

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

| | | | |
|---|----|--|-----|
| Organizzazione del Fondo | 3 | NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe | 65 |
| Prospetto Comparativo dei Patrimoni Netti degli ultimi 3 anni/periodi | 5 | Prospetto del Patrimonio Netto | 65 |
| Prospetto del Patrimonio Netto consolidato | 7 | Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto | 66 |
| Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto consolidato | 8 | Portafoglio Titoli | 67 |
| NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond | 9 | NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond | 69 |
| Prospetto del Patrimonio Netto | 9 | Prospetto del Patrimonio Netto | 69 |
| Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto | 10 | Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto | 70 |
| Portafoglio Titoli | 11 | Portafoglio Titoli | 71 |
| Impegni su acquisto/vendita di contratti futures | 19 | Contratti finanziari a termine | 74 |
| Contratti di opzioni | 20 | NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing | 75 |
| Contratti finanziari a termine | 21 | Prospetto del Patrimonio Netto | 75 |
| Contratti Swap | 22 | Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto | 76 |
| NEW MILLENNIUM - Euro Equities | 23 | Portafoglio Titoli | 77 |
| Prospetto del Patrimonio Netto | 23 | NEW MILLENNIUM - Alpha Active Allocation | 78 |
| Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto | 24 | Prospetto del Patrimonio Netto | 78 |
| Portafoglio Titoli | 25 | Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto | 79 |
| NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged) | 28 | Portafoglio Titoli | 80 |
| Prospetto del Patrimonio Netto | 28 | Impegni su acquisto/vendita di contratti futures | 84 |
| Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto | 29 | NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond | 85 |
| Portafoglio Titoli | 30 | Quality Bond | |
| Impegni su acquisto/vendita di contratti futures | 33 | Prospetto del Patrimonio Netto | 85 |
| NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term | 34 | Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto | 86 |
| Prospetto del Patrimonio Netto | 34 | Portafoglio Titoli | 87 |
| Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto | 35 | Contratti di opzioni | 89 |
| Portafoglio Titoli | 36 | Contratti finanziari a termine | 90 |
| NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond | 38 | NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond | 91 |
| Prospetto del Patrimonio Netto | 38 | Prospetto del Patrimonio Netto | 91 |
| Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto | 39 | Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto | 92 |
| Portafoglio Titoli | 40 | Portafoglio Titoli | 93 |
| Impegni su acquisto/vendita di contratti futures | 43 | Impegni su acquisto/vendita di contratti futures | 96 |
| Contratti finanziari a termine | 44 | Contratti finanziari a termine | 97 |
| Contratti Swap | 45 | NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity | 98 |
| NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate | 46 | Prospetto del Patrimonio Netto | 98 |
| Prospetto del Patrimonio Netto | 46 | Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto | 99 |
| Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto | 47 | Portafoglio Titoli | 100 |
| Portafoglio Titoli | 48 | Impegni su acquisto/vendita di contratti futures | 104 |
| NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative | 51 | NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia | 105 |
| Prospetto del Patrimonio Netto | 51 | Prospetto del Patrimonio Netto | 105 |
| Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto | 52 | Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto | 106 |
| Portafoglio Titoli | 53 | Portafoglio Titoli | 107 |
| NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible | 57 | Note ai Rendiconti Finanziari | 110 |
| Prospetto del Patrimonio Netto | 57 | Appendice non certificata | 123 |
| Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto | 58 | | |
| Portafoglio Titoli | 59 | | |
| Impegni su acquisto/vendita di contratti futures | 63 | | |
| Contratti di opzioni | 64 | | |

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 |

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 SYNnex 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 | FINECOBANK 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 |

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 |

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 |

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 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 |
|--------------------------------------|--|--------|----------------------|----------------------|----------------|
| 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 |

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

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

NOTE AI RENDICONTI FINANZIARI

1. INFORMAZIONI DI CARATTERE GENERALE

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

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

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

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

I comparti operativi al 30 Giugno 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% |

| Commissioni sulla performance relative | Benchmark | Percentuale |
|--|---|--------------------|
| 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% |
| 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% |

| Comparti | Classe | Valuta | Importo della commissione di performance | Percentuale del valore del Patrimonio Netto della Classe a fine anno |
|--|--------|--------|--|--|
| 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 |
| 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. è 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 è Morgan Stanley & Co. International Plc. è per le posizioni aperte su credit default swap la controparte è 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 | 1,618,54 |
| | 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 |

| Comparti | Nome della classe | Dividendo per azione | Valuta | Somma da pagare |
|--|-------------------|----------------------|--------|-----------------|
| 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 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.