titoli	34	Contratti finanziari a termine	90
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond	36	NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond	91
Prospetto del Patrimonio Netto	36	Prospetto del Patrimonio Netto	91
Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	37	Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	92
Portafoglio Titoli	38	Portafoglio Titoli	93
Contratti finanziari a termine	42	Contratti finanziari a termine	95
NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate	43	NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity	96
Prospetto del Patrimonio Netto	43	Prospetto del Patrimonio Netto	96
Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	44	Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	97
Portafoglio Titoli	45	Portafoglio Titoli	98
NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative	48	Impegni su acquisto/vendita di contratti futures	102
Prospetto del Patrimonio Netto	48	NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia	103
Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	49	Prospetto del Patrimonio Netto	103
Portafoglio Titoli	50	Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	104
NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible	55	Portafoglio Titoli	105
Prospetto del Patrimonio Netto	55	Note ai Rendiconti Finanziari	108
Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	56	Appendice non certificata	121
Portafoglio Titoli	57		
Impegni su acquisto/vendita di contratti futures	61		
Contratti di opzioni	62		
Contratti finanziari a termine	63		

ORGANIZZAZIONE DELLA SOCIETA**CONSIGLIO D'AMMINISTRAZIONE****Presidente****Mr. Sante JANNONI**

Direttore Generale
Natam Management Company S.A.
11 rue Béatrix de Bourbon
L-1225 Luxembourg

Amministratori**Mr. Emanuele BONABELLO**

Responsabile Direzione Investimenti e Relazioni Istituzionali
Banca Finnat Euramerica S.p.A.
49, Piazza del Gesù
I - 00186 Roma

Mr. Antonio MAUCERI

(fino al 29 Aprile 2022)
Socio
AZ Swiss & Partners S.A.
6, Via Marina
I - 20121 Milan

Mrs. Paola DE SIMONE

(dal 29 Aprile 2022)
Banca Finnat Euramerica S.p.A.
49, Piazza del Gesù
I - 00186 Roma

SOCIETA' DI GESTIONE**Natam Management Company S.A.**

11 rue Béatrix de Bourbon
L-1225 Luxembourg

Consiglio di Amministrazione della Società di Gestione**Mr. Alberto ALFIERO (Presidente)**

Vice Direttore Generale
Banca Finnat Euramerica S.p.A.
49, Piazza del Gesù
I - 00186 Roma

Mr. Gianluca COSTANTINI (Amministratore)

Reponsabile direzione amministrazione
Banca Finnat Euramerica S.p.A.
49, Piazza del Gesù
I - 00186 Roma

Mr. Alex SCHMITT (Amministratore)

Socio
Bonn&Schmitt
148, Avenue de la Faïencerie
L-1511 Luxembourg

Incaricati della Società di Gestione**Mr. Pietro MISSERI**

Responsabile Gestione Rischi
Natam Management Company S.A.
11 Rue Béatrix de Bourbon
L-1225 Luxembourg

Mr. Sante JANNONI

Direttore Generale
Natam Management Company S.A.
11 rue Béatrix de Bourbon
L-1225 Luxembourg

Mr. Alberto ALFIERO

Vice Direttore Generale
Banca Finnat Euramerica S.p.A.
49, Piazza del Gesù
I - 00186 Roma

SEDE LEGALE

49, avenue J.F. Kennedy
L - 1855 Luxembourg

DISTRIBUTORE GLOBALE

Banca Finnat Euramerica S.p.A

49, Piazza del Gesù
I - 00186 Roma

BANCA DEPOSITARIA

State Street Bank International GmbH, Filiale di Lussemburgo.

49, avenue J.F. Kennedy
L - 1855 Luxembourg

AMMINISTRAZIONE CENTRALE

State Street Bank International GmbH, Filiale di Lussemburgo.

49, avenue J.F. Kennedy
L - 1855 Luxembourg

REVISORE CONTABILE

**PricewaterhouseCoopers,
Société coopérative**

2, rue Gerhard Mercator
L - 2182 Luxembourg

COMPARATIVO DEI VALORI NETTI D'INVENTARIO DEGLI ULTIMI TRE ANNI

	Valuta	30 Giugno 2022		31 Dicembre 2021		31 Dicembre 2020	
		Totale NAV	per Azione	Totale NAV	per Azione	Totale NAV	per Azione
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond							
Azione A	EUR	34,709,017.98	206.37	43,824,847.98	230.58	47,871,925.90	225.99
Azione A (H-CHF)	CHF	1,949,154.73	92.02	3,614,686.20	103.06	2,837,841.55	101.57
Azione A (H-USD)	USD	6,645,319.49	101.92	7,579,023.45	112.90	5,914,673.84	110.21
Azione D	EUR	9,443,284.05	89.50	11,965,330.69	103.63	11,012,744.37	105.24
Azione I	EUR	229,228,579.62	224.24	261,000,262.47	249.58	284,616,800.47	242.93
Azione L	EUR	83,804.97	221.12	93,359.18	246.33	75,652.49	240.17
Azione Y	EUR	1,252,550.21	181.34	1,444,644.15	209.15	3,039,190.33	210.95
Azione Z	EUR	13,895,387.05	88.50	15,720,164.88	100.12	15,814,967.66	100.72
Totale attivo netto	EUR	297,207,098.10		345,242,319.00		369,889,157.15	
NEW MILLENNIUM - Euro Equities							
Azione A	EUR	4,933,302.63	58.23	7,004,797.81	71.71	5,780,433.13	61.15
Azione I	EUR	21,821,891.82	64.50	27,831,532.13	79.09	21,361,766.75	66.88
Azione L	EUR	177,309.17	63.76	217,641.61	78.26	184,387.72	66.30
Azione Y	EUR	819,179.11	57.48	1,091,193.95	76.56	1,623,173.72	67.20
Totale attivo netto	EUR	27,751,682.73		36,145,165.50		28,949,761.32	
NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)							
Azione A	EUR	2,880,098.54	103.17	3,545,186.75	128.54	3,291,487.19	108.29
Azione I	EUR	34,076,626.85	114.72	39,385,485.18	142.35	25,786,950.80	118.92
Azione L	EUR	212,570.23	113.31	264,003.82	140.73	216,260.46	117.79
Totale attivo netto	EUR	37,169,295.62		43,194,675.75		29,294,698.45	
NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term							
Azione A	EUR	2,221,752.66	130.05	2,484,198.60	132.64	2,610,764.27	133.96
Azione D	EUR	12,765.01	91.34	31,689.46	93.63	63,835.68	95.03
Azione I	EUR	9,001,784.53	135.36	9,507,911.01	137.86	9,170,562.84	138.82
Azione L	EUR	1,955,434.84	133.47	2,009,760.30	136.06	2,468,934.81	137.27
Azione Y	EUR	2,834.71	134.21	2,899.56	137.28	2,928.92	138.67
Totale attivo netto	EUR	13,194,571.75		14,036,458.93		14,317,026.52	
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond							
Azione A	EUR	41,511,510.55	151.01	35,326,318.29	155.44	26,815,575.28	152.41
Azione A (H-CHF)	CHF	16,731.89	93.04	16,640.85	95.79	1,051,979.64	96.89
Azione A (H-USD)	USD	1,458,835.67	102.81	425,199.56	106.62	593,558.83	107.24
Azione D	EUR	14,407,155.95	86.10	14,100,250.29	90.90	7,396,142.72	91.41
Azione I	EUR	81,322,101.71	159.19	94,812,757.99	163.42	93,787,900.01	159.49
Azione L	EUR	35,229.97	157.28	36,201.21	161.61	35,387.48	157.98
Azione Y	EUR	0.00	0.00	0.00	0.00	1,071,857.18	144.55
Totale attivo netto	EUR	138,751,565.83		144,717,368.19		130,564,627.77	
NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate							
Azione A	EUR	2,565,527.52	127.38	3,284,228.92	138.47	3,725,558.63	140.43
Azione D	EUR	245,299.52	105.32	319,426.89	115.06	322,549.78	117.28
Azione I	EUR	54,427,902.60	135.58	64,189,577.90	147.02	67,766,971.60	148.38
Azione L	EUR	2,200,995.47	133.87	2,388,933.54	145.30	2,734,405.04	146.92
Azione Y	EUR	5,516,263.93	133.32	6,011,894.76	145.30	6,098,058.31	147.39
Totale attivo netto	EUR	64,955,989.04		76,194,062.01		80,647,543.36	
NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative							
Azione A	EUR	47,914,537.32	140.41	54,820,864.02	155.13	43,302,468.86	153.03
Azione D	EUR	941,392.66	140.14	1,041,984.74	155.11	0.00	0.00
Azione I	EUR	14,855,404.64	152.40	16,886,124.27	167.89	6,719,017.94	164.66
Azione L	EUR	14,123,180.47	150.65	16,895,552.78	166.11	16,536,718.16	163.20
Totale attivo netto	EUR	77,834,515.09		89,644,525.81		66,558,204.96	
NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible							
Azione A	EUR	2,949,662.83	118.23	3,261,223.12	128.38	15,404,826.03	123.95
Azione I	EUR	2,999,725.20	97.10	3,251,011.71	105.24	0.00	0.00
Azione L	EUR	10,878,065.79	118.03	11,904,109.35	128.03	0.00	0.00
Totale attivo netto	EUR	16,827,453.91		18,416,344.18		15,404,826.03	
NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe							
Azione A	EUR	2,829,607.70	108.50	2,280,268.48	109.05	870,257.40	105.48
Azione I	EUR	31,455,829.42	114.92	31,790,974.89	115.25	19,486,567.21	110.99
Azione L	EUR	1,250,271.54	113.26	1,255,069.95	113.69	1,161,598.89	109.70
Azione Y	EUR	2,475,641.64	112.55	2,495,359.63	113.45	3,033.33	109.66
Totale attivo netto	EUR	38,011,350.30		37,821,672.95		21,521,456.83	

COMPARATIVO DEI VALORI NETTI D'INVENTARIO DEGLI ULTIMI TRE ANNI

	Valuta	30 Giugno 2022		31 Dicembre 2021		31 Dicembre 2020	
		Totale NAV	per Azione	Totale NAV	per Azione	Totale NAV	per Azione
NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond							
Azione A	EUR	2,168,321.62	123.60	2,386,800.20	137.42	1,772,946.47	133.85
Azione D	EUR	651,548.42	94.86	1,295,719.60	108.74	1,510,927.59	109.16
Azione I	EUR	52,044,264.70	132.59	60,088,275.28	146.85	63,417,055.12	142.00
Azione L	EUR	166,915.06	131.02	174,576.56	145.24	126,478.61	140.69
Totale attivo netto	EUR	55,031,049.81		63,945,371.64		66,827,407.79	
NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing							
Azione A	EUR	2,326,907.42	103.85	2,513,823.21	112.82	2,462,317.77	106.69
Azione D	EUR	265,374.88	83.73	295,687.24	93.29	295,551.89	90.49
Azione I	EUR	707,447.12	113.19	764,743.58	122.36	716,485.16	114.64
Azione L	EUR	1,023.71	113.75	1,104.87	122.76	1,035.49	115.05
Azione Y	EUR	2,914.15	96.79	3,233.94	107.41	3,107.85	103.22
Totale attivo netto	EUR	3,303,667.28		3,578,592.84		3,478,498.16	
NEW MILLENNIUM - VolActive							
Azione A	EUR	537,621.94	88.67	641,261.02	101.74	473,813.15	97.64
Azione D	EUR	790.86	68.43	947.22	81.96	5,912.52	80.23
Azione I	EUR	3,922,963.94	97.23	5,768,675.32	110.93	6,749,548.80	105.85
Azione L	EUR	8,523.98	95.78	9,733.65	109.37	9,308.84	104.59
Totale attivo netto	EUR	4,469,900.72		6,420,617.21		7,238,583.31	
NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond							
Azione A	EUR	331,688.68	104.71	47,733.28	107.16	159,403.31	103.03
Azione D	EUR	138,204.28	78.78	147,308.68	83.96	266,454.97	84.10
Azione I	EUR	54,019,645.42	110.04	61,686,719.19	112.15	55,758,242.85	106.93
Azione L	EUR	28,278.01	108.76	28,846.90	110.95	27,554.08	105.98
Totale attivo netto	EUR	54,517,816.40		61,910,608.05		56,211,655.21	
NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond							
Azione A	EUR	342,376.55	79.77	385,597.90	89.84	1,267,221.27	83.66
Azione I	EUR	1,372,485.65	84.16	1,944,726.53	94.37	2,184,878.01	87.09
Azione L	EUR	0.00	0.00	0.00	0.00	51,831.59	86.39
Totale attivo netto	EUR	1,714,862.29		2,330,324.43		3,503,930.87	
NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity							
Azione A	EUR	23,862,358.82	97.60	26,667,411.35	108.17	26,122,794.74	102.57
Azione I	EUR	4,461,764.65	100.34	4,246,726.37	110.94	188,773.63	104.87
Azione L	EUR	66,607,087.36	99.45	73,305,920.19	110.05	70,663,743.26	104.09
Totale attivo netto	EUR	94,931,210.83		104,220,057.91		96,975,311.63	
NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia							
Azione A	EUR	5,056,303.13	93.45	6,078,324.54	109.15	4,999,310.40	100.95
Azione I	EUR	3,419,733.99	96.21	4,046,707.49	112.04	3,902,794.28	103.22
Azione L	EUR	188,310.13	95.35	219,486.46	111.13	202,527.59	102.55
Totale attivo netto	EUR	8,664,347.25		10,344,518.49		9,104,632.27	

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO CONSOLIDATO AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR**Attività**

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	875,181,815.84
Liquidità bancarie a vista		17,534,790.15
Importi dovuti dai broker	(Nota 12)	42,452,870.64
Premio pagato su contratti swap	(Nota 2f)	12,879.00
Contratti di opzioni al valore di mercato	(Note 2e, 12)	28,887.09
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	(Note 2c, 12)	281,822.47
Utili non realizzati su contratti futures	(Note 2d, 12)	33,154.71
Interessi da ricevere su contratti swap		22,404.99
Dividendi da ricevere		43,455.22
Interessi da ricevere		7,969,955.49
Da ricevere su sottoscrizioni		406,897.08
Altre attività		751,512.08
Totale attività		944,720,444.76

Passività

Scoperti bancari		-2,647,576.57
Premio ricevuto su contratti swap	(Nota 2f)	-204,454.69
Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	(Note 2c, 12)	-479,579.34
Perdite non realizzate su contratti futures	(Note 2d, 12)	-1,352,160.59
Perdite non realizzate su contratti swap	(Note 2f, 12)	-1,246,411.53
Da pagare su acquisto titoli		-730,448.77
Da pagare su rimborsi		-410,280.90
Altre passività		-3,313,155.42
Totale passività		-10,384,067.81

Totale attivo netto**934,336,376.95**

PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO CONSOLIDATO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Attivo netto all'inizio del periodo		1,058,162,682.89
Risultato netto degli investimenti		17,604,450.31
Interessi ricevuti da contratti swap		38,776.91
Altri ricavi		654,597.31
Totale ricavi		18,297,824.53
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-4,669,730.17
Commissioni sulla performance	(Nota 6)	-2,316.97
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 7)	-278,984.40
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-103,471.20
Interessi pagati su contratti swap		-296,312.60
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 7)	-345,042.48
Commissioni del Transfer Agent		-118,657.16
Compensi professionali	(Nota 8)	-95,627.10
Pubblicazioni		-78,910.14
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-337,034.80
Totale costi		-6,326,087.02
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		11,971,737.51
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	8,504,291.62
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		-21,365,493.94
- di contratti di opzioni		-198,825.91
- di contratti futures		-2,008,513.74
- di contratti swap		1,628,253.23
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		-88,647,807.10
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(Nota 2c)	6,192,590.22
- sulle opzioni		3,642.06
- su contratti futures	(Nota 2d)	-2,980,272.48
- su contratti swap		-1,031,228.58
Risultato netto delle operazioni per il periodo		-87,931,627.11
Distribuzioni di dividendi	(Nota 14)	-1,276,416.74
Sottoscrizioni del periodo		84,904,722.66
Rimborsi del periodo		-119,522,984.75
Attivo netto alla fine del periodo		934,336,376.95

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Attività

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	273,250,471.00
Liquidità bancarie a vista		452,150.66
Importi dovuti dai broker	(Nota 12)	23,056,683.15
Premio pagato su contratti swap	(Nota 2f)	12,879.00
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	(Note 2c, 12)	187,910.99
Interessi da ricevere su contratti swap		22,404.99
Interessi da ricevere		4,054,575.02
Da ricevere su sottoscrizioni		108,119.54
Altre attività		200,614.87
Totale attività		301,345,809.22

Passività

Scoperti bancari		-1,031,383.51
Premio ricevuto su contratti swap	(Nota 2f)	-204,454.69
Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	(Note 2c, 12)	-264,991.61
Perdite non realizzate su contratti futures	(Note 2d, 12)	-453,790.00
Perdite non realizzate su contratti swap	(Note 2f, 12)	-1,246,411.53
Da pagare su rimborsi		-44,807.51
Altre passività		-892,872.27
Totale passività		-4,138,711.12

Totale attivo netto**297,207,098.10**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	206.37	168,189.609
Azione A (H-CHF)	CHF	92.02	21,198.967
Azione A (H-USD)	USD	101.92	68,161.555
Azione D	EUR	89.50	105,516.383
Azione I	EUR	224.24	1,022,226.527
Azione L	EUR	221.12	379.000
Azione Y	EUR	181.34	6,907.351
Azione Z	EUR	88.50	157,011.448

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Attivo netto all'inizio del periodo		345,242,319.00
Risultato netto degli investimenti		6,505,808.56
Interessi ricevuti da contratti swap		38,776.91
Altri ricavi		193,507.12
Totale ricavi		6,738,092.59
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-1,418,732.44
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 7)	-89,189.97
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-25,180.98
Interessi pagati su contratti swap		-256,414.90
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 7)	-52,568.39
Commissioni del Transfer Agent		-23,092.09
Compensi professionali	(Nota 8)	-15,227.02
Pubblicazioni		-1,018.98
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-94,448.94
Totale costi		-1,975,873.71
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		4,762,218.88
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	6,412,778.92
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		-14,339,618.76
- di contratti futures		2,152,147.65
- di contratti swap		1,493,718.23
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		-35,436,561.49
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(Nota 2c)	4,024,557.51
- su contratti futures	(Nota 2d)	-1,436,141.61
- su contratti swap		-1,053,228.41
Risultato netto delle operazioni per il periodo		-33,420,129.08
Distribuzioni di dividendi	(Nota 14)	-738,192.07
Sottoscrizioni del periodo		33,559,342.74
Rimborsi del periodo		-47,436,242.49
Attivo netto alla fine del periodo		297,207,098.10

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			292,628,741.86	273,250,471.00	91.94
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			249,908,916.58	232,141,491.78	78.11
Azioni			655,941.32	617,242.40	0.21
LUSSEMBURGO			655,941.32	617,242.40	0.21
Beni di prima necessità			655,941.32	617,242.40	0.21
800,000.00	MINERVA LUXEMBOURG SA	USD	655,941.32	617,242.40	0.21
Obbligazioni ordinarie			100,869,483.04	95,540,057.73	32.15
REGNO UNITO			26,059,817.61	26,668,747.05	8.97
Sovranazionale			15,693,423.52	16,560,303.94	5.57
105,000,000.00	EUROPEAN BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT 5.00% 27/01/2025	BRL	15,693,423.52	16,560,303.94	5.57
Beni voluttuari			5,857,293.29	5,925,363.16	1.99
2,250,000.00	INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY PLC 3.50% 15/06/2026	EUR	1,935,055.00	2,055,960.00	0.69
1,600,000.00	JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC 3.88% 01/03/2023	GBP	1,705,027.77	1,791,231.77	0.60
1,000,000.00	JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC 7.75% 15/10/2025	USD	949,860.52	897,661.39	0.30
1,000,000.00	JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC 4.50% 15/07/2028	EUR	803,500.00	719,050.00	0.24
500,000.00	JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC 5.88% 15/11/2024	EUR	463,850.00	461,460.00	0.16
Finanza			4,509,100.80	4,183,079.95	1.41
2,000,000.00	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC REG 6.63% 18/12/2025	GBP	2,801,007.14	2,407,270.30	0.81
2,000,000.00	PRUDENTIAL PLC 4.88% 24/10/2022	USD	1,708,093.66	1,775,809.65	0.60
ITALIA			18,451,735.70	17,260,912.33	5.81
Finanza			12,471,140.00	11,525,071.33	3.88
4,500,000.00	BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA 3.63% 24/09/2024	EUR	4,500,000.00	4,167,270.00	1.40
3,499,000.00	VITTORIA ASSICURAZIONI SPA 5.75% 11/07/2028	EUR	3,809,105.00	3,618,560.83	1.22
2,950,000.00	UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA 3.88% 01/03/2028	EUR	3,060,535.00	2,716,920.50	0.92
1,000,000.00	EUROVITA ASSICURAZIONI SPA 6.00% 22/12/2025	EUR	1,101,500.00	1,022,320.00	0.34
Industria			5,091,665.70	4,876,998.00	1.64
3,600,000.00	SALINI IMPREGILO SPA 1.75% 26/10/2024	EUR	3,306,895.70	3,294,612.00	1.11
1,000,000.00	WEBUILD SPA 5.88% 15/12/2025	EUR	1,089,950.00	915,930.00	0.31
700,000.00	LEONARDO SPA 2.38% 08/01/2026	EUR	694,820.00	666,456.00	0.22
Beni voluttuari			888,930.00	858,843.00	0.29
900,000.00	PIAGGIO & C SPA 3.63% 30/04/2025	EUR	888,930.00	858,843.00	0.29
STATI UNITI			12,515,991.18	12,054,080.42	4.06
Servizi di telecomunicazione			3,861,650.00	3,441,014.00	1.16
3,800,000.00	NETFLIX INC 3.88% 15/11/2029	EUR	3,861,650.00	3,441,014.00	1.16
Informatica			3,497,405.92	3,281,743.14	1.10
1,925,000.00	LEIDOS HOLDINGS INC 5.95% 01/12/2040	USD	1,913,766.44	1,756,906.78	0.59
2,000,000.00	LEIDOS INC 2.30% 15/02/2031	USD	1,583,639.48	1,524,836.36	0.51
Salute			2,916,290.17	2,819,188.21	0.95
3,000,000.00	ST JUDE MEDICAL LLC 4.75% 15/04/2043	USD	2,916,290.17	2,819,188.21	0.95
Sovranazionale			1,168,142.02	1,421,563.61	0.48
100,000,000.00	INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT 6.75% 14/11/2022	RUB	1,168,142.02	1,421,563.61	0.48
Beni voluttuari			1,072,503.07	1,090,571.46	0.37
1,000,000.00	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.54% 06/03/2025	GBP	1,072,503.07	1,090,571.46	0.37

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
LUSSEMBURGO			10,362,640.91	8,859,125.32	2.98
Sovranazionale			4,374,906.86	4,529,690.98	1.52
30,000,000.00	INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT SARL 4.88% 22/01/2026	BRL	4,374,906.86	4,529,690.98	1.52
Finanza			2,749,869.42	2,687,326.21	0.90
2,300,000.00	MEXICO REMITTANCES FUNDING FIDUCIARY ESTATE MANAGEMENT SARL 4.88% 15/01/2028	USD	1,882,109.09	1,800,224.02	0.60
5,326,050.00	SWISS INSURED BRAZIL POWER FINANCE SARL 9.85% 16/07/2032	BRL	867,760.33	887,102.19	0.30
Energia			2,293,052.48	907,447.24	0.31
1,000,000.00	GAZPROM PJSC VIA GAZ CAPITAL SA 1.45% 06/03/2023	CHF	922,525.96	469,305.72	0.16
1,500,000.00	GAZPROM PJSC VIA GAZ CAPITAL SA 5.15% 11/02/2026	USD	1,370,526.52	438,141.52	0.15
Servizi di telecomunicazione			944,812.15	734,660.89	0.25
1,005,000.00	TELECOM ITALIA CAPITAL SA 7.20% 18/07/2036	USD	944,812.15	734,660.89	0.25
FRANCIA			5,499,732.35	5,441,474.00	1.83
Beni voluttuari			4,507,232.35	4,547,034.00	1.53
2,800,000.00	AIR FRANCE-KLM 1.88% 16/01/2025	EUR	2,278,360.00	2,366,084.00	0.80
8,000,000.00	AIR FRANCE-KLM 0.13% 25/03/2026	EUR	1,247,872.35	1,249,840.00	0.42
1,000,000.00	AIR FRANCE-KLM 3.00% 01/07/2024	EUR	981,000.00	931,110.00	0.31
Servizi di telecomunicazione			992,500.00	894,440.00	0.30
1,000,000.00	ILIAD HOLDING SASU 5.13% 15/10/2026	EUR	992,500.00	894,440.00	0.30
CINA			2,644,364.49	2,865,334.27	0.96
Sovranazionale			2,644,364.49	2,865,334.27	0.96
20,000,000.00	ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.90% 05/03/2024	CNY	2,644,364.49	2,865,334.27	0.96
MESSICO			3,082,800.00	2,795,760.00	0.94
Industria			3,082,800.00	2,795,760.00	0.94
3,000,000.00	CEMEX SAB DE CV 3.13% 19/03/2026	EUR	3,082,800.00	2,795,760.00	0.94
SPAGNA			3,268,730.00	2,646,567.00	0.89
Industria			3,268,730.00	2,646,567.00	0.89
2,900,000.00	CELLNEX FINANCE CO SA 2.00% 15/09/2032	EUR	2,511,230.00	1,977,887.00	0.67
1,000,000.00	CELLNEX FINANCE CO SA 2.00% 15/02/2033	EUR	757,500.00	668,680.00	0.22
GERMANIA			2,647,767.37	2,644,430.91	0.89
Finanza			1,447,579.38	1,357,253.00	0.46
2,000,000.00	ALLIANZ SE 3.88% 29/12/2049	USD	1,447,579.38	1,357,253.00	0.46
Materie prime			1,200,187.99	1,287,177.91	0.43
1,400,000.00	THYSSENKRUPP AG 4.13% 26/01/2026	USD	1,200,187.99	1,287,177.91	0.43
GIAPPONE			2,250,000.00	2,106,337.50	0.71
Beni voluttuari			2,250,000.00	2,106,337.50	0.71
2,250,000.00	NISSAN MOTOR CO LTD 2.65% 17/03/2026	EUR	2,250,000.00	2,106,337.50	0.71
CANADA			2,063,646.57	1,969,601.82	0.66
Materie prime			2,063,646.57	1,969,601.82	0.66
2,000,000.00	KINROSS GOLD CORP 6.88% 01/09/2041	USD	2,063,646.57	1,969,601.82	0.66
JERSEY			2,174,601.96	1,845,594.30	0.62
Beni voluttuari			1,130,835.80	1,093,667.92	0.37
1,250,000.00	ASTON MARTIN CAPITAL HOLDINGS LTD 10.50% 30/11/2025	USD	1,130,835.80	1,093,667.92	0.37
Servizi di telecomunicazione			1,043,766.16	751,926.38	0.25
1,000,000.00	CORNWALL JERSEY LTD 0.75% 16/04/2026	GBP	1,043,766.16	751,926.38	0.25

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
FILIPPINE			1,173,253.93	1,209,409.32	0.41
Sovranazionale			1,173,253.93	1,209,409.32	0.41
100,000,000.00	ASIAN DEVELOPMENT BANK 5.90% 20/12/2022	INR	1,173,253.93	1,209,409.32	0.41
IRLANDA			2,482,794.96	1,058,878.04	0.36
Materie prime			1,351,636.80	797,911.03	0.27
1,600,000.00	MMC NORILSK NICKEL OJSC VIA MMC FINANCE DAC 2.55% 11/09/2025	USD	1,351,636.80	797,911.03	0.27
Finanza			835,864.93	159,644.19	0.05
1,000,000.00	GTLK EUROPE CAPITAL DAC 4.80% 26/02/2028	USD	835,864.93	159,644.19	0.05
Industria			295,293.23	101,322.82	0.04
1,210,000.00	RUSSIAN RAILWAYS VIA RZD CAPITAL PLC 2.10% 02/10/2023	CHF	295,293.23	101,322.82	0.04
HONG KONG			855,662.64	972,719.99	0.33
Materie prime			855,662.64	972,719.99	0.33
1,000,000.00	CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 4.88% 14/03/2025	USD	855,662.64	972,719.99	0.33
EMIRATI ARABI UNITI			802,536.73	960,658.19	0.32
Servizi di telecomunicazione			802,536.73	960,658.19	0.32
1,000,000.00	OZTEL HOLDINGS SPC LTD 5.63% 24/10/2023	USD	802,536.73	960,658.19	0.32
OMAN			826,842.42	922,990.20	0.31
Enti Governativi			826,842.42	922,990.20	0.31
1,000,000.00	OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.63% 17/01/2028	USD	826,842.42	922,990.20	0.31
PAESI BASSI			900,000.00	850,120.00	0.29
Salute			900,000.00	850,120.00	0.29
1,000,000.00	TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NETHERLANDS II BV 3.75% 09/05/2027	EUR	900,000.00	850,120.00	0.29
GUERNSEY			831,000.00	820,020.00	0.28
Finanza			831,000.00	820,020.00	0.28
1,000,000.00	PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD 1.38% 01/10/2027	EUR	831,000.00	820,020.00	0.28
ISRAELE			591,840.90	674,020.83	0.23
Energia			591,840.90	674,020.83	0.23
700,000.00	DELEK OVERRIDING ROYALTY LEVIATHAN LTD 7.49% 30/12/2023	USD	591,840.90	674,020.83	0.23
BRASILE			648,148.32	663,346.24	0.22
Servizi di pubblica utilità			648,148.32	663,346.24	0.22
665,000.00	CEMIG GERACAO E TRANSMISSAO SA 9.25% 05/12/2024	USD	648,148.32	663,346.24	0.22
UCRAINA			735,575.00	249,930.00	0.08
Enti Governativi			735,575.00	249,930.00	0.08
1,000,000.00	UKRAINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.38% 27/01/2030	EUR	735,575.00	249,930.00	0.08
Obbligazioni a tasso variabile			125,615,011.85	114,375,856.76	38.48
ITALIA			78,370,909.99	73,090,031.38	24.59
Finanza			70,139,385.37	64,605,136.96	21.74
10,800,000.00	UNIONE DI BANCHE ITALIANE SPA REG FRN 31/12/2099	EUR	10,484,500.00	9,963,216.00	3.35
9,236,000.00	FINECOBANK BANCA FINECO SPA FRN 31/12/2099	EUR	9,633,670.00	8,871,178.00	2.99
7,500,000.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA FRN 29/06/2049	GBP	7,336,565.96	8,602,708.51	2.89
7,000,000.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA FRN 08/06/2048	EUR	7,398,000.00	6,889,820.00	2.32
5,750,000.00	UNICREDIT SPA FRN 31/12/2099	EUR	6,199,582.64	5,468,307.50	1.84
5,000,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 31/12/2099	EUR	5,360,191.06	4,768,550.00	1.60
5,000,000.00	UNICREDIT SPA FRN 31/12/2099	EUR	6,020,500.00	4,626,850.00	1.56

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
3,000,000.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA FRN 30/11/2049	EUR	3,326,500.00	2,907,330.00	0.98
3,015,000.00	UNICREDIT SPA FRN 31/12/2099	EUR	2,999,825.71	2,608,366.95	0.88
3,000,000.00	ICCREA BANCA SPA FRN 18/01/2032	EUR	3,000,000.00	2,535,420.00	0.85
2,500,000.00	ICCREA BANCA SPA REG FRN 28/11/2029	EUR	2,528,500.00	2,353,250.00	0.79
2,000,000.00	BANCO BPM SPA REG FRN 31/12/2099	EUR	2,164,000.00	1,797,520.00	0.61
1,500,000.00	UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA FRN 31/12/2099	EUR	1,500,000.00	1,319,970.00	0.44
1,000,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 29/12/2049	EUR	1,126,500.00	951,640.00	0.32
1,000,000.00	SOCIETA CATTOLICA DI ASSICURAZIONI SC FRN 14/12/2047	EUR	1,061,050.00	941,010.00	0.32
Servizi di pubblica utilità			6,374,374.62	6,902,234.42	2.32
7,035,000.00	ENEL SPA FRN 24/09/2073	USD	6,374,374.62	6,902,234.42	2.32
Energia			1,857,150.00	1,582,660.00	0.53
2,000,000.00	ENI SPA FRN 31/12/2099	EUR	1,857,150.00	1,582,660.00	0.53
PAESI BASSI			8,430,155.43	7,966,787.95	2.68
Finanza			8,430,155.43	7,966,787.95	2.68
13,000,000.00	AEGON NV FRN 29/06/2049	NLG	5,303,559.73	5,350,994.46	1.80
2,190,000.00	ACHMEA BV FRN 31/12/2099	EUR	2,205,488.70	1,833,030.00	0.62
1,000,000.00	ING GROEP NV REG FRN 31/12/2099	USD	921,107.00	782,763.49	0.26
REGNO UNITO			9,592,022.75	7,890,724.28	2.66
Finanza			5,888,974.61	5,018,538.74	1.69
2,500,000.00	ROTHESAY LIFE PLC REG FRN 31/12/2099	GBP	3,500,478.26	2,727,328.94	0.92
1,000,000.00	STANDARD CHARTERED PLC FRN 29/01/2049	USD	846,482.85	778,459.12	0.26
1,000,000.00	BARCLAYS BANK PLC FRN 28/12/2040	EUR	773,750.00	774,370.00	0.26
1,000,000.00	HSBC BANK PLC FRN 29/06/2049	USD	768,263.50	738,380.68	0.25
Energia			3,703,048.14	2,872,185.54	0.97
3,000,000.00	BP CAPITAL MARKETS PLC FRN 31/12/2099	USD	2,703,048.14	2,706,815.54	0.91
1,000,000.00	GAZPROM PJSC VIA GAZ FINANCE PLC FRN 31/12/2099	EUR	1,000,000.00	165,370.00	0.06
FRANCIA			7,379,635.30	7,224,315.13	2.43
Finanza			7,379,635.30	7,224,315.13	2.43
4,000,000.00	BNP PARIBAS SA FRN 31/12/2099	USD	3,287,729.00	3,211,823.00	1.08
2,000,000.00	LA MONDIALE SAM FRN 18/01/2048	USD	1,770,247.67	1,755,282.60	0.59
1,000,000.00	CREDIT AGRICOLE SA FRN 31/12/2099	USD	934,928.81	926,242.39	0.31
1,000,000.00	BNP PARIBAS SA FRN 31/12/2099	USD	921,729.82	919,757.14	0.31
500,000.00	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA FRN 29/12/2049	EUR	465,000.00	411,210.00	0.14
LUSSEMBURGO			9,211,146.18	6,370,736.47	2.14
Finanza			9,211,146.18	6,370,736.47	2.14
9,100,000.00	MITSUBISHI UFJ INVESTOR SERVICES & BANKING LUXEMBOURG SA FRN 15/12/2050	EUR	5,634,314.18	3,138,317.00	1.05
2,800,000.00	HELVETIA EUROPE SA FRN 30/09/2041	EUR	2,676,012.00	2,336,432.00	0.79
1,000,000.00	SWISS RE FINANCE LUXEMBOURG SA FRN 31/12/2099	USD	900,820.00	895,987.47	0.30
STATI UNITI			4,828,906.25	4,376,000.00	1.47
Servizi di telecomunicazione			4,828,906.25	4,376,000.00	1.47
5,000,000.00	AT&T INC FRN 31/12/2099	EUR	4,828,906.25	4,376,000.00	1.47
SPAGNA			2,661,805.55	2,575,260.00	0.87
Finanza			2,661,805.55	2,575,260.00	0.87
3,000,000.00	BANCO SANTANDER SA FRN 31/12/2099	EUR	2,661,805.55	2,575,260.00	0.87
GERMANIA			2,392,445.86	2,111,205.93	0.71
Enti Governativi			2,392,445.86	2,111,205.93	0.71
3,000,000.00	ALLIANZ SE FRN 31/12/2099	USD	2,392,445.86	2,111,205.93	0.71

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
KUWAIT			1,026,483.04	1,034,205.48	0.35
Finanza			1,026,483.04	1,034,205.48	0.35
1,300,000.00	BURGAN BANK SAK FRN 15/12/2031	USD	1,026,483.04	1,034,205.48	0.35
GIAPPONE			790,000.00	697,730.00	0.23
Servizi di telecomunicazione			790,000.00	697,730.00	0.23
1,000,000.00	RAKUTEN GROUP INC FRN 31/12/2099	EUR	790,000.00	697,730.00	0.23
AUSTRALIA			578,394.51	694,916.14	0.23
Finanza			578,394.51	694,916.14	0.23
1,000,000.00	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD FRN 29/10/2049	USD	578,394.51	694,916.14	0.23
ISOLE CAYMAN			353,106.99	343,944.00	0.12
Finanza			353,106.99	343,944.00	0.12
360,000.00	EMERGING MARKETS CAPITAL PROTECTED INVESTMENTS LTD FRN 20/04/2028	EUR	353,106.99	343,944.00	0.12
Obbligazioni zero coupon			997,046.39	1,061,844.30	0.36
CILE			997,046.39	1,061,844.30	0.36
Servizi di pubblica utilità			997,046.39	1,061,844.30	0.36
1,500,000.00	CHILE ELECTRICITY PEC SPA 0.00% 25/01/2028	USD	997,046.39	1,061,844.30	0.36
Azioni di OICR			20,367,650.43	19,194,103.18	6.46
LUSSEMBURGO			20,367,650.43	19,194,103.18	6.46
Finanza			20,367,650.43	19,194,103.18	6.46
1,708,812.51	AZ FUND 1 CGM OPPORTUNISTIC CORPORATE BOND -A-	EUR	11,000,000.00	9,796,622.09	3.30
40,326.65	PLANETARIUM FUND - ENHANCED EURO CREDIT	EUR	4,000,000.02	3,668,111.72	1.23
29,985.37	PLANETARIUM FUND - EURO CURRENCIES BONDS	EUR	2,500,000.01	2,570,945.71	0.87
281,320.33	AZ FUND 1 - AZ BOND TARGET 2024 USD	USD	1,243,884.00	1,261,764.00	0.42
191,497.51	AZ MULTI ASSET - MAMG GLOBAL SUKUK	USD	809,651.00	1,035,839.63	0.35
184,150.64	AZ FUND 1-AZ BOND-US DOLLAR AGGREGATE -A-	USD	814,115.40	860,820.03	0.29
Titoli garantiti da Ipotecche immobiliari e da collaterale			1,403,783.55	1,352,387.41	0.45
ITALIA			1,403,783.55	1,352,387.41	0.45
Finanza			1,403,783.55	1,352,387.41	0.45
1,423,715.56	SPV PROJECT SRL 7.00% 15/11/2037*	EUR	1,403,783.55	1,352,387.41	0.45
NEGOZIATI SU UN ALTRO MERCATO REGOLAMENTATO			34,249,767.09	33,985,973.88	11.43
Obbligazioni ordinarie			32,022,275.90	31,626,195.55	10.64
STATI UNITI			15,982,353.59	16,566,867.82	5.57
Industria			10,445,089.87	10,809,239.28	3.64
9,000,000.00	LEONARDO US HOLDINGS INC 6.25% 15/01/2040	USD	8,580,969.36	8,790,722.64	2.96
1,850,000.00	LEONARDO US HOLDINGS INC 7.38% 15/07/2039	USD	1,864,120.51	2,018,516.64	0.68
Beni voluttuari			3,496,126.56	3,686,110.79	1.24
1,753,000.00	DELTA AIR LINES INC 7.00% 01/05/2025	USD	1,665,620.94	1,699,124.92	0.57
1,500,000.00	MICHAEL KORS USA INC 4.25% 01/11/2024	USD	1,284,443.05	1,380,467.89	0.46
429,585.60	AMERICAN AIRLINES 2013-2 CLASS A PASS THROUGH TRUST 4.95% 15/01/2023	USD	348,925.28	401,668.43	0.14
238,127.47	US AIRWAYS 2013-1 CLASS A PASS THROUGH TRUST 3.95% 15/11/2025	USD	197,137.29	204,849.55	0.07
Servizi di telecomunicazione			1,216,829.38	1,194,938.19	0.40
1,300,000.00	NETFLIX INC 4.38% 15/11/2026	USD	1,216,829.38	1,194,938.19	0.40
Finanza			824,307.78	876,579.56	0.29
1,000,000.00	CITADEL FINANCE LLC 3.38% 09/03/2026	USD	824,307.78	876,579.56	0.29

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
LUSSEMBURGO			6,091,436.04	4,703,039.11	1.58
Servizi di telecomunicazione			6,091,436.04	4,703,039.11	1.58
2,268,000.00	TELECOM ITALIA CAPITAL SA 6.38% 15/11/2033	USD	2,060,143.42	1,679,832.25	0.56
2,117,000.00	TELECOM ITALIA CAPITAL SA 7.72% 04/06/2038	USD	2,118,318.85	1,569,976.04	0.53
2,000,000.00	TELECOM ITALIA CAPITAL SA 6.00% 30/09/2034	USD	1,912,973.77	1,453,230.82	0.49
COLOMBIA			3,474,654.99	2,965,041.21	1.00
Servizi di telecomunicazione			3,474,654.99	2,965,041.21	1.00
3,950,000.00	COLOMBIA TELECOMUNICACIONES SA ESP 4.95% 17/07/2030	USD	3,474,654.99	2,965,041.21	1.00
CANADA			1,907,037.62	2,660,664.98	0.90
Industria			1,907,037.62	2,660,664.98	0.90
3,011,000.00	BOMBARDIER INC 7.50% 15/03/2025	USD	1,907,037.62	2,660,664.98	0.90
JERSEY			1,839,392.91	1,888,583.32	0.64
Beni voluttuari			1,839,392.91	1,888,583.32	0.64
2,185,712.00	ASTON MARTIN CAPITAL HOLDINGS LTD 15.00% 30/11/2026	USD	1,839,392.91	1,888,583.32	0.64
LIBERIA			967,481.87	1,015,187.49	0.34
Beni voluttuari			967,481.87	1,015,187.49	0.34
1,007,000.00	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD 11.50% 01/06/2025	USD	967,481.87	1,015,187.49	0.34
MESSICO			917,494.88	950,997.28	0.32
Industria			917,494.88	950,997.28	0.32
1,000,000.00	CEMEX SAB DE CV 7.38% 05/06/2027	USD	917,494.88	950,997.28	0.32
GIAPPONE			842,424.00	875,814.34	0.29
Beni voluttuari			842,424.00	875,814.34	0.29
1,000,000.00	NISSAN MOTOR CO LTD 4.35% 17/09/2027	USD	842,424.00	875,814.34	0.29
Obbligazioni a tasso variabile			2,227,491.19	2,359,778.33	0.79
STATI UNITI			2,227,491.19	2,359,778.33	0.79
Finanza			1,383,907.44	1,544,559.92	0.52
2,000,000.00	USB REALTY CORP FRN 29/12/2049	USD	1,383,907.44	1,544,559.92	0.52
Servizi di pubblica utilità			843,583.75	815,218.41	0.27
1,000,000.00	SOUTHERN CO FRN 15/09/2051	USD	843,583.75	815,218.41	0.27
ALTRI VALORI MOBILIARI			8,470,058.19	7,123,005.34	2.40
Obbligazioni a tasso variabile			3,670,058.19	3,247,965.34	1.09
ITALIA			2,789,275.35	2,500,134.18	0.84
Finanza			2,789,275.35	2,500,134.18	0.84
3,500,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 01/06/2032	USD	2,789,275.35	2,500,134.18	0.84
FRANCIA			880,782.84	747,831.16	0.25
Finanza			880,782.84	747,831.16	0.25
1,000,000.00	CREDIT AGRICOLE SA FRN 31/12/2099	USD	880,782.84	747,831.16	0.25
Titoli garantiti da Ipotecche immobiliari e da collaterale			4,800,000.00	3,875,040.00	1.31
ITALIA			4,800,000.00	3,875,040.00	1.31
Finanza			4,800,000.00	3,875,040.00	1.31
4,800,000.00	SIERRA ONE SPV SRL 7.00% 30/06/2025*	EUR	4,800,000.00	3,875,040.00	1.31
Totale del Portafoglio Titoli			292,628,741.86	273,250,471.00	91.94

* Vedi Nota 13

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

IMPEGNI SU ACQUISTO / VENDITA DI CONTRATTI FUTURES AL 30 GIUGNO 2022

Valore nominale	Quantità	Acquisto / Vendita	Contratto	Scadenza	Valore di mercato al 30 Giugno 2022	Valuta	Plus/(minus) valenza non realizzata (EUR)	Impegno (EUR)
							-453,790.00	24,624,000.00
100,000	-200	Vendita	EURO-BTP FUTURE	08/09/2022	123.12	EUR	-453,790.00	24,624,000.00

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

CONTRATTI FINANZIARI A TERMINE AL 30 GIUGNO 2022

Scadenza	Impegno di acquisto di valute		Impegno di vendita di valute		Plus/(minus)-valenza non realizzata (EUR)
					-77,080.62
25/07/2022	16,970.14	EUR	18,000.00	USD	-224.78
25/07/2022	24,888.71	EUR	25,200.00	CHF	-287.15
21/09/2022	510,000.00	GBP	590,490.67	EUR	-507.98
25/07/2022	75,890.38	EUR	80,000.00	USD	-531.47
25/07/2022	40,013.92	EUR	43,000.00	USD	-1,062.83
25/07/2022	138,411.14	EUR	140,000.00	CHF	-1,454.75
25/07/2022	235,731.73	EUR	242,000.00	CHF	-6,036.46
25/07/2022	308,390.06	EUR	332,000.00	USD	-8,760.64
25/07/2022	1,246,333.68	EUR	1,329,000.00	USD	-23,224.38
16/08/2022	24,779,528.15	USD	131,500,000.00	BRL	-41,775.31
21/09/2022	1,337,509.18	EUR	1,390,000.00	CHF	-51,259.01
21/09/2022	19,050,354.75	EUR	16,580,000.00	GBP	-129,866.85
21/09/2022	122,070,419.39	EUR	128,260,000.00	USD	70,675.34
25/07/2022	2,449,950.00	CHF	2,382,481.92	EUR	65,121.29
25/07/2022	8,925,500.00	USD	8,485,949.05	EUR	40,341.74
21/09/2022	1,660,000.00	USD	1,567,399.75	EUR	11,577.13
25/07/2022	51,500.00	USD	49,001.08	EUR	195.49

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

CONTRATTI SWAP AL 30 GIUGNO 2022

Sottostante	Valuta	Posizione	Nominale	Controparte	Scadenza	Interessi da ricevere / pagare (EUR)	Plus/(minus) -valenza non realizzata(EUR)
CONTRATTI CREDIT DEFAULT SWAP						18,333.33	-168,508.81
iTraxx Europe Crossover Series 37 Version 1	EUR		5,000,000.00	J.P. MORGAN SE	06/20/2027	7,638.89	(29,389.93)
iTraxx Europe Crossover Series 37 Version 1	EUR		7,000,000.00	J.P. MORGAN SE	06/20/2027	10,694.44	(139,118.88)
CONTRATTI TOTAL RETURN SWAP						4,071.66	-1,077,902.72
EUR LIBOR BBA	EUR		5,000,000.00	J.P. MORGAN SE	09/20/2022	1,349.40	(286,277.75)
EUR EURIB ACT	EUR		7,000,000.00	J.P. MORGAN SE	09/20/2022	2,722.26	(791,624.97)

Le note allegare ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Euro Equities

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Attività

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	25,342,168.50
Liquidità bancarie a vista		1,774,713.58
Importi dovuti dai broker	(Nota 12)	650,892.81
Utili non realizzati su contratti futures	(Note 2d, 12)	7,875.00
Dividendi da ricevere		23,652.12
Da ricevere su sottoscrizioni		4,229.66
Altre attività		75,123.16
Totale attività		27,878,654.83

Passività

Altre passività		-126,972.10
Totale passività		-126,972.10

Totale attivo netto**27,751,682.73**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	58.23	84,715.841
Azione I	EUR	64.50	338,339.621
Azione L	EUR	63.76	2,781.000
Azione Y	EUR	57.48	14,252.021

NEW MILLENNIUM - Euro Equities

PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Attivo netto all'inizio del periodo		36,145,165.50
Risultato netto degli investimenti		714,968.02
Altri ricavi		68,125.21
Totale ricavi		783,093.23
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-145,727.53
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 7)	-8,725.23
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-2,602.74
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 7)	-8,329.65
Commissioni del Transfer Agent		-6,255.60
Compensi professionali	(Nota 8)	-4,927.04
Pubblicazioni		-3,346.58
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-36,374.57
Totale costi		-216,288.94
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		566,804.29
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	-2,075,410.75
- di contratti futures		85,435.60
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		-5,031,547.21
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(Nota 2c)	166.71
- su contratti futures	(Nota 2d)	7,875.00
Risultato netto delle operazioni per il periodo		-6,446,676.36
Distribuzioni di dividendi	(Nota 14)	-87,364.89
Sottoscrizioni del periodo		2,953,368.02
Rimborsi del periodo		-4,812,809.54
Attivo netto alla fine del periodo		27,751,682.73

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Euro Equities

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			27,589,779.04	25,342,168.50	91.32
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			27,589,779.04	25,342,168.50	91.32
Azioni			26,635,870.33	24,508,568.50	88.32
FRANCIA			10,190,099.77	9,939,297.40	35.82
Beni voluttuari			3,195,600.64	3,249,738.39	11.71
2,311.00	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	EUR	1,216,150.24	1,344,308.70	4.84
1,686.00	L'OREAL SA	EUR	551,399.64	555,199.80	2.00
437.00	HERMES INTERNATIONAL	EUR	406,395.80	466,279.00	1.68
836.00	KERING SA	EUR	471,060.70	409,723.60	1.48
2,183.00	SODEXO	EUR	167,089.93	146,391.98	0.53
2,725.00	PUBLICIS GROUPE SA	EUR	132,126.20	127,148.50	0.46
4,789.00	RENAULT SA	EUR	151,449.85	113,930.31	0.41
3,340.00	CIE GENERALE DES ETABLISSEMENTS MICHELIN SCA	EUR	99,928.28	86,756.50	0.31
Industria			1,819,516.26	1,576,006.88	5.68
3,956.00	SCHNEIDER ELECTRIC SE	EUR	561,093.07	446,632.40	1.61
4,654.00	VINCI SA	EUR	428,399.33	395,403.84	1.42
5,015.00	CIE DE SAINT-GOBAIN	EUR	291,863.72	205,339.18	0.74
1,632.00	WENDEL SA	EUR	147,283.97	130,152.00	0.47
898.00	THALES SA	EUR	99,482.41	105,110.90	0.38
1,147.00	EIFFAGE SA	EUR	99,662.91	98,504.36	0.36
658.00	DASSAULT AVIATION SA	EUR	89,749.74	97,976.20	0.35
3,300.00	BOUYGUES SA	EUR	101,981.11	96,888.00	0.35
Salute			1,250,712.29	1,355,901.54	4.89
7,946.00	SANOFI	EUR	682,327.36	765,517.64	2.76
3,161.00	ESSILORLUXOTTICA SA	EUR	428,707.97	451,706.90	1.63
1,540.00	IPSEN SA	EUR	139,676.96	138,677.00	0.50
Energia			934,440.61	1,066,282.53	3.84
21,169.00	TOTAL SA	EUR	934,440.61	1,066,282.53	3.84
Materie prime			914,837.75	778,272.16	2.80
4,908.00	AIR LIQUIDE SA	EUR	717,842.44	628,812.96	2.26
1,760.00	ARKEMA SA	EUR	196,995.31	149,459.20	0.54
Informatica			863,762.11	759,064.60	2.74
3,876.00	CAPGEMINI SE	EUR	743,389.24	633,532.20	2.29
428.00	TELEPERFORMANCE	EUR	120,372.87	125,532.40	0.45
Beni di prima necessità			579,250.58	578,490.90	2.09
1,670.00	PERNOD RICARD SA	EUR	261,850.85	292,751.00	1.06
5,365.00	DANONE SA	EUR	317,399.73	285,739.90	1.03
Finanza			504,544.30	444,434.70	1.60
14,505.00	AXA SA	EUR	345,042.74	314,178.30	1.13
2,204.00	EURAZEO SE	EUR	159,501.56	130,256.40	0.47
Servizi di telecomunicazione			127,435.23	131,105.70	0.47
11,685.00	ORANGE SA	EUR	127,435.23	131,105.70	0.47
GERMANIA			7,271,149.73	6,226,679.25	22.44
Beni voluttuari			1,660,598.51	1,351,313.05	4.87
2,225.00	ADIDAS AG	EUR	599,245.65	375,491.00	1.35
6,405.00	DAIMLER AG REG	EUR	354,656.97	353,684.10	1.28
1,898.00	VOLKSWAGEN AG -PREF-	EUR	315,002.04	241,843.16	0.87
2,648.00	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	EUR	219,344.34	194,522.08	0.70
960.00	BEIERSDORF AG	EUR	87,312.63	93,580.80	0.34
3,701.00	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	EUR	85,036.88	92,191.91	0.33
Informatica			1,348,614.32	1,130,959.30	4.08
13,010.00	SAP SE	EUR	1,348,614.32	1,130,959.30	4.08

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Euro Equities

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Salute			1,132,675.65	1,078,505.32	3.89
17,694.00	FRESENIUS SE & CO KGAA	EUR	518,109.13	511,356.60	1.84
7,751.00	BAYER AG REG	EUR	509,232.38	439,636.72	1.59
792.00	MERCK KGAA	EUR	105,334.14	127,512.00	0.46
Industria			1,331,141.94	973,971.57	3.51
5,374.00	SIEMENS AG REG	EUR	706,221.63	521,761.66	1.88
9,889.00	DEUTSCHE POST AG REG	EUR	438,997.98	353,432.86	1.27
2,495.00	KION GROUP AG	EUR	185,922.33	98,777.05	0.36
Finanza			1,007,824.05	883,239.00	3.18
2,450.00	ALLIANZ SE REG	EUR	537,060.37	446,194.00	1.61
1,255.00	MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS-GESELLSCHAFT AG IN MUENCHEN REG	EUR	304,624.36	281,371.00	1.01
1,124.00	HANNOVER RUECK SE	EUR	166,139.32	155,674.00	0.56
Servizi di telecomunicazione			441,899.87	502,220.57	1.81
26,508.00	DEUTSCHE TELEKOM AG REG	EUR	441,899.87	502,220.57	1.81
Materie prime			259,645.58	217,536.30	0.78
3,503.00	BRENTAG AG	EUR	259,645.58	217,536.30	0.78
Beni di prima necessità			88,749.81	88,934.14	0.32
1,513.00	HENKEL AG & CO KGAA -PREF-	EUR	88,749.81	88,934.14	0.32
PAESI BASSI			4,490,527.89	4,112,554.52	14.82
Informatica			2,600,080.47	2,314,303.79	8.34
3,633.00	ASML HOLDING NV	EUR	1,788,867.00	1,656,103.05	5.97
21,951.00	STMICROELECTRONICS NV	EUR	811,213.47	658,200.74	2.37
Finanza			820,886.69	816,903.47	2.94
49,534.00	ING GROEP NV	EUR	475,669.02	467,155.15	1.68
32,641.00	ABN AMRO GROUP NV -CVA-	EUR	345,217.67	349,748.32	1.26
Industria			392,874.44	414,545.80	1.50
4,484.00	AIRBUS SE	EUR	392,874.44	414,545.80	1.50
Beni voluttuari			303,500.23	260,874.42	0.94
22,123.00	STELLANTIS NV	EUR	303,500.23	260,874.42	0.94
Materie prime			290,285.06	228,062.04	0.82
3,642.00	AKZO NOBEL NV	EUR	290,285.06	228,062.04	0.82
Beni di prima necessità			82,901.00	77,865.00	0.28
895.00	HEINEKEN NV	EUR	82,901.00	77,865.00	0.28
ITALIA			2,452,656.42	2,182,114.23	7.86
Finanza			1,288,420.30	1,115,186.67	4.02
252,429.00	INTESA SANPAOLO SPA	EUR	557,819.37	449,323.62	1.62
31,696.00	FINECOBANK BANCA FINECO SPA	EUR	399,288.41	361,968.32	1.30
17,079.00	POSTE ITALIANE SPA	EUR	154,004.36	152,208.05	0.55
9,963.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA	EUR	177,308.16	151,686.68	0.55
Servizi di pubblica utilità			623,642.05	598,514.76	2.15
114,658.00	ENEL SPA	EUR	623,642.05	598,514.76	2.15
Energia			540,594.07	468,412.80	1.69
41,350.00	ENI SPA	EUR	540,594.07	468,412.80	1.69
SPAGNA			1,124,542.49	1,104,449.66	3.98
Servizi di pubblica utilità			660,649.12	659,914.76	2.38
66,685.00	IBERDROLA SA	EUR	660,649.12	659,914.76	2.38
Finanza			352,829.53	346,394.31	1.25
104,430.00	CAIXABANK SA	EUR	352,829.53	346,394.31	1.25

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Euro Equities

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Industria			111,063.84	98,140.59	0.35
4,243.00	ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS SA	EUR	111,063.84	98,140.59	0.35
BELGIO			710,815.62	618,549.64	2.23
Beni di prima necessità			418,183.94	340,927.68	1.23
6,638.00	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	EUR	418,183.94	340,927.68	1.23
Materie prime			165,709.82	147,307.72	0.53
4,421.00	UMICORE SA	EUR	165,709.82	147,307.72	0.53
Salute			126,921.86	130,314.24	0.47
1,616.00	UCB SA	EUR	126,921.86	130,314.24	0.47
LUSSEMBURGO			183,859.77	140,976.54	0.51
Materie prime			183,859.77	140,976.54	0.51
6,554.00	ARCELORMITTAL	EUR	183,859.77	140,976.54	0.51
FINLANDIA			115,170.96	103,202.70	0.37
Industria			115,170.96	103,202.70	0.37
13,890.00	WARTSILA OYJ ABP	EUR	115,170.96	103,202.70	0.37
IRLANDA			97,047.68	80,744.56	0.29
Beni di prima necessità			97,047.68	80,744.56	0.29
884.00	KERRY GROUP PLC -A-	EUR	97,047.68	80,744.56	0.29
Azioni di OICR			953,908.71	833,600.00	3.00
IRLANDA			953,908.71	833,600.00	3.00
Finanza			953,908.71	833,600.00	3.00
50,000.00	ISHARES EURO DIVIDEND UCITS ETF	EUR	953,908.71	833,600.00	3.00
Totale del Portafoglio Titoli			27,589,779.04	25,342,168.50	91.32

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Euro Equities

IMPEGNI SU ACQUISTO / VENDITA DI CONTRATTI FUTURES AL 30 GIUGNO 2022

Valore nominale	Quantità	Acquisto / Vendita	Contratto	Scadenza	Valore di mercato al 30 Giugno 2022	Valuta	Plus/(minus) valenza non realizzata (EUR)	Impegno (EUR)
							7,875.00	860,250.00
10	25	Acquisto	EURO STOXX 50	16/09/2022	3,441.00	EUR	7,875.00	860,250.00

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)**PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR****Attività**

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	32,582,961.23
Liquidità bancarie a vista		2,143,817.45
Importi dovuti dai broker	(Nota 12)	3,160,445.74
Utili non realizzati su contratti futures	(Note 2d, 12)	25,279.71
Dividendi da ricevere		15,264.58
Da ricevere su sottoscrizioni		14,669.20
Altre attività		31,737.39
Totale attività		37,974,175.30

Passività

Perdite non realizzate su contratti futures	(Note 2d, 12)	-686,338.09
Altre passività		-118,541.59
Totale passività		-804,879.68

Totale attivo netto**37,169,295.62**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	103.17	27,917.081
Azione I	EUR	114.72	297,038.646
Azione L	EUR	113.31	1,876.000

NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)**PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR**

Attivo netto all'inizio del periodo		43,194,675.75
Risultato netto degli investimenti		196,285.12
Altri ricavi		20,636.32
Totale ricavi		216,921.44
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-186,924.35
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 7)	-11,217.31
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-2,608.66
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 7)	-9,222.20
Commissioni del Transfer Agent		-3,271.04
Compensi professionali	(Nota 8)	-2,082.54
Pubblicazioni		-3,468.48
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-10,715.98
Totale costi		-229,510.56
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		-12,589.12
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	5,649,175.70
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		159,620.23
- di contratti futures		-6,809,984.38
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		-6,814,663.81
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(Nota 2c)	18,204.55
- su contratti futures	(Nota 2d)	-852,937.58
Risultato netto delle operazioni per il periodo		-8,663,174.41
Sottoscrizioni del periodo		5,975,823.14
Rimborsi del periodo		-3,338,028.86
Attivo netto alla fine del periodo		37,169,295.62

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			26,310,977.25	32,582,961.23	87.66
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			26,213,700.88	32,466,672.73	87.35
Azioni			24,094,872.87	30,345,351.57	81.64
STATI UNITI			21,206,402.70	27,044,304.38	72.76
Informatica			3,812,536.76	5,652,257.05	15.21
7,750.00	MICROSOFT CORP	USD	1,123,316.31	1,903,900.44	5.12
13,400.00	APPLE INC	USD	725,696.47	1,752,401.55	4.71
4,750.00	NVIDIA CORP	USD	407,134.14	688,748.94	1.85
2,250.00	SALESFORCE.COM INC	USD	424,995.33	355,196.36	0.96
6,000.00	INTEL CORP	USD	236,208.40	214,701.83	0.58
600.00	ADOBE INC	USD	146,190.55	210,087.54	0.57
4,000.00	MARVELL TECHNOLOGY INC	USD	252,390.61	166,550.31	0.45
1,000.00	QUALCOMM INC	USD	154,547.98	122,186.63	0.33
750.00	TEXAS INSTRUMENTS INC	USD	116,624.10	110,227.66	0.30
500.00	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	USD	60,315.18	67,525.95	0.18
7,000.00	PALANTIR TECHNOLOGIES INC -A-	USD	165,117.69	60,729.84	0.16
Servizi di telecomunicazione			4,128,972.02	5,031,811.72	13.54
800.00	ALPHABET INC -A-	USD	721,654.41	1,667,615.08	4.49
12,800.00	AMAZON.COM INC	USD	1,017,347.67	1,300,385.62	3.50
4,500.00	FACEBOOK INC -A-	USD	949,875.45	694,079.18	1.87
6,000.00	VERIZON COMMUNICATIONS INC	USD	287,385.74	291,262.17	0.78
500.00	PALO ALTO NETWORKS INC	USD	136,945.57	236,233.23	0.64
5,000.00	CISCO SYSTEMS INC	USD	256,696.13	203,931.34	0.55
4,000.00	COMCAST CORP -A-	USD	138,582.16	150,136.32	0.40
1,500.00	WALT DISNEY CO	USD	156,943.75	135,444.08	0.36
800.00	NETFLIX INC	USD	261,571.75	133,814.16	0.36
1,000.00	T-MOBILE US INC	USD	100,440.02	128,691.01	0.35
4,500.00	AT&T INC	USD	101,529.37	90,219.53	0.24
Finanza			4,661,413.48	4,966,044.83	13.36
3,900.00	VISA INC -A-	USD	534,462.36	734,488.58	1.98
22,000.00	BANK OF AMERICA CORP	USD	586,640.15	655,086.40	1.76
5,000.00	JPMORGAN CHASE & CO	USD	541,836.79	538,571.96	1.45
1,500.00	BERKSHIRE HATHAWAY INC -B-	USD	319,748.12	391,726.09	1.05
1,250.00	MASTERCARD INC -A-	USD	337,034.70	377,206.03	1.01
1,300.00	GOLDMAN SACHS GROUP INC	USD	366,935.25	369,339.56	0.99
9,000.00	WELLS FARGO & CO	USD	344,834.15	337,204.11	0.91
7,000.00	US BANCORP	USD	295,957.38	308,135.29	0.83
3,500.00	MORGAN STANLEY	USD	143,223.46	254,636.79	0.69
1,000.00	AMERICAN TOWER CORP	USD	216,028.47	244,478.48	0.66
2,800.00	PAYPAL HOLDINGS INC	USD	455,606.86	187,050.57	0.50
2,000.00	SIMON PROPERTY GROUP INC	USD	113,291.71	181,586.90	0.49
300.00	BLACKROCK INC	USD	151,236.84	174,768.78	0.47
3,000.00	CITIGROUP INC	USD	177,128.18	131,971.89	0.36
2,000.00	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	USD	77,449.06	79,793.40	0.21
Salute			3,045,962.31	4,211,391.74	11.33
4,000.00	JOHNSON & JOHNSON	USD	509,466.28	679,171.72	1.83
1,200.00	UNITEDHEALTH GROUP INC	USD	353,967.22	589,560.54	1.59
10,000.00	PFIZER INC	USD	370,103.85	501,506.58	1.35
5,000.00	MERCK & CO INC	USD	309,010.04	436,032.38	1.17
2,500.00	ABBVIE INC	USD	196,467.60	366,253.81	0.98
1,000.00	DANAHER CORP	USD	89,856.06	242,498.47	0.65
4,000.00	GILEAD SCIENCES INC	USD	228,161.36	236,491.49	0.64
1,700.00	MODERNA INC	USD	394,057.57	232,287.56	0.62
3,000.00	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	USD	102,972.18	220,957.51	0.59
2,000.00	ABBOTT LABORATORIES	USD	82,194.69	207,853.10	0.56
350.00	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	USD	147,481.47	181,881.51	0.49
2,000.00	CVS HEALTH CORP	USD	138,471.39	177,263.40	0.48
600.00	AMGEN INC	USD	123,752.60	139,633.67	0.38

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Beni voluttuari			1,805,512.90	2,245,618.36	6.04
3,500.00	PROCTER & GAMBLE CO	USD	329,185.39	481,386.06	1.29
1,500.00	HOME DEPOT INC	USD	218,586.08	393,519.58	1.06
1,400.00	MCDONALD'S CORP	USD	204,605.87	330,605.99	0.89
500.00	TESLA INC	USD	403,852.95	322,071.87	0.87
1,250.00	LOWE'S COS INC	USD	136,733.77	208,845.50	0.56
2,000.00	NIKE INC -B-	USD	153,427.07	195,513.91	0.53
700.00	TARGET CORP	USD	36,543.56	94,563.12	0.25
5,000.00	PLUG POWER INC	USD	145,867.71	79,248.18	0.21
1,000.00	COLGATE-PALMOLIVE CO	USD	64,247.30	76,655.99	0.21
2,000.00	RIVIAN AUTOMOTIVE INC	USD	81,184.64	49,241.96	0.13
1,088.00	WARNER BROS DISCOVERY INC	USD	31,278.56	13,966.20	0.04
Industria			1,558,088.64	1,636,061.20	4.40
3,000.00	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	USD	465,452.14	498,761.35	1.34
1,000.00	BROADCOM INC	USD	541,946.20	464,689.90	1.25
2,000.00	UNITED PARCEL SERVICE INC -B-	USD	255,953.06	349,208.51	0.94
1,000.00	3M CO	USD	155,865.42	123,784.03	0.33
1,500.00	EMERSON ELECTRIC CO	USD	86,158.25	114,123.12	0.31
500.00	CATERPILLAR INC	USD	52,713.57	85,494.29	0.23
Energia			945,118.70	1,531,005.95	4.12
1,500.00	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	USD	206,077.05	392,673.05	1.06
4,000.00	EXXON MOBIL CORP	USD	254,565.39	327,667.55	0.88
3,000.00	CONOCOPHILLIPS	USD	110,462.19	257,716.80	0.69
2,500.00	VALERO ENERGY CORP	USD	153,661.72	254,148.96	0.69
10,000.00	KINDER MORGAN INC	USD	141,472.82	160,313.76	0.43
1,000.00	CHEVRON CORP	USD	78,879.53	138,485.83	0.37
Servizi di pubblica utilità			786,185.16	991,769.20	2.67
7,000.00	NEXTERA ENERGY INC	USD	437,690.93	518,647.53	1.40
2,500.00	DUKE ENERGY CORP	USD	203,804.41	256,372.88	0.69
5,000.00	EXELON CORP	USD	144,689.82	216,748.79	0.58
Beni di prima necessità			462,612.73	778,344.33	2.09
6,000.00	COCA-COLA CO	USD	241,876.84	361,050.30	0.97
1,500.00	PEPSICO INC	USD	89,800.42	239,121.93	0.64
3,000.00	MONDELEZ INTERNATIONAL INC -A-	USD	130,935.47	178,172.10	0.48
GIAPPONE			2,071,913.76	2,323,161.96	6.25
Industria			554,056.66	601,963.27	1.62
300.00	SMC CORP	JPY	128,352.60	125,149.97	0.33
5,700.00	KOMATSU LTD	JPY	119,188.31	119,113.20	0.32
2,100.00	OMRON CORP	JPY	107,805.73	99,581.36	0.27
200.00	KEYENCE CORP	JPY	35,904.01	64,226.05	0.17
1,000.00	SCREEN HOLDINGS CO LTD	JPY	42,259.33	62,029.33	0.17
5,000.00	MITSUBISHI ELECTRIC CORP	JPY	56,130.38	50,957.69	0.14
1,000.00	HITACHI LTD	JPY	27,118.20	44,617.46	0.12
1,200.00	YASKAWA ELECTRIC CORP	JPY	37,298.10	36,288.21	0.10
Beni voluttuari			487,870.11	587,486.72	1.58
13,500.00	TOYOTA MOTOR CORP	JPY	151,968.68	196,469.62	0.53
1,300.00	SONY CORP	JPY	92,095.41	98,944.17	0.27
9,000.00	MARUBENI CORP	JPY	46,508.39	75,533.55	0.20
4,000.00	YAMAHA MOTOR CO LTD	JPY	53,664.17	68,830.73	0.19
6,600.00	PANASONIC CORP	JPY	63,627.96	50,186.72	0.13
3,000.00	SEKISUI HOUSE LTD	JPY	40,916.58	49,880.45	0.13
1,500.00	UNICHARM CORP	JPY	39,088.92	47,641.48	0.13
Informatica			432,113.32	474,042.06	1.28
800.00	TOKYO ELECTRON LTD	JPY	190,884.25	240,287.95	0.65
1,700.00	FUJIFILM HOLDINGS CORP	JPY	58,648.69	88,273.86	0.24
8,900.00	RENESAS ELECTRONICS CORP	JPY	91,643.90	74,882.28	0.20

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
3,000.00	SUMCO CORP	JPY	60,335.37	35,802.40	0.10
700.00	ADVANTEST CORP	JPY	30,601.11	34,795.57	0.09
Salute			375,423.56	376,031.84	1.01
13,700.00	ASTELLAS PHARMA INC	JPY	201,904.49	198,560.38	0.53
2,200.00	SYSTEMX CORP	JPY	128,209.12	126,613.05	0.34
1,800.00	TERUMO CORP	JPY	45,309.95	50,858.41	0.14
Materie prime			80,498.34	119,348.37	0.32
1,100.00	SHIN-ETSU CHEMICAL CO LTD	JPY	80,498.34	119,348.37	0.32
Finanza			83,342.13	102,246.29	0.27
2,900.00	NOMURA REAL ESTATE HOLDINGS INC	JPY	49,434.95	67,380.32	0.18
2,000.00	DAI-ICHI LIFE HOLDINGS INC	JPY	33,907.18	34,865.97	0.09
Beni di prima necessità			58,609.64	62,043.41	0.17
2,000.00	ASAHI GROUP HOLDINGS LTD	JPY	58,609.64	62,043.41	0.17
IRLANDA			816,556.41	977,885.23	2.63
Informatica			387,875.48	531,158.89	1.43
2,000.00	ACCENTURE PLC -A-	USD	387,875.48	531,158.89	1.43
Materie prime			268,022.09	275,029.92	0.74
1,000.00	LINDE PLC	USD	268,022.09	275,029.92	0.74
Salute			160,658.84	171,696.42	0.46
2,000.00	MEDTRONIC PLC	USD	160,658.84	171,696.42	0.46
Obbligazioni ordinarie			3,004.15	935.48	0.00
STATI UNITI			3,004.15	935.48	0.00
Informatica			3,004.15	935.48	0.00
100.00	KYNDRYL HOLDINGS INC 0.00%	USD	3,004.15	935.48	0.00
Azioni di OICR			2,115,823.86	2,120,385.68	5.71
IRLANDA			1,639,081.44	1,539,642.81	4.14
Finanza			1,639,081.44	1,539,642.81	4.14
79,600.00	ISHARES CORE FTSE 100 UCITS ETF	GBP	639,772.64	648,105.27	1.74
14,000.00	VANGUARD FTSE 250 UCITS ETF	GBP	522,947.83	503,547.54	1.36
15,000.00	L&G E FUND MSCI CHINA A UCITS ETF	EUR	273,845.65	272,970.00	0.73
18,000.00	HSBC HANG SENG TECH UCITS ETF	EUR	202,515.32	115,020.00	0.31
LUSSEMBURGO			476,742.42	580,742.87	1.57
Finanza			476,742.42	580,742.87	1.57
44,000.00	LYXOR FTSE 100 UCITS ETF	GBP	476,742.42	580,742.87	1.57
ALTRI VALORI MOBILIARI			1,733.47	1,700.50	0.00
Azioni			1,733.47	1,700.50	0.00
ITALIA			1,733.47	1,700.50	0.00
Servizi di telecomunicazione			1,733.47	1,700.50	0.00
1,463,856.00	TELEUNIT SPA	GBP	1,733.47	1,700.50	0.00
QUOTE DI OICR			95,542.90	114,588.00	0.31
Azioni di OICR			95,542.90	114,588.00	0.31
IRLANDA			95,542.90	114,588.00	0.31
Finanza			95,542.90	114,588.00	0.31
18,000.00	HSBC HANG SENG TECH UCITS ETF	EUR	95,542.90	114,588.00	0.31
Totale del Portafoglio Titoli			26,310,977.25	32,582,961.23	87.66

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)

IMPEGNI SU ACQUISTO / VENDITA DI CONTRATTI FUTURES AL 30 GIUGNO 2022

Valore nominale	Quantità	Acquisto / Vendita	Contratto	Scadenza	Valore di mercato al 30 Giugno 2022	Valuta	Plus/(minus) valenza non realizzata (EUR)	Impegno (EUR)
							-661,058.38	36,956,718.82
1,000	20	Acquisto	CBOE VIX FUTURE	17/08/2022	27.91	USD	16,785.12	558,178.83
125,000	15	Acquisto	EURO/GBP FUTURE	19/09/2022	1.01	GBP	8,494.59	1,881,551.17
10	10	Acquisto	FTSE 100 IDX FUT SEP22	16/09/2022	8,272.13	GBP	-348.50	827,213.11
10	16	Acquisto	SWISS MKT IX FUTR SEP22	16/09/2022	10,677.80	CHF	-9,431.87	1,708,448.26
125,000	24	Acquisto	EURO/JPY FUTURE	19/09/2022	1.00	JPY	-24,924.38	3,001,698.35
125,000	230	Acquisto	EURO FX CURR FUT SEP22	19/09/2022	1.01	USD	-651,633.34	28,979,629.10

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Attività

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	12,807,991.72
Liquidità bancarie a vista		271,129.68
Importi dovuti dai broker	(Nota 12)	76,924.81
Interessi da ricevere		43,446.70
Da ricevere su sottoscrizioni		4,776.76
Altre attività		33,688.18
Totale attività		13,237,957.85

Passività

Altre passività		-43,386.10
Totale passività		-43,386.10

Totale attivo netto**13,194,571.75**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	130.05	17,083.900
Azione D	EUR	91.34	139.750
Azione I	EUR	135.36	66,504.607
Azione L	EUR	133.47	14,651.000
Azione Y	EUR	134.21	21.122

NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term

PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Attivo netto all'inizio del periodo		14,036,458.93
Risultato netto degli investimenti		148,570.85
Altri ricavi		25,459.19
Totale ricavi		174,030.04
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-35,405.44
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 7)	-3,750.78
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-1,456.51
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 7)	-6,463.32
Compensi professionali	(Nota 8)	-11,037.56
Pubblicazioni		-2,946.52
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-7,925.56
Totale costi		-68,985.69
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		105,044.35
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	23,773.35
- di contratti futures		-14,396.80
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		-364,384.32
Risultato netto delle operazioni per il periodo		-249,963.42
Distribuzioni di dividendi	(Nota 14)	-173.65
Sottoscrizioni del periodo		540,310.32
Rimborsi del periodo		-1,132,060.43
Attivo netto alla fine del periodo		13,194,571.75

NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			13,249,955.98	12,807,991.72	97.07
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			13,249,955.98	12,807,991.72	97.07
Obbligazioni ordinarie			8,273,896.73	7,982,774.53	60.50
ITALIA			4,260,646.56	4,116,292.33	31.20
Finanza			2,562,001.88	2,459,582.60	18.64
1,200,000.00	CASSA DEPOSITI E PRESTITI SPA 1.50% 20/04/2023	EUR	1,242,282.52	1,208,736.00	9.16
400,000.00	CASSA DEPOSITI E PRESTITI SPA 2.13% 27/09/2023	EUR	413,371.16	405,284.00	3.07
400,000.00	CASSA DEPOSITI E PRESTITI SPA 2.13% 21/03/2026	EUR	441,208.42	397,560.00	3.02
260,000.00	INTESA SANPAOLO SPA 0.75% 04/12/2024	EUR	265,704.04	249,719.60	1.89
100,000.00	AMCO - ASSET MANAGEMENT CO SPA 1.50% 17/07/2023	EUR	99,791.90	100,400.00	0.76
100,000.00	BANCA DEL MEZZOGIORNO-MEDIO CREDITO CENTRALE SPA 1.50% 24/10/2024	EUR	99,643.84	97,883.00	0.74
Enti Governativi			1,478,789.78	1,465,640.73	11.11
639,095.73	BTP 0.50% 20/04/2023	EUR	669,243.58	665,106.93	5.04
557,000.00	BTP 0.50% 01/02/2026	EUR	535,874.31	527,367.60	4.00
339,000.00	ITALY BTPORO 0.95% 01/06/2032	EUR	273,671.89	273,166.20	2.07
Industria			120,607.22	103,141.00	0.78
100,000.00	LEONARDO SPA 4.88% 24/03/2025	EUR	120,607.22	103,141.00	0.78
Energia			99,247.68	87,928.00	0.67
100,000.00	ERG SPA 0.50% 11/09/2027	EUR	99,247.68	87,928.00	0.67
FRANCIA			1,301,854.24	1,289,440.88	9.77
Enti Governativi			797,517.98	793,740.88	6.01
741,155.87	FRANCE REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 0.25% 25/07/2024	EUR	797,517.98	793,740.88	6.01
Finanza			504,336.26	495,700.00	3.76
500,000.00	AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT EPIC 0.13% 15/11/2023	EUR	504,336.26	495,700.00	3.76
GERMANIA			1,151,375.72	1,116,867.57	8.46
Enti Governativi			1,051,785.90	1,019,762.57	7.73
590,013.55	DEUTSCHE BUNDESREPUBLIK INFLATION LINKED BOND 0.10% 15/04/2023	EUR	612,340.79	612,510.77	4.64
405,000.00	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 1.00% 15/08/2025	EUR	439,445.11	407,251.80	3.09
Salute			99,589.82	97,105.00	0.73
100,000.00	BAYER AG 0.38% 06/07/2024	EUR	99,589.82	97,105.00	0.73
SPAGNA			622,507.40	599,100.00	4.54
Enti Governativi			622,507.40	599,100.00	4.54
600,000.00	FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO FTA 0.85% 17/12/2023	EUR	622,507.40	599,100.00	4.54
LUSSEMBURGO			565,125.43	503,490.00	3.82
Sovranazionale			565,125.43	503,490.00	3.82
500,000.00	EIB 2.25% 14/10/2022	EUR	565,125.43	503,490.00	3.82
PAESI BASSI			372,387.38	357,583.75	2.71
Industria			200,015.97	197,240.00	1.49
200,000.00	ABB FINANCE BV 0.63% 31/03/2024	EUR	200,015.97	197,240.00	1.49
Servizi di pubblica utilità			172,371.41	160,343.75	1.22
100,000.00	IBERDROLA INTERNATIONAL BV 1.88% 08/10/2024	EUR	108,921.04	100,444.00	0.76
59,000.00	INNOGY FINANCE BV 3.00% 17/01/2024	EUR	63,450.37	59,899.75	0.46

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Obbligazioni a tasso variabile			2,237,276.59	2,205,992.32	16.72
ITALIA			1,688,636.52	1,664,543.29	12.62
Enti Governativi			1,351,589.72	1,360,072.30	10.31
800,000.00	CCT FRN 15/09/2025	EUR	785,422.66	801,040.00	6.07
558,000.00	CCT FRN 15/12/2022	EUR	566,167.06	559,032.30	4.24
Finanza			337,046.80	304,470.99	2.31
210,000.00	CREDITO EMILIANO SPA FRN 19/01/2028	EUR	210,073.50	183,126.30	1.39
127,000.00	ICCREA BANCA SPA FRN 20/10/2025	EUR	126,973.30	121,344.69	0.92
GERMANIA			548,640.07	541,449.03	4.10
Industria			548,640.07	541,449.03	4.10
541,000.00	DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH FRN 06/12/2024	EUR	548,640.07	541,449.03	4.10
Obbligazioni zero coupon			1,816,971.28	1,744,960.23	13.22
GERMANIA			536,093.99	527,138.43	3.99
Enti Governativi			536,093.99	527,138.43	3.99
547,000.00	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 0.00% 15/08/2026	EUR	536,093.99	527,138.43	3.99
FRANCIA			302,941.12	292,340.00	2.22
Finanza			203,141.22	193,458.00	1.47
200,000.00	AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT EPIC REG 0.00% 25/03/2025	EUR	203,141.22	193,458.00	1.47
Industria			99,799.90	98,882.00	0.75
100,000.00	SCHNEIDER ELECTRIC SE 0.00% 12/06/2023	EUR	99,799.90	98,882.00	0.75
SPAGNA			279,186.27	259,936.80	1.97
Enti Governativi			279,186.27	259,936.80	1.97
276,000.00	INSTITUTO DE CREDITO OFICIAL 0.00% 30/04/2026	EUR	279,186.27	259,936.80	1.97
PAESI BASSI			248,235.26	241,235.00	1.83
Servizi di pubblica utilità			248,235.26	241,235.00	1.83
250,000.00	ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 0.00% 17/06/2024	EUR	248,235.26	241,235.00	1.83
ITALIA			250,542.68	231,630.00	1.75
Servizi di pubblica utilità			250,542.68	231,630.00	1.75
250,000.00	ACEA SPA 0.00% 28/09/2025	EUR	250,542.68	231,630.00	1.75
CINA			199,971.96	192,680.00	1.46
Finanza			199,971.96	192,680.00	1.46
200,000.00	BANK OF CHINA LTD/LUXEMBOURG 0.00% 28/04/2024	EUR	199,971.96	192,680.00	1.46
Azioni di OICR			921,811.38	874,264.64	6.63
LUSSEMBURGO			636,811.28	613,637.13	4.65
Finanza			636,811.28	613,637.13	4.65
3,226.81	EURIZON FUND - SECURITIZED BOND FUND -Z-	EUR	326,811.22	318,163.37	2.41
2,437.30	CB-ACCENT LUX - SWAN SHORT-TERM HIGH YIELD -A-	EUR	310,000.06	295,473.76	2.24
IRLANDA			285,000.10	260,627.51	1.98
Finanza			285,000.10	260,627.51	1.98
63,863.64	TENDERCAPITAL BOND TWO STEPS FUND -IA-	EUR	285,000.10	260,627.51	1.98
Totale del Portafoglio Titoli			13,249,955.98	12,807,991.72	97.07

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Attività

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	128,471,752.22
Liquidità bancarie a vista		495,508.54
Importi dovuti dai broker	(Nota 12)	9,548,798.56
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	(Note 2c, 12)	53,990.43
Interessi da ricevere		859,415.51
Da ricevere su sottoscrizioni		15,000.00
Altre attività		146,465.59
Totale attività		139,590,930.85

Passività

Scoperti bancari		-118,152.99
Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	(Note 2c, 12)	-77,617.47
Da pagare su rimborsi		-211,234.47
Altre passività		-432,360.09
Totale passività		-839,365.02

Totale attivo netto**138,751,565.83**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	151.01	274,894.779
Azione A (H-CHF)	CHF	93.04	180.000
Azione A (H-USD)	USD	102.81	14,835.036
Azione D	EUR	86.10	167,326.537
Azione I	EUR	159.19	510,833.809
Azione L	EUR	157.28	224.000

NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond**PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR**

Attivo netto all'inizio del periodo		144,717,368.19
Risultato netto degli investimenti		3,842,826.97
Altri ricavi		112,939.69
Totale ricavi		3,955,766.66
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-656,534.15
Commissioni sulla performance	(Nota 6)	-2,316.97
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 7)	-39,603.52
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-18,162.48
Interessi pagati su contratti swap		-5,314.35
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 7)	-30,833.24
Commissioni del Transfer Agent		-15,870.22
Compensi professionali	(Nota 8)	-6,006.66
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-33,237.67
Totale costi		-807,879.26
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		3,147,887.40
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	1,119,072.69
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		-5,172,611.24
- di contratti futures		1,920,001.59
- di contratti swap		125,602.64
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		-5,654,279.18
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(Nota 2c)	1,064,069.92
- su contratti futures	(Nota 2d)	-334,265.23
- su contratti swap		27,699.62
Risultato netto delle operazioni per il periodo		-3,756,821.79
Distribuzioni di dividendi	(Nota 14)	-352,138.24
Sottoscrizioni del periodo		23,819,592.95
Rimborsi del periodo		-25,676,435.28
Attivo netto alla fine del periodo		138,751,565.83

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			131,557,601.66	128,471,752.22	92.59
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			122,861,537.01	119,893,774.61	86.41
Obbligazioni ordinarie			39,972,734.70	39,306,807.09	28.33
ITALIA			19,052,735.76	18,824,915.41	13.57
Enti Governativi			15,878,487.76	15,869,338.75	11.44
5,079,600.00	BTP 0.40% 11/04/2024	EUR	5,272,742.10	5,254,744.61	3.79
5,000,000.00	ITALY BTPORO 0.90% 01/04/2031	EUR	4,323,000.00	4,137,500.00	2.98
3,500,000.00	REPUBLIC OF ITALY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.25% 17/02/2026	USD	2,843,464.80	2,991,329.41	2.16
3,000,000.00	ITALY BTPORO 1.45% 15/11/2024	EUR	2,918,580.00	2,990,100.00	2.15
101,146.00	BTP 0.35% 24/10/2024	EUR	101,771.48	104,564.73	0.08
100,000.00	BTP 1.85% 01/07/2025	EUR	107,396.80	99,830.00	0.07
100,000.00	BTP 2.10% 15/07/2026	EUR	110,913.00	99,590.00	0.07
100,000.00	BTP 0.00% 15/08/2024	EUR	100,600.00	97,000.00	0.07
100,000.00	BTP 0.50% 01/02/2026	EUR	100,019.58	94,680.00	0.07
Finanza			2,131,748.00	2,003,496.66	1.44
2,038,000.00	BANCA POPOLARE DI SONDRIO SCPA 2.38% 03/04/2024	EUR	2,131,748.00	2,003,496.66	1.44
Industria			1,042,500.00	952,080.00	0.69
1,000,000.00	LEONARDO SPA 2.38% 08/01/2026	EUR	1,042,500.00	952,080.00	0.69
REGNO UNITO			4,809,688.53	5,046,949.77	3.64
Sovranazionale			4,809,688.53	5,046,949.77	3.64
32,000,000.00	EUROPEAN BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT 5.00% 27/01/2025	BRL	4,809,688.53	5,046,949.77	3.64
LUSSEMBURGO			5,311,680.83	4,450,127.07	3.21
Sovranazionale			2,916,639.89	3,019,793.98	2.18
20,000,000.00	INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT 5.00% 22/01/2026	BRL	2,916,639.89	3,019,793.98	2.18
Finanza			1,472,473.89	961,027.37	0.69
5,769,887.50	SWISS INSURED BRAZIL POWER FINANCE SARL 9.85% 16/07/2032	BRL	1,472,473.89	961,027.37	0.69
Energia			922,567.05	469,305.72	0.34
1,000,000.00	GAZPROM PJSC VIA GAZ CAPITAL SA 1.45% 06/03/2023	CHF	922,567.05	469,305.72	0.34
MESSICO			2,819,780.00	2,799,496.00	2.02
Energia			2,819,780.00	2,799,496.00	2.02
2,800,000.00	PETROLEOS MEXICANOS 2.50% 24/11/2022	EUR	2,819,780.00	2,799,496.00	2.02
FRANCIA			1,833,186.49	1,879,076.20	1.35
Finanza			1,833,186.49	1,879,076.20	1.35
2,000,000.00	BNP PARIBAS SA 4.38% 12/05/2026	USD	1,833,186.49	1,879,076.20	1.35
FILIPPINE			1,407,904.72	1,451,291.19	1.04
Sovranazionale			1,407,904.72	1,451,291.19	1.04
120,000,000.00	ASIAN DEVELOPMENT BANK 5.90% 20/12/2022	INR	1,407,904.72	1,451,291.19	1.04
ISOLE CAYMAN			1,178,336.43	1,243,254.23	0.90
Finanza			1,178,336.43	1,243,254.23	0.90
1,400,000.00	QNB FINANCE LTD 1.63% 22/09/2025	USD	1,178,336.43	1,243,254.23	0.90
HONG KONG			1,024,641.13	1,167,263.98	0.84
Materie prime			1,024,641.13	1,167,263.98	0.84
1,200,000.00	CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 4.88% 14/03/2025	USD	1,024,641.13	1,167,263.98	0.84

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
ISOLE VERGINI BRITANNICHE			844,798.92	881,467.41	0.63
Beni di prima necessità			844,798.92	881,467.41	0.63
1,000,000.00	YILI HOLDING INVESTMENT LTD 1.63% 19/11/2025	USD	844,798.92	881,467.41	0.63
CINA			641,565.82	716,333.57	0.52
Sovranazionale			641,565.82	716,333.57	0.52
5,000,000.00	ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.90% 05/03/2024	CNY	641,565.82	716,333.57	0.52
GERMANIA			879,679.27	678,626.50	0.49
Finanza			879,679.27	678,626.50	0.49
1,000,000.00	ALLIANZ SE 3.88% 29/12/2049	USD	879,679.27	678,626.50	0.49
STATI UNITI			168,736.80	168,005.76	0.12
Industria			168,736.80	168,005.76	0.12
174,583.62	US AIRWAYS 2011-1 CLASS A PASS THROUGH TRUST 7.13% 22/10/2023	USD	168,736.80	168,005.76	0.12
Obbligazioni a tasso variabile			33,545,694.48	31,722,663.20	22.86
ITALIA			17,328,263.68	16,441,015.01	11.85
Finanza			13,953,531.04	13,199,267.82	9.51
4,000,000.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA FRN 29/06/2049	GBP	4,434,534.41	4,588,111.20	3.30
3,314,000.00	UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA FRN 31/12/2049	EUR	3,294,506.40	3,235,557.62	2.33
3,000,000.00	UNICREDIT SPA REG FRN 15/01/2032	EUR	3,000,000.00	2,550,030.00	1.84
1,900,000.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA FRN 30/11/2049	EUR	2,084,790.23	1,841,309.00	1.33
1,000,000.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA FRN 08/06/2048	EUR	1,139,700.00	984,260.00	0.71
Servizi di pubblica utilità			1,584,732.64	1,659,087.19	1.20
1,691,000.00	ENEL SPA FRN 24/09/2073	USD	1,584,732.64	1,659,087.19	1.20
Energia			1,790,000.00	1,582,660.00	1.14
2,000,000.00	ENI SPA FRN 31/12/2099	EUR	1,790,000.00	1,582,660.00	1.14
FRANCIA			3,525,629.61	3,324,263.82	2.39
Finanza			1,937,838.81	1,890,892.39	1.36
1,000,000.00	BNP PARIBAS SA FRN 25/07/2028	EUR	1,002,910.00	964,650.00	0.69
1,000,000.00	CREDIT AGRICOLE SA FRN 31/12/2099	USD	934,928.81	926,242.39	0.67
Enti Governativi			1,587,790.80	1,433,371.43	1.03
1,800,000.00	BNP PARIBAS FRN 31/12/2099	USD	1,587,790.80	1,433,371.43	1.03
PAESI BASSI			3,118,073.37	2,901,143.37	2.09
Finanza			2,105,473.37	2,017,608.37	1.45
3,000,000.00	AEGON NV FRN 29/06/2049	NLG	1,184,366.37	1,234,844.88	0.89
1,000,000.00	ING GROEP NV REG FRN 31/12/2099	USD	921,107.00	782,763.49	0.56
Beni voluttuari			512,600.00	454,605.00	0.33
500,000.00	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN 31/12/2099	EUR	512,600.00	454,605.00	0.33
Beni di prima necessità			500,000.00	428,930.00	0.31
500,000.00	JT INTERNATIONAL FINANCIAL SERVICES BV FRN 07/10/2083	EUR	500,000.00	428,930.00	0.31
GERMANIA			3,159,543.72	2,756,415.58	1.99
Salute			1,488,060.00	1,259,835.00	0.91
1,500,000.00	BAYER AG FRN 25/03/2082	EUR	1,488,060.00	1,259,835.00	0.91
Finanza			848,463.48	792,845.27	0.57
1,000,000.00	ALLIANZ SE FRN 31/12/2099	USD	848,463.48	792,845.27	0.57
Enti Governativi			823,020.24	703,735.31	0.51
1,000,000.00	ALLIANZ SE FRN 31/12/2099	USD	823,020.24	703,735.31	0.51

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
REGNO UNITO			2,380,930.50	2,344,527.77	1.69
Energia			1,336,600.50	1,353,407.77	0.98
1,500,000.00	BP CAPITAL MARKETS PLC FRN 31/12/2099	USD	1,336,600.50	1,353,407.77	0.98
Finanza			1,044,330.00	991,120.00	0.71
1,000,000.00	VIRGIN MONEY UK PLC FRN 24/06/2025	EUR	1,044,330.00	991,120.00	0.71
ISOLE VERGINI BRITANNICHE			1,667,258.85	1,857,439.58	1.34
Servizi di pubblica utilità			1,667,258.85	1,857,439.58	1.34
1,000,000.00	CHINA HUANENG GROUP HONG KONG TREASURY MANAGEMENT HOLDING LTD FRN 31/12/2099	USD	827,667.70	941,097.24	0.68
1,000,000.00	CHINA HUANENG GROUP HONG KONG TREASURY MANAGEMENT HOLDING LTD FRN 31/12/2099	USD	839,591.15	916,342.34	0.66
STATI UNITI			2,000,000.00	1,750,400.00	1.26
Servizi di telecomunicazione			2,000,000.00	1,750,400.00	1.26
2,000,000.00	AT&T INC FRN 31/12/2099	EUR	2,000,000.00	1,750,400.00	1.26
AUSTRALIA			365,994.75	347,458.07	0.25
Finanza			365,994.75	347,458.07	0.25
500,000.00	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD FRN 29/10/2049	USD	365,994.75	347,458.07	0.25
Obbligazioni zero coupon			49,343,107.83	48,864,304.32	35.22
GERMANIA			30,889,381.00	30,423,668.00	21.93
Enti Governativi			30,889,381.00	30,423,668.00	21.93
31,900,000.00	BUNDESobligation 0.00% 16/04/2027	EUR	30,889,381.00	30,423,668.00	21.93
ITALIA			12,319,310.00	12,150,880.00	8.76
Enti Governativi			12,319,310.00	12,150,880.00	8.76
13,300,000.00	ITALY BTPORO 0.00% 01/08/2026	EUR	12,319,310.00	12,150,880.00	8.76
STATI UNITI			6,134,416.83	6,289,756.32	4.53
Enti Governativi			6,134,416.83	6,289,756.32	4.53
5,000,000.00	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND - WHEN ISSUED 0.00% 31/12/2026	USD	4,328,958.86	4,421,317.28	3.18
2,000,000.00	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND - WHEN ISSUED 0.00% 29/02/2024	USD	1,805,457.97	1,868,439.04	1.35
NEGOZIATI SU UN ALTRO MERCATO REGOLAMENTATO			7,111,767.40	7,149,329.51	5.15
Obbligazioni ordinarie			7,111,767.40	7,149,329.51	5.15
STATI UNITI			7,111,767.40	7,149,329.51	5.15
Beni voluttuari			4,149,400.55	4,291,760.69	3.09
1,803,536.11	US AIRWAYS 2012-2 CLASS A PASS THROUGH TRUST 4.63% 03/06/2025	USD	1,519,252.34	1,594,157.38	1.15
1,700,000.00	MICHAEL KORS USA INC 4.25% 01/11/2024	USD	1,547,091.46	1,564,530.27	1.13
1,169,000.00	DELTA AIR LINES INC 7.00% 01/05/2025	USD	1,083,056.75	1,133,073.04	0.81
Industria			2,962,366.85	2,857,568.82	2.06
1,500,000.00	LEONARDO US HOLDINGS INC 7.38% 15/07/2039	USD	1,682,678.88	1,636,635.12	1.18
1,250,000.00	LEONARDO US HOLDINGS INC 6.25% 15/01/2040	USD	1,279,687.97	1,220,933.70	0.88

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond**PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR**

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
ALTRI VALORI MOBILIARI			1,584,297.25	1,428,648.10	1.03
Obbligazioni a tasso variabile			1,584,297.25	1,428,648.10	1.03
ITALIA			1,584,297.25	1,428,648.10	1.03
Finanza			1,584,297.25	1,428,648.10	1.03
2,000,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 01/06/2032	USD	1,584,297.25	1,428,648.10	1.03
Totale del Portafoglio Titoli			131,557,601.66	128,471,752.22	92.59

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond

CONTRATTI FINANZIARI A TERMINE AL 30 GIUGNO 2022

Scadenza	Impegno di acquisto di valute		Impegno di vendita di valute		Plus/(minus)-valenza non realizzata (EUR)
					-23,627.04
21/09/2022	3,900,000.00	USD	3,717,333.57	EUR	-7,689.08
16/08/2022	9,704,530.04	USD	51,500,000.00	BRL	-16,360.67
21/09/2022	495,596.60	EUR	515,000.00	CHF	-18,947.01
21/09/2022	5,078,562.61	EUR	4,420,000.00	GBP	-34,620.71
21/09/2022	48,519,803.37	EUR	50,980,000.00	USD	28,091.60
25/07/2022	1,071,000.00	USD	1,000,531.47	EUR	22,566.11
25/07/2022	486,000.00	USD	461,345.51	EUR	2,917.26
25/07/2022	17,240.00	CHF	16,808.03	EUR	415.46

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Attività

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	61,259,717.47
Liquidità bancarie a vista		2,976,489.11
Importi dovuti dai broker	(Nota 12)	331,177.60
Interessi da ricevere		324,105.91
Da ricevere su sottoscrizioni		190,753.06
Altre attività		33,320.92
Totale attività		65,115,564.07

Passività

Da pagare su rimborsi		-4,753.75
Altre passività		-154,821.28
Totale passività		-159,575.03

Totale attivo netto**64,955,989.04**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	127.38	20,140.085
Azione D	EUR	105.32	2,329.167
Azione I	EUR	135.58	401,442.729
Azione L	EUR	133.87	16,441.000
Azione Y	EUR	133.32	41,374.823

NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate

PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Attivo netto all'inizio del periodo		76,194,062.01
Risultato netto degli investimenti		415,889.13
Altri ricavi		24,700.07
Totale ricavi		440,589.20
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-181,983.80
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 7)	-19,319.24
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-4,433.26
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 7)	-12,859.96
Commissioni del Transfer Agent		-26,770.68
Compensi professionali	(Nota 8)	-4,099.37
Pubblicazioni		-3,762.40
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-14,415.85
Totale costi		-267,644.56
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		172,944.64
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	-1,464,759.23
- di contratti futures		43,517.00
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		-4,351,843.74
Risultato netto delle operazioni per il periodo		-5,600,141.33
Distribuzioni di dividendi	(Nota 14)	-31,813.80
Sottoscrizioni del periodo		3,359,848.46
Rimborsi del periodo		-8,965,966.30
Attivo netto alla fine del periodo		64,955,989.04

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			66,127,623.22	61,259,717.47	94.31
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			65,727,623.22	60,846,361.97	93.67
Obbligazioni ordinarie			44,975,803.73	40,735,973.72	62.71
ITALIA			10,271,660.25	9,247,614.50	14.24
Energia			2,785,040.57	2,569,575.00	3.96
1,500,000.00	ENI SPA 0.38% 14/06/2028	EUR	1,498,610.20	1,305,390.00	2.01
1,300,000.00	ENI SPA 0.63% 19/09/2024	EUR	1,286,430.37	1,264,185.00	1.95
Servizi di pubblica utilità			2,652,768.45	2,385,355.00	3.67
1,500,000.00	A2A SPA 1.63% 19/10/2027	EUR	1,629,367.48	1,398,135.00	2.15
1,000,000.00	ERG SPA 1.88% 11/04/2025	EUR	1,023,400.97	987,220.00	1.52
Finanza			2,384,575.66	2,248,065.50	3.46
1,000,000.00	BANCA DEL MEZZOGIORNO-MEDIO CREDITO CENTRALE SPA 1.50% 24/10/2024	EUR	995,790.16	978,830.00	1.51
800,000.00	ANIMA HOLDING SPA 1.50% 22/04/2028	EUR	714,801.01	675,864.00	1.04
400,000.00	BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA 3.63% 24/09/2024	EUR	424,569.76	370,424.00	0.57
250,000.00	INTESA SANPAOLO SPA 0.63% 24/02/2026	EUR	249,414.73	222,947.50	0.34
Industria			2,449,275.57	2,044,619.00	3.15
1,500,000.00	POSTE ITALIANE SPA 0.50% 10/12/2028	EUR	1,485,850.10	1,255,530.00	1.93
500,000.00	AEROPORTI DI ROMA SPA REG 1.63% 08/06/2027	EUR	481,442.50	451,535.00	0.70
507,600.00	ENERTRONICA SPA 7.00% 31/12/2022	EUR	481,982.97	337,554.00	0.52
STATI UNITI			9,267,804.80	8,322,083.00	12.81
Beni voluttuari			2,937,453.52	2,567,128.00	3.95
1,300,000.00	MCDONALD'S CORP 1.88% 26/05/2027	EUR	1,459,276.49	1,262,092.00	1.94
800,000.00	AMERICAN HONDA FINANCE CORP 0.30% 07/07/2028	EUR	803,121.12	678,704.00	1.05
700,000.00	COMCAST CORP 0.25% 20/05/2027	EUR	675,055.91	626,332.00	0.96
Servizi di telecomunicazione			2,233,240.11	2,017,278.00	3.11
1,100,000.00	WARNER MEDIA LLC 1.95% 15/09/2023	EUR	1,145,758.29	1,097,668.00	1.69
1,000,000.00	VERIZON COMMUNICATIONS INC 1.38% 02/11/2028	EUR	1,087,481.82	919,610.00	1.42
Beni di prima necessità			2,122,706.72	2,003,480.00	3.08
2,000,000.00	KRAFT HEINZ FOODS CO 2.00% 30/06/2023	EUR	2,122,706.72	2,003,480.00	3.08
Informatica			1,072,543.85	948,200.00	1.46
1,000,000.00	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 1.25% 29/01/2027	EUR	1,072,543.85	948,200.00	1.46
Finanza			901,860.60	785,997.00	1.21
900,000.00	AMERICAN TOWER CORP 0.45% 15/01/2027	EUR	901,860.60	785,997.00	1.21
GERMANIA			5,914,635.62	5,385,170.52	8.29
Salute			2,007,049.50	1,844,106.00	2.84
1,300,000.00	FRESENIUS SE & CO KGAA 0.38% 28/09/2026	EUR	1,299,178.46	1,164,371.00	1.79
700,000.00	BAYER AG 0.38% 06/07/2024	EUR	707,871.04	679,735.00	1.05
Enti Governativi			1,438,127.30	1,417,620.00	2.18
1,500,000.00	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 0.25% 15/02/2029	EUR	1,438,127.30	1,417,620.00	2.18
Beni voluttuari			1,572,492.75	1,318,002.00	2.03
1,400,000.00	VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 2.25% 01/10/2027	EUR	1,572,492.75	1,318,002.00	2.03
Industria			896,966.07	805,442.52	1.24
841,000.00	HOCHTIEF AG 1.75% 03/07/2025	EUR	896,966.07	805,442.52	1.24
FRANCIA			5,818,311.78	5,313,543.00	8.18
Beni voluttuari			2,894,892.48	2,692,000.00	4.15
1,000,000.00	PERNOD RICARD SA 1.38% 07/04/2029	EUR	952,911.02	914,290.00	1.41
1,000,000.00	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE 0.13% 11/02/2028	EUR	921,453.43	892,510.00	1.38
1,000,000.00	RENAULT SA 1.00% 28/11/2025	EUR	1,020,528.03	885,200.00	1.36

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Industria			2,457,558.03	2,190,228.00	3.37
1,700,000.00	THALES SA REG 0.25% 29/01/2027	EUR	1,703,271.04	1,532,788.00	2.36
700,000.00	CIE DE SAINT-GOBAIN 1.38% 14/06/2027	EUR	754,286.99	657,440.00	1.01
Servizi di telecomunicazione			465,861.27	431,315.00	0.66
500,000.00	EUTELSAT SA 1.50% 13/10/2028	EUR	465,861.27	431,315.00	0.66
REGNO UNITO			5,758,128.88	5,280,805.00	8.13
Materie prime			1,516,361.35	1,417,170.00	2.18
1,500,000.00	ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC 1.63% 11/03/2026	EUR	1,516,361.35	1,417,170.00	2.18
Energia			1,548,953.84	1,360,245.00	2.09
1,500,000.00	BP CAPITAL MARKETS PLC 0.83% 08/11/2027	EUR	1,548,953.84	1,360,245.00	2.09
Servizi di telecomunicazione			1,138,842.35	1,004,850.00	1.55
1,000,000.00	SKY LTD 2.50% 15/09/2026	EUR	1,138,842.35	1,004,850.00	1.55
Finanza			1,001,050.26	969,530.00	1.49
1,000,000.00	HSBC HOLDINGS PLC 0.88% 06/09/2024	EUR	1,001,050.26	969,530.00	1.49
Salute			552,921.08	529,010.00	0.82
500,000.00	GLAXOSMITHKLINE CAPITAL PLC 4.00% 16/06/2025	EUR	552,921.08	529,010.00	0.82
PAESI BASSI			3,627,737.51	3,351,176.00	5.16
Finanza			1,541,668.42	1,397,280.00	2.15
1,500,000.00	NE PROPERTY BV 1.75% 23/11/2024	EUR	1,541,668.42	1,397,280.00	2.15
Industria			849,300.58	809,936.00	1.25
800,000.00	SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCHAPPIJ NV 2.88% 10/03/2028	EUR	849,300.58	809,936.00	1.25
Energia			599,305.62	579,750.00	0.89
600,000.00	REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV 0.13% 05/10/2024	EUR	599,305.62	579,750.00	0.89
Servizi di pubblica utilità			637,462.89	564,210.00	0.87
600,000.00	ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 1.13% 16/09/2026	EUR	637,462.89	564,210.00	0.87
LUSSEMBURGO			2,972,488.09	2,588,731.70	3.98
Finanza			1,550,129.82	1,332,150.00	2.05
1,500,000.00	GRAND CITY PROPERTIES SA 1.38% 03/08/2026	EUR	1,550,129.82	1,332,150.00	2.05
Industria			1,422,358.27	1,256,581.70	1.93
1,342,000.00	HEIDELBERGCEMENT FINANCE LUXEMBOURG SA 1.63% 07/04/2026	EUR	1,422,358.27	1,256,581.70	1.93
SPAGNA			1,345,036.80	1,246,850.00	1.92
Finanza			1,345,036.80	1,246,850.00	1.92
1,000,000.00	BANKINTER SA 0.63% 06/10/2027	EUR	905,892.21	854,750.00	1.32
400,000.00	BANCO DE SABADELL SA 5.63% 06/05/2026	EUR	439,144.59	392,100.00	0.60
Obbligazioni a tasso variabile			18,451,819.50	18,198,529.10	28.02
ITALIA			10,822,446.84	10,664,780.10	16.42
Finanza			7,863,723.46	7,662,980.10	11.80
2,000,000.00	BANCO BPM SPA FRN 30/07/2022	EUR	2,034,993.67	2,000,720.00	3.08
1,500,000.00	UNICREDIT SPA FRN 30/06/2023	EUR	1,495,943.18	1,499,505.00	2.31
1,000,000.00	UNICREDIT SPA FRN 09/03/2026	EUR	983,493.24	968,100.00	1.49
900,000.00	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA FRN 28/12/2024	EUR	908,463.24	905,958.00	1.39
900,000.00	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA FRN 10/09/2025	EUR	947,534.55	902,628.00	1.39
400,000.00	CASSA DEPOSITI E PRESTITI SPA FRN 28/06/2026	EUR	415,766.24	401,840.00	0.62
400,000.00	SERVIZI ASSICURATIVI DEL COMMERCIO ESTERO SPA FRN 10/02/2049	EUR	417,126.78	365,548.00	0.56
350,000.00	ICCREA BANCA SPA FRN 20/10/2025	EUR	356,671.11	334,414.50	0.52
313,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 25/01/2027	EUR	303,731.45	284,266.60	0.44
Servizi di pubblica utilità			1,959,633.60	2,000,500.00	3.08
2,000,000.00	SNAM SPA FRN 02/08/2024	EUR	1,959,633.60	2,000,500.00	3.08

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Enti Governativi			999,089.78	1,001,300.00	1.54
1,000,000.00	CCT FRN 15/09/2025	EUR	999,089.78	1,001,300.00	1.54
FRANCIA			3,142,040.26	3,111,469.00	4.79
Finanza			1,658,727.17	1,642,024.00	2.53
1,200,000.00	SOCIETE GENERALE SA FRN 22/05/2024	EUR	1,205,545.97	1,207,584.00	1.86
500,000.00	BNP PARIBAS SA FRN 30/05/2028	EUR	453,181.20	434,440.00	0.67
Beni voluttuari			1,483,313.09	1,469,445.00	2.26
1,500,000.00	RCI BANQUE SA FRN 12/03/2025	EUR	1,483,313.09	1,469,445.00	2.26
STATI UNITI			2,972,456.69	2,950,580.00	4.54
Finanza			2,972,456.69	2,950,580.00	4.54
1,500,000.00	GOLDMAN SACHS GROUP INC FRN 26/09/2023	EUR	1,500,623.19	1,500,210.00	2.31
1,000,000.00	GOLDMAN SACHS GROUP INC FRN 18/09/2025	EUR	984,138.50	971,070.00	1.49
500,000.00	GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE FRN 22/10/2025	EUR	487,695.00	479,300.00	0.74
MESSICO			991,266.35	976,100.00	1.50
Energia			991,266.35	976,100.00	1.50
1,000,000.00	PETROLEOS MEXICANOS FRN 24/08/2023	EUR	991,266.35	976,100.00	1.50
REGNO UNITO			523,609.36	495,600.00	0.77
Finanza			523,609.36	495,600.00	0.77
500,000.00	HSBC HOLDINGS PLC FRN 29/12/2049	EUR	523,609.36	495,600.00	0.77
Azioni di OICR			2,299,999.99	1,911,859.15	2.94
FRANCIA			2,299,999.99	1,911,859.15	2.94
Finanza			2,299,999.99	1,911,859.15	2.94
120,996.09	ELLIPSIS ASSET MANAGEMENT - ELLIPSIS MASTER TOP ECI FUND	EUR	2,299,999.99	1,911,859.15	2.94
ALTRI VALORI MOBILIARI			400,000.00	413,355.50	0.64
Obbligazioni ordinarie			400,000.00	413,355.50	0.64
ITALIA			400,000.00	413,355.50	0.64
Servizi di pubblica utilità			400,000.00	413,355.50	0.64
400,000.00	INNOVATEC SPA 6.00% 30/09/2026	EUR	400,000.00	413,355.50	0.64
Totale del Portafoglio Titoli			66,127,623.22	61,259,717.47	94.31

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative**PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR****Attività**

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	75,025,073.09
Liquidità bancarie a vista		3,429,334.39
Importi dovuti dai broker	(Nota 12)	260,567.49
Interessi da ricevere		193,436.55
Altre attività		3,582.97
Totale attività		78,911,994.49

Passività

Da pagare su acquisto titoli		-730,448.77
Da pagare su rimborsi		-63,887.41
Altre passività		-283,143.22
Totale passività		-1,077,479.40

Totale attivo netto**77,834,515.09**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	140.41	341,238.958
Azione D	EUR	140.14	6,717.538
Azione I	EUR	152.40	97,476.019
Azione L	EUR	150.65	93,746.000

NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative**PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR**

Attivo netto all'inizio del periodo		89,644,525.81
Risultato netto degli investimenti		406,205.05
Altri ricavi		6,839.66
Totale ricavi		413,044.71
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-397,891.39
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 7)	-23,120.83
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-13,216.16
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 7)	-27,792.45
Commissioni del Transfer Agent		-19,602.66
Compensi professionali	(Nota 8)	-10,304.50
Pubblicazioni		-4,194.40
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-22,838.36
Totale costi		-518,960.75
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		-105,916.04
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	-1,215,578.03
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		551,143.76
- di contratti futures		-24.00
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		-7,490,416.24
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(Nota 2c)	-253.98
Risultato netto delle operazioni per il periodo		-8,261,044.53
Distribuzioni di dividendi	(Nota 14)	-1,948.09
Sottoscrizioni del periodo		1,423,869.26
Rimborsi del periodo		-4,970,887.36
Attivo netto alla fine del periodo		77,834,515.09

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			77,767,647.36	75,025,073.09	96.39
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			73,618,514.43	71,268,302.15	91.56
Azioni			3,604,504.33	3,259,015.66	4.19
ITALIA			2,107,252.46	1,845,114.00	2.37
Industria			1,728,613.69	1,564,534.00	2.01
60,000.00	LEONARDO SPA	EUR	593,010.16	580,680.00	0.74
10,000.00	INTERPUMP GROUP SPA	EUR	428,576.19	363,800.00	0.47
10,000.00	PRYSMIAN SPA	EUR	274,735.13	262,100.00	0.34
20,000.00	INDUSTRIAL STARS OF ITALY 4 SPA	EUR	200,000.00	197,000.00	0.25
45,000.00	GRIFAL SPA	EUR	213,183.11	115,650.00	0.15
3,400.00	OFFICINA STELLARE SPA	EUR	18,545.46	44,710.00	0.06
40.00	FERVI SPA	EUR	563.64	594.00	0.00
Beni voluttuari			314,888.77	211,580.00	0.27
7,800.00	PORTOBELLO SPA	EUR	313,579.68	209,820.00	0.27
400.00	POWERSOFT SPA	EUR	1,309.09	1,760.00	0.00
Informatica			63,750.00	69,000.00	0.09
15,000.00	ALMAWAVE SPA	EUR	63,750.00	69,000.00	0.09
ISOLE CAYMAN			546,173.95	543,689.38	0.70
Servizi di telecomunicazione			546,173.95	543,689.38	0.70
5,000.00	ALIBABA GROUP HOLDING LTD -ADR-	USD	546,173.95	543,689.38	0.70
GERMANIA			497,570.35	455,300.00	0.59
Finanza			497,570.35	455,300.00	0.59
2,500.00	ALLIANZ SE REG	EUR	497,570.35	455,300.00	0.59
STATI UNITI			266,469.32	229,006.67	0.29
Informatica			266,469.32	229,006.67	0.29
5,500.00	MARVELL TECHNOLOGY INC	USD	266,469.32	229,006.67	0.29
IRLANDA			187,038.25	185,905.61	0.24
Informatica			187,038.25	185,905.61	0.24
700.00	ACCENTURE PLC -A-	USD	187,038.25	185,905.61	0.24
Obbligazioni ordinarie			28,607,340.02	26,840,983.38	34.48
ITALIA			9,418,083.60	8,986,449.00	11.55
Enti Governativi			5,369,792.00	5,295,015.00	6.80
3,300,000.00	BTP 0.65% 15/10/2023	EUR	3,284,525.03	3,287,295.00	4.22
1,000,000.00	BTP 1.75% 01/07/2024	EUR	1,008,691.70	1,006,420.00	1.29
1,000,000.00	BTP 2.00% 01/12/2025	EUR	1,076,575.27	1,001,300.00	1.29
Finanza			2,411,475.20	2,218,233.00	2.85
800,000.00	AZIMUT HOLDING SPA REG 1.63% 12/12/2024	EUR	825,119.92	775,872.00	1.00
800,000.00	UNICREDIT SPA 2.13% 24/10/2026	EUR	879,774.77	755,104.00	0.97
400,000.00	INTESA SANPAOLO SPA 2.86% 23/04/2025	EUR	407,648.99	393,608.00	0.50
300,000.00	BANCA DEL MEZZOGIORNO-MEDIOCREDITO CENTRALE SPA 1.50% 24/10/2024	EUR	298,931.52	293,649.00	0.38
Energia			999,352.58	900,917.00	1.16
700,000.00	ENI SPA 0.38% 14/06/2028	EUR	701,575.52	609,182.00	0.78
300,000.00	ENI SPA 0.63% 19/09/2024	EUR	297,777.06	291,735.00	0.38
Servizi di pubblica utilità			435,642.20	404,880.00	0.52
400,000.00	HERA SPA 2.38% 04/07/2024	EUR	435,642.20	404,880.00	0.52
Industria			201,821.62	167,404.00	0.22
200,000.00	POSTE ITALIANE SPA 0.50% 10/12/2028	EUR	201,821.62	167,404.00	0.22

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
SPAGNA			3,695,577.96	3,489,287.00	4.48
Enti Governativi			2,846,598.51	2,743,067.00	3.52
1,300,000.00	SPAIN GOVERNMENT BOND 0.35% 30/07/2023	EUR	1,302,243.34	1,295,749.00	1.66
1,000,000.00	SPAIN GOVERNMENT BOND 3.80% 30/04/2024	EUR	1,110,693.11	1,051,410.00	1.35
400,000.00	SPAIN GOVERNMENT BOND 1.30% 31/10/2026	EUR	433,662.06	395,908.00	0.51
Finanza			848,979.45	746,220.00	0.96
500,000.00	SANTANDER CONSUMER FINANCE SA REG 0.50% 14/11/2026	EUR	512,705.00	452,145.00	0.58
300,000.00	BANCO DE SABADELL SA 5.63% 06/05/2026	EUR	336,274.45	294,075.00	0.38
STATI UNITI			3,668,102.35	3,418,235.37	4.39
Servizi di telecomunicazione			1,071,228.33	958,745.00	1.23
500,000.00	WARNER MEDIA LLC 1.95% 15/09/2023	EUR	521,633.58	498,940.00	0.64
500,000.00	VERIZON COMMUNICATIONS INC 1.38% 02/11/2028	EUR	549,594.75	459,805.00	0.59
Enti Governativi			900,859.88	938,871.37	1.21
1,000,000.00	UNITED STATES TREASURY NOTE 2.00% 30/06/2024	USD	900,859.88	938,871.37	1.21
Finanza			499,269.63	436,665.00	0.56
500,000.00	AMERICAN TOWER CORP 0.45% 15/01/2027	EUR	499,269.63	436,665.00	0.56
Beni voluttuari			455,382.08	404,152.00	0.52
400,000.00	MCDONALD'S CORP 2.88% 17/12/2025	EUR	455,382.08	404,152.00	0.52
Informatica			423,109.18	379,280.00	0.49
400,000.00	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 1.25% 29/01/2027	EUR	423,109.18	379,280.00	0.49
Beni di prima necessità			318,253.25	300,522.00	0.38
300,000.00	KRAFT HEINZ FOODS CO 2.00% 30/06/2023	EUR	318,253.25	300,522.00	0.38
FRANCIA			3,374,839.24	3,238,787.39	4.16
Enti Governativi			2,766,366.96	2,680,325.39	3.44
2,539,269.00	FRANCE REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 0.10% 01/03/2025	EUR	2,766,366.96	2,680,325.39	3.44
Servizi di telecomunicazione			308,193.22	292,902.00	0.38
300,000.00	LAGARDERE SCA 1.63% 21/06/2024	EUR	308,193.22	292,902.00	0.38
Beni voluttuari			300,279.06	265,560.00	0.34
300,000.00	RENAULT SA 1.00% 28/11/2025	EUR	300,279.06	265,560.00	0.34
LUSSEMBURGO			2,374,135.75	2,193,625.62	2.82
Sovranazionale			1,217,692.35	1,197,415.62	1.54
1,233,000.00	EIB 0.13% 15/04/2025	EUR	1,217,692.35	1,197,415.62	1.54
Finanza			738,226.18	621,670.00	0.80
700,000.00	GRAND CITY PROPERTIES SA 1.38% 03/08/2026	EUR	738,226.18	621,670.00	0.80
Industria			418,217.22	374,540.00	0.48
400,000.00	HEIDELBERGCEMENT FINANCE LUXEMBOURG SA 1.63% 07/04/2026	EUR	418,217.22	374,540.00	0.48
REGNO UNITO			2,136,497.29	1,961,417.00	2.52
Servizi di telecomunicazione			1,292,011.62	1,174,025.00	1.51
700,000.00	SKY LTD 2.50% 15/09/2026	EUR	799,314.62	703,395.00	0.90
500,000.00	BRITISH TELECOMMUNICATIONS PLC 0.50% 12/09/2025	EUR	492,697.00	470,630.00	0.61
Beni di prima necessità			428,823.46	399,580.00	0.51
400,000.00	TESCO CORPORATE TREASURY SERVICES PLC 2.50% 01/07/2024	EUR	428,823.46	399,580.00	0.51
Finanza			415,662.21	387,812.00	0.50
400,000.00	HSBC HOLDINGS PLC 0.88% 06/09/2024	EUR	415,662.21	387,812.00	0.50

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
GERMANIA			1,036,247.76	951,935.00	1.22
Beni voluttuari			534,722.23	504,100.00	0.65
500,000.00	VOLKSWAGEN LEASING GMBH 2.63% 15/01/2024	EUR	534,722.23	504,100.00	0.65
Salute			501,525.53	447,835.00	0.57
500,000.00	FRESENIUS SE & CO KGAA 0.38% 28/09/2026	EUR	501,525.53	447,835.00	0.57
EMIRATI ARABI UNITI			995,498.04	913,450.00	1.17
Finanza			995,498.04	913,450.00	1.17
1,000,000.00	FIRST ABU DHABI BANK PJSC 0.13% 16/02/2026	EUR	995,498.04	913,450.00	1.17
PAESI BASSI			963,463.22	871,856.00	1.12
Finanza			514,059.54	465,760.00	0.60
500,000.00	NE PROPERTY BV 1.75% 23/11/2024	EUR	514,059.54	465,760.00	0.60
Beni voluttuari			449,403.68	406,096.00	0.52
400,000.00	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV 3.75% 29/03/2024	EUR	449,403.68	406,096.00	0.52
UNGHERIA			515,006.92	412,845.00	0.53
Energia			515,006.92	412,845.00	0.53
500,000.00	MOL HUNGARIAN OIL & GAS PLC 1.50% 08/10/2027	EUR	515,006.92	412,845.00	0.53
BERMUDA			429,887.89	403,096.00	0.52
Beni di prima necessità			429,887.89	403,096.00	0.52
400,000.00	BACARDI LTD 2.75% 03/07/2023	EUR	429,887.89	403,096.00	0.52
Obbligazioni a tasso variabile			11,925,804.82	11,688,832.00	15.02
ITALIA			7,439,372.95	7,278,082.00	9.35
Finanza			5,275,348.23	5,061,862.00	6.50
1,300,000.00	CASSA DEPOSITI E PRESTITI SPA FRN 28/06/2026	EUR	1,359,879.74	1,305,980.00	1.68
800,000.00	UNICREDIT SPA FRN 30/06/2023	EUR	800,159.94	794,240.00	1.02
600,000.00	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA FRN 10/09/2025	EUR	640,501.10	601,752.00	0.77
500,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 29/06/2027	EUR	542,691.99	516,595.00	0.66
500,000.00	BANCO BPM SPA FRN 30/07/2022	EUR	504,016.53	500,180.00	0.64
500,000.00	ICCREA BANCA SPA FRN 20/10/2025	EUR	504,156.58	477,735.00	0.62
300,000.00	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA FRN 25/01/2024	EUR	313,788.38	300,789.00	0.39
300,000.00	UNICREDIT SPA FRN 09/03/2026	EUR	296,708.64	290,430.00	0.37
300,000.00	SERVIZI ASSICURATIVI DEL COMMERCIO ESTERO SPA FRN 10/02/2049	EUR	313,445.33	274,161.00	0.35
Enti Governativi			2,164,024.72	2,216,220.00	2.85
1,200,000.00	CCT FRN 15/09/2025	EUR	1,172,684.49	1,201,560.00	1.54
600,000.00	CCT FRN 15/10/2024	EUR	592,400.46	610,620.00	0.79
400,000.00	CCT FRN 15/02/2024	EUR	398,939.77	404,040.00	0.52
FRANCIA			2,309,275.35	2,269,366.00	2.92
Beni voluttuari			1,486,244.26	1,478,620.00	1.90
1,000,000.00	RCI BANQUE SA FRN 12/03/2025	EUR	992,897.00	979,630.00	1.26
500,000.00	RCI BANQUE SA FRN 12/01/2023	EUR	493,347.26	498,990.00	0.64
Finanza			607,949.09	603,792.00	0.78
600,000.00	SOCIETE GENERALE SA FRN 22/05/2024	EUR	607,949.09	603,792.00	0.78
Energia			215,082.00	186,954.00	0.24
200,000.00	TOTAL SA FRN 29/12/2049	EUR	215,082.00	186,954.00	0.24
STATI UNITI			1,184,879.76	1,165,284.00	1.50
Finanza			1,184,879.76	1,165,284.00	1.50
1,200,000.00	GOLDMAN SACHS GROUP INC FRN 18/09/2025	EUR	1,184,879.76	1,165,284.00	1.50

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
MESSICO			992,276.76	976,100.00	1.25
Energia			992,276.76	976,100.00	1.25
1,000,000.00	PETROLEOS MEXICANOS FRN 24/08/2023	EUR	992,276.76	976,100.00	1.25
Obbligazioni zero coupon			11,230,252.72	11,050,085.00	14.20
GERMANIA			8,440,391.36	8,439,125.00	10.84
Enti Governativi			8,440,391.36	8,439,125.00	10.84
5,000,000.00	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0.00% 15/03/2024	EUR	4,981,423.98	4,957,850.00	6.37
3,500,000.00	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0.00% 15/12/2023	EUR	3,458,967.38	3,481,275.00	4.47
ITALIA			2,789,861.36	2,610,960.00	3.36
Enti Governativi			1,791,762.28	1,655,010.00	2.13
1,300,000.00	ITALY BTPORO 0.00% 01/04/2026	EUR	1,298,608.67	1,198,210.00	1.54
500,000.00	ITALY BTPORO 0.00% 01/08/2026	EUR	493,153.61	456,800.00	0.59
Servizi di pubblica utilità			998,099.08	955,950.00	1.23
1,000,000.00	INTESA SANPAOLO SPA 0.21% 26/01/2026	EUR	998,099.08	955,950.00	1.23
Azioni di OICR			18,250,612.54	18,425,834.51	23.67
LUSSEMBURGO			11,525,544.68	12,032,626.22	15.46
Finanza			11,525,544.68	12,032,626.22	15.46
6,442.45	PICTET - SECURITY -HI-	EUR	1,070,999.92	1,423,265.17	1.83
13,655.21	NORDEA 1 SICAV - LOW DURATION EUROPEAN COVERED BOND FUND -BI-	EUR	1,400,000.05	1,392,422.38	1.79
9,719.25	FLOSSBACH VON STORCH BOND OPPORTUNITIES -I-	EUR	1,279,999.64	1,268,070.16	1.63
411.29	CANDRIAM EQUITIES L EUROPE INNOVATION -I-	EUR	1,100,000.65	986,836.89	1.27
395.93	OYSTER FUNDS - JAPAN OPPORTUNITIES -R-	EUR	698,827.35	860,991.16	1.10
7,599.25	GAM STAR LUX - MERGER ARBITRAGE -I-	USD	749,472.41	845,225.39	1.08
5,064.56	MIRABAUD - EQUITIES GLOBAL FOCUS -IC-	USD	764,103.65	841,518.49	1.08
22,000.06	JPMORGAN FUNDS - US VALUE FUND -C-	USD	650,820.80	810,179.77	1.04
6,576.81	VONTOBEL FUND - EMERGING MARKETS DEBT -I-	USD	745,058.60	713,952.86	0.92
6,000.00	NEW MILLENNIUM SIF-SICAV - AIM SISTEMA ITALIA - PIR	EUR	600,000.00	701,962.80	0.90
4,668.42	RWC FUNDS - RWC ASIA CONVERTIBLES FUND -B-	EUR	749,999.89	628,751.15	0.81
3,920.83	CB-ACCENT LUX - SWAN SHORT-TERM HIGH YIELD -A-	EUR	501,331.89	475,322.58	0.61
2,859.58	VONTOBEL FUND - MTX SUSTAINABLE EMERGING MARKETS LEADERS	USD	400,050.76	426,673.02	0.55
22,000.00	ALGER SICAV - ALGER SMALL CAP FOCUS FUND -I-	EUR	514,879.04	356,400.00	0.46
3,101.10	NEW MILLENNIUM - VOLACTIVE -I-	EUR	300,000.03	301,054.40	0.39
IRLANDA			6,725,067.86	6,393,208.29	8.21
Finanza			6,725,067.86	6,393,208.29	8.21
101,380.33	GAM STAR ALPHA TECHNOLOGY	EUR	1,399,999.92	1,365,207.80	1.75
14,000.00	ISHARES CHINA LARGE CAP UCITS ETF	EUR	1,281,528.24	1,286,600.00	1.65
13,216.48	LAZARD GLOBAL CONVERTIBLES RECOVERY FUND -A-	EUR	1,499,999.99	1,271,205.60	1.63
8,039.58	MAN FUNDS VI PLC - MAN GLG EVENT DRIVEN ALTERNATIVE	EUR	950,000.08	941,997.82	1.21
5,800.16	PLURIMA FUNDS - APUANO FLEXIBLE BOND FUND -A-	EUR	645,325.82	636,996.77	0.82
8,000.00	WISDOMTREE AT1 COCO BOND UCITS ETF	EUR	678,174.78	636,400.00	0.82
62,427.75	TENDERCAPITAL BOND TWO STEPS FUND -IA-	EUR	270,000.00	254,767.63	0.33
0.23	MAN FUNDS VI PLC - MAN AHL TARGETRISK	EUR	39.03	32.67	0.00
Warrants			0.00	3,551.60	0.00
ITALIA			0.00	3,551.60	0.00
Industria			0.00	3,454.80	0.00
1,360.00	INDUSTRIAL STARS OF ITALY 4 SPA WARRANT C 10/06/2027	EUR	0.00	1,224.00	0.00
1,320.00	INDUSTRIAL STARS OF ITALY 4 SPA WARRANT B 10/06/2027	EUR	0.00	1,174.80	0.00
1,320.00	INDUSTRIAL STARS OF ITALY 4 SPA WARRANT A 10/06/2027	EUR	0.00	1,056.00	0.00
Beni voluttuari			0.00	96.80	0.00
100.00	SOSTRAVEL.COM SPA	EUR	0.00	96.80	0.00

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
QUOTE DI OICR			4,149,132.93	3,756,770.94	4.83
Azioni di OICR			4,149,132.93	3,756,770.94	4.83
IRLANDA			2,802,192.01	2,463,850.00	3.17
Finanza			2,802,192.01	2,463,850.00	3.17
50,000.00	SPDR S&P U.S. FINANCIALS SELECT SECTOR UCITS ETF	EUR	1,931,586.51	1,684,750.00	2.17
28,000.00	WISDOMTREE GLOBAL QUALITY DIVIDEND GROWTH UCITS ETF	EUR	870,605.50	779,100.00	1.00
LUSSEMBURGO			1,346,940.92	1,292,920.94	1.66
Finanza			1,346,940.92	1,292,920.94	1.66
6,181.62	MIRABAUD - SUSTAINABLE CONVERTIBLES GLOBAL	USD	896,941.02	855,297.57	1.10
3,831.74	PICTET - JAPANESE EQUITY SELECTION	EUR	449,999.90	437,623.37	0.56
Totale del Portafoglio Titoli			77,767,647.36	75,025,073.09	96.39

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Attività

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	15,369,633.18
Liquidità bancarie a vista		645,341.37
Importi dovuti dai broker	(Nota 12)	741,880.62
Contratti di opzioni al valore di mercato	(Note 2e, 12)	28,887.09
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	(Note 2c, 12)	3,350.28
Dividendi da ricevere		3,449.32
Interessi da ricevere		145,024.41
Altre attività		44,964.84
Totale attività		16,982,531.11

Passività

Scoperti bancari		-7,541.82
Perdite non realizzate su contratti futures	(Note 2d, 12)	-43,091.44
Altre passività		-104,443.94
Totale passività		-155,077.20

Totale attivo netto**16,827,453.91**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	118.23	24,948.375
Azione I	EUR	97.10	30,891.849
Azione L	EUR	118.03	92,166.000

NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible

PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Attivo netto all'inizio del periodo		18,416,344.18
Risultato netto degli investimenti		193,986.44
Altri ricavi		48,481.35
Totale ricavi		242,467.79
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-113,584.86
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 7)	-4,940.93
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-3,726.75
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 7)	-27,230.91
Commissioni del Transfer Agent		-801.86
Pubblicazioni		-6,265.10
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-14,887.12
Totale costi		-171,437.53
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		71,030.26
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	678,233.60
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		-393,967.95
- di contratti di opzioni		31,748.37
- di contratti futures		-802,847.73
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		-1,059,721.21
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(Nota 2c)	82,675.46
- sulle opzioni		3,642.06
- su contratti futures	(Nota 2d)	-43,091.44
Risultato netto delle operazioni per il periodo		-1,432,298.58
Sottoscrizioni del periodo		38,634.00
Rimborsi del periodo		-195,225.69
Attivo netto alla fine del periodo		16,827,453.91

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			15,916,463.61	15,369,633.18	91.33
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			15,519,533.28	15,012,471.15	89.21
Azioni			1,730,315.91	1,628,025.28	9.67
STATI UNITI			999,840.73	1,015,092.18	6.03
Salute			309,221.69	367,392.07	2.18
1,500.00	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	USD	81,572.91	110,478.75	0.66
1,500.00	HENRY SCHEIN INC	USD	96,439.29	110,105.71	0.65
400.00	ABBVIE INC	USD	38,173.75	58,600.61	0.35
1,000.00	PFIZER INC	USD	48,240.83	50,150.66	0.30
200.00	STRYKER CORP	USD	44,794.91	38,056.34	0.22
Informatica			264,301.40	250,821.69	1.49
350.00	MICROSOFT CORP	USD	64,899.02	85,982.60	0.51
1,000.00	FISERV INC	USD	93,719.99	85,102.12	0.51
350.00	QORVO INC	USD	48,973.18	31,576.84	0.19
200.00	NVIDIA CORP	USD	32,304.49	28,999.96	0.17
400.00	COHU INC	USD	12,061.73	10,617.44	0.06
300.00	ULTRA CLEAN HOLDINGS INC	USD	12,342.99	8,542.73	0.05
Energia			224,592.84	218,499.23	1.30
3,500.00	APA CORP	USD	122,376.89	116,839.65	0.70
1,000.00	VALERO ENERGY CORP	USD	102,215.95	101,659.58	0.60
Materie prime			137,760.78	118,058.27	0.70
1,000.00	NEWMONT MINING CORP	USD	59,786.21	57,075.91	0.34
1,400.00	FREEMONT-MCMORAN INC	USD	43,946.82	39,183.13	0.23
500.00	ALCOA CORP	USD	34,027.75	21,799.23	0.13
Beni voluttuari			39,848.67	31,919.27	0.19
1,000.00	BORGWARNER INC	USD	39,848.67	31,919.27	0.19
Industria			24,115.35	28,401.65	0.17
250.00	AGILENT TECHNOLOGIES INC	USD	24,115.35	28,401.65	0.17
IRLANDA			151,674.90	149,223.03	0.89
Salute			113,417.59	94,433.03	0.56
1,100.00	MEDTRONIC PLC	USD	113,417.59	94,433.03	0.56
Industria			38,257.31	54,790.00	0.33
200.00	LINDE PLC	EUR	38,257.31	54,790.00	0.33
ITALIA			183,239.98	148,720.00	0.88
Servizi di pubblica utilità			85,469.12	67,780.00	0.40
20,000.00	IREN SPA	EUR	46,611.34	41,680.00	0.25
5,000.00	ENEL SPA	EUR	38,857.78	26,100.00	0.15
Finanza			54,885.06	44,560.00	0.26
5,000.00	POSTE ITALIANE SPA	EUR	54,885.06	44,560.00	0.26
Industria			42,885.80	36,380.00	0.22
1,000.00	INTERPUMP GROUP SPA	EUR	42,885.80	36,380.00	0.22
BELGIO			87,783.62	71,712.00	0.43
Finanza			87,783.62	71,712.00	0.43
900.00	GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	EUR	87,783.62	71,712.00	0.43
SVIZZERA			56,039.09	54,281.06	0.32
Salute			56,039.09	54,281.06	0.32
600.00	NOVARTIS AG REG	CHF	44,816.22	48,468.25	0.29
100.00	CRISPR THERAPEUTICS AG	USD	11,222.87	5,812.81	0.03

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
GERMANIA			66,866.62	48,545.00	0.29
Industria			66,866.62	48,545.00	0.29
500.00	SIEMENS AG REG	EUR	66,866.62	48,545.00	0.29
PAESI BASSI			62,700.54	45,585.00	0.27
Informatica			62,700.54	45,585.00	0.27
100.00	ASML HOLDING NV	EUR	62,700.54	45,585.00	0.27
FRANCIA			72,239.16	44,170.00	0.26
Industria			72,239.16	44,170.00	0.26
200.00	SCHNEIDER ELECTRIC SE	EUR	28,322.64	22,580.00	0.13
1,000.00	ALSTOM SA	EUR	43,916.52	21,590.00	0.13
SPAGNA			41,705.97	41,246.53	0.24
Servizi di pubblica utilità			41,705.97	41,246.53	0.24
4,168.00	IBERDROLA SA	EUR	41,705.97	41,246.53	0.24
ISOLE CAYMAN			8,225.30	9,450.48	0.06
Industria			8,225.30	9,450.48	0.06
1,000.00	SCION TECH GROWTH I -A-	USD	8,225.30	9,450.48	0.06
Obbligazioni ordinarie			6,706,782.33	6,523,604.32	38.77
STATI UNITI			2,371,431.24	2,320,133.33	13.79
Informatica			1,003,005.19	983,232.47	5.84
700,000.00	APPLE INC 1.00% 10/11/2022	EUR	722,176.00	701,988.00	4.17
300,000.00	MICROCHIP TECHNOLOGY INC 4.25% 01/09/2025	USD	280,829.19	281,244.47	1.67
Finanza			755,227.00	708,127.00	4.21
700,000.00	JPMORGAN CHASE & CO 2.75% 01/02/2023	EUR	755,227.00	708,127.00	4.21
Enti Governativi			613,199.05	628,773.86	3.74
380,000.00	UNITED STATES TREASURY NOTE 0.38% 15/08/2024	USD	329,092.59	343,957.03	2.05
300,000.00	US TREASURY NOTES 2.75% 15/05/2025	USD	284,106.46	284,816.83	1.69
PAESI BASSI			1,235,955.78	1,205,276.11	7.16
Enti Governativi			440,897.50	419,465.35	2.49
500,000.00	PROSUS NV 3.26% 19/01/2027	USD	440,897.50	419,465.35	2.49
Beni voluttuari			409,324.52	400,776.00	2.38
400,000.00	FERRARI NV 1.50% 16/03/2023	EUR	409,324.52	400,776.00	2.38
Finanza			385,733.76	385,034.76	2.29
300,000.00	ING GROEP NV 4.63% 06/01/2026	USD	281,549.76	287,640.76	1.71
100,000.00	ING GROEP NV 2.13% 10/01/2026	EUR	104,184.00	97,394.00	0.58
ITALIA			1,115,852.00	1,066,865.00	6.34
Beni di prima necessità			797,931.00	783,216.00	4.65
800,000.00	ESSELUNGA SPA 0.88% 25/10/2023	EUR	797,931.00	783,216.00	4.65
Industria			216,900.00	183,186.00	1.09
200,000.00	WEBUILD SPA 5.88% 15/12/2025	EUR	216,900.00	183,186.00	1.09
Finanza			101,021.00	100,463.00	0.60
100,000.00	INTESA SANPAOLO SPA 2.13% 30/08/2023	EUR	101,021.00	100,463.00	0.60
FRANCIA			855,555.60	776,502.32	4.62
Servizi di telecomunicazione			500,000.00	447,220.00	2.66
500,000.00	ILIAD HOLDING SASU 5.13% 15/10/2026	EUR	500,000.00	447,220.00	2.66

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Finanza			253,760.60	237,265.32	1.41
300,000.00	AXA SA 4.50% 29/12/2049	USD	253,760.60	237,265.32	1.41
Beni voluttuari			101,795.00	92,017.00	0.55
100,000.00	ACCOR SA 3.00% 04/02/2026	EUR	101,795.00	92,017.00	0.55
GERMANIA			425,978.59	469,190.35	2.79
Materie prime			425,978.59	469,190.35	2.79
500,000.00	BASF SE 0.93% 09/03/2023	USD	425,978.59	469,190.35	2.79
REGNO UNITO			265,999.62	266,371.45	1.58
Finanza			265,999.62	266,371.45	1.58
300,000.00	PRUDENTIAL PLC 4.88% 24/10/2022	USD	265,999.62	266,371.45	1.58
LUSSEMBURGO			234,089.50	219,301.76	1.30
Servizi di telecomunicazione			234,089.50	219,301.76	1.30
300,000.00	TELECOM ITALIA CAPITAL SA 7.20% 18/07/2036	USD	234,089.50	219,301.76	1.30
MESSICO			201,920.00	199,964.00	1.19
Energia			201,920.00	199,964.00	1.19
200,000.00	PETROLEOS MEXICANOS 2.50% 24/11/2022	EUR	201,920.00	199,964.00	1.19
Obbligazioni a tasso variabile			4,206,559.78	3,885,211.43	23.09
ITALIA			2,168,591.34	1,961,681.35	11.66
Finanza			1,577,200.00	1,429,944.00	8.50
500,000.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA FRN 30/11/2049	EUR	550,500.00	484,555.00	2.88
300,000.00	FINECOBANCA BANCA FINECO SPA FRN 31/12/2099	EUR	314,250.00	288,150.00	1.71
200,000.00	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA FRN 25/01/2024	EUR	207,550.00	200,526.00	1.19
200,000.00	UNICREDIT SPA FRN 31/12/2099	EUR	207,800.00	190,202.00	1.13
200,000.00	ICCREA BANCA SPA FRN 18/01/2032	EUR	200,000.00	169,028.00	1.01
100,000.00	INTESA SANPAOLO VITA SPA FRN 31/12/2049	EUR	97,100.00	97,483.00	0.58
Servizi di pubblica utilità			303,766.34	294,338.35	1.75
300,000.00	ENEL SPA FRN 24/09/2073	USD	303,766.34	294,338.35	1.75
Energia			287,625.00	237,399.00	1.41
300,000.00	ENI SPA FRN 31/12/2099	EUR	287,625.00	237,399.00	1.41
FRANCIA			758,385.87	738,878.57	4.39
Finanza			758,385.87	738,878.57	4.39
500,000.00	BNP PARIBAS SA FRN 31/12/2099	USD	456,164.87	459,878.57	2.73
300,000.00	LA BANQUE POSTALE SA FRN 17/06/2026	EUR	302,221.00	279,000.00	1.66
GERMANIA			429,373.00	385,594.00	2.29
Finanza			339,723.00	301,605.00	1.79
300,000.00	ALLIANZ SE FRN 31/12/2049	EUR	339,723.00	301,605.00	1.79
Salute			89,650.00	83,989.00	0.50
100,000.00	BAYER AG FRN 25/03/2082	EUR	89,650.00	83,989.00	0.50
PAESI BASSI			352,387.57	329,291.97	1.96
Finanza			352,387.57	329,291.97	1.96
800,000.00	AEGON NV FRN 29/06/2049	NLG	352,387.57	329,291.97	1.96
REGNO UNITO			327,232.21	309,738.74	1.84
Finanza			249,482.21	233,537.74	1.39
300,000.00	STANDARD CHARTERED PLC FRN 29/01/2049	USD	249,482.21	233,537.74	1.39
Servizi di telecomunicazione			77,750.00	76,201.00	0.45
100,000.00	VODAFONE GROUP PLC FRN 27/08/2080	EUR	77,750.00	76,201.00	0.45

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
STATI UNITI			170,589.79	160,026.80	0.95
Finanza			170,589.79	160,026.80	0.95
200,000.00	EVEREST REINSURANCE HOLDINGS INC FRN 15/05/2037	USD	170,589.79	160,026.80	0.95
Obbligazioni zero coupon			1,471,768.77	1,469,178.21	8.73
GERMANIA			1,296,477.50	1,284,157.00	7.63
Enti Governativi			996,620.00	996,940.00	5.92
1,000,000.00	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0.00% 16/06/2023	EUR	996,620.00	996,940.00	5.92
Salute			299,857.50	287,217.00	1.71
300,000.00	FRESENIUS SE & CO KGAA 0.00% 31/01/2024	EUR	299,857.50	287,217.00	1.71
ISOLE CAYMAN			175,291.27	185,021.21	1.10
Finanza			175,291.27	185,021.21	1.10
234,475.30	PERU PAYROLL DEDUCTION FINANCE LTD 0.00% 01/11/2029	USD	175,291.27	185,021.21	1.10
Azioni di OICR			1,404,106.49	1,506,451.91	8.95
FRANCIA			600,732.11	687,433.92	4.09
Finanza			600,732.11	687,433.92	4.09
471.00	SYQUANT CAPITAL - HELIUM OPPORTUNITES -A-	EUR	600,732.11	687,433.92	4.09
AUSTRIA			563,325.57	589,456.99	3.50
Finanza			563,325.57	589,456.99	3.50
3,200.27	ERSTE SPARINVEST - ESPA BOND EMERGING MARKETS CORPORATE	EUR	563,325.57	589,456.99	3.50
IRLANDA			240,048.81	229,561.00	1.36
Finanza			240,048.81	229,561.00	1.36
1,000.00	ISHARES EUR ULTRASHORT BOND UCITS ETF	EUR	100,280.18	99,310.00	0.59
350.00	ISHARES EUR INFLATION LINKED GOVT BOND UCITS ETF	EUR	79,529.45	78,211.00	0.46
5,000.00	ISHARES GLOBAL CLEAN ENERGY UCITS ETF	EUR	60,239.18	52,040.00	0.31
Warrants			0.00	0.00	0.00
ITALIA			0.00	0.00	0.00
Beni voluttuari			0.00	0.00	0.00
3,619.00	WEBUILD SPA 02/08/2030	EUR	0.00	0.00	0.00
ALTRI VALORI MOBILIARI			396,930.33	357,162.03	2.12
Obbligazioni a tasso variabile			396,930.33	357,162.03	2.12
ITALIA			396,930.33	357,162.03	2.12
Finanza			396,930.33	357,162.03	2.12
500,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 01/06/2032	USD	396,930.33	357,162.03	2.12
Totale del Portafoglio Titoli			15,916,463.61	15,369,633.18	91.33

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible

IMPEGNI SU ACQUISTO / VENDITA DI CONTRATTI FUTURES AL 30 GIUGNO 2022

Valore nominale	Quantità	Acquisto / Vendita	Contratto	Scadenza	Valore di mercato al 30 Giugno 2022	Valuta	Plus/(minus) valenza non realizzata (EUR)	Impegno (EUR)
							-43,091.44	852,860.66
50	5	Acquisto	STOXX 600 BAS	16/09/2022	545.80	EUR	-3,050.00	136,450.00
10	8	Acquisto	EURO STOXX 50	16/09/2022	3,441.00	EUR	-8,720.00	275,280.00
20	2	Acquisto	NASDAQ 100 E-MINI SEP22	16/09/2022	11,028.27	USD	-31,321.44	441,130.66

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible

CONTRATTI DI OPZIONI AL 30 GIUGNO 2022

Quantità	Acquisto / Vendita		Call/Put	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	Impegno (EUR)
CONTRATTI DI OPZIONI						25,245.03	28,887.09	0.00
OPZIONI ACQUISTATE						25,245.03	28,887.09	0.00
8	Acquisto		CALL	S&P500 E-MINI 4,000.00 16/09/2022	USD	25,245.03	28,887.09	0.00

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible**CONTRATTI FINANZIARI A TERMINE AL 30 GIUGNO 2022**

Scadenza	Impegno di acquisto di valute		Impegno di vendita di valute		Plus/(minus)-valenza non realizzata (EUR)
					3,350.28
21/09/2022	5,786,590.91	EUR	6,080,000.00	USD	3,350.28

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Attività

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	36,585,473.56
Liquidità bancarie a vista		1,228,129.88
Importi dovuti dai broker	(Nota 12)	73,656.11
Interessi da ricevere		135,540.66
Da ricevere su sottoscrizioni		69,348.86
Altre attività		3,598.53
Totale attività		38,095,747.60

Passività

Da pagare su rimborsi		-5,659.93
Altre passività		-78,737.37
Totale passività		-84,397.30

Totale attivo netto**38,011,350.30**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	108.50	26,080.405
Azione I	EUR	114.92	273,722.385
Azione L	EUR	113.26	11,039.000
Azione Y	EUR	112.55	21,996.025

NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe**PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR**

Attivo netto all'inizio del periodo		37,821,672.95
Risultato netto degli investimenti		1,603,039.47
Totale ricavi		1,603,039.47
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-95,125.72
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 7)	-10,588.80
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-2,694.33
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 7)	-9,890.51
Commissioni del Transfer Agent		-2,879.59
Compensi professionali	(Nota 8)	-4,233.77
Pubblicazioni		-3,528.30
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-12,507.96
Totale costi		-141,448.98
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		1,461,590.49
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	171,868.60
- di contratti futures		-19,854.00
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		-1,734,169.12
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(Nota 2c)	1,191.96
Risultato netto delle operazioni per il periodo		-119,372.07
Distribuzioni di dividendi	(Nota 14)	-12,537.73
Sottoscrizioni del periodo		3,248,899.82
Rimborsi del periodo		-2,927,312.67
Attivo netto alla fine del periodo		38,011,350.30

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			38,424,223.93	36,585,473.56	96.25
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			37,804,079.66	36,005,187.62	94.72
Obbligazioni ordinarie			34,401,527.81	33,042,636.13	86.93
ITALIA			14,578,891.90	13,803,020.46	36.31
Enti Governativi			14,379,604.21	13,607,254.46	35.80
8,186,520.04	BTP 3.10% 15/09/2026	EUR	10,037,422.26	9,459,523.91	24.89
3,261,115.20	BTP 0.65% 15/05/2026	EUR	3,585,930.73	3,364,492.55	8.85
972,000.00	ITALY BTPORO 0.95% 01/06/2032	EUR	756,250.85	783,237.60	2.06
0.34	BTP 2.60% 15/09/2023	EUR	0.34	0.37	0.00
0.03	BTP 1.45% 26/11/2022	EUR	0.03	0.03	0.00
Finanza			199,287.69	195,766.00	0.51
200,000.00	BANCA DEL MEZZOGIORNO-MEDIOCREDITO CENTRALE SPA 1.50% 24/10/2024	EUR	199,287.69	195,766.00	0.51
GERMANIA			11,767,880.58	11,391,966.51	29.97
Enti Governativi			11,567,754.56	11,202,190.51	29.47
8,614,960.64	DEUTSCHE BUNDESREPUBLIK INFLATION LINKED BOND 0.10% 15/04/2026	EUR	9,588,291.85	9,214,303.45	24.24
1,914,872.95	DEUTSCHE BUNDESREPUBLIK INFLATION LINKED BOND 0.10% 15/04/2023	EUR	1,979,462.71	1,987,887.06	5.23
Finanza			200,126.02	189,776.00	0.50
200,000.00	DEUTSCHE WOHNEN SE 1.00% 30/04/2025	EUR	200,126.02	189,776.00	0.50
FRANCIA			7,896,701.63	7,695,363.16	20.25
Enti Governativi			7,896,701.63	7,695,363.16	20.25
4,717,808.76	FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 0.10% 01/03/2026	EUR	5,203,757.71	5,012,860.52	13.19
1,798,676.55	FRANCE REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 2.10% 25/07/2023	EUR	1,928,220.72	1,926,184.73	5.07
716,515.47	FRANCE REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 0.10% 01/03/2025	EUR	764,723.19	756,317.90	1.99
0.01	FRANCE REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 1.10% 25/07/2022	EUR	0.01	0.01	0.00
PAESI BASSI			158,053.70	152,286.00	0.40
Beni voluttuari			158,053.70	152,286.00	0.40
150,000.00	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV 3.75% 29/03/2024	EUR	158,053.70	152,286.00	0.40
Obbligazioni a tasso variabile			1,739,864.42	1,544,936.50	4.06
ITALIA			628,644.86	539,111.90	1.42
Finanza			479,735.82	424,870.40	1.12
380,000.00	CREDITO EMILIANO SPA FRN 19/01/2028	EUR	380,132.99	331,371.40	0.87
100,000.00	UNICREDIT SPA FRN 16/06/2026	EUR	99,602.83	93,499.00	0.25
Servizi di pubblica utilità			148,909.04	114,241.50	0.30
150,000.00	ENEL SPA FRN 31/12/2099	EUR	148,909.04	114,241.50	0.30
REGNO UNITO			493,043.26	463,881.60	1.22
Finanza			493,043.26	463,881.60	1.22
468,000.00	HSBC HOLDINGS PLC FRN 29/12/2049	EUR	493,043.26	463,881.60	1.22
PAESI BASSI			201,160.43	181,842.00	0.48
Beni voluttuari			201,160.43	181,842.00	0.48
200,000.00	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN 31/12/2099	EUR	201,160.43	181,842.00	0.48
SPAGNA			199,545.79	180,716.00	0.47
Finanza			199,545.79	180,716.00	0.47
200,000.00	CAIXABANK SA FRN 18/11/2026	EUR	199,545.79	180,716.00	0.47

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
FRANCIA			217,470.08	179,385.00	0.47
Servizi di pubblica utilità			117,885.27	91,723.00	0.24
100,000.00	ELECTRICITE DE FRANCE SA FRN 29/01/2049	EUR	117,885.27	91,723.00	0.24
Finanza			99,584.81	87,662.00	0.23
100,000.00	SOCIETE GENERALE SA FRN 24/11/2030	EUR	99,584.81	87,662.00	0.23
Obbligazioni zero coupon			450,514.64	424,310.00	1.12
ITALIA			250,542.68	231,630.00	0.61
Servizi di pubblica utilità			250,542.68	231,630.00	0.61
250,000.00	ACEA SPA 0.00% 28/09/2025	EUR	250,542.68	231,630.00	0.61
CINA			199,971.96	192,680.00	0.51
Finanza			199,971.96	192,680.00	0.51
200,000.00	BANK OF CHINA LTD/LUXEMBOURG 0.00% 28/04/2024	EUR	199,971.96	192,680.00	0.51
Azioni di OICR			1,212,172.79	993,304.99	2.61
JERSEY			738,472.79	566,179.56	1.49
Finanza			738,472.79	566,179.56	1.49
39,090.00	WISDOMTREE INDUSTRIAL METALS	EUR	738,472.79	566,179.56	1.49
IRLANDA			473,700.00	427,125.43	1.12
Finanza			473,700.00	427,125.43	1.12
104,661.95	TENDERCAPITAL BOND TWO STEPS FUND -IA-	EUR	473,700.00	427,125.43	1.12
QUOTE DI OICR			620,144.27	580,285.94	1.53
Azioni di OICR			620,144.27	580,285.94	1.53
JERSEY			620,144.27	580,285.94	1.53
Finanza			620,144.27	580,285.94	1.53
90,345.00	WISDOMTREE AGRICULTURE	EUR	620,144.27	580,285.94	1.53
Totale del Portafoglio Titoli			38,424,223.93	36,585,473.56	96.25

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Attività

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	52,274,013.09
Liquidità bancarie a vista		235,845.58
Importi dovuti dai broker	(Nota 12)	1,855,476.57
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	(Note 2c, 12)	9,566.34
Interessi da ricevere		956,106.93
Altre attività		9,830.22
Totale attività		55,340,838.73

Passività

Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	(Note 2c, 12)	-36,609.66
Perdite non realizzate su contratti futures	(Note 2d, 12)	-84,690.00
Altre passività		-188,489.26
Totale passività		-309,788.92

Totale attivo netto**55,031,049.81**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	123.60	17,543.542
Azione D	EUR	94.86	6,868.385
Azione I	EUR	132.59	392,507.437
Azione L	EUR	131.02	1,274.000

NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond**PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR**

Attivo netto all'inizio del periodo		63,945,371.64
Risultato netto degli investimenti		1,283,923.74
Altri ricavi		8,363.55
Totale ricavi		1,292,287.29
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-248,027.73
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 7)	-16,282.91
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-3,533.90
Interessi pagati su contratti swap		-34,236.12
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 7)	-12,666.12
Commissioni del Transfer Agent		-17,013.18
Compensi professionali	(Nota 8)	-13,175.24
Pubblicazioni		-6,974.46
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-13,535.03
Totale costi		-365,444.69
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		926,842.60
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	-99,798.42
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		-1,397,134.63
- di contratti futures		727,587.66
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		-6,551,410.90
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(Nota 2c)	547,616.26
- su contratti futures	(Nota 2d)	-84,690.00
Risultato netto delle operazioni per il periodo		-5,930,987.43
Distribuzioni di dividendi	(Nota 14)	-38,846.27
Sottoscrizioni del periodo		3,330,077.20
Rimborsi del periodo		-6,274,565.33
Attivo netto alla fine del periodo		55,031,049.81

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			55,703,730.79	52,274,013.09	94.99
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			49,210,114.05	46,306,697.15	84.15
Obbligazioni ordinarie			17,648,056.30	16,516,322.65	30.01
ITALIA			15,296,320.27	14,384,089.10	26.14
Finanza			8,820,722.51	8,565,557.50	15.56
2,100,000.00	VITTORIA ASSICURAZIONI SPA 5.75% 11/07/2028	EUR	2,212,375.00	2,171,757.00	3.95
2,000,000.00	BANCA POPOLARE DI SONDRIO SCPA 2.38% 03/04/2024	EUR	1,976,400.00	1,966,140.00	3.57
1,500,000.00	AZIMUT HOLDING SPA REG 1.63% 12/12/2024	EUR	1,496,837.51	1,454,760.00	2.64
1,000,000.00	EUROVITA ASSICURAZIONI SPA 6.00% 22/12/2025	EUR	1,000,000.00	1,022,320.00	1.86
1,000,000.00	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE SIIQ SPA 2.13% 28/11/2024	EUR	993,360.00	911,340.00	1.65
500,000.00	ANIMA HOLDING SPA 1.75% 23/10/2026	EUR	485,250.00	463,815.00	0.84
400,000.00	NET INSURANCE SPA 5.10% 28/09/2031	EUR	400,000.00	339,228.00	0.62
250,000.00	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA 1.13% 23/04/2025	EUR	256,500.00	236,197.50	0.43
Industria			5,195,137.01	4,644,166.60	8.44
1,500,000.00	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA 1.63% 21/10/2028	EUR	1,496,325.00	1,275,330.00	2.32
1,000,000.00	WEBUILD SPA 3.88% 28/07/2026	EUR	951,640.00	828,910.00	1.51
720,000.00	WEBUILD SPA 5.88% 15/12/2025	EUR	765,363.00	659,469.60	1.20
600,000.00	SOFIMA HOLDING SPA 3.75% 15/01/2028	EUR	579,444.00	484,002.00	0.88
500,000.00	LEONARDO SPA 2.38% 08/01/2026	EUR	496,300.00	476,040.00	0.86
500,000.00	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA 1.88% 08/07/2026	EUR	499,045.00	462,830.00	0.84
500,000.00	SALINI IMPREGILO SPA 1.75% 26/10/2024	EUR	407,020.01	457,585.00	0.83
Beni voluttuari			630,460.75	587,457.50	1.07
300,000.00	GAMMA BIDCO S.P.A. 6.25% 15/07/2025	EUR	310,197.00	280,107.00	0.51
250,000.00	PIAGGIO & C SPA 3.63% 30/04/2025	EUR	251,500.00	238,567.50	0.43
68,750.00	SISAL GROUP SPA 7.00% 31/07/2023	EUR	68,763.75	68,783.00	0.13
Informatica			350,000.00	333,560.50	0.61
350,000.00	WIIT SPA 2.38% 07/10/2026	EUR	350,000.00	333,560.50	0.61
Enti Governativi			300,000.00	253,347.00	0.46
300,000.00	ALMAVIVA THE ITALIAN INN 4.88% 30/10/2026	EUR	300,000.00	253,347.00	0.46
STATI UNITI			1,111,611.03	1,070,859.55	1.95
Energia			1,111,611.03	1,070,859.55	1.95
1,000,000.00	ENI USA INC 7.30% 15/11/2027	USD	1,111,611.03	1,070,859.55	1.95
FRANCIA			628,950.00	536,664.00	0.97
Servizi di telecomunicazione			628,950.00	536,664.00	0.97
600,000.00	ILIAD HOLDING SASU 5.13% 15/10/2026	EUR	628,950.00	536,664.00	0.97
LUSSEMBURGO			611,175.00	524,710.00	0.95
Servizi di telecomunicazione			611,175.00	524,710.00	0.95
500,000.00	TELECOM ITALIA FINANCE SA 7.75% 24/01/2033	EUR	611,175.00	524,710.00	0.95
Obbligazioni a tasso variabile			31,086,774.05	29,339,578.69	53.32
ITALIA			26,397,136.41	25,508,183.21	46.35
Finanza			20,894,205.73	19,950,950.74	36.25
3,300,000.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA FRN 29/06/2049	GBP	3,483,482.40	3,785,191.74	6.88
3,000,000.00	UNICREDIT SPA FRN 31/12/2099	EUR	3,160,233.33	2,853,030.00	5.18
2,500,000.00	FINCOBANK BANCA FINECO SPA FRN 31/12/2099	EUR	2,673,050.00	2,401,250.00	4.36
1,300,000.00	INTESA SANPAOLO VITA SPA FRN 31/12/2049	EUR	1,289,050.00	1,267,279.00	2.30
1,200,000.00	BANCA SELLA SPA FRN 22/09/2027	EUR	1,200,000.00	1,204,872.00	2.19
1,200,000.00	SOCIETA CATTOLICA DI ASSICURAZIONI SC FRN 14/12/2047	EUR	1,282,875.00	1,129,212.00	2.05
1,000,000.00	AMISSIMA VITA SPA FRN 16/08/2031	EUR	1,000,000.00	1,042,770.00	1.89
1,000,000.00	ICCREA BANCA SPA FRN 20/10/2025	EUR	999,390.00	955,470.00	1.74
1,000,000.00	ICCREA BANCA SPA FRN 28/11/2029	EUR	1,000,000.00	941,300.00	1.71

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
1,000,000.00	UNIONE DI BANCHE ITALIANE SPA REG FRN 31/12/2099	EUR	1,000,000.00	922,520.00	1.68
1,000,000.00	UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA FRN 31/12/2099	EUR	1,000,000.00	879,980.00	1.60
700,000.00	BANCA POPOLARE DI SONDRIO SCPA FRN 30/07/2029	EUR	732,850.00	710,269.00	1.29
700,000.00	BANCO BPM SPA FRN 31/12/2099	EUR	702,400.00	692,958.00	1.26
500,000.00	BANCO BPM SPA REG FRN 31/12/2099	EUR	541,250.00	449,380.00	0.82
500,000.00	ICCREA BANCA SPA FRN 18/01/2032	EUR	500,000.00	422,570.00	0.77
300,000.00	UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA FRN 31/12/2049	EUR	329,625.00	292,899.00	0.53
Servizi di pubblica utilità			3,183,410.68	3,433,947.47	6.24
3,500,000.00	ENEL SPA FRN 24/09/2073	USD	3,183,410.68	3,433,947.47	6.24
Energia			1,822,030.00	1,686,650.00	3.07
1,000,000.00	ENI SPA FRN 31/12/2099	EUR	994,030.00	895,320.00	1.63
1,000,000.00	ENI SPA FRN 31/12/2099	EUR	828,000.00	791,330.00	1.44
Beni voluttuari			497,490.00	436,635.00	0.79
500,000.00	GOLDEN GOOSE SPA FRN 14/05/2027	EUR	497,490.00	436,635.00	0.79
REGNO UNITO			2,173,941.30	1,865,301.58	3.39
Finanza			2,173,941.30	1,865,301.58	3.39
1,000,000.00	ROTHESAY LIFE PLC REG FRN 31/12/2099	GBP	1,400,191.30	1,090,931.58	1.98
1,000,000.00	BARCLAYS BANK PLC FRN 28/12/2040	EUR	773,750.00	774,370.00	1.41
PAESI BASSI			1,405,696.34	1,276,353.90	2.32
Finanza			1,405,696.34	1,276,353.90	2.32
2,150,000.00	AEGON NV FRN 29/06/2049	NLG	945,142.84	884,972.16	1.61
500,000.00	ING GROEP NV REG FRN 31/12/2099	USD	460,553.50	391,381.74	0.71
LUSSEMBURGO			1,110,000.00	689,740.00	1.26
Finanza			1,110,000.00	689,740.00	1.26
2,000,000.00	MITSUBISHI UFJ INVESTOR SERVICES & BANKING LUXEMBOURG SA FRN 15/12/2050	EUR	1,110,000.00	689,740.00	1.26
Titoli garantiti da ipoteche immobiliari e da collaterale			475,283.70	450,795.81	0.82
ITALIA			475,283.70	450,795.81	0.82
Finanza			475,283.70	450,795.81	0.82
474,571.86	SPV PROJECT SRL 7.00% 15/11/2037*	EUR	475,283.70	450,795.81	0.82
NEGOZIATI SU UN ALTRO MERCATO REGOLAMENTATO			4,706,725.15	4,453,764.89	8.09
Obbligazioni ordinarie			3,817,718.15	3,677,113.60	6.68
STATI UNITI			2,170,201.87	2,441,867.40	4.44
Industria			2,170,201.87	2,441,867.40	4.44
2,500,000.00	LEONARDO US HOLDINGS INC 6.25% 15/01/2040	USD	2,170,201.87	2,441,867.40	4.44
LUSSEMBURGO			1,647,516.28	1,235,246.20	2.24
Servizi di telecomunicazione			1,647,516.28	1,235,246.20	2.24
1,700,000.00	TELECOM ITALIA CAPITAL SA 6.00% 30/09/2034	USD	1,647,516.28	1,235,246.20	2.24
Obbligazioni a tasso variabile			889,007.00	776,651.29	1.41
ITALIA			889,007.00	776,651.29	1.41
Finanza			889,007.00	776,651.29	1.41
1,000,000.00	UNICREDIT SPA FRN 30/06/2035	USD	889,007.00	776,651.29	1.41

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
ALTRI VALORI MOBILIARI			1,786,891.59	1,513,551.05	2.75
Obbligazioni a tasso variabile			796,820.87	714,324.05	1.30
ITALIA			796,820.87	714,324.05	1.30
Finanza			796,820.87	714,324.05	1.30
1,000,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 01/06/2032	USD	796,820.87	714,324.05	1.30
Titoli garantiti da ipoteche immobiliari e da collaterale			990,070.72	799,227.00	1.45
ITALIA			990,070.72	799,227.00	1.45
Finanza			990,070.72	799,227.00	1.45
990,000.00	SIERRA ONE SPV SRL 7.00% 30/06/2025*	EUR	990,070.72	799,227.00	1.45
Totale del Portafoglio Titoli			55,703,730.79	52,274,013.09	94.99

* Vedi Nota 13

NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond

IMPEGNI SU ACQUISTO / VENDITA DI CONTRATTI FUTURES AL 30 GIUGNO 2022

Valore nominale	Quantità	Acquisto / Vendita	Contratto	Scadenza	Valore di mercato al 30 Giugno 2022	Valuta	Plus/(minus) valenza non realizzata (EUR)	Impegno (EUR)
							-84,690.00	4,924,800.00
100,000	-40	Vendita	EURO-BTP FUTURE	08/09/2022	123.12	EUR	-84,690.00	4,924,800.00

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond

CONTRATTI FINANZIARI A TERMINE AL 30 GIUGNO 2022

Scadenza	Impegno di acquisto di valute		Impegno di vendita di valute		Plus/(minus)-valenza non realizzata (EUR)
					-27,043.32
21/09/2022	240,000.00	GBP	277,982.98	EUR	-344.07
21/09/2022	5,319,851.78	EUR	4,630,000.00	GBP	-36,265.59
21/09/2022	10,936,466.47	EUR	11,491,000.00	USD	6,331.91
21/09/2022	270,000.00	USD	253,587.11	EUR	3,234.43

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Attività

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	3,068,550.58
Liquidità bancarie a vista		266,911.00
Importi dovuti dai broker	(Nota 12)	79.77
Interessi da ricevere		1,484.17
Altre attività		21,566.49
Totale attività		3,358,592.01

Passività

Altre passività		-54,924.73
Totale passività		-54,924.73

Totale attivo netto**3,303,667.28**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	103.85	22,406.780
Azione D	EUR	83.73	3,169.497
Azione I	EUR	113.19	6,250.000
Azione L	EUR	113.75	9.000
Azione Y	EUR	96.79	30.108

NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing

PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Attivo netto all'inizio del periodo		3,578,592.84
Risultato netto degli investimenti		6,871.43
Altri ricavi		17,744.36
Totale ricavi		24,615.79
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-13,364.41
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 7)	-1,762.61
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-111.17
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 7)	-19,638.60
Commissioni del Transfer Agent		-392.10
Compensi professionali	(Nota 8)	-3,265.65
Pubblicazioni		-6,027.32
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-17,889.33
Totale costi		-62,451.19
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		-37,835.40
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	-48,833.08
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		13,809.23
- di contratti futures		56,639.62
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		-264,739.48
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(Nota 2c)	-1,037.66
Risultato netto delle operazioni per il periodo		-281,996.77
Distribuzioni di dividendi	(Nota 14)	-7,465.92
Sottoscrizioni del periodo		24,990.00
Rimborsi del periodo		-10,452.87
Attivo netto alla fine del periodo		3,303,667.28

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			2,924,511.38	3,068,550.58	92.88
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			2,924,511.38	3,068,550.58	92.88
Azioni			27,693.39	31,979.66	0.97
ITALIA			27,607.58	31,976.00	0.97
Finanza			27,607.58	31,976.00	0.97
2,800.00	FINECOBANK BANCA FINECO SPA	EUR	27,607.58	31,976.00	0.97
STATI UNITI			85.81	3.66	0.00
Energia			85.81	3.66	0.00
38,279.00	PETROQUEST ENERGY INC	USD	85.81	3.66	0.00
Obbligazioni a tasso variabile			348,058.14	332,236.53	10.05
FRANCIA			200,792.00	192,930.00	5.84
Finanza			200,792.00	192,930.00	5.84
200,000.00	BNP PARIBAS SA FRN 25/07/2028	EUR	200,792.00	192,930.00	5.84
PAESI BASSI			147,266.14	139,306.53	4.21
Enti Governativi			147,266.14	139,306.53	4.21
200,000.00	ING GROEP NV FRN 31/12/2099	USD	147,266.14	139,306.53	4.21
Azioni di OICR			2,548,759.85	2,675,352.79	80.98
LUSSEMBURGO			2,548,759.85	2,675,352.79	80.98
Finanza			2,548,759.85	2,675,352.79	80.98
3,365.65	NEW MILLENNIUM - AUGUSTUM HIGH QUALITY BOND -I-	EUR	532,679.67	535,408.08	16.21
3,919.00	NEW MILLENNIUM - AUGUSTUM ITALIAN DIVERSIFIED BOND -I-	EUR	458,887.04	522,128.37	15.80
72,884.86	AZ FUND 1-AZ ALLOCATION-INTERNATIONAL 50%-100%	EUR	382,358.89	454,947.30	13.77
3,935.78	NEW MILLENNIUM - AUGUSTUM EXTRA EURO HIGH QUALITY BOND -I-	EUR	414,290.03	432,069.82	13.08
70,876.29	AZ FUND 1-AZ BOND-GLOBAL MACRO BOND -AI-	EUR	330,000.00	348,427.84	10.55
53,498.13	AZ FUND 1-AZ BOND-TARGET 2021 -AAZ-	EUR	280,544.18	245,342.41	7.42
607.83	NEW MILLENNIUM - AUGUSTUM CORPORATE BOND -I-	EUR	150,000.04	137,028.97	4.15
Warrants			0.00	28,981.60	0.88
ITALIA			0.00	28,981.60	0.88
Finanza			0.00	28,981.60	0.88
8,524.00	NET INSURANCE SPA 21/05/2023	EUR	0.00	28,981.60	0.88
STATI UNITI			0.00	0.00	0.00
Beni di prima necessità			0.00	0.00	0.00
1,751.00	CEC BRANDS LLC 31/12/2025	USD	0.00	0.00	0.00
Totale del Portafoglio Titoli			2,924,511.38	3,068,550.58	92.88

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - VolActive

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Attività

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	4,191,733.20
Liquidità bancarie a vista		125,560.34
Importi dovuti dai broker	(Nota 12)	157,480.73
Interessi da ricevere		23,938.54
Altre attività		20,199.84
Totale attività		4,518,912.65

Passività

Perdite non realizzate su contratti futures	(Note 2d, 12)	-5,734.37
Altre passività		-43,277.56
Totale passività		-49,011.93

Totale attivo netto**4,469,900.72**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	88.67	6,063.390
Azione D	EUR	68.43	11.557
Azione I	EUR	97.23	40,348.694
Azione L	EUR	95.78	89.000

NEW MILLENNIUM - VolActive

PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Attivo netto all'inizio del periodo		6,420,617.21
Risultato netto degli investimenti		34,300.38
Altri ricavi		11,412.88
Totale ricavi		45,713.26
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-42,345.50
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 7)	-1,910.40
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-349.18
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 7)	-13,433.98
Compensi professionali	(Nota 8)	-3,517.27
Pubblicazioni		-6,075.40
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-4,885.60
Totale costi		-72,517.33
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		-26,804.07
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	-1,097,882.85
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		23,011.84
- di contratti futures		726,484.44
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		-253,875.50
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(Nota 2c)	7,827.52
- su contratti futures	(Nota 2d)	-86,524.93
Risultato netto delle operazioni per il periodo		-707,763.55
Distribuzioni di dividendi	(Nota 14)	-41.26
Sottoscrizioni del periodo		351,779.92
Rimborsi del periodo		-1,594,691.60
Attivo netto alla fine del periodo		4,469,900.72

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - VolActive

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			4,524,600.82	4,191,733.20	93.78
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			4,524,600.82	4,191,733.20	93.78
Azioni			156,904.40	119,792.20	2.68
FRANCIA			128,364.95	119,792.20	2.68
Materie prime			128,364.95	119,792.20	2.68
935.00	AIR LIQUIDE SA	EUR	128,364.95	119,792.20	2.68
ITALIA			28,539.45	0.00	0.00
Beni voluttuari			28,539.45	0.00	0.00
14,430.00	SEMPLICEMENTE SPA	EUR	28,539.45	0.00	0.00
Obbligazioni ordinarie			3,944,690.96	3,667,511.00	82.05
FRANCIA			678,107.26	637,136.50	14.25
Enti Governativi			574,626.88	546,555.50	12.23
300,000.00	FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 1.75% 25/11/2024	EUR	309,404.83	306,213.00	6.85
250,000.00	FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 0.75% 25/05/2028	EUR	265,222.05	240,342.50	5.38
Beni voluttuari			103,480.38	90,581.00	2.02
100,000.00	VALEO 1.63% 18/03/2026	EUR	103,480.38	90,581.00	2.02
ITALIA			631,974.34	599,553.00	13.41
Enti Governativi			301,088.04	299,872.00	6.71
200,000.00	BTP 0.65% 15/10/2023	EUR	195,686.96	199,230.00	4.46
100,000.00	BTP 1.75% 01/07/2024	EUR	105,401.08	100,642.00	2.25
Servizi di pubblica utilità			210,138.02	196,540.00	4.39
100,000.00	ERG SPA 1.88% 11/04/2025	EUR	106,542.60	98,722.00	2.21
100,000.00	A2A SPA 1.75% 25/02/2025	EUR	103,595.42	97,818.00	2.18
Industria			120,748.28	103,141.00	2.31
100,000.00	LEONARDO SPA 4.88% 24/03/2025	EUR	120,748.28	103,141.00	2.31
SPAGNA			570,606.13	518,717.00	11.61
Enti Governativi			570,606.13	518,717.00	11.61
300,000.00	SPAIN GOVERNMENT BOND 3.80% 30/04/2024	EUR	358,122.40	315,423.00	7.06
200,000.00	SPAIN GOVERNMENT BOND 1.95% 30/04/2026	EUR	212,483.73	203,294.00	4.55
GERMANIA			508,606.39	485,103.00	10.85
Enti Governativi			299,955.96	290,598.00	6.50
300,000.00	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 0.25% 15/02/2027	EUR	299,955.96	290,598.00	6.50
Beni voluttuari			208,650.43	194,505.00	4.35
100,000.00	VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 1.50% 01/10/2024	EUR	104,968.97	98,132.00	2.19
100,000.00	SCHAEFFLER AG 1.88% 26/03/2024	EUR	103,681.46	96,373.00	2.16
PORTOGALLO			314,974.46	285,750.00	6.39
Enti Governativi			314,974.46	285,750.00	6.39
300,000.00	PORTUGAL OBRIGACOES DO TESOURO OT 0.70% 15/10/2027	EUR	314,974.46	285,750.00	6.39
FINLANDIA			304,684.38	283,176.00	6.34
Enti Governativi			304,684.38	283,176.00	6.34
300,000.00	FINLAND GOVERNMENT BOND 0.50% 15/09/2028	EUR	304,684.38	283,176.00	6.34
LUSSEMBURGO			301,690.76	279,559.00	6.25
Sovranazionale			98,779.63	97,114.00	2.17
100,000.00	EIB 0.13% 15/04/2025	EUR	98,779.63	97,114.00	2.17

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - VolActive

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Industria			98,888.54	93,635.00	2.09
100,000.00	HEIDELBERGCEMENT FINANCE LUXEMBOURG SA 1.63% 07/04/2026	EUR	98,888.54	93,635.00	2.09
Finanza			104,022.59	88,810.00	1.99
100,000.00	GRAND CITY PROPERTIES SA 1.38% 03/08/2026	EUR	104,022.59	88,810.00	1.99
PAESI BASSI			258,548.37	241,422.50	5.40
Beni voluttuari			103,122.23	99,346.00	2.22
100,000.00	STELLANTIS NV 2.00% 23/03/2024	EUR	103,122.23	99,346.00	2.22
Informatica			108,102.22	97,350.00	2.18
100,000.00	ASML HOLDING NV 1.63% 28/05/2027	EUR	108,102.22	97,350.00	2.18
Salute			47,323.92	44,726.50	1.00
50,000.00	TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NETHERLANDS II BV 1.13% 15/10/2024	EUR	47,323.92	44,726.50	1.00
STATI UNITI			160,903.34	141,480.00	3.17
Finanza			160,903.34	141,480.00	3.17
150,000.00	GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 1.63% 27/07/2026	EUR	160,903.34	141,480.00	3.17
REGNO UNITO			101,847.72	98,869.00	2.21
Salute			101,847.72	98,869.00	2.21
100,000.00	ASTRAZENECA PLC 0.75% 12/05/2024	EUR	101,847.72	98,869.00	2.21
IRLANDA			112,747.81	96,745.00	2.17
Enti Governativi			112,747.81	96,745.00	2.17
100,000.00	IRELAND GOVERNMENT BOND 1.35% 18/03/2031	EUR	112,747.81	96,745.00	2.17
Obbligazioni a tasso variabile			423,005.46	404,430.00	9.05
ITALIA			423,005.46	404,430.00	9.05
Enti Governativi			297,575.31	302,150.00	6.76
200,000.00	CCT FRN 15/02/2024	EUR	197,465.29	202,020.00	4.52
100,000.00	CCT FRN 15/09/2025	EUR	100,110.02	100,130.00	2.24
Finanza			125,430.15	102,280.00	2.29
100,000.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA FRN 12/12/2042	EUR	125,430.15	102,280.00	2.29
NEGOZIATI SU UN ALTRO MERCATO REGOLAMENTATO			0.00	0.00	0.00
Warrants			0.00	0.00	0.00
ITALIA			0.00	0.00	0.00
Beni voluttuari			0.00	0.00	0.00
10,665.00	SEMPLICEMENTE SPA 15/06/2017	EUR	0.00	0.00	0.00
Totale del Portafoglio Titoli			4,524,600.82	4,191,733.20	93.78

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - VoActive

IMPEGNI SU ACQUISTO / VENDITA DI CONTRATTI FUTURES AL 30 GIUGNO 2022

Valore nominale	Quantità	Acquisto / Vendita	Contratto	Scadenza	Valore di mercato al 30 Giugno 2022	Valuta	Plus/(minus) valenza non realizzata (EUR)	Impegno (EUR)
							-5,734.37	251,996.77
125,000	2	Acquisto	EURO FX CURR FUT SEP22	19/09/2022	1.01	USD	-5,734.37	251,996.77

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond**PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR****Attività**

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	52,652,311.41
Liquidità bancarie a vista		1,688,564.52
Importi dovuti dai broker	(Nota 12)	1,198,579.49
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	(Note 2c, 12)	26,496.93
Interessi da ricevere		751,529.02
Altre attività		37,422.20
Totale attività		56,354,903.57

Passività

Scoperti bancari		-1,483,503.68
Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	(Note 2c, 12)	-100,360.60
Perdite non realizzate su contratti futures	(Note 2d, 12)	-78,016.69
Da pagare su rimborsi		-51.83
Altre passività		-175,154.37
Totale passività		-1,837,087.17

Totale attivo netto**54,517,816.40**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	104.71	3,167.679
Azione D	EUR	78.78	1,754.410
Azione I	EUR	110.04	490,887.154
Azione L	EUR	108.76	260.000

NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond**PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR**

Attivo netto all'inizio del periodo		61,910,608.05
Risultato netto degli investimenti		903,600.83
Altri ricavi		30,552.09
Totale ricavi		934,152.92
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-251,877.92
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 7)	-16,360.81
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-2,868.20
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 7)	-12,914.05
Compensi professionali	(Nota 8)	-8,049.14
Pubblicazioni		-7,003.04
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-15,549.61
Totale costi		-314,622.77
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		619,530.15
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	-138,219.37
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		-834,332.70
- di contratti di opzioni		-230,574.28
- di contratti futures		50,509.02
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		-1,005,933.95
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(Nota 2c)	417,082.97
- su contratti futures	(Nota 2d)	-78,016.69
Risultato netto delle operazioni per il periodo		-1,199,954.85
Distribuzioni di dividendi	(Nota 14)	-5,894.82
Sottoscrizioni del periodo		4,228,947.89
Rimborsi del periodo		-10,415,889.87
Attivo netto alla fine del periodo		54,517,816.40

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			53,785,822.54	52,652,311.41	96.58
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			47,196,197.90	45,694,072.59	83.82
Obbligazioni ordinarie			39,523,845.21	38,099,027.19	69.88
STATI UNITI			8,440,432.92	8,771,101.75	16.09
Enti Governativi			6,102,753.18	6,338,593.63	11.63
4,500,000.00	US TREASURY N/B 0.75% 15/11/2024	USD	3,927,917.90	4,082,254.95	7.49
2,400,000.00	UNITED STATES TREASURY NOTE 0.50% 28/02/2026	USD	2,016,333.53	2,092,819.12	3.84
2,500,000.00	INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK 7.88% 14/03/2023	IDR	158,501.75	163,519.56	0.30
Sovranazionale			1,907,635.84	2,004,164.30	3.68
2,104,000.00	INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT 1.90% 16/01/2025	CAD	1,498,786.14	1,506,617.04	2.77
35,000,000.00	INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT 6.75% 14/11/2022	RUB	408,849.70	497,547.26	0.91
Energia			430,043.90	428,343.82	0.78
400,000.00	ENI USA INC 7.30% 15/11/2027	USD	430,043.90	428,343.82	0.78
LUSSEMBURGO			6,450,929.44	5,321,620.66	9.76
Sovranazionale			3,281,125.69	3,006,028.46	5.51
18,000,000.00	EIB 0.63% 24/04/2023	NOK	1,761,788.09	1,719,368.01	3.15
22,000,000.00	EIB 8.38% 29/07/2022	ZAR	1,519,337.60	1,286,660.45	2.36
Finanza			2,434,164.07	1,581,998.90	2.90
9,498,122.50	SWISS INSURED BRAZIL POWER FINANCE SARL 9.85% 16/07/2032	BRL	2,434,164.07	1,581,998.90	2.90
Enti Governativi			403,936.88	425,738.99	0.78
10,000,000.00	EUROPEAN INVESTMENT BANK 4.25% 19/06/2024	MXN	403,936.88	425,738.99	0.78
Servizi di telecomunicazione			331,702.80	307,854.31	0.57
300,000.00	CK HUTCHISON GROUP TELECOM FINANCE SA 2.00% 17/10/2027	GBP	331,702.80	307,854.31	0.57
GERMANIA			3,987,386.88	4,436,725.77	8.14
Enti Governativi			2,185,123.16	2,457,282.40	4.51
106,000,000.00	INTERNATIONAL FINANCE CORP 3.75% 15/12/2022	RUB	1,123,350.76	1,406,021.24	2.58
1,600,000.00	INTERNATIONAL FINANCE CORP 2.70% 15/03/2023	AUD	1,061,772.40	1,051,261.16	1.93
Materie prime			1,281,962.67	1,407,571.05	2.58
1,500,000.00	BASF SE 0.93% 09/03/2023	USD	1,281,962.67	1,407,571.05	2.58
Finanza			520,301.05	571,872.32	1.05
4,000,000.00	KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.70% 08/08/2022	CNY	520,301.05	571,872.32	1.05
REGNO UNITO			3,337,176.66	3,460,447.59	6.35
Sovranazionale			1,654,931.10	1,746,196.24	3.20
27,000,000,000.00	EUROPEAN BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT 6.45% 13/12/2022	IDR	1,654,931.10	1,746,196.24	3.20
Finanza			1,682,245.56	1,714,251.35	3.15
1,500,000.00	LLOYDS BANK CORPORATE MARKETS PLC 1.50% 23/06/2023	GBP	1,682,245.56	1,714,251.35	3.15
FILIPPINE			3,103,843.66	3,077,256.94	5.64
Sovranazionale			3,103,843.66	3,077,256.94	5.64
90,000,000.00	ASIAN DEVELOPMENT BANK 5.25% 09/03/2023	PHP	1,660,528.20	1,556,476.64	2.85
6,000,000.00	ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.72% 16/01/2023	CNY	798,025.80	855,605.17	1.57
55,000,000.00	ASIAN DEVELOPMENT BANK 5.90% 20/12/2022	INR	645,289.66	665,175.13	1.22
COREA DEL SUD			2,636,191.08	2,731,566.79	5.01
Enti Governativi			2,636,191.08	2,731,566.79	5.01
225,300,000.00	EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 6.90% 07/02/2023	INR	2,636,191.08	2,731,566.79	5.01

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
FRANCIA			2,049,755.57	2,054,188.35	3.77
Finanza			2,049,755.57	2,054,188.35	3.77
1,000,000.00	SOCIETE GENERALE SA 1.88% 03/10/2024	GBP	1,122,207.47	1,107,868.48	2.03
1,000,000.00	BNP PARIBAS SA 4.38% 28/09/2025	USD	927,548.10	946,319.87	1.74
PAESI BASSI			1,725,660.59	1,836,702.05	3.37
Beni voluttuari			1,725,660.59	1,836,702.05	3.37
9,000,000.00	BMW FINANCE NV 2.80% 11/08/2023	CNY	1,164,223.24	1,277,569.41	2.34
500,000.00	BMW INTERNATIONAL INVESTMENT BV 0.75% 08/03/2024	GBP	561,437.35	559,132.64	1.03
EMIRATI ARABI UNITI			1,719,139.88	1,764,866.99	3.24
Energia			1,719,139.88	1,764,866.99	3.24
2,000,000.00	ABU DHABI NATIONAL OIL CO 0.70% 04/06/2024	USD	1,719,139.88	1,764,866.99	3.24
HONG KONG			831,932.71	956,937.31	1.75
Materie prime			831,932.71	956,937.31	1.75
1,000,000.00	CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 3.50% 19/07/2022	USD	831,932.71	956,937.31	1.75
ISOLE VERGINI BRITANNICHE			898,429.56	918,035.39	1.68
Beni voluttuari			898,429.56	918,035.39	1.68
1,000,000.00	LEVC FINANCE LTD 1.38% 25/03/2024	USD	898,429.56	918,035.39	1.68
SINGAPORE			831,142.43	890,989.16	1.63
Enti Governativi			831,142.43	890,989.16	1.63
1,300,000.00	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 1.75% 01/02/2023	SGD	831,142.43	890,989.16	1.63
NUOVA ZELANDA			804,389.59	746,153.83	1.37
Enti Governativi			804,389.59	746,153.83	1.37
1,300,000.00	NEW ZEALAND LOCAL GOVERNMENT FUNDING AGENCY BOND 2.75% 15/04/2025	NZD	804,389.59	746,153.83	1.37
IRLANDA			2,162,170.35	572,838.80	1.05
Industria			2,162,170.35	572,838.80	1.05
76,000,000.00	RUSSIAN RAILWAYS VIA RZD CAPITAL PLC 7.90% 19/10/2024	RUB	907,847.61	463,979.58	0.85
1,300,000.00	RUSSIAN RAILWAYS VIA RZD CAPITAL PLC 2.10% 02/10/2023	CHF	1,254,322.74	108,859.22	0.20
POLONIA			353,050.87	348,980.88	0.64
Enti Governativi			353,050.87	348,980.88	0.64
2,500,000.00	REPUBLIC OF POLAND GOVERNMENT BOND 1.25% 25/10/2030	PLN	353,050.87	348,980.88	0.64
MESSICO			192,213.02	210,614.93	0.39
Servizi di telecomunicazione			192,213.02	210,614.93	0.39
4,500,000.00	AMERICA MOVIL SAB DE CV 6.45% 05/12/2022	MXN	192,213.02	210,614.93	0.39
Obbligazioni a tasso variabile			5,687,880.91	5,553,159.62	10.19
LUSSEMBURGO			2,166,079.62	2,217,087.62	4.07
Finanza			2,166,079.62	2,217,087.62	4.07
1,400,000.00	SWISS RE FINANCE LUXEMBOURG SA FRN 31/12/2099	USD	1,277,647.85	1,254,382.46	2.30
1,000,000.00	KBC IFIMA SA FRN 07/02/2025	USD	888,431.77	962,705.16	1.77
ITALIA			1,524,711.15	1,376,433.36	2.52
Finanza			1,524,711.15	1,376,433.36	2.52
1,200,000.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA FRN 29/06/2049	GBP	1,524,711.15	1,376,433.36	2.52

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
REGNO UNITO			894,496.98	902,271.85	1.66
Energia			894,496.98	902,271.85	1.66
1,000,000.00	BP CAPITAL MARKETS PLC FRN 31/12/2099	USD	894,496.98	902,271.85	1.66
PAESI BASSI			460,553.50	391,381.74	0.72
Finanza			460,553.50	391,381.74	0.72
500,000.00	ING GROEP NV REG FRN 31/12/2099	USD	460,553.50	391,381.74	0.72
AUSTRALIA			289,197.26	347,458.07	0.64
Finanza			289,197.26	347,458.07	0.64
500,000.00	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD FRN 29/10/2049	USD	289,197.26	347,458.07	0.64
FRANCIA			352,842.40	318,526.98	0.58
Enti Governativi			352,842.40	318,526.98	0.58
400,000.00	BNP PARIBAS FRN 31/12/2099	USD	352,842.40	318,526.98	0.58
Obbligazioni zero coupon			1,984,471.78	2,041,885.78	3.75
STATI UNITI			1,984,471.78	2,041,885.78	3.75
Enti Governativi			1,732,110.26	1,768,526.91	3.25
2,000,000.00	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND - WHEN ISSUED 0.00% 31/12/2026	USD	1,732,110.26	1,768,526.91	3.25
Finanza			252,361.52	273,358.87	0.50
300,000.00	JPMORGAN CHASE BANK NA 0.00% 28/12/2023	USD	252,361.52	273,358.87	0.50
NEGOZIATI SU UN ALTRO MERCATO REGOLAMENTATO			4,223,192.95	4,345,225.01	7.97
Obbligazioni ordinarie			3,801,401.07	3,937,615.80	7.22
STATI UNITI			2,486,092.19	2,508,279.00	4.60
Industria			988,365.53	985,081.17	1.81
500,000.00	LEONARDO US HOLDINGS INC 7.38% 15/07/2039	USD	527,628.68	545,545.04	1.00
450,000.00	LEONARDO US HOLDINGS INC 6.25% 15/01/2040	USD	460,736.85	439,536.13	0.81
Beni voluttuari			918,745.91	920,646.71	1.69
1,000,000.00	HARLEY-DAVIDSON FINANCIAL SERVICES INC 3.35% 08/06/2025	USD	918,745.91	920,646.71	1.69
Servizi di telecomunicazione			578,980.75	602,551.12	1.10
700,000.00	EBAY INC 1.40% 10/05/2026	USD	578,980.75	602,551.12	1.10
ITALIA			1,315,308.88	1,429,336.80	2.62
Energia			1,315,308.88	1,429,336.80	2.62
1,500,000.00	ENI SPA 4.00% 12/09/2023	USD	1,315,308.88	1,429,336.80	2.62
Obbligazioni a tasso variabile			421,791.88	407,609.21	0.75
STATI UNITI			421,791.88	407,609.21	0.75
Servizi di pubblica utilità			421,791.88	407,609.21	0.75
500,000.00	SOUTHERN CO FRN 15/09/2051	USD	421,791.88	407,609.21	0.75
ALTRI VALORI MOBILIARI			2,366,431.69	2,613,013.81	4.79
Obbligazioni ordinarie			772,851.29	922,311.07	1.69
ITALIA			772,851.29	922,311.07	1.69
Finanza			772,851.29	922,311.07	1.69
1,000,000.00	UNICREDIT SPA 4.63% 12/04/2027	USD	772,851.29	922,311.07	1.69

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Obbligazioni a tasso variabile			1,593,580.40	1,690,702.74	3.10
EGITTO			1,063,053.20	1,242,004.05	2.28
Enti Governativi			1,063,053.20	1,242,004.05	2.28
1,300,000.00	AFRICAN EXPORT-IMPORT BANK FRN 01/08/2022	USD	1,063,053.20	1,242,004.05	2.28
FRANCIA			530,527.20	448,698.69	0.82
Finanza			530,527.20	448,698.69	0.82
600,000.00	CREDIT AGRICOLE SA FRN 31/12/2099	USD	530,527.20	448,698.69	0.82
Totale del Portafoglio Titoli			53,785,822.54	52,652,311.41	96.58

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond**IMPEGNI SU ACQUISTO / VENDITA DI CONTRATTI FUTURES AL 30 GIUGNO 2022**

Valore nominale	Quantità	Acquisto / Vendita	Contratto	Scadenza	Valore di mercato al 30 Giugno 2022	Valuta	Plus/(minus) valenza non realizzata (EUR)	Impegno (EUR)
							-78,016.69	7,730,643.14
100,000	72	Acquisto	US 5YR NOTE (CBT) SEP22	30/09/2022	107.37	USD	-78,016.69	7,730,643.14

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond

CONTRATTI FINANZIARI A TERMINE AL 30 GIUGNO 2022

Scadenza	Impegno di acquisto di valute		Impegno di vendita di valute		Plus/(minus)-valenza non realizzata (EUR)
					-73,863.67
27/07/2022	135,581,240.00	JPY	1,000,000.00	USD	-692.27
21/09/2022	1,148,765.08	EUR	12,000,000.00	NOK	-8,514.56
27/07/2022	1,000,000.00	EUR	10,466,654.10	NOK	-12,235.99
21/09/2022	5,170,482.29	EUR	4,500,000.00	GBP	-35,247.33
21/09/2022	460,000,000.00	JPY	3,281,963.47	EUR	-43,670.45
27/07/2022	10,462,345.20	NOK	1,000,000.00	EUR	11,819.28
14/07/2022	1,055,928.10	USD	1,000,000.00	EUR	9,443.19
21/09/2022	8,565,677.33	EUR	9,000,000.00	USD	4,959.28
14/07/2022	1,000,000.00	EUR	1,045,762.20	USD	275.18

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Attività

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	1,372,066.83
Liquidità bancarie a vista		203,551.70
Importi dovuti dai broker	(Nota 12)	146,297.44
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	(Note 2c, 12)	507.50
Interessi da ricevere		25,398.38
Altre attività		23,362.49
Totale attività		1,771,184.34

Passività

Scoperti bancari		-6,994.57
Altre passività		-49,327.48
Totale passività		-56,322.05

Totale attivo netto**1,714,862.29**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	79.77	4,291.815
Azione I	EUR	84.16	16,308.324

NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond

PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Attivo netto all'inizio del periodo		2,330,324.43
Risultato netto degli investimenti		37,637.59
Altri ricavi		19,585.77
Totale ricavi		57,223.36
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-20,297.69
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 7)	-1,641.41
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-162.17
Interessi pagati su contratti swap		-347.23
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 7)	-28,427.30
Commissioni del Transfer Agent		-398.56
Compensi professionali	(Nota 8)	-1,553.86
Pubblicazioni		-5,997.84
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-4,285.67
Totale costi		-63,111.73
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		-5,888.37
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	32,924.63
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		-90,573.59
- di contratti futures		-5.99
- di contratti swap		8,932.36
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		-180,055.57
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(Nota 2c)	25,802.18
- su contratti swap		-5,699.79
Risultato netto delle operazioni per il periodo		-214,564.14
Rimborsi del periodo		-400,898.00
Attivo netto alla fine del periodo		1,714,862.29

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			2,452,386.04	1,372,066.83	80.01
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			1,404,823.81	924,721.04	53.93
Azioni			172,591.46	85,521.10	4.99
FRANCIA			100,000.00	85,521.00	4.99
Energia			100,000.00	85,521.00	4.99
100,000.00	CGG SA	EUR	100,000.00	85,521.00	4.99
STATI UNITI			72,591.46	0.10	0.00
Energia			72,591.46	0.10	0.00
100,000.00	SANCHEZ ENERGY CORP	USD	72,591.46	0.10	0.00
Obbligazioni ordinarie			1,086,457.11	709,572.35	41.38
FRANCIA			199,647.00	182,555.00	10.65
Beni voluttuari			99,647.00	93,111.00	5.43
100,000.00	AIR FRANCE-KLM 3.00% 01/07/2024	EUR	99,647.00	93,111.00	5.43
Servizi di telecomunicazione			100,000.00	89,444.00	5.22
100,000.00	ILIAD HOLDING SASU 5.13% 15/10/2026	EUR	100,000.00	89,444.00	5.22
ITALIA			175,402.71	161,389.00	9.41
Finanza			106,075.00	92,606.00	5.40
100,000.00	BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA 3.63% 24/09/2024	EUR	106,075.00	92,606.00	5.40
Beni voluttuari			69,327.71	68,783.00	4.01
68,750.00	SISAL GROUP SPA 7.00% 31/07/2023	EUR	69,327.71	68,783.00	4.01
PAESI BASSI			120,876.77	123,379.00	7.19
Beni voluttuari			80,561.98	83,617.17	4.87
90,000.00	KONINKLIJKE LUCHTVAART MAATSCHAPPIJ NV 5.75% 29/05/2049	CHF	80,561.98	83,617.17	4.87
Salute			40,314.79	39,761.83	2.32
50,000.00	TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NETHERLANDS III BV 3.15% 01/10/2026	USD	40,314.79	39,761.83	2.32
REGNO UNITO			78,650.00	91,376.00	5.33
Beni voluttuari			78,650.00	91,376.00	5.33
100,000.00	INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY PLC 3.50% 15/06/2026	EUR	78,650.00	91,376.00	5.33
SPAGNA			102,500.00	81,501.00	4.75
Finanza			102,500.00	81,501.00	4.75
100,000.00	NEINOR HOMES SA 4.50% 15/10/2026	EUR	102,500.00	81,501.00	4.75
STATI UNITI			38,798.45	34,251.76	2.00
Beni voluttuari			38,798.45	34,251.76	2.00
50,000.00	FORD MOTOR CO 4.75% 15/01/2043	USD	38,798.45	34,251.76	2.00
NORVEGIA			21,550.55	22,339.27	1.30
Energia			21,550.55	22,339.27	1.30
23,415.00	DNO ASA 8.38% 29/05/2024	USD	21,550.55	22,339.27	1.30
LIBANO			165,956.46	12,781.10	0.75
Enti Governativi			165,956.46	12,781.10	0.75
200,000.00	LEBANON GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.05% 02/11/2035	USD	165,956.46	12,781.10	0.75

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
CANADA			183,075.17	0.22	0.00
Industria			183,075.17	0.22	0.00
300,000.00	ENTREC CORP 8.50% 30/06/2021	CAD	183,075.17	0.22	0.00
Obbligazioni a tasso variabile			145,775.24	129,627.59	7.56
ITALIA			100,000.00	84,514.00	4.93
Finanza			100,000.00	84,514.00	4.93
100,000.00	ICCREA BANCA SPA FRN 18/01/2032	EUR	100,000.00	84,514.00	4.93
REGNO UNITO			45,775.24	45,113.59	2.63
Energia			45,775.24	45,113.59	2.63
50,000.00	BP CAPITAL MARKETS PLC FRN 31/12/2099	USD	45,775.24	45,113.59	2.63
NEGOZIATI SU UN ALTRO MERCATO REGOLAMENTATO			752,812.22	426,370.19	24.86
Obbligazioni ordinarie			752,812.22	426,370.19	24.86
STATI UNITI			205,142.00	213,501.52	12.45
Beni voluttuari			158,913.37	168,945.58	9.85
94,758.71	US AIRWAYS 2012-2 CLASS A PASS THROUGH TRUST 4.63% 03/06/2025	USD	69,750.51	83,757.85	4.88
50,000.00	CINEMARK USA INC 8.75% 01/05/2025	USD	46,116.91	48,660.87	2.84
50,000.00	FOOT LOCKER INC 4.00% 01/10/2029	USD	43,045.95	36,526.86	2.13
Informatica			46,228.63	44,555.94	2.60
50,000.00	XEROX HOLDINGS CORP 5.00% 15/08/2025	USD	46,228.63	44,555.94	2.60
CANADA			72,581.18	75,993.75	4.43
Industria			72,581.18	75,993.75	4.43
86,000.00	BOMBARDIER INC 7.50% 15/03/2025	USD	72,581.18	75,993.75	4.43
LUSSEMBURGO			95,856.10	72,661.54	4.24
Servizi di telecomunicazione			95,856.10	72,661.54	4.24
100,000.00	TELECOM ITALIA CAPITAL SA 6.00% 30/09/2034	USD	95,856.10	72,661.54	4.24
REGNO UNITO			55,042.11	63,934.07	3.73
Energia			55,042.11	63,934.07	3.73
67,000.00	TECHNIPFMC PLC 6.50% 01/02/2026	USD	55,042.11	63,934.07	3.73
BERMUDA			324,190.83	279.31	0.01
Servizi di telecomunicazione			324,190.83	279.31	0.01
400,000.00	DIGICEL GROUP LTD 8.25% 30/09/2020	USD	324,190.83	279.31	0.01
ALTRI VALORI MOBILIARI			294,750.01	20,975.60	1.22
Obbligazioni ordinarie			294,750.01	20,975.60	1.22
STATI UNITI			20,219.01	20,975.60	1.22
Industria			20,219.01	20,975.60	1.22
22,000.00	XPO LOGISTICS INC 6.25% 01/05/2025	USD	20,219.01	20,975.60	1.22
LUSSEMBURGO			274,531.00	0.00	0.00
Energia			274,531.00	0.00	0.00
13,042.00	CONSTELLATION OIL SERVICES HOLDING SA 0.50% 31/12/2050	USD	274,531.00	0.00	0.00
Totale del Portafoglio Titoli			2,452,386.04	1,372,066.83	80.01

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond**CONTRATTI FINANZIARI A TERMINE AL 30 GIUGNO 2022**

Scadenza	Impegno di acquisto di valute		Impegno di vendita di valute		Plus/(minus)-valenza non realizzata (EUR)
					507.50
21/09/2022	876,554.31	EUR	921,000.00	USD	507.50

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Attività

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	92,515,725.15
Liquidità bancarie a vista		1,415,178.75
Importi dovuti dai broker	(Nota 12)	1,144,130.00
Dividendi da ricevere		1,089.20
Interessi da ricevere		378,472.22
Altre attività		29,378.60
Totale attività		95,483,973.92

Passività

Perdite non realizzate su contratti futures	(Note 2d, 12)	-500.00
Da pagare su rimborsi		-79,886.00
Altre passività		-472,377.09
Totale passività		-552,763.09

Totale attivo netto**94,931,210.83**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	97.60	244,485.844
Azione I	EUR	100.34	44,465.145
Azione L	EUR	99.45	669,774.000

NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity

PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Attivo netto all'inizio del periodo		104,220,057.91
Risultato netto degli investimenti		1,209,701.72
Altri ricavi		35,583.68
Totale ricavi		1,245,285.40
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-806,377.13
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 7)	-27,922.90
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-20,835.36
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 7)	-19,060.94
Compensi professionali	(Nota 8)	-6,705.36
Pubblicazioni		-12,150.96
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-28,987.02
Totale costi		-922,039.67
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		323,245.73
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	1,022,669.21
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		115,159.87
- di contratti futures		-123,679.33
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		-11,442,811.37
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(Nota 2c)	4,361.39
- su contratti futures	(Nota 2d)	-72,480.00
Risultato netto delle operazioni per il periodo		-10,173,534.50
Sottoscrizioni del periodo		1,984,427.50
Rimborsi del periodo		-1,099,740.08
Attivo netto alla fine del periodo		94,931,210.83

NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			98,403,064.93	92,515,725.15	97.45
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			97,466,574.42	91,820,003.90	96.72
Azioni			1,019,800.34	1,036,028.34	1.09
STATI UNITI			515,874.50	543,668.34	0.57
Informatica			515,874.50	543,668.34	0.57
7,300.00	ACTIVISION BLIZZARD INC	USD	515,874.50	543,668.34	0.57
ITALIA			503,925.84	492,360.00	0.52
Beni voluttuari			503,925.84	492,360.00	0.52
22,000.00	ATLANTIA SPA	EUR	503,925.84	492,360.00	0.52
Obbligazioni ordinarie			33,434,965.25	31,333,285.51	33.00
ITALIA			12,540,980.05	11,936,357.98	12.57
Enti Governativi			5,026,268.49	5,043,388.98	5.31
3,107,843.00	BTP 0.55% 21/05/2026	EUR	3,010,748.43	3,142,340.06	3.31
1,015,920.00	BTP 0.40% 11/04/2024	EUR	1,024,404.38	1,050,948.92	1.11
1,000,000.00	ITALY BTPORO 0.95% 01/08/2030	EUR	991,115.68	850,100.00	0.89
Finanza			4,797,480.82	4,536,177.00	4.78
1,000,000.00	UNIONE DI BANCHE ITALIANE SPA 0.75% 17/10/2022	EUR	987,367.44	1,000,820.00	1.05
1,000,000.00	BANCO BPM SPA 1.63% 18/02/2025	EUR	965,020.39	940,600.00	0.99
1,000,000.00	CASSA DEPOSITI E PRESTITI SPA -E- 1.00% 21/09/2028	EUR	1,017,962.28	897,300.00	0.95
500,000.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA 4.13% 04/05/2026	EUR	534,123.63	501,875.00	0.53
500,000.00	UNICREDIT SPA 1.00% 18/01/2023	EUR	493,815.54	499,885.00	0.53
500,000.00	BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA REG 2.63% 28/04/2025	EUR	496,159.57	444,270.00	0.47
300,000.00	BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA 1.88% 09/01/2026	EUR	303,031.97	251,427.00	0.26
Industria			2,204,331.96	1,893,432.00	1.99
700,000.00	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA 1.63% 21/10/2028	EUR	699,089.02	595,154.00	0.63
700,000.00	WEBUILD SPA 3.88% 28/07/2026	EUR	696,497.21	580,237.00	0.61
500,000.00	LEONARDO SPA 2.38% 08/01/2026	EUR	503,462.18	476,040.00	0.50
300,000.00	SOFIMA HOLDING SPA 3.75% 15/01/2028	EUR	305,283.55	242,001.00	0.25
Beni voluttuari			512,898.78	463,360.00	0.49
500,000.00	NEXI SPA 1.75% 31/10/2024	EUR	512,898.78	463,360.00	0.49
SPAGNA			4,784,876.43	4,423,142.86	4.66
Enti Governativi			4,487,168.43	4,169,009.86	4.39
3,000,000.00	SPAIN GOVERNMENT BOND 1.45% 30/04/2029	EUR	3,197,692.93	2,903,400.00	3.06
1,148,060.00	SPAIN GOVERNMENT INFLATION LINKED BOND 1.80% 30/11/2024	EUR	1,289,475.50	1,265,609.86	1.33
Industria			297,708.00	254,133.00	0.27
300,000.00	CELLNEX FINANCE CO SA 0.75% 15/11/2026	EUR	297,708.00	254,133.00	0.27
REGNO UNITO			3,441,175.90	3,388,251.42	3.57
Enti Governativi			3,441,175.90	3,388,251.42	3.57
3,000,000.00	UNITED KINGDOM GILT 0.13% 31/01/2024	GBP	3,441,175.90	3,388,251.42	3.57
GERMANIA			3,566,657.06	3,378,499.12	3.56
Enti Governativi			2,574,963.36	2,533,439.12	2.67
2,368,652.00	DEUTSCHE BUNDESREPUBLIK INFLATION LINKED BOND 0.10% 15/04/2026	EUR	2,574,963.36	2,533,439.12	2.67
Beni voluttuari			991,693.70	845,060.00	0.89
1,000,000.00	DEUTSCHE LUFTHANSA AG 3.00% 29/05/2026	EUR	991,693.70	845,060.00	0.89

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
PORTOGALLO			2,545,998.32	2,381,250.00	2.51
Enti Governativi			2,545,998.32	2,381,250.00	2.51
2,500,000.00	PORTUGAL OBRIGACOES DO TESOURO OT 0.70% 15/10/2027	EUR	2,545,998.32	2,381,250.00	2.51
STATI UNITI			1,925,965.66	1,888,524.13	1.99
Beni voluttuari			1,511,654.32	1,414,530.00	1.49
1,000,000.00	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 1.74% 19/07/2024	EUR	1,007,101.38	926,560.00	0.98
500,000.00	NETFLIX INC 3.00% 15/06/2025	EUR	504,552.94	487,970.00	0.51
Enti Governativi			414,311.34	473,994.13	0.50
500,000.00	UNITED STATES TREASURY NOTE 0.13% 30/11/2022	USD	414,311.34	473,994.13	0.50
FRANCIA			2,026,260.97	1,742,040.00	1.83
Beni voluttuari			1,010,860.62	854,275.00	0.90
500,000.00	RCI BANQUE SA 1.75% 10/04/2026	EUR	508,374.13	456,030.00	0.48
500,000.00	ACCOR SA 2.38% 29/11/2028	EUR	502,486.49	398,245.00	0.42
Industria			521,364.70	447,930.00	0.47
500,000.00	SPIE SA REG 2.63% 18/06/2026	EUR	521,364.70	447,930.00	0.47
Servizi di telecomunicazione			494,035.65	439,835.00	0.46
500,000.00	ILIAD SA 2.38% 17/06/2026	EUR	494,035.65	439,835.00	0.46
PAESI BASSI			2,097,697.36	1,695,310.00	1.78
Servizi di telecomunicazione			1,039,076.84	795,130.00	0.84
1,000,000.00	PROSUS NV 1.54% 03/08/2028	EUR	1,039,076.84	795,130.00	0.84
Materie prime			544,510.89	495,145.00	0.52
500,000.00	SYNGENTA FINANCE NV 3.38% 16/04/2026	EUR	544,510.89	495,145.00	0.52
Industria			514,109.63	405,035.00	0.42
500,000.00	EASYJET FINCO BV 1.88% 03/03/2028	EUR	514,109.63	405,035.00	0.42
MESSICO			505,353.50	499,910.00	0.53
Energia			505,353.50	499,910.00	0.53
500,000.00	PETROLEOS MEXICANOS 2.50% 24/11/2022	EUR	505,353.50	499,910.00	0.53
Obbligazioni a tasso variabile			31,550,092.46	28,325,872.42	29.84
ITALIA			15,629,641.99	14,419,533.42	15.19
Enti Governativi			5,992,384.84	5,995,300.00	6.32
3,000,000.00	CCT FRN 15/04/2026	EUR	3,006,513.06	2,993,100.00	3.15
2,000,000.00	CCT FRN 15/02/2024	EUR	1,991,404.15	2,020,200.00	2.13
1,000,000.00	ITALY CERTIFICATI DI CREDITO DEL TESORO/ CCTS-EU FRN 15/04/2029	EUR	994,467.63	982,000.00	1.04
Finanza			6,431,874.95	5,790,291.42	6.10
1,700,000.00	UNICREDIT SPA FRN 31/12/2099	EUR	1,728,707.25	1,616,717.00	1.70
922,000.00	BANCO BPM SPA FRN 30/07/2022	EUR	954,499.51	922,331.92	0.97
1,000,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 31/12/2099	EUR	997,147.64	804,120.00	0.85
750,000.00	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA FRN 23/11/2030	EUR	753,602.15	661,042.50	0.70
500,000.00	BANCA POPOLARE DI SONDRIO SCPA FRN 30/07/2029	EUR	530,946.40	507,335.00	0.53
500,000.00	UNICREDIT SPA FRN 23/09/2029	EUR	492,290.20	462,190.00	0.49
500,000.00	SERVIZI ASSICURATIVI DEL COMMERCIO ESTERO SPA FRN 10/02/2049	EUR	511,858.05	456,935.00	0.48
500,000.00	UNICREDIT SPA REG FRN 31/12/2099	EUR	462,823.75	359,620.00	0.38
Energia			1,578,644.28	1,432,512.00	1.51
1,600,000.00	ENI SPA FRN 31/12/2099	EUR	1,578,644.28	1,432,512.00	1.51
Industria			1,000,499.86	705,770.00	0.74
1,000,000.00	POSTE ITALIANE SPA FRN 31/12/2099	EUR	1,000,499.86	705,770.00	0.74

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Servizi di pubblica utilità			626,238.06	495,660.00	0.52
600,000.00	ENEL SPA FRN 31/12/2099	EUR	626,238.06	495,660.00	0.52
FRANCIA			3,456,817.41	3,131,318.00	3.30
Finanza			1,241,938.08	1,275,960.00	1.34
1,500,000.00	AXA SA FRN 29/12/2049	EUR	1,241,938.08	1,275,960.00	1.34
Energia			1,213,178.63	1,030,378.00	1.09
700,000.00	TOTALENERGIES SE FRN 31/12/2099	EUR	705,323.38	559,538.00	0.59
500,000.00	TOTAL SA FRN 31/12/2099	EUR	507,855.25	470,840.00	0.50
Beni di prima necessità			1,001,700.70	824,980.00	0.87
1,000,000.00	DANONE SA FRN 31/12/2099	EUR	1,001,700.70	824,980.00	0.87
PAESI BASSI			3,377,372.64	3,043,536.00	3.21
Finanza			2,079,644.86	1,932,360.00	2.04
1,400,000.00	AEGON NV FRN 29/07/2049	EUR	1,075,342.34	1,177,960.00	1.24
1,000,000.00	COOPERATIEVE RABOBANK UA FRN 31/12/2099	EUR	1,004,302.52	754,400.00	0.80
Beni voluttuari			1,098,748.59	946,920.00	1.00
1,000,000.00	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN 29/03/2049	EUR	1,098,748.59	946,920.00	1.00
Industria			198,979.19	164,256.00	0.17
200,000.00	ADECCO INTERNATIONAL FINANCIAL SERVICES BV FRN 21/03/2082	EUR	198,979.19	164,256.00	0.17
REGNO UNITO			3,100,794.03	2,883,970.00	3.04
Finanza			2,096,191.30	1,976,160.00	2.08
2,000,000.00	HSBC HOLDINGS PLC FRN 29/12/2049	EUR	2,096,191.30	1,976,160.00	2.08
Energia			1,004,602.73	907,810.00	0.96
1,000,000.00	BP CAPITAL MARKETS PLC FRN 31/12/2099	EUR	1,004,602.73	907,810.00	0.96
GERMANIA			2,995,274.72	2,310,805.00	2.43
Finanza			2,490,546.66	1,883,245.00	1.98
1,000,000.00	ALLIANZ SE FRN 31/12/2099	EUR	983,590.03	721,350.00	0.76
1,000,000.00	ALLIANZ SE FRN 31/12/2099	EUR	1,005,203.15	689,590.00	0.72
500,000.00	DEUTSCHE BANK AG FRN 19/11/2025	EUR	501,753.48	472,305.00	0.50
Salute			504,728.06	427,560.00	0.45
500,000.00	BAYER AG FRN 25/03/2082	EUR	504,728.06	427,560.00	0.45
SPAGNA			2,360,050.88	2,088,498.00	2.20
Finanza			2,360,050.88	2,088,498.00	2.20
1,800,000.00	BANCO SANTANDER SA FRN 31/12/2099	EUR	1,769,838.02	1,563,570.00	1.65
600,000.00	BANCO DE SABADELL SA FRN 17/01/2030	EUR	590,212.86	524,928.00	0.55
LUSSEMBURGO			630,140.79	448,212.00	0.47
Finanza			630,140.79	448,212.00	0.47
600,000.00	TLG FINANCE SARL FRN 31/12/2099	EUR	630,140.79	448,212.00	0.47
Obbligazioni zero coupon			8,370,823.89	8,343,255.00	8.79
ITALIA			5,469,856.52	5,457,150.00	5.75
Enti Governativi			5,469,856.52	5,457,150.00	5.75
3,500,000.00	ITALY BTPORO 0.00% 28/06/2030	EUR	3,500,000.00	3,486,350.00	3.67
2,000,000.00	ITALY BTPORO 0.00% 29/11/2023	EUR	1,969,856.52	1,970,800.00	2.08
SPAGNA			1,483,888.31	1,473,555.00	1.55
Enti Governativi			1,483,888.31	1,473,555.00	1.55
1,500,000.00	SPAIN GOVERNMENT BOND 0.00% 31/05/2024	EUR	1,483,888.31	1,473,555.00	1.55

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
FRANCIA			1,417,079.06	1,412,550.00	1.49
Enti Governativi			1,417,079.06	1,412,550.00	1.49
1,500,000.00	FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 0.00% 25/02/2027	EUR	1,417,079.06	1,412,550.00	1.49
Azioni di OICR			23,090,892.48	22,781,562.63	24.00
LUSSEMBURGO			10,933,321.34	11,367,902.33	11.98
Finanza			10,933,321.34	11,367,902.33	11.98
45,600.00	AMUNDI INDEX MSCI EUROPE SRI UCITS DR ETF	EUR	2,598,620.20	2,883,744.00	3.04
57,000.22	FUNDSMITH EQUITY FUND SICAV -F-	EUR	2,269,036.26	2,801,737.51	2.95
17,506.00	LYXOR DAX UCITS ETF	EUR	2,233,399.16	2,081,813.52	2.19
19,600.00	MULTI UNITS LUXEMBOURG-LYXOR EURO STOXX BANKS DR UCITS ETF	EUR	1,878,174.62	1,601,908.00	1.69
2,350.00	LYXOR MSCI WORLD HEALTH CARE TR UCITS ETF	EUR	940,018.62	1,006,152.50	1.06
79,100.00	XTRACKERS HARVEST CSI300 UCITS ETF	EUR	1,014,072.48	992,546.80	1.05
IRLANDA			10,348,896.25	9,741,047.80	10.26
Finanza			10,348,896.25	9,741,047.80	10.26
87,500.00	ISHARES MSCI EUROPE UCITS ETF	EUR	2,123,539.60	2,230,812.50	2.35
53,000.00	ISHARES MSCI EUROPE EX-UK UCITS ETF	EUR	1,716,796.52	1,815,780.00	1.91
14,700.00	ISHARES J.P. MORGAN USD EM BOND EUR HEDGED UCITS ETF -H-	EUR	1,419,944.51	987,252.00	1.04
11,500.00	ISHARES S&P 500 UCITS ETF -H-	EUR	987,650.78	938,745.00	0.99
90,000.00	ISHARES GLOBAL CLEAN ENERGY UCITS ETF	EUR	1,015,070.59	936,720.00	0.99
11,700.00	SPDR BARCLAYS EMERGING MARKETS LOCAL BOND UCITS ETF	EUR	692,037.24	613,548.00	0.65
9,850.00	ISHARES PLC - ISHARES MSCI AC FAR EAST EX-JAPAN UCITS ETF	EUR	518,566.15	492,401.50	0.52
68,000.00	ISHARES IV PLC-ISHARES HEALTHCARE INNOVATION UCITS ETF	EUR	531,148.37	459,408.00	0.48
9,000.00	ISHARES GLOBAL WATER UCITS ETF	EUR	508,348.14	445,365.00	0.47
33,350.00	ISHARES MSCI JAPAN UCITS ETF USD DIST	EUR	520,126.60	428,480.80	0.45
13,000.00	ISHARES GLOBAL INFRASTRUCTURE UCITS ETF	EUR	315,667.75	392,535.00	0.41
FRANCIA			1,808,674.89	1,672,612.50	1.76
Finanza			1,808,674.89	1,672,612.50	1.76
47,500.00	LYXOR FTSE MIB UCITS ETF	EUR	1,104,455.46	1,012,462.50	1.07
8,150.00	LYXOR IBEX35 DR UCITS ETF	EUR	704,219.43	660,150.00	0.69
QUOTE DI OICR			936,490.51	695,721.25	0.73
Azioni di OICR			936,490.51	695,721.25	0.73
IRLANDA			936,490.51	695,721.25	0.73
Finanza			936,490.51	695,721.25	0.73
87,500.00	AIRLINES HOTELS CRUISE LINES UCITS ETF	EUR	532,090.91	418,993.75	0.44
10,500.00	WISDOMTREE CLOUD COMPUTING UCITS ETF	EUR	404,399.60	276,727.50	0.29
Totale del Portafoglio Titoli			98,403,064.93	92,515,725.15	97.45

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity

IMPEGNI SU ACQUISTO / VENDITA DI CONTRATTI FUTURES AL 30 GIUGNO 2022

Valore nominale	Quantità	Acquisto / Vendita	Contratto	Scadenza	Valore di mercato al 30 Giugno 2022	Valuta	Plus/(minus) valenza non realizzata (EUR)	Impegno (EUR)
							-500.00	860,250.00
10	25	Acquisto	EURO STOXX 50	16/09/2022	3,441.00	EUR	-500.00	860,250.00

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Attività

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	8,412,173.61
Liquidità bancarie a vista		182,563.60
Importi dovuti dai broker	(Nota 12)	49,799.75
Interessi da ricevere		77,481.47
Altre attività		36,655.79
Totale attività		8,758,674.22

Passività

Altre passività		-94,326.97
Totale passività		-94,326.97

Totale attivo netto**8,664,347.25**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	93.45	54,109.492
Azione I	EUR	96.21	35,544.084
Azione L	EUR	95.35	1,975.000

NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia

PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Attivo netto all'inizio del periodo		10,344,518.49
Risultato netto degli investimenti		100,835.01
Altri ricavi		30,666.37
Totale ricavi		131,501.38
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-55,530.11
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 7)	-2,646.75
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-1,529.35
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 7)	-53,710.86
Commissioni del Transfer Agent		-2,309.58
Compensi professionali	(Nota 8)	-1,442.12
Pubblicazioni		-6,150.36
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-4,550.53
Totale costi		-127,869.66
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		3,631.72
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	-465,723.35
- di contratti futures		-44.09
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		-1,011,394.01
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(Nota 2c)	325.43
Risultato netto delle operazioni per il periodo		-1,473,204.30
Sottoscrizioni del periodo		64,811.44
Rimborsi del periodo		-271,778.38
Attivo netto alla fine del periodo		8,664,347.25

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			9,195,052.86	8,412,173.61	97.09
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			9,032,462.67	8,249,273.78	95.21
Azioni			3,090,305.21	2,745,419.90	31.69
ITALIA			2,592,968.65	2,288,519.90	26.42
Industria			933,295.12	826,329.50	9.54
20,000.00	LEONARDO SPA	EUR	186,594.69	193,560.00	2.23
10,000.00	AVIO SPA	EUR	114,294.53	110,000.00	1.27
10,000.00	INDUSTRIAL STARS OF ITALY 4 SPA	EUR	100,000.00	98,500.00	1.14
3,500.00	PRYSMIAN SPA	EUR	95,578.35	91,735.00	1.06
2,500.00	INTERPUMP GROUP SPA	EUR	107,568.24	90,950.00	1.05
13,000.00	SCIUKER FRAMES SPA	EUR	98,025.32	79,170.00	0.91
6,000.00	BIESSE SPA	EUR	99,064.09	75,840.00	0.88
19,500.00	GRIFAL SPA	EUR	91,138.50	50,115.00	0.58
2,750.00	OFFICINA STELLARE SPA	EUR	40,749.58	36,162.50	0.42
20.00	FERVI SPA	EUR	281.82	297.00	0.00
Finanza			734,754.67	625,171.90	7.22
5,573.00	FIRST CAPITAL SPA	EUR	107,800.00	113,131.90	1.31
15,000.00	BANCA FARMAFACTORING SPA	EUR	120,457.90	96,225.00	1.11
10,000.00	UNICREDIT SPA	EUR	104,059.50	90,650.00	1.05
10,000.00	POSTE ITALIANE SPA	EUR	118,494.94	89,120.00	1.03
3,000.00	BANCA GENERALI SPA	EUR	99,059.09	80,880.00	0.93
10,000.00	NEXI SPA	EUR	93,705.86	79,040.00	0.91
5,000.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA	EUR	91,177.38	76,125.00	0.88
Informatica			352,785.08	320,373.70	3.70
7,000.00	EL.EN. SPA	EUR	105,662.46	86,450.00	1.00
15,000.00	ALMAWAVE SPA	EUR	63,750.00	69,000.00	0.80
543.00	SESA SPA	EUR	68,512.26	65,920.20	0.76
1,720.00	DIGITAL BROS SPA	EUR	47,935.54	43,516.00	0.50
10,000.00	SABABA SECURITY SPA	EUR	37,000.00	29,050.00	0.34
2,250.00	DOXEE SPA	EUR	29,924.82	26,437.50	0.30
Beni voluttuari			235,568.72	176,774.80	2.04
3,452.00	PORTOBELLO SPA	EUR	139,733.56	92,858.80	1.07
30,000.00	ELICA SPA	EUR	94,853.34	82,500.00	0.95
300.00	POWERSOFT SPA	EUR	981.82	1,320.00	0.02
100.00	RADICI PIETRO INDUSTRIES & BRANDS SPA	EUR	0.00	96.00	0.00
Salute			131,337.53	124,530.00	1.44
3,000.00	RECORDATI SPA	EUR	131,337.53	124,530.00	1.44
Materie prime			108,205.93	115,360.00	1.33
7,000.00	SOL SPA	EUR	108,205.93	115,360.00	1.33
Servizi di pubblica utilità			97,021.60	99,980.00	1.15
20,000.00	SNAM SPA	EUR	97,021.60	99,980.00	1.15
PAESI BASSI			397,912.87	365,840.00	4.22
Beni voluttuari			224,152.62	205,520.00	2.37
10,000.00	STELLANTIS NV	EUR	132,665.59	117,920.00	1.36
500.00	FERRARI NV	EUR	91,487.03	87,600.00	1.01
Beni di prima necessità			97,445.95	100,350.00	1.16
10,000.00	DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	EUR	97,445.95	100,350.00	1.16
Informatica			76,314.30	59,970.00	0.69
2,000.00	STMICROELECTRONICS NV	EUR	76,314.30	59,970.00	0.69

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
GERMANIA			99,423.69	91,060.00	1.05
Finanza			99,423.69	91,060.00	1.05
500.00	ALLIANZ SE REG	EUR	99,423.69	91,060.00	1.05
Obbligazioni ordinarie			3,549,073.19	3,200,140.50	36.93
ITALIA			3,290,363.26	2,949,328.50	34.04
Finanza			978,344.67	895,745.50	10.34
250,000.00	INTESA SANPAOLO SPA 0.63% 24/02/2026	EUR	250,135.01	222,947.50	2.57
200,000.00	INTESA SANPAOLO SPA 2.86% 23/04/2025	EUR	205,713.74	196,804.00	2.27
200,000.00	UNICREDIT SPA 2.13% 24/10/2026	EUR	216,939.75	188,776.00	2.18
100,000.00	BANCA DEL MEZZOGIORNO-MEDIO CREDITO CENTRALE SPA 1.50% 24/10/2024	EUR	99,643.84	97,883.00	1.13
100,000.00	TAMBURI INVESTMENT PARTNERS SPA 2.50% 05/12/2024	EUR	99,769.89	96,729.00	1.12
100,000.00	BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA 3.63% 24/09/2024	EUR	106,142.44	92,606.00	1.07
Servizi di pubblica utilità			642,831.02	581,466.00	6.71
200,000.00	ACQUIRENTE UNICO SPA REG 2.80% 20/02/2026	EUR	220,200.04	201,344.00	2.32
200,000.00	ERG SPA 1.88% 11/04/2025	EUR	208,215.25	197,444.00	2.28
200,000.00	IREN SPA 1.50% 24/10/2027	EUR	214,415.73	182,678.00	2.11
Industria			658,392.90	540,849.00	6.24
200,000.00	AEROPORTI DI ROMA SPA REG 1.63% 08/06/2027	EUR	209,253.67	180,614.00	2.08
200,000.00	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA 1.63% 21/10/2028	EUR	206,200.45	170,044.00	1.96
150,000.00	POSTE ITALIANE SPA 0.50% 10/12/2028	EUR	151,195.95	125,553.00	1.45
97,200.00	ENERTRONICA SPA 7.00% 31/12/2022	EUR	91,742.83	64,638.00	0.75
Energia			400,383.11	360,692.00	4.16
300,000.00	ENI SPA 0.38% 14/06/2028	EUR	300,383.11	261,078.00	3.01
100,000.00	ALERION CLEANPOWER SPA REG 3.13% 19/12/2025	EUR	100,000.00	99,614.00	1.15
Enti Governativi			202,648.52	201,284.00	2.33
200,000.00	BTP 1.75% 01/07/2024	EUR	202,648.52	201,284.00	2.33
Servizi di telecomunicazione			206,582.60	195,850.00	2.26
200,000.00	RAI-RADIOTELEVISIONE ITALIANA SPA 1.38% 04/12/2024	EUR	206,582.60	195,850.00	2.26
Salute			201,180.44	173,442.00	2.00
200,000.00	AMPLIFON SPA 1.13% 13/02/2027	EUR	201,180.44	173,442.00	2.00
LUSSEMBURGO			147,409.55	145,671.00	1.68
Sovranazionale			147,409.55	145,671.00	1.68
150,000.00	EIB 0.13% 15/04/2025	EUR	147,409.55	145,671.00	1.68
SPAGNA			111,300.38	105,141.00	1.21
Enti Governativi			111,300.38	105,141.00	1.21
100,000.00	SPAIN GOVERNMENT BOND 3.80% 30/04/2024	EUR	111,300.38	105,141.00	1.21
Obbligazioni a tasso variabile			1,125,197.27	1,090,698.00	12.59
ITALIA			1,125,197.27	1,090,698.00	12.59
Finanza			928,353.19	890,438.00	10.28
300,000.00	UNICREDIT SPA FRN 30/06/2023	EUR	300,130.00	297,840.00	3.44
200,000.00	CASSA DEPOSITI E PRESTITI SPA FRN 28/06/2026	EUR	209,407.73	200,920.00	2.32
200,000.00	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA FRN 10/09/2025	EUR	212,276.88	200,584.00	2.31
200,000.00	ICCREA BANCA SPA FRN 20/10/2025	EUR	206,538.58	191,094.00	2.21
Enti Governativi			196,844.08	200,260.00	2.31
200,000.00	CCT FRN 15/09/2025	EUR	196,844.08	200,260.00	2.31

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2022 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Obbligazioni zero coupon			698,455.54	670,055.00	7.73
ITALIA			500,688.23	471,125.00	5.44
Servizi di pubblica utilità			300,720.24	286,785.00	3.31
300,000.00	INTESA SANPAOLO SPA 0.21% 26/01/2026	EUR	300,720.24	286,785.00	3.31
Enti Governativi			199,967.99	184,340.00	2.13
200,000.00	ITALY BTPORO 0.00% 01/04/2026	EUR	199,967.99	184,340.00	2.13
GERMANIA			197,767.31	198,930.00	2.29
Enti Governativi			197,767.31	198,930.00	2.29
200,000.00	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0.00% 15/12/2023	EUR	197,767.31	198,930.00	2.29
Azioni di OICR			569,292.96	541,203.94	6.25
FRANCIA			363,607.81	317,571.70	3.67
Finanza			363,607.81	317,571.70	3.67
2,315.00	LYXOR FTSE ITALIA MID CAP PIR DR UCITS ETF	EUR	363,607.81	317,571.70	3.67
LUSSEMBURGO			205,685.15	223,632.24	2.58
Finanza			205,685.15	223,632.24	2.58
1,911.49	NEW MILLENNIUM SIF-SICAV - AIM SISTEMA ITALIA - PIR	EUR	205,685.15	223,632.24	2.58
Warrants			138.50	1,756.44	0.02
ITALIA			138.50	1,756.44	0.02
Industria			0.00	1,727.40	0.02
680.00	INDUSTRIAL STARS OF ITALY 4 SPA WARRANT C 10/06/2027	EUR	0.00	612.00	0.01
660.00	INDUSTRIAL STARS OF ITALY 4 SPA WARRANT B 10/06/2027	EUR	0.00	587.40	0.01
660.00	INDUSTRIAL STARS OF ITALY 4 SPA WARRANT A 10/06/2027	EUR	0.00	528.00	0.00
Beni voluttuari			138.50	29.04	0.00
30.00	SOSTRAVEL.COM SPA	EUR	138.50	29.04	0.00
ALTRI VALORI MOBILIARI			162,590.19	162,899.83	1.88
Obbligazioni ordinarie			162,590.19	162,899.83	1.88
ITALIA			162,590.19	162,899.83	1.88
Servizi di pubblica utilità			100,000.00	103,338.88	1.19
100,000.00	INNOVATEC SPA 6.00% 30/09/2026	EUR	100,000.00	103,338.88	1.19
Servizi di telecomunicazione			62,590.19	59,560.95	0.69
62,565.49	PRISMI SPA 3.50% 18/12/2024	EUR	62,590.19	59,560.95	0.69
Totale del Portafoglio Titoli			9,195,052.86	8,412,173.61	97.09

Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NOTE AI RENDICONTI FINANZIARI

1. INFORMAZIONI DI CARATTERE GENERALE

NEW MILLENNIUM, di seguito "la SICAV", è una società d'investimento a capitale variabile di diritto lussemburghese, costituita con durata illimitata in Lussemburgo, in data 11 Agosto 1999 e organizzata ai sensi della parte I della legge del 17 Dicembre 2010 che, nello specifico, si applica agli organismi di investimento collettivo in valori mobiliari (la "Legge del 17 Dicembre 2010"), come modificata, e alla legge del 10 Agosto 1915 sulle società commerciali come modificata al 10 Dicembre 2010.

La SICAV è composta da diversi comparti aventi ciascuno un proprio patrimonio ed una specifica politica d'investimento.

A decorrere dal 1° Gennaio 2017 la SICAV ha designato Natam Management Company S.A. come Società di Gestione.

L'obiettivo della SICAV è di offrire ai propri azionisti un accesso agevolato ai diversi mercati mobiliari, nel rispetto del principio di diversificazione del rischio. Quasi tutti i valori mobiliari acquistati sono costituiti da titoli quotati in una Borsa Ufficiale o negoziati in un mercato regolamentato, regolarmente funzionante, riconosciuto ed aperto al pubblico.

I comparti operativi al 30 Giugno 2022 sono i seguenti:

- NEW MILLENNIUM - Euro Equities
- NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)
- NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term
- NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate
- NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative
- NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible
- NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe
- NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond
- NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond
- NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond
- NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing
- NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond
- NEW MILLENNIUM - VolActive
- NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond
- NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity
- NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia

Può essere ottenuta una copia gratuita del prospetto previa richiesta indirizzata alla sede legale della SICAV.

2. SOMMARIO DEI PRINCIPALI METODI CONTABILI

Il Fondo tiene la contabilità di ciascun Comparto nella rispettiva valuta ed i rendiconti finanziari sono espressi in Euro conformemente ai principi contabili validi per gli organismi di investimento collettivo in Lussemburgo, utilizzando in particolare le seguenti regole di valutazione:

a) Valutazione del portafoglio titoli

I titoli, comprese le obbligazioni zero coupon e gli strumenti del mercato monetario, quotati in una borsa ufficiale o in altro mercato regolamentato, sono valutati sulla base dell'ultimo prezzo di quotazione noto e, se ci sono più mercati, sulla base dell'ultimo prezzo di quotazione del mercato principale.

I titoli, comprese le obbligazioni zero coupon e gli strumenti del mercato monetario, non quotati in una borsa ufficiale o in un altro mercato regolamentato, sono valutati in buona fede sulla base del probabile valore di realizzo ritenuto prudente.

Il valore di ciascuna azione in un altro OICR e/o OIC, quotato o meno, è determinato in base all'ultimo Valore del Patrimonio Netto conosciuto al Giorno di Valorizzazione.

In assenza di un mercato per gli strumenti finanziari, la valutazione sarà effettuata facendo riferimento a metodi alternativi, come la quotazione di un broker o l'applicazione di una analisi ad hoc giudicata pertinente dalla Management Company.

b) Utile (perdita) netto(a) realizzato(a) sul portafoglio titoli

Gli utili o le perdite realizzate sulle vendite di titoli sono calcolati sulla base del costo medio.

c) Contratti di cambio a termine

I contratti di cambio a termine sono valutati al prezzo di quotazione di cambio a termine per la scadenza restante dalla data di valutazione.

Le plusvalenze o minusvalenze non realizzate sono registrate nel Prospetto del Patrimonio Netto e le loro variazioni nel Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto sotto la voce «Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata su contratti di cambio a termine e su valute estere».

d) Contratti Futures

Gli impegni legati ai contratti Futures sono registrati fuori bilancio e i contratti Futures sono valutati all'ultimo prezzo di quotazione disponibile dei contratti. Le plusvalenze o minusvalenze non realizzate sui contratti Futures sono registrate nel Prospetto del Patrimonio Netto e le loro variazioni nel Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto sotto la voce «Variazione della plus / (minus)- valenza non realizzata su contratti Futures». I depositi di garanzia sono classificati alle voci "Importi dovuti dai broker" e "Scoperti presso brokers".

e) Contratti di opzioni

Le opzioni quotate su una borsa ufficiale o su un altro mercato regolamentato sono valutate sulla base dell'ultimo prezzo di quotazione noto o, se ci sono più mercati, sulla base dell'ultimo prezzo di quotazione noto del mercato principale.

Le opzioni non quotate in una borsa ufficiale o in un altro mercato regolamentato sono valutati al loro ultimo valore di mercato noto o, in assenza di valore di mercato, sulla base del probabile valore di realizzo ritenuto prudente dal Consiglio di Amministrazione della Sicav.

I premi incassati sulle vendite di opzioni sono registrati al passivo e i premi pagati sull'acquisto di contratti di opzioni sono registrati all'attivo. Le plusvalenze o minusvalenze non realizzate su contratti di opzione sono registrate nel Prospetto del Patrimonio Netto e le loro variazioni nel Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto sotto la voce «Variazione della plus / (minus)- valenza non realizzata sulle opzioni».

f) Contratti Swap

I Contratti Swap sono valutati al loro fair value basato sul sottostante e sulle caratteristiche degli impegni sul sottostante o altrimenti in conformità ai principi contabili di riferimento.

I pagamenti anticipati, che rappresentano un premio per il rischio dei Contratti Credit Default Swap, sono registrati nello Prospetto del Patrimonio Netto alla voce "premio ricevuto su contratti swap". Tale importo da pagare è correlato all'importo di denaro ricevuto per compensare la differenza tra il valore di mercato dei Contratti Credit Default Swap e il ricavato della sottoscrizione.

Il valore di mercato dei contratti Credit Default Swap è calcolato come somma del premio swap ricevuto e della plus/(minus)-valenza non realizzata registrata nella sezione Contratti Swap.

g) Costo d'acquisto dei titoli in portafoglio

Per i titoli espressi in valute diverse dalla valuta di riferimento del Comparto, si calcola il costo d'acquisto sulla base del cambio di chiusura del giorno d'acquisto.

h) Ricavi

I dividendi sono riconosciuti alla data nella quale le relative Azioni/Quote sono quotate «exdividend, al netto della ritenuta alla fonte». Gli interessi sono contabilizzati pro rata temporis, al netto della ritenuta alla fonte.

i) Conversioni delle voci in valute estere

Gli attivi e passivi in valute estere sono convertiti nella divisa del Comparto ai corsi di cambio di chiusura alla data dell'ultimo giorno dell'esercizio.

I ricavi e le spese espressi in valute diverse dalla valuta del Comparto sono convertiti nella valuta di denominazione del Comparto al prezzo di cambio di chiusura del giorno della transazione.

Gli utili o le perdite su cambi realizzati e non realizzati che ne conseguono sono inclusi nel Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto.

j) Valore del Patrimonio Netto per Azione

Il Valore del Patrimonio Netto di ciascun Comparto è pari alla differenza tra l'attivo lordo ed il passivo esigibile del Comparto stesso.

Il Valore del Patrimonio Netto per Azione è determinato dividendo il Valore del Patrimonio Netto per il numero di Azioni in circolazione il giorno della valutazione.

k) Prospetto finanziario

I prospetti finanziari sono stati presentati sulla base dell'ultimo Valore del Patrimonio Netto dell'esercizio. Conformemente a quanto stabilito nel prospetto, i Valori del Patrimonio Netto sono stati calcolati utilizzando gli ultimi prezzi di quotazione noti al momento del calcolo.

l) Tassi di cambio

I principali tassi di cambio utilizzati al 30 Giugno 2022 sono:

1 EUR =	1.520323	AUD
1 EUR =	5.467128	BRL
1 EUR =	1.348578	CAD
1 EUR =	1.000861	CHF
1 EUR =	6.998555	CNY
1 EUR =	7.436651	DKK
1 EUR =	0.860842	GBP
1 EUR =	8.203593	HKD
1 EUR =	15574.59	IDR
1 EUR =	82.56179	INR
1 EUR =	138.7051	ISK
1 EUR =	142.0296	JPY
1 EUR =	21.09274	MXN
1 EUR =	10.32878	NOK
1 EUR =	1.681463	NZD
1 EUR =	57.48406	PHP
1 EUR =	4.700186	PLN
1 EUR =	57.23838	RUB
1 EUR =	10.71314	SEK
1 EUR =	1.454953	SGD
1 EUR =	17.45535	TRY
1 EUR =	1.04545	USD
1 EUR =	17.12708	ZAR

m) Investimenti incrociati

Il Prospetto del Patrimonio Netto consolidato mostra un totale del Patrimonio Netto a EUR 934,336,376.95. Alla fine dell'anno, i comparti NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing e NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative hanno investito un valore totale di EUR 1,927,689.64 in altri comparti della struttura NEW MILLENNIUM SICAV. Se tali investimenti fossero esclusi del Patrimonio Netto consolidato, il Patrimonio Netto totale per la SICAV sarebbe EUR 932,408,687.31.

3. REGIME FISCALE

Il Fondo è soggetto alla legislazione lussemburghese applicabile ai Fondi comuni di investimento.

Allo stato attuale della legislazione, il Fondo è soggetto ad un'imposta lussemburghese (la «taxe d'abonnement») dello 0,05% annuale calcolata e pagata trimestralmente sul Valore del Patrimonio Netto di ciascun Comparto del Fondo alla fine di ciascun trimestre.

L'aliquota della «taxe d'abonnement» è pari allo 0,01% annuale per i Comparti o le Azioni riservate ad uno o più investitori istituzionali, così come per i Comparti che hanno come oggetto esclusivo l'investimento collettivo in strumenti del mercato monetario e/o depositi aperti presso un istituto di credito.

La «taxe d'abonnement» non si applica al valore degli attivi rappresentato da Azioni / Quote detenute in altri Organismi di Investimento Collettivo nella misura in cui queste Azioni / Quote sono già sottoposte alla «taxe d'abonnement».

4. ALTRE SPESE E TASSE

Le spese d'iscrizione presso l'autorità di controllo e le altre spese professionali (domiciliazione, amministrazione dei pagamenti, di registrazione e distribuzione, diverse) sono ripartite fra i diversi Comparti in modo proporzionale al Valore del Patrimonio Netto di ciascun Comparto.

La tabella seguente mostra la ripartizione delle Altre spese e tasse quando questo ammontare eccede il 10% delle spese totali del comparto:

Comparti	Tasse di domicilio	Commissioni di distribuzione	Pagamento delle commissioni dell'amministratore	Commissioni varie	Totale
NEW MILLENNIUM - Euro Equities	0.00	0.00	0.00	36,374.57	36,374.57
NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term	0.00	0.00	0.00	7,925.56	7,925.56
NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing	0.00	13,520.77	0.00	4,368.56	17,889.33

5. COMMISSIONE DI GESTIONE

Il Gestore, la Società di Gestione ed i Gestori dei comparti ricevono una commissione di Gestione calcolata sulla base del Valore del Patrimonio Netto di ciascun Comparto del Fondo. Al 30 Giugno 2022, le aliquote in vigore per i Comparti sono le seguenti:

Comparti	Commissioni di Gestione per Classe di Investimento:					
	A, A (H-CHF), A (H-USD)	D	I	L	Y	Z
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	1.50%	1.50%	0.75%	0.90%	0.75%	0.50%
NEW MILLENNIUM - Euro Equities	1.50%		0.70%	0.85%	0.70%	
NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)	1.60%		0.80%	0.95%		
NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term	0.55%	0.55%	0.30%	0.45%	0.30%	
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond	1.20%	1.20%	0.70%	0.85%	0.70%	
NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate	0.90%	0.90%	0.45%	0.60%	0.45%	
NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative	1.10%	1.10%	0.55%	0.70%		
NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible	1.35%		1.00%	1.15%		
NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe	0.80%		0.40%	0.55%	0.40%	
NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond	1.50%	1.50%	0.75%	0.90%		
NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing	0.60%	0.60%	0.60%	0.75%	0.60%	
NEW MILLENNIUM - VolActive	2.20%	2.20%	1.10%	1.25%		
NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond	1.60%	1.60%	0.80%	0.95%		
NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond	1.70%		0.85%	1.00%		
NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity	1.80%		1.35%	1.50%		
NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia	1.20%		0.60%	0.75%		

In ciascun Comparto del Fondo, questa commissione è pagata trimestralmente e calcolata sulla media dei Valori del Patrimonio Netto del trimestre.

La Società di gestione riceve inoltre, per ogni comparto, una commissione fissa fino ad un massimo di 11,000 Euro, pagabile in rate trimestrali posticipate.

Oltre a questo, il Comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing paga una commissione di distribuzione dell'1% sulle classi A e D. Questa commissione è pagata trimestralmente, calcolata e attribuita giornalmente relativamente al Valore del Patrimonio Netto.

Inoltre al 30 Giugno 2022, il Comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing risulta investito per più del 50% in Azioni di OICR. Rispetto agli investimenti sostanziali in OICR ed altri OIC legati al Fondo o in altri comparti della SICAV, la commissione totale di gestione (esclusa la commissione sulla performance, se presente) applicata al comparto e ad ognuno degli OICR o altri OIC in questione, non dovrà superare il 2% del Valore Netto delle attività gestite. Le percentuali delle commissioni di commissione di gestione applicabili al livello delle Azioni di OICR sono le seguenti:

Azioni di OICR	Commissione di gestione
AZ FUND 1-AZ ALLOCATION-INTERNATIONAL 50%-100%	1.50%
AZ FUND 1-AZ BOND-TARGET 2021 -AAZ-	1.20%
AZ FUND 1-AZ BOND-GLOBAL MACRO BOND -AI-	1.20%
NEW MILLENNIUM - AUGUSTUM EXTRA EURO HIGH QUALITY BOND -I-	0.80%
NEW MILLENNIUM - AUGUSTUM CORPORATE BOND -I-	0.75%
NEW MILLENNIUM - AUGUSTUM ITALIAN DIVERSIFIED BOND -I-	0.75%
NEW MILLENNIUM - AUGUSTUM HIGH QUALITY BOND -I-	0.70%

6. COMMISSIONI SULLA PERFORMANCE

Le commissioni sulla performance ove applicabili sono riportate nella sezione “Prospetto delle variazioni del patrimonio netto”.

Le commissioni sulla performance, come di seguito specificato , sono previste per i seguenti comparti:

a) Per i Comparti con commissioni sulla performance assoluta:

La commissione sarà calcolata in base alla differenza, se positiva, tra l'ultimo valore del patrimonio netto per azione prima della deduzione delle commissioni sulla performance (GAV) determinato al termine di un periodo di 12 mesi, con decorrenza dal 1° Gennaio di ogni anno, ed il più alto valore del patrimonio netto per azione tra quelli determinati alla fine di uno qualsiasi anno di calendario precedenti che abbia dato luogo al pagamento di commissioni sulla performance, a partire dal primo periodo, o il primo valore del patrimonio netto per azione del primo periodo soggetto al calcolo della commissione sulla performance. La commissione sarà quindi pari ad una percentuale, indicata di seguito, della differenza così determinata, moltiplicata per il numero medio di azioni in circolazione del Comparto.

Commissioni sulla performance assoluta	Percentuale
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	10%
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond	7.50%
NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond	10%
NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing	10%

b) Per i Comparti con commissioni sulla performance relative:

Per i Comparti:

NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond
 NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond

La commissione sarà pari ad una percentuale, come indicato di seguito, dell'extra return sull'indice di riferimento indicato qui sotto. Le commissioni sulla performance sono subordinate al verificarsi delle seguenti condizioni:

- Il GAV del comparto è superiore all'HWM (High Water Mark)
- Nel corso dell'anno di calendario il rendimento del comparto è positivo e maggiore di quello del benchmark.

Una volta verificata le due sopra citate condizioni, si può presentare un doppio scenario:

a) il valore dell'HWM è uguale o maggiore del valore netto per azione del fine anno di calendario precedente: l'accantonamento sarà calcolato sulla differenza tra la performance del comparto e la performance del benchmark a partire dalla data in cui l'HWM viene superato. Per il comparto verrà calcolata la differenza tra il GAV e l'HWM, per il benchmark verrà calcolata la differenza tra il valore giornaliero ed il prezzo di chiusura del giorno precedente a quello in cui l'HWM è stato superato (ad esempio: se l'HWM viene superato il 20 Aprile, il rendimento del benchmark da considerare il 20 Aprile è quello tra il 20 e il 19 Aprile).

b) il valore dell'HWM è inferiore al valore netto per azione del fine anno di calendario precedente: l'accantonamento sarà calcolato sulla differenza tra la performance del comparto e la performance del benchmark nell'anno in corso.

Per i Comparti:

NEW MILLENNIUM - Euro Equities
NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)
NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term
NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe
NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate
NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative
NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible
NEW MILLENNIUM - VolActive
NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity
NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia

Le commissioni di performance sono calcolate per ogni giorno di calcolo del valore patrimoniale netto e sono pagate annualmente con riferimento al 31 Dicembre, alla Società di Gestione, al Gestore degli investimenti o al Consulente degli Investimenti (se presente) all'inizio dell'anno successivo.

La Sicav applicherà in ogni momento il principio dell'High Water Mark, ciò significa che non saranno pagate commissioni di performance nel caso in cui il Gross Asset Value (il "GAV") ossia il valore del patrimonio al netto di tutte le spese, gli impegni e le commissioni di gestione (ma al lordo delle commissioni di performance), al termine del l'anno di calendario sia inferiore al più alto valore del patrimonio netto per azione determinato al termine di qualunque periodo (anno di calendario) precedente che abbia dato luogo al pagamento di commissioni di performance, a decorrere dal primo periodo, o al primo valore del patrimonio netto per azione del primo periodo nel quale la commissione di performance è stata calcolata ("High-Water Mark"). Come "Periodo di Riferimento della Performance" si considera l'intera vita del fondo.

Il rendimento delle Azioni sarà calcolato considerando il reinvestimento di eventuali dividendi. L'aliquota della commissione di performance sarà pari ad una percentuale, indicata di seguito, dell'extra rendimento rispetto al relativo benchmark/target.

La commissione di performance è applicata al minore tra il valore patrimoniale netto del comparto nel giorno di valutazione e il valore medio del patrimonio netto del comparto nel corso dell'anno di calendario. Le commissioni di performance verranno applicate al verificarsi delle seguenti condizioni:

- Il GAV del Comparto è superiore all' HWM
- Nel corso dell'anno di calendario il rendimento del Comparto è positivo e maggiore di quello del benchmark/target.

Una volta verificate le sopracitate condizioni si può presentare un doppio scenario:

a) Il valore dell'HWM è uguale o maggiore del Valore netto per Azione del fine anno precedente: l'accantonamento sarà calcolato sulla differenza tra la performance del Comparto e la performance del benchmark a partire dalla data in cui l'HWM viene superato. Per il comparto verrà calcolata la differenza tra il GAV e l'HWM , per il benchmark verrà calcolata la differenza tra il prezzo di chiusura del giorno

precedente a quello in cui l'HWM è stato superato (ad esempio: se l'HWM viene superato il 20 Aprile, il rendimento del benchmark da considerare è quello tra il 20 ed il 19 Aprile);

b) Il valore dell'HWM è inferiore al Valore netto per Azione del fine anno precedente: l'accantonamento sarà calcolato sulla differenza tra la performance del Comparto e la performance del benchmark/target nell'anno di calendario in corso.

Commissioni sulla performance relative	Benchmark	Percentuale
NEW MILLENNIUM - Euro Equities	95% MSCI EMU TOP 50 Total Return 5% Bloomberg Barclays 3 month Euribor Swap Index Total Return EUR	20%
NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)	95% MSCI world ex EMU Net Return EUR Hedged Index 5% Bloomberg Barclays 3 month Euribor Swap Index Total Return EUR	20%
NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term	90% Bloomberg Barclays Euro Aggregate Government 1-3 Years Total Return Index EUR 10% Bloomberg Barclays Pan-European Corporate FRN Index Total Return Hedged EUR	15%
NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate	95% Bloomberg Barclays Euro Corporate Bonds 1-5 Years Total Return Index Unhedged EUR 5% Bloomberg Barclays 3 month Euribor Swap Index Total Return EUR	20%
NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative	20% MSCI AC World Net Return Unhedged EUR Index 50% Bloomberg Barclays Euro Aggregate Government 3-5 Years Total Return Index EUR 30% Bloomberg Barclays Global Aggregate Corporate 1-3 Years Total Return Index Value Hedged EUR	20%
NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible	Euribor 6M + 300 bps	10%
NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe	80% Bloomberg Barclays Euro Government Inflation-Linked Bond 3-5 Years Total Return Index 20% Bloomberg Barclays FRN Total Return Index EUR	15%
NEW MILLENNIUM - VolActive	Euribor 3M + 350 bps	20%
NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond	60% ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Years Global Government Excluding Euro Governments Index in LOC 40% ICE BofA Merrill Lynch 3-5 Years Global Government Excluding Euro Governments Index in LOC	20%
NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond	40% Bloomberg Barclays Global High Yield Total Return Index Value Hedged EUR 30% Bloomberg Barclays Pan-European High Yield Total Return Index Value Unhedged EUR 20% Bloomberg Barclays Euro Aggregate Corporate Total Return Index Value Unhedged EUR 10% Bloomberg Barclays 3 month Euribor Swap Index Total Return EUR	20%
NEW MILLENNIUM – Multi Asset Opportunity	15% MSCI Europe Net Return EUR Index 10% MSCI AC World Net Return EUR Index 40% Bloomberg Barclays Euro Aggregate Government 3-5 Years Total Return Index EUR 25% Bloomberg Barclays Global Aggregate Corporate Total Return Index Value Hedged EUR 10% Bloomberg Barclays 3 month Euribor Swap Index Total Return EUR	20%

Commissioni sulla performance relative	Benchmark	Percentuale
NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia	40% MSCI Italy Net return 30% Bloomberg Barclays bond Italian Aggregate Issuers Total Return 30% Bloomberg Barclays bond Global Aggregate 1-3 Years Total Return Hedged EUR	20%

La tabella seguente mostra le commissioni sulla performance effettive applicabili per Classe di Azioni del Fondo.

Comparti	Classe	Valuta	Importo della commissione di performance	Percentuale del valore del Patrimonio Netto della Classe
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond	A	EUR	105.42	0.00%
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond	D	EUR	22.54	0.00%
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond	I	EUR	2,189.01	0.00%

7. COMMISSIONE DELLA BANCA DEPOSITARIA E DELL'AMMINISTRAZIONE CENTRALE

Per i servizi resi alla SICAV, come Banca Depositaria, State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch riceverà per ciascun Comparto una commissione annuale pari allo 0.04% del valore del patrimonio netto, con un minimo di 3,000.00 Euro a Comparto. Inoltre l'amministrazione centrale riceve una commissione fissa con un massimo pari allo 0.021% sulla base della media del patrimonio netto di ciascun Comparto, ed un minimo pari a 2,400.00 Euro per comparto. Tale commissione viene calcolata mensilmente sulla base della media del patrimonio netto di ciascun Comparto, matura in ciascun giorno di valutazione ed è pagata entro i primi 10 giorni di calendario del mese successivo.

8. COMPENSI PROFESSIONALI

I compensi professionali sono composti di spese legali e di spese per l'audit.

9. LE AZIONI DEL FONDO

Le Classi di Azioni in circolazione al 30 Giugno 2022 sono le seguenti:

Comparti	Azioni in circolazione
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	A,A (H-CHF),A (H-USD),D,I,L,Y,Z
NEW MILLENNIUM - Euro Equities	A,I,L,Y
NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)	A,I,L
NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term	A,D,I,L,Y
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond	A,A (H-CHF),A (H-USD),D,I,L
NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate	A,D,I,L,Y
NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative	A,D,I,L
NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible	A,I,L
NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe	A,I,L,Y
NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond	A,D,I,L
NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing	A,D,I,L,Y
NEW MILLENNIUM - VolActive	A,D,I,L
NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond	A,D,I,L
NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond	A,I

Comparti	Azioni in circolazione
NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity	A,I,L
NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia	A,I,L

10. VARIAZIONI NELLA COMPOSIZIONE DEI PORTAFOGLI DEI COMPARTI

La lista dei movimenti intervenuti nella composizione del portafoglio titoli di ogni Comparto della SICAV per l'esercizio che va dal 1° Gennaio al 30 Giugno 2022 è disponibile presso la sede sociale della Sicav.

11. COSTI DI TRANSAZIONE

Per il periodo che termina il 30 Giugno 2022, il Fondo ha sostenuto costi di transazione (rappresentati da commissioni di borsa e imposte di bollo) relativi all'acquisto o vendita di titoli di investimento e/o altre attività esigibili. I costi registrati dal Fondo per il periodo che termina il 30 Giugno 2022, sono inclusi nel costo degli investimenti e ammontano ai seguenti importi (in EUR):

Comparti	Costi di transazione
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	0.00
NEW MILLENNIUM - Euro Equities	131,390.04
NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)	16,877.27
NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term	1,699.78
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond	0.00
NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate	20,693.72
NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative	114,905.52
NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible	3,703.27
NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe	15,776.65
NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond	0.00
NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing	0.00
NEW MILLENNIUM - VolActive	2,000.53
NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond	0.00
NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond	0.00
NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity	18,066.24
NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia	23,992.56

I costi di transazione sui contratti derivati sono registrati direttamente nel Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto sotto la voce " Commissioni dell'Amministrazione Centrale"

12. CONTRATTI FINANZIARI A TERMINE, CONTRATTI FUTURES, CONTRATTI SWAP E CONTRATTI DI OPZIONI

Nell'esercizio finanziario in rassegna, alcuni comparti hanno stipulato contratti finanziari a termine, contratti futures e contratti swap. Informazioni dettagliate relative alle posizioni aperte al 30 Giugno 2022 sono riportate in seguito ai Portafogli dei comparti interessati.

Le controparti per le posizioni aperte su contratti finanziari a termine sono Morgan Stanley Bank e Nomura International Plc. La controparte per le posizioni aperte su futures è Intesa Sanpaolo S.p.A. Le controparti per le posizioni aperte su contratti swap sono J. P. Morgan Securities Plc e Citibank NA..

Al 30 Giugno 2022, ci sono posizioni aperte di titoli in garanzia e richieste di margini registrate nel Prospetto del patrimonio netto alla voce "Importi dovuti dai broker".

Al 30 Giugno 2022 il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 9,935,975.03 da Nomura International Plc. come garanzia per i contratti finanziari a termine.

Al 30 Giugno 2022 il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 596,181.00 da Morgan Stanley AG come garanzia per i contratti finanziari a termine.

Al 30 Giugno 2022 il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 3,171,293.23 da J.P. Morgan Securities Plc. come garanzia per i contratti swap.

Al 30 Giugno 2022 il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 596,921.45 da Nomura International Plc. come garanzia per i contratti finanziari a termine.

Al 30 Giugno 2022 il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 597,528.00 da Morgan Stanley Bank come garanzia per i contratti finanziari a termine.

Al 30 Giugno 2022 il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 3,017,502.59 da Nomura International Plc. come garanzia per i contratti finanziari a termine.

Al 30 Giugno 2022 il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 1,398,767.12 J.P. Morgan Securities Plc. come garanzia per i contratti swap.

Al 30 Giugno 2022 il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 1,198,491.34 da Nomura International Plc. come garanzia per i contratti finanziari a termine.

Al 30 Giugno 2022 il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 847.32 da J.P. Morgan Securities Plc. come garanzia per i contratti swap.

Al 30 Giugno 2022 il comparto NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 146,251.53 da Nomura International Plc. come garanzia per i contratti finanziari a termine.

13. INVESTIMENTI VALUTATI A FAIR VALUE

30 giugno 2022, i seguenti comparti investono in due titoli: Al Sierra One SPV e SPV Project, con un peso sul valore dell'attivo netto totale dell'intero veicolo di 0,50% e 0,19%.

Fondo	Descrizione	Peso NAV (%)
NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond	Sierra One SPV	1.45
	SPV Project	0.82
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	Sierra One SPV	1.31
	SPV Project	0.45

Al 30 giugno 2022 non era disponibile alcun prezzo di mercato per i 2 titoli e, conseguentemente, la Management Company ha deciso di valutare tali titoli a fair value, in conformità con le politiche di valutazione del fondo. A causa della intrinseca incertezza associata alla valutazione fair di tali investimenti e dell'assenza di un mercato liquido, il fair value stimato potrebbe in definitiva differire dai valori di realizzo e tale differenza potrebbe essere materiale

14. EVENTI ACCADUTI DURANTE IL PERIODO

Distribuzione Dividendi

Un dividendo per le Azioni D per il comparto NEW MILLENNIUM - VolActive, NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond, NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond, NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond e NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative, per le Azioni Y per il

comparto NEW MILLENNIUM - Euro Equities e NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe, per le Azioni D e Y per i compartimenti NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate, NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing e NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term, e per le Azioni D, Y e Z per il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond e' stato pagato come da tabella seguente, con la data dello stacco cedola al 3 Gennaio 2023 e data valuta 6 Gennaio 2022:

Comparti	Nome della classe	Dividendo per azione	Valuta	Somma da pagare
NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate	D	0.58	EUR	1,610.18
	Y	0.73	EUR	30,203.62
NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term	D	0.47	EUR	159.08
	Y	0.69	EUR	14.57
NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond	D	3.26	EUR	38,846.27
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	D	3.63	EUR	419,140.69
	Y	7.32	EUR	50,561.81
	Z	0.88	EUR	138,170.07
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond	D	2.27	EUR	352,138.24
NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing	D	2.33	EUR	7,384.93
	Y	2.69	EUR	80.99
NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond	D	3.36	EUR	5,894.82
NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative	D	0.29	EUR	1,948.09
NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe	Y	0.57	EUR	12,537.73
NEW MILLENNIUM - VolActive	D	3.57	EUR	41.26
NEW MILLENNIUM - Euro Equities	Y	6.13	EUR	87,364.89

Un dividendo per le Azioni Z per il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond e' stato pagato come da tabella seguente, con la data dello stacco cedola al 1 Aprile 2022 e data valuta 6 Aprile 2022:

Comparti	Nome della classe	Dividendo per azione	Valuta	Somma da pagare
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	Z	0.83	EUR	130,319.50

Crisi Russia-Ucraina:

Durante il mese di febbraio 2022, le tensioni tra Russia e Ucraina sono aumentate e hanno portato all'invasione dell'Ucraina da parte della Russia. Gran parte della comunità internazionale ha risposto imponendo sanzioni economiche a individui ed entità russe. I mercati finanziari hanno registrato e potrebbero continuare a subire una significativa volatilità. I titoli emessi da entità russe o denominati in rubli hanno subito un drastico calo di valore, nonché sanzioni. I Fondi gestiti hanno una esposizione molto bassa a questi titoli, l'impatto è stato quindi irrilevante. La Società ha posto in essere, attraverso l'attività di NATAM e dei suoi delegati, le misure idonee a garantire il presidio del rischio, sanzionatorio e antiriciclaggio.

15. EVENTI SUCCESSIVI

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond Classe A (H-CHF) è stata chiusa il 29 Luglio 2022.

APPENDICE NON CERTIFICATA

1. ESPOSIZIONE GLOBALE E LIVELLO DI LEVA ATTESO

Nell'ambito della gestione del rischio, l'esposizione globale per tutti i comparti è misurata e controllata attraverso il metodo VaR.

Il VaR è calcolato secondo il metodo Montecarlo, sulla base di un intervallo di confidenza del 99% ed un orizzonte temporale di un mese.

Periodo: 01.01-30.06.2022	Limite VaR	VaR			Riferimento
		% Utilizzo Limite VaR			
		Minimo	Medio	Massimo	
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	20.00%	11.09	18.16	37.00	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Euro Equities	20.00%	53.09	75.60	100.46	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)	20.00%	43.16	58.11	84.02	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term	20.00%	2.97	4.26	8.07	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond	20.00%	5.01	11.07	26.82	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate	20.00%	5.38	9.14	14.80	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative	20.00%	10.32	14.26	17.46	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible	20.00%	12.60	18.04	26.81	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe	20.00%	7.40	10.73	19.95	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond	20.00%	9.38	18.99	37.97	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing	20.00%	12.19	16.23	23.59	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - VolActive	20.00%	4.45	23.01	55.01	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond	20.00%	15.20	20.50	29.70	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond	20.00%	8.20	18.22	59.80	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity	20.00%	14.68	20.46	24.91	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia	20.00%	19.49	25.29	32.35	Absolute VaR

La leva è calcolata sulla base della metodologia del "Somma dei Nozionali" secondo quanto disposto dalle linee guida emanate dall' ESMA:

Fondo	Leva					
	Somma dei nozionali			Metodo degli impegni		
	Min	Medio	Max	Min	Medio	Max
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	90.34	124.47	264.23	3.15	7.63	103.17
NEW MILLENNIUM - Euro Equities	0.00	2.50	6.27	0.00	2.20	6.27
NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)	81.44	90.67	104.07	5.03	7.09	10.49
NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond	69.40	99.43	225.12	0.00	4.27	84.11
NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate	0.44	0.51	0.55	0.00	0.38	0.55
NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative	0.04	0.16	1.99	0.02	0.10	1.25
NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible	25.68	57.29	124.15	0.08	4.99	8.77
NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond	20.98	39.18	94.68	0.00	1.77	30.68

Fondo	Leva					
	Somma dei nozionali			Metodo degli impegni		
	Min	Medio	Max	Min	Medio	Max
NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing	1.57	1.71	1.95	1.25	1.45	1.75
NEW MILLENNIUM - VolActive	4.11	12.14	18.52	0.00	9.74	18.52
NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond	40.55	159.05	283.65	1.90	14.49	26.85
NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond	42.14	61.23	169.68	0.00	0.54	26.28
NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity	0.00	1.98	6.18	0.00	1.20	3.15
NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia	0.83	0.92	1.01	0.12	0.68	0.94

2. SUSTAINABLE FINANCE DISCLOSURE REGULATION (SFDR)

Ai sensi dell'articolo 2 del Regolamento (UE) 2019/2088 del Parlamento Europeo e del Consiglio del 27 novembre 2019 sull'informativa relativa alla sostenibilità nel settore dei servizi finanziari ("SFDR"), il rischio di sostenibilità è definito come un evento o condizione ambientale, sociale o di governance che, se si verifica, potrebbe causare un impatto negativo materiale effettivo o potenziale sul valore di un investimento. L'impatto dei fattori ambientali, sociali e di governance sul valore di un investimento può variare non solo in base alle sue attività aziendali (ad es. tipo di attività, settore, dimensione, posizione geografica e fase del ciclo di vita e passività) ma anche in base alla governance ed alla strategia dell'azienda per la loro gestione.

Ai sensi dell'articolo 3 del Regolamento SFDR, i rischi per la sostenibilità sono integrati nel processo decisionale di investimento del Fondo. Le valutazioni del rischio e le decisioni di investimento si basano su ricerche e valutazioni interne ed esterne sui fattori di sostenibilità e sui rischi per la sostenibilità.

Attualmente il Fondo non prende in considerazione i "principali impatti negativi" delle decisioni di investimento sui fattori di sostenibilità.

Comparti classificati "Art. 8 SFDR"

I seguenti Comparti sono conformi all'articolo 8 della SFDR: NEW MILLENNIUM - Euro Equities, NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged), NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term, NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate, NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative, NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe e NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia.

In conformità con le politiche e gli obiettivi di investimento descritti nella Documentazione di Offerta del Fondo, tutti i suddetti Comparti mirano a promuovere caratteristiche ambientali o sociali, o una combinazione di tali caratteristiche. Il gestore degli investimenti implementa l'integrazione ESG nel processo di investimento seguendo due tipi di criteri:

i) il rating medio ESG di portafoglio, è determinato, internamente e almeno su base mensile, su una scala crescente che va da 0 (meno virtuoso) a 100 (più virtuoso), elaborando su base ponderata (esclusa componente cash e derivati) i punteggi assegnati da provider di rating ESG esterni, sempre su scala da 0 a 100, per ogni asset detenuto in portafoglio. Ai fini dell'attribuzione del rating, gli strumenti finanziari sono suddivisi in quattro macro-categorie per ciascuna delle quali viene individuato un "rating ESG", implementato da primari fornitori, come rappresentato nella tabella seguente.

Tipo di attività	Fonte dati per ESG rating
Titoli di debito pubblico	EPI ("Environmental Performance Index"): pubblicato dall'Università di Yale. Il fornitore assegna annualmente un punteggio di sostenibilità ambientale a 180 paesi sulla base di 32 diversi indicatori. Ai restanti paesi, non coperti da rating, viene prudentemente assegnato un punteggio pari a zero.
Titoli di emittenti sovranazionali	Ad emittenti sovranazionali quali la Banca Europea per gli Investimenti, la Banca Mondiale, il Fondo Monetario Internazionale, la Banca Internazionale di Ricostruzione e Sviluppo ecc. vengono convenzionalmente assegnati punteggi pari a 100 (in considerazione dei loro ruoli e particolari competenze nel settore ESG)
Emissioni societarie (azioni/obbligazioni)	Rating di rischio ESG - emesso da fornitori indipendenti Classifica percentile complessiva assegnata a ciascuna società in base al punteggio totale ambientale, sociale e di governance (ESG) rispetto ai suoi concorrenti del settore. Per l'1% più alto il percentile è del 99%; per l'1% più basso il percentile è dell'1%. La performance ESG aggregata comprende il livello di preparazione, divulgazione e partecipazione alle controversie di un'azienda in tutti e tre i temi ESG. Laddove i suddetti provider non emettano rating per determinati asset detenuti in portafoglio (ad esempio medie e piccole imprese) a tali asset, pur restando idonei dal punto di vista ESG, verrà cautamente assegnato un punteggio pari a zero
OICR	Rating di rischio ESG - emesso da fornitori indipendenti Poiché i rating di sostenibilità più comuni assegnano un punteggio da 0 a 100 assegnando, al contrario, valori inferiori al miglior livello di sostenibilità dell'OICR analizzato, il punteggio finale, ai fini dell'omogeneità con le categorie precedenti, sarà adeguato come segue: 100 - valutazione di sostenibilità. Laddove i fornitori non forniscano un rating a determinati OICR (ad esempio OICR con un'esposizione significativa ad emissioni governative) a tali OICR, pur rimanendo idonei da un punto di vista ESG, verrà prudentemente assegnato un punteggio finale pari a zero a meno che ai portafogli sottostanti (look through) si applichi la metodologia di calcolo sopra descritta al fine di ottenere uno specifico "rating medio di portafoglio ESG" per i relativi fondi.
Strumenti con elevate caratteristiche ESG	· Obbligazioni Verdi ("Green Bond") · Obbligazioni sociali ("Social Bond") · Fondi Art 9 SFDR Il modello assegna un punteggio massimo di 100 agli strumenti di cui sopra indipendentemente dall'emittente

ii) restrizioni e limiti di investimento specifici significano limiti e restrizioni aggiuntivi e specifici di natura attiva e passiva imposti al gestore delegato, così come descritto nelle appendici dei comparti interessati nel paragrafo "Criteri di sostenibilità nelle decisioni di investimento":

NEW MILLENNIUM - Euro Equities:

- almeno l'80% degli investimenti diretti in strumenti finanziari societari in emittenti che hanno formalmente dichiarato l'adozione di politiche aziendali virtuose (ad esempio: codici di condotta e politiche rispettose dei diritti umani, tutela del lavoro minorile e dell'ambiente, adeguate strutture interne di gestione e distribuzione del rischio, chiare politiche di strategia fiscale);
- almeno il 25% del patrimonio netto investito in strumenti finanziari societari con un rating di rischio ESG nel miglior 10° percentile;
- non più del 15% degli strumenti finanziari societari con un rating di rischio ESG nel 25° percentile inferiore o senza rating ESG;
- sostanzialmente esclusi (non più del 5%) gli investimenti diretti e indiretti in emittenti il cui fatturato deriva principalmente dalla produzione o distribuzione di tabacco, energia nucleare, armi controverse (bombe a grappolo, armi biologiche o chimiche) nonché appartenenti all'industria del gioco d'azzardo.

NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged):

- almeno l'80% degli investimenti diretti in strumenti finanziari societari in emittenti che hanno formalmente dichiarato l'adozione di politiche aziendali virtuose (ad esempio: codici di condotta e politiche rispettose dei diritti umani, tutela del lavoro minorile e dell'ambiente, adeguate strutture interne di gestione e distribuzione del rischio, chiare politiche di strategia fiscale);
- almeno il 20% del patrimonio netto investito in strumenti finanziari societari con un rating di rischio ESG nel miglior 15° percentile;
- non più del 15% degli strumenti finanziari societari con un rating di rischio ESG nel 25° percentile inferiore o senza rating ESG;

- sostanzialmente esclusi (non più del 5%) gli investimenti diretti e indiretti in emittenti il cui fatturato deriva principalmente dalla produzione o distribuzione di tabacco, energia nucleare, armi controverse (bombe a grappolo, armi biologiche o chimiche) nonché appartenenti all'industria del gioco d'azzardo.

NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term:

- almeno l'80% dei Titoli di Stato (o quelli il cui principale azionista è un governo) deve essere emesso da Paesi che, allo stesso tempo:

i. sono firmatari dei trattati di Parigi (COP 21) sulla protezione del clima;

ii. hanno una produzione di Co2 inferiore a 0,3 Kg / PIL (miglior terzile al mondo; fonte dati IEA 2020 - International Energy Agency);

iii. sostengono una spesa per l'istruzione superiore al 4% del PIL (fonte Banca Mondiale);

iv. hanno un indice di controllo della corruzione superiore a 0,2 (fonte Banca Mondiale: scala di rating da -2,5 a +2,5).

- almeno l'80% delle obbligazioni societarie sono emesse da società che hanno formalmente dichiarato l'adozione di politiche aziendali virtuose (ad esempio: codici di condotta e politiche rispettose dei diritti umani, tutela del lavoro minorile e dell'ambiente, adeguate strutture interne di gestione e distribuzione del rischio, chiare politiche di strategia fiscale);

- almeno il 15% del portafoglio è investito in "Green Bond" o in "Social Bond" o in Corporate Bond di emittenti con rating di rischio ESG nel miglior 20° percentile;

- sostanzialmente esclusi (non più del 5%) gli investimenti diretti e indiretti in emittenti il cui fatturato deriva principalmente dalla produzione o distribuzione di tabacco, energia nucleare, armi controverse (bombe a grappolo, armi biologiche o chimiche) nonché appartenenti all'industria del gioco d'azzardo.

NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate:

- almeno l'80% delle obbligazioni societarie sono emesse da società che hanno formalmente dichiarato l'adozione di politiche aziendali virtuose (ad esempio: codici di condotta e politiche rispettose dei diritti umani, tutela del lavoro minorile e dell'ambiente, adeguate strutture interne di gestione e distribuzione del rischio, chiare politiche di strategia fiscale);

- almeno il 30% del portafoglio è investito in "Green Bond" o in "Social Bond" o in Corporate Bond di emittenti con rating di rischio ESG nel miglior 20° percentile;

- non più del 10% delle obbligazioni societarie con un rating di rischio ESG nel 25° percentile inferiore o non classificato ESG;

- sostanzialmente esclusi (non più del 5%) gli investimenti diretti e indiretti in emittenti il cui fatturato deriva principalmente dalla produzione o distribuzione di tabacco, energia nucleare, armi controverse (bombe a grappolo, armi biologiche o chimiche) nonché appartenenti all'industria del gioco d'azzardo.

NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative:

- almeno l'80% dei Titoli di Stato (o quelli il cui principale azionista è un governo) deve essere emesso da Paesi che, allo stesso tempo:

i. sono firmatari dei trattati di Parigi (COP 21) sulla protezione del clima;

ii. hanno una produzione di Co2 inferiore a 0,3 Kg / PIL (miglior terzile al mondo; fonte dati IEA 2020 - International Energy Agency);

iii. sostengono una spesa per l'istruzione superiore al 4% del PIL (fonte Banca Mondiale);

iv. hanno un indice di controllo della corruzione superiore a 0,2 (fonte Banca Mondiale: scala di rating da -2,5 a +2,5).

- almeno l'80% degli investimenti diretti in azioni o in obbligazioni societarie deve essere emesso da società che hanno formalmente dichiarato l'adozione di politiche aziendali virtuose (ad esempio: codici di condotta e politiche rispettose dei diritti umani, tutela del lavoro minorile e dell'ambiente, adeguate strutture interne di gestione e distribuzione del rischio, chiare politiche di strategia fiscale);

- almeno il 15% del portafoglio è investito in titoli emessi da società con rating di rischio ESG nel miglior 80° percentile, o in "Green Bond" o "Social Bond" o in OICR che promuovono caratteristiche ESG o in OICR sostenibili;

- almeno il 50% dei fondi in portafoglio ha un rating di rischio ESG, emesso da fornitori indipendenti, nel miglior 50° percentile o un "rating ESG medio di portafoglio" dell'attività detenuta dallo specifico OICR (calcolato come descritto nel Paragrafo Informativa su "Pratiche di integrazione ESG") maggiore di 65;

- sostanzialmente esclusi (non più del 5%) gli investimenti diretti e indiretti in emittenti il cui fatturato deriva principalmente dalla produzione o distribuzione di tabacco, energia nucleare, armi controverse (bombe a grappolo, armi biologiche o chimiche) nonché appartenenti all'industria del gioco d'azzardo.

NEW MILLENNIUM – Inflation Linked Bond Europe

-almeno l'80% dei Titoli di Stato (o quelli il cui principale azionista è un governo) deve essere emesso da Paesi che, allo stesso tempo:

i. sono firmatari dei trattati di Parigi (COP 21) sulla protezione del clima;

ii. hanno una produzione di Co2 inferiore a 0,3 Kg / PIL (miglior terzile al mondo; fonte dati IEA 2020 - International Energy Agency);

iii. sostengono una spesa per l'istruzione superiore al 4% del PIL (fonte Banca Mondiale);

iv. hanno un indice di controllo della corruzione superiore a 0,2 (fonte Banca Mondiale: scala di rating da -2,5 a +2,5).

- almeno l'80% delle obbligazioni societarie sono emesse da società che hanno formalmente dichiarato l'adozione di politiche aziendali virtuose (ad esempio: codici di condotta e politiche rispettose dei diritti umani, tutela del lavoro minorile e dell'ambiente, adeguate strutture interne di gestione e distribuzione del rischio, chiare politiche di strategia fiscale);

- almeno il 10% del portafoglio è investito in "Green Bond" o in "Social Bond" o in Corporate Bond di emittenti con rating di rischio ESG nel miglior 20° percentile;

- sostanzialmente esclusi (non più del 5%) gli investimenti diretti e indiretti in emittenti il cui fatturato deriva principalmente dalla produzione o distribuzione di tabacco, energia nucleare, armi controverse (bombe a grappolo, armi biologiche o chimiche) nonché appartenenti all'industria del gioco d'azzardo.

NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia

- ipotizzando che tra le "microimprese" i casi di delocalizzazione della produzione siano molto rari e che, invece, ci siano benefici molto significativi sulla comunità di riferimento (anche in termini di crescita economica e di occupazione sul territorio), e quindi che l'allocazione di risorse su queste microimprese promuova lo sviluppo di un sistema economico più circolare, resiliente e sostenibile a lungo termine:

i. almeno il 15% del patrimonio netto è investito in strumenti finanziari di emittenti con una capitalizzazione non superiore a 2,5 miliardi di euro;

ii. il gestore presterà particolare attenzione a quelle "micro cap" che, sebbene prive di rating ESG (per le loro ridotte dimensioni), sono di fatto impegnate in settori di particolare coerenza con i temi della sostenibilità ambientale e sociale (es. energie rinnovabili, mobilità sostenibile, economie, smaltimento dei rifiuti)

- almeno il 50% del portafoglio è investito:

i. in "green bond" o "social bond" o

ii. in strumenti finanziari di emittenti con rating di rischio ESG emesso da fornitori indipendenti; tra questi almeno il 20% deve essere nel miglior 20° percentile.

- sostanzialmente esclusi (non più del 5%) gli investimenti diretti e indiretti in emittenti il cui fatturato deriva principalmente dalla produzione o distribuzione di tabacco, energia nucleare, armi controverse (bombe a grappolo, armi biologiche o chimiche) nonché appartenenti all'industria del gioco d'azzardo

Il comparto non può investire in strumenti finanziari emessi da società che non siano residenti in Paesi che consentono un adeguato scambio di informazioni con l'Italia.

The application of the above mentioned criteria, leads to an average ESG rating higher than the limit set in the Prospectus, meaning a lower level or risk for all the Sub-funds, as reported in the table below, which represents the quality of the portfolio composition as of 31.12.2021: the minimum average ESG rating of the portfolio (as stated in the appendix of each Sub-fund) is compared with the actual average ESG rating, on a scale from 0 (lowest rate, highest risk level) to 100 (highest rate, lowest risk level).

L'applicazione dei criteri sopra citati, porta ad un rating ESG medio superiore al limite fissato nel Prospetto, ovvero un livello di rischio inferiore per tutti i Comparti, come riportato nella tabella seguente, che rappresenta la qualità della composizione del portafoglio al 31.12.2021: il rating ESG medio minimo del portafoglio (come indicato nell'appendice di ciascun Comparto) viene confrontato con il rating ESG medio effettivo, su una scala da 0 (tasso più basso, livello di rischio più alto) a 100 (tasso più alto, livello di rischio più basso).

Comparto	ESG rating medio minimo	ESG rating medio
Balanced World Conservative	55.0	74.6
Euro Bonds Short Term	65.0	88.0
Euro Equities	65.0	82.4
Global Equities (Eur Hedged)	55.0	75.6
Inflation Linked Bond Europe	65.0	88.2
Large Europe Corporate	65.0	73.6
PIR Bilanciato Sistema Italia	55.0	65.5

Durante il periodo di riferimento, non sono stati registrati sforamenti dei criteri e limiti sopra riportati.

Le Strategie promuovono caratteristiche ambientali o sociali, ma non hanno come obiettivo specifico un investimento sostenibile e non prevedono una quota minima di investimenti allineati alla tassonomia e/o sostenibili.

Comparti non classificati "Art. 8 or 9 SFDR"

I restanti Comparti non rientrano nell'articolo 8 SFDR (promozione di obiettivi di sostenibilità) o nell'articolo 9 SFDR (investimenti sostenibili): non tengono conto dei criteri di sostenibilità nell'ambito del processo di investimento, non promuovono caratteristiche ESG e non hanno come investimento obiettivo sostenibile. Gli investimenti alla base di questo prodotto finanziario non tengono conto dei criteri dell'UE per le attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale.

3. REGOLAMENTO DELLE TRANSAZIONI DI TITOLI FINANZIARI

Il Securities Financing Transaction Regulation (SFTR) 2015/2365 sulla trasparenza delle operazioni di finanziamento tramite titoli e del riutilizzo, è entrato in vigore il 12 Gennaio 2016 e introduce nuovi obblighi di informativa per le operazioni di finanziamento di titoli e per gli swap total return.

Un'operazione di finanziamento tramite titoli finanziari è definita dall' articolo 3 (11) del SFTR come:

- contratti con patto di riacquisto / riacquisto inverso
- la concessione e assunzione di titoli o merci in prestito
- un'operazione di buy-sell-back o di sell-buy back
- un finanziamento con margini

Contratti Total Return Swaps

Non è stata ricevuta alcuna garanzia per i contratti Total Return Swap.

Tutti i rendimenti dei contratti Total Return Swap sono attribuiti ai Comparti. I costi di transazione non lo sono identificabili separatamente.

Le transazioni in contratti Total Return Swap sono operazioni bilaterali.

Di seguito viene sintetizzato il valore aggregato dei contratti Total Return Swap, analizzato per controparte come al 30 Giugno 2022:

Comparti	Valuta	Controparte	Paese di costituzione della controparte	Total Return Swaps	% Attivo Netto
(Valori assoluti)					
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	EUR	J.P. Morgan SE	Germany	1,077,902.72	0,36

La tabella seguente mostra un'analisi della durata di scadenza delle operazioni di contratti Total Return Swap in essere al 30 Giugno 2022:

Comparti	Valuta	1 giorno	2 a 7 giorni	8 a 30 giorni	31 a 90 giorni	91 a 365 giorni	più di 365 giorni	Totale
(Valori assoluti)								
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	EUR				1,077,902.72			1,077,902.72