

## AVVISO AGLI AZIONISTI di NEW MILLENNIUM SICAV (il "Fondo")

Lussemburgo, 25 novembre 2022

Egregio Azionista,

il Consiglio di Amministrazione ("il Consiglio") di NEW MILLENNIUM SICAV ("il Fondo") desidera informarLa, nella Sua qualità di investitore del Fondo, di una serie di modifiche riguardanti alcuni Comparti nonché il Prospetto della Sicav stessa.

\* \* \*

### 1. Modifica della composizione del Consiglio di Amministrazione

È stata modificata la composizione del Consiglio di Amministrazione del Fondo, così come approvata dall'Assemblea Generale degli Azionisti tenutasi in data 29 aprile 2022

### 2. Aggiornamento normativo

È stato inserito il riferimento alla Legge di Bilancio 2022, relativamente ai Piani individuali di risparmio (PIR) nei due comparti *New Millennium Pir Bilanciato Sistema Italia* e *New Millennium Augustum Italian Diversified Bond*

### 3. Investimenti in Special Purpose Acquisition Companies ("SPAC")

È stata inserita l'informativa relativa al possibile investimento in SPAC, conformemente alle *FAQ on Law of 17 December 2010 version 1.4 December 2021*, sia nella parte generale del Prospetto che nella politica di investimento dei seguenti comparti (nel limite massimo del 5% del patrimonio netto):

- Euro Equities
- Global Equities (Eur Hedged)
- Balanced World Conservative
- Total Return Flexible
- Augustum Market Timing
- VolActive
- Multi Asset Opportunity
- PIR Bilanciato Sistema Italia

## 4. Criteri di sostenibilità nelle decisioni di investimento

La sezione *Criteri di sostenibilità nelle decisioni di investimento* è stata riformulata al fine di chiarire meglio la posizione in termini di Tassonomia UE (Regolamento UE 2020/852).

In particolare il seguente paragrafo è stato così modificato:

Comparto	Formulazione precedente	Formulazione rivista
<ul style="list-style-type: none"> <li>• Euro Equities</li> <li>• Global Equities (Eur Hedged)</li> <li>• Large Europe Corporate</li> <li>• Balanced World Conservative</li> <li>• Euro Bonds Short Term</li> <li>• Inflation Linked Bond Europe</li> <li>• PIR Bilanciato Sistema Italia</li> </ul>	<p><i>La strategia promuove caratteristiche ambientali o sociali, ma non ha come obiettivo specifico un investimento sostenibile e non ha una percentuale minima di investimenti allineati alla tassonomia e/o sostenibili.</i></p>	<p><i>La strategia promuove caratteristiche ambientali o sociali. Per quanto riguarda il Regolamento Tassonomia, gli investimenti sottostanti il Comparto non tengono conto dei criteri dell'UE per le attività economiche ecosostenibili.</i></p>

## 5. Benchmark

A seguito della negoziazione di nuovi accordi per la sostituzione dell'amministratore di indici *MSCI* con *Bloomberg Index Services Limited*, ed a seguito di una rivalutazione generale della coerenza dei benchmark con le differenti strategie, le componenti del benchmark di alcuni Comparti vengono modificate come di seguito riportato:

Comparto	Fino al 31 dicembre 2022	A partire dal 1 gennaio 2023
<b>Large Europe Corporate</b>	95% B-Barclays Euro Corp TR 1-5 Y (LEC4TREU) + 5% B-Barclays 3 M euribor/swap TR (LS01TREU)	95% B-Barclays Euro Corp TR 1-5 Y (LEC4TREU) + 5% €STR: BCE euro short-term rate index (ESTCINDX Index)
<b>Augustum High Quality Bond</b>	30% Bloomberg Barclays 3 mesi Euribor Swap Index TR Eur (LS01TREU) + 40% Bloomberg Barclays Euro Aggregate Gov.1-3 Years TR Index Value Unhedged Euro (LEG1TREU) ; + 30% Bloomberg Barclays Euro Agg Goc TR Index Value Unhedged EUR (LEEGTREU)	30% €STR: BCE euro short-term rate index (ESTCINDX Index) + 40% Bloomberg Barclays Euro Aggregate Gov.1-3 Years TR Index Value Unhedged Euro (LEG1TREU) + 30% Bloomberg Barclays Euro Agg Goc TR Index Value Unhedged EUR (LEEGTREU)
<b>Augustum Corporate Bond</b>	80% Bloomberg Barclays EuroAgg Corporate Total Return Index Value Unhedged EUR (LECP TREU) +	80% Bloomberg Barclays Euro-Agg Corp TR Index Eur (LECP TREU) +

# NEW MILLENNIUM

SOCIÉTÉ D'INVESTISSEMENT À CAPITAL VARIABLE

	20% Bloomberg Barclays 3 mesi Euribor Swap Index TR Eur (LS01TREU)	20% €STR: BCE euro short-term rate index (ESTCINDX Index)
<b>Evergreen Global High Yield Bond</b>	40% Bloomberg Barclays Global High Yield TR Index Value Hedged Eur (LG30TREH) + 30% Bloomberg Barclays Euro High Yield TR Index Eur (LP01TREU) + 20% Bloomberg Barclays Euro-Agg Corp TR Index Eur (LECP TREU) + 10% Bloomberg Barclays 3 mesi Euribor Swap Index TR Eur (LS01TREU)	40% Bloomberg Barclays Global High Yield TR Index Value Hedged Eur (LG30TREH) + 30% Bloomberg Barclays Pan-European High Yield (Euro) TR Index Value Unhedged EUR (LP02TREU) + 20% Bloomberg Barclays Euro-Agg Corp TR Index Eur (LECP TREU) + 10% €STR: BCE euro short-term rate index (ESTCINDX Index)
<b>Euro Equities</b>	95% MSCI EMU TOP 50 TR Index (M7CXBFB) +  5% Bloomberg Barclays 3M Euribor TR	95% Bloomberg Eurozone 50 Net Return Index (EUODN50) +  5% €STR: BCE euro short-term rate index (ESTCINDX Index)
<b>Global Equities</b>	95% MSCI world ex EMU Tot. Ret. Euro Hedged (M0WOMHEU) + 5% Bloomberg Barclays 3M Euribor TR (LS01TREU)	95% Bloomberg World DM ex EMU Net Ret Eur Hedged Index (DMXEZNHE) + 5% €STR: BCE euro short-term rate index (ESTCINDX Index)
<b>Balanced World Conservative</b>	20% MSCI AC World Net Tot Ret Eur (NDEEWNR) + 50% B-Barclays Emu Govt Bond 3-5 y TR (LEG3TREU) + 30% B-Barclays global corp 1-3 y TR hedged EUR (BAC1TREH)	20% Bloomberg World Large & Mid Cap Net Return Index EUR (WRLDNE) + 50% Bloomberg Barclays Eur-Agg Govt 3-5 Years TR Index Eur (LEG3TREU) + 30% Bloomberg Barclays Global Agg Corp 1-3Y TR Index Value Hedged Eur (BAC1TREH)
<b>Multi Asset Opportunity</b>	15% MSCI Europe Net TR eur (MSDEE15N) + 10% MSCI AC World Net TR eur (NDEEWNR) (non "euro hedged") + 40% B-Barclays Euro Govt 3-5 Year TR eur (LEG3TREU) + 25% B-Barclays Global Corp TR eur hedged (LGCPTREH) + 10% B- Barclays 3M Euribor TR eur (LS01TREU) +	15% Bloomberg Europe Developed Markets Large & Mid Cap Net Return Index EUR (EDMNE) + 10% Bloomberg World Large & Mid Cap Net Return Index EUR (WRLDNE) + 40% Bloomberg Barclays Eur-Agg Govt 3-5 Years TR Index Eur (LEG3TREU) + 25% Bloomberg Barclays Global Agg Corp TR Index Value Hedged Eur (LGCPTREH) + 10% €STR: BCE euro short-term rate index (ESTCINDX Index)
<b>Augustum Market Timing</b>	30% Bloomberg Euro Treasury (LS01TREU) +  45% Bloomberg Barclays Euro-Agg Govt 3-5 Years TR Index Eur (LEG3TREU) +  15% MSCI World Local Index (MSDLWI) +  10% MSCI EMU TOP 50 TR (M7CXBFB)	30% €STR: BCE euro short-term rate index (ESTCINDX Index) +  45% Bloomberg Barclays Euro-Agg Govt 3-5 Years TR Index Eur (LEG3TREU) +  15% Bloomberg World Large & Mid Cap Net Return EUR Hedged Index (WORLDNHE) + 10% Bloomberg Eurozone 50 Net Return Index (EUODN50)
<b>PIR Bilanciato Sistema Italia</b>	40% MSCI Italy Net return (M7IT Index) + 30% Bloomberg Barclays bond Italian Aggregate Issuers TR (LEI2TREU Index) + 30% Bloomberg Barclays bond Global Aggregate 1-3 YR TR Hedged Eur (LG13TREH Index)	15% Bloomberg Italy Large & Mid Cap Net Return Index (ITNL) + 25% Bloomberg Italy Small Cap Net Return Index (ITSCNL) + 45% Bloomberg Euro Aggregate Corporate Italy Index Unhedged EUR (I02087EU) + 15% Bloomberg Euro Treasury/Corp Short Term Index EUR (I34936EU)

Non è prevista alcuna modifica relativa al modello di commissione di performance.

## 6. Calcolo dell'esposizione globale

I comparti azionari sono gestiti con una strategia “buy and hold” e, anche nei casi in cui sono gestiti più attivamente, restano comunque con un basso turnover. L'uso di derivati è molto limitato. La metodologia per il calcolo dell'esposizione globale al rischio è stata pertanto modificata passando dall'approccio “Var assoluto” al “Metodo degli impegni” (come definito dalle linee guida ESMA 10/788) per i seguenti Comparti:

- Euro Equities
- Global Equities (Eur Hedged)

## Data di entrata in vigore:

Le modifiche contemplate nel presente avviso ai punti **1, 2 e 4**, essendo semplici informazioni o chiarimenti che non rappresentano condizioni meno favorevoli per gli investitori, si considerano già in vigore.

Le modifiche di cui ai punti **3 - 5 e 6** dovranno essere considerate efficaci a partire dal **1° gennaio 2023**.

Gli Azionisti in disaccordo con le modifiche relative ai punti 3 -5 e 6 hanno diritto – previa richiesta scritta da indirizzare al Fondo – di chiedere il rimborso delle loro azioni, senza spese, entro la scadenza del termine di 30 giorni a decorrere dalla data di questo avviso.

\*.\*.\*

Le modifiche di cui sopra si rifletteranno nella versione aggiornata del Prospetto Informativo datata novembre 2022, una copia della quale è disponibile su richiesta presso la sede legale della Società.

**Il Consiglio di Amministrazione**

-