



Alla gentile attenzione di:  
Distributori autorizzati  
Clienti Istituzionali  
Soggetti Incaricati dei Pagamenti  
della SICAV New Millennium

28 Maggio 2020

**OGGETTO:** . Comunicazione Percentuale Media Titoli Pubblici Italiani ed Esteri valida per il secondo semestre 2020

Egregi Signori,

Con la Presente vi certifichiamo la percentuale media di titoli governativi detenuti direttamente o indirettamente dall'OICVM rispetto al totale del proprio attivo patrimoniale. Al fine di determinare tale media, così come prescritto dal Decreto Ministeriale del 13 dicembre 2011 (*decreto determinazione quota titoli pubblici*), si è fatto riferimento agli ultimi due prospetti redatti dalla SICAV (relazione semestrale al 30.06.2019 e relazione annuale al 31.12.2019).

---

**NATAM Management Company S.A.**

32-36 Bd. des Avranches - L-1160 Luxembourg

T. +352 264979 2112 | F. +352 264979 8888

[www.natam.lu](http://www.natam.lu) | [info@natam.lu](mailto:info@natam.lu)

RCS Luxembourg B 208754

Cap. Soc. 750.000 EUR

TVA LU 28858850

**Percentuale Media di Titoli Pubblici Italiani ed Esteri: elementi per il calcolo e percentuale valida per il secondo semestre 2020**

ISIN	Issuing Company	Currency	% WHITE LIST as of 30.06.2019	% WHITE LIST as of 31.12.2019	% WHITE LIST from 01.07.2020 to 31.12.2020
LU0097542376	NEW MILLENNIUM EURO BONDS SHORT TERM CLASSE A	EUR	48,15	62,41	<b>55,28</b>
LU0373792984	NEW MILLENNIUM EURO BONDS SHORT TERM CLASSE I	EUR	48,15	62,41	<b>55,28</b>
LU0452433385	NEW MILLENNIUM EURO BONDS SHORT TERM CLASSE D	EUR	48,15	62,41	<b>55,28</b>
LU1148873661	NEW MILLENNIUM EURO BONDS SHORT TERM CLASSE L	EUR	48,15	62,41	<b>55,28</b>
LU1362558352	NEW MILLENNIUM EURO BONDS SHORT TERM CLASSE Y	EUR	48,15	62,41	<b>55,28</b>
LU0163796203	NEW MILLENNIUM AUGUSTUM CORPORATE BOND CLASSE A	EUR	5,45	7,03	<b>6,24</b>
LU0373793016	NEW MILLENNIUM AUGUSTUM CORPORATE BOND CLASSE I	EUR	5,45	7,03	<b>6,24</b>
LU0777018002	NEW MILLENNIUM AUGUSTUM CORPORATE BOND CLASSE D	EUR	5,45	7,03	<b>6,24</b>
LU1148874396	NEW MILLENNIUM AUGUSTUM CORPORATE BOND CLASSE L	EUR	5,45	7,03	<b>6,24</b>
LU1362558865	NEW MILLENNIUM AUGUSTUM CORPORATE BOND CLASSE Y	EUR	5,45	7,03	<b>6,24</b>
LU1675756339	NEW MILLENNIUM AUGUSTUM CORPORATE BOND CLASSE A-CHF-HEDGED	CHF	5,45	7,03	<b>6,24</b>
LU1796860580	NEW MILLENNIUM AUGUSTUM CORPORATE BOND CLASSE A-USD-HEDGED	USD	5,45	7,03	<b>6,24</b>
LU2003425266	NEW MILLENNIUM AUGUSTUM CORPORATE BOND CLASSE Z	EUR	5,45	7,03	<b>6,24</b>
LU0163795908	NEW MILLENNIUM AUGUSTUM HIGH QUALITY BOND CLASSE A	EUR	57,88	51,73	<b>54,81</b>
LU0373791820	NEW MILLENNIUM AUGUSTUM HIGH QUALITY BOND CLASSE I	EUR	57,88	51,73	<b>54,81</b>
LU0777019158	NEW MILLENNIUM AUGUSTUM HIGH QUALITY BOND CLASSE D	EUR	57,88	51,73	<b>54,81</b>
LU1148873745	NEW MILLENNIUM AUGUSTUM HIGH QUALITY BOND CLASSE L	EUR	57,88	51,73	<b>54,81</b>
LU1362558436	NEW MILLENNIUM AUGUSTUM HIGH QUALITY BOND CLASSE Y	EUR	57,88	51,73	<b>54,81</b>
LU1675756172	NEW MILLENNIUM AUGUSTUM HIGH QUALITY BOND CLASSE A-CHF-HEDGED	CHF	57,88	51,73	<b>54,81</b>
LU1796860663	NEW MILLENNIUM AUGUSTUM HIGH QUALITY BOND CLASSE A-USD-HEDGED	USD	57,88	51,73	<b>54,81</b>
LU0437189599	NEW MILLENNIUM INFLATION LINKED BOND EUROPE CLASSE A	EUR	78,72	78,55	<b>78,63</b>
LU0437191736	NEW MILLENNIUM INFLATION LINKED BOND EUROPE CLASSE I	EUR	78,72	78,55	<b>78,63</b>
LU0863466057	NEW MILLENNIUM INFLATION LINKED BOND EUROPE CLASSE D	EUR	78,72	78,55	<b>78,63</b>
LU1148874040	NEW MILLENNIUM INFLATION LINKED BOND EUROPE CLASSE L	EUR	78,72	78,55	<b>78,63</b>
LU1362558600	NEW MILLENNIUM INFLATION LINKED BOND EUROPE CLASSE Y	EUR	78,72	78,55	<b>78,63</b>
LU0149079047	NEW MILLENNIUM BALANCED WORLD CONSERVATIVE CLASSE A	EUR	24,74	27,05	<b>25,90</b>
LU2149247145	NEW MILLENNIUM BALANCED WORLD CONSERVATIVE CLASSE D	EUR	24,74	27,05	<b>25,90</b>
LU0373792802	NEW MILLENNIUM BALANCED WORLD CONSERVATIVE CLASSE I	EUR	24,74	27,05	<b>25,90</b>
LU2149247228	NEW MILLENNIUM BALANCED WORLD CONSERVATIVE CLASSE Y	EUR	24,74	27,05	<b>25,90</b>
LU1148874552	NEW MILLENNIUM BALANCED WORLD CONSERVATIVE CLASSE L	EUR	24,74	27,05	<b>25,90</b>
LU0215785410	NEW MILLENNIUM TOTAL RETURN FLEXIBLE CLASSE A	EUR	1,36	0,00	<b>0,68</b>
LU1109961877	NEW MILLENNIUM TOTAL RETURN FLEXIBLE CLASSE I	EUR	1,36	0,00	<b>0,68</b>
LU0851647247	NEW MILLENNIUM AUGUSTUM ITALIAN DIVERSIFIED BOND CLASSE A	EUR	3,04	3,45	<b>3,24</b>
LU0851648724	NEW MILLENNIUM AUGUSTUM ITALIAN DIVERSIFIED BOND CLASSE I	EUR	3,04	3,45	<b>3,24</b>
LU0851648567	NEW MILLENNIUM AUGUSTUM ITALIAN DIVERSIFIED BOND CLASSE D	EUR	3,04	3,45	<b>3,24</b>
LU1148874479	NEW MILLENNIUM AUGUSTUM ITALIAN DIVERSIFIED BOND CLASSE L	EUR	3,04	3,45	<b>3,24</b>
LU1362559087	NEW MILLENNIUM AUGUSTUM ITALIAN DIVERSIFIED BOND CLASSE Y	EUR	3,04	3,45	<b>3,24</b>
LU0956012602	NEW MILLENNIUM AUGUSTUM MARKET TIMING CLASSE A	EUR	25,20	15,36	<b>20,28</b>
LU0956012867	NEW MILLENNIUM AUGUSTUM MARKET TIMING CLASSE I	EUR	25,20	15,36	<b>20,28</b>

ISIN	Issuing Company	Currency	% WHITE LIST as of 30.06.2019	% WHITE LIST as of 31.12.2019	% WHITE LIST from 01.07.2020 to 31.12.2020
LU0956012784	NEW MILLENNIUM AUGUSTUM MARKET TIMING CLASSE D	EUR	25,20	15,36	<b>20,28</b>
LU1148874636	NEW MILLENNIUM AUGUSTUM MARKET TIMING CLASSE L	EUR	25,20	15,36	<b>20,28</b>
LU1362559160	NEW MILLENNIUM AUGUSTUM MARKET TIMING CLASSE Y	EUR	25,20	15,36	<b>20,28</b>
LU0993156016	NEW MILLENNIUM VOLACTIVE CLASSE A	EUR	57,44	58,63	<b>58,04</b>
LU0993156289	NEW MILLENNIUM VOLACTIVE CLASSE D	EUR	57,44	58,63	<b>58,04</b>
LU0993156446	NEW MILLENNIUM VOLACTIVE CLASSE I	EUR	57,44	58,63	<b>58,04</b>
LU1148874800	NEW MILLENNIUM VOLACTIVE CLASSE L	EUR	57,44	58,63	<b>58,04</b>
LU0097542707	NEW MILLENNIUM EURO EQUITIES CLASSE A	EUR	0,00	0,00	<b>0,00</b>
LU2149246923	NEW MILLENNIUM EURO EQUITIES CLASSE D	EUR	0,00	0,00	<b>0,00</b>
LU0373792398	NEW MILLENNIUM EURO EQUITIES CLASSE I	EUR	0,00	0,00	<b>0,00</b>
LU2149247061	NEW MILLENNIUM EURO EQUITIES CLASSE Y	EUR	0,00	0,00	<b>0,00</b>
LU1148873406	NEW MILLENNIUM EURO EQUITIES CLASSE L	EUR	0,00	0,00	<b>0,00</b>
LU0097544745	NEW MILLENNIUM GLOBAL EQUITIES EUR HEDGED CLASSE A	EUR	0,00	0,00	<b>0,00</b>
LU0373792042	NEW MILLENNIUM GLOBAL EQUITIES EUR HEDGED CLASSE I	EUR	0,00	0,00	<b>0,00</b>
LU1148873588	NEW MILLENNIUM GLOBAL EQUITIES EUR HEDGED CLASSE L	EUR	0,00	0,00	<b>0,00</b>
LU0215785253	NEW MILLENNIUM LARGE EUROPE CORPORATE CLASSE A	EUR	1,42	2,89	<b>2,15</b>
LU0373792471	NEW MILLENNIUM LARGE EUROPE CORPORATE CLASSE I	EUR	1,42	2,89	<b>2,15</b>
LU0452433468	NEW MILLENNIUM LARGE EUROPE CORPORATE CLASSE D	EUR	1,42	2,89	<b>2,15</b>
LU1148874123	NEW MILLENNIUM LARGE EUROPE CORPORATE CLASSE L	EUR	1,42	2,89	<b>2,15</b>
LU1362558782	NEW MILLENNIUM LARGE EUROPE CORPORATE CLASSE Y	EUR	1,42	2,89	<b>2,15</b>
LU0956012941	NEW MILLENNIUM AUGUSTUM EXTRA EURO HIGH QUALITY BOND CLASSE A	EUR	44,65	39,00	<b>41,82</b>
LU0956013089	NEW MILLENNIUM AUGUSTUM EXTRA EURO HIGH QUALITY BOND CLASSE D	EUR	44,65	39,00	<b>41,82</b>
LU0956013162	NEW MILLENNIUM AUGUSTUM EXTRA EURO HIGH QUALITY BOND CLASSE I	EUR	44,65	39,00	<b>41,82</b>
LU1148873828	NEW MILLENNIUM AUGUSTUM EXTRA EURO HIGH QUALITY BOND CLASSE L	EUR	44,65	39,00	<b>41,82</b>
LU1362558519	NEW MILLENNIUM AUGUSTUM EXTRA EURO HIGH QUALITY BOND CLASSE Y	EUR	44,65	39,00	<b>41,82</b>
LU1363165835	NEW MILLENNIUM EVERGREEN GLOBAL HIGH YIELD BOND CLASSE A	EUR	4,66	5,98	<b>5,32</b>
LU1550198169	NEW MILLENNIUM EVERGREEN GLOBAL HIGH YIELD BOND CLASSE I	EUR	4,66	5,98	<b>5,32</b>
LU1363165918	NEW MILLENNIUM EVERGREEN GLOBAL HIGH YIELD BOND CLASSE L	EUR	4,66	5,98	<b>5,32</b>
LU1363165595	NEW MILLENNIUM MULTI ASSET OPPORTUNITY CLASSE A	EUR	16,85	29,06	<b>22,95</b>
LU1363165678	NEW MILLENNIUM MULTI ASSET OPPORTUNITY CLASSE I	EUR	16,85	29,06	<b>22,95</b>
LU1363165751	NEW MILLENNIUM MULTI ASSET OPPORTUNITY CLASSE L	EUR	16,85	29,06	<b>22,95</b>
LU1602468479	NEW MILLENNIUM PIR BILANCIATO SISTEMA ITALIA CLASSE A	EUR	10,29	10,38	<b>10,33</b>
LU2149247491	NEW MILLENNIUM PIR BILANCIATO SISTEMA ITALIA CLASSE D	EUR	10,29	10,38	<b>10,33</b>
LU1602468636	NEW MILLENNIUM PIR BILANCIATO SISTEMA ITALIA CLASSE I	EUR	10,29	10,38	<b>10,33</b>
LU2149247574	NEW MILLENNIUM PIR BILANCIATO SISTEMA ITALIA CLASSE Y	EUR	10,29	10,38	<b>10,33</b>
LU1602468800	NEW MILLENNIUM PIR BILANCIATO SISTEMA ITALIA CLASSE L	EUR	10,29	10,38	<b>10,33</b>

Alberto Alfiero

(Presidente del CdA di Natam Management Company S.A.)