

NEW MILLENNIUM

SOCIÉTÉ D'INVESTISSEMENT À CAPITAL VARIABLE

RENDICONTO DI GESTIONE SEMESTRALE NON CERTIFICATO AL 30 GIUGNO 2023

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	4	NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible	59
Prospetto Comparativo dei Patrimoni Netti degli ultimi 3 anni/periodi	6	Prospetto del Patrimonio Netto	59
Prospetto del Patrimonio Netto consolidato	8	Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	60
Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto consolidato	9	Portafoglio Titoli	61
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	10	Impegni su acquisto/vendita di contratti futures	66
Prospetto del Patrimonio Netto	10	Contratti di opzioni	67
Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	11	Contratti finanziari a termine	68
Portafoglio Titoli	12	NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe	69
Impegni su acquisto/vendita di contratti futures	19	Prospetto del Patrimonio Netto	69
Contratti di opzioni	20	Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	70
Contratti finanziari a termine	21	Portafoglio Titoli	71
Contratti Swap	22	NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond	73
NEW MILLENNIUM - Euro Equities	23	Prospetto del Patrimonio Netto	73
Prospetto del Patrimonio Netto	23	Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	74
Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	24	Portafoglio Titoli	75
Portafoglio Titoli	25	Contratti finanziari a termine	78
Impegni su acquisto/vendita di contratti futures	28	NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing	79
NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)	29	Prospetto del Patrimonio Netto	79
Prospetto del Patrimonio Netto	29	Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	80
Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	30	Portafoglio Titoli	81
Portafoglio Titoli	31	NEW MILLENNIUM - VolActive	82
Impegni su acquisto/vendita di contratti futures	35	Prospetto del Patrimonio Netto	82
NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term	36	Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	83
Prospetto del Patrimonio Netto	36	Portafoglio Titoli	84
Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	37	Impegni su acquisto/vendita di contratti futures	88
Portafoglio Titoli	38	NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond	89
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond	40	Prospetto del Patrimonio Netto	89
Prospetto del Patrimonio Netto	40	Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	90
Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	41	Portafoglio Titoli	91
Portafoglio Titoli	42	Impegni su acquisto/vendita di contratti futures	93
Impegni su acquisto/vendita di contratti futures	46	Contratti di opzioni	94
Contratti finanziari a termine	47	Contratti finanziari a termine	95
NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate	48	NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond	96
Prospetto del Patrimonio Netto	48	Prospetto del Patrimonio Netto	96
Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	49	Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	97
Portafoglio Titoli	50	Portafoglio Titoli	98
NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative	53	Contratti finanziari a termine	101
Prospetto del Patrimonio Netto	53	NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity	102
Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	54	Prospetto del Patrimonio Netto	102
Portafoglio Titoli	55	Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	103
		Portafoglio Titoli	104
		Impegni su acquisto/vendita di contratti futures	108
		NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia	109
		Prospetto del Patrimonio Netto	109
		Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	110
		Portafoglio Titoli	111

INDICE

Note ai Rendiconti Finanziari	114
Appendice non certificata	126

ORGANIZZAZIONE DELLA SOCIETA**CONSIGLIO D'AMMINISTRAZIONE****Presidente****Mr. Sante JANNONI**

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

Amministratori**Mr. Emanuele BONABELLO**

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

Mrs. Paola DE SIMONE

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

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

11 rue Béatrix de Bourbon
L-1225 Luxembourg

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

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

Mr. Gianluca COSTANTINI (Amministratore)

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

Mr. Alex SCHMITT (Amministratore)

Socio
Bonn&Schmitt
148, Avenue de la Faiènerie
L-1511 Luxembourg

Incaricati della Società di Gestione**Mr. Pietro MISSERI**

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

Mr. Sante JANNONI

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

Mr. Alberto ALFIERO

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

SEDE LEGALE

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

DISTRIBUTORE GLOBALE

Banca Finnat Euramerica S.p.A

49, Piazza del Gesù
I - 00186 Roma

BANCA DEPOSITARIA

State Street Bank International GmbH, Filiale di Lussemburgo.

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

AMMINISTRAZIONE CENTRALE E TRANSFER AGENT

State Street Bank International GmbH, Filiale di Lussemburgo.

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

SOGGETTO INCARICATO DEI PAGAMENTI IN ITALIA

ICCREA Banca S.p.A.

41-47, Via Lucrezia Romana
I - 00178 Roma

State Street Bank GmbH - Succursale Italia

10, Via Ferrante Aporti
I - 20125 Milano

Société Générale Securities Services S.p.A.

19, Via Santa Chiara
I - 10122 Torino

Allfunds Bank S.A. (succursale di Milano)

6, Via Bocchetto
I - 20123 Milano

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

3, Piazza Salimbeni
I - 53100 Siena

REVISORE CONTABILE

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative

2, rue Gerhard Mercator
L - 2182 Luxembourg
(fino al 18 Aprile 2023)

KPMG Audit S.à r.l.

39, Avenue J.F. Kennedy
L-1855 Luxembourg
(dal 19 Aprile 2023)

COMPARATIVO DEI VALORI NETTI D'INVENTARIO DEGLI ULTIMI TRE ANNI

	Valuta	30 Giugno 2023		31 Dicembre 2022		31 Dicembre 2021	
		Totale NAV	per Azione	Totale NAV	per Azione	Totale NAV	per Azione
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond							
Azione A	EUR	43,795,545.32	216.21	34,823,368.06	210.58	43,824,847.98	230.58
Azione A (H-CHF)	CHF	1,541,180.31	94.26	1,747,382.88	93.05	3,614,686.20	103.06
Azione A (H-USD)	USD	8,206,775.22	109.33	6,118,823.51	105.36	7,579,023.45	112.90
Azione D	EUR	9,241,694.08	90.48	9,277,034.71	91.32	11,965,330.69	103.63
Azione I	EUR	215,533,945.73	236.80	227,624,217.79	229.73	261,000,262.47	249.58
Azione L	EUR	68,526.48	233.08	111,811.28	226.34	93,359.18	246.33
Azione Y	EUR	0.00	0.00	1,283,165.02	185.77	1,444,644.15	209.15
Azione Z	EUR	0.00	0.00	14,003,405.22	89.19	15,720,164.88	100.12
Totale attivo netto	EUR	277,741,170.28		294,626,132.87		345,242,319.00	
NEW MILLENNIUM - Euro Equities							
Azione A	EUR	4,288,517.77	71.57	5,144,921.20	61.98	7,004,797.81	71.71
Azione I	EUR	23,130,744.55	79.94	21,597,319.57	68.94	27,831,532.13	79.09
Azione L	EUR	148,368.28	78.88	189,349.08	68.09	217,641.61	78.26
Azione Y	EUR	0.00	0.00	875,633.40	61.44	1,091,193.95	76.56
Totale attivo netto	EUR	27,567,630.60		27,807,223.25		36,145,165.50	
NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)							
Azione A	EUR	3,187,780.84	114.87	2,733,429.59	101.43	3,545,186.75	128.54
Azione I	EUR	38,544,122.38	128.79	32,165,568.14	113.26	39,385,485.18	142.35
Azione L	EUR	238,221.80	126.98	209,671.29	111.77	264,003.82	140.73
Totale attivo netto	EUR	41,970,125.02		35,108,669.02		43,194,675.75	
NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term							
Azione A	EUR	360,657.64	128.54	337,371.43	127.31	2,484,198.60	132.64
Azione D	EUR	52,300.60	89.69	37,213.88	89.41	31,689.46	93.63
Azione I	EUR	8,733,199.71	134.17	8,249,646.28	132.69	9,507,911.01	137.86
Azione L	EUR	1,934,641.94	132.05	1,915,180.53	130.72	2,009,760.30	136.06
Azione Y	EUR	2,794.36	132.30	2,779.47	131.59	2,899.56	137.28
Totale attivo netto	EUR	11,083,594.25		10,542,191.59		14,036,458.93	
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond							
Azione A	EUR	45,994,055.57	151.36	41,821,138.73	149.22	35,326,318.29	155.44
Azione A (H-CHF)	CHF	0.00	0.00	0.00	0.00	16,640.85	95.79
Azione A (H-USD)	USD	1,428,108.03	105.03	1,524,448.30	102.76	425,199.56	106.62
Azione D	EUR	13,584,633.29	84.15	14,329,467.53	85.08	14,100,250.29	90.90
Azione I	EUR	47,598,979.12	160.43	57,697,345.66	157.74	94,812,757.99	163.42
Azione L	EUR	35,438.26	158.21	34,874.52	155.69	36,201.21	161.61
Totale attivo netto	EUR	108,641,214.27		115,311,368.44		144,717,368.19	
NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate							
Azione A	EUR	2,022,273.73	126.24	2,428,497.78	123.81	3,284,228.92	138.47
Azione D	EUR	227,731.97	103.48	225,275.10	102.36	319,426.89	115.06
Azione I	EUR	53,876,616.33	135.03	51,069,511.38	132.10	64,189,577.90	147.02
Azione L	EUR	2,189,312.38	133.07	2,143,914.88	130.31	2,388,933.54	145.30
Azione Y	EUR	2,789.88	131.72	5,374,731.18	129.90	6,011,894.76	145.30
Totale attivo netto	EUR	58,318,724.29		61,241,930.32		76,194,062.01	
NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative							
Azione A	EUR	38,670,716.15	139.99	40,923,887.19	135.31	54,820,864.02	155.13
Azione D	EUR	796,496.37	138.32	907,179.30	135.05	1,041,984.74	155.11
Azione I	EUR	7,896,563.28	152.81	13,733,028.42	147.29	16,886,124.27	167.89
Azione L	EUR	13,363,611.35	150.80	14,329,172.82	145.47	16,895,552.78	166.11
Totale attivo netto	EUR	60,727,387.15		69,893,267.73		89,644,525.81	
NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible							
Azione A	EUR	732,324.19	123.38	746,290.39	119.01	3,261,223.12	128.38
Azione I	EUR	4,940,099.32	101.74	4,583,058.66	97.95	3,251,011.71	105.24
Azione L	EUR	11,328,252.86	123.42	10,961,510.04	118.93	11,904,109.35	128.03
Totale attivo netto	EUR	17,000,676.37		16,290,859.18		18,416,344.18	
NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe							
Azione A	EUR	2,167,433.05	105.56	2,329,250.30	104.27	2,280,268.48	109.05
Azione I	EUR	22,217,716.58	112.30	20,563,087.71	110.69	31,790,974.89	115.25
Azione L	EUR	1,216,589.63	110.48	2,171,613.49	108.98	1,255,069.95	113.69
Azione Y	EUR	2,394,024.76	108.84	2,384,531.15	108.41	2,495,359.63	113.45
Totale attivo netto	EUR	27,995,764.02		27,448,482.65		37,821,672.95	

COMPARATIVO DEI VALORI NETTI D'INVENTARIO DEGLI ULTIMI TRE ANNI

	Valuta	30 Giugno 2023		31 Dicembre 2022		31 Dicembre 2021	
		Totale NAV	per Azione	Totale NAV	per Azione	Totale NAV	per Azione
NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond							
Azione A	EUR	4,277,896.02	125.30	2,427,334.64	122.50	2,386,800.20	137.42
Azione D	EUR	515,350.83	93.29	592,984.40	94.02	1,295,719.60	108.74
Azione I	EUR	49,371,709.65	135.49	50,003,627.57	131.94	60,088,275.28	146.85
Azione L	EUR	148,594.23	133.63	155,256.84	130.25	174,576.56	145.24
Totale attivo netto	EUR	54,313,550.73		53,179,203.46		63,945,371.64	
NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing							
Azione A	EUR	2,050,657.98	103.15	2,178,425.07	102.33	2,513,823.21	112.82
Azione D	EUR	239,274.72	81.09	243,447.95	82.50	295,687.24	93.29
Azione I	EUR	709,800.08	113.57	700,628.08	112.10	764,743.58	122.36
Azione L	EUR	1,029.22	114.36	1,014.86	112.76	1,104.87	122.76
Azione Y	EUR	2,852.95	94.76	2,885.75	95.85	3,233.94	107.41
Totale attivo netto	EUR	3,003,614.95		3,126,401.71		3,578,592.84	
NEW MILLENNIUM - VolActive							
Azione A	EUR	411,766.95	86.54	453,811.00	84.71	641,261.02	101.74
Azione D	EUR	772.43	66.84	755.72	65.39	947.22	81.96
Azione I	EUR	31,084,307.22	95.99	5,356,757.88	93.42	5,768,675.32	110.93
Azione L	EUR	8,401.60	94.40	8,183.52	91.95	9,733.65	109.37
Totale attivo netto	EUR	31,505,248.20		5,819,508.12		6,420,617.21	
NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond							
Azione A	EUR	168,988.18	102.00	323,590.94	101.60	47,733.28	107.16
Azione D	EUR	129,219.20	73.65	134,106.24	76.44	147,308.68	83.96
Azione I	EUR	25,716,133.29	108.09	32,633,674.04	107.23	61,686,719.19	112.15
Azione L	EUR	27,725.00	106.63	27,529.75	105.88	28,846.90	110.95
Totale attivo netto	EUR	26,042,065.67		33,118,900.98		61,910,608.05	
NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond							
Azione A	EUR	238,054.12	82.09	232,002.29	80.00	385,597.90	89.84
Azione I	EUR	6,285,873.48	87.38	1,280,848.14	84.78	1,944,726.53	94.37
Totale attivo netto	EUR	6,523,927.60		1,512,850.52		2,330,324.43	
NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity							
Azione A	EUR	23,706,517.37	101.61	23,538,015.85	98.03	26,667,411.35	108.17
Azione I	EUR	4,667,565.17	104.97	4,492,162.75	101.03	4,246,726.37	110.94
Azione L	EUR	58,139,712.57	103.84	61,132,024.48	100.03	73,305,920.19	110.05
Totale attivo netto	EUR	86,513,795.11		89,162,203.08		104,220,057.91	
NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia							
Azione A	EUR	4,893,908.98	95.01	4,859,306.11	90.33	6,078,324.54	109.15
Azione I	EUR	3,624,949.18	98.43	3,498,892.81	93.30	4,046,707.49	112.04
Azione L	EUR	192,316.34	97.38	182,447.43	92.38	219,486.46	111.13
Totale attivo netto	EUR	8,711,174.50		8,540,646.35		10,344,518.49	

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO CONSOLIDATO AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR**Attività**

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	808,790,355.84
Liquidità bancarie a vista		13,823,323.80
Importi dovuti dai broker		18,916,774.67
Premio pagato su contratti swap	(Nota 2f)	425,326.76
Contratti di opzioni al valore di mercato	(Note 2e, 13)	532,192.43
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	(Note 2c, 13)	1,463,712.60
Utili non realizzati su contratti futures	(Note 2d, 13)	622,856.98
Dividendi da ricevere		55,496.96
Interessi da ricevere		8,679,367.52
Da ricevere su vendita titoli		1,891,259.65
Da ricevere su sottoscrizioni		504,619.47
Altre attività		70,745.20
Totale attività		855,776,031.88

Passività

Scoperti bancari		-110,155.03
Contratti di opzioni al valore di mercato	(Note 2e, 13)	-314,669.98
Premio ricevuto su contratti swap	(Nota 2f)	-45,975.00
Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	(Note 2c, 13)	-2,016,323.03
Perdite non realizzate su contratti futures	(Note 2d, 13)	-1,144,826.05
Perdite non realizzate su contratti swap	(Note 2f, 13)	-156,109.04
Interessi da pagare su contratti swap		-6,111.12
Interest payable		-505.30
Da pagare su acquisto titoli		-1,222,171.42
Da pagare su rimborsi		-362,545.16
Altre passività		-2,736,977.74
Totale passività		-8,116,368.87

Totale attivo netto**847,659,663.01**

PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO CONSOLIDATO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Attivo netto all'inizio del periodo		852,729,839.27
Risultato netto degli investimenti		14,844,994.29
Altri ricavi		14,092.79
Totale ricavi		14,859,087.08
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-3,800,865.49
Commissione di consulenza	(Nota 6)	-138,686.54
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 8)	-235,301.16
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-93,530.39
Interessi pagati su contratti swap		-69,469.15
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 8)	-345,934.41
Commissioni del Transfer Agent		-34,757.05
Compensi professionali	(Nota 9)	-120,054.96
Pubblicazioni		-22,229.44
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-252,074.73
Totale costi		-5,112,903.32
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		9,746,183.76
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	-7,659,300.85
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		3,556,635.58
- di contratti di opzioni		-285,886.33
- di contratti futures		650,572.99
- di contratti swap		747,676.21
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		28,142,472.71
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(Nota 2c)	-3,473,865.84
- sulle opzioni		-198,342.16
- su contratti futures	(Nota 2d)	-445,086.93
- su contratti swap		-392,284.47
Risultato netto delle operazioni per il periodo		30,388,774.67
Distribuzioni di dividendi	(Nota 14)	-977,439.18
Sottoscrizioni del periodo		90,905,974.15
Rimborsi del periodo		-125,387,485.90
Attivo netto alla fine del periodo		847,659,663.01

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Attività

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	266,201,654.60
Liquidità bancarie a vista		1,858,885.42
Importi dovuti dai broker		5,474,223.60
Premio pagato su contratti swap	(Nota 2f)	425,326.76
Contratti di opzioni al valore di mercato	(Note 2e, 13)	509,629.15
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	(Note 2c, 13)	975,479.36
Utili non realizzati su contratti futures	(Note 2d, 13)	83,782.05
Dividendi da ricevere		11.61
Interessi da ricevere		4,394,047.83
Da ricevere su vendita titoli		916,590.00
Da ricevere su sottoscrizioni		159,144.48
Altre attività		28,316.15
Totale attività		281,027,091.01

Passività

Scoperti bancari		-110,155.03
Contratti di opzioni al valore di mercato	(Note 2e, 13)	-310,473.60
Premio ricevuto su contratti swap	(Nota 2f)	-45,975.00
Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	(Note 2c, 13)	-1,308,531.42
Perdite non realizzate su contratti futures	(Note 2d, 13)	-419,433.03
Perdite non realizzate su contratti swap	(Note 2f, 13)	-156,109.04
Interessi da pagare su contratti swap		-6,111.12
Da pagare su rimborsi		-158,966.46
Altre passività		-770,166.03
Totale passività		-3,285,920.73

Totale attivo netto**277,741,170.28**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	216.21	202,561.770
Azione A (H-CHF)	CHF	94.26	16,350.311
Azione A (H-USD)	USD	109.33	75,064.257
Azione D	EUR	90.48	102,143.368
Azione I	EUR	236.80	910,211.716
Azione L	EUR	233.08	294.000

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Attivo netto all'inizio del periodo		294,626,132.87
Risultato netto degli investimenti		6,767,826.70
Altri ricavi		7,615.05
Totale ricavi		6,775,441.75
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-1,227,836.38
Commissione di consulenza	(Nota 6)	-17,560.04
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 8)	-79,229.15
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-24,092.21
Interessi pagati su contratti swap		-69,469.15
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 8)	-69,316.99
Commissioni del Transfer Agent		-5,501.25
Compensi professionali	(Nota 9)	-20,057.97
Pubblicazioni		-5,719.67
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-51,699.57
Totale costi		-1,570,482.38
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		5,204,959.37
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	-2,630,164.49
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		2,102,519.58
- di contratti di opzioni		-397,632.19
- di contratti futures		-27,554.09
- di contratti swap		747,676.21
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		6,764,426.12
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(Nota 2c)	-2,114,796.26
- sulle opzioni		-180,094.45
- su contratti futures	(Nota 2d)	-335,650.98
- su contratti swap		-392,284.47
Risultato netto delle operazioni per il periodo		8,741,404.35
Distribuzioni di dividendi	(Nota 14)	-494,016.76
Sottoscrizioni del periodo		30,363,179.04
Rimborsi del periodo		-55,495,529.22
Attivo netto alla fine del periodo		277,741,170.28

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			284,810,617.61	266,201,654.60	95.85
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			253,094,678.72	241,822,425.51	87.07
Obbligazioni ordinarie			84,869,975.42	83,779,526.43	30.17
REGNO UNITO			14,969,567.92	16,209,498.07	5.84
Sovranazionale			6,725,752.94	7,992,459.59	2.88
45,000,000.00	EUROPEAN BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT 5.00% 27/01/2025	BRL	6,725,752.94	7,992,459.59	2.88
Finanza			4,108,597.23	3,741,353.45	1.35
2,000,000.00	PRUDENTIAL PLC 4.88% 31/12/2099	USD	1,708,093.66	1,605,517.38	0.58
1,000,000.00	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC REG 6.63% 18/12/2025	GBP	1,400,503.57	1,139,286.07	0.41
1,000,000.00	MAREX GROUP PLC 8.38% 02/02/2028	EUR	1,000,000.00	996,550.00	0.36
Beni voluttuari			3,206,985.52	3,548,776.23	1.28
3,000,000.00	JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC 4.50% 15/07/2028	EUR	2,257,125.00	2,626,980.00	0.95
1,000,000.00	JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC 7.75% 15/10/2025	USD	949,860.52	921,796.23	0.33
Enti Governativi			928,232.23	926,908.80	0.33
1,000,000.00	OCADO GROUP PLC 3.88% 08/10/2026	GBP	928,232.23	926,908.80	0.33
STATI UNITI			14,377,666.86	13,554,110.83	4.88
Beni voluttuari			3,998,003.07	4,058,466.59	1.46
3,000,000.00	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.87% 03/08/2027	EUR	2,925,500.00	2,949,630.00	1.06
1,000,000.00	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.54% 06/03/2025	GBP	1,072,503.07	1,108,836.59	0.40
Servizi di telecomunicazione			3,861,650.00	3,714,842.00	1.34
3,800,000.00	NETFLIX INC 3.88% 15/11/2029	EUR	3,861,650.00	3,714,842.00	1.34
Salute			2,916,290.17	2,175,343.05	0.78
3,000,000.00	ST JUDE MEDICAL LLC 4.75% 15/04/2043	USD	2,916,290.17	2,175,343.05	0.78
Sovranazionale			1,687,957.18	1,939,849.49	0.70
10,000,000.00	INTERNATIONAL FINANCE CORP. 10.00% 03/02/2027	BRL	1,687,957.18	1,939,849.49	0.70
Informatica			1,913,766.44	1,665,609.70	0.60
1,925,000.00	LEIDOS HOLDINGS INC 5.95% 01/12/2040	USD	1,913,766.44	1,665,609.70	0.60
FRANCIA			8,706,077.28	9,068,028.63	3.26
Servizi di telecomunicazione			3,131,068.28	3,089,264.63	1.11
2,500,000.00	ILIAD HOLDING SASU 5.13% 15/10/2026	EUR	2,411,500.00	2,395,450.00	0.86
800,000.00	ILIAD HOLDING SASU 6.50% 16/10/2026	USD	719,568.28	693,814.63	0.25
Beni voluttuari			2,278,360.00	2,633,036.00	0.95
2,800,000.00	AIR FRANCE-KLM 1.88% 16/01/2025	EUR	2,278,360.00	2,633,036.00	0.95
Industria			1,700,329.00	1,763,920.00	0.63
1,700,000.00	AIR FRANCE-KLM 8.13% 31/05/2028	EUR	1,700,329.00	1,763,920.00	0.63
Finanza			1,596,320.00	1,581,808.00	0.57
1,600,000.00	CREDIT AGRICOLE SA 3.88% 20/04/2031	EUR	1,596,320.00	1,581,808.00	0.57
LUSSEMBURGO			7,922,880.74	8,715,669.49	3.14
Sovranazionale			4,374,906.86	5,223,992.98	1.88
30,000,000.00	INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT 5.00% 22/01/2026	BRL	4,374,906.86	5,223,992.98	1.88
Finanza			2,603,161.73	2,694,336.84	0.97
2,185,000.00	MEXICO REMITTANCES FUNDING FIDUCIARY ESTATE MANAGEMENT SARL 4.88% 15/01/2028	USD	1,788,003.64	1,810,665.48	0.65
5,003,550.00	SWISS INSURED BRAZIL POWER FINANCE SARL 9.85% 16/07/2032	BRL	815,158.09	883,671.36	0.32

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Servizi di telecomunicazione			944,812.15	797,339.67	0.29
1,005,000.00	TELECOM ITALIA CAPITAL SA 7.20% 18/07/2036	USD	944,812.15	797,339.67	0.29
ITALIA			9,371,055.00	8,382,076.51	3.02
Finanza			7,456,105.00	6,408,296.51	2.31
3,499,000.00	VITTORIA ASSICURAZIONI SPA 5.75% 11/07/2028	EUR	3,809,105.00	3,493,716.51	1.26
2,000,000.00	BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA 1.88% 09/01/2026	EUR	1,781,000.00	1,781,720.00	0.64
1,000,000.00	INTESA SANPAOLO VITA SPA 2.38% 22/12/2030	EUR	764,500.00	757,860.00	0.27
1,000,000.00	EUROVITA ASSICURAZIONI SPA 6.00% 22/12/2025*	EUR	1,101,500.00	375,000.00	0.14
Industria			1,914,950.00	1,973,780.00	0.71
2,000,000.00	WEBUILD SPA 5.88% 15/12/2025	EUR	1,914,950.00	1,973,780.00	0.71
PAESI BASSI			7,361,703.38	7,673,226.02	2.76
Servizi di pubblica utilità			3,956,490.33	4,210,089.04	1.52
3,000,000.00	ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 5.50% 15/06/2052	USD	2,230,990.33	2,492,309.04	0.90
1,000,000.00	TENNET HOLDING BV 2.13% 17/11/2029	EUR	933,500.00	937,040.00	0.34
1,000,000.00	TENNET HOLDING BV 0.88% 16/06/2035	EUR	792,000.00	780,740.00	0.28
Salute			1,770,500.00	1,813,000.00	0.65
2,000,000.00	TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NETHERLANDS II BV 3.75% 09/05/2027	EUR	1,770,500.00	1,813,000.00	0.65
Servizi di telecomunicazione			853,106.65	861,997.90	0.31
1,500,000.00	PROSUS NV 4.03% 03/08/2050	USD	853,106.65	861,997.90	0.31
Materie prime			781,606.40	788,139.08	0.28
1,000,000.00	BRASKEM NETHERLANDS FINANCE BV 4.50% 31/01/2030	USD	781,606.40	788,139.08	0.28
GERMANIA			4,194,697.99	4,161,208.51	1.50
Enti Governativi			2,994,510.00	2,995,680.00	1.08
3,000,000.00	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 2.00% 15/08/2023	EUR	2,994,510.00	2,995,680.00	1.08
Materie prime			1,200,187.99	1,165,528.51	0.42
1,400,000.00	THYSSENKRUPP AG 4.13% 26/01/2026	USD	1,200,187.99	1,165,528.51	0.42
SPAGNA			3,268,730.00	3,070,878.00	1.10
Industria			3,268,730.00	3,070,878.00	1.10
2,900,000.00	CELLNEX FINANCE CO SA 2.00% 15/09/2032	EUR	2,511,230.00	2,289,898.00	0.82
1,000,000.00	CELLNEX FINANCE CO SA 2.00% 15/02/2033	EUR	757,500.00	780,980.00	0.28
CINA			2,644,364.49	2,529,488.34	0.91
Sovranazionale			2,644,364.49	2,529,488.34	0.91
20,000,000.00	ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.90% 05/03/2024	CNY	2,644,364.49	2,529,488.34	0.91
JERSEY			2,236,701.41	2,239,845.78	0.81
Beni voluttuari			2,027,948.18	2,082,930.15	0.75
2,250,000.00	ASTON MARTIN CAPITAL HOLDINGS LTD 10.50% 30/11/2025	USD	2,027,948.18	2,082,930.15	0.75
Servizi di telecomunicazione			208,753.23	156,915.63	0.06
200,000.00	CORNWALL JERSEY LTD 0.75% 16/04/2026	GBP	208,753.23	156,915.63	0.06
CANADA			2,063,646.57	1,905,663.94	0.69
Materie prime			2,063,646.57	1,905,663.94	0.69
2,000,000.00	KINROSS GOLD CORP 6.88% 01/09/2041	USD	2,063,646.57	1,905,663.94	0.69
SVIZZERA			1,636,705.60	1,695,563.18	0.61
Finanza			1,636,705.60	1,695,563.18	0.61
2,000,000.00	CREDIT SUISSE GROUP AG 4.28% 09/01/2028	USD	1,636,705.60	1,695,563.18	0.61

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
MESSICO			1,271,987.01	1,212,079.87	0.44
Energia			1,271,987.01	1,212,079.87	0.44
600,000.00	PETROLEOS MEXICANOS 10.00% 07/02/2033	USD	539,754.20	503,570.88	0.18
500,000.00	PETROLEOS MEXICANOS 2.75% 21/04/2027	EUR	387,500.00	397,565.00	0.15
500,000.00	PETROLEOS MEXICANOS 7.69% 23/01/2050	USD	344,732.81	310,943.99	0.11
GIAPPONE			1,250,000.00	1,169,262.50	0.42
Beni voluttuari			1,250,000.00	1,169,262.50	0.42
1,250,000.00	NISSAN MOTOR CO LTD 2.65% 17/03/2026	EUR	1,250,000.00	1,169,262.50	0.42
GUERNSEY			831,000.00	855,010.00	0.31
Finanza			831,000.00	855,010.00	0.31
1,000,000.00	PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD 1.38% 01/10/2027	EUR	831,000.00	855,010.00	0.31
TRINIDAD E TOBAGO			704,668.06	638,933.35	0.23
Servizi di telecomunicazione			704,668.06	638,933.35	0.23
850,000.00	TELECOMMUNICATIONS SERVICES OF TRINIDAD & TOBAGO LTD 8.88% 18/10/2029	USD	704,668.06	638,933.35	0.23
NORVEGIA			487,083.18	482,173.41	0.17
Energia			487,083.18	482,173.41	0.17
495,000.00	VAR ENERGI ASA 8.00% 15/11/2032	USD	487,083.18	482,173.41	0.17
UCRAINA			735,575.00	216,810.00	0.08
Enti Governativi			735,575.00	216,810.00	0.08
1,000,000.00	UKRAINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.38% 27/01/2032	EUR	735,575.00	216,810.00	0.08
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
Obbligazioni a tasso variabile			151,264,231.34	142,928,088.56	51.46
ITALIA			59,197,375.62	57,255,752.71	20.61
Finanza			55,975,625.62	54,137,042.71	19.49
10,200,000.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA FRN 27/10/2047	EUR	10,190,000.00	10,283,232.00	3.70
10,300,000.00	UNIONE DI BANCHE ITALIANE SPA REG FRN 31/12/2099	EUR	9,999,106.47	9,736,796.00	3.51
6,136,000.00	FINECOBANK BANCA FINECO SPA FRN 31/12/2099	EUR	6,400,194.81	5,921,608.16	2.13
6,050,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 31/12/2099	EUR	4,634,300.00	4,835,523.00	1.74
3,000,000.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA FRN 30/11/2049	EUR	3,326,500.00	2,921,490.00	1.05
3,000,000.00	BANCO BPM SPA REG FRN 31/12/2099	EUR	2,980,250.00	2,848,590.00	1.03
3,015,000.00	UNICREDIT SPA FRN 31/12/2099	EUR	2,999,825.71	2,765,448.45	1.00
3,000,000.00	ICCREA BANCA SPA FRN 18/01/2032	EUR	3,000,000.00	2,587,620.00	0.93
2,500,000.00	BANCO BPM SPA FRN 14/06/2028	EUR	2,499,065.00	2,486,425.00	0.89
3,000,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 31/12/2099	EUR	2,079,510.00	2,102,610.00	0.76
2,098,000.00	UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA FRN 31/12/2099	EUR	1,990,539.13	1,818,861.10	0.65
2,000,000.00	UNICREDIT SPA FRN 31/12/2099	EUR	1,480,000.00	1,579,120.00	0.57
1,437,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 29/12/2049	EUR	1,543,179.50	1,392,453.00	0.50
1,200,000.00	ICCREA BANCA SPA REG FRN 28/11/2029	EUR	1,213,680.00	1,137,996.00	0.41
1,000,000.00	SOCIETA CATTOLICA DI ASSICURAZIONI SC FRN 14/12/2047	EUR	969,100.00	962,050.00	0.35
1,000,000.00	UNICREDIT SPA REG FRN 31/12/2099	EUR	670,375.00	757,220.00	0.27
Energia			2,221,750.00	2,109,800.00	0.76
2,500,000.00	ENI SPA FRN 31/12/2099	EUR	2,221,750.00	2,109,800.00	0.76
Servizi di pubblica utilità			1,000,000.00	1,008,910.00	0.36
1,000,000.00	ENEL SPA FRN 31/12/2099	EUR	1,000,000.00	1,008,910.00	0.36

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
FRANCIA			16,798,558.04	16,081,545.60	5.79
Finanza			14,758,478.04	14,033,699.10	5.05
4,000,000.00	BNP PARIBAS SA FRN 31/12/2099	USD	3,287,729.00	2,911,859.78	1.05
2,852,000.00	AXA SA FRN 29/10/2049	EUR	2,310,120.00	2,309,606.64	0.83
2,000,000.00	CREDIT AGRICOLE ASSURANCES SA FRN 27/09/2048	EUR	1,960,000.00	1,925,260.00	0.69
2,000,000.00	LA MONDIALE SAM FRN 18/01/2048	USD	1,770,247.67	1,659,339.54	0.60
2,000,000.00	SCOR SE FRN 31/12/2049	USD	1,512,497.43	1,393,381.79	0.50
1,000,000.00	AXA SA FRN 11/07/2043	EUR	995,370.00	1,002,090.00	0.36
1,000,000.00	BNP PARIBAS SA FRN 31/12/2099	EUR	1,017,100.00	973,040.00	0.35
1,000,000.00	AXA SA FRN 29/10/2049	EUR	811,250.00	804,240.00	0.29
1,000,000.00	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA FRN 29/11/2049	EUR	789,000.00	764,150.00	0.28
400,000.00	BNP PARIBAS SA FRN 31/12/2099	USD	305,163.94	290,731.35	0.10
Energia			1,162,500.00	1,177,512.50	0.43
1,250,000.00	TOTALENERGIES SE FRN 29/12/2049	EUR	1,162,500.00	1,177,512.50	0.43
Servizi di pubblica utilità			877,580.00	870,334.00	0.31
600,000.00	ELECTRICITE DE FRANCE SA FRN 31/12/2099	EUR	472,500.00	462,666.00	0.16
400,000.00	ELECTRICITE DE FRANCE SA FRN 31/12/2029	EUR	405,080.00	407,668.00	0.15
PAESI BASSI			16,639,815.37	15,345,769.62	5.53
Finanza			10,326,975.37	9,214,694.12	3.32
12,500,000.00	AEGON NV FRN 29/06/2049	NLG	5,099,576.67	4,507,228.72	1.62
3,190,000.00	ACHMEA BV FRN 31/12/2099	EUR	2,971,488.70	2,483,925.40	0.90
1,000,000.00	ASR NEDERLAND NV FRN 07/12/2043	EUR	1,051,000.00	1,043,120.00	0.38
1,000,000.00	ABN AMRO BANK NV FRN 22/02/2033	EUR	1,005,600.00	979,930.00	0.35
200,000.00	NN GROUP NV FRN 03/11/2043	EUR	199,310.00	200,490.00	0.07
Beni voluttuari			5,268,885.00	5,089,840.00	1.83
6,100,000.00	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN 31/12/2099	EUR	5,268,885.00	5,089,840.00	1.83
Energia			1,043,955.00	1,041,235.50	0.38
1,110,000.00	REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV FRN 31/12/2099	EUR	1,043,955.00	1,041,235.50	0.38
LUSSEMBURGO			15,134,146.18	13,150,991.34	4.74
Finanza			15,134,146.18	13,150,991.34	4.74
9,000,000.00	HELVETIA EUROPE SA FRN 30/09/2041	EUR	7,605,012.00	7,176,240.00	2.58
9,100,000.00	MITSUBISHI UFJ INVESTOR SERVICES & BANKING LUXEMBOURG SA FRN 15/12/2050	EUR	5,634,314.18	4,205,292.00	1.52
1,000,000.00	BANQUE INTERNATIONALE A LUXEMBOURG SA FRN 01/05/2033	EUR	994,000.00	924,730.00	0.33
1,000,000.00	SWISS RE FINANCE LUXEMBOURG SA FRN 31/12/2099	USD	900,820.00	844,729.34	0.31
GERMANIA			12,027,318.84	11,630,342.84	4.19
Finanza			7,280,698.84	6,849,378.84	2.47
2,000,000.00	COMMERZBANK AG FRN 28/02/2033	GBP	2,385,432.98	2,246,689.32	0.81
3,000,000.00	ALLIANZ SE FRN 31/12/2099	USD	2,392,445.86	2,038,129.52	0.74
2,000,000.00	ALLIANZ SE FRN 05/07/2052	EUR	1,801,570.00	1,861,460.00	0.67
1,000,000.00	ALLIANZ SE FRN 31/12/2099	EUR	701,250.00	703,100.00	0.25
Salute			3,379,120.00	3,349,464.00	1.21
3,200,000.00	BAYER AG FRN 25/03/2082	EUR	3,001,240.00	2,970,688.00	1.07
400,000.00	BAYER AG FRN 25/03/2082	EUR	377,880.00	378,776.00	0.14
Servizi di pubblica utilità			1,367,500.00	1,431,500.00	0.51
2,000,000.00	ENBW ENERGIE BADEN-WUERTTEMBERG AG FRN 31/08/2081	EUR	1,367,500.00	1,431,500.00	0.51
REGNO UNITO			12,235,740.35	11,015,710.90	3.97
Finanza			7,972,240.35	6,745,240.90	2.43
2,500,000.00	ROTHESAY LIFE PLC REG FRN 31/12/2099	GBP	3,500,478.26	2,413,147.66	0.87
2,000,000.00	STANDARD CHARTERED PLC FRN 10/05/2031	EUR	2,000,000.00	1,978,940.00	0.71
952,000.00	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC FRN 31/12/2049	GBP	932,433.74	868,228.30	0.31

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
1,000,000.00	BARCLAYS BANK PLC FRN 28/12/2040	EUR	773,750.00	737,070.00	0.27
500,000.00	STANDARD CHARTERED PLC FRN 29/01/2049	USD	417,064.46	423,748.72	0.15
400,000.00	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC FRN 31/12/2099	USD	348,513.89	324,106.22	0.12
Servizi di telecomunicazione			2,428,500.00	2,426,550.00	0.87
3,000,000.00	VODAFONE GROUP PLC FRN 27/08/2080	EUR	2,428,500.00	2,426,550.00	0.87
Servizi di pubblica utilità			1,835,000.00	1,843,920.00	0.67
2,000,000.00	SSE PLC FRN 31/12/2099	EUR	1,835,000.00	1,843,920.00	0.67
STATI UNITI			6,470,406.25	6,239,220.00	2.25
Servizi di telecomunicazione			5,730,406.25	5,536,620.00	2.00
6,000,000.00	AT&T INC FRN 31/12/2099	EUR	5,730,406.25	5,536,620.00	2.00
Finanza			740,000.00	702,600.00	0.25
1,000,000.00	DEUTSCHE POSTBANK FUNDING TRUST III FRN 29/06/2049	EUR	740,000.00	702,600.00	0.25
AUSTRIA			3,356,000.00	3,363,320.00	1.21
Finanza			3,356,000.00	3,363,320.00	1.21
2,000,000.00	VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICHERUNG GRUPPE FRN 15/06/2042	EUR	1,909,000.00	1,881,220.00	0.68
2,000,000.00	UNIQA INSURANCE GROUP AG FRN 09/12/2041	EUR	1,447,000.00	1,482,100.00	0.53
BELGIO			3,400,710.00	3,177,830.00	1.14
Enti Governativi			2,401,500.00	2,173,470.00	0.78
3,000,000.00	AGEAS FRN 31/12/2099	EUR	2,401,500.00	2,173,470.00	0.78
Servizi di pubblica utilità			999,210.00	1,004,360.00	0.36
1,000,000.00	ELIA GROUP SA/NV FRN 31/12/2099	EUR	999,210.00	1,004,360.00	0.36
SPAGNA			2,400,434.00	2,400,378.00	0.86
Finanza			2,400,434.00	2,400,378.00	0.86
2,400,000.00	BANCO SANTANDER SA FRN 31/12/2099	EUR	1,802,000.00	1,803,984.00	0.65
600,000.00	BANCO SANTANDER SA FRN 23/08/2033	EUR	598,434.00	596,394.00	0.21
KUWAIT			1,166,932.45	1,041,447.89	0.37
Finanza			1,166,932.45	1,041,447.89	0.37
1,500,000.00	BURGAN BANK SAK FRN 15/12/2031	USD	1,166,932.45	1,041,447.89	0.37
ROMANIA			1,004,490.00	1,023,850.00	0.37
Finanza			1,004,490.00	1,023,850.00	0.37
1,000,000.00	BANCA COMERCIALA ROMANA SA FRN 19/05/2027	EUR	1,004,490.00	1,023,850.00	0.37
GIAPPONE			790,000.00	478,210.00	0.17
Servizi di telecomunicazione			790,000.00	478,210.00	0.17
1,000,000.00	RAKUTEN GROUP INC FRN 31/12/2099	EUR	790,000.00	478,210.00	0.17
AUSTRALIA			289,197.25	423,551.66	0.15
Finanza			289,197.25	423,551.66	0.15
500,000.00	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD FRN 29/10/2049	USD	289,197.25	423,551.66	0.15
ISOLE CAYMAN			353,106.99	300,168.00	0.11
Finanza			353,106.99	300,168.00	0.11
360,000.00	EMERGING MARKETS CAPITAL PROTECTED INVESTMENTS LTD FRN 20/04/2028	EUR	353,106.99	300,168.00	0.11

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Obbligazioni zero coupon			1,597,803.65	1,623,053.24	0.58
CILE			997,046.39	1,067,116.99	0.38
Servizi di pubblica utilità			997,046.39	1,067,116.99	0.38
1,500,000.00	CHILE ELECTRICITY PEC SPA 0.00% 25/01/2028	USD	997,046.39	1,067,116.99	0.38
AUSTRIA			333,463.01	308,384.00	0.11
Informatica			333,463.01	308,384.00	0.11
400,000.00	AMS-OSRAM AG 0.00% 05/03/2025	EUR	333,463.01	308,384.00	0.11
COSTA D'AVORIO			267,294.25	247,552.25	0.09
Sovranazionale			267,294.25	247,552.25	0.09
60,000,000.00	AFRICAN DEVELOPMENT BANK 0.00% 03/02/2053	MXN	267,294.25	247,552.25	0.09
Azioni di OICR			13,958,884.76	13,491,755.86	4.86
LUSSEMBURGO			13,958,884.76	13,491,755.86	4.86
Finanza			13,958,884.76	13,491,755.86	4.86
1,021,409.17	AZ FUND 1 - CGM OPPORTUNISTIC CORPORATE BOND -A-	EUR	6,575,034.33	5,933,365.87	2.14
29,985.37	PLANETARIUM FUND - EUROCURRENCIES BONDS	EUR	2,500,000.01	2,511,274.82	0.90
20,326.65	PLANETARIUM FUND - ENHANCED EURO CREDIT	EUR	2,016,200.02	1,906,029.60	0.69
281,320.33	AZ FUND 1 - AZ BOND TARGET 2024 USD	USD	1,243,884.00	1,309,389.73	0.47
191,497.51	AZ MULTI ASSET - MAMG GLOBAL SUKUK	USD	809,651.00	1,011,373.34	0.36
184,150.64	AZ FUND 1 - AZ BOND US DOLLAR AGGREGATE -A-	USD	814,115.40	820,322.50	0.30
Titoli garantiti da ipoteche immobiliari e da collaterale			1,403,783.55	1.42	0.00
ITALIA			1,403,783.55	1.42	0.00
Finanza			1,403,783.55	1.42	0.00
1,423,715.56	SPV PROJECT SRL 7.00% 15/11/2037*	EUR	1,403,783.55	1.42	0.00
NEGOZIATI SU UN ALTRO MERCATO REGOLAMENTATO			17,508,837.44	15,565,435.73	5.61
Obbligazioni ordinarie			13,611,439.35	11,732,911.72	4.23
LUSSEMBURGO			5,939,341.35	4,841,255.15	1.75
Servizi di telecomunicazione			5,939,341.35	4,841,255.15	1.75
2,268,000.00	TELECOM ITALIA CAPITAL SA 6.38% 15/11/2033	USD	2,060,143.42	1,766,253.82	0.64
1,965,000.00	TELECOM ITALIA CAPITAL SA 7.72% 04/06/2038	USD	1,966,224.16	1,594,873.47	0.58
2,000,000.00	TELECOM ITALIA CAPITAL SA 6.00% 30/09/2034	USD	1,912,973.77	1,480,127.86	0.53
COLOMBIA			4,227,987.59	3,438,638.26	1.24
Servizi di telecomunicazione			4,227,987.59	3,438,638.26	1.24
4,950,000.00	COLOMBIA TELECOMUNICACIONES SA ESP 4.95% 17/07/2030	USD	4,227,987.59	3,438,638.26	1.24
STATI UNITI			2,296,543.14	2,312,970.53	0.83
Beni voluttuari			1,019,687.62	1,053,007.58	0.38
1,000,000.00	MACY'S RETAIL HOLDINGS LLC 6.70% 15/09/2028	USD	849,554.16	876,580.85	0.32
205,508.82	US AIRWAYS 2013-1 CLASS A PASS THROUGH TRUST 3.95% 15/11/2025	USD	170,133.46	176,426.73	0.06
Finanza			824,307.78	826,810.01	0.30
1,000,000.00	CITADEL FINANCE LLC 3.38% 09/03/2026	USD	824,307.78	826,810.01	0.30
Informatica			452,547.74	433,152.94	0.15
500,000.00	XEROX HOLDINGS CORP 5.00% 15/08/2025	USD	452,547.74	433,152.94	0.15
GIAPPONE			842,424.00	832,135.40	0.30
Beni voluttuari			842,424.00	832,135.40	0.30
1,000,000.00	NISSAN MOTOR CO LTD 4.35% 17/09/2027	USD	842,424.00	832,135.40	0.30

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
JERSEY			305,143.27	307,912.38	0.11
Beni voluttuari			305,143.27	307,912.38	0.11
309,165.00	ASTON MARTIN CAPITAL HOLDINGS LTD 15.00% 30/11/2026	USD	305,143.27	307,912.38	0.11
Obbligazioni a tasso variabile			3,897,398.09	3,832,524.01	1.38
STATI UNITI			2,391,523.69	2,277,254.10	0.82
Servizi di pubblica utilità			1,232,781.97	1,171,250.78	0.42
1,500,000.00	SOUTHERN CO FRN 15/09/2051	USD	1,232,781.97	1,171,250.78	0.42
Finanza			1,158,741.72	1,106,003.32	0.40
1,000,000.00	USB REALTY CORP FRN 29/12/2049	USD	691,953.72	651,530.50	0.24
500,000.00	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP. FRN 08/06/2029	USD	466,788.00	454,472.82	0.16
ITALIA			1,505,874.40	1,555,269.91	0.56
Finanza			1,505,874.40	1,555,269.91	0.56
2,000,000.00	UNICREDIT SPA FRN 30/06/2035	USD	1,505,874.40	1,555,269.91	0.56
ALTRI VALORI MOBILIARI			11,444,120.65	6,170,393.36	2.22
Obbligazioni a tasso variabile			6,644,120.65	6,170,388.56	2.22
ITALIA			5,323,478.97	5,005,483.33	1.80
Finanza			5,323,478.97	5,005,483.33	1.80
7,300,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 01/06/2032	USD	5,323,478.97	5,005,483.33	1.80
FRANCIA			1,320,641.68	1,164,905.23	0.42
Finanza			1,320,641.68	1,164,905.23	0.42
1,600,000.00	CREDIT AGRICOLE SA FRN 31/12/2099	USD	1,320,641.68	1,164,905.23	0.42
Titoli garantiti da ipoteche immobiliari e da collaterale			4,800,000.00	4.80	0.00
ITALIA			4,800,000.00	4.80	0.00
Finanza			4,800,000.00	4.80	0.00
4,800,000.00	SIERRA ONE SPV SRL 7.00% 30/06/2025*	EUR	4,800,000.00	4.80	0.00
QUOTE DI OICR			2,762,980.80	2,643,400.00	0.95
Azioni di OICR			2,762,980.80	2,643,400.00	0.95
IRLANDA			2,762,980.80	2,643,400.00	0.95
Finanza			2,762,980.80	2,643,400.00	0.95
40,000.00	ISHARES J.P. MORGAN USD EM BOND EUR HEDGED UCITS ETF DIST	EUR	2,762,980.80	2,643,400.00	0.95
Totale del Portafoglio Titoli			284,810,617.61	266,201,654.60	95.85

* Strumenti finanziari prezzati al fair value

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

IMPEGNI SU ACQUISTO / VENDITA DI CONTRATTI FUTURES AL 30 GIUGNO 2023

Valore nominale	Quantità	Acquisto / Vendita	Contratto	Scadenza	Valore di mercato al 30 Giugno 2023	Valuta	Plus/(minus) valenza non realizzata (EUR)	Impegno (EUR)
							-335,650.98	48,127,605.98
100,000	-65	Vendita	US 10YR NOTE (CBT)	20/09/2023	102.90	USD	83,782.05	6,688,600.71
200,000	117	Acquisto	US 2YR NOTE (CBT)	29/09/2023	93.20	USD	-204,428.21	21,806,793.20
100,000	200	Acquisto	US 5YR NOTE (CBT)	29/09/2023	98.16	USD	-215,004.82	19,632,212.07

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

CONTRATTI DI OPZIONI AL 30 GIUGNO 2023

Quantità	Acquisto / Vendita		Call/Put	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	Impegno (EUR)
CONTRATTI DI OPZIONI						379,250.00	199,155.55	310,000,000.00
OPZIONE SCRITTA						-917,800.00	-310,473.60	310,000,000.00
-45,000,000	Vendita		PUT	CDS EUR PUT 6.00 20/09/2023	EUR	-153,000.00	-72,993.60	270,000,000.00
-40,000,000	Vendita		PUT	EUR/JPY PUT 134.00 24/04/2024	EUR	-764,800.00	-237,480.00	40,000,000.00
OPZIONI ACQUISTATE						1,297,050.00	509,629.15	0.00
40,000,000	Acquisto		PUT	EUR/JPY PUT 135.50 24/04/2024	EUR	934,800.00	315,640.00	0.00
45,000,000	Acquisto		PUT	CDS EUR PUT 5.00 20/09/2023	EUR	362,250.00	193,989.15	0.00

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

CONTRATTI FINANZIARI A TERMINE AL 30 GIUGNO 2023

Scadenza	Ammontare comprato	Valuta comprata	Ammontare venduto	Valuta venduta	Plus/(minus)-valenza non realizzata (EUR)
					-333,052.06
20/09/2023	55,800.00	USD	51,176.16	EUR	-225.95
17/07/2023	760,000.00	GBP	886,732.31	EUR	-1,596.87
20/09/2023	200,000.00	USD	184,235.30	EUR	-1,618.06
17/07/2023	929,700.79	EUR	800,000.00	GBP	-2,020.72
17/07/2023	3,000,000.00	USD	2,756,998.18	EUR	-8,817.15
17/07/2023	1,170,000.00	USD	1,084,296.35	EUR	-12,505.75
20/09/2023	1,557,350.00	CHF	1,618,125.50	EUR	-15,742.39
17/07/2023	2,100,000.00	USD	1,942,286.35	EUR	-18,559.63
20/09/2023	1,430,900.00	USD	1,329,578.66	EUR	-23,043.60
17/07/2023	3,600,000.00	EUR	3,971,520.00	USD	-38,151.97
20/12/2023	13,454,982.96	USD	67,100,000.00	BRL	-89,344.06
20/09/2023	6,247,700.00	USD	5,800,875.39	EUR	-96,186.67
05/07/2023	3,974,167.91	USD	20,000,000.00	BRL	-156,564.42
17/07/2023	9,464,185.00	EUR	8,390,000.00	GBP	-307,244.37
05/07/2023	11,123,799.02	USD	56,500,000.00	BRL	-536,909.81
17/07/2023	74,055,229.20	EUR	80,050,000.00	USD	724,598.82
05/07/2023	67,100,000.00	BRL	13,823,650.60	USD	75,853.75
05/07/2023	9,400,000.00	BRL	1,888,877.73	USD	54,319.65
17/07/2023	2,780,000.00	USD	2,505,153.59	EUR	41,494.16
17/07/2023	2,779,103.00	EUR	3,000,000.00	USD	30,921.97
17/07/2023	2,000,000.00	USD	1,808,318.26	EUR	23,802.42
17/07/2023	2,000,000.00	USD	1,821,659.53	EUR	10,461.15
17/07/2023	558,124.48	EUR	600,000.00	USD	8,488.27
17/07/2023	2,844,576.12	EUR	3,100,000.00	USD	4,789.06
20/09/2023	160,000.00	USD	145,782.84	EUR	310.95
20/09/2023	49,015.78	EUR	47,375.00	CHF	270.86
20/09/2023	37,300.00	CHF	38,234.09	EUR	144.50
20/09/2023	4,500.00	CHF	4,606.32	EUR	23.80

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

CONTRATTI SWAP AL 30 GIUGNO 2023

Sottostante	Valuta	Posizione	Nominale	Controparte	Scadenza	Interessi da ricevere / pagare (EUR)	Plus/(minus) -valenza non realizzata(EUR)
CONTRATTI CREDIT DEFAULT SWAP						-6,111.12	-156,109.04
iTraxx Europe Crossover Series 39 Version 1	EUR	Long	2,500,000.00	J.P. MORGAN SE	12/20/2027	-763.89	(19,467.37)
iTraxx Europe Crossover Series 39 Version 1	EUR	Long	2,500,000.00	J.P. MORGAN SE	12/20/2027	-763.89	(63,055.88)
iTraxx Europe Crossover Series 39 Version 1	EUR	Long	1,500,000.00	J.P. MORGAN SE	12/20/2027	-2,291.67	(27,121.56)
iTraxx Europe Crossover Series 39 Version 1	EUR	Long	7,500,000.00	J.P. MORGAN SE	06/20/2028	-2,291.67	(46,464.23)

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - Euro Equities

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Attività

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	26,592,556.86
Liquidità bancarie a vista		367,257.27
Importi dovuti dai broker		774,280.32
Dividendi da ricevere		21,581.91
Da ricevere su sottoscrizioni		26,367.29
Altre attività		2,630.65
Totale attività		27,784,674.30

Passività

Perdite non realizzate su contratti futures	(Note 2d, 13)	-3,950.00
Da pagare su rimborsi		-110,010.77
Altre passività		-103,082.93
Totale passività		-217,043.70

Totale attivo netto**27,567,630.60**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	71.57	59,917.304
Azione I	EUR	79.94	289,348.664
Azione L	EUR	78.88	1,881.000

NEW MILLENNIUM - Euro Equities

PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Attivo netto all'inizio del periodo		27,807,223.25
Risultato netto degli investimenti		715,740.69
Altri ricavi		362.90
Totale ricavi		716,103.59
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-119,626.65
Commissione di consulenza	(Nota 6)	-8,055.46
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 8)	-7,891.47
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-2,404.55
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 8)	-26,056.30
Commissioni del Transfer Agent		-2,741.66
Compensi professionali	(Nota 9)	-6,083.14
Pubblicazioni		-552.57
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-11,647.83
Totale costi		-185,059.63
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		531,043.96
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	1,530,310.14
- di contratti futures		54,926.80
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		2,070,333.62
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(Nota 2c)	-49.60
- su contratti futures	(Nota 2d)	3,750.00
Risultato netto delle operazioni per il periodo		4,190,314.92
Distribuzioni di dividendi	(Nota 14)	-13,111.86
Sottoscrizioni del periodo		924,302.98
Rimborsi del periodo		-5,341,098.69
Attivo netto alla fine del periodo		27,567,630.60

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

NEW MILLENNIUM - Euro Equities

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			24,094,723.97	26,592,556.86	96.46
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			24,094,723.97	26,592,556.86	96.46
Azioni			23,523,146.15	25,980,261.75	94.24
FRANCIA			9,793,721.11	10,925,128.99	39.63
Beni voluttuari			2,896,693.94	3,664,117.42	13.29
1,828.00	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	EUR	1,075,103.92	1,577,564.00	5.72
1,389.00	L'OREAL SA	EUR	487,025.81	593,241.90	2.15
6,189.00	SEB SA	EUR	536,829.84	585,788.85	2.12
5,372.00	SODEXO SA	EUR	504,711.62	541,766.20	1.97
2,183.00	SODEXO	EUR	167,089.93	220,155.55	0.80
3,774.00	RENAULT SA	EUR	125,932.82	145,600.92	0.53
Industria			1,552,579.98	1,594,233.26	5.78
5,939.00	VINCI SA	EUR	589,241.86	631,790.82	2.29
1,152.00	DASSAULT AVIATION SA	EUR	199,339.90	211,276.80	0.77
1,401.00	THALES SA	EUR	188,760.38	192,217.20	0.70
6,226.00	BOUYGUES SA	EUR	203,829.04	191,511.76	0.69
3,374.00	CIE DE SAINT-GOBAIN	EUR	177,117.57	188,033.02	0.68
1,877.00	IEFFAGE SA	EUR	194,291.23	179,403.66	0.65
Finanza			1,604,544.29	1,593,489.87	5.78
13,581.00	BNP PARIBAS SA	EUR	797,625.66	783,895.32	2.84
9,655.00	EURAZEO SE	EUR	639,012.67	622,264.75	2.26
7,871.00	SOCIETE GENERALE SA	EUR	167,905.96	187,329.80	0.68
Salute			1,036,886.70	1,154,716.80	4.19
6,365.00	SANOFI	EUR	565,479.08	625,043.00	2.27
2,415.00	ESSILORLUXOTTICA SA	EUR	357,030.19	416,829.00	1.51
1,024.00	IPSEN SA	EUR	114,377.43	112,844.80	0.41
Energia			720,876.62	850,784.50	3.09
16,190.00	TOTAL SA	EUR	720,876.62	850,784.50	3.09
Materie prime			683,916.95	750,394.00	2.72
4,570.00	AIR LIQUIDE SA	EUR	683,916.95	750,394.00	2.72
Beni di prima necessità			477,160.81	530,736.46	1.92
1,366.00	PERNOD RICARD SA	EUR	219,422.04	276,478.40	1.00
4,529.00	DANONE SA	EUR	257,738.77	254,258.06	0.92
Servizi di telecomunicazione			404,958.25	395,888.38	1.44
36,992.00	ORANGE SA	EUR	404,958.25	395,888.38	1.44
Informatica			416,103.57	390,768.30	1.42
1,470.00	CAPGEMINI SE	EUR	274,381.55	255,118.50	0.93
884.00	TELEPERFORMANCE	EUR	141,722.02	135,649.80	0.49
GERMANIA			5,577,234.84	5,975,585.67	21.68
Beni voluttuari			1,714,992.37	1,903,732.03	6.91
10,862.00	PUMA SE	EUR	539,625.80	598,713.44	2.17
7,261.00	DAIMLER AG REG	EUR	437,436.47	534,917.87	1.94
2,636.00	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	EUR	227,620.15	296,602.72	1.08
1,742.00	CONTINENTAL AG	EUR	115,744.99	120,372.20	0.44
972.00	VOLKSWAGEN AG -PREF-	EUR	156,275.98	119,497.68	0.43
12,499.00	DEUTSCHE LUFTHANSA AG REG	EUR	121,973.78	117,228.12	0.43
960.00	BEIERSDORF AG	EUR	116,315.20	116,400.00	0.42
Industria			1,152,471.41	1,253,572.27	4.55
4,837.00	SIEMENS AG REG	EUR	642,072.92	737,835.98	2.68
7,093.00	DEUTSCHE POST AG REG	EUR	313,103.93	317,269.89	1.15
836.00	MTU AERO ENGINES AG	EUR	197,294.56	198,466.40	0.72

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

NEW MILLENNIUM - Euro Equities

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Finanza			977,951.67	1,008,616.05	3.66
3,193.00	ALLIANZ SE REG	EUR	656,927.31	680,747.60	2.47
1,687.00	HANNOVER RUECK SE	EUR	321,024.36	327,868.45	1.19
Informatica			736,077.53	880,860.46	3.19
7,039.00	SAP SE	EUR	736,077.53	880,860.46	3.19
Salute			512,662.85	438,369.66	1.59
6,498.00	BAYER AG REG	EUR	412,391.29	329,253.66	1.19
720.00	MERCK KGAA	EUR	100,271.56	109,116.00	0.40
Materie prime			389,728.73	377,468.28	1.37
1,974.00	SYMRISE AG	EUR	207,893.90	189,543.48	0.69
2,632.00	BRENNTAG AG	EUR	181,834.83	187,924.80	0.68
Beni di prima necessità			93,350.28	112,966.92	0.41
1,542.00	HENKEL AG & CO KGAA -PREF-	EUR	93,350.28	112,966.92	0.41
PAESI BASSI			4,168,669.56	4,962,331.60	18.00
Informatica			2,120,442.26	2,673,116.04	9.70
2,717.00	ASML HOLDING NV	EUR	1,392,444.09	1,801,371.00	6.54
19,134.00	STMICROELECTRONICS NV	EUR	727,998.17	871,745.04	3.16
Finanza			558,365.13	589,042.68	2.14
31,909.00	ING GROEP NV	EUR	356,587.66	393,693.24	1.43
13,728.00	ABN AMRO GROUP NV -CVA-	EUR	201,777.47	195,349.44	0.71
Beni voluttuari			504,494.69	553,533.59	2.01
25,542.00	STELLANTIS NV	EUR	362,617.99	410,970.78	1.49
2,951.00	RANDSTAD NV	EUR	141,876.70	142,562.81	0.52
Industria			395,431.19	551,544.12	2.00
4,167.00	AIRBUS SE	EUR	395,431.19	551,544.12	2.00
Materie prime			365,895.44	366,260.92	1.33
2,621.00	AKZO NOBEL NV	EUR	192,246.94	195,841.12	0.71
1,294.00	IMCD GROUP NV	EUR	173,648.50	170,419.80	0.62
Servizi di telecomunicazione			142,409.73	147,180.19	0.53
45,023.00	KONINKLIJKE KPN NV	EUR	142,409.73	147,180.19	0.53
Beni di prima necessità			81,631.12	81,654.06	0.29
867.00	HEINEKEN NV	EUR	81,631.12	81,654.06	0.29
ITALIA			1,871,821.03	2,054,201.58	7.45
Finanza			1,114,187.01	1,236,745.04	4.49
18,407.00	UNICREDIT SPA	EUR	244,761.90	391,424.86	1.42
161,011.00	INTESA SANPAOLO SPA	EUR	363,570.48	386,426.40	1.40
15,362.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA	EUR	294,206.24	286,040.44	1.04
14,036.00	FINECOBANK BANCA FINECO SPA	EUR	211,648.39	172,853.34	0.63
Energia			446,190.47	452,458.97	1.64
34,324.00	ENI SPA	EUR	446,190.47	452,458.97	1.64
Servizi di pubblica utilità			311,443.55	364,997.57	1.32
59,176.00	ENEL SPA	EUR	311,443.55	364,997.57	1.32
SPAGNA			1,013,140.42	1,054,771.60	3.83
Servizi di pubblica utilità			455,879.33	477,378.60	1.73
39,948.00	IBERDROLA SA	EUR	455,879.33	477,378.60	1.73
Finanza			374,624.60	384,566.02	1.40
54,688.00	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	EUR	374,624.60	384,566.02	1.40

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

NEW MILLENNIUM - Euro Equities

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Industria			182,636.49	192,826.98	0.70
5,994.00	ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS SA	EUR	182,636.49	192,826.98	0.70
BELGIO			1,005,697.73	929,409.15	3.37
Beni di prima necessità			378,658.28	322,278.94	1.17
6,218.00	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	EUR	378,658.28	322,278.94	1.17
Beni voluttuari			183,483.08	186,492.90	0.67
1,823.00	SOLVAY SA	EUR	183,483.08	186,492.90	0.67
Materie prime			205,507.06	176,289.51	0.64
6,889.00	UMICORE SA	EUR	205,507.06	176,289.51	0.64
Servizi di pubblica utilità			135,797.83	137,001.40	0.50
1,178.00	ELIA GROUP SA/NV	EUR	135,797.83	137,001.40	0.50
Salute			102,251.48	107,346.40	0.39
1,322.00	UCB SA	EUR	102,251.48	107,346.40	0.39
IRLANDA			92,861.46	78,833.16	0.28
Beni di prima necessità			92,861.46	78,833.16	0.28
882.00	KERRY GROUP PLC -A-	EUR	92,861.46	78,833.16	0.28
Azioni di OICR			571,577.82	612,295.11	2.22
LUSSEMBURGO			571,577.82	612,295.11	2.22
Finanza			571,577.82	612,295.11	2.22
21,678.00	LYXOR FTSE MIB UCITS ETF	EUR	571,577.82	612,295.11	2.22
Totale del Portafoglio Titoli			24,094,723.97	26,592,556.86	96.46

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

NEW MILLENNIUM - Euro Equities

IMPEGNI SU ACQUISTO / VENDITA DI CONTRATTI FUTURES AL 30 GIUGNO 2023

Valore nominale	Quantità	Acquisto / Vendita	Contratto	Scadenza	Valore di mercato al 30 Giugno 2023	Valuta	Plus/(minus) valenza non realizzata (EUR)	Impegno (EUR)
							-3,950.00	442,700.00
10	-10	Vendita	EURO STOXX 50	15/09/2023	4,427.00	EUR	-3,950.00	442,700.00

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)**PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR****Attività**

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	38,747,035.49
Liquidità bancarie a vista		214,055.97
Importi dovuti dai broker		2,855,558.50
Utili non realizzati su contratti futures	(Note 2d, 13)	263,796.12
Dividendi da ricevere		15,155.74
Da ricevere su sottoscrizioni		54,299.46
Altre attività		2,514.19
Totale attività		42,152,415.47

Passività

Perdite non realizzate su contratti futures	(Note 2d, 13)	-56,839.58
Da pagare su rimborsi		-2,719.30
Altre passività		-122,731.57
Totale passività		-182,290.45

Totale attivo netto**41,970,125.02**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	114.87	27,750.418
Azione I	EUR	128.79	299,269.122
Azione L	EUR	126.98	1,876.000

NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)**PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR**

Attivo netto all'inizio del periodo		35,108,669.02
Risultato netto degli investimenti		273,490.06
Totale ricavi		273,490.06
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-161,367.14
Commissione di consulenza	(Nota 6)	-7,729.46
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 8)	-10,451.42
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-2,563.91
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 8)	-21,784.45
Commissioni del Transfer Agent		-3,015.50
Compensi professionali	(Nota 9)	-6,790.20
Pubblicazioni		-717.20
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-11,823.46
Totale costi		-226,242.74
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		47,247.32
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	388,854.80
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		-29,784.04
- di contratti futures		163,681.50
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		4,085,542.26
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(Nota 2c)	-34,511.48
- su contratti futures	(Nota 2d)	251,009.58
Risultato netto delle operazioni per il periodo		4,872,039.94
Sottoscrizioni del periodo		4,155,007.06
Rimborsi del periodo		-2,165,591.00
Attivo netto alla fine del periodo		41,970,125.02

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

NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			28,466,459.81	38,747,035.49	92.32
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			28,217,546.60	38,490,364.89	91.71
Azioni			26,677,742.48	36,736,649.70	87.53
STATI UNITI			23,251,339.11	32,137,865.17	76.57
Informatica			2,914,401.17	6,554,807.52	15.62
12,060.00	APPLE INC	USD	653,126.82	2,144,159.01	5.11
6,750.00	MICROSOFT CORP	USD	978,372.27	2,106,915.02	5.02
3,000.00	NVIDIA CORP	USD	257,137.35	1,163,207.71	2.77
1,500.00	SALESFORCE.COM INC	USD	283,330.22	290,458.21	0.69
2,500.00	QUALCOMM INC	USD	286,684.19	272,777.18	0.65
600.00	ADOBE INC	USD	146,190.55	268,922.01	0.64
1,500.00	TEXAS INSTRUMENTS INC	USD	244,466.41	247,506.80	0.59
5,000.00	KYNDRYL HOLDINGS INC	USD	65,093.36	60,861.58	0.15
Servizi di telecomunicazione			3,985,659.22	5,727,033.07	13.64
16,000.00	ALPHABET INC -A-	USD	721,654.41	1,755,453.17	4.18
12,800.00	AMAZON.COM INC	USD	1,017,347.67	1,529,429.41	3.64
2,000.00	FACEBOOK INC -A-	USD	422,166.87	526,086.00	1.25
1,500.00	PALO ALTO NETWORKS INC	USD	183,110.86	351,296.87	0.84
800.00	NETFLIX INC	USD	261,571.75	322,998.98	0.77
2,500.00	T-MOBILE US INC	USD	317,954.64	318,285.88	0.76
5,000.00	CISCO SYSTEMS INC	USD	256,696.13	237,121.83	0.56
6,000.00	COMCAST CORP -A-	USD	211,975.07	228,505.89	0.54
2,500.00	WALT DISNEY CO	USD	249,778.21	204,582.89	0.49
5,500.00	VERIZON COMMUNICATIONS INC	USD	241,874.24	187,483.90	0.45
4,500.00	AT&T INC	USD	101,529.37	65,788.25	0.16
Finanza			4,804,492.61	5,403,106.49	12.87
3,900.00	VISA INC -A-	USD	534,462.36	848,919.99	2.02
2,500.00	BERKSHIRE HATHAWAY INC -B-	USD	616,164.75	781,392.98	1.86
4,000.00	JPMORGAN CHASE & CO	USD	433,469.43	533,235.40	1.27
1,250.00	MASTERCARD INC -A-	USD	337,034.70	450,618.56	1.08
15,000.00	BANK OF AMERICA CORP	USD	399,981.92	394,454.51	0.94
1,300.00	GOLDMAN SACHS GROUP INC	USD	366,935.25	384,328.02	0.92
3,500.00	MORGAN STANLEY	USD	143,223.46	273,968.75	0.65
7,000.00	WELLS FARGO & CO	USD	268,204.34	273,840.43	0.65
2,000.00	SIMON PROPERTY GROUP INC	USD	158,832.34	211,695.63	0.51
5,000.00	CITIGROUP INC	USD	267,227.76	210,999.02	0.50
300.00	BLACKROCK INC	USD	151,236.84	190,047.60	0.45
1,000.00	AMERICAN TOWER CORP	USD	216,028.47	177,763.46	0.42
4,000.00	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	USD	164,078.74	163,226.35	0.39
1,000.00	AMERICAN EXPRESS CO	USD	149,671.49	159,669.98	0.38
2,000.00	PAYPAL HOLDINGS INC	USD	325,433.47	122,328.10	0.29
4,000.00	US BANCORP	USD	169,118.50	121,136.53	0.29
2,000.00	AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC	USD	103,388.79	105,481.18	0.25
Salute			3,205,170.62	4,024,235.24	9.59
4,500.00	JOHNSON & JOHNSON	USD	585,733.57	682,712.90	1.63
5,000.00	MERCK & CO INC	USD	309,010.04	528,826.60	1.26
1,200.00	UNITEDHEALTH GROUP INC	USD	353,967.22	528,659.78	1.26
6,000.00	GILEAD SCIENCES INC	USD	373,488.71	423,849.55	1.01
2,500.00	ABBVIE INC	USD	196,467.60	308,730.43	0.74
8,000.00	PFIZER INC	USD	296,083.08	268,964.17	0.64
4,000.00	CVS HEALTH CORP	USD	272,814.43	253,455.47	0.60
1,200.00	AMGEN INC	USD	246,309.33	244,201.57	0.58
500.00	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	USD	220,575.63	239,115.42	0.57
1,000.00	DANAHER CORP	USD	89,856.06	219,981.60	0.52
3,000.00	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	USD	102,972.18	175,847.79	0.42
1,500.00	ABBOTT LABORATORIES	USD	157,892.77	149,889.96	0.36

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

NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Beni voluttuari			2,675,503.56	3,448,192.33	8.22
5,000.00	PROCTER & GAMBLE CO	USD	534,497.06	695,416.83	1.66
2,000.00	TESLA INC	USD	471,674.93	479,871.53	1.14
1,500.00	HOME DEPOT INC	USD	218,586.08	427,094.28	1.02
4,000.00	NIKE INC -B-	USD	361,850.07	404,656.15	0.97
1,400.00	MCDONALD'S CORP	USD	204,605.87	382,927.47	0.91
5,000.00	COLGATE-PALMOLIVE CO	USD	346,746.61	353,070.47	0.84
1,250.00	LOWE'S COS INC	USD	136,733.77	258,592.95	0.62
2,000.00	STARBUCKS CORP	USD	185,400.14	181,594.81	0.43
1,000.00	WALMART INC	USD	134,744.44	144,069.62	0.34
1,000.00	TARGET CORP	USD	80,664.59	120,898.22	0.29
Industria			2,563,838.18	2,996,710.81	7.14
3,250.00	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	USD	546,707.52	618,125.38	1.47
750.00	BROADCOM INC	USD	406,459.65	596,308.25	1.42
2,500.00	CATERPILLAR INC	USD	489,017.34	563,817.42	1.34
2,000.00	UNITED PARCEL SERVICE INC -B-	USD	255,953.06	328,597.52	0.78
2,500.00	3M CO	USD	254,416.21	229,353.73	0.55
1,000.00	FEDEX CORP	USD	191,112.59	227,222.66	0.54
1,000.00	UNION PACIFIC CORP	USD	187,908.41	187,552.65	0.45
2,000.00	EMERSON ELECTRIC CO	USD	156,734.15	165,701.14	0.40
1,500.00	BALL CORP	USD	75,529.25	80,032.06	0.19
Energia			1,116,856.06	1,592,611.79	3.79
5,000.00	EXXON MOBIL CORP	USD	354,246.66	491,521.39	1.17
3,000.00	VALERO ENERGY CORP	USD	214,302.25	322,548.02	0.77
2,000.00	CHEVRON CORP	USD	239,988.93	288,450.87	0.68
3,000.00	CONOCOPHILLIPS	USD	110,462.19	284,903.67	0.68
13,000.00	KINDER MORGAN INC	USD	197,856.03	205,187.84	0.49
Servizi di pubblica utilità			1,014,851.47	1,093,789.77	2.61
7,000.00	NEXTERA ENERGY INC	USD	437,690.93	476,076.85	1.13
3,500.00	SOUTHERN CO	USD	228,666.31	225,366.57	0.54
2,500.00	DUKE ENERGY CORP	USD	203,804.41	205,636.97	0.49
5,000.00	EXELON CORP	USD	144,689.82	186,709.38	0.45
Beni di prima necessità			741,568.59	1,066,571.62	2.54
8,000.00	COCA-COLA CO	USD	353,546.16	441,576.40	1.05
2,500.00	PEPSICO INC	USD	257,086.96	424,427.00	1.01
3,000.00	MONDELEZ INTERNATIONAL INC -A-	USD	130,935.47	200,568.22	0.48
Materie prime			228,997.63	230,806.53	0.55
2,000.00	DUPONT DE NEMOURS INC	USD	128,218.13	130,962.38	0.31
1,000.00	STEEL DYNAMICS INC	USD	100,779.50	99,844.15	0.24
GIAPPONE			2,370,069.62	3,302,603.44	7.87
Beni voluttuari			686,571.93	945,442.59	2.25
20,000.00	TOYOTA MOTOR CORP	JPY	239,808.01	294,950.02	0.70
2,600.00	SONY CORP	JPY	202,957.90	219,788.81	0.52
9,000.00	MARUBENI CORP	JPY	46,508.39	141,745.33	0.34
4,000.00	YAMAHA MOTOR CO LTD	JPY	53,664.17	106,006.98	0.25
6,600.00	PANASONIC CORP	JPY	63,627.96	75,108.57	0.18
3,000.00	SEKISUI HOUSE LTD	JPY	40,916.58	56,142.60	0.14
1,500.00	UNICHARM CORP	JPY	39,088.92	51,700.28	0.12
Industria			603,673.44	842,010.98	2.01
300.00	SMC CORP	JPY	128,352.60	155,053.28	0.37
5,700.00	KOMATSU LTD	JPY	119,188.31	143,107.52	0.34
2,100.00	OMRON CORP	JPY	107,805.73	119,524.20	0.29
2,000.00	HITACHI LTD	JPY	76,734.98	114,796.50	0.27
1,000.00	SCREEN HOLDINGS CO LTD	JPY	42,259.33	105,810.39	0.25
200.00	KEYENCE CORP	JPY	35,904.01	88,301.10	0.21

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

NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
5,000.00	MITSUBISHI ELECTRIC CORP	JPY	56,130.38	64,811.64	0.16
1,200.00	YASKAWA ELECTRIC CORP	JPY	37,298.10	50,606.35	0.12
Informatica			481,950.58	796,103.77	1.90
2,400.00	TOKYO ELECTRON LTD	JPY	190,884.25	325,250.41	0.78
1,400.00	ADVANTEST CORP	JPY	80,438.37	180,096.44	0.43
8,900.00	RENESAS ELECTRONICS CORP	JPY	91,643.90	158,033.85	0.38
1,700.00	FUJIFILM HOLDINGS CORP	JPY	58,648.69	93,836.09	0.22
3,000.00	SUMCO CORP	JPY	60,335.37	38,886.98	0.09
Salute			375,423.56	376,271.82	0.90
13,700.00	ASTELLAS PHARMA INC	JPY	201,904.49	186,315.38	0.44
2,200.00	SYSMEX CORP	JPY	128,209.12	137,744.39	0.33
1,800.00	TERUMO CORP	JPY	45,309.95	52,212.05	0.13
Materie prime			80,498.34	173,139.66	0.41
5,500.00	SHIN-ETSU CHEMICAL CO LTD	JPY	80,498.34	173,139.66	0.41
Finanza			83,342.13	97,935.96	0.23
2,900.00	NOMURA REAL ESTATE HOLDINGS INC	JPY	49,434.95	63,025.19	0.15
2,000.00	DAI-ICHI LIFE HOLDINGS INC	JPY	33,907.18	34,910.77	0.08
Beni di prima necessità			58,609.64	71,698.66	0.17
2,000.00	ASAHI GROUP HOLDINGS LTD	JPY	58,609.64	71,698.66	0.17
IRLANDA			1,056,333.75	1,296,181.09	3.09
Informatica			626,942.17	791,955.76	1.89
2,800.00	ACCENTURE PLC -A-	USD	626,942.17	791,955.76	1.89
Materie prime			201,016.57	261,970.59	0.62
750.00	LINDE PLC	USD	201,016.57	261,970.59	0.62
Salute			228,375.01	242,254.74	0.58
3,000.00	MEDTRONIC PLC	USD	228,375.01	242,254.74	0.58
Azioni di OICR			1,539,804.12	1,753,715.19	4.18
LUSSEMBURGO			730,375.31	908,282.52	2.17
Finanza			730,375.31	908,282.52	2.17
63,000.00	LYXOR FTSE 100 UCITS ETF	GBP	730,375.31	908,282.52	2.17
IRLANDA			639,772.64	681,032.67	1.62
Finanza			639,772.64	681,032.67	1.62
79,600.00	ISHARES CORE FTSE 100 UCITS ETF	GBP	639,772.64	681,032.67	1.62
FRANCIA			169,656.17	164,400.00	0.39
Finanza			169,656.17	164,400.00	0.39
15,000.00	LYXOR MSCI EMERGING MARKETS UCITS ETF	EUR	169,656.17	164,400.00	0.39
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

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

NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)**PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR**

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
QUOTE DI OICR			247,179.74	256,670.60	0.61
Azioni di OICR			247,179.74	256,670.60	0.61
IRLANDA			247,179.74	256,670.60	0.61
Finanza			247,179.74	256,670.60	0.61
30,000.00	ISHARES PLC - ISHARES CORE FTSE 100 UCITS ETF	GBP	247,179.74	256,670.60	0.61
Totale del Portafoglio Titoli			28,466,459.81	38,747,035.49	92.32

** Inadempiente / delistata

NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)

IMPEGNI SU ACQUISTO / VENDITA DI CONTRATTI FUTURES AL 30 GIUGNO 2023

Valore nominale	Quantità	Acquisto / Vendita	Contratto	Scadenza	Valore di mercato al 30 Giugno 2023	Valuta	Plus/(minus) valenza non realizzata (EUR)	Impegno (EUR)
							206,956.54	41,673,379.16
125,000	250	Acquisto	EURO FX CURRENCY	18/09/2023	1.00	USD	153,442.89	31,373,157.10
125,000	28	Acquisto	EURO/JPY	18/09/2023	0.99	JPY	104,890.85	3,466,756.65
125,000	15	Acquisto	EURO/GBP	18/09/2023	1.01	GBP	5,462.38	1,884,520.53
10	10	Acquisto	SWISS MARKET INDEX	15/09/2023	11,604.78	CHF	-450.79	1,160,477.83
10	8	Acquisto	FTSE 100 INDEX	15/09/2023	8,788.17	GBP	-7,924.09	703,053.25
50	-15	Vendita	S&P500 EMINI	15/09/2023	4,113.88	USD	-48,464.70	3,085,413.80

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Attività

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	10,380,664.98
Liquidità bancarie a vista		562,449.83
Importi dovuti dai broker		77,257.13
Interessi da ricevere		63,033.87
Da ricevere su sottoscrizioni		30,900.73
Altre attività		5,176.31
Totale attività		11,119,482.85

Passività

Da pagare su rimborsi		-1,406.64
Altre passività		-34,481.96
Totale passività		-35,888.60

Totale attivo netto**11,083,594.25**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	128.54	2,805.785
Azione D	EUR	89.69	583.158
Azione I	EUR	134.17	65,091.273
Azione L	EUR	132.05	14,651.000
Azione Y	EUR	132.30	21.122

NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term

PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Attivo netto all'inizio del periodo		10,542,191.59
Risultato netto degli investimenti		105,129.62
Altri ricavi		10.90
Totale ricavi		105,140.52
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-18,024.28
Commissione di consulenza	(Nota 6)	-7,817.48
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 8)	-3,002.37
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-972.75
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 8)	-10,846.94
Commissioni del Transfer Agent		-1,515.90
Compensi professionali	(Nota 9)	-5,133.10
Pubblicazioni		-200.49
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-8,829.61
Totale costi		-56,342.92
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		48,797.60
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita - di titoli	(Nota 2b)	-108,569.71
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata - sugli investimenti		174,770.08
Risultato netto delle operazioni per il periodo		114,997.97
Distribuzioni di dividendi	(Nota 14)	-263.71
Sottoscrizioni del periodo		643,646.55
Rimborsi del periodo		-216,978.15
Attivo netto alla fine del periodo		11,083,594.25

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

NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			10,625,207.73	10,380,664.98	93.66
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			10,625,207.73	10,380,664.98	93.66
Obbligazioni ordinarie			5,768,965.47	5,602,350.34	50.55
GERMANIA			1,402,050.07	1,386,990.87	12.51
Enti Governativi			1,152,499.29	1,140,552.37	10.29
896,000.00	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 0.25% 15/02/2027	EUR	832,220.32	820,942.08	7.41
331,000.00	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0.40% 13/09/2024	EUR	320,278.97	319,610.29	2.88
Salute			249,550.78	246,438.50	2.22
150,000.00	BAYER AG 4.00% 26/08/2026	EUR	149,960.96	150,151.50	1.35
100,000.00	BAYER AG 0.38% 06/07/2024	EUR	99,589.82	96,287.00	0.87
ITALIA			1,114,182.71	1,030,355.40	9.30
Finanza			1,114,182.71	1,030,355.40	9.30
400,000.00	CASSA DEPOSITI E PRESTITI SPA 2.13% 21/03/2026	EUR	441,208.42	383,640.00	3.46
300,000.00	CASSA DEPOSITI E PRESTITI SPA 2.13% 27/09/2023	EUR	310,028.37	299,229.00	2.70
160,000.00	INTESA SANPAOLO SPA 0.75% 04/12/2024	EUR	163,510.18	152,286.40	1.38
100,000.00	AMCO - ASSET MANAGEMENT CO SPA 1.50% 17/07/2023	EUR	99,791.90	99,949.00	0.90
100,000.00	BANCA DEL MEZZOGIORNO-MEDIO CREDITO CENTRALE SPA 1.50% 24/10/2024	EUR	99,643.84	95,251.00	0.86
SPAGNA			1,037,687.64	1,002,631.98	9.05
Enti Governativi			1,037,687.64	1,002,631.98	9.05
600,000.00	FONDO DE TITULIZACION DEL DEFICIT DEL SISTEMA ELECTRICO FTA 0.85% 17/12/2023	EUR	622,507.40	591,462.00	5.34
453,000.00	SPAIN GOVERNMENT BOND 0.80% 30/07/2027	EUR	415,180.24	411,169.98	3.71
PORTOGALLO			964,894.59	959,693.06	8.66
Enti Governativi			964,894.59	959,693.06	8.66
528,000.00	PORTUGAL OBRIGACOES DO TESOURO OT 5.65% 15/02/2024	EUR	539,286.70	535,534.56	4.83
425,000.00	PORTUGAL OBRIGACOES DO TESOURO OT 2.88% 21/07/2026	EUR	425,607.89	424,158.50	3.83
FRANCIA			786,974.27	771,694.00	6.96
Finanza			604,165.18	592,508.00	5.34
500,000.00	AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT EPIC 0.13% 15/11/2023	EUR	504,336.26	493,260.00	4.45
100,000.00	BANQUE STELLANTIS FRANCE SACA 3.88% 19/01/2026	EUR	99,828.92	99,248.00	0.89
Enti Governativi			182,809.09	179,186.00	1.62
200,000.00	CAISSE FRANCAISE DE FINANCEMENT LOCAL 1.13% 12/06/2028	EUR	182,809.09	179,186.00	1.62
PAESI BASSI			463,176.19	450,985.03	4.07
Industria			299,789.86	293,053.00	2.64
200,000.00	ABB FINANCE BV 0.63% 31/03/2024	EUR	200,015.97	195,260.00	1.76
100,000.00	SIEMENS ENERGY FINANCE BV 4.00% 05/04/2026	EUR	99,773.89	97,793.00	0.88
Finanza			99,935.96	99,158.00	0.90
100,000.00	ABN AMRO BANK NV 3.75% 20/04/2025	EUR	99,935.96	99,158.00	0.90
Servizi di pubblica utilità			63,450.37	58,774.03	0.53
59,000.00	INNOGY FINANCE BV 3.00% 17/01/2024	EUR	63,450.37	58,774.03	0.53
Obbligazioni a tasso variabile			1,312,719.05	1,327,908.96	11.98
ITALIA			1,012,374.94	1,028,008.96	9.27
Enti Governativi			785,422.66	805,920.00	7.27
800,000.00	CCT FRN 15/09/2025	EUR	785,422.66	805,920.00	7.27

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

NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Finanza			226,952.28	222,088.96	2.00
127,000.00	ICCREA BANCA SPA FRN 20/10/2025	EUR	126,973.30	122,615.96	1.10
100,000.00	FINECOBANK BANCA FINECO SPA FRN 23/02/2029	EUR	99,978.98	99,473.00	0.90
FRANCIA			200,276.10	200,138.00	1.81
Finanza			100,121.05	100,076.00	0.91
100,000.00	SOCIETE GENERALE SA FRN 13/01/2025	EUR	100,121.05	100,076.00	0.91
Industria			100,155.05	100,062.00	0.90
100,000.00	CIE DE SAINT-GOBAIN FRN 18/07/2024	EUR	100,155.05	100,062.00	0.90
STATI UNITI			100,068.01	99,762.00	0.90
Finanza			100,068.01	99,762.00	0.90
100,000.00	BANK OF AMERICA CORP FRN 22/09/2026	EUR	100,068.01	99,762.00	0.90
Obbligazioni zero coupon			2,926,564.15	2,836,886.00	25.59
ITALIA			901,923.11	875,656.98	7.90
Enti Governativi			751,597.50	739,120.98	6.67
751,597.50	BTP 0.00% 22/11/2028	EUR	751,597.50	739,120.98	6.67
Servizi di pubblica utilità			150,325.61	136,536.00	1.23
150,000.00	ACEA SPA 0.00% 28/09/2025	EUR	150,325.61	136,536.00	1.23
SPAGNA			818,689.95	787,897.22	7.11
Enti Governativi			818,689.95	787,897.22	7.11
574,000.00	SPAIN GOVERNMENT BOND 0.00% 31/05/2025	EUR	539,503.68	537,705.98	4.85
276,000.00	INSTITUTO DE CREDITO OFICIAL 0.00% 30/04/2026	EUR	279,186.27	250,191.24	2.26
FRANCIA			552,393.39	534,742.00	4.82
Enti Governativi			349,252.17	346,792.00	3.13
400,000.00	AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT EPIC 0.00% 28/10/2027	EUR	349,252.17	346,792.00	3.13
Finanza			203,141.22	187,950.00	1.69
200,000.00	AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT EPIC REG 0.00% 25/03/2025	EUR	203,141.22	187,950.00	1.69
GERMANIA			453,585.74	445,465.80	4.02
Enti Governativi			453,585.74	445,465.80	4.02
340,000.00	BUNDESobligation 0.00% 11/04/2025	EUR	321,277.35	321,606.00	2.90
135,000.00	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 0.00% 15/08/2026	EUR	132,308.39	123,859.80	1.12
CINA			199,971.96	193,124.00	1.74
Finanza			199,971.96	193,124.00	1.74
200,000.00	BANK OF CHINA LTD 0.00% 28/04/2024	EUR	199,971.96	193,124.00	1.74
Azioni di OICR			616,959.06	613,519.68	5.54
LUSSEMBURGO			474,763.28	479,883.58	4.33
Finanza			474,763.28	479,883.58	4.33
2,437.30	CB-ACCENT LUX - SWAN SHORT-TERM HIGH YIELD -A-	EUR	310,000.06	313,461.02	2.83
1,626.81	EURIZON FUND - SECURITIZED BOND FUND -Z-	EUR	164,763.22	166,422.56	1.50
IRLANDA			142,195.78	133,636.10	1.21
Finanza			142,195.78	133,636.10	1.21
31,863.64	TENDERCAPITAL BOND TWO STEPS FUND -IA-	EUR	142,195.78	133,636.10	1.21
Totale del Portafoglio Titoli			10,625,207.73	10,380,664.98	93.66

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 2023 IN EUR****Attività**

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	101,580,329.56
Liquidità bancarie a vista		2,186,336.79
Importi dovuti dai broker		4,662,337.35
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	(Note 2c, 13)	346,494.30
Utili non realizzati su contratti futures	(Note 2d, 13)	124,548.33
Interessi da ricevere		1,084,189.04
Da ricevere su sottoscrizioni		71,961.25
Altre attività		10,431.75
Totale attività		110,066,628.37

Passività

Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	(Note 2c, 13)	-427,630.26
Perdite non realizzate su contratti futures	(Note 2d, 13)	-586,809.00
Da pagare su rimborsi		-50,612.10
Altre passività		-360,362.74
Totale passività		-1,425,414.10

Totale attivo netto**108,641,214.27**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	151.36	303,867.774
Azione A (H-USD)	USD	105.03	14,835.036
Azione D	EUR	84.15	161,442.100
Azione I	EUR	160.43	296,694.569
Azione L	EUR	158.21	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 2023 IN EUR**

Attivo netto all'inizio del periodo		115,311,368.44
Risultato netto degli investimenti		1,811,203.51
Altri ricavi		32.59
Totale ricavi		1,811,236.10
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-533,802.28
Commissione di consulenza	(Nota 6)	-9,662.21
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 8)	-30,844.83
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-17,420.71
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 8)	-32,854.17
Commissioni del Transfer Agent		-4,774.27
Compensi professionali	(Nota 9)	-10,930.84
Pubblicazioni		-7,810.46
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-24,445.29
Totale costi		-672,545.06
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		1,138,691.04
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	-2,695,930.13
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		585,301.10
- di contratti di opzioni		-47,740.29
- di contratti futures		62,449.77
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		3,623,877.66
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(Nota 2c)	-668,187.32
- su contratti futures	(Nota 2d)	-238,332.70
Risultato netto delle operazioni per il periodo		1,760,129.13
Distribuzioni di dividendi	(Nota 14)	-358,735.09
Sottoscrizioni del periodo		12,226,232.87
Rimborsi del periodo		-20,297,781.08
Attivo netto alla fine del periodo		108,641,214.27

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

NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			103,935,182.59	101,580,329.56	93.50
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			100,898,590.98	98,729,862.25	90.88
Obbligazioni ordinarie			44,103,339.80	43,922,575.89	40.43
ITALIA			20,215,708.61	19,713,601.73	18.15
Enti Governativi			17,421,608.33	16,999,290.78	15.65
7,503,375.00	BTP 0.40% 11/04/2024	EUR	7,658,303.53	7,489,868.93	6.89
7,000,000.00	BTP 0.90% 01/04/2031	EUR	5,921,000.00	5,637,100.00	5.19
3,500,000.00	REPUBLIC OF ITALY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.25% 17/02/2026	USD	2,843,464.80	2,867,111.85	2.64
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	1,005,210.00	0.93
Finanza			2,272,850.28	2,239,580.95	2.06
2,000,000.00	INTESA SANPAOLO SPA 6.63% 31/05/2033	GBP	2,272,850.28	2,239,580.95	2.06
Industria			521,250.00	474,730.00	0.44
500,000.00	LEONARDO SPA 2.38% 08/01/2026	EUR	521,250.00	474,730.00	0.44
GERMANIA			12,856,480.00	12,839,320.00	11.82
Enti Governativi			12,856,480.00	12,839,320.00	11.82
13,000,000.00	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 2.50% 13/03/2025	EUR	12,856,480.00	12,839,320.00	11.82
LUSSEMBURGO			4,299,953.37	4,439,972.63	4.09
Sovranazionale			2,916,639.89	3,482,661.99	3.21
20,000,000.00	INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT 5.00% 22/01/2026	BRL	2,916,639.89	3,482,661.99	3.21
Finanza			1,383,313.48	957,310.64	0.88
5,420,512.50	SWISS INSURED BRAZIL POWER FINANCE SARL 9.85% 16/07/2032	BRL	1,383,313.48	957,310.64	0.88
STATI UNITI			2,695,845.20	2,579,366.29	2.37
Enti Governativi			2,304,925.59	2,158,610.92	1.99
1,157,050.00	UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BOND 0.13% 15/04/2026	USD	1,097,748.53	993,718.12	0.91
450,000.00	UNITED STATES TREASURY NOTE 1.38% 31/01/2025	USD	403,778.07	388,925.97	0.36
450,000.00	UNITED STATES TREASURY NOTE 1.00% 15/12/2024	USD	401,665.97	388,152.59	0.36
450,000.00	UNITED STATES TREASURY NOTE 1.13% 15/01/2025	USD	401,733.02	387,814.24	0.36
Sovranazionale			247,514.65	284,513.80	0.26
1,200,000,000.00	INTERNATIONAL FINANCE CORP. 12.00% 03/11/2027	COP	247,514.65	284,513.80	0.26
Industria			143,404.96	136,241.57	0.12
148,374.01	US AIRWAYS 2011-1 CLASS A PASS THROUGH TRUST 7.13% 22/10/2023	USD	143,404.96	136,241.57	0.12
REGNO UNITO			1,503,027.67	1,776,102.13	1.63
Sovranazionale			1,503,027.67	1,776,102.13	1.63
10,000,000.00	EUROPEAN BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT 5.00% 27/01/2025	BRL	1,503,027.67	1,776,102.13	1.63
HONG KONG			1,024,641.13	1,075,677.03	0.99
Materie prime			1,024,641.13	1,075,677.03	0.99
1,200,000.00	CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 4.88% 14/03/2025	USD	1,024,641.13	1,075,677.03	0.99
CINA			641,565.82	632,372.08	0.58
Sovranazionale			641,565.82	632,372.08	0.58
5,000,000.00	ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.90% 05/03/2024	CNY	641,565.82	632,372.08	0.58

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

NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
PAESI BASSI			466,750.00	468,520.00	0.43
Servizi di pubblica utilità			466,750.00	468,520.00	0.43
500,000.00	TENNET HOLDING BV 2.13% 17/11/2029	EUR	466,750.00	468,520.00	0.43
SVEZIA			399,368.00	397,644.00	0.37
Servizi di pubblica utilità			399,368.00	397,644.00	0.37
400,000.00	VATTENFALL AB 3.25% 18/04/2024	EUR	399,368.00	397,644.00	0.37
Obbligazioni a tasso variabile			34,504,997.07	32,847,174.42	30.24
ITALIA			14,401,997.08	13,799,592.00	12.70
Finanza			12,111,997.08	11,607,297.00	10.68
3,500,000.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA FRN 27/10/2047	EUR	3,539,681.25	3,528,560.00	3.25
2,000,000.00	UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA FRN 31/12/2049	EUR	1,988,235.60	1,979,340.00	1.82
1,900,000.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA FRN 30/11/2049	EUR	2,084,790.23	1,850,277.00	1.70
2,000,000.00	UNICREDIT SPA REG FRN 15/01/2032	EUR	2,000,000.00	1,750,880.00	1.61
1,000,000.00	BANCO BPM SPA FRN 14/06/2028	EUR	999,550.00	994,570.00	0.92
1,000,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 20/02/2034	EUR	1,000,000.00	991,140.00	0.91
500,000.00	UNICREDIT SPA FRN 15/11/2027	EUR	499,740.00	512,530.00	0.47
Energia			1,790,000.00	1,687,840.00	1.55
2,000,000.00	ENI SPA FRN 31/12/2099	EUR	1,790,000.00	1,687,840.00	1.55
Servizi di pubblica utilità			500,000.00	504,455.00	0.47
500,000.00	ENEL SPA FRN 31/12/2099	EUR	500,000.00	504,455.00	0.47
FRANCIA			5,414,029.61	4,996,780.64	4.60
Finanza			5,414,029.61	4,996,780.64	4.60
2,000,000.00	BNP PARIBAS SA FRN 23/01/2027	EUR	1,888,400.00	1,875,460.00	1.73
1,800,000.00	BNP PARIBAS SA FRN 31/12/2099	USD	1,587,790.80	1,308,291.07	1.20
1,000,000.00	BNP PARIBAS SA FRN 25/07/2028	EUR	1,002,910.00	931,160.00	0.86
1,000,000.00	CREDIT AGRICOLE SA FRN 31/12/2099	USD	934,928.81	881,869.57	0.81
REGNO UNITO			3,076,146.22	2,968,196.42	2.73
Finanza			1,739,545.72	1,647,495.64	1.52
1,000,000.00	VIRGIN MONEY UK PLC FRN 24/06/2025	EUR	1,044,330.00	969,070.00	0.89
600,000.00	NATWEST GROUP PLC FRN 06/06/2033	GBP	695,215.72	678,425.64	0.63
Energia			1,336,600.50	1,320,700.78	1.21
1,500,000.00	BP CAPITAL MARKETS PLC FRN 31/12/2099	USD	1,336,600.50	1,320,700.78	1.21
GERMANIA			3,159,543.72	2,832,903.69	2.61
Finanza			1,671,483.72	1,440,393.69	1.33
1,000,000.00	ALLIANZ SE FRN 31/12/2099	USD	848,463.48	761,017.18	0.70
1,000,000.00	ALLIANZ SE FRN 31/12/2099	USD	823,020.24	679,376.51	0.63
Salute			1,488,060.00	1,392,510.00	1.28
1,500,000.00	BAYER AG FRN 25/03/2082	EUR	1,488,060.00	1,392,510.00	1.28
STATI UNITI			2,000,000.00	1,845,540.00	1.70
Servizi di telecomunicazione			2,000,000.00	1,845,540.00	1.70
2,000,000.00	AT&T INC FRN 31/12/2099	EUR	2,000,000.00	1,845,540.00	1.70
PAESI BASSI			1,874,366.37	1,749,254.89	1.61
Finanza			1,184,366.37	1,081,734.89	1.00
3,000,000.00	AEGON NV FRN 29/06/2049	NLG	1,184,366.37	1,081,734.89	1.00
Beni voluttuari			690,000.00	667,520.00	0.61
800,000.00	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN 31/12/2099	EUR	690,000.00	667,520.00	0.61

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

NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
SVIZZERA			1,241,500.00	1,353,530.00	1.25
Finanza			1,241,500.00	1,353,530.00	1.25
1,000,000.00	CREDIT SUISSE GROUP AG FRN 14/01/2028	EUR	767,000.00	860,800.00	0.79
500,000.00	UBS GROUP AG FRN 16/01/2026	EUR	474,500.00	492,730.00	0.46
IRLANDA			1,016,600.00	1,016,720.00	0.93
Finanza			1,016,600.00	1,016,720.00	0.93
1,000,000.00	BANK OF IRELAND GROUP PLC FRN 01/03/2033	EUR	1,016,600.00	1,016,720.00	0.93
SPAGNA			1,008,000.00	995,780.00	0.92
Finanza			1,008,000.00	995,780.00	0.92
1,000,000.00	BANCO DE SABADELL SA FRN 08/09/2026	EUR	1,008,000.00	995,780.00	0.92
DANIMARCA			946,819.32	865,325.12	0.80
Finanza			946,819.32	865,325.12	0.80
1,000,000.00	DANSKE BANK A/S FRN 31/12/2099	USD	946,819.32	865,325.12	0.80
AUSTRALIA			365,994.75	423,551.66	0.39
Finanza			365,994.75	423,551.66	0.39
500,000.00	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD FRN 29/10/2049	USD	365,994.75	423,551.66	0.39
Obbligazioni zero coupon			22,290,254.11	21,960,111.94	20.21
ITALIA			20,017,358.89	19,734,258.92	18.17
Enti Governativi			20,017,358.89	19,734,258.92	18.17
10,900,000.00	BTP 0.00% 01/08/2026	EUR	10,066,776.57	9,728,250.00	8.96
5,007,250.00	BTP 0.00% 14/03/2028	EUR	5,007,250.00	5,043,802.93	4.64
5,014,710.00	BTP 0.00% 26/05/2025	EUR	4,943,332.32	4,962,205.99	4.57
SPAGNA			1,894,263.62	1,873,540.00	1.72
Enti Governativi			1,894,263.62	1,873,540.00	1.72
2,000,000.00	SPAIN GOVERNMENT BOND 0.00% 31/05/2025	EUR	1,894,263.62	1,873,540.00	1.72
FILIPPINE			200,435.44	187,278.19	0.17
Sovranazionale			200,435.44	187,278.19	0.17
20,000,000.00	ASIAN DEVELOPMENT BANK 0.00% 20/04/2043	MXN	200,435.44	187,278.19	0.17
COSTA D'AVORIO			178,196.16	165,034.83	0.15
Sovranazionale			178,196.16	165,034.83	0.15
40,000,000.00	AFRICAN DEVELOPMENT BANK 0.00% 03/02/2053	MXN	178,196.16	165,034.83	0.15
NEGOZIATI SU UN ALTRO MERCATO REGOLAMENTATO			1,452,294.36	1,479,102.02	1.36
Obbligazioni ordinarie			1,452,294.36	1,479,102.02	1.36
FRANCIA			923,220.10	931,594.58	0.86
Servizi di pubblica utilità			923,220.10	931,594.58	0.86
1,000,000.00	ELECTRICITE DE FRANCE SA 6.25% 23/05/2033	USD	923,220.10	931,594.58	0.86
STATI UNITI			529,074.26	547,507.44	0.50
Beni voluttuari			529,074.26	547,507.44	0.50
628,075.08	US AIRWAYS 2012-2 CLASS A PASS THROUGH TRUST 4.63% 03/06/2025	USD	529,074.26	547,507.44	0.50

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

NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond**PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR**

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
ALTRI VALORI MOBILIARI			1,584,297.25	1,371,365.29	1.26
Obbligazioni a tasso variabile			1,584,297.25	1,371,365.29	1.26
ITALIA			1,584,297.25	1,371,365.29	1.26
Finanza			1,584,297.25	1,371,365.29	1.26
2,000,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 01/06/2032	USD	1,584,297.25	1,371,365.29	1.26
Totale del Portafoglio Titoli			103,935,182.59	101,580,329.56	93.50

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 2023

Valore nominale	Quantità	Acquisto / Vendita	Contratto	Scadenza	Valore di mercato al 30 Giugno 2023	Valuta	Plus/(minus) valenza non realizzata (EUR)	Impegno (EUR)
							-462,260.67	77,787,211.09
100,000	-59	Vendita	US 10YR NOTE (CBT)	20/09/2023	102.90	USD	76,048.33	6,071,191.41
100,000	-50	Vendita	EURO BOBL	07/09/2023	115.71	EUR	48,500.00	5,785,500.00
100,000	50	Acquisto	US 5YR NOTE (CBT)	29/09/2023	98.16	USD	-63,015.56	4,908,053.02
100,000	116	Acquisto	EURO SCHATZ	07/09/2023	104.85	EUR	-67,860.00	12,162,600.00
100,000	100	Acquisto	SHORT EURO BTP	07/09/2023	104.65	EUR	-96,000.00	10,465,000.00
200,000	206	Acquisto	US 2YR NOTE (CBT)	29/09/2023	93.19	USD	-359,933.44	38,394,866.66

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond

CONTRATTI FINANZIARI A TERMINE AL 30 GIUGNO 2023

Scadenza	Ammontare comprato	Valuta comprata	Ammontare venduto	Valuta venduta	Plus/(minus)-valenza non realizzata (EUR)
					-81,135.96
17/07/2023	220,000.00	USD	201,872.94	EUR	-339.66
17/07/2023	1,000,000.00	USD	920,361.15	EUR	-4,300.81
17/07/2023	1,000,000.00	USD	921,650.49	EUR	-5,590.15
17/07/2023	900,000.00	EUR	992,880.00	USD	-9,537.99
17/07/2023	800,000.00	USD	744,140.78	EUR	-11,292.51
20/09/2023	1,559,000.00	USD	1,447,350.38	EUR	-23,848.98
17/07/2023	2,298,584.52	EUR	2,000,000.00	GBP	-30,719.26
17/07/2023	947,546.53	EUR	840,000.00	GBP	-30,761.06
05/07/2023	993,541.98	USD	5,000,000.00	BRL	-39,141.11
20/12/2023	5,915,379.99	USD	29,500,000.00	BRL	-39,279.43
05/07/2023	4,823,594.27	USD	24,500,000.00	BRL	-232,819.30
17/07/2023	27,938,387.53	EUR	30,200,000.00	USD	273,365.20
05/07/2023	29,500,000.00	BRL	6,077,461.89	USD	33,348.53
17/07/2023	940,000.00	USD	847,029.99	EUR	14,066.73
17/07/2023	1,000,000.00	USD	907,751.23	EUR	8,309.11
17/07/2023	2,000,000.00	USD	1,824,276.89	EUR	7,843.79
17/07/2023	170,000.00	GBP	192,016.69	EUR	5,974.13
17/07/2023	1,000,000.00	USD	912,473.53	EUR	3,586.81

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Attività

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	55,987,324.69
Liquidità bancarie a vista		1,535,410.39
Importi dovuti dai broker		332,608.68
Interessi da ricevere		418,208.87
Da ricevere su sottoscrizioni		161,946.26
Altre attività		8,840.82
Totale attività		58,444,339.71

Passività

Da pagare su rimborsi		-8,551.05
Altre passività		-117,064.37
Totale passività		-125,615.42

Totale attivo netto**58,318,724.29**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	126.24	16,018.698
Azione D	EUR	103.48	2,200.759
Azione I	EUR	135.03	399,005.969
Azione L	EUR	133.07	16,452.000
Azione Y	EUR	131.72	21.180

NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate

PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Attivo netto all'inizio del periodo		61,241,930.32
Risultato netto degli investimenti		597,360.48
Altri ricavi		186.11
Totale ricavi		597,546.59
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-135,648.22
Commissione di consulenza	(Nota 6)	-8,482.52
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 8)	-15,991.63
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-3,785.72
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 8)	-16,132.48
Commissioni del Transfer Agent		-3,752.26
Compensi professionali	(Nota 9)	-7,760.68
Pubblicazioni		-1,185.01
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-15,944.17
Totale costi		-208,682.69
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		388,863.90
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	-593,190.29
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		1,533,623.22
Risultato netto delle operazioni per il periodo		1,329,296.83
Distribuzioni di dividendi	(Nota 14)	-47,862.72
Sottoscrizioni del periodo		3,832,520.55
Rimborsi del periodo		-8,037,160.69
Attivo netto alla fine del periodo		58,318,724.29

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

NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			60,194,077.91	55,987,324.69	96.00
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			57,494,077.92	53,532,817.37	91.79
Obbligazioni ordinarie			41,713,620.70	37,697,316.96	64.64
ITALIA			12,111,273.31	10,735,788.00	18.41
Finanza			3,455,486.85	3,322,559.00	5.70
1,000,000.00	BANCA DEL MEZZOGIORNO-MEDIOCREDITO CENTRALE SPA 1.50% 24/10/2024	EUR	995,790.16	952,510.00	1.63
800,000.00	ANIMA HOLDING SPA 1.50% 22/04/2028	EUR	714,801.01	682,336.00	1.17
700,000.00	BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA REG 2.63% 28/04/2025	EUR	654,544.71	656,383.00	1.13
500,000.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA 2.43% 14/07/2031	EUR	416,366.48	415,970.00	0.71
400,000.00	BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA 3.63% 24/09/2024	EUR	424,569.76	389,080.00	0.67
250,000.00	INTESA SANPAOLO SPA 0.63% 24/02/2026	EUR	249,414.73	226,280.00	0.39
Servizi di pubblica utilità			3,080,734.57	2,750,595.00	4.72
1,500,000.00	A2A SPA 1.63% 19/10/2027	EUR	1,629,367.48	1,375,185.00	2.36
1,000,000.00	ERG SPA 1.88% 11/04/2025	EUR	1,023,400.97	960,860.00	1.65
500,000.00	SNAM SPA 0.75% 20/06/2029	EUR	427,966.12	414,550.00	0.71
Industria			2,844,183.47	2,144,340.00	3.68
1,500,000.00	POSTE ITALIANE SPA 0.50% 10/12/2028	EUR	1,485,850.10	1,233,240.00	2.11
500,000.00	WEBUILD SPA 5.88% 15/12/2025	EUR	472,689.00	493,445.00	0.85
500,000.00	NEXI SPA 2.13% 30/04/2029	EUR	403,661.40	417,655.00	0.72
507,600.00	ENERTRONICA SPA 7.00% 31/12/2022*	EUR	481,982.97	0.00	0.00
Energia			1,498,610.20	1,266,990.00	2.17
1,500,000.00	ENI SPA 0.38% 14/06/2028	EUR	1,498,610.20	1,266,990.00	2.17
Enti Governativi			1,133,128.58	1,152,480.00	1.97
1,200,000.00	BTP 3.00% 01/08/2029	EUR	1,133,128.58	1,152,480.00	1.97
Servizi di telecomunicazione			99,129.64	98,824.00	0.17
100,000.00	TELECOM ITALIA SPA/MILANO 4.00% 11/04/2024	EUR	99,129.64	98,824.00	0.17
FRANCIA			8,374,432.82	7,786,824.00	13.35
Beni voluttuari			3,719,626.24	3,494,361.00	5.99
1,500,000.00	PERNOD RICARD SA 1.38% 07/04/2029	EUR	1,429,973.77	1,336,665.00	2.29
1,400,000.00	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE 0.13% 11/02/2028	EUR	1,269,124.44	1,217,986.00	2.09
1,000,000.00	RENAULT SA 1.00% 28/11/2025	EUR	1,020,528.03	939,710.00	1.61
Industria			3,000,487.11	2,641,449.00	4.53
1,700,000.00	THALES SA REG 0.25% 29/01/2027	EUR	1,703,271.04	1,494,997.00	2.57
700,000.00	CIE DE SAINT-GOBAIN 1.38% 14/06/2027	EUR	754,286.99	642,950.00	1.10
600,000.00	SCHNEIDER ELECTRIC SE 0.25% 11/03/2029	EUR	542,929.08	503,502.00	0.86
Finanza			1,654,319.47	1,651,014.00	2.83
1,300,000.00	CREDIT AGRICOLE ASSURANCES SA 2.00% 17/07/2030	EUR	1,058,341.17	1,052,532.00	1.80
600,000.00	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 4.00% 21/11/2029	EUR	595,978.30	598,482.00	1.03
STATI UNITI			5,756,607.73	4,972,304.00	8.53
Beni voluttuari			2,937,453.52	2,495,332.00	4.28
1,300,000.00	MCDONALD'S CORP 1.88% 26/05/2027	EUR	1,459,276.49	1,212,198.00	2.08
800,000.00	AMERICAN HONDA FINANCE CORP 0.30% 07/07/2028	EUR	803,121.12	671,992.00	1.15
700,000.00	COMCAST CORP 0.25% 20/05/2027	EUR	675,055.91	611,142.00	1.05
Servizi di telecomunicazione			1,917,293.61	1,695,160.00	2.91
1,000,000.00	VERIZON COMMUNICATIONS INC 1.38% 02/11/2028	EUR	1,087,481.82	878,720.00	1.51
1,000,000.00	AT&T INC 0.80% 04/03/2030	EUR	829,811.79	816,440.00	1.40
Finanza			901,860.60	781,812.00	1.34
900,000.00	AMERICAN TOWER CORP 0.45% 15/01/2027	EUR	901,860.60	781,812.00	1.34

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

NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
PAESI BASSI			4,274,531.64	4,098,052.00	7.03
Finanza			3,327,462.96	3,166,427.00	5.43
1,500,000.00	NE PROPERTY BV 1.75% 23/11/2024	EUR	1,541,668.42	1,425,525.00	2.45
1,300,000.00	ABN AMRO BANK NV 4.25% 21/02/2030	EUR	1,308,603.74	1,289,912.00	2.21
500,000.00	EXOR NV 1.75% 18/01/2028	EUR	477,190.80	450,990.00	0.77
Beni voluttuari			505,402.08	501,310.00	0.86
500,000.00	STELLANTIS NV 4.38% 14/03/2030	EUR	505,402.08	501,310.00	0.86
Materie prime			441,666.60	430,315.00	0.74
500,000.00	AKZO NOBEL NV 1.63% 14/04/2030	EUR	441,666.60	430,315.00	0.74
GERMANIA			3,382,225.35	2,963,996.00	5.08
Beni voluttuari			1,572,492.75	1,304,912.00	2.24
1,400,000.00	VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 2.25% 01/10/2027	EUR	1,572,492.75	1,304,912.00	2.24
Salute			1,299,178.46	1,156,194.00	1.98
1,300,000.00	FRESENIUS SE & CO KGAA 0.38% 28/09/2026	EUR	1,299,178.46	1,156,194.00	1.98
Finanza			510,554.14	502,890.00	0.86
500,000.00	TALANX AG 4.00% 25/10/2029	EUR	510,554.14	502,890.00	0.86
REGNO UNITO			2,548,997.25	2,296,655.00	3.94
Materie prime			1,516,361.35	1,406,475.00	2.41
1,500,000.00	ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC 1.63% 11/03/2026	EUR	1,516,361.35	1,406,475.00	2.41
Energia			1,032,635.90	890,180.00	1.53
1,000,000.00	BP CAPITAL MARKETS PLC 0.83% 08/11/2027	EUR	1,032,635.90	890,180.00	1.53
SPAGNA			2,178,075.88	2,061,990.00	3.53
Finanza			2,178,075.88	2,061,990.00	3.53
1,000,000.00	BANKINTER SA 0.63% 06/10/2027	EUR	905,892.21	854,650.00	1.46
900,000.00	BANCO SANTANDER SA 2.13% 08/02/2028	EUR	833,039.08	809,280.00	1.39
400,000.00	BANCO DE SABADELL SA 5.63% 06/05/2026	EUR	439,144.59	398,060.00	0.68
LUSSEMBURGO			1,835,726.22	1,607,573.96	2.76
Industria			1,422,358.27	1,267,357.96	2.17
1,342,000.00	HEIDELBERGCEMENT FINANCE LUXEMBOURG SA 1.63% 07/04/2026	EUR	1,422,358.27	1,267,357.96	2.17
Finanza			413,367.95	340,216.00	0.59
400,000.00	GRAND CITY PROPERTIES SA 1.38% 03/08/2026	EUR	413,367.95	340,216.00	0.59
CANADA			992,897.00	910,740.00	1.56
Energia			992,897.00	910,740.00	1.56
1,000,000.00	TOTALENERGIES CAPITAL CANADA LTD 2.13% 18/09/2029	EUR	992,897.00	910,740.00	1.56
ISLANDA			258,853.50	263,394.00	0.45
Finanza			258,853.50	263,394.00	0.45
300,000.00	ARION BANKI HF 0.38% 14/07/2025	EUR	258,853.50	263,394.00	0.45
Obbligazioni a tasso variabile			14,771,584.83	14,826,588.41	25.42
ITALIA			8,261,506.84	8,255,944.41	14.16
Finanza			4,217,130.37	4,164,984.41	7.14
1,000,000.00	UNICREDIT SPA FRN 09/03/2026	EUR	983,493.24	994,280.00	1.70
900,000.00	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA FRN 10/09/2025	EUR	947,534.55	916,794.00	1.57
900,000.00	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA FRN 28/12/2024	EUR	908,463.24	905,508.00	1.55
400,000.00	CASSA DEPOSITI E PRESTITI SPA FRN 28/06/2026	EUR	415,766.24	414,000.00	0.71
350,000.00	ICCREA BANCA SPA FRN 20/10/2025	EUR	356,671.11	337,918.00	0.58

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

NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
300,000.00	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA FRN 30/10/2023	EUR	301,470.54	300,834.00	0.52
313,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 25/01/2027	EUR	303,731.45	295,650.41	0.51
Enti Governativi			2,084,742.87	2,101,140.00	3.61
1,500,000.00	CCT FRN 15/09/2025	EUR	1,499,739.89	1,511,100.00	2.59
600,000.00	ITALY CERTIFICATI DI CREDITO DEL TESORO/ CCTS-EU FRN 15/10/2030	EUR	585,002.98	590,040.00	1.02
Servizi di pubblica utilità			1,959,633.60	1,989,820.00	3.41
2,000,000.00	SNAM SPA FRN 02/08/2024	EUR	1,959,633.60	1,989,820.00	3.41
STATI UNITI			2,555,906.95	2,556,679.00	4.38
Finanza			1,471,833.50	1,470,770.00	2.52
1,000,000.00	GOLDMAN SACHS GROUP INC FRN 18/09/2025	EUR	984,138.50	981,170.00	1.68
500,000.00	GOLDMAN SACHS GROUP INC FRN 22/10/2025	EUR	487,695.00	489,600.00	0.84
Beni voluttuari			1,084,073.45	1,085,909.00	1.86
1,100,000.00	FORD MOTOR CREDIT CO LLC FRN 01/12/2024	EUR	1,084,073.45	1,085,909.00	1.86
FRANCIA			1,483,313.09	1,490,235.00	2.55
Beni voluttuari			1,483,313.09	1,490,235.00	2.55
1,500,000.00	RCI BANQUE SA FRN 12/03/2025	EUR	1,483,313.09	1,490,235.00	2.55
GERMANIA			1,004,401.60	1,002,660.00	1.72
Beni voluttuari			1,004,401.60	1,002,660.00	1.72
1,000,000.00	DAIMLER AG FRN 03/07/2024	EUR	1,004,401.60	1,002,660.00	1.72
MESSICO			991,266.35	997,380.00	1.71
Energia			991,266.35	997,380.00	1.71
1,000,000.00	PETROLEOS MEXICANOS FRN 24/08/2023	EUR	991,266.35	997,380.00	1.71
SPAGNA			475,190.00	523,690.00	0.90
Industria			475,190.00	523,690.00	0.90
500,000.00	CELLNEX TELECOM SA FRN 03/08/2027	EUR	475,190.00	523,690.00	0.90
Obbligazioni zero coupon			1,008,872.39	1,008,912.00	1.73
FRANCIA			1,008,872.39	1,008,912.00	1.73
Industria			1,008,872.39	1,008,912.00	1.73
1,200,000.00	VINCI SA 0.00% 27/11/2028	EUR	1,008,872.39	1,008,912.00	1.73
ALTRI VALORI MOBILIARI			400,000.00	377,467.18	0.65
Obbligazioni ordinarie			400,000.00	377,467.18	0.65
ITALIA			400,000.00	377,467.18	0.65
Servizi di pubblica utilità			400,000.00	377,467.18	0.65
400,000.00	INNOVATEC SPA 6.00% 30/09/2026	EUR	400,000.00	377,467.18	0.65
QUOTE DI OICR			2,299,999.99	2,077,040.14	3.56
Azioni di OICR			2,299,999.99	2,077,040.14	3.56
FRANCIA			2,299,999.99	2,077,040.14	3.56
Finanza			2,299,999.99	2,077,040.14	3.56
1.66	ELLIPSIS ASSET MANAGEMENT - ELLIPSIS EUROPEAN CONVERTIBLES FUND -I-	EUR	2,299,999.99	2,077,040.14	3.56
Totale del Portafoglio Titoli			60,194,077.91	55,987,324.69	96.00

* 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 2023 IN EUR****Attività**

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	58,395,652.26
Liquidità bancarie a vista		2,209,911.58
Importi dovuti dai broker		261,693.37
Interessi da ricevere		179,578.28
Altre attività		779.26
Totale attività		61,047,614.75

Passività

Da pagare su acquisto titoli		-121,942.70
Altre passività		-198,284.90
Totale passività		-320,227.60

Totale attivo netto**60,727,387.15**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	139.99	276,246.745
Azione D	EUR	138.32	5,758.299
Azione I	EUR	152.81	51,674.057
Azione L	EUR	150.80	88,618.000

NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative**PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR**

Attivo netto all'inizio del periodo		69,893,267.73
Risultato netto degli investimenti		360,224.29
Altri ricavi		14.85
Totale ricavi		360,239.14
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-298,904.49
Commissione di consulenza	(Nota 6)	-8,624.33
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 8)	-18,025.03
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-10,854.25
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 8)	-20,359.13
Commissioni del Transfer Agent		-2,040.76
Compensi professionali	(Nota 9)	-7,673.66
Pubblicazioni		-1,395.28
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-16,144.04
Totale costi		-384,020.97
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		-23,781.83
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	-299,872.62
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		57,118.74
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		2,678,047.21
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(Nota 2c)	8.42
Risultato netto delle operazioni per il periodo		2,411,519.92
Distribuzioni di dividendi	(Nota 14)	-9,068.68
Sottoscrizioni del periodo		399,450.95
Rimborsi del periodo		-11,967,782.77
Attivo netto alla fine del periodo		60,727,387.15

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

NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			58,601,857.88	58,395,652.26	96.16
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			57,063,113.34	56,822,927.26	93.57
Azioni			1,358,075.61	1,350,656.80	2.22
ITALIA			1,095,886.92	1,097,306.80	1.80
Informatica			470,017.63	440,774.80	0.73
29,000.00	EL.EN. SPA	EUR	348,074.93	318,710.00	0.53
1,067.00	SESA SPA	EUR	121,942.70	122,064.80	0.20
Industria			365,009.92	385,092.00	0.63
10,000.00	PRYSMIAN SPA	EUR	363,628.10	382,800.00	0.63
150.00	OFFICINA STELLARE SPA	EUR	818.18	1,620.00	0.00
40.00	FERVI SPA	EUR	563.64	672.00	0.00
Salute			259,550.28	268,720.00	0.44
8,000.00	AMPLIFON SPA	EUR	259,550.28	268,720.00	0.44
Beni voluttuari			1,309.09	2,720.00	0.00
400.00	POWERSOFT SPA	EUR	1,309.09	2,720.00	0.00
GERMANIA			262,188.69	253,350.00	0.42
Salute			262,188.69	253,350.00	0.42
5,000.00	BAYER AG REG	EUR	262,188.69	253,350.00	0.42
Obbligazioni ordinarie			24,700,540.70	23,462,344.22	38.64
ITALIA			6,716,379.23	6,604,242.00	10.88
Enti Governativi			3,678,095.48	3,732,400.00	6.15
3,300,000.00	BTP 1.65% 01/03/2032	EUR	2,743,178.53	2,772,000.00	4.57
1,000,000.00	BTP 3.00% 01/08/2029	EUR	934,916.95	960,400.00	1.58
Industria			931,560.40	922,139.00	1.52
800,000.00	POSTE ITALIANE SPA 0.50% 10/12/2028	EUR	671,209.30	657,728.00	1.08
300,000.00	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA 1.63% 21/10/2028	EUR	260,351.10	264,411.00	0.44
Energia			999,352.58	879,529.00	1.45
700,000.00	ENI SPA 0.38% 14/06/2028	EUR	701,575.52	591,262.00	0.97
300,000.00	ENI SPA 0.63% 19/09/2024	EUR	297,777.06	288,267.00	0.48
Finanza			706,580.51	673,041.00	1.11
400,000.00	INTESA SANPAOLO SPA 2.86% 23/04/2025	EUR	407,648.99	387,288.00	0.64
300,000.00	BANCA DEL MEZZOGIORNO-MEDIOCREDITO CENTRALE SPA 1.50% 24/10/2024	EUR	298,931.52	285,753.00	0.47
Servizi di telecomunicazione			298,259.26	296,472.00	0.49
300,000.00	TELECOM ITALIA SPA/MILANO 4.00% 11/04/2024	EUR	298,259.26	296,472.00	0.49
Servizi di pubblica utilità			102,531.00	100,661.00	0.16
100,000.00	A2A SPA 4.50% 19/09/2030	EUR	102,531.00	100,661.00	0.16
SPAGNA			4,726,800.98	4,479,910.00	7.38
Enti Governativi			3,902,411.37	3,739,530.00	6.16
3,500,000.00	SPAIN GOVERNMENT BOND 0.50% 31/10/2031	EUR	2,889,371.55	2,800,700.00	4.61
1,000,000.00	SPAIN GOVERNMENT BOND 1.30% 31/10/2026	EUR	1,013,039.82	938,830.00	1.55
Finanza			824,389.61	740,380.00	1.22
500,000.00	SANTANDER CONSUMER FINANCE SA REG 0.50% 14/11/2026	EUR	512,705.00	441,835.00	0.73
300,000.00	BANCO DE SABADELL SA 5.63% 06/05/2026	EUR	311,684.61	298,545.00	0.49

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

NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
PORTOGALLO			2,891,727.26	2,835,630.00	4.67
Enti Governativi			2,891,727.26	2,835,630.00	4.67
3,000,000.00	PORTUGAL OBRIGACOES DO TESOURO OT 1.95% 15/06/2029	EUR	2,891,727.26	2,835,630.00	4.67
FRANCIA			2,469,865.53	2,401,513.00	3.96
Enti Governativi			1,861,393.25	1,823,740.00	3.00
2,000,000.00	FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 0.25% 25/11/2026	EUR	1,861,393.25	1,823,740.00	3.00
Servizi di telecomunicazione			308,193.22	295,860.00	0.49
300,000.00	LAGARDERE SCA 1.63% 21/06/2024	EUR	308,193.22	295,860.00	0.49
Beni voluttuari			300,279.06	281,913.00	0.47
300,000.00	RENAULT SA 1.00% 28/11/2025	EUR	300,279.06	281,913.00	0.47
REGNO UNITO			2,136,497.29	1,913,696.00	3.15
Servizi di telecomunicazione			1,292,011.62	1,134,740.00	1.87
700,000.00	SKY LTD 2.50% 15/09/2026	EUR	799,314.62	671,580.00	1.11
500,000.00	BRITISH TELECOMMUNICATIONS PLC 0.50% 12/09/2025	EUR	492,697.00	463,160.00	0.76
Beni di prima necessità			428,823.46	394,204.00	0.65
400,000.00	TESCO CORPORATE TREASURY SERVICES PLC 2.50% 01/07/2024	EUR	428,823.46	394,204.00	0.65
Finanza			415,662.21	384,752.00	0.63
400,000.00	HSBC HOLDINGS PLC 0.88% 06/09/2024	EUR	415,662.21	384,752.00	0.63
STATI UNITI			1,570,497.96	1,370,395.00	2.26
Servizi di telecomunicazione			1,071,228.33	936,055.00	1.54
500,000.00	WARNER MEDIA LLC 1.95% 15/09/2023	EUR	521,633.58	496,695.00	0.82
500,000.00	VERIZON COMMUNICATIONS INC 1.38% 02/11/2028	EUR	549,594.75	439,360.00	0.72
Finanza			499,269.63	434,340.00	0.72
500,000.00	AMERICAN TOWER CORP 0.45% 15/01/2027	EUR	499,269.63	434,340.00	0.72
LUSSEMBURGO			1,323,153.24	1,246,959.22	2.05
Sovranazionale			1,217,692.35	1,161,905.22	1.91
1,233,000.00	EIB 0.13% 15/04/2025	EUR	1,217,692.35	1,161,905.22	1.91
Finanza			105,460.89	85,054.00	0.14
100,000.00	GRAND CITY PROPERTIES SA 1.38% 03/08/2026	EUR	105,460.89	85,054.00	0.14
EMIRATI ARABI UNITI			995,498.04	898,970.00	1.48
Finanza			995,498.04	898,970.00	1.48
1,000,000.00	FIRST ABU DHABI BANK PJSC 0.13% 16/02/2026	EUR	995,498.04	898,970.00	1.48
GERMANIA			841,054.71	798,044.00	1.31
Beni voluttuari			534,722.23	496,310.00	0.82
500,000.00	VOLKSWAGEN LEASING GMBH 2.63% 15/01/2024	EUR	534,722.23	496,310.00	0.82
Finanza			306,332.48	301,734.00	0.49
300,000.00	TALANX AG 4.00% 25/10/2029	EUR	306,332.48	301,734.00	0.49
PAESI BASSI			514,059.54	475,175.00	0.78
Finanza			514,059.54	475,175.00	0.78
500,000.00	NE PROPERTY BV 1.75% 23/11/2024	EUR	514,059.54	475,175.00	0.78
UNGHERIA			515,006.92	437,810.00	0.72
Energia			515,006.92	437,810.00	0.72
500,000.00	MOL HUNGARIAN OIL & GAS PLC 1.50% 08/10/2027	EUR	515,006.92	437,810.00	0.72

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

NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Obbligazioni a tasso variabile			3,054,822.46	3,043,712.00	5.01
ITALIA			2,558,684.08	2,545,022.00	4.19
Finanza			1,385,999.59	1,336,142.00	2.20
500,000.00	ICCREA BANCA SPA FRN 20/10/2025	EUR	504,156.58	482,740.00	0.79
300,000.00	UNICREDIT SPA FRN 09/03/2026	EUR	296,708.64	298,284.00	0.49
300,000.00	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA FRN 25/01/2024	EUR	313,788.38	296,538.00	0.49
250,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 29/06/2027	EUR	271,345.99	258,580.00	0.43
Enti Governativi			1,172,684.49	1,208,880.00	1.99
1,200,000.00	CCT FRN 15/09/2025	EUR	1,172,684.49	1,208,880.00	1.99
MESSICO			496,138.38	498,690.00	0.82
Energia			496,138.38	498,690.00	0.82
500,000.00	PETROLEOS MEXICANOS FRN 24/08/2023	EUR	496,138.38	498,690.00	0.82
Obbligazioni zero coupon			9,945,369.52	9,612,727.32	15.83
GERMANIA			4,660,285.24	4,578,305.00	7.54
Enti Governativi			4,660,285.24	4,578,305.00	7.54
2,000,000.00	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 0.00% 15/02/2032	EUR	1,686,585.82	1,637,300.00	2.70
1,500,000.00	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0.00% 15/12/2023	EUR	1,479,272.23	1,476,795.00	2.43
1,500,000.00	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0.00% 15/03/2024	EUR	1,494,427.19	1,464,210.00	2.41
ITALIA			3,033,119.31	2,827,547.32	4.66
Enti Governativi			3,033,119.31	2,827,547.32	4.66
1,300,000.00	BTP 0.00% 01/04/2026	EUR	1,298,608.67	1,174,550.00	1.94
1,300,000.00	BTP 0.00% 01/08/2026	EUR	1,233,445.64	1,160,250.00	1.91
501,065.00	BTP 0.00% 22/11/2028	EUR	501,065.00	492,747.32	0.81
BELGIO			2,251,964.97	2,206,875.00	3.63
Enti Governativi			2,251,964.97	2,206,875.00	3.63
2,500,000.00	BELGIUM KINGDOM 0.00% 22/10/2027	EUR	2,251,964.97	2,206,875.00	3.63
Azioni di OICR			18,004,305.05	19,353,380.42	31.87
LUSSEMBURGO			10,811,585.64	12,145,456.77	20.00
Finanza			10,811,585.64	12,145,456.77	20.00
4,500.00	AMUNDI NASDAQ-100 UCITS ETF	EUR	1,264,839.29	1,627,695.00	2.68
9,719.25	FLOSSBACH VON STORCH BOND OPPORTUNITIES -I-	EUR	1,279,999.64	1,299,852.09	2.14
4,942.45	PICTET - SECURITY -HI-	EUR	821,638.13	1,145,461.28	1.89
395.93	OYSTER FUNDS - JAPAN OPPORTUNITIES -R-	EUR	698,827.35	1,106,221.67	1.82
22,000.06	JP MORGAN FUNDS - US VALUE FUND -C-	USD	650,820.80	878,590.62	1.45
6,181.61	MIRABAUD - SUSTAINABLE CONVERTIBLES GLOBAL	USD	896,941.02	874,888.21	1.44
7,599.25	GAM MULTISTOCK MERGER ARBITRAGE	USD	749,472.41	837,867.55	1.38
6,576.81	VONTOBEL FUND - EMERGING MARKETS DEBT -I-	USD	745,058.60	736,951.91	1.21
6,000.00	NEW MILLENNIUM SIF-SICAV - AIM SISTEMA ITALIA - PIR	EUR	600,000.00	634,097.40	1.04
240.29	CANDRIAM EQUITIES L EUROPE INNOVATION -I-	EUR	642,658.84	609,930.51	1.00
3,831.74	PICTET - JAPANESE EQUITY SELECTION	EUR	449,999.90	550,698.10	0.91
3,920.83	CB-ACCENT LUX - SWAN SHORT-TERM HIGH YIELD -A-	EUR	501,331.89	504,258.33	0.83
2,859.58	VONTOBEL FUND - MTX SUSTAINABLE EMERGING MARKETS LEADERS	USD	400,050.76	394,443.13	0.65
22,000.00	ALGER SICAV - ALGER SMALL CAP FOCUS FUND -I-	EUR	514,879.04	358,820.00	0.59
383.49	VARIOPARTNER SICAV - SECTORAL HEALTHCARE OPPORTUNITIES FUND	USD	297,480.08	295,656.29	0.49
21,401.25	M&G LUX INVESTMENT FUNDS 1 - M&G GLOBAL LISTED INFRASTRUCTURE	USD	297,480.65	289,909.32	0.48
0.56	MIRABAUD - EQUITIES GLOBAL FOCUS -IC-	USD	85.09	93.22	0.00
0.22	NORDEA 1 SICAV - LOW DURATION EUROPEAN COVERED BOND FUND -BI-	EUR	22.15	22.14	0.00

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

NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
IRLANDA			6,192,722.43	6,144,820.27	10.12
Finanza			6,192,722.43	6,144,820.27	10.12
13,216.48	LAZARD GLOBAL CONVERTIBLES RECOVERY FUND -A-	EUR	1,499,999.99	1,390,110.27	2.29
91,583.01	NEUBERGER BERMAN GLOBAL EQUITY MEGATRENDS FUND	USD	1,217,360.89	1,263,358.30	2.08
8,039.58	MAN FUNDS VI PLC - MAN GLG EVENT DRIVEN ALTERNATIVE	EUR	950,000.08	966,277.36	1.59
2,000.00	INVESCO EQQQ NASDAQ-100 UCITS ETF	EUR	586,176.50	679,060.00	1.12
5,800.16	PLURIMA FUNDS - APUANO FLEXIBLE BOND FUND -A-	EUR	645,325.82	633,812.48	1.04
30,795.60	GUINNESS GLOBAL EQUITY INCOME FUND	EUR	599,999.91	598,179.89	0.99
5,000.00	WISDOMTREE AT1 COCO BOND UCITS ETF	EUR	423,859.24	352,200.00	0.58
62,427.74	TENDERCAPITAL BOND TWO STEPS FUND -IA-	EUR	270,000.00	261,821.97	0.43
FRANCIA			999,996.98	1,063,103.38	1.75
Finanza			999,996.98	1,063,103.38	1.75
100.12	ELLIPSIS DISRUPTION CONVERTIBLE FUND -J-	EUR	999,996.98	1,063,103.38	1.75
Warrants			0.00	106.50	0.00
ITALIA			0.00	106.50	0.00
Beni voluttuari			0.00	106.50	0.00
100.00	SOSTRAVEL.COM SPA	EUR	0.00	106.50	0.00
QUOTE DI OICR			1,538,744.54	1,572,725.00	2.59
Azioni di OICR			1,538,744.54	1,572,725.00	2.59
IRLANDA			1,538,744.54	1,572,725.00	2.59
Finanza			1,538,744.54	1,572,725.00	2.59
40,000.00	WISDOMTREE GLOBAL QUALITY DIVIDEND GROWTH UCITS ETF	EUR	1,234,997.11	1,262,800.00	2.08
11,500.00	FIRST TRUST NASDAQ CYBERSECURITY UCITS ETF	EUR	303,747.43	309,925.00	0.51
Totale del Portafoglio Titoli			58,601,857.88	58,395,652.26	96.16

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

NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Attività

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	16,406,446.35
Liquidità bancarie a vista		74,499.72
Importi dovuti dai broker		335,729.17
Contratti di opzioni al valore di mercato	(Note 2e, 13)	20,609.57
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	(Note 2c, 13)	50,522.19
Utili non realizzati su contratti futures	(Note 2d, 13)	5,948.67
Dividendi da ricevere		2,912.05
Interessi da ricevere		227,192.81
Altre attività		903.56
Totale attività		17,124,764.09

Passività

Contratti di opzioni al valore di mercato	(Note 2e, 13)	-4,196.38
Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	(Note 2c, 13)	-2,126.29
Perdite non realizzate su contratti futures	(Note 2d, 13)	-3,299.72
Altre passività		-114,465.33
Totale passività		-124,087.72

Totale attivo netto**17,000,676.37**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	123.38	5,935.346
Azione I	EUR	101.74	48,557.001
Azione L	EUR	123.42	91,786.000

NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible

PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Attivo netto all'inizio del periodo		16,290,859.18
Risultato netto degli investimenti		313,388.82
Altri ricavi		1,443.05
Totale ricavi		314,831.87
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-93,366.04
Commissione di consulenza	(Nota 6)	-7,453.99
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 8)	-4,686.14
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-3,239.44
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 8)	-26,196.33
Commissioni del Transfer Agent		-117.36
Compensi professionali	(Nota 9)	-6,730.32
Pubblicazioni		-309.70
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-13,984.39
Totale costi		-156,083.71
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		158,748.16
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	-147,578.68
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		99,546.72
- di contratti di opzioni		189,377.93
- di contratti futures		10,112.96
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		300,632.69
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(Nota 2c)	3,868.78
- sulle opzioni		7,879.92
- su contratti futures	(Nota 2d)	2,648.95
Risultato netto delle operazioni per il periodo		625,237.43
Sottoscrizioni del periodo		663,356.20
Rimborsi del periodo		-578,776.44
Attivo netto alla fine del periodo		17,000,676.37

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

NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			16,699,261.70	16,406,446.35	96.51
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			15,515,112.29	15,327,450.18	90.16
Azioni			849,809.34	839,552.17	4.94
STATI UNITI			535,293.25	562,389.39	3.31
Salute			212,782.40	226,869.78	1.33
1,500.00	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	USD	81,572.91	87,923.90	0.51
200.00	STRYKER CORP	USD	44,794.91	55,928.49	0.33
400.00	ABBVIE INC	USD	38,173.75	49,396.87	0.29
1,000.00	PFIZER INC	USD	48,240.83	33,620.52	0.20
Informatica			77,242.01	119,823.07	0.71
350.00	MICROSOFT CORP	USD	64,899.02	109,247.45	0.65
300.00	ULTRA CLEAN HOLDINGS INC	USD	12,342.99	10,575.62	0.06
Servizi di telecomunicazione			107,508.06	109,715.82	0.65
1,000.00	ALPHABET INC -A-	USD	107,508.06	109,715.82	0.65
Materie prime			137,760.78	105,980.72	0.62
1,400.00	FREEPORT-MCMORAN INC	USD	43,946.82	51,329.04	0.30
1,000.00	NEWMONT MINING CORP	USD	59,786.21	39,101.73	0.23
500.00	ALCOA CORP	USD	34,027.75	15,549.95	0.09
IRLANDA			113,417.59	88,826.74	0.52
Salute			113,417.59	88,826.74	0.52
1,100.00	MEDTRONIC PLC	USD	113,417.59	88,826.74	0.52
PAESI BASSI			62,700.54	66,300.00	0.39
Informatica			62,700.54	66,300.00	0.39
100.00	ASML HOLDING NV	EUR	62,700.54	66,300.00	0.39
ITALIA			85,469.12	64,860.00	0.38
Servizi di pubblica utilità			85,469.12	64,860.00	0.38
20,000.00	IREN SPA	EUR	46,611.34	34,020.00	0.20
5,000.00	ENEL SPA	EUR	38,857.78	30,840.00	0.18
SPAGNA			41,705.97	52,030.30	0.31
Servizi di pubblica utilità			41,705.97	52,030.30	0.31
4,354.00	IBERDROLA SA	EUR	41,705.97	52,030.30	0.31
SVIZZERA			11,222.87	5,145.74	0.03
Salute			11,222.87	5,145.74	0.03
100.00	CRISPR THERAPEUTICS AG	USD	11,222.87	5,145.74	0.03
Obbligazioni ordinarie			5,344,054.57	5,273,753.09	31.02
STATI UNITI			1,203,601.10	1,197,080.89	7.04
Enti Governativi			631,952.13	631,562.74	3.71
700,000.00	UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.00% 31/10/2023	USD	631,952.13	631,562.74	3.71
Beni voluttuari			384,233.97	380,916.92	2.24
200,000.00	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.87% 03/08/2027	EUR	195,000.00	196,642.00	1.16
200,000.00	FORD MOTOR CREDIT CO. LLC 6.95% 06/03/2026	USD	189,233.97	184,274.92	1.08
Industria			187,415.00	184,601.23	1.09
200,000.00	STANLEY BLACK & DECKER, INC. 6.27% 06/03/2026	USD	187,415.00	184,601.23	1.09

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

NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
REGNO UNITO			884,335.99	854,911.11	5.03
Servizi di pubblica utilità			438,944.75	433,205.46	2.55
470,000.00	NATIONAL GRID PLC 5.60% 12/06/2028	USD	438,944.75	433,205.46	2.55
Finanza			445,391.24	421,705.65	2.48
300,000.00	PRUDENTIAL PLC 4.88% 31/12/2099	USD	265,999.62	240,827.61	1.42
200,000.00	HSBC HOLDINGS PLC 4.25% 14/03/2024	USD	179,391.62	180,878.04	1.06
FRANCIA			682,224.00	669,743.00	3.94
Servizi di telecomunicazione			382,914.00	373,154.00	2.20
200,000.00	ILIAD HOLDING SASU 5.13% 15/10/2026	EUR	200,000.00	191,636.00	1.13
200,000.00	EUTELSAT SA 2.00% 02/10/2025	EUR	182,914.00	181,518.00	1.07
Finanza			299,310.00	296,589.00	1.74
300,000.00	CREDIT AGRICOLE SA 3.88% 20/04/2031	EUR	299,310.00	296,589.00	1.74
PAESI BASSI			671,247.27	666,272.56	3.92
Servizi di telecomunicazione			284,846.47	287,332.63	1.69
500,000.00	PROSUS NV 4.03% 03/08/2050	USD	284,846.47	287,332.63	1.69
Beni voluttuari			199,912.00	198,764.00	1.17
200,000.00	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV 4.13% 15/11/2025	EUR	199,912.00	198,764.00	1.17
Enti Governativi			186,488.80	180,175.93	1.06
200,000.00	BRASKEM NETHERLANDS 7.25% 13/02/2033	USD	186,488.80	180,175.93	1.06
ITALIA			634,143.00	624,700.00	3.67
Finanza			217,475.00	226,280.00	1.33
250,000.00	INTESA SANPAOLO SPA 0.63% 24/02/2026	EUR	217,475.00	226,280.00	1.33
Enti Governativi			199,768.00	201,042.00	1.18
200,000.00	AGENZIA NAZIONALE PER L'ATTRAZIONE DEGLI INVESTIMENTI E LO SVILUPPO D'IMPRESA 5.25% 14/11/2025	EUR	199,768.00	201,042.00	1.18
Industria			216,900.00	197,378.00	1.16
200,000.00	WEBUILD SPA 5.88% 15/12/2025	EUR	216,900.00	197,378.00	1.16
SPAGNA			499,430.00	492,735.00	2.90
Finanza			499,430.00	492,735.00	2.90
500,000.00	BANCO SANTANDER SA 3.75% 16/01/2026	EUR	499,430.00	492,735.00	2.90
LUSSEMBURGO			234,089.50	236,950.43	1.39
Servizi di telecomunicazione			234,089.50	236,950.43	1.39
300,000.00	TELECOM ITALIA CAPITAL SA 7.20% 18/07/2036	USD	234,089.50	236,950.43	1.39
SVIZZERA			235,299.71	233,932.10	1.38
Finanza			235,299.71	233,932.10	1.38
250,000.00	CREDIT SUISSE AG 7.95% 09/01/2025	USD	235,299.71	233,932.10	1.38
SVEZIA			199,684.00	198,822.00	1.17
Servizi di pubblica utilità			199,684.00	198,822.00	1.17
200,000.00	VATTENFALL AB 3.25% 18/04/2024	EUR	199,684.00	198,822.00	1.17
GERMANIA			100,000.00	98,606.00	0.58
Servizi di telecomunicazione			100,000.00	98,606.00	0.58
100,000.00	DELIVERY HERO SE 3.25% 21/02/2030	EUR	100,000.00	98,606.00	0.58

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

NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Obbligazioni a tasso variabile			7,278,086.23	7,025,713.80	41.33
FRANCIA			2,107,970.87	2,077,854.06	12.22
Finanza			1,441,220.87	1,403,015.06	8.25
500,000.00	BNP PARIBAS SA FRN 31/12/2099	USD	456,164.87	441,668.06	2.60
300,000.00	BNP PARIBAS SA FRN 23/01/2027	EUR	282,960.00	281,319.00	1.65
300,000.00	LA BANQUE POSTALE SA FRN 17/06/2026	EUR	302,221.00	276,513.00	1.63
250,000.00	AXA SA FRN 29/10/2049	EUR	202,500.00	202,455.00	1.19
250,000.00	AXA SA FRN 29/10/2049	EUR	197,375.00	201,060.00	1.18
Energia			466,750.00	471,005.00	2.77
500,000.00	TOTALENERGIES SE FRN 29/12/2049	EUR	466,750.00	471,005.00	2.77
Servizi di pubblica utilità			200,000.00	203,834.00	1.20
200,000.00	ELECTRICITE DE FRANCE SA FRN 31/12/2029	EUR	200,000.00	203,834.00	1.20
ITALIA			1,949,250.00	1,796,646.00	10.57
Finanza			1,661,625.00	1,543,470.00	9.08
500,000.00	BANCO BPM SPA FRN 14/06/2028	EUR	499,775.00	497,285.00	2.93
500,000.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA FRN 30/11/2049	EUR	550,500.00	486,915.00	2.86
300,000.00	FINECOBANK BANCA FINECO SPA FRN 31/12/2099	EUR	314,250.00	289,518.00	1.70
200,000.00	ICCREA BANCA SPA FRN 18/01/2032	EUR	200,000.00	172,508.00	1.02
100,000.00	INTESA SANPAOLO VITA SPA FRN 31/12/2049	EUR	97,100.00	97,244.00	0.57
Energia			287,625.00	253,176.00	1.49
300,000.00	ENI SPA FRN 31/12/2099	EUR	287,625.00	253,176.00	1.49
SPAGNA			770,910.00	769,210.00	4.52
Finanza			770,910.00	769,210.00	4.52
500,000.00	BANCO DE SABADELL SA FRN 08/09/2026	EUR	504,000.00	497,890.00	2.93
300,000.00	BANCO SANTANDER SA FRN 31/12/2099	EUR	266,910.00	271,320.00	1.59
PAESI BASSI			829,788.57	761,263.64	4.48
Finanza			829,788.57	761,263.64	4.48
800,000.00	AEGON NV FRN 29/06/2049	NLG	352,387.57	288,462.64	1.70
300,000.00	ELM BV FOR SWISS REINSURANCE CO LTD FRN 29/12/2049	EUR	278,889.00	279,429.00	1.64
200,000.00	NN GROUP NV FRN 13/01/2048	EUR	198,512.00	193,372.00	1.14
REGNO UNITO			557,205.00	557,590.00	3.28
Finanza			479,455.00	476,705.00	2.80
500,000.00	HSBC HOLDINGS PLC FRN 15/06/2027	EUR	479,455.00	476,705.00	2.80
Servizi di telecomunicazione			77,750.00	80,885.00	0.48
100,000.00	VODAFONE GROUP PLC FRN 27/08/2080	EUR	77,750.00	80,885.00	0.48
GERMANIA			368,152.00	372,053.00	2.19
Finanza			278,502.00	279,219.00	1.64
300,000.00	ALLIANZ SE FRN 05/07/2052	EUR	278,502.00	279,219.00	1.64
Salute			89,650.00	92,834.00	0.55
100,000.00	BAYER AG FRN 25/03/2082	EUR	89,650.00	92,834.00	0.55
SVIZZERA			285,270.00	295,638.00	1.74
Finanza			285,270.00	295,638.00	1.74
300,000.00	UBS GROUP AG FRN 16/01/2026	EUR	285,270.00	295,638.00	1.74
LUSSEMBURGO			238,950.00	239,208.00	1.41
Finanza			238,950.00	239,208.00	1.41
300,000.00	HELVETIA EUROPE SA FRN 30/09/2041	EUR	238,950.00	239,208.00	1.41

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

NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
STATI UNITI			170,589.79	156,251.10	0.92
Finanza			170,589.79	156,251.10	0.92
200,000.00	EVEREST REINSURANCE HOLDINGS INC FRN 15/05/2037	USD	170,589.79	156,251.10	0.92
Obbligazioni zero coupon			840,703.11	832,823.00	4.90
GERMANIA			840,703.11	832,823.00	4.90
Enti Governativi			540,845.61	540,233.00	3.18
400,000.00	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0.00% 15/12/2023	EUR	393,737.99	393,812.00	2.32
150,000.00	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0.00% 15/03/2024	EUR	147,107.62	146,421.00	0.86
Salute			299,857.50	292,590.00	1.72
300,000.00	FRESENIUS SE & CO KGAA 0.00% 31/01/2024	EUR	299,857.50	292,590.00	1.72
Azioni di OICR			1,202,459.04	1,355,608.12	7.97
FRANCIA			600,732.11	718,435.14	4.23
Finanza			600,732.11	718,435.14	4.23
471.00	SYQUANT CAPITAL - HELIUM OPPORTUNITES -A-	EUR	600,732.11	718,435.14	4.23
AUSTRIA			563,325.57	599,377.82	3.52
Finanza			563,325.57	599,377.82	3.52
3,200.27	ERSTE SPARINVEST - ESPA BOND EMERGING MARKETS CORPORATE	EUR	563,325.57	599,377.82	3.52
IRLANDA			38,401.36	37,795.16	0.22
Finanza			38,401.36	37,795.16	0.22
169.00	ISHARES EUR INFLATION LINKED GOVT BOND UCITS ETF	EUR	38,401.36	37,795.16	0.22
Warrants			0.00	0.00	0.00
ITALIA			0.00	0.00	0.00
Beni voluttuari			0.00	0.00	0.00
3,619.00	WEBUILD SPA 02/08/2030**	EUR	0.00	0.00	0.00
NEGOZIATI SU UN ALTRO MERCATO REGOLAMENTATO			587,493.77	572,614.85	3.37
Obbligazioni ordinarie			295,687.70	283,537.03	1.67
NORVEGIA			295,687.70	283,537.03	1.67
Energia			295,687.70	283,537.03	1.67
300,000.00	VAR ENERGI ASA 7.50% 15/01/2028	USD	295,687.70	283,537.03	1.67
Obbligazioni a tasso variabile			291,806.07	289,077.82	1.70
ITALIA			291,806.07	289,077.82	1.70
Finanza			291,806.07	289,077.82	1.70
300,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 21/11/2033	USD	291,806.07	289,077.82	1.70
ALTRI VALORI MOBILIARI			396,930.33	342,841.32	2.02
Obbligazioni a tasso variabile			396,930.33	342,841.32	2.02
ITALIA			396,930.33	342,841.32	2.02
Finanza			396,930.33	342,841.32	2.02
500,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 01/06/2032	USD	396,930.33	342,841.32	2.02

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

NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible**PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR**

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
QUOTE DI OICR			199,725.31	163,540.00	0.96
Azioni di OICR			199,725.31	163,540.00	0.96
IRLANDA			199,725.31	163,540.00	0.96
Finanza			199,725.31	163,540.00	0.96
40,000.00	ISHARES MSCI CHINA A UCITS ETF	EUR	199,725.31	163,540.00	0.96
Totale del Portafoglio Titoli			16,699,261.70	16,406,446.35	96.51

** Inadempiente / delistata

NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible

IMPEGNI SU ACQUISTO / VENDITA DI CONTRATTI FUTURES AL 30 GIUGNO 2023

Valore nominale	Quantità	Acquisto / Vendita	Contratto	Scadenza	Valore di mercato al 30 Giugno 2023	Valuta	Plus/(minus) valenza non realizzata (EUR)	Impegno (EUR)
							2,648.95	4,798,889.44
20	1	Acquisto	NASDAQ 100 EMINI	15/09/2023	14,057.74	USD	5,948.67	281,154.82
125,000	36	Acquisto	EURO FX CURRENCY	18/09/2023	1.00	USD	-3,299.72	4,517,734.62

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible

CONTRATTI DI OPZIONI AL 30 GIUGNO 2023

Quantità	Acquisto / Vendita		Call/Put	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	Impegno (EUR)
CONTRATTI DI OPZIONI						15,754.90	16,413.19	85,063.38
OPZIONI ACQUISTATE						23,596.57	20,609.57	0.00
2	Acquisto		CALL	NASDAQ 100 EMINI 15,500.00 15/09/2023	USD	12,496.57	15,059.57	0.00
30	Acquisto		CALL	STOXX 600 OIL & GAS 350.00 15/09/2023	EUR	11,100.00	5,550.00	0.00
OPZIONE SCRITTA						-7,841.67	-4,196.38	85,063.38
-30	Vendita		CALL	STOXX 600 OIL & GAS 380.00 15/09/2023	EUR	-2,100.00	-750.00	22,496.40
-2	Vendita		PUT	NASDAQ 100 EMINI 13,500.00 15/09/2023	USD	-5,741.67	-3,446.38	62,566.98

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible

CONTRATTI FINANZIARI A TERMINE AL 30 GIUGNO 2023

Scadenza	Ammontare comprato	Valuta comprata	Ammontare venduto	Valuta venduta	Plus/(minus)-valenza non realizzata (EUR)
					48,395.90
17/07/2023	4,680,000.00	USD	4,289,288.69	EUR	-2,126.29
17/07/2023	4,903,094.50	EUR	5,300,000.00	USD	47,974.69
17/07/2023	500,000.00	USD	456,279.32	EUR	1,750.85
17/07/2023	120,000.00	USD	109,130.59	EUR	796.65

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Attività

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	27,314,037.96
Liquidità bancarie a vista		440,831.65
Importi dovuti dai broker		111,971.10
Interessi da ricevere		196,965.94
Altre attività		4,089.30
Totale attività		28,067,895.95

Passività

Da pagare su rimborsi		-3,102.29
Altre passività		-69,029.64
Totale passività		-72,131.93

Totale attivo netto**27,995,764.02**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	105.56	20,531.760
Azione I	EUR	112.30	197,835.106
Azione L	EUR	110.48	11,012.000
Azione Y	EUR	108.84	21,996.025

NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe**PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR**

Attivo netto all'inizio del periodo		27,448,482.65
Risultato netto degli investimenti		613,396.07
Altri ricavi		28.88
Totale ricavi		613,424.95
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-62,328.41
Commissione di consulenza	(Nota 6)	-8,048.94
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 8)	-7,873.15
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-2,208.98
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 8)	-17,740.27
Commissioni del Transfer Agent		-3,538.73
Compensi professionali	(Nota 9)	-5,797.41
Pubblicazioni		-541.16
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-9,362.48
Totale costi		-117,439.53
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		495,985.42
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	-1,022,582.15
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		482.09
- di contratti futures		37,822.50
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		883,880.45
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(Nota 2c)	-797.14
Risultato netto delle operazioni per il periodo		394,791.17
Distribuzioni di dividendi	(Nota 14)	-25,075.47
Sottoscrizioni del periodo		2,006,014.69
Rimborsi del periodo		-1,828,449.02
Attivo netto alla fine del periodo		27,995,764.02

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

NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			29,041,810.59	27,314,037.96	97.57
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			28,029,042.04	26,568,739.65	94.91
Obbligazioni ordinarie			23,854,070.42	22,560,186.20	80.59
FRANCIA			12,382,578.85	11,903,677.67	42.52
Enti Governativi			12,083,254.16	11,609,347.67	41.47
6,735,326.92	FRANCE REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 1.85% 25/07/2027	EUR	7,417,927.23	7,082,330.96	25.30
4,053,540.09	FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 0.10% 01/03/2028	EUR	4,116,946.94	3,979,846.73	14.22
442,447.16	FRANCE REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 3.15% 25/07/2032	EUR	548,379.99	547,169.98	1.95
Finanza			299,324.69	294,330.00	1.05
200,000.00	CREDIT AGRICOLE SA 3.38% 28/07/2027	EUR	199,495.77	195,082.00	0.70
100,000.00	BANQUE STELLANTIS FRANCE SACA 3.88% 19/01/2026	EUR	99,828.92	99,248.00	0.35
ITALIA			5,847,108.95	5,131,622.12	18.33
Enti Governativi			5,647,821.26	4,941,120.12	17.65
2,399,246.20	BTP 3.10% 15/09/2026	EUR	2,906,692.74	2,515,129.79	8.98
2,507,483.55	BTP 0.65% 15/05/2026	EUR	2,741,128.52	2,425,990.33	8.67
Finanza			199,287.69	190,502.00	0.68
200,000.00	BANCA DEL MEZZOGIORNO-MEDIOCREDITO CENTRALE SPA 1.50% 24/10/2024	EUR	199,287.69	190,502.00	0.68
GERMANIA			2,888,097.07	2,834,644.36	10.13
Enti Governativi			2,638,162.14	2,584,391.86	9.23
1,377,517.59	DEUTSCHE BUNDESREPUBLIK INFLATION LINKED BOND 0.10% 15/04/2046	EUR	1,442,432.01	1,432,342.79	5.12
1,129,393.44	DEUTSCHE BUNDESREPUBLIK INFLATION LINKED BOND 0.50% 15/04/2030	EUR	1,195,730.13	1,152,049.07	4.11
Salute			249,934.93	250,252.50	0.90
250,000.00	BAYER AG 4.00% 26/08/2026	EUR	249,934.93	250,252.50	0.90
SPAGNA			2,336,865.84	2,296,340.05	8.20
Enti Governativi			2,336,865.84	2,296,340.05	8.20
2,337,931.86	SPAIN GOVERNMENT INFLATION LINKED BOND 0.65% 30/11/2027	EUR	2,336,865.84	2,296,340.05	8.20
PAESI BASSI			399,419.71	393,902.00	1.41
Finanza			199,871.92	198,316.00	0.71
200,000.00	ABN AMRO BANK NV 3.75% 20/04/2025	EUR	199,871.92	198,316.00	0.71
Industria			199,547.79	195,586.00	0.70
200,000.00	SIEMENS ENERGY FINANCE BV 4.00% 05/04/2026	EUR	199,547.79	195,586.00	0.70
Obbligazioni a tasso variabile			2,574,854.92	2,475,347.47	8.84
FRANCIA			618,022.23	586,631.00	2.10
Finanza			299,826.87	288,652.00	1.03
200,000.00	SOCIETE GENERALE SA FRN 13/01/2025	EUR	200,242.06	200,152.00	0.71
100,000.00	SOCIETE GENERALE SA FRN 24/11/2030	EUR	99,584.81	88,500.00	0.32
Industria			200,310.09	200,124.00	0.72
200,000.00	CIE DE SAINT-GOBAIN FRN 18/07/2024	EUR	200,310.09	200,124.00	0.72
Servizi di pubblica utilità			117,885.27	97,855.00	0.35
100,000.00	ELECTRICITE DE FRANCE SA FRN 29/01/2049	EUR	117,885.27	97,855.00	0.35

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

NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
STATI UNITI			564,167.71	562,977.95	2.01
Finanza			564,167.71	562,977.95	2.01
281,000.00	GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE FRN 19/03/2026	EUR	281,834.86	281,649.11	1.01
282,000.00	BANK OF AMERICA CORP FRN 22/09/2026	EUR	282,332.85	281,328.84	1.00
SPAGNA			498,879.48	477,934.00	1.71
Finanza			498,879.48	477,934.00	1.71
300,000.00	BANCO SANTANDER SA FRN 29/01/2026	EUR	299,333.69	297,492.00	1.06
200,000.00	CAIXABANK SA FRN 18/11/2026	EUR	199,545.79	180,442.00	0.65
REGNO UNITO			493,043.26	466,193.52	1.66
Finanza			493,043.26	466,193.52	1.66
468,000.00	HSBC HOLDINGS PLC FRN 29/12/2049	EUR	493,043.26	466,193.52	1.66
ITALIA			199,581.81	193,373.00	0.69
Finanza			199,581.81	193,373.00	0.69
100,000.00	FINECOBANK BANCA FINECO SPA FRN 23/02/2029	EUR	99,978.98	99,473.00	0.35
100,000.00	UNICREDIT SPA FRN 16/06/2026	EUR	99,602.83	93,900.00	0.34
PAESI BASSI			201,160.43	188,238.00	0.67
Beni voluttuari			201,160.43	188,238.00	0.67
200,000.00	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN 31/12/2099	EUR	201,160.43	188,238.00	0.67
Obbligazioni zero coupon			1,371,472.11	1,326,353.58	4.74
ITALIA			1,171,500.15	1,133,229.58	4.05
Enti Governativi			920,957.47	905,669.58	3.24
920,957.47	BTP 0.00% 22/11/2028	EUR	920,957.47	905,669.58	3.24
Servizi di pubblica utilità			250,542.68	227,560.00	0.81
250,000.00	ACEA SPA 0.00% 28/09/2025	EUR	250,542.68	227,560.00	0.81
CINA			199,971.96	193,124.00	0.69
Finanza			199,971.96	193,124.00	0.69
200,000.00	BANK OF CHINA LTD 0.00% 28/04/2024	EUR	199,971.96	193,124.00	0.69
Azioni di OICR			228,644.59	206,852.40	0.74
JERSEY			228,644.59	206,852.40	0.74
Finanza			228,644.59	206,852.40	0.74
16,110.00	WISDOMTREE INDUSTRIAL METALS	EUR	228,644.59	206,852.40	0.74
QUOTE DI OICR			1,012,768.55	745,298.31	2.66
Azioni di OICR			1,012,768.55	745,298.31	2.66
JERSEY			1,012,768.55	745,298.31	2.66
Finanza			1,012,768.55	745,298.31	2.66
58,036.00	WISDOMTREE INDUSTRIAL METALS	EUR	1,012,768.55	745,298.31	2.66
Totale del Portafoglio Titoli			29,041,810.59	27,314,037.96	97.57

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 2023 IN EUR

Attività

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	53,277,037.01
Liquidità bancarie a vista		732,617.08
Importi dovuti dai broker		571,760.34
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	(Note 2c, 13)	31,599.93
Interessi da ricevere		1,047,989.29
Altre attività		788.25
Totale attività		55,661,791.90

Passività

Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	(Note 2c, 13)	-168,461.21
Da pagare su acquisto titoli		-1,000,000.00
Da pagare su rimborsi		-26,743.43
Altre passività		-153,036.53
Totale passività		-1,348,241.17

Totale attivo netto**54,313,550.73**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	125.30	34,139.874
Azione D	EUR	93.29	5,524.150
Azione I	EUR	135.49	364,382.528
Azione L	EUR	133.63	1,112.000

NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond**PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR**

Attivo netto all'inizio del periodo		53,179,203.46
Risultato netto degli investimenti		1,483,008.18
Altri ricavi		103.57
Totale ricavi		1,483,111.75
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-211,302.98
Commissione di consulenza	(Nota 6)	-8,383.09
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 8)	-14,774.09
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-3,454.12
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 8)	-19,398.19
Commissioni del Transfer Agent		-2,187.46
Compensi professionali	(Nota 9)	-6,618.11
Pubblicazioni		-1,036.68
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-14,559.82
Totale costi		-281,714.54
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		1,201,397.21
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	-1,288,917.68
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		630,777.47
- di contratti futures		28,882.50
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		1,197,601.93
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(Nota 2c)	-349,772.60
Risultato netto delle operazioni per il periodo		1,419,968.83
Distribuzioni di dividendi	(Nota 14)	-17,785.40
Sottoscrizioni del periodo		4,485,255.00
Rimborsi del periodo		-4,753,091.16
Attivo netto alla fine del periodo		54,313,550.73

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			57,794,406.92	53,277,037.01	98.09
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			53,692,365.35	50,727,030.39	93.39
Obbligazioni ordinarie			17,107,299.58	16,113,502.04	29.66
ITALIA			16,496,124.58	15,589,612.04	28.70
Finanza			9,062,566.58	8,304,766.24	15.29
2,100,000.00	VITTORIA ASSICURAZIONI SPA 5.75% 11/07/2028	EUR	2,212,375.00	2,096,829.00	3.86
1,200,000.00	AZIMUT HOLDING SPA REG 1.63% 12/12/2024	EUR	1,197,470.01	1,154,292.00	2.13
1,100,000.00	AMCO - ASSET MANAGEMENT CO. SPA 4.63% 06/02/2027	EUR	1,098,005.00	1,093,653.00	2.01
800,000.00	ILLIMITY BANK SPA 6.63% 09/12/2025	EUR	800,000.00	805,216.00	1.48
800,000.00	BANCA IFIS SPA 6.13% 19/01/2027	EUR	798,359.00	801,240.00	1.48
500,000.00	INTESA SANPAOLO SPA 6.63% 31/05/2033	GBP	568,212.57	559,895.24	1.03
500,000.00	ANIMA HOLDING SPA 1.75% 23/10/2026	EUR	485,250.00	452,750.00	0.83
500,000.00	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE SIIQ SPA 2.13% 28/11/2024	EUR	496,680.00	441,470.00	0.81
400,000.00	NET INSURANCE SPA 5.10% 28/09/2031	EUR	400,000.00	325,120.00	0.60
350,000.00	BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA 1.88% 09/01/2026	EUR	306,215.00	311,801.00	0.58
700,000.00	EUROVITA ASSICURAZIONI SPA 6.00% 22/12/2025*	EUR	700,000.00	262,500.00	0.48
Industria			3,281,742.00	3,164,976.80	5.83
1,000,000.00	WEBUILD SPA 3.88% 28/07/2026	EUR	951,640.00	924,060.00	1.70
720,000.00	WEBUILD SPA 5.88% 15/12/2025	EUR	765,363.00	710,560.80	1.31
500,000.00	FIBER BIDCO SPA 11.00% 25/10/2027	EUR	486,250.00	535,940.00	0.99
600,000.00	SOFIMA HOLDING SPA 3.75% 15/01/2028	EUR	579,444.00	529,116.00	0.97
500,000.00	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA 1.88% 08/07/2026	EUR	499,045.00	465,300.00	0.86
Enti Governativi			2,262,790.00	2,236,810.00	4.12
1,250,000.00	PIRELLI + C SPA 4.25% 18/01/2028	EUR	1,242,290.00	1,231,600.00	2.27
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	1,005,210.00	1.85
Servizi di pubblica utilità			1,889,026.00	1,883,059.00	3.46
1,000,000.00	ALPERIA SPA 5.70% 05/07/2028	EUR	1,000,000.00	997,020.00	1.83
500,000.00	ITALGAS SPA 4.13% 08/06/2032	EUR	493,730.00	490,535.00	0.90
400,000.00	A2A SPA 4.38% 03/02/2034	EUR	395,296.00	395,504.00	0.73
LUSSEMBURGO			611,175.00	523,890.00	0.96
Servizi di telecomunicazione			611,175.00	523,890.00	0.96
500,000.00	TELECOM ITALIA FINANCE SA 7.75% 24/01/2033	EUR	611,175.00	523,890.00	0.96
Obbligazioni a tasso variabile			36,109,782.07	34,613,527.88	63.73
ITALIA			30,955,378.40	30,314,236.81	55.81
Finanza			25,475,758.40	24,906,673.81	45.86
3,300,000.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA FRN 29/06/2049	GBP	3,483,482.40	3,740,108.81	6.89
3,000,000.00	UNICREDIT SPA FRN 31/12/2099	EUR	2,771,250.00	2,751,690.00	5.07
2,500,000.00	FINCOBANK BANCA FINECO SPA FRN 31/12/2099	EUR	2,673,050.00	2,412,650.00	4.44
1,500,000.00	UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA FRN 31/12/2099	EUR	1,444,500.00	1,300,425.00	2.39
1,300,000.00	INTESA SANPAOLO VITA SPA FRN 31/12/2049	EUR	1,289,050.00	1,264,172.00	2.33
1,200,000.00	SOCIETA CATTOLICA DI ASSICURAZIONI SC FRN 14/12/2047	EUR	1,282,875.00	1,154,460.00	2.13
1,000,000.00	BPER BANCA FRN 20/01/2033	EUR	1,017,000.00	1,042,610.00	1.92
1,000,000.00	CREDITO EMILIANO SPA FRN 30/05/2029	EUR	1,002,445.00	1,009,470.00	1.86
1,000,000.00	AMISSIMA VITA SPA FRN 16/08/2031	EUR	1,000,000.00	975,080.00	1.80
1,000,000.00	ICCREA BANCA SPA FRN 28/11/2029	EUR	1,000,000.00	948,330.00	1.75
1,000,000.00	UNIONE DI BANCHE ITALIANE SPA REG FRN 31/12/2099	EUR	1,000,000.00	945,320.00	1.74
750,000.00	BANCO BPM SPA FRN 21/01/2028	EUR	752,980.00	752,227.50	1.39
750,000.00	CASSA CENTRALE BANCA - CREDITO COOPERATIVO ITALIANO SPA FRN 16/02/2027	EUR	752,115.00	751,522.50	1.38
700,000.00	BANCO BPM SPA FRN 31/12/2099	EUR	702,400.00	702,590.00	1.29
1,000,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 31/12/2099	EUR	688,750.00	700,870.00	1.29
700,000.00	BANCA POPOLARE DI SONDRIO SCPA FRN 30/07/2029	EUR	732,850.00	697,711.00	1.29

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
500,000.00	ICCREA BANCA SPA FRN 20/09/2027	EUR	500,000.00	506,950.00	0.93
500,000.00	BPER BANCA FRN 01/02/2028	EUR	499,235.00	505,150.00	0.93
500,000.00	BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA FRN 02/03/2026	EUR	500,000.00	501,060.00	0.92
500,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 08/03/2028	EUR	500,270.00	499,690.00	0.92
500,000.00	BANCO BPM SPA REG FRN 31/12/2099	EUR	541,250.00	474,765.00	0.87
500,000.00	BANCA POPOLARE DI SONDRIO SPA FRN 13/07/2027	EUR	442,500.00	440,660.00	0.81
500,000.00	ICCREA BANCA SPA FRN 18/01/2032	EUR	500,000.00	431,270.00	0.79
400,000.00	FINECOBANCA BANCA FINECO SPA FRN 23/02/2029	EUR	399,756.00	397,892.00	0.73
Servizi di pubblica utilità			2,548,500.00	2,522,275.00	4.64
2,500,000.00	ENEL SPA FRN 31/12/2099	EUR	2,548,500.00	2,522,275.00	4.64
Energia			2,242,630.00	2,189,620.00	4.03
1,500,000.00	ENI SPA FRN 31/12/2099	EUR	1,248,600.00	1,265,880.00	2.33
1,000,000.00	ENI SPA FRN 31/12/2099	EUR	994,030.00	923,740.00	1.70
Beni voluttuari			497,490.00	500,180.00	0.92
500,000.00	GOLDEN GOOSE SPA FRN 14/05/2027	EUR	497,490.00	500,180.00	0.92
Salute			191,000.00	195,488.00	0.36
200,000.00	BORMIOLI PHARMA SPA FRN 15/05/2028	EUR	191,000.00	195,488.00	0.36
REGNO UNITO			2,173,941.30	1,702,329.06	3.14
Finanza			2,173,941.30	1,702,329.06	3.14
1,000,000.00	ROTHESAY LIFE PLC REG FRN 31/12/2099	GBP	1,400,191.30	965,259.06	1.78
1,000,000.00	BARCLAYS BANK PLC FRN 28/12/2040	EUR	773,750.00	737,070.00	1.36
PAESI BASSI			1,364,297.37	1,169,982.01	2.15
Finanza			1,364,297.37	1,169,982.01	2.15
2,165,000.00	AEGON NV FRN 29/06/2049	NLG	950,797.37	780,652.01	1.44
500,000.00	ACHMEA BV FRN 31/12/2099	EUR	413,500.00	389,330.00	0.71
LUSSEMBURGO			1,110,000.00	924,240.00	1.70
Finanza			1,110,000.00	924,240.00	1.70
2,000,000.00	MITSUBISHI UFJ INVESTOR SERVICES & BANKING LUXEMBOURG SA FRN 15/12/2050	EUR	1,110,000.00	924,240.00	1.70
SPAGNA			506,165.00	502,740.00	0.93
Finanza			506,165.00	502,740.00	0.93
500,000.00	UNICAJA BANCO SA FRN 15/11/2027	EUR	506,165.00	502,740.00	0.93
Titoli garantiti da ipoteche immobiliari e da collaterale			475,283.70	0.47	0.00
ITALIA			475,283.70	0.47	0.00
Finanza			475,283.70	0.47	0.00
474,571.86	SPV PROJECT SRL 7.00% 15/11/2037*	EUR	475,283.70	0.47	0.00
NEGOZIATI SU UN ALTRO MERCATO REGOLAMENTATO			2,536,523.28	2,035,743.64	3.75
Obbligazioni ordinarie			1,647,516.28	1,258,108.68	2.32
LUSSEMBURGO			1,647,516.28	1,258,108.68	2.32
Servizi di telecomunicazione			1,647,516.28	1,258,108.68	2.32
1,700,000.00	TELECOM ITALIA CAPITAL SA 6.00% 30/09/2034	USD	1,647,516.28	1,258,108.68	2.32
Obbligazioni a tasso variabile			889,007.00	777,634.96	1.43
ITALIA			889,007.00	777,634.96	1.43
Finanza			889,007.00	777,634.96	1.43
1,000,000.00	UNICREDIT SPA FRN 30/06/2035	USD	889,007.00	777,634.96	1.43

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
ALTRI VALORI MOBILIARI			1,565,518.29	514,262.98	0.95
Obbligazioni a tasso variabile			575,447.57	514,261.99	0.95
ITALIA			575,447.57	514,261.99	0.95
Finanza			575,447.57	514,261.99	0.95
750,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 01/06/2032	USD	575,447.57	514,261.99	0.95
Titoli garantiti da ipoteche immobiliari e da collaterale			990,070.72	0.99	0.00
ITALIA			990,070.72	0.99	0.00
Finanza			990,070.72	0.99	0.00
990,000.00	SIERRA ONE SPV SRL 7.00% 30/06/2025*	EUR	990,070.72	0.99	0.00
Totale del Portafoglio Titoli			57,794,406.92	53,277,037.01	98.09

* Strumenti finanziari prezzati al fair value

NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond**CONTRATTI FINANZIARI A TERMINE AL 30 GIUGNO 2023**

Scadenza	Ammontare comprato	Valuta comprata	Ammontare venduto	Valuta venduta	Plus/(minus)-valenza non realizzata (EUR)
					-136,861.28
17/07/2023	620,000.00	USD	573,233.97	EUR	-5,276.56
17/07/2023	530,388.74	EUR	460,000.00	GBP	-5,351.13
17/07/2023	4,861,816.13	EUR	4,310,000.00	GBP	-157,833.52
17/07/2023	3,229,566.58	EUR	3,491,000.00	USD	31,599.93

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Attività

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	3,000,103.06
Liquidità bancarie a vista		36,724.66
Importi dovuti dai broker		80.06
Interessi da ricevere		3,457.13
Altre attività		398.42
Totale attività		3,040,763.33

Passività

Altre passività		-37,148.38
Totale passività		-37,148.38

Totale attivo netto**3,003,614.95**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	103.15	19,880.283
Azione D	EUR	81.09	2,950.846
Azione I	EUR	113.57	6,250.000
Azione L	EUR	114.36	9.000
Azione Y	EUR	94.76	30.108

NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing**PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR**

Attivo netto all'inizio del periodo		3,126,401.71
Risultato netto degli investimenti		6,693.26
Totale ricavi		6,693.26
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-1,741.05
Commissione di consulenza	(Nota 6)	-7,724.57
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 8)	-1,732.23
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-70.76
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 8)	-10,823.79
Commissioni del Transfer Agent		-93.36
Compensi professionali	(Nota 9)	-5,092.19
Pubblicazioni		-60.31
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-18,758.75
Totale costi		-46,097.01
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		-39,403.75
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	41,000.44
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		4,638.83
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		27,381.66
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(Nota 2c)	-4,635.83
Risultato netto delle operazioni per il periodo		28,981.35
Distribuzioni di dividendi	(Nota 14)	-6,151.00
Rimborsi del periodo		-145,617.11
Attivo netto alla fine del periodo		3,003,614.95

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			2,824,115.38	3,000,103.06	99.88
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			2,824,029.57	3,000,103.06	99.88
Azioni			27,607.58	34,482.00	1.15
ITALIA			27,607.58	34,482.00	1.15
Finanza			27,607.58	34,482.00	1.15
2,800.00	FINECOBANK BANCA FINECO SPA	EUR	27,607.58	34,482.00	1.15
Obbligazioni a tasso variabile			247,662.14	224,342.36	7.47
PAESI BASSI			147,266.14	131,226.36	4.37
Enti Governativi			147,266.14	131,226.36	4.37
200,000.00	ING GROEP NV FRN 31/12/2099	USD	147,266.14	131,226.36	4.37
FRANCIA			100,396.00	93,116.00	3.10
Finanza			100,396.00	93,116.00	3.10
100,000.00	BNP PARIBAS SA FRN 25/07/2028	EUR	100,396.00	93,116.00	3.10
Azioni di OICR			2,548,759.85	2,741,278.70	91.26
LUSSEMBURGO			2,548,759.85	2,741,278.70	91.26
Finanza			2,548,759.85	2,741,278.70	91.26
3,365.65	NEW MILLENNIUM - AUGUSTUM HIGH QUALITY BOND -I-	EUR	532,679.67	539,783.43	17.97
3,919.00	NEW MILLENNIUM - AUGUSTUM ITALIAN DIVERSIFIED BOND -I-	EUR	458,887.04	530,397.46	17.66
72,884.86	AZ FUND 1 - AZ ALLOCATION INTERNATIONAL 50%-100%	EUR	382,358.89	477,978.92	15.91
3,935.78	NEW MILLENNIUM - AUGUSTUM EXTRA EURO HIGH QUALITY BOND -I-	EUR	414,290.03	426,008.72	14.18
70,876.29	AZ FUND 1 - AZ BOND GLOBAL MACRO -AI-	EUR	330,000.00	359,130.16	11.96
53,498.13	AZ FUND 1 - AZ BOND TARGET 2021 -AAZ-	EUR	280,544.18	264,173.75	8.79
607.83	NEW MILLENNIUM - AUGUSTUM CORPORATE BOND -I-	EUR	150,000.04	143,806.26	4.79
Warrants			0.00	0.00	0.00
STATI UNITI			0.00	0.00	0.00
Beni di prima necessità			0.00	0.00	0.00
1,751.00	CEC BRANDS LLC 31/12/2025**	USD	0.00	0.00	0.00
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
Totale del Portafoglio Titoli			2,824,115.38	3,000,103.06	99.88

** Inadempiente / delistata

NEW MILLENNIUM - VolActive

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Attività

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	29,137,238.26
Liquidità bancarie a vista		1,595,854.89
Importi dovuti dai broker		585,268.68
Utili non realizzati su contratti futures	(Note 2d, 13)	142,781.81
Dividendi da ricevere		3,840.53
Interessi da ricevere		127,701.72
Altre attività		404.86
Totale attività		31,593,090.75

Passività

Perdite non realizzate su contratti futures	(Note 2d, 13)	-1,793.67
Altre passività		-86,048.88
Totale passività		-87,842.55

Totale attivo netto**31,505,248.20**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	86.54	4,758.037
Azione D	EUR	66.84	11.557
Azione I	EUR	95.99	323,835.529
Azione L	EUR	94.40	89.000

NEW MILLENNIUM - VolActive

PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Attivo netto all'inizio del periodo		5,819,508.12
Risultato netto degli investimenti		139,303.94
Altri ricavi		25.26
Totale ricavi		139,329.20
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-73,966.67
Commissione di consulenza	(Nota 6)	-7,540.38
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 8)	-3,848.03
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-1,016.71
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 8)	-16,167.36
Commissioni del Transfer Agent		-1,458.85
Compensi professionali	(Nota 9)	-5,121.27
Pubblicazioni		-112.47
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-10,200.25
Totale costi		-119,431.99
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		19,897.21
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	-200,332.32
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		-68,976.59
- di contratti futures		-119,909.78
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		567,117.32
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(Nota 2c)	-12,630.89
- su contratti futures	(Nota 2d)	133,834.15
Risultato netto delle operazioni per il periodo		318,999.10
Sottoscrizioni del periodo		25,701,405.50
Rimborsi del periodo		-334,664.52
Attivo netto alla fine del periodo		31,505,248.20

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

NEW MILLENNIUM - VolActive

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			28,882,244.48	29,137,238.26	92.49
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			27,168,811.15	27,409,329.45	87.00
Azioni			7,660,705.49	8,024,382.26	25.47
STATI UNITI			5,201,135.85	5,600,497.73	17.78
Salute			1,095,190.45	1,083,900.41	3.44
389.00	ELI LILLY & CO	USD	145,093.89	167,216.47	0.53
1,076.00	JOHNSON & JOHNSON	USD	159,623.27	163,244.24	0.52
1,474.00	MERCK & CO INC	USD	155,603.06	155,898.08	0.49
351.00	UNITEDHEALTH GROUP INC	USD	157,523.72	154,632.99	0.49
319.00	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	USD	159,870.84	152,555.64	0.48
4,357.00	PFIZER INC	USD	155,642.53	146,484.61	0.47
1,165.00	ABBVIE INC	USD	161,833.14	143,868.38	0.46
Beni voluttuari			929,538.64	1,029,474.57	3.27
894.00	TESLA INC	USD	142,292.91	214,502.57	0.68
343.00	COSTCO WHOLESALE CORP	USD	157,754.99	169,261.49	0.54
580.00	HOME DEPOT INC	USD	155,385.08	165,143.12	0.52
1,136.00	WALMART INC	USD	157,612.94	163,663.08	0.52
583.00	MCDONALD'S CORP	USD	156,623.04	159,461.94	0.51
1,132.00	PROCTER & GAMBLE CO	USD	159,869.68	157,442.37	0.50
Servizi di telecomunicazione			880,266.06	965,566.61	3.06
680.00	FACEBOOK INC -A-	USD	141,945.71	178,869.24	0.57
1,468.00	AMAZON.COM INC	USD	147,310.39	175,406.44	0.55
3,458.00	CISCO SYSTEMS INC	USD	152,796.63	163,993.46	0.52
1,839.00	WALT DISNEY CO	USD	161,603.91	150,491.17	0.48
1,341.00	ALPHABET INC -C-	USD	138,146.83	148,689.94	0.47
1,350.00	ALPHABET INC -A-	USD	138,462.59	148,116.36	0.47
Informatica			738,550.40	904,443.80	2.87
541.00	NVIDIA CORP	USD	141,193.47	209,765.12	0.67
453.00	ADOBE INC	USD	151,846.91	203,036.11	0.64
969.00	APPLE INC	USD	151,168.92	172,279.44	0.55
525.00	MICROSOFT CORP	USD	145,386.45	163,871.17	0.52
803.00	SALESFORCE.COM INC	USD	148,954.65	155,491.96	0.49
Finanza			767,949.55	797,213.54	2.53
1,223.00	JPMORGAN CHASE & CO	USD	152,799.22	163,036.72	0.52
513.00	BERKSHIRE HATHAWAY INC -B-	USD	152,203.32	160,341.84	0.51
730.00	VISA INC -A-	USD	155,572.76	158,900.41	0.50
439.00	MASTERCARD INC -A-	USD	152,521.60	158,257.24	0.50
5,958.00	BANK OF AMERICA CORP	USD	154,852.65	156,677.33	0.50
Energia			326,545.34	317,730.84	1.01
1,107.00	CHEVRON CORP	USD	163,928.63	159,657.56	0.51
1,608.00	EXXON MOBIL CORP	USD	162,616.71	158,073.28	0.50
Beni di prima necessità			316,718.24	304,988.70	0.97
904.00	PEPSICO INC	USD	157,292.17	153,472.80	0.49
2,745.00	COCA-COLA CO	USD	159,426.07	151,515.90	0.48
Industria			146,377.17	197,179.26	0.63
248.00	BROADCOM INC	USD	146,377.17	197,179.26	0.63
REGNO UNITO			626,913.47	617,998.08	1.96
Salute			317,449.63	302,566.39	0.96
3,227.00	UNILEVER PLC	GBP	161,049.92	154,084.32	0.49
1,130.00	ASTRAZENECA PLC	GBP	156,399.71	148,482.07	0.47
Finanza			150,969.43	160,137.20	0.51
22,104.00	HSBC HOLDINGS PLC	GBP	150,969.43	160,137.20	0.51

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

NEW MILLENNIUM - VolActive

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Energia			158,494.41	155,294.49	0.49
5,689.00	SHELL PLC	GBP	158,494.41	155,294.49	0.49
FRANCIA			482,983.22	463,624.30	1.47
Beni voluttuari			160,644.11	157,929.00	0.50
183.00	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	EUR	160,644.11	157,929.00	0.50
Salute			161,066.32	156,138.00	0.50
1,590.00	SANOFI	EUR	161,066.32	156,138.00	0.50
Energia			161,272.79	149,557.30	0.47
2,846.00	TOTAL SA	EUR	161,272.79	149,557.30	0.47
SVIZZERA			463,281.46	451,442.67	1.43
Salute			305,208.73	302,399.90	0.96
1,672.00	NOVARTIS AG REG	CHF	153,865.17	154,170.30	0.49
529.00	ROCHE HOLDING AG	CHF	151,343.56	148,229.60	0.47
Beni di prima necessità			158,072.73	149,042.77	0.47
1,352.00	NESTLE SA REG	CHF	158,072.73	149,042.77	0.47
GIAPPONE			399,722.04	410,522.10	1.30
Beni voluttuari			266,318.47	281,437.87	0.89
10,800.00	TOYOTA MOTOR CORP	JPY	137,623.77	158,108.68	0.50
1,500.00	SONY CORP	JPY	128,694.70	123,329.19	0.39
Industria			133,403.57	129,084.23	0.41
300.00	KEYENCE CORP	JPY	133,403.57	129,084.23	0.41
GERMANIA			308,487.09	316,536.38	1.01
Informatica			155,722.83	161,555.74	0.52
1,291.00	SAP SE	EUR	155,722.83	161,555.74	0.52
Industria			152,764.26	154,980.64	0.49
1,016.00	SIEMENS AG REG	EUR	152,764.26	154,980.64	0.49
PAESI BASSI			149,642.91	163,761.00	0.52
Informatica			149,642.91	163,761.00	0.52
247.00	ASML HOLDING NV	EUR	149,642.91	163,761.00	0.52
ITALIA			28,539.45	0.00	0.00
Beni voluttuari			28,539.45	0.00	0.00
14,430.00	SEMPLICEMENTE SPA**	EUR	28,539.45	0.00	0.00
Obbligazioni ordinarie			11,016,858.36	10,878,006.60	34.53
STATI UNITI			8,311,415.02	8,182,087.31	25.97
Enti Governativi			7,865,708.59	7,736,951.81	24.56
3,555,000.00	UNITED STATES TREASURY NOTE 0.63% 15/08/2030	USD	2,662,048.05	2,590,998.71	8.22
2,267,000.00	UNITED STATES TREASURY NOTE 5.25% 15/02/2029	USD	2,254,128.26	2,189,759.51	6.95
1,627,000.00	UNITED STATES TREASURY NOTE 2.50% 15/08/2023	USD	1,486,244.06	1,486,456.88	4.72
1,629,000.00	UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.00% 31/10/2023	USD	1,463,288.22	1,469,736.71	4.67
Informatica			445,706.43	445,135.50	1.41
450,000.00	APPLE INC 1.38% 17/01/2024	EUR	445,706.43	445,135.50	1.41

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

NEW MILLENNIUM - VolActive

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
GERMANIA			966,967.64	965,197.58	3.06
Enti Governativi			966,967.64	965,197.58	3.06
729,000.00	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 1.50% 15/05/2024	EUR	719,343.76	717,554.70	2.28
248,000.00	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 2.00% 15/08/2023	EUR	247,623.88	247,642.88	0.78
PAESI BASSI			532,429.91	527,954.63	1.68
Beni voluttuari			532,429.91	527,954.63	1.68
553,000.00	FERRARI NV 1.50% 27/05/2025	EUR	532,429.91	527,954.63	1.68
PORTOGALLO			503,474.28	500,631.41	1.59
Enti Governativi			503,474.28	500,631.41	1.59
253,000.00	PORTUGAL OBRIGACOES DO TESOURO OT 4.95% 25/10/2023	EUR	255,239.89	254,163.80	0.81
243,000.00	PORTUGAL OBRIGACOES DO TESOURO OT 5.65% 15/02/2024	EUR	248,234.39	246,467.61	0.78
ITALIA			449,881.19	450,643.71	1.43
Servizi di telecomunicazione			449,881.19	450,643.71	1.43
451,000.00	TELECOM ITALIA SPA/MILANO 2.50% 19/07/2023	EUR	449,881.19	450,643.71	1.43
SPAGNA			252,690.32	251,491.96	0.80
Enti Governativi			252,690.32	251,491.96	0.80
251,000.00	SPAIN GOVERNMENT BOND 4.40% 31/10/2023	EUR	252,690.32	251,491.96	0.80
Obbligazioni zero coupon			7,241,552.82	7,262,961.95	23.05
ITALIA			4,566,241.10	4,579,943.97	14.54
Enti Governativi			4,566,241.10	4,579,943.97	14.54
950,000.00	BOT 0.00% 13/10/2023	EUR	935,110.13	941,127.00	2.99
612,000.00	BOT 0.00% 14/08/2023	EUR	608,435.82	609,600.96	1.94
611,000.00	BOT 0.00% 31/07/2023	EUR	608,130.12	609,460.28	1.93
500,000.00	BOT 0.00% 14/03/2024	EUR	486,632.66	489,030.00	1.55
494,000.00	BTP 0.00% 29/11/2023	EUR	487,665.38	487,093.88	1.55
490,000.00	BOT 0.00% 14/09/2023	EUR	483,885.88	486,560.20	1.54
489,000.00	BOT 0.00% 14/06/2024	EUR	472,495.61	471,591.60	1.50
247,000.00	BOT 0.00% 14/12/2023	EUR	242,043.78	243,134.45	0.77
248,000.00	BOT 0.00% 14/02/2024	EUR	241,841.72	242,345.60	0.77
STATI UNITI			1,461,061.43	1,471,742.57	4.67
Enti Governativi			1,461,061.43	1,471,742.57	4.67
1,612,000.00	UNITED STATES TREASURY NOTE 0.00% 31/07/2023	USD	1,461,061.43	1,471,742.57	4.67
GERMANIA			485,768.23	486,343.00	1.54
Enti Governativi			485,768.23	486,343.00	1.54
494,000.00	GERMAN TREASURY BILL 0.00% 13/12/2023	EUR	485,768.23	486,343.00	1.54
FRANCIA			487,271.69	486,056.06	1.54
Enti Governativi			487,271.69	486,056.06	1.54
497,000.00	FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 0.00% 25/02/2024	EUR	487,271.69	486,056.06	1.54
SPAGNA			241,210.37	238,876.35	0.76
Enti Governativi			241,210.37	238,876.35	0.76
255,000.00	SPAIN GOVERNMENT BOND 0.00% 31/05/2025	EUR	241,210.37	238,876.35	0.76

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

NEW MILLENNIUM - VolActive

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Azioni di OICR			1,249,694.48	1,243,978.64	3.95
IRLANDA			1,249,694.48	1,243,978.64	3.95
Finanza			1,249,694.48	1,243,978.64	3.95
36,199.00	INVESCO EURO CORPORATE HYBRID BOND UCITS ETF	EUR	1,249,694.48	1,243,978.64	3.95
NEGOZIATI SU UN ALTRO MERCATO REGOLAMENTATO			1,093,604.01	1,089,670.49	3.46
Obbligazioni ordinarie			1,093,604.01	1,089,670.49	3.46
STATI UNITI			1,093,604.01	1,089,670.49	3.46
Informatica			1,093,604.01	1,089,670.49	3.46
705,000.00	NVIDIA CORP. 0.58% 14/06/2024	USD	618,438.85	617,388.53	1.96
518,000.00	MICROSOFT CORP. 3.63% 15/12/2023	USD	475,165.16	472,281.96	1.50
Warrants			0.00	0.00	0.00
ITALIA			0.00	0.00	0.00
Beni voluttuari			0.00	0.00	0.00
10,665.00	SEMPLICEMENTE SPA 15/06/2017	EUR	0.00	0.00	0.00
QUOTE DI OICR			619,829.32	638,238.32	2.03
Azioni di OICR			619,829.32	638,238.32	2.03
IRLANDA			619,829.32	638,238.32	2.03
Finanza			619,829.32	638,238.32	2.03
15,944.00	SPDR REFINITIV GLOBAL CONVERTIBLE BOND UCITS ETF	EUR	619,829.32	638,238.32	2.03
Totale del Portafoglio Titoli			28,882,244.48	29,137,238.26	92.49

** Inadempiente / delistata

NEW MILLENNIUM - VolActive

IMPEGNI SU ACQUISTO / VENDITA DI CONTRATTI FUTURES AL 30 GIUGNO 2023

Valore nominale	Quantità	Acquisto / Vendita	Contratto	Scadenza	Valore di mercato al 30 Giugno 2023	Valuta	Plus/(minus) valenza non realizzata (EUR)	Impegno (EUR)
							140,988.14	15,577,220.75
125,000	124	Acquisto	EURO FX CURRENCY	18/09/2023	1.00	USD	142,781.81	15,561,085.92
1,000	1	Acquisto	CBOE VIX	20/09/2023	16.14	USD	-1,793.67	16,134.83

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Attività

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	23,854,992.84
Liquidità bancarie a vista		593,641.72
Importi dovuti dai broker		1,416,025.52
Contratti di opzioni al valore di mercato	(Note 2e, 13)	1,953.71
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	(Note 2c, 13)	51,193.83
Interessi da ricevere		349,908.47
Altre attività		456.07
Totale attività		26,268,172.16

Passività

Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	(Note 2c, 13)	-101,595.34
Perdite non realizzate su contratti futures	(Note 2d, 13)	-32,415.21
Interest payable		-505.30
Da pagare su rimborsi		-433.12
Altre passività		-91,157.52
Totale passività		-226,106.49

Totale attivo netto**26,042,065.67**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	102.00	1,656.814
Azione D	EUR	73.65	1,754.410
Azione I	EUR	108.09	237,912.004
Azione L	EUR	106.63	260.000

NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond**PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR**

Attivo netto all'inizio del periodo		33,118,900.98
Risultato netto degli investimenti		539,106.24
Altri ricavi		304.42
Totale ricavi		539,410.66
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-121,032.45
Commissione di consulenza	(Nota 6)	-8,133.70
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 8)	-8,349.60
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-1,502.51
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 8)	-14,480.37
Commissioni del Transfer Agent		-2,979.64
Compensi professionali	(Nota 9)	-5,507.61
Pubblicazioni		-668.30
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-11,272.88
Totale costi		-173,927.06
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		365,483.60
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	-872,025.24
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		170,035.90
- di contratti di opzioni		-8,016.78
- di contratti futures		15,944.78
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		936,069.31
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(Nota 2c)	-282,212.74
- sulle opzioni		-26,127.63
- su contratti futures	(Nota 2d)	-32,415.21
Risultato netto delle operazioni per il periodo		266,735.99
Distribuzioni di dividendi	(Nota 14)	-5,368.49
Sottoscrizioni del periodo		406,711.52
Rimborsi del periodo		-7,744,914.33
Attivo netto alla fine del periodo		26,042,065.67

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 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			25,262,255.93	23,854,992.84	91.60
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			23,836,016.19	22,484,009.55	86.34
Obbligazioni ordinarie			19,533,618.24	18,277,486.43	70.18
STATI UNITI			6,577,876.40	6,372,450.82	24.47
Enti Governativi			3,441,595.62	3,384,879.95	13.00
1,600,000.00	UNITED STATES TREASURY NOTE 0.50% 28/02/2026	USD	1,344,222.35	1,316,509.67	5.06
1,174,740.00	UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.13% 15/04/2025	USD	1,043,965.17	1,024,221.08	3.93
1,000,000.00	UNITED STATES TREASURY NOTE 0.75% 15/11/2024	USD	872,870.65	862,060.05	3.31
3,000,000,000.00	INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT 5.50% 04/03/2025	IDR	180,537.45	182,089.15	0.70
Sovranazionale			2,706,236.88	2,593,943.13	9.96
2,104,000.00	INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT 1.90% 16/01/2025	CAD	1,498,786.14	1,391,861.31	5.34
1,150,000,000.00	INTERNATIONAL FINANCE CORP. 0.50% 23/12/2024	CLP	1,207,450.74	1,202,081.82	4.62
Energia			430,043.90	393,627.74	1.51
400,000.00	ENI USA INC 7.30% 15/11/2027	USD	430,043.90	393,627.74	1.51
LUSSEMBURGO			3,474,725.24	2,541,297.99	9.76
Finanza			2,286,771.93	1,575,880.60	6.05
8,922,997.50	SWISS INSURED BRAZIL POWER FINANCE SARL 9.85% 16/07/2032	BRL	2,286,771.93	1,575,880.60	6.05
Enti Governativi			1,187,953.31	965,417.39	3.71
20,000,000.00	EUROPEAN INVESTMENT BANK 8.50% 17/09/2024	ZAR	1,187,953.31	965,417.39	3.71
REGNO UNITO			2,090,780.46	2,031,361.04	7.80
Sovranazionale			2,090,780.46	2,031,361.04	7.80
120,000,000.00	EUROPEAN BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT 5.00% 15/01/2026	INR	1,277,536.00	1,278,011.01	4.91
6,000,000.00	EUROPEAN BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT 2.00% 21/01/2025	CNY	813,244.46	753,350.03	2.89
FRANCIA			1,713,093.33	1,648,868.95	6.33
Finanza			1,713,093.33	1,648,868.95	6.33
1,000,000.00	BNP PARIBAS SA 4.38% 28/09/2025	USD	927,548.10	880,375.53	3.38
700,000.00	SOCIETE GENERALE SA 1.88% 03/10/2024	GBP	785,545.23	768,493.42	2.95
SENEGAL			1,509,053.04	1,517,317.92	5.83
Enti Governativi			1,509,053.04	1,517,317.92	5.83
25,000,000,000.00	EUROPEAN BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT 5.20% 28/05/2024	IDR	1,509,053.04	1,517,317.92	5.83
PAESI BASSI			1,164,223.24	1,135,839.49	4.36
Beni voluttuari			1,164,223.24	1,135,839.49	4.36
9,000,000.00	BMW FINANCE NV 2.80% 11/08/2023	CNY	1,164,223.24	1,135,839.49	4.36
FILIPPINE			957,219.40	1,102,063.51	4.23
Sovranazionale			957,219.40	1,102,063.51	4.23
5,000,000,000.00	ASIAN DEVELOPMENT BANK 10.75% 27/01/2026	COP	957,219.40	1,102,063.51	4.23
ISOLE VERGINI BRITANNICHE			898,429.56	886,315.03	3.40
Beni voluttuari			898,429.56	886,315.03	3.40
1,000,000.00	LEVC FINANCE LTD 1.38% 25/03/2024	USD	898,429.56	886,315.03	3.40

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 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
NUOVA ZELANDA			804,389.59	694,221.10	2.67
Enti Governativi			804,389.59	694,221.10	2.67
1,300,000.00	NEW ZEALAND LOCAL GOVERNMENT FUNDING AGENCY BOND 2.75% 15/04/2025	NZD	804,389.59	694,221.10	2.67
EMIRATI ARABI UNITI			343,827.98	347,750.58	1.33
Energia			343,827.98	347,750.58	1.33
400,000.00	ABU DHABI NATIONAL OIL CO 0.70% 04/06/2024	USD	343,827.98	347,750.58	1.33
Obbligazioni a tasso variabile			2,948,803.95	2,938,734.20	11.29
LUSSEMBURGO			1,765,109.71	1,634,715.35	6.28
Finanza			1,765,109.71	1,634,715.35	6.28
1,400,000.00	SWISS RE FINANCE LUXEMBOURG SA FRN 31/12/2099	USD	1,277,647.85	1,182,621.08	4.54
500,000.00	MEDIOBANCA INTERNATIONAL LUXEMBOURG SA FRN 29/03/2024	USD	487,461.86	452,094.27	1.74
REGNO UNITO			894,496.98	880,467.19	3.38
Energia			894,496.98	880,467.19	3.38
1,000,000.00	BP CAPITAL MARKETS PLC FRN 31/12/2099	USD	894,496.98	880,467.19	3.38
AUSTRALIA			289,197.26	423,551.66	1.63
Finanza			289,197.26	423,551.66	1.63
500,000.00	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD FRN 29/10/2049	USD	289,197.26	423,551.66	1.63
Obbligazioni zero coupon			1,353,594.00	1,267,788.92	4.87
STATI UNITI			1,153,158.56	1,080,510.73	4.15
Enti Governativi			1,039,266.16	988,971.98	3.80
1,200,000.00	UNITED STATES TREASURY NOTE 0.00% 31/12/2026	USD	1,039,266.16	988,971.98	3.80
Sovranazionale			113,892.40	91,538.75	0.35
20,000,000.00	INTERNATIONAL FINANCE CORP. 0.00% 26/04/2052	MXN	113,892.40	91,538.75	0.35
FILIPPINE			200,435.44	187,278.19	0.72
Sovranazionale			200,435.44	187,278.19	0.72
20,000,000.00	ASIAN DEVELOPMENT BANK 0.00% 20/04/2043	MXN	200,435.44	187,278.19	0.72
NEGOZIATI SU UN ALTRO MERCATO REGOLAMENTATO			459,372.95	432,928.37	1.66
Obbligazioni ordinarie			459,372.95	432,928.37	1.66
STATI UNITI			459,372.95	432,928.37	1.66
Beni voluttuari			459,372.95	432,928.37	1.66
500,000.00	HARLEY-DAVIDSON FINANCIAL SERVICES INC 3.35% 08/06/2025	USD	459,372.95	432,928.37	1.66
ALTRI VALORI MOBILIARI			966,866.79	938,054.92	3.60
Obbligazioni ordinarie			966,866.79	938,054.92	3.60
FILIPPINE			966,866.79	938,054.92	3.60
Sovranazionale			966,866.79	938,054.92	3.60
1,600,000.00	ASIAN DEVELOPMENT BANK 1.10% 15/08/2024	AUD	966,866.79	938,054.92	3.60
Totale del Portafoglio Titoli			25,262,255.93	23,854,992.84	91.60

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond

IMPEGNI SU ACQUISTO / VENDITA DI CONTRATTI FUTURES AL 30 GIUGNO 2023

Valore nominale	Quantità	Acquisto / Vendita	Contratto	Scadenza	Valore di mercato al 30 Giugno 2023	Valuta	Plus/(minus) valenza non realizzata (EUR)	Impegno (EUR)
							-32,415.21	4,178,103.65
100,000	-8	Vendita	US 10YR NOTE (CBT)	20/09/2023	102.90	USD	-572.87	823,212.39
200,000	18	Acquisto	US 2YR NOTE (CBT)	29/09/2023	93.19	USD	-31,842.34	3,354,891.26

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond

CONTRATTI DI OPZIONI AL 30 GIUGNO 2023

Quantità	Acquisto / Vendita		Call/Put	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	Impegno (EUR)
CONTRATTI DI OPZIONI						16,037.24	1,953.71	0.00
OPZIONI ACQUISTATE						16,037.24	1,953.71	0.00
350,000	Acquisto		PUT	DIGITAL 111.00 15/11/2023	USD	16,037.24	1,953.71	0.00

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond

CONTRATTI FINANZIARI A TERMINE AL 30 GIUGNO 2023

Scadenza	Ammontare comprato	Valuta comprata	Ammontare venduto	Valuta venduta	Plus/(minus)-valenza non realizzata (EUR)
					-50,401.51
17/07/2023	1,000,000.00	USD	919,430.83	EUR	-3,370.49
20/09/2023	139,971,030.00	JPY	1,000,000.00	USD	-18,132.73
17/07/2023	744,500.85	EUR	660,000.00	GBP	-24,169.40
20/09/2023	460,000,000.00	JPY	2,997,092.75	EUR	-55,922.72
17/07/2023	1,424,672.74	EUR	1,540,000.00	USD	13,939.81
17/07/2023	926,367.67	EUR	1,000,000.00	USD	10,307.33
14/07/2023	1,000,000.00	USD	907,764.75	EUR	8,431.46
17/07/2023	1,500,000.00	USD	1,366,558.81	EUR	7,531.70
14/07/2023	620,000.00	USD	562,531.19	EUR	5,510.46
14/07/2023	500,000.00	USD	453,127.33	EUR	4,970.78
14/07/2023	458,600.40	EUR	500,000.00	USD	502.29

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Attività

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	6,146,164.52
Liquidità bancarie a vista		149,981.24
Importi dovuti dai broker		147,973.19
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	(Note 2c, 13)	8,422.99
Interessi da ricevere		111,701.99
Altre attività		562.26
Totale attività		6,564,806.19

Passività

Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	(Note 2c, 13)	-7,978.51
Altre passività		-32,900.08
Totale passività		-40,878.59

Totale attivo netto**6,523,927.60**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	82.09	2,900.000
Azione I	EUR	87.38	71,938.405

NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond**PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR**

Attivo netto all'inizio del periodo		1,512,850.52
Risultato netto degli investimenti		80,892.91
Totale ricavi		80,892.91
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-15,101.06
Commissione di consulenza	(Nota 6)	-7,264.91
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 8)	-1,752.76
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-245.08
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 8)	-10,592.02
Commissioni del Transfer Agent		-30.97
Compensi professionali	(Nota 9)	-4,794.10
Pubblicazioni		-29.34
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-7,324.58
Totale costi		-47,134.82
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		33,758.09
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	-26,492.98
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		13,057.32
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		108,355.90
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(Nota 2c)	-4,208.45
Risultato netto delle operazioni per il periodo		124,469.88
Sottoscrizioni del periodo		5,024,479.20
Rimborsi del periodo		-137,872.00
Attivo netto alla fine del periodo		6,523,927.60

NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			7,117,142.85	6,146,164.52	94.21
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			6,009,839.33	5,653,063.73	86.65
Obbligazioni ordinarie			1,574,233.96	1,157,732.94	17.75
ITALIA			644,415.00	639,879.00	9.81
Finanza			644,415.00	639,879.00	9.81
250,000.00	INTESA SANPAOLO VITA SPA 2.38% 22/12/2030	EUR	188,750.00	189,465.00	2.91
200,000.00	BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA 1.88% 09/01/2026	EUR	176,750.00	178,172.00	2.73
200,000.00	BANCO BPM SPA 3.38% 19/01/2032	EUR	172,840.00	174,972.00	2.68
100,000.00	BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA 3.63% 24/09/2024	EUR	106,075.00	97,270.00	1.49
GRECIA			350,840.00	350,031.50	5.37
Enti Governativi			350,840.00	350,031.50	5.37
350,000.00	HELLENIC REPUBLIC GOVERNMENT BOND 3.38% 15/02/2025	EUR	350,840.00	350,031.50	5.37
FRANCIA			100,000.00	95,818.00	1.47
Servizi di telecomunicazione			100,000.00	95,818.00	1.47
100,000.00	ILIAD HOLDING SASU 5.13% 15/10/2026	EUR	100,000.00	95,818.00	1.47
PAESI BASSI			35,805.32	38,066.38	0.58
Beni voluttuari			35,805.32	38,066.38	0.58
40,000.00	KONINKLIJKE LUCHTVAART MAATSCHAPPIJ NV 5.75% 29/05/2049	CHF	35,805.32	38,066.38	0.58
NORVEGIA			21,550.55	21,503.60	0.33
Energia			21,550.55	21,503.60	0.33
23,415.00	DNO ASA 8.38% 29/05/2024	USD	21,550.55	21,503.60	0.33
LIBANO			165,956.46	12,434.46	0.19
Enti Governativi			165,956.46	12,434.46	0.19
200,000.00	LEBANON GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.05% 02/11/2035	USD	165,956.46	12,434.46	0.19
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 7.75% 15/06/2021**	USD	72,591.46	0.00	0.00
Obbligazioni a tasso variabile			4,435,605.37	4,495,330.79	68.90
ITALIA			1,799,905.00	1,824,195.00	27.96
Finanza			1,494,890.00	1,518,671.00	23.28
400,000.00	UNICREDIT SPA REG FRN 31/12/2099	EUR	287,180.00	302,888.00	4.64
200,000.00	BPER BANCA FRN 20/01/2033	EUR	204,040.00	208,522.00	3.20
250,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 31/12/2099	EUR	197,050.00	199,815.00	3.06
200,000.00	FINECOBANCA BANCA FINECO SPA FRN 31/12/2099	EUR	182,020.00	193,012.00	2.96
200,000.00	UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA FRN 31/12/2099	EUR	169,540.00	173,390.00	2.66
200,000.00	ICCREA BANCA SPA FRN 18/01/2032	EUR	185,920.00	172,508.00	2.64
200,000.00	BANCA POPOLARE DI SONDRIO SPA FRN 25/02/2032	EUR	168,000.00	167,720.00	2.57
100,000.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA FRN 27/10/2047	EUR	101,140.00	100,816.00	1.55
Industria			305,015.00	305,524.00	4.68
400,000.00	POSTE ITALIANE SPA FRN 31/12/2099	EUR	305,015.00	305,524.00	4.68

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

NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
LUSSEMBURGO			488,540.00	485,045.00	7.44
Salute			300,000.00	300,099.00	4.60
300,000.00	EUROFINS SCIENTIFIC SE FRN 31/12/2099	EUR	300,000.00	300,099.00	4.60
Finanza			188,540.00	184,946.00	2.84
200,000.00	BANQUE INTERNATIONALE A LUXEMBOURG SA FRN 01/05/2033	EUR	188,540.00	184,946.00	2.84
GRECIA			422,978.65	437,956.64	6.71
Finanza			422,978.65	437,956.64	6.71
200,000.00	NATIONAL BANK OF GREECE SA FRN 02/06/2027	GBP	224,018.65	232,632.64	3.56
200,000.00	ALPHA BANK SA FRN 16/06/2027	EUR	198,960.00	205,324.00	3.15
SPAGNA			384,480.00	386,102.00	5.92
Finanza			384,480.00	386,102.00	5.92
200,000.00	UNICAJA BANCO SA FRN 15/11/2027	EUR	201,840.00	201,096.00	3.08
200,000.00	BANCO DE SABADELL SA FRN 16/08/2033	EUR	182,640.00	185,006.00	2.84
PORTOGALLO			345,500.00	358,226.00	5.49
Servizi di pubblica utilità			198,500.00	198,638.00	3.04
200,000.00	EDP - ENERGIAS DE PORTUGAL SA FRN 23/04/2083	EUR	198,500.00	198,638.00	3.04
Finanza			147,000.00	159,588.00	2.45
200,000.00	BANCO COMERCIAL PORTUGUES SA FRN 17/05/2032	EUR	147,000.00	159,588.00	2.45
REGNO UNITO			330,400.00	340,464.00	5.22
Finanza			166,400.00	178,694.00	2.74
200,000.00	BARCLAYS BANK PLC FRN 29/03/2049	EUR	166,400.00	178,694.00	2.74
Servizi di telecomunicazione			164,000.00	161,770.00	2.48
200,000.00	VODAFONE GROUP PLC FRN 27/08/2080	EUR	164,000.00	161,770.00	2.48
GERMANIA			276,504.00	279,219.00	4.28
Finanza			276,504.00	279,219.00	4.28
300,000.00	ALLIANZ SE FRN 05/07/2052	EUR	276,504.00	279,219.00	4.28
FRANCIA			194,962.00	203,834.00	3.12
Servizi di pubblica utilità			194,962.00	203,834.00	3.12
200,000.00	ELECTRICITE DE FRANCE SA FRN 31/12/2029	EUR	194,962.00	203,834.00	3.12
PAESI BASSI			192,335.72	180,289.15	2.76
Finanza			192,335.72	180,289.15	2.76
500,000.00	AEGON NV FRN 29/06/2049	NLG	192,335.72	180,289.15	2.76
NEGOZIATI SU UN ALTRO MERCATO REGOLAMENTATO			695,841.47	355,964.26	5.46
Obbligazioni ordinarie			695,841.47	355,964.26	5.46
LUSSEMBURGO			277,389.08	255,765.08	3.92
Energia			200,704.20	196,559.97	3.01
248,469.99	ACU PETROLEO LUXEMBOURG SARL 7.50% 13/01/2032	USD	200,704.20	196,559.97	3.01
Servizi di telecomunicazione			76,684.88	59,205.11	0.91
80,000.00	TELECOM ITALIA CAPITAL SA 6.00% 30/09/2034	USD	76,684.88	59,205.11	0.91
STATI UNITI			94,261.56	100,199.18	1.54
Beni voluttuari			48,032.93	56,883.89	0.87
65,254.55	US AIRWAYS 2012-2 CLASS A PASS THROUGH TRUST 4.63% 03/06/2025	USD	48,032.93	56,883.89	0.87

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

NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Informatica			46,228.63	43,315.29	0.67
50,000.00	XEROX HOLDINGS CORP 5.00% 15/08/2025	USD	46,228.63	43,315.29	0.67
BERMUDA			324,190.83	0.00	0.00
Servizi di telecomunicazione			324,190.83	0.00	0.00
400,000.00	DIGICEL GROUP LTD 8.25% 30/09/2020	USD	324,190.83	0.00	0.00
ALTRI VALORI MOBILIARI			411,462.05	137,136.53	2.10
Obbligazioni ordinarie			274,556.37	0.00	0.00
LUSSEMBURGO			274,556.37	0.00	0.00
Energia			274,556.37	0.00	0.00
13,068.00	CONSTELLATION OIL SERVICES HOLDING SA 0.25% 31/12/2050**	USD	274,556.37	0.00	0.00
Obbligazioni a tasso variabile			136,905.68	137,136.53	2.10
ITALIA			136,905.68	137,136.53	2.10
Finanza			136,905.68	137,136.53	2.10
200,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 01/06/2032	USD	136,905.68	137,136.53	2.10
Totale del Portafoglio Titoli			7,117,142.85	6,146,164.52	94.21

** Inadempiente / delistata

NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond

CONTRATTI FINANZIARI A TERMINE AL 30 GIUGNO 2023

Scadenza	Ammontare comprato	Valuta comprata	Ammontare venduto	Valuta venduta	Plus/(minus)-valenza non realizzata (EUR)
					444.48
17/07/2023	236,598.39	EUR	210,000.00	GBP	-7,978.51
17/07/2023	667,005.87	EUR	721,000.00	USD	6,526.36
17/07/2023	200,000.00	USD	181,315.44	EUR	1,896.63

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Attività

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	83,614,489.30
Liquidità bancarie a vista		742,303.69
Importi dovuti dai broker		1,282,035.09
Utili non realizzati su contratti futures	(Note 2d, 13)	2,000.00
Dividendi da ricevere		11,995.12
Interessi da ricevere		424,925.56
Da ricevere su vendita titoli		876,584.85
Altre attività		2,483.93
Totale attività		86,956,817.54

Passività

Perdite non realizzate su contratti futures	(Note 2d, 13)	-40,285.84
Altre passività		-402,736.59
Totale passività		-443,022.43

Totale attivo netto**86,513,795.11**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	101.61	233,308.794
Azione I	EUR	104.97	44,465.145
Azione L	EUR	103.84	559,887.000

NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity**PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR**

Attivo netto all'inizio del periodo		89,162,203.08
Risultato netto degli investimenti		891,211.64
Altri ricavi		3,954.19
Totale ricavi		895,165.83
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-686,677.45
Commissione di consulenza	(Nota 6)	-8,409.17
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 8)	-24,413.33
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-18,299.98
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 8)	-19,371.09
Commissioni del Transfer Agent		-818.37
Compensi professionali	(Nota 9)	-9,059.17
Pubblicazioni		-1,724.54
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-17,697.31
Totale costi		-786,470.41
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		108,695.42
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	188,938.39
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		-8,081.54
- di contratti futures		424,276.05
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		2,859,760.83
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(Nota 2c)	-5,848.99
- su contratti futures	(Nota 2d)	-229,930.72
Risultato netto delle operazioni per il periodo		3,337,809.44
Sottoscrizioni del periodo		74,412.04
Rimborsi del periodo		-6,060,629.45
Attivo netto alla fine del periodo		86,513,795.11

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

NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			86,951,608.01	83,614,489.30	96.65
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			86,158,945.39	82,844,899.30	95.76
Azioni			995,358.70	1,081,759.52	1.25
STATI UNITI			995,358.70	1,081,759.52	1.25
Informatica			995,358.70	1,081,759.52	1.25
14,000.00	ACTIVISION BLIZZARD INC	USD	995,358.70	1,081,759.52	1.25
Obbligazioni ordinarie			29,491,740.60	27,351,896.79	31.61
ITALIA			11,201,950.64	10,778,985.02	12.46
Enti Governativi			6,914,488.81	6,793,332.02	7.85
4,000,000.00	BTP 0.95% 01/08/2030	EUR	3,406,718.70	3,296,800.00	3.81
3,106,355.00	BTP 0.55% 21/05/2026	EUR	3,009,260.43	2,999,807.02	3.47
500,000.00	BANCO BPM SPA 4.88% 18/01/2027	EUR	498,509.68	496,725.00	0.57
Finanza			1,817,153.82	1,595,603.00	1.85
1,000,000.00	CASSA DEPOSITI E PRESTITI SPA -E- 1.00% 21/09/2028	EUR	1,017,962.28	859,500.00	1.00
500,000.00	BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA REG 2.63% 28/04/2025	EUR	496,159.57	468,845.00	0.54
300,000.00	BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA 1.88% 09/01/2026	EUR	303,031.97	267,258.00	0.31
Beni di prima necessità			977,183.55	984,530.00	1.14
1,000,000.00	ESSELUNGA SPA 0.88% 25/10/2023	EUR	977,183.55	984,530.00	1.14
Industria			1,001,780.76	911,400.00	1.05
700,000.00	WEBUILD SPA 3.88% 28/07/2026	EUR	696,497.21	646,842.00	0.75
300,000.00	SOFIMA HOLDING SPA 3.75% 15/01/2028	EUR	305,283.55	264,558.00	0.30
Servizi di telecomunicazione			491,343.70	494,120.00	0.57
500,000.00	TELECOM ITALIA SPA/MILANO 4.00% 11/04/2024	EUR	491,343.70	494,120.00	0.57
GERMANIA			6,627,561.53	6,310,389.28	7.29
Enti Governativi			5,632,517.86	5,349,174.28	6.18
3,000,000.00	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 0.50% 15/02/2025	EUR	2,894,272.00	2,873,550.00	3.32
2,531,934.50	DEUTSCHE BUNDESREPUBLIK INFLATION LINKED BOND 0.10% 15/04/2026	EUR	2,738,245.86	2,475,624.28	2.86
Servizi di pubblica utilità			499,196.82	485,195.00	0.56
500,000.00	RWE AG 2.50% 24/08/2025	EUR	499,196.82	485,195.00	0.56
Beni voluttuari			495,846.85	476,020.00	0.55
500,000.00	DEUTSCHE LUFTHANSA AG 3.00% 29/05/2026	EUR	495,846.85	476,020.00	0.55
SPAGNA			4,566,318.43	3,956,921.97	4.57
Enti Governativi			4,566,318.43	3,956,921.97	4.57
3,000,000.00	SPAIN GOVERNMENT BOND 1.45% 30/04/2029	EUR	3,197,692.93	2,723,760.00	3.15
1,227,210.00	SPAIN GOVERNMENT INFLATION LINKED BOND 1.80% 30/11/2024	EUR	1,368,625.50	1,233,161.97	1.42
PORTOGALLO			2,545,998.32	2,278,825.00	2.63
Enti Governativi			2,545,998.32	2,278,825.00	2.63
2,500,000.00	PORTUGAL OBRIGACOES DO TESOURO OT 0.70% 15/10/2027	EUR	2,545,998.32	2,278,825.00	2.63
PAESI BASSI			2,097,697.36	1,742,595.00	2.02
Servizi di telecomunicazione			1,039,076.84	824,990.00	0.95
1,000,000.00	PROSUS NV 1.54% 03/08/2028	EUR	1,039,076.84	824,990.00	0.95
Materie prime			544,510.89	480,180.00	0.56
500,000.00	SYNGENTA FINANCE NV 3.38% 16/04/2026	EUR	544,510.89	480,180.00	0.56

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

NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Industria			514,109.63	437,425.00	0.51
500,000.00	EASYJET FINCO BV 1.88% 03/03/2028	EUR	514,109.63	437,425.00	0.51
FRANCIA			1,504,896.27	1,379,165.00	1.59
Beni voluttuari			1,010,860.62	915,455.00	1.06
500,000.00	RCI BANQUE SA 1.75% 10/04/2026	EUR	508,374.13	465,405.00	0.54
500,000.00	ACCOR SA 2.38% 29/11/2028	EUR	502,486.49	450,050.00	0.52
Servizi di telecomunicazione			494,035.65	463,710.00	0.53
500,000.00	ILIAD SA 2.38% 17/06/2026	EUR	494,035.65	463,710.00	0.53
STATI UNITI			503,550.69	483,955.00	0.56
Beni voluttuari			503,550.69	483,955.00	0.56
500,000.00	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 1.74% 19/07/2024	EUR	503,550.69	483,955.00	0.56
REGNO UNITO			443,767.36	421,060.52	0.49
Enti Governativi			443,767.36	421,060.52	0.49
500,000.00	UNITED KINGDOM GILT 0.25% 31/07/2031	GBP	443,767.36	421,060.52	0.49
Obbligazioni a tasso variabile			29,889,098.11	27,309,851.99	31.57
ITALIA			13,669,301.39	12,852,428.00	14.86
Enti Governativi			5,494,533.80	5,518,350.00	6.38
3,000,000.00	CCT FRN 15/04/2026	EUR	3,006,513.06	3,016,800.00	3.49
1,500,000.00	CCT FRN 15/02/2024	EUR	1,493,553.11	1,507,650.00	1.74
1,000,000.00	CCT FRN 15/04/2029	EUR	994,467.63	993,900.00	1.15
Finanza			4,969,385.39	4,571,832.00	5.29
900,000.00	UNICREDIT SPA FRN 20/02/2029	EUR	888,539.83	895,752.00	1.04
1,000,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 31/12/2099	EUR	997,147.64	838,280.00	0.97
1,000,000.00	UNICREDIT SPA REG FRN 31/12/2099	EUR	859,326.11	757,220.00	0.87
750,000.00	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA FRN 23/11/2030	EUR	753,602.15	679,695.00	0.79
500,000.00	UNICREDIT SPA FRN 23/09/2029	EUR	492,290.20	472,820.00	0.55
500,000.00	UNICREDIT SPA FRN 16/06/2026	EUR	466,621.41	469,500.00	0.54
500,000.00	SERVIZI ASSICURATIVI DEL COMMERCIO ESTERO SPA FRN 10/02/2049	EUR	511,858.05	458,565.00	0.53
Energia			1,578,644.28	1,477,984.00	1.71
1,600,000.00	ENI SPA FRN 31/12/2099	EUR	1,578,644.28	1,477,984.00	1.71
Industria			1,000,499.86	763,810.00	0.88
1,000,000.00	POSTE ITALIANE SPA FRN 31/12/2099	EUR	1,000,499.86	763,810.00	0.88
Servizi di pubblica utilità			626,238.06	520,452.00	0.60
600,000.00	ENEL SPA FRN 31/12/2099	EUR	626,238.06	520,452.00	0.60
FRANCIA			3,456,817.41	3,138,640.00	3.63
Finanza			1,241,938.08	1,197,435.00	1.38
1,500,000.00	AXA SA FRN 29/12/2049	EUR	1,241,938.08	1,197,435.00	1.38
Energia			1,213,178.63	1,068,355.00	1.24
700,000.00	TOTALENERGIES SE FRN 31/12/2099	EUR	705,323.38	583,730.00	0.68
500,000.00	TOTAL SA FRN 31/12/2099	EUR	507,855.25	484,625.00	0.56
Beni di prima necessità			1,001,700.70	872,850.00	1.01
1,000,000.00	DANONE SA FRN 31/12/2099	EUR	1,001,700.70	872,850.00	1.01
SPAGNA			3,117,830.96	2,871,380.00	3.32
Finanza			3,117,830.96	2,871,380.00	3.32
1,800,000.00	BANCO SANTANDER SA FRN 31/12/2099	EUR	1,769,838.02	1,552,338.00	1.79
800,000.00	BANCO SANTANDER SA FRN 31/12/2099	EUR	757,780.08	769,304.00	0.89
600,000.00	BANCO DE SABADELL SA FRN 17/01/2030	EUR	590,212.86	549,738.00	0.64

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

NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
GERMANIA			3,572,878.76	2,865,971.00	3.31
Finanza			3,068,150.70	2,392,501.00	2.76
1,000,000.00	ALLIANZ SE FRN 31/12/2099	EUR	983,590.03	703,100.00	0.81
1,000,000.00	ALLIANZ SE FRN 31/12/2099	EUR	1,005,203.15	667,940.00	0.77
600,000.00	COMMERZBANK AG FRN 31/03/2099	EUR	577,604.04	549,156.00	0.63
500,000.00	DEUTSCHE BANK AG FRN 19/11/2025	EUR	501,753.48	472,305.00	0.55
Salute			504,728.06	473,470.00	0.55
500,000.00	BAYER AG FRN 25/03/2082	EUR	504,728.06	473,470.00	0.55
PAESI BASSI			3,223,752.30	2,815,706.00	3.25
Finanza			1,926,024.52	1,705,898.00	1.97
1,200,000.00	AEGON NV FRN 29/07/2049	EUR	921,722.00	926,028.00	1.07
1,000,000.00	COOPERATIEVE RABOBANK UA FRN 31/12/2099	EUR	1,004,302.52	779,870.00	0.90
Beni voluttuari			1,098,748.59	955,040.00	1.10
1,000,000.00	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN 29/03/2049	EUR	1,098,748.59	955,040.00	1.10
Industria			198,979.19	154,768.00	0.18
200,000.00	ADECCO INTERNATIONAL FINANCIAL SERVICES BV FRN 21/03/2082	EUR	198,979.19	154,768.00	0.18
REGNO UNITO			2,399,328.35	2,319,256.00	2.68
Finanza			1,394,725.62	1,394,596.00	1.61
1,400,000.00	HSBC HOLDINGS PLC FRN 29/12/2049	EUR	1,394,725.62	1,394,596.00	1.61
Energia			1,004,602.73	924,660.00	1.07
1,000,000.00	BP CAPITAL MARKETS PLC FRN 31/12/2099	EUR	1,004,602.73	924,660.00	1.07
STATI UNITI			449,188.94	446,470.99	0.52
Finanza			449,188.94	446,470.99	0.52
500,000.00	GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE FRN 24/01/2025	USD	449,188.94	446,470.99	0.52
Obbligazioni zero coupon			6,568,455.79	6,478,269.64	7.49
ITALIA			2,701,345.23	2,711,029.64	3.13
Enti Governativi			2,701,345.23	2,711,029.64	3.13
1,750,000.00	BTP 0.00% 29/11/2023	EUR	1,723,624.46	1,725,535.00	1.99
1,002,130.00	BTP 0.00% 22/11/2028	EUR	977,720.77	985,494.64	1.14
SPAGNA			2,450,031.50	2,419,325.00	2.80
Enti Governativi			2,450,031.50	2,419,325.00	2.80
2,500,000.00	SPAIN GOVERNMENT BOND 0.00% 31/05/2024	EUR	2,450,031.50	2,419,325.00	2.80
FRANCIA			1,417,079.06	1,347,915.00	1.56
Enti Governativi			1,417,079.06	1,347,915.00	1.56
1,500,000.00	FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BOND OAT 0.00% 25/02/2027	EUR	1,417,079.06	1,347,915.00	1.56
Azioni di OICR			19,214,292.19	20,623,121.36	23.84
IRLANDA			11,592,246.63	11,667,173.80	13.49
Finanza			11,592,246.63	11,667,173.80	13.49
87,500.00	ISHARES MSCI EUROPE UCITS ETF	EUR	2,123,539.60	2,537,937.50	2.94
53,000.00	ISHARES MSCI EUROPE EX-UK UCITS ETF	EUR	1,716,796.52	2,120,000.00	2.45
11,500.00	ISHARES S&P 500 UCITS ETF -H-	EUR	987,650.78	1,083,300.00	1.25
14,700.00	ISHARES J.P. MORGAN USD EM BOND EUR HEDGED UCITS ETF -H-	EUR	1,419,944.51	971,670.00	1.12
14,000.00	ISHARES GLOBAL WATER UCITS ETF	EUR	786,136.96	776,860.00	0.90
80,000.00	ISHARES GLOBAL CLEAN ENERGY UCITS ETF	EUR	902,284.97	768,720.00	0.89
100,000.00	ISHARES HEALTHCARE INNOVATION UCITS ETF	EUR	766,732.37	684,500.00	0.79
2,000.00	INVESCO EQQQ NASDAQ-100 UCITS ETF	EUR	556,181.57	679,060.00	0.79
11,700.00	SPDR BARCLAYS EMERGING MARKETS LOCAL BOND UCITS ETF	EUR	692,037.24	615,654.00	0.71

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

NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
17,700.00	WISDOMTREE CLOUD COMPUTING UCITS ETF	EUR	602,249.36	507,459.00	0.59
33,350.00	ISHARES MSCI JAPAN UCITS ETF USD DIST	EUR	520,126.60	478,172.30	0.55
9,850.00	ISHARES MSCI AC FAR EAST EX-JAPAN UCITS ETF	EUR	518,566.15	443,841.00	0.51
LUSSEMBURGO			7,622,045.56	8,955,947.56	10.35
Finanza			7,622,045.56	8,955,947.56	10.35
32,000.00	AMUNDI INDEX MSCI EUROPE SRI UCITS DR ETF	EUR	1,823,593.12	2,332,800.00	2.70
41,000.00	FUNDSMITH EQUITY FUND SICAV -T-	EUR	1,632,107.50	2,266,037.20	2.62
15,006.00	LYXOR DAX UCITS ETF	EUR	1,914,451.49	2,236,794.36	2.59
17,000.00	LYXOR STOXX EUROPE 600 OIL & GAS UCITS ETF	EUR	928,468.69	912,220.00	1.05
51,000.00	XTRACKERS HARVEST CSI300 UCITS ETF	EUR	653,826.76	482,766.00	0.56
2,000.00	AMUNDI S&P GLOBAL LUXURY UCITS ETF	EUR	430,034.91	436,180.00	0.50
2,500.00	LYXOR EURO STOXX BANKS DR UCITS ETF	EUR	239,563.09	289,150.00	0.33
QUOTE DI OICR			792,662.62	769,590.00	0.89
Azioni di OICR			792,662.62	769,590.00	0.89
IRLANDA			792,662.62	769,590.00	0.89
Finanza			792,662.62	769,590.00	0.89
90,000.00	ISHARES PLC - ISHARES CORE FTSE 100 UCITS ETF	EUR	792,662.62	769,590.00	0.89
Totale del Portafoglio Titoli			86,951,608.01	83,614,489.30	96.65

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 2023

Valore nominale	Quantità	Acquisto / Vendita	Contratto	Scadenza	Valore di mercato al 30 Giugno 2023	Valuta	Plus/(minus) valenza non realizzata (EUR)	Impegno (EUR)
							-38,285.84	4,877,467.89
10	20	Acquisto	EURO STOXX 50	15/09/2023	4,427.00	EUR	2,000.00	885,400.00
100,000	16	Acquisto	EURO BUND	07/09/2023	133.74	EUR	-12,960.00	2,139,840.00
100,000	18	Acquisto	US 10YR NOTE (CBT)	20/09/2023	102.90	USD	-27,325.84	1,852,227.89

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Attività

Portafoglio Titoli al valore di mercato	(Nota 2a)	8,154,628.10
Liquidità bancarie a vista		522,561.90
Importi dovuti dai broker		27,972.57
Interessi da ricevere		50,466.72
Da ricevere su vendita titoli		98,084.80
Altre attività		1,969.42
Totale attività		8,855,683.51

Passività

Da pagare su acquisto titoli		-100,228.72
Altre passività		-44,280.29
Totale passività		-144,509.01

Totale attivo netto**8,711,174.50**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	95.01	51,509.248
Azione I	EUR	98.43	36,826.415
Azione L	EUR	97.38	1,975.000

NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia

PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Attivo netto all'inizio del periodo		8,540,646.35
Risultato netto degli investimenti		147,017.88
Altri ricavi		11.02
Totale ricavi		147,028.90
Commissioni di consulenza/gestione	(Nota 5)	-40,139.94
Commissione di consulenza	(Nota 6)	-7,796.29
Commissioni della Banca Depositaria	(Nota 8)	-2,435.93
Tassa di registrazione	(Nota 3)	-1,398.71
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(Nota 8)	-13,814.53
Commissioni del Transfer Agent		-190.71
Compensi professionali	(Nota 9)	-6,905.19
Pubblicazioni		-166.26
Altre spese e tasse	(Nota 4)	-8,380.30
Totale costi		-81,227.86
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		65,801.04
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(Nota 2b)	77,251.67
- di contratti di opzioni		-21,875.00
- di contratti futures		-60.00
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		331,052.45
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(Nota 2c)	-91.74
Risultato netto delle operazioni per il periodo		452,078.42
Rimborsi del periodo		-281,550.27
Attivo netto alla fine del periodo		8,711,174.50

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

NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			8,276,769.69	8,154,628.10	93.61
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			8,097,619.64	7,982,064.78	91.63
Azioni			3,174,450.92	3,305,275.23	37.94
ITALIA			2,673,178.13	2,738,602.73	31.44
Servizi di pubblica utilità			641,897.25	691,665.80	7.94
47,600.00	ENEL SPA	EUR	259,048.67	293,596.80	3.37
60,000.00	A2A SPA	EUR	87,043.87	100,380.00	1.15
35,000.00	HERA SPA	EUR	90,921.74	95,270.00	1.09
16,000.00	ITALGAS SPA	EUR	88,941.81	86,800.00	1.00
6,500.00	TERNA RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA	EUR	47,620.77	50,739.00	0.58
10,000.00	SNAM SPA	EUR	51,428.26	47,870.00	0.55
10,000.00	IREN SPA	EUR	16,892.13	17,010.00	0.20
Finanza			539,014.25	585,886.00	6.73
8,000.00	UNICREDIT SPA	EUR	134,696.90	170,120.00	1.95
36,900.00	BANCO BPM SPA	EUR	147,583.11	156,825.00	1.80
12,500.00	BANCA FARMAFACTORING SPA	EUR	116,716.06	125,375.00	1.44
6,000.00	POSTE ITALIANE SPA	EUR	59,527.45	59,496.00	0.69
10,000.00	BANCA POPOLARE DI SONDRIO	EUR	41,142.61	38,160.00	0.44
5,000.00	NEXI SPA	EUR	39,348.12	35,910.00	0.41
Industria			578,261.72	585,200.13	6.72
5,500.00	PRYSMIAN SPA	EUR	197,688.40	210,540.00	2.42
9,500.00	BIESSE SPA	EUR	115,437.91	114,570.00	1.32
11,000.00	LEONARDO SPA	EUR	117,911.55	114,345.00	1.31
1,456.00	INTERPUMP GROUP SPA	EUR	76,005.38	74,081.28	0.85
7,645.00	AVIO SPA	EUR	70,936.66	71,327.85	0.82
20.00	FERVI SPA	EUR	281.82	336.00	0.00
Beni voluttuari			237,186.04	234,695.80	2.69
10,000.00	TECHNOGYM SPA	EUR	85,225.24	84,800.00	0.97
950.00	BRUNELLO CUCINELLI SPA	EUR	78,861.67	76,570.00	0.88
5,000.00	BREMBO SPA	EUR	65,964.50	67,900.00	0.78
152.00	PORTOBELLO SPA	EUR	6,152.81	3,252.80	0.04
300.00	POWERSOFT SPA	EUR	981.82	2,040.00	0.02
100.00	RADICI PIETRO INDUSTRIES & BRANDS SPA	EUR	0.00	133.00	0.00
Informatica			195,335.83	184,790.00	2.12
700.00	SESA SPA	EUR	79,798.12	80,080.00	0.92
3,000.00	WIIT SPA	EUR	59,287.44	60,750.00	0.70
4,000.00	EL.EN. SPA	EUR	56,250.27	43,960.00	0.50
Servizi di telecomunicazione			125,487.94	111,540.00	1.28
700.00	REPLY SPA	EUR	84,666.14	72,870.00	0.84
150,000.00	TELECOM ITALIA SPA	EUR	40,821.80	38,670.00	0.44
Beni di prima necessità			115,210.84	108,280.00	1.24
8,500.00	FILA SPA	EUR	63,532.98	66,810.00	0.77
11,000.00	CIA DEI CARAIBI SPA	EUR	51,677.86	41,470.00	0.47
Salute			98,254.50	100,770.00	1.16
3,000.00	AMPLIFON SPA	EUR	98,254.50	100,770.00	1.16
Energia			91,602.72	82,875.00	0.95
65,000.00	SAIPEM SPA	EUR	91,602.72	82,875.00	0.95
Materie prime			50,927.04	52,900.00	0.61
2,000.00	SOL SPA	EUR	50,927.04	52,900.00	0.61

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

NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
PAESI BASSI			501,272.79	566,672.50	6.50
Beni voluttuari			375,339.17	429,335.00	4.93
950.00	FERRARI NV	EUR	242,408.08	284,525.00	3.27
9,000.00	STELLANTIS NV	EUR	132,931.09	144,810.00	1.66
Informatica			79,699.37	91,120.00	1.04
2,000.00	STMICROELECTRONICS NV	EUR	79,699.37	91,120.00	1.04
Industria			46,234.25	46,217.50	0.53
3,500.00	CNH INDUSTRIAL NV	EUR	46,234.25	46,217.50	0.53
Obbligazioni ordinarie			4,265,008.21	4,031,279.00	46.28
ITALIA			4,167,526.23	3,934,661.00	45.17
Enti Governativi			993,426.95	1,007,381.00	11.56
400,000.00	BTP 3.00% 01/08/2029	EUR	376,623.31	384,160.00	4.41
270,000.00	BTP 2.00% 01/12/2025	EUR	256,834.86	259,281.00	2.97
200,000.00	CASSA DEPOSITI E PRESTITI SPA 3.50% 19/09/2027	EUR	199,122.62	195,940.00	2.25
200,000.00	BTP 1.65% 01/03/2032	EUR	160,846.16	168,000.00	1.93
Finanza			949,188.01	900,181.00	10.33
250,000.00	INTESA SANPAOLO SPA 0.63% 24/02/2026	EUR	250,135.01	226,280.00	2.60
200,000.00	BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA 3.63% 24/09/2024	EUR	202,719.06	194,540.00	2.23
200,000.00	INTESA SANPAOLO SPA 2.86% 23/04/2025	EUR	205,713.74	193,644.00	2.22
100,000.00	TAMBURI INVESTMENT PARTNERS SPA 2.50% 05/12/2024	EUR	99,769.89	96,697.00	1.11
100,000.00	BANCA DEL MEZZOGIORNO-MEDIO CREDITO CENTRALE SPA 1.50% 24/10/2024	EUR	99,643.84	95,251.00	1.09
100,000.00	BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA REG 2.63% 28/04/2025	EUR	91,206.47	93,769.00	1.08
Servizi di pubblica utilità			854,095.50	817,130.00	9.38
300,000.00	SNAM SPA 0.75% 20/06/2029	EUR	251,344.50	248,730.00	2.85
200,000.00	A2A SPA 4.50% 19/09/2030	EUR	205,061.99	201,322.00	2.31
200,000.00	ITALGAS SPA 1.63% 19/01/2027	EUR	183,273.28	185,402.00	2.13
200,000.00	IREN SPA 1.50% 24/10/2027	EUR	214,415.73	181,676.00	2.09
Energia			439,078.58	439,800.00	5.05
200,000.00	ERG SPA 0.50% 11/09/2027	EUR	174,318.70	173,560.00	1.99
200,000.00	ENI SPA 0.38% 14/06/2028	EUR	164,759.88	168,932.00	1.94
100,000.00	ALERION CLEANPOWER SPA REG 3.13% 19/12/2025	EUR	100,000.00	97,308.00	1.12
Industria			531,929.33	391,554.00	4.50
250,000.00	POSTE ITALIANE SPA 0.50% 10/12/2028	EUR	230,932.83	205,540.00	2.36
200,000.00	AEROPORTI DI ROMA SPA REG 1.63% 08/06/2027	EUR	209,253.67	186,014.00	2.14
97,200.00	ENERTRONICA SPA 7.00% 31/12/2022*	EUR	91,742.83	0.00	0.00
Servizi di telecomunicazione			198,627.42	198,745.00	2.28
100,000.00	TELECOM ITALIA SPA/MILANO 2.50% 19/07/2023	EUR	99,497.78	99,921.00	1.15
100,000.00	TELECOM ITALIA SPA/MILANO 4.00% 11/04/2024	EUR	99,129.64	98,824.00	1.13
Salute			201,180.44	179,870.00	2.07
200,000.00	AMPLIFON SPA 1.13% 13/02/2027	EUR	201,180.44	179,870.00	2.07
FRANCIA			97,481.98	96,618.00	1.11
Beni voluttuari			97,481.98	96,618.00	1.11
100,000.00	PEUGEOT SA 2.00% 20/03/2025	EUR	97,481.98	96,618.00	1.11
Obbligazioni a tasso variabile			452,336.86	443,467.00	5.09
ITALIA			452,336.86	443,467.00	5.09
Finanza			452,336.86	443,467.00	5.09
300,000.00	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA FRN 17/07/2029	EUR	245,798.28	250,371.00	2.87
200,000.00	ICCREA BANCA SPA FRN 20/10/2025	EUR	206,538.58	193,096.00	2.22

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

NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2023 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Azioni di OICR			205,685.15	202,011.60	2.32
LUSSEMBURGO			205,685.15	202,011.60	2.32
Finanza			205,685.15	202,011.60	2.32
1,911.49	NEW MILLENNIUM SIF-SICAV - AIM SISTEMA ITALIA - PIR	EUR	205,685.15	202,011.60	2.32
Warrants			138.50	31.95	0.00
ITALIA			138.50	31.95	0.00
Beni voluttuari			138.50	31.95	0.00
30.00	SOSTRAVEL.COM SPA	EUR	138.50	31.95	0.00
ALTRI VALORI MOBILIARI			179,150.05	172,563.32	1.98
Obbligazioni ordinarie			179,150.05	172,563.32	1.98
ITALIA			179,150.05	172,563.32	1.98
Servizi di pubblica utilità			100,000.00	94,366.80	1.08
100,000.00	INNOVATEC SPA 6.00% 30/09/2026	EUR	100,000.00	94,366.80	1.08
Servizi di telecomunicazione			79,150.05	78,196.52	0.90
79,000.24	PRISMI SPA 4.00% 18/12/2024	EUR	79,150.05	78,196.52	0.90
Totale del Portafoglio Titoli			8,276,769.69	8,154,628.10	93.61

* Strumenti finanziari prezzati al fair value

NOTE AI RENDICONTI FINANZIARI

1. INFORMAZIONI DI CARATTERE GENERALE

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

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

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

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

I comparti operativi al 30 Giugno 2023 sono i seguenti:

- NEW MILLENNIUM - Euro Equities
- NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)
- NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term
- NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate
- NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative
- NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible
- NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe
- NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond
- NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond
- NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond
- NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing
- NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond
- NEW MILLENNIUM - VolActive
- NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond
- NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity
- NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia

Può essere ottenuta una copia gratuita del prospetto previa richiesta indirizzata alla sede legale della SICAV.

2. SOMMARIO DEI PRINCIPALI METODI CONTABILI

Il Fondo tiene la contabilità di ciascun Comparto nella rispettiva valuta ed i rendiconti finanziari sono espressi in Euro conformemente ai principi contabili validi per gli organismi di investimento collettivo in Lussemburgo, utilizzando in particolare le seguenti regole di valutazione:

a) Valutazione del portafoglio titoli

I titoli, comprese le obbligazioni zero coupon e gli strumenti del mercato monetario, quotati in una borsa ufficiale o in altro mercato regolamentato, sono valutati sulla base dell'ultimo prezzo di quotazione noto e, se ci sono più mercati, sulla base dell'ultimo prezzo di quotazione del mercato principale.

I titoli, comprese le obbligazioni zero coupon e gli strumenti del mercato monetario, non quotati in una borsa ufficiale o in un altro mercato regolamentato, sono valutati in buona fede sulla base del probabile valore di realizzo ritenuto prudente.

Il valore di ciascuna azione in un altro OICR e/o OIC, quotato o meno, è determinato in base all'ultimo Valore del Patrimonio Netto conosciuto al Giorno di Valorizzazione.

In assenza di un mercato per gli strumenti finanziari, la valutazione sarà effettuata facendo riferimento a metodi alternativi, come la quotazione di un broker o l'applicazione di una analisi ad hoc giudicata pertinente dalla Management Company.

b) Utile (perdita) netto(a) realizzato(a) sul portafoglio titoli

Gli utili o le perdite realizzate sulle vendite di titoli sono calcolati sulla base del costo medio.

c) Contratti di cambio a termine

I contratti di cambio a termine sono valutati al prezzo di quotazione di cambio a termine per la scadenza restante dalla data di valutazione.

Le plusvalenze o minusvalenze non realizzate sono registrate nel Prospetto del Patrimonio Netto e le loro variazioni nel Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto sotto la voce «Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata su contratti di cambio a termine e su valute estere».

d) Contratti Futures

Gli impegni legati ai contratti Futures sono registrati fuori bilancio e i contratti Futures sono valutati all'ultimo prezzo di quotazione disponibile dei contratti. Le plusvalenze o minusvalenze non realizzate sui contratti Futures sono registrate nel Prospetto del Patrimonio Netto e le loro variazioni nel Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto sotto la voce «Variazione della plus / (minus)- valenza non realizzata su contratti Futures». I depositi di garanzia sono classificati alle voci "Importi dovuti dai broker" e "Scoperti presso brokers".

e) Contratti di opzioni

Le opzioni quotate su una borsa ufficiale o su un altro mercato regolamentato sono valutate sulla base dell'ultimo prezzo di quotazione noto o, se ci sono più mercati, sulla base dell'ultimo prezzo di quotazione noto del mercato principale.

Le opzioni non quotate in una borsa ufficiale o in un altro mercato regolamentato sono valutati al loro ultimo valore di mercato noto o, in assenza di valore di mercato, sulla base del probabile valore di realizzo ritenuto prudente dal Consiglio di Amministrazione della Sicav.

I premi incassati sulle vendite di opzioni sono registrati al passivo e i premi pagati sull'acquisto di contratti di opzioni sono registrati all'attivo. Le plusvalenze o minusvalenze non realizzate su contratti di opzione sono registrate nel Prospetto del Patrimonio Netto e le loro variazioni nel Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto sotto la voce «Variazione della plus / (minus)- valenza non realizzata sulle opzioni».

f) Contratti Swap

I Contratti Swap sono valutati al loro fair value basato sul sottostante e sulle caratteristiche degli impegni sul sottostante o altrimenti in conformita' ai principi contabili di riferimento.

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 stati presentati sulla base dell'ultimo Valore del Patrimonio Netto dell'esercizio. Conformemente a quanto stabilito nel prospetto, i Valori del Patrimonio Netto sono stati calcolati utilizzando gli ultimi prezzi di quotazione noti al momento del calcolo.

l) Tassi di cambio

I principali tassi di cambio utilizzati al 30 Giugno 2023 sono:

1 EUR =	1.564128	AUD
1 EUR =	6.334203	BRL
1 EUR =	1.436454	CAD
1 EUR =	1.036160	CHF
1 EUR =	7.347772	CNY
1 EUR =	7.437571	DKK
1 EUR =	0.839603	GBP
1 EUR =	8.865950	HKD
1 EUR =	16207.94	IDR
1 EUR =	84.53448	INR
1 EUR =	147.6028	ISK
1 EUR =	130.9542	JPY
1 EUR =	23.27279	MXN
1 EUR =	2.203710	NLG
1 EUR =	10.02817	NOK
1 EUR =	1.660994	NZD
1 EUR =	57.98866	PHP
1 EUR =	4.583370	PLN
1 EUR =	85.29709	RUB
1 EUR =	10.29604	SEK
1 EUR =	1.533116	SGD
1 EUR =	15.10173	TRY
1 EUR =	1.137200	USD
1 EUR =	18.14971	ZAR

m) Investimenti incrociati

Il Prospetto del Patrimonio Netto consolidato mostra un totale del Patrimonio Netto a EUR 847,659,663.01. Alla fine dell'anno, i comparti NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing hanno investito un valore totale di EUR 1,639,995.87 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 846,019,667.14.

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:

Sub-Fund	Commissioni di distribuzione	Tasse di segnalazione	Pagamento per investimenti	Commissioni dell'agente di collocamento	Tasse di autorità	Co Sponship	Commissioni varie	Totale
NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term	0.00	4,484.51	0.00	497.15	1,198.56	252.99	2,396.40	8,829.61
NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing	11,773.77	3,316.14	0.00	301.71	931.87	102.47	2,332.79	18,758.75
NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond	0.00	3,548.12	0.00	254.24	1,111.06	55.81	2,355.35	7,324.58
NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia	0.00	4,018.63	0.00	414.02	1,087.21	222.34	2,638.10	8,380.30

The above miscellaneous fees are composed of: license fees, contributions fees, regulatory fess and listing fees.

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 2023, 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%	
NEW MILLENNIUM - Euro Equities	1.50%		0.70%	0.85%	
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 - VolActive	2.20%	2.20%	1.10%	1.25%	
NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond	1.60%	1.60%	0.80%	0.95%	
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 2023, il Comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing risulta investito per più del 50% in Azioni di OICR. Rispetto agli investimenti sostanziali in OICR ed altri OIC legati al Fondo o in altri comparti della SICAV, la commissione totale di gestione (esclusa la commissione sulla performance, se presente) applicata al comparto e ad ognuno degli OICR o altri OIC in questione, non dovrà superare il 2% del Valore

Netto delle attività gestite. Le percentuali delle commissioni di commissione di gestione applicabili al livello delle Azioni di OICR sono le seguenti:

Azioni di OICR	Commissione di gestione
AZ FUND 1 - AZ ALLOCATION INTERNATIONAL 50%-100%	1.50%
AZ FUND 1 - AZ BOND TARGET 2021 -AAZ-	1.20%
AZ FUND 1 - AZ BOND GLOBAL MACRO -AI-	1.20%
NEW MILLENNIUM - AUGUSTUM EXTRA EURO HIGH QUALITY BOND -I-	0.80%
NEW MILLENNIUM - AUGUSTUM CORPORATE BOND -I-	0.75%
NEW MILLENNIUM - AUGUSTUM ITALIAN DIVERSIFIED BOND -I-	0.75%
NEW MILLENNIUM - AUGUSTUM HIGH QUALITY BOND -I-	0.70%

6. ADVISORY FEE

The advisory fee includes the 11,000 Eur for rent of compartment and ancillary fee.

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 - 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 - VolActive
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 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 Unhedged EUR 5% BCE euro short-term rate index	20%
NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative	20% Bloomberg World Large & Mid Cap Net Return Index 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 - VolActive	Euribor 3M + 350 bps	20%
NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond	60% ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Years Global Government Excluding Euro Governments Index in LOC 40% ICE BofA Merrill Lynch 3-5 Years Global Government Excluding Euro Governments Index in LOC	20%
NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond	40% Bloomberg Barclays Global High Yield Total Return Index Value Hedged EUR 30% Bloomberg Barclays Pan-European High Yield Total Return Index Value Unhedged EUR 20% Bloomberg Barclays Euro Aggregate Corporate Total Return Index Value Unhedged EUR 10% BCE euro short-term rate index	20%
NEW MILLENNIUM – Multi Asset Opportunity	15% Bloomberg Europe Developed Markets Large & 10% Bloomberg World Large & Mid Cap Net Return 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	Bloomberg Italy Large & Mid Cap Net Return Index USD 25% Bloomberg Italy Small Cap Net Return Index 45% Bloomberg Euro Aggregate Corporate Italy Index 15% Bloomberg Euro Treasury/Corp Short Term Index EUR	20%

8. COMMISSIONE DELLA BANCA DEPOSITARIA E DELL'AMMINISTRAZIONE CENTRALE

Per i servizi resi alla SICAV, come Banca Depositaria, State Street Bank International GmbH, Luxembourg Branch riceverà per ciascun Comparto una commissione annuale pari allo 0.04% del valore del patrimonio netto, con un minimo di 3,000.00 Euro a Comparto. Inoltre l'amministrazione centrale riceve una commissione fissa con un massimo pari allo 0.021% sulla base della media del patrimonio netto di ciascun Comparto, ed un minimo pari a 2,400.00 Euro per comparto. Tale commissione viene calcolata mensilmente sulla base della media del patrimonio netto di ciascun Comparto, matura in ciascun giorno di valutazione ed è pagata entro i primi 10 giorni di calendario del mese successivo.

9. COMPENSI PROFESSIONALI

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

10. LE AZIONI DEL FONDO

Le Classi di Azioni in circolazione al 30 Giugno 2023 sono le seguenti:

Comparti	Azioni in circolazione
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	A,A (H-CHF),A (H-USD),D,I,L,Y,Z
NEW MILLENNIUM - Euro Equities	A,I,L,Y
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-CHF),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 - VolActive	A,D,I,L
NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond	A,D,I,L
NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond	A,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 2023 è disponibile presso la sede sociale della Sicav.

12. COSTI DI TRANSAZIONE

Per il periodo che termina il 30 Giugno 2023, 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 2023, sono inclusi nel costo degli investimenti e ammontano ai seguenti importi (in EUR):

Comparti	Costi di transazione
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	1,380.80
NEW MILLENNIUM - Euro Equities	103,813.91
NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)	14,913.68
NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term	1,529.83

Comparti	Costi di transazione
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond	0.00
NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate	7,428.30
NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative	49,231.70
NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible	681.98
NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe	9,031.95
NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond	0.00
NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing	0.00
NEW MILLENNIUM - VolActive	31,036.60
NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond	0.00
NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond	0.00
NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity	10,478.07
NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia	34,613.50

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, contratti futures e contratti swap. Informazioni dettagliate relative alle posizioni aperte al 30 Giugno 2023 sono riportate in seguito ai Portafogli dei comparti interessati.

Le controparti per le posizioni aperte su contratti finanziari a termine sono JP Morgan, Morgan Stanley Bank e Nomura International Plc. La controparte per le posizioni aperte su futures è Intesa Sanpaolo S.p.A. e Nomura International Plc. Le controparti per le posizioni aperte su contratti swap sono J. P. Morgan Securities Plc.

Al 30 Giugno 2023, ci sono posizioni aperte di titoli in garanzia e richieste di margini registrate nel Prospetto del patrimonio netto alla voce "Importi dovuti dai broker".

Al 31 Dicembre 2022 il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 3,931,904.31 da Nomura International Plc. come garanzia per i contratti finanziari a termine.

Al 31 Dicembre 2022 il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 2,542,095.00 da Morgan Stanley AG come garanzia per i contratti finanziari a termine.

Al 31 Dicembre 2022 il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 1,092,211.63 da J.P. Morgan Securities Plc. come garanzia per i contratti swap.

Al 31 Dicembre 2022 il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 596,545.32 da Nomura International Plc. come garanzia per i contratti finanziari a termine.

Al 31 Dicembre 2022 il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 400,000.00 da Morgan Stanley Bank come garanzia per i contratti finanziari a termine.

Al 31 Dicembre 2022 il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 570,109.00 da Morgan Stanley Bank come garanzia per i contratti finanziari a termine.

Al 31 Dicembre 2022 il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 1,525,346.32 da Nomura International Plc. come garanzia per i contratti finanziari a termine.

Al 31 Dicembre 2022 il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 898,779.63 J.P. Morgan Securities Plc. come garanzia per i contratti swap.

Al 31 Dicembre 2022 il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 258,833.34 da Nomura International Plc. come garanzia per i contratti finanziari a termine.

Al 31 Dicembre 2022 il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 50,000.00 da Morgan Stanley Bank come garanzia per i contratti finanziari a termine.

Al 31 Dicembre 2022 il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 0.93 da J.P. Morgan Securities Plc. come garanzia per i contratti swap.

Al 31 Dicembre 2022 il comparto NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 145,828.62 da Nomura International Plc. come garanzia per i contratti finanziari a termine.

Al 31 Dicembre 2022 il comparto NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 310,684.72 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 - VolActive, NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond, NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond, NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond e NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative, per le Azioni Y per il comparto NEW MILLENNIUM - Euro Equities e NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe, per le Azioni D e Y per i comparti NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate, NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing e NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term, e per le Azioni D, Y e Z per il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond e' stato pagato come da tabella seguente, con la data dello stacco cedola al 3 Gennaio 2022 e data valuta 6 Gennaio 2022:

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

15. EVENTI SUCCESSIVI

Successivamente alla fine dell'anno, la Silicon Valley Bank, banca californiana specializzata nel finanziamento di startup tecnologiche, è fallita, innescando una crisi che ha portato alla chiusura di un'altra banca americana, Signature Bank, e all'acquisizione della filiale britannica di SVB da parte di HSBC.

Pur escludendo un effetto contagio, il fattore comune dell'innalzamento dei tassi di interesse ha colpito la banca Credit Suisse che ha accumulato nel tempo una serie di problemi come carenze gestionali, bilanci in perdita e infine la decisione del suo maggiore azionista (Banca Nazionale Saudita) di astenersi dal fornire nuovo sostegno finanziario. Nei giorni successivi di significativi turbolenze nei mercati finanziari globali, la Banca centrale svizzera ha annunciato un prestito al Credit Suisse e l'autorità di regolamentazione svizzera FINMA ha consentito la fusione tra UBS e Credit Suisse, eliminando \$ 17 miliardi di obbligazioni AT1 New Millennium Sicav non è esposta a SVB e Signature Bank.

Alcuni comparti della New Millennium SICAV detengono obbligazioni senior di Credit Suisse (quindi nessun impatto dalla svalutazione).

NATAM Management Company S.A continua a monitorare la situazione ea valutare le implicazioni sulle operazioni della New Millenium SICAV.

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.

Periodo: 01.01-30.06.2023	Limite VaR	VaR			Riferimento
		% Utilizzo Limite VaR			
		Minimo	Medio	Massimo	
Fondo					
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	20.00%	23.76	33.14	53.70	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term	20.00%	5.10	7.79	13.48	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond	20.00%	13.88	18.96	34.00	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate	20.00%	10.28	14.24	25.14	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative	20.00%	14.03	17.73	25.91	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible	20.00%	14.84	18.97	30.15	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe	20.00%	13.13	19.50	39.00	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond	20.00%	24.70	33.97	57.31	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing	20.00%	17.37	20.31	27.83	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - VolActive	20.00%	4.13	18.72	48.64	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond	20.00%	25.27	30.01	41.12	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond	20.00%	14.41	29.24	43.51	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity	20.00%	20.42	25.28	38.32	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia	20.00%	21.71	36.05	55.15	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	96.37	154.79	324.20	4.08	16.14	49.10
NEW MILLENNIUM - Euro Equities	0.00	0.00	0.00	0.00	1.11	3.92
NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)	0.00	0.00	0.00	3.08	6.14	13.65
NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond	108.33	149.64	342.70	32.46	44.08	61.86
NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate	0.00	0.01	0.79	0.00	0.00	0.00
NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative	0.00	0.04	1.66	0.00	0.04	1.66
NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible	30.71	68.79	130.32	0.22	4.00	15.06
NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe	0.00	0.92	3.74	0.00	0.00	0.00
NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond	16.84	24.58	68.46	1.47	1.78	3.20
NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing	0.00	1.51	2.65	0.00	1.48	2.65
NEW MILLENNIUM - VolActive	4.11	25.42	58.61	0.00	6.48	39.94

Fondo	Leva					
	Somma dei nozionali			Metodo degli impegni		
	Min	Medio	Max	Min	Medio	Max
NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond	55.19	81.50	163.16	2.02	9.96	23.64
NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond	13.54	36.80	144.73	0.00	0.86	48.24
NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity	2.28	4.46	5.95	1.19	3.36	5.06
NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia	0.00	2.44	19.82	0.00	0.98	9.42

Comparti classificati "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 nell'ambito del processo di investimento, non promuovono caratteristiche ESG e non hanno come investimento oggettivo sostenibile. Gli investimenti alla base di questo prodotto finanziario non tengono conto dei criteri dell'UE per le attività economiche sostenibili dal punto di vista ambientale.

3. SECURITIES FINANCING TRANSACTIONS REGULATION

The Securities Financing Transaction Regulation (SFTR) 2015/2365 on transparency of securities financing transactions and of reuse came into force on 12 January 2016 and introduces new disclosure requirements for securities financing transactions and total return swaps.

A securities financing transaction is defined as per Article 3(11) of the SFTR as:

- a repurchase/reverse repurchase agreement,
- securities or commodities lending and securities or commodities borrowing,
- a buy-sell back transaction or sell-buy back transaction, or
- a margin lending transaction.

Total Return Swaps

No collateral has been received for total return swaps.

All the returns of the total return swaps are attributed to the Sub-Funds. The transaction costs are not separately identifiable.

Transactions in total return swaps are bilateral trades.

The following summarises the aggregate value of total return swaps, analysed by counterparty as at 30 June 2023: