

NEW MILLENNIUM

SOCIÉTÉ D'INVESTISSEMENT À CAPITAL VARIABLE

RENDICONTO DI GESTIONE SEMESTRALE NON CERTIFICATO AL 30 GIUGNO 2021

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

Informazioni per investitori in Svizzera	3	NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible	59
Organizzazione del Fondo	4	Prospetto del Patrimonio Netto	59
Prospetto Comparativo dei Patrimoni Netti degli ultimi 3 anni/periodi	6	Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	60
		Portafoglio Titoli	61
		Impegni su acquisto/vendita di contratti futures	65
		Contratti finanziari a termine	66
Prospetto del Patrimonio Netto consolidato	8	NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe	67
		Prospetto del Patrimonio Netto	67
Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto consolidato	9	Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	68
		Portafoglio Titoli	69
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	10	NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond	71
Prospetto del Patrimonio Netto	10	Prospetto del Patrimonio Netto	71
Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	11	Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	72
Portafoglio Titoli	12	Portafoglio Titoli	73
Impegni su acquisto/vendita di contratti futures	18	Contratti finanziari a termine	76
Contratti finanziari a termine	19		
Contratti Swap	20	NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing	77
		Prospetto del Patrimonio Netto	77
NEW MILLENNIUM - Euro Equities	21	Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	78
Prospetto del Patrimonio Netto	21	Portafoglio Titoli	79
Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	22		
Portafoglio Titoli	23	NEW MILLENNIUM - VolActive	80
		Prospetto del Patrimonio Netto	80
NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)	26	Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	81
Prospetto del Patrimonio Netto	26	Portafoglio Titoli	82
Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	27	Impegni su acquisto/vendita di contratti futures	84
Portafoglio Titoli	28		
Impegni su acquisto/vendita di contratti futures	32	NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond	85
		Prospetto del Patrimonio Netto	85
NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term	33	Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	86
Prospetto del Patrimonio Netto	33	Portafoglio Titoli	87
Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	34	Contratti finanziari a termine	91
Portafoglio Titoli	35		
		NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond	92
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond	38	Prospetto del Patrimonio Netto	92
Prospetto del Patrimonio Netto	38	Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	93
Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	39	Portafoglio Titoli	94
Portafoglio Titoli	40	Contratti finanziari a termine	97
Impegni su acquisto/vendita di contratti futures	43		
Contratti finanziari a termine	44	NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity	98
Contratti Swap	45	Prospetto del Patrimonio Netto	98
		Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	99
NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate	46	Portafoglio Titoli	100
Prospetto del Patrimonio Netto	46	Impegni su acquisto/vendita di contratti futures	104
Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	47		
Portafoglio Titoli	48	NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia	105
		Prospetto del Patrimonio Netto	105
NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative	52	Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	106
Prospetto del Patrimonio Netto	52	Portafoglio Titoli	107
Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	53		
Portafoglio Titoli	54	Note ai Rendiconti Finanziari	110
		Appendice non certificata	121

Informazioni per investitori in Svizzera

Il prospetto e le informazioni essenziali per gli investitori, gli statuti, il regolamento del fondo, il rapporto annuale e semestrale nonché i cambiamenti del portafoglio sono disponibili gratuitamente presso il rappresentante in Svizzera.

Rappresentante e Agente di pagamento in Svizzera è State Street Bank International GmbH, Munich, Zurich Branch, Beethovenstrasse 19, Postfach, 8027 Zurich.

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

Socio
AZ Swiss & Partners S.A.
6, Via Marina
I - 20121 Milan

SOCIETA' DI GESTIONE**Consiglio di Amministrazione della Società di Gestione****Natam Management Company S.A.**

11 rue Béatrix de Bourbon
L-1225 Luxembourg

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. Lorenzo PERELLI**

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

SOGGETTO INCARICATO DEI PAGAMENTI IN ITALIA

ICCREA Banca S.p.A.

41-47, Via Lucrezia Romana
I - 00178 Roma

State Street Bank GmbH - Succursale Italia

10, Via Ferrante Aporti
I - 20125 Milano

Société Générale Securities Services S.p.A.

19, Via Santa Chiara
I - 10122 Torino

Allfunds Bank S.A. (succursale di Milano)

6, Via Bocchetto
I - 20123 Milano

Banca Monte dei Paschi di Siena S.p.A.

3, Piazza Salimbeni
I - 53100 Siena

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 2021		31 Dicembre 2020		31 Dicembre 2019	
		Totale NAV	per Azione	Totale NAV	per Azione	Totale NAV	per Azione
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond							
Azione A	EUR	46,829,337.98	231.10	47,871,925.90	225.99	37,445,911.12	226.50
Azione A (H-CHF)	CHF	3,223,822.53	103.63	2,837,841.55	101.57	4,084,385.74	102.68
Azione A (H-USD)	USD	6,445,365.87	112.87	5,914,673.84	110.21	12,203,356.52	108.59
Azione D	EUR	11,583,017.74	103.86	11,012,744.37	105.24	12,232,118.45	109.30
Azione I	EUR	284,885,544.54	249.24	284,616,800.47	242.93	250,996,355.44	241.69
Azione L	EUR	93,310.59	246.20	75,652.49	240.17	253,676.17	239.32
Azione Y	EUR	1,442,677.97	208.86	3,039,190.33	210.95	6,853,987.55	217.48
Azione Z	EUR	15,960,678.20	101.65	15,814,967.66	100.72	16,256,055.35	103.53
Totale attivo netto	EUR	370,463,755.42		369,889,157.15		338,667,276.15	
NEW MILLENNIUM - Euro Equities							
Azione A	EUR	6,246,214.52	68.11	5,780,433.13	61.15	8,501,497.26	61.37
Azione I	EUR	23,906,847.49	74.81	21,361,766.75	66.88	28,765,550.51	66.87
Azione L	EUR	206,046.33	74.09	184,387.72	66.30	173,779.29	66.30
Azione Y	EUR	1,749,209.51	72.42	1,623,173.72	67.20	—	—
Totale attivo netto	EUR	32,108,317.85		28,949,761.32		37,440,827.06	
NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)							
Azione A	EUR	3,644,784.65	119.72	3,291,487.19	108.29	4,610,381.98	95.00
Azione I	EUR	32,886,672.36	132.02	25,786,950.80	118.92	28,804,316.62	103.57
Azione L	EUR	245,082.99	130.64	216,260.46	117.79	188,629.81	102.74
Totale attivo netto	EUR	36,776,540.00		29,294,698.45		33,603,328.41	
NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term							
Azione A	EUR	2,512,610.20	133.22	2,610,764.27	133.96	3,043,958.59	134.80
Azione D	EUR	36,418.03	94.03	63,835.68	95.03	120,124.30	95.82
Azione I	EUR	9,230,167.21	138.26	9,170,562.84	138.82	10,198,949.21	139.30
Azione L	EUR	2,415,630.69	136.58	2,468,934.81	137.27	2,643,561.09	138.00
Azione Y	EUR	2,905.30	137.55	2,928.92	138.67	2,939.89	139.19
Totale attivo netto	EUR	14,197,731.43		14,317,026.52		16,009,533.08	
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond							
Azione A	EUR	27,812,632.57	155.24	26,815,575.28	152.41	25,464,681.01	153.08
Azione A (H-CHF)	CHF	452,268.71	97.17	1,051,979.64	96.89	3,061,167.25	98.70
Azione A (H-USD)	USD	412,226.23	107.80	593,558.83	107.24	4,024,741.88	106.22
Azione D	EUR	11,040,681.22	90.78	7,396,142.72	91.41	3,791,352.45	94.16
Azione I	EUR	88,831,175.27	162.80	93,787,900.01	159.49	106,947,949.14	159.32
Azione L	EUR	36,094.09	161.13	35,387.48	157.98	35,414.21	158.10
Azione Y	EUR	—	—	1,071,857.18	144.55	2,235,624.48	148.11
Totale attivo netto	EUR	128,585,078.09		130,564,627.77		144,876,771.83	
NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate							
Azione A	EUR	3,516,713.19	139.96	3,725,558.63	140.43	5,039,728.94	140.23
Azione D	EUR	319,851.86	116.30	322,549.78	117.28	324,348.53	117.35
Azione I	EUR	70,645,490.83	148.24	67,766,971.60	148.38	73,051,224.97	147.45
Azione L	EUR	2,411,075.06	146.65	2,734,405.04	146.92	2,700,507.29	146.28
Azione Y	EUR	6,061,820.73	146.51	6,098,058.31	147.39	3,106.86	146.69
Totale attivo netto	EUR	82,954,951.67		80,647,543.36		81,118,916.59	
NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative							
Azione A	EUR	49,884,010.02	156.03	43,302,468.86	153.03	40,773,379.50	147.28
Azione I	EUR	8,248,170.58	168.37	6,719,017.94	164.66	6,680,723.51	157.73
Azione L	EUR	16,904,458.20	166.74	16,536,718.16	163.20	15,987,808.35	156.60
Totale attivo netto	EUR	75,036,638.80		66,558,204.96		63,441,911.36	
NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible							
Azione A	EUR	6,124,710.58	128.34	15,404,826.03	123.95	17,426,459.25	122.34
Azione I	EUR	—	—	—	—	1,992,800.33	100.25
Azione L	EUR	11,524,330.84	128.13	—	—	—	—
Totale attivo netto	EUR	17,649,041.42		15,404,826.03		19,419,259.58	
NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe							
Azione A	EUR	870,762.54	106.84	870,257.40	105.48	1,329,689.12	105.86
Azione I	EUR	20,978,595.99	112.66	19,486,567.21	110.99	21,612,970.38	110.93
Azione L	EUR	1,178,003.47	111.25	1,161,598.89	109.70	1,154,478.53	109.82
Azione Y	EUR	3,065.51	110.83	3,033.33	109.66	3,038.05	109.84
Totale attivo netto	EUR	23,030,427.51		21,521,456.83		24,100,176.08	

COMPARATIVO DEI VALORI NETTI D'INVENTARIO DEGLI ULTIMI TRE ANNI

	Valuta	30 Giugno 2021		31 Dicembre 2020		31 Dicembre 2019	
		Totale NAV	per Azione	Totale NAV	per Azione	Totale NAV	per Azione
NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond							
Azione A	EUR	1,660,205.69	137.44	1,772,946.47	133.85	2,423,434.25	131.83
Azione D	EUR	1,295,730.82	108.74	1,510,927.59	109.16	485,128.99	110.83
Azione I	EUR	60,522,849.89	146.32	63,417,055.12	142.00	68,832,258.52	138.86
Azione L	EUR	146,586.15	144.85	126,478.61	140.69	99,637.55	137.81
Azione Y	EUR	—	—	—	—	107,309.31	126.74
Totale attivo netto	EUR	63,625,372.55		66,827,407.79		71,947,768.62	
NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing							
Azione A	EUR	2,472,787.96	112.71	2,462,317.77	106.69	2,871,126.96	111.34
Azione D	EUR	295,392.46	93.20	295,551.89	90.49	543,979.86	96.85
Azione I	EUR	760,008.73	121.60	716,485.16	114.64	3,818,866.08	118.44
Azione L	EUR	1,097.97	122.00	1,035.49	115.05	1,067.42	118.60
Azione Y	EUR	3,213.84	106.74	3,107.85	103.22	3,292.96	109.37
Totale attivo netto	EUR	3,532,500.96		3,478,498.16		7,238,333.28	
NEW MILLENNIUM - VolActive							
Azione A	EUR	489,280.72	99.69	473,813.15	97.64	402,230.87	95.91
Azione D	EUR	927.56	80.26	5,912.52	80.23	926.31	80.15
Azione I	EUR	5,552,457.75	108.35	6,749,548.80	105.85	6,307,794.53	102.79
Azione L	EUR	9,511.78	106.87	9,308.84	104.59	11,701.26	101.75
Totale attivo netto	EUR	6,052,177.81		7,238,583.31		6,722,652.97	
NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond							
Azione A	EUR	62,524.16	105.69	159,403.31	103.03	855,705.31	111.59
Azione D	EUR	145,275.76	82.81	266,454.97	84.10	242,712.44	94.91
Azione I	EUR	58,745,522.44	110.14	55,758,242.85	106.93	63,468,624.60	114.84
Azione L	EUR	28,357.03	109.07	27,554.08	105.98	1,140.30	114.03
Azione Y	EUR	—	—	—	—	686,752.91	101.98
Totale attivo netto	EUR	58,981,679.39		56,211,655.21		65,254,935.56	
NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond							
Azione A	EUR	1,337,332.57	88.29	1,267,221.27	83.66	2,637,555.40	95.69
Azione I	EUR	2,050,087.18	92.31	2,184,878.01	87.09	3,885,308.79	98.74
Azione L	EUR	54,890.06	91.48	51,831.59	86.39	58,870.38	98.12
Totale attivo netto	EUR	3,442,309.81		3,503,930.87		6,581,734.57	
NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity							
Azione A	EUR	26,634,139.45	106.84	26,122,794.74	102.57	28,957,368.54	101.88
Azione I	EUR	197,014.41	109.45	188,773.63	104.87	186,593.36	103.66
Azione L	EUR	74,600,999.16	108.55	70,663,743.26	104.09	67,906,599.11	103.08
Totale attivo netto	EUR	101,432,153.02		96,975,311.63		97,050,561.01	
NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia							
Azione A	EUR	4,426,696.93	107.38	4,999,310.40	100.95	6,109,360.91	101.09
Azione I	EUR	3,976,463.88	109.85	3,902,794.28	103.22	3,874,606.60	102.83
Azione L	EUR	215,387.54	109.06	202,527.59	102.55	217,411.48	102.31
Totale attivo netto	EUR	8,618,548.35		9,104,632.27		10,201,378.99	

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO CONSOLIDATO AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR**Attività**

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	955,636,648.63
Liquidità bancarie a vista		52,913,312.80
Importi dovuti dai broker	(Nota 12)	22,955,916.88
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	(Note 2c, 12)	189,546.03
Utili non realizzati su contratti futures	(Note 2d, 12)	19,464.84
Dividendi da ricevere		60,240.30
Interessi da ricevere		8,183,987.38
Da ricevere su vendita titoli		2,696,205.15
Da ricevere su sottoscrizioni		1,475,794.52
Altre attività		73,287.91
Totale attività		1,044,204,404.44

Passività

Scoperti bancari		-450,750.10
Premio ricevuto su contratti swap		-6,013,508.83
Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	(Note 2c, 12)	-3,082,147.08
Perdite non realizzate su contratti futures	(Note 2d, 12)	-1,315,925.88
Perdite non realizzate su contratti swap	(Note 2f, 12)	-952,394.68
Interessi da pagare su contratti swap		-77,646.46
Da pagare su acquisto titoli		-161,198.41
Da pagare su rimborsi		-700,307.30
Altre passività		-4,963,301.62
Totale passività		-17,717,180.36

Totale attivo netto **1,026,487,224.08**

PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO CONSOLIDATO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Attivo netto all'inizio del periodo		1,000,487,321.63
Risultato netto degli investimenti		14,290,440.28
Interessi ricevuti da contratti swap		20,264.46
Altri ricavi		14,017.31
Totale ricavi		14,324,722.05
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-4,546,228.22
Commissioni sulla performance	(Nota 6)	-1,707,343.88
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 7)	-280,363.44
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-106,831.44
Interessi pagati su contratti swap		-1,285,749.27
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 7)	-361,662.96
Commissioni del Transfer Agent		-36,931.40
Compensi professionali	(Nota 8)	-64,068.24
Pubblicazioni		-46,290.91
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-212,134.32
Totale costi		-8,647,604.08
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		5,677,117.97
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	23,594,023.16
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		-7,226,719.51
- di contratti futures		-7,028,240.96
- di contratti swap		-469,737.80
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		19,709,376.96
- su contratti di cambio a termine e su valute estere		-2,648,878.85
- su contratti futures		-1,192,172.31
- su contratti swap		-562,591.20
Risultato netto delle operazioni per il periodo		29,852,177.46
Distribuzioni di dividendi	(Nota 13)	-1,137,131.51
Sottoscrizioni del periodo		128,622,040.09
Rimborsi del periodo		-131,337,183.59
Attivo netto alla fine del periodo		1,026,487,224.08

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Attività

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	338,493,796.44
Liquidità bancarie a vista		23,249,582.79
Importi dovuti dai broker	(Nota 12)	12,949,748.32
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	(Note 2c, 12)	153,920.84
Interessi da ricevere		4,290,232.28
Da ricevere su vendita titoli		2,246,929.84
Da ricevere su sottoscrizioni		516,050.33
Altre attività		24,181.98
Totale attività		381,924,442.82

Passività

Premio ricevuto su contratti swap		-6,013,508.83
Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	(Note 2c, 12)	-2,070,121.10
Perdite non realizzate su contratti futures	(Note 2d, 12)	-311,812.08
Perdite non realizzate su contratti swap	(Note 2f, 12)	-898,708.56
Interessi da pagare su contratti swap		-77,143.36
Da pagare su rimborsi		-117,418.02
Altre passività		-1,971,975.45
Totale passività		-11,460,687.40

Totale attivo netto**370,463,755.42**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	231.10	202,638.274
Azione A (H-CHF)	CHF	103.63	34,100.250
Azione A (H-USD)	USD	112.87	67,718.554
Azione D	EUR	103.86	111,524.050
Azione I	EUR	249.24	1,143,016.500
Azione L	EUR	246.20	379.000
Azione Y	EUR	208.86	6,907.351
Azione Z	EUR	101.65	157,011.448

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond**PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR**

Attivo netto all'inizio del periodo		369,889,157.15
Risultato netto degli investimenti		7,257,080.61
Interessi ricevuti da contratti swap		20,264.46
Altri ricavi		4,682.37
Totale ricavi		7,282,027.44
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-1,563,823.47
Commissioni sulla performance	(Nota 6)	-965,817.01
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 7)	-102,065.69
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-30,160.31
Interessi pagati su contratti swap		-1,285,246.17
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 7)	-85,921.41
Commissioni del Transfer Agent		-8,747.73
Compensi professionali	(Nota 8)	-9,672.86
Pubblicazioni		-6,927.01
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-56,486.15
Totale costi		-4,114,867.81
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		3,167,159.63
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	11,591,386.31
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		-3,972,969.24
- di contratti futures		-3,567,205.78
- di contratti swap		-469,737.80
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		4,960,368.13
- su contratti di cambio a termine e su valute estere		-1,682,540.58
- su contratti futures		-135,583.06
- su contratti swap		-508,905.08
Risultato netto delle operazioni per il periodo		9,381,972.53
Distribuzioni di dividendi	(Nota 13)	-769,339.97
Sottoscrizioni del periodo		44,188,225.79
Rimborsi del periodo		-52,226,260.08
Attivo netto alla fine del periodo		370,463,755.42

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			320,022,822.82	338,493,796.44	91.37
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			280,175,195.69	296,551,589.85	80.05
Azioni			655,941.32	671,294.04	0.18
LUSSEMBURGO			655,941.32	671,294.04	0.18
Beni di prima necessità			655,941.32	671,294.04	0.18
800,000.00	MINERVA LUXEMBOURG SA	USD	655,941.32	671,294.04	0.18
Obbligazioni ordinarie			123,440,830.46	129,234,994.81	34.88
ITALIA			43,326,744.36	44,130,543.75	11.91
Finanza			29,093,932.43	30,146,512.48	8.14
9,900,000.00	AZIMUT HOLDING SPA REG 1.63% 12/12/2024	EUR	9,883,962.00	10,307,781.00	2.78
4,800,000.00	BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA 4.00% 10/07/2022	EUR	4,874,760.00	4,902,096.00	1.32
4,500,000.00	BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA 3.63% 24/09/2024	EUR	4,500,000.00	4,698,675.00	1.27
3,499,000.00	VITTORIA ASSICURAZIONI SPA 5.75% 11/07/2028	EUR	3,809,105.00	3,985,430.98	1.08
2,950,000.00	UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA 3.88% 01/03/2028	EUR	3,060,535.00	3,218,479.50	0.87
1,000,000.00	EUROVITA ASSICURAZIONI SPA 6.00% 22/12/2025	EUR	1,101,500.00	1,120,220.00	0.30
1,000,000.00	BANCA CARIGE SPA 5.00% 22/12/2022	EUR	963,750.00	1,036,330.00	0.28
900,000.00	NET INSURANCE SPA 7.00% 30/09/2026	EUR	900,320.43	877,500.00	0.24
Enti Governativi			9,878,601.93	9,250,045.27	2.50
9,955,920.00	BTP 0.15% 15/05/2051	EUR	9,878,601.93	9,250,045.27	2.50
Industria			3,366,510.00	3,713,716.00	1.00
3,000,000.00	SALINI IMPREGILO SPA 1.75% 26/10/2024	EUR	2,671,690.00	2,981,460.00	0.80
700,000.00	LEONARDO SPA 2.38% 08/01/2026	EUR	694,820.00	732,256.00	0.20
Beni voluttuari			987,700.00	1,020,270.00	0.27
1,000,000.00	PIAGGIO & C SPA 3.63% 30/04/2025	EUR	987,700.00	1,020,270.00	0.27
REGNO UNITO			20,653,786.06	21,908,126.67	5.91
Sovranazionale			9,843,454.12	10,131,865.33	2.73
65,000,000.00	EUROPEAN BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT 5.00% 27/01/2025	BRL	9,843,454.12	10,131,865.33	2.73
Beni voluttuari			6,301,231.14	7,206,331.94	1.95
2,350,000.00	JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC 5.00% 15/02/2022	GBP	2,556,721.49	2,800,548.95	0.76
2,250,000.00	INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY PLC 3.50% 15/06/2026	EUR	1,935,055.00	2,309,917.50	0.62
1,300,000.00	JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC 3.88% 01/03/2023	GBP	1,345,604.65	1,545,090.49	0.42
500,000.00	JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC 5.88% 15/11/2024	EUR	463,850.00	550,775.00	0.15
Finanza			4,509,100.80	4,569,929.40	1.23
2,000,000.00	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC REG 6.63% 18/12/2025	GBP	2,801,007.14	2,819,512.87	0.76
2,000,000.00	PRUDENTIAL PLC 4.88% 24/10/2022	USD	1,708,093.66	1,750,416.53	0.47
STATI UNITI			16,307,817.96	17,324,465.23	4.68
Sovranazionale			4,129,624.28	4,022,241.52	1.09
250,000,000.00	INTERNATIONAL FINANCE CORP 7.45% 08/11/2021	INR	2,961,482.26	2,862,345.44	0.77
100,000,000.00	INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT 6.75% 14/11/2022	RUB	1,168,142.02	1,159,896.08	0.32
Servizi di telecomunicazione			2,888,150.00	3,377,304.00	0.91
2,800,000.00	NETFLIX INC 3.88% 15/11/2029	EUR	2,888,150.00	3,377,304.00	0.91
Beni voluttuari			2,634,003.07	3,121,338.91	0.84
1,800,000.00	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 2.39% 17/02/2026	EUR	1,561,500.00	1,870,614.00	0.50
1,000,000.00	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.54% 06/03/2025	GBP	1,072,503.07	1,250,724.91	0.34
Salute			2,916,290.17	2,972,525.71	0.80
3,000,000.00	ST JUDE MEDICAL LLC 4.75% 15/04/2043	USD	2,916,290.17	2,972,525.71	0.80

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Informatica			1,913,766.44	2,033,366.47	0.55
1,925,000.00	LEIDOS HOLDINGS INC 5.95% 01/12/2040	USD	1,913,766.44	2,033,366.47	0.55
Industria			1,825,984.00	1,797,688.62	0.49
2,000,000.00	BOEING CO 4.51% 01/05/2023	USD	1,825,984.00	1,797,688.62	0.49
MESSICO			12,020,782.90	13,225,622.00	3.57
Energia			8,937,982.90	10,135,952.00	2.74
6,100,000.00	PETROLEOS MEXICANOS 1.88% 21/04/2022	EUR	5,277,982.90	6,126,352.00	1.66
4,000,000.00	PETROLEOS MEXICANOS 2.50% 21/08/2021	EUR	3,660,000.00	4,009,600.00	1.08
Industria			3,082,800.00	3,089,670.00	0.83
3,000,000.00	CEMEX SAB DE CV 3.13% 19/03/2026	EUR	3,082,800.00	3,089,670.00	0.83
LUSSEMBURGO			8,626,604.06	9,144,575.89	2.47
Sovranazionale			4,374,906.86	4,615,697.74	1.25
30,000,000.00	INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT 5.00% 22/01/2026	BRL	4,374,906.86	4,615,697.74	1.25
Finanza			2,384,359.09	2,512,169.97	0.68
2,300,000.00	MEXICO REMITTANCES FUNDING FIDUCIARY ESTATE MANAGEMENT SARL 4.88% 15/01/2028	USD	1,882,109.09	1,917,169.97	0.52
700,000.00	VIC PROPERTIES SA 3.00% 28/05/2025	EUR	502,250.00	595,000.00	0.16
Servizi di telecomunicazione			944,812.15	1,095,652.00	0.29
1,005,000.00	TELECOM ITALIA CAPITAL SA 7.20% 18/07/2036	USD	944,812.15	1,095,652.00	0.29
Energia			922,525.96	921,056.18	0.25
1,000,000.00	GAZPROM PJSC VIA GAZ CAPITAL SA 1.45% 06/03/2023	CHF	922,525.96	921,056.18	0.25
PAESI BASSI			3,627,294.29	3,613,985.56	0.98
Beni voluttuari			2,600,794.29	2,546,395.56	0.69
2,800,000.00	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV 5.25% 15/04/2023	USD	2,600,794.29	2,546,395.56	0.69
Servizi di telecomunicazione			1,026,500.00	1,067,590.00	0.29
1,000,000.00	PPF TELECOM GROUP BV 3.50% 20/05/2024	EUR	1,026,500.00	1,067,590.00	0.29
HONG KONG			2,800,991.03	2,985,101.60	0.81
Materie prime			2,126,321.67	2,299,027.23	0.62
2,485,000.00	CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 4.88% 14/03/2025	USD	2,126,321.67	2,299,027.23	0.62
Informatica			674,669.36	686,074.37	0.19
800,000.00	LENOVO GROUP LTD 3.88% 16/03/2022	USD	674,669.36	686,074.37	0.19
FRANCIA			2,596,732.35	2,888,278.00	0.78
Beni voluttuari			2,596,732.35	2,888,278.00	0.78
1,700,000.00	AIR FRANCE-KLM 1.88% 16/01/2025	EUR	1,348,860.00	1,601,638.00	0.43
8,000,000.00	AIR FRANCE-KLM 0.13% 25/03/2026	EUR	1,247,872.35	1,286,640.00	0.35
GIAPPONE			2,250,000.00	2,453,535.00	0.66
Beni voluttuari			2,250,000.00	2,453,535.00	0.66
2,250,000.00	NISSAN MOTOR CO LTD 2.65% 17/03/2026	EUR	2,250,000.00	2,453,535.00	0.66
IRLANDA			2,187,501.73	2,255,038.93	0.61
Materie prime			1,351,636.80	1,368,708.32	0.37
1,600,000.00	MMC NORILSK NICKEL OJSC VIA MMC FINANCE DAC 2.55% 11/09/2025	USD	1,351,636.80	1,368,708.32	0.37
Finanza			835,864.93	886,330.61	0.24
1,000,000.00	GTLK EUROPE CAPITAL DAC 4.80% 26/02/2028	USD	835,864.93	886,330.61	0.24

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
OMAN			1,653,684.84	1,777,585.76	0.48
Enti Governativi			1,653,684.84	1,777,585.76	0.48
2,000,000.00	OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.63% 17/01/2028	USD	1,653,684.84	1,777,585.76	0.48
GERMANIA			1,280,925.00	1,345,997.55	0.36
Materie prime			1,280,925.00	1,345,997.55	0.36
1,000,000.00	THYSSENKRUPP AG 1.88% 06/03/2023	EUR	967,720.00	1,003,780.00	0.27
400,000.00	THYSSENKRUPP AG 4.13% 26/01/2026	USD	313,205.00	342,217.55	0.09
GEORGIA			1,405,498.52	1,315,228.28	0.35
Finanza			1,405,498.52	1,315,228.28	0.35
1,500,000.00	PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD 5.50% 15/07/2022	USD	1,405,498.52	1,315,228.28	0.35
JERSEY			1,130,835.80	1,175,614.98	0.32
Beni voluttuari			1,130,835.80	1,175,614.98	0.32
1,250,000.00	ASTON MARTIN CAPITAL HOLDINGS LTD 10.50% 30/11/2025	USD	1,130,835.80	1,175,614.98	0.32
FILIPPINE			1,173,253.93	1,153,015.50	0.31
Sovranazionale			1,173,253.93	1,153,015.50	0.31
100,000,000.00	ASIAN DEVELOPMENT BANK 5.90% 20/12/2022	INR	1,173,253.93	1,153,015.50	0.31
SVEZIA			1,004,000.00	1,032,180.00	0.28
Finanza			1,004,000.00	1,032,180.00	0.28
1,000,000.00	HOIST FINANCE AB 2.75% 03/04/2023	EUR	1,004,000.00	1,032,180.00	0.28
EMIRATI ARABI UNITI			802,536.73	899,628.53	0.24
Servizi di telecomunicazione			802,536.73	899,628.53	0.24
1,000,000.00	OZTEL HOLDINGS SPC LTD 5.63% 24/10/2023	USD	802,536.73	899,628.53	0.24
ISRAELE			591,840.90	606,471.58	0.16
Energia			591,840.90	606,471.58	0.16
700,000.00	DELEK OVERRIDING ROYALTY LEVIATHAN LTD 7.49% 30/12/2023	USD	591,840.90	606,471.58	0.16
Obbligazioni a tasso variabile			133,309,943.54	142,773,753.15	38.54
ITALIA			86,001,708.88	94,341,114.95	25.47
Finanza			80,764,012.75	88,591,268.75	23.92
14,500,000.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA FRN 29/06/2049	GBP	14,184,027.56	19,636,275.11	5.30
10,750,000.00	UNICREDIT SPA FRN 31/12/2099	EUR	11,590,524.06	11,593,875.00	3.13
10,000,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 31/12/2099	EUR	10,720,382.18	10,989,800.00	2.97
8,515,000.00	UNICREDIT SPA FRN 31/12/2099	EUR	8,472,144.52	9,044,633.00	2.44
7,536,000.00	FINECOBANK BANCA FINECO SPA FRN 31/12/2099	EUR	7,869,420.00	8,214,164.64	2.22
5,800,000.00	UNIONE DI BANCHE ITALIANE SPA REG FRN 31/12/2099	EUR	5,828,250.00	6,403,374.00	1.73
4,400,000.00	CREDITO VALTELLINESE SPA FRN 12/04/2027	EUR	4,446,249.43	4,676,672.00	1.26
4,000,000.00	ICCREA BANCA SPA REG FRN 28/11/2029	EUR	4,045,600.00	4,074,480.00	1.10
3,500,000.00	ICCREA BANCA SPA FRN 20/10/2025	EUR	3,497,865.00	3,591,455.00	0.97
3,000,000.00	BANCO BPM SPA REG FRN 31/12/2099	EUR	3,246,000.00	3,196,440.00	0.86
1,500,000.00	UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA FRN 31/12/2099	EUR	1,500,000.00	1,730,040.00	0.47
1,500,000.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA FRN 30/11/2049	EUR	1,653,850.00	1,692,165.00	0.46
1,500,000.00	CREDITO EMILIANO SPA FRN 10/07/2027	EUR	1,528,650.00	1,544,355.00	0.42
1,000,000.00	SOCIETA CATTOLICA DI ASSICURAZIONI SC FRN 14/12/2047	EUR	1,061,050.00	1,130,750.00	0.30
1,000,000.00	UNICREDIT SPA FRN 29/12/2049	EUR	1,120,000.00	1,072,790.00	0.29
Servizi di pubblica utilità			5,237,696.13	5,749,846.20	1.55
5,861,000.00	ENEL SPA FRN 24/09/2073	USD	5,237,696.13	5,749,846.20	1.55

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
PAESI BASSI			10,628,852.42	11,393,873.96	3.08
Finanza			10,628,852.42	11,393,873.96	3.08
11,000,000.00	AEGON NV FRN 29/06/2049	NLG	4,424,357.10	4,718,193.41	1.28
8,000,000.00	AEGON NV FRN 31/12/2099	NLG	3,077,899.62	3,417,509.56	0.92
2,190,000.00	ACHMEA BV FRN 31/12/2099	EUR	2,205,488.70	2,375,230.20	0.64
1,000,000.00	ING GROEP NV REG FRN 31/12/2099	USD	921,107.00	882,940.79	0.24
STATI UNITI			8,805,206.25	9,523,560.00	2.57
Servizi di telecomunicazione			4,828,906.25	5,103,050.00	1.38
5,000,000.00	AT&T INC FRN 31/12/2099	EUR	4,828,906.25	5,103,050.00	1.38
Beni voluttuari			3,096,800.00	3,482,500.00	0.94
3,500,000.00	FORD MOTOR CREDIT CO LLC FRN 07/12/2022	EUR	3,096,800.00	3,482,500.00	0.94
Finanza			879,500.00	938,010.00	0.25
1,000,000.00	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC FRN 15/03/2037	EUR	879,500.00	938,010.00	0.25
REGNO UNITO			9,513,803.41	9,449,887.43	2.55
Finanza			5,810,755.27	5,708,683.44	1.54
2,500,000.00	ROTHESAY LIFE PLC REG FRN 31/12/2099	GBP	3,500,478.26	3,358,626.47	0.91
2,000,000.00	HSBC BANK PLC FRN 29/06/2049	USD	1,536,527.01	1,585,056.97	0.43
1,000,000.00	BARCLAYS BANK PLC FRN 28/12/2040	EUR	773,750.00	765,000.00	0.20
Energia			3,703,048.14	3,741,203.99	1.01
3,000,000.00	BP CAPITAL MARKETS PLC FRN 31/12/2099	USD	2,703,048.14	2,705,133.99	0.73
1,000,000.00	GAZPROM PJSC VIA GAZ FINANCE PLC FRN 31/12/2099	EUR	1,000,000.00	1,036,070.00	0.28
LUSSEMBURGO			7,327,806.18	6,447,814.24	1.74
Finanza			7,327,806.18	6,447,814.24	1.74
9,100,000.00	MITSUBISHI UFJ INVESTOR SERVICES & BANKING LUXEMBOURG SA FRN 15/12/2050	EUR	5,634,314.18	4,689,139.00	1.27
1,000,000.00	SWISS RE FINANCE LUXEMBOURG SA FRN 31/12/2099	USD	900,820.00	893,363.24	0.24
800,000.00	HELVETIA EUROPE SA FRN 30/09/2041	EUR	792,672.00	865,312.00	0.23
SPAGNA			2,661,805.55	2,865,390.00	0.77
Finanza			2,661,805.55	2,865,390.00	0.77
3,000,000.00	BANCO SANTANDER SA FRN 31/12/2099	EUR	2,661,805.55	2,865,390.00	0.77
FRANCIA			2,700,247.67	2,769,211.66	0.75
Finanza			2,700,247.67	2,769,211.66	0.75
2,000,000.00	LA MONDIALE SAM FRN 18/01/2048	USD	1,770,247.67	1,814,401.66	0.49
1,000,000.00	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA FRN 29/12/2049	EUR	930,000.00	954,810.00	0.26
ISOLE VERGINI BRITANNICHE			2,049,090.89	2,000,445.92	0.54
Materie prime			1,658,252.34	1,712,689.93	0.46
2,000,000.00	CNRC CAPITALE LTD FRN 31/12/2099	USD	1,658,252.34	1,712,689.93	0.46
Finanza			390,838.55	287,755.99	0.08
500,000.00	HUARONG FINANCE 2017 CO LTD FRN 31/12/2099	USD	390,838.55	287,755.99	0.08
GERMANIA			1,692,229.80	1,747,414.59	0.47
Finanza			1,692,229.80	1,747,414.59	0.47
2,000,000.00	ALLIANZ SE FRN 31/12/2099	USD	1,692,229.80	1,747,414.59	0.47
GIAPPONE			841,750.99	876,624.91	0.24
Servizi di telecomunicazione			841,750.99	876,624.91	0.24
1,000,000.00	RAKUTEN GROUP INC FRN 31/12/2099	USD	841,750.99	876,624.91	0.24

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
AUSTRALIA			578,394.51	797,680.69	0.21
Finanza			578,394.51	797,680.69	0.21
1,000,000.00	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD FRN 29/10/2049	USD	578,394.51	797,680.69	0.21
ISOLE CAYMAN			249,606.99	303,966.00	0.08
Finanza			249,606.99	303,966.00	0.08
260,000.00	EMERGING MARKETS CAPITAL PROTECTED INVESTMENTS LTD FRN 20/04/2028	EUR	249,606.99	303,966.00	0.08
FINLANDIA			259,440.00	256,768.80	0.07
Beni voluttuari			259,440.00	256,768.80	0.07
240,000.00	FINNAIR OYJ FRN 31/12/2099	EUR	259,440.00	256,768.80	0.07
Obbligazioni zero coupon			997,046.39	1,027,029.59	0.28
CILE			997,046.39	1,027,029.59	0.28
Servizi di pubblica utilità			997,046.39	1,027,029.59	0.28
1,500,000.00	CHILE ELECTRICITY PEC SPA 0.00% 25/01/2028	USD	997,046.39	1,027,029.59	0.28
Azioni di OICR			20,367,650.43	21,520,462.79	5.81
LUSSEMBURGO			20,367,650.43	21,520,462.79	5.81
Finanza			20,367,650.43	21,520,462.79	5.81
1,708,812.51	AZ FUND 1 CGM OPPORTUNISTIC CORPORATE BOND -A-	EUR	11,000,000.00	11,406,323.46	3.08
40,326.65	PLANETARIUM FUND - ENHANCED EURO CREDIT	EUR	4,000,000.02	4,199,213.65	1.14
29,985.37	PLANETARIUM FUND - EURO CURRENCIES BONDS	EUR	2,500,000.01	2,860,604.39	0.77
281,320.33	AZ FUND 1 - AZ BOND TARGET 2024 USD	USD	1,243,884.00	1,271,503.68	0.34
191,497.51	AZ MULTI ASSET - MAMG GLOBAL SUKUK	USD	809,651.00	963,542.53	0.26
184,150.64	AZ FUND 1-AZ BOND-US DOLLAR AGGREGATE -A-	USD	814,115.40	819,275.08	0.22
Titoli garantiti da Ipotecche immobiliari e da collaterale			1,403,783.55	1,324,055.47	0.36
ITALIA			1,403,783.55	1,324,055.47	0.36
Finanza			1,403,783.55	1,324,055.47	0.36
1,423,715.56	SPV PROJECT SRL 7.00% 15/11/2037	EUR	1,403,783.55	1,324,055.47	0.36
NEGOZIATI SU UN ALTRO MERCATO REGOLAMENTATO			35,047,627.13	37,617,406.59	10.15
Obbligazioni ordinarie			31,560,784.01	34,127,676.06	9.21
STATI UNITI			18,445,831.63	19,354,902.48	5.22
Industria			10,445,089.87	11,090,339.36	2.99
9,000,000.00	LEONARDO US HOLDINGS INC 6.25% 15/01/2040	USD	8,580,969.36	9,046,744.80	2.44
1,850,000.00	LEONARDO US HOLDINGS INC 7.38% 15/07/2039	USD	1,864,120.51	2,043,594.56	0.55
Beni voluttuari			5,218,024.46	5,420,503.15	1.46
3,000,000.00	DELTA AIR LINES INC 7.00% 01/05/2025	USD	2,850,463.68	2,954,868.25	0.80
1,500,000.00	MICHAEL KORS USA INC 4.50% 01/11/2024	USD	1,284,443.05	1,341,221.19	0.36
1,055,587.95	AMERICAN AIRLINES 2013-2 CLASS A PASS THROUGH TRUST 4.95% 15/01/2023	USD	857,387.50	893,079.12	0.24
272,665.66	US AIRWAYS 2013-1 CLASS A PASS THROUGH TRUST 3.95% 15/11/2025	USD	225,730.23	231,334.59	0.06
Servizi di telecomunicazione			1,216,829.38	1,245,100.99	0.34
1,300,000.00	NETFLIX INC 4.38% 15/11/2026	USD	1,216,829.38	1,245,100.99	0.34
Finanza			824,307.78	846,301.96	0.23
1,000,000.00	CITADEL FINANCE LLC 3.38% 09/03/2026	USD	824,307.78	846,301.96	0.23
Salute			741,580.14	752,657.02	0.20
759,000.00	CELGENE CORP 5.00% 15/08/2045	USD	741,580.14	752,657.02	0.20

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
LUSSEMBURGO			4,178,462.27	4,719,855.86	1.27
Servizi di telecomunicazione			4,178,462.27	4,719,855.86	1.27
2,117,000.00	TELECOM ITALIA CAPITAL SA 7.72% 04/06/2038	USD	2,118,318.85	2,438,163.70	0.66
2,268,000.00	TELECOM ITALIA CAPITAL SA 6.38% 15/11/2033	USD	2,060,143.42	2,281,692.16	0.61
CANADA			2,791,471.13	3,633,145.96	0.98
Industria			2,791,471.13	3,633,145.96	0.98
3,500,000.00	BOMBARDIER INC 7.50% 15/03/2025	USD	2,216,749.15	3,040,887.26	0.82
701,000.00	BOMBARDIER INC 6.00% 15/10/2022	USD	574,721.98	592,258.70	0.16
COLOMBIA			2,656,638.51	2,586,665.38	0.70
Servizi di telecomunicazione			2,656,638.51	2,586,665.38	0.70
2,950,000.00	COLOMBIA TELECOMUNICACIONES SA ESP 4.95% 17/07/2030	USD	2,656,638.51	2,586,665.38	0.70
JERSEY			1,728,461.59	1,953,328.25	0.53
Beni voluttuari			1,728,461.59	1,953,328.25	0.53
2,058,045.00	ASTON MARTIN CAPITAL HOLDINGS LTD 15.00% 30/11/2026	USD	1,728,461.59	1,953,328.25	0.53
MESSICO			917,494.88	951,125.25	0.26
Industria			917,494.88	951,125.25	0.26
1,000,000.00	CEMEX SAB DE CV 7.38% 05/06/2027	USD	917,494.88	951,125.25	0.26
GIAPPONE			842,424.00	928,652.88	0.25
Beni voluttuari			842,424.00	928,652.88	0.25
1,000,000.00	NISSAN MOTOR CO LTD 4.35% 17/09/2027	USD	842,424.00	928,652.88	0.25
Obbligazioni a tasso variabile			3,486,843.12	3,489,730.53	0.94
STATI UNITI			3,486,843.12	3,489,730.53	0.94
Beni voluttuari			1,259,351.93	1,319,008.96	0.36
1,550,000.00	GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC FRN 05/01/2023	USD	1,259,351.93	1,319,008.96	0.36
Finanza			1,383,907.44	1,316,940.06	0.35
2,000,000.00	USB REALTY CORP FRN 29/12/2049	USD	1,383,907.44	1,316,940.06	0.35
Servizi di pubblica utilità			843,583.75	853,781.51	0.23
1,000,000.00	SOUTHERN CO FRN 15/09/2051	USD	843,583.75	853,781.51	0.23
ALTRI VALORI MOBILIARI			4,800,000.00	4,324,800.00	1.17
Titoli garantiti da Ipotecche immobiliari e da collaterale			4,800,000.00	4,324,800.00	1.17
ITALIA			4,800,000.00	4,324,800.00	1.17
Finanza			4,800,000.00	4,324,800.00	1.17
4,800,000.00	SIERRA ONE SPV SRL 7.00% 30/06/2025	EUR	4,800,000.00	4,324,800.00	1.17
Totale del Portafoglio Titoli			320,022,822.82	338,493,796.44	91.37

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 2021

Valore nominale	Quantità	Acquisto / Vendita	Contratto	Scadenza	Valore di mercato al 30 Giugno 2021	Valuta	Plus/(minus) valenza non realizzata (EUR)	Impegno (EUR)
							-311,812.08	56,354,621.62
100,000	-50	Vendita	US 10YR NOTE (CBT)	21/09/2021	111.73	USD	-32,412.08	5,586,471.62
100,000	-145	Vendita	EURO BUND	08/09/2021	172.61	EUR	-124,700.00	25,028,450.00
100,000	-170	Vendita	EURO BTP	08/09/2021	151.41	EUR	-154,700.00	25,739,700.00

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

CONTRATTI FINANZIARI A TERMINE AL 30 GIUGNO 2021

Scadenza	Impegno di acquisto di valute		Impegno di vendita di valute		Plus/(minus)-valenza non realizzata (EUR)
					-1,916,200.26
23/11/2021	51,630.00	CHF	47,192.08	EUR	-52.26
23/11/2021	26,000.00	CHF	23,896.42	EUR	-157.60
23/09/2021	903,103.14	EUR	990,000.00	CHF	-472.76
23/11/2021	62,485.39	EUR	76,000.00	USD	-1,400.55
23/11/2021	242,804.32	EUR	292,000.00	USD	-2,652.18
23/11/2021	91,950.78	EUR	113,000.00	USD	-3,037.52
23/11/2021	185,591.19	EUR	225,000.00	USD	-3,544.81
23/09/2021	2,346,643.50	EUR	2,800,000.00	USD	-10,446.17
23/09/2021	1,401,146.17	EUR	1,700,000.00	USD	-29,943.99
23/11/2021	3,336,000.00	CHF	3,082,120.50	EUR	-36,247.12
23/09/2021	2,731,279.81	EUR	3,300,000.00	USD	-46,718.73
23/09/2021	27,501,759.97	EUR	23,830,000.00	GBP	-215,972.45
14/07/2021	5,512,679.16	USD	30,000,000.00	BRL	-386,599.99
15/07/2021	12,149,532.71	USD	65,000,000.00	BRL	-663,376.46
23/09/2021	76,659,879.16	EUR	91,860,000.00	USD	-669,498.51
23/11/2021	5,959,000.00	USD	4,890,936.79	EUR	118,225.16
23/11/2021	1,125,000.00	USD	925,091.44	EUR	20,588.57
23/11/2021	675,000.00	USD	556,197.17	EUR	11,210.84
23/11/2021	532,000.00	USD	443,831.68	EUR	3,369.89
23/11/2021	51,500.00	CHF	46,816.96	EUR	204.17
23/11/2021	26,800.00	CHF	24,319.25	EUR	150.00
23/11/2021	17,440.74	EUR	19,000.00	CHF	93.14
23/11/2021	10,400.00	CHF	9,416.46	EUR	79.07

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond**CONTRATTI SWAP AL 30 GIUGNO 2021**

Sottostante	Valuta	Posizione	Nominale	Controparte	Scadenza	Interessi da ricevere / pagare (EUR)	Plus/(minus) -valenza non realizzata(EUR)
EQUITY SWAP CONTRACTS						-1,448.92	-154,616.26
CITI VOLATILITY INDEX TOTAL RETURN	USD	L	7,331,846.40	CITIBANK NA	05/23/2022	-1,448.92	(154,616.26)
CONTRATTI CREDIT DEFAULT SWAP						-75,694.44	-744,092.30
ITRAXX EUROPE CROSSOVER SERIES 35 VERSION 1	EUR	L	54,500,000.00	J.P.MORGAN AG	06/20/2026	-75,694.44	(744,092.30)

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

NEW MILLENNIUM - Euro Equities

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Attività

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	30,806,428.93
Liquidità bancarie a vista		709,246.06
Importi dovuti dai broker	(Nota 12)	659,752.11
Dividendi da ricevere		37,759.52
Da ricevere su sottoscrizioni		100,138.42
Altre attività		2,118.66
Totale attività		32,315,443.70

Passività

Da pagare su rimborsi		-77,013.69
Altre passività		-130,112.16
Totale passività		-207,125.85

Totale attivo netto**32,108,317.85**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	68.11	91,702.138
Azione I	EUR	74.81	319,570.826
Azione L	EUR	74.09	2,781.000
Azione Y	EUR	72.42	24,154.589

NEW MILLENNIUM - Euro Equities

PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Attivo netto all'inizio del periodo		28,949,761.32
Risultato netto degli investimenti		465,228.17
Totale ricavi		465,228.17
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-141,666.68
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 7)	-8,770.62
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-2,863.01
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 7)	-27,869.30
Commissioni del Transfer Agent		-2,838.08
Compensi professionali	(Nota 8)	-3,860.39
Pubblicazioni		-2,651.17
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-6,277.44
Totale costi		-196,796.69
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		268,431.48
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	2,210,825.31
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		-2.09
- di contratti futures		86,420.05
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		963,780.31
- su contratti di cambio a termine e su valute estere		31.45
- su contratti futures		-3,250.00
Risultato netto delle operazioni per il periodo		3,526,236.51
Distribuzioni di dividendi	(Nota 13)	-59,661.83
Sottoscrizioni del periodo		4,924,754.54
Rimborsi del periodo		-5,232,772.69
Attivo netto alla fine del periodo		32,108,317.85

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

NEW MILLENNIUM - Euro Equities

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			28,129,125.40	30,806,428.93	95.95
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			28,129,125.40	30,806,428.93	95.95
Azioni			28,129,125.38	30,805,310.68	95.94
FRANCIA			9,833,383.81	10,982,252.11	34.20
Beni voluttuari			3,287,205.05	4,214,737.44	13.13
2,201.00	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	EUR	1,099,868.05	1,455,521.30	4.53
2,441.00	L'OREAL SA	EUR	768,335.47	917,327.80	2.86
497.00	HERMES INTERNATIONAL	EUR	376,500.64	610,564.50	1.90
2,206.00	SEB SA	EUR	259,117.90	336,194.40	1.05
3,901.00	SODEXO SA	EUR	247,232.91	307,008.70	0.96
1,566.00	CIE GENERALE DES ETABLISSEMENTS MICHELIN SCA	EUR	149,610.95	210,627.00	0.66
4,972.00	FAURECIA SE	EUR	219,449.20	205,691.64	0.64
2,183.00	SODEXO	EUR	167,089.93	171,802.10	0.53
Salute			1,579,279.23	1,727,238.37	5.38
9,358.00	SANOFI	EUR	787,856.86	826,872.88	2.58
3,227.00	ESSILORLUXOTTICA SA	EUR	399,122.54	502,250.28	1.56
2,493.00	IPSEN SA	EUR	215,138.75	218,685.96	0.68
1,673.00	ORPEA	EUR	177,161.08	179,429.25	0.56
Industria			1,586,527.48	1,707,504.39	5.32
4,902.00	SCHNEIDER ELECTRIC SE	EUR	574,069.81	650,397.36	2.02
3,641.00	SAFRAN SA	EUR	390,556.89	425,705.72	1.33
2,529.00	THALES SA	EUR	212,353.69	217,595.16	0.68
216.00	DASSAULT AVIATION SA	EUR	195,483.73	214,272.00	0.67
4,685.00	ALSTOM SA	EUR	214,063.36	199,534.15	0.62
Finanza			1,162,539.40	1,302,942.51	4.06
15,558.00	AXA SA	EUR	324,554.30	332,707.83	1.03
27,082.00	CREDIT AGRICOLE SA	EUR	214,596.84	319,946.75	1.00
12,644.00	SOCIETE GENERALE SA	EUR	330,178.97	314,329.84	0.98
6,447.00	SCOR SE	EUR	155,643.55	172,908.54	0.54
2,193.00	AMUNDI SA	EUR	137,565.74	163,049.55	0.51
Informatica			1,056,931.01	839,331.60	2.61
11,904.00	ATOS SE	EUR	876,937.63	610,675.20	1.90
668.00	TELEPERFORMANCE	EUR	179,993.38	228,656.40	0.71
Beni di prima necessità			723,154.40	816,832.59	2.54
2,249.00	PERNOD RICARD SA	EUR	318,643.57	421,012.80	1.31
6,667.00	DANONE SA	EUR	404,510.83	395,819.79	1.23
Energia			298,613.27	254,112.30	0.79
6,660.00	TOTAL SA	EUR	298,613.27	254,112.30	0.79
Servizi di telecomunicazione			139,133.97	119,552.91	0.37
12,434.00	ORANGE SA	EUR	139,133.97	119,552.91	0.37
GERMANIA			9,032,483.66	9,532,061.68	29.69
Beni voluttuari			2,139,352.81	2,478,417.63	7.72
2,269.00	ADIDAS AG	EUR	624,717.10	712,239.10	2.22
7,685.00	DAIMLER AG REG	EUR	479,707.07	578,680.50	1.80
2,000.00	VOLKSWAGEN AG -PREF-	EUR	336,533.48	422,400.00	1.32
3,571.00	BEIERSDORF AG	EUR	351,884.00	363,349.25	1.13
1,647.00	CONTINENTAL AG	EUR	200,455.00	204,195.06	0.64
2,212.00	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	EUR	146,056.16	197,553.72	0.61
Informatica			2,006,469.64	2,036,361.92	6.34
12,072.00	SAP SE	EUR	1,423,437.61	1,434,636.48	4.47
17,792.00	INFINEON TECHNOLOGIES AG	EUR	583,032.03	601,725.44	1.87

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

NEW MILLENNIUM - Euro Equities

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Industria			1,310,952.50	1,302,656.30	4.06
6,186.00	SIEMENS AG REG	EUR	751,585.20	826,573.32	2.58
4,058.00	HOCHTIEF AG	EUR	409,921.67	262,796.08	0.82
1,021.00	MTU AERO ENGINES AG	EUR	149,445.63	213,286.90	0.66
Salute			1,243,231.42	1,171,232.49	3.65
9,816.00	BAYER AG REG	EUR	654,299.29	502,677.36	1.57
1,469.00	MERCK KGAA	EUR	150,579.05	237,537.30	0.74
3,228.00	FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	EUR	230,104.11	226,089.12	0.70
4,658.00	FRESENIUS SE & CO KGAA	EUR	208,248.97	204,928.71	0.64
Finanza			1,124,868.36	1,159,803.55	3.61
2,472.00	ALLIANZ SE REG	EUR	502,870.36	519,861.60	1.62
1,293.00	MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS-GESELLSCHAFT AG IN MUENCHEN REG	EUR	311,693.00	298,618.35	0.93
1,212.00	HANNOVER RUECK SE	EUR	160,264.53	171,013.20	0.53
1,157.00	DEUTSCHE BOERSE AG	EUR	150,040.47	170,310.40	0.53
Materie prime			768,452.14	919,641.02	2.87
2,116.00	SYMRISE AG	EUR	184,519.33	248,630.00	0.78
3,002.00	BRENTAG AG	EUR	143,324.68	235,416.84	0.73
4,090.00	COVESTRO AG	EUR	229,415.60	222,741.40	0.70
5,189.00	FUCHS PETROLUB SE -PREF-	EUR	211,192.53	212,852.78	0.66
Beni di prima necessità			316,525.44	318,941.28	0.99
3,582.00	HENKEL AG & CO KGAA -PREF-	EUR	316,525.44	318,941.28	0.99
Servizi di telecomunicazione			122,631.35	145,007.49	0.45
8,141.00	DEUTSCHE TELEKOM AG REG	EUR	122,631.35	145,007.49	0.45
PAESI BASSI			4,466,865.10	5,421,914.53	16.89
Informatica			1,751,063.51	2,337,574.88	7.28
2,880.00	ASML HOLDING NV	EUR	1,086,343.38	1,668,672.00	5.20
21,856.00	STMICROELECTRONICS NV	EUR	664,720.13	668,902.88	2.08
Finanza			1,053,848.49	1,030,742.40	3.21
6,372.00	PROSUS NV	EUR	545,848.49	525,498.84	1.64
45,354.00	ING GROEP NV	EUR	508,000.00	505,243.56	1.57
Industria			455,815.96	615,288.56	1.92
5,674.00	AIRBUS SE	EUR	455,815.96	615,288.56	1.92
Materie prime			518,733.93	581,199.60	1.81
2,248.00	KONINKLIJKE DSM NV	EUR	339,612.98	353,835.20	1.10
2,182.00	AKZO NOBEL NV	EUR	179,120.95	227,364.40	0.71
Beni voluttuari			287,604.49	453,310.00	1.41
220.00	ADYEN NV	EUR	287,604.49	453,310.00	1.41
Energia			243,136.00	219,123.69	0.68
17,099.00	SBM OFFSHORE NV	EUR	243,136.00	219,123.69	0.68
Beni di prima necessità			156,662.72	184,675.40	0.58
1,807.00	HEINEKEN NV	EUR	156,662.72	184,675.40	0.58
BELGIO			1,229,137.12	1,363,332.47	4.25
Beni di prima necessità			502,318.11	454,433.13	1.42
7,473.00	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	EUR	502,318.11	454,433.13	1.42
Finanza			245,294.83	315,005.70	0.98
4,899.00	KBC GROUP NV	EUR	245,294.83	315,005.70	0.98
Salute			209,449.08	245,172.96	0.76
2,781.00	UCB SA	EUR	209,449.08	245,172.96	0.76

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

NEW MILLENNIUM - Euro Equities

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Materie prime			151,328.81	233,192.00	0.73
4,528.00	UMICORE SA	EUR	151,328.81	233,192.00	0.73
Servizi di telecomunicazione			120,746.29	115,528.68	0.36
7,092.00	PROXIMUS SADP	EUR	120,746.29	115,528.68	0.36
ITALIA			997,489.71	980,454.90	3.05
Finanza			650,236.86	657,873.36	2.05
207,257.00	INTESA SANPAOLO SPA	EUR	491,591.56	482,805.18	1.50
10,356.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA	EUR	158,645.30	175,068.18	0.55
Beni voluttuari			209,446.89	207,320.79	0.64
13,577.00	ATLANTIA SPA	EUR	209,446.89	207,320.79	0.64
Servizi di telecomunicazione			137,805.96	115,260.75	0.36
275,151.00	TELECOM ITALIA SPA	EUR	137,805.96	115,260.75	0.36
SPAGNA			1,073,372.67	923,136.33	2.87
Finanza			338,489.95	308,442.16	0.96
118,906.00	CAIXABANK SA	EUR	338,489.95	308,442.16	0.96
Industria			313,718.14	251,178.21	0.78
11,119.00	ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS SA	EUR	313,718.14	251,178.21	0.78
Energia			300,008.14	248,493.93	0.77
23,545.00	REPSOL SA	EUR	300,008.14	248,493.93	0.77
Servizi di telecomunicazione			121,156.44	115,022.03	0.36
29,186.00	TELEFONICA SA	EUR	121,156.44	115,022.03	0.36
IRLANDA			881,597.02	895,643.36	2.79
Industria			699,648.03	704,336.16	2.19
8,844.00	KINGSPAN GROUP PLC	EUR	699,648.03	704,336.16	2.19
Beni di prima necessità			181,948.99	191,307.20	0.60
1,624.00	KERRY GROUP PLC -A-	EUR	181,948.99	191,307.20	0.60
FINLANDIA			284,564.86	411,316.76	1.28
Energia			134,584.91	239,144.84	0.74
4,631.00	NESTE OYJ	EUR	134,584.91	239,144.84	0.74
Finanza			149,979.95	172,171.92	0.54
4,442.00	SAMPO OYJ -A-	EUR	149,979.95	172,171.92	0.54
AUSTRIA			330,231.43	295,198.54	0.92
Finanza			330,231.43	295,198.54	0.92
9,541.00	ERSTE GROUP BANK AG	EUR	330,231.43	295,198.54	0.92
Warrants			0.02	1,118.25	0.01
ITALIA			0.02	1,118.25	0.01
Beni voluttuari			0.02	1,118.25	0.01
17,750.00	SOSTRAVEL.COM SPA 31/12/2021	EUR	0.02	1,118.25	0.01
Totale del Portafoglio Titoli			28,129,125.40	30,806,428.93	95.95

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 2021 IN EUR****Attività**

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	33,498,261.69
Liquidità bancarie a vista		1,071,341.98
Importi dovuti dai broker	(Nota 12)	3,036,325.79
Utili non realizzati su contratti futures	(Note 2d, 12)	4,013.91
Dividendi da ricevere		9,475.03
Da ricevere su sottoscrizioni		105,932.42
Altre attività		1,943.62
Totale attività		37,727,294.44

Passività

Scoperti bancari		-4,547.81
Perdite non realizzate su contratti futures	(Note 2d, 12)	-813,399.53
Altre passività		-132,807.10
Totale passività		-950,754.44

Totale attivo netto**36,776,540.00**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	119.72	30,443.694
Azione I	EUR	132.02	249,109.029
Azione L	EUR	130.64	1,876.000

NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)**PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR**

Attivo netto all'inizio del periodo		29,294,698.45
Risultato netto degli investimenti		137,430.66
Totale ricavi		137,430.66
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-154,396.82
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 7)	-9,262.84
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-2,408.95
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 7)	-22,061.16
Commissioni del Transfer Agent		-3,710.50
Compensi professionali	(Nota 8)	-3,890.90
Pubblicazioni		-2,390.48
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-6,462.68
Totale costi		-204,584.33
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		-67,153.67
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	3,352,962.58
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		-39,416.89
- di contratti futures		-3,024,763.29
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		4,139,257.76
- su contratti di cambio a termine e su valute estere		61,393.63
- su contratti futures		-930,992.03
Risultato netto delle operazioni per il periodo		3,491,288.09
Sottoscrizioni del periodo		7,271,042.81
Rimborsi del periodo		-3,280,489.35
Attivo netto alla fine del periodo		36,776,540.00

NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			22,523,507.55	33,498,261.69	91.09
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			22,521,774.08	33,496,556.45	91.08
Azioni			20,402,629.38	31,265,000.72	85.01
STATI UNITI			17,632,974.38	27,461,961.74	74.67
Informatica			3,447,794.34	6,249,273.81	16.99
16,800.00	APPLE INC	USD	909,828.41	1,940,236.83	5.28
8,000.00	MICROSOFT CORP	USD	1,061,556.83	1,827,471.89	4.97
1,000.00	NVIDIA CORP	USD	234,411.41	674,677.12	1.83
1,900.00	SALESFORCE.COM INC	USD	352,091.59	391,359.11	1.06
2,750.00	QUALCOMM INC	USD	214,476.86	331,442.20	0.90
600.00	ADOBE INC	USD	146,190.55	296,301.40	0.81
2,000.00	APPLIED MATERIALS INC	USD	98,210.58	240,155.04	0.65
5,000.00	INTEL CORP	USD	163,384.11	236,697.75	0.64
2,000.00	NETAPP INC	USD	85,173.89	137,987.96	0.38
5,000.00	PALANTIR TECHNOLOGIES INC -A-	USD	119,150.78	111,139.16	0.30
500.00	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP	USD	63,319.33	61,805.35	0.17
Finanza			4,205,691.27	5,893,414.31	16.03
3,300.00	PAYPAL HOLDINGS INC	USD	499,804.46	811,100.03	2.21
22,000.00	BANK OF AMERICA CORP	USD	586,640.15	764,870.18	2.08
2,350.00	MASTERCARD INC -A-	USD	534,890.59	723,468.31	1.97
5,000.00	JPMORGAN CHASE & CO	USD	477,710.82	655,788.53	1.78
2,500.00	VISA INC -A-	USD	262,826.33	492,916.53	1.34
9,000.00	WELLS FARGO & CO	USD	340,114.64	343,713.46	0.93
3,500.00	MORGAN STANLEY	USD	143,223.46	270,608.69	0.74
800.00	GOLDMAN SACHS GROUP INC	USD	199,135.28	256,028.21	0.70
5,000.00	US BANCORP	USD	192,584.86	240,197.20	0.65
4,000.00	CITIGROUP INC	USD	231,379.60	238,637.20	0.65
350.00	EQUINIX INC	USD	141,668.20	236,874.83	0.64
1,000.00	BERKSHIRE HATHAWAY INC -B-	USD	171,982.60	234,353.54	0.64
2,000.00	SIMON PROPERTY GROUP INC	USD	113,291.71	220,052.17	0.60
750.00	AMERICAN TOWER CORP	USD	155,904.00	170,844.84	0.46
200.00	BLACKROCK INC	USD	77,085.51	147,562.12	0.40
2,000.00	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	USD	77,449.06	86,398.47	0.24
Servizi di telecomunicazione			3,161,281.23	5,851,990.17	15.91
535.00	AMAZON.COM INC	USD	716,654.68	1,551,972.92	4.22
700.00	ALPHABET INC -A-	USD	478,617.24	1,441,312.21	3.92
3,000.00	FACEBOOK INC -A-	USD	483,657.17	879,609.98	2.39
150.00	ALPHABET INC -C-	USD	219,172.31	317,014.77	0.86
1,000.00	PALO ALTO NETWORKS INC	USD	228,603.23	312,884.57	0.85
700.00	NETFLIX INC	USD	223,398.94	311,785.83	0.85
500.00	CHARTER COMMUNICATIONS INC -A-	USD	162,057.67	304,178.11	0.83
6,000.00	VERIZON COMMUNICATIONS INC	USD	287,385.74	283,480.76	0.77
4,000.00	COMCAST CORP -A-	USD	138,582.16	192,326.41	0.52
1,000.00	WALT DISNEY CO	USD	90,329.79	148,216.47	0.40
4,500.00	AT&T INC	USD	132,822.30	109,208.14	0.30
Salute			2,157,058.02	2,832,162.77	7.70
1,350.00	UNITEDHEALTH GROUP INC	USD	351,885.07	455,851.03	1.24
1,500.00	AMGEN INC	USD	251,597.18	308,309.99	0.84
2,000.00	JOHNSON & JOHNSON	USD	221,080.67	277,831.04	0.75
2,500.00	ABBVIE INC	USD	196,467.60	237,456.67	0.65
4,000.00	GILEAD SCIENCES INC	USD	228,161.36	232,262.30	0.63
1,000.00	DANAHER CORP	USD	89,856.06	226,292.15	0.61
2,000.00	ABBOTT LABORATORIES	USD	82,194.69	195,513.86	0.53
3,000.00	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	USD	102,972.18	169,036.09	0.46
5,000.00	PFIZER INC	USD	164,081.88	165,106.59	0.45
500.00	BIOGEN INC	USD	114,897.03	145,994.53	0.40
2,000.00	MERCK & CO INC	USD	95,105.16	131,157.71	0.36
250.00	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	USD	94,344.94	106,347.45	0.29

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

NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
1,500.00	CVS HEALTH CORP	USD	91,161.61	105,540.04	0.29
1,000.00	BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	USD	68,816.86	70,360.03	0.19
200.00	ORGANON & CO	USD	4,435.73	5,103.29	0.01
Beni voluttuari			1,426,747.26	2,369,760.62	6.44
1,450.00	LULULEMON ATHLETICA INC	USD	282,901.33	446,248.62	1.21
3,000.00	NIKE INC -B-	USD	230,140.61	390,816.91	1.06
2,500.00	PROCTER & GAMBLE CO	USD	207,390.55	284,446.27	0.77
1,400.00	MCDONALD'S CORP	USD	204,605.87	272,692.33	0.74
1,000.00	HOME DEPOT INC	USD	73,860.03	268,901.12	0.73
1,000.00	LOWE'S COS INC	USD	84,864.62	163,563.46	0.45
700.00	TARGET CORP	USD	36,543.56	142,691.56	0.39
1,000.00	WALMART INC	USD	76,576.63	118,913.85	0.32
750.00	GLOBAL PAYMENTS INC	USD	112,460.68	118,606.06	0.32
1,000.00	STARBUCKS CORP	USD	53,156.08	94,282.78	0.26
1,000.00	COLGATE-PALMOLIVE CO	USD	64,247.30	68,597.66	0.19
Industria			1,280,247.09	1,808,543.67	4.92
1,500.00	UNION PACIFIC CORP	USD	191,423.47	278,180.99	0.76
1,500.00	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	USD	182,444.49	277,447.37	0.75
1,500.00	UNITED PARCEL SERVICE INC -B-	USD	141,887.33	263,053.25	0.72
1,000.00	FEDEX CORP	USD	167,717.05	251,564.09	0.68
3,000.00	BALL CORP	USD	205,908.74	204,958.16	0.56
1,000.00	CATERPILLAR INC	USD	105,427.14	183,514.54	0.50
1,000.00	3M CO	USD	150,658.12	167,492.96	0.46
1,500.00	EMERSON ELECTRIC CO	USD	86,158.25	121,730.27	0.33
300.00	BOEING CO	USD	48,622.50	60,602.04	0.16
Servizi di pubblica utilità			851,909.48	884,332.13	2.40
6,500.00	NEXTERA ENERGY INC	USD	400,982.37	401,652.55	1.09
4,000.00	SOUTHERN CO	USD	173,186.45	204,098.05	0.56
2,000.00	DUKE ENERGY CORP	USD	158,059.15	166,489.50	0.45
3,000.00	EXELON CORP	USD	119,681.51	112,092.03	0.30
Energia			600,903.44	869,807.31	2.37
1,500.00	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	USD	118,203.12	349,569.77	0.95
3,000.00	CONOCOPHILLIPS	USD	110,462.19	154,060.13	0.42
2,500.00	EXXON MOBIL CORP	USD	177,427.94	132,979.11	0.36
1,500.00	VALERO ENERGY CORP	USD	73,632.21	98,760.39	0.27
1,000.00	CHEVRON CORP	USD	78,879.53	88,321.06	0.24
3,000.00	KINDER MORGAN INC	USD	42,298.45	46,116.85	0.13
Beni di prima necessità			343,778.54	498,043.44	1.35
4,500.00	COCA-COLA CO	USD	173,540.69	205,324.97	0.56
1,500.00	PEPSICO INC	USD	89,800.42	187,414.53	0.51
2,000.00	MONDELEZ INTERNATIONAL INC -A-	USD	80,437.43	105,303.94	0.28
Materie prime			157,563.71	204,633.51	0.56
2,000.00	DOW INC	USD	70,370.10	106,720.58	0.29
1,500.00	DUPONT DE NEMOURS INC	USD	87,193.61	97,912.93	0.27
GIAPPONE			2,053,013.73	2,830,067.91	7.70
Industria			537,496.91	745,053.09	2.03
2,100.00	OMRON CORP	JPY	107,805.73	141,198.61	0.38
5,700.00	KOMATSU LTD	JPY	119,188.31	121,601.75	0.33
200.00	KEYENCE CORP	JPY	35,904.01	85,440.93	0.23
1,000.00	SCREEN HOLDINGS CO LTD	JPY	42,259.33	80,532.97	0.22
1,100.00	MURATA MANUFACTURING CO LTD	JPY	47,593.46	70,668.44	0.19
5,000.00	mitsubishi electric corp	JPY	56,130.38	57,550.69	0.16
100.00	SMC CORP	JPY	24,485.22	49,565.77	0.14
1,200.00	YASKAWA ELECTRIC CORP	JPY	37,298.10	49,504.99	0.14
1,000.00	HITACHI LTD	JPY	27,118.20	48,221.02	0.13
200.00	FANUC CORP	JPY	39,714.17	40,767.92	0.11

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

NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Beni voluttuari			494,440.12	673,145.86	1.83
2,700.00	TOYOTA MOTOR CORP	JPY	151,968.68	198,772.09	0.54
4,000.00	YAMAHA MOTOR CO LTD	JPY	53,664.17	91,777.20	0.25
3,700.00	AEON CO LTD	JPY	49,753.43	83,699.21	0.23
800.00	SONY CORP	JPY	48,911.99	66,492.88	0.18
9,000.00	MARUBENI CORP	JPY	46,508.39	65,894.96	0.18
6,600.00	PANASONIC CORP	JPY	63,627.96	64,183.26	0.17
3,000.00	SEKISUI HOUSE LTD	JPY	40,916.58	51,442.34	0.14
1,500.00	UNICHARM CORP	JPY	39,088.92	50,883.92	0.14
Informatica			348,661.69	580,062.28	1.58
700.00	TOKYO ELECTRON LTD	JPY	150,049.47	254,955.23	0.69
1,700.00	FUJIFILM HOLDINGS CORP	JPY	58,648.69	105,107.68	0.29
1,300.00	ADVANTEST CORP	JPY	56,830.64	97,087.82	0.26
400.00	FUJITSU LTD	JPY	22,797.52	62,238.31	0.17
3,000.00	SUMCO CORP	JPY	60,335.37	60,673.24	0.17
Salute			400,736.73	465,800.43	1.27
1,300.00	SYSMEX CORP	JPY	71,429.25	127,112.94	0.35
3,600.00	TERUMO CORP	JPY	90,619.91	121,246.19	0.33
7,000.00	ASTELLAS PHARMA INC	JPY	99,422.93	101,923.59	0.28
2,000.00	OTSUKA HOLDINGS CO LTD	JPY	73,789.22	70,078.88	0.19
1,600.00	TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD	JPY	65,475.42	45,438.83	0.12
Materie prime			66,924.20	149,836.91	0.41
800.00	SHIN-ETSU CHEMICAL CO LTD	JPY	40,858.47	114,417.60	0.31
2,000.00	MITSUBISHI GAS CHEMICAL CO INC	JPY	26,065.73	35,419.31	0.10
Finanza			146,144.44	137,961.19	0.37
2,900.00	NOMURA REAL ESTATE HOLDINGS INC	JPY	49,434.95	61,448.94	0.17
10,600.00	NOMURA HOLDINGS INC	JPY	62,802.31	45,605.82	0.12
2,000.00	DAI-ICHI LIFE HOLDINGS INC	JPY	33,907.18	30,906.43	0.08
Beni di prima necessità			58,609.64	78,208.15	0.21
2,000.00	ASAHI GROUP HOLDINGS LTD	JPY	58,609.64	78,208.15	0.21
IRLANDA			382,450.30	582,211.53	1.58
Informatica			221,791.46	372,868.52	1.01
1,500.00	ACCENTURE PLC -A-	USD	221,791.46	372,868.52	1.01
Salute			160,658.84	209,343.01	0.57
2,000.00	MEDTRONIC PLC	USD	160,658.84	209,343.01	0.57
ISOLE CAYMAN			209,119.67	239,037.74	0.65
Servizi di telecomunicazione			209,119.67	239,037.74	0.65
1,250.00	ALIBABA GROUP HOLDING LTD -ADR-	USD	209,119.67	239,037.74	0.65
REGNO UNITO			125,071.30	151,721.80	0.41
Salute			125,071.30	151,721.80	0.41
1,500.00	ASTRAZENECA PLC	GBP	125,071.30	151,721.80	0.41
Azioni di OICR			2,119,144.70	2,231,555.73	6.07
IRLANDA			1,686,911.84	1,721,591.26	4.68
Finanza			1,686,911.84	1,721,591.26	4.68
79,600.00	ISHARES CORE FTSE 100 UCITS ETF	GBP	639,772.64	638,509.00	1.74
12,300.00	VANGUARD FTSE 250 UCITS ETF	GBP	454,522.51	518,896.26	1.41
15,000.00	L&G E FUND MSCI CHINA A UCITS ETF	EUR	273,845.65	279,630.00	0.76
18,000.00	HSBC HANG SENG TECH UCITS ETF	EUR	202,515.32	171,396.00	0.46
10,000.00	ISHARES GLOBAL CLEAN ENERGY UCITS ETF	EUR	116,255.72	113,160.00	0.31

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

NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)**PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR**

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
LUSSEMBURGO			432,232.86	509,964.47	1.39
Finanza			432,232.86	509,964.47	1.39
40,580.00	LYXOR FTSE 100 UCITS ETF	GBP	432,232.86	509,964.47	1.39
ALTRI VALORI MOBILIARI			1,733.47	1,705.24	0.01
Azioni			1,733.47	1,705.24	0.01
ITALIA			1,733.47	1,705.24	0.01
Servizi di telecomunicazione			1,733.47	1,705.24	0.01
1,463,856.00	TELEUNIT SPA	GBP	1,733.47	1,705.24	0.01
Totale del Portafoglio Titoli			22,523,507.55	33,498,261.69	91.09

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 2021

Valore nominale	Quantità	Acquisto / Vendita	Contratto	Scadenza	Valore di mercato al 30 Giugno 2021	Valuta	Plus/(minus) valenza non realizzata (EUR)	Impegno (EUR)
							-809,385.62	34,085,636.21
10	20	Acquisto	SWISS MARKET INDEX	17/09/2021	10,878.62	CHF	4,013.91	2,175,723.25
125,000	16	Acquisto	EURO/GBP CURRENCY	13/09/2021	1.00	GBP	-4,521.25	2,002,338.73
10	8	Acquisto	FTSE 100 INDEX	17/09/2021	8,131.55	GBP	-12,394.49	650,524.20
1,000	16	Acquisto	CBOE VIX	21/07/2021	15.10	USD	-15,201.27	241,548.75
125,000	22	Acquisto	EURO/JPY CURRENCY	13/09/2021	1.00	JPY	-34,539.91	2,752,233.32
125,000	210	Acquisto	EURO FX CURRENCY	13/09/2021	1.00	USD	-746,742.61	26,263,267.96

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 2021 IN EUR

Attività

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	13,042,211.34
Liquidità bancarie a vista		1,054,522.01
Importi dovuti dai broker	(Nota 12)	77,818.79
Interessi da ricevere		65,898.91
Altre attività		4,666.87
Totale attività		14,245,117.92

Passività

Altre passività		-47,386.49
Totale passività		-47,386.49

Totale attivo netto**14,197,731.43**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	133.22	18,860.438
Azione D	EUR	94.03	387.287
Azione I	EUR	138.26	66,760.121
Azione L	EUR	136.58	17,686.000
Azione Y	EUR	137.55	21.122

NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term

PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Attivo netto all'inizio del periodo		14,317,026.52
Risultato netto degli investimenti		60,193.55
Totale ricavi		60,193.55
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-34,246.77
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 7)	-3,961.57
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-1,638.44
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 7)	-11,838.14
Commissioni del Transfer Agent		-1,652.53
Compensi professionali	(Nota 8)	-848.72
Pubblicazioni		-2,174.35
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-4,443.95
Totale costi		-60,804.47
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		-610.92
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	-38,827.98
- di contratti futures		-14,396.80
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		-10,377.76
Risultato netto delle operazioni per il periodo		-64,213.46
Distribuzioni di dividendi	(Nota 13)	-337.01
Sottoscrizioni del periodo		694,358.44
Rimborsi del periodo		-749,103.06
Attivo netto alla fine del periodo		14,197,731.43

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

NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			13,127,396.75	13,042,211.34	91.86
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			13,127,396.75	13,042,211.34	91.86
Obbligazioni ordinarie			7,134,578.75	6,968,587.49	49.08
ITALIA			2,155,894.82	2,153,445.00	15.17
Finanza			1,936,039.92	1,938,646.00	13.66
1,000,000.00	CASSA DEPOSITI E PRESTITI SPA 1.50% 20/04/2023	EUR	1,035,687.92	1,031,850.00	7.27
500,000.00	CASSA DEPOSITI E PRESTITI SPA 2.13% 21/03/2026	EUR	551,510.52	546,300.00	3.85
150,000.00	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA 1.00% 08/09/2027	EUR	149,405.74	154,707.00	1.09
100,000.00	AMCO - ASSET MANAGEMENT CO SPA 1.50% 17/07/2023	EUR	99,791.90	103,259.00	0.73
100,000.00	BANCA DEL MEZZOGIORNO-MEDIOCREDITO CENTRALE SPA 1.50% 24/10/2024	EUR	99,643.84	102,530.00	0.72
Industria			120,607.22	114,836.00	0.81
100,000.00	LEONARDO SPA 4.88% 24/03/2025	EUR	120,607.22	114,836.00	0.81
Energia			99,247.68	99,963.00	0.70
100,000.00	ERG SPA 0.50% 11/09/2027	EUR	99,247.68	99,963.00	0.70
GERMANIA			1,463,160.66	1,398,041.69	9.85
Enti Governativi			634,981.25	623,127.89	4.39
583,000.00	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 1.00% 15/08/2025	EUR	634,981.25	623,127.89	4.39
Finanza			594,453.68	540,124.20	3.81
540,000.00	KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 3.50% 04/07/2021	EUR	594,453.68	540,124.20	3.81
Servizi di pubblica utilità			134,135.91	133,629.60	0.94
130,000.00	E.ON SE 0.88% 22/05/2024	EUR	134,135.91	133,629.60	0.94
Salute			99,589.82	101,160.00	0.71
100,000.00	BAYER AG 0.38% 06/07/2024	EUR	99,589.82	101,160.00	0.71
SPAGNA			1,214,161.47	1,209,474.00	8.52
Enti Governativi			1,214,161.47	1,209,474.00	8.52
900,000.00	INSTITUTO DE CREDITO OFICIAL 0.10% 30/07/2021	EUR	900,127.91	900,441.00	6.34
300,000.00	FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO FTA 0.85% 17/12/2023	EUR	314,033.56	309,033.00	2.18
FRANCIA			631,637.09	612,282.60	4.31
Enti Governativi			532,318.38	510,978.60	3.60
300,000.00	CAISSE D'AMORTISSEMENT DE LA DETTE SOCIALE REG 0.13% 25/10/2023	EUR	306,416.52	304,449.00	2.14
204,000.00	FRANCE REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 3.25% 25/10/2021	EUR	225,901.86	206,529.60	1.46
Finanza			99,318.71	101,304.00	0.71
100,000.00	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD SE 0.63% 04/05/2027	EUR	99,318.71	101,304.00	0.71
LUSSEMBURGO			565,125.43	518,670.00	3.65
Sovranazionale			565,125.43	518,670.00	3.65
500,000.00	EIB 2.25% 14/10/2022	EUR	565,125.43	518,670.00	3.65
POLONIA			437,763.58	428,596.98	3.02
Enti Governativi			437,763.58	428,596.98	3.02
427,000.00	REPUBLIC OF POLAND GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 0.88% 14/10/2021	EUR	437,763.58	428,596.98	3.02
PORTOGALLO			394,424.29	375,787.50	2.65
Enti Governativi			394,424.29	375,787.50	2.65
250,000.00	PORTUGAL OBRIGACOES DO TESOURO OT 2.20% 17/10/2022	EUR	270,541.14	259,302.50	1.83
100,000.00	PORTUGAL OBRIGACOES DO TESOURO OT 5.65% 15/02/2024	EUR	123,883.15	116,485.00	0.82

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

NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
PAESI BASSI			172,371.41	170,605.72	1.20
Servizi di pubblica utilità			172,371.41	170,605.72	1.20
100,000.00	IBERDROLA INTERNATIONAL BV 1.88% 08/10/2024	EUR	108,921.04	106,822.00	0.75
59,000.00	INNOGY FINANCE BV 3.00% 17/01/2024	EUR	63,450.37	63,783.72	0.45
AUSTRALIA			100,040.00	101,684.00	0.71
Beni voluttuari			100,040.00	101,684.00	0.71
100,000.00	TOYOTA FINANCE AUSTRALIA LTD 1.58% 21/04/2022	EUR	100,040.00	101,684.00	0.71
Obbligazioni a tasso variabile			2,590,361.04	2,625,868.33	18.49
ITALIA			2,490,685.19	2,524,211.33	17.78
Enti Governativi			1,782,880.11	1,814,263.22	12.78
1,093,000.00	CCT FRN 15/09/2025	EUR	1,064,517.60	1,100,323.10	7.75
708,000.00	CCT FRN 15/12/2022	EUR	718,362.51	713,940.12	5.03
Finanza			558,896.04	561,380.61	3.95
430,000.00	CASSA DEPOSITI E PRESTITI SPA FRN 20/03/2022	EUR	431,922.74	431,062.10	3.03
127,000.00	ICCREA BANCA SPA FRN 20/10/2025	EUR	126,973.30	130,318.51	0.92
Servizi di pubblica utilità			148,909.04	148,567.50	1.05
150,000.00	ENEL SPA FRN 31/12/2099	EUR	148,909.04	148,567.50	1.05
FRANCIA			99,675.85	101,657.00	0.71
Finanza			99,675.85	101,657.00	0.71
100,000.00	SOCIETE GENERALE SA FRN 22/09/2028	EUR	99,675.85	101,657.00	0.71
Obbligazioni zero coupon			2,480,645.58	2,501,146.75	17.62
ITALIA			671,359.16	690,572.75	4.86
Enti Governativi			420,816.48	440,495.25	3.10
407,790.46	BTP 0.00% 26/05/2025	EUR	420,816.48	440,495.25	3.10
Servizi di pubblica utilità			250,542.68	250,077.50	1.76
250,000.00	ACEA SPA 0.00% 28/09/2025	EUR	250,542.68	250,077.50	1.76
GERMANIA			552,365.85	550,121.00	3.88
Industria			552,365.85	550,121.00	3.88
550,000.00	DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH 0.00% 19/07/2021	EUR	552,365.85	550,121.00	3.88
SPAGNA			505,772.23	505,250.00	3.56
Enti Governativi			505,772.23	505,250.00	3.56
500,000.00	INSTITUTO DE CREDITO OFICIAL 0.00% 30/04/2026	EUR	505,772.23	505,250.00	3.56
FRANCIA			302,941.12	303,355.00	2.14
Finanza			203,141.22	202,668.00	1.43
200,000.00	AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT EPIC REG 0.00% 25/03/2025	EUR	203,141.22	202,668.00	1.43
Industria			99,799.90	100,687.00	0.71
100,000.00	SCHNEIDER ELECTRIC SE 0.00% 12/06/2023	EUR	99,799.90	100,687.00	0.71
PAESI BASSI			248,235.26	251,680.00	1.77
Servizi di pubblica utilità			248,235.26	251,680.00	1.77
250,000.00	ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 0.00% 17/06/2024	EUR	248,235.26	251,680.00	1.77
CINA			199,971.96	200,168.00	1.41
Finanza			199,971.96	200,168.00	1.41
200,000.00	BANK OF CHINA LTD/LUXEMBOURG 0.00% 28/04/2024	EUR	199,971.96	200,168.00	1.41

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

NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Azioni di OICR			921,811.38	946,608.77	6.67
LUSSEMBURGO			636,811.28	655,901.49	4.62
Finanza			636,811.28	655,901.49	4.62
3,226.81	EURIZON FUND - SECURITIZED BOND FUND -Z-	EUR	326,811.22	328,231.01	2.31
2,437.30	CB-ACCENT LUX - SWAN SHORT-TERM HIGH YIELD -A-	EUR	310,000.06	327,670.48	2.31
IRLANDA			285,000.10	290,707.28	2.05
Finanza			285,000.10	290,707.28	2.05
63,863.64	TENDERCAPITAL BOND TWO STEPS FUND -IA-	EUR	285,000.10	290,707.28	2.05
Totale del Portafoglio Titoli			13,127,396.75	13,042,211.34	91.86

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 2021 IN EUR

Attività

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	116,269,539.54
Liquidità bancarie a vista		9,860,162.78
Importi dovuti dai broker	(Nota 12)	2,863,906.32
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	(Note 2c, 12)	9,719.07
Interessi da ricevere		705,040.00
Da ricevere su sottoscrizioni		447,789.67
Altre attività		10,330.89
Totale attività		130,166,488.27

Passività

Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	(Note 2c, 12)	-772,260.40
Perdite non realizzate su contratti futures	(Note 2d, 12)	-131,423.92
Perdite non realizzate su contratti swap	(Note 2f, 12)	-53,686.12
Interessi da pagare su contratti swap		-503.10
Da pagare su rimborsi		-55,799.29
Altre passività		-567,737.35
Totale passività		-1,581,410.18

Totale attivo netto**128,585,078.09**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	155.24	179,160.028
Azione A (H-CHF)	CHF	97.17	5,102.000
Azione A (H-USD)	USD	107.80	4,535.036
Azione D	EUR	90.78	121,621.069
Azione I	EUR	162.80	545,660.775
Azione L	EUR	161.13	224.000

NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond**PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR**

Attivo netto all'inizio del periodo		130,564,627.77
Risultato netto degli investimenti		1,747,387.86
Totale ricavi		1,747,387.86
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-522,267.18
Commissioni sulla performance	(Nota 6)	-184,832.78
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 7)	-33,808.41
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-13,695.54
Interessi pagati su contratti swap		-503.10
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 7)	-48,335.74
Commissioni del Transfer Agent		-7,098.82
Compensi professionali	(Nota 8)	-5,438.31
Pubblicazioni		-4,286.48
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-18,670.00
Totale costi		-838,936.36
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		908,451.50
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	3,039,893.97
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		-1,002,855.06
- di contratti futures		-938,701.40
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		1,549,929.42
- su contratti di cambio a termine e su valute estere		-1,016,905.90
- su contratti futures		-48,969.79
- su contratti swap		-53,686.12
Risultato netto delle operazioni per il periodo		2,437,156.62
Distribuzioni di dividendi	(Nota 13)	-212,047.12
Sottoscrizioni del periodo		27,851,171.41
Rimborsi del periodo		-32,055,830.59
Attivo netto alla fine del periodo		128,585,078.09

NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			111,992,731.82	116,269,539.54	90.42
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			106,826,115.69	110,964,829.83	86.30
Obbligazioni ordinarie			53,204,115.98	53,456,865.46	41.57
ITALIA			31,347,477.28	31,779,996.80	24.71
Enti Governativi			27,853,147.28	28,135,831.80	21.88
10,074,200.00	BTP 0.40% 11/04/2024	EUR	10,418,688.62	10,397,581.82	8.09
10,000,000.00	BTP 2.15% 15/12/2021	EUR	10,143,900.00	10,123,300.00	7.87
4,027,440.00	BTP 0.65% 28/10/2027	EUR	4,027,440.00	4,275,530.30	3.32
3,500,000.00	REPUBLIC OF ITALY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.25% 17/02/2026	USD	2,843,464.80	2,915,484.68	2.27
100,000.00	BTP 2.10% 15/07/2026	EUR	110,913.00	109,970.00	0.09
100,000.00	BTP 1.85% 01/07/2025	EUR	107,396.80	107,500.00	0.08
100,699.00	BTP 0.35% 24/10/2024	EUR	101,324.48	104,445.00	0.08
100,000.00	BTP 0.50% 01/02/2026	EUR	100,019.58	102,020.00	0.08
Finanza			3,494,330.00	3,644,165.00	2.83
3,500,000.00	AZIMUT HOLDING SPA REG 1.63% 12/12/2024	EUR	3,494,330.00	3,644,165.00	2.83
REGNO UNITO			5,761,993.89	5,937,551.28	4.62
Sovranazionale			3,785,943.89	3,896,871.28	3.03
25,000,000.00	EUROPEAN BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT 5.00% 27/01/2025	BRL	3,785,943.89	3,896,871.28	3.03
Beni voluttuari			1,976,050.00	2,040,680.00	1.59
2,000,000.00	FCE BANK PLC 1.62% 11/05/2023	EUR	1,976,050.00	2,040,680.00	1.59
LUSSEMBURGO			5,404,697.95	5,082,973.66	3.95
Sovranazionale			2,916,639.89	3,077,131.83	2.39
20,000,000.00	INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT 5.00% 22/01/2026	BRL	2,916,639.89	3,077,131.83	2.39
Finanza			1,565,491.01	1,084,785.65	0.84
6,134,375.00	SWISS INSURED BRAZIL POWER FINANCE SARL 9.85% 16/07/2032	BRL	1,565,491.01	1,084,785.65	0.84
Energia			922,567.05	921,056.18	0.72
1,000,000.00	GAZPROM PJSC VIA GAZ CAPITAL SA 1.45% 06/03/2023	CHF	922,567.05	921,056.18	0.72
HONG KONG			2,023,021.13	2,122,724.24	1.65
Materie prime			2,023,021.13	2,122,724.24	1.65
1,200,000.00	CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 4.88% 14/03/2025	USD	1,024,641.13	1,110,194.24	0.86
1,000,000.00	CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 1.75% 14/06/2022	EUR	998,380.00	1,012,530.00	0.79
MESSICO			2,024,665.00	2,008,640.00	1.56
Energia			2,024,665.00	2,008,640.00	1.56
2,000,000.00	PETROLEOS MEXICANOS 1.88% 21/04/2022	EUR	2,024,665.00	2,008,640.00	1.56
FILIPPINE			1,407,904.72	1,383,618.60	1.08
Sovranazionale			1,407,904.72	1,383,618.60	1.08
120,000,000.00	ASIAN DEVELOPMENT BANK 5.90% 20/12/2022	INR	1,407,904.72	1,383,618.60	1.08
STATI UNITI			1,414,018.03	1,242,677.79	0.97
Industria			912,992.00	898,844.31	0.70
1,000,000.00	BOEING CO 4.51% 01/05/2023	USD	912,992.00	898,844.31	0.70
Sovranazionale			501,026.03	343,833.48	0.27
2,000,000.00	INTERNATIONAL FINANCE CORP 8.25% 30/01/2023	BRL	501,026.03	343,833.48	0.27

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

NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
ISOLE CAYMAN			1,178,336.43	1,190,052.53	0.92
Finanza			1,178,336.43	1,190,052.53	0.92
1,400,000.00	QNB FINANCE LTD 1.63% 22/09/2025	USD	1,178,336.43	1,190,052.53	0.92
CINA			1,048,170.01	1,077,518.30	0.84
Sovranazionale			641,565.82	658,963.72	0.51
5,000,000.00	ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.90% 05/03/2024	CNY	641,565.82	658,963.72	0.51
Finanza			406,604.19	418,554.58	0.33
3,200,000.00	BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD 3.15% 22/01/2022	CNY	406,604.19	418,554.58	0.33
ISOLE VERGINI BRITANNICHE			844,798.92	839,083.82	0.65
Beni di prima necessità			844,798.92	839,083.82	0.65
1,000,000.00	YILI HOLDING INVESTMENT LTD 1.63% 19/11/2025	USD	844,798.92	839,083.82	0.65
KAZAKHSTAN			749,032.62	792,028.44	0.62
Sovranazionale			749,032.62	792,028.44	0.62
900,000.00	EURASIAN DEVELOPMENT BANK 4.77% 20/09/2022	USD	749,032.62	792,028.44	0.62
Obbligazioni a tasso variabile			24,898,508.24	26,586,499.43	20.68
ITALIA			13,192,580.04	14,483,998.18	11.26
Finanza			12,102,121.91	13,315,585.48	10.35
4,000,000.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA FRN 29/06/2049	GBP	4,434,534.41	5,416,903.48	4.21
3,200,000.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA FRN 30/11/2049	EUR	3,527,887.50	3,609,952.00	2.81
3,000,000.00	UNICREDIT SPA REG FRN 15/01/2032	EUR	3,000,000.00	3,072,420.00	2.39
1,000,000.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA FRN 08/06/2048	EUR	1,139,700.00	1,216,310.00	0.94
Servizi di pubblica utilità			1,090,458.13	1,168,412.70	0.91
1,191,000.00	ENEL SPA FRN 24/09/2073	USD	1,090,458.13	1,168,412.70	0.91
PAESI BASSI			3,118,073.37	3,256,640.81	2.53
Finanza			2,105,473.37	2,169,720.81	1.69
3,000,000.00	AEGON NV FRN 29/06/2049	NLG	1,184,366.37	1,286,780.02	1.00
1,000,000.00	ING GROEP NV REG FRN 31/12/2099	USD	921,107.00	882,940.79	0.69
Beni di prima necessità			500,000.00	546,100.00	0.42
500,000.00	JT INTERNATIONAL FINANCIAL SERVICES BV FRN 07/10/2083	EUR	500,000.00	546,100.00	0.42
Beni voluttuari			512,600.00	540,820.00	0.42
500,000.00	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN 31/12/2099	EUR	512,600.00	540,820.00	0.42
REGNO UNITO			2,380,930.50	2,427,427.00	1.89
Energia			1,336,600.50	1,352,567.00	1.05
1,500,000.00	BP CAPITAL MARKETS PLC FRN 31/12/2099	USD	1,336,600.50	1,352,567.00	1.05
Finanza			1,044,330.00	1,074,860.00	0.84
1,000,000.00	VIRGIN MONEY UK PLC FRN 24/06/2025	EUR	1,044,330.00	1,074,860.00	0.84
ISOLE VERGINI BRITANNICHE			2,087,054.42	2,152,933.41	1.68
Servizi di pubblica utilità			2,087,054.42	2,152,933.41	1.68
1,500,000.00	CHINA HUANENG GROUP HONG KONG TREASURY MANAGEMENT HOLDING LTD FRN 31/12/2099	USD	1,259,386.72	1,293,788.88	1.01
1,000,000.00	CHINA HUANENG GROUP HONG KONG TREASURY MANAGEMENT HOLDING LTD FRN 31/12/2099	USD	827,667.70	859,144.53	0.67
STATI UNITI			2,000,000.00	2,041,220.00	1.59
Servizi di telecomunicazione			2,000,000.00	2,041,220.00	1.59
2,000,000.00	AT&T INC FRN 31/12/2099	EUR	2,000,000.00	2,041,220.00	1.59

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

NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
HONG KONG			907,760.26	951,732.39	0.74
Finanza			907,760.26	951,732.39	0.74
1,200,000.00	HONGKONG & SHANGHAI BANKING CORP LTD FRN 29/07/2049	USD	907,760.26	951,732.39	0.74
GERMANIA			846,114.90	873,707.30	0.68
Finanza			846,114.90	873,707.30	0.68
1,000,000.00	ALLIANZ SE FRN 31/12/2099	USD	846,114.90	873,707.30	0.68
AUSTRALIA			365,994.75	398,840.34	0.31
Finanza			365,994.75	398,840.34	0.31
500,000.00	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD FRN 29/10/2049	USD	365,994.75	398,840.34	0.31
Obbligazioni zero coupon			28,723,491.47	30,921,464.94	24.05
ITALIA			28,723,491.47	30,921,464.94	24.05
Enti Governativi			28,723,491.47	30,921,464.94	24.05
28,625,685.00	BTP 0.00% 26/05/2025	EUR	28,723,491.47	30,921,464.94	24.05
NEGOZIATI SU UN ALTRO MERCATO REGOLAMENTATO			5,166,616.13	5,304,709.71	4.12
Obbligazioni ordinarie			5,166,616.13	5,304,709.71	4.12
STATI UNITI			5,166,616.13	5,304,709.71	4.12
Industria			2,962,366.85	2,913,460.89	2.26
1,500,000.00	LEONARDO US HOLDINGS INC 7.38% 15/07/2039	USD	1,682,678.88	1,656,968.56	1.29
1,250,000.00	LEONARDO US HOLDINGS INC 6.25% 15/01/2040	USD	1,279,687.97	1,256,492.33	0.97
Beni voluttuari			2,204,249.28	2,391,248.82	1.86
2,000,000.00	DELTA AIR LINES INC 7.00% 01/05/2025	USD	1,852,962.77	1,969,912.16	1.53
496,703.05	US AIRWAYS 2012-2 CLASS A PASS THROUGH TRUST 4.63% 03/06/2025	USD	351,286.51	421,336.66	0.33
Totale del Portafoglio Titoli			111,992,731.82	116,269,539.54	90.42

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

NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond

IMPEGNI SU ACQUISTO / VENDITA DI CONTRATTI FUTURES AL 30 GIUGNO 2021

Valore nominale	Quantità	Acquisto / Vendita	Contratto	Scadenza	Valore di mercato al 30 Giugno 2021	Valuta	Plus/(minus) valenza non realizzata (EUR)	Impegno (EUR)
							-131,423.92	20,111,530.14
100,000	-35	Vendita	US 10YR NOTE (CBT)	21/09/2021	111.73	USD	-21,673.92	3,910,530.14
100,000	-50	Vendita	EURO BTP	08/09/2021	151.41	EUR	-53,750.00	7,570,500.00
100,000	-50	Vendita	EURO BUND	08/09/2021	172.61	EUR	-56,000.00	8,630,500.00

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 2021

Scadenza	Impegno di acquisto di valute		Impegno di vendita di valute		Plus/(minus)-valenza non realizzata (EUR)
					-762,541.33
23/11/2021	8,811.40	EUR	9,700.00	CHF	-45.01
23/09/2021	925,930.99	EUR	1,015,000.00	CHF	-462.48
23/11/2021	488,000.00	CHF	450,885.58	EUR	-5,326.16
23/09/2021	4,870,223.55	EUR	4,220,000.00	GBP	-38,246.06
23/09/2021	23,366,825.78	EUR	28,000,000.00	USD	-204,070.96
15/07/2021	4,672,897.20	USD	25,000,000.00	BRL	-255,144.79
14/07/2021	3,661,796.48	USD	20,000,000.00	BRL	-268,964.94
23/11/2021	486,000.00	USD	398,822.90	EUR	9,710.87
23/11/2021	11,640.00	CHF	10,619.49	EUR	8.20

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

NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond**CONTRATTI SWAP AL 30 GIUGNO 2021**

Sottostante	Valuta	Posizione	Nominale	Controparte	Scadenza	Interessi da ricevere / pagare (EUR)	Plus/(minus) -valenza non realizzata(EUR)
EQUITY SWAP CONTRACTS						-503.10	-53,686.12
CITI VOLATILITY INDEX TOTAL RETURN	USD	L	2,545,780.00	CITIBANK NA	05/23/2022	-503.10	(53,686.12)

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

NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Attività

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	80,327,390.69
Liquidità bancarie a vista		2,026,630.52
Importi dovuti dai broker	(Nota 12)	335,027.16
Interessi da ricevere		471,474.83
Altre attività		8,140.01
Totale attività		83,168,663.21

Passività

Da pagare su rimborsi		-45,757.72
Altre passività		-167,953.82
Totale passività		-213,711.54

Totale attivo netto**82,954,951.67**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	139.96	25,126.130
Azione D	EUR	116.30	2,750.163
Azione I	EUR	148.24	476,560.215
Azione L	EUR	146.65	16,441.000
Azione Y	EUR	146.51	41,374.823

NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate

PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Attivo netto all'inizio del periodo		80,647,543.36
Risultato netto degli investimenti		521,050.02
Totale ricavi		521,050.02
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-202,032.87
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 7)	-22,699.45
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-5,380.10
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 7)	-20,241.93
Commissioni del Transfer Agent		-1,685.11
Compensi professionali	(Nota 8)	-4,737.69
Pubblicazioni		-3,594.53
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-11,600.35
Totale costi		-271,972.03
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		249,077.99
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	-88,188.62
- di contratti futures		43,517.00
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		-292,778.32
- su contratti di cambio a termine e su valute estere		-0.06
Risultato netto delle operazioni per il periodo		-88,372.01
Distribuzioni di dividendi	(Nota 13)	-32,239.97
Sottoscrizioni del periodo		6,656,649.97
Rimborsi del periodo		-4,228,629.68
Attivo netto alla fine del periodo		82,954,951.67

NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			80,175,540.40	80,327,390.69	96.83
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			80,175,540.40	80,327,390.69	96.83
Obbligazioni ordinarie			55,478,990.35	55,257,436.06	66.61
ITALIA			11,000,964.41	11,090,502.00	13.37
Servizi di pubblica utilità			4,382,657.86	4,384,301.00	5.29
1,500,000.00	A2A SPA 1.63% 19/10/2027	EUR	1,629,367.48	1,620,435.00	1.96
1,300,000.00	A2A SPA 1.75% 25/02/2025	EUR	1,346,594.15	1,376,856.00	1.66
900,000.00	IREN SPA 1.50% 24/10/2027	EUR	981,212.33	962,010.00	1.16
400,000.00	ERG SPA 1.88% 11/04/2025	EUR	425,483.90	425,000.00	0.51
Finanza			3,745,106.47	3,827,648.00	4.61
1,000,000.00	BANCA DEL MEZZOGIORNO-MEDIO CREDITO CENTRALE SPA 1.50% 24/10/2024	EUR	995,790.16	1,025,300.00	1.23
600,000.00	FCA BANK SPA 0.25% 28/02/2023	EUR	596,290.42	603,594.00	0.73
500,000.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA 4.13% 04/05/2026	EUR	572,854.07	586,795.00	0.71
500,000.00	UNICREDIT SPA 2.13% 24/10/2026	EUR	523,384.27	544,170.00	0.66
500,000.00	TAMBURI INVESTMENT PARTNERS SPA 2.50% 05/12/2024	EUR	498,849.46	509,145.00	0.61
300,000.00	BANCA FARMAFACTORING SPA 1.75% 23/05/2023	EUR	308,523.36	308,769.00	0.37
250,000.00	INTESA SANPAOLO SPA 0.63% 24/02/2026	EUR	249,414.73	249,875.00	0.30
Industria			1,577,891.16	1,550,325.00	1.87
600,000.00	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA 1.63% 21/10/2028	EUR	614,465.69	611,664.00	0.74
500,000.00	AEROPORTI DI ROMA SPA REG 1.63% 08/06/2027	EUR	481,442.50	527,505.00	0.64
507,600.00	ENERTRONICA SPA 7.00% 31/12/2022	EUR	481,982.97	411,156.00	0.49
Energia			790,732.17	819,648.00	0.99
800,000.00	ENI SPA 0.63% 19/09/2024	EUR	790,732.17	819,648.00	0.99
Beni voluttuari			504,576.75	508,580.00	0.61
500,000.00	PIRELLI & C SPA 1.38% 25/01/2023	EUR	504,576.75	508,580.00	0.61
STATI UNITI			10,667,827.22	10,524,883.00	12.69
Beni di prima necessità			3,485,256.96	3,482,534.00	4.20
1,500,000.00	KRAFT HEINZ FOODS CO 2.00% 30/06/2023	EUR	1,616,266.22	1,551,840.00	1.87
1,000,000.00	COCA-COLA CO 1.88% 22/09/2026	EUR	1,067,806.92	1,105,590.00	1.33
800,000.00	KELLOGG CO 1.00% 17/05/2024	EUR	801,183.82	825,104.00	1.00
Beni voluttuari			2,591,712.81	2,556,450.00	3.08
1,300,000.00	MCDONALD'S CORP 1.88% 26/05/2027	EUR	1,459,276.49	1,434,810.00	1.73
1,000,000.00	WALMART INC 2.55% 08/04/2026	EUR	1,132,436.32	1,121,640.00	1.35
Servizi di telecomunicazione			2,063,006.71	1,977,704.00	2.38
800,000.00	VERIZON COMMUNICATIONS INC 1.38% 02/11/2028	EUR	870,463.05	854,424.00	1.03
600,000.00	WARNER MEDIA LLC 1.95% 15/09/2023	EUR	639,055.69	620,040.00	0.75
500,000.00	AT&T INC 2.65% 17/12/2021	EUR	553,487.97	503,240.00	0.60
Informatica			1,072,543.85	1,061,550.00	1.28
1,000,000.00	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 1.25% 29/01/2027	EUR	1,072,543.85	1,061,550.00	1.28
Finanza			901,860.60	900,990.00	1.09
900,000.00	AMERICAN TOWER CORP 0.45% 15/01/2027	EUR	901,860.60	900,990.00	1.09
Salute			553,446.29	545,655.00	0.66
500,000.00	AMGEN INC 2.00% 25/02/2026	EUR	553,446.29	545,655.00	0.66
REGNO UNITO			6,383,098.88	6,325,024.00	7.62
Energia			1,548,953.84	1,548,345.00	1.86
1,500,000.00	BP CAPITAL MARKETS PLC 0.83% 08/11/2027	EUR	1,548,953.84	1,548,345.00	1.86
Salute			1,577,458.84	1,513,629.00	1.82
1,300,000.00	GLAXOSMITHKLINE CAPITAL PLC 4.00% 16/06/2025	EUR	1,577,458.84	1,513,629.00	1.82

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

NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Servizi di telecomunicazione			1,138,842.35	1,126,050.00	1.36
1,000,000.00	SKY LTD 2.50% 15/09/2026	EUR	1,138,842.35	1,126,050.00	1.36
Beni di prima necessità			1,087,166.70	1,075,690.00	1.30
1,000,000.00	TESCO CORPORATE TREASURY SERVICES PLC 2.50% 01/07/2024	EUR	1,087,166.70	1,075,690.00	1.30
Materie prime			1,030,677.15	1,061,310.00	1.28
1,000,000.00	ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC 1.63% 11/03/2026	EUR	1,030,677.15	1,061,310.00	1.28
FRANCIA			6,237,415.95	6,194,308.00	7.47
Industria			2,780,823.88	2,784,778.00	3.36
1,700,000.00	THALES SA REG 0.25% 29/01/2027	EUR	1,703,271.04	1,708,058.00	2.06
1,000,000.00	CIE DE SAINT-GOBAIN 1.38% 14/06/2027	EUR	1,077,552.84	1,076,720.00	1.30
Servizi di telecomunicazione			1,935,143.76	1,903,704.00	2.30
1,000,000.00	VIVENDI SA 1.88% 26/05/2026	EUR	1,092,922.00	1,081,120.00	1.31
800,000.00	LAGARDERE SCA 2.75% 13/04/2023	EUR	842,221.76	822,584.00	0.99
Beni voluttuari			1,318,667.24	1,294,640.00	1.56
1,000,000.00	RENAULT SA 1.00% 28/11/2025	EUR	1,020,528.03	992,390.00	1.20
300,000.00	VALEO SA 0.63% 11/01/2023	EUR	298,139.21	302,250.00	0.36
Salute			202,781.07	211,186.00	0.25
200,000.00	ORPEA 2.63% 10/03/2025	EUR	202,781.07	211,186.00	0.25
PAESI BASSI			6,094,646.89	6,078,791.00	7.33
Finanza			2,372,800.74	2,371,704.00	2.86
1,500,000.00	NE PROPERTY BV 1.75% 23/11/2024	EUR	1,541,668.42	1,544,520.00	1.86
800,000.00	EURONEXT NV 1.00% 18/04/2025	EUR	831,132.32	827,184.00	1.00
Beni voluttuari			1,723,007.93	1,719,004.00	2.07
800,000.00	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV 4.50% 07/07/2028	EUR	1,009,618.69	998,984.00	1.20
700,000.00	DAIMLER INTERNATIONAL FINANCE BV 0.88% 09/04/2024	EUR	713,389.24	720,020.00	0.87
Servizi di pubblica utilità			1,399,532.60	1,384,009.00	1.67
700,000.00	INNOGY FINANCE BV 1.63% 30/05/2026	EUR	762,069.71	752,143.00	0.91
600,000.00	ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 1.13% 16/09/2026	EUR	637,462.89	631,866.00	0.76
Energia			599,305.62	604,074.00	0.73
600,000.00	REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV 0.13% 05/10/2024	EUR	599,305.62	604,074.00	0.73
GERMANIA			5,861,418.09	5,851,865.72	7.05
Industria			2,281,875.84	2,269,409.72	2.73
1,300,000.00	DEUTSCHE POST AG 1.25% 01/04/2026	EUR	1,384,909.77	1,378,858.00	1.66
841,000.00	HOCHTIEF AG 1.75% 03/07/2025	EUR	896,966.07	890,551.72	1.07
Salute			2,007,049.50	2,023,304.00	2.44
1,300,000.00	FRESENIUS SE & CO KGAA 0.38% 28/09/2026	EUR	1,299,178.46	1,315,184.00	1.59
700,000.00	BAYER AG 0.38% 06/07/2024	EUR	707,871.04	708,120.00	0.85
Beni voluttuari			1,572,492.75	1,559,152.00	1.88
1,400,000.00	VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 2.25% 01/10/2027	EUR	1,572,492.75	1,559,152.00	1.88
LUSSEMBURGO			3,466,044.27	3,529,191.34	4.25
Finanza			1,550,129.82	1,585,605.00	1.91
1,500,000.00	GRAND CITY PROPERTIES SA 1.38% 03/08/2026	EUR	1,550,129.82	1,585,605.00	1.91
Industria			1,422,358.27	1,432,276.34	1.73
1,342,000.00	HEIDELBERGCEMENT FINANCE LUXEMBOURG SA 1.63% 07/04/2026	EUR	1,422,358.27	1,432,276.34	1.73
Sovranazionale			493,556.18	511,310.00	0.61
500,000.00	EIB 0.13% 15/04/2025	EUR	493,556.18	511,310.00	0.61

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

NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
SPAGNA			2,531,061.04	2,523,426.00	3.04
Finanza			1,971,097.13	1,984,961.00	2.39
800,000.00	BANKINTER SA 0.63% 06/10/2027	EUR	814,165.54	806,896.00	0.97
700,000.00	SANTANDER CONSUMER FINANCE SA REG 0.50% 14/11/2026	EUR	717,787.00	710,857.00	0.86
400,000.00	BANCO DE SABADELL SA 5.63% 06/05/2026	EUR	439,144.59	467,208.00	0.56
Beni voluttuari			559,963.91	538,465.00	0.65
500,000.00	ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA 3.75% 20/06/2023	EUR	559,963.91	538,465.00	0.65
BERMUDA			1,670,367.88	1,575,885.00	1.90
Beni di prima necessità			1,670,367.88	1,575,885.00	1.90
1,500,000.00	BACARDI LTD 2.75% 03/07/2023	EUR	1,670,367.88	1,575,885.00	1.90
BELGIO			1,064,259.53	1,058,000.00	1.28
Beni di prima necessità			1,064,259.53	1,058,000.00	1.28
1,000,000.00	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV 1.13% 01/07/2027	EUR	1,064,259.53	1,058,000.00	1.28
IRLANDA			501,886.19	505,560.00	0.61
Informatica			501,886.19	505,560.00	0.61
500,000.00	DELL BANK INTERNATIONAL DAC 0.63% 17/10/2022	EUR	501,886.19	505,560.00	0.61
Obbligazioni a tasso variabile			22,396,550.06	22,478,581.46	27.10
ITALIA			11,638,934.28	11,623,796.46	14.01
Finanza			7,569,341.76	7,493,213.46	9.03
1,600,000.00	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA FRN 18/05/2022	EUR	1,582,248.66	1,608,032.00	1.94
1,500,000.00	UNICREDIT SPA FRN 30/06/2023	EUR	1,495,943.18	1,507,635.00	1.82
1,100,000.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA FRN 12/12/2042	EUR	1,360,128.83	1,223,893.00	1.47
900,000.00	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA FRN 10/09/2025	EUR	947,534.55	974,700.00	1.17
800,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 30/06/2022	EUR	822,964.05	810,760.00	0.98
500,000.00	UNICREDIT SPA FRN 09/03/2026	EUR	489,695.80	490,950.00	0.59
400,000.00	SERVIZI ASSICURATIVI DEL COMMERCIO ESTERO SPA FRN 10/02/2049	EUR	417,126.78	415,044.00	0.50
313,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 25/01/2027	EUR	303,731.45	308,279.96	0.37
150,000.00	ICCREA BANCA SPA FRN 20/10/2025	EUR	149,968.46	153,919.50	0.19
Enti Governativi			2,109,958.92	2,118,003.00	2.55
800,000.00	CCT FRN 15/04/2026	EUR	804,072.78	804,560.00	0.97
700,000.00	CCT FRN 15/12/2022	EUR	706,791.33	705,873.00	0.85
500,000.00	CCT FRN 15/02/2024	EUR	498,244.63	506,900.00	0.61
100,000.00	CCT FRN 15/09/2025	EUR	100,850.18	100,670.00	0.12
Servizi di pubblica utilità			1,959,633.60	2,012,580.00	2.43
2,000,000.00	SNAM SPA FRN 02/08/2024	EUR	1,959,633.60	2,012,580.00	2.43
STATI UNITI			2,984,969.43	2,994,060.00	3.61
Finanza			2,984,969.43	2,994,060.00	3.61
2,000,000.00	GOLDMAN SACHS GROUP INC FRN 26/09/2023	EUR	2,000,830.93	2,005,900.00	2.42
1,000,000.00	GOLDMAN SACHS GROUP INC FRN 18/09/2025	EUR	984,138.50	988,160.00	1.19
FRANCIA			2,793,467.89	2,825,670.00	3.41
Finanza			1,806,899.42	1,822,050.00	2.20
1,200,000.00	SOCIETE GENERALE SA FRN 22/05/2024	EUR	1,205,545.97	1,217,220.00	1.47
600,000.00	CREDIT AGRICOLE SA FRN 06/03/2023	EUR	601,353.45	604,830.00	0.73
Beni voluttuari			986,568.47	1,003,620.00	1.21
1,000,000.00	RCI BANQUE SA FRN 12/01/2023	EUR	986,568.47	1,003,620.00	1.21

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

NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
SPAGNA			1,990,732.00	2,016,830.00	2.43
Finanza			1,990,732.00	2,016,830.00	2.43
1,000,000.00	BANCO SANTANDER SA FRN 28/03/2023	EUR	1,004,877.79	1,009,670.00	1.22
1,000,000.00	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA FRN 09/03/2023	EUR	985,854.21	1,007,160.00	1.21
GERMANIA			1,972,618.77	2,004,715.00	2.42
Finanza			1,477,295.72	1,501,395.00	1.81
1,500,000.00	DEUTSCHE BANK AG FRN 10/09/2021	EUR	1,477,295.72	1,501,395.00	1.81
Beni voluttuari			495,323.05	503,320.00	0.61
500,000.00	DAIMLER AG FRN 03/07/2024	EUR	495,323.05	503,320.00	0.61
REGNO UNITO			1,015,827.69	1,013,510.00	1.22
Finanza			1,015,827.69	1,013,510.00	1.22
1,000,000.00	LLOYDS BANKING GROUP PLC FRN 21/06/2024	EUR	1,015,827.69	1,013,510.00	1.22
Azioni di OICR			2,299,999.99	2,591,373.17	3.12
FRANCIA			2,299,999.99	2,591,373.17	3.12
Finanza			2,299,999.99	2,591,373.17	3.12
120,996.09	ELLIPSIS ASSET MANAGEMENT - ELLIPSIS MASTER TOP ECI FUND	EUR	2,299,999.99	2,591,373.17	3.12
Totale del Portafoglio Titoli			80,175,540.40	80,327,390.69	96.83

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

NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Attività

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	73,209,208.56
Liquidità bancarie a vista		1,153,436.89
Importi dovuti dai broker	(Nota 12)	263,596.09
Interessi da ricevere		281,299.12
Da ricevere su vendita titoli		359,398.11
Da ricevere su sottoscrizioni		996.00
Altre attività		121.37
Totale attività		75,268,056.14

Passività

Altre passività		-231,417.34
Totale passività		-231,417.34

Totale attivo netto**75,036,638.80**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	156.03	319,708.824
Azione I	EUR	168.37	48,989.016
Azione L	EUR	166.74	101,385.000

NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative**PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR**

Attivo netto all'inizio del periodo		66,558,204.96
Risultato netto degli investimenti		260,044.66
Totale ricavi		260,044.66
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-339,346.89
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 7)	-19,617.15
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-12,332.84
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 7)	-18,003.16
Commissioni del Transfer Agent		-713.35
Compensi professionali	(Nota 8)	-4,542.75
Pubblicazioni		-3,314.94
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-11,785.28
Totale costi		-409,656.36
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		-149,611.70
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	1,188,496.41
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		-109,367.43
- di contratti futures		-24.00
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		499,992.93
- su contratti di cambio a termine e su valute estere		1,976.33
Risultato netto delle operazioni per il periodo		1,431,462.54
Sottoscrizioni del periodo		9,244,274.05
Rimborsi del periodo		-2,197,302.75
Attivo netto alla fine del periodo		75,036,638.80

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

NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			68,275,305.70	73,209,208.56	97.56
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			66,397,318.37	71,304,078.40	95.02
Azioni			2,311,343.81	2,715,099.00	3.62
FRANCIA			932,150.83	1,187,101.00	1.58
Beni voluttuari			932,150.83	1,187,101.00	1.58
1,170.00	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	EUR	593,031.41	773,721.00	1.03
1,100.00	L'OREAL SA	EUR	339,119.42	413,380.00	0.55
GERMANIA			714,565.02	683,100.00	0.91
Beni voluttuari			448,349.96	427,050.00	0.57
45,000.00	DEUTSCHE LUFTHANSA AG REG	EUR	448,349.96	427,050.00	0.57
Salute			266,215.06	256,050.00	0.34
5,000.00	BAYER AG REG	EUR	266,215.06	256,050.00	0.34
ITALIA			409,996.59	583,898.00	0.78
Industria			344,937.50	514,148.00	0.69
15,400.00	OFFICINA STELLARE SPA	EUR	84,000.00	264,880.00	0.36
20,000.00	AVIO SPA	EUR	260,373.86	248,800.00	0.33
40.00	FERVI SPA	EUR	563.64	468.00	0.00
Informatica			63,750.00	67,725.00	0.09
15,000.00	ALMAWAVE SPA	EUR	63,750.00	67,725.00	0.09
Beni voluttuari			1,309.09	2,025.00	0.00
400.00	POWERSOFT SPA	EUR	1,309.09	1,920.00	0.00
100.00	SOSTRAVEL.COM SPA	EUR	0.00	105.00	0.00
PAESI BASSI			254,631.37	261,000.00	0.35
Beni voluttuari			254,631.37	261,000.00	0.35
1,500.00	FERRARI NV	EUR	254,631.37	261,000.00	0.35
Obbligazioni ordinarie			32,676,828.02	32,632,507.42	43.49
ITALIA			8,035,028.58	8,098,357.00	10.79
Enti Governativi			3,758,601.71	3,806,120.00	5.07
1,800,000.00	BTP 0.65% 15/10/2023	EUR	1,773,644.22	1,839,420.00	2.45
600,000.00	BTP 2.00% 01/12/2025	EUR	653,430.66	652,500.00	0.87
400,000.00	BTP 3.00% 01/08/2029	EUR	488,108.18	476,800.00	0.64
400,000.00	BTP 1.65% 01/03/2032	EUR	439,687.92	431,560.00	0.57
400,000.00	BTP 0.90% 01/08/2022	EUR	403,730.73	405,840.00	0.54
Finanza			2,754,212.23	2,791,103.00	3.72
800,000.00	UNICREDIT SPA 2.13% 24/10/2026	EUR	879,774.77	870,672.00	1.16
800,000.00	AZIMUT HOLDING SPA REG 1.63% 12/12/2024	EUR	825,119.92	832,952.00	1.11
400,000.00	INTESA SANPAOLO SPA 2.86% 23/04/2025	EUR	407,648.99	427,812.00	0.57
300,000.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA 4.13% 04/05/2026	EUR	342,737.03	352,077.00	0.47
300,000.00	BANCA DEL MEZZOGIORNO-MEDIO CREDITO CENTRALE SPA 1.50% 24/10/2024	EUR	298,931.52	307,590.00	0.41
Servizi di pubblica utilità			983,361.20	964,094.00	1.28
500,000.00	IREN SPA 1.50% 24/10/2027	EUR	547,719.00	534,450.00	0.71
400,000.00	HERA SPA 2.38% 04/07/2024	EUR	435,642.20	429,644.00	0.57
Energia			297,777.06	307,368.00	0.41
300,000.00	ENI SPA 0.63% 19/09/2024	EUR	297,777.06	307,368.00	0.41
Industria			241,076.38	229,672.00	0.31
200,000.00	LEONARDO SPA 4.88% 24/03/2025	EUR	241,076.38	229,672.00	0.31

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

NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
STATI UNITI			6,709,268.05	6,582,804.96	8.77
Beni voluttuari			2,129,326.56	2,144,616.96	2.86
700,000.00	HOME DEPOT INC 3.00% 01/04/2026	USD	629,929.72	642,714.07	0.86
600,000.00	MCDONALD'S CORP 3.38% 26/05/2025	USD	546,553.93	549,688.57	0.73
600,000.00	PROCTER & GAMBLE CO 0.55% 29/10/2025	USD	497,460.83	499,878.32	0.67
400,000.00	MCDONALD'S CORP 2.88% 17/12/2025	EUR	455,382.08	452,336.00	0.60
Servizi di telecomunicazione			1,503,628.28	1,484,410.71	1.98
500,000.00	VERIZON COMMUNICATIONS INC 1.38% 02/11/2028	EUR	549,594.75	534,015.00	0.71
500,000.00	WARNER MEDIA LLC 1.95% 15/09/2023	EUR	521,633.58	516,700.00	0.69
500,000.00	WALT DISNEY CO 1.75% 13/01/2026	USD	432,399.95	433,695.71	0.58
Informatica			1,291,727.49	1,228,444.00	1.63
800,000.00	MICROSOFT CORP 2.13% 06/12/2021	EUR	868,618.31	803,824.00	1.07
400,000.00	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 1.25% 29/01/2027	EUR	423,109.18	424,620.00	0.56
Finanza			1,025,124.20	974,026.00	1.30
700,000.00	WELLS FARGO & CO 2.63% 16/08/2022	EUR	774,974.18	723,751.00	0.97
250,000.00	AMERICAN TOWER CORP 0.45% 15/01/2027	EUR	250,150.02	250,275.00	0.33
Enti Governativi			441,208.27	440,939.29	0.59
500,000.00	UNITED STATES TREASURY NOTE 2.00% 30/06/2024	USD	441,208.27	440,939.29	0.59
Beni di prima necessità			318,253.25	310,368.00	0.41
300,000.00	KRAFT HEINZ FOODS CO 2.00% 30/06/2023	EUR	318,253.25	310,368.00	0.41
SPAGNA			4,787,247.49	4,823,798.00	6.43
Enti Governativi			3,244,970.83	3,275,543.00	4.37
1,500,000.00	SPAIN GOVERNMENT BOND 0.45% 31/10/2022	EUR	1,509,065.43	1,520,430.00	2.03
1,300,000.00	SPAIN GOVERNMENT BOND 0.35% 30/07/2023	EUR	1,302,243.34	1,323,049.00	1.76
400,000.00	SPAIN GOVERNMENT BOND 1.30% 31/10/2026	EUR	433,662.06	432,064.00	0.58
Finanza			1,542,276.66	1,548,255.00	2.06
800,000.00	BANKINTER SA 0.63% 06/10/2027	EUR	810,003.87	806,896.00	1.07
500,000.00	SANTANDER CONSUMER FINANCE SA REG 0.50% 14/11/2026	EUR	512,705.00	507,755.00	0.68
200,000.00	BANCO DE SABADELL SA 5.63% 06/05/2026	EUR	219,567.79	233,604.00	0.31
GERMANIA			4,365,164.66	4,343,394.00	5.79
Enti Governativi			2,012,800.66	1,988,712.00	2.65
1,500,000.00	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 0.25% 15/02/2027	EUR	1,589,411.68	1,568,220.00	2.09
400,000.00	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 0.25% 15/02/2029	EUR	423,388.98	420,492.00	0.56
Beni voluttuari			1,422,677.27	1,425,274.00	1.90
800,000.00	VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 2.25% 01/10/2027	EUR	887,955.04	890,944.00	1.19
500,000.00	VOLKSWAGEN LEASING GMBH 2.63% 15/01/2024	EUR	534,722.23	534,330.00	0.71
Salute			501,525.53	505,840.00	0.67
500,000.00	FRESENIUS SE & CO KGAA 0.38% 28/09/2026	EUR	501,525.53	505,840.00	0.67
Industria			428,161.20	423,568.00	0.57
400,000.00	HOCHTIEF AG 1.75% 03/07/2025	EUR	428,161.20	423,568.00	0.57
FRANCIA			2,340,791.96	2,338,746.00	3.12
Industria			1,208,540.25	1,216,953.00	1.62
700,000.00	THALES SA REG 0.25% 29/01/2027	EUR	709,090.53	703,318.00	0.94
500,000.00	THALES SA 0.75% 23/01/2025	EUR	499,449.72	513,635.00	0.68
Servizi di telecomunicazione			831,972.65	824,076.00	1.10
500,000.00	EUTELSAT SA 1.50% 13/10/2028	EUR	523,779.43	522,840.00	0.70
300,000.00	LAGARDERE SCA 1.63% 21/06/2024	EUR	308,193.22	301,236.00	0.40
Beni voluttuari			300,279.06	297,717.00	0.40
300,000.00	RENAULT SA 1.00% 28/11/2025	EUR	300,279.06	297,717.00	0.40

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

NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
PAESI BASSI			1,737,086.55	1,734,823.00	2.31
Beni voluttuari			827,104.70	814,895.00	1.08
400,000.00	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV 3.75% 29/03/2024	EUR	449,403.68	440,276.00	0.58
300,000.00	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV 4.50% 07/07/2028	EUR	377,701.02	374,619.00	0.50
Finanza			514,059.54	514,840.00	0.69
500,000.00	NE PROPERTY BV 1.75% 23/11/2024	EUR	514,059.54	514,840.00	0.69
Servizi di pubblica utilità			395,922.31	405,088.00	0.54
400,000.00	ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 0.38% 17/06/2027	EUR	395,922.31	405,088.00	0.54
REGNO UNITO			1,643,800.29	1,630,167.00	2.17
Servizi di telecomunicazione			799,314.62	788,235.00	1.05
700,000.00	SKY LTD 2.50% 15/09/2026	EUR	799,314.62	788,235.00	1.05
Beni di prima necessità			428,823.46	430,276.00	0.57
400,000.00	TESCO CORPORATE TREASURY SERVICES PLC 2.50% 01/07/2024	EUR	428,823.46	430,276.00	0.57
Finanza			415,662.21	411,656.00	0.55
400,000.00	HSBC HOLDINGS PLC 0.88% 06/09/2024	EUR	415,662.21	411,656.00	0.55
LUSSEMBURGO			1,582,918.46	1,609,651.46	2.15
Finanza			738,226.18	739,949.00	0.99
700,000.00	GRAND CITY PROPERTIES SA 1.38% 03/08/2026	EUR	738,226.18	739,949.00	0.99
Sovranazionale			426,475.06	442,794.46	0.59
433,000.00	EIB 0.13% 15/04/2025	EUR	426,475.06	442,794.46	0.59
Industria			418,217.22	426,908.00	0.57
400,000.00	HEIDELBERGCEMENT FINANCE LUXEMBOURG SA 1.63% 07/04/2026	EUR	418,217.22	426,908.00	0.57
BELGIO			530,627.17	529,000.00	0.70
Beni di prima necessità			530,627.17	529,000.00	0.70
500,000.00	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV 1.13% 01/07/2027	EUR	530,627.17	529,000.00	0.70
UNGHERIA			515,006.92	521,530.00	0.70
Energia			515,006.92	521,530.00	0.70
500,000.00	MOL HUNGARIAN OIL & GAS PLC 1.50% 08/10/2027	EUR	515,006.92	521,530.00	0.70
BERMUDA			429,887.89	420,236.00	0.56
Beni di prima necessità			429,887.89	420,236.00	0.56
400,000.00	BACARDI LTD 2.75% 03/07/2023	EUR	429,887.89	420,236.00	0.56
Obbligazioni a tasso variabile			8,468,324.22	8,617,139.00	11.48
ITALIA			6,264,334.97	6,405,503.00	8.54
Enti Governativi			4,827,447.55	4,951,960.00	6.60
1,500,000.00	CCT FRN 15/07/2023	EUR	1,487,697.48	1,516,200.00	2.02
1,200,000.00	CCT FRN 15/09/2025	EUR	1,172,684.49	1,208,040.00	1.61
1,200,000.00	CCT FRN 15/06/2022	EUR	1,175,725.35	1,205,400.00	1.61
600,000.00	CCT FRN 15/10/2024	EUR	592,400.46	616,800.00	0.82
400,000.00	CCT FRN 15/02/2024	EUR	398,939.77	405,520.00	0.54
Finanza			1,436,887.42	1,453,543.00	1.94
500,000.00	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA FRN 18/05/2022	EUR	493,627.35	502,510.00	0.67
300,000.00	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA FRN 10/09/2025	EUR	316,026.36	324,900.00	0.43
300,000.00	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA FRN 25/01/2024	EUR	313,788.38	314,850.00	0.42
300,000.00	SERVIZI ASSICURATIVI DEL COMMERCIO ESTERO SPA FRN 10/02/2049	EUR	313,445.33	311,283.00	0.42

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

NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
FRANCIA			1,316,378.35	1,322,292.00	1.76
Finanza			607,949.09	608,610.00	0.81
600,000.00	SOCIETE GENERALE SA FRN 22/05/2024	EUR	607,949.09	608,610.00	0.81
Beni voluttuari			493,347.26	501,810.00	0.67
500,000.00	RCI BANQUE SA FRN 12/01/2023	EUR	493,347.26	501,810.00	0.67
Energia			215,082.00	211,872.00	0.28
200,000.00	TOTAL SA FRN 29/12/2049	EUR	215,082.00	211,872.00	0.28
STATI UNITI			887,610.90	889,344.00	1.18
Finanza			887,610.90	889,344.00	1.18
900,000.00	GOLDMAN SACHS GROUP INC FRN 18/09/2025	EUR	887,610.90	889,344.00	1.18
Obbligazioni zero coupon			396,538.75	408,971.88	0.54
STATI UNITI			396,538.75	408,971.88	0.54
Enti Governativi			396,538.75	408,971.88	0.54
500,000.00	UNITED STATES TREASURY NOTE 0.00% 15/02/2031	USD	396,538.75	408,971.88	0.54
Azioni di OICR			22,544,283.57	26,927,939.43	35.89
LUSSEMBURGO			14,750,053.52	18,535,310.58	24.70
Finanza			14,750,053.52	18,535,310.58	24.70
6,442.45	PICTET - SECURITY -HI-	EUR	1,070,999.92	1,922,039.34	2.56
41,799.06	JPMORGAN FUNDS - US VALUE FUND -C-	USD	1,236,528.31	1,453,573.17	1.94
9,719.25	FLOSSBACH VON STORCH BOND OPPORTUNITIES -I-	EUR	1,279,999.64	1,426,396.69	1.90
35,386.23	ALGER SICAV - ALGER SMALL CAP FOCUS FUND -I-	EUR	750,000.01	1,160,668.48	1.55
2,000.62	WELLS FARGO LUX WORLDWIDE FUND - US ALL CAP GROWTH -I-	USD	568,979.57	1,073,171.24	1.43
5,064.56	MIRABAUD - EQUITIES GLOBAL FOCUS -IC-	USD	764,103.65	1,006,506.32	1.34
8,212.43	BLACKROCK STRATEGIC FUNDS - GLOBAL EVENT DRIVEN FUND -D2-	EUR	900,000.20	986,969.84	1.32
8,838.26	NORDEA 1 SICAV - LOW DURATION EUROPEAN COVERED BOND FUND -BI-	EUR	900,000.02	918,206.83	1.22
273.44	CANDRIAM EQUITIES L - ROBOTICS & INNOVATIVE TECHNOLOGY- IU-	USD	468,143.94	914,192.66	1.22
6,315.60	CB-ACCENT LUX - SWAN SHORT-TERM HIGH YIELD -A-	EUR	799,999.96	849,069.53	1.13
6,576.81	VONTOBEL FUND - EMERGING MARKETS DEBT -I-	USD	745,058.60	825,109.20	1.10
4,668.42	RWC FUNDS - RWC ASIA CONVERTIBLES FUND -B-	EUR	749,999.89	754,097.37	1.00
6,000.00	NEW MILLENNIUM SIF-SICAV - AIM SISTEMA ITALIA - PIR	EUR	600,000.00	737,400.00	0.98
3,092.97	GAM MULTISTOCK - CHINA EVOLUTION EQUITY	USD	594,076.06	713,684.79	0.95
250.45	CANDRIAM EQUITIES L EUROPE INNOVATION -I-	EUR	600,000.45	713,259.40	0.95
697.44	LA FRANCAISE LUX - JKC ASIA BOND 2023	EUR	719,999.34	711,895.04	0.95
260.00	OYSTER FUNDS - JAPAN OPPORTUNITIES -R-	EUR	398,826.61	560,812.20	0.75
42,662.12	FRANKLIN TEMPLETON INVESTMENT FUNDS - FRANKLIN GCC BOND	EUR	500,000.00	542,662.12	0.72
2,859.58	VONTOBEL FUND - MTX SUSTAINABLE EMERGING MARKETS LEADERS	USD	400,050.76	524,315.63	0.70
4,169.01	GAM STAR LUX - MERGER ARBITRAGE -I-	USD	403,286.56	405,370.01	0.54
3,101.10	NEW MILLENNIUM - VOLACTIVE -I-	EUR	300,000.03	335,910.72	0.45
IRLANDA			6,633,847.56	6,778,083.97	9.04
Finanza			6,633,847.56	6,778,083.97	9.04
13,216.48	LAZARD GLOBAL CONVERTIBLES RECOVERY FUND -A-	EUR	1,499,999.99	1,495,633.26	1.99
101,380.33	GAM STAR ALPHA TECHNOLOGY	EUR	1,399,999.92	1,443,858.66	1.93
10,000.00	ISHARES CHINA LARGE CAP UCITS ETF	EUR	1,169,773.65	1,116,200.00	1.49
6,358.63	MAN FUNDS VI PLC - MAN GLG EVENT DRIVEN ALTERNATIVE	EUR	750,000.05	752,034.82	1.00
5,800.16	PLURIMA FUNDS - APUANO FLEXIBLE BOND FUND -A-	EUR	645,325.82	723,268.35	0.97
6,000.00	WISDOMTREE AT1 COCO BOND UCITS ETF	EUR	489,073.95	541,860.00	0.72
2,013.54	NOMURA FUNDS IRELAND - JAPAN HIGH CONVICTION -I-	JPY	409,674.18	421,057.78	0.56
62,427.74	TENDERCAPITAL BOND TWO STEPS FUND -IA-	EUR	270,000.00	284,171.10	0.38
FRANCIA			1,160,382.49	1,614,544.88	2.15
Finanza			1,160,382.49	1,614,544.88	2.15
700.43	LAZARD CONVERTIBLE GLOBAL -E-	EUR	1,160,382.49	1,614,544.88	2.15

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

NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Warrants			0.00	2,421.67	0.00
ITALIA			0.00	2,421.67	0.00
Beni voluttuari			0.00	2,421.67	0.00
13,849.00	RADICI PIETRO INDUSTRIES & BRANDS SPA 22/07/2022	EUR	0.00	2,285.09	0.00
2,168.00	SOSTRAVEL.COM SPA 31/12/2021	EUR	0.00	136.58	0.00
NEGOZIATI SU UN ALTRO MERCATO REGOLAMENTATO			1,877,987.33	1,905,130.16	2.54
Obbligazioni ordinarie			1,450,613.17	1,473,593.15	1.96
STATI UNITI			1,450,613.17	1,473,593.15	1.96
Informatica			744,867.78	749,984.44	1.00
500,000.00	MICROSOFT CORP 3.30% 06/02/2027	USD	465,727.10	469,187.72	0.63
300,000.00	APPLE INC 3.35% 09/02/2027	USD	279,140.68	280,796.72	0.37
Servizi di telecomunicazione			705,745.39	723,608.71	0.96
800,000.00	CISCO SYSTEMS INC 2.50% 20/09/2026	USD	705,745.39	723,608.71	0.96
Obbligazioni a tasso variabile			427,374.16	431,537.01	0.58
STATI UNITI			427,374.16	431,537.01	0.58
Finanza			427,374.16	431,537.01	0.58
500,000.00	GOLDMAN SACHS GROUP INC FRN 15/05/2026	USD	427,374.16	431,537.01	0.58
Totale del Portafoglio Titoli			68,275,305.70	73,209,208.56	97.56

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

NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Attività

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	14,709,661.62
Liquidità bancarie a vista		2,774,288.78
Importi dovuti dai broker	(Nota 12)	327,805.88
Utili non realizzati su contratti futures	(Note 2d, 12)	3,740.00
Dividendi da ricevere		4,908.92
Interessi da ricevere		57,132.45
Altre attività		9,711.27
Totale attività		17,887,248.92

Passività

Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	(Note 2c, 12)	-19,737.18
Perdite non realizzate su contratti futures	(Note 2d, 12)	-13,568.08
Da pagare su acquisto titoli		-61,551.41
Altre passività		-143,350.83
Totale passività		-238,207.50

Totale attivo netto**17,649,041.42**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	128.34	47,722.718
Azione L	EUR	128.13	89,945.000

NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible**PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR**

Attivo netto all'inizio del periodo		15,404,826.03
Risultato netto degli investimenti		125,239.66
Altri ricavi		1,223.38
Totale ricavi		126,463.04
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-111,234.21
Commissioni sulla performance	(Nota 6)	-39,244.86
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 7)	-4,610.57
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-4,363.71
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 7)	-26,777.13
Compensi professionali	(Nota 8)	-3,598.51
Pubblicazioni		-2,155.79
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-11,381.03
Totale costi		-203,365.81
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		-76,902.77
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	996,832.47
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		-9,085.03
- di contratti futures		-489,873.31
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		144,519.63
- su contratti di cambio a termine e su valute estere		8,732.28
- su contratti futures		-20,261.84
Risultato netto delle operazioni per il periodo		553,961.43
Sottoscrizioni del periodo		11,371,228.45
Rimborsi del periodo		-9,680,974.49
Attivo netto alla fine del periodo		17,649,041.42

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

NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			14,130,665.23	14,709,661.62	83.34
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			14,130,665.23	14,709,661.62	83.34
Azioni			3,983,543.95	4,368,307.75	24.75
STATI UNITI			1,372,532.82	1,563,930.38	8.86
Industria			337,966.58	388,503.19	2.20
330.00	NORTHROP GRUMMAN CORP	USD	84,840.34	101,131.50	0.57
225.00	LOCKHEED MARTIN CORP	USD	65,368.97	71,784.05	0.41
350.00	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	USD	61,339.15	64,737.72	0.37
500.00	AGILENT TECHNOLOGIES INC	USD	48,230.70	62,319.73	0.35
400.00	WASTE MANAGEMENT INC	USD	38,136.37	47,258.60	0.27
800.00	WORTHINGTON INDUSTRIES INC	USD	40,051.05	41,271.59	0.23
Informatica			295,405.68	367,567.91	2.08
175.00	NVIDIA CORP	USD	82,294.30	118,068.50	0.67
500.00	MICROSOFT CORP	USD	92,712.88	114,216.99	0.65
100.00	ADOBE INC	USD	40,111.89	49,383.57	0.28
1,200.00	AVID TECHNOLOGY INC	USD	34,370.68	39,615.46	0.22
250.00	FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES INC	USD	29,454.19	29,865.49	0.17
500.00	DXC TECHNOLOGY CO	USD	16,461.74	16,417.90	0.09
Salute			227,372.31	248,049.45	1.41
1,000.00	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	USD	52,668.90	56,345.36	0.32
100.00	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	USD	38,814.29	42,538.98	0.24
150.00	STRYKER CORP	USD	29,899.46	32,852.25	0.19
900.00	BOSTON SCIENTIFIC CORP	USD	25,654.53	32,451.29	0.18
250.00	ABBOTT LABORATORIES	USD	23,651.36	24,439.23	0.14
1,000.00	JANUX THERAPEUTICS INC	USD	20,754.56	21,038.86	0.12
25.00	INTUITIVE SURGICAL INC	USD	17,513.08	19,386.95	0.11
200.00	ABBVIE INC	USD	18,416.13	18,996.53	0.11
Beni voluttuari			173,516.17	178,526.77	1.01
800.00	VF CORP	USD	52,229.13	55,343.59	0.31
500.00	STARBUCKS CORP	USD	47,213.10	47,141.39	0.27
100.00	ESTEE LAUDER COS INC -A-	USD	26,219.08	26,821.81	0.15
500.00	FOOT LOCKER INC	USD	25,156.02	25,984.47	0.15
500.00	KOHL'S CORP	USD	22,698.84	23,235.51	0.13
Beni di prima necessità			135,223.85	151,530.41	0.86
2,500.00	KRAFT HEINZ CO	USD	71,651.22	85,968.42	0.49
1,000.00	SYSCO CORP	USD	63,572.63	65,561.99	0.37
Servizi di telecomunicazione			90,027.34	111,009.98	0.63
500.00	WALT DISNEY CO	USD	52,236.01	74,108.24	0.42
20.00	BOOKING HOLDINGS INC	USD	37,791.33	36,901.74	0.21
Finanza			85,843.63	90,586.85	0.51
200.00	BERKSHIRE HATHAWAY INC -B-	USD	41,769.76	46,870.71	0.27
200.00	MARSH & MCLENNAN COS INC	USD	22,985.81	23,725.43	0.13
100.00	CIGNA CORP	USD	21,088.06	19,990.71	0.11
Servizi di pubblica utilità			27,177.26	28,155.82	0.16
1,800.00	VISTRA ENERGY CORP	USD	27,177.26	28,155.82	0.16
ITALIA			845,296.00	911,886.00	5.17
Finanza			399,657.74	443,360.00	2.51
7,500.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA	EUR	122,437.29	126,787.50	0.72
45,000.00	INTESA SANPAOLO SPA	EUR	97,690.14	104,827.50	0.59
14,000.00	SOCIETA CATTOLICA DI ASSICURAZIONI SC	EUR	69,904.57	98,070.00	0.56
7,500.00	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA	EUR	68,416.93	73,875.00	0.42
4,000.00	UNICREDIT SPA	EUR	41,208.81	39,800.00	0.22

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

NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Beni voluttuari			205,692.28	205,098.00	1.16
5,400.00	ATLANTIA SPA	EUR	89,027.82	82,458.00	0.47
7,000.00	BREMBO SPA	EUR	72,076.91	74,760.00	0.42
30,000.00	OVS SPA	EUR	44,587.55	47,880.00	0.27
Industria			107,327.30	114,568.00	0.65
36,000.00	SALINI IMPREGILO SPA	EUR	76,754.40	80,568.00	0.46
2,000.00	LU-VE SPA	EUR	30,572.90	34,000.00	0.19
Servizi di pubblica utilità			66,214.06	72,180.00	0.41
30,000.00	IREN SPA	EUR	66,214.06	72,180.00	0.41
Energia			47,505.74	51,350.00	0.29
5,000.00	ENI SPA	EUR	47,505.74	51,350.00	0.29
Servizi di telecomunicazione			18,898.88	25,330.00	0.15
1,700.00	ALKEMY SPA	EUR	18,898.88	25,330.00	0.15
GERMANIA			625,139.12	687,512.00	3.89
Materie prime			167,031.25	190,700.00	1.08
2,000.00	BASF SE	EUR	112,924.44	132,880.00	0.75
1,000.00	LANXESS AG	EUR	54,106.81	57,820.00	0.33
Servizi di telecomunicazione			134,099.16	142,496.00	0.81
8,000.00	DEUTSCHE TELEKOM AG REG	EUR	134,099.16	142,496.00	0.81
Finanza			122,416.29	138,108.00	0.78
500.00	ALLIANZ SE REG	EUR	88,826.23	105,150.00	0.59
3,000.00	DEUTSCHE BANK AG REG	EUR	33,590.06	32,958.00	0.19
Salute			107,177.59	118,998.00	0.67
2,000.00	FRESENIUS SE & CO KGAA	EUR	78,878.04	87,990.00	0.50
600.00	SIEMENS HEALTHINEERS AG	EUR	28,299.55	31,008.00	0.17
Industria			67,619.30	66,810.00	0.38
500.00	SIEMENS AG REG	EUR	67,619.30	66,810.00	0.38
Informatica			26,795.53	30,400.00	0.17
2,000.00	HENSOLDT AG	EUR	26,795.53	30,400.00	0.17
FRANCIA			501,212.57	507,131.00	2.87
Industria			253,535.23	259,253.00	1.47
2,000.00	CIE DE SAINT-GOBAIN	EUR	104,024.28	111,080.00	0.63
2,000.00	ALSTOM SA	EUR	87,833.04	85,180.00	0.48
700.00	VINCI SA	EUR	61,677.91	62,993.00	0.36
Servizi di pubblica utilità			146,764.33	138,648.00	0.78
12,000.00	ENGIE SA	EUR	146,764.33	138,648.00	0.78
Finanza			58,225.09	63,444.00	0.36
1,200.00	BNP PARIBAS SA	EUR	58,225.09	63,444.00	0.36
Energia			42,687.92	45,786.00	0.26
1,200.00	TOTAL SA	EUR	42,687.92	45,786.00	0.26
PAESI BASSI			190,411.45	192,105.00	1.09
Beni voluttuari			77,832.14	82,770.00	0.47
5,000.00	STELLANTIS NV	EUR	77,832.14	82,770.00	0.47
Finanza			71,025.30	67,560.00	0.38
1,000.00	EXOR NV	EUR	71,025.30	67,560.00	0.38
Industria			41,554.01	41,775.00	0.24
3,000.00	CNH INDUSTRIAL NV	EUR	41,554.01	41,775.00	0.24

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

NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
IRLANDA			155,655.01	188,924.40	1.07
Industria			76,514.62	97,340.00	0.55
400.00	LINDE PLC	EUR	76,514.62	97,340.00	0.55
Informatica			40,593.45	49,715.80	0.28
200.00	ACCENTURE PLC -A-	USD	40,593.45	49,715.80	0.28
Salute			38,546.94	41,868.60	0.24
400.00	MEDTRONIC PLC	USD	38,546.94	41,868.60	0.24
SVIZZERA			143,161.57	160,933.97	0.91
Industria			87,122.48	101,130.04	0.57
1,000.00	LAFARGEHOLCIM LTD REG	CHF	49,925.01	50,630.04	0.29
1,000.00	LAFARGEHOLCIM LTD REG	EUR	37,197.47	50,500.00	0.28
Salute			56,039.09	59,803.93	0.34
600.00	NOVARTIS AG REG	CHF	44,816.22	46,152.70	0.26
100.00	CRISPR THERAPEUTICS AG	USD	11,222.87	13,651.23	0.08
SPAGNA			80,179.45	85,685.00	0.49
Beni voluttuari			38,473.48	44,565.00	0.25
1,500.00	INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA	EUR	38,473.48	44,565.00	0.25
Servizi di pubblica utilità			41,705.97	41,120.00	0.24
4,000.00	IBERDROLA SA	EUR	41,705.97	41,120.00	0.24
BELGIO			69,955.96	70,200.00	0.40
Finanza			69,955.96	70,200.00	0.40
1,500.00	AGEAS	EUR	69,955.96	70,200.00	0.40
Obbligazioni ordinarie			5,056,545.42	5,021,626.00	28.45
STATI UNITI			2,211,636.65	2,151,646.00	12.19
Informatica			1,456,409.65	1,417,066.00	8.03
700,000.00	APPLE INC 1.00% 10/11/2022	EUR	722,176.00	713,720.00	4.04
700,000.00	MICROSOFT CORP 2.13% 06/12/2021	EUR	734,233.65	703,346.00	3.99
Finanza			755,227.00	734,580.00	4.16
700,000.00	JPMORGAN CHASE & CO 2.75% 01/02/2023	EUR	755,227.00	734,580.00	4.16
FRANCIA			1,120,312.96	1,127,612.00	6.39
Finanza			717,780.00	711,466.00	4.03
700,000.00	BNP PARIBAS SA 0.75% 11/11/2022	EUR	717,780.00	711,466.00	4.03
Informatica			199,975.96	200,182.00	1.13
200,000.00	CAPGEMINI SE 0.50% 09/11/2021	EUR	199,975.96	200,182.00	1.13
Industria			100,762.00	109,305.00	0.62
100,000.00	SCHNEIDER ELECTRIC SE 1.50% 15/01/2028	EUR	100,762.00	109,305.00	0.62
Beni voluttuari			101,795.00	106,659.00	0.61
100,000.00	ACCOR SA 3.00% 04/02/2026	EUR	101,795.00	106,659.00	0.61
ITALIA			1,003,393.76	1,020,179.00	5.78
Beni di prima necessità			797,931.00	813,408.00	4.61
800,000.00	ESSELUNGA SPA 0.88% 25/10/2023	EUR	797,931.00	813,408.00	4.61
Finanza			101,021.00	104,901.00	0.59
100,000.00	INTESA SANPAOLO SPA 2.13% 30/08/2023	EUR	101,021.00	104,901.00	0.59
Industria			104,441.76	101,870.00	0.58
100,000.00	PRYSMIAN SPA 2.50% 11/04/2022	EUR	104,441.76	101,870.00	0.58

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

NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
PAESI BASSI			513,508.52	519,205.00	2.94
Beni voluttuari			409,324.52	410,076.00	2.32
400,000.00	FERRARI NV 1.50% 16/03/2023	EUR	409,324.52	410,076.00	2.32
Finanza			104,184.00	109,129.00	0.62
100,000.00	ING GROEP NV 2.13% 10/01/2026	EUR	104,184.00	109,129.00	0.62
AUSTRIA			207,693.53	202,984.00	1.15
Servizi di telecomunicazione			207,693.53	202,984.00	1.15
200,000.00	TELEKOM FINANZMANAGEMENT GMBH 3.13% 03/12/2021	EUR	207,693.53	202,984.00	1.15
Obbligazioni a tasso variabile			1,126,031.89	1,140,059.93	6.46
FRANCIA			481,658.89	488,955.93	2.77
Finanza			481,658.89	488,955.93	2.77
300,000.00	LA BANQUE POSTALE SA FRN 17/06/2026	EUR	302,221.00	303,819.00	1.72
200,000.00	BNP PARIBAS SA FRN 31/12/2099	USD	179,437.89	185,136.93	1.05
GERMANIA			339,723.00	331,011.00	1.88
Finanza			339,723.00	331,011.00	1.88
300,000.00	ALLIANZ SE FRN 31/12/2049	EUR	339,723.00	331,011.00	1.88
ITALIA			304,650.00	320,093.00	1.81
Finanza			304,650.00	320,093.00	1.81
200,000.00	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA FRN 25/01/2024	EUR	207,550.00	209,900.00	1.19
100,000.00	INTESA SANPAOLO VITA SPA FRN 31/12/2049	EUR	97,100.00	110,193.00	0.62
Obbligazioni zero coupon			2,506,405.69	2,506,355.00	14.20
ITALIA			2,506,405.69	2,506,355.00	14.20
Enti Governativi			2,506,405.69	2,506,355.00	14.20
1,500,000.00	BOT 0.00% 12/11/2021	EUR	1,504,260.51	1,504,035.00	8.52
1,000,000.00	BOT 0.00% 29/10/2021	EUR	1,002,145.18	1,002,320.00	5.68
Azioni di OICR			1,458,138.28	1,673,312.94	9.48
FRANCIA			662,076.85	763,233.18	4.32
Finanza			662,076.85	763,233.18	4.32
471.00	SYQUANT CAPITAL - HELIUM OPPORTUNITES -A-	EUR	600,732.11	691,465.68	3.92
3,500.00	LYXOR MSCI INDIA UCITS ETF	EUR	61,344.74	71,767.50	0.40
AUSTRIA			563,325.57	664,887.26	3.77
Finanza			563,325.57	664,887.26	3.77
3,200.27	ERSTE SPARINVEST - ESPA BOND EMERGING MARKETS CORPORATE	EUR	563,325.57	664,887.26	3.77
IRLANDA			179,809.63	180,218.50	1.02
Finanza			179,809.63	180,218.50	1.02
1,000.00	ISHARES EUR ULTRASHORT BOND UCITS ETF	EUR	100,280.18	100,100.00	0.57
350.00	ISHARES EUR INFLATION LINKED GOVT BOND UCITS ETF	EUR	79,529.45	80,118.50	0.45
LUSSEMBURGO			52,926.23	64,974.00	0.37
Finanza			52,926.23	64,974.00	0.37
3,500.00	LYXOR MSCI BRAZIL UCITS ETF	EUR	52,926.23	64,974.00	0.37
Totale del Portafoglio Titoli			14,130,665.23	14,709,661.62	83.34

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 2021

Valore nominale	Quantità	Acquisto / Vendita	Contratto	Scadenza	Valore di mercato al 30 Giugno 2021	Valuta	Plus/(minus) valenza non realizzata (EUR)	Impegno (EUR)
							-9,828.08	1,825,331.88
10	-5	Vendita	CAC40 10 EURO	16/07/2021	6,505.00	EUR	3,625.00	325,250.00
5	-3	Vendita	FTSE/MIB INDEX	17/09/2021	25,004.00	EUR	115.00	375,060.00
25	-1	Vendita	DAX INDEX	17/09/2021	15,528.00	EUR	-150.00	388,200.00
50	-2	Vendita	S&P500 EMINI	17/09/2021	3,616.32	USD	-1,104.65	361,632.34
125,000	3	Acquisto	EURO FX CURRENCY	13/09/2021	1.00	USD	-12,313.43	375,189.54

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

NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible**CONTRATTI FINANZIARI A TERMINE AL 30 GIUGNO 2021**

Scadenza	Impegno di acquisto di valute		Impegno di vendita di valute		Plus/(minus)-valenza non realizzata (EUR)
					-19,737.18
30/09/2021	2,084,497.18	EUR	2,500,000.00	USD	-19,737.18

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 2021 IN EUR

Attività

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	21,807,010.97
Liquidità bancarie a vista		1,134,562.10
Importi dovuti dai broker	(Nota 12)	74,512.26
Interessi da ricevere		73,678.84
Altre attività		3,598.53
Totale attività		23,093,362.70

Passività

Da pagare su rimborsi		-3,363.72
Altre passività		-59,571.47
Totale passività		-62,935.19

Totale attivo netto **23,030,427.51**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	106.84	8,150.329
Azione I	EUR	112.66	186,205.400
Azione L	EUR	111.25	10,589.000
Azione Y	EUR	110.83	27.660

NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe**PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR**

Attivo netto all'inizio del periodo		21,521,456.83
Risultato netto degli investimenti		369,111.81
Altri ricavi		1,076.90
Totale ricavi		370,188.71
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-55,094.12
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 7)	-6,186.61
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-1,545.47
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 7)	-12,559.12
Commissioni del Transfer Agent		-3,556.65
Compensi professionali	(Nota 8)	-3,698.05
Pubblicazioni		-2,151.56
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-3,375.62
Totale costi		-88,167.20
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		282,021.51
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	202,702.02
- di contratti futures		-19,854.00
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		-132,076.14
- su contratti di cambio a termine e su valute estere		400.76
Risultato netto delle operazioni per il periodo		333,194.15
Distribuzioni di dividendi	(Nota 13)	-15.21
Sottoscrizioni del periodo		2,402,250.10
Rimborsi del periodo		-1,226,458.36
Attivo netto alla fine del periodo		23,030,427.51

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

NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			21,656,845.35	21,807,010.97	94.69
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			21,656,845.35	21,807,010.97	94.69
Obbligazioni ordinarie			17,675,111.61	17,722,614.77	76.95
FRANCIA			6,032,468.27	5,983,125.71	25.98
Enti Governativi			6,032,468.27	5,983,125.71	25.98
2,541,148.20	FRANCE REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 0.25% 25/07/2024	EUR	2,758,230.86	2,715,725.08	11.79
2,131,268.88	FRANCE REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 0.10% 01/03/2025	EUR	2,273,388.63	2,268,607.85	9.85
514,474.38	FRANCE REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 2.10% 25/07/2023	EUR	560,663.51	555,961.59	2.42
360,879.14	FRANCE REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 1.85% 25/07/2027	EUR	440,185.26	442,831.18	1.92
0.01	FRANCE REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 1.10% 25/07/2022	EUR	0.01	0.01	0.00
ITALIA			5,350,697.58	5,421,587.14	23.54
Enti Governativi			4,751,671.56	4,808,985.14	20.88
3,058,660.18	BTP 2.35% 15/09/2024	EUR	3,416,894.93	3,424,781.80	14.87
1,303,883.70	BTP 0.65% 28/10/2027	EUR	1,334,776.26	1,384,202.94	6.01
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			599,026.02	612,602.00	2.66
250,000.00	INTESA SANPAOLO SPA 0.88% 27/06/2022	EUR	250,332.59	252,835.00	1.10
200,000.00	BANCA DEL MEZZOGIORNO-MEDIOCREDITO CENTRALE SPA 1.50% 24/10/2024	EUR	199,287.69	205,060.00	0.89
150,000.00	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA 1.00% 08/09/2027	EUR	149,405.74	154,707.00	0.67
GERMANIA			4,073,724.97	4,063,534.08	17.64
Enti Governativi			3,873,598.95	3,856,130.08	16.74
3,523,414.09	DEUTSCHE BUNDESREPUBLIK INFLATION LINKED BOND 0.10% 15/04/2026	EUR	3,873,598.95	3,856,130.08	16.74
Finanza			200,126.02	207,404.00	0.90
200,000.00	DEUTSCHE WOHNEN SE 1.00% 30/04/2025	EUR	200,126.02	207,404.00	0.90
SPAGNA			2,218,220.79	2,254,367.84	9.79
Enti Governativi			2,218,220.79	2,254,367.84	9.79
1,399,077.44	SPAIN GOVERNMENT INFLATION LINKED BOND 1.80% 30/11/2024	EUR	1,560,730.76	1,573,150.66	6.83
600,752.40	SPAIN GOVERNMENT INFLATION LINKED BOND 0.65% 30/11/2027	EUR	657,490.03	681,217.18	2.96
Obbligazioni a tasso variabile			1,166,307.97	1,177,037.50	5.11
FRANCIA			317,054.90	312,389.00	1.36
Finanza			199,169.63	199,970.00	0.87
200,000.00	SOCIETE GENERALE SA FRN 24/11/2030	EUR	199,169.63	199,970.00	0.87
Servizi di pubblica utilità			117,885.27	112,419.00	0.49
100,000.00	ELECTRICITE DE FRANCE SA FRN 29/01/2049	EUR	117,885.27	112,419.00	0.49
REGNO UNITO			301,155.41	304,053.00	1.32
Finanza			301,155.41	304,053.00	1.32
300,000.00	LLOYDS BANKING GROUP PLC FRN 21/06/2024	EUR	301,155.41	304,053.00	1.32
ITALIA			248,511.87	252,061.50	1.09
Servizi di pubblica utilità			148,909.04	148,567.50	0.64
150,000.00	ENEL SPA FRN 31/12/2099	EUR	148,909.04	148,567.50	0.64
Finanza			99,602.83	103,494.00	0.45
100,000.00	UNICREDIT SPA FRN 16/06/2026	EUR	99,602.83	103,494.00	0.45

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

NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
SPAGNA			199,545.79	200,370.00	0.87
Finanza			199,545.79	200,370.00	0.87
200,000.00	CAIXABANK SA FRN 18/11/2026	EUR	199,545.79	200,370.00	0.87
PAESI BASSI			100,040.00	108,164.00	0.47
Beni voluttuari			100,040.00	108,164.00	0.47
100,000.00	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN 31/12/2099	EUR	100,040.00	108,164.00	0.47
Obbligazioni zero coupon			1,741,311.28	1,808,620.03	7.86
ITALIA			1,541,339.32	1,608,452.03	6.99
Enti Governativi			1,290,796.64	1,358,374.53	5.90
1,257,521.32	BTP 0.00% 26/05/2025	EUR	1,290,796.64	1,358,374.53	5.90
Servizi di pubblica utilità			250,542.68	250,077.50	1.09
250,000.00	ACEA SPA 0.00% 28/09/2025	EUR	250,542.68	250,077.50	1.09
CINA			199,971.96	200,168.00	0.87
Finanza			199,971.96	200,168.00	0.87
200,000.00	BANK OF CHINA LTD/LUXEMBOURG 0.00% 28/04/2024	EUR	199,971.96	200,168.00	0.87
Azioni di OICR			1,074,114.49	1,098,738.67	4.77
JERSEY			600,414.49	622,317.46	2.70
Finanza			600,414.49	622,317.46	2.70
26,463.00	WISDOMTREE INDUSTRIAL METALS	EUR	308,226.45	341,002.22	1.48
15,412.00	WISDOMTREE PRECIOUS METALS ETF	EUR	292,188.04	281,315.24	1.22
IRLANDA			473,700.00	476,421.21	2.07
Finanza			473,700.00	476,421.21	2.07
104,661.95	TENDERCAPITAL BOND TWO STEPS FUND -IA-	EUR	473,700.00	476,421.21	2.07
Totale del Portafoglio Titoli			21,656,845.35	21,807,010.97	94.69

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 2021 IN EUR

Attività

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	60,735,776.54
Liquidità bancarie a vista		1,582,249.70
Importi dovuti dai broker	(Nota 12)	708,643.43
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	(Note 2c, 12)	2,152.27
Interessi da ricevere		969,957.60
Da ricevere su sottoscrizioni		206,162.51
Totale attività		64,204,942.05

Passività

Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	(Note 2c, 12)	-152,872.35
Da pagare su rimborsi		-47,802.77
Altre passività		-378,894.38
Totale passività		-579,569.50

Totale attivo netto**63,625,372.55**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	137.44	12,079.226
Azione D	EUR	108.74	11,916.034
Azione I	EUR	146.32	413,621.467
Azione L	EUR	144.85	1,012.000

NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond**PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR**

Attivo netto all'inizio del periodo		66,827,407.79
Risultato netto degli investimenti		1,394,067.69
Altri ricavi		2,565.28
Totale ricavi		1,396,632.97
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-258,262.83
Commissioni sulla performance	(Nota 6)	-211,463.96
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 7)	-17,781.82
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-3,740.01
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 7)	-16,827.40
Commissioni del Transfer Agent		-571.29
Compensi professionali	(Nota 8)	-792.82
Pubblicazioni		-3,103.18
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-10,483.80
Totale costi		-523,027.11
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		873,605.86
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	206,001.37
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		-571,081.91
- di contratti futures		279,038.32
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		1,247,454.98
- su contratti di cambio a termine e su valute estere		-125,406.35
Risultato netto delle operazioni per il periodo		1,909,612.27
Distribuzioni di dividendi	(Nota 13)	-45,260.42
Sottoscrizioni del periodo		5,069,332.93
Rimborsi del periodo		-10,135,720.02
Attivo netto alla fine del periodo		63,625,372.55

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			57,290,458.15	60,735,776.54	95.46
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			51,296,150.91	54,447,385.44	85.58
Obbligazioni ordinarie			17,802,755.20	18,845,386.34	29.62
ITALIA			15,461,944.17	16,473,137.00	25.89
Finanza			10,773,339.17	11,397,122.50	17.91
2,500,000.00	AZIMUT HOLDING SPA REG 1.63% 12/12/2024	EUR	2,494,729.17	2,602,975.00	4.09
2,000,000.00	VITTORIA ASSICURAZIONI SPA 5.75% 11/07/2028	EUR	2,102,000.00	2,278,040.00	3.58
2,000,000.00	BANCA POPOLARE DI SONDRIO SCPA 2.38% 03/04/2024	EUR	1,976,400.00	2,094,800.00	3.29
1,000,000.00	EUROVITA ASSICURAZIONI SPA 6.00% 22/12/2025	EUR	1,000,000.00	1,120,220.00	1.76
1,000,000.00	BANCA CARIGE SPA 5.00% 22/12/2022	EUR	965,000.00	1,036,330.00	1.63
1,000,000.00	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE SIIQ SPA 2.13% 28/11/2024	EUR	993,360.00	1,004,090.00	1.58
500,000.00	ANIMA HOLDING SPA 1.75% 23/10/2026	EUR	485,250.00	515,405.00	0.81
500,000.00	NET INSURANCE SPA 7.00% 30/09/2026	EUR	500,100.00	487,500.00	0.77
250,000.00	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA 1.13% 23/04/2025	EUR	256,500.00	257,762.50	0.40
Industria			4,437,105.00	4,820,947.00	7.58
1,500,000.00	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA 1.63% 21/10/2028	EUR	1,496,325.00	1,529,160.00	2.41
1,500,000.00	SALINI IMPREGILO SPA 1.75% 26/10/2024	EUR	1,221,060.00	1,490,730.00	2.34
500,000.00	WEBUILD SPA 5.88% 15/12/2025	EUR	524,375.00	553,960.00	0.87
500,000.00	LEONARDO SPA 2.38% 08/01/2026	EUR	496,300.00	523,040.00	0.82
500,000.00	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA 1.88% 08/07/2026	EUR	499,045.00	522,745.00	0.82
200,000.00	SOFIMA HOLDING SPA 3.75% 15/01/2028	EUR	200,000.00	201,312.00	0.32
Beni voluttuari			251,500.00	255,067.50	0.40
250,000.00	PIAGGIO & C SPA 3.63% 30/04/2025	EUR	251,500.00	255,067.50	0.40
REGNO UNITO			1,085,700.00	1,101,550.00	1.73
Beni voluttuari			1,085,700.00	1,101,550.00	1.73
1,000,000.00	JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC 5.88% 15/11/2024	EUR	1,085,700.00	1,101,550.00	1.73
STATI UNITI			1,111,611.03	1,100,699.34	1.73
Energia			1,111,611.03	1,100,699.34	1.73
1,000,000.00	ENI USA INC 7.30% 15/11/2027	USD	1,111,611.03	1,100,699.34	1.73
LUSSEMBURGO			143,500.00	170,000.00	0.27
Finanza			143,500.00	170,000.00	0.27
200,000.00	VIC PROPERTIES SA 3.00% 28/05/2025	EUR	143,500.00	170,000.00	0.27
Obbligazioni a tasso variabile			32,923,055.27	35,072,376.91	55.13
ITALIA			27,503,953.06	29,710,281.85	46.70
Finanza			22,672,239.42	24,532,977.80	38.56
3,800,000.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA FRN 29/06/2049	GBP	4,011,282.76	5,146,058.30	8.09
2,500,000.00	FINECOBANK BANCA FINECO SPA FRN 31/12/2099	EUR	2,673,050.00	2,724,975.00	4.28
2,300,000.00	CREDITO VALTELLINESE SPA FRN 12/04/2027	EUR	2,357,116.66	2,444,624.00	3.84
2,000,000.00	UNICREDIT SPA FRN 31/12/2099	EUR	2,247,500.00	2,157,000.00	3.39
1,250,000.00	CREDITO EMILIANO SPA FRN 10/07/2027	EUR	1,271,250.00	1,286,962.50	2.02
1,200,000.00	BANCA SELLA SPA FRN 22/09/2027	EUR	1,200,000.00	1,259,796.00	1.98
1,000,000.00	UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA FRN 31/12/2099	EUR	1,000,000.00	1,153,360.00	1.81
1,000,000.00	SOCIETA CATTOLICA DI ASSICURAZIONI SC FRN 14/12/2047	EUR	1,076,125.00	1,130,750.00	1.78
1,000,000.00	UNIONE DI BANCHE ITALIANE SPA REG FRN 31/12/2099	EUR	1,000,000.00	1,104,030.00	1.74
1,000,000.00	AMISSIMA VITA SPA FRN 16/08/2031	EUR	1,000,000.00	1,046,500.00	1.64
1,000,000.00	ICCREA BANCA SPA FRN 20/10/2025	EUR	999,390.00	1,026,130.00	1.61
1,000,000.00	ICCREA BANCA SPA FRN 28/11/2029	EUR	1,000,000.00	1,018,620.00	1.60
800,000.00	INTESA SANPAOLO VITA SPA FRN 31/12/2049	EUR	775,500.00	881,544.00	1.39
700,000.00	BANCO BPM SPA FRN 31/12/2099	EUR	702,400.00	800,590.00	1.26
500,000.00	BANCO BPM SPA REG FRN 31/12/2099	EUR	541,250.00	532,740.00	0.84

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
500,000.00	BANCO BPM SPA FRN 29/06/2049	EUR	487,750.00	488,425.00	0.77
300,000.00	UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA FRN 31/12/2049	EUR	329,625.00	330,873.00	0.52
Servizi di pubblica utilità			3,638,183.64	3,924,140.05	6.17
4,000,000.00	ENEL SPA FRN 24/09/2073	USD	3,638,183.64	3,924,140.05	6.17
Energia			994,030.00	1,052,040.00	1.65
1,000,000.00	ENI SPA FRN 31/12/2099	EUR	994,030.00	1,052,040.00	1.65
Industria			199,500.00	201,124.00	0.32
200,000.00	SOFIMA HOLDING SPA FRN 15/01/2028	EUR	199,500.00	201,124.00	0.32
REGNO UNITO			2,567,733.13	2,504,541.97	3.94
Finanza			2,567,733.13	2,504,541.97	3.94
1,000,000.00	ROTHESAY LIFE PLC REG FRN 31/12/2099	GBP	1,400,191.30	1,343,450.59	2.11
1,000,000.00	BARCLAYS BANK PLC FRN 28/12/2040	EUR	773,750.00	765,000.00	1.20
500,000.00	HSBC BANK PLC FRN 30/09/2049	USD	393,791.83	396,091.38	0.63
PAESI BASSI			1,296,219.08	1,359,926.09	2.14
Finanza			1,296,219.08	1,359,926.09	2.14
2,150,000.00	AEGON NV FRN 31/12/2099	NLG	835,665.58	918,455.70	1.44
500,000.00	ING GROEP NV REG FRN 31/12/2099	USD	460,553.50	441,470.39	0.70
LUSSEMBURGO			1,110,000.00	1,030,580.00	1.62
Finanza			1,110,000.00	1,030,580.00	1.62
2,000,000.00	MITSUBISHI UFJ INVESTOR SERVICES & BANKING LUXEMBOURG SA FRN 15/12/2050	EUR	1,110,000.00	1,030,580.00	1.62
GERMANIA			345,800.00	355,768.00	0.56
Salute			345,800.00	355,768.00	0.56
350,000.00	BAYER AG FRN 02/04/2075	EUR	345,800.00	355,768.00	0.56
FRANCIA			99,350.00	111,279.00	0.17
Finanza			99,350.00	111,279.00	0.17
100,000.00	CNP ASSURANCES FRN 29/11/2049	EUR	99,350.00	111,279.00	0.17
Titoli garantiti da Ipoteche immobiliari e da collaterale			570,340.44	529,622.19	0.83
ITALIA			570,340.44	529,622.19	0.83
Finanza			570,340.44	529,622.19	0.83
569,486.23	SPV PROJECT SRL 7.00% 15/11/2037	EUR	570,340.44	529,622.19	0.83
NEGOZIATI SU UN ALTRO MERCATO REGOLAMENTATO			4,794,221.52	5,207,191.10	8.18
Obbligazioni ordinarie			3,471,873.67	3,861,660.95	6.07
STATI UNITI			3,109,435.28	3,497,940.75	5.50
Industria			2,170,201.87	2,512,984.67	3.95
2,500,000.00	LEONARDO US HOLDINGS INC 6.25% 15/01/2040	USD	2,170,201.87	2,512,984.67	3.95
Beni voluttuari			939,233.41	984,956.08	1.55
1,000,000.00	DELTA AIR LINES INC 7.00% 01/05/2025	USD	939,233.41	984,956.08	1.55
PAESI BASSI			362,438.39	363,720.20	0.57
Beni voluttuari			362,438.39	363,720.20	0.57
400,000.00	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV 5.25% 15/04/2023	USD	362,438.39	363,720.20	0.57
Obbligazioni a tasso variabile			1,322,347.85	1,345,530.15	2.11
ITALIA			889,007.00	920,979.39	1.45
Finanza			889,007.00	920,979.39	1.45
1,000,000.00	UNICREDIT SPA FRN 30/06/2035	USD	889,007.00	920,979.39	1.45

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond**PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR**

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
STATI UNITI			433,340.85	424,550.76	0.66
Beni voluttuari			433,340.85	424,550.76	0.66
500,000.00	GENERAL MOTORS FINANCIAL CO INC FRN 14/01/2022	USD	433,340.85	424,550.76	0.66
ALTRI VALORI MOBILIARI			1,200,085.72	1,081,200.00	1.70
Titoli garantiti da Ipotecche immobiliari e da collaterale			1,200,085.72	1,081,200.00	1.70
ITALIA			1,200,085.72	1,081,200.00	1.70
Finanza			1,200,085.72	1,081,200.00	1.70
1,200,000.00	SIERRA ONE SPV SRL 7.00% 30/06/2025	EUR	1,200,085.72	1,081,200.00	1.70
Totale del Portafoglio Titoli			57,290,458.15	60,735,776.54	95.46

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 2021

Scadenza	Impegno di acquisto di valute		Impegno di vendita di valute		Plus/(minus)-valenza non realizzata (EUR)
					-150,720.08
23/09/2021	7,086,059.85	EUR	6,140,000.00	GBP	-55,647.12
23/09/2021	11,132,623.43	EUR	13,340,000.00	USD	-97,225.23
23/09/2021	360,000.00	GBP	416,579.73	EUR	2,152.27

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Attività

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	3,306,358.13
Liquidità bancarie a vista		263,660.84
Importi dovuti dai broker	(Nota 12)	80.19
Interessi da ricevere		730.63
Totale attività		3,570,829.79

Passività

Altre passività		-38,328.83
Totale passività		-38,328.83

Totale attivo netto**3,532,500.96**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	112.71	21,939.653
Azione D	EUR	93.20	3,169.497
Azione I	EUR	121.60	6,250.000
Azione L	EUR	122.00	9.000
Azione Y	EUR	106.74	30.108

NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing**PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR**

Attivo netto all'inizio del periodo		3,478,498.16
Risultato netto degli investimenti		6,962.73
Altri ricavi		711.33
Totale ricavi		7,674.06
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-13,931.02
Commissioni sulla performance	(Nota 6)	-676.86
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 7)	-1,764.64
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-161.49
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 7)	-5,832.28
Commissioni del Transfer Agent		-195.12
Compensi professionali	(Nota 8)	-3,370.19
Pubblicazioni		-2,121.48
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-17,939.22
Totale costi		-45,992.30
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		-38,318.24
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	73,550.03
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		-8,989.55
- di contratti futures		56,639.62
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		110,626.72
- su contratti di cambio a termine e su valute estere		588.95
Risultato netto delle operazioni per il periodo		194,097.53
Distribuzioni di dividendi	(Nota 13)	-7,459.33
Sottoscrizioni del periodo		9,985.00
Rimborsi del periodo		-142,620.40
Attivo netto alla fine del periodo		3,532,500.96

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			2,907,006.86	3,306,358.13	93.60
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			2,907,006.86	3,306,358.13	93.60
Azioni			60,125.79	101,160.26	2.87
ITALIA			60,039.98	101,160.00	2.87
Industria			32,432.40	60,000.00	1.70
3,000.00	COMER INDUSTRIES SPA	EUR	32,432.40	60,000.00	1.70
Finanza			27,607.58	41,160.00	1.17
2,800.00	FINECOBANK BANCA FINECO SPA	EUR	27,607.58	41,160.00	1.17
STATI UNITI			85.81	0.26	0.00
Energia			85.81	0.26	0.00
3,128.00	PETROQUEST ENERGY INC	USD	85.81	0.26	0.00
Obbligazioni ordinarie			197,000.00	200,696.00	5.68
ITALIA			197,000.00	200,696.00	5.68
Servizi di telecomunicazione			197,000.00	200,696.00	5.68
200,000.00	TELECOM ITALIA SPA 1.13% 26/03/2022	EUR	197,000.00	200,696.00	5.68
Obbligazioni zero coupon			101,121.22	108,496.37	3.07
ITALIA			101,121.22	108,496.37	3.07
Enti Governativi			101,121.22	108,496.37	3.07
100,441.00	BTP 0.00% 26/05/2025	EUR	101,121.22	108,496.37	3.07
Azioni di OICR			2,548,759.85	2,878,960.91	81.50
LUSSEMBURGO			2,548,759.85	2,878,960.91	81.50
Finanza			2,548,759.85	2,878,960.91	81.50
3,919.00	NEW MILLENNIUM - AUGUSTUM ITALIAN DIVERSIFIED BOND -I-	EUR	458,887.04	573,192.94	16.23
3,365.65	NEW MILLENNIUM - AUGUSTUM HIGH QUALITY BOND -I-	EUR	532,679.67	547,928.31	15.51
72,884.86	AZ FUND 1-AZ ALLOCATION-INTERNATIONAL 50%-100%	EUR	382,358.89	524,187.92	14.84
3,935.78	NEW MILLENNIUM - AUGUSTUM EXTRA EURO HIGH QUALITY BOND -I-	EUR	414,290.03	432,620.83	12.25
70,876.29	AZ FUND 1-AZ BOND-GLOBAL MACRO BOND -AI-	EUR	330,000.00	368,202.32	10.42
53,498.13	AZ FUND 1-AZ BOND-TARGET 2021 -AAZ-	EUR	280,544.18	281,400.15	7.96
607.83	NEW MILLENNIUM - AUGUSTUM CORPORATE BOND -I-	EUR	150,000.04	151,428.44	4.29
Warrants			0.00	17,044.59	0.48
ITALIA			0.00	17,044.59	0.48
Finanza			0.00	17,044.59	0.48
8,524.00	NET INSURANCE SPA 21/05/2023	EUR	0.00	17,044.59	0.48
Totale del Portafoglio Titoli			2,907,006.86	3,306,358.13	93.60

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

NEW MILLENNIUM - VolActive

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Attività

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	5,162,688.50
Liquidità bancarie a vista		415,475.07
Importi dovuti dai broker	(Nota 12)	516,114.08
Utili non realizzati su contratti futures	(Note 2d, 12)	11,710.93
Interessi da ricevere		24,184.94
Altre attività		3,413.32
Totale attività		6,133,586.84

Passività

Perdite non realizzate su contratti futures	(Note 2d, 12)	-10,672.27
Altre passività		-70,736.76
Totale passività		-81,409.03

Totale attivo netto**6,052,177.81**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	99.69	4,907.896
Azione D	EUR	80.26	11.557
Azione I	EUR	108.35	51,245.026
Azione L	EUR	106.87	89.000

NEW MILLENNIUM - VolActive

PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Attivo netto all'inizio del periodo		7,238,583.31
Risultato netto degli investimenti		27,028.34
Altri ricavi		1,927.63
Totale ricavi		28,955.97
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-48,957.10
Commissioni sulla performance	(Nota 6)	-22,972.32
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 7)	-2,042.16
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-420.73
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 7)	-13,208.42
Commissioni del Transfer Agent		-2,912.29
Compensi professionali	(Nota 8)	-3,429.05
Pubblicazioni		-1,946.70
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-2,439.95
Totale costi		-98,328.72
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		-69,372.75
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	-629,949.55
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		-21,810.54
- di contratti futures		877,932.59
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		-9,712.72
- su contratti di cambio a termine e su valute estere		40,435.47
- su contratti futures		-18,065.59
Risultato netto delle operazioni per il periodo		169,456.91
Distribuzioni di dividendi	(Nota 13)	-124.55
Sottoscrizioni del periodo		2,615,697.14
Rimborsi del periodo		-3,971,435.00
Attivo netto alla fine del periodo		6,052,177.81

NEW MILLENNIUM - VolActive

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			5,175,564.90	5,162,688.50	85.31
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			5,175,564.90	5,162,688.50	85.31
Azioni			467,786.94	458,335.00	7.58
FRANCIA			144,799.57	159,705.00	2.64
Beni voluttuari			144,799.57	159,705.00	2.64
130.00	HERMES INTERNATIONAL	EUR	144,799.57	159,705.00	2.64
AUSTRIA			149,805.14	152,750.00	2.53
Industria			149,805.14	152,750.00	2.53
4,700.00	WIENERBERGER AG	EUR	149,805.14	152,750.00	2.53
PAESI BASSI			144,642.78	145,880.00	2.41
Materie prime			144,642.78	145,880.00	2.41
1,400.00	AKZO NOBEL NV	EUR	144,642.78	145,880.00	2.41
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			3,485,986.77	3,486,504.50	57.61
ITALIA			729,663.40	738,484.00	12.20
Enti Governativi			301,088.04	310,140.00	5.12
200,000.00	BTP 0.65% 15/10/2023	EUR	195,686.96	204,380.00	3.37
100,000.00	BTP 1.75% 01/07/2024	EUR	105,401.08	105,760.00	1.75
Servizi di pubblica utilità			210,138.02	212,162.00	3.51
100,000.00	ERG SPA 1.88% 11/04/2025	EUR	106,542.60	106,250.00	1.76
100,000.00	A2A SPA 1.75% 25/02/2025	EUR	103,595.42	105,912.00	1.75
Industria			120,748.28	114,836.00	1.90
100,000.00	LEONARDO SPA 4.88% 24/03/2025	EUR	120,748.28	114,836.00	1.90
Finanza			97,689.06	101,346.00	1.67
100,000.00	UNIONE DI BANCHE ITALIANE SPA 1.00% 22/07/2022	EUR	97,689.06	101,346.00	1.67
SPAGNA			611,913.82	589,726.00	9.74
Enti Governativi			611,913.82	589,726.00	9.74
300,000.00	SPAIN GOVERNMENT BOND 3.80% 30/04/2024	EUR	358,122.40	336,321.00	5.56
250,000.00	SPAIN GOVERNMENT BOND 0.45% 31/10/2022	EUR	253,791.42	253,405.00	4.18
ROMANIA			432,129.60	431,280.00	7.13
Enti Governativi			432,129.60	431,280.00	7.13
400,000.00	ROMANIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.00% 08/12/2026	EUR	432,129.60	431,280.00	7.13
GERMANIA			408,143.38	418,678.00	6.92
Beni voluttuari			209,937.94	209,582.00	3.46
200,000.00	VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 1.50% 01/10/2024	EUR	209,937.94	209,582.00	3.46
Enti Governativi			198,205.44	209,096.00	3.46
200,000.00	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 0.25% 15/02/2027	EUR	198,205.44	209,096.00	3.46
PORTOGALLO			314,974.46	315,696.00	5.22
Enti Governativi			314,974.46	315,696.00	5.22
300,000.00	PORTUGAL OBRIGACOES DO TESOURO OT 0.70% 15/10/2027	EUR	314,974.46	315,696.00	5.22

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

NEW MILLENNIUM - VolActive

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
LUSSEMBURGO			301,690.76	314,696.00	5.20
Industria			98,888.54	106,727.00	1.76
100,000.00	HEIDELBERGCEMENT FINANCE LUXEMBOURG SA 1.63% 07/04/2026	EUR	98,888.54	106,727.00	1.76
Finanza			104,022.59	105,707.00	1.75
100,000.00	GRAND CITY PROPERTIES SA 1.38% 03/08/2026	EUR	104,022.59	105,707.00	1.75
Sovranazionale			98,779.63	102,262.00	1.69
100,000.00	EIB 0.13% 15/04/2025	EUR	98,779.63	102,262.00	1.69
IRLANDA			225,495.63	225,000.00	3.72
Enti Governativi			225,495.63	225,000.00	3.72
200,000.00	IRELAND GOVERNMENT BOND 1.35% 18/03/2031	EUR	225,495.63	225,000.00	3.72
REGNO UNITO			205,827.30	208,503.00	3.44
Materie prime			103,979.58	106,131.00	1.75
100,000.00	ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC 1.63% 11/03/2026	EUR	103,979.58	106,131.00	1.75
Salute			101,847.72	102,372.00	1.69
100,000.00	ASTRAZENECA PLC 0.75% 12/05/2024	EUR	101,847.72	102,372.00	1.69
PAESI BASSI			141,971.77	140,884.50	2.33
Salute			141,971.77	140,884.50	2.33
150,000.00	TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NETHERLANDS II BV 1.13% 15/10/2024	EUR	141,971.77	140,884.50	2.33
ISOLE CAYMAN			114,176.65	103,557.00	1.71
Servizi di pubblica utilità			114,176.65	103,557.00	1.71
100,000.00	HUTCHISON WHAMPOA EUROPE FINANCE 12 LTD 3.63% 06/06/2022	EUR	114,176.65	103,557.00	1.71
Obbligazioni a tasso variabile			1,221,791.19	1,217,849.00	20.12
ITALIA			1,120,765.80	1,120,452.00	18.51
Enti Governativi			894,795.45	908,680.00	15.01
400,000.00	CCT FRN 15/09/2025	EUR	400,440.09	402,680.00	6.65
300,000.00	CCT FRN 15/07/2023	EUR	296,890.07	303,240.00	5.01
200,000.00	CCT FRN 15/02/2024	EUR	197,465.29	202,760.00	3.35
Finanza			225,970.35	211,772.00	3.50
100,000.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA FRN 12/12/2042	EUR	125,430.15	111,263.00	1.84
100,000.00	UNICREDIT SPA FRN 30/06/2023	EUR	100,540.20	100,509.00	1.66
STATI UNITI			101,025.39	97,397.00	1.61
Beni voluttuari			101,025.39	97,397.00	1.61
100,000.00	FORD MOTOR CREDIT CO LLC FRN 01/12/2024	EUR	101,025.39	97,397.00	1.61
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			5,175,564.90	5,162,688.50	85.31

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

NEW MILLENNIUM - VolActive

IMPEGNI SU ACQUISTO / VENDITA DI CONTRATTI FUTURES AL 30 GIUGNO 2021

Valore nominale	Quantità	Acquisto / Vendita	Contratto	Scadenza	Valore di mercato al 30 Giugno 2021	Valuta	Plus/(minus) valenza non realizzata (EUR)	Impegno (EUR)
							1,038.66	565,687.80
1,000	-6	Vendita	CBOE VIX	21/07/2021	15.10	USD	8,415.71	90,580.78
1,000	-6	Vendita	CBOE VIX	18/08/2021	16.65	USD	3,295.22	99,917.48
125,000	3	Acquisto	EURO FX CURRENCY	13/09/2021	1.00	USD	-10,672.27	375,189.54

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 2021 IN EUR

Attività

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	57,148,107.63
Liquidità bancarie a vista		1,346,839.58
Importi dovuti dai broker	(Nota 12)	323,254.76
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	(Note 2c, 12)	15,466.40
Interessi da ricevere		780,150.97
Da ricevere su sottoscrizioni		98,725.17
Altre attività		356.73
Totale attività		59,712,901.24

Passività

Scoperti bancari		-359,408.77
Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	(Note 2c, 12)	-61,092.63
Da pagare su rimborsi		-135,872.09
Altre passività		-174,848.36
Totale passività		-731,221.85

Totale attivo netto**58,981,679.39**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	105.69	591.591
Azione D	EUR	82.81	1,754.410
Azione I	EUR	110.14	533,358.155
Azione L	EUR	109.07	260.000

NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond**PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR**

Attivo netto all'inizio del periodo		56,211,655.21
Risultato netto degli investimenti		987,021.91
Totale ricavi		987,021.91
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-238,979.14
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 7)	-16,009.94
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-3,021.46
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 7)	-18,671.62
Commissioni del Transfer Agent		-1,739.41
Compensi professionali	(Nota 8)	-4,314.47
Pubblicazioni		-3,134.83
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-9,746.47
Totale costi		-295,617.34
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		691,404.57
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	193,984.34
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		-1,294,375.82
- di contratti futures		2,181.32
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		2,053,507.87
- su contratti di cambio a termine e su valute estere		48,708.35
Risultato netto delle operazioni per il periodo		1,695,410.63
Distribuzioni di dividendi	(Nota 13)	-10,646.10
Sottoscrizioni del periodo		3,315,390.15
Rimborsi del periodo		-2,230,130.50
Attivo netto alla fine del periodo		58,981,679.39

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 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			58,018,167.51	57,148,107.63	96.89
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			49,213,368.36	48,217,727.93	81.75
Obbligazioni ordinarie			40,932,759.39	39,771,237.05	67.43
REGNO UNITO			5,682,310.06	5,739,254.69	9.73
Finanza			4,027,378.96	4,130,235.72	7.00
2,000,000.00	NATIONWIDE BUILDING SOCIETY REG 1.00% 24/01/2023	GBP	2,345,133.40	2,350,549.27	3.98
1,500,000.00	LLOYDS BANK CORPORATE MARKETS PLC 1.50% 23/06/2023	GBP	1,682,245.56	1,779,686.45	3.02
Sovranazionale			1,654,931.10	1,609,018.97	2.73
27,000,000,000.00	EUROPEAN BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT 6.45% 13/12/2022	IDR	1,654,931.10	1,609,018.97	2.73
LUSSEMBURGO			6,364,137.00	5,395,217.34	9.15
Sovranazionale			3,444,502.42	3,251,875.04	5.51
18,000,000.00	EIB 0.63% 24/04/2023	NOK	1,761,788.09	1,760,364.07	2.98
22,000,000.00	EIB 8.38% 29/07/2022	ZAR	1,519,337.60	1,344,151.70	2.28
2,500,000,000.00	EIB 7.40% 24/01/2022	IDR	163,376.73	147,359.27	0.25
Finanza			2,587,931.78	1,785,724.07	3.03
10,098,125.00	SWISS INSURED BRAZIL POWER FINANCE SARL 9.85% 16/07/2032	BRL	2,587,931.78	1,785,724.07	3.03
Servizi di telecomunicazione			331,702.80	357,618.23	0.61
300,000.00	CK HUTCHISON GROUP TELECOM FINANCE SA 2.00% 17/10/2027	GBP	331,702.80	357,618.23	0.61
STATI UNITI			4,623,675.51	4,399,272.76	7.46
Sovranazionale			1,747,904.03	1,593,029.90	2.70
1,300,000.00	INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT 4.63% 06/10/2021	NZD	769,443.17	774,466.10	1.31
2,400,000.00	INTERNATIONAL FINANCE CORP 8.25% 30/01/2023	BRL	569,611.16	412,600.17	0.70
35,000,000.00	INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT 6.75% 14/11/2022	RUB	408,849.70	405,963.63	0.69
Finanza			1,621,318.64	1,535,700.12	2.60
2,230,000.00	CITIGROUP INC 3.39% 18/11/2021	CAD	1,621,318.64	1,535,700.12	2.60
Enti Governativi			824,408.94	830,263.00	1.41
1,000,000.00	UNITED STATES TREASURY NOTE 0.50% 28/02/2026	USD	824,408.94	830,263.00	1.41
Energia			430,043.90	440,279.74	0.75
400,000.00	ENI USA INC 7.30% 15/11/2027	USD	430,043.90	440,279.74	0.75
GERMANIA			3,987,386.88	4,027,716.66	6.83
Enti Governativi			2,185,123.16	2,234,398.69	3.79
106,000,000.00	INTERNATIONAL FINANCE CORP 3.75% 15/12/2022	RUB	1,123,350.76	1,178,884.59	2.00
1,600,000.00	INTERNATIONAL FINANCE CORP 2.70% 15/03/2023	AUD	1,061,772.40	1,055,514.10	1.79
Materie prime			1,281,962.67	1,268,845.81	2.15
1,500,000.00	BASF SE 0.93% 09/03/2023	USD	1,281,962.67	1,268,845.81	2.15
Finanza			520,301.05	524,472.16	0.89
4,000,000.00	KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 2.70% 08/08/2022	CNY	520,301.05	524,472.16	0.89
PAESI BASSI			3,785,282.14	3,872,073.77	6.57
Beni voluttuari			3,785,282.14	3,872,073.77	6.57
1,600,000.00	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV 5.25% 15/04/2023	USD	1,418,555.25	1,455,083.18	2.47
9,000,000.00	BMW FINANCE NV 2.80% 11/08/2023	CNY	1,164,223.24	1,176,820.66	2.00
5,000,000.00	DAIMLER INTERNATIONAL FINANCE BV 4.50% 21/09/2021	CNY	641,066.30	654,833.28	1.11
500,000.00	BMW INTERNATIONAL INVESTMENT BV 0.75% 08/03/2024	GBP	561,437.35	585,336.65	0.99

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 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
FRANCIA			2,795,997.00	2,909,858.85	4.93
Energia			1,673,789.53	1,715,270.25	2.91
2,000,000.00	TOTAL SA 0.50% 02/12/2022	USD	1,673,789.53	1,715,270.25	2.91
Finanza			1,122,207.47	1,194,588.60	2.02
1,000,000.00	SOCIETE GENERALE SA 1.88% 03/10/2024	GBP	1,122,207.47	1,194,588.60	2.02
COREA DEL SUD			2,636,191.08	2,621,386.27	4.44
Enti Governativi			2,636,191.08	2,621,386.27	4.44
225,300,000.00	EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 6.90% 07/02/2023	INR	2,636,191.08	2,621,386.27	4.44
FILIPPINE			2,305,817.86	2,253,528.46	3.82
Sovranazionale			2,305,817.86	2,253,528.46	3.82
90,000,000.00	ASIAN DEVELOPMENT BANK 5.25% 09/03/2023	PHP	1,660,528.20	1,619,369.93	2.75
55,000,000.00	ASIAN DEVELOPMENT BANK 5.90% 20/12/2022	INR	645,289.66	634,158.53	1.07
IRLANDA			2,162,170.35	2,131,488.59	3.61
Industria			2,162,170.35	2,131,488.59	3.61
1,300,000.00	RUSSIAN RAILWAYS VIA RZD CAPITAL PLC 2.10% 02/10/2023	CHF	1,254,322.74	1,232,808.58	2.09
76,000,000.00	RUSSIAN RAILWAYS VIA RZD CAPITAL PLC 7.90% 19/10/2024	RUB	907,847.61	898,680.01	1.52
EMIRATI ARABI UNITI			1,809,758.61	1,766,488.71	3.00
Enti Governativi			1,809,758.61	1,766,488.71	3.00
2,000,000.00	ABU DHABI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.13% 30/09/2024	USD	1,809,758.61	1,766,488.71	3.00
GEORGIA			1,411,543.67	1,315,228.28	2.23
Finanza			1,411,543.67	1,315,228.28	2.23
1,500,000.00	PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD 5.50% 15/07/2022	USD	1,411,543.67	1,315,228.28	2.23
HONG KONG			831,932.71	861,623.65	1.46
Materie prime			831,932.71	861,623.65	1.46
1,000,000.00	CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 3.50% 19/07/2022	USD	831,932.71	861,623.65	1.46
SINGAPORE			831,142.43	832,737.19	1.41
Enti Governativi			831,142.43	832,737.19	1.41
1,300,000.00	SINGAPORE GOVERNMENT BOND 1.75% 01/02/2023	SGD	831,142.43	832,737.19	1.41
GRECIA			728,717.77	715,250.51	1.21
Sovranazionale			728,717.77	715,250.51	1.21
800,000.00	BLACK SEA TRADE & DEVELOPMENT BANK 3.50% 25/06/2024	USD	728,717.77	715,250.51	1.21
GIAPPONE			726,148.08	675,159.46	1.15
Finanza			726,148.08	675,159.46	1.15
800,000.00	NTT FINANCE CORP 1.90% 21/07/2021	USD	726,148.08	675,159.46	1.15
CINA			165,182.95	170,037.80	0.29
Finanza			165,182.95	170,037.80	0.29
1,300,000.00	BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD 3.15% 22/01/2022	CNY	165,182.95	170,037.80	0.29
MESSICO			85,365.29	84,914.06	0.14
Servizi di telecomunicazione			85,365.29	84,914.06	0.14
2,000,000.00	AMERICA MOVIL SAB DE CV 6.45% 05/12/2022	MXN	85,365.29	84,914.06	0.14

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 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Obbligazioni a tasso variabile			8,280,608.97	8,446,490.88	14.32
LUSSEMBURGO			2,876,825.03	2,882,030.77	4.89
Finanza			2,876,825.03	2,882,030.77	4.89
1,800,000.00	KBC IFIMA SA FRN 07/02/2025	USD	1,599,177.18	1,631,322.23	2.77
1,400,000.00	SWISS RE FINANCE LUXEMBOURG SA FRN 31/12/2099	USD	1,277,647.85	1,250,708.54	2.12
REGNO UNITO			1,281,468.68	1,298,085.87	2.20
Energia			894,496.98	901,711.33	1.53
1,000,000.00	BP CAPITAL MARKETS PLC FRN 31/12/2099	USD	894,496.98	901,711.33	1.53
Finanza			386,971.70	396,374.54	0.67
335,000.00	HSBC HOLDINGS PLC FRN 27/06/2023	GBP	386,971.70	396,374.54	0.67
ITALIA			1,062,681.04	1,083,380.70	1.84
Finanza			1,062,681.04	1,083,380.70	1.84
800,000.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA FRN 29/06/2049	GBP	1,062,681.04	1,083,380.70	1.84
STATI UNITI			1,066,710.39	1,068,977.71	1.81
Finanza			1,066,710.39	1,068,977.71	1.81
1,270,000.00	GOLDMAN SACHS GROUP INC FRN 08/04/2022	USD	1,066,710.39	1,068,977.71	1.81
AUSTRALIA			775,903.45	879,435.12	1.49
Finanza			775,903.45	879,435.12	1.49
750,000.00	MACQUARIE GROUP LTD FRN 15/12/2022	AUD	486,706.19	480,594.78	0.81
500,000.00	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD FRN 29/10/2049	USD	289,197.26	398,840.34	0.68
HONG KONG			756,466.88	793,110.32	1.34
Finanza			756,466.88	793,110.32	1.34
1,000,000.00	HONGKONG & SHANGHAI BANKING CORP LTD FRN 29/07/2049	USD	756,466.88	793,110.32	1.34
PAESI BASSI			460,553.50	441,470.39	0.75
Finanza			460,553.50	441,470.39	0.75
500,000.00	ING GROEP NV REG FRN 31/12/2099	USD	460,553.50	441,470.39	0.75
NEGOZIATI SU UN ALTRO MERCATO REGOLAMENTATO			6,491,042.76	6,370,025.91	10.80
Obbligazioni ordinarie			6,069,250.88	5,943,135.15	10.08
STATI UNITI			3,204,588.30	3,176,007.35	5.39
Beni voluttuari			1,637,242.02	1,579,567.47	2.68
1,000,000.00	HARLEY-DAVIDSON FINANCIAL SERVICES INC 3.35% 08/06/2025	USD	918,745.91	902,478.68	1.53
800,000.00	BMW US CAPITAL LLC 3.40% 13/08/2021	USD	718,496.11	677,088.79	1.15
Industria			988,365.53	1,004,660.09	1.71
500,000.00	LEONARDO US HOLDINGS INC 7.38% 15/07/2039	USD	527,628.68	552,322.85	0.94
450,000.00	LEONARDO US HOLDINGS INC 6.25% 15/01/2040	USD	460,736.85	452,337.24	0.77
Servizi di telecomunicazione			578,980.75	591,779.79	1.00
700,000.00	EBAY INC 1.40% 10/05/2026	USD	578,980.75	591,779.79	1.00
ITALIA			2,425,551.11	2,336,067.22	3.96
Finanza			1,561,798.90	1,434,743.78	2.43
1,650,000.00	UNICREDIT SPA 6.57% 14/01/2022	USD	1,561,798.90	1,434,743.78	2.43
Energia			863,752.21	901,323.44	1.53
1,000,000.00	ENI SPA 4.00% 12/09/2023	USD	863,752.21	901,323.44	1.53

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 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
PAESI BASSI			439,111.47	431,060.58	0.73
Servizi di pubblica utilità			439,111.47	431,060.58	0.73
500,000.00	ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 2.88% 25/05/2022	USD	439,111.47	431,060.58	0.73
Obbligazioni a tasso variabile			421,791.88	426,890.76	0.72
STATI UNITI			421,791.88	426,890.76	0.72
Servizi di pubblica utilità			421,791.88	426,890.76	0.72
500,000.00	SOUTHERN CO FRN 15/09/2051	USD	421,791.88	426,890.76	0.72
ALTRI VALORI MOBILIARI			2,313,756.39	2,560,353.79	4.34
Obbligazioni ordinarie			772,851.29	947,195.75	1.61
ITALIA			772,851.29	947,195.75	1.61
Finanza			772,851.29	947,195.75	1.61
1,000,000.00	UNICREDIT SPA 4.63% 12/04/2027	USD	772,851.29	947,195.75	1.61
Obbligazioni a tasso variabile			1,540,905.10	1,613,158.04	2.73
EGITTO			1,063,053.20	1,102,549.41	1.87
Enti Governativi			1,063,053.20	1,102,549.41	1.87
1,300,000.00	AFRICAN EXPORT-IMPORT BANK FRN 01/08/2022	USD	1,063,053.20	1,102,549.41	1.87
AUSTRALIA			477,851.90	510,608.63	0.86
Finanza			477,851.90	510,608.63	0.86
800,000.00	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD FRN 05/07/2022	AUD	477,851.90	510,608.63	0.86
Totale del Portafoglio Titoli			58,018,167.51	57,148,107.63	96.89

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 2021

Scadenza	Impegno di acquisto di valute		Impegno di vendita di valute		Plus/(minus)-valenza non realizzata (EUR)
					-45,626.23
23/09/2021	1,181,339.85	EUR	1,300,000.00	CHF	-5,173.95
23/09/2021	3,361,477.30	EUR	4,000,000.00	USD	-5,793.66
21/09/2021	460,000,000.00	JPY	3,541,594.49	EUR	-50,125.02
23/09/2021	1,794,517.85	EUR	18,200,000.00	NOK	13,524.86
23/09/2021	2,908,853.97	EUR	2,500,000.00	GBP	992.83
23/09/2021	1,745,665.40	EUR	1,500,000.00	GBP	948.71

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 2021 IN EUR

Attività

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	3,012,477.17
Liquidità bancarie a vista		318,050.34
Importi dovuti dai broker	(Nota 12)	196,768.70
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	(Note 2c, 12)	8,287.45
Interessi da ricevere		41,469.70
Da ricevere su vendita titoli		89,877.20
Totale attività		3,666,930.56

Passività

Scoperti bancari		-86,793.52
Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	(Note 2c, 12)	-6,063.42
Da pagare su acquisto titoli		-99,647.00
Altre passività		-32,116.81
Totale passività		-224,620.75

Totale attivo netto**3,442,309.81**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	88.29	15,147.136
Azione I	EUR	92.31	22,208.324
Azione L	EUR	91.48	600.000

NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond

PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Attivo netto all'inizio del periodo		3,503,930.87
Risultato netto degli investimenti		75,065.56
Altri ricavi		153.52
Totale ricavi		75,219.08
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-28,410.12
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 7)	-1,766.61
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-451.23
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 7)	-6,078.01
Compensi professionali	(Nota 8)	-3,370.40
Pubblicazioni		-2,041.46
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-4,056.73
Totale costi		-46,174.56
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		29,044.52
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	-1,286,721.39
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		-136,062.87
- di contratti futures		-5.99
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		1,589,859.87
- su contratti di cambio a termine e su valute estere		3,687.70
Risultato netto delle operazioni per il periodo		199,801.84
Rimborsi del periodo		-261,422.90
Attivo netto alla fine del periodo		3,442,309.81

NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			4,079,484.02	3,012,477.17	87.51
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			2,913,474.27	2,454,885.60	71.31
Azioni			194,122.40	103,779.05	3.01
FRANCIA			100,000.00	103,776.00	3.01
Energia			100,000.00	103,776.00	3.01
100,000.00	CGG SA	EUR	100,000.00	103,776.00	3.01
STATI UNITI			94,122.40	3.05	0.00
Energia			94,122.40	3.05	0.00
35,151.00	PETROQUEST ENERGY INC	USD	21,530.94	2.97	0.00
100,000.00	SANCHEZ ENERGY CORP	USD	72,591.46	0.08	0.00
Obbligazioni ordinarie			2,138,438.53	1,820,630.72	52.89
ITALIA			522,240.43	537,749.00	15.62
Finanza			306,115.00	299,415.00	8.70
200,000.00	NET INSURANCE SPA 7.00% 30/09/2026	EUR	200,040.00	195,000.00	5.67
100,000.00	BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA 3.63% 24/09/2024	EUR	106,075.00	104,415.00	3.03
Beni voluttuari			138,655.43	138,952.00	4.03
137,500.00	SISAL GROUP SPA 7.00% 31/07/2023	EUR	138,655.43	138,952.00	4.03
Industria			77,470.00	99,382.00	2.89
100,000.00	SALINI IMPREGILO SPA 1.75% 26/10/2024	EUR	77,470.00	99,382.00	2.89
REGNO UNITO			271,535.00	311,662.00	9.05
Beni voluttuari			271,535.00	311,662.00	9.05
100,000.00	JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC 5.88% 15/11/2024	EUR	97,485.00	110,155.00	3.20
100,000.00	INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY PLC 3.50% 15/06/2026	EUR	78,650.00	102,663.00	2.98
100,000.00	EC FINANCE PLC 2.38% 15/11/2022	EUR	95,400.00	98,844.00	2.87
GERMANIA			196,290.00	201,458.00	5.85
Beni voluttuari			99,190.00	102,058.00	2.96
100,000.00	DEUTSCHE LUFTHANSA AG 2.88% 11/02/2025	EUR	99,190.00	102,058.00	2.96
Beni di prima necessità			97,100.00	99,400.00	2.89
100,000.00	EKOSEM-AGRAR AG 7.50% 01/08/2024	EUR	97,100.00	99,400.00	2.89
JERSEY			182,528.74	188,098.40	5.47
Beni voluttuari			182,528.74	188,098.40	5.47
200,000.00	ASTON MARTIN CAPITAL HOLDINGS LTD 10.50% 30/11/2025	USD	182,528.74	188,098.40	5.47
FINLANDIA			149,850.00	153,327.00	4.45
Beni voluttuari			149,850.00	153,327.00	4.45
150,000.00	FINNAIR OYJ 4.25% 19/05/2025	EUR	149,850.00	153,327.00	4.45
MESSICO			115,694.53	106,142.57	3.08
Servizi di telecomunicazione			115,694.53	106,142.57	3.08
2,500,000.00	AMERICA MOVIL SAB DE CV 6.45% 05/12/2022	MXN	115,694.53	106,142.57	3.08
SPAGNA			100,140.00	100,147.00	2.91
Beni voluttuari			100,140.00	100,147.00	2.91
100,000.00	NH HOTEL GROUP SA 4.00% 02/07/2026	EUR	100,140.00	100,147.00	2.91
PANAMA			95,269.00	99,124.00	2.88
Beni voluttuari			95,269.00	99,124.00	2.88
100,000.00	CARNIVAL CORP 1.88% 07/11/2022	EUR	95,269.00	99,124.00	2.88

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

NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
FRANCIA			99,647.00	99,031.00	2.88
Beni voluttuari			99,647.00	99,031.00	2.88
100,000.00	AIR FRANCE-KLM 3.00% 01/07/2024	EUR	99,647.00	99,031.00	2.88
LIBANO			165,956.46	22,003.53	0.64
Enti Governativi			165,956.46	22,003.53	0.64
200,000.00	LEBANON GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.05% 02/11/2035	USD	165,956.46	22,003.53	0.64
STATI UNITI			56,212.20	1,888.02	0.06
Industria			56,212.20	1,888.02	0.06
100,000.00	HORNBECK OFFSHORE SERVICES INC 5.88% 01/04/2020	USD	56,212.20	1,888.02	0.06
CANADA			183,075.17	0.20	0.00
Industria			183,075.17	0.20	0.00
300,000.00	ENTREC CORP 8.50% 30/06/2021	CAD	183,075.17	0.20	0.00
Obbligazioni a tasso variabile			511,800.00	530,402.00	15.41
ITALIA			300,150.00	324,286.00	9.42
Finanza			300,150.00	324,286.00	9.42
200,000.00	FINCOBANK BANCA FINECO SPA FRN 31/12/2099	EUR	200,000.00	217,998.00	6.33
100,000.00	CREDITO VALTELLINESE SPA FRN 12/04/2027	EUR	100,150.00	106,288.00	3.09
LUSSEMBURGO			211,650.00	206,116.00	5.99
Finanza			211,650.00	206,116.00	5.99
400,000.00	MITSUBISHI UFJ INVESTOR SERVICES & BANKING LUXEMBOURG SA FRN 15/12/2050	EUR	211,650.00	206,116.00	5.99
Warrants			69,113.34	73.83	0.00
STATI UNITI			69,113.34	73.83	0.00
Beni di prima necessità			69,113.34	73.83	0.00
1,751.00	CEC BRANDS LLC 31/12/2025	USD	69,113.34	73.83	0.00
NEGOZIATI SU UN ALTRO MERCATO REGOLAMENTATO			891,478.75	546,509.37	15.88
Obbligazioni ordinarie			816,853.75	546,509.27	15.88
STATI UNITI			239,998.36	275,290.93	8.00
Beni voluttuari			165,357.00	176,685.70	5.13
100,000.00	CINEMARK USA INC 8.75% 01/05/2025	USD	92,233.82	92,418.37	2.68
99,340.61	US AIRWAYS 2012-2 CLASS A PASS THROUGH TRUST 4.63% 03/06/2025	USD	73,123.18	84,267.33	2.45
Beni di prima necessità			74,641.36	98,605.23	2.87
100,000.00	SAFEWAY INC 7.25% 01/02/2031	USD	74,641.36	98,605.23	2.87
CANADA			170,512.16	175,222.10	5.09
Industria			170,512.16	175,222.10	5.09
100,000.00	BOMBARDIER INC 7.50% 01/12/2024	USD	86,115.44	88,339.61	2.57
100,000.00	BOMBARDIER INC 7.50% 15/03/2025	USD	84,396.72	86,882.49	2.52
REGNO UNITO			82,152.40	91,196.51	2.65
Energia			82,152.40	91,196.51	2.65
100,000.00	TECHNIPFMC PLC 6.50% 01/02/2026	USD	82,152.40	91,196.51	2.65
BERMUDA			324,190.83	4,799.73	0.14
Servizi di telecomunicazione			324,190.83	4,799.73	0.14
400,000.00	DIGICEL GROUP LTD 8.25% 30/09/2020	USD	324,190.83	4,799.73	0.14

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

NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Obbligazioni zero coupon			74,625.00	0.10	0.00
PAESI BASSI			74,625.00	0.10	0.00
Materie prime			74,625.00	0.10	0.00
100,000.00	NYRSTAR NETHERLANDS HOLDINGS BV 0.00% 31/12/2099	EUR	74,625.00	0.10	0.00
ALTRI VALORI MOBILIARI			274,531.00	11,082.20	0.32
Obbligazioni ordinarie			274,531.00	11,082.20	0.32
LUSSEMBURGO			274,531.00	11,082.03	0.32
Energia			274,531.00	11,082.03	0.32
438,073.00	CONSTELLATION OIL SERVICES HOLDING SA REG 6.25% 09/11/2030	USD	274,531.00	11,082.03	0.32
STATI UNITI			0.00	0.17	0.00
Energia			0.00	0.17	0.00
200,000.00	BRISTOW GROUP INC 6.25% 15/10/2022	USD	0.00	0.17	0.00
Totale del Portafoglio Titoli			4,079,484.02	3,012,477.17	87.51

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 2021

Scadenza	Impegno di acquisto di valute		Impegno di vendita di valute		Plus/(minus)-valenza non realizzata (EUR)
					2,224.03
23/09/2021	57,409.92	EUR	70,000.00	USD	-1,517.32
23/09/2021	208,632.37	EUR	250,000.00	USD	-1,822.07
23/09/2021	300,330.36	EUR	360,000.00	USD	-2,724.03
23/09/2021	210,000.00	USD	171,572.78	EUR	5,208.95
23/09/2021	315,000.00	USD	263,013.14	EUR	2,159.45
23/09/2021	186,097.25	EUR	220,000.00	USD	897.35
23/09/2021	92,621.65	EUR	110,000.00	USD	21.70

NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Attività

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	95,939,511.83
Liquidità bancarie a vista		5,502,169.09
Importi dovuti dai broker	(Nota 12)	572,184.66
Dividendi da ricevere		7,121.83
Interessi da ricevere		388,293.11
Altre attività		3,051.06
Totale attività		102,412,331.58

Passività

Perdite non realizzate su contratti futures	(Note 2d, 12)	-35,050.00
Da pagare su rimborsi		-217,280.00
Altre passività		-727,848.56
Totale passività		-980,178.56

Totale attivo netto**101,432,153.02**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	106.84	249,283.089
Azione I	EUR	109.45	1,800.000
Azione L	EUR	108.55	687,250.000

NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity**PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR**

Attivo netto all'inizio del periodo		96,975,311.63
Risultato netto degli investimenti		776,743.92
Altri ricavi		1,676.90
Totale ricavi		778,420.82
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-786,294.78
Commissioni sulla performance	(Nota 6)	-240,028.76
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 7)	-27,581.95
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-23,301.08
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 7)	-21,905.75
Commissioni del Transfer Agent		-1,328.54
Compensi professionali	(Nota 8)	-5,042.85
Pubblicazioni		-2,015.96
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-32,349.13
Totale costi		-1,139,848.80
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		-361,427.98
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	2,074,681.75
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		-60,703.61
- di contratti futures		-319,101.20
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		2,833,819.79
- su contratti di cambio a termine e su valute estere		9,926.66
- su contratti futures		-35,050.00
Risultato netto delle operazioni per il periodo		4,142,145.41
Sottoscrizioni del periodo		2,945,727.04
Rimborsi del periodo		-2,631,031.06
Attivo netto alla fine del periodo		101,432,153.02

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

NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			89,920,594.66	95,939,511.83	94.58
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			89,920,594.66	95,939,511.83	94.58
Obbligazioni ordinarie			36,816,888.52	37,588,801.83	37.06
ITALIA			13,173,584.09	13,662,634.38	13.47
Finanza			5,293,640.39	5,477,951.00	5.40
1,000,000.00	CASSA DEPOSITI E PRESTITI SPA -E- 1.00% 21/09/2028	EUR	1,017,962.28	1,035,200.00	1.02
1,000,000.00	BANCO BPM SPA 1.63% 18/02/2025	EUR	965,020.39	1,020,090.00	1.01
1,000,000.00	BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA REG 2.63% 28/04/2025	EUR	992,319.14	1,016,250.00	1.00
1,000,000.00	UNIONE DI BANCHE ITALIANE SPA 0.75% 17/10/2022	EUR	987,367.44	1,013,100.00	1.00
500,000.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA 4.13% 04/05/2026	EUR	534,123.63	586,795.00	0.58
500,000.00	UNICREDIT SPA 1.00% 18/01/2023	EUR	493,815.54	508,610.00	0.50
300,000.00	BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA 1.88% 09/01/2026	EUR	303,031.97	297,906.00	0.29
Enti Governativi			5,049,837.59	5,353,204.38	5.28
3,115,128.00	BTP 0.55% 21/05/2026	EUR	3,018,033.43	3,273,688.02	3.23
2,014,840.00	BTP 0.40% 11/04/2024	EUR	2,031,804.16	2,079,516.36	2.05
Industria			1,309,656.12	1,317,544.00	1.30
700,000.00	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA 1.63% 21/10/2028	EUR	699,089.02	713,608.00	0.70
600,000.00	SOFIMA HOLDING SPA 3.75% 15/01/2028	EUR	610,567.10	603,936.00	0.60
Servizi di telecomunicazione			1,007,551.21	1,003,480.00	0.99
1,000,000.00	TELECOM ITALIA SPA 1.13% 26/03/2022	EUR	1,007,551.21	1,003,480.00	0.99
Beni voluttuari			512,898.78	510,455.00	0.50
500,000.00	NEXI SPA 1.75% 31/10/2024	EUR	512,898.78	510,455.00	0.50
SPAGNA			4,913,862.58	4,898,039.51	4.83
Enti Governativi			4,616,154.58	4,600,115.51	4.54
2,132,740.00	SPAIN GOVERNMENT INFLATION LINKED BOND 1.80% 30/11/2024	EUR	2,416,020.51	2,398,095.51	2.37
2,000,000.00	SPAIN GOVERNMENT BOND 1.45% 30/04/2029	EUR	2,200,134.07	2,202,020.00	2.17
Industria			297,708.00	297,924.00	0.29
300,000.00	CELLNEX FINANCE CO SA 0.75% 15/11/2026	EUR	297,708.00	297,924.00	0.29
GERMANIA			4,337,094.67	4,358,799.06	4.30
Enti Governativi			3,345,400.97	3,347,539.06	3.30
3,058,705.50	DEUTSCHE BUNDESREPUBLIK INFLATION LINKED BOND 0.10% 15/04/2026	EUR	3,345,400.97	3,347,539.06	3.30
Beni voluttuari			991,693.70	1,011,260.00	1.00
1,000,000.00	DEUTSCHE LUFTHANSA AG 3.00% 29/05/2026	EUR	991,693.70	1,011,260.00	1.00
FRANCIA			3,026,786.67	3,140,880.00	3.10
Servizi di telecomunicazione			1,488,673.72	1,559,565.00	1.54
1,000,000.00	EUTELSAT SA 1.50% 13/10/2028	EUR	994,638.07	1,045,680.00	1.03
500,000.00	ILIAD SA 2.38% 17/06/2026	EUR	494,035.65	513,885.00	0.51
Beni voluttuari			1,016,748.25	1,062,060.00	1.05
1,000,000.00	RCI BANQUE SA 1.75% 10/04/2026	EUR	1,016,748.25	1,062,060.00	1.05
Industria			521,364.70	519,255.00	0.51
500,000.00	SPIE SA REG 2.63% 18/06/2026	EUR	521,364.70	519,255.00	0.51
REGNO UNITO			2,988,318.69	3,062,597.24	3.02
Enti Governativi			2,272,417.91	2,326,890.24	2.29
2,000,000.00	UNITED KINGDOM GILT 0.13% 31/01/2024	GBP	2,272,417.91	2,326,890.24	2.29
Beni voluttuari			715,900.78	735,707.00	0.73
700,000.00	INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY PLC 3.50% 15/07/2024	EUR	715,900.78	735,707.00	0.73

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

NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
STATI UNITI			2,503,816.39	2,536,164.64	2.50
Beni voluttuari			1,509,469.16	1,524,730.00	1.50
1,000,000.00	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 1.74% 19/07/2024	EUR	1,007,101.38	1,016,550.00	1.00
500,000.00	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 1.51% 17/02/2023	EUR	502,367.78	508,180.00	0.50
Enti Governativi			994,347.23	1,011,434.64	1.00
1,200,000.00	UNITED STATES TREASURY NOTE 0.13% 30/11/2022	USD	994,347.23	1,011,434.64	1.00
PAESI BASSI			2,285,859.51	2,321,447.00	2.29
Servizi di telecomunicazione			1,039,076.84	1,036,120.00	1.02
1,000,000.00	PROSUS NV 1.54% 03/08/2028	EUR	1,039,076.84	1,036,120.00	1.02
Energia			702,271.78	728,077.00	0.72
700,000.00	SAIPEM FINANCE INTERNATIONAL BV 2.63% 07/01/2025	EUR	702,271.78	728,077.00	0.72
Materie prime			544,510.89	557,250.00	0.55
500,000.00	SYNGENTA FINANCE NV 3.38% 16/04/2026	EUR	544,510.89	557,250.00	0.55
PORTOGALLO			2,057,111.34	2,104,640.00	2.07
Enti Governativi			2,057,111.34	2,104,640.00	2.07
2,000,000.00	PORTUGAL OBRIGACOES DO TESOURO OT 0.70% 15/10/2027	EUR	2,057,111.34	2,104,640.00	2.07
MESSICO			1,530,454.58	1,503,600.00	1.48
Energia			1,530,454.58	1,503,600.00	1.48
1,500,000.00	PETROLEOS MEXICANOS 2.50% 21/08/2021	EUR	1,530,454.58	1,503,600.00	1.48
Obbligazioni a tasso variabile			27,756,644.69	28,565,966.84	28.16
ITALIA			13,447,286.49	13,706,396.84	13.51
Finanza			5,827,835.49	5,980,562.84	5.90
1,000,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 31/12/2099	EUR	997,147.64	1,102,580.00	1.09
922,000.00	BANCO BPM SPA FRN 30/07/2022	EUR	954,499.51	951,245.84	0.94
800,000.00	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA FRN 18/05/2022	EUR	800,660.39	804,016.00	0.79
750,000.00	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA FRN 23/11/2030	EUR	753,602.15	764,805.00	0.76
500,000.00	BANCA POPOLARE DI SONDRIO SCPA FRN 30/07/2029	EUR	530,946.40	551,745.00	0.54
500,000.00	SERVIZI ASSICURATIVI DEL COMMERCIO ESTERO SPA FRN 10/02/2049	EUR	511,858.05	518,805.00	0.51
500,000.00	UNICREDIT SPA FRN 23/09/2029	EUR	492,290.20	504,295.00	0.50
500,000.00	UNICREDIT SPA REG FRN 31/12/2099	EUR	462,823.75	479,300.00	0.47
300,000.00	UNICREDIT SPA FRN 29/12/2049	EUR	324,007.40	303,771.00	0.30
Enti Governativi			4,997,917.21	5,044,700.00	4.97
3,000,000.00	CCT FRN 15/04/2026	EUR	3,006,513.06	3,017,100.00	2.97
2,000,000.00	CCT FRN 15/02/2024	EUR	1,991,404.15	2,027,600.00	2.00
Energia			994,795.87	1,052,040.00	1.04
1,000,000.00	ENI SPA FRN 31/12/2099	EUR	994,795.87	1,052,040.00	1.04
Industria			1,000,499.86	999,970.00	0.98
1,000,000.00	POSTE ITALIANE SPA FRN 31/12/2099	EUR	1,000,499.86	999,970.00	0.98
Servizi di pubblica utilità			626,238.06	629,124.00	0.62
600,000.00	ENEL SPA FRN 31/12/2099	EUR	626,238.06	629,124.00	0.62
FRANCIA			3,197,929.18	3,332,671.00	3.28
Finanza			1,400,522.08	1,503,752.00	1.48
1,700,000.00	AXA SA FRN 29/12/2049	EUR	1,400,522.08	1,503,752.00	1.48
Energia			1,213,178.63	1,214,927.00	1.20
700,000.00	TOTALENERGIES SE FRN 31/12/2099	EUR	705,323.38	701,862.00	0.69
500,000.00	TOTAL SA FRN 31/12/2099	EUR	507,855.25	513,065.00	0.51
Servizi di telecomunicazione			584,228.47	613,992.00	0.60
600,000.00	ORANGE SA FRN 31/12/2099	EUR	584,228.47	613,992.00	0.60

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

NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
PAESI BASSI			2,987,048.90	3,173,529.00	3.13
Finanza			2,310,075.35	2,489,523.00	2.46
1,700,000.00	AEGON NV FRN 29/07/2049	EUR	1,305,772.83	1,476,093.00	1.46
1,000,000.00	COOPERATIEVE RABOBANK UA FRN 31/12/2099	EUR	1,004,302.52	1,013,430.00	1.00
Beni voluttuari			676,973.55	684,006.00	0.67
600,000.00	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN 29/03/2049	EUR	676,973.55	684,006.00	0.67
SPAGNA			2,360,050.88	2,472,564.00	2.44
Finanza			2,360,050.88	2,472,564.00	2.44
1,800,000.00	BANCO SANTANDER SA FRN 31/12/2099	EUR	1,769,838.02	1,878,372.00	1.85
600,000.00	BANCO DE SABADELL SA FRN 17/01/2030	EUR	590,212.86	594,192.00	0.59
GERMANIA			2,117,325.09	2,135,652.00	2.10
Finanza			1,602,840.20	1,627,412.00	1.60
1,000,000.00	DEUTSCHE BANK AG FRN 19/11/2025	EUR	1,003,506.96	1,021,280.00	1.00
600,000.00	ALLIANZ SE FRN 31/12/2099	EUR	599,333.24	606,132.00	0.60
Salute			514,484.89	508,240.00	0.50
500,000.00	BAYER AG FRN 02/04/2075	EUR	514,484.89	508,240.00	0.50
REGNO UNITO			2,074,000.78	2,118,460.00	2.09
Energia			1,004,602.73	1,070,300.00	1.06
1,000,000.00	BP CAPITAL MARKETS PLC FRN 31/12/2099	EUR	1,004,602.73	1,070,300.00	1.06
Finanza			1,069,398.05	1,048,160.00	1.03
1,000,000.00	HSBC HOLDINGS PLC FRN 29/12/2049	EUR	1,069,398.05	1,048,160.00	1.03
STATI UNITI			942,862.58	1,002,190.00	0.99
Finanza			942,862.58	1,002,190.00	0.99
1,000,000.00	GOLDMAN SACHS GROUP INC FRN 21/04/2023	EUR	942,862.58	1,002,190.00	0.99
LUSSEMBURGO			630,140.79	624,504.00	0.62
Finanza			630,140.79	624,504.00	0.62
600,000.00	TLG FINANCE SARL FRN 31/12/2099	EUR	630,140.79	624,504.00	0.62
Obbligazioni zero coupon			632,324.81	650,978.21	0.64
ITALIA			632,324.81	650,978.21	0.64
Enti Governativi			632,324.81	650,978.21	0.64
602,646.00	BTP 0.00% 26/05/2025	EUR	632,324.81	650,978.21	0.64
Azioni di OICR			24,714,736.64	29,133,764.95	28.72
IRLANDA			12,712,232.29	14,766,880.00	14.56
Finanza			12,308,088.55	14,116,540.00	13.92
87,500.00	ISHARES MSCI EUROPE UCITS ETF	EUR	2,123,539.60	2,443,875.00	2.41
31,000.00	ISHARES MSCI WORLD EUR HEDGED UCITS ETF -H-	EUR	1,396,705.31	2,239,130.00	2.21
53,000.00	ISHARES MSCI EUROPE EX-UK UCITS ETF	EUR	1,716,796.52	2,084,225.00	2.06
14,700.00	ISHARES J.P. MORGAN USD EM BOND EUR HEDGED UCITS ETF -H-	EUR	1,419,944.51	1,337,700.00	1.32
65,000.00	ISHARES EURO DIVIDEND UCITS ETF	EUR	1,470,941.97	1,327,625.00	1.31
26,000.00	ISHARES GLOBAL INFRASTRUCTURE UCITS ETF	EUR	631,335.51	696,410.00	0.69
11,700.00	SPDR BARCLAYS EMERGING MARKETS LOCAL BOND UCITS ETF	EUR	692,037.24	683,631.00	0.67
17,000.00	VANGUARD FTSE 100 UCITS ETF	EUR	494,428.94	612,340.00	0.60
9,850.00	ISHARES PLC - ISHARES MSCI AC FAR EAST EX-JAPAN UCITS ETF	EUR	518,566.15	609,124.00	0.60
68,000.00	ISHARES IV PLC-ISHARES HEALTHCARE INNOVATION UCITS ETF	EUR	531,148.37	608,600.00	0.60
22,300.00	ISHARES MSCI BRAZIL UCITS ETF	EUR	494,843.74	574,894.00	0.57
45,000.00	ISHARES GLOBAL CLEAN ENERGY UCITS ETF	EUR	509,377.87	509,220.00	0.50
2,850.00	ISHARES CORE EURO STOXX 50 UCITS ETF	EUR	308,422.82	389,766.00	0.38

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

NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Beni voluttuari			404,143.74	650,340.00	0.64
9,000.00	ISHARES MSCI WORLD EUR HEDGED UCITS ETF ACC -H-	EUR	404,143.74	650,340.00	0.64
LUSSEMBURGO			7,781,552.55	9,458,602.95	9.32
Finanza			7,781,552.55	9,458,602.95	9.32
45,600.00	AMUNDI INDEX MSCI EUROPE SRI UCITS DR ETF	EUR	2,598,620.20	3,199,752.00	3.15
57,000.22	FUNDSMITH EQUITY FUND SICAV -T-	EUR	2,269,036.26	3,122,608.85	3.08
79,100.00	XTRACKERS HARVEST CSI300 UCITS ETF	EUR	1,014,072.48	1,050,131.60	1.03
5,500.00	LYXOR DAX UCITS ETF	EUR	684,861.76	800,030.00	0.79
11,500.00	BNP PARIBAS EASY NMX 30 INFRASTRUCTURE GLOBAL	EUR	703,921.78	762,105.00	0.75
1,350.00	LYXOR MSCI WORLD HEALTH CARE TR UCITS ETF	EUR	511,040.07	523,975.50	0.52
FRANCIA			4,220,951.80	4,908,282.00	4.84
Finanza			4,220,951.80	4,908,282.00	4.84
70,000.00	LYXOR EURO STOXX 50 DR UCITS ETF -DR-	EUR	2,236,196.75	2,807,700.00	2.77
43,500.00	LYXOR FTSE MIB UCITS ETF	EUR	986,399.12	1,066,185.00	1.05
11,700.00	LYXOR IBEX35 DR UCITS ETF	EUR	998,355.93	1,034,397.00	1.02
Totale del Portafoglio Titoli			89,920,594.66	95,939,511.83	94.58

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 2021

Valore nominale	Quantità	Acquisto / Vendita	Contratto	Scadenza	Valore di mercato al 30 Giugno 2021	Valuta	Plus/(minus) valenza non realizzata (EUR)	Impegno (EUR)
							-35,050.00	5,005,690.00
100,000	-29	Vendita	EURO BUND	08/09/2021	172.61	EUR	-35,050.00	5,005,690.00

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 2021 IN EUR

Attività

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	8,168,219.05
Liquidità bancarie a vista		451,094.27
Importi dovuti dai broker	(Nota 12)	50,378.34
Dividendi da ricevere		975.00
Interessi da ricevere		34,444.00
Altre attività		1,653.60
Totale attività		8,706,764.26

Passività

Altre passività		-88,215.91
Totale passività		-88,215.91

Totale attivo netto**8,618,548.35**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	107.38	41,226.359
Azione I	EUR	109.85	36,200.418
Azione L	EUR	109.06	1,975.000

NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia

PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Attivo netto all'inizio del periodo		9,104,632.27
Risultato netto degli investimenti		80,783.13
Totale ricavi		80,783.13
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-47,284.22
Commissioni sulla performance	(Nota 6)	-42,307.33
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 7)	-2,433.41
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-1,347.07
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 7)	-5,532.39
Commissioni del Transfer Agent		-181.98
Compensi professionali	(Nota 8)	-3,460.28
Pubblicazioni		-2,280.99
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-4,636.52
Totale costi		-109,464.19
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		-28,681.06
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	506,394.14
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		0.53
- di contratti futures		-44.09
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		61,204.49
- su contratti di cambio a termine e su valute estere		92.46
Risultato netto delle operazioni per il periodo		538,966.47
Sottoscrizioni del periodo		61,952.27
Rimborsi del periodo		-1,087,002.66
Attivo netto alla fine del periodo		8,618,548.35

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

NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			7,739,143.18	8,168,219.05	94.77
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			7,583,490.16	8,012,626.42	92.97
Azioni			2,722,771.73	2,998,400.42	34.79
ITALIA			1,875,960.96	2,053,500.42	23.83
Finanza			492,981.07	526,021.00	6.11
3,500.00	BANCA GENERALI SPA	EUR	123,683.44	125,930.00	1.46
9,265.00	BANCA IFIS SPA	EUR	96,790.12	124,151.00	1.44
5,500.00	AZIMUT HOLDING SPA	EUR	113,788.77	112,640.00	1.31
10,000.00	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA	EUR	91,219.74	98,500.00	1.15
15,000.00	CELLULARLINE SPA	EUR	67,499.00	64,800.00	0.75
Beni voluttuari			391,964.99	441,338.20	5.12
2,000.00	TOD'S SPA	EUR	83,488.21	114,600.00	1.33
30,000.00	ELICA SPA	EUR	101,491.83	105,750.00	1.23
5,500.00	SALVATORE FERRAGAMO SPA	EUR	85,360.70	99,247.50	1.15
4,000.00	UNIEURO SPA	EUR	101,971.93	97,600.00	1.13
452.00	PORTOBELLO SPA	EUR	18,532.00	19,933.20	0.23
1,600.00	RADICI PIETRO INDUSTRIES & BRANDS SPA	EUR	0.00	2,736.00	0.03
300.00	POWERSOFT SPA	EUR	981.82	1,440.00	0.02
30.00	SOSTRAVEL.COM SPA	EUR	138.50	31.50	0.00
Industria			324,233.78	394,854.00	4.58
8,500.00	OFFICINA STELLARE SPA	EUR	61,547.25	146,200.00	1.70
9,000.00	AVIO SPA	EUR	121,023.86	111,960.00	1.30
100,000.00	FINCANTIERI SPA	EUR	82,473.95	76,000.00	0.88
2,000.00	PRYSMIAN SPA	EUR	58,906.90	60,460.00	0.70
20.00	FERVI SPA	EUR	281.82	234.00	0.00
Beni di prima necessità			176,622.84	189,800.00	2.20
15,000.00	NEWLAT FOOD SPA	EUR	97,514.32	102,300.00	1.19
25,000.00	CENTRALE DEL LATTE D'ITALIA	EUR	79,108.52	87,500.00	1.01
Informatica			164,043.39	159,485.00	1.85
20,000.00	EUROTECH SPA	EUR	100,293.39	91,760.00	1.06
15,000.00	ALMAWAVE SPA	EUR	63,750.00	67,725.00	0.79
Materie prime			108,345.22	121,948.30	1.42
7,165.00	SOL SPA	EUR	108,345.22	121,948.30	1.42
Servizi di pubblica utilità			101,913.63	104,520.00	1.21
30,000.00	HERA SPA	EUR	101,913.63	104,520.00	1.21
Energia			102,816.41	102,700.00	1.19
10,000.00	ENI SPA	EUR	102,816.41	102,700.00	1.19
Servizi di telecomunicazione			13,039.63	12,833.92	0.15
18,127.00	RIZZOLI CORRIERE DELLA SERA MEDIAGROUP SPA	EUR	13,039.63	12,833.92	0.15
PAESI BASSI			408,437.35	409,370.00	4.75
Beni voluttuari			171,463.66	174,000.00	2.02
1,000.00	FERRARI NV	EUR	171,463.66	174,000.00	2.02
Informatica			122,844.77	122,420.00	1.42
4,000.00	STMICROELECTRONICS NV	EUR	122,844.77	122,420.00	1.42
Beni di prima necessità			114,128.92	112,950.00	1.31
10,000.00	DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	EUR	114,128.92	112,950.00	1.31
FRANCIA			239,758.45	348,710.00	4.04
Beni voluttuari			239,758.45	348,710.00	4.04
300.00	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	EUR	119,952.06	198,390.00	2.30
400.00	L'OREAL SA	EUR	119,806.39	150,320.00	1.74

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

NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
GERMANIA			106,786.55	94,900.00	1.10
Beni voluttuari			106,786.55	94,900.00	1.10
10,000.00	DEUTSCHE LUFTHANSA AG REG	EUR	106,786.55	94,900.00	1.10
LUSSEMBURGO			91,828.42	91,920.00	1.07
Industria			91,828.42	91,920.00	1.07
10,000.00	TENARIS SA	EUR	91,828.42	91,920.00	1.07
Obbligazioni ordinarie			3,704,562.44	3,741,151.50	43.41
ITALIA			2,897,810.32	2,926,372.50	33.95
Finanza			1,420,204.24	1,457,279.50	16.91
250,000.00	INTESA SANPAOLO SPA 0.63% 24/02/2026	EUR	250,135.01	249,875.00	2.90
200,000.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA 4.13% 04/05/2026	EUR	225,590.20	234,718.00	2.72
200,000.00	UNICREDIT SPA 2.13% 24/10/2026	EUR	216,939.75	217,668.00	2.53
200,000.00	UNIPOL GRUPPO SPA 3.00% 18/03/2025	EUR	214,611.81	217,288.00	2.52
200,000.00	INTESA SANPAOLO SPA 2.86% 23/04/2025	EUR	205,713.74	213,906.00	2.48
110,000.00	FIRST CAPITAL SPA 3.75% 06/12/2026	EUR	107,800.00	119,465.50	1.39
100,000.00	BANCA DEL MEZZOGIORNO-MEDIO CREDITO CENTRALE SPA 1.50% 24/10/2024	EUR	99,643.84	102,530.00	1.19
100,000.00	TAMBURI INVESTMENT PARTNERS SPA 2.50% 05/12/2024	EUR	99,769.89	101,829.00	1.18
Servizi di pubblica utilità			529,293.62	535,768.00	6.21
200,000.00	ERG SPA 1.88% 11/04/2025	EUR	208,215.25	212,500.00	2.47
100,000.00	ACQUIRENTE UNICO SPA REG 2.80% 20/02/2026	EUR	110,205.06	110,690.00	1.28
100,000.00	A2A SPA 1.63% 19/10/2027	EUR	106,783.69	108,029.00	1.25
100,000.00	TERNA RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA 1.00% 10/04/2026	EUR	104,089.62	104,549.00	1.21
Industria			429,311.80	413,905.00	4.80
200,000.00	LEONARDO SPA 4.88% 24/03/2025	EUR	234,587.79	229,672.00	2.67
100,000.00	AEROPORTI DI ROMA SPA REG 1.63% 08/06/2027	EUR	102,981.18	105,501.00	1.22
97,200.00	ENERTRONICA SPA 7.00% 31/12/2022	EUR	91,742.83	78,732.00	0.91
Servizi di telecomunicazione			206,582.60	206,640.00	2.40
200,000.00	RAI-RADIOTELEVISIONE ITALIANA SPA 1.38% 04/12/2024	EUR	206,582.60	206,640.00	2.40
Enti Governativi			110,536.32	107,890.00	1.25
100,000.00	BTP 1.65% 01/03/2032	EUR	110,536.32	107,890.00	1.25
Energia			100,000.00	103,174.00	1.20
100,000.00	ALERION CLEANPOWER SPA REG 3.13% 19/12/2025	EUR	100,000.00	103,174.00	1.20
Beni voluttuari			101,881.74	101,716.00	1.18
100,000.00	PIRELLI & C SPA 1.38% 25/01/2023	EUR	101,881.74	101,716.00	1.18
PAESI BASSI			448,559.35	452,290.00	5.25
Beni voluttuari			250,950.34	249,746.00	2.90
200,000.00	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV 4.50% 07/07/2028	EUR	250,950.34	249,746.00	2.90
Servizi di pubblica utilità			197,609.01	202,544.00	2.35
200,000.00	ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 0.38% 17/06/2027	EUR	197,609.01	202,544.00	2.35
GERMANIA			210,783.22	209,096.00	2.43
Enti Governativi			210,783.22	209,096.00	2.43
200,000.00	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 0.25% 15/02/2027	EUR	210,783.22	209,096.00	2.43
LUSSEMBURGO			147,409.55	153,393.00	1.78
Sovranazionale			147,409.55	153,393.00	1.78
150,000.00	EIB 0.13% 15/04/2025	EUR	147,409.55	153,393.00	1.78

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

NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2021 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Obbligazioni a tasso variabile			749,337.57	761,044.50	8.83
ITALIA			749,337.57	761,044.50	8.83
Finanza			454,071.46	459,034.50	5.33
231,000.00	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA FRN 25/01/2024	EUR	241,794.58	242,434.50	2.81
200,000.00	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA FRN 10/09/2025	EUR	212,276.88	216,600.00	2.52
Enti Governativi			295,266.11	302,010.00	3.50
300,000.00	CCT FRN 15/09/2025	EUR	295,266.11	302,010.00	3.50
Azioni di OICR			406,818.42	512,030.00	5.94
FRANCIA			256,818.42	327,680.00	3.80
Finanza			256,818.42	327,680.00	3.80
2,000.00	LYXOR FTSE ITALIA MID CAP PIR DR UCITS ETF	EUR	256,818.42	327,680.00	3.80
LUSSEMBURGO			150,000.00	184,350.00	2.14
Finanza			150,000.00	184,350.00	2.14
1,500.00	NEW MILLENNIUM SIF-SICAV - AIM SISTEMA ITALIA - PIR	EUR	150,000.00	184,350.00	2.14
ALTRI VALORI MOBILIARI			155,653.02	155,592.63	1.80
Obbligazioni ordinarie			155,653.02	155,592.63	1.80
ITALIA			155,653.02	155,592.63	1.80
Servizi di telecomunicazione			155,653.02	155,592.63	1.80
155,592.62	PRISMI SPA 3.50% 18/12/2023	EUR	155,653.02	155,592.63	1.80
Totale del Portafoglio Titoli			7,739,143.18	8,168,219.05	94.77

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 2021 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 conformita' ai principi contabili di riferimento.

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 2021 sono:

1 EUR =	1.579621	AUD
1 EUR =	5.950671	BRL
1 EUR =	1.096187	CHF
1 EUR =	7.662637	CNY
1 EUR =	7.436249	DKK
1 EUR =	0.858446	GBP
1 EUR =	88.14799	INR
1 EUR =	146.5062	ISK
1 EUR =	131.6231	JPY
1 EUR =	23.61187	MXN
1 EUR =	2.20371	NLG
1 EUR =	10.20491	NOK
1 EUR =	86.63449	RUB
1 EUR =	10.142	SEK
1 EUR =	10.30251	TRY
1 EUR =	1.185901	USD
1 EUR =	16.93318	ZAR

m) Investimenti incrociati

Il Prospetto del Patrimonio Netto consolidato mostra un totale del Patrimonio Netto a EUR 1,026,487,224.08. Alla fine dell'anno, i comparti NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing e NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative hanno investito un valore totale di EUR 2,041,081.24 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 1,024,446,142.84.

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 0,01% annuale calcolata e pagata trimestralmente sul Valore del Patrimonio Netto di ciascun Comparto del Fondo alla fine di ciascun trimestre.

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 - Augustum Market Timing	1,846.32	13,643.41	7.3	2,442.19	17,939.22

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 2021, 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%	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%	0.55%	
NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible	1.35%		1.00%	1.15%		
NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe	0.80%	0.80%	0.40%	0.55%	0.40%	
NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond	1.50%	1.50%	0.75%	0.90%	0.75%	
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%	0.80%	
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%	1.20%	0.60%	0.75%	0.60%	

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 2021, 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 - TARGET 2021 -AAZ-	1.20%
AZ FUND 1 - 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 dei periodi 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. Il periodo di riferimento inizia il 1° Gennaio di ogni anno e termina il 31 Dicembre dello stesso anno. A partire dal 6 Dicembre 2012, le commissioni sulla performance sono subordinate al verificarsi delle seguenti condizioni:

- Il GAV del comparto è superiore all'HWM (High Water Mark)
- Nel periodo di riferimento 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 maggiore del valore netto per azione della fine dell'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 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 alla fine dell'anno precedente: l'accantonamento sarà calcolata sulla differenza tra la performance del comparto e la performance del benchmark nel periodo di riferimento.

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 - PIR Bilanciato Sistema Italia

Le commissioni di performance sono calcolate per ogni giorno di calcolo del valore patrimoniale netto e sono pagate annualmente 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 periodo di riferimento sia inferiore al più alto valore del patrimonio netto per azione determinato al termine di qualunque periodo 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"). Il periodo di riferimento inizia il 1° gennaio di ogni anno e termina il 31 dicembre.

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

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 periodo di riferimento. Il periodo di riferimento inizia il 1° gennaio di ogni anno e termina il 31 dicembre dello stesso anno. Le commissioni di performance verranno applicate al verificarsi delle seguenti condizioni:

- Il GAV del Comparto è superiore all' HWM
- Nel periodo di riferimento il rendimento del Comparto è positivo e maggiore di quello del benchmark

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 calcolata la differenza tra il valore giornaliero ed il prezzo di chiusura del giorno precedente a quello in cui l'HWM è stato superato (as esempio: se l'HWM viene superato il 20 aprile, il rendimento del benchmark da considerare il 20 aprile 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 nel periodo di riferimento.

Per il comparto:

NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity

Le commissioni di performance sono calcolate per ogni giorno di calcolo del valore patrimoniale netto e sono pagate annualmente alla Società di Gestione, al Gestore degli investimenti o al Consulente degli Investimenti (se presente) all'inizio dell'anno successivo. Il principio dell'High Water Mark non è applicato a questo comparto. La commissione di performance sarà pari ad una percentuale, indicata di seguito, dell'extra rendimento rispetto al relativo benchmark.

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 periodo di riferimento. Il periodo di riferimento inizia il 1° gennaio di ogni anno e termina il 31 dicembre dello stesso anno. Le commissioni di performance verranno applicate al verificarsi delle seguenti condizioni:

- Nel periodo di riferimento il rendimento del Comparto è positivo e maggiore di quello del benchmark.
- Una volta verificatasi questa condizione, l'accantonamento verrà calcolato sulla differenza tra la performance del comparto e la performance del benchmark nel periodo di riferimento.

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%

Commissioni sulla performance relative	Benchmark	Percentuale
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%
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%

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 2021 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,D,I,L,Y
NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)	A,I,L

Comparti	Azioni in circolazione
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,Y*
NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate	A,D,I,L,Y
NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative	A,D,I,L,Y
NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible	A,I,L
NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe	A,D,I,L,Y
NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond	A,D,I,L,Y
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,Y
NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond	A,I,L
NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity	A,I,L
NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia	A,D,I,L,Y

* NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond Classe Y chiusa il 27 Gennaio 2021

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 2021 è disponibile presso la sede sociale della Sicav.

11. COSTI DI TRANSAZIONE

Per il periodo che termina il 30 Giugno 2021, 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 2021, 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	67,466.88
NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)	16,251.58
NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term	2,395.67
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond	115.52
NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate	6,961.45
NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative	38,688.60
NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible	30,777.28
NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe	11,495.88
NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond	0.00
NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing	327.96
NEW MILLENNIUM - VolActive	4,504.73
NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond	0.00
NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond	0.00
NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity	19,811.91
NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia	22,527.19

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 2021 sono riportate in seguito ai Portafogli dei comparti interessati.

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

Al 30 Giugno 2021, 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 2021, il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond ha pagato un importo in denaro pari a EUR 163.78 da JP Morgan Securities Plc. come garanzia per i contratti swap.

Al 30 Giugno 2021, il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 1,099.59 da JP Morgan Securities Plc. come garanzia per i contratti swap.

Al 30 Giugno 2021, il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 1,000,000.00 da JP Morgan Securities Plc. come garanzia per i contratti swap.

Al 30 Giugno 2021, il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 9,110,247.80 da JP Morgan Securities Plc. come garanzia per i contratti swap.

Al 30 Giugno 2021, il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 499,586.26 da JP Morgan Securities Plc. come garanzia per i contratti finanziari a termine.

Al 30 Giugno 2021, il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 100,000.00 da Nomura International Plc. come garanzia per i contratti finanziari a termine.

Al 30 Giugno 2021, il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 198,400.04 da Nomura International Plc. come garanzia per i contratti finanziari a termine.

Al 30 Giugno 2021, il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 220,000.00 da Nomura International Plc. come garanzia per i contratti finanziari a termine.

Al 30 Giugno 2021, il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Global High Yield Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 196,726.19 da Nomura International Plc. come garanzia per i contratti finanziari a termine.

Al 30 Giugno 2021, il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 440,000.00 da Nomura International Plc. come garanzia per i contratti finanziari a termine.

13. EVENTI ACCADUTI DURANTE IL PERIODO

Un dividendo per le Azioni D per il comparto NEW MILLENNIUM - VolActive, NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond e NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond, 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 comparti NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond, 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 4 Gennaio 2021 e data valuta 7 Gennaio 2021:

Comparti	Nome della classe	Dividendo per azione	Valuta	Somma da pagare
NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate	D	0.59	EUR	1,622.60
	Y	0.74	EUR	30,617.37
NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term	D	0.48	EUR	322.44
	Y	0.69	EUR	14.57
NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond	D	3.27	EUR	45,260.42
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	D	3.68	EUR	385,103.48
	Y	7.38	EUR	106,326.24
	Z	0.89	EUR	139,740.19
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond	D	2.29	EUR	185,278.97
	Y	3.61	EUR	26,768.15
NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing	D	2.26	EUR	7,381.65
	Y	2.58	EUR	77.68
NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond	D	3.36	EUR	10,646.10
NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe	Y	0.55	EUR	15.21
NEW MILLENNIUM - VolActive	D	1.69	EUR	124.55
NEW MILLENNIUM - Euro Equities	Y	2.47	EUR	59,661.83

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 2021 e data valuta 8 Aprile 2021:

Comparti	Nome della classe	Dividendo per azione	Valuta	Somma da pagare
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	Z	0.88	EUR	138,170.06

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.

A partire dal 29 Aprile tutti i comparti adottano la metodologia del VaR assoluto.

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: 01.01-30.06.2021 Fondo	Limite VaR	VaR			Riferimento
		% Utilizzo Limite VaR			
		Minimo	Medio	Massimo	
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	20%	8.60	10.17	11.92	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Euro Equities	20%	43.26	52.24	63.48	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Global Equities	20%	38.00	45.15	54.76	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term	20%	2.35	3.37	4.41	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond	20%	5.83	8.50	11.24	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate	20%	4.11	4.81	6.09	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative	20%	10.18	13.10	16.30	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible	20%	9.00	16.70	26.46	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe	20%	5.67	8.81	12.43	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond	20%	8.10	9.51	11.77	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing	20%	11.35	16.65	24.14	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Volactive	20%	3.48	21.01	47.14	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond	20%	15.96	19.65	24.84	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield	20%	20.15	24.98	30.70	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity	20%	13.77	16.74	19.90	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia	20%	16.01	21.88	28.97	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	57.13	89.51	146.71	1.41	6.64	29.95
NEW MILLENNIUM - Euro Equities	0.06	1.32	3.14	0.01	1.27	3.10
NEW MILLENNIUM - Global Equities	85.86	91.57	101.63	7.62	9.24	12.13
NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond	54.69	98.52	172.54	0.00	1.62	23.95
NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate	0.48	0.52	0.56	0.48	0.52	0.56
NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative	0.03	0.21	2.53	0.01	0.14	2.44
NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible	3.20	16.82	27.64	0.00	0.92	5.51
NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00

Fondo	Leva					
	Somma dei nozionali			Metodo degli impegni		
	Min	Medio	Max	Min	Medio	Max
NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond	30.09	32.33	89.95	1.55	1.80	3.12
NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing	2.38	2.66	2.88	0.83	1.05	1.46
NEW MILLENNIUM - Volactive	5.09	10.79	17.25	0.00	7.30	16.82
NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond	17.38	21.52	53.77	0.85	1.56	15.71
NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield	14.15	29.60	51.21	5.83	8.73	15.73
NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity	0.20	2.56	3.68	0.00	0.01	0.50
NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia	2.16	2.55	3.20	1.52	1.94	2.49

2. 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

Alla data del 30 Giugno 2021, il fondo non è impattato dal regolamento delle transazioni finanziarie di titoli.

APPENDICE NON AUDITATA PER INVESTITORI SVIZZERI**1. Performance e TER**

Fondo	Classe	Performance YTD	Benchmark YTD	TER	Performance Fee (%)
New Millennium - Augustum High Quality Bond	A	1.86%	-1.10%	1.55%	0.11%
New Millennium - Augustum High Quality Bond	I	2.08%	-1.10%	1.07%	0.17%
New Millennium - Augustum High Quality Bond	D	1.86%	-1.10%	1.58%	0.14%
New Millennium - Augustum High Quality Bond	L	1.99%	-1.10%	1.24%	0.16%
New Millennium - Augustum High Quality Bond*	Y	-0.67%	-1.10%	0.91%	0.03%
New Millennium - Augustum High Quality Bond	A (H-CHF)	0.29%	-1.10%	3.39%	0.00%
New Millennium - Augustum High Quality Bond	A (H-USD)	0.52%	-1.10%	4.16%	0.10%
New Millennium - Augustum Corporate Bond	A	2.26%	-0.38%	1.99%	0.22%
New Millennium - Augustum Corporate Bond	I	2.60%	-0.38%	1.31%	0.32%
New Millennium - Augustum Corporate Bond	D	2.26%	-0.38%	1.99%	0.22%
New Millennium - Augustum Corporate Bond	L	2.51%	-0.38%	1.42%	0.25%
New Millennium - Augustum Corporate Bond	Y	2.60%	-0.38%	1.27%	0.28%
New Millennium - Augustum Corporate Bond	A (H-CHF)	2.03%	-0.38%	2.40%	0.11%
New Millennium - Augustum Corporate Bond	A (H-USD)	2.41%	-0.38%	2.47%	0.41%
New Millennium - Augustum Corporate Bond	Z	2.73%	-0.38%	1.09%	0.35%
New Millennium - Augustum Italian Diversified Bond	A	2.68%	-1.17%	2.18%	0.44%
New Millennium - Augustum Italian Diversified Bond	I	3.04%	-1.17%	1.53%	0.58%
New Millennium - Augustum Italian Diversified Bond	D	2.69%	-1.17%	2.17%	0.43%
New Millennium - Augustum Italian Diversified Bond	L	2.96%	-1.17%	1.76%	0.62%
New Millennium - Augustum Market Timing	A	5.64%	3.20%	4.10%	0.00%
New Millennium - Augustum Market Timing	I	6.07%	3.20%	3.18%	0.09%
New Millennium - Augustum Market Timing	D	5.63%	3.20%	4.08%	0.00%
New Millennium - Augustum Market Timing	L	6.04%	3.20%	3.10%	0.10%
New Millennium - Augustum Market Timing	Y	6.06%	3.20%	3.22%	0.09%
New Millennium - Augustum Extra Euro High Quality Bond	A	2.58%	-0.33%	1.87%	0.00%
New Millennium - Augustum Extra Euro High Quality Bond	I	3.00%	-0.33%	1.04%	0.00%
New Millennium - Augustum Extra Euro High Quality Bond	D	2.56%	-0.33%	1.87%	0.00%
New Millennium - Augustum Extra Euro High Quality Bond	L	2.92%	-0.33%	1.22%	0.00%
New Millennium - Evergreen Global High Yield Bond	A	5.53%	1.71%	3.19%	0.00%
New Millennium - Evergreen Global High Yield Bond	I	5.99%	1.71%	2.25%	0.00%
New Millennium - Evergreen Global High Yield Bond	L	5.89%	1.71%	2.48%	0.00%
New Millennium - Inflation Linked Bond Europe	A	1.29%	2.01%	1.27%	0.00%
New Millennium - Inflation Linked Bond Europe	I	1.50%	2.01%	0.83%	0.00%
New Millennium - Inflation Linked Bond Europe	L	1.41%	2.01%	1.02%	0.00%
New Millennium - Inflation Linked Bond Europe	Y	1.58%	2.01%	0.72%	0.00%
New Millennium - Balanced World Conservative	A	1.96%	2.75%	1.98%	0.28%
New Millennium - Balanced World Conservative	I	2.25%	2.75%	1.51%	0.39%
New Millennium - Balanced World Conservative	L	2.17%	2.75%	1.68%	0.39%
New Millennium - Euro Bonds Short Term	A	-0.55%	-0.33%	1.17%	0.00%
New Millennium - Euro Bonds Short Term	I	-0.40%	-0.33%	0.89%	0.00%
New Millennium - Euro Bonds Short Term	D	-0.55%	-0.33%	1.18%	0.00%
New Millennium - Euro Bonds Short Term	L	-0.50%	-0.33%	1.07%	0.00%
New Millennium - Euro Bonds Short Term	Y	-0.31%	-0.33%	0.71%	0.00%
New Millennium - Global Equities (Eur Hedged)	A	10.55%	12.97%	2.38%	0.34%

Fondo	Classe	Performance YTD	Benchmark YTD	TER	Performance Fee (%)
New Millennium - Global Equities (Eur Hedged)	I	11.02%	12.97%	1.64%	0.44%
New Millennium - Global Equities (Eur Hedged)	L	10.91%	12.97%	1.82%	0.43%
New Millennium - Euro Equities	A	11.38%	15.97%	1.98%	0.00%
New Millennium - Euro Equities	I	11.86%	15.97%	1.65%	0.51%
New Millennium - Euro Equities	L	11.75%	15.97%	1.63%	0.30%
New Millennium - Euro Equities	Y	11.88%	15.97%	1.14%	0.00%
New Millennium - Total Return Flexible	A	3.54%	2.52%	2.20%	0.13%
New Millennium - Total Return Flexible**	L	0.00%	2.52%	2.25%	0.27%
New Millennium - Large Europe Corporate	A	-0.33%	0.21%	1.16%	0.00%
New Millennium - Large Europe Corporate	I	-0.09%	0.21%	0.67%	0.00%
New Millennium - Large Europe Corporate	D	-0.33%	0.21%	1.16%	0.00%
New Millennium - Large Europe Corporate	L	-0.18%	0.21%	0.86%	0.00%
New Millennium - Large Europe Corporate	Y	-0.10%	0.21%	0.67%	0.00%
New Millennium - VolActive	A	2.10%	1.47%	3.28%	0.00%
New Millennium - VolActive	I	2.36%	1.47%	2.46%	0.33%
New Millennium - VolActive	D	2.19%	1.47%	3.37%	0.00%
New Millennium - VolActive	L	2.18%	1.47%	2.73%	0.42%
New Millennium - Multi Asset Opportunity	A	4.16%	3.14%	2.36%	0.22%
New Millennium - Multi Asset Opportunity	I	4.37%	3.14%	1.94%	0.28%
New Millennium - Multi Asset Opportunity	L	4.28%	3.14%	2.10%	0.26%
New Millennium - PIR Bilanciato Sistema Italia	A	6.37%	4.81%	2.24%	0.33%
New Millennium - PIR Bilanciato Sistema Italia	I	6.42%	4.81%	2.05%	0.77%
New Millennium - PIR Bilanciato Sistema Italia	L	6.35%	4.81%	2.17%	0.71%

*Ultimo NAV calcolato il 24/01/2021; la performance indicata si riferisce al periodo 31/12/2020 - 24/01/2021.

**Primo NAV calcolato il 01/02/2021; la performance indicata si riferisce al periodo 01/02/2021 - 30/06/2021.

Le performance passate non sono un indicatore delle performance attuali o future. I dati sulla performance non tengono conto delle commissioni e dei costi sostenuti al momento della sottoscrizione e del riscatto delle quote. Le commissioni e le spese hanno un impatto negativo sulla performance.

Per i comparti con una esposizione in fondi maggiore del 10% (Balanced World Conservative, Augustum Market Timing e Multi Asset Opportunity), il TER riportato include il costo collegato ai fondi target. Il valore del TER dei singoli fondi è stato stimato utilizzando le spese correnti come riportate dai KIID in vigore.