

## N.M. AUGUSTUM EXTRA EURO HIGH QUALITY BOND - A

Report Mensile Agosto 2022

106,77 EUR

NAV al 31 Agosto 2022

### UN PORTAFOGLIO OBBLIGAZIONARIO DI ALTA QUALITÀ PER UNA ESPOSIZIONE ATTIVA ALLE DINAMICHE VALUTARIE

Il comparto investe in titoli a reddito fisso classificati "investment grade" denominati esclusivamente in valute diverse dall'Euro, quali obbligazioni con tassi di interesse sia fisso che variabile, emessi da emittenti sovranazionali, governi e/o da società, senza limitazione geografica alcuna. Almeno il 70% delle attività sarà investito in titoli con Rating minimo A-. Non è consentito l'investimento in valori mobiliari di emittenti not-rated o non investment grade. Una consapevole assunzione del rischio di cambio è elemento caratterizzante del fondo; verranno comunque privilegiate le divise più importanti quali USD, GBP, AUD, CAD e JPY. L'uso di derivati, ai fini di investimento, è consentito a condizione che l'insieme degli impegni non superi in nessun momento il 100% del valore del patrimonio netto del comparto e può comportare un potenziale aumento delle perdite o dei rendimenti. Il comparto è gestito attivamente rispetto al benchmark dal quale ci si può, comunque, discostare significativamente. Il Comparto non tiene conto dei criteri di sostenibilità come parte del suo processo di investimento, non promuove le caratteristiche ESG e non ha come obiettivo un investimento sostenibile (ex art. 6 SFDR) RISCHI SIGNIFICATIVI PER IL COMPARTO: rischio legato all'andamento dei tassi di interesse, rischio derivati quotati o meno su mercati regolamentati, rischio di cambio, rischio di sostenibilità

E' disponibile anche la Classe D del comparto (ISIN: LU0956013089) con distribuzione annuale del dividendo pari 4% e trattamento commissionale analogo alla Classe A.

Isin Code	LU0956012941
Codice Bloomberg	NMAEEHA LX
Categoria	Obbligazionario Extra Euro
Assogestioni	
Data di lancio	5 Dic 2014
Classe di azioni	A: tutti gli investitori
Asset del comparto	€54.703.111,07
Valorizzazione	Giornaliera
Valuta	Euro
Benchmark	60% N1Q1 Index + 40% N2Q1 Index
Profilo di rischio	Valore SRR1 (min 1 max 7)= 4
Reg. UE 2019/2088 SFDR	Ex Art 6

Per ulteriori info sulla sostenibilità controllare il link <http://www.newmillenniumsicav.com/pages/index/marketingita>

Commissione di gestione	1,60 % annuo
-------------------------	--------------

Tale commissione ha impatto sul rendimento del fondo ed è inclusa nel NAV

Commissioni di performance	20% annuo sull'extra rendimento del benchmark con applicazione dell'High Water Mark
----------------------------	---

Tali commissioni vengono accantonate solo al verificarsi di determinate condizioni (vd Prospetto) e, se applicate, sono incluse nel NAV

Banca depositaria	State Street Bank Intern.GmbH, Lux Branch
-------------------	---

GESTORE DELEGATO	AZ Swiss & Partners S.A. AZIMUT GROUP
------------------	---------------------------------------

AZ Swiss & Partners SA, società di diritto svizzero appartenente al gruppo Azimut, è autorizzata dalla FINMA (Autorità Federale di Vigilanza sui Mercati Finanziari) alla gestione patrimoniale di investimenti collettivi di capitale. Le principali attività che svolge la società sono la gestione patrimoniale di investimenti collettivi di capitale (UCITS e AIF), la gestione patrimoniale discrezionale e la consulenza per clientela privata e istituzionale di portafogli d'investimento nonché la distribuzione di investimenti collettivi di capitale ad investitori qualificati.

**NEW MILLENNIUM SICAV** ([www.newmillenniumsicav.com](http://www.newmillenniumsicav.com))

Indirizzo: 49, Avenue J.F. Kennedy L1855 Luxembourg

Tel: +352 4640107071 - Fax: +352 464010413

E-mail: [info@newmillenniumsicav.com](mailto:info@newmillenniumsicav.com)

**Distributore Globale**

BANCA FINNAT EURAMERICA S.p.A.

Tel. +39 06 69933393; E-mail: [istituzionali@finnat.it](mailto:istituzionali@finnat.it)

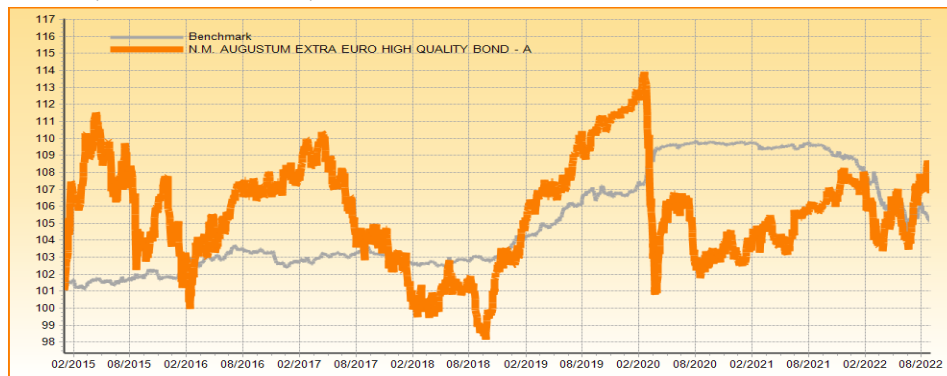
**Management Company**

NATAM S.A.

Tel. +352 28.80.91; Email: [info@natam.lu](mailto:info@natam.lu)

### PERFORMANCE DEL FONDO

I rendimenti passati non sono indicativi di quelli futuri



	2012	2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022 - al 30/06
COMPARTO	-	-	-	3,5%	3,0%	-5,1%	0,5%	8,6%	-7,7%	4,0%	-2,3%
BENCHMARK	-	-	-	0,7%	0,9%	0,3%	1,0%	2,6%	2,8%	-0,9%	-2,9%

### DURATION

<2 anni	2-5 anni	>5 anni
63.16%	31.00%	5.85%

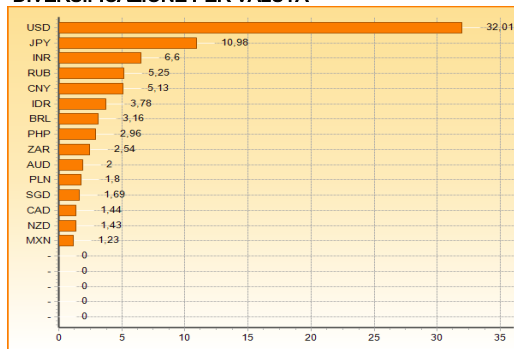
### DIVERSIFICAZIONE PER RATING

High	Upper Medium	Lower Medium
59.00%	20.00%	17.00%

### INDICATORI RISCHIO/EFFICIENZA

	Comparto	Benchmark
Sharpe Ratio 1 anno	Neg.	Neg.
Var 99% 20 giorni	4.45%	-
Deviazione Standard 1 anno	5.14%	1.96%
Duration modificata	2.57	2.75

### DIVERSIFICAZIONE PER VALUTA



### Commento mensile del Gestore Delegato

Dati sull'inflazione in leggero miglioramento negli Stati Uniti non sono stati sufficienti a ridimensionare i toni del governatore Powell, che durante il congresso di Jackson Hole ha ribadito la determinazione della Fed nel fermare l'inflazione, anche a costo di pesanti ricadute economiche. Ciò ha provocato ribassi sui mercati azionari e obbligazionari. In Europa, timori di tagli alle forniture di gas da parte della Russia, hanno portato il prezzo dei futures al di sopra dei 300 euro per MWh, il livello più alto mai registrato. Questo ha comportato un ulteriore innalzamento delle aspettative di inflazione per il continente. Il gestore ha incrementato marginalmente l'esposizione al dollaro statunitense durante il mese. La classe istituzionale chiude il mese con il NAV a 112.37 e una performance mensile pari a -0.79%.



\* Per maggiori informazioni [www.morningstar.it](http://www.morningstar.it) (Rating aggiornati al mese di Luglio 2022)  
 \*\* Per maggiori informazioni [www.fidaonline.com](http://www.fidaonline.com) (Rating aggiornati al mese di Luglio 2022)  
 \*\*\* Per maggiori informazioni [www.lipperleaders.com](http://www.lipperleaders.com) (Rating aggiornati al mese di Luglio 2022)

Il presente documento costituisce una comunicazione di marketing. Si prega di consultare il prospetto di New Millennium e il relativo KIID prima di prendere una decisione finale di investimento, disponibili presso i soggetti collocatori e sul sito [www.newmillenniumsicav.com](http://www.newmillenniumsicav.com). I predetti documenti, il modulo di sottoscrizione (tutti in lingua italiana) e lo statuto sociale (solo in lingua inglese) che tra l'altro contengono anche informazioni sui diritti degli investitori, sono forniti gratuitamente su richiesta anche in formato cartaceo. La Management Company ha il diritto di porre fine agli accordi per la commercializzazione del comparto in Italia in base al processo di ritiro della notifica previsto dalla Direttiva 2009/65/CE. Le performance illustrate sono al lordo dell'effetto fiscale.