

NEW MILLENNIUM

SOCIÉTÉ D'INVESTISSEMENT À CAPITAL VARIABLE

RENDICONTO DI GESTIONE SEMESTRALE NON CERTIFICATO AL 30 GIUGNO 2024

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	4	NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible	59
Organizzazione del Fondo	5	Prospetto del Patrimonio Netto	59
Prospetto Comparativo dei Patrimoni Netti degli ultimi 3 anni/periodi	7	Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	60
		Portafoglio Titoli	61
		Impegni su acquisto/vendita di contratti futures	65
		Contratti di opzioni	66
Prospetto del Patrimonio Netto consolidato	9	NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe	67
		Prospetto del Patrimonio Netto	67
Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto consolidato	10	Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	68
		Portafoglio Titoli	69
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	11	NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond	71
Prospetto del Patrimonio Netto	11	Prospetto del Patrimonio Netto	71
Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	12	Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	72
Portafoglio Titoli	13	Portafoglio Titoli	73
Impegni su acquisto/vendita di contratti futures	21	Contratti finanziari a termine	76
Contratti di opzioni	22		
Contratti finanziari a termine	23	NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing	77
Contratti Swap	24	Prospetto del Patrimonio Netto	77
		Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	78
NEW MILLENNIUM - Euro Equities	25	Portafoglio Titoli	79
Prospetto del Patrimonio Netto	25		
Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	26	NEW MILLENNIUM - Alpha Active Allocation	80
Portafoglio Titoli	27	Prospetto del Patrimonio Netto	80
		Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	81
NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)	30	Portafoglio Titoli	82
Prospetto del Patrimonio Netto	30	Impegni su acquisto/vendita di contratti futures	86
Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	31		
Portafoglio Titoli	32	NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond	87
Impegni su acquisto/vendita di contratti futures	35	Prospetto del Patrimonio Netto	87
		Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	88
NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term	36	Portafoglio Titoli	89
Prospetto del Patrimonio Netto	36	Contratti di opzioni	91
Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	37	Contratti finanziari a termine	92
Portafoglio Titoli	38		
		NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond	93
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond	40	Prospetto del Patrimonio Netto	93
Prospetto del Patrimonio Netto	40	Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	94
Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	41	Portafoglio Titoli	95
Portafoglio Titoli	42	Impegni su acquisto/vendita di contratti futures	98
Impegni su acquisto/vendita di contratti futures	45	Contratti finanziari a termine	99
Contratti finanziari a termine	46		
Contratti Swap	47	NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity	100
		Prospetto del Patrimonio Netto	100
NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate	48	Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	101
Prospetto del Patrimonio Netto	48	Portafoglio Titoli	102
Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	49	Impegni su acquisto/vendita di contratti futures	106
Portafoglio Titoli	50		
		NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia	107
NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative	53	Prospetto del Patrimonio Netto	107
Prospetto del Patrimonio Netto	53	Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	108
Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	54	Portafoglio Titoli	109
Portafoglio Titoli	55		
		Note ai Rendiconti Finanziari	112

INDICE

Appendice non certificata

125 |

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****Sante JANNONI**

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

Amministratori**Emanuele BONABELLO**

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

Paola DE SIMONE

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

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

11 rue Béatrix de Bourbon
L-1225 Lussemburgo

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

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

Gianluca COSTANTINI (Amministratore)

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

Alex SCHMITT (Amministratore)

Socio
Bonn & Schmitt
148, Avenue de la Faiencerie
L-1511 Lussemburgo

Incaricati della Società di Gestione**Alberto ALFIERO**

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

Sante JANNONI

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

Pietro MISSERI

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

SEDE LEGALE

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

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 Lussemburgo

AMMINISTRAZIONE CENTRALE E TRANSFER AGENT**State Street Bank International GmbH, Filiale di Lussemburgo.**

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

SOGGETTO INCARICATO DEI PAGAMENTI IN ITALIA**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 Turin

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**KPMG Audit S.à r.l.,**

39, Avenue J.F. Kennedy
L-1855 Lussemburgo

COMPARATIVO DEI VALORI NETTI D'INVENTARIO DEGLI ULTIMI TRE ANNI

	Valuta	30 Giugno 2024		31 Dicembre 2023		31 Dicembre 2022	
		Totale NAV in EUR	per Azione nella valuta della Classe di Azioni	Totale NAV in EUR	per Azione nella valuta della Classe di Azioni	Totale NAV in EUR	per Azione nella valuta della Classe di Azioni
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond							
Azione A	EUR	78,462,672.07	238.70	53,517,775.03	231.73	34,823,368.06	210.58
Azione A (H-CHF)	CHF	2,752,032.75	101.40	2,039,502.49	99.54	1,769,696.14	93.05
Azione A (H-USD)	USD	7,741,468.23	121.80	8,052,912.45	117.67	5,733,434.65	105.36
Azione D	EUR	13,017,107.12	96.41	9,816,425.18	97.00	9,277,034.71	91.32
Azione I	EUR	223,624,083.55	263.01	209,685,706.64	254.42	227,624,217.79	229.73
Azione L	EUR	90,750.43	258.55	73,589.89	250.31	111,811.28	226.34
Azione Y	EUR	0.00	0.00	0.00	0.00	1,283,165.02	185.77
Azione Z	EUR	0.00	0.00	0.00	0.00	14,003,405.22	89.19
Totale attivo netto	EUR	325,688,114.15		283,185,911.68		294,626,132.87	
NEW MILLENNIUM - Euro Equities							
Azione A	EUR	3,522,651.28	78.82	3,583,163.94	73.33	5,144,921.20	61.98
Azione I	EUR	21,218,933.66	88.77	20,528,039.18	82.25	21,597,319.57	68.94
Azione L	EUR	164,444.77	87.42	167,823.23	81.07	189,349.08	68.09
Azione Y	EUR	0.00	0.00	0.00	0.00	875,633.40	61.44
Totale attivo netto	EUR	24,906,029.71		24,279,026.35		27,807,223.25	
NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)							
Azione A	EUR	3,361,910.65	134.33	3,209,526.90	119.89	2,733,429.59	101.43
Azione I	EUR	38,563,470.68	151.88	36,088,543.51	134.98	32,165,568.14	113.26
Azione L	EUR	280,388.19	149.46	249,430.84	132.96	209,671.29	111.77
Totale attivo netto	EUR	42,205,769.52		39,547,501.25		35,108,669.02	
NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term							
Azione A	EUR	365,548.92	132.01	364,747.26	131.67	337,371.43	127.31
Azione D	EUR	36,898.37	88.66	43,351.36	91.87	37,213.88	89.41
Azione I	EUR	7,399,571.95	138.18	7,581,353.75	137.64	8,249,646.28	132.69
Azione L	EUR	829,635.96	135.74	1,848,798.31	135.33	1,915,180.53	130.72
Azione Y	EUR	2,775.86	131.42	2,868.95	135.83	2,779.47	131.59
Totale attivo netto	EUR	8,634,431.06		9,841,119.63		10,542,191.59	
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond							
Azione A	EUR	53,893,210.25	157.13	49,054,255.94	157.78	41,821,138.73	149.22
Azione A (H-CHF)	CHF	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
Azione A (H-USD)	USD	1,595,065.97	109.62	1,474,954.34	109.82	1,428,430.75	102.76
Azione D	EUR	15,361,477.87	85.17	13,839,356.25	87.72	14,329,467.53	85.08
Azione I	EUR	41,787,662.18	167.31	46,585,555.90	167.55	57,697,345.66	157.74
Azione L	EUR	36,899.05	164.73	36,987.29	165.12	34,874.52	155.69
Totale attivo netto	EUR	112,674,315.32		110,991,109.72		115,311,368.44	
NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate							
Azione A	EUR	2,440,522.31	131.82	2,238,940.95	131.19	2,428,497.78	123.81
Azione D	EUR	236,567.36	103.79	236,658.17	107.53	225,275.10	102.36
Azione I	EUR	50,138,920.62	141.68	50,667,561.80	140.67	51,069,511.38	132.10
Azione L	EUR	1,678,127.39	139.37	2,227,317.15	138.50	2,143,914.88	130.31
Azione Y	EUR	2,813.95	132.86	2,906.89	137.25	5,374,731.18	129.90
Totale attivo netto	EUR	54,496,951.63		55,373,384.96		61,241,930.32	
NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative							
Azione A	EUR	25,558,628.80	148.02	36,731,127.44	144.72	40,923,887.19	135.31
Azione D	EUR	411,081.62	138.96	823,443.27	143.00	907,179.30	135.05
Azione I	EUR	9,030,626.36	162.55	8,192,804.57	158.45	13,733,028.42	147.29
Azione L	EUR	8,074,111.17	160.11	12,548,540.98	156.22	14,329,172.82	145.47
Totale attivo netto	EUR	43,074,447.95		58,295,916.26		69,893,267.73	
NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible							
Azione A	EUR	1,200,210.80	132.78	913,197.80	129.01	746,290.39	119.01
Azione I	EUR	2,624,325.54	109.88	5,224,877.46	106.54	4,583,058.66	97.95
Azione L	EUR	12,916,437.01	133.05	11,832,677.36	129.13	10,961,510.04	118.93
Totale attivo netto	EUR	16,740,973.35		17,970,752.71		16,290,859.18	
NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe							
Azione A	EUR	998,540.05	107.53	2,033,260.73	107.61	2,329,250.30	104.27
Azione I	EUR	19,251,066.65	114.82	19,960,399.35	114.73	20,563,087.71	110.69
Azione L	EUR	497,124.67	112.80	1,122,378.01	112.76	2,171,613.49	108.98
Azione Y	EUR	2,346,172.40	106.66	2,445,716.55	111.19	2,384,531.15	108.41
Totale attivo netto	EUR	23,092,903.77		25,561,754.64		27,448,482.65	

COMPARATIVO DEI VALORI NETTI D'INVENTARIO DEGLI ULTIMI TRE ANNI

	Valuta	30 Giugno 2024		31 Dicembre 2023		31 Dicembre 2022	
		Totale NAV in EUR	per Azione nella valuta della Classe di Azioni	Totale NAV in EUR	per Azione nella valuta della Classe di Azioni	Totale NAV in EUR	per Azione nella valuta della Classe di Azioni
NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond							
Azione A	EUR	13,289,854.69	138.40	5,971,747.51	134.42	2,427,334.64	122.50
Azione D	EUR	968,936.51	99.99	607,055.06	100.08	592,984.40	94.02
Azione I	EUR	48,100,993.16	150.54	46,973,793.31	145.93	50,003,627.57	131.94
Azione L	EUR	157,150.46	148.26	152,414.46	143.79	155,256.84	130.25
Totale attivo netto	EUR	62,516,934.82		53,705,010.35		53,179,203.46	
NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing							
Azione A	EUR	2,078,641.54	108.79	2,093,677.70	106.96	2,178,425.07	102.33
Azione D	EUR	203,460.26	83.38	248,122.24	84.09	243,447.95	82.50
Azione I	EUR	30,260.61	121.04	29,604.36	118.42	700,628.08	112.10
Azione L	EUR	1,100.10	122.23	1,074.22	119.36	1,014.86	112.76
Azione Y	EUR	2,966.65	98.53	2,974.47	98.79	2,885.75	95.85
Totale attivo netto	EUR	2,316,429.16		2,375,452.99		3,126,401.71	
NEW MILLENNIUM - Alpha Active Allocation							
Azione A	EUR	357,265.71	90.66	363,325.73	88.22	453,811.00	84.71
Azione D	EUR	15,952.47	67.05	16,220.21	68.18	755.72	65.39
Azione I	EUR	45,303,043.52	101.51	43,922,311.70	98.42	5,356,757.88	93.42
Azione L	EUR	8,874.88	99.72	8,609.25	96.73	8,183.52	91.95
Totale attivo netto	EUR	45,685,136.58		44,310,466.89		5,819,508.12	
NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond							
Azione A	EUR	122,985.60	105.49	137,216.82	104.44	323,590.94	101.60
Azione D	EUR	128,313.44	73.14	132,320.17	75.42	134,106.24	76.44
Azione I	EUR	16,024,314.62	112.74	23,495,343.75	111.15	32,633,674.04	107.23
Azione L	EUR	28,863.42	111.01	28,483.63	109.55	27,529.75	105.88
Totale attivo netto	EUR	16,304,477.08		23,793,364.38		33,118,900.98	
NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond							
Azione A	EUR	0.00	0.00	0.00	0.00	232,002.29	80.00
Azione I	EUR	9,986,131.75	100.09	6,747,909.97	95.57	1,280,848.14	84.78
Totale attivo netto	EUR	9,986,131.75		6,747,909.97		1,512,850.52	
NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity							
Azione A	EUR	23,212,852.28	107.55	23,424,939.19	105.12	23,538,015.85	98.03
Azione I	EUR	4,736,459.86	111.66	4,634,312.31	108.87	4,492,162.75	101.03
Azione L	EUR	52,228,334.13	110.24	52,783,875.70	107.59	61,132,024.48	100.03
Totale attivo netto	EUR	80,177,646.27		80,843,127.20		89,162,203.08	
NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia							
Azione A	EUR	2,190,238.08	103.27	4,726,907.46	98.10	4,859,306.11	90.33
Azione I	EUR	3,571,071.90	107.70	3,586,084.35	101.95	3,498,892.81	93.30
Azione L	EUR	188,214.42	106.34	199,003.01	100.76	182,447.43	92.38
Totale attivo netto	EUR	5,949,524.40		8,511,994.82		8,540,646.35	

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO CONSOLIDATO AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Attività	Note	
Portafoglio Titoli al valore di mercato	(2a)	828,538,343.73
Liquidità bancarie a vista		20,924,220.51
Importi dovuti dai broker		18,333,681.75
Premio pagato su contratti swap	(2f)	821,015.43
Contratti di opzioni al valore di mercato	(2e, 13)	475,171.80
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	(2c, 13)	323,607.91
Utili non realizzati su contratti futures	(2d, 13)	461,938.81
Utili non realizzati su contratti swap	(2f, 13)	97,633.80
Dividendi da ricevere		58,108.36
Interessi da ricevere		9,369,138.20
Da ricevere su vendita titoli		1,113,522.83
Da ricevere su sottoscrizioni		1,684,437.23
Altre attività		87,050.26
Totale attività		882,287,870.62
Passività		
Scoperti bancari		-344,874.35
Contratti di opzioni al valore di mercato	(2e, 13)	-215,271.45
Premio ricevuto su contratti swap	(2f)	-20,910.91
Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	(2c, 13)	-509,222.91
Perdite non realizzate su contratti futures	(2d, 13)	-278,398.89
Perdite non realizzate su contratti swap	(2f, 13)	-826,865.47
Interessi da pagare su contratti swap		-17,248.29
Da pagare su rimborsi		-1,798,640.98
Altre passività		-3,826,220.85
Totale passività		-7,837,654.10
Totale attivo netto		874,450,216.52

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

PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO CONSOLIDATO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Attivo netto all'inizio del periodo	Note	845,333,803.80
Risultato netto degli investimenti		15,564,020.29
Altri ricavi		12,180.76
Totale ricavi		15,576,201.05
Commissioni di consulenza/gestione	(5)	-4,146,019.42
Commissione di consulenza	(6)	-118,947.88
Commissioni sulla performance	(7)	-1,178,600.79
Commissioni della Banca Depositaria	(8)	-247,492.52
Tassa di registrazione	(3)	-105,810.27
Interessi pagati su contratti swap		-263,501.04
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(8)	-378,031.56
Commissioni del Transfer Agent		-50,309.20
Compensi professionali	(9)	-92,094.86
Pubblicazioni		-20,722.24
Altre spese e tasse	(4)	-225,958.05
Totale costi		-6,827,487.83
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		8,748,713.22
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(2b)	7,826,194.37
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		-2,191,371.16
- di contratti di opzioni		-298,553.52
- di contratti futures		-1,963,892.47
- di contratti swap		11,884.33
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		15,032,842.20
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(2c)	-817,462.13
- sulle opzioni		190,745.35
- su contratti futures	(2d)	-1,786,044.43
- su contratti swap		-129,156.83
Risultato netto delle operazioni per il periodo		24,623,898.93
Distribuzioni di dividendi	(14)	-874,870.06
Sottoscrizioni del periodo		105,527,368.10
Rimborsi del periodo		-100,159,984.25
Attivo netto alla fine del periodo		874,450,216.52

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Attività	Note		
Portafoglio Titoli al valore di mercato	(2a)	307,113,279.32	
Liquidità bancarie a vista		9,653,695.74	
Importi dovuti dai broker		5,128,988.37	
Premio pagato su contratti swap	(2f)	821,015.43	
Contratti di opzioni al valore di mercato	(2e, 13)	451,403.80	
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	(2c, 13)	160,830.94	
Utili non realizzati su contratti futures	(2d, 13)	82,916.34	
Utili non realizzati su contratti swap	(2f, 13)	97,633.80	
Dividendi da ricevere		12.93	
Interessi da ricevere		4,726,436.33	
Da ricevere su sottoscrizioni		1,254,206.58	
Altre attività		13,776.22	
Totale attività		329,504,195.80	
Passività			
Scoperti bancari		-344,874.35	
Contratti di opzioni al valore di mercato	(2e, 13)	-215,268.25	
Premio ricevuto su contratti swap	(2f)	-9,797.24	
Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	(2c, 13)	-344,891.64	
Perdite non realizzate su contratti swap	(2f, 13)	-685,899.47	
Interessi da pagare su contratti swap		-13,743.96	
Da pagare su rimborsi		-323,975.67	
Altre passività		-1,877,631.07	
Totale passività		-3,816,081.65	
Totale attivo netto		325,688,114.15	
	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	238.70	328,703.068
Azione A (H-CHF)	CHF	101.40	26,137.404
Azione A (H-USD)	USD	121.80	68,114.120
Azione D	EUR	96.41	135,011.389
Azione I	EUR	263.01	850,244.752
Azione L	EUR	258.55	351.000

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Attivo netto all'inizio del periodo	Note	283,185,911.68
Risultato netto degli investimenti		7,174,666.96
Altri ricavi		8,865.98
Totale ricavi		7,183,532.94
Commissioni di consulenza/gestione	(5)	-1,456,453.64
Commissione di consulenza	(6)	-11,770.26
Commissioni sulla performance	(7)	-1,026,877.16
Commissioni della Banca Depositaria	(8)	-85,300.57
Tassa di registrazione	(3)	-33,209.58
Interessi pagati su contratti swap		-193,368.88
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(8)	-76,772.67
Commissioni del Transfer Agent		-17,149.38
Compensi professionali	(9)	-8,811.40
Pubblicazioni		-7,004.98
Altre spese e tasse	(4)	-43,240.21
Totale costi		-2,959,958.73
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		4,223,574.21
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(2b)	2,047,309.14
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		-1,585,032.77
- di contratti di opzioni		-194,875.00
- di contratti futures		-86,639.89
- di contratti swap		11,884.33
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		6,360,545.56
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(2c)	-677,318.34
- sulle opzioni		181,910.55
- su contratti futures	(2d)	-349,915.36
- su contratti swap		-118,551.05
Risultato netto delle operazioni per il periodo		9,812,891.38
Distribuzioni di dividendi	(14)	-344,394.63
Sottoscrizioni del periodo		64,867,297.16
Rimborsi del periodo		-31,833,591.44
Attivo netto alla fine del periodo		325,688,114.15

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			305,951,515.84	307,113,279.32	94.30
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			262,319,612.70	269,060,956.70	82.62
Obbligazioni ordinarie			83,135,581.93	83,439,279.97	25.62
STATI UNITI			19,371,589.91	18,845,102.37	5.79
Beni voluttuari			7,752,905.20	8,123,379.19	2.50
3,000,000.00	FORD MOTOR CREDIT CO. LLC 4.87% 03/08/2027	EUR	2,925,500.00	3,078,690.00	0.95
1,800,000.00	FORD MOTOR CREDIT CO. LLC 4.54% 06/03/2025	GBP	1,965,251.04	2,106,765.42	0.65
2,000,000.00	COTY, INC. 4.50% 15/05/2027	EUR	2,012,600.00	2,018,540.00	0.62
1,000,000.00	MACY'S RETAIL HOLDINGS LLC 6.70% 15/09/2028	USD	849,554.16	919,383.77	0.28
Enti Governativi			3,816,331.07	3,849,740.24	1.18
3,000,000.00	U.S. TREASURY NOTES 1.13% 15/01/2025	USD	2,724,745.13	2,737,818.06	0.84
1,200,000.00	U.S. TREASURY NOTES 1.25% 31/08/2024	USD	1,091,585.94	1,111,922.18	0.34
Salute			2,916,290.17	2,096,150.22	0.64
3,000,000.00	ST. JUDE MEDICAL LLC 4.75% 15/04/2043	USD	2,916,290.17	2,096,150.22	0.64
Informatica			1,913,766.44	1,761,461.77	0.54
1,925,000.00	LEIDOS HOLDINGS, INC. 5.95% 01/12/2040	USD	1,913,766.44	1,761,461.77	0.54
Sovranazionale			1,687,957.18	1,657,487.95	0.51
10,000,000.00	INTERNATIONAL FINANCE CORP. 10.00% 03/02/2027	BRL	1,687,957.18	1,657,487.95	0.51
Finanza			824,307.78	889,134.20	0.27
1,000,000.00	CITADEL FINANCE LLC 3.38% 09/03/2026	USD	824,307.78	889,134.20	0.27
Industria			460,032.07	467,748.80	0.15
500,000.00	TD SYNEX CORP. 6.10% 12/04/2034	USD	460,032.07	467,748.80	0.15
FRANCIA			11,559,350.68	11,690,075.10	3.59
Beni voluttuari			6,652,089.00	6,805,268.00	2.09
3,000,000.00	AIR FRANCE-KLM SA 4.63% 23/05/2029	EUR	2,977,140.00	2,959,440.00	0.91
2,000,000.00	VALEO SE 4.50% 11/04/2030	EUR	1,974,620.00	1,961,820.00	0.60
1,700,000.00	AIR FRANCE-KLM 8.13% 31/05/2028	EUR	1,700,329.00	1,884,008.00	0.58
Finanza			2,916,961.68	2,918,167.10	0.90
1,600,000.00	CREDIT AGRICOLE SA 3.88% 20/04/2031	EUR	1,596,320.00	1,617,536.00	0.50
1,600,000.00	CREDIT AGRICOLE SA 4.75% 31/12/2099	USD	1,320,641.68	1,300,631.10	0.40
Beni di prima necessità			1,990,300.00	1,966,640.00	0.60
2,000,000.00	ELO SACA 6.00% 22/03/2029	EUR	1,990,300.00	1,966,640.00	0.60
LUSSEMBURGO			8,200,086.64	8,067,503.86	2.48
Servizi di telecomunicazione			6,788,504.82	6,602,280.58	2.03
1,941,000.00	TELECOM ITALIA CAPITAL SA 6.38% 15/11/2033	USD	1,763,112.16	1,784,016.81	0.55
1,784,000.00	TELECOM ITALIA CAPITAL SA 6.00% 30/09/2034	USD	1,706,372.60	1,598,333.45	0.49
1,231,000.00	TELECOM ITALIA CAPITAL SA 7.72% 04/06/2038	USD	1,231,766.89	1,218,387.95	0.37
752,000.00	TELECOM ITALIA CAPITAL SA 7.20% 18/07/2036	USD	706,963.92	722,067.03	0.22
734,000.00	TELECOM ITALIA CAPITAL SA 7.72% 04/06/2038	USD	734,457.27	669,554.26	0.21
327,000.00	TELECOM ITALIA CAPITAL SA 6.38% 15/11/2033	USD	297,031.26	285,386.13	0.09
253,000.00	TELECOM ITALIA CAPITAL SA 7.20% 18/07/2036	USD	237,848.24	226,801.68	0.07
116,000.00	TELECOM ITALIA CAPITAL SA 6.00% 30/09/2034	USD	110,952.48	97,733.27	0.03
Finanza			1,411,581.82	1,465,223.28	0.45
1,725,000.00	MEXICO REMITTANCES FUNDING FIDUCIARY ESTATE MANAGEMENT SARL 4.88% 15/01/2028	USD	1,411,581.82	1,465,223.28	0.45

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
PAESI BASSI			6,666,996.80	7,350,463.60	2.26
Servizi di telecomunicazione			2,898,485.39	3,196,987.50	0.98
1,738,000.00	PROSUS NV 1.99% 13/07/2033	EUR	1,187,054.00	1,369,057.36	0.42
1,500,000.00	PROSUS NV 4.03% 03/08/2050	USD	853,106.65	954,807.13	0.29
1,000,000.00	PROSUS NV 3.26% 19/01/2027	USD	858,324.74	873,123.01	0.27
Servizi di pubblica utilità			2,230,990.33	2,565,065.33	0.79
3,000,000.00	ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 5.50% 15/06/2052	USD	2,230,990.33	2,565,065.33	0.79
Materie prime			1,537,521.08	1,588,410.77	0.49
2,000,000.00	BRASKEM NETHERLANDS FINANCE BV 4.50% 31/01/2030	USD	1,537,521.08	1,588,410.77	0.49
ITALIA			5,486,819.02	5,484,102.42	1.68
Finanza			5,486,819.02	5,484,102.42	1.68
3,499,000.00	VITTORIA ASSICURAZIONI SPA 5.75% 11/07/2028	EUR	3,809,105.00	3,611,702.79	1.11
1,000,000.00	INTESA SANPAOLO SPA 7.20% 28/11/2033	USD	913,214.02	1,001,949.63	0.31
1,000,000.00	INTESA SANPAOLO VITA SPA 2.38% 22/12/2030	EUR	764,500.00	870,450.00	0.26
REGNO UNITO			4,831,179.73	4,982,459.65	1.53
Materie prime			2,579,240.00	2,575,525.00	0.79
2,500,000.00	INEOS FINANCE PLC 6.38% 15/04/2029	EUR	2,579,240.00	2,575,525.00	0.79
Finanza			1,323,707.50	1,403,558.00	0.43
1,300,000.00	MAREX GROUP PLC 8.38% 02/02/2028	EUR	1,323,707.50	1,403,558.00	0.43
Beni di prima necessità			928,232.23	1,003,376.65	0.31
1,000,000.00	OCADO GROUP PLC 3.88% 08/10/2026	GBP	928,232.23	1,003,376.65	0.31
MESSICO			3,639,487.01	4,008,829.50	1.23
Energia			3,639,487.01	4,008,829.50	1.23
3,500,000.00	PETROLEOS MEXICANOS 2.75% 21/04/2027	EUR	2,755,000.00	3,109,400.00	0.96
600,000.00	PETROLEOS MEXICANOS 10.00% 07/02/2033	USD	539,754.20	562,233.48	0.17
500,000.00	PETROLEOS MEXICANOS 7.69% 23/01/2050	USD	344,732.81	337,196.02	0.10
COLOMBIA			4,227,987.59	3,608,891.32	1.11
Servizi di telecomunicazione			4,227,987.59	3,608,891.32	1.11
4,950,000.00	COLOMBIA TELECOMUNICACIONES SA ESP 4.95% 17/07/2030	USD	4,227,987.59	3,608,891.32	1.11
SPAGNA			3,216,847.24	3,268,665.00	1.00
Industria			3,216,847.24	3,268,665.00	1.00
2,000,000.00	CELLNEX TELECOM SA 0.75% 20/11/2031	EUR	1,680,000.00	1,647,560.00	0.50
1,000,000.00	CELLNEX FINANCE CO. SA 2.00% 15/02/2033	EUR	757,500.00	848,410.00	0.26
900,000.00	CELLNEX FINANCE CO. SA 2.00% 15/09/2032	EUR	779,347.24	772,695.00	0.24
GERMANIA			2,728,800.00	2,776,210.00	0.85
Materie prime			2,001,300.00	1,996,540.00	0.61
2,000,000.00	K&S AG 4.25% 19/06/2029	EUR	2,001,300.00	1,996,540.00	0.61
Servizi di telecomunicazione			727,500.00	779,670.00	0.24
1,000,000.00	DELIVERY HERO SE 1.50% 15/01/2028	EUR	727,500.00	779,670.00	0.24
BELGIO			1,991,380.00	1,999,460.00	0.61
Enti Governativi			1,991,380.00	1,999,460.00	0.61
2,000,000.00	SOLVAY SA 3.88% 03/04/2028	EUR	1,991,380.00	1,999,460.00	0.61
CANADA			2,063,646.57	1,986,973.69	0.61
Materie prime			2,063,646.57	1,986,973.69	0.61
2,000,000.00	KINROSS GOLD CORP. 6.88% 01/09/2041	USD	2,063,646.57	1,986,973.69	0.61

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
GIAPPONE			1,671,212.00	1,670,030.32	0.51
Beni voluttuari			1,671,212.00	1,670,030.32	0.51
1,250,000.00	NISSAN MOTOR CO. LTD. 2.65% 17/03/2026	EUR	1,250,000.00	1,223,975.00	0.37
500,000.00	NISSAN MOTOR CO. LTD. 4.35% 17/09/2027	USD	421,212.00	446,055.32	0.14
BERMUDA			1,527,600.00	1,586,070.00	0.49
Finanza			1,527,600.00	1,586,070.00	0.49
1,500,000.00	ATHORA HOLDING LTD. 6.63% 16/06/2028	EUR	1,527,600.00	1,586,070.00	0.49
JERSEY			1,400,725.55	1,337,273.31	0.41
Beni voluttuari			1,191,972.32	1,173,798.52	0.36
1,000,000.00	ASTON MARTIN CAPITAL HOLDINGS LTD 10.38% 31/03/2029	GBP	1,191,972.32	1,173,798.52	0.36
Servizi di telecomunicazione			208,753.23	163,474.79	0.05
200,000.00	CORNWALL JERSEY LTD. 0.75% 16/04/2026	GBP	208,753.23	163,474.79	0.05
SVIZZERA			969,483.90	986,647.56	0.30
Finanza			969,483.90	986,647.56	0.30
1,000,000.00	VONTOBEL HOLDING AG 9.48% 31/12/2099	USD	969,483.90	986,647.56	0.30
GUERNSEY			831,000.00	895,840.00	0.28
Finanza			831,000.00	895,840.00	0.28
1,000,000.00	PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD. 1.38% 01/10/2027	EUR	831,000.00	895,840.00	0.28
ISOLE VERGINI BRITANNICHE			710,579.90	844,328.99	0.26
Finanza			710,579.90	844,328.99	0.26
1,000,000.00	HUARONG FINANCE 2019 CO. LTD. 4.50% 29/05/2029	USD	710,579.90	844,328.99	0.26
AUSTRIA			807,500.00	788,390.00	0.24
Informatica			807,500.00	788,390.00	0.24
1,000,000.00	AMS-OSRAM AG 2.13% 03/11/2027	EUR	807,500.00	788,390.00	0.24
CILE			746,226.21	745,486.95	0.23
Materie prime			746,226.21	745,486.95	0.23
800,000.00	CORP. NACIONAL DEL COBRE DE CHILE 5.95% 08/01/2034	USD	746,226.21	745,486.95	0.23
NORVEGIA			487,083.18	516,476.33	0.16
Energia			487,083.18	516,476.33	0.16
495,000.00	VAR ENERGI ASA 8.00% 15/11/2032	USD	487,083.18	516,476.33	0.16
Obbligazioni a tasso variabile			177,193,804.31	184,007,778.07	56.50
ITALIA			48,643,304.36	52,050,134.55	15.98
Finanza			42,028,866.86	45,265,534.55	13.90
8,500,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 31/12/2099	EUR	6,762,737.50	8,128,210.00	2.50
6,500,000.00	BPER BANCA FRN 11/09/2029	EUR	6,554,838.00	6,843,655.00	2.10
4,500,000.00	BANCO BPM SPA FRN 14/06/2028	EUR	4,513,065.00	4,724,190.00	1.45
5,000,000.00	UNICREDIT SPA FRN 30/06/2035	USD	4,098,167.63	4,378,724.43	1.34
3,500,000.00	ICCREA BANCA SPA FRN 18/01/2032	EUR	3,494,600.00	3,446,660.00	1.06
3,000,000.00	BANCA POPOLARE DI SONDRIO SPA FRN 26/09/2028	EUR	2,995,170.00	3,137,910.00	0.96
3,000,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 31/12/2099	EUR	3,000,000.00	2,979,840.00	0.91
2,098,000.00	UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA FRN 31/12/2099	EUR	1,990,539.13	2,107,315.12	0.65
2,000,000.00	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA FRN 07/02/2029	EUR	2,030,600.00	2,055,600.00	0.63
2,000,000.00	UNICREDIT SPA FRN 31/12/2099	EUR	1,480,000.00	1,832,020.00	0.56
1,600,000.00	BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA FRN 15/03/2029	EUR	1,600,000.00	1,604,832.00	0.49
1,500,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 31/12/2099	EUR	1,039,755.00	1,287,510.00	0.40
1,000,000.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA FRN 27/10/2047	EUR	999,019.60	1,033,930.00	0.32

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
1,000,000.00	UNICREDIT SPA FRN 31/12/2099	EUR	670,375.00	900,810.00	0.28
800,000.00	BANCA POPOLARE DI SONDRIO SPA FRN 13/03/2034	EUR	800,000.00	804,328.00	0.25
Servizi di pubblica utilità			4,392,687.50	4,465,375.00	1.37
2,000,000.00	ENEL SPA FRN 31/12/2099	EUR	1,650,000.00	1,652,760.00	0.51
1,000,000.00	ENEL SPA FRN 31/12/2099	EUR	1,000,000.00	1,079,640.00	0.33
1,000,000.00	A2A SPA FRN 31/12/2099	EUR	994,600.00	991,900.00	0.30
750,000.00	TERNA - RETE ELETTRICA NAZIONALE FRN 31/12/2099	EUR	748,087.50	741,075.00	0.23
Energia			2,221,750.00	2,319,225.00	0.71
2,500,000.00	ENI SPA FRN 31/12/2099	EUR	2,221,750.00	2,319,225.00	0.71
FRANCIA			25,131,919.10	26,313,368.04	8.08
Finanza			21,026,454.10	21,908,094.04	6.73
5,500,000.00	CREDIT AGRICOLE ASSURANCES SA FRN 27/09/2048	EUR	5,309,671.06	5,533,990.00	1.70
4,000,000.00	BNP PARIBAS SA FRN 31/12/2099	USD	3,287,729.00	3,348,018.10	1.03
3,000,000.00	LA BANQUE POSTALE SA FRN 31/12/2099	EUR	1,978,500.00	2,311,890.00	0.71
2,000,000.00	LA MONDIALE SAM FRN 18/01/2048	USD	1,770,247.67	1,735,049.38	0.53
2,000,000.00	SCOR SE FRN 31/12/2049	USD	1,512,497.43	1,609,348.48	0.49
1,500,000.00	CNP ASSURANCES SACA FRN 31/12/2099	EUR	1,306,875.00	1,271,250.00	0.39
1,000,000.00	SOGECAP SA FRN 16/05/2044	EUR	1,067,000.00	1,068,080.00	0.33
1,000,000.00	AXA SA FRN 11/07/2043	EUR	995,370.00	1,056,220.00	0.32
1,000,000.00	BNP PARIBAS SA FRN 31/12/2099	EUR	1,017,100.00	1,041,420.00	0.32
1,000,000.00	CNP ASSURANCES SACA FRN 18/07/2053	EUR	945,300.00	1,025,380.00	0.32
1,000,000.00	AXA SA FRN 31/12/2099	EUR	1,000,000.00	1,024,980.00	0.32
600,000.00	CNP ASSURANCES SACA FRN 29/03/2049	EUR	531,000.00	546,360.00	0.17
400,000.00	BNP PARIBAS SA FRN 31/12/2099	USD	305,163.94	336,108.08	0.10
Servizi di pubblica utilità			3,605,465.00	3,897,024.00	1.20
2,400,000.00	ELECTRICITE DE FRANCE SA FRN 31/12/2099	EUR	1,901,340.00	2,098,104.00	0.65
2,000,000.00	VEOLIA ENVIRONNEMENT SA FRN 31/12/2099	EUR	1,704,125.00	1,798,920.00	0.55
Industria			500,000.00	508,250.00	0.15
500,000.00	ALSTOM SA FRN 31/12/2099	EUR	500,000.00	508,250.00	0.15
REGNO UNITO			18,304,349.54	18,238,081.24	5.60
Finanza			15,659,849.54	15,375,631.24	4.72
3,500,000.00	ROTHESAY LIFE PLC FRN 31/12/2099	GBP	4,572,655.54	3,903,414.69	1.20
2,000,000.00	BARCLAYS PLC FRN 31/12/2099	GBP	2,273,250.17	2,418,624.84	0.74
2,000,000.00	STANDARD CHARTERED PLC FRN 10/05/2031	EUR	2,000,000.00	2,078,460.00	0.64
1,952,000.00	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC FRN 31/12/2049	GBP	1,997,575.37	2,074,789.75	0.64
1,800,000.00	ROTHESAY LIFE PLC FRN 31/12/2099	GBP	1,619,793.86	1,630,247.03	0.50
2,000,000.00	STANDARD CHARTERED PLC FRN 31/12/2099	USD	1,512,292.46	1,565,308.37	0.48
800,000.00	BARCLAYS PLC FRN 31/12/2099	USD	736,275.20	808,762.88	0.25
1,000,000.00	BARCLAYS BANK PLC FRN 28/12/2040	EUR	773,750.00	711,240.00	0.22
200,000.00	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC FRN 31/12/2099	USD	174,256.94	184,783.68	0.05
Servizi di pubblica utilità			1,835,000.00	1,956,560.00	0.60
2,000,000.00	SSE PLC FRN 31/12/2099	EUR	1,835,000.00	1,956,560.00	0.60
Servizi di telecomunicazione			809,500.00	905,890.00	0.28
1,000,000.00	VODAFONE GROUP PLC FRN 27/08/2080	EUR	809,500.00	905,890.00	0.28
LUSSEMBURGO			16,114,576.18	15,845,807.00	4.87
Finanza			15,114,576.18	14,835,497.00	4.56
9,000,000.00	HELVETIA EUROPE SA FRN 30/09/2041	EUR	7,605,012.00	7,908,660.00	2.43
9,100,000.00	MITSUBISHI UFJ INVESTOR SERVICES & BANKING LUXEMBOURG SA FRN 15/12/2050	EUR	5,634,314.18	5,065,697.00	1.56
1,000,000.00	BANQUE INTERNATIONALE A LUXEMBOURG SA FRN 01/05/2033	EUR	994,000.00	965,510.00	0.30
1,000,000.00	BANQUE INTERNATIONALE A LUXEMBOURG SA FRN 18/08/2031	EUR	881,250.00	895,630.00	0.27
Salute			1,000,000.00	1,010,310.00	0.31
1,000,000.00	EUROFINS SCIENTIFIC SE FRN 31/12/2099	EUR	1,000,000.00	1,010,310.00	0.31

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
GERMANIA			14,736,257.25	15,412,351.87	4.73
Finanza			8,605,625.17	8,920,573.87	2.74
2,000,000.00	COMMERZBANK AG FRN 28/02/2033	GBP	2,385,432.98	2,503,263.73	0.77
3,000,000.00	ALLIANZ SE FRN 31/12/2099	USD	2,392,445.86	2,302,784.14	0.71
2,000,000.00	DEUTSCHE BANK AG FRN 24/06/2032	EUR	1,865,397.33	1,952,140.00	0.60
1,400,000.00	ALLIANZ SE FRN 05/07/2052	EUR	1,261,099.00	1,383,536.00	0.42
1,000,000.00	ALLIANZ SE FRN 31/12/2099	EUR	701,250.00	778,850.00	0.24
Salute			4,563,132.08	4,661,346.00	1.43
3,400,000.00	BAYER AG FRN 25/03/2082	EUR	3,192,320.60	3,242,274.00	0.99
1,000,000.00	BAYER AG FRN 25/09/2083	EUR	992,931.48	1,033,520.00	0.32
400,000.00	BAYER AG FRN 25/03/2082	EUR	377,880.00	385,552.00	0.12
Servizi di pubblica utilità			1,567,500.00	1,830,432.00	0.56
2,000,000.00	ENBW ENERGIE BADEN-WUERTTEMBERG AG FRN 31/08/2081	EUR	1,367,500.00	1,624,780.00	0.50
200,000.00	ENBW ENERGIE BADEN-WUERTTEMBERG AG FRN 23/01/2084	EUR	200,000.00	205,652.00	0.06
PAESI BASSI			14,744,285.70	15,230,292.19	4.68
Finanza			6,159,755.70	6,202,514.89	1.91
3,190,000.00	ACHMEA BV FRN 31/12/2099	EUR	2,971,488.70	2,882,994.40	0.89
1,000,000.00	ASR NEDERLAND NV FRN 07/12/2043	EUR	1,051,000.00	1,130,210.00	0.35
1,000,000.00	ABN AMRO BANK NV FRN 22/02/2033	EUR	1,005,600.00	1,020,960.00	0.31
1,000,000.00	ING GROEP NV FRN 31/12/2049	USD	932,357.00	952,516.49	0.29
200,000.00	NN GROUP NV FRN 03/11/2043	EUR	199,310.00	215,834.00	0.07
Beni voluttuari			5,268,885.00	5,624,078.00	1.73
6,100,000.00	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN 31/12/2099	EUR	5,268,885.00	5,624,078.00	1.73
Energia			2,016,455.00	2,084,743.30	0.64
2,110,000.00	REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV FRN 31/12/2099	EUR	2,016,455.00	2,084,743.30	0.64
Servizi di telecomunicazione			800,000.00	820,056.00	0.25
800,000.00	TELEFONICA EUROPE BV FRN 31/12/2099	EUR	800,000.00	820,056.00	0.25
Servizi di pubblica utilità			499,190.00	498,900.00	0.15
500,000.00	TENNET HOLDING BV FRN 31/12/2099	EUR	499,190.00	498,900.00	0.15
STATI UNITI			8,658,238.52	8,931,124.58	2.74
Servizi di telecomunicazione			4,775,338.55	4,908,350.00	1.51
5,000,000.00	AT&T, INC. FRN 31/12/2099	EUR	4,775,338.55	4,908,350.00	1.51
Servizi di pubblica utilità			3,416,111.97	3,545,629.94	1.09
2,500,000.00	SOUTHERN CO. FRN 15/09/2081	EUR	2,183,330.00	2,230,725.00	0.69
1,500,000.00	SOUTHERN CO. FRN 15/09/2051	USD	1,232,781.97	1,314,904.94	0.40
Finanza			466,788.00	477,144.64	0.14
500,000.00	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP. FRN 08/06/2029	USD	466,788.00	477,144.64	0.14
BERMUDA			7,374,433.62	6,982,983.24	2.15
Finanza			7,374,433.62	6,982,983.24	2.15
12,500,000.00	AEGON LTD. FRN 29/06/2049	NLG	5,099,576.67	4,748,299.46	1.46
6,500,000.00	AEGON LTD. FRN 31/12/2099	NLG	2,274,856.95	2,234,683.78	0.69
SPAGNA			5,486,835.00	6,033,508.00	1.85
Finanza			5,486,835.00	6,033,508.00	1.85
2,400,000.00	BANCO SANTANDER SA FRN 31/12/2099	EUR	1,802,000.00	2,159,448.00	0.66
2,000,000.00	BANCO SANTANDER SA FRN 31/12/2099	EUR	2,000,000.00	2,009,740.00	0.62
2,000,000.00	BANCO DE CREDITO SOCIAL COOPERATIVO SA FRN 09/03/2028	EUR	1,684,835.00	1,864,320.00	0.57

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
SVIZZERA			4,412,562.16	4,729,107.89	1.45
Finanza			4,412,562.16	4,729,107.89	1.45
2,000,000.00	UBS GROUP AG FRN 09/06/2033	EUR	2,027,700.00	2,019,000.00	0.62
2,000,000.00	EFG INTERNATIONAL AG FRN 31/12/2099	USD	1,497,292.16	1,701,422.15	0.52
1,000,000.00	UBS GROUP AG FRN 31/12/2099	CHF	887,570.00	1,008,685.74	0.31
AUSTRIA			4,231,900.00	4,603,470.00	1.41
Finanza			4,231,900.00	4,603,470.00	1.41
2,000,000.00	VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICHERUNG GRUPPE FRN 15/06/2042	EUR	1,909,000.00	2,005,480.00	0.61
2,000,000.00	UNIQA INSURANCE GROUP AG FRN 09/12/2041	EUR	1,447,000.00	1,693,220.00	0.52
1,000,000.00	ERSTE GROUP BANK AG FRN 31/12/2099	EUR	875,900.00	904,770.00	0.28
BELGIO			3,252,700.00	3,469,270.00	1.07
Finanza			3,252,700.00	3,469,270.00	1.07
3,000,000.00	AGEAS SA FRN 31/12/2099	EUR	2,401,500.00	2,554,770.00	0.79
1,000,000.00	BNP PARIBAS FORTIS SA FRN 29/12/2049	EUR	851,200.00	914,500.00	0.28
COSTA D'AVORIO			3,182,913.44	3,137,376.72	0.96
Sovranazionale			3,182,913.44	3,137,376.72	0.96
3,500,000.00	AFRICAN DEVELOPMENT BANK FRN 31/12/2099	USD	3,182,913.44	3,137,376.72	0.96
KUWAIT			1,166,932.45	1,242,322.75	0.38
Finanza			1,166,932.45	1,242,322.75	0.38
1,500,000.00	BURGAN BANK SAK FRN 15/12/2031	USD	1,166,932.45	1,242,322.75	0.38
ROMANIA			1,004,490.00	1,050,570.00	0.32
Finanza			1,004,490.00	1,050,570.00	0.32
1,000,000.00	BANCA COMERCIALA ROMANA SA FRN 19/05/2027	EUR	1,004,490.00	1,050,570.00	0.32
GIAPPONE			395,000.00	395,110.00	0.12
Servizi di telecomunicazione			395,000.00	395,110.00	0.12
500,000.00	RAKUTEN GROUP, INC. FRN 31/12/2099	EUR	395,000.00	395,110.00	0.12
ISOLE CAYMAN			353,106.99	342,900.00	0.11
Finanza			353,106.99	342,900.00	0.11
360,000.00	EMERGING MARKETS CAPITAL PROTECTED INVESTMENTS LTD. FRN 20/04/2028	EUR	353,106.99	342,900.00	0.11
Obbligazioni zero coupon			1,990,226.46	1,613,898.66	0.50
CILE			987,357.21	1,107,840.38	0.34
Servizi di pubblica utilità			987,357.21	1,107,840.38	0.34
1,485,423.18	CHILE ELECTRICITY PEC SPA 0.00% 25/01/2028	USD	987,357.21	1,107,840.38	0.34
UCRAINA			735,575.00	264,160.00	0.08
Enti Governativi			735,575.00	264,160.00	0.08
1,000,000.00	UKRAINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BONDS 4.38% 27/01/2032	EUR	735,575.00	264,160.00	0.08
COSTA D'AVORIO			267,294.25	241,898.28	0.08
Sovranazionale			267,294.25	241,898.28	0.08
60,000,000.00	AFRICAN DEVELOPMENT BANK 0.00% 03/02/2053	MXN	267,294.25	241,898.28	0.08

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
NEGOZIATI SU UN ALTRO MERCATO REGOLAMENTATO			17,970,389.06	19,157,114.44	5.88
Obbligazioni ordinarie			7,024,832.51	7,233,223.58	2.22
ITALIA			2,990,749.99	3,105,359.00	0.95
Finanza			2,990,749.99	3,105,359.00	0.95
3,000,000.00	INTESA SANPAOLO SPA 7.80% 28/11/2053	USD	2,990,749.99	3,105,359.00	0.95
STATI UNITI			2,788,458.04	2,795,641.39	0.86
Beni voluttuari			1,875,899.24	1,860,880.90	0.57
2,000,000.00	HARLEY-DAVIDSON FINANCIAL SERVICES, INC. 5.95% 11/06/2029	USD	1,875,899.24	1,860,880.90	0.57
Servizi di pubblica utilità			912,558.80	934,760.49	0.29
1,000,000.00	VISTRA OPERATIONS CO. LLC 6.00% 15/04/2034	USD	912,558.80	934,760.49	0.29
LUSSEMBURGO			788,732.48	874,000.86	0.27
Energia			788,732.48	874,000.86	0.27
969,700.04	ACU PETROLEO LUXEMBOURG SARL 7.50% 13/01/2032	USD	788,732.48	874,000.86	0.27
JERSEY			456,892.00	458,222.33	0.14
Beni voluttuari			456,892.00	458,222.33	0.14
500,000.00	ASTON MARTIN CAPITAL HOLDINGS LTD. 10.00% 31/03/2029	USD	456,892.00	458,222.33	0.14
Obbligazioni a tasso variabile			10,945,556.55	11,923,890.86	3.66
ITALIA			9,320,853.83	10,268,318.94	3.15
Finanza			9,320,853.83	10,268,318.94	3.15
7,000,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 20/06/2054	USD	6,203,337.02	6,882,105.62	2.11
4,275,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 01/06/2032	USD	3,117,516.81	3,386,213.32	1.04
FRANCIA			932,749.00	937,447.68	0.29
Finanza			932,749.00	937,447.68	0.29
1,000,000.00	BNP PARIBAS SA FRN 31/12/2099	USD	932,749.00	937,447.68	0.29
STATI UNITI			691,953.72	718,124.24	0.22
Finanza			691,953.72	718,124.24	0.22
1,000,000.00	USB REALTY CORP. FRN 29/12/2049	USD	691,953.72	718,124.24	0.22
ALTRI VALORI MOBILIARI			7,039,648.48	6.22	0.00
Obbligazioni ordinarie			835,864.93	0.00	0.00
IRLANDA			835,864.93	0.00	0.00
Finanza			835,864.93	0.00	0.00
1,000,000.00	GTLK EUROPE CAPITAL DAC 4.80% 26/02/2028*	USD	835,864.93	0.00	0.00
Titoli garantiti da ipoteche immobiliari e da collaterale			6,203,783.55	6.22	0.00
ITALIA			6,203,783.55	6.22	0.00
Finanza			6,203,783.55	6.22	0.00
4,800,000.00	SIERRA ONE SPV SRL 7.00% 30/06/2025*	EUR	4,800,000.00	4.80	0.00
1,423,715.56	SPV PROJECT SRL 7.00% 15/11/2037*	EUR	1,403,783.55	1.42	0.00

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
QUOTE DI OICR			18,621,865.60	18,895,201.96	5.80
Azioni di OICR			18,621,865.60	18,895,201.96	5.80
LUSSEMBURGO			15,858,884.80	16,252,401.96	4.99
Finanza			15,858,884.80	16,252,401.96	4.99
1,021,409.17	AZ FUND 1 - CGM OPPORTUNISTIC CORPORATE BOND -A-AZ- EUR - (1.200%)	EUR	6,575,034.33	6,167,268.57	1.89
40,385.77	PLANETARIUM FUND - ENHANCED EURO CREDIT -B- EUR - (0.650%)	EUR	3,916,200.06	4,134,694.93	1.27
29,985.37	PLANETARIUM FUND - EUROCURRENCIES BONDS -A- EUR - (0.200%)	EUR	2,500,000.01	2,580,241.17	0.79
281,320.33	AZ FUND 1 - AZ BOND - TARGET 2024 -A-AZ- USD - (1.200%)	USD	1,243,884.00	1,425,565.69	0.44
191,497.51	AZ MULTI ASSET - MAMG GLOBAL SUKUK -A-ME- USD - (1.000%)	USD	809,651.00	1,082,427.25	0.33
184,150.64	AZ FUND 1 - AZ BOND - US DOLLAR AGGREGATE USD - (1.000%)	USD	814,115.40	862,204.35	0.27
IRLANDA			2,762,980.80	2,642,800.00	0.81
Finanza			2,762,980.80	2,642,800.00	0.81
40,000.00	ISHARES VI PLC - ISHARES J.P. MORGAN \$ EM BOND EUR HEDGED UCITS ETF EUR (HEDGED) - (0.500%)	EUR	2,762,980.80	2,642,800.00	0.81
Totale del Portafoglio Titoli			305,951,515.84	307,113,279.32	94.30

* Strumenti finanziari prezzati al fair value

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond**IMPEGNI SU ACQUISTO / VENDITA DI CONTRATTI FUTURES AL 30 GIUGNO 2024**

Valore nominale	Quantità	Acquisto / Vendita	Contratto	Scadenza	Valore di mercato al 30 Giugno 2024	Valuta	Plus/(minus) valenza non realizzata (EUR)	Impegno (EUR)
							82,916.34	12,430,379.92
100,000	125	Acquisto	US 5YR NOTE (CBT)	30/09/2024	99.44	USD	82,916.34	12,430,379.92

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

CONTRATTI DI OPZIONI AL 30 GIUGNO 2024

Quantità	Acquisto / Vendita		Call/Put	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	Impegno (EUR)
CONTRATTI DI OPZIONI						167,225.00	236,135.55	55,750,000.00
OPZIONI ACQUISTATE						417,850.00	451,403.80	0.00
55,000,000	Acquisto		PUT	CDS EUR PUT 3.63 18/09/2024	EUR	393,250.00	451,371.80	0.00
2,000,000	Acquisto		PUT	EUR/USD PUT 1.03 03/07/2024	EUR	24,600.00	32.00	0.00
OPZIONE SCRITTA						-250,625.00	-215,268.25	55,750,000.00
-750,000	Vendita		PUT	EUR/USD PUT 1.03 03/07/2024	EUR	-41,625.00	-12.00	750,000.00
-55,000,000	Vendita		PUT	CDS EUR PUT 4.25 18/09/2024	EUR	-209,000.00	-215,256.25	55,000,000.00

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

CONTRATTI FINANZIARI A TERMINE AL 30 GIUGNO 2024

Scadenza	Ammontare comprato	Valuta comprata	Ammontare venduto	Valuta venduta	Plus/(minus)-valenza non realizzata (EUR)
					-184,060.70
18/09/2024	984,800.00	EUR	1,059,428.64	USD	-34.34
18/09/2024	960,585.91	EUR	920,000.00	CHF	-93.16
18/09/2024	12,000.00	CHF	12,671.59	EUR	-140.99
18/09/2024	18,000.00	CHF	18,983.84	EUR	-187.95
18/09/2024	90,000.00	CHF	94,752.24	EUR	-772.77
18/09/2024	508,935,000.00	JPY	3,000,000.00	EUR	-23,917.32
12/09/2024	8,772,000.00	BRL	1,500,000.00	EUR	-43,034.05
18/09/2024	77,883,221.48	EUR	84,080,000.00	USD	-276,711.06
18/09/2024	16,262,564.78	EUR	13,760,000.00	GBP	84,400.58
18/09/2024	8,933,000.00	USD	8,240,414.58	EUR	63,613.46
18/09/2024	2,540,000.00	CHF	2,640,253.87	EUR	12,055.75
18/09/2024	243,000.00	USD	225,129.24	EUR	761.15

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

CONTRATTI SWAP AL 30 GIUGNO 2024

Sottostante	Valuta	Posizione	Nominale	Controparte	Scadenza	Interessi da ricevere / pagare (EUR)	Plus/(minus) -valenza non realizzata(EUR)
CONTRATTI CREDIT DEFAULT SWAP						0.00	-588,265.67
ITRAXX EUROPE SUB FINANCIALS SERIES 38 VERSION 1	EUR	Long	2,500,000.00	J.P. MORGAN SE	12/20/2027	0.00	-73,565.68
ITRAXX EUROPE SUB FINANCIALS SERIES 38 VERSION 1	EUR	Long	2,500,000.00	J.P. MORGAN SE	12/20/2027	0.00	-117,154.19
ITRAXX EUROPE SUB FINANCIALS SERIES 39 VERSION 1	EUR	Long	7,500,000.00	J.P. MORGAN SE	06/20/2028	0.00	-232,480.22
ITALY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND	USD	Long	8,000,000.00	J.P. MORGAN SE	12/20/2028	0.00	-71,311.92
ITRAXX EUROPE SUB FINANCIALS SERIES 40 VERSION 1	EUR	Long	25,000,000.00	J.P. MORGAN SE	12/20/2028	0.00	-191,387.46
ITRAXX EUROPE SUB FINANCIALS SERIES 41 VERSION 1	EUR	Long	10,000,000.00	J.P. MORGAN SE	06/20/2029	0.00	97,633.80

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - Euro Equities

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Attività	Note		
Portafoglio Titoli al valore di mercato	(2a)	23,772,260.65	
Liquidità bancarie a vista		796,795.29	
Importi dovuti dai broker		397,340.00	
Dividendi da ricevere		31,881.34	
Da ricevere su sottoscrizioni		518.13	
Altre attività		3,662.68	
Totale attività		25,002,458.09	
Passività			
Da pagare su rimborsi		-15,673.87	
Altre passività		-80,754.51	
Totale passività		-96,428.38	
Totale attivo netto		24,906,029.71	
	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	78.82	44,694.549
Azione I	EUR	88.77	239,030.479
Azione L	EUR	87.42	1,881.000

NEW MILLENNIUM - Euro Equities

PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Attivo netto all'inizio del periodo	Note	24,279,026.35
Risultato netto degli investimenti		642,967.15
Altri ricavi		132.16
Totale ricavi		643,099.31
Commissioni di consulenza/gestione	(5)	-102,964.28
Commissione di consulenza	(6)	-6,626.00
Commissioni della Banca Depositaria	(8)	-7,599.56
Tassa di registrazione	(3)	-2,091.84
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(8)	-20,240.73
Commissioni del Transfer Agent		-2,753.82
Compensi professionali	(9)	-5,626.74
Pubblicazioni		-597.14
Altre spese e tasse	(4)	-10,475.14
Totale costi		-158,975.25
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		484,124.06
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(2b)	1,865,666.92
- di contratti futures		9,996.90
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		-442,346.73
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(2c)	22.31
- su contratti futures	(2d)	4,650.00
Risultato netto delle operazioni per il periodo		1,922,113.46
Sottoscrizioni del periodo		1,033,310.41
Rimborsi del periodo		-2,328,420.51
Attivo netto alla fine del periodo		24,906,029.71

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

NEW MILLENNIUM - Euro Equities

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			21,927,882.24	23,772,260.65	95.45
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			21,927,882.24	23,772,260.65	95.45
Azioni			21,927,882.24	23,772,260.65	95.45
FRANCIA			8,850,337.96	9,406,206.46	37.77
Beni voluttuari			2,522,959.65	2,778,828.02	11.16
1,593.00	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	EUR	993,340.89	1,136,764.80	4.56
1,686.00	L'OREAL SA	EUR	634,860.34	691,344.30	2.77
3,952.00	SEB SA	EUR	359,062.13	377,811.20	1.52
6,133.00	RENAULT SA	EUR	217,240.31	293,402.72	1.18
10,735.00	WORLDLINE SA	EUR	138,509.74	108,638.20	0.44
1,146.00	SODEXO SA	EUR	90,405.74	96,264.00	0.39
2,346.00	LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	EUR	89,540.50	74,602.80	0.30
Industria			1,729,156.32	2,007,633.26	8.06
2,921.00	SCHNEIDER ELECTRIC SE	EUR	471,319.37	655,180.30	2.63
5,350.00	CIE DE SAINT-GOBAIN SA	EUR	345,077.72	388,517.00	1.56
3,741.00	VINCI SA	EUR	408,733.54	368,039.58	1.48
16,891.00	ALSTOM SA	EUR	206,165.46	265,188.70	1.06
2,183.00	SODEXO, INC.	EUR	119,141.55	183,372.00	0.74
1,718.00	EIFFAGE SA	EUR	178,718.68	147,335.68	0.59
Salute			1,028,802.56	1,095,682.08	4.40
7,077.00	SANOFI SA	EUR	630,149.71	636,505.38	2.56
1,536.00	ESSILORLUXOTTICA SA	EUR	236,036.78	309,043.20	1.24
888.00	IPSEN SA	EUR	107,095.19	101,676.00	0.41
546.00	BIOMÉRIEUX SA	EUR	55,520.88	48,457.50	0.19
Finanza			1,089,929.01	1,084,668.61	4.36
11,483.00	BNP PARIBAS SA	EUR	661,492.15	683,582.99	2.75
10,461.00	SOCIETE GENERALE SA	EUR	248,953.19	229,305.12	0.92
1,432.00	AMUNDI SA	EUR	92,456.95	86,278.00	0.35
1,150.00	EURAZEO SE	EUR	87,026.72	85,502.50	0.34
Energia			498,580.04	692,174.65	2.78
11,105.00	TOTALENERGIES SE	EUR	498,580.04	692,174.65	2.78
Materie prime			588,613.29	543,307.53	2.18
2,856.00	AIR LIQUIDE SA	EUR	494,913.81	460,615.68	1.85
1,019.00	ARKEMA SA	EUR	93,699.48	82,691.85	0.33
Informatica			607,948.65	521,805.00	2.10
2,670.00	TELEPERFORMANCE SE	EUR	335,549.64	262,567.80	1.06
1,396.00	CAPGEMINI SE	EUR	272,399.01	259,237.20	1.04
Servizi di pubblica utilità			303,971.11	282,574.91	1.13
5,275.00	VEOLIA ENVIRONNEMENT SA	EUR	155,093.83	147,278.00	0.59
10,146.00	ENGIE SA	EUR	148,877.28	135,296.91	0.54
Beni di prima necessità			307,509.63	254,667.00	1.02
2,010.00	PERNOD RICARD SA	EUR	307,509.63	254,667.00	1.02
Servizi di telecomunicazione			172,867.70	144,865.40	0.58
15,487.00	ORANGE SA	EUR	172,867.70	144,865.40	0.58
GERMANIA			7,681,443.82	8,273,643.08	33.22
Informatica			1,442,280.89	1,945,207.83	7.81
6,832.00	SAP SE	EUR	815,354.55	1,294,800.64	5.20
14,766.00	INFINEON TECHNOLOGIES AG	EUR	468,835.33	506,547.63	2.03
3,274.00	BECHTLE AG	EUR	158,091.01	143,859.56	0.58

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

NEW MILLENNIUM - Euro Equities

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Finanza			1,734,755.36	1,874,089.73	7.53
2,992.00	ALLIANZ SE REG	EUR	702,595.83	776,424.00	3.12
971.00	MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS-GESELLSCHAFT AG IN MUENCHEN	EUR	444,897.91	453,457.00	1.82
20,428.00	COMMERZBANK AG	EUR	273,026.85	289,771.18	1.16
2,535.00	TALANX AG	EUR	167,455.43	188,984.25	0.76
699.00	HANNOVER RUECK SE	EUR	146,779.34	165,453.30	0.67
Beni voluttuari			1,686,821.15	1,741,195.45	6.99
23,279.00	ZALANDO SE	EUR	420,441.24	509,577.31	2.04
11,194.00	PUMA SE	EUR	460,301.38	479,886.78	1.93
4,190.00	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	EUR	396,256.82	370,312.20	1.49
1,851.00	VOLKSWAGEN AG	EUR	224,748.72	195,095.40	0.78
3,803.00	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	EUR	125,011.69	141,357.51	0.57
7,875.00	DEUTSCHE LUFTHANSA AG	EUR	60,061.30	44,966.25	0.18
Industria			1,381,984.64	1,538,788.19	6.18
3,999.00	SIEMENS AG	EUR	545,988.02	694,706.28	2.79
5,217.00	DEUTSCHE POST AG	EUR	209,619.89	197,150.43	0.79
2,650.00	KNORR-BREMSE AG	EUR	189,588.50	188,945.00	0.76
757.00	MTU AERO ENGINES AG	EUR	176,944.81	180,771.60	0.73
4,615.00	GEA GROUP AG	EUR	175,794.72	179,523.50	0.72
1,009.00	HEIDELBERG MATERIALS AG	EUR	84,048.70	97,691.38	0.39
Salute			667,991.54	416,975.91	1.67
9,033.00	BAYER AG	EUR	491,205.21	238,290.54	0.96
763.00	MERCK KGAA	EUR	113,968.24	118,074.25	0.47
2,174.00	FRESENIUS SE & CO. KGAA	EUR	62,818.09	60,611.12	0.24
Servizi di telecomunicazione			354,186.86	383,334.48	1.54
16,326.00	DEUTSCHE TELEKOM AG	EUR	354,186.86	383,334.48	1.54
Materie prime			248,890.02	231,586.44	0.93
2,019.00	BRENNTAG AG	EUR	160,871.11	127,116.24	0.51
914.00	SYMRISE AG	EUR	88,018.91	104,470.20	0.42
Servizi di pubblica utilità			164,533.36	142,465.05	0.57
4,459.00	RWE AG	EUR	164,533.36	142,465.05	0.57
PAESI BASSI			2,383,598.21	2,824,535.70	11.34
Informatica			1,535,739.21	2,133,955.65	8.57
1,732.00	ASML HOLDING NV	EUR	1,000,636.82	1,669,994.40	6.71
12,582.00	STMICROELECTRONICS NV	EUR	535,102.39	463,961.25	1.86
Beni voluttuari			562,122.47	421,614.69	1.69
22,827.00	STELLANTIS NV	EUR	562,122.47	421,614.69	1.69
Beni di prima necessità			189,365.70	187,372.50	0.75
2,075.00	HEINEKEN NV	EUR	189,365.70	187,372.50	0.75
Materie prime			96,370.83	81,592.86	0.33
1,437.00	AKZO NOBEL NV	EUR	96,370.83	81,592.86	0.33
ITALIA			1,350,830.00	1,595,172.32	6.40
Finanza			916,235.70	1,129,944.83	4.53
160,611.00	INTESA SANPAOLO SPA	EUR	567,987.66	557,480.78	2.24
13,365.00	UNICREDIT SPA	EUR	230,155.61	462,495.83	1.85
19,313.00	NEXI SPA	EUR	118,092.43	109,968.22	0.44
Energia			434,594.30	465,227.49	1.87
32,411.00	ENI SPA	EUR	434,594.30	465,227.49	1.87

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

NEW MILLENNIUM - Euro Equities

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
SPAGNA			582,904.24	565,104.61	2.27
Industria			406,313.48	394,278.64	1.58
1,890.00	ACCIONA SA	EUR	222,593.48	208,467.00	0.84
4,613.00	ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS SA	EUR	183,720.00	185,811.64	0.74
Servizi di pubblica utilità			176,590.76	170,825.97	0.69
9,742.00	ENDESA SA	EUR	176,590.76	170,825.97	0.69
AUSTRIA			429,236.09	443,726.49	1.78
Finanza			258,807.96	273,668.64	1.10
6,186.00	ERSTE GROUP BANK AG	EUR	258,807.96	273,668.64	1.10
Servizi di pubblica utilità			170,428.13	170,057.85	0.68
2,309.00	VERBUND AG	EUR	170,428.13	170,057.85	0.68
BELGIO			164,381.17	202,230.00	0.81
Beni di prima necessità			164,381.17	202,230.00	0.81
21.00	LOTUS BAKERIES NV	EUR	164,381.17	202,230.00	0.81
BERMUDA			199,624.72	190,741.99	0.77
Finanza			199,624.72	190,741.99	0.77
33,069.00	AEGON LTD.	EUR	199,624.72	190,741.99	0.77
FINLANDIA			179,395.01	173,930.40	0.70
Servizi di telecomunicazione			179,395.01	173,930.40	0.70
4,060.00	ELISA OYJ	EUR	179,395.01	173,930.40	0.70
IRLANDA			106,131.02	96,969.60	0.39
Materie prime			106,131.02	96,969.60	0.39
2,331.00	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	EUR	106,131.02	96,969.60	0.39
Totale del Portafoglio Titoli			21,927,882.24	23,772,260.65	95.45

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 2024 IN EUR**

Attività	Note		
Portafoglio Titoli al valore di mercato	(2a)	38,459,182.59	
Liquidità bancarie a vista		906,091.16	
Importi dovuti dai broker		2,895,988.06	
Utili non realizzati su contratti futures	(2d, 13)	102,532.94	
Dividendi da ricevere		6,104.94	
Altre attività		4,005.03	
Totale attività		42,373,904.72	
Passività			
Perdite non realizzate su contratti futures	(2d, 13)	-43,245.38	
Da pagare su rimborsi		-5,705.40	
Altre passività		-119,184.42	
Totale passività		-168,135.20	
Totale attivo netto		42,205,769.52	
	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	134.33	25,027.420
Azione I	EUR	151.88	253,902.346
Azione L	EUR	149.46	1,876.000

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

NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)**PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR**

Attivo netto all'inizio del periodo	Note	39,547,501.25
Risultato netto degli investimenti		258,646.42
Totale ricavi		258,646.42
Commissioni di consulenza/gestione	(5)	-176,244.98
Commissione di consulenza	(6)	-6,872.64
Commissioni della Banca Depositaria	(8)	-11,971.21
Tassa di registrazione	(3)	-2,861.86
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(8)	-26,424.77
Commissioni del Transfer Agent		-2,765.40
Compensi professionali	(9)	-4,919.66
Pubblicazioni		-968.86
Altre spese e tasse	(4)	-11,415.93
Totale costi		-244,445.31
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		14,201.11
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(2b)	2,407,497.09
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		-14,993.76
- di contratti futures		-636,861.44
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		3,419,113.08
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(2c)	-19,021.46
- su contratti futures	(2d)	-338,635.83
Risultato netto delle operazioni per il periodo		4,831,298.79
Sottoscrizioni del periodo		1,471,186.34
Rimborsi del periodo		-3,644,216.86
Attivo netto alla fine del periodo		42,205,769.52

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

NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			23,909,952.54	38,459,182.59	91.12
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			22,862,682.37	37,138,687.97	87.99
Azioni			22,862,682.37	37,138,687.97	87.99
STATI UNITI			19,272,072.45	32,456,148.28	76.90
Informatica			4,103,501.67	9,963,551.49	23.61
5,000.00	MICROSOFT CORP.	USD	724,720.20	2,085,140.19	4.94
10,430.00	APPLE, INC.	USD	564,851.79	2,049,699.67	4.86
17,300.00	NVIDIA CORP.	USD	148,282.54	1,994,160.06	4.72
750.00	BROADCOM, INC.	USD	406,459.65	1,123,533.44	2.66
2,500.00	QUALCOMM, INC.	USD	286,684.19	464,613.74	1.10
15,000.00	INTEL CORP.	USD	487,767.40	433,449.77	1.03
1,500.00	SALESFORCE, INC.	USD	286,492.48	359,831.89	0.85
2,000.00	ADVANCED MICRO DEVICES, INC.	USD	203,414.58	302,701.05	0.72
500.00	ADOBE, INC.	USD	121,825.46	259,174.13	0.61
300.00	SERVICENOW, INC.	USD	206,862.43	220,201.44	0.52
300.00	INTUIT, INC.	USD	169,031.44	183,963.53	0.44
1,450.00	SKYWORKS SOLUTIONS, INC.	USD	141,946.91	144,194.94	0.34
750.00	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP.	USD	118,922.82	121,028.64	0.29
500.00	WORKDAY, INC.	USD	109,155.81	104,296.66	0.25
1,250.00	FORTINET, INC.	USD	82,209.95	70,293.88	0.17
2,000.00	PALANTIR TECHNOLOGIES, INC.	USD	44,874.02	47,268.46	0.11
Servizi di telecomunicazione			2,876,641.71	6,448,047.04	15.28
12,000.00	AMAZON.COM, INC.	USD	953,763.45	2,163,749.91	5.13
12,500.00	ALPHABET, INC.	USD	563,792.51	2,124,445.05	5.03
2,000.00	META PLATFORMS, INC.	USD	422,166.87	940,927.97	2.23
800.00	NETFLIX, INC.	USD	261,571.75	503,759.05	1.20
1,350.00	PALO ALTO NETWORKS, INC.	USD	353,325.51	427,024.30	1.01
6,500.00	CISCO SYSTEMS, INC.	USD	322,021.62	288,140.76	0.68
Finanza			3,341,771.66	5,040,804.84	11.94
3,000.00	VISA, INC.	USD	411,124.89	734,695.26	1.74
3,500.00	JPMORGAN CHASE & CO.	USD	379,285.75	660,517.55	1.56
1,500.00	BERKSHIRE HATHAWAY, INC.	USD	369,698.85	569,348.94	1.35
1,250.00	MASTERCARD, INC.	USD	337,034.70	514,532.08	1.22
1,000.00	GOLDMAN SACHS GROUP, INC.	USD	282,257.88	422,038.53	1.00
7,000.00	WELLS FARGO & CO.	USD	268,204.34	387,898.12	0.92
10,000.00	BANK OF AMERICA CORP.	USD	266,654.61	371,075.18	0.88
2,500.00	MORGAN STANLEY	USD	102,302.47	226,708.55	0.54
4,000.00	BANK OF NEW YORK MELLON CORP.	USD	164,078.74	223,522.18	0.53
300.00	BLACKROCK, INC.	USD	151,236.84	220,383.39	0.52
1,500.00	SIMON PROPERTY GROUP, INC.	USD	119,124.25	212,456.17	0.50
1,000.00	COINBASE GLOBAL, INC.	USD	208,052.19	207,352.37	0.49
4,000.00	U.S. BANCORP	USD	169,118.50	148,168.82	0.35
2,400.00	CITIGROUP, INC.	USD	113,597.65	142,107.70	0.34
Salute			2,940,256.60	3,393,519.24	8.04
6,268.00	JOHNSON & JOHNSON	USD	851,024.96	854,798.67	2.03
10,000.00	CVS HEALTH CORP.	USD	657,507.33	551,061.10	1.31
750.00	UNITEDHEALTH GROUP, INC.	USD	221,229.51	356,374.93	0.84
1,200.00	AMGEN, INC.	USD	246,309.33	349,838.89	0.83
2,000.00	ABBVIE, INC.	USD	157,174.08	320,074.50	0.76
500.00	THERMO FISHER SCIENTIFIC, INC.	USD	220,575.63	257,989.15	0.61
1,000.00	DANAHER CORP.	USD	79,766.57	233,123.29	0.55
3,000.00	GILEAD SCIENCES, INC.	USD	186,744.35	192,050.30	0.45
4,000.00	PFIZER, INC.	USD	148,041.54	104,427.29	0.25
2,000.00	IONIS PHARMACEUTICALS, INC.	USD	88,315.41	88,938.61	0.21
1,500.00	INCYTE CORP.	USD	83,567.89	84,842.51	0.20

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

NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Beni voluttuari			2,448,126.08	3,049,357.16	7.23
13,000.00	COLGATE-PALMOLIVE CO.	USD	970,425.09	1,177,065.02	2.79
4,000.00	PROCTER & GAMBLE CO.	USD	427,597.65	615,516.40	1.46
4,000.00	TARGET CORP	USD	525,944.31	552,516.66	1.31
1,500.00	TESLA, INC.	USD	243,267.54	276,948.79	0.66
1,000.00	MCDONALD'S CORP.	USD	146,147.05	237,779.23	0.56
3,000.00	WALMART, INC.	USD	134,744.44	189,531.06	0.45
Industria			1,616,355.60	1,917,068.42	4.54
8,000.00	3M CO.	USD	691,608.50	762,789.49	1.81
2,750.00	HONEYWELL INTERNATIONAL, INC.	USD	462,598.67	547,921.38	1.30
1,000.00	CATERPILLAR, INC.	USD	198,831.46	310,799.95	0.73
1,400.00	UNION PACIFIC CORP.	USD	263,316.97	295,557.60	0.70
Energia			826,455.34	1,297,447.52	3.07
5,000.00	EXXON MOBIL CORP.	USD	354,246.66	537,065.31	1.27
3,000.00	CONOCOPHILLIPS	USD	110,462.19	320,167.81	0.76
2,000.00	CHEVRON CORP.	USD	239,988.93	291,896.30	0.69
8,000.00	KINDER MORGAN, INC.	USD	121,757.56	148,318.10	0.35
Beni di prima necessità			912,876.19	1,112,552.81	2.64
5,300.00	PEPSICO, INC.	USD	691,909.84	815,608.69	1.93
5,000.00	COCA-COLA CO.	USD	220,966.35	296,944.12	0.71
Servizi di pubblica utilità			206,087.60	233,799.76	0.55
2,500.00	DUKE ENERGY CORP.	USD	206,087.60	233,799.76	0.55
GIAPPONE			2,692,154.50	3,638,034.91	8.62
Industria			891,986.07	1,200,146.53	2.84
20,000.00	HITACHI LTD.	JPY	214,731.43	431,318.05	1.02
8,400.00	OMRON CORP.	JPY	377,312.81	276,066.75	0.65
9,100.00	KOMATSU LTD.	JPY	201,552.12	252,305.98	0.60
2,000.00	SCREEN HOLDINGS CO. LTD.	JPY	42,259.33	166,297.58	0.39
5,000.00	MITSUBISHI ELECTRIC CORP.	JPY	56,130.38	74,158.17	0.18
Beni voluttuari			710,652.81	917,618.13	2.18
20,000.00	TOYOTA MOTOR CORP.	JPY	239,808.01	380,970.54	0.90
4,100.00	SONY GROUP CORP.	JPY	337,175.13	326,997.78	0.77
12,000.00	YAMAHA MOTOR CO. LTD.	JPY	53,664.17	103,363.20	0.25
3,000.00	SEKISUI HOUSE LTD.	JPY	40,916.58	62,000.52	0.15
1,500.00	UNICHARM CORP.	JPY	39,088.92	44,286.09	0.11
Informatica			362,966.52	848,186.71	2.01
2,400.00	TOKYO ELECTRON LTD.	JPY	190,884.25	484,728.17	1.15
5,600.00	ADVANTEST CORP.	JPY	80,438.37	208,536.13	0.49
8,900.00	RENESAS ELECTRONICS CORP.	JPY	91,643.90	154,922.41	0.37
Salute			618,504.51	539,180.04	1.28
30,200.00	ASTELLAS PHARMA, INC.	JPY	386,336.75	278,261.04	0.66
5,100.00	FUJIFILM HOLDINGS CORP.	JPY	58,648.69	110,991.89	0.26
6,600.00	SYSMEX CORP.	JPY	128,209.12	96,721.16	0.23
3,600.00	TERUMO CORP.	JPY	45,309.95	53,205.95	0.13
Finanza			49,434.95	68,159.39	0.16
2,900.00	NOMURA REAL ESTATE HOLDINGS, INC.	JPY	49,434.95	68,159.39	0.16
Beni di prima necessità			58,609.64	64,744.11	0.15
2,000.00	ASAHI GROUP HOLDINGS LTD.	JPY	58,609.64	64,744.11	0.15
IRLANDA			898,455.42	1,044,504.78	2.47
Materie prime			454,622.92	532,262.88	1.26
1,300.00	LINDE PLC	USD	454,622.92	532,262.88	1.26

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

NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Informatica			367,707.50	438,801.30	1.04
1,550.00	ACCENTURE PLC	USD	367,707.50	438,801.30	1.04
Salute			76,125.00	73,440.60	0.17
1,000.00	MEDTRONIC PLC	USD	76,125.00	73,440.60	0.17
ALTRI VALORI MOBILIARI			1,733.47	0.00	0.00
Azioni			1,733.47	0.00	0.00
ITALIA			1,733.47	0.00	0.00
Servizi di telecomunicazione			1,733.47	0.00	0.00
1,463,856.00	TELEUNIT SPA**	GBP	1,733.47	0.00	0.00
QUOTE DI OICR			1,045,536.70	1,320,494.62	3.13
Azioni di OICR			1,045,536.70	1,320,494.62	3.13
IRLANDA			639,772.64	745,360.59	1.77
Finanza			639,772.64	745,360.59	1.77
79,600.00	ISHARES PLC - ISHARES CORE FTSE 100 UCITS ETF GBP - (0.070%)	GBP	639,772.64	745,360.59	1.77
LUSSEMBURGO			405,764.06	575,134.03	1.36
Finanza			405,764.06	575,134.03	1.36
35,000.00	MULTI UNITS LUXEMBOURG SICAV - LYXOR FTSE 100 UCITS ETF GBP - (0.150%)	GBP	405,764.06	575,134.03	1.36
Totale del Portafoglio Titoli			23,909,952.54	38,459,182.59	91.12

** Inadempiente / delistata

NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)

IMPEGNI SU ACQUISTO / VENDITA DI CONTRATTI FUTURES AL 30 GIUGNO 2024

Valore nominale	Quantità	Acquisto / Vendita	Contratto	Scadenza	Valore di mercato al 30 Giugno 2024	Valuta	Plus/(minus) valenza non realizzata (EUR)	Impegno (EUR)
							59,287.56	40,191,949.40
125,000	30	Acquisto	EURO/JPY	16/09/2024	0.99	JPY	72,338.29	3,716,681.42
50	-12	Vendita	S&P 500 EMINI	20/09/2024	5,151.85	USD	21,525.53	3,091,111.28
125,000	12	Acquisto	EURO/GBP	16/09/2024	1.00	GBP	8,669.12	1,503,914.98
10	10	Acquisto	SWISS MARKET INDEX	20/09/2024	12,483.97	CHF	-7,683.72	1,248,397.09
10	12	Acquisto	FTSE 100 INDEX	20/09/2024	9,685.82	GBP	-11,039.86	1,162,298.67
125,000	235	Acquisto	EURO FX CURRENCY	16/09/2024	1.01	USD	-24,521.80	29,469,545.96

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Attività	Note	
Portafoglio Titoli al valore di mercato	(2a)	8,358,551.67
Liquidità bancarie a vista		355,760.38
Importi dovuti dai broker		79,089.83
Interessi da ricevere		46,156.73
Da ricevere su vendita titoli		231,841.83
Altre attività		3,562.05
Totale attività		9,074,962.49
Passività		
Da pagare su rimborsi		-415,709.05
Altre passività		-24,822.38
Totale passività		-440,531.43
Totale attivo netto		8,634,431.06

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	132.01	2,769.122
Azione D	EUR	88.66	416.194
Azione I	EUR	138.18	53,550.168
Azione L	EUR	135.74	6,112.000
Azione Y	EUR	131.42	21.122

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

NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term

PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Attivo netto all'inizio del periodo	Note	9,841,119.63
Risultato netto degli investimenti		85,410.65
Totale ricavi		85,410.65
Commissioni di consulenza/gestione	(5)	-15,945.99
Commissione di consulenza	(6)	-6,442.14
Commissioni della Banca Depositaria	(8)	-2,970.07
Tassa di registrazione	(3)	-808.38
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(8)	-12,813.33
Commissioni del Transfer Agent		-1,549.68
Compensi professionali	(9)	-4,593.58
Pubblicazioni		-237.12
Altre spese e tasse	(4)	-7,657.24
Totale costi		-53,017.53
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		32,393.12
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita - di titoli	(2b)	-6,178.91
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata - sugli investimenti		7,193.86
Risultato netto delle operazioni per il periodo		33,408.07
Distribuzioni di dividendi	(14)	-1,725.63
Sottoscrizioni del periodo		342,582.42
Rimborsi del periodo		-1,580,953.43
Attivo netto alla fine del periodo		8,634,431.06

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

NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			8,350,620.95	8,358,551.67	96.80
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			7,875,857.67	7,838,599.41	90.78
Obbligazioni ordinarie			5,320,192.47	5,295,387.75	61.33
ITALIA			2,300,414.27	2,257,795.80	26.15
Enti Governativi			1,157,449.44	1,157,775.30	13.41
443,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.25% 13/06/2027	EUR	444,507.28	444,461.90	5.15
342,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.60% 29/09/2025	EUR	343,197.23	342,410.40	3.97
254,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 2.00% 01/12/2025	EUR	248,751.14	249,097.80	2.88
124,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 1.50% 01/06/2025	EUR	120,993.79	121,805.20	1.41
Finanza			1,042,964.83	998,998.50	11.57
400,000.00	CASSA DEPOSITI E PRESTITI SPA 2.13% 21/03/2026	EUR	441,208.42	393,320.00	4.56
200,000.00	UNICREDIT SPA 0.50% 09/04/2025	EUR	188,815.50	195,212.00	2.26
160,000.00	INTESA SANPAOLO SPA 0.75% 04/12/2024	EUR	163,510.18	157,968.00	1.83
150,000.00	BANCO BPM SPA 4.63% 29/11/2027	EUR	149,786.89	153,625.50	1.78
100,000.00	MEDIOCREDITO CENTRALE - BANCA DEL MEZZOGIORNO SPA 1.50% 24/10/2024	EUR	99,643.84	98,873.00	1.14
Servizi di pubblica utilità			100,000.00	101,022.00	1.17
100,000.00	ALPERIA SPA 4.75% 05/06/2029	EUR	100,000.00	101,022.00	1.17
GERMANIA			1,704,652.14	1,714,366.67	19.86
Enti Governativi			1,604,885.25	1,613,565.67	18.69
896,000.00	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 0.25% 15/02/2027	EUR	832,220.32	843,082.24	9.76
414,000.00	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 0.50% 15/02/2028	EUR	386,942.45	385,669.98	4.47
387,000.00	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 2.50% 13/03/2025	EUR	385,722.48	384,813.45	4.46
Beni voluttuari			99,766.89	100,801.00	1.17
100,000.00	SCHAEFFLER AG 4.50% 14/08/2026	EUR	99,766.89	100,801.00	1.17
SPAGNA			606,935.19	614,179.53	7.11
Enti Governativi			606,935.19	614,179.53	7.11
453,000.00	SPAIN GOVERNMENT BONDS 0.80% 30/07/2027	EUR	415,180.24	423,450.81	4.90
213,000.00	SPAIN GOVERNMENT BONDS 0.80% 30/07/2029	EUR	191,754.95	190,728.72	2.21
PORTOGALLO			425,607.89	424,281.75	4.91
Enti Governativi			425,607.89	424,281.75	4.91
425,000.00	PORTUGAL OBRIGACOES DO TESOURO OT 2.88% 21/07/2026	EUR	425,607.89	424,281.75	4.91
FRANCIA			182,809.09	184,718.00	2.14
Enti Governativi			182,809.09	184,718.00	2.14
200,000.00	CAISSE FRANCAISE DE FINANCEMENT LOCAL 1.13% 12/06/2028	EUR	182,809.09	184,718.00	2.14
PAESI BASSI			99,773.89	100,046.00	1.16
Industria			99,773.89	100,046.00	1.16
100,000.00	SIEMENS ENERGY FINANCE BV 4.00% 05/04/2026	EUR	99,773.89	100,046.00	1.16
Obbligazioni a tasso variabile			757,129.62	757,880.74	8.78
ITALIA			657,696.86	658,340.74	7.63
Finanza			657,696.86	658,340.74	7.63
324,000.00	CASSA DEPOSITI E PRESTITI SPA FRN 04/12/2029	EUR	332,154.58	331,484.40	3.84
127,000.00	ICCREA BANCA SPA FRN 20/10/2025	EUR	126,973.30	126,291.34	1.46
100,000.00	FINECOBANCA BANCA FINECO SPA FRN 23/02/2029	EUR	99,978.98	102,235.00	1.19
100,000.00	SACE SPA FRN 10/02/2049	EUR	98,590.00	98,330.00	1.14

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

NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
FRANCIA			99,432.76	99,540.00	1.15
Finanza			99,432.76	99,540.00	1.15
100,000.00	AXA SA FRN 29/11/2049	EUR	99,432.76	99,540.00	1.15
Obbligazioni zero coupon			1,798,535.58	1,785,330.92	20.67
SPAGNA			818,689.95	816,360.62	9.45
Enti Governativi			818,689.95	816,360.62	9.45
574,000.00	SPAIN GOVERNMENT BONDS 0.00% 31/05/2025	EUR	539,503.68	556,200.26	6.44
276,000.00	INSTITUTO DE CREDITO OFICIAL 0.00% 30/04/2026	EUR	279,186.27	260,160.36	3.01
FRANCIA			473,888.95	463,666.00	5.37
Finanza			473,888.95	463,666.00	5.37
300,000.00	AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT EPIC 0.00% 28/10/2027	EUR	270,747.73	268,902.00	3.11
200,000.00	AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT EPIC 0.00% 25/03/2025	EUR	203,141.22	194,764.00	2.26
GERMANIA			264,599.06	264,101.80	3.06
Enti Governativi			264,599.06	264,101.80	3.06
140,000.00	BUNDESobligation 0.00% 11/04/2025	EUR	132,290.67	136,570.00	1.58
135,000.00	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 0.00% 15/08/2026	EUR	132,308.39	127,531.80	1.48
ITALIA			241,357.62	241,202.50	2.79
Enti Governativi			241,357.62	241,202.50	2.79
245,000.00	ITALY BUONI ORDINARI DEL TESORO BOT 0.00% 13/12/2024	EUR	241,357.62	241,202.50	2.79
QUOTE DI OICR			474,763.28	519,952.26	6.02
Azioni di OICR			474,763.28	519,952.26	6.02
LUSSEMBURGO			474,763.28	519,952.26	6.02
Finanza			474,763.28	519,952.26	6.02
2,437.30	CB-ACCENT LUX - SWAN SHORT-TERM HIGH YIELD -A- EUR - (1.200%)	EUR	310,000.06	340,368.81	3.94
1,626.81	EURIZON FUND - SECURITIZED BOND FUND -Z- EUR - (0.400%)	EUR	164,763.22	179,583.45	2.08
Totale del Portafoglio Titoli			8,350,620.95	8,358,551.67	96.80

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 2024 IN EUR

Attività	Note		
Portafoglio Titoli al valore di mercato	(2a)	105,590,849.92	
Liquidità bancarie a vista		1,941,797.80	
Importi dovuti dai broker		4,160,518.92	
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	(2c, 13)	140,073.82	
Utili non realizzati su contratti futures	(2d, 13)	168,692.05	
Interessi da ricevere		1,283,315.70	
Da ricevere su sottoscrizioni		9,449.28	
Altre attività		11,661.87	
Totale attività		113,306,359.36	
Passività			
Premio ricevuto su contratti swap	(2f)	-11,113.67	
Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	(2c, 13)	-62,957.69	
Perdite non realizzate su contratti futures	(2d, 13)	-51,600.00	
Perdite non realizzate su contratti swap	(2f, 13)	-140,966.00	
Interessi da pagare su contratti swap		-3,504.33	
Da pagare su rimborsi		-21,455.73	
Altre passività		-340,446.62	
Totale passività		-632,044.04	
Totale attivo netto		112,674,315.32	
	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	157.13	342,988.552
Azione A (H-USD)	USD	109.62	15,595.036
Azione D	EUR	85.17	180,353.185
Azione I	EUR	167.31	249,758.154
Azione L	EUR	164.73	224.000

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

NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond**PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR**

Attivo netto all'inizio del periodo	Note	110,991,109.72
Risultato netto degli investimenti		1,902,998.19
Totale ricavi		1,902,998.19
Commissioni di consulenza/gestione	(5)	-564,863.44
Commissione di consulenza	(6)	-7,928.75
Commissioni sulla performance	(7)	-791.70
Commissioni della Banca Depositaria	(8)	-31,881.04
Tassa di registrazione	(3)	-19,763.06
Interessi pagati su contratti swap		-70,132.16
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(8)	-43,693.93
Commissioni del Transfer Agent		-11,718.82
Compensi professionali	(9)	-6,871.04
Pubblicazioni		-2,763.13
Altre spese e tasse	(4)	-20,574.04
Totale costi		-780,981.11
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		1,122,017.08
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(2b)	-244,815.85
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		-207,291.61
- di contratti di opzioni		-26,631.44
- di contratti futures		-488,658.52
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		216,493.34
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(2c)	-70,676.35
- su contratti futures	(2d)	-580,611.15
- su contratti swap		-10,605.78
Risultato netto delle operazioni per il periodo		-290,780.28
Distribuzioni di dividendi	(14)	-346,513.89
Sottoscrizioni del periodo		15,065,324.56
Rimborsi del periodo		-12,744,824.79
Attivo netto alla fine del periodo		112,674,315.32

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

NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			104,606,957.56	105,590,849.92	93.71
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			101,172,528.80	102,090,231.00	90.60
Obbligazioni ordinarie			62,876,291.60	63,418,152.33	56.28
ITALIA			56,398,919.87	56,634,483.85	50.26
Enti Governativi			49,729,296.28	49,632,513.22	44.05
12,000,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 4.75% 01/09/2028	EUR	12,706,360.00	12,594,000.00	11.18
11,000,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.20% 28/01/2026	EUR	10,979,774.35	10,954,900.00	9.72
11,000,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 0.90% 01/04/2031	EUR	9,299,000.00	9,181,700.00	8.15
9,000,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.40% 01/04/2028	EUR	9,074,990.00	8,995,500.00	7.98
4,008,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 2.00% 14/03/2028	EUR	4,008,000.00	3,952,288.80	3.51
3,500,000.00	REPUBLIC OF ITALY GOVERNMENT INTERNATIONAL BONDS 1.25% 17/02/2026	USD	2,843,464.80	3,057,334.77	2.71
1,000,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.25% 01/03/2038	EUR	814,000.00	895,900.00	0.80
900.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 1.40% 26/05/2025	EUR	3,707.13	889.65	0.00
Finanza			6,669,623.59	7,001,970.63	6.21
2,000,000.00	INTESA SANPAOLO SPA 6.63% 31/05/2033	GBP	2,272,850.28	2,463,421.18	2.19
1,500,000.00	INTESA SANPAOLO SPA 7.20% 28/11/2033	USD	1,406,178.31	1,502,924.45	1.33
1,000,000.00	AGENZIA NAZIONALE PER L'ATTRAZIONE DEGLI INVESTIMENTI E LO SVILUPPO D'IMPRESA 5.25% 14/11/2025	EUR	998,840.00	1,009,230.00	0.90
1,000,000.00	UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA 4.90% 23/05/2034	EUR	998,530.00	985,630.00	0.87
500,000.00	INTESA SANPAOLO SPA 5.13% 29/08/2031	EUR	496,415.00	535,570.00	0.47
500,000.00	BANCA IFIS SPA 5.50% 27/02/2029	EUR	496,810.00	505,195.00	0.45
STATI UNITI			5,452,730.60	5,670,465.34	5.03
Sovranazionale			3,040,397.21	3,267,931.12	2.90
20,000,000.00	INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT 5.00% 22/01/2026	BRL	2,916,639.89	3,125,726.29	2.77
600,000,000.00	INTERNATIONAL FINANCE CORP. 12.00% 03/11/2027	COP	123,757.32	142,204.83	0.13
Enti Governativi			1,939,097.01	1,886,574.66	1.67
1,195,670.00	U.S. TREASURY INFLATION-INDEXED NOTES 0.13% 15/04/2026	USD	1,133,585.92	1,065,376.85	0.95
450,000.00	U.S. TREASURY NOTES 1.13% 15/01/2025	USD	401,733.02	410,672.71	0.36
450,000.00	U.S. TREASURY NOTES 1.38% 31/01/2025	USD	403,778.07	410,525.10	0.36
Beni voluttuari			473,236.38	515,959.56	0.46
561,788.76	U.S. AIRWAYS PASS-THROUGH TRUST 4.63% 03/06/2025	USD	473,236.38	515,959.56	0.46
HONG KONG			1,024,641.13	1,113,203.14	0.99
Materie prime			1,024,641.13	1,113,203.14	0.99
1,200,000.00	CNAC HK FINBRIDGE CO. LTD. 4.88% 14/03/2025	USD	1,024,641.13	1,113,203.14	0.99
Obbligazioni a tasso variabile			29,561,962.53	29,945,507.26	26.58
ITALIA			11,838,191.48	11,949,560.00	10.61
Finanza			9,548,191.48	9,554,360.00	8.48
2,000,000.00	UNICREDIT SPA FRN 14/02/2030	EUR	1,997,740.00	2,069,420.00	1.84
1,900,000.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA FRN 30/11/2049	EUR	2,084,790.23	1,898,024.00	1.68
1,500,000.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA FRN 27/10/2047	EUR	1,517,006.25	1,550,895.00	1.38
1,000,000.00	BANCO BPM SPA FRN 14/06/2028	EUR	999,550.00	1,049,820.00	0.93
1,000,000.00	ICCREA BANCA SPA FRN 20/09/2027	EUR	1,053,000.00	1,047,570.00	0.93
700,000.00	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA FRN 13/09/2027	EUR	699,755.00	714,987.00	0.64
700,000.00	ICCREA BANCA SPA FRN 05/02/2030	EUR	696,610.00	701,519.00	0.62
500,000.00	UNICREDIT SPA FRN 15/11/2027	EUR	499,740.00	522,125.00	0.46
Energia			1,790,000.00	1,855,380.00	1.65
2,000,000.00	ENI SPA FRN 31/12/2099	EUR	1,790,000.00	1,855,380.00	1.65

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

NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Servizi di pubblica utilità			500,000.00	539,820.00	0.48
500,000.00	ENEL SPA FRN 31/12/2099	EUR	500,000.00	539,820.00	0.48
FRANCIA			6,492,664.08	6,482,131.80	5.75
Finanza			6,492,664.08	6,482,131.80	5.75
2,000,000.00	BNP PARIBAS SA FRN 23/01/2027	EUR	1,888,400.00	1,947,000.00	1.73
1,800,000.00	BNP PARIBAS SA FRN 31/12/2099	USD	1,587,790.80	1,512,486.38	1.34
1,000,000.00	BNP PARIBAS SA FRN 25/07/2028	EUR	1,002,910.00	969,310.00	0.86
1,000,000.00	CREDIT AGRICOLE SA FRN 31/12/2099	USD	934,928.81	932,007.98	0.83
500,000.00	BNP PARIBAS SA FRN 18/08/2029	GBP	578,634.47	608,837.44	0.54
500,000.00	AXA SA FRN 31/12/2099	EUR	500,000.00	512,490.00	0.45
STATI UNITI			2,000,000.00	1,963,340.00	1.74
Servizi di telecomunicazione			2,000,000.00	1,963,340.00	1.74
2,000,000.00	AT&T, INC. FRN 31/12/2099	EUR	2,000,000.00	1,963,340.00	1.74
GERMANIA			1,671,483.72	1,637,769.27	1.45
Finanza			1,671,483.72	1,637,769.27	1.45
1,000,000.00	ALLIANZ SE FRN 31/12/2099	USD	848,463.48	870,174.56	0.77
1,000,000.00	ALLIANZ SE FRN 31/12/2099	USD	823,020.24	767,594.71	0.68
SVIZZERA			1,241,500.00	1,426,795.00	1.27
Finanza			1,241,500.00	1,426,795.00	1.27
1,000,000.00	UBS GROUP AG FRN 14/01/2028	EUR	767,000.00	925,120.00	0.82
500,000.00	UBS GROUP AG FRN 16/01/2026	EUR	474,500.00	501,675.00	0.45
PAESI BASSI			1,190,000.00	1,303,164.00	1.16
Beni voluttuari			1,190,000.00	1,303,164.00	1.16
800,000.00	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN 31/12/2099	EUR	690,000.00	737,584.00	0.66
500,000.00	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN 31/12/2099	EUR	500,000.00	565,580.00	0.50
BERMUDA			1,184,366.37	1,139,591.87	1.01
Finanza			1,184,366.37	1,139,591.87	1.01
3,000,000.00	AEGON LTD. FRN 29/06/2049	NLG	1,184,366.37	1,139,591.87	1.01
IRLANDA			1,016,600.00	1,073,120.00	0.95
Finanza			1,016,600.00	1,073,120.00	0.95
1,000,000.00	BANK OF IRELAND GROUP PLC FRN 01/03/2033	EUR	1,016,600.00	1,073,120.00	0.95
REGNO UNITO			972,337.56	1,019,966.25	0.91
Finanza			695,215.72	734,702.41	0.65
600,000.00	NATWEST GROUP PLC FRN 06/06/2033	GBP	695,215.72	734,702.41	0.65
Energia			277,121.84	285,263.84	0.26
311,000.00	BP CAPITAL MARKETS PLC FRN 31/12/2099	USD	277,121.84	285,263.84	0.26
SPAGNA			1,008,000.00	1,017,240.00	0.90
Finanza			1,008,000.00	1,017,240.00	0.90
1,000,000.00	BANCO DE SABADELL SA FRN 08/09/2026	EUR	1,008,000.00	1,017,240.00	0.90
DANIMARCA			946,819.32	932,829.07	0.83
Finanza			946,819.32	932,829.07	0.83
1,000,000.00	DANSKE BANK AS FRN 31/12/2099	USD	946,819.32	932,829.07	0.83

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

NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Obbligazioni zero coupon			8,734,274.67	8,726,571.41	7.74
ITALIA			8,312,017.35	8,391,600.00	7.45
Enti Governativi			8,312,017.35	8,391,600.00	7.45
9,000,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 0.00% 01/08/2026	EUR	8,312,017.35	8,391,600.00	7.45
FILIPPINE			244,061.16	173,705.89	0.15
Sovranazionale			244,061.16	173,705.89	0.15
20,000,000.00	ASIAN DEVELOPMENT BANK 0.00% 20/04/2043	MXN	244,061.16	173,705.89	0.15
COSTA D'AVORIO			178,196.16	161,265.52	0.14
Sovranazionale			178,196.16	161,265.52	0.14
40,000,000.00	AFRICAN DEVELOPMENT BANK 0.00% 03/02/2053	MXN	178,196.16	161,265.52	0.14
NEGOZIATI SU UN ALTRO MERCATO REGOLAMENTATO			3,434,428.76	3,500,618.92	3.11
Obbligazioni ordinarie			1,850,131.51	1,916,425.55	1.70
FRANCIA			923,220.10	968,238.43	0.86
Servizi di pubblica utilità			923,220.10	968,238.43	0.86
1,000,000.00	ELECTRICITE DE FRANCE SA 6.25% 23/05/2033	USD	923,220.10	968,238.43	0.86
ITALIA			926,911.41	948,187.12	0.84
Finanza			926,911.41	948,187.12	0.84
1,000,000.00	CASSA DEPOSITI E PRESTITI SPA 5.88% 30/04/2029	USD	926,911.41	948,187.12	0.84
Obbligazioni a tasso variabile			1,584,297.25	1,584,193.37	1.41
ITALIA			1,584,297.25	1,584,193.37	1.41
Finanza			1,584,297.25	1,584,193.37	1.41
2,000,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 01/06/2032	USD	1,584,297.25	1,584,193.37	1.41
Totale del Portafoglio Titoli			104,606,957.56	105,590,849.92	93.71

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 2024

Valore nominale	Quantità	Acquisto / Vendita	Contratto	Scadenza	Valore di mercato al 30 Giugno 2024	Valuta	Plus/(minus) valenza non realizzata (EUR)	Impegno (EUR)
							117,092.05	55,137,452.94
200,000	170	Acquisto	US 2YR NOTE (CBT)	30/09/2024	95.28	USD	81,776.03	32,392,975.96
100,000	116	Acquisto	EURO SCHATZ	06/09/2024	105.70	EUR	35,380.00	12,261,200.00
100,000	50	Acquisto	US 5YR NOTE (CBT)	30/09/2024	99.44	USD	33,166.54	4,972,151.96
100,000	20	Acquisto	US 10YR NOTE (CBT)	19/09/2024	102.62	USD	18,369.48	2,052,425.02
100,000	30	Acquisto	EURO BTP	06/09/2024	115.29	EUR	-51,600.00	3,458,700.00

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond

CONTRATTI FINANZIARI A TERMINE AL 30 GIUGNO 2024

Scadenza	Ammontare comprato	Valuta comprata	Ammontare venduto	Valuta venduta	Plus/(minus)-valenza non realizzata (EUR)
					77,116.13
18/09/2024	17,720,100.23	EUR	19,130,000.00	USD	-62,957.69
12/09/2024	3,600,509.61	USD	19,500,000.00	BRL	109,160.22
18/09/2024	3,744,971.90	EUR	3,170,000.00	GBP	17,880.29
18/09/2024	1,690,200.00	USD	1,558,159.82	EUR	13,033.31

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond**CONTRATTI SWAP AL 30 GIUGNO 2024**

Sottostante	Valuta	Posizione	Nominale	Controparte	Scadenza	Interessi da ricevere / pagare (EUR)	Plus/(minus) -valenza non realizzata(EUR)
CONTRATTI CREDIT DEFAULT SWAP						0.00	-140,966.00
ITALY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND	USD	Long	15,000,000.00	J.P. MORGAN SE	12/20/2028	0.00	-140,966.00

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Attività		Note	
Portafoglio Titoli al valore di mercato		(2a)	52,792,702.69
Liquidità bancarie a vista			1,047,415.09
Importi dovuti dai broker			340,498.89
Interessi da ricevere			415,204.72
Da ricevere su sottoscrizioni			20.55
Altre attività			4,670.89
Totale attività			54,600,512.83
Passività			
Da pagare su rimborsi			-9,854.95
Altre passività			-93,706.25
Totale passività			-103,561.20
Totale attivo netto			54,496,951.63
	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	131.82	18,514.250
Azione D	EUR	103.79	2,279.243
Azione I	EUR	141.68	353,886.827
Azione L	EUR	139.37	12,041.000
Azione Y	EUR	132.86	21.180

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

NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate

PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Attivo netto all'inizio del periodo	Note	55,373,384.96
Risultato netto degli investimenti		699,053.71
Altri ricavi		53.99
Totale ricavi		699,107.70
Commissioni di consulenza/gestione	(5)	-129,977.65
Commissione di consulenza	(6)	-7,103.98
Commissioni della Banca Depositaria	(8)	-15,996.20
Tassa di registrazione	(3)	-3,657.41
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(8)	-18,795.93
Commissioni del Transfer Agent		-2,966.42
Compensi professionali	(9)	-5,095.50
Pubblicazioni		-1,340.45
Altre spese e tasse	(4)	-13,356.54
Totale costi		-198,290.08
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		500,817.62
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita - di titoli	(2b)	-173,450.22
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata - sugli investimenti		60,099.07
Risultato netto delle operazioni per il periodo		387,466.47
Distribuzioni di dividendi	(14)	-9,423.58
Sottoscrizioni del periodo		2,381,572.98
Rimborsi del periodo		-3,636,049.20
Attivo netto alla fine del periodo		54,496,951.63

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

NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			54,256,836.66	52,792,702.69	96.87
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			53,489,133.69	52,517,441.23	96.37
Obbligazioni ordinarie			36,451,003.40	35,381,021.23	64.92
ITALIA			13,927,309.77	13,543,738.23	24.85
Finanza			3,569,698.31	3,676,884.00	6.75
1,000,000.00	MEDIOCREDITO CENTRALE - BANCA DEL MEZZOGIORNO SPA 1.50% 24/10/2024	EUR	995,790.16	988,730.00	1.82
1,000,000.00	ANIMA HOLDING SPA 1.50% 22/04/2028	EUR	894,845.80	917,270.00	1.68
1,000,000.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA 2.43% 14/07/2031	EUR	829,611.71	879,280.00	1.61
500,000.00	UNIPOL GRUPPO SPA 3.25% 23/09/2030	EUR	475,425.09	498,220.00	0.92
400,000.00	BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA 2.63% 28/04/2025	EUR	374,025.55	393,384.00	0.72
Industria			2,630,437.76	2,471,778.23	4.53
1,500,000.00	POSTE ITALIANE SPA 0.50% 10/12/2028	EUR	1,485,850.10	1,312,110.00	2.40
1,000,000.00	FERROVIE DELLO STATO ITALIANE SPA 4.50% 23/05/2033	EUR	1,033,978.43	1,040,540.00	1.91
117,000.00	WEBUILD SPA 5.88% 15/12/2025	EUR	110,609.23	119,128.23	0.22
Servizi di pubblica utilità			2,565,831.92	2,363,960.00	4.34
1,500,000.00	A2A SPA 1.63% 19/10/2027	EUR	1,629,367.48	1,411,245.00	2.59
500,000.00	A2A SPA 4.50% 19/09/2030	EUR	508,498.32	517,690.00	0.95
500,000.00	SNAM SPA 0.75% 20/06/2029	EUR	427,966.12	435,025.00	0.80
Energia			2,522,011.17	2,314,690.00	4.25
1,500,000.00	ENI SPA 0.38% 14/06/2028	EUR	1,498,610.20	1,330,050.00	2.44
1,000,000.00	ERG SPA 1.88% 11/04/2025	EUR	1,023,400.97	984,640.00	1.81
Beni voluttuari			1,612,197.62	1,682,986.00	3.09
1,400,000.00	ASTM SPA 1.50% 25/01/2030	EUR	1,208,536.22	1,229,956.00	2.26
500,000.00	NEXI SPA 2.13% 30/04/2029	EUR	403,661.40	453,030.00	0.83
Enti Governativi			1,027,132.99	1,033,440.00	1.89
1,200,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 1.65% 01/03/2032	EUR	1,027,132.99	1,033,440.00	1.89
PAESI BASSI			5,926,020.54	5,956,600.00	10.93
Finanza			2,850,272.16	2,815,994.00	5.17
1,500,000.00	NE PROPERTY BV 1.75% 23/11/2024	EUR	1,541,668.42	1,483,650.00	2.72
1,300,000.00	ABN AMRO BANK NV 4.25% 21/02/2030	EUR	1,308,603.74	1,332,344.00	2.45
Materie prime			1,386,248.28	1,440,800.00	2.64
1,600,000.00	AKZO NOBEL NV 1.63% 14/04/2030	EUR	1,386,248.28	1,440,800.00	2.64
Beni di prima necessità			897,658.92	896,430.00	1.65
1,000,000.00	HEINEKEN NV 1.75% 17/03/2031	EUR	897,658.92	896,430.00	1.65
Beni voluttuari			791,841.18	803,376.00	1.47
400,000.00	STELLANTIS NV 4.38% 14/03/2030	EUR	402,325.44	411,192.00	0.75
400,000.00	FERRARI NV 1.50% 27/05/2025	EUR	389,515.74	392,184.00	0.72
GERMANIA			4,775,577.47	4,507,404.00	8.27
Servizi di pubblica utilità			1,393,352.12	1,431,105.00	2.62
1,500,000.00	RWE AG 2.75% 24/05/2030	EUR	1,393,352.12	1,431,105.00	2.62
Beni voluttuari			1,572,492.75	1,350,720.00	2.48
1,400,000.00	VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 2.25% 01/10/2027	EUR	1,572,492.75	1,350,720.00	2.48
Salute			1,299,178.46	1,214,889.00	2.23
1,300,000.00	FRESENIUS SE & CO. KGAA 0.38% 28/09/2026	EUR	1,299,178.46	1,214,889.00	2.23
Finanza			510,554.14	510,690.00	0.94
500,000.00	TALANX AG 4.00% 25/10/2029	EUR	510,554.14	510,690.00	0.94

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

NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
STATI UNITI			4,297,331.24	3,959,036.00	7.26
Servizi di telecomunicazione			2,592,349.52	2,420,122.00	4.44
1,000,000.00	VERIZON COMMUNICATIONS, INC. 1.38% 02/11/2028	EUR	1,087,481.82	920,670.00	1.69
1,000,000.00	AT&T, INC. 0.80% 04/03/2030	EUR	829,811.79	858,560.00	1.57
700,000.00	COMCAST CORP. 0.25% 20/05/2027	EUR	675,055.91	640,892.00	1.18
Finanza			901,860.60	831,186.00	1.52
900,000.00	AMERICAN TOWER CORP. 0.45% 15/01/2027	EUR	901,860.60	831,186.00	1.52
Beni voluttuari			803,121.12	707,728.00	1.30
800,000.00	AMERICAN HONDA FINANCE CORP. 0.30% 07/07/2028	EUR	803,121.12	707,728.00	1.30
FRANCIA			3,357,590.51	3,302,041.00	6.06
Finanza			1,654,319.47	1,737,956.00	3.19
1,300,000.00	CREDIT AGRICOLE ASSURANCES SA 2.00% 17/07/2030	EUR	1,058,341.17	1,128,764.00	2.07
600,000.00	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 4.00% 21/11/2029	EUR	595,978.30	609,192.00	1.12
Industria			1,703,271.04	1,564,085.00	2.87
1,700,000.00	THALES SA 0.25% 29/01/2027	EUR	1,703,271.04	1,564,085.00	2.87
CANADA			992,897.00	940,180.00	1.73
Energia			992,897.00	940,180.00	1.73
1,000,000.00	TOTALENERGIES CAPITAL CANADA LTD. 2.13% 18/09/2029	EUR	992,897.00	940,180.00	1.73
SPAGNA			905,892.21	908,160.00	1.67
Finanza			905,892.21	908,160.00	1.67
1,000,000.00	BANKINTER SA 0.63% 06/10/2027	EUR	905,892.21	908,160.00	1.67
SVEZIA			827,841.00	834,804.00	1.53
Beni voluttuari			827,841.00	834,804.00	1.53
900,000.00	ELECTROLUX AB 2.50% 18/05/2030	EUR	827,841.00	834,804.00	1.53
DANIMARCA			768,322.21	765,567.00	1.40
Beni di prima necessità			768,322.21	765,567.00	1.40
900,000.00	CARLSBERG BREWERIES AS 0.63% 09/03/2030	EUR	768,322.21	765,567.00	1.40
LUSSEMBURGO			413,367.95	374,444.00	0.69
Finanza			413,367.95	374,444.00	0.69
400,000.00	GRAND CITY PROPERTIES SA 1.38% 03/08/2026	EUR	413,367.95	374,444.00	0.69
ISLANDA			258,853.50	289,047.00	0.53
Finanza			258,853.50	289,047.00	0.53
300,000.00	ARION BANKI HF. 0.38% 14/07/2025	EUR	258,853.50	289,047.00	0.53
Obbligazioni a tasso variabile			16,029,257.90	16,091,484.00	29.53
ITALIA			7,144,951.60	7,171,159.00	13.16
Finanza			4,294,492.74	4,274,541.00	7.84
1,000,000.00	UNICREDIT SPA FRN 09/03/2026	EUR	983,493.24	1,001,240.00	1.84
900,000.00	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA FRN 28/12/2024	EUR	908,463.24	902,979.00	1.65
600,000.00	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA FRN 10/09/2025	EUR	631,689.71	608,790.00	1.12
500,000.00	BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA FRN 15/03/2029	EUR	500,200.00	501,510.00	0.92
500,000.00	BANCA POPOLARE DI SONDRIO SPA FRN 04/06/2030	EUR	498,209.20	497,575.00	0.91
400,000.00	CASSA DEPOSITI E PRESTITI SPA FRN 28/06/2026	EUR	415,766.24	414,400.00	0.76
350,000.00	ICCREA BANCA SPA FRN 20/10/2025	EUR	356,671.11	348,047.00	0.64
Servizi di pubblica utilità			1,959,633.60	2,001,460.00	3.67
2,000,000.00	SNAM SPA FRN 02/08/2024	EUR	1,959,633.60	2,001,460.00	3.67

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

NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Enti Governativi			585,002.98	590,700.00	1.09
600,000.00	ITALY CERTIFICATI DI CREDITO DEL TESORO FRN 15/10/2030	EUR	585,002.98	590,700.00	1.09
Beni voluttuari			305,822.28	304,458.00	0.56
300,000.00	LOTTOMATICA SPA FRN 15/12/2030	EUR	305,822.28	304,458.00	0.56
PAESI BASSI			3,813,518.80	3,806,885.00	6.99
Beni voluttuari			3,311,217.96	3,305,410.00	6.07
1,000,000.00	TOYOTA MOTOR FINANCE NETHERLANDS BV FRN 31/08/2025	EUR	1,003,001.04	1,002,490.00	1.84
1,000,000.00	MERCEDES-BENZ INTERNATIONAL FINANCE BV FRN 03/07/2024	EUR	1,004,401.60	1,000,050.00	1.84
800,000.00	MERCEDES-BENZ INTERNATIONAL FINANCE BV FRN 01/12/2025	EUR	802,865.02	802,120.00	1.47
500,000.00	TOYOTA MOTOR FINANCE NETHERLANDS BV FRN 13/03/2026	EUR	500,950.30	500,750.00	0.92
Industria			502,300.84	501,475.00	0.92
500,000.00	SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCHAPPIJ NV FRN 18/12/2025	EUR	502,300.84	501,475.00	0.92
STATI UNITI			3,087,384.45	3,107,010.00	5.70
Beni di prima necessità			1,502,750.86	1,503,675.00	2.76
1,500,000.00	KRAFT HEINZ FOODS CO. FRN 09/05/2025	EUR	1,502,750.86	1,503,675.00	2.76
Beni voluttuari			1,084,073.45	1,102,255.00	2.02
1,100,000.00	FORD MOTOR CREDIT CO. LLC FRN 01/12/2024	EUR	1,084,073.45	1,102,255.00	2.02
Servizi di telecomunicazione			500,560.14	501,080.00	0.92
500,000.00	AT&T, INC. FRN 06/03/2025	EUR	500,560.14	501,080.00	0.92
FRANCIA			1,483,313.09	1,503,630.00	2.76
Beni voluttuari			1,483,313.09	1,503,630.00	2.76
1,500,000.00	RCI BANQUE SA FRN 12/03/2025	EUR	1,483,313.09	1,503,630.00	2.76
REGNO UNITO			500,089.96	502,800.00	0.92
Finanza			500,089.96	502,800.00	0.92
500,000.00	BARCLAYS PLC FRN 12/05/2026	EUR	500,089.96	502,800.00	0.92
Obbligazioni zero coupon			1,008,872.39	1,044,936.00	1.92
FRANCIA			1,008,872.39	1,044,936.00	1.92
Industria			1,008,872.39	1,044,936.00	1.92
1,200,000.00	VINCI SA 0.00% 27/11/2028	EUR	1,008,872.39	1,044,936.00	1.92
ALTRI VALORI MOBILIARI			767,702.97	275,261.46	0.50
Obbligazioni ordinarie			767,702.97	275,261.46	0.50
ITALIA			767,702.97	275,261.46	0.50
Informatica			285,720.00	275,261.46	0.50
285,720.00	INNOVATEC SPA 6.00% 30/09/2026	EUR	285,720.00	275,261.46	0.50
Energia			481,982.97	0.00	0.00
507,600.00	ENERTRONICA SANTERNO SPA 7.00% 31/12/2022*	EUR	481,982.97	0.00	0.00
Totale del Portafoglio Titoli			54,256,836.66	52,792,702.69	96.87

* Strumenti finanziari prezzati al fair value

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

NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Attività	Note		
Portafoglio Titoli al valore di mercato	(2a)	41,706,213.03	
Liquidità bancarie a vista		1,049,029.78	
Importi dovuti dai broker		267,901.34	
Interessi da ricevere		147,943.75	
Da ricevere su vendita titoli		881,681.00	
Da ricevere su sottoscrizioni		19,975.00	
Altre attività		5,664.19	
Totale attività		44,078,408.09	
Passività			
Da pagare su rimborsi		-860,744.79	
Altre passività		-143,215.35	
Totale passività		-1,003,960.14	
Totale attivo netto		43,074,447.95	
	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	148.02	172,672.097
Azione D	EUR	138.96	2,958.299
Azione I	EUR	162.55	55,557.531
Azione L	EUR	160.11	50,429.000

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

NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative**PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR**

Attivo netto all'inizio del periodo	Note	58,295,916.26
Risultato netto degli investimenti		288,190.05
Altri ricavi		16.32
Totale ricavi		288,206.37
Commissioni di consulenza/gestione	(5)	-245,678.66
Commissione di consulenza	(6)	-7,143.86
Commissioni della Banca Depositaria	(8)	-15,563.83
Tassa di registrazione	(3)	-8,576.22
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(8)	-21,687.97
Commissioni del Transfer Agent		-1,981.18
Compensi professionali	(9)	-5,117.98
Pubblicazioni		-1,394.52
Altre spese e tasse	(4)	-13,588.20
Totale costi		-320,732.42
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		-32,526.05
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(2b)	409,052.45
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		38,672.13
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		807,986.34
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(2c)	712.94
Risultato netto delle operazioni per il periodo		1,223,897.81
Distribuzioni di dividendi	(14)	-41,171.84
Sottoscrizioni del periodo		794,190.63
Rimborsi del periodo		-17,198,384.91
Attivo netto alla fine del periodo		43,074,447.95

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

NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			39,741,451.65	41,706,213.03	96.82
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			25,240,868.56	24,981,493.32	57.99
Azioni			178,768.90	178,818.50	0.41
ITALIA			178,768.90	178,818.50	0.41
Salute			176,641.63	170,450.00	0.40
3,500.00	RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA E FARMACEUTICA SPA	EUR	176,641.63	170,450.00	0.40
Beni voluttuari			1,309.09	6,726.00	0.01
400.00	POWERSOFT SPA	EUR	1,309.09	6,600.00	0.01
100.00	SOSTRAVEL.COM SPA	EUR	0.00	126.00	0.00
Industria			818.18	1,642.50	0.00
150.00	OFFICINA STELLARE SPA	EUR	818.18	1,642.50	0.00
Obbligazioni ordinarie			21,993,350.33	21,775,257.82	50.55
ITALIA			6,055,538.11	6,075,239.00	14.10
Enti Governativi			2,198,165.85	2,193,320.00	5.09
1,600,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 1.65% 01/03/2032	EUR	1,358,302.91	1,377,920.00	3.20
500,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 0.95% 15/09/2027	EUR	463,912.76	463,650.00	1.07
500,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 2.80% 01/03/2067	EUR	375,950.18	351,750.00	0.82
Finanza			1,396,540.39	1,435,606.00	3.33
500,000.00	UNIPOL GRUPPO SPA 3.25% 23/09/2030	EUR	486,489.52	498,220.00	1.16
500,000.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA 2.12% 01/10/2030	EUR	415,791.25	444,075.00	1.03
300,000.00	MEDIOCREDITO CENTRALE - BANCA DEL MEZZOGIORNO SPA 1.50% 24/10/2024	EUR	298,931.52	296,619.00	0.69
200,000.00	BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA 2.63% 28/04/2025	EUR	195,328.10	196,692.00	0.45
Industria			931,560.40	976,446.00	2.27
800,000.00	POSTE ITALIANE SPA 0.50% 10/12/2028	EUR	671,209.30	699,792.00	1.63
300,000.00	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA 1.63% 21/10/2028	EUR	260,351.10	276,654.00	0.64
Servizi di pubblica utilità			827,695.95	849,177.00	1.97
500,000.00	SNAM SPA 0.75% 20/06/2029	EUR	420,333.07	435,025.00	1.01
400,000.00	A2A SPA 4.50% 19/09/2030	EUR	407,362.88	414,152.00	0.96
Energia			701,575.52	620,690.00	1.44
700,000.00	ENI SPA 0.38% 14/06/2028	EUR	701,575.52	620,690.00	1.44
GERMANIA			2,948,910.59	2,982,617.00	6.92
Enti Governativi			1,406,041.69	1,411,410.00	3.27
1,500,000.00	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 0.25% 15/02/2027	EUR	1,406,041.69	1,411,410.00	3.27
Finanza			606,224.39	611,772.00	1.42
300,000.00	TALANX AG 4.00% 25/10/2029	EUR	306,332.48	306,414.00	0.71
300,000.00	BAYERISCHE LANDESBANK 4.25% 21/06/2027	EUR	299,891.91	305,358.00	0.71
Beni voluttuari			473,059.15	482,400.00	1.12
500,000.00	VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 2.25% 01/10/2027	EUR	473,059.15	482,400.00	1.12
Servizi di pubblica utilità			463,585.36	477,035.00	1.11
500,000.00	RWE AG 2.75% 24/05/2030	EUR	463,585.36	477,035.00	1.11
FRANCIA			2,269,506.43	2,312,325.00	5.37
Enti Governativi			1,861,393.25	1,870,740.00	4.34
2,000,000.00	FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BONDS OAT 0.25% 25/11/2026	EUR	1,861,393.25	1,870,740.00	4.34
Finanza			408,113.18	441,585.00	1.03
500,000.00	TIKEHAU CAPITAL SCA 1.63% 31/03/2029	EUR	408,113.18	441,585.00	1.03

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

NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
SPAGNA			2,253,417.42	2,201,520.00	5.11
Enti Governativi			1,740,712.42	1,736,315.00	4.03
1,500,000.00	SPAIN GOVERNMENT BONDS 0.50% 31/10/2031	EUR	1,245,168.81	1,243,335.00	2.89
500,000.00	SPAIN GOVERNMENT BONDS 2.15% 31/10/2025	EUR	495,543.61	492,980.00	1.14
Finanza			512,705.00	465,205.00	1.08
500,000.00	SANTANDER CONSUMER FINANCE SA 0.50% 14/11/2026	EUR	512,705.00	465,205.00	1.08
STATI UNITI			2,138,318.59	2,010,655.00	4.67
Servizi di telecomunicazione			1,068,094.07	975,471.00	2.27
600,000.00	AT&T, INC. 0.80% 04/03/2030	EUR	518,499.32	515,136.00	1.20
500,000.00	VERIZON COMMUNICATIONS, INC. 1.38% 02/11/2028	EUR	549,594.75	460,335.00	1.07
Industria			570,954.89	573,414.00	1.33
600,000.00	FEDEX CORP. 1.63% 11/01/2027	EUR	570,954.89	573,414.00	1.33
Finanza			499,269.63	461,770.00	1.07
500,000.00	AMERICAN TOWER CORP. 0.45% 15/01/2027	EUR	499,269.63	461,770.00	1.07
PAESI BASSI			1,802,835.85	1,818,089.00	4.22
Finanza			810,494.07	802,014.00	1.86
500,000.00	NE PROPERTY BV 1.75% 23/11/2024	EUR	514,059.54	494,550.00	1.15
300,000.00	ABN AMRO BANK NV 4.25% 21/02/2030	EUR	296,434.53	307,464.00	0.71
Beni voluttuari			509,898.88	513,990.00	1.19
500,000.00	STELLANTIS NV 4.38% 14/03/2030	EUR	509,898.88	513,990.00	1.19
Industria			482,442.90	502,085.00	1.17
500,000.00	SIEMENS ENERGY FINANCE BV 4.25% 05/04/2029	EUR	482,442.90	502,085.00	1.17
LUSSEMBURGO			1,323,153.24	1,296,451.82	3.01
Sovranazionale			1,217,692.35	1,202,840.82	2.79
1,233,000.00	EUROPEAN INVESTMENT BANK 0.13% 15/04/2025	EUR	1,217,692.35	1,202,840.82	2.79
Finanza			105,460.89	93,611.00	0.22
100,000.00	GRAND CITY PROPERTIES SA 1.38% 03/08/2026	EUR	105,460.89	93,611.00	0.22
EMIRATI ARABI UNITI			995,498.04	942,390.00	2.19
Finanza			995,498.04	942,390.00	2.19
1,000,000.00	FIRST ABU DHABI BANK PJSC 0.13% 16/02/2026	EUR	995,498.04	942,390.00	2.19
PORTOGALLO			771,127.27	768,496.00	1.78
Enti Governativi			771,127.27	768,496.00	1.78
800,000.00	PORTUGAL OBRIGACOES DO TESOURO OT 1.95% 15/06/2029	EUR	771,127.27	768,496.00	1.78
REGNO UNITO			492,697.00	481,520.00	1.12
Servizi di telecomunicazione			492,697.00	481,520.00	1.12
500,000.00	BRITISH TELECOMMUNICATIONS PLC 0.50% 12/09/2025	EUR	492,697.00	481,520.00	1.12
UNGHERIA			515,006.92	460,640.00	1.07
Energia			515,006.92	460,640.00	1.07
500,000.00	MOL HUNGARIAN OIL & GAS PLC 1.50% 08/10/2027	EUR	515,006.92	460,640.00	1.07
DANIMARCA			427,340.87	425,315.00	0.99
Beni di prima necessità			427,340.87	425,315.00	0.99
500,000.00	CARLSBERG BREWERIES AS 0.63% 09/03/2030	EUR	427,340.87	425,315.00	0.99

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

NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Obbligazioni a tasso variabile			568,054.63	563,937.00	1.31
ITALIA			568,054.63	563,937.00	1.31
Finanza			568,054.63	563,937.00	1.31
300,000.00	UNICREDIT SPA FRN 09/03/2026	EUR	296,708.64	300,372.00	0.70
250,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 29/06/2027	EUR	271,345.99	263,565.00	0.61
Obbligazioni zero coupon			2,500,694.70	2,463,480.00	5.72
GERMANIA			1,267,249.06	1,251,360.00	2.91
Enti Governativi			1,267,249.06	1,251,360.00	2.91
1,500,000.00	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 0.00% 15/02/2032	EUR	1,267,249.06	1,251,360.00	2.91
ITALIA			1,233,445.64	1,212,120.00	2.81
Enti Governativi			1,233,445.64	1,212,120.00	2.81
1,300,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 0.00% 01/08/2026	EUR	1,233,445.64	1,212,120.00	2.81
QUOTE DI OICR			14,500,583.09	16,724,719.71	38.83
Azioni di OICR			14,500,583.09	16,724,719.71	38.83
LUSSEMBURGO			7,397,195.14	8,991,180.71	20.88
Finanza			7,397,195.14	8,991,180.71	20.88
395.93	IMGP - JAPAN OPPORTUNITIES -R EUR HP PR- EUR (HEDGED) - (1.000%)	EUR	698,827.35	1,378,387.22	3.20
22,000.06	JPMORGAN FUNDS SICAV - US VALUE FUND -C- USD - (0.600%)	USD	650,820.80	1,017,739.71	2.36
4,781.89	SWISSCANTO (LU) BOND FUND FCP - COCO -B- EUR (HEDGED) - (1.450%)	EUR	900,000.00	965,990.00	2.24
6,818.34	BLACKROCK SYSTEMATIC US EQUITY ABSOLUTE RETURN FUND -I2- USD- (1.000%)	USD	877,477.00	900,014.12	2.09
6,576.81	VONTOBEL FUND - EMERGING MARKETS DEBT -I- USD - (0.550%)	USD	745,058.60	878,871.02	2.04
3,831.74	PICTET - JAPANESE EQUITY SELECTION -HI- EUR - (0.900%)	EUR	449,999.90	689,598.79	1.60
6,000.00	NEW MILLENNIUM SICAV - AIM SISTEMA ITALIA PIR -I- EUR - (1.100%)	EUR	600,000.00	577,553.40	1.34
2,678.95	MFS MERIDIAN FUNDS - CONTRARIAN VALUE FUND -I1- EUR - (0.700%)	EUR	500,000.00	543,666.92	1.26
3,159.36	JPMORGAN FUNDS SICAV - EUROPE EQUITY ABSOLUTE ALPHA FUND -C- EUR (0.750%)	EUR	500,000.00	514,848.98	1.20
3,796.27	DNCA INVEST - ALPHA BONDS -I- EUR - (0.600%)	EUR	480,000.00	482,771.27	1.12
2,859.58	VONTOBEL FUND - MTX SUSTAINABLE EMERGING MARKETS LEADERS -I- USD - (0.825%)	USD	400,050.76	437,974.52	1.02
383.49	VARIOPARTNER SICAV - SECTORAL HEALTHCARE OPPORTUNITIES FUND -I- USD - (0.600%)	USD	297,480.08	307,278.49	0.72
21,401.25	M&G (LUX) INVESTMENT FUNDS 1 - M&G (LUX) GLOBAL LISTED INFRASTRUCTURE FUND -CI- USD - (0.750%)	USD	297,480.65	296,486.27	0.69
IRLANDA			6,103,390.97	6,651,068.99	15.44
Finanza			6,103,390.97	6,651,068.99	15.44
13,216.47	LAZARD GLOBAL INVESTMENT FUNDS - LAZARD GLOBAL CONVERTIBLES RECOVERY FUND -C- EUR (HEDGED) - (0.850%)	EUR	1,499,999.99	1,419,046.42	3.29
75,000.00	NEUBERGER BERMAN INVESTMENT FUNDS PLC - NEUBERGER BERMAN GLOBAL EQUITY MEGATRENDS FUND -I- USD - (0.850%)	USD	996,932.34	1,273,617.35	2.96
30,000.00	WISDOMTREE ISSUER ICAV - WISDOMTREE GLOBAL QUALITY DIVIDEND GROWTH UCITS ETF EUR - (0.380%)	EUR	926,247.83	1,100,550.00	2.55
35,069.79	LIONTRUST GLOBAL FUNDS PLC - LIONTRUST GF EUROPEAN STRATEGIC EQUITY FUND -A3- EUR (1.000%)	EUR	700,000.00	733,347.84	1.70
30,795.60	GUINNESS ASSET MANAGEMENT FUNDS PLC - GUINNESS GLOBAL EQUITY INCOME FUND -Y- EUR - (0.790%)	EUR	599,999.91	698,102.38	1.62
8,000.00	ISHARES PLC - ISHARES CHINA LARGE CAP UCITS ETF EUR - (0.740%)	EUR	578,057.79	562,480.00	1.31

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

NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative**PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR**

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
50,000.00	HANETF ICAV - FUTURE OF DEFENCE UCITS ETF EUR - (0.490%)	EUR	493,178.68	494,050.00	1.15
11,000.00	FIRST TRUST GLOBAL FUNDS PLC - FIRST TRUST NASDAQ CYBERSECURITY UCITS ETF EUR - (0.600%)	EUR	308,974.43	369,875.00	0.86
FRANCIA			999,996.98	1,082,470.01	2.51
Finanza			999,996.98	1,082,470.01	2.51
100.12	ELLIPSIS DISRUPTION CONVERTIBLE FUND - ELLIPSIS DISRUPTION CONVERTIBLE FUND -JEUR- EUR - (1.200%)	EUR	999,996.98	1,082,470.01	2.51
Totale del Portafoglio Titoli			39,741,451.65	41,706,213.03	96.82

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

NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Attività	Note		
Portafoglio Titoli al valore di mercato	(2a)	16,136,439.02	
Liquidità bancarie a vista		80,031.11	
Importi dovuti dai broker		217,707.26	
Contratti di opzioni al valore di mercato	(2e, 13)	23,760.00	
Utili non realizzati su contratti futures	(2d, 13)	8,018.19	
Dividendi da ricevere		1,963.32	
Interessi da ricevere		273,206.13	
Da ricevere su sottoscrizioni		110,050.00	
Altre attività		4,322.70	
Totale attività		16,855,497.73	
Passività			
Perdite non realizzate su contratti futures	(2d, 13)	-42,713.17	
Altre passività		-71,811.21	
Totale passività		-114,524.38	
Totale attivo netto		16,740,973.35	
	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	132.78	9,038.814
Azione I	EUR	109.88	23,883.522
Azione L	EUR	133.05	97,080.000

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

NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible

PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Attivo netto all'inizio del periodo	Note	17,970,752.71
Risultato netto degli investimenti		344,172.32
Altri ricavi		1,379.67
Totale ricavi		345,551.99
Commissioni di consulenza/gestione	(5)	-93,455.71
Commissione di consulenza	(6)	-11,279.07
Commissioni della Banca Depositaria	(8)	-5,108.51
Tassa di registrazione	(3)	-3,557.69
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(8)	-15,227.33
Commissioni del Transfer Agent		-179.54
Compensi professionali	(9)	-4,682.88
Pubblicazioni		-427.26
Altre spese e tasse	(4)	-8,643.34
Totale costi		-142,561.33
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		202,990.66
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(2b)	100,946.32
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		9,074.73
- di contratti di opzioni		-67,334.49
- di contratti futures		-58,395.22
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		407,938.65
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(2c)	13,533.37
- sulle opzioni		3,880.00
- su contratti futures	(2d)	-127,916.80
Risultato netto delle operazioni per il periodo		484,717.22
Sottoscrizioni del periodo		1,148,215.80
Rimborsi del periodo		-2,862,712.38
Attivo netto alla fine del periodo		16,740,973.35

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

NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			15,208,585.06	16,136,439.02	96.39
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			12,540,587.01	13,221,489.78	78.98
Azioni			558,003.19	868,126.21	5.19
STATI UNITI			484,079.78	766,666.79	4.58
Informatica			208,584.23	448,464.93	2.68
2,000.00	NVIDIA CORP.	USD	81,235.41	230,538.74	1.38
350.00	MICROSOFT CORP.	USD	64,899.02	145,959.81	0.87
300.00	SALESFORCE, INC.	USD	62,449.80	71,966.38	0.43
Servizi di telecomunicazione			107,508.06	169,955.60	1.01
1,000.00	ALPHABET, INC.	USD	107,508.06	169,955.60	1.01
Salute			167,987.49	148,246.26	0.89
400.00	ABBVIE, INC.	USD	38,173.75	64,014.90	0.38
1,500.00	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO.	USD	81,572.91	58,124.54	0.35
1,000.00	PFIZER, INC.	USD	48,240.83	26,106.82	0.16
PAESI BASSI			62,700.54	96,420.00	0.58
Informatica			62,700.54	96,420.00	0.58
100.00	ASML HOLDING NV	EUR	62,700.54	96,420.00	0.58
SVIZZERA			11,222.87	5,039.42	0.03
Salute			11,222.87	5,039.42	0.03
100.00	CRISPR THERAPEUTICS AG	USD	11,222.87	5,039.42	0.03
Obbligazioni ordinarie			3,986,928.34	4,068,736.96	24.30
ITALIA			1,324,494.00	1,314,092.00	7.85
Enti Governativi			925,726.00	915,120.00	5.47
900,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 4.20% 01/03/2034	EUR	925,726.00	915,120.00	5.47
Finanza			398,768.00	398,972.00	2.38
200,000.00	AGENZIA NAZIONALE PER L'ATTRAZIONE DEGLI INVESTIMENTI E LO SVILUPPO D'IMPRESA 5.25% 14/11/2025	EUR	199,768.00	201,846.00	1.20
200,000.00	UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA 4.90% 23/05/2034	EUR	199,000.00	197,126.00	1.18
STATI UNITI			942,310.36	953,821.93	5.70
Beni voluttuari			384,233.97	394,816.24	2.36
200,000.00	FORD MOTOR CREDIT CO. LLC 4.87% 03/08/2027	EUR	195,000.00	205,246.00	1.23
200,000.00	FORD MOTOR CREDIT CO. LLC 6.95% 06/03/2026	USD	189,233.97	189,570.24	1.13
Enti Governativi			370,661.39	372,419.35	2.23
400,000.00	U.S. TREASURY NOTES 4.50% 15/05/2027	USD	370,661.39	372,419.35	2.23
Industria			187,415.00	186,586.34	1.11
200,000.00	STANLEY BLACK & DECKER, INC. 6.27% 06/03/2026	USD	187,415.00	186,586.34	1.11
PAESI BASSI			671,247.27	695,705.97	4.15
Servizi di telecomunicazione			284,846.47	318,269.04	1.90
500,000.00	PROSUS NV 4.03% 03/08/2050	USD	284,846.47	318,269.04	1.90
Beni voluttuari			199,912.00	201,256.00	1.20
200,000.00	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV 4.13% 15/11/2025	EUR	199,912.00	201,256.00	1.20
Materie prime			186,488.80	176,180.93	1.05
200,000.00	BRASKEM NETHERLANDS FINANCE BV 7.25% 13/02/2033	USD	186,488.80	176,180.93	1.05

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

NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
FRANCIA			299,310.00	303,288.00	1.81
Finanza			299,310.00	303,288.00	1.81
300,000.00	CREDIT AGRICOLE SA 3.88% 20/04/2031	EUR	299,310.00	303,288.00	1.81
LUSSEMBURGO			234,089.50	283,213.94	1.69
Servizi di telecomunicazione			234,089.50	283,213.94	1.69
300,000.00	TELECOM ITALIA CAPITAL SA 7.20% 18/07/2036	USD	234,089.50	283,213.94	1.69
REGNO UNITO			280,177.50	282,720.66	1.69
Servizi di pubblica utilità			280,177.50	282,720.66	1.69
300,000.00	NATIONAL GRID PLC 5.60% 12/06/2028	USD	280,177.50	282,720.66	1.69
SVIZZERA			235,299.71	235,894.46	1.41
Finanza			235,299.71	235,894.46	1.41
250,000.00	CREDIT SUISSE AG 7.95% 09/01/2025	USD	235,299.71	235,894.46	1.41
Obbligazioni a tasso variabile			7,995,655.48	8,284,626.61	49.49
FRANCIA			2,022,331.00	2,113,467.00	12.62
Finanza			1,238,781.00	1,274,293.00	7.61
500,000.00	AXA SA FRN 10/03/2043	EUR	464,600.00	486,920.00	2.91
300,000.00	BNP PARIBAS SA FRN 23/01/2027	EUR	282,960.00	292,050.00	1.74
300,000.00	LA BANQUE POSTALE SA FRN 17/06/2026	EUR	302,221.00	290,247.00	1.73
200,000.00	CNP ASSURANCES SACA FRN 18/07/2053	EUR	189,000.00	205,076.00	1.23
Energia			466,750.00	489,490.00	2.92
500,000.00	TOTALENERGIES SE FRN 29/12/2049	EUR	466,750.00	489,490.00	2.92
Servizi di pubblica utilità			316,800.00	349,684.00	2.09
400,000.00	ELECTRICITE DE FRANCE SA FRN 31/12/2099	EUR	316,800.00	349,684.00	2.09
ITALIA			1,588,387.39	1,653,135.47	9.87
Finanza			1,588,387.39	1,653,135.47	9.87
650,000.00	BANCO BPM SPA FRN 14/06/2028	EUR	649,595.00	682,383.00	4.07
300,000.00	UNICREDIT SPA FRN 30/06/2035	USD	240,214.39	262,723.47	1.57
200,000.00	BANCA POPOLARE DI SONDRIO SPA FRN 26/09/2028	EUR	199,678.00	209,194.00	1.25
200,000.00	BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA FRN 02/03/2026	EUR	201,800.00	202,210.00	1.21
200,000.00	ICCREA BANCA SPA FRN 18/01/2032	EUR	200,000.00	196,952.00	1.18
100,000.00	INTESA SANPAOLO VITA SPA FRN 31/12/2049	EUR	97,100.00	99,673.00	0.59
SPAGNA			703,686.00	719,646.00	4.30
Finanza			703,686.00	719,646.00	4.30
500,000.00	BANCO DE SABADELL SA FRN 08/09/2026	EUR	504,000.00	508,620.00	3.04
200,000.00	UNICAJA BANCO SA FRN 11/09/2028	EUR	199,686.00	211,026.00	1.26
PAESI BASSI			578,889.00	631,314.00	3.77
Beni voluttuari			300,000.00	339,348.00	2.03
300,000.00	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN 31/12/2099	EUR	300,000.00	339,348.00	2.03
Finanza			278,889.00	291,966.00	1.74
300,000.00	ELM BV FOR SWISS REINSURANCE CO. LTD. FRN 29/12/2049	EUR	278,889.00	291,966.00	1.74
GERMANIA			566,738.30	598,537.00	3.58
Salute			288,236.30	302,065.00	1.81
200,000.00	BAYER AG FRN 25/09/2083	EUR	198,586.30	206,704.00	1.24
100,000.00	BAYER AG FRN 25/03/2082	EUR	89,650.00	95,361.00	0.57
Finanza			278,502.00	296,472.00	1.77
300,000.00	ALLIANZ SE FRN 05/07/2052	EUR	278,502.00	296,472.00	1.77

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

NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
SVIZZERA			566,010.40	585,402.35	3.50
Finanza			566,010.40	585,402.35	3.50
300,000.00	UBS GROUP AG FRN 16/01/2026	EUR	285,270.00	301,005.00	1.80
300,000.00	UBS GROUP AG FRN 22/12/2027	USD	280,740.40	284,397.35	1.70
REGNO UNITO			557,205.00	583,329.00	3.48
Finanza			479,455.00	492,740.00	2.94
500,000.00	HSBC HOLDINGS PLC FRN 15/06/2027	EUR	479,455.00	492,740.00	2.94
Servizi di telecomunicazione			77,750.00	90,589.00	0.54
100,000.00	VODAFONE GROUP PLC FRN 27/08/2080	EUR	77,750.00	90,589.00	0.54
COSTA D'AVORIO			451,647.03	448,196.67	2.68
Sovranazionale			451,647.03	448,196.67	2.68
500,000.00	AFRICAN DEVELOPMENT BANK FRN 31/12/2099	USD	451,647.03	448,196.67	2.68
BERMUDA			352,387.57	303,891.17	1.82
Finanza			352,387.57	303,891.17	1.82
800,000.00	AEGON LTD. FRN 29/06/2049	NLG	352,387.57	303,891.17	1.82
LUSSEMBURGO			238,950.00	263,622.00	1.57
Finanza			238,950.00	263,622.00	1.57
300,000.00	HELVETIA EUROPE SA FRN 30/09/2041	EUR	238,950.00	263,622.00	1.57
DANIMARCA			198,834.00	201,982.00	1.21
Servizi di pubblica utilità			198,834.00	201,982.00	1.21
200,000.00	ORSTED AS FRN 14/03/3024	EUR	198,834.00	201,982.00	1.21
STATI UNITI			170,589.79	182,103.95	1.09
Finanza			170,589.79	182,103.95	1.09
200,000.00	EVEREST REINSURANCE HOLDINGS, INC. FRN 15/05/2037	USD	170,589.79	182,103.95	1.09
NEGOZIATI SU UN ALTRO MERCATO REGOLAMENTATO			1,304,215.06	1,385,935.47	8.28
Obbligazioni ordinarie			567,650.75	584,405.62	3.49
NORVEGIA			295,687.70	294,502.32	1.76
Energia			295,687.70	294,502.32	1.76
300,000.00	VAR ENERGI ASA 7.50% 15/01/2028	USD	295,687.70	294,502.32	1.76
ITALIA			271,963.05	289,903.30	1.73
Finanza			271,963.05	289,903.30	1.73
300,000.00	INTESA SANPAOLO SPA 6.63% 20/06/2033	USD	271,963.05	289,903.30	1.73
Obbligazioni a tasso variabile			736,564.31	801,529.85	4.79
ITALIA			736,564.31	801,529.85	4.79
Finanza			736,564.31	801,529.85	4.79
500,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 20/06/2054	USD	444,758.24	491,578.97	2.94
300,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 21/11/2033	USD	291,806.07	309,950.88	1.85
ALTRI VALORI MOBILIARI			0.00	0.00	0.00
Warrants			0.00	0.00	0.00
ITALIA			0.00	0.00	0.00
Industria			0.00	0.00	0.00
3,619.00	WEBUILD SPA 02/08/2030**	EUR	0.00	0.00	0.00

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

NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
QUOTE DI OICR			1,363,782.99	1,529,013.77	9.13
Azioni di OICR			1,363,782.99	1,529,013.77	9.13
LUSSEMBURGO			600,732.11	747,673.36	4.46
Finanza			600,732.11	747,673.36	4.46
606.30	HELIUM FUND SICAV - HELIUM FUND -I- EUR - (1.250%)	EUR	600,732.11	747,673.36	4.46
AUSTRIA			563,325.57	630,580.41	3.77
Finanza			563,325.57	630,580.41	3.77
3,200.26	ERSTE BOND EMERGING MARKETS CORPORATE -VT- EUR - (0.960%)	EUR	563,325.57	630,580.41	3.77
IRLANDA			199,725.31	150,760.00	0.90
Finanza			199,725.31	150,760.00	0.90
40,000.00	ISHARES IV PLC - ISHARES MSCI CHINA A UCITS ETF EUR - (0.400%)	EUR	199,725.31	150,760.00	0.90
Totale del Portafoglio Titoli			15,208,585.06	16,136,439.02	96.39

** Inadempiente / delistata

NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible

IMPEGNI SU ACQUISTO / VENDITA DI CONTRATTI FUTURES AL 30 GIUGNO 2024

Valore nominale	Quantità	Acquisto / Vendita	Contratto	Scadenza	Valore di mercato al 30 Giugno 2024	Valuta	Plus/(minus) valenza non realizzata (EUR)	Impegno (EUR)
							-34,694.98	6,093,940.48
100,000	5	Acquisto	US LONG BOND (CBT)	19/09/2024	110.39	USD	8,018.19	551,959.17
100,000	10	Acquisto	EURO BTP	06/09/2024	115.29	EUR	-17,200.00	1,152,900.00
125,000	35	Acquisto	EURO FX CURRENCY	16/09/2024	1.00	USD	-25,513.17	4,389,081.31

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible

CONTRATTI DI OPZIONI AL 30 GIUGNO 2024

Quantità	Acquisto / Vendita		Call/Put	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	Impegno (EUR)
CONTRATTI DI OPZIONI						19,880.00	23,760.00	0.00
OPZIONI ACQUISTATE						19,880.00	23,760.00	0.00
40	Acquisto		PUT	EURO STOXX 50 PR 4,650.00 20/09/2024	EUR	19,880.00	23,760.00	0.00

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Attività		Note	
Portafoglio Titoli al valore di mercato		(2a)	22,138,454.32
Liquidità bancarie a vista			868,403.00
Importi dovuti dai broker			114,627.37
Interessi da ricevere			141,504.34
Altre attività			3,714.78
Totale attività			23,266,703.81
Passività			
Da pagare su rimborsi			-114,630.08
Altre passività			-59,169.96
Totale passività			-173,800.04
Totale attivo netto			23,092,903.77
	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	107.53	9,286.490
Azione I	EUR	114.82	167,670.124
Azione L	EUR	112.80	4,407.000
Azione Y	EUR	106.66	21,996.025

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

NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe

PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Attivo netto all'inizio del periodo	Note	25,561,754.64
Risultato netto degli investimenti		355,449.72
Totale ricavi		355,449.72
Commissioni di consulenza/gestione	(5)	-52,454.04
Commissione di consulenza	(6)	-6,667.26
Commissioni sulla performance	(7)	-10,173.86
Commissioni della Banca Depositaria	(8)	-7,394.08
Tassa di registrazione	(3)	-1,649.44
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(8)	-15,452.87
Commissioni del Transfer Agent		-2,826.16
Compensi professionali	(9)	-5,630.68
Pubblicazioni		-612.99
Altre spese e tasse	(4)	-9,539.37
Totale costi		-112,400.75
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		243,048.97
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita - di titoli	(2b)	-46,749.48
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata - sugli investimenti		-181,397.03
Risultato netto delle operazioni per il periodo		14,902.46
Distribuzioni di dividendi	(14)	-101,181.72
Sottoscrizioni del periodo		869,733.05
Rimborsi del periodo		-3,252,304.66
Attivo netto alla fine del periodo		23,092,903.77

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

NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			22,982,431.94	22,138,454.32	95.87
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			21,958,946.34	21,248,433.22	92.01
Obbligazioni ordinarie			20,088,172.19	19,382,473.22	83.93
FRANCIA			12,386,105.50	11,725,132.73	50.77
Enti Governativi			12,286,276.58	11,624,913.73	50.34
5,187,899.20	FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BONDS OAT 1.85% 25/07/2027	EUR	5,702,007.04	5,319,723.72	23.04
3,526,505.50	FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BONDS OAT 0.10% 01/03/2029	EUR	3,475,913.00	3,379,802.87	14.63
3,061,437.42	FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BONDS OAT 0.10% 01/03/2028	EUR	3,108,356.54	2,925,387.14	12.67
Finanza			99,828.92	100,219.00	0.43
100,000.00	BANQUE STELLANTIS FRANCE SACA 3.88% 19/01/2026	EUR	99,828.92	100,219.00	0.43
ITALIA			3,925,298.98	3,928,002.26	17.01
Enti Governativi			3,726,011.29	3,730,256.26	16.15
3,785,140.80	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 1.30% 15/05/2028	EUR	3,726,011.29	3,730,256.26	16.15
Finanza			199,287.69	197,746.00	0.86
200,000.00	MEDIOCREDITO CENTRALE - BANCA DEL MEZZOGIORNO SPA 1.50% 24/10/2024	EUR	199,287.69	197,746.00	0.86
SPAGNA			2,991,707.19	2,942,639.38	12.74
Enti Governativi			2,991,707.19	2,942,639.38	12.74
2,990,608.74	SPAIN GOVERNMENT BONDS INFLATION-LINKED 0.65% 30/11/2027	EUR	2,991,707.19	2,942,639.38	12.74
GERMANIA			585,512.73	586,606.85	2.54
Enti Governativi			286,004.98	284,128.85	1.23
305,000.00	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 0.50% 15/02/2028	EUR	286,004.98	284,128.85	1.23
Beni voluttuari			199,533.78	201,602.00	0.87
200,000.00	SCHAEFFLER AG 4.50% 14/08/2026	EUR	199,533.78	201,602.00	0.87
Salute			99,973.97	100,876.00	0.44
100,000.00	BAYER AG 4.00% 26/08/2026	EUR	99,973.97	100,876.00	0.44
PAESI BASSI			199,547.79	200,092.00	0.87
Industria			199,547.79	200,092.00	0.87
200,000.00	SIEMENS ENERGY FINANCE BV 4.00% 05/04/2026	EUR	199,547.79	200,092.00	0.87
Obbligazioni a tasso variabile			1,770,557.08	1,770,442.00	7.67
FRANCIA			465,899.92	448,364.00	1.94
Finanza			348,014.65	348,390.00	1.51
350,000.00	AXA SA FRN 29/11/2049	EUR	348,014.65	348,390.00	1.51
Servizi di pubblica utilità			117,885.27	99,974.00	0.43
100,000.00	ELECTRICITE DE FRANCE SA FRN 29/01/2049	EUR	117,885.27	99,974.00	0.43
ITALIA			432,632.49	443,139.00	1.92
Energia			233,050.68	243,325.00	1.05
250,000.00	ENI SPA FRN 31/12/2099	EUR	233,050.68	243,325.00	1.05
Finanza			199,581.81	199,814.00	0.87
100,000.00	FINECOBANK BANCA FINECO SPA FRN 23/02/2029	EUR	99,978.98	102,235.00	0.45
100,000.00	UNICREDIT SPA FRN 16/06/2026	EUR	99,602.83	97,579.00	0.42

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

NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
GERMANIA			371,540.56	390,236.00	1.69
Industria			371,540.56	390,236.00	1.69
400,000.00	DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH FRN 31/12/2099	EUR	371,540.56	390,236.00	1.69
SPAGNA			299,323.68	291,125.00	1.26
Finanza			299,323.68	291,125.00	1.26
200,000.00	CAIXABANK SA FRN 18/11/2026	EUR	199,545.79	190,782.00	0.83
100,000.00	BANCO SANTANDER SA FRN 29/01/2026	EUR	99,777.89	100,343.00	0.43
PAESI BASSI			201,160.43	197,578.00	0.86
Beni voluttuari			201,160.43	197,578.00	0.86
200,000.00	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN 31/12/2099	EUR	201,160.43	197,578.00	0.86
Obbligazioni zero coupon			100,217.07	95,518.00	0.41
ITALIA			100,217.07	95,518.00	0.41
Servizi di pubblica utilità			100,217.07	95,518.00	0.41
100,000.00	ACEA SPA 0.00% 28/09/2025	EUR	100,217.07	95,518.00	0.41
QUOTE DI OICR			1,023,485.60	890,021.10	3.86
Azioni di OICR			1,023,485.60	890,021.10	3.86
JERSEY			1,023,485.60	890,021.10	3.86
Finanza			1,023,485.60	890,021.10	3.86
60,952.00	WISDOMTREE INDUSTRIAL METALS - (0.490%)	EUR	1,023,485.60	890,021.10	3.86
Totale del Portafoglio Titoli			22,982,431.94	22,138,454.32	95.87

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 2024 IN EUR**

Attività	Note		
Portafoglio Titoli al valore di mercato	(2a)	59,600,706.75	
Liquidità bancarie a vista		1,039,415.97	
Importi dovuti dai broker		596,918.47	
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	(2c, 13)	9,774.12	
Interessi da ricevere		1,293,812.65	
Da ricevere su sottoscrizioni		290,217.69	
Altre attività		8,273.02	
Totale attività		62,839,118.67	
Passività			
Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	(2c, 13)	-9,580.23	
Da pagare su rimborsi		-4,065.66	
Altre passività		-308,537.96	
Totale passività		-322,183.85	
Totale attivo netto		62,516,934.82	
	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	138.40	96,024.723
Azione D	EUR	99.99	9,690.462
Azione I	EUR	150.54	319,515.510
Azione L	EUR	148.26	1,060.000

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond

PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Attivo netto all'inizio del periodo	Note	53,705,010.35
Risultato netto degli investimenti		1,583,652.09
Altri ricavi		804.95
Totale ricavi		1,584,457.04
Commissioni di consulenza/gestione	(5)	-255,942.10
Commissione di consulenza	(6)	-7,105.10
Commissioni sulla performance	(7)	-140,758.07
Commissioni della Banca Depositaria	(8)	-16,850.82
Tassa di registrazione	(3)	-5,495.52
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(8)	-19,538.40
Commissioni del Transfer Agent		-2,436.92
Compensi professionali	(9)	-5,082.58
Pubblicazioni		-1,332.01
Altre spese e tasse	(4)	-13,610.03
Totale costi		-468,151.55
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		1,116,305.49
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(2b)	64,171.08
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		-76,252.15
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		680,195.60
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(2c)	-42,396.03
Risultato netto delle operazioni per il periodo		1,742,023.99
Distribuzioni di dividendi	(14)	-18,196.96
Sottoscrizioni del periodo		11,745,384.11
Rimborsi del periodo		-4,657,286.67
Attivo netto alla fine del periodo		62,516,934.82

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			60,024,764.46	59,600,706.75	95.34
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			57,883,483.16	58,863,336.83	94.16
Obbligazioni ordinarie			17,995,842.00	18,227,036.91	29.16
ITALIA			17,414,365.67	17,691,456.57	28.30
Finanza			8,870,172.67	9,078,862.61	14.52
2,100,000.00	VITTORIA ASSICURAZIONI SPA 5.75% 11/07/2028	EUR	2,212,375.00	2,167,641.00	3.47
1,300,000.00	INTESA SANPAOLO VITA SPA 2.38% 22/12/2030	EUR	1,014,000.00	1,131,585.00	1.81
1,000,000.00	AGENZIA NAZIONALE PER L'ATTRAZIONE DEGLI INVESTIMENTI E LO SVILUPPO D'IMPRESA 5.25% 14/11/2025	EUR	1,020,500.00	1,009,230.00	1.61
1,000,000.00	UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA 4.90% 23/05/2034	EUR	998,530.00	985,630.00	1.58
800,000.00	AMCO - ASSET MANAGEMENT CO. SPA 4.63% 06/02/2027	EUR	798,549.09	808,688.00	1.29
600,000.00	BANCA IFIS SPA 6.88% 13/09/2028	EUR	598,374.00	634,770.00	1.02
500,000.00	INTESA SANPAOLO SPA 6.63% 31/05/2033	GBP	568,212.57	615,855.29	0.98
500,000.00	BANCA IFIS SPA 5.50% 27/02/2029	EUR	496,810.00	505,195.00	0.81
500,000.00	INTESA SANPAOLO SPA 7.20% 28/11/2033	USD	456,607.01	500,974.82	0.80
400,000.00	NET INSURANCE SPA 5.10% 28/09/2031	EUR	400,000.00	383,640.00	0.61
350,000.00	BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA 1.88% 09/01/2026	EUR	306,215.00	335,653.50	0.54
Enti Governativi			4,489,295.00	4,449,900.00	7.12
3,000,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.35% 01/07/2029	EUR	2,989,250.00	2,972,100.00	4.76
1,500,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.85% 01/07/2034	EUR	1,500,045.00	1,477,800.00	2.36
Industria			1,525,225.00	1,522,970.00	2.44
500,000.00	WEBUILD SPA 7.00% 27/09/2028	EUR	529,500.00	530,740.00	0.85
500,000.00	WEBUILD SPA 5.38% 20/06/2029	EUR	496,500.00	496,940.00	0.80
500,000.00	FIBER BIDCO SPA 6.13% 15/06/2031	EUR	499,225.00	495,290.00	0.79
Servizi di pubblica utilità			1,000,000.00	1,043,560.00	1.67
1,000,000.00	ALPERIA SPA 5.70% 05/07/2028	EUR	1,000,000.00	1,043,560.00	1.67
Servizi di telecomunicazione			703,392.00	770,155.96	1.23
700,000.00	TELECOM ITALIA SPA 7.88% 31/07/2028	EUR	703,392.00	770,155.96	1.23
Beni voluttuari			528,450.00	528,885.00	0.85
500,000.00	PIAGGIO & C SPA 6.50% 05/10/2030	EUR	528,450.00	528,885.00	0.85
Energia			297,831.00	297,123.00	0.47
300,000.00	ENI SPA 3.88% 15/01/2034	EUR	297,831.00	297,123.00	0.47
LUSSEMBURGO			581,476.33	535,580.34	0.86
Servizi di telecomunicazione			581,476.33	535,580.34	0.86
600,000.00	TELECOM ITALIA CAPITAL SA 6.00% 30/09/2034	USD	581,476.33	535,580.34	0.86
Obbligazioni a tasso variabile			39,887,641.16	40,636,299.92	65.00
ITALIA			33,872,699.49	34,977,290.11	55.95
Finanza			25,901,914.49	26,700,131.11	42.71
3,000,000.00	UNICREDIT SPA FRN 31/12/2099	EUR	2,771,250.00	2,977,830.00	4.76
1,600,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 31/12/2099	EUR	1,622,800.00	1,770,176.00	2.83
1,500,000.00	BANCO BPM SPA FRN 31/12/2099	EUR	1,608,750.00	1,642,140.00	2.63
1,500,000.00	BPER BANCA FRN 11/09/2029	EUR	1,494,275.00	1,579,305.00	2.53
1,500,000.00	FINECOBANK BANCA FINECO SPA FRN 31/12/2099	EUR	1,533,100.00	1,539,855.00	2.46
1,500,000.00	UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA FRN 31/12/2099	EUR	1,444,500.00	1,506,660.00	2.41
1,425,000.00	FINECOBANK BANCA FINECO SPA FRN 23/02/2029	EUR	1,436,323.50	1,456,848.75	2.33
1,200,000.00	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA FRN 01/02/2030	EUR	1,196,484.00	1,223,580.00	1.96
1,000,000.00	CREDITO EMILIANO SPA FRN 30/05/2029	EUR	1,002,445.00	1,051,410.00	1.68
1,000,000.00	BPER BANCA SPA FRN 31/12/2099	EUR	1,040,600.00	1,037,550.00	1.66
1,000,000.00	ATHORA ITALIA SPA FRN 16/08/2031	EUR	1,000,000.00	1,006,840.00	1.61
1,000,000.00	BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA FRN 15/03/2029	EUR	1,000,000.00	1,003,020.00	1.60
1,000,000.00	ICCREA BANCA SPA FRN 05/02/2030	EUR	995,020.00	1,002,170.00	1.60

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
1,000,000.00	UNICREDIT SPA FRN 30/06/2035	USD	889,007.00	875,744.89	1.40
800,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 31/12/2099	EUR	800,000.00	794,624.00	1.27
750,000.00	BANCO BPM SPA FRN 21/01/2028	EUR	752,980.00	784,972.50	1.26
750,000.00	CASSA CENTRALE BANCA - CREDITO COOPERATIVO ITALIANO SPA FRN 16/02/2027	EUR	752,115.00	771,255.00	1.23
500,000.00	ICCREA BANCA SPA FRN 20/09/2027	EUR	500,000.00	523,785.00	0.84
500,000.00	BANCA POPOLARE DI SONDRIO SPA FRN 26/09/2028	EUR	499,195.00	522,985.00	0.84
500,000.00	BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA FRN 02/03/2026	EUR	500,000.00	505,525.00	0.81
500,000.00	BPER BANCA SPA FRN 20/02/2030	EUR	498,765.00	503,320.00	0.80
500,000.00	BANCA POPOLARE DI SONDRIO SPA FRN 13/03/2034	EUR	500,000.00	502,705.00	0.80
500,000.00	BANCO BPM SPA FRN 18/06/2034	EUR	498,085.00	497,825.00	0.80
500,000.00	ICCREA BANCA SPA FRN 18/01/2032	EUR	500,000.00	492,380.00	0.79
500,000.00	BANCA POPOLARE DI SONDRIO SPA FRN 13/07/2027	EUR	442,500.00	473,605.00	0.76
300,000.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA FRN 29/06/2049	GBP	316,680.22	355,723.97	0.57
300,000.00	GENERTEL SPA FRN 14/12/2047	EUR	307,039.77	298,296.00	0.48
Servizi di pubblica utilità			4,043,250.00	4,183,150.00	6.69
2,500,000.00	ENEL SPA FRN 31/12/2099	EUR	2,548,500.00	2,699,100.00	4.32
1,000,000.00	TERNA - RETE ELETTRICA NAZIONALE FRN 31/12/2099	EUR	997,450.00	988,100.00	1.58
500,000.00	A2A SPA FRN 31/12/2099	EUR	497,300.00	495,950.00	0.79
Energia			1,745,615.00	1,878,185.00	3.00
1,500,000.00	ENI SPA FRN 31/12/2099	EUR	1,248,600.00	1,391,535.00	2.22
500,000.00	ENI SPA FRN 31/12/2099	EUR	497,015.00	486,650.00	0.78
Industria			1,493,430.00	1,510,815.00	2.42
1,000,000.00	IMA INDUSTRIA MACCHINE AUTOMATICHE SPA FRN 15/04/2029	EUR	1,003,430.00	1,008,490.00	1.61
500,000.00	RENO DE MEDICI SPA FRN 15/04/2029	EUR	490,000.00	502,325.00	0.81
Beni voluttuari			497,490.00	503,085.00	0.81
500,000.00	GOLDEN GOOSE SPA FRN 14/05/2027	EUR	497,490.00	503,085.00	0.81
Salute			191,000.00	201,924.00	0.32
200,000.00	BORMIOLI PHARMA SPA FRN 15/05/2028	EUR	191,000.00	201,924.00	0.32
REGNO UNITO			2,173,941.30	1,826,501.34	2.92
Finanza			2,173,941.30	1,826,501.34	2.92
1,000,000.00	ROTHESAY LIFE PLC FRN 31/12/2099	GBP	1,400,191.30	1,115,261.34	1.78
1,000,000.00	BARCLAYS BANK PLC FRN 28/12/2040	EUR	773,750.00	711,240.00	1.14
LUSSEMBURGO			1,110,000.00	1,113,340.00	1.78
Finanza			1,110,000.00	1,113,340.00	1.78
2,000,000.00	MITSUBISHI UFJ INVESTOR SERVICES & BANKING LUXEMBOURG SA FRN 15/12/2050	EUR	1,110,000.00	1,113,340.00	1.78
PAESI BASSI			801,700.00	903,760.00	1.45
Finanza			801,700.00	903,760.00	1.45
1,000,000.00	ACHMEA BV FRN 31/12/2099	EUR	801,700.00	903,760.00	1.45
BERMUDA			950,797.37	822,405.47	1.31
Finanza			950,797.37	822,405.47	1.31
2,165,000.00	AEGON LTD. FRN 29/06/2049	NLG	950,797.37	822,405.47	1.31
SPAGNA			506,165.00	530,625.00	0.85
Finanza			506,165.00	530,625.00	0.85
500,000.00	UNICAJA BANCO SA FRN 15/11/2027	EUR	506,165.00	530,625.00	0.85
FRANCIA			472,338.00	462,378.00	0.74
Finanza			472,338.00	462,378.00	0.74
600,000.00	LA BANQUE POSTALE SA FRN 31/12/2099	EUR	472,338.00	462,378.00	0.74

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
NEGOZIATI SU UN ALTRO MERCATO REGOLAMENTATO			675,926.88	737,368.46	1.18
Obbligazioni a tasso variabile			675,926.88	737,368.46	1.18
ITALIA			675,926.88	737,368.46	1.18
Finanza			675,926.88	737,368.46	1.18
750,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 20/06/2054	USD	675,926.88	737,368.46	1.18
ALTRI VALORI MOBILIARI			1,465,354.42	1.46	0.00
Titoli garantiti da Ipotecche immobiliari e da collaterale			1,465,354.42	1.46	0.00
ITALIA			1,465,354.42	1.46	0.00
Finanza			1,465,354.42	1.46	0.00
990,000.00	SIERRA ONE SPV SRL 7.00% 30/06/2025*	EUR	990,070.72	0.99	0.00
474,571.86	SPV PROJECT SRL 7.00% 15/11/2037*	EUR	475,283.70	0.47	0.00
Totale del Portafoglio Titoli			60,024,764.46	59,600,706.75	95.34

* Strumenti finanziari prezzati al fair value

NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond

CONTRATTI FINANZIARI A TERMINE AL 30 GIUGNO 2024

Scadenza	Ammontare comprato	Valuta comprata	Ammontare venduto	Valuta venduta	Plus/(minus)-valenza non realizzata (EUR)
					193.89
18/09/2024	2,696,456.44	EUR	2,911,000.00	USD	-9,580.23
18/09/2024	2,032,044.64	EUR	1,720,000.00	GBP	9,774.12

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Attività		Note	
Portafoglio Titoli al valore di mercato		(2a)	2,303,067.66
Liquidità bancarie a vista			40,328.45
Importi dovuti dai broker			82.20
Altre attività			3,398.85
Totale attività			2,346,877.16
Passività			
Altre passività			-30,448.00
Totale passività			-30,448.00
Totale attivo netto			2,316,429.16
	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	108.79	19,107.358
Azione D	EUR	83.38	2,440.093
Azione I	EUR	121.04	250.000
Azione L	EUR	122.23	9.000
Azione Y	EUR	98.53	30.108

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing**PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR**

Attivo netto all'inizio del periodo	Note	2,375,452.99
Risultato netto degli investimenti		731.70
Totale ricavi		731.70
Commissioni di consulenza/gestione	(5)	-802.67
Commissione di consulenza	(6)	-6,327.70
Commissioni della Banca Depositaria	(8)	-1,679.89
Tassa di registrazione	(3)	-13.05
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(8)	-10,683.60
Commissioni del Transfer Agent		-91.20
Compensi professionali	(9)	-4,515.00
Pubblicazioni		-57.97
Altre spese e tasse	(4)	-18,287.97
Totale costi		-42,459.05
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		-41,727.35
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita - di titoli	(2b)	5,020.65
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata - sugli investimenti		76,829.77
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(2c)	169.39
Risultato netto delle operazioni per il periodo		40,292.46
Distribuzioni di dividendi	(14)	-6,271.15
Rimborsi del periodo		-93,045.14
Attivo netto alla fine del periodo		2,316,429.16

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			1,985,827.20	2,303,067.66	99.42
ALTRI VALORI MOBILIARI			85.81	0.00	0.00
Azioni			85.81	0.00	0.00
STATI UNITI			85.81	0.00	0.00
Energia			85.81	0.00	0.00
383.00	PETROQUEST ENERGY, INC.**	USD	85.81	0.00	0.00
Warrants			0.00	0.00	0.00
STATI UNITI			0.00	0.00	0.00
Finanza			0.00	0.00	0.00
1,751.00	CEC BRANDS LLC 31/12/2025**	USD	0.00	0.00	0.00
QUOTE DI OICR			1,985,741.39	2,303,067.66	99.42
Azioni di OICR			1,985,741.39	2,303,067.66	99.42
LUSSEMBURGO			1,985,741.39	2,303,067.66	99.42
Finanza			1,985,741.39	2,303,067.66	99.42
2,431.65	NEW MILLENNIUM SICAV - AUGUSTUM HIGH QUALITY BOND -I- EUR - (0.700%)	EUR	384,856.11	407,107.35	17.57
2,569.00	NEW MILLENNIUM SICAV - AUGUSTUM ITALIAN DIVERSIFIED BOND -I- EUR - (0.700%)	EUR	300,811.64	386,840.02	16.70
70,876.29	AZ FUND 1 - GLOBAL MACRO BOND -A- EUR - (1.200%)	EUR	330,000.00	385,992.27	16.66
3,030.78	NEW MILLENNIUM SICAV - AUGUSTUM EXTRA EURO HIGH QUALITY BOND -I- EUR - (0.800%)	EUR	319,027.45	341,538.49	14.74
42,031.86	AZ FUND 1 - AZ ALLOCATION - INTERNATIONAL 50%-100% -A-AZ- EUR - (1.500%)	EUR	220,501.97	325,620.83	14.06
53,498.13	AZ FUND 1 - AZ BOND TARGET 2021 -A- EUR - (1.200%)	EUR	280,544.18	295,951.64	12.78
607.83	NEW MILLENNIUM SICAV - AUGUSTUM CORPORATE BOND -I- EUR - (0.750%)	EUR	150,000.04	160,017.06	6.91
Totale del Portafoglio Titoli			1,985,827.20	2,303,067.66	99.42

** Inadempiente / delistata

NEW MILLENNIUM - Alpha Active Allocation

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Attività	Note		
Portafoglio Titoli al valore di mercato	(2a)	43,558,013.04	
Liquidità bancarie a vista		1,083,711.47	
Importi dovuti dai broker		1,136,063.49	
Utili non realizzati su contratti futures	(2d, 13)	65,092.16	
Dividendi da ricevere		6,150.60	
Interessi da ricevere		153,381.30	
Altre attività		4,287.09	
Totale attività		46,006,699.15	
Passività			
Perdite non realizzate su contratti futures	(2d, 13)	-140,604.45	
Altre passività		-180,958.12	
Totale passività		-321,562.57	
Totale attivo netto		45,685,136.58	
	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	90.66	3,940.899
Azione D	EUR	67.05	237.917
Azione I	EUR	101.51	446,271.932
Azione L	EUR	99.72	89.000

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

NEW MILLENNIUM - Alpha Active Allocation

PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Attivo netto all'inizio del periodo	Note	44,310,466.89
Risultato netto degli investimenti		469,285.46
Totale ricavi		469,285.46
Commissioni di consulenza/gestione	(5)	-266,397.72
Commissione di consulenza	(6)	-6,916.12
Commissioni della Banca Depositaria	(8)	-12,646.12
Tassa di registrazione	(3)	-2,361.30
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(8)	-27,178.62
Commissioni del Transfer Agent		-832.88
Compensi professionali	(9)	-11,880.20
Pubblicazioni		-1,083.35
Altre spese e tasse	(4)	-11,940.86
Totale costi		-341,237.17
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		128,048.29
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(2b)	735,209.02
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		-19,949.42
- di contratti futures		-786,826.64
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		1,601,486.11
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(2c)	52,182.00
- su contratti futures	(2d)	-318,963.37
Risultato netto delle operazioni per il periodo		1,391,185.99
Distribuzioni di dividendi	(14)	-692.34
Sottoscrizioni del periodo		521,738.00
Rimborsi del periodo		-537,561.96
Attivo netto alla fine del periodo		45,685,136.58

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

NEW MILLENNIUM - Alpha Active Allocation

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			40,934,979.27	43,558,013.04	95.34
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			36,352,407.32	38,582,061.89	84.45
Azioni			8,860,233.84	10,660,781.43	23.33
STATI UNITI			5,758,273.81	7,207,104.82	15.77
Informatica			1,167,042.73	1,891,554.35	4.14
3,960.00	NVIDIA CORP.	USD	224,857.10	456,466.70	1.00
273.00	BROADCOM, INC.	USD	166,343.39	408,966.17	0.90
693.00	MICROSOFT CORP.	USD	197,516.42	289,000.43	0.63
1,065.00	SALESFORCE, INC.	USD	202,779.74	255,480.64	0.56
1,256.00	APPLE, INC.	USD	223,699.17	246,828.65	0.54
453.00	ADOBE, INC.	USD	151,846.91	234,811.76	0.51
Finanza			1,024,626.50	1,270,236.62	2.78
1,592.00	JPMORGAN CHASE & CO.	USD	203,444.80	300,441.13	0.66
7,234.00	BANK OF AMERICA CORP.	USD	224,140.90	268,435.78	0.59
634.00	BERKSHIRE HATHAWAY, INC.	USD	193,707.26	240,644.82	0.53
560.00	MASTERCARD, INC.	USD	199,421.04	230,510.37	0.50
940.00	VISA, INC.	USD	203,912.50	230,204.52	0.50
Beni voluttuari			809,023.65	1,062,500.87	2.32
416.00	COSTCO WHOLESALE CORP.	USD	195,695.33	329,923.66	0.72
4,251.00	WALMART, INC.	USD	200,533.09	268,565.51	0.59
1,523.00	PROCTER & GAMBLE CO.	USD	216,070.35	234,357.87	0.51
715.00	HOME DEPOT, INC.	USD	196,724.88	229,653.83	0.50
Servizi di telecomunicazione			773,844.54	1,022,305.02	2.24
1,609.00	AMAZON.COM, INC.	USD	165,924.83	290,122.80	0.64
1,705.00	ALPHABET, INC.	USD	183,479.99	289,774.30	0.63
2,793.00	WALT DISNEY CO.	USD	235,378.23	258,751.43	0.57
4,143.00	CISCO SYSTEMS, INC.	USD	189,061.49	183,656.49	0.40
Salute			894,211.49	853,331.49	1.87
2,163.00	MERCK & CO., INC.	USD	225,779.83	249,852.37	0.55
486.00	UNITEDHEALTH GROUP, INC.	USD	218,445.52	230,930.95	0.51
1,422.00	JOHNSON & JOHNSON	USD	212,228.47	193,925.29	0.42
6,842.00	PFIZER, INC.	USD	237,757.67	178,622.88	0.39
Beni di prima necessità			449,974.37	436,554.71	0.95
3,990.00	COCA-COLA CO.	USD	227,837.00	236,961.41	0.52
1,297.00	PEPSICO, INC.	USD	222,137.37	199,593.30	0.43
Energia			415,693.93	419,806.20	0.92
2,002.00	EXXON MOBIL CORP.	USD	205,511.63	215,040.95	0.47
1,403.00	CHEVRON CORP.	USD	210,182.30	204,765.25	0.45
Industria			223,856.60	250,815.56	0.55
807.00	CATERPILLAR, INC.	USD	223,856.60	250,815.56	0.55
REGNO UNITO			880,632.10	985,955.59	2.16
Salute			235,895.44	256,494.54	0.56
1,760.00	ASTRAZENECA PLC	GBP	235,895.44	256,494.54	0.56
Finanza			209,571.60	245,985.10	0.54
30,495.00	HSBC HOLDINGS PLC	GBP	209,571.60	245,985.10	0.54
Energia			206,918.69	245,582.51	0.54
7,347.00	SHELL PLC	GBP	206,918.69	245,582.51	0.54
Beni voluttuari			228,246.37	237,893.44	0.52
4,642.00	UNILEVER PLC	GBP	228,246.37	237,893.44	0.52

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

NEW MILLENNIUM - Alpha Active Allocation

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
SVIZZERA			658,207.51	629,457.42	1.38
Salute			429,353.98	439,555.61	0.96
2,303.00	NOVARTIS AG	CHF	202,153.97	229,971.20	0.50
809.00	ROCHE HOLDING AG	CHF	227,200.01	209,584.41	0.46
Beni di prima necessità			228,853.53	189,901.81	0.42
1,994.00	NESTLE SA	CHF	228,853.53	189,901.81	0.42
FRANCIA			666,109.84	624,318.87	1.37
Energia			201,366.16	218,840.63	0.48
3,511.00	TOTALENERGIES SE	EUR	201,366.16	218,840.63	0.48
Beni voluttuari			248,890.00	213,366.40	0.47
299.00	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	EUR	248,890.00	213,366.40	0.47
Salute			215,853.68	192,111.84	0.42
2,136.00	SANOFI SA	EUR	215,853.68	192,111.84	0.42
GERMANIA			445,016.44	605,600.40	1.32
Informatica			209,890.27	325,216.32	0.71
1,716.00	SAP SE	EUR	209,890.27	325,216.32	0.71
Industria			235,126.17	280,384.08	0.61
1,614.00	SIEMENS AG	EUR	235,126.17	280,384.08	0.61
PAESI BASSI			227,442.43	363,503.40	0.79
Informatica			227,442.43	363,503.40	0.79
377.00	ASML HOLDING NV	EUR	227,442.43	363,503.40	0.79
IRLANDA			224,551.71	244,840.93	0.54
Materie prime			224,551.71	244,840.93	0.54
598.00	LINDE PLC	USD	224,551.71	244,840.93	0.54
Obbligazioni ordinarie			18,998,508.91	19,374,586.86	42.41
STATI UNITI			12,560,230.61	12,649,948.82	27.69
Enti Governativi			12,560,230.61	12,649,948.82	27.69
4,191,000.00	U.S. TREASURY NOTES 0.63% 15/08/2030	USD	3,118,711.50	3,129,103.84	6.85
3,141,000.00	U.S. TREASURY BONDS 5.25% 15/02/2029	USD	3,104,213.19	3,042,911.08	6.66
2,511,000.00	U.S. TREASURY NOTES 1.75% 15/03/2025	USD	2,245,369.09	2,286,565.90	5.00
2,278,000.00	U.S. TREASURY NOTES 2.25% 15/11/2024	USD	2,037,288.49	2,101,209.30	4.60
2,271,000.00	U.S. TREASURY NOTES 0.63% 15/10/2024	USD	2,054,648.34	2,090,158.70	4.58
PAESI BASSI			2,750,127.91	3,004,177.88	6.58
Finanza			2,000,855.79	2,241,380.00	4.91
2,000.00	BNP PARIBAS ISSUANCE BV 1.00% 29/12/2093	EUR	2,000,855.79	2,241,380.00	4.91
Beni voluttuari			749,272.12	762,797.88	1.67
778,000.00	FERRARI NV 1.50% 27/05/2025	EUR	749,272.12	762,797.88	1.67
GERMANIA			1,852,377.34	1,863,193.32	4.08
Enti Governativi			1,852,377.34	1,863,193.32	4.08
1,201,000.00	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 0.50% 15/02/2025	EUR	1,175,699.24	1,180,342.80	2.58
687,000.00	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0.40% 13/09/2024	EUR	676,678.10	682,850.52	1.50
ITALIA			693,767.59	716,847.04	1.57
Servizi di telecomunicazione			693,767.59	716,847.04	1.57
728,000.00	TELECOM ITALIA SPA 3.00% 30/09/2025	EUR	693,767.59	716,847.04	1.57

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

NEW MILLENNIUM - Alpha Active Allocation

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
PORTOGALLO			717,704.53	713,515.48	1.56
Enti Governativi			717,704.53	713,515.48	1.56
716,000.00	PORTUGAL OBRIGACOES DO TESOURO OT 2.88% 15/10/2025	EUR	717,704.53	713,515.48	1.56
SPAGNA			424,300.93	426,904.32	0.93
Enti Governativi			424,300.93	426,904.32	0.93
428,000.00	SPAIN GOVERNMENT BONDS 2.75% 31/10/2024	EUR	424,300.93	426,904.32	0.93
Obbligazioni zero coupon			8,493,664.57	8,546,693.60	18.71
ITALIA			4,713,615.00	4,721,779.61	10.34
Enti Governativi			4,713,615.00	4,721,779.61	10.34
1,260,000.00	ITALY BUONI ORDINARI DEL TESORO BOT 0.00% 14/11/2024	EUR	1,243,265.66	1,242,864.00	2.72
1,199,000.00	ITALY BUONI ORDINARI DEL TESORO BOT 0.00% 13/12/2024	EUR	1,180,201.88	1,180,415.50	2.59
922,000.00	ITALY BUONI ORDINARI DEL TESORO BOT 0.00% 13/09/2024	EUR	907,797.96	915,647.42	2.01
721,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO BTP 0.00% 15/12/2024	EUR	709,948.53	709,745.19	1.55
695,000.00	ITALY BUONI ORDINARI DEL TESORO BOT 0.00% 13/06/2025	EUR	672,400.97	673,107.50	1.47
GERMANIA			1,803,560.94	1,850,361.14	4.05
Enti Governativi			1,803,560.94	1,850,361.14	4.05
1,910,000.00	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 0.00% 15/08/2050	EUR	920,838.94	967,357.70	2.12
450,000.00	GERMAN TREASURY BILLS 0.00% 16/10/2024	EUR	445,417.89	445,603.50	0.97
438,000.00	GERMAN TREASURY BILLS 0.00% 17/07/2024	EUR	437,304.11	437,399.94	0.96
FRANCIA			1,635,875.83	1,635,406.35	3.58
Enti Governativi			1,635,875.83	1,635,406.35	3.58
911,000.00	FRANCE TREASURY BILLS BTF 0.00% 03/07/2024	EUR	910,814.69	910,826.91	1.99
741,000.00	FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BONDS OAT 0.00% 25/02/2025	EUR	725,061.14	724,579.44	1.59
SPAGNA			340,612.80	339,146.50	0.74
Enti Governativi			340,612.80	339,146.50	0.74
350,000.00	SPAIN GOVERNMENT BONDS 0.00% 31/05/2025	EUR	340,612.80	339,146.50	0.74
NEGOZIATI SU UN ALTRO MERCATO REGOLAMENTATO			2,810,553.75	3,105,400.11	6.80
Obbligazioni ordinarie			907,703.75	901,609.11	1.97
STATI UNITI			907,703.75	901,609.11	1.97
Informatica			907,703.75	901,609.11	1.97
1,000,000.00	NVIDIA CORP. 3.20% 16/09/2026	USD	907,703.75	901,609.11	1.97
Warrants			1,902,850.00	2,203,791.00	4.83
FRANCIA			1,902,850.00	2,203,791.00	4.83
Finanza			1,902,850.00	2,203,791.00	4.83
1,900.00	BNP PARIBAS SA 22/01/2094	EUR	1,902,850.00	2,203,791.00	4.83
ITALIA			0.00	0.00	0.00
Energia			0.00	0.00	0.00
10,665.00	SEMPLICEMENTE SPA 15/06/2017	EUR	0.00	0.00	0.00
ALTRI VALORI MOBILIARI			28,539.45	0.00	0.00
Azioni			28,539.45	0.00	0.00
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

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

NEW MILLENNIUM - Alpha Active Allocation

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
QUOTE DI OICR			1,743,478.75	1,870,551.04	4.09
Azioni di OICR			1,743,478.75	1,870,551.04	4.09
IRLANDA			1,743,478.75	1,870,551.04	4.09
Finanza			1,743,478.75	1,870,551.04	4.09
50,392.00	INVESCO MARKETS II PLC - INVESCO EURO CORPORATE HYBRID BOND UCITS ETF EUR - (0.390%)	EUR	1,743,478.75	1,870,551.04	4.09
Totale del Portafoglio Titoli			40,934,979.27	43,558,013.04	95.34

** Inadempiente / delistata

NEW MILLENNIUM - Alpha Active Allocation

IMPEGNI SU ACQUISTO / VENDITA DI CONTRATTI FUTURES AL 30 GIUGNO 2024

Valore nominale	Quantità	Acquisto / Vendita	Contratto	Scadenza	Valore di mercato al 30 Giugno 2024	Valuta	Plus/(minus) valenza non realizzata (EUR)	Impegno (EUR)
							-75,512.29	37,561,659.62
100,000	45	Acquisto	US 10YR NOTE (CBT)	19/09/2024	102.62	USD	36,082.91	4,617,956.30
100,000	34	Acquisto	EURO BUND	06/09/2024	131.62	EUR	22,170.01	4,475,080.00
1,000	22	Acquisto	IBIG IBOXX ISHARES	03/09/2024	124.71	USD	6,839.24	2,743,558.37
100,000	19	Acquisto	EURO BTP	06/09/2024	115.29	EUR	-34,580.00	2,190,510.00
100,000	18	Acquisto	EURO OAT	06/09/2024	123.12	EUR	-37,620.00	2,216,160.00
125,000	170	Acquisto	EURO FX CURRENCY	16/09/2024	1.00	USD	-68,404.45	21,318,394.95

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond**PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR**

Attività	Note		
Portafoglio Titoli al valore di mercato	(2a)	13,999,345.54	
Liquidità bancarie a vista		743,463.06	
Importi dovuti dai broker		1,466,251.90	
Contratti di opzioni al valore di mercato	(2e, 13)	8.00	
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	(2c, 13)	1,428.77	
Interessi da ricevere		228,235.81	
Altre attività		3,680.55	
Totale attività		16,442,413.63	
Passività			
Contratti di opzioni al valore di mercato	(2e, 13)	-3.20	
Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	(2c, 13)	-75,331.13	
Da pagare su rimborsi		-5,547.78	
Altre passività		-57,054.44	
Totale passività		-137,936.55	
Totale attivo netto		16,304,477.08	
	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	105.49	1,165.814
Azione D	EUR	73.14	1,754.410
Azione I	EUR	112.74	142,132.440
Azione L	EUR	111.01	260.000

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond**PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR**

Attivo netto all'inizio del periodo	Note	23,793,364.38
Risultato netto degli investimenti		480,757.89
Totale ricavi		480,757.89
Commissioni di consulenza/gestione	(5)	-77,506.81
Commissione di consulenza	(6)	-6,625.86
Commissioni della Banca Depositaria	(8)	-5,718.59
Tassa di registrazione	(3)	-949.95
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(8)	-17,140.46
Commissioni del Transfer Agent		-2,050.04
Compensi professionali	(9)	-4,736.94
Pubblicazioni		-554.58
Altre spese e tasse	(4)	-11,773.92
Totale costi		-127,057.15
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		353,700.74
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(2b)	-69,937.69
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		-305,012.53
- di contratti di opzioni		-9,712.59
- di contratti futures		7,042.81
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		335,679.62
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(2c)	-78,192.08
- sulle opzioni		4,954.80
Risultato netto delle operazioni per il periodo		238,523.08
Distribuzioni di dividendi	(14)	-5,298.32
Sottoscrizioni del periodo		823,059.86
Rimborsi del periodo		-8,545,171.92
Attivo netto alla fine del periodo		16,304,477.08

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 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			14,357,792.44	13,999,345.54	85.86
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			14,357,792.44	13,999,345.54	85.86
Obbligazioni ordinarie			12,222,496.40	11,836,919.88	72.60
STATI UNITI			6,987,044.31	6,763,453.53	41.48
Sovranazionale			4,760,068.86	4,469,776.01	27.41
2,150,000,000.00	INTERNATIONAL FINANCE CORP. 0.50% 23/12/2024	CLP	2,134,603.33	2,073,593.34	12.72
2,104,000.00	INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT 1.90% 16/01/2025	CAD	1,498,786.14	1,414,177.80	8.67
3,000,000.00	INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT 9.50% 09/02/2029	BRL	566,968.25	480,822.69	2.95
2,000,000.00	INTERNATIONAL FINANCE CORP. 10.00% 03/02/2027	BRL	379,173.69	331,497.59	2.03
3,000,000,000.00	INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT 5.50% 04/03/2025	IDR	180,537.45	169,684.59	1.04
Enti Governativi			2,226,975.45	2,293,677.52	14.07
1,600,000.00	U.S. TREASURY NOTES 0.50% 28/02/2026	USD	1,344,222.35	1,389,520.02	8.52
500,000.00	U.S. TREASURY NOTES 1.25% 31/03/2028	USD	403,962.11	415,026.35	2.55
300,000.00	U.S. TREASURY NOTES 3.88% 15/08/2033	USD	262,719.83	268,763.01	1.65
242,790.00	U.S. TREASURY INFLATION-INDEXED NOTES 0.13% 15/04/2025	USD	216,071.16	220,368.14	1.35
REGNO UNITO			2,281,066.10	2,267,132.34	13.91
Sovranazionale			2,281,066.10	2,267,132.34	13.91
120,000,000.00	EUROPEAN BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT 5.00% 15/01/2026	INR	1,277,536.00	1,305,946.35	8.01
6,000,000.00	EUROPEAN BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT 2.00% 21/01/2025	CNY	813,244.46	768,388.13	4.72
200,000.00	EUROPEAN BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT 20.00% 19/03/2025	USD	190,285.64	192,797.86	1.18
FILIPPINE			962,043.09	1,062,021.06	6.51
Sovranazionale			962,043.09	1,062,021.06	6.51
2,500,000,000.00	ASIAN DEVELOPMENT BANK 10.75% 27/01/2026	COP	478,609.70	565,513.45	3.47
800,000.00	ASIAN DEVELOPMENT BANK 1.10% 15/08/2024	AUD	483,433.39	496,507.61	3.04
LUSSEMBURGO			1,187,953.31	1,021,125.85	6.26
Sovranazionale			1,187,953.31	1,021,125.85	6.26
20,000,000.00	EUROPEAN INVESTMENT BANK 8.50% 17/09/2024	ZAR	1,187,953.31	1,021,125.85	6.26
NUOVA ZELANDA			804,389.59	723,187.10	4.44
Enti Governativi			804,389.59	723,187.10	4.44
1,300,000.00	NEW ZEALAND LOCAL GOVERNMENT FUNDING AGENCY BONDS 2.75% 15/04/2025	NZD	804,389.59	723,187.10	4.44
Obbligazioni a tasso variabile			457,141.79	448,196.67	2.75
COSTA D'AVORIO			457,141.79	448,196.67	2.75
Sovranazionale			457,141.79	448,196.67	2.75
500,000.00	AFRICAN DEVELOPMENT BANK FRN 31/12/2099	USD	457,141.79	448,196.67	2.75
Obbligazioni zero coupon			1,678,154.25	1,714,228.99	10.51
STATI UNITI			1,186,200.35	1,124,569.05	6.90
Enti Governativi			1,039,266.16	1,031,577.57	6.33
1,200,000.00	U.S. TREASURY NOTES 1.25% 30/06/2029	USD	1,039,266.16	1,031,577.57	6.33
Sovranazionale			146,934.19	92,991.48	0.57
20,000,000.00	INTERNATIONAL FINANCE CORP. 0.00% 26/04/2052	MXN	146,934.19	92,991.48	0.57

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 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
REGNO UNITO			247,888.27	415,954.05	2.55
Sovranazionale			247,888.27	415,954.05	2.55
158,000,000.00	EUROPEAN BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT 0.00% 19/03/2034	TRY	247,888.27	415,954.05	2.55
FILIPPINE			244,065.63	173,705.89	1.06
Sovranazionale			244,065.63	173,705.89	1.06
20,000,000.00	ASIAN DEVELOPMENT BANK 0.00% 20/04/2043	MXN	244,065.63	173,705.89	1.06
Totale del Portafoglio Titoli			14,357,792.44	13,999,345.54	85.86

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond

CONTRATTI DI OPZIONI AL 30 GIUGNO 2024

Quantità	Acquisto / Vendita		Call/Put	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	Impegno (EUR)
CONTRATTI DI OPZIONI						-4,950.00	4.80	200,000.00
OPZIONI ACQUISTATE						6,150.00	8.00	0.00
500,000	Acquisto		PUT	EUR/USD PUT 1.03 03/07/2024	EUR	6,150.00	8.00	0.00
OPZIONE SCRITTA						-11,100.00	-3.20	200,000.00
-200,000	Vendita		PUT	EUR/USD PUT 1.03 03/07/2024	EUR	-11,100.00	-3.20	200,000.00

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond**CONTRATTI FINANZIARI A TERMINE AL 30 GIUGNO 2024**

Scadenza	Ammontare comprato	Valuta comprata	Ammontare venduto	Valuta venduta	Plus/(minus)-valenza non realizzata (EUR)
					-73,902.36
18/09/2024	155,632,580.00	JPY	1,000,000.00	USD	-19,502.47
18/09/2024	460,000,000.00	JPY	2,745,755.73	EUR	-55,828.66
18/09/2024	3,130,000.00	USD	2,908,188.13	EUR	1,428.77

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Attività	Note		
Portafoglio Titoli al valore di mercato	(2a)	9,425,200.76	
Liquidità bancarie a vista		269,220.50	
Importi dovuti dai broker		165,635.27	
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	(2c, 13)	11,500.26	
Utili non realizzati su contratti futures	(2d, 13)	8,018.19	
Interessi da ricevere		161,545.11	
Altre attività		3,857.08	
Totale attività		10,044,977.17	
Passività			
Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	(2c, 13)	-16,462.22	
Altre passività		-42,383.20	
Totale passività		-58,845.42	
Totale attivo netto		9,986,131.75	
	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione I	EUR	100.09	99,770.429

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

NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond**PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR**

Attivo netto all'inizio del periodo	Note	6,747,909.97
Risultato netto degli investimenti		260,758.46
Altri ricavi		102.25
Totale ricavi		260,860.71
Commissioni di consulenza/gestione	(5)	-39,961.58
Commissione di consulenza	(6)	-6,241.70
Commissioni della Banca Depositaria	(8)	-2,596.44
Tassa di registrazione	(3)	-503.27
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(8)	-12,612.53
Commissioni del Transfer Agent		-194.56
Compensi professionali	(9)	-4,564.34
Pubblicazioni		-182.16
Altre spese e tasse	(4)	-7,317.30
Totale costi		-74,173.88
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		186,686.83
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(2b)	118,910.75
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		-31,726.43
- di contratti futures		-23,452.04
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		170,375.96
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(2c)	-13,178.96
- su contratti futures	(2d)	8,018.19
Risultato netto delle operazioni per il periodo		415,634.30
Sottoscrizioni del periodo		3,824,246.20
Rimborsi del periodo		-1,001,658.72
Attivo netto alla fine del periodo		9,986,131.75

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

NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			9,802,804.07	9,425,200.76	94.38
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			7,902,951.88	8,282,965.95	82.94
Obbligazioni ordinarie			1,564,509.25	1,629,965.42	16.32
ITALIA			682,025.00	713,677.50	7.15
Enti Governativi			493,275.00	496,065.00	4.97
500,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO BTP 1.45% 15/11/2024	EUR	493,275.00	496,065.00	4.97
Finanza			188,750.00	217,612.50	2.18
250,000.00	INTESA SANPAOLO VITA SPA 2.38% 22/12/2030	EUR	188,750.00	217,612.50	2.18
MESSICO			238,875.00	266,520.00	2.67
Energia			238,875.00	266,520.00	2.67
300,000.00	PETROLEOS MEXICANOS 2.75% 21/04/2027	EUR	238,875.00	266,520.00	2.67
LUSSEMBURGO			250,463.93	253,789.95	2.54
Finanza			123,194.74	127,410.72	1.28
150,000.00	MEXICO REMITTANCES FUNDING FIDUCIARY ESTATE MANAGEMENT SARL 4.88% 15/01/2028	USD	123,194.74	127,410.72	1.28
Servizi di telecomunicazione			127,269.19	126,379.23	1.26
150,000.00	TELECOM ITALIA CAPITAL SA 6.00% 30/09/2034	USD	127,269.19	126,379.23	1.26
JERSEY			199,700.00	196,768.00	1.97
Beni voluttuari			199,700.00	196,768.00	1.97
200,000.00	AVIS BUDGET FINANCE PLC 7.00% 28/02/2029	EUR	199,700.00	196,768.00	1.97
AUSTRIA			157,640.00	157,678.00	1.58
Informatica			157,640.00	157,678.00	1.58
200,000.00	AMS-OSRAM AG 2.13% 03/11/2027	EUR	157,640.00	157,678.00	1.58
PAESI BASSI			35,805.32	41,531.97	0.41
Beni voluttuari			35,805.32	41,531.97	0.41
40,000.00	KONINKLIJKE LUCHTVAART MAATSCHAPPIJ NV 5.75% 29/05/2049	CHF	35,805.32	41,531.97	0.41
Obbligazioni a tasso variabile			6,172,486.17	6,639,909.80	66.49
ITALIA			2,546,737.29	2,805,841.44	28.10
Finanza			2,241,722.29	2,454,189.44	24.58
500,000.00	UNICREDIT SPA FRN 30/06/2035	USD	429,438.29	437,872.44	4.39
400,000.00	UNICREDIT SPA FRN 31/12/2099	EUR	287,180.00	360,324.00	3.61
250,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 31/12/2099	EUR	197,050.00	239,065.00	2.39
200,000.00	BANCO BPM SPA FRN 31/12/2099	EUR	200,000.00	218,952.00	2.19
200,000.00	FINECOBANK BANCA FINECO SPA FRN 31/12/2099	EUR	200,000.00	205,314.00	2.06
200,000.00	BANCA POPOLARE DI SONDRIO SPA FRN 13/03/2034	EUR	200,000.00	201,082.00	2.01
200,000.00	UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA FRN 31/12/2099	EUR	169,540.00	200,888.00	2.01
200,000.00	BANCO BPM SPA FRN 18/06/2034	EUR	199,234.00	199,130.00	2.00
200,000.00	ICCREA BANCA SPA FRN 18/01/2032	EUR	191,280.00	196,952.00	1.97
200,000.00	BANCA POPOLARE DI SONDRIO SPA FRN 25/02/2032	EUR	168,000.00	194,610.00	1.95
Industria			305,015.00	351,652.00	3.52
400,000.00	POSTE ITALIANE SPA FRN 31/12/2099	EUR	305,015.00	351,652.00	3.52
LUSSEMBURGO			949,140.00	976,592.00	9.78
Salute			500,000.00	505,155.00	5.06
500,000.00	EUROFINS SCIENTIFIC SE FRN 31/12/2099	EUR	500,000.00	505,155.00	5.06

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

NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Finanza			449,140.00	471,437.00	4.72
500,000.00	mitsubishi UFJ INVESTOR SERVICES & BANKING LUXEMBOURG SA FRN 15/12/2050	EUR	260,600.00	278,335.00	2.79
200,000.00	BANQUE INTERNATIONALE A LUXEMBOURG SA FRN 01/05/2033	EUR	188,540.00	193,102.00	1.93
SPAGNA			519,840.00	578,636.00	5.79
Finanza			519,840.00	578,636.00	5.79
200,000.00	UNICAJA BANCO SA FRN 15/11/2027	EUR	201,840.00	212,250.00	2.12
200,000.00	BANCO DE CREDITO SOCIAL COOPERATIVO SA FRN 09/03/2028	EUR	167,000.00	186,432.00	1.87
200,000.00	BANCO SANTANDER SA FRN 31/12/2099	EUR	151,000.00	179,954.00	1.80
GRECIA			422,978.65	458,375.45	4.59
Finanza			422,978.65	458,375.45	4.59
200,000.00	NATIONAL BANK OF GREECE SA FRN 02/06/2027	GBP	224,018.65	246,679.45	2.47
200,000.00	ALPHA BANK SA FRN 16/06/2027	EUR	198,960.00	211,696.00	2.12
GERMANIA			413,320.00	413,408.00	4.14
Salute			413,320.00	413,408.00	4.14
400,000.00	BAYER AG FRN 25/09/2083	EUR	413,320.00	413,408.00	4.14
REGNO UNITO			348,068.80	383,368.72	3.84
Finanza			184,068.80	202,190.72	2.03
200,000.00	BARCLAYS PLC FRN 31/12/2099	USD	184,068.80	202,190.72	2.03
Servizi di telecomunicazione			164,000.00	181,178.00	1.81
200,000.00	VODAFONE GROUP PLC FRN 27/08/2080	EUR	164,000.00	181,178.00	1.81
NORVEGIA			321,750.00	326,121.00	3.27
Energia			321,750.00	326,121.00	3.27
300,000.00	VAR ENERGI ASA FRN 15/11/2083	EUR	321,750.00	326,121.00	3.27
PAESI BASSI			200,000.00	205,014.00	2.05
Servizi di telecomunicazione			200,000.00	205,014.00	2.05
200,000.00	TELEFONICA EUROPE BV FRN 31/12/2099	EUR	200,000.00	205,014.00	2.05
PORTOGALLO			147,000.00	193,494.00	1.94
Finanza			147,000.00	193,494.00	1.94
200,000.00	BANCO COMERCIAL PORTUGUES SA FRN 17/05/2032	EUR	147,000.00	193,494.00	1.94
AUSTRIA			188,250.00	185,100.00	1.85
Finanza			188,250.00	185,100.00	1.85
200,000.00	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG FRN 31/12/2049	EUR	188,250.00	185,100.00	1.85
BERMUDA			115,401.43	113,959.19	1.14
Finanza			115,401.43	113,959.19	1.14
300,000.00	AEGON LTD. FRN 29/06/2049	NLG	115,401.43	113,959.19	1.14
Obbligazioni zero coupon			165,956.46	13,090.73	0.13
LIBANO			165,956.46	13,090.73	0.13
Enti Governativi			165,956.46	13,090.73	0.13
200,000.00	LEBANON GOVERNMENT INTERNATIONAL BONDS 0.00% 02/11/2035	USD	165,956.46	13,090.73	0.13

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

NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
NEGOZIATI SU UN ALTRO MERCATO REGOLAMENTATO			1,045,408.03	1,142,234.81	11.44
Obbligazioni ordinarie			563,347.29	601,497.94	6.02
LUSSEMBURGO			195,821.31	218,500.21	2.19
Energia			195,821.31	218,500.21	2.19
242,425.01	ACU PETROLEO LUXEMBOURG SARL 7.50% 13/01/2032	USD	195,821.31	218,500.21	2.19
GIAPPONE			180,556.42	199,708.80	2.00
Servizi di telecomunicazione			180,556.42	199,708.80	2.00
200,000.00	RAKUTEN GROUP, INC. 11.25% 15/02/2027	USD	180,556.42	199,708.80	2.00
JERSEY			186,969.56	183,288.93	1.83
Beni voluttuari			186,969.56	183,288.93	1.83
200,000.00	ASTON MARTIN CAPITAL HOLDINGS LTD. 10.00% 31/03/2029	USD	186,969.56	183,288.93	1.83
Obbligazioni a tasso variabile			482,060.74	540,736.87	5.42
ITALIA			482,060.74	540,736.87	5.42
Finanza			482,060.74	540,736.87	5.42
550,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 20/06/2054	USD	482,060.74	540,736.87	5.42
ALTRI VALORI MOBILIARI			854,444.16	0.00	0.00
Obbligazioni ordinarie			854,444.16	0.00	0.00
BERMUDA			324,190.83	0.00	0.00
Servizi di telecomunicazione			324,190.83	0.00	0.00
400,000.00	DGL3 LTD. 0.00% 30/09/2020**	USD	324,190.83	0.00	0.00
CANADA			183,075.17	0.00	0.00
Industria			183,075.17	0.00	0.00
300,000.00	ENTREC CORP. 8.50% 30/06/2021**	CAD	183,075.17	0.00	0.00
STATI UNITI			72,591.46	0.00	0.00
Energia			72,591.46	0.00	0.00
100,000.00	SANCHEZ ENERGY CORP. 0.00% 15/06/2021**	USD	72,591.46	0.00	0.00
LUSSEMBURGO			274,586.70	0.00	0.00
Energia			274,586.70	0.00	0.00
13,100.00	CONSTELLATION OIL SERVICES HOLDING SA 0.25% 31/12/2050**	USD	274,586.70	0.00	0.00
Totale del Portafoglio Titoli			9,802,804.07	9,425,200.76	94.38

** Inadempiente / delistata

NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond

IMPEGNI SU ACQUISTO / VENDITA DI CONTRATTI FUTURES AL 30 GIUGNO 2024

Valore nominale	Quantità	Acquisto / Vendita	Contratto	Scadenza	Valore di mercato al 30 Giugno 2024	Valuta	Plus/(minus) valenza non realizzata (EUR)	Impegno (EUR)
							8,018.19	551,959.17
100,000	5	Acquisto	US LONG BOND (CBT)	19/09/2024	110.39	USD	8,018.19	551,959.17

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond

CONTRATTI FINANZIARI A TERMINE AL 30 GIUGNO 2024

Scadenza	Ammontare comprato	Valuta comprata	Ammontare venduto	Valuta venduta	Plus/(minus)-valenza non realizzata (EUR)
					-4,961.96
18/09/2024	1,682,159.02	EUR	1,816,000.00	USD	-5,976.54
18/09/2024	1,816,000.00	GBP	2,145,627.12	EUR	-10,485.68
18/09/2024	2,145,559.94	EUR	1,816,000.00	GBP	10,418.50
18/09/2024	247,986.88	EUR	210,000.00	GBP	1,081.76

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Attività	Note		
Portafoglio Titoli al valore di mercato	(2a)	77,979,797.63	
Liquidità bancarie a vista		721,248.87	
Importi dovuti dai broker		1,337,434.36	
Utili non realizzati su contratti futures	(2d, 13)	26,668.94	
Dividendi da ricevere		11,995.23	
Interessi da ricevere		459,365.35	
Altre attività		4,915.88	
Totale attività		80,541,426.26	
Passività			
Perdite non realizzate su contratti futures	(2d, 13)	-235.89	
Altre passività		-363,544.10	
Totale passività		-363,779.99	
Totale attivo netto		80,177,646.27	
	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	107.55	215,837.174
Azione I	EUR	111.66	42,419.511
Azione L	EUR	110.24	473,777.000

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

NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity**PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR**

Attivo netto all'inizio del periodo	Note	80,843,127.20
Risultato netto degli investimenti		901,301.45
Altri ricavi		815.20
Totale ricavi		902,116.65
Commissioni di consulenza/gestione	(5)	-634,531.33
Commissione di consulenza	(6)	-7,481.82
Commissioni della Banca Depositaria	(8)	-22,075.46
Tassa di registrazione	(3)	-19,297.44
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(8)	-21,747.62
Commissioni del Transfer Agent		-608.22
Compensi professionali	(9)	-5,375.48
Pubblicazioni		-1,963.53
Altre spese e tasse	(4)	-17,163.57
Totale costi		-730,244.47
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		171,872.18
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(2b)	23,182.14
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		1,140.65
- di contratti futures		99,901.57
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		1,720,656.64
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(2c)	16,513.48
- su contratti futures	(2d)	-82,670.11
Risultato netto delle operazioni per il periodo		1,950,596.55
Sottoscrizioni del periodo		639,526.58
Rimborsi del periodo		-3,255,604.06
Attivo netto alla fine del periodo		80,177,646.27

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

NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			78,067,055.34	77,979,797.63	97.26
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			61,624,680.25	59,688,034.63	74.45
Obbligazioni ordinarie			33,868,831.46	32,802,365.13	40.92
ITALIA			12,973,446.59	12,907,617.41	16.10
Enti Governativi			7,316,736.82	7,334,063.41	9.15
4,500,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 0.95% 01/08/2030	EUR	3,820,586.46	3,844,800.00	4.80
3,098,481.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 0.55% 21/05/2026	EUR	3,001,386.43	2,991,583.41	3.73
500,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 2.50% 01/12/2024	EUR	494,763.93	497,680.00	0.62
Finanza			4,847,073.42	4,789,794.00	5.97
1,600,000.00	CASSA DEPOSITI E PRESTITI SPA 3.63% 13/01/2030	EUR	1,595,143.16	1,600,000.00	2.00
1,000,000.00	CASSA DEPOSITI E PRESTITI SPA 1.00% 21/09/2028	EUR	1,017,962.28	892,500.00	1.11
800,000.00	INTESA SANPAOLO SPA 5.63% 08/03/2033	EUR	810,115.02	875,456.00	1.09
700,000.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA 2.12% 01/10/2030	EUR	622,311.31	621,705.00	0.77
500,000.00	BANCO BPM SPA 4.88% 18/01/2027	EUR	498,509.68	512,430.00	0.64
300,000.00	BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA 1.88% 09/01/2026	EUR	303,031.97	287,703.00	0.36
Servizi di pubblica utilità			504,352.80	497,710.00	0.62
500,000.00	SNAM SPA 3.25% 29/09/2028	EUR	504,352.80	497,710.00	0.62
Industria			305,283.55	286,050.00	0.36
300,000.00	IMA INDUSTRIA MACCHINE AUTOMATICHE SPA 3.75% 15/01/2028	EUR	305,283.55	286,050.00	0.36
GERMANIA			4,258,019.76	4,180,924.36	5.22
Enti Governativi			4,258,019.76	4,180,924.36	5.22
3,000,000.00	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 0.50% 15/02/2025	EUR	2,894,272.00	2,948,400.00	3.68
1,263,130.00	DEUTSCHE BUNDESREPUBLIK BONDS INFLATION-LINKED 0.10% 15/04/2026	EUR	1,363,747.76	1,232,524.36	1.54
SPAGNA			4,351,543.96	3,883,268.18	4.84
Enti Governativi			4,351,543.96	3,883,268.18	4.84
3,500,000.00	SPAIN GOVERNMENT BONDS 1.45% 30/04/2029	EUR	3,653,299.03	3,256,190.00	4.06
627,530.00	SPAIN GOVERNMENT BONDS INFLATION-LINKED 1.80% 30/11/2024	EUR	698,244.93	627,078.18	0.78
BELGIO			3,284,881.21	3,226,070.00	4.02
Enti Governativi			3,284,881.21	3,226,070.00	4.02
2,000,000.00	EUROPEAN UNION 1.63% 04/12/2029	EUR	1,876,583.23	1,865,900.00	2.33
1,500,000.00	EUROPEAN UNION 3.00% 04/03/2053	EUR	1,408,297.98	1,360,170.00	1.69
PORTOGALLO			3,099,422.98	2,896,609.00	3.61
Enti Governativi			3,099,422.98	2,896,609.00	3.61
3,100,000.00	PORTUGAL OBRIGACOES DO TESOURO OT 0.70% 15/10/2027	EUR	3,099,422.98	2,896,609.00	3.61
FRANCIA			2,072,199.37	2,008,969.00	2.51
Enti Governativi			1,569,712.88	1,537,989.00	1.92
1,500,000.00	FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BONDS OAT 1.25% 25/05/2034	EUR	1,277,160.38	1,248,180.00	1.56
300,000.00	COUNCIL OF EUROPE DEVELOPMENT BANK 2.63% 11/01/2034	EUR	292,552.50	289,809.00	0.36
Beni voluttuari			502,486.49	470,980.00	0.59
500,000.00	ACCOR SA 2.38% 29/11/2028	EUR	502,486.49	470,980.00	0.59
STATI UNITI			1,801,962.50	1,852,280.41	2.31
Enti Governativi			1,298,411.81	1,352,890.41	1.69
1,500,000.00	U.S. TREASURY NOTES 2.00% 15/08/2025	USD	1,298,411.81	1,352,890.41	1.69
Beni voluttuari			503,550.69	499,390.00	0.62
500,000.00	FORD MOTOR CREDIT CO. LLC 1.74% 19/07/2024	EUR	503,550.69	499,390.00	0.62

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

NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
PAESI BASSI			1,583,587.73	1,392,595.00	1.74
Servizi di telecomunicazione			1,039,076.84	897,480.00	1.12
1,000,000.00	PROSUS NV 1.54% 03/08/2028	EUR	1,039,076.84	897,480.00	1.12
Materie prime			544,510.89	495,115.00	0.62
500,000.00	SYNGENTA FINANCE NV 3.38% 16/04/2026	EUR	544,510.89	495,115.00	0.62
REGNO UNITO			443,767.36	454,031.77	0.57
Enti Governativi			443,767.36	454,031.77	0.57
500,000.00	U.K. GILTS 0.25% 31/07/2031	GBP	443,767.36	454,031.77	0.57
Obbligazioni a tasso variabile			23,222,815.55	22,378,089.50	27.91
ITALIA			11,287,222.68	11,202,580.50	13.97
Finanza			5,081,359.65	5,073,172.50	6.33
1,000,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 31/12/2099	EUR	997,147.64	957,380.00	1.20
1,000,000.00	UNICREDIT SPA FRN 31/12/2099	EUR	859,326.11	900,810.00	1.12
750,000.00	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA FRN 23/11/2030	EUR	753,602.15	721,627.50	0.90
500,000.00	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA FRN 01/02/2030	EUR	500,521.93	509,825.00	0.64
500,000.00	UNICREDIT SPA FRN 16/04/2034	EUR	499,992.16	507,550.00	0.63
500,000.00	UNICREDIT SPA FRN 23/09/2029	EUR	492,290.20	496,435.00	0.62
500,000.00	SACE SPA FRN 10/02/2049	EUR	511,858.05	491,650.00	0.61
500,000.00	UNICREDIT SPA FRN 16/06/2026	EUR	466,621.41	487,895.00	0.61
Enti Governativi			4,000,980.69	4,006,400.00	5.00
3,000,000.00	ITALY CERTIFICATI DI CREDITO DEL TESORO FRN 15/04/2026	EUR	3,006,513.06	3,013,200.00	3.76
1,000,000.00	ITALY CERTIFICATI DI CREDITO DEL TESORO FRN 15/04/2029	EUR	994,467.63	993,200.00	1.24
Energia			1,578,644.28	1,557,280.00	1.94
1,600,000.00	ENI SPA FRN 31/12/2099	EUR	1,578,644.28	1,557,280.00	1.94
Servizi di pubblica utilità			626,238.06	565,728.00	0.70
600,000.00	ENEL SPA FRN 31/12/2099	EUR	626,238.06	565,728.00	0.70
GERMANIA			4,436,597.94	3,997,550.00	4.99
Finanza			3,931,869.88	3,515,610.00	4.39
1,000,000.00	COMMERZBANK AG FRN 31/03/2099	EUR	953,146.74	992,290.00	1.24
1,000,000.00	DEUTSCHE BANK AG FRN 19/11/2025	EUR	989,929.96	989,010.00	1.24
1,000,000.00	ALLIANZ SE FRN 31/12/2099	EUR	983,590.03	778,850.00	0.97
1,000,000.00	ALLIANZ SE FRN 31/12/2099	EUR	1,005,203.15	755,460.00	0.94
Salute			504,728.06	481,940.00	0.60
500,000.00	BAYER AG FRN 25/03/2082	EUR	504,728.06	481,940.00	0.60
FRANCIA			2,038,207.56	1,932,149.00	2.41
Beni di prima necessità			1,001,700.70	927,910.00	1.16
1,000,000.00	DANONE SA FRN 31/12/2099	EUR	1,001,700.70	927,910.00	1.16
Energia			705,323.38	635,999.00	0.79
700,000.00	TOTALENERGIES SE FRN 31/12/2099	EUR	705,323.38	635,999.00	0.79
Finanza			331,183.48	368,240.00	0.46
400,000.00	AXA SA FRN 29/12/2049	EUR	331,183.48	368,240.00	0.46
PAESI BASSI			2,103,051.11	1,864,110.00	2.32
Beni voluttuari			1,098,748.59	996,080.00	1.24
1,000,000.00	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN 29/03/2049	EUR	1,098,748.59	996,080.00	1.24
Finanza			1,004,302.52	868,030.00	1.08
1,000,000.00	COOPERATIEVE RABOBANK UA FRN 31/12/2099	EUR	1,004,302.52	868,030.00	1.08

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

NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
SPAGNA			1,738,652.20	1,741,236.00	2.17
Finanza			1,738,652.20	1,741,236.00	2.17
1,200,000.00	BANCO SANTANDER SA FRN 31/12/2099	EUR	1,148,439.34	1,151,916.00	1.44
600,000.00	BANCO DE SABADELL SA FRN 17/01/2030	EUR	590,212.86	589,320.00	0.73
REGNO UNITO			1,004,602.73	978,440.00	1.22
Energia			1,004,602.73	978,440.00	1.22
1,000,000.00	BP CAPITAL MARKETS PLC FRN 31/12/2099	EUR	1,004,602.73	978,440.00	1.22
BERMUDA			614,481.33	662,024.00	0.83
Finanza			614,481.33	662,024.00	0.83
800,000.00	AEGON LTD. FRN 29/07/2049	EUR	614,481.33	662,024.00	0.83
Obbligazioni zero coupon			4,533,033.24	4,507,580.00	5.62
FRANCIA			2,693,243.85	2,676,671.00	3.34
Enti Governativi			2,693,243.85	2,676,671.00	3.34
2,900,000.00	FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BONDS OAT 0.00% 25/02/2027	EUR	2,693,243.85	2,676,671.00	3.34
GERMANIA			1,337,638.44	1,330,275.00	1.66
Finanza			1,337,638.44	1,330,275.00	1.66
1,500,000.00	KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 0.00% 15/09/2028	EUR	1,337,638.44	1,330,275.00	1.66
ITALIA			502,150.95	500,634.00	0.62
Salute			502,150.95	500,634.00	0.62
600,000.00	DIASORIN SPA 0.00% 05/05/2028	EUR	502,150.95	500,634.00	0.62
QUOTE DI OICR			16,442,375.09	18,291,763.00	22.81
Azioni di OICR			16,442,375.09	18,291,763.00	22.81
IRLANDA			12,942,165.71	14,028,000.00	17.49
Finanza			12,942,165.71	14,028,000.00	17.49
87,500.00	ISHARES II PLC - ISHARES CORE MSCI EUROPE UCITS ETF EUR - (0.120%)	EUR	2,123,539.60	2,808,312.50	3.50
53,000.00	ISHARES PLC - ISHARES MSCI EUROPE EX-UK UCITS ETF EUR - (0.400%)	EUR	1,716,796.52	2,351,345.00	2.93
17,000.00	ISHARES V PLC - ISHARES S&P 500 EUR HEDGED UCITS ETF EUR (HEDGED) - (0.200%)	EUR	1,502,651.25	1,965,880.00	2.45
12,000.00	ISHARES V PLC - ISHARES MSCI WORLD EUR HEDGED UCITS ETF EUR (HEDGED) - (0.550%)	EUR	882,212.89	1,049,760.00	1.31
14,700.00	ISHARES VI PLC - ISHARES J.P. MORGAN \$ EM BOND EUR HEDGED UCITS ETF EUR (HEDGED) - (0.500%)	EUR	1,419,944.51	971,376.00	1.21
90,000.00	ISHARES PLC - ISHARES CORE FTSE 100 UCITS ETF EUR - (0.070%)	EUR	792,662.62	842,670.00	1.05
100,000.00	ISHARES IV PLC - ISHARES HEALTHCARE INNOVATION UCITS ETF EUR - (0.400%)	EUR	766,732.37	691,000.00	0.86
28,000.00	LEGAL & GENERAL UCITS ETF PLC - L&G CYBER SECURITY UCITS ETF EUR - (0.690%)	EUR	553,427.98	627,200.00	0.78
10,000.00	ISHARES II PLC - ISHARES GLOBAL WATER UCITS ETF EUR - (0.650%)	EUR	561,526.40	608,800.00	0.76
11,700.00	SSGA SPDR ETFS EUROPE I PLC - SPDR BLOOMBERG EMERGING MARKETS LOCAL BOND UCITS ETF EUR - (0.550%)	EUR	692,037.24	597,168.00	0.75
80,000.00	ISHARES II PLC - ISHARES GLOBAL CLEAN ENERGY UCITS ETF EUR - (0.650%)	EUR	902,284.97	580,480.00	0.72
17,700.00	WISDOMTREE ISSUER ICAV - WISDOMTREE CLOUD COMPUTING UCITS ETF EUR - (0.040%)	EUR	602,249.36	510,733.50	0.64
25,000.00	LEGAL & GENERAL UCITS ETF PLC - L&G BATTERY VALUE-CHAIN UCITS ETF EUR - (0.490%)	EUR	426,100.00	423,275.00	0.53

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

NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
LUSSEMBURGO			3,500,209.38	4,263,763.00	5.32
Finanza			3,500,209.38	4,263,763.00	5.32
33,500.00	AMUNDI INDEX SOLUTIONS - AMUNDI INDEX MSCI EUROPE SRI UCITS ETF DR EUR - (0.180%)	EUR	1,984,316.66	2,820,365.00	3.52
4,000.00	AMUNDI INDEX SOLUTIONS - AMUNDI S&P GLOBAL LUXURY UCITS ETF EUR - (0.250%)	EUR	863,621.60	801,600.00	1.00
2,500.00	MULTI UNITS LUXEMBOURG SICAV - LYXOR DAX (DR) UCITS ETF EUR - (0.150%)	EUR	318,947.67	418,900.00	0.52
26,000.00	XTRACKERS - HARVEST CSI300 UCITS ETF -1D- EUR - (0.450%)	EUR	333,323.45	222,898.00	0.28
Totale del Portafoglio Titoli			78,067,055.34	77,979,797.63	97.26

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 2024

Valore nominale	Quantità	Acquisto / Vendita	Contratto	Scadenza	Valore di mercato al 30 Giugno 2024	Valuta	Plus/(minus) valenza non realizzata (EUR)	Impegno (EUR)
							26,433.05	10,391,575.58
100,000	45	Acquisto	EURO BUND	06/09/2024	131.62	EUR	18,650.00	5,922,900.00
50	10	Acquisto	EMINI RUSSELL 2000	20/09/2024	1,926.76	USD	6,050.85	963,377.22
100,000	20	Acquisto	US 10YR NOTE (CBT)	19/09/2024	102.62	USD	1,968.09	2,052,425.02
10	15	Acquisto	FTSE 100 INDEX	20/09/2024	9,685.82	GBP	-235.89	1,452,873.34

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Attività	Note		
Portafoglio Titoli al valore di mercato	(2a)	5,604,279.14	
Liquidità bancarie a vista		327,812.84	
Importi dovuti dai broker		28,636.02	
Interessi da ricevere		39,030.28	
Altre attività		3,597.38	
Totale attività		6,003,355.66	
Passività			
Da pagare su rimborsi		-21,278.00	
Altre passività		-32,553.26	
Totale passività		-53,831.26	
Totale attivo netto		5,949,524.40	
	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	103.27	21,208.343
Azione I	EUR	107.70	33,158.710
Azione L	EUR	106.34	1,770.000

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

NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia

PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Attivo netto all'inizio del periodo	Note	8,511,994.82
Risultato netto degli investimenti		115,978.07
Altri ricavi		10.24
Totale ricavi		115,988.31
Commissioni di consulenza/gestione	(5)	-32,838.82
Commissione di consulenza	(6)	-6,415.62
Commissioni della Banca Depositaria	(8)	-2,140.13
Tassa di registrazione	(3)	-1,014.26
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(8)	-18,020.80
Commissioni del Transfer Agent		-204.98
Compensi professionali	(9)	-4,590.86
Pubblicazioni		-202.19
Altre spese e tasse	(4)	-7,374.39
Totale costi		-72,802.05
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		43,186.26
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(2b)	590,360.96
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		-208,007.64
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(2c)	187.60
Risultato netto delle operazioni per il periodo		425,727.18
Rimborsi del periodo		-2,988,197.60
Attivo netto alla fine del periodo		5,949,524.40

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

NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			5,731,077.73	5,604,279.14	94.20
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			5,031,168.92	5,017,186.05	84.33
Azioni			1,782,373.60	1,750,337.12	29.42
ITALIA			1,456,135.77	1,450,594.62	24.38
Industria			377,027.11	362,735.00	6.10
2,000.00	INTERPUMP GROUP SPA	EUR	84,049.60	82,960.00	1.39
5,000.00	B&C SPEAKERS SPA	EUR	88,181.68	76,500.00	1.29
15,000.00	FINCANTIERI SPA	EUR	68,781.62	67,965.00	1.14
1,500.00	DANIELI & C OFFICINE MECCANICHE SPA	EUR	52,104.94	53,400.00	0.90
2,000.00	LEONARDO SPA	EUR	43,358.13	43,360.00	0.73
1,000.00	CEMBRE SPA	EUR	40,551.14	38,550.00	0.65
Finanza			243,917.89	239,075.14	4.02
4,057.00	AZIMUT HOLDING SPA	EUR	98,716.23	89,335.14	1.50
5,000.00	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA	EUR	68,470.75	68,450.00	1.15
2,000.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA	EUR	46,475.89	46,580.00	0.78
10,000.00	INTESA SANPAOLO SPA	EUR	30,255.02	34,710.00	0.59
Energia			219,836.59	224,567.04	3.77
50,000.00	SAIPEM SPA	EUR	111,427.88	119,600.00	2.01
2,641.00	ERG SPA	EUR	63,987.94	61,905.04	1.04
3,000.00	ENI SPA	EUR	44,420.77	43,062.00	0.72
Servizi di telecomunicazione			168,682.00	177,300.00	2.98
400,000.00	TELECOM ITALIA SPA	EUR	89,683.66	89,400.00	1.50
500.00	REPLY SPA	EUR	62,298.34	68,900.00	1.16
10,000.00	EXECUS SPA	EUR	16,700.00	19,000.00	0.32
Beni voluttuari			159,266.66	157,335.44	2.64
10,000.00	PIRELLI & C SPA	EUR	60,410.66	55,600.00	0.93
1,750.00	FOPE SPA	EUR	45,718.48	49,000.00	0.82
500.00	BRUNELLO CUCINELLI SPA	EUR	45,864.39	46,750.00	0.79
300.00	POWERSOFT SPA	EUR	981.82	4,950.00	0.08
152.00	PORTOBELLO SPA	EUR	6,152.81	884.64	0.02
100.00	RADICI PIETRO INDUSTRIES & BRANDS SPA	EUR	0.00	113.00	0.00
30.00	SOSTRAVEL.COM SPA	EUR	138.50	37.80	0.00
Salute			146,216.60	146,110.00	2.46
1,500.00	AMPLIFON SPA	EUR	51,034.64	49,860.00	0.84
1,000.00	RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA E FARMACEUTICA SPA	EUR	48,512.06	48,700.00	0.82
1,000.00	PHARMANUTRA SPA	EUR	46,669.90	47,550.00	0.80
Informatica			66,845.72	73,792.00	1.24
640.00	SESA SPA	EUR	66,845.72	73,792.00	1.24
Beni di prima necessità			42,363.45	37,740.00	0.63
3,000.00	ORSERO SPA	EUR	42,363.45	37,740.00	0.63
Servizi di pubblica utilità			31,979.75	31,940.00	0.54
10,000.00	HERA SPA	EUR	31,979.75	31,940.00	0.54
PAESI BASSI			222,222.03	213,642.50	3.59
Beni voluttuari			118,717.81	114,210.00	1.92
300.00	FERRARI NV	EUR	118,717.81	114,210.00	1.92
Informatica			55,793.57	55,312.50	0.93
1,500.00	STMICROELECTRONICS NV	EUR	55,793.57	55,312.50	0.93
Beni di prima necessità			47,710.65	44,120.00	0.74
5,000.00	DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	EUR	47,710.65	44,120.00	0.74

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

NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
LUSSEMBURGO			104,015.80	86,100.00	1.45
Industria			104,015.80	86,100.00	1.45
6,000.00	TENARIS SA	EUR	104,015.80	86,100.00	1.45
Obbligazioni ordinarie			2,942,298.75	2,953,682.33	49.65
ITALIA			2,544,361.46	2,549,622.33	42.85
Servizi di pubblica utilità			658,842.43	657,855.00	11.06
300,000.00	SNAM SPA 0.75% 20/06/2029	EUR	251,344.50	261,015.00	4.39
200,000.00	A2A SPA 4.50% 19/09/2030	EUR	205,061.99	207,076.00	3.48
100,000.00	TERNA - RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA 1.00% 10/04/2026	EUR	95,228.08	95,812.00	1.61
100,000.00	IREN SPA 1.50% 24/10/2027	EUR	107,207.86	93,952.00	1.58
Finanza			454,742.83	475,453.00	7.99
200,000.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA 2.12% 01/10/2030	EUR	166,306.50	177,630.00	2.99
100,000.00	BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA 3.63% 24/09/2024	EUR	101,359.53	99,833.00	1.68
100,000.00	UNIPOL GRUPPO SPA 3.25% 23/09/2030	EUR	95,870.33	99,644.00	1.67
100,000.00	BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA 2.63% 28/04/2025	EUR	91,206.47	98,346.00	1.65
Industria			431,139.88	418,006.00	7.02
250,000.00	POSTE ITALIANE SPA 0.50% 10/12/2028	EUR	230,932.83	218,685.00	3.67
100,000.00	FERROVIE DELLO STATO ITALIANE SPA 4.50% 23/05/2033	EUR	104,918.95	104,054.00	1.75
100,000.00	AEROPORTI DI ROMA SPA REG 1.63% 08/06/2027	EUR	95,288.10	95,267.00	1.60
Enti Governativi			394,061.27	393,375.00	6.61
200,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.00% 01/08/2029	EUR	188,311.66	195,120.00	3.28
150,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 2.80% 01/03/2067	EUR	113,047.61	105,525.00	1.77
100,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 0.95% 15/09/2027	EUR	92,702.00	92,730.00	1.56
Energia			357,747.56	367,120.00	6.17
200,000.00	ENI SPA 0.38% 14/06/2028	EUR	170,588.21	177,340.00	2.98
100,000.00	ALERION CLEANPOWER SPA 3.13% 19/12/2025	EUR	100,000.00	99,551.00	1.67
100,000.00	ERG SPA 0.50% 11/09/2027	EUR	87,159.35	90,229.00	1.52
Salute			100,590.22	93,306.00	1.57
100,000.00	AMPLIFON SPA 1.13% 13/02/2027	EUR	100,590.22	93,306.00	1.57
Beni voluttuari			88,037.20	87,854.00	1.48
100,000.00	ASTM SPA 1.50% 25/01/2030	EUR	88,037.20	87,854.00	1.48
Servizi di telecomunicazione			59,200.07	56,653.33	0.95
58,871.35	PRISMI SPA 6.00% 18/08/2026	EUR	59,200.07	56,653.33	0.95
PAESI BASSI			199,485.76	200,844.00	3.38
Beni voluttuari			199,485.76	200,844.00	3.38
100,000.00	STELLANTIS NV 4.38% 14/03/2030	EUR	102,106.83	102,798.00	1.73
100,000.00	FERRARI NV 1.50% 27/05/2025	EUR	97,378.93	98,046.00	1.65
LUSSEMBURGO			100,000.00	104,620.00	1.76
Finanza			100,000.00	104,620.00	1.76
100,000.00	CARRARO FINANCE SA 7.75% 06/11/2028	EUR	100,000.00	104,620.00	1.76
SPAGNA			98,451.53	98,596.00	1.66
Enti Governativi			98,451.53	98,596.00	1.66
100,000.00	SPAIN GOVERNMENT BONDS 2.15% 31/10/2025	EUR	98,451.53	98,596.00	1.66

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

NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2024 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Obbligazioni a tasso variabile			306,496.55	295,000.00	4.96
ITALIA			306,496.55	295,000.00	4.96
Finanza			306,496.55	295,000.00	4.96
200,000.00	ICCREA BANCA SPA FRN 20/10/2025	EUR	206,538.58	198,884.00	3.34
100,000.00	BFF BANK SPA FRN 20/03/2029	EUR	99,957.97	96,116.00	1.62
Warrants			0.02	18,166.60	0.30
ITALIA			0.02	18,166.60	0.30
Energia			0.00	12,916.60	0.21
34,000.00	LEMON SISTEMI SPA 06/12/2026	EUR	0.00	12,916.60	0.21
Servizi di telecomunicazione			0.02	5,250.00	0.09
15,000.00	EXECUS SPA 16/10/2026	EUR	0.02	5,250.00	0.09
ALTRI VALORI MOBILIARI			163,172.83	68,815.36	1.16
Obbligazioni ordinarie			163,172.83	68,815.36	1.16
ITALIA			163,172.83	68,815.36	1.16
Informatica			71,430.00	68,815.36	1.16
71,430.00	INNOVATEC SPA 6.00% 30/09/2026	EUR	71,430.00	68,815.36	1.16
Energia			91,742.83	0.00	0.00
97,200.00	ENERTRONICA SANTERNO SPA 7.00% 31/12/2022*	EUR	91,742.83	0.00	0.00
QUOTE DI OICR			536,735.98	518,277.73	8.71
Azioni di OICR			536,735.98	518,277.73	8.71
IRLANDA			194,326.05	197,620.00	3.32
Finanza			194,326.05	197,620.00	3.32
20,000.00	HANETF ICAV - FUTURE OF DEFENCE UCITS ETF EUR - (0.490%)	EUR	194,326.05	197,620.00	3.32
LUSSEMBURGO			205,685.15	183,997.73	3.09
Finanza			205,685.15	183,997.73	3.09
1,911.49	NEW MILLENNIUM SICAV - AIM SISTEMA ITALIA PIR -I- EUR - (1.100%)	EUR	205,685.15	183,997.73	3.09
FRANCIA			136,724.78	136,660.00	2.30
Finanza			136,724.78	136,660.00	2.30
20,000.00	MULTI UNITS FRANCE - AMUNDI FTSE MIB DAILY (-1X) INVERSE UCITS ETF EUR - (0.600%)	EUR	136,724.78	136,660.00	2.30
Totale del Portafoglio Titoli			5,731,077.73	5,604,279.14	94.20

* Strumenti finanziari prezzati al fair value

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 2024 sono i seguenti:

- NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond
- NEW MILLENNIUM - Euro Equities
- NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)
- NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term
- NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond
- 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 Market Timing
- NEW MILLENNIUM - Alpha Active Allocation
- NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond
- NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond
- NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity
- NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia

Le classi di azioni "L" di ogni comparto sono quotate al mercato ATFund (Borsa Italiana – Euronext).

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, in regime di continuità del Fondo, 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 a termine su valute».

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.

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

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

g) Costo d'acquisto dei titoli in portafoglio

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

h) Ricavi

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

i) Conversioni delle voci in valute estere

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

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

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

j) Valore del Patrimonio Netto per Azione

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

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

k) Prospetto finanziario

I prospetti finanziari sono 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 2024 sono:

1 EUR =	1.604777	AUD
1 EUR =	5.952984	BRL
1 EUR =	1.466530	CAD
1 EUR =	0.963075	CHF
1 EUR =	57.98866	CLP
1 EUR =	7.787393	CNY
1 EUR =	4441.495	COP
1 EUR =	7.457454	DKK
1 EUR =	0.847837	GBP
1 EUR =	8.367585	HKD
1 EUR =	17549.91	IDR
1 EUR =	89.37059	INR
1 EUR =	148.9090	ISK
1 EUR =	172.4018	JPY
1 EUR =	19.59749	MXN
1 EUR =	2.203710	NLG
1 EUR =	11.41146	NOK
1 EUR =	1.758842	NZD
1 EUR =	4.583370	PLN
1 EUR =	92.43848	RUB
1 EUR =	11.35005	SEK
1 EUR =	1.452490	SGD
1 EUR =	35.13573	TRY
1 EUR =	1.071750	USD
1 EUR =	19.57016	ZAR

m) Investimenti incrociati

Il Prospetto del Patrimonio Netto consolidato mostra un totale del Patrimonio Netto a EUR 874,450,216.52. Alla fine dell'anno, i comparti NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing hanno investito un valore totale di EUR 1,295,502.92 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 873,154,713.60.

3. REGIME FISCALE

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

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

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

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

4. ALTRE SPESE E TASSE

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

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

Comparti	Commissioni di distribuzione	Tasse di segnalazione	Commissioni dell'agente di collocamento	Tasse di autorità	Co Sponship	Spese varie	Totale
NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term	0.00	2,197.58	479.54	2,172.92	244.82	2,562.38	7,657.24
NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing	11,580.26	2,155.48	119.50	2,064.62	61.58	2,306.53	18,287.97
NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia	0.00	2,081.96	409.08	2,162.24	207.76	2,513.35	7,374.39

I diritti vari di cui sopra sono composti da: diritti di licenza, diritti contributivi, diritti di regolamentazione e diritti di quotazione.

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 2024, 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
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	1.50%	1.50%	0.75%	0.90%	0.75%
NEW MILLENNIUM - Euro Equities	1.50%		0.70%	0.85%	0.70%
NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)	1.60%		0.80%	0.95%	
NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term	0.55%	0.55%	0.30%	0.45%	0.30%
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond	1.20%	1.20%	0.70%	0.85%	
NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate	0.90%	0.90%	0.45%	0.60%	0.45%
NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative	1.10%	1.10%	0.55%	0.70%	
NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible	1.35%		1.00%	1.15%	
NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe	0.80%		0.40%	0.55%	0.40%
NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond	1.50%	1.50%	0.75%	0.90%	
NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing	0.60%	0.60%	0.60%	0.75%	0.60%
NEW MILLENNIUM - Alpha Active Allocation	2.00%	2.00%	1.30%	1.45%	
NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond	1.60%	1.60%	0.80%	0.95%	
NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond	1.70%		0.85%		
NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity	1.80%		1.35%	1.50%	
NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia	1.20%		0.60%	0.75%	

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

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 2024, 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% -A-AZ- EUR - (1.500%)	1.50%
AZ FUND 1 - AZ BOND HIGH YIELD -A- EUR - (1.440%)	1.44%
AZ FUND 1 - GLOBAL MACRO BOND -A- EUR - (1.200%)	1.20%
NEW MILLENNIUM SICAV - AUGUSTUM EXTRA EURO HIGH QUALITY BOND -I- EUR - (0.800%)	0.80%
NEW MILLENNIUM SICAV - AUGUSTUM CORPORATE BOND -I- EUR - (0.750%)	0.75%
NEW MILLENNIUM SICAV - AUGUSTUM ITALIAN DIVERSIFIED BOND -I- EUR - (0.700%)	0.70%
NEW MILLENNIUM SICAV - AUGUSTUM HIGH QUALITY BOND -I- EUR - (0.700%)	0.70%

6. COMMISSIONE DI CONSULENZA

Il compenso di consulenza comprende la spesa fissa fino a 12.000 Eur per anno da pagare alla società di gestione e spese accessorie.

7. COMMISSIONI SULLA PERFORMANCE

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

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

a) Per i Comparti con commissioni sulla performance assoluta:

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

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

b) Per i Comparti con commissioni sulla performance relative:

Per i Comparti:

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

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

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

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

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

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

Per i Comparti:

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

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

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

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

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

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

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

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

differenza tra il GAV e l'HWM , per il benchmark verrà calcolata la differenza tra il prezzo di chiusura del giorno precedente a quello in cui l'HWM è stato superato (ad esempio: se l'HWM viene superato il 20 Aprile, il rendimento del benchmark da considerare è quello tra il 20 ed il 19 Aprile);

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

Commissioni sulla performance relative	Benchmark	Percentuale
NEW MILLENNIUM - Euro Equities	95% Bloomberg Eurozone 50 Net Return Index 5% BCE euro short-term Rate Index	20%
NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)	95% Bloomberg World DM ex EMU Net Ret Eur Hedged Index 5% BCE euro short-term Rate Index	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 Euro Corporate Bonds 1-5 Years Total Return Index EUR 5% BCE euro short-term Rate Index	20%
NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative	20% Bloomberg World Large & Mid Cap Net Return Index EUR 50% Bloomberg Euro Aggregate Government 3-5 Years Total Return Index EUR 30% Bloomberg Global Aggregate Corporate 1-3 Years Total Return Index Value Hedged EUR	20%
NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible	Euribor 6M + 300 bps	10%
NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe	80% Bloomberg Barclays Euro Government Inflation-Linked Bond 3-5 Years Total Return Index 20% Bloomberg Barclays FRN Total Return Index EUR	15%
NEW MILLENNIUM - Alpha Active Allocation*	70% Bloomberg Global-Aggregate Total Return Index Value Hedged EUR 30% Bloomberg World Large & Mid Cap Net Return EUR Hedged Index	10%
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% BCE euro short-term Rate Index	20%
NEW MILLENNIUM – Multi Asset Opportunity	15% Bloomberg Europe Developed Markets Large & Mid Cap Net Return Index EUR 10% Bloomberg World Large & Mid Cap Net Return Index EUR 40% Bloomberg Euro Aggregate Government 3-5 Years Total Return Index EUR 25% Bloomberg Global Aggregate Corporate Total Return Index Value Hedged EUR 10% BCE euro short-term Rate Index	20%

Commissioni sulla performance relative	Benchmark	Percentuale
NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia	15% Bloomberg Italy Large & Mid Cap Net Return Index 25% Bloomberg Italy Small Cap Net Return Index 45% Bloomberg Euro Aggregate Corporate Italy Index Unhedged EUR 15% Bloomberg Euro Treasury/Corp Short Term Index EUR	20%

* NEW MILLENNIUM - Alpha Active Allocation dal 1° gennaio 2024 ha cambiato il benchmark da EURIBOR 6 mesi Index + 300 bps a Bloomberg Global Aggregate Total Return Index Value Hedged EUR e Bloomberg World Large & Mid Cap Net Return EUR Hedged Index.

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

Comparti	Classe	Valuta	Importo della commissione di performance	Percentuale del valore del Patrimonio Netto della Classe a fine anno
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	A	EUR	206,588.04	0.26%
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	A (H-USD)	USD	30,905.68	0.40%
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	D	EUR	36,181.81	0.28%
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	I	EUR	752,898.93	0.34%
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	L	EUR	302.70	0.33%
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond	A	EUR	83.34	0.00%
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond	D	EUR	26.44	0.00%
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond	I	EUR	681.92	0.00%
NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe	I	EUR	8,928.99	0.05%
NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe	L	EUR	201.25	0.04%
NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe	Y	EUR	1,043.62	0.04%
NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond	A	EUR	9,182.79	0.07%
NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond	D	EUR	287.92	0.03%
NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond	I	EUR	130,932.05	0.27%
NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond	L	EUR	355.31	0.23%

8. COMMISSIONE DELLA BANCA DEPOSITARIA E DELL'AMMINISTRAZIONE CENTRALE

Per i servizi resi alla SICAV, come Banca Depositaria, State Street Bank International GmbH, Filiale di Lussemburgo riceverà per ciascun Comparto una commissione annuale pari allo 0.04% del valore del patrimonio netto, con un minimo di 3,000.00 Euro per anno 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 anno 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.

9. COMPENSI PROFESSIONALI

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

10. LE AZIONI DEL FONDO

Le Classi di Azioni in circolazione al 30 Giugno 2024 sono le seguenti:

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

11. 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 2024 è disponibile presso la sede sociale della Sicav.

12. COSTI DI TRANSAZIONE

Per il periodo che termina il 30 Giugno 2024, 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 2024, 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	96,814.00
NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)	29,788.66
NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term	1,164.62
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond	0.00
NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate	7,674.23
NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative	52,451.17
NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible	0.00
NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe	5,448.08
NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond	0.00

Comparti	Costi di transazione
NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing	0.00
NEW MILLENNIUM - Alpha Active Allocation	18,796.34
NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond	0.00
NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond	0.00
NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity	10,319.55
NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia	36,966.33

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

13. 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 su valute, contratti futures, contratti su opzioni e contratti swap. Informazioni dettagliate relative alle posizioni aperte al 30 Giugno 2024 sono riportate in seguito ai Portafogli dei comparti interessati.

Le controparti per le posizioni aperte su contratti finanziari su cambi a termine sono Morgan Stanley Bank AG, Nomura International Plc. e States Street Bank International GmbH, per le posizioni aperte su futures e Intesa Sanpaolo S.p.A., per le posizioni aperte su opzioni la controparte sono Intesa Sanpaolo S.p.A., J.P. Morgan Chase, J.P. Morgan SE e Morgan Stanley & Co. International Plc. è per le posizioni aperte su credit default swap la controparte e J.P. Morgan SE.

Al 30 Giugno 2024 il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 2,616,963.84 da Nomura International Plc. come garanzia per i contratti finanziari a termine.

Al 30 Giugno 2024 il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 517,815.00 da Morgan Stanley AG come garanzia per i contratti finanziari a termine.

Al 30 Giugno 2024 il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 625,888.72 da J.P. Morgan SE come garanzia per i contratti swap.

Al 30 Giugno 2024 il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 628,742.37 da Nomura International Plc. come garanzia per i contratti finanziari a termine.

Al 30 Giugno 2024 il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 415,526.00 da Morgan Stanley AG come garanzia per i contratti finanziari a termine.

Al 30 Giugno 2024 il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 468,524.85 da Nomura International Plc. come garanzia per i contratti finanziari a termine.

Al 30 Giugno 2024 il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 1,731,803.00 da Morgan Stanley AG come garanzia per i contratti finanziari a termine.

Al 30 Giugno 2024 il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 432,500,91 J.P. Morgan SE come garanzia per i contratti swap.

Al 30 Giugno 2024 il comparto NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 153,796.59 da Nomura International Plc. come garanzia per i contratti finanziari a termine.

Al 30 Giugno 2024 il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 272,471.96 da Nomura International Plc. come garanzia per i contratti finanziari a termine.

Al 30 Giugno 2024 il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 52,376.00 da Morgan Stanley AG come garanzia per i contratti finanziari a termine.

Al 30 Giugno 2024 il comparto NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 1,228.00 da Nomura International Plc. come garanzia per i contratti finanziari a termine.

14. EVENTI ACCADUTI DURANTE IL PERIODO

Distribuzione Dividendi

Un dividendo per le Azioni D per il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond, NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond, NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative, NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond, NEW MILLENNIUM - Alpha Active Allocation e NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond, per le Azioni Y per il comparto NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe, per le Azioni D e Y per i comparti NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term, NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate e NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing e' stato pagato come da tabella seguente, con la data dello stacco cedola al 2 Gennaio 2024 e data valuta 5 Gennaio 2024:

Comparti	Nome della classe	Dividendo per azione	Valuta	Somma da pagare
NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate	D	4.23	EUR	9,309.21
	Y	5.40	EUR	114.37
NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term	D	3.43	EUR	161,854.00
	Y	5.07	EUR	107.09
NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond	D	3.00	EUR	18,196.96
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	D	3.40	EUR	344,394.63
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond	D	2.19	EUR	346,513.89
NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing	D	2.10	EUR	6,196.78
	Y	2.47	EUR	74.37
NEW MILLENNIUM - Alpha Active Allocation	D	2.91	EUR	692.34
NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond	D	3.02	EUR	5,298.32
NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative	D	7.15	EUR	41,171.84
NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe	Y	4.60	EUR	101,181.72

Crisi Russia-Ucraina:

Continuano le tensioni tra Russia e Ucraina. Gran parte della comunità internazionale ha risposto con imposizioni economiche contro le persone russe (individui ed entità) che sono state inasprite nel corso dei mesi. I mercati finanziari hanno vissuto e potrebbero continuare a vivere esperienze significative di volatilità. I titoli emessi da entità russe e/o denominati in rubli hanno subito forti ribassi di valore come così come le restrizioni commerciali. Alcuni dei comparti gestiti detengono tali titoli: quando l'emittente e il titolo è soggetto a sanzione, è stata applicata una cancellazione totale, negli altri casi il titolo è stato valorizzato al fair value secondo la decisione del Consiglio di Amministrazione. Al 30 giugno 2024, solo una obbligazione di un emittente russo è detenuta ed è attualmente soggetta a sanzione e quindi non negoziabile (XS2249778247 GTLK EUROPE CAPITAL DAC per il comparto Augustum Corporate Bond). La Società ha posto in essere tramite l'attività di NATAM e dei suoi delegati, la misura adeguata per garantire il monitoraggio del rischio, sanzioni e antiriciclaggio.

A partire dal 1° gennaio 2024 il Comparto NEW MILLENNIUM SICAV - Volactive ha cambiato nome in NEWMILLENNIUM SICAV - Alpha Active Allocation e modificato la politica di investimento, Commissioni di gestione, commissioni di benchmark e di performance.

A partire dal 1° gennaio 2024 la commissione fissa a carico di ciascun Comparto alla Società di Gestione è aumentata da "fino a 11.000 Euro all'anno" a "fino a 12.000 Euro all'anno".

15. EVENTI SUCCESSIVI

Non si segnalano eventi successivi alla chiusura del periodo.

APPENDICE NON CERTIFICATA

1. ESPOSIZIONE GLOBALE E LIVELLO DI LEVA ATTESO

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

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

A partire dal 1° gennaio 2024 il metodo VaR è applicato per il Comparto NEW MILLENNIUM -Euro Equities and NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged).

Periodo: 01.01-30.06.2024	Limite VaR	VaR			Riferimento
		% Utilizzo Limite VaR			
		Minimo	Medio	Massimo	
Fondo					
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	20.00%	17.65	22.27	29.70	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term	20.00%	4.79	6.10	7.73	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond	20.00%	12.28	16.45	20.99	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate	20.00%	7.96	10.20	14.60	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative	20.00%	12.93	14.98	17.14	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible	20.00%	13.86	19.03	27.64	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe	20.00%	10.22	13.19	17.87	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond	20.00%	15.22	20.09	28.16	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing	20.00%	13.71	15.57	18.26	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Alpha Active Allocation	20.00%	13.05	21.86	27.62	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond	20.00%	22.62	25.04	29.68	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond	20.00%	23.85	30.14	41.68	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity	20.00%	16.20	19.67	22.78	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia	20.00%	19.60	26.13	34.46	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	66.50	101.32	170.10	3.84	17.29	33.60
NEW MILLENNIUM - Euro Equities	-	-	-	0.00	0.00	0.00
NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)	-	-	-	5.40	6.39	7.68
NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond	75.75	105.17	194.27	43.82	50.19	62.23
NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible	21.81	36.62	51.21	0.12	8.69	23.45
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	0.38	17.18	32.02	0.21	1.41	2.07
NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
NEW MILLENNIUM - Alpha Active Allocation	48.31	78.67	89.08	0.03	32.53	40.98
NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond	32.47	78.81	226.54	0.00	2.15	11.96
NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond	5.22	32.81	153.60	0.00	4.84	8.88
NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity	2.09	8.62	11.91	1.98	8.34	11.41
NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia	0.53	1.20	2.17	0.53	1.17	2.17

2. REGOLAMENTO DELLE TRANSAZIONI DI TITOLI FINANZIARI

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

Al 30 Giugno 2024, la SICAV non è impattata dal regolamento sulle operazioni di finanziamento tramite titoli (SFTR).

4. PROMOZIONE DELLE CARATTERISTICHE AMBIENTALI O SOCIALI

Ai sensi dell'articolo 2 del Regolamento (UE) 2019/2088 del Parlamento Europeo e del Consiglio del 27 novembre 2019 sull'informativa relativa alla sostenibilità nel settore dei servizi finanziari (SFDR), il rischio di sostenibilità è definito come un evento o una condizione di tipo ambientale, sociale o di governance che, qualora si verificasse, potrebbe provocare un significativo impatto negativo effettivo o potenziale sul valore dell'investimento.

L'impatto di fattori ambientali, sociali e di governance sul valore di un investimento può variare non solo a seconda della sua attività (ad esempio tipo di attività, settore, dimensione, area geografica e fase del ciclo di vita, e passività) ma anche della governance e della strategia adottata dalla società per la gestione di questi fattori. Ai sensi dell'articolo 3 del Regolamento Informativo, i rischi di sostenibilità sono integrati nel processo di investimento del Fondo. Le valutazioni del rischio e le decisioni di investimento si basano su ricerche interne ed esterne e su valutazioni di fattori di sostenibilità e rischi di sostenibilità.

Al momento il Fondo non considera i "principali impatti negativi" delle decisioni di investimento sui fattori di sostenibilità.

I comparti classificati ai sensi dell'art. 8 SFDR

I seguenti Comparti promuovono caratteristiche ambientali o sociali, ai sensi dell'Articolo 8 SFDR: NEW MILLENNIUM - Euro Equities, NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged), NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term, NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate, NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative, NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe e NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia. L'allegato di cui all'articolo 11 SFDR è pubblicato nell'allegato IV nell'appendice non certificata.

I comparti classificati ai sensi dell'art. 6 SFDR

I restanti Comparti non rientrano nell'articolo 8 SFDR (promozione di obiettivi di sostenibilità) o nell'articolo 9 SFDR (investimenti sostenibili): non tengono conto dei criteri di sostenibilità come parte del proprio processo di investimento, non promuovono caratteristiche ESG e non hanno come obiettivo l'investimento sostenibile. Gli investimenti alla base di questo prodotto finanziario non tengono conto dei criteri comunitari per attività economiche ambientali e sostenibili.

APPENDICE NON AUDITATA PER INVESTITORI SVIZZERI

1. Performance e TER

Fondo	Classe	Performance da inizio anno	Performance del benchmark da inizio anno	TER	Commissione di performance (%)
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	A	3.01%	0.83%	2.05%	0.26%
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	A (H-CHF)	1.87%	0.83%	2.49%	0.00%
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	A (H-USD)	3.51%	0.83%	2.37%	0.40%
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	D	2.90%	0.83%	2.08%	0.28%
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	I	3.38%	0.83%	1.34%	0.34%
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	L	3.29%	0.83%	1.51%	0.33%
NEW MILLENNIUM - Euro Equities	A	7.48%	10.01%	1.97%	0.00%
NEW MILLENNIUM - Euro Equities	I	7.93%	10.01%	1.13%	0.00%
NEW MILLENNIUM - Euro Equities	L	7.83%	10.01%	1.32%	0.00%
NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)	A	12.05%	12.82%	2.01%	0.00%
NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)	I	12.52%	12.82%	1.16%	0.00%
NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)	L	12.41%	12.82%	1.35%	0.00%
NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term	A	0.26%	0.57%	1.43%	0.00%
NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term	D	0.24%	0.57%	1.45%	0.00%
NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term	I	0.39%	0.57%	1.15%	0.00%
NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term	L	0.30%	0.57%	1.33%	0.00%

Fondo	Classe	Performance da inizio anno	Performance del benchmark da inizio anno	TER	Commissione di performance (%)
NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term	Y	0.49%	0.57%	0.97%	0.00%
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond	A	-0.41%	0.19%	1.46%	0.00%
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond	A (H-USD)	-0.19%	0.19%	2.43%	0.00%
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond	D	-0.41%	0.19%	1.46%	0.00%
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond	I	-0.14%	0.19%	0.92%	0.00%
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond	L	-0.24%	0.19%	1.11%	0.00%
NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate	A	0.48%	1.16%	1.18%	0.00%
NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate	D	0.45%	1.16%	1.18%	0.00%
NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate	I	0.72%	1.16%	0.70%	0.00%
NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate	L	0.63%	1.16%	0.88%	0.00%
NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate	Y	0.74%	1.16%	0.63%	0.00%
NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative	A	2.28%	2.76%	1.72%	0.00%
NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative	D	2.17%	2.76%	1.71%	0.00%
NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative	I	2.58%	2.76%	1.14%	0.00%
NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative	L	2.49%	2.76%	1.32%	0.00%
NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible	A	2.92%	3.41%	1.78%	0.00%
NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible	I	3.13%	3.41%	1.26%	0.00%
NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible	L	3.04%	3.41%	1.54%	0.00%
NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe	A	-0.07%	-0.19%	1.21%	0.00%
NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe	I	0.08%	-0.19%	0.83%	0.05%
NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe	L	0.04%	-0.19%	1.00%	0.04%
NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe	Y	0.06%	-0.19%	0.82%	0.04%
NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond	A	2.96%	-0.08%	1.85%	0.07%
NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond	D	2.91%	-0.08%	1.82%	0.03%
NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond	I	3.16%	-0.08%	1.26%	0.27%
NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond	L	3.11%	-0.08%	1.41%	0.23%
NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing	A	1.71%	3.08%	5.22%	0.00%
NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing	D	1.65%	3.08%	5.22%	0.00%
NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing	I	2.21%	3.08%	3.71%	0.00%
NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing	L	2.40%	3.08%	3.86%	0.00%
NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing	Y	2.24%	3.08%	4.11%	0.00%
NEW MILLENNIUM - Alpha Active Allocation	A	2.77%	3.19%	2.24%	0.00%
NEW MILLENNIUM - Alpha Active Allocation	D	2.61%	3.19%	2.28%	0.00%
NEW MILLENNIUM - Alpha Active Allocation	I	3.14%	3.19%	1.48%	0.00%
NEW MILLENNIUM - Alpha Active Allocation	L	3.09%	3.19%	1.59%	0.00%
NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond	A	1.01%	0.49%	2.08%	0.00%
NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond	D	1.02%	0.49%	2.09%	0.00%
NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond	I	1.43%	0.49%	1.23%	0.00%
NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond	L	1.33%	0.49%	1.42%	0.00%
NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond	I	4.73%	2.40%	1.74%	0.00%
NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity	A	2.31%	2.47%	2.13%	0.00%
NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity	I	2.56%	2.47%	1.63%	0.00%
NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity	L	2.47%	2.47%	1.83%	0.00%
NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia	A	5.28%	6.58%	2.31%	0.00%
NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia	I	5.63%	6.58%	1.70%	0.00%
NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia	L	5.53%	6.58%	1.90%	0.00%