

NEW MILLENNIUM

SOCIÉTÉ D'INVESTISSEMENT À CAPITAL VARIABLE

RENDICONTO DI GESTIONE SEMESTRALE NON CERTIFICATO AL 30 GIUGNO 2026

Società d'Investimento a Capitale Variabile
a Comparti Multipli

R.C.S. Luxembourg B71.256

Le sottoscrizioni potranno essere effettuate soltanto sulla base dell'ultimo prospetto aggiornato accompagnato dall'ultima relazione annuale disponibile e dall'ultima relazione semestrale, se posteriore alla relazione annuale.

INDICE

Informazioni per investitori in Svizzera	3	NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible	59
Organizzazione del Fondo	4	Prospetto del Patrimonio Netto	59
Prospetto Comparativo dei Patrimoni Netti degli ultimi 3 anni/periodi	7	Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	60
		Portafoglio Titoli	61
		Impegni su acquisto/vendita di contratti futures	64
		Contratti finanziari a termine	65
Prospetto del Patrimonio Netto consolidato	9	NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe	66
Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto consolidato	10	Prospetto del Patrimonio Netto	66
		Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	67
		Portafoglio Titoli	68
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	11	NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond	69
Prospetto del Patrimonio Netto	11	Prospetto del Patrimonio Netto	69
Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	12	Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	70
Portafoglio Titoli	13	Portafoglio Titoli	71
Impegni su acquisto/vendita di contratti futures	21		
Contratti finanziari a termine	22	NEW MILLENNIUM - Alpha Active Allocation	73
Contratti Swap	23	Prospetto del Patrimonio Netto	73
		Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	74
NEW MILLENNIUM - Euro Equities	24	Portafoglio Titoli	75
Prospetto del Patrimonio Netto	24	Impegni su acquisto/vendita di contratti futures	79
Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	25		
Portafoglio Titoli	26	NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond	80
		Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	80
NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)	29		
Prospetto del Patrimonio Netto	29	NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond	81
Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	30	Prospetto del Patrimonio Netto	81
Portafoglio Titoli	31	Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	82
Impegni su acquisto/vendita di contratti futures	35	Portafoglio Titoli	83
Contratti finanziari a termine	36	Contratti finanziari a termine	87
		Contratti Swap	88
NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term	37		
Prospetto del Patrimonio Netto	37	NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity	89
Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	38	Prospetto del Patrimonio Netto	89
Portafoglio Titoli	39	Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	90
		Portafoglio Titoli	91
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond	41	Impegni su acquisto/vendita di contratti futures	95
Prospetto del Patrimonio Netto	41		
Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	42	NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia	96
Portafoglio Titoli	43	Prospetto del Patrimonio Netto	96
Impegni su acquisto/vendita di contratti futures	46	Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	97
Contratti finanziari a termine	47	Portafoglio Titoli	98
Contratti Swap	48		
		NEW MILLENNIUM - Augustum Flexible Equity	101
NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate	49	Prospetto del Patrimonio Netto	101
Prospetto del Patrimonio Netto	49	Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	102
Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	50	Portafoglio Titoli	103
Portafoglio Titoli	51	Impegni su acquisto/vendita di contratti futures	106
		Contratti di opzioni	107
NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative	54	Contratti finanziari a termine	108
Prospetto del Patrimonio Netto	54		
Prospetto delle Variazioni del Patrimonio Netto	55	Note ai Rendiconti Finanziari	109
Portafoglio Titoli	56	Appendice non certificata	122

Informazioni per investitori in Svizzera

Il prospetto e le informazioni essenziali per gli investitori, gli statuti, il regolamento del fondo, il rapporto annuale e semestrale nonché i cambiamenti del portafoglio sono disponibili gratuitamente presso il rappresentante in Svizzera.

Rappresentante e Agente di pagamento in Svizzera è State Street Bank International GmbH, Munich, Zurich Branch, Kalanderplatz 5 Postfach, 8027 Zurich.

ORGANIZZAZIONE DELLA SOCIETA**CONSIGLIO D'AMMINISTRAZIONE****Presidente****Sante JANNONI***Direttore Generale*

Natam Management Company S.A.

11, rue Béatrix de Bourbon

L - 1225 Luxembourg

Granducato di Lussemburgo

Amministratori**Emanuele BONABELLO***Responsabile Direzione Investimenti e Relazioni Istituzionali*

Banca Finnat Euramerica S.p.A.

49, Piazza del Gesù

I - 00186 Roma

Italia

Paola DE SIMONE

Banca Finnat Euramerica S.p.A.

49, Piazza del Gesù

I - 00186 Roma

Italia

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

11, rue Béatrix de Bourbon

L - 1225 Lussemburgo

Granducato di Lussemburgo

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

Banca Finnat Euramerica S.p.A.

49, Piazza del Gesù

I - 00186 Roma

Italia

Gianluca COSTANTINI (Amministratore)*Reponsabile direzione amministrazione*

Banca Finnat Euramerica S.p.A.

49, Piazza del Gesù

I - 00186 Roma

Italia

Alex SCHMITT (Amministratore)

108, avenue du X Septembre

L - 2550 Lussemburgo

Granducato di Lussemburgo

Incaricati della Società di Gestione**Alberto ALFIERO***Vice Direttore Generale*

Banca Finnat Euramerica S.p.A.

49, Piazza del Gesù

I - 00186 Roma

Italia

Sante JANNONI*Direttore Generale*

Natam Management Company S.A.

11, rue Béatrix de Bourbon

L - 1225 Lussemburgo

Granducato di Lussemburgo

Pietro MISSERI*Responsabile Gestione Rischi*

Natam Management Company S.A.

11, rue Béatrix de Bourbon

L - 1225 Lussemburgo

Granducato di Lussemburgo

SEDE LEGALE

49, Avenue J.F. Kennedy (fino al 30 giugno 2026)

L - 1855 Luxembourg

Grand Duchy of Luxembourg

17, Boulevard de Kockelscheuer (dal 1 luglio 2026)

L - 1821 Lussemburgo

Granducato di Lussemburgo

DISTRIBUTORE GLOBALE**Banca Finnat Euramerica S.p.A.**

49, Piazza del Gesù

I - 00186 Roma

Italia

BANCA DEPOSITARIA**State Street Bank International GmbH, Filiale di Lussemburgo.**

49, Avenue J.F. Kennedy (fino al 30 giugno 2026)

L - 1855 Luxembourg

Grand Duchy of Luxembourg

17, Boulevard de Kockelscheuer (dal 1 luglio 2026)

L-1821 Lussemburgo

Granducato di Lussemburgo

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

49, Avenue J.F. Kennedy (fino al 30 giugno 2026)

L - 1855 Lussemburgo

Granducato di Lussemburgo

17, Boulevard de Kockelscheuer (dal 1 luglio 2026)

L - 1821 Lussemburgo

Granducato di Lussemburgo

SOGGETTO INCARICATO DEI PAGAMENTI IN ITALIA

State Street Bank GmbH - Succursale Italia

10, Via Ferrante Aporti
I - 20125 Milano
Italia

Société Générale Securities Services S.p.A.

19, Via Santa Chiara
I - 10122 Turin
Italia

Allfunds Bank S.A. (succursale di Milano)

6, Via Bocchetto
I - 20123 Milano
Italia

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

3, Piazza Salimbeni
I - 53100 Siena
Italia

REVISORE CONTABILE

KPMG Audit S.à r.l.,

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

COMPARATIVO DEI VALORI NETTI D'INVENTARIO DEGLI ULTIMI TRE ANNI

		30 Giugno 2026		31 December 2025		31 December 2024	
Valuta	Totale NAV in EUR	NAV per Azione nella valuta della Classe di Azioni		Totale NAV in EUR	NAV per Azione nella valuta della Classe di Azioni	Totale NAV in EUR	NAV per Azione nella valuta della Classe di Azioni
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond							
Azione A	EUR	157,695,120.95	261.96	149,972,244.59	258.07	114,620,701.10	247.89
Azione A (H-CHF)	CHF	944,554.01 ¹	104.86	556,431.47 ¹	105.29	2,824,534.61 ¹	104.06
Azione A (H-USD)	USD	4,004,467.34 ¹	136.51	3,637,815.06 ¹	133.79	7,712,473.52 ¹	126.46
Azione D	EUR	20,384,834.39	98.53	22,563,134.93	100.59	17,674,195.72	100.12
Azione I	EUR	196,890,413.27	292.87	218,009,369.37	287.50	229,227,209.44	274.19
Azione I (H-CHF)	CHF	11,012,231.16	101.22	0.00	0.00	0.00	0.00
Azione L	EUR	323,231.44	286.81	191,345.66	281.81	149,146.21	269.22
Azione Z	EUR	5,043,769.40	111.34	5,013,194.32	110.66	0.00	0.00
Totale attivo netto	EUR	396,298,621.96		399,943,535.40		372,208,260.60	
NEW MILLENNIUM - Euro Equities							
Azione A	EUR	4,168,999.47	105.73	4,596,187.53	93.84	3,277,463.49	77.67
Azione I	EUR	29,763,893.05	120.99	23,374,571.40	107.04	19,803,255.80	87.85
Azione L	EUR	116,543.47	118.68	197,714.71	105.11	162,585.87	86.44
Totale attivo netto	EUR	34,049,435.99		28,168,473.64		23,243,305.16	
NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)							
Azione A	EUR	4,911,186.48	175.53	4,198,118.56	162.71	3,495,992.31	139.50
Azione I	EUR	45,509,232.99	201.47	41,286,000.18	185.97	38,223,934.16	158.40
Azione L	EUR	187,128.69	197.60	397,267.67	182.57	338,857.52	155.72
Totale attivo netto	EUR	50,607,548.16		45,881,386.41		42,058,783.99	
NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term							
Azione A	EUR	74,838.20	136.50	74,651.13	136.16	241,078.16	134.55
Azione D	EUR	23,754.09	85.93	24,298.08	87.90	33,733.29	90.36
Azione I	EUR	7,754,797.33	143.69	8,104,428.08	143.12	7,366,074.98	141.03
Azione L	EUR	136,422.82	140.64	384,467.73	140.21	379,578.09	138.43
Azione Y	EUR	0.00	0.00	2,770.73	131.18	2,834.06	134.18
Totale attivo netto	EUR	7,989,812.44		8,590,615.75		8,023,298.58	
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond							
Azione A	EUR	49,878,318.52	167.89	58,797,018.08	167.24	56,784,150.07	161.72
Azione A (H-USD)	USD	3,524,760.85 ¹	119.53	5,447,119.56 ¹	118.35	6,156,829.29 ¹	112.55
Azione D	EUR	23,029,324.51	86.51	26,557,250.00	88.38	19,141,708.64	87.66
Azione I	EUR	30,678,585.15	180.53	28,911,442.74	179.39	39,244,995.83	172.60
Azione L	EUR	161,385.05	177.15	18,852.40	176.19	38,035.27	169.80
Totale attivo netto	EUR	107,272,374.08		119,731,682.78		121,365,719.10	
NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate							
Azione A	EUR	1,482,279.85	139.11	2,465,146.06	138.55	2,824,728.54	135.64
Azione D	EUR	50,725.41	102.25	51,918.09	104.65	273,101.62	106.80
Azione I	EUR	56,862,372.26	150.98	55,797,086.89	150.02	50,525,918.97	146.15
Azione L	EUR	1,098,882.69	147.96	1,185,416.71	147.15	1,157,022.87	143.62
Azione Y	EUR	2,805.40	132.46	2,862.87	135.17	2,904.47	137.13
Totale attivo netto	EUR	59,497,065.61		59,502,430.62		54,783,676.47	
NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative							
Azione A	EUR	18,055,084.23	158.29	19,847,110.01	155.27	23,215,561.04	152.85
Azione D	EUR	0.00	0.00	0.00	0.00	424,500.37	143.49
Azione I	EUR	5,697,639.95	175.87	7,653,895.00	172.01	8,257,417.57	168.34
Azione L	EUR	5,569,211.20	172.60	7,474,917.13	168.97	7,384,964.10	165.67
Totale attivo netto	EUR	29,321,935.38		34,975,922.14		39,282,443.08	
NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible							
Azione A	EUR	2,400,003.00	139.47	3,011,864.60	140.07	1,610,436.53	137.48
Azione I	EUR	1,786,767.77	116.53	1,697,240.79	116.63	4,971,869.63	113.93
Azione L	EUR	16,112,304.77	140.39	15,888,096.77	140.76	14,953,446.29	137.88
Totale attivo netto	EUR	20,299,075.54		20,597,202.16		21,535,752.45	
NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe							
Azione A	EUR	553,617.23	113.20	456,251.69	111.23	961,494.77	109.26
Azione I	EUR	17,216,532.75	122.00	17,815,993.25	119.61	18,792,531.57	116.98
Azione L	EUR	121,577.16	119.43	333,682.33	117.20	326,973.77	114.85
Azione Y	EUR	2,317,863.49	105.38	2,339,808.65	106.37	2,390,439.05	108.68
Totale attivo netto	EUR	20,209,590.63		20,945,735.92		22,471,439.16	

COMPARATIVO DEI VALORI NETTI D'INVENTARIO DEGLI ULTIMI TRE ANNI

		30 Giugno 2026		31 December 2025		31 December 2024	
Valuta	Totale NAV in EUR	NAV per Azione nella valuta della Classe di Azioni		Totale NAV in EUR	NAV per Azione nella valuta della Classe di Azioni	Totale NAV in EUR	NAV per Azione nella valuta della Classe di Azioni
NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond							
Azione A	EUR	24,891,606.86	150.11	28,312,119.06	149.01	23,068,486.39	144.28
Azione D	EUR	1,115,204.57	102.05	1,171,176.65	104.43	1,365,182.25	104.25
Azione I	EUR	23,026,216.15	165.61	38,451,270.83	163.83	48,498,799.68	157.53
Azione L	EUR	292,915.70	162.55	243,978.51	160.94	196,236.84	155.01
Totale attivo netto	EUR	49,325,943.28		68,178,545.05		73,128,705.16	
NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing							
Azione A	EUR	0.00	0.00	0.00	0.00	2,069,475.92	110.91
Azione D	EUR	0.00	0.00	0.00	0.00	193,405.50	85.01
Azione I	EUR	0.00	0.00	0.00	0.00	31,006.25	124.03
Azione L	EUR	0.00	0.00	0.00	0.00	1,129.56	125.51
Azione Y	EUR	0.00	0.00	0.00	0.00	3,041.26	101.01
Totale attivo netto	EUR	0.00		0.00		2,298,058.49	
NEW MILLENNIUM - Alpha Active Allocation							
Azione A	EUR	231,611.44	97.66	239,715.55	98.20	293,331.25	93.12
Azione D	EUR	744.66	64.43	794.69	68.76	16,385.91	68.87
Azione I	EUR	48,926,619.64	111.05	49,012,713.68	111.25	46,648,433.93	104.68
Azione L	EUR	9,787.38	108.75	14,718.97	109.03	9,145.72	102.76
Totale attivo netto	EUR	49,168,763.12		49,267,942.89		46,967,296.81	
NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond ²							
Azione A	EUR	0.00	0.00	65,574.99	102.01	115,865.35	106.22
Azione D	EUR	0.00	0.00	119,140.86	67.91	129,194.77	73.64
Azione I	EUR	0.00	0.00	13,959,730.71	110.40	15,396,881.48	114.00
Azione L	EUR	0.00	0.00	28,185.14	108.40	29,158.60	112.15
Totale attivo netto	EUR	0.00		14,172,631.70		15,671,100.20	
NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond							
Azione A	EUR	2,110,925.16	107.41	2,079,869.70	105.41	0.00	0.00
Azione I	EUR	13,121,961.35	115.27	9,498,507.09	112.79	10,657,778.81	105.55
Azione L	EUR	84,947.56	98.78	20,795.42	96.72	0.00	0.00
Totale attivo netto	EUR	15,317,834.07		11,599,172.21		10,657,778.81	
NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity							
Azione A	EUR	23,211,456.80	118.71	22,814,376.88	114.75	23,386,353.75	110.62
Azione I	EUR	4,487,963.03	124.38	5,121,814.22	120.00	4,935,053.39	115.13
Azione L	EUR	51,060,833.70	122.37	50,594,419.44	118.16	52,937,264.98	113.56
Totale attivo netto	EUR	78,760,253.53		78,530,610.54		81,258,672.12	
NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia							
Azione A	EUR	1,832,363.85	116.46	1,958,675.08	114.31	2,164,186.69	103.81
Azione I	EUR	3,436,479.56	122.96	3,449,789.35	120.33	3,422,544.74	108.59
Azione L	EUR	155,188.79	120.96	198,803.37	118.48	179,750.20	107.12
Totale attivo netto	EUR	5,424,032.20		5,607,267.80		5,766,481.63	
NEW MILLENNIUM - Augustum Flexible Equity ³							
Azione A Acc	EUR	5,105.82	103.25	0.00	0.00	0.00	0.00
Azione I	EUR	14,853,189.41	106.00	0.00	0.00	0.00	0.00
Totale attivo netto	EUR	14,858,295.23		0.00		0.00	

¹La valuta della classe di azioni è stata convertita in EUR²Il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond è stato chiuso il 3 febbraio 2026.³Il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Flexible Equity è partito il 10 aprile 2026.

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO CONSOLIDATO AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Attività	Note	
Portafoglio Titoli al valore di mercato	(2a)	894,238,673.77
Liquidità bancarie a vista		22,039,129.84
Importi dovuti dai broker		17,798,985.63
Premio pagato su contratti swap	(2f)	147,260.67
Contratti di opzioni al valore di mercato	(2e, 13)	29,198.35
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine	(2c, 13)	273,405.59
Utili non realizzati su contratti futures	(2d, 13)	489,194.49
Dividendi da ricevere		71,481.24
Interessi da ricevere		11,423,589.35
Da ricevere su vendita titoli		1,835,602.81
Da ricevere su sottoscrizioni		470,677.35
Altre attività		94,088.36
Totale attività		948,911,287.45
Passività		
Premio ricevuto su contratti swap	(2f)	-202,092.03
Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine	(2c, 13)	-2,986,812.32
Perdite non realizzate su contratti futures	(2d, 13)	-670,912.65
Perdite non realizzate su contratti swap	(2f, 13)	-840,557.89
Interessi da pagare su contratti swap		-17,503.56
Interest payable		-97,904.18
Da pagare su acquisto titoli		-949,902.94
Da pagare su rimborsi		-802,277.12
Altre passività		-3,942,743.54
Totale passività		-10,510,706.23
Totale attivo netto		938,400,581.22

PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO CONSOLIDATO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Attivo netto all'inizio del periodo	Note	965,693,155.01
Risultato netto degli investimenti	(2h)	18,258,749.60
Altri ricavi		15,044.28
Totale ricavi		18,273,793.88
Commissioni di consulenza/gestione	(5)	-4,795,311.56
Commissione di consulenza	(6)	-133,393.71
Commissioni sulla performance	(7)	-942,011.37
Commissioni della Banca Depositaria	(8)	-261,197.58
Tassa di registrazione	(3)	-123,124.93
Interessi pagati su contratti swap		-389,569.31
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(8)	-356,992.85
Commissioni del Transfer Agent		-48,578.49
Compensi professionali	(9)	-106,869.52
Pubblicazioni		-21,980.50
Altre spese e tasse	(4)	-280,641.82
Totale costi		-7,459,671.64
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		10,814,122.24
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(2b)	-390,583,081.26
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		398,910,708.51
- di contratti di opzioni		26,592.99
- di contratti futures		-2,581,454.97
- di contratti swap		-99,001.34
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		5,755,978.39
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(2c)	-1,415,172.15
- sulle opzioni	(2e)	-3,821.27
- su contratti futures	(2d)	-287,569.67
- su contratti swap		-165,239.85
Risultato netto delle operazioni per il periodo		20,372,061.62
Distribuzioni di dividendi	(14)	-1,628,549.26
Sottoscrizioni del periodo		103,617,955.21
Rimborsi del periodo		-149,654,041.36
Attivo netto alla fine del periodo		938,400,581.22

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Attività		Note	
Portafoglio Titoli al valore di mercato		(2a)	378,704,165.85
Liquidità bancarie a vista			9,386,943.11
Importi dovuti dai broker			5,141,904.64
Premio pagato su contratti swap		(2f)	122,864.33
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine		(2c, 13)	120,202.28
Utili non realizzati su contratti futures		(2d, 13)	156,000.00
Interessi da ricevere			6,612,627.10
Da ricevere su vendita titoli			1,043,431.51
Da ricevere su sottoscrizioni			241,268.82
Altre attività			22,515.24
Totale attività			401,551,922.88
Passività			
Premio ricevuto su contratti swap		(2f)	-202,092.03
Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine		(2c, 13)	-1,949,536.87
Perdite non realizzate su contratti futures		(2d, 13)	-125,760.16
Perdite non realizzate su contratti swap		(2f, 13)	-721,007.16
Interessi da pagare su contratti swap			-15,628.56
Interest payable			-97,904.18
Da pagare su rimborsi			-258,517.67
Altre passività			-1,882,854.29
Totale passività			-5,253,300.92
Totale attivo netto			396,298,621.96
	Valuta	Valore Netto d’Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	261.96	601,973.710
Azione A (H-CHF)	CHF	104.86	8,307.095
Azione A (H-USD)	USD	136.51	33,538.323
Azione D	EUR	98.53	206,886.188
Azione I	EUR	292.87	672,290.027
Azione L	EUR	286.81	1,127.000
Azione I (H-CHF)	CHF	101.22	100,338.148
Azione Z	EUR	111.34	45,302.165

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Attivo netto all'inizio del periodo	Note	399,943,535.40
Risultato netto degli investimenti	(2h)	9,493,641.75
Altri ricavi		9,512.59
Totale ricavi		9,503,154.34
Commissioni di consulenza/gestione	(5)	-2,112,705.00
Commissione di consulenza	(6)	-13,435.94
Commissioni sulla performance	(7)	-707,366.44
Commissioni della Banca Depositaria	(8)	-109,971.72
Tassa di registrazione	(3)	-51,247.29
Interessi pagati su contratti swap		-351,860.97
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(8)	-84,103.32
Commissioni del Transfer Agent		-20,521.87
Compensi professionali	(9)	-12,325.76
Pubblicazioni		-9,214.12
Altre spese e tasse	(4)	-72,803.48
Totale costi		-3,545,555.91
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		5,957,598.43
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(2b)	8,759,043.36
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		-3,124,872.34
- di contratti di opzioni		-24,083.29
- di contratti futures		-701,798.50
- di contratti swap		-99,001.34
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		-3,332,489.63
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(2c)	-955,471.13
- su contratti futures	(2d)	75,739.84
- su contratti swap		-129,781.27
Risultato netto delle operazioni per il periodo		6,424,884.13
Distribuzioni di dividendi	(14)	-855,096.25
Sottoscrizioni del periodo		73,259,045.74
Rimborsi del periodo		-82,473,747.06
Attivo netto alla fine del periodo		396,298,621.96

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			374,932,573.94	378,704,165.85	95.56
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			339,428,857.45	347,824,560.88	87.77
Obbligazioni ordinarie			117,473,649.47	118,024,539.33	29.78
STATI UNITI			23,547,160.03	22,732,729.45	5.74
Sovranazionale			13,042,058.66	13,146,031.72	3.32
30,000,000.00	INTERNATIONAL FINANCE CORP. 11.75% 18/07/2030	BRL	4,900,340.30	4,963,816.72	1.25
30,000,000.00	INTERNATIONAL FINANCE CORP. 11.50% 16/01/2030	BRL	4,886,407.76	4,936,542.44	1.25
10,000,000.00	INTERNATIONAL FINANCE CORP. 10.00% 03/02/2027	BRL	1,687,957.18	1,660,756.65	0.42
10,000,000.00	INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT 9.50% 09/02/2029	BRL	1,567,353.42	1,584,915.91	0.40
Beni voluttuari			4,762,485.96	4,901,201.30	1.24
2,000,000.00	FORD MOTOR CREDIT CO. LLC 6.18% 29/08/2031	GBP	2,309,205.96	2,368,361.30	0.60
1,500,000.00	FORD MOTOR CREDIT CO. LLC 4.87% 03/08/2027	EUR	1,462,750.00	1,526,400.00	0.39
1,000,000.00	HARLEY-DAVIDSON FINANCIAL SERVICES, INC. 4.00% 12/03/2030	EUR	990,530.00	1,006,440.00	0.25
Salute			2,916,290.17	2,112,936.07	0.53
3,000,000.00	ST. JUDE MEDICAL LLC 4.75% 15/04/2043	USD	2,916,290.17	2,112,936.07	0.53
Informatica			1,913,766.44	1,673,653.76	0.42
1,925,000.00	LEIDOS HOLDINGS, INC. 5.95% 01/12/2040	USD	1,913,766.44	1,673,653.76	0.42
Servizi di pubblica utilità			912,558.80	898,906.60	0.23
1,000,000.00	VISTRA OPERATIONS CO. LLC 6.00% 15/04/2034	USD	912,558.80	898,906.60	0.23
ITALIA			17,421,679.04	17,544,769.29	4.43
Enti Governativi			9,996,129.21	10,180,039.60	2.57
5,000,000.00	FIBERCOP SPA 5.13% 30/06/2032	EUR	5,032,500.00	5,136,050.00	1.30
3,008,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.65% 01/08/2035	EUR	2,940,792.16	3,041,689.60	0.77
2,000,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.10% 28/08/2026	EUR	2,022,837.05	2,002,300.00	0.50
Finanza			5,486,819.02	5,569,010.77	1.41
3,499,000.00	VITTORIA ASSICURAZIONI SPA 5.75% 11/07/2028	EUR	3,809,105.00	3,637,630.38	0.92
1,000,000.00	INTESA SANPAOLO SPA 7.20% 28/11/2033	USD	913,214.02	985,900.39	0.25
1,000,000.00	INTESA SANPAOLO VITA SPA 2.38% 22/12/2030	EUR	764,500.00	945,480.00	0.24
Servizi di telecomunicazione			1,938,730.81	1,795,718.92	0.45
1,231,000.00	OPTICS BIDCO SPA 7.72% 04/06/2038	USD	1,231,766.89	1,120,971.14	0.28
752,000.00	OPTICS BIDCO SPA 7.20% 18/07/2036	USD	706,963.92	674,747.78	0.17
PAESI BASSI			11,332,634.87	11,636,520.53	2.94
Beni voluttuari			4,108,000.00	4,146,165.00	1.05
2,500,000.00	ZF EUROPE FINANCE BV 7.00% 12/06/2030	EUR	2,608,000.00	2,660,700.00	0.67
1,500,000.00	ZF EUROPE FINANCE BV 5.50% 17/02/2032	EUR	1,500,000.00	1,485,465.00	0.38
Industria			3,037,830.00	3,022,920.00	0.76
3,000,000.00	POSTNL NV 4.00% 02/10/2030	EUR	3,037,830.00	3,022,920.00	0.76
Servizi di pubblica utilità			2,230,990.33	2,437,339.09	0.62
3,000,000.00	ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 5.50% 15/06/2052	USD	2,230,990.33	2,437,339.09	0.62
Servizi di telecomunicazione			1,187,054.00	1,525,338.32	0.38
1,738,000.00	PROSUS NV 1.99% 13/07/2033	EUR	1,187,054.00	1,525,338.32	0.38
Materie prime			768,760.54	504,758.12	0.13
1,000,000.00	BRASKEM NETHERLANDS FINANCE BV 4.50% 31/01/2030	USD	768,760.54	504,758.12	0.13

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
COLOMBIA			10,977,987.59	11,072,481.77	2.79
Enti Governativi			6,750,000.00	6,957,570.00	1.75
6,000,000.00	COLOMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BONDS 5.00% 19/09/2032	EUR	5,819,000.00	5,963,220.00	1.50
1,000,000.00	COLOMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BONDS 5.63% 19/02/2036	EUR	931,000.00	994,350.00	0.25
Servizi di telecomunicazione			4,227,987.59	4,114,911.77	1.04
4,950,000.00	COLOMBIA TELECOMUNICACIONES SA ESP 4.95% 17/07/2030	USD	4,227,987.59	4,114,911.77	1.04
MESSICO			6,858,109.92	8,011,386.50	2.02
Energia			6,858,109.92	8,011,386.50	2.02
4,000,000.00	PETROLEOS MEXICANOS 4.75% 26/02/2029	EUR	3,559,500.00	4,064,600.00	1.02
1,482,000.00	PETROLEOS MEXICANOS 2.75% 21/04/2027	EUR	1,166,545.71	1,471,833.48	0.37
1,000,000.00	PETROLEOS MEXICANOS 6.75% 21/09/2047	USD	667,740.95	748,648.59	0.19
1,000,000.00	PETROLEOS MEXICANOS 5.50% 27/06/2044	USD	579,836.25	699,991.20	0.18
600,000.00	PETROLEOS MEXICANOS 10.00% 07/02/2033	USD	539,754.20	618,336.35	0.16
500,000.00	PETROLEOS MEXICANOS 7.69% 23/01/2050	USD	344,732.81	407,976.88	0.10
FRANCIA			7,558,308.00	7,757,492.00	1.96
Beni voluttuari			4,960,988.00	5,122,220.00	1.29
3,000,000.00	AIR FRANCE-KLM 4.63% 23/05/2029	EUR	2,977,140.00	3,092,460.00	0.78
2,000,000.00	VALEO SE 4.50% 11/04/2030	EUR	1,983,848.00	2,029,760.00	0.51
Finanza			1,596,320.00	1,645,152.00	0.42
1,600,000.00	CREDIT AGRICOLE SA 3.88% 20/04/2031	EUR	1,596,320.00	1,645,152.00	0.42
Informatica			1,001,000.00	990,120.00	0.25
1,000,000.00	ATOS GROUP 8.13% 21/05/2031	EUR	1,001,000.00	990,120.00	0.25
TOGO			6,787,380.00	6,863,040.00	1.73
Sovranazionale			6,787,380.00	6,863,040.00	1.73
8,000,000.00	BANQUE OUEST AFRICAINE DE DEVELOPPEMENT 2.75% 22/01/2033	EUR	6,787,380.00	6,863,040.00	1.73
LUSSEMBURGO			5,677,307.14	5,711,994.28	1.44
Servizi di telecomunicazione			2,989,500.00	2,988,870.00	0.75
3,000,000.00	MATTERHORN TELECOM SA 3.88% 15/10/2030	EUR	2,989,500.00	2,988,870.00	0.75
Finanza			2,687,807.14	2,723,124.28	0.69
2,650,000.00	CPI PROPERTY GROUP SA 1.50% 27/01/2031	EUR	2,142,340.00	2,173,318.00	0.55
500,000.00	CPI PROPERTY GROUP SA 3.95% 26/05/2031	CHF	545,467.14	549,806.28	0.14
REGNO UNITO			5,103,754.68	5,029,157.99	1.27
Finanza			3,556,210.68	3,552,332.99	0.90
3,000,000.00	IG GROUP HOLDINGS PLC 6.13% 22/10/2030	GBP	3,556,210.68	3,552,332.99	0.90
Materie prime			1,547,544.00	1,476,825.00	0.37
1,500,000.00	INEOS FINANCE PLC 6.38% 15/04/2029	EUR	1,547,544.00	1,476,825.00	0.37
SPAGNA			4,197,710.50	4,351,995.00	1.10
Energia			2,517,710.50	2,536,075.00	0.64
2,500,000.00	CEPSA FINANCE SA 4.13% 11/04/2031	EUR	2,517,710.50	2,536,075.00	0.64
Industria			1,680,000.00	1,815,920.00	0.46
2,000,000.00	CELLNEX TELECOM SA 0.75% 20/11/2031	EUR	1,680,000.00	1,815,920.00	0.46
SVEZIA			3,026,700.00	3,023,160.00	0.76
Enti Governativi			3,026,700.00	3,023,160.00	0.76
3,000,000.00	VOLVO CAR AB 4.20% 10/06/2029	EUR	3,026,700.00	3,023,160.00	0.76

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
CANADA			2,697,986.05	2,560,316.42	0.64
Materie prime			2,063,646.57	1,921,717.68	0.48
2,000,000.00	KINROSS GOLD CORP. 6.88% 01/09/2041	USD	2,063,646.57	1,921,717.68	0.48
Industria			634,339.48	638,598.74	0.16
750,000.00	CANADA CARTAGE CORP. 9.75% 08/05/2031	USD	634,339.48	638,598.74	0.16
GEORGIA			2,531,250.00	2,534,375.00	0.64
Finanza			2,531,250.00	2,534,375.00	0.64
2,500,000.00	PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD. 4.25% 29/04/2030	EUR	2,531,250.00	2,534,375.00	0.64
JERSEY			2,844,135.44	2,215,114.57	0.56
Beni voluttuari			2,844,135.44	2,215,114.57	0.56
2,000,000.00	ASTON MARTIN CAPITAL HOLDINGS LTD. 10.38% 31/03/2029	GBP	2,387,243.44	1,865,648.14	0.47
500,000.00	ASTON MARTIN CAPITAL HOLDINGS LTD. 10.00% 31/03/2029	USD	456,892.00	349,466.43	0.09
ROMANIA			2,142,370.00	2,129,540.00	0.54
Enti Governativi			2,142,370.00	2,129,540.00	0.54
2,000,000.00	ROMANIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BONDS 6.38% 18/09/2033	EUR	2,142,370.00	2,129,540.00	0.54
GERMANIA			2,001,300.00	2,045,440.00	0.52
Materie prime			2,001,300.00	2,045,440.00	0.52
2,000,000.00	K&S AG 4.25% 19/06/2029	EUR	2,001,300.00	2,045,440.00	0.52
BERMUDA			1,527,600.00	1,568,160.00	0.39
Finanza			1,527,600.00	1,568,160.00	0.39
1,500,000.00	ATHORA HOLDING LTD. 6.63% 16/06/2028	EUR	1,527,600.00	1,568,160.00	0.39
CILE			746,226.21	721,056.53	0.18
Materie prime			746,226.21	721,056.53	0.18
800,000.00	CORP. NACIONAL DEL COBRE DE CHILE 5.95% 08/01/2034	USD	746,226.21	721,056.53	0.18
AUSTRIA			494,050.00	515,810.00	0.13
Informatica			494,050.00	515,810.00	0.13
500,000.00	AMS-OSRAM AG 7.25% 31/05/2032	EUR	494,050.00	515,810.00	0.13
Obbligazioni a tasso variabile			208,653,660.63	216,283,465.93	54.58
ITALIA			52,279,785.76	54,125,003.08	13.66
Finanza			44,652,868.26	45,915,405.58	11.59
6,500,000.00	BPER BANCA FRN 11/09/2029	EUR	6,554,838.00	6,836,895.00	1.72
5,000,000.00	UNIPOL ASSICURAZIONI SPA FRN 31/12/2099	EUR	5,106,400.00	5,098,350.00	1.29
5,000,000.00	BPER BANCA SPA FRN 31/12/2099	EUR	5,016,000.00	5,084,800.00	1.28
4,500,000.00	UNICREDIT SPA FRN 31/12/2099	EUR	4,497,369.23	4,522,095.00	1.14
5,000,000.00	UNICREDIT SPA FRN 30/06/2035	USD	4,098,167.63	4,397,620.58	1.11
3,000,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 31/12/2099	EUR	3,000,000.00	3,288,480.00	0.83
3,000,000.00	BANCA POPOLARE DI SONDRIO SPA FRN 26/09/2028	EUR	2,995,170.00	3,086,400.00	0.78
3,000,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 31/12/2099	EUR	3,020,160.00	3,034,890.00	0.77
2,600,000.00	BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA FRN 15/03/2029	EUR	2,625,500.00	2,666,352.00	0.67
2,000,000.00	SACE SPA FRN 10/02/2049	EUR	2,005,000.00	2,010,140.00	0.51
1,300,000.00	BANCO BPM SPA FRN 26/11/2036	EUR	1,298,466.00	1,337,063.00	0.34
1,000,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 31/12/2099	EUR	1,000,000.00	1,061,480.00	0.27
1,000,000.00	BANCA SELLA HOLDING SPA FRN 18/07/2029	EUR	1,040,200.00	1,027,140.00	0.26
1,000,000.00	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA FRN 18/09/2035	EUR	995,597.40	1,016,830.00	0.26
800,000.00	BANCA POPOLARE DI SONDRIO SPA FRN 13/03/2034	EUR	800,000.00	834,336.00	0.21
600,000.00	BPER BANCA SPA FRN 31/12/2099	EUR	600,000.00	612,534.00	0.15

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Servizi di pubblica utilità			4,392,687.50	4,732,067.50	1.19
2,000,000.00	ENEL SPA FRN 31/12/2099	EUR	1,650,000.00	1,833,040.00	0.46
1,000,000.00	ENEL SPA FRN 31/12/2099	EUR	1,000,000.00	1,103,160.00	0.28
1,000,000.00	A2A SPA FRN 31/12/2099	EUR	994,600.00	1,025,190.00	0.26
750,000.00	TERNA - RETE ELETTRICA NAZIONALE FRN 31/12/2099	EUR	748,087.50	770,677.50	0.19
Energia			2,221,750.00	2,465,200.00	0.62
2,500,000.00	ENI SPA FRN 31/12/2099	EUR	2,221,750.00	2,465,200.00	0.62
Industria			1,012,480.00	1,012,330.00	0.26
1,000,000.00	IMA INDUSTRIA MACCHINE AUTOMATICHE SPA FRN 15/04/2029	EUR	1,012,480.00	1,012,330.00	0.26
PAESI BASSI			27,392,941.50	28,109,143.60	7.09
Beni voluttuari			20,124,144.94	20,562,143.22	5.19
6,500,000.00	STELLANTIS NV FRN 31/12/2099	EUR	6,481,405.00	6,345,755.00	1.60
6,100,000.00	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN 31/12/2099	EUR	5,268,885.00	5,906,935.00	1.49
5,000,000.00	STELLANTIS NV FRN 31/12/2099	EUR	4,904,180.00	4,903,950.00	1.24
3,000,000.00	STELLANTIS NV FRN 31/12/2099	GBP	3,469,674.94	3,405,503.22	0.86
Finanza			4,769,606.56	4,965,016.38	1.25
2,000,000.00	ACHMEA BV FRN 31/12/2099	EUR	1,982,000.00	1,995,720.00	0.50
1,000,000.00	ASR NEDERLAND NV FRN 07/12/2043	EUR	1,051,000.00	1,175,640.00	0.30
1,000,000.00	ING GROEP NV FRN 31/12/2099	USD	837,303.56	857,561.38	0.22
700,000.00	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS FINANCE BV FRN 31/12/2099	EUR	699,993.00	713,461.00	0.18
200,000.00	NN GROUP NV FRN 03/11/2043	EUR	199,310.00	222,634.00	0.05
Enti Governativi			900,000.00	918,931.00	0.23
500,000.00	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS FINANCE BV FRN 31/12/2099	EUR	500,000.00	507,155.00	0.13
400,000.00	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN 31/12/2099	EUR	400,000.00	411,776.00	0.10
Servizi di telecomunicazione			800,000.00	846,752.00	0.21
800,000.00	TELEFONICA EUROPE BV FRN 31/12/2099	EUR	800,000.00	846,752.00	0.21
Servizi di pubblica utilità			499,190.00	513,460.00	0.13
500,000.00	TENNET HOLDING BV FRN 31/12/2099	EUR	499,190.00	513,460.00	0.13
Industria			300,000.00	302,841.00	0.08
300,000.00	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS FINANCE BV FRN 31/12/2099	EUR	300,000.00	302,841.00	0.08
FRANCIA			25,955,406.71	27,134,641.31	6.85
Finanza			19,857,961.71	20,321,780.31	5.13
6,000,000.00	BNP PARIBAS SA FRN 31/12/2099	EUR	5,997,400.00	6,003,180.00	1.51
3,000,000.00	SOCIETE GENERALE SA FRN 31/12/2099	EUR	3,001,500.00	3,039,300.00	0.77
2,100,000.00	CREDIT AGRICOLE SA FRN 31/12/2099	EUR	2,162,465.00	2,160,291.00	0.55
2,000,000.00	CREDIT AGRICOLE ASSURANCES SA FRN 31/12/2099	EUR	2,113,400.00	2,081,260.00	0.53
1,800,000.00	BNP PARIBAS CARDIF SA FRN 27/05/2041	EUR	1,819,278.00	1,828,620.00	0.46
1,000,000.00	SOGECAP SA FRN 16/05/2044	EUR	1,067,000.00	1,135,300.00	0.29
1,000,000.00	AXA SA FRN 11/07/2043	EUR	995,370.00	1,088,760.00	0.27
1,000,000.00	AXA SA FRN 31/12/2099	EUR	1,000,000.00	1,075,690.00	0.27
1,000,000.00	CNP ASSURANCES SACA FRN 18/07/2053	EUR	945,300.00	1,065,830.00	0.27
1,000,000.00	SCOR SE FRN 31/12/2049	USD	756,248.71	843,549.31	0.21
Servizi di pubblica utilità			4,600,095.00	5,278,006.00	1.33
2,400,000.00	ELECTRICITE DE FRANCE SA FRN 31/12/2099	EUR	1,901,340.00	2,315,136.00	0.58
2,000,000.00	VEOLIA ENVIRONNEMENT SA FRN 31/12/2099	EUR	1,704,125.00	1,933,340.00	0.49
1,000,000.00	ELECTRICITE DE FRANCE SA FRN 31/12/2099	EUR	994,630.00	1,029,530.00	0.26
Enti Governativi			997,350.00	1,015,690.00	0.26
1,000,000.00	ALSTOM SA FRN 31/12/2099	EUR	997,350.00	1,015,690.00	0.26
Industria			500,000.00	519,165.00	0.13
500,000.00	ALSTOM SA FRN 31/12/2099	EUR	500,000.00	519,165.00	0.13

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
GERMANIA			22,183,823.58	23,298,433.99	5.88
Finanza			13,735,422.98	13,942,472.99	3.52
7,000,000.00	ALLIANZ SE FRN 31/12/2099	EUR	6,339,390.00	6,392,120.00	1.61
5,000,000.00	DEUTSCHE BANK AG FRN 31/12/2099	EUR	5,010,600.00	5,120,000.00	1.29
2,000,000.00	COMMERZBANK AG FRN 28/02/2033	GBP	2,385,432.98	2,430,352.99	0.62
Salute			5,680,900.60	6,167,019.00	1.55
3,400,000.00	BAYER AG FRN 25/03/2082	EUR	3,192,320.60	3,508,834.00	0.88
1,500,000.00	BAYER AG FRN 13/09/2054	EUR	1,495,740.00	1,550,295.00	0.39
1,000,000.00	BAYER AG FRN 25/09/2083	EUR	992,840.00	1,107,890.00	0.28
Servizi di pubblica utilità			1,967,500.00	2,367,126.00	0.60
2,000,000.00	ENBW ENERGIE BADEN-WUERTTEMBERG AG FRN 31/08/2081	EUR	1,367,500.00	1,773,300.00	0.45
600,000.00	ENBW ENERGIE BADEN-WUERTTEMBERG AG FRN 10/02/2056	EUR	600,000.00	593,826.00	0.15
Industria			800,000.00	821,816.00	0.21
800,000.00	VOSSLOH AG FRN 12/01/2033	EUR	800,000.00	821,816.00	0.21
REGNO UNITO			22,220,003.47	22,840,441.43	5.76
Finanza			15,970,200.12	16,226,922.47	4.09
2,000,000.00	NATWEST GROUP PLC FRN 31/12/2099	GBP	2,416,884.31	2,392,275.70	0.60
2,000,000.00	STANDARD CHARTERED PLC FRN 10/05/2031	EUR	2,000,000.00	2,105,720.00	0.53
2,000,000.00	BARCLAYS PLC FRN 31/12/2099	EUR	2,027,000.00	2,017,400.00	0.51
1,800,000.00	ROTHESAY LIFE PLC FRN 31/12/2099	GBP	1,619,793.86	1,901,856.39	0.48
1,500,000.00	BARCLAYS PLC FRN 31/12/2099	GBP	1,868,681.05	1,856,268.12	0.47
1,500,000.00	NATWEST GROUP PLC FRN 31/12/2099	GBP	1,731,325.42	1,757,307.78	0.44
2,000,000.00	MAREX GROUP PLC FRN 31/12/2099	USD	1,726,736.08	1,752,715.68	0.44
2,000,000.00	STANDARD CHARTERED PLC FRN 29/01/2049	USD	1,806,029.40	1,712,428.80	0.43
1,000,000.00	BARCLAYS BANK PLC FRN 28/12/2040	EUR	773,750.00	730,950.00	0.19
Enti Governativi			3,605,303.35	3,638,598.96	0.92
3,000,000.00	NATIONWIDE BUILDING SOCIETY FRN 31/12/2099	GBP	3,605,303.35	3,638,598.96	0.92
Servizi di pubblica utilità			1,835,000.00	2,011,120.00	0.51
2,000,000.00	SSE PLC FRN 31/12/2099	EUR	1,835,000.00	2,011,120.00	0.51
Servizi di telecomunicazione			809,500.00	963,800.00	0.24
1,000,000.00	VODAFONE GROUP PLC FRN 27/08/2080	EUR	809,500.00	963,800.00	0.24
LUSSEMBURGO			18,460,480.96	19,737,704.00	4.98
Finanza			10,203,995.96	11,374,899.00	2.87
6,000,000.00	HELVETIA EUROPE SA FRN 30/09/2041	EUR	5,070,008.00	5,711,460.00	1.44
8,100,000.00	MITSUBISHI UFJ INVESTOR SERVICES & BANKING LUXEMBOURG SA FRN 15/12/2050	EUR	5,133,987.96	5,663,439.00	1.43
Servizi di telecomunicazione			2,996,460.00	2,996,290.00	0.76
2,000,000.00	SES SA FRN 12/09/2054	EUR	1,989,460.00	2,007,240.00	0.51
1,000,000.00	SES SA FRN 12/09/2054	EUR	1,007,000.00	989,050.00	0.25
Salute			2,000,000.00	2,098,495.00	0.53
1,500,000.00	EUROFINS SCIENTIFIC SE FRN 31/12/2099	EUR	1,500,000.00	1,573,800.00	0.40
500,000.00	EUROFINS SCIENTIFIC SE FRN 31/12/2099	EUR	500,000.00	524,695.00	0.13
Energia			2,000,000.00	2,020,020.00	0.51
2,000,000.00	REPSOL EUROPE FINANCE SARL FRN 31/12/2099	EUR	2,000,000.00	2,020,020.00	0.51
Enti Governativi			1,260,025.00	1,248,000.00	0.31
1,300,000.00	CPI PROPERTY GROUP SA FRN 31/12/2099	EUR	1,260,025.00	1,248,000.00	0.31

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
AUSTRIA			8,369,400.00	9,030,400.00	2.28
Finanza			8,369,400.00	9,030,400.00	2.28
5,000,000.00	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG FRN 31/12/2099	EUR	5,013,400.00	5,059,500.00	1.28
2,000,000.00	VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICHERUNG GRUPPE FRN 15/06/2042	EUR	1,909,000.00	2,102,140.00	0.53
2,000,000.00	UNIQA INSURANCE GROUP AG FRN 09/12/2041	EUR	1,447,000.00	1,868,760.00	0.47
BERMUDA			7,053,115.77	7,129,627.79	1.80
Finanza			7,053,115.77	7,129,627.79	1.80
9,500,000.00	AEGON LTD. FRN 31/12/2099	NLG	3,323,089.25	3,467,180.35	0.88
8,000,000.00	AEGON LTD. FRN 29/03/2049	NLG	2,825,349.06	2,632,796.51	0.66
1,500,000.00	AEGON LTD. FRN 31/12/2099	USD	904,677.46	1,029,650.93	0.26
STATI UNITI			6,246,615.54	6,660,701.57	1.68
Servizi di pubblica utilità			4,361,381.97	4,747,242.44	1.20
3,500,000.00	SOUTHERN CO. FRN 15/09/2081	EUR	3,128,600.00	3,437,665.00	0.87
1,500,000.00	SOUTHERN CO. FRN 15/09/2051	USD	1,232,781.97	1,309,577.44	0.33
Industria			1,885,233.57	1,913,459.13	0.48
2,200,000.00	STANLEY BLACK & DECKER INC FRN 15/03/2060	USD	1,885,233.57	1,913,459.13	0.48
IRLANDA			3,102,000.00	3,126,090.00	0.79
Finanza			3,102,000.00	3,126,090.00	0.79
3,000,000.00	BANK OF IRELAND GROUP PLC FRN 31/12/2099	EUR	3,102,000.00	3,126,090.00	0.79
SVIZZERA			2,997,183.90	3,032,009.22	0.77
Finanza			2,997,183.90	3,032,009.22	0.77
2,000,000.00	UBS GROUP AG FRN 09/06/2033	EUR	2,027,700.00	2,059,220.00	0.52
1,000,000.00	VONTOBEL HOLDING AG FRN 31/12/2099	USD	969,483.90	972,789.22	0.25
BELGIO			2,988,353.00	3,029,357.00	0.76
Servizi di pubblica utilità			2,288,353.00	2,316,491.00	0.58
2,300,000.00	ELIA GROUP SA FRN 31/12/2099	EUR	2,288,353.00	2,316,491.00	0.58
Servizi di telecomunicazione			700,000.00	712,866.00	0.18
700,000.00	PROXIMUS SADP FRN 31/12/2099	EUR	700,000.00	712,866.00	0.18
COSTA D'AVORIO			3,182,913.44	3,014,842.76	0.76
Sovranazionale			3,182,913.44	3,014,842.76	0.76
3,500,000.00	AFRICAN DEVELOPMENT BANK FRN 31/12/2099	USD	3,182,913.44	3,014,842.76	0.76
LIECHTENSTEIN			1,949,780.00	1,929,127.00	0.49
Finanza			1,949,780.00	1,929,127.00	0.49
1,900,000.00	SWISS LIFE FINANCE II AG FRN 01/10/2044	EUR	1,949,780.00	1,929,127.00	0.49
SPAGNA			1,060,000.00	1,055,600.00	0.27
Energia			1,060,000.00	1,055,600.00	0.27
1,000,000.00	BANCO DE SABADELL SA FRN 31/12/2099	EUR	1,060,000.00	1,055,600.00	0.27
POLONIA			1,031,500.00	1,037,740.00	0.26
Finanza			1,031,500.00	1,037,740.00	0.26
1,000,000.00	BANK MILLENNIUM SA FRN 25/09/2029	EUR	1,031,500.00	1,037,740.00	0.26
NORVEGIA			696,675.00	699,874.00	0.18
Energia			696,675.00	699,874.00	0.18
700,000.00	VAR ENERGI ASA FRN 29/04/2086	EUR	696,675.00	699,874.00	0.18

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
GIAPPONE			395,000.00	494,155.00	0.12
Servizi di telecomunicazione			395,000.00	494,155.00	0.12
500,000.00	RAKUTEN GROUP, INC. FRN 31/12/2099	EUR	395,000.00	494,155.00	0.12
UCRAINA			735,575.01	451,750.18	0.11
Enti Governativi			735,575.01	451,750.18	0.11
198,911.00	UKRAINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BONDS FRN 01/02/2036	USD	193,360.57	119,536.23	0.03
174,047.00	UKRAINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BONDS FRN 01/02/2035	USD	172,718.12	105,674.98	0.03
124,319.00	UKRAINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BONDS FRN 01/02/2034	USD	125,627.46	76,576.93	0.02
101,506.00	UKRAINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BONDS FRN 01/02/2034	USD	72,154.38	50,210.53	0.01
85,780.00	UKRAINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BONDS FRN 01/02/2035	USD	79,840.56	45,113.84	0.01
71,483.00	UKRAINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BONDS FRN 01/02/2036	USD	65,258.82	37,573.43	0.01
27,163.00	UKRAINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BONDS FRN 01/02/2030	USD	26,615.10	17,064.24	0.00
ISOLE CAYMAN			353,106.99	346,824.00	0.09
Finanza			353,106.99	346,824.00	0.09
360,000.00	EMERGING MARKETS CAPITAL PROTECTED INVESTMENTS LTD. FRN 20/04/2028	EUR	353,106.99	346,824.00	0.09
Obbligazioni zero coupon			5,401,547.35	5,506,594.68	1.39
ITALIA			2,359,993.10	2,353,250.00	0.59
Beni voluttuari			2,359,993.10	2,353,250.00	0.59
2,500,000.00	NEXI SPA 0.00% 24/02/2028	EUR	2,359,993.10	2,353,250.00	0.59
ISOLE CAYMAN			1,507,577.35	1,408,527.83	0.36
Beni voluttuari			1,507,577.35	1,408,527.83	0.36
1,800,000.00	ALIBABA GROUP HOLDING LTD. 0.00% 15/09/2032	USD	1,507,577.35	1,408,527.83	0.36
CILE			740,609.33	896,069.17	0.23
Servizi di pubblica utilità			740,609.33	896,069.17	0.23
1,110,398.60	CHILE ELECTRICITY PEC SPA 0.00% 25/01/2028	USD	740,609.33	896,069.17	0.23
STATI UNITI			526,073.32	598,328.96	0.15
Sovranazionale			526,073.32	598,328.96	0.15
70,000,000.00	INTERNATIONAL FINANCE CORP. 0.00% 24/01/2050	ZAR	526,073.32	598,328.96	0.15
COSTA D'AVORIO			267,294.25	250,418.72	0.06
Sovranazionale			267,294.25	250,418.72	0.06
60,000,000.00	AFRICAN DEVELOPMENT BANK 0.00% 03/02/2053	MXN	267,294.25	250,418.72	0.06
Azioni di OICR			7,900,000.00	8,009,960.94	2.02
LUSSEMBURGO			7,900,000.00	8,009,960.94	2.02
Finanza			7,900,000.00	8,009,960.94	2.02
1,399,119.81	AZ FUND 1 - AZ BOND - EURO CORPORATE -A-INSTITUTIONAL- EUR - (0.800%)	EUR	7,900,000.00	8,009,960.94	2.02
NEGOZIATI SU UN ALTRO MERCATO REGOLAMENTATO			14,139,832.81	15,507,562.99	3.91
Obbligazioni ordinarie			7,077,058.06	7,409,153.76	1.87
STATI UNITI			3,400,112.35	3,460,928.62	0.87
Informatica			3,400,112.35	3,460,928.62	0.87
4,000,000.00	COREWEAVE, INC. 9.00% 01/02/2031	USD	3,400,112.35	3,460,928.62	0.87

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
ITALIA			2,990,749.99	3,187,483.35	0.81
Finanza			2,990,749.99	3,187,483.35	0.81
3,000,000.00	INTESA SANPAOLO SPA 7.80% 28/11/2053	USD	2,990,749.99	3,187,483.35	0.81
LUSSEMBURGO			686,195.72	760,741.79	0.19
Energia			686,195.72	760,741.79	0.19
843,637.15	ACU PETROLEO LUXEMBOURG SARL 7.50% 13/01/2032	USD	686,195.72	760,741.79	0.19
Obbligazioni a tasso variabile			7,062,774.75	8,098,409.23	2.04
ITALIA			7,062,774.75	8,098,409.23	2.04
Finanza			7,062,774.75	8,098,409.23	2.04
7,800,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 20/06/2054	USD	7,062,774.75	8,098,409.23	2.04
ALTRI VALORI MOBILIARI			7,039,648.48	6.58	0.00
Obbligazioni ordinarie			835,864.93	0.00	0.00
IRLANDA			835,864.93	0.00	0.00
Finanza			835,864.93	0.00	0.00
1,000,000.00	GTLK EUROPE CAPITAL DAC 4.80% 26/02/2028	USD	835,864.93	0.00	0.00
Titoli garantiti da Ipotecche immobiliari e da collaterale			6,203,783.55	6.58	0.00
ITALIA			6,203,783.55	6.58	0.00
Finanza			6,203,783.55	6.58	0.00
4,800,000.00	SIERRA ONE SPV SRL 7.00% 30/06/2025*	EUR	4,800,000.00	4.80	0.00
1,779,644.46	SPV PROJECT SRL 7.00% 15/11/2037*	EUR	1,403,783.55	1.78	0.00
QUOTE DI OICR			14,324,235.20	15,372,035.40	3.88
Azioni di OICR			14,324,235.20	15,372,035.40	3.88
LUSSEMBURGO			11,561,254.40	12,629,235.40	3.19
Finanza			11,561,254.40	12,629,235.40	3.19
40,385.77	PLANETARIUM FUND - ENHANCED EURO CREDIT -B- EUR - (0.650%)	EUR	3,916,200.06	4,539,360.32	1.15
709,861.12	AZ FUND 1 - AZ BOND - TARGET 2029 -A- USD - (1.440%)	USD	3,230,939.43	3,356,519.65	0.85
29,985.37	PLANETARIUM FUND - EUROCURRENCIES BONDS -A- EUR - (0.200%)	EUR	2,500,000.01	2,738,863.79	0.69
184,150.64	AZ FUND 1 - AZ BOND - US DOLLAR AGGREGATE USD - (1.000%)	USD	814,115.40	877,506.02	0.22
52,576.24	SUMUS - HYBRID BONDS FUND -PREMIUM EUR- EUR - (0.200%)	EUR	599,999.99	611,514.19	0.15
431.54	SUMUS - CROSSOVER BONDS FUND -PREMIUM EUR-H- EUR (HEDGED) - (0.200%)	EUR	499,999.51	505,471.43	0.13
IRLANDA			2,762,980.80	2,742,800.00	0.69
Finanza			2,762,980.80	2,742,800.00	0.69
40,000.00	ISHARES VI PLC - ISHARES J.P. MORGAN \$ EM BOND EUR HEDGED UCITS ETF EUR (HEDGED) - (0.500%)	EUR	2,762,980.80	2,742,800.00	0.69
Totale del Portafoglio Titoli			374,932,573.94	378,704,165.85	95.56

* 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 2026

Valore nominale	Quantità	Acquisto / Vendita	Contratto	Scadenza	Valore di mercato al 30 Giugno 2026	Valuta	Plus/(minus) valenza non realizzata (EUR)	Impegno (EUR)
							30,239.84	84,852,532.59
100,000	100	Acquisto	EURO-BUND	08/09/2026	127.34	EUR	156,000.00	12,734,000.00
200,000	400	Acquisto	US 2YR NOTE (CBT)	30/09/2026	90.15	USD	-125,760.16	72,118,532.59

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

CONTRATTI FINANZIARI A TERMINE AL 30 GIUGNO 2026

Scadenza	Ammontare comprato	Valuta comprata	Ammontare venduto	Valuta venduta	Plus/(minus)-valenza non realizzata (EUR)
					-1,829,334.59
22/07/2026	2,500,000.00	CHF	2,717,199.33	EUR	-2,688.53
22/07/2026	829,675.00	CHF	907,671.18	EUR	-6,806.48
22/07/2026	1,152,495.96	EUR	1,000,000.00	GBP	-7,439.19
22/07/2026	2,500,000.00	CHF	2,722,332.93	EUR	-7,822.13
22/07/2026	5,000,000.00	CHF	5,452,116.78	EUR	-23,095.17
22/07/2026	1,700,897.22	EUR	2,000,000.00	USD	-47,008.78
22/07/2026	21,030,974.97	EUR	18,400,000.00	GBP	-311,831.85
22/07/2026	48,097,685.72	EUR	56,800,000.00	USD	-1,542,844.74
22/07/2026	4,425,260.00	USD	3,747,266.98	EUR	120,202.28

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond

CONTRATTI SWAP AL 30 GIUGNO 2026

Sottostante	Valuta	Posizione	Nominale	Controparte	Scadenza	Interessi da ricevere / pagare (EUR)	Plus/(minus) -valenza non realizzata(EUR)
CONTRATTI CREDIT DEFAULT SWAP						-15,628.56	-721,007.16
ITRAXX EUROPE SUB FINANCIALS SERIES 43 VERSION 1	EUR	Long	20,000,000.00	J.P. MORGAN SE	06/20/2030	-5,000.00	-318,803.27
iTraxx Europe Series 44 Version 1	USD	Long	8,000,000.00	J.P. MORGAN SE	12/20/2030	-1,753.56	-10,800.90
ITALY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND	EUR	Long	35,500,000.00	J.P. MORGAN SE	12/20/2030	-8,875.00	-391,402.99

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - Euro Equities

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Attività	Note	
Portafoglio Titoli al valore di mercato	(2a)	32,329,886.38
Liquidità bancarie a vista		1,554,889.32
Importi dovuti dai broker		309,959.39
Dividendi da ricevere		51,094.29
Da ricevere su sottoscrizioni		6,728.82
Altre attività		3,472.09
Totale attività		34,256,030.29

Passività	
Da pagare su rimborsi	-4,496.37
Altre passività	-202,097.93
Totale passività	-206,594.30

Totale attivo netto	34,049,435.99
----------------------------	----------------------

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	105.73	39,431.199
Azione I	EUR	120.99	246,011.913
Azione L	EUR	118.68	982.000

NEW MILLENNIUM - Euro Equities

PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Attivo netto all'inizio del periodo	Note	28,168,473.64
Risultato netto degli investimenti	(2h)	596,058.26
Altri ricavi		179.04
Totale ricavi		596,237.30
Commissioni di consulenza/gestione	(5)	-124,378.25
Commissione di consulenza	(6)	-8,642.66
Commissioni sulla performance	(7)	-102,954.94
Commissioni della Banca Depositaria	(8)	-8,706.99
Tassa di registrazione	(3)	-2,388.92
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(8)	-24,448.79
Commissioni del Transfer Agent		-3,147.37
Compensi professionali	(9)	-6,690.03
Pubblicazioni		-691.41
Altre spese e tasse	(4)	-12,043.77
Totale costi		-294,093.13
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		302,144.17
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(2b)	1,596,113.84
- di contratti futures		22,202.68
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		1,999,236.00
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(2c)	1.52
Risultato netto delle operazioni per il periodo		3,919,698.21
Sottoscrizioni del periodo		5,758,900.32
Rimborsi del periodo		-3,797,636.18
Attivo netto alla fine del periodo		34,049,435.99

NEW MILLENNIUM - Euro Equities

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			27,572,484.96	32,329,886.38	94.95
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			27,572,484.96	32,329,886.38	94.95
Azioni			27,572,484.96	32,325,797.22	94.94
GERMANIA			8,422,387.13	9,719,428.24	28.54
Industria			2,598,414.43	3,194,631.80	9.38
5,472.00	SIEMENS AG	EUR	1,078,139.35	1,538,452.80	4.52
2,655.00	SIEMENS ENERGY AG	EUR	460,063.50	440,199.00	1.29
1,047.00	MTU AERO ENGINES AG	EUR	377,565.28	381,003.30	1.12
6,030.00	DEUTSCHE POST AG	EUR	239,992.71	320,193.00	0.94
593.00	HOCHTIEF AG	EUR	196,690.69	300,651.00	0.88
1,283.00	HEIDELBERG MATERIALS AG	EUR	245,962.90	214,132.70	0.63
Informatica			2,081,127.84	2,702,452.00	7.94
20,000.00	INFINEON TECHNOLOGIES AG	EUR	752,758.54	1,633,400.00	4.80
7,978.00	SAP SE	EUR	1,328,369.30	1,069,052.00	3.14
Finanza			2,306,772.49	2,591,680.93	7.61
2,661.00	ALLIANZ SE	EUR	855,095.15	1,101,920.10	3.24
13,546.00	COMMERZBANK AG	EUR	430,485.87	504,317.58	1.48
922.00	MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS-GESELLSCHAFT AG IN MUENCHEN	EUR	515,832.72	450,397.00	1.32
1,360.00	DEUTSCHE BOERSE AG	EUR	312,064.26	324,768.00	0.95
7,098.00	DEUTSCHE BANK AG	EUR	193,294.49	210,278.25	0.62
Servizi di telecomunicazione			986,794.97	726,685.65	2.13
30,469.00	DEUTSCHE TELEKOM AG	EUR	986,794.97	726,685.65	2.13
Servizi di pubblica utilità			250,252.05	271,606.14	0.80
4,797.00	RWE AG	EUR	250,252.05	271,606.14	0.80
Materie prime			199,025.35	232,371.72	0.68
2,646.00	SYMRISE AG	EUR	199,025.35	232,371.72	0.68
FRANCIA			8,159,581.45	8,454,328.72	24.83
Industria			1,793,645.44	2,037,484.20	5.99
3,854.00	SCHNEIDER ELECTRIC SE	EUR	876,365.42	1,099,931.60	3.23
3,880.00	VINCI SA	EUR	473,788.69	495,864.00	1.46
3,485.00	CIE DE SAINT-GOBAIN SA	EUR	279,477.25	275,872.60	0.81
3,290.00	SPIE SA	EUR	164,014.08	165,816.00	0.49
Beni voluttuari			1,569,479.32	1,502,467.80	4.41
534.00	HERMES INTERNATIONAL SCA	EUR	945,696.67	853,332.00	2.50
1,692.00	L'OREAL SA	EUR	623,782.65	649,135.80	1.91
Finanza			1,033,852.79	1,274,748.43	3.74
9,769.00	SOCIETE GENERALE SA	EUR	555,544.43	755,827.53	2.22
11,834.00	AXA SA	EUR	478,308.36	518,920.90	1.52
Energia			839,575.11	976,638.68	2.87
14,356.00	TOTALENERGIES SE	EUR	839,575.11	976,638.68	2.87
Salute			1,169,473.31	959,556.62	2.82
8,039.00	SANOFI SA	EUR	686,845.68	603,568.12	1.77
2,170.00	ESSILORLUXOTTICA SA	EUR	482,627.63	355,988.50	1.05
Materie prime			591,059.85	657,944.16	1.93
3,797.00	AIR LIQUIDE SA	EUR	591,059.85	657,944.16	1.93
Servizi di pubblica utilità			611,947.40	629,254.53	1.85
11,771.00	ENGIE SA	EUR	343,071.97	324,761.89	0.95
8,356.00	VEOLIA ENVIRONNEMENT SA	EUR	268,875.43	304,492.64	0.90

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

NEW MILLENNIUM - Euro Equities

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Informatica			350,300.94	221,747.16	0.65
2,521.00	CAPGEMINI SE	EUR	350,300.94	221,747.16	0.65
Beni di prima necessità			200,247.29	194,487.14	0.57
2,711.00	DANONE SA	EUR	200,247.29	194,487.14	0.57
PAESI BASSI			4,737,200.75	6,623,087.69	19.45
Informatica			1,870,159.21	3,591,884.40	10.55
1,796.00	ASML HOLDING NV	EUR	1,419,677.24	3,091,634.40	9.08
500.00	ASM INTERNATIONAL NV	EUR	450,481.97	500,250.00	1.47
Finanza			1,053,745.42	1,060,195.12	3.11
27,990.00	ING GROEP NV	EUR	768,250.74	774,483.30	2.27
3,727.00	NN GROUP NV	EUR	285,494.68	285,711.82	0.84
Industria			735,058.35	798,197.62	2.34
4,103.00	AIRBUS SE	EUR	735,058.35	798,197.62	2.34
Salute			246,900.65	339,165.20	1.00
349.00	ARGENX SE	EUR	201,925.06	283,178.60	0.83
69.00	ARGENX SE	EUR	44,975.59	55,986.60	0.17
Servizi di telecomunicazione			353,225.72	330,513.00	0.97
8,700.00	PROSUS NV	EUR	353,225.72	330,513.00	0.97
Beni voluttuari			286,932.27	301,321.15	0.89
929.00	FERRARI NV	EUR	286,932.27	301,321.15	0.89
Beni di prima necessità			191,179.13	201,811.20	0.59
2,742.00	HEINEKEN NV	EUR	191,179.13	201,811.20	0.59
SPAGNA			4,016,865.21	4,741,482.68	13.93
Finanza			2,333,358.90	2,749,395.24	8.08
99,603.00	BANCO SANTANDER SA	EUR	892,696.96	1,203,602.65	3.54
47,500.00	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	EUR	938,083.76	1,038,825.00	3.05
40,934.00	CAIXABANK SA	EUR	502,578.18	506,967.59	1.49
Servizi di pubblica utilità			1,121,761.16	1,283,051.32	3.77
45,522.00	IBERDROLA SA	EUR	895,201.01	994,200.48	2.92
7,243.00	ENDESA SA	EUR	226,560.15	288,850.84	0.85
Beni voluttuari			390,930.12	422,549.92	1.24
7,666.00	INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL SA	EUR	390,930.12	422,549.92	1.24
Industria			170,815.03	286,486.20	0.84
2,226.00	ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS SA	EUR	170,815.03	286,486.20	0.84
ITALIA			1,405,105.62	1,922,920.89	5.65
Finanza			661,645.73	1,019,179.98	2.99
13,023.00	UNICREDIT SPA	EUR	661,645.73	1,019,179.98	2.99
Industria			430,001.86	587,217.71	1.73
3,005.00	PRYSMIAN SPA	EUR	310,132.65	438,880.25	1.29
5,183.00	POSTE ITALIANE SPA	EUR	119,869.21	148,337.46	0.44
Beni voluttuari			313,458.03	316,523.20	0.93
3,832.00	BRUNELLO CUCINELLI SPA	EUR	313,458.03	316,523.20	0.93
BELGIO			831,344.80	864,549.00	2.54
Servizi di pubblica utilità			620,161.69	625,605.00	1.84
4,475.00	ELIA GROUP SA	EUR	620,161.69	625,605.00	1.84
Salute			211,183.11	238,944.00	0.70
912.00	UCB SA	EUR	211,183.11	238,944.00	0.70

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

NEW MILLENNIUM - Euro Equities

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Rights			0.00	4,089.16	0.01
SPAGNA			0.00	4,089.16	0.01
Beni voluttuari			0.00	4,089.16	0.01
2,226.00	ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS SA 16/07/2026	EUR	0.00	4,089.16	0.01
Totale del Portafoglio Titoli			27,572,484.96	32,329,886.38	94.95

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

NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Attività		Note	
Portafoglio Titoli al valore di mercato		(2a)	46,418,051.00
Liquidità bancarie a vista			1,188,987.15
Importi dovuti dai broker			3,574,846.54
Utili non realizzati su contratti futures		(2d, 13)	56,643.39
Dividendi da ricevere			10,626.69
Da ricevere su sottoscrizioni			6,867.15
Altre attività			4,183.97
Totale attività			51,260,205.89
Passività			
Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine		(2c, 13)	-349,405.50
Perdite non realizzate su contratti futures		(2d, 13)	-143,639.64
Da pagare su rimborsi			-5,712.72
Altre passività			-153,899.87
Totale passività			-652,657.73
Totale attivo netto			50,607,548.16
	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	175.53	27,978.733
Azione I	EUR	201.47	225,884.534
Azione L	EUR	197.60	947.000

NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)**PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR**

Attivo netto all'inizio del periodo	Note	45,881,386.41
Risultato netto degli investimenti	(2h)	234,780.09
Altri ricavi		2.18
Totale ricavi		234,782.27
Commissioni di consulenza/gestione	(5)	-205,971.10
Commissione di consulenza	(6)	-8,853.54
Commissioni della Banca Depositaria	(8)	-13,209.55
Tassa di registrazione	(3)	-3,318.67
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(8)	-24,202.83
Commissioni del Transfer Agent		-3,346.40
Compensi professionali	(9)	-6,889.95
Pubblicazioni		-1,055.54
Altre spese e tasse	(4)	-14,429.62
Totale costi		-281,277.20
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		-46,494.93
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(2b)	840,832.36
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		-577,674.24
- di contratti futures		-145,756.66
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		4,515,966.44
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(2c)	-422,139.19
- su contratti futures	(2d)	-250,707.65
Risultato netto delle operazioni per il periodo		3,914,026.13
Sottoscrizioni del periodo		4,250,696.22
Rimborsi del periodo		-3,438,560.60
Attivo netto alla fine del periodo		50,607,548.16

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

NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			26,762,068.46	46,418,051.00	91.72
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			26,589,053.74	46,165,439.73	91.22
Azioni			26,589,053.74	46,165,439.73	91.22
STATI UNITI			21,882,595.94	39,108,165.80	77.28
Informatica			7,591,681.71	15,468,423.50	30.57
9,500.00	APPLE, INC.	USD	738,150.28	2,404,373.12	4.75
13,500.00	NVIDIA CORP.	USD	470,019.83	2,362,647.41	4.67
6,000.00	MICROSOFT CORP.	USD	1,232,199.32	1,957,596.28	3.87
4,000.00	BROADCOM, INC.	USD	275,036.36	1,321,612.77	2.61
2,000.00	APPLIED MATERIALS, INC.	USD	297,851.99	1,264,759.81	2.50
2,000.00	ADVANCED MICRO DEVICES, INC.	USD	252,839.14	1,016,198.64	2.01
5,000.00	PALANTIR TECHNOLOGIES, INC.	USD	433,745.67	510,233.49	1.01
4,000.00	INTEL CORP.	USD	130,071.31	488,515.66	0.97
2,000.00	CLOUDFLARE, INC.	USD	289,497.99	429,073.70	0.85
1,000.00	SYNOPSYS, INC.	USD	376,890.77	390,160.03	0.77
1,500.00	INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP.	USD	270,490.66	368,945.13	0.73
500.00	CROWDSTRIKE HOLDINGS, INC.	USD	171,800.65	333,744.40	0.66
1,000.00	CADENCE DESIGN SYSTEMS, INC.	USD	260,332.05	328,277.77	0.65
2,000.00	QUALCOMM, INC.	USD	259,541.84	323,257.21	0.64
1,000.00	TEXAS INSTRUMENTS, INC.	USD	176,802.40	260,710.20	0.51
2,250.00	SERVICENOW, INC.	USD	340,131.16	195,381.77	0.39
500.00	ANALOG DEVICES, INC.	USD	85,010.23	173,694.55	0.34
7,500.00	D-WAVE QUANTUM, INC.	USD	105,076.46	157,373.38	0.31
1,000.00	AMPHENOL CORP.	USD	118,559.87	154,220.23	0.30
3,000.00	IONQ, INC.	USD	93,223.51	139,753.33	0.28
1,000.00	SALESFORCE, INC.	USD	209,607.54	137,024.39	0.27
1,000.00	ORACLE CORP.	USD	200,287.81	128,181.57	0.25
7,500.00	RIGETTI COMPUTING, INC.	USD	103,678.47	126,738.38	0.25
14,000.00	QUANTUM COMPUTING, INC.	USD	144,933.13	118,778.96	0.23
1,500.00	QUANTINUUM, INC.	USD	79,796.88	107,242.19	0.21
400.00	INTUIT, INC.	USD	233,908.25	91,314.61	0.18
500.00	ADOBE, INC.	USD	156,583.60	89,661.50	0.18
1,500.00	SKYWORKS SOLUTIONS, INC.	USD	85,614.54	88,953.02	0.18
Servizi di telecomunicazione			3,339,193.50	7,551,449.16	14.92
7,500.00	ALPHABET, INC.	USD	372,893.85	2,344,332.01	4.63
10,000.00	AMAZON.COM, INC.	USD	850,398.73	2,084,667.03	4.12
2,250.00	META PLATFORMS, INC.	USD	665,179.44	1,108,547.54	2.19
5,000.00	CISCO SYSTEMS, INC.	USD	247,708.94	513,688.41	1.02
1,500.00	PALO ALTO NETWORKS, INC.	USD	196,291.95	447,415.34	0.88
6,500.00	NETFLIX, INC.	USD	294,802.69	405,930.17	0.80
1,500.00	ARISTA NETWORKS, INC.	USD	186,818.80	222,881.12	0.44
3,000.00	VERIZON COMMUNICATIONS INC.	USD	118,134.75	111,099.44	0.22
5,000.00	AT&T, INC.	USD	107,630.80	90,527.41	0.18
4,000.00	COMCAST CORP.	USD	125,912.71	85,891.71	0.17
500.00	T-MOBILE U.S., INC.	USD	98,433.70	73,353.44	0.15
1,000.00	UBER TECHNOLOGIES, INC.	USD	74,987.14	63,115.54	0.12
Finanza			2,523,259.24	4,842,306.98	9.57
2,000.00	BERKSHIRE HATHAWAY, INC.	USD	584,192.81	875,343.24	1.73
2,500.00	JPMORGAN CHASE & CO.	USD	270,918.39	715,756.96	1.42
4,000.00	BANK OF NEW YORK MELLON CORP.	USD	164,078.74	505,938.91	1.00
500.00	GOLDMAN SACHS GROUP, INC.	USD	141,128.94	442,302.95	0.87
900.00	MASTERCARD, INC.	USD	242,664.98	404,303.30	0.80
1,200.00	VISA, INC.	USD	164,449.95	360,104.93	0.71
6,000.00	BANK OF AMERICA CORP.	USD	159,992.77	299,029.10	0.59
2,400.00	CITIGROUP, INC.	USD	113,597.65	293,802.13	0.58
300.00	BLACKROCK, INC.	USD	151,236.84	252,311.71	0.50
3,000.00	WELLS FARGO & CO.	USD	114,944.71	216,845.96	0.43

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

NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
4,000.00	U.S. BANCORP	USD	164,273.27	211,318.10	0.42
600.00	AMERICAN EXPRESS CO.	USD	156,659.26	177,512.45	0.35
500.00	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP.	USD	95,120.93	87,737.24	0.17
Salute			3,334,134.41	4,522,106.71	8.94
750.00	ELI LILLY & CO.	USD	578,925.09	786,820.98	1.55
3,500.00	JOHNSON & JOHNSON	USD	475,205.39	777,481.79	1.54
1,500.00	AMGEN, INC.	USD	359,967.01	475,098.36	0.94
1,250.00	UNITEDHEALTH GROUP, INC.	USD	361,651.80	454,419.19	0.90
5,000.00	CVS HEALTH CORP.	USD	328,753.67	452,418.40	0.89
2,000.00	ABBVIE, INC.	USD	157,174.08	440,199.39	0.87
750.00	THERMO FISHER SCIENTIFIC, INC.	USD	333,529.04	328,890.03	0.65
2,000.00	GILEAD SCIENCES, INC.	USD	124,496.23	221,009.34	0.44
1,500.00	MERCK & CO., INC.	USD	109,956.91	168,590.91	0.33
1,000.00	DANAHER CORP.	USD	130,041.15	166,605.43	0.33
250.00	INTUITIVE SURGICAL, INC.	USD	113,048.85	86,958.80	0.17
4,000.00	PFIZER, INC.	USD	148,041.54	84,247.35	0.17
1,000.00	ABBOTT LABORATORIES	USD	113,343.65	79,366.74	0.16
Industria			1,436,700.69	2,344,078.81	4.63
700.00	CATERPILLAR, INC.	USD	175,035.93	651,998.55	1.29
1,250.00	GENERAL ELECTRIC CO.	USD	254,662.96	408,608.82	0.81
2,500.00	3M CO.	USD	216,127.66	354,040.91	0.70
1,000.00	UNION PACIFIC CORP.	USD	188,083.55	237,907.79	0.47
1,500.00	EMERSON ELECTRIC CO.	USD	154,776.14	187,811.58	0.37
400.00	VERTIV HOLDINGS CO.	USD	104,118.89	117,141.60	0.23
500.00	AUTOMATIC DATA PROCESSING, INC.	USD	97,974.27	97,940.17	0.19
500.00	HONEYWELL INTERNATIONAL, INC.	USD	81,109.44	97,918.30	0.19
500.00	HONEYWELL AEROSPACE, INC.	USD	77,555.35	96,685.03	0.19
1,000.00	UNITED PARCEL SERVICE, INC.	USD	87,256.50	94,026.06	0.19
Beni voluttuari			1,650,275.17	2,026,702.35	4.00
1,500.00	TESLA, INC.	USD	402,386.34	551,823.62	1.09
3,000.00	WALMART, INC.	USD	134,744.44	297,192.31	0.59
2,000.00	PROCTER & GAMBLE CO.	USD	213,798.83	256,520.58	0.51
1,000.00	MCDONALD'S CORP.	USD	146,147.05	236,429.61	0.47
200.00	COSTCO WHOLESALE CORP.	USD	183,099.78	163,643.83	0.32
500.00	HOME DEPOT, INC.	USD	164,238.66	154,237.72	0.30
1,500.00	COLGATE-PALMOLIVE CO.	USD	111,972.13	120,283.38	0.24
1,000.00	TARGET CORP.	USD	132,453.73	114,239.47	0.22
500.00	LOWE'S COS., INC.	USD	106,106.84	96,427.00	0.19
1,000.00	NIKE, INC.	USD	55,327.37	35,904.83	0.07
Energia			746,136.15	973,077.85	1.92
4,500.00	EXXON MOBIL CORP.	USD	354,634.35	538,126.43	1.06
3,000.00	CHEVRON CORP.	USD	391,501.80	434,951.42	0.86
Servizi di pubblica utilità			777,260.58	854,025.55	1.69
1,250.00	CONSTELLATION ENERGY CORP.	USD	298,143.53	271,549.44	0.54
2,000.00	DUKE ENERGY CORP.	USD	164,870.08	221,429.18	0.44
2,000.00	SEMPRA	USD	141,822.30	162,179.64	0.32
1,500.00	NEXTERA ENERGY, INC.	USD	97,115.84	115,153.49	0.23
1,000.00	SOUTHERN CO.	USD	75,308.83	83,713.80	0.16
Beni di prima necessità			483,954.49	525,994.89	1.04
2,000.00	PEPSICO, INC.	USD	264,304.86	236,858.20	0.47
3,000.00	COCA-COLA CO.	USD	132,579.81	213,251.10	0.42
1,500.00	MONDELEZ INTERNATIONAL, INC.	USD	87,069.82	75,885.59	0.15

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

NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
GIAPPONE			2,371,138.97	4,929,807.63	9.74
Informatica			362,966.52	2,237,812.04	4.42
2,400.00	TOKYO ELECTRON LTD.	JPY	190,884.25	1,017,787.35	2.01
5,600.00	ADVANTEST CORP.	JPY	80,438.37	974,647.63	1.93
8,900.00	RENESAS ELECTRONICS CORP.	JPY	91,643.90	245,377.06	0.48
Industria			777,180.82	1,336,861.95	2.64
4,000.00	SCREEN HOLDINGS CO. LTD.	JPY	42,259.33	419,557.43	0.83
15,000.00	HITACHI LTD.	JPY	161,048.57	362,941.93	0.72
8,400.00	OMRON CORP.	JPY	377,312.81	271,328.16	0.53
6,000.00	KOMATSU LTD.	JPY	132,891.51	202,104.41	0.40
200.00	SMC CORP.	JPY	63,668.60	80,930.02	0.16
Beni voluttuari			615,061.99	730,366.83	1.44
20,500.00	SONY GROUP CORP.	JPY	321,589.81	358,555.85	0.71
20,000.00	TOYOTA MOTOR CORP.	JPY	239,808.01	293,248.90	0.58
12,000.00	YAMAHA MOTOR CO. LTD.	JPY	53,664.17	78,562.08	0.15
Salute			444,985.44	439,606.96	0.87
30,200.00	ASTELLAS PHARMA, INC.	JPY	386,336.75	344,476.78	0.68
5,100.00	FUJIFILM HOLDINGS CORP.	JPY	58,648.69	95,130.18	0.19
Materie prime			94,079.29	137,104.22	0.27
3,000.00	NISSAN CHEMICAL CORP.	JPY	94,079.29	137,104.22	0.27
Finanza			76,864.91	48,055.63	0.10
30,000.00	METAPLANET, INC.	JPY	61,279.59	32,290.21	0.07
20,500.00	SONY FINANCIAL GROUP, INC.	JPY	15,585.32	15,765.42	0.03
REGNO UNITO			607,437.92	758,527.57	1.50
Salute			415,593.29	554,233.60	1.10
1,700.00	ASTRAZENECA PLC	GBP	218,563.33	278,266.08	0.55
12,000.00	GSK PLC	GBP	197,029.96	275,967.52	0.55
Energia			191,844.63	204,293.97	0.40
6,000.00	SHELL PLC	GBP	191,844.63	204,293.97	0.40
IRLANDA			749,123.47	731,343.43	1.44
Materie prime			357,378.78	453,896.58	0.90
1,000.00	LINDE PLC	USD	357,378.78	453,896.58	0.90
Salute			114,498.69	102,637.10	0.20
1,500.00	MEDTRONIC PLC	USD	114,498.69	102,637.10	0.20
Industria			88,157.79	93,177.64	0.18
250.00	EATON CORP. PLC	USD	88,157.79	93,177.64	0.18
Informatica			189,088.21	81,632.11	0.16
750.00	ACCENTURE PLC	USD	189,088.21	81,632.11	0.16
JERSEY			174,867.47	238,586.76	0.47
Materie prime			174,867.47	238,586.76	0.47
40,000.00	GLENCORE PLC	GBP	174,867.47	238,586.76	0.47
PAESI BASSI			623,081.89	200,822.17	0.40
Beni voluttuari			623,081.89	200,822.17	0.40
40,000.00	STELLANTIS NV	USD	623,081.89	200,822.17	0.40
SVIZZERA			180,808.08	198,186.37	0.39
Beni di prima necessità			180,808.08	198,186.37	0.39
2,200.00	NESTLE SA	CHF	180,808.08	198,186.37	0.39

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

NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
ALTRI VALORI MOBILIARI			1,819.28	0.00	0.00
Azioni			1,819.28	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
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
QUOTE DI OICR			171,195.44	252,611.27	0.50
Azioni di OICR			171,195.44	252,611.27	0.50
IRLANDA			171,195.44	252,611.27	0.50
Finanza			171,195.44	252,611.27	0.50
21,300.00	ISHARES PLC - ISHARES CORE FTSE 100 UCITS ETF GBP - (0.070%)	GBP	171,195.44	252,611.27	0.50
Totale del Portafoglio Titoli			26,762,068.46	46,418,051.00	91.72

* Inadempiente / delistata

NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)**IMPEGNI SU ACQUISTO / VENDITA DI CONTRATTI FUTURES AL 30 GIUGNO 2026**

Valore nominale	Quantità	Acquisto / Vendita	Contratto	Scadenza	Valore di mercato al 30 Giugno 2026	Valuta	Plus/(minus) valenza non realizzata (EUR)	Impegno (EUR)
							-86,996.25	18,973,613.21
10	15	Acquisto	FTSE 100 INDEX	18/09/2026	12,237.55	GBP	43,922.39	1,835,633.24
125,000	35	Acquisto	EUR/JPY CURRENCY	14/09/2026	1.00	JPY	12,721.00	4,359,817.11
125,000	12	Acquisto	EUR/GBP CURRENCY	14/09/2026	1.01	GBP	-3,918.01	1,505,039.90
125,000	90	Acquisto	EURO FX CURRENCY	14/09/2026	1.00	USD	-139,721.63	11,273,122.96

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)

CONTRATTI FINANZIARI A TERMINE AL 30 GIUGNO 2026

Scadenza	Ammontare comprato	Valuta comprata	Ammontare venduto	Valuta venduta	Plus/(minus)-valenza non realizzata (EUR)
					-349,405.50
14/09/2026	30,169,734.93	EUR	35,000,000.00	USD	-349,405.50

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Attività	Note	
Portafoglio Titoli al valore di mercato	(2a)	7,801,028.22
Liquidità bancarie a vista		121,656.72
Importi dovuti dai broker		82,828.76
Interessi da ricevere		42,746.46
Altre attività		2,792.99
Totale attività		8,051,053.15

Passività	
Da pagare su rimborsi	-31,117.81
Altre passività	-30,122.90
Totale passività	-61,240.71

Totale attivo netto	7,989,812.44
----------------------------	---------------------

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	136.50	548.280
Azione D	EUR	85.93	276.444
Azione I	EUR	143.69	53,969.188
Azione L	EUR	140.64	970.000

NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term

PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Attivo netto all'inizio del periodo	Note	8,590,615.75
Risultato netto degli investimenti	(2h)	103,763.10
Totale ricavi		103,763.10
Commissioni di consulenza/gestione	(5)	-12,699.85
Commissione di consulenza	(6)	-8,358.09
Commissioni della Banca Depositaria	(8)	-2,318.43
Tassa di registrazione	(3)	-479.46
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(8)	-12,943.63
Commissioni del Transfer Agent		-1,220.02
Compensi professionali	(9)	-6,528.00
Pubblicazioni		-200.34
Altre spese e tasse	(4)	-8,612.63
Totale costi		-53,360.45
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		50,402.65
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita - di titoli	(2b)	-4,235.82
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata - sugli investimenti		-15,187.73
Risultato netto delle operazioni per il periodo		30,979.10
Distribuzioni di dividendi	(14)	-671.30
Sottoscrizioni del periodo		224,482.93
Rimborsi del periodo		-855,594.04
Attivo netto alla fine del periodo		7,989,812.44

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

NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			7,720,249.50	7,801,028.22	97.64
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			7,720,249.50	7,801,028.22	97.64
Obbligazioni ordinarie			6,034,362.01	6,105,997.02	76.42
ITALIA			2,216,713.15	2,215,734.67	27.73
Enti Governativi			1,966,962.27	1,965,210.67	24.60
575,101.50	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 1.85% 04/06/2032	EUR	579,816.69	584,648.18	7.32
330,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.85% 15/12/2029	EUR	346,107.21	340,824.00	4.26
300,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 2.80% 15/06/2029	EUR	299,639.93	300,270.00	3.76
254,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.45% 01/02/2036	EUR	254,914.57	251,739.40	3.15
250,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 2.65% 15/06/2028	EUR	251,762.84	249,850.00	3.13
239,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 1.25% 01/12/2026	EUR	234,721.03	237,879.09	2.98
Industria			149,750.88	148,041.00	1.85
150,000.00	POSTE ITALIANE SPA 3.00% 03/12/2030	EUR	149,750.88	148,041.00	1.85
Servizi di pubblica utilità			100,000.00	102,483.00	1.28
100,000.00	ALPERIA SPA 4.75% 05/06/2029	EUR	100,000.00	102,483.00	1.28
FRANCIA			1,656,029.63	1,663,925.00	20.82
Enti Governativi			1,656,029.63	1,663,925.00	20.82
817,000.00	FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BONDS OAT 0.75% 25/02/2028	EUR	788,723.25	791,999.80	9.91
480,000.00	FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BONDS OAT 2.75% 25/10/2027	EUR	487,514.21	480,691.20	6.02
200,000.00	FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BONDS OAT 2.50% 25/05/2030	EUR	196,983.08	197,490.00	2.47
200,000.00	CAISSE FRANCAISE DE FINANCEMENT LOCAL 1.13% 12/06/2028	EUR	182,809.09	193,744.00	2.42
GERMANIA			1,619,860.41	1,661,237.44	20.79
Enti Governativi			1,619,860.41	1,661,237.44	20.79
584,000.00	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 0.50% 15/02/2028	EUR	547,472.29	565,738.32	7.08
450,000.00	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 0.25% 15/02/2027	EUR	417,967.80	444,024.00	5.56
382,000.00	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 0.00% 15/08/2029	EUR	357,505.27	353,602.12	4.42
300,000.00	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 2.10% 15/03/2028	EUR	296,915.05	297,873.00	3.73
SPAGNA			328,170.61	343,234.65	4.30
Enti Governativi			328,170.61	343,234.65	4.30
363,000.00	SPAIN GOVERNMENT BONDS 0.80% 30/07/2029	EUR	328,170.61	343,234.65	4.30
PORTOGALLO			213,588.21	221,865.26	2.78
Enti Governativi			213,588.21	221,865.26	2.78
227,000.00	PORTUGAL OBRIGACOES DO TESOURO OT 0.70% 15/10/2027	EUR	213,588.21	221,865.26	2.78
Obbligazioni a tasso variabile			1,165,940.57	1,168,096.40	14.62
ITALIA			961,108.67	958,961.40	12.00
Finanza			762,837.39	761,929.40	9.54
324,000.00	CASSA DEPOSITI E PRESTITI SPA FRN 04/12/2029	EUR	332,154.58	329,508.00	4.12
220,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 31/12/2099	EUR	225,827.90	228,177.40	2.86
100,000.00	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA FRN 07/02/2029	EUR	104,875.93	102,169.00	1.28
100,000.00	FINECOBANK BANCA FINECO SPA FRN 23/02/2029	EUR	99,978.98	102,075.00	1.28
Servizi di pubblica utilità			198,271.28	197,032.00	2.46
200,000.00	ENEL SPA FRN 31/12/2099	EUR	198,271.28	197,032.00	2.46

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

NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
FRANCIA			204,831.90	209,135.00	2.62
Finanza			204,831.90	209,135.00	2.62
100,000.00	CREDIT AGRICOLE SA FRN 31/12/2099	EUR	104,791.90	105,789.00	1.33
100,000.00	SOCIETE GENERALE SA FRN 31/12/2099	EUR	100,040.00	103,346.00	1.29
Obbligazioni zero coupon			519,946.92	526,934.80	6.60
GERMANIA			327,719.69	334,088.80	4.18
Enti Governativi			327,719.69	334,088.80	4.18
335,000.00	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 0.00% 15/08/2026	EUR	327,719.69	334,088.80	4.18
FRANCIA			192,227.23	192,846.00	2.42
Finanza			192,227.23	192,846.00	2.42
200,000.00	AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT EPIC 0.00% 28/10/2027	EUR	192,227.23	192,846.00	2.42
Totale del Portafoglio Titoli			7,720,249.50	7,801,028.22	97.64

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 2026 IN EUR

Attività		Note	
Portafoglio Titoli al valore di mercato		(2a)	102,248,079.78
Liquidità bancarie a vista			1,214,368.49
Importi dovuti dai broker			3,321,052.01
Premio pagato su contratti swap		(2f)	19,517.07
Utili non realizzati su contratti di cambio a termine		(2c, 13)	153,203.31
Utili non realizzati su contratti futures		(2d, 13)	96,200.00
Interessi da ricevere			1,266,947.88
Da ricevere su sottoscrizioni			105,152.12
Altre attività			7,896.97
Totale attività			108,432,417.63
Passività			
Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine		(2c, 13)	-500,903.35
Perdite non realizzate su contratti futures		(2d, 13)	-35,310.00
Perdite non realizzate su contratti swap		(2f, 13)	-95,640.58
Interessi da pagare su contratti swap			-1,500.00
Da pagare su rimborsi			-127,620.89
Altre passività			-399,068.73
Totale passività			-1,160,043.55
Totale attivo netto			107,272,374.08
	Valuta	Valore Netto d’Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	167.89	297,092.229
Azione A (H-USD)	USD	119.53	33,715.140
Azione D	EUR	86.51	266,215.592
Azione I	EUR	180.53	169,938.994
Azione L	EUR	177.15	911.000

NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond**PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR**

Attivo netto all'inizio del periodo	Note	119,731,682.78
Risultato netto degli investimenti	(2h)	2,352,036.81
Altri ricavi		908.65
Totale ricavi		2,352,945.46
Commissioni di consulenza/gestione	(5)	-595,886.41
Commissione di consulenza	(6)	-9,716.30
Commissioni sulla performance	(7)	-45,559.38
Commissioni della Banca Depositaria	(8)	-31,549.21
Tassa di registrazione	(3)	-21,134.95
Interessi pagati su contratti swap		-30,166.67
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(8)	-38,919.24
Commissioni del Transfer Agent		-9,947.10
Compensi professionali	(9)	-7,251.01
Pubblicazioni		-2,741.69
Altre spese e tasse	(4)	-26,539.88
Totale costi		-819,411.84
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		1,533,533.62
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(2b)	651,679.79
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		-1,174,361.49
- di contratti futures		-375,329.70
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		209,766.73
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(2c)	-153,754.46
- su contratti futures	(2d)	60,890.00
- su contratti swap		-28,366.86
Risultato netto delle operazioni per il periodo		724,057.63
Distribuzioni di dividendi	(14)	-664,089.83
Sottoscrizioni del periodo		14,758,714.33
Rimborsi del periodo		-27,277,990.83
Attivo netto alla fine del periodo		107,272,374.08

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

NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			100,770,633.38	102,248,079.78	95.32
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			97,230,045.92	98,617,755.56	91.93
Obbligazioni ordinarie			67,406,343.22	68,240,418.31	63.61
ITALIA			46,961,893.75	47,734,667.37	44.50
Enti Governativi			41,318,048.16	41,719,852.14	38.89
9,000,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.70% 15/06/2030	EUR	9,262,194.54	9,268,200.00	8.64
7,500,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 4.75% 01/09/2028	EUR	7,941,475.00	7,824,000.00	7.29
8,000,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 0.90% 01/04/2031	EUR	6,762,909.09	7,274,400.00	6.78
5,114,450.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 2.00% 14/03/2028	EUR	5,242,993.33	5,172,243.29	4.82
5,005,350.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 1.60% 28/06/2030	EUR	5,060,319.20	5,060,408.85	4.72
4,000,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.65% 01/08/2035	EUR	3,979,750.00	4,044,800.00	3.77
2,000,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.85% 01/07/2034	EUR	2,057,760.00	2,063,200.00	1.92
1,000,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.40% 01/04/2028	EUR	1,010,647.00	1,012,600.00	0.95
Finanza			5,143,825.59	5,518,590.23	5.15
2,000,000.00	INTESA SANPAOLO SPA 6.63% 31/05/2033	GBP	2,272,850.28	2,499,054.65	2.33
1,500,000.00	INTESA SANPAOLO SPA 7.20% 28/11/2033	USD	1,406,178.31	1,478,850.58	1.38
500,000.00	INTESA SANPAOLO SPA 5.13% 29/08/2031	EUR	496,415.00	541,145.00	0.51
500,000.00	UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA 4.90% 23/05/2034	EUR	499,265.00	526,800.00	0.49
500,000.00	INTESA SANPAOLO VITA SPA 2.38% 22/12/2030	EUR	469,117.00	472,740.00	0.44
Industria			500,020.00	496,225.00	0.46
500,000.00	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA 3.75% 01/04/2030	EUR	500,020.00	496,225.00	0.46
STATI UNITI			7,314,075.80	7,407,304.00	6.91
Enti Governativi			4,235,422.58	4,248,506.37	3.96
4,845,960.00	U.S. TREASURY INFLATION-INDEXED NOTES 2.13% 15/04/2029	USD	4,235,422.58	4,248,506.37	3.96
Sovranazionale			1,923,911.74	1,974,616.98	1.84
12,000,000.00	INTERNATIONAL FINANCE CORP. 11.50% 16/01/2030	BRL	1,923,911.74	1,974,616.98	1.84
Beni voluttuari			1,154,741.48	1,184,180.65	1.11
1,000,000.00	FORD MOTOR CREDIT CO. LLC 6.18% 29/08/2031	GBP	1,154,741.48	1,184,180.65	1.11
SPAGNA			4,982,750.00	4,998,750.00	4.66
Enti Governativi			4,982,750.00	4,998,750.00	4.66
5,000,000.00	SPAIN GOVERNMENT BONDS 2.70% 31/01/2030	EUR	4,982,750.00	4,998,750.00	4.66
FRANCIA			4,961,640.00	4,946,750.00	4.61
Enti Governativi			4,961,640.00	4,946,750.00	4.61
5,000,000.00	FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BONDS OAT 2.70% 25/02/2031	EUR	4,961,640.00	4,946,750.00	4.61
MESSICO			1,169,383.67	1,170,936.94	1.09
Enti Governativi			998,570.00	993,400.00	0.93
1,000,000.00	MEXICO GOVERNMENT INTERNATIONAL BONDS 3.50% 19/09/2029	EUR	998,570.00	993,400.00	0.93
Servizi di pubblica utilità			170,813.67	177,536.94	0.16
200,000.00	COX ASSET MEXICO SA DE CV 7.13% 08/01/2032	USD	170,813.67	177,536.94	0.16
ROMANIA			1,028,500.00	1,035,110.00	0.96
Enti Governativi			1,028,500.00	1,035,110.00	0.96
1,000,000.00	ROMANIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BONDS 5.38% 22/03/2031	EUR	1,028,500.00	1,035,110.00	0.96
PAESI BASSI			988,100.00	946,900.00	0.88
Beni voluttuari			988,100.00	946,900.00	0.88
1,000,000.00	STELLANTIS NV 4.00% 19/03/2034	EUR	988,100.00	946,900.00	0.88

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

NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Obbligazioni a tasso variabile			28,099,592.31	28,716,204.85	26.77
FRANCIA			8,767,230.00	8,871,156.00	8.27
Finanza			5,960,230.00	6,014,745.00	5.61
2,000,000.00	LA BANQUE POSTALE SA FRN 01/04/2031	EUR	1,989,900.00	2,000,900.00	1.87
1,000,000.00	BNP PARIBAS SA FRN 31/12/2099	EUR	1,079,500.00	1,095,230.00	1.02
1,000,000.00	CREDIT AGRICOLE ASSURANCES SA FRN 31/12/2099	EUR	1,056,700.00	1,040,630.00	0.97
1,000,000.00	AXA SA FRN 31/12/2099	EUR	1,034,130.00	1,035,370.00	0.97
500,000.00	AXA SA FRN 31/12/2099	EUR	500,000.00	537,845.00	0.50
300,000.00	BNP PARIBAS CARDIF SA FRN 27/05/2041	EUR	300,000.00	304,770.00	0.28
Enti Governativi			1,300,000.00	1,322,906.00	1.23
1,300,000.00	CREDIT AGRICOLE ASSURANCES SA FRN 31/12/2099	EUR	1,300,000.00	1,322,906.00	1.23
Industria			1,007,000.00	1,029,320.00	0.96
1,000,000.00	LA POSTE SA FRN 31/12/2099	EUR	1,007,000.00	1,029,320.00	0.96
Servizi di pubblica utilità			500,000.00	504,185.00	0.47
500,000.00	ENGIE SA FRN 31/12/2099	EUR	500,000.00	504,185.00	0.47
PAESI BASSI			3,666,800.00	3,845,290.00	3.59
Finanza			1,976,800.00	1,992,060.00	1.86
1,000,000.00	ACHMEA BV FRN 31/12/2099	EUR	991,000.00	997,860.00	0.93
1,000,000.00	ING GROEP NV FRN 20/08/2037	EUR	985,800.00	994,200.00	0.93
Beni voluttuari			1,690,000.00	1,853,230.00	1.73
800,000.00	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN 31/12/2099	EUR	690,000.00	774,680.00	0.72
500,000.00	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN 31/12/2099	EUR	500,000.00	568,860.00	0.53
500,000.00	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN 31/12/2099	EUR	500,000.00	509,690.00	0.48
GERMANIA			3,016,160.24	3,199,522.11	2.98
Finanza			3,016,160.24	3,199,522.11	2.98
2,000,000.00	ALLIANZ SE FRN 31/12/2099	EUR	1,716,140.00	1,826,320.00	1.70
1,000,000.00	ALLIANZ SE FRN 31/12/2099	USD	823,020.24	838,896.11	0.78
600,000.00	ALLIANZ SE FRN 31/12/2099	EUR	477,000.00	534,306.00	0.50
REGNO UNITO			3,017,358.17	2,999,730.44	2.80
Finanza			2,415,815.80	2,393,297.28	2.23
1,000,000.00	LLOYDS BANKING GROUP PLC FRN 31/12/2099	GBP	1,207,373.65	1,197,159.43	1.12
1,000,000.00	NATWEST GROUP PLC FRN 31/12/2099	GBP	1,208,442.15	1,196,137.85	1.11
Enti Governativi			601,542.37	606,433.16	0.57
500,000.00	NATIONWIDE BUILDING SOCIETY FRN 31/12/2099	GBP	601,542.37	606,433.16	0.57
ITALIA			1,950,800.00	2,089,240.00	1.95
Servizi di pubblica utilità			1,055,800.00	1,103,160.00	1.03
1,000,000.00	ENEL SPA FRN 31/12/2099	EUR	1,055,800.00	1,103,160.00	1.03
Energia			895,000.00	986,080.00	0.92
1,000,000.00	ENI SPA FRN 31/12/2099	EUR	895,000.00	986,080.00	0.92
STATI UNITI			2,000,000.00	1,974,780.00	1.84
Servizi di pubblica utilità			2,000,000.00	1,974,780.00	1.84
2,000,000.00	NEXTERA ENERGY CAPITAL HOLDINGS, INC. FRN 26/02/2056	EUR	2,000,000.00	1,974,780.00	1.84
IRLANDA			1,337,125.00	1,354,639.00	1.26
Finanza			1,337,125.00	1,354,639.00	1.26
1,300,000.00	BANK OF IRELAND GROUP PLC FRN 31/12/2099	EUR	1,337,125.00	1,354,639.00	1.26

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

NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
NORVEGIA			1,272,151.07	1,288,808.61	1.20
Finanza			1,272,151.07	1,288,808.61	1.20
1,500,000.00	DNB BANK ASA FRN 04/11/2031	USD	1,272,151.07	1,288,808.61	1.20
SPAGNA			1,085,500.00	1,077,320.00	1.00
Finanza			1,085,500.00	1,077,320.00	1.00
1,000,000.00	BANCO SANTANDER SA FRN 31/12/2099	EUR	1,085,500.00	1,077,320.00	1.00
LUSSEMBURGO			1,024,000.00	1,028,420.00	0.96
Finanza			1,024,000.00	1,028,420.00	0.96
1,000,000.00	BANQUE INTERNATIONALE A LUXEMBOURG SA FRN 01/05/2033	EUR	1,024,000.00	1,028,420.00	0.96
BERMUDA			962,467.83	987,298.69	0.92
Finanza			962,467.83	987,298.69	0.92
3,000,000.00	AEGON LTD. FRN 29/03/2049	NLG	962,467.83	987,298.69	0.92
Obbligazioni zero coupon			724,110.39	629,972.46	0.59
STATI UNITI			225,460.05	256,426.70	0.24
Sovranazionale			225,460.05	256,426.70	0.24
30,000,000.00	INTERNATIONAL FINANCE CORP. 0.00% 24/01/2050	ZAR	225,460.05	256,426.70	0.24
FILIPPINE			320,454.18	206,599.95	0.19
Sovranazionale			320,454.18	206,599.95	0.19
20,000,000.00	ASIAN DEVELOPMENT BANK 0.00% 20/04/2043	MXN	320,454.18	206,599.95	0.19
COSTA D'AVORIO			178,196.16	166,945.81	0.16
Sovranazionale			178,196.16	166,945.81	0.16
40,000,000.00	AFRICAN DEVELOPMENT BANK 0.00% 03/02/2053	MXN	178,196.16	166,945.81	0.16
Azioni di OICR			1,000,000.00	1,031,159.94	0.96
LUSSEMBURGO			1,000,000.00	1,031,159.94	0.96
Finanza			1,000,000.00	1,031,159.94	0.96
180,115.27	AZ FUND 1 - AZ BOND - EURO CORPORATE -A-INSTITUTIONAL- EUR - (0.800%)	EUR	1,000,000.00	1,031,159.94	0.96
NEGOZIATI SU UN ALTRO MERCATO REGOLAMENTATO			3,540,587.46	3,630,324.22	3.39
Obbligazioni ordinarie			923,220.10	937,680.33	0.88
FRANCIA			923,220.10	937,680.33	0.88
Servizi di pubblica utilità			923,220.10	937,680.33	0.88
1,000,000.00	ELECTRICITE DE FRANCE SA 6.25% 23/05/2033	USD	923,220.10	937,680.33	0.88
Obbligazioni a tasso variabile			2,617,367.36	2,692,643.89	2.51
ITALIA			2,617,367.36	2,692,643.89	2.51
Finanza			2,617,367.36	2,692,643.89	2.51
2,000,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 01/06/2032	USD	1,584,297.25	1,654,386.30	1.54
1,000,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 20/06/2054	USD	1,033,070.11	1,038,257.59	0.97
Totale del Portafoglio Titoli			100,770,633.38	102,248,079.78	95.32

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 2026**

Valore nominale	Quantità	Acquisto / Vendita	Contratto	Scadenza	Valore di mercato al 30 Giugno 2026	Valuta	Plus/(minus) valenza non realizzata (EUR)	Impegno (EUR)
							60,890.00	26,442,000.00
100,000	130	Acquisto	EURO-BOBL	08/09/2026	115.38	EUR	93,600.00	14,999,400.00
100,000	10	Acquisto	EURO-SCHATZ	08/09/2026	105.96	EUR	2,600.00	1,059,600.00
			BLOOMBERG EURO CORPORATE SCREENED INDEX					
1,000	-60	Vendita		18/09/2026	173.05	EUR	-35,310.00	10,383,000.00

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond**CONTRATTI FINANZIARI A TERMINE AL 30 GIUGNO 2026**

Scadenza	Ammontare comprato	Valuta comprata	Ammontare venduto	Valuta venduta	Plus/(minus)-valenza non realizzata (EUR)
					-347,700.04
22/07/2026	428,242.05	EUR	500,000.00	USD	-8,734.45
22/07/2026	510,451.49	EUR	600,000.00	USD	-13,920.31
22/07/2026	6,057,835.18	EUR	5,300,000.00	GBP	-89,821.13
22/07/2026	12,109,100.45	EUR	14,300,000.00	USD	-388,427.46
22/07/2026	5,070,000.00	USD	4,293,226.52	EUR	137,715.20
22/07/2026	1,000,000.00	USD	858,464.89	EUR	15,488.11

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond

CONTRATTI SWAP AL 30 GIUGNO 2026

Sottostante	Valuta	Posizione	Nominale	Controparte	Scadenza	Interessi da ricevere / pagare (EUR)	Plus/(minus) -valenza non realizzata(EUR)
CONTRATTI CREDIT DEFAULT SWAP						-1,500.00	-95,640.58
ITRAXX EUROPE SUB FINANCIALS SERIES 43 VERSION 1	EUR	Long	6,000,000.00	J.P. MORGAN SE	06/20/2030	-1,500.00	-95,640.58

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Attività	Note	
Portafoglio Titoli al valore di mercato	(2a)	56,779,944.30
Liquidità bancarie a vista		1,954,143.36
Importi dovuti dai broker		356,596.16
Interessi da ricevere		697,118.39
Da ricevere su sottoscrizioni		147.90
Altre attività		4,828.63
Totale attività		59,792,778.74

Passività	
Da pagare su rimborsi	-188,518.29
Altre passività	-107,194.84
Totale passività	-295,713.13

Totale attivo netto **59,497,065.61**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	139.11	10,655.657
Azione D	EUR	102.25	496.107
Azione I	EUR	150.98	376,609.954
Azione L	EUR	147.96	7,427.000
Azione Y	EUR	132.46	21.180

NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate

PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Attivo netto all'inizio del periodo	Note	59,502,430.62
Risultato netto degli investimenti	(2h)	929,182.66
Altri ricavi		64.38
Totale ricavi		929,247.04
Commissioni di consulenza/gestione	(5)	-139,773.60
Commissione di consulenza	(6)	-9,048.60
Commissioni della Banca Depositaria	(8)	-16,764.67
Tassa di registrazione	(3)	-3,586.18
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(8)	-18,317.82
Commissioni del Transfer Agent		-1,917.47
Compensi professionali	(9)	-7,531.11
Pubblicazioni		-1,402.84
Altre spese e tasse	(4)	-17,071.99
Totale costi		-215,414.28
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		713,832.76
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(2b)	187,959.20
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		-531,522.67
Risultato netto delle operazioni per il periodo		370,269.29
Distribuzioni di dividendi	(14)	-1,465.77
Sottoscrizioni del periodo		5,997,454.97
Rimborsi del periodo		-6,371,623.50
Attivo netto alla fine del periodo		59,497,065.61

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

NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			56,597,853.80	56,779,944.30	95.43
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			56,115,870.83	56,779,944.30	95.43
Obbligazioni ordinarie			32,458,730.33	33,151,534.50	55.72
ITALIA			8,863,305.19	9,235,688.00	15.52
Industria			3,353,014.67	3,427,966.00	5.76
1,400,000.00	AEROPORTI DI ROMA SPA 1.75% 30/07/2031	EUR	1,244,076.43	1,286,166.00	2.16
1,000,000.00	AUTOSTRADe PER L'ITALIA SPA 5.13% 14/06/2033	EUR	1,074,959.81	1,077,740.00	1.81
1,000,000.00	FERROVIE DELLO STATO ITALIANE SPA 4.50% 23/05/2033	EUR	1,033,978.43	1,064,060.00	1.79
Finanza			1,913,954.27	2,040,482.00	3.43
1,150,000.00	INTESA SANPAOLO VITA SPA 2.38% 22/12/2030	EUR	1,084,342.56	1,087,302.00	1.83
1,000,000.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA 2.43% 14/07/2031	EUR	829,611.71	953,180.00	1.60
Servizi di pubblica utilità			1,118,725.32	1,176,832.00	1.98
700,000.00	SNAM SPA 0.75% 20/06/2029	EUR	610,227.00	654,122.00	1.10
500,000.00	A2A SPA 4.50% 19/09/2030	EUR	508,498.32	522,710.00	0.88
Beni voluttuari			1,070,984.22	1,159,428.00	1.95
1,200,000.00	NEXI SPA 2.13% 30/04/2029	EUR	1,070,984.22	1,159,428.00	1.95
Enti Governativi			909,102.78	927,300.00	1.56
1,000,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 1.65% 01/03/2032	EUR	909,102.78	927,300.00	1.56
Energia			497,523.93	503,680.00	0.84
500,000.00	ENI SPA 3.50% 26/05/2031	EUR	497,523.93	503,680.00	0.84
FRANCIA			7,508,295.43	7,485,796.50	12.58
Enti Governativi			4,808,388.89	4,796,486.50	8.06
2,400,000.00	FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BONDS OAT 3.00% 25/05/2033	EUR	2,348,000.19	2,364,672.00	3.97
1,300,000.00	FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BONDS OAT 5.75% 25/10/2032	EUR	1,507,328.87	1,491,932.00	2.51
950,000.00	FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BONDS OAT 2.70% 25/02/2031	EUR	953,059.83	939,882.50	1.58
Beni voluttuari			2,038,507.08	2,018,990.00	3.39
1,000,000.00	PSA TRESORERIE GIE 6.00% 19/09/2033	EUR	1,127,951.00	1,100,100.00	1.85
1,000,000.00	AUTOROUTES DU SUD DE LA FRANCE SA 1.38% 21/02/2031	EUR	910,556.08	918,890.00	1.54
Beni di prima necessità			661,399.46	670,320.00	1.13
700,000.00	PERNOD RICARD SA 1.38% 07/04/2029	EUR	661,399.46	670,320.00	1.13
PAESI BASSI			4,733,852.36	4,886,456.00	8.21
Beni voluttuari			1,538,990.93	1,520,010.00	2.56
1,500,000.00	STELLANTIS NV 4.38% 14/03/2030	EUR	1,538,990.93	1,520,010.00	2.56
Materie prime			1,386,248.28	1,507,456.00	2.53
1,600,000.00	AKZO NOBEL NV 1.63% 14/04/2030	EUR	1,386,248.28	1,507,456.00	2.53
Beni di prima necessità			1,359,303.50	1,406,430.00	2.36
1,500,000.00	HEINEKEN NV 1.75% 17/03/2031	EUR	1,359,303.50	1,406,430.00	2.36
Finanza			449,309.65	452,560.00	0.76
500,000.00	EXOR NV 0.88% 19/01/2031	EUR	449,309.65	452,560.00	0.76
STATI UNITI			3,648,219.20	3,737,354.00	6.28
Beni voluttuari			1,905,718.98	1,899,504.00	3.19
1,000,000.00	FORD MOTOR CREDIT CO. LLC 4.45% 16/09/2032	EUR	1,005,376.99	1,009,530.00	1.70
900,000.00	FORD MOTOR CREDIT CO. LLC 3.31% 17/05/2029	EUR	900,341.99	889,974.00	1.49
Industria			886,449.94	920,070.00	1.55
1,000,000.00	3M CO. 1.50% 02/06/2031	EUR	886,449.94	920,070.00	1.55

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

NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Servizi di telecomunicazione			856,050.28	917,780.00	1.54
1,000,000.00	AT&T, INC. 0.80% 04/03/2030	EUR	856,050.28	917,780.00	1.54
GERMANIA			3,609,701.31	3,648,307.00	6.13
Beni voluttuari			1,723,659.19	1,729,052.00	2.91
1,200,000.00	VOLKSWAGEN BANK GMBH 4.00% 26/11/2030	EUR	1,201,380.36	1,210,512.00	2.04
500,000.00	VOLKSWAGEN BANK GMBH 4.63% 03/05/2031	EUR	522,278.83	518,540.00	0.87
Industria			1,375,487.98	1,405,425.00	2.36
1,000,000.00	HOCHTIEF AG 1.25% 03/09/2031	EUR	861,532.48	891,640.00	1.50
500,000.00	MTU AERO ENGINES AG 3.88% 18/09/2031	EUR	513,955.50	513,785.00	0.86
Finanza			510,554.14	513,830.00	0.86
500,000.00	TALANX AG 4.00% 25/10/2029	EUR	510,554.14	513,830.00	0.86
SPAGNA			1,424,749.02	1,452,250.00	2.44
Servizi di pubblica utilità			992,111.69	989,370.00	1.66
1,000,000.00	EDP SERVICIOS FINANCIEROS ESPANA SA 3.25% 04/02/2032	EUR	992,111.69	989,370.00	1.66
Energia			432,637.33	462,880.00	0.78
500,000.00	ACCIONA ENERGIA FINANCIACION FILIALES SA 1.38% 26/01/2032	EUR	432,637.33	462,880.00	0.78
SVEZIA			1,345,147.84	1,379,108.00	2.32
Beni voluttuari			1,345,147.84	1,379,108.00	2.32
900,000.00	ELECTROLUX AB 2.50% 18/05/2030	EUR	827,841.00	863,568.00	1.45
500,000.00	VOLVO CAR AB 4.75% 08/05/2030	EUR	517,306.84	515,540.00	0.87
GIAPPONE			787,294.80	789,240.00	1.33
Beni voluttuari			787,294.80	789,240.00	1.33
800,000.00	NISSAN MOTOR CO. LTD. 3.20% 17/09/2028	EUR	787,294.80	789,240.00	1.33
LUSSEMBURGO			538,165.18	537,335.00	0.91
Industria			538,165.18	537,335.00	0.91
500,000.00	HEIDELBERG MATERIALS FINANCE LUXEMBOURG SA 4.88% 21/11/2033	EUR	538,165.18	537,335.00	0.91
Obbligazioni a tasso variabile			23,657,140.50	23,628,409.80	39.71
ITALIA			15,264,653.25	15,302,318.00	25.72
Finanza			8,255,224.77	8,267,490.00	13.90
1,900,000.00	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA FRN 01/02/2030	EUR	1,964,342.42	1,949,761.00	3.28
1,300,000.00	FINECOBANK BANCA FINECO SPA FRN 23/02/2029	EUR	1,347,403.75	1,326,975.00	2.23
1,100,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 31/12/2099	EUR	1,139,945.80	1,140,887.00	1.92
1,100,000.00	UNICREDIT SPA FRN 31/12/2099	EUR	1,095,135.88	1,104,323.00	1.86
1,000,000.00	BANCA POPOLARE DI SONDRIO SPA FRN 04/06/2030	EUR	1,010,277.94	1,024,740.00	1.72
800,000.00	CREDITO EMILIANO SPA FRN 03/06/2032	EUR	797,758.98	800,176.00	1.34
500,000.00	BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA FRN 15/03/2029	EUR	500,200.00	512,760.00	0.86
400,000.00	UNIPOL ASSICURAZIONI SPA FRN 31/12/2099	EUR	400,160.00	407,868.00	0.69
Enti Governativi			5,304,306.71	5,330,160.00	8.96
3,600,000.00	ITALY CERTIFICATI DI CREDITO DEL TESORO/CCTS-EU FRN 15/04/2034	EUR	3,700,900.07	3,701,520.00	6.22
1,600,000.00	ITALY CERTIFICATI DI CREDITO DEL TESORO FRN 15/10/2030	EUR	1,603,406.64	1,628,640.00	2.74
Beni di prima necessità			1,004,077.47	1,006,905.00	1.69
500,000.00	SAMMONTANA ITALIA SPA FRN 15/10/2031	EUR	502,576.95	503,655.00	0.85
500,000.00	LA DORIA SPA FRN 30/12/2030	EUR	501,500.52	503,250.00	0.84
Servizi di pubblica utilità			396,542.55	394,064.00	0.66
400,000.00	ENEL SPA FRN 31/12/2099	EUR	396,542.55	394,064.00	0.66

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

NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Industria			304,501.75	303,699.00	0.51
300,000.00	IMA INDUSTRIA MACCHINE AUTOMATICHE SPA FRN 15/04/2029	EUR	304,501.75	303,699.00	0.51
FRANCIA			4,754,466.03	4,731,220.00	7.95
Finanza			3,250,489.68	3,219,910.00	5.41
1,500,000.00	CREDIT AGRICOLE SA FRN 31/12/2099	EUR	1,600,279.86	1,586,835.00	2.67
1,000,000.00	BNP PARIBAS SA FRN 31/12/2099	EUR	1,107,943.00	1,095,230.00	1.84
500,000.00	AXA SA FRN 31/12/2099	EUR	542,266.82	537,845.00	0.90
Beni voluttuari			1,503,976.35	1,511,310.00	2.54
1,500,000.00	RCI BANQUE SA FRN 05/03/2029	EUR	1,503,976.35	1,511,310.00	2.54
PAESI BASSI			1,203,859.35	1,172,985.00	1.97
Beni voluttuari			1,203,859.35	1,172,985.00	1.97
1,100,000.00	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN 31/12/2099	EUR	1,203,859.35	1,172,985.00	1.97
SPAGNA			997,748.94	998,570.00	1.68
Finanza			997,748.94	998,570.00	1.68
1,000,000.00	UNICAJA BANCO SA FRN 26/06/2033	EUR	997,748.94	998,570.00	1.68
STATI UNITI			929,960.43	918,966.80	1.54
Finanza			929,960.43	918,966.80	1.54
929,000.00	JPMORGAN CHASE & CO. FRN 18/02/2032	EUR	929,960.43	918,966.80	1.54
REGNO UNITO			506,452.50	504,350.00	0.85
Finanza			506,452.50	504,350.00	0.85
500,000.00	BARCLAYS PLC FRN 31/12/2099	EUR	506,452.50	504,350.00	0.85
ALTRI VALORI MOBILIARI			481,982.97	0.00	0.00
Obbligazioni ordinarie			481,982.97	0.00	0.00
ITALIA			481,982.97	0.00	0.00
Energia			481,982.97	0.00	0.00
507,600.00	ENERTRONICA SANTERNO SPA 7.00% 31/12/2022*	EUR	481,982.97	0.00	0.00
Totale del Portafoglio Titoli			56,597,853.80	56,779,944.30	95.43

* Strumenti finanziari prezzati al fair value

NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative**PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR**

Attività		Note	
Portafoglio Titoli al valore di mercato		(2a)	27,964,292.60
Liquidità bancarie a vista			802,383.28
Importi dovuti dai broker			280,566.24
Dividendi da ricevere			728.60
Interessi da ricevere			200,714.75
Da ricevere su vendita titoli			174,269.04
Da ricevere su sottoscrizioni			172.26
Altre attività			3,432.31
Totale attività			29,426,559.08
Passività			
Da pagare su rimborsi			-4,984.96
Altre passività			-99,638.74
Totale passività			-104,623.70
Totale attivo netto			29,321,935.38
	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	158.29	114,064.001
Azione I	EUR	175.87	32,396.881
Azione L	EUR	172.60	32,267.000

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

NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative**PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR**

Attivo netto all'inizio del periodo	Note	34,975,922.14
Risultato netto degli investimenti	(2h)	223,079.48
Altri ricavi		81.16
Totale ricavi		223,160.64
Commissioni di consulenza/gestione	(5)	-144,027.79
Commissione di consulenza	(6)	-8,681.26
Commissioni della Banca Depositaria	(8)	-8,968.51
Tassa di registrazione	(3)	-5,341.31
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(8)	-18,687.85
Commissioni del Transfer Agent		-1,164.51
Compensi professionali	(9)	-6,691.96
Pubblicazioni		-787.01
Altre spese e tasse	(4)	-12,649.70
Totale costi		-206,999.90
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		16,160.74
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(2b)	165,019.57
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		2,313.11
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		440,136.54
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(2c)	1,467.17
Risultato netto delle operazioni per il periodo		625,097.13
Sottoscrizioni del periodo		164,545.42
Rimborsi del periodo		-6,443,629.31
Attivo netto alla fine del periodo		29,321,935.38

NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			26,313,889.00	27,964,292.60	95.37
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			20,176,206.53	20,605,575.14	70.27
Azioni			213,705.01	231,716.14	0.79
ITALIA			102,560.52	119,909.10	0.41
Finanza			67,836.60	76,900.00	0.26
25,000.00	BFF BANK SPA	EUR	67,836.60	76,900.00	0.26
Beni voluttuari			33,905.74	36,079.10	0.12
5,000.00	ESPRINET SPA	EUR	33,414.83	33,575.00	0.11
150.00	POWERSOFT SPA	EUR	490.91	2,475.00	0.01
100.00	SOSTRAVEL.COM SPA	EUR	0.00	29.10	0.00
Industria			818.18	6,930.00	0.03
150.00	OFFICINA STELLARE SPA	EUR	818.18	6,930.00	0.03
STATI UNITI			111,144.49	111,807.04	0.38
Informatica			111,144.49	111,807.04	0.38
1,300.00	PAYCHEX, INC.	USD	111,144.49	111,807.04	0.38
Obbligazioni ordinarie			19,662,006.37	20,071,787.50	68.45
ITALIA			7,135,029.56	7,439,158.00	25.37
Enti Governativi			3,449,514.07	3,592,373.00	12.25
1,600,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 1.65% 01/03/2032	EUR	1,358,302.91	1,483,680.00	5.06
1,300,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 0.95% 01/12/2031	EUR	1,156,984.35	1,165,593.00	3.97
1,000,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 0.45% 15/02/2029	EUR	934,226.81	943,100.00	3.22
Finanza			1,523,396.62	1,608,242.00	5.48
500,000.00	UNIPOL GRUPPO SPA 3.25% 23/09/2030	EUR	486,489.52	506,470.00	1.73
500,000.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA 2.12% 01/10/2030	EUR	415,791.25	477,290.00	1.63
400,000.00	ANIMA HOLDING SPA 1.50% 22/04/2028	EUR	385,274.05	388,112.00	1.32
250,000.00	INTESA SANPAOLO VITA SPA 2.38% 22/12/2030	EUR	235,841.80	236,370.00	0.80
Servizi di pubblica utilità			834,826.80	885,398.00	3.02
500,000.00	SNAM SPA 0.75% 20/06/2029	EUR	420,333.07	467,230.00	1.59
400,000.00	A2A SPA 4.50% 19/09/2030	EUR	414,493.73	418,168.00	1.43
Industria			783,272.04	826,758.00	2.82
400,000.00	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA 1.63% 21/10/2028	EUR	368,903.51	383,252.00	1.31
300,000.00	POSTE ITALIANE SPA 0.50% 10/12/2028	EUR	251,703.49	283,050.00	0.96
160,000.00	WEBUILD SPA 4.13% 03/07/2031	EUR	162,665.04	160,456.00	0.55
Energia			400,900.30	382,588.00	1.31
400,000.00	ENI SPA 0.63% 14/06/2028	EUR	400,900.30	382,588.00	1.31
Servizi di telecomunicazione			143,119.73	143,799.00	0.49
150,000.00	TELECOM ITALIA SPA 1.63% 18/01/2029	EUR	143,119.73	143,799.00	0.49
GERMANIA			4,943,628.96	4,979,989.00	16.98
Enti Governativi			2,158,520.37	2,170,993.00	7.40
2,300,000.00	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 0.25% 15/02/2029	EUR	2,158,520.37	2,170,993.00	7.40
Industria			1,362,144.63	1,351,862.00	4.61
500,000.00	DEUTSCHE POST AG 3.13% 05/06/2032	EUR	502,630.97	498,150.00	1.70
500,000.00	HOCHTIEF AG 1.25% 03/09/2031	EUR	451,590.56	445,820.00	1.52
400,000.00	HEIDELBERG MATERIALS AG 3.95% 19/07/2034	EUR	407,923.10	407,892.00	1.39

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

NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Beni voluttuari			653,046.12	653,416.00	2.23
500,000.00	MERCEDES-BENZ GROUP AG 1.13% 06/11/2031	EUR	445,022.94	446,000.00	1.52
200,000.00	VOLKSWAGEN BANK GMBH 4.63% 03/05/2031	EUR	208,023.18	207,416.00	0.71
Servizi di pubblica utilità			463,585.36	495,420.00	1.69
500,000.00	RWE AG 2.75% 24/05/2030	EUR	463,585.36	495,420.00	1.69
Finanza			306,332.48	308,298.00	1.05
300,000.00	TALANX AG 4.00% 25/10/2029	EUR	306,332.48	308,298.00	1.05
PAESI BASSI			2,166,725.84	2,197,327.50	7.49
Industria			586,947.69	615,882.00	2.10
600,000.00	SIEMENS ENERGY FINANCE BV 4.25% 05/04/2029	EUR	586,947.69	615,882.00	2.10
Beni voluttuari			509,898.88	506,670.00	1.73
500,000.00	STELLANTIS NV 4.38% 14/03/2030	EUR	509,898.88	506,670.00	1.73
Materie prime			470,797.74	471,080.00	1.61
500,000.00	AKZO NOBEL NV 1.63% 14/04/2030	EUR	470,797.74	471,080.00	1.61
Finanza			447,734.02	452,560.00	1.54
500,000.00	EXOR NV 0.88% 19/01/2031	EUR	447,734.02	452,560.00	1.54
Enti Governativi			151,347.51	151,135.50	0.51
150,000.00	TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NETHERLANDS II BV 4.13% 01/06/2031	EUR	151,347.51	151,135.50	0.51
SPAGNA			1,872,761.66	1,880,320.00	6.41
Enti Governativi			1,872,761.66	1,880,320.00	6.41
2,000,000.00	SPAIN GOVERNMENT BONDS 1.25% 31/10/2030	EUR	1,872,761.66	1,880,320.00	6.41
FRANCIA			1,523,210.04	1,525,595.00	5.20
Finanza			465,596.16	471,180.00	1.61
500,000.00	CREDIT AGRICOLE ASSURANCES SA 2.00% 17/07/2030	EUR	465,596.16	471,180.00	1.61
Materie prime			434,608.77	438,320.00	1.49
500,000.00	AIR LIQUIDE FINANCE SA 0.38% 27/05/2031	EUR	434,608.77	438,320.00	1.49
Servizi di pubblica utilità			422,054.76	414,652.00	1.41
400,000.00	ELECTRICITE DE FRANCE SA 4.38% 12/10/2029	EUR	422,054.76	414,652.00	1.41
Beni voluttuari			200,950.35	201,443.00	0.69
100,000.00	VALEO SE 4.50% 11/04/2030	EUR	100,440.16	101,488.00	0.35
100,000.00	VALEO SE 4.63% 23/03/2032	EUR	100,510.19	99,955.00	0.34
STATI UNITI			731,124.84	732,604.50	2.50
Beni voluttuari			500,394.08	504,765.00	1.72
500,000.00	FORD MOTOR CREDIT CO. LLC 4.45% 16/09/2032	EUR	500,394.08	504,765.00	1.72
Beni di prima necessità			230,730.76	227,839.50	0.78
225,000.00	GENERAL MILLS, INC. 3.65% 23/10/2030	EUR	230,730.76	227,839.50	0.78
IRLANDA			438,375.28	441,255.00	1.51
Salute			438,375.28	441,255.00	1.51
500,000.00	FRESENIUS FINANCE IRELAND PLC 0.88% 01/10/2031	EUR	438,375.28	441,255.00	1.51
DANIMARCA			348,602.25	365,680.00	1.25
Beni di prima necessità			348,602.25	365,680.00	1.25
400,000.00	CARLSBERG BREWERIES AS 0.63% 09/03/2030	EUR	348,602.25	365,680.00	1.25

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

NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
LUSSEMBURGO			357,695.02	361,876.00	1.23
Servizi di telecomunicazione			357,695.02	361,876.00	1.23
400,000.00	CK HUTCHISON GROUP TELECOM FINANCE SA 1.50% 17/10/2031	EUR	357,695.02	361,876.00	1.23
GIAPPONE			144,852.92	147,982.50	0.51
Beni voluttuari			144,852.92	147,982.50	0.51
150,000.00	NISSAN MOTOR CO. LTD. 3.20% 17/09/2028	EUR	144,852.92	147,982.50	0.51
Obbligazioni a tasso variabile			300,495.15	302,071.50	1.03
ITALIA			300,495.15	302,071.50	1.03
Beni di prima necessità			300,495.15	302,071.50	1.03
150,000.00	SAMMONTANA ITALIA SPA FRN 15/10/2031	EUR	150,060.00	151,096.50	0.52
150,000.00	LA DORIA SPA FRN 30/12/2030	EUR	150,435.15	150,975.00	0.51
QUOTE DI OICR			6,137,682.47	7,358,717.46	25.10
Azioni di OICR			6,137,682.47	7,358,717.46	25.10
LUSSEMBURGO			3,179,360.09	3,685,373.76	12.57
Finanza			3,179,360.09	3,685,373.76	12.57
4,000.00	SWISSCANTO (LU) BOND FUND FCP - COCO -B- EUR (HEDGED) - (0.570%)	EUR	752,840.09	943,680.00	3.22
15,182.00	JANUS HENDERSON HORIZON FUND - GLOBAL SMALLER COMPANIES FUND -IU2- EUR - (1.000%)	EUR	740,000.00	879,189.85	3.00
6,000.00	NEW MILLENNIUM SIF-SICAV - EGM SISTEMA ITALIA PIR -I- EUR - (1.100%)	EUR	600,000.00	602,211.60	2.06
3,796.27	DNCA INVEST - ALPHA BONDS -I- EUR - (0.600%)	EUR	480,000.00	525,175.58	1.79
2,000.00	JPMORGAN FUNDS SICAV - EUROPE EQUITY ABSOLUTE ALPHA FUND -C- EUR - (0.750%)	EUR	316,520.00	399,860.00	1.36
1,656.27	REDWHEEL FUNDS SICAV - REDWHEEL NEXT GENERATION EMERGING MARKETS EQUITY FUND -B- EUR - (1.000%)	EUR	290,000.00	335,256.73	1.14
IRLANDA			2,958,322.38	3,673,343.70	12.53
Finanza			2,958,322.38	3,673,343.70	12.53
91,369.00	ISHARES III PLC - ISHARES S&P 500 SCORED AND SCREENED UCITS ETF EUR - (0.070%)	EUR	688,227.71	802,859.40	2.74
17,799.00	ISHARES V PLC - ISHARES S&P 500 INFORMATION TECHNOLOGY SECTOR UCITS ETF - EUR - (0.150%)	EUR	587,671.62	775,591.43	2.65
467.00	ISHARES VII PLC - ISHARES NASDAQ 100 UCITS ETF EUR - (0.300%)	EUR	538,370.09	707,691.80	2.41
250,000.00	JUPITER ASSET MANAGEMENT SERIES PLC - JUPITER MERIAN GLOBAL EQUITY ABSOLUTE RETURN FUND -I- USD - (0.750%)	USD	566,257.20	612,962.43	2.09
23,295.60	GUINNESS ASSET MANAGEMENT FUNDS PLC - GUINNESS GLOBAL EQUITY INCOME FUND -Y- EUR - (0.790%)	EUR	453,875.16	611,008.64	2.08
3,000.00	WISDOMTREE ISSUER ICAV - WISDOMTREE JAPAN EQUITY UCITS ETF EUR (HEDGED) - (0.450%)	EUR	123,920.60	163,230.00	0.56
Totale del Portafoglio Titoli			26,313,889.00	27,964,292.60	95.37

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

NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Attività		Note	
Portafoglio Titoli al valore di mercato		(2a)	19,620,399.64
Liquidità bancarie a vista			433,855.43
Importi dovuti dai broker			213,920.02
Dividendi da ricevere			1,735.82
Interessi da ricevere			234,343.54
Da ricevere su vendita titoli			392,799.67
Altre attività			3,639.57
Totale attività			20,900,693.69
Passività			
Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine		(2c, 13)	-53,932.67
Perdite non realizzate su contratti futures		(2d, 13)	-2,689.58
Da pagare su acquisto titoli			-444,327.94
Da pagare su rimborsi			-19,218.33
Altre passività			-81,449.63
Totale passività			-601,618.15
Totale attivo netto			20,299,075.54
	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	139.47	17,207.419
Azione I	EUR	116.53	15,332.616
Azione L	EUR	140.39	114,766.000

NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible

PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Attivo netto all'inizio del periodo	Note	20,597,202.16
Risultato netto degli investimenti	(2h)	487,394.60
Altri ricavi		1,810.69
Totale ricavi		489,205.29
Commissioni di consulenza/gestione	(5)	-104,267.30
Commissione di consulenza	(6)	-8,422.13
Commissioni della Banca Depositaria	(8)	-5,700.20
Tassa di registrazione	(3)	-4,543.14
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(8)	-19,853.54
Commissioni del Transfer Agent		-604.85
Compensi professionali	(9)	-8,648.46
Pubblicazioni		-477.21
Altre spese e tasse	(4)	-10,496.46
Totale costi		-163,013.29
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		326,192.00
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(2b)	455,074.82
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		-206,038.53
- di contratti futures		-262,679.60
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		-315,507.74
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(2c)	-50,993.16
- su contratti futures	(2d)	-2,689.58
Risultato netto delle operazioni per il periodo		-56,641.79
Sottoscrizioni del periodo		1,189,321.05
Rimborsi del periodo		-1,430,805.88
Attivo netto alla fine del periodo		20,299,075.54

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

NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			19,458,497.74	19,620,399.64	96.66
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			17,306,335.29	17,306,587.76	85.26
Azioni			745,850.29	613,267.52	3.02
STATI UNITI			395,888.29	334,328.15	1.65
Informatica			279,914.16	240,885.49	1.19
400.00	MICROSOFT CORP.	USD	152,849.25	130,506.42	0.64
550.00	PALANTIR TECHNOLOGIES, INC.	USD	67,120.64	56,125.68	0.28
310.00	NVIDIA CORP.	USD	59,944.27	54,253.39	0.27
Salute			51,729.74	49,727.10	0.24
450.00	GILEAD SCIENCES, INC.	USD	51,729.74	49,727.10	0.24
Servizi di telecomunicazione			64,244.39	43,715.56	0.22
700.00	NETFLIX, INC.	USD	64,244.39	43,715.56	0.22
GIAPPONE			166,541.12	132,579.37	0.65
Beni voluttuari			166,541.12	132,579.37	0.65
900.00	TOYOTA MOTOR CORP.	USD	166,541.12	132,579.37	0.65
FRANCIA			104,812.54	74,190.00	0.36
Beni voluttuari			104,812.54	74,190.00	0.36
300.00	KERING SA	EUR	104,812.54	74,190.00	0.36
ITALIA			78,608.34	72,170.00	0.36
Energia			78,608.34	72,170.00	0.36
3,500.00	ENI SPA	EUR	78,608.34	72,170.00	0.36
Obbligazioni ordinarie			8,452,774.29	8,454,017.15	41.65
ITALIA			4,537,490.79	4,513,798.78	22.24
Enti Governativi			2,927,836.76	2,895,589.78	14.27
1,329,757.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 2.00% 14/03/2028	EUR	1,363,247.99	1,344,783.25	6.63
809,504.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 1.60% 22/11/2028	EUR	828,341.06	815,170.53	4.02
500,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 4.35% 01/11/2033	EUR	534,667.11	533,700.00	2.63
200,000.00	VITTORIA ASSICURAZIONI SPA 4.78% 25/06/2036	EUR	201,580.60	201,936.00	0.99
Finanza			1,206,066.66	1,212,345.00	5.97
700,000.00	GENERALI 4.14% 18/06/2036	EUR	705,121.93	699,405.00	3.44
300,000.00	INTESA SANPAOLO ASSICURAZIONI SPA 4.22% 05/03/2035	EUR	301,944.73	302,220.00	1.49
200,000.00	UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA 4.90% 23/05/2034	EUR	199,000.00	210,720.00	1.04
Industria			204,577.80	204,392.00	1.01
200,000.00	PRYSMIAN SPA 3.88% 28/11/2031	EUR	204,577.80	204,392.00	1.01
Energia			199,009.57	201,472.00	0.99
200,000.00	ENI SPA 3.50% 26/05/2031	EUR	199,009.57	201,472.00	0.99
FRANCIA			1,863,326.54	1,858,577.96	9.16
Enti Governativi			1,385,357.49	1,382,430.00	6.81
1,400,000.00	FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BONDS OAT 2.50% 25/05/2030	EUR	1,385,357.49	1,382,430.00	6.81
Servizi di pubblica utilità			477,969.05	476,147.96	2.35
500,000.00	ELECTRICITE DE FRANCE SA 6.90% 23/05/2053	USD	477,969.05	476,147.96	2.35
GERMANIA			793,109.83	794,328.00	3.91
Enti Governativi			793,109.83	794,328.00	3.91
800,000.00	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 2.10% 15/03/2028	EUR	793,109.83	794,328.00	3.91

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

NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
REGNO UNITO			465,928.88	480,396.15	2.37
Finanza			465,928.88	480,396.15	2.37
400,000.00	SCOTTISH WIDOWS LTD. 7.00% 16/06/2043	GBP	465,928.88	480,396.15	2.37
LUSSEMBURGO			418,263.47	430,280.73	2.12
Servizi di telecomunicazione			418,263.47	430,280.73	2.12
450,000.00	TELECOM ITALIA CAPITAL SA 7.20% 18/07/2036	USD	418,263.47	430,280.73	2.12
STATI UNITI			175,606.75	175,533.53	0.86
Enti Governativi			175,606.75	175,533.53	0.86
200,000.00	U.S. TREASURY NOTES 4.50% 15/05/2027	USD	175,606.75	175,533.53	0.86
SVEZIA			100,040.00	100,772.00	0.50
Enti Governativi			100,040.00	100,772.00	0.50
100,000.00	VOLVO CAR AB 4.20% 10/06/2029	EUR	100,040.00	100,772.00	0.50
COLOMBIA			99,008.03	100,330.00	0.49
Enti Governativi			99,008.03	100,330.00	0.49
100,000.00	COLOMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BONDS 4.50% 26/11/2030	EUR	99,008.03	100,330.00	0.49
Obbligazioni a tasso variabile			8,107,710.71	8,239,303.09	40.59
ITALIA			4,557,069.41	4,634,764.00	22.83
Finanza			3,389,263.47	3,480,594.00	17.14
600,000.00	FINECOBANK BANCA FINECO SPA FRN 31/12/2099	EUR	643,278.26	646,002.00	3.18
400,000.00	UNICREDIT SPA FRN 31/12/2099	EUR	423,108.17	429,076.00	2.11
400,000.00	BANCO BPM SPA FRN 14/06/2028	EUR	399,750.77	411,012.00	2.03
400,000.00	BPER BANCA SPA FRN 31/12/2099	EUR	402,871.08	408,356.00	2.01
400,000.00	UNIPOL ASSICURAZIONI SPA FRN 31/12/2099	EUR	400,236.03	407,868.00	2.01
300,000.00	UNICREDIT SPA FRN 02/04/2034	USD	272,652.57	276,344.77	1.36
300,000.00	UNICREDIT SPA FRN 30/06/2035	USD	240,214.39	263,857.23	1.30
200,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 31/12/2099	EUR	201,500.00	219,232.00	1.08
200,000.00	BANCO BPM SPA FRN 31/12/2099	EUR	204,581.80	217,416.00	1.07
200,000.00	GENERALI FRN 31/12/2099	EUR	201,070.40	201,430.00	0.99
Servizi di pubblica utilità			759,954.86	748,612.00	3.69
500,000.00	ENEL SPA FRN 31/12/2099	EUR	561,683.58	551,580.00	2.72
200,000.00	ENEL SPA FRN 31/12/2099	EUR	198,271.28	197,032.00	0.97
Energia			205,232.06	203,092.00	1.00
200,000.00	ENI SPA FRN 31/12/2099	EUR	205,232.06	203,092.00	1.00
Industria			202,619.02	202,466.00	1.00
200,000.00	IMA INDUSTRIA MACCHINE AUTOMATICHE SPA FRN 15/04/2029	EUR	202,619.02	202,466.00	1.00
FRANCIA			1,954,052.35	1,985,257.00	9.78
Finanza			1,954,052.35	1,985,257.00	9.78
400,000.00	CREDIT AGRICOLE SA FRN 31/12/2099	EUR	422,334.90	425,052.00	2.09
400,000.00	AXA SA FRN 10/03/2043	EUR	397,116.63	408,400.00	2.01
400,000.00	BNP PARIBAS CARDIF SA FRN 31/12/2099	EUR	401,623.58	403,964.00	1.99
200,000.00	BNP PARIBAS SA FRN 31/12/2099	EUR	217,080.75	219,046.00	1.08
200,000.00	AXA SA FRN 31/12/2099	EUR	213,303.29	215,138.00	1.06
200,000.00	AXA SA FRN 31/12/2099	EUR	208,093.20	207,074.00	1.02
100,000.00	CNP ASSURANCES SACA FRN 18/07/2053	EUR	94,500.00	106,583.00	0.53
GERMANIA			923,244.84	953,956.00	4.70
Finanza			501,803.73	510,800.00	2.52
500,000.00	ALLIANZ SE FRN 05/07/2052	EUR	501,803.73	510,800.00	2.52

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

NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Salute			421,441.11	443,156.00	2.18
400,000.00	BAYER AG FRN 25/09/2083	EUR	421,441.11	443,156.00	2.18
PAESI BASSI			402,355.89	406,911.00	2.01
Enti Governativi			304,076.59	308,832.00	1.52
300,000.00	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN 31/12/2099	EUR	304,076.59	308,832.00	1.52
Beni voluttuari			98,279.30	98,079.00	0.49
100,000.00	STELLANTIS NV FRN 31/12/2099	EUR	98,279.30	98,079.00	0.49
COSTA D'AVORIO			270,988.22	258,415.09	1.27
Sovranazionale			270,988.22	258,415.09	1.27
300,000.00	AFRICAN DEVELOPMENT BANK FRN 31/12/2099	USD	270,988.22	258,415.09	1.27
NEGOZIATI SU UN ALTRO MERCATO REGOLAMENTATO			1,442,496.82	1,479,368.38	7.29
Obbligazioni ordinarie			465,293.17	448,644.24	2.21
PAESI BASSI			465,293.17	448,644.24	2.21
Servizi di pubblica utilità			465,293.17	448,644.24	2.21
500,000.00	ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 6.00% 07/10/2039	USD	465,293.17	448,644.24	2.21
Obbligazioni a tasso variabile			977,203.65	1,030,724.14	5.08
ITALIA			977,203.65	1,030,724.14	5.08
Finanza			977,203.65	1,030,724.14	5.08
700,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 20/06/2054	USD	685,397.58	726,780.32	3.58
300,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 21/11/2033	USD	291,806.07	303,943.82	1.50
ALTRI VALORI MOBILIARI			0.00	0.00	0.00
Warrants			0.00	0.00	0.00
ITALIA			0.00	0.00	0.00
Industria			0.00	0.00	0.00
3,619.00	WEBUILD SPA 02/08/2030*	EUR	0.00	0.00	0.00
QUOTE DI OICR			709,665.63	834,443.50	4.11
Azioni di OICR			709,665.63	834,443.50	4.11
AUSTRIA			563,325.57	679,768.50	3.35
Finanza			563,325.57	679,768.50	3.35
3,200.27	ERSTE BOND EMERGING MARKETS CORPORATE -VT- EUR - (0.960%)	EUR	563,325.57	679,768.50	3.35
IRLANDA			146,340.06	154,675.00	0.76
Finanza			146,340.06	154,675.00	0.76
1,250.00	VANECK UCITS ETFS PLC - VANECK SPACE INNOVATORS UCITS ETF -A- EUR - (0.550%)	EUR	99,701.31	108,387.50	0.53
1,250.00	WISDOMTREE ISSUER ICAV - WISDOMTREE QUANTUM COMPUTING UCITS ETF EUR - (0.500%)	EUR	46,638.75	46,287.50	0.23
Totale del Portafoglio Titoli			19,458,497.74	19,620,399.64	96.66

* Strumenti finanziari prezzati al fair value

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

NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible

IMPEGNI SU ACQUISTO / VENDITA DI CONTRATTI FUTURES AL 30 GIUGNO 2026

Valore nominale	Quantità	Acquisto / Vendita	Contratto	Scadenza	Valore di mercato al 30 Giugno 2026	Valuta	Plus/(minus) valenza non realizzata (EUR)	Impegno (EUR)
							-2,689.58	751,541.53
125,000	6	Acquisto	EURO FX CURRENCY	14/09/2026	1.00	USD	-2,689.58	751,541.53

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible

CONTRATTI FINANZIARI A TERMINE AL 30 GIUGNO 2026

Scadenza	Ammontare comprato	Valuta comprata	Ammontare venduto	Valuta venduta	Plus/(minus)-valenza non realizzata (EUR)
					-53,932.67
16/07/2026	3,442,730.10	EUR	4,000,000.00	USD	-53,932.67

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Attività	Note	
Portafoglio Titoli al valore di mercato	(2a)	19,517,995.86
Liquidità bancarie a vista		561,021.56
Importi dovuti dai broker		120,013.89
Interessi da ricevere		121,211.50
Da ricevere su sottoscrizioni		119.33
Altre attività		3,276.23
Totale attività		20,323,638.37

Passività	
Da pagare su rimborsi	-66,753.16
Altre passività	-47,294.58
Totale passività	-114,047.74

Totale attivo netto	20,209,590.63
----------------------------	----------------------

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	113.20	4,890.574
Azione I	EUR	122.00	141,116.648
Azione L	EUR	119.43	1,018.000
Azione Y	EUR	105.38	21,996.025

NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe**PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR**

Attivo netto all'inizio del periodo	Note	20,945,735.92
Risultato netto degli investimenti	(2h)	518,630.80
Altri ricavi		5.00
Totale ricavi		518,635.80
Commissioni di consulenza/gestione	(5)	-42,077.23
Commissione di consulenza	(6)	-8,521.79
Commissioni della Banca Depositaria	(8)	-5,755.17
Tassa di registrazione	(3)	-1,164.46
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(8)	-14,280.18
Commissioni del Transfer Agent		-1,179.45
Compensi professionali	(9)	-6,649.86
Pubblicazioni		-486.66
Altre spese e tasse	(4)	-10,620.27
Totale costi		-90,735.07
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		427,900.73
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(2b)	103,020.33
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		4,250.86
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		-135,856.86
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(2c)	6,697.54
Risultato netto delle operazioni per il periodo		406,012.60
Distribuzioni di dividendi	(14)	-67,307.84
Sottoscrizioni del periodo		590,805.42
Rimborsi del periodo		-1,665,655.47
Attivo netto alla fine del periodo		20,209,590.63

NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			19,612,043.65	19,517,995.86	96.58
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			19,388,486.91	19,282,708.95	95.41
Obbligazioni ordinarie			16,873,282.13	16,750,192.50	82.88
FRANCIA			6,769,258.44	6,712,196.71	33.21
Enti Governativi			6,769,258.44	6,712,196.71	33.21
3,518,651.71	FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BONDS OAT 0.10% 01/03/2029	EUR	3,470,620.56	3,436,983.80	17.01
3,302,325.00	FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BONDS OAT 0.70% 25/07/2030	EUR	3,298,637.88	3,275,212.91	16.20
GERMANIA			5,494,720.03	5,453,696.71	26.99
Enti Governativi			5,494,720.03	5,453,696.71	26.99
3,300,979.20	DEUTSCHE BUNDESREPUBLIK BONDS INFLATION-LINKED 0.50% 15/04/2030	EUR	3,307,916.58	3,261,400.46	16.14
2,215,000.00	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 2.50% 15/11/2032	EUR	2,186,803.45	2,192,296.25	10.85
ITALIA			4,609,303.66	4,584,299.08	22.68
Enti Governativi			4,609,303.66	4,584,299.08	22.68
2,557,081.80	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 1.50% 15/05/2029	EUR	2,607,639.52	2,584,186.87	12.79
1,967,452.50	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 1.85% 04/06/2032	EUR	2,001,664.14	2,000,112.21	9.89
Obbligazioni a tasso variabile			2,515,204.78	2,532,516.45	12.53
FRANCIA			1,510,515.59	1,515,733.85	7.50
Finanza			1,177,270.72	1,186,919.00	5.87
600,000.00	BNP PARIBAS SA FRN 31/12/2099	EUR	657,562.92	657,138.00	3.25
300,000.00	AXA SA FRN 31/12/2099	EUR	319,627.80	322,707.00	1.60
200,000.00	AXA SA FRN 31/12/2099	EUR	200,080.00	207,074.00	1.02
Servizi di telecomunicazione			333,244.87	328,814.85	1.63
327,000.00	ORANGE SA FRN 31/12/2099	EUR	333,244.87	328,814.85	1.63
ITALIA			1,004,689.19	1,016,782.60	5.03
Finanza			651,860.64	657,777.50	3.25
400,000.00	GENERALI FRN 31/12/2099	EUR	401,760.64	402,860.00	1.99
250,000.00	UNIPOL ASSICURAZIONI SPA FRN 31/12/2099	EUR	250,100.00	254,917.50	1.26
Servizi di pubblica utilità			352,828.55	359,005.10	1.78
200,000.00	ENEL SPA FRN 31/12/2099	EUR	198,271.28	197,032.00	0.98
163,000.00	ENEL SPA FRN 31/12/2099	EUR	154,557.27	161,973.10	0.80
QUOTE DI OICR			223,556.74	235,286.91	1.17
Certificati Quotati			223,556.74	235,286.91	1.17
JERSEY			223,556.74	235,286.91	1.17
Finanza			223,556.74	235,286.91	1.17
14,265.00	WISDOMTREE INDUSTRIAL METALS ETF EUR - (0.490%)	EUR	223,556.74	235,286.91	1.17
Totale del Portafoglio Titoli			19,612,043.65	19,517,995.86	96.58

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 2026 IN EUR**

Attività	Note	
Portafoglio Titoli al valore di mercato	(2a)	47,991,605.67
Liquidità bancarie a vista		359,880.87
Importi dovuti dai broker		385,684.18
Interessi da ricevere		1,040,301.71
Da ricevere su sottoscrizioni		110,112.40
Altre attività		4,299.34
Totale attività		49,891,884.17

Passività	
Da pagare su acquisto titoli	-338,231.37
Da pagare su rimborsi	-1,000.60
Altre passività	-226,708.92
Totale passività	-565,940.89

Totale attivo netto **49,325,943.28**

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	150.11	165,826.362
Azione D	EUR	102.05	10,927.942
Azione I	EUR	165.61	139,038.902
Azione L	EUR	162.55	1,802.000

NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond**PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR**

Attivo netto all'inizio del periodo	Note	68,178,545.05
Risultato netto degli investimenti	(2h)	1,299,673.40
Altri ricavi		1,062.96
Totale ricavi		1,300,736.36
Commissioni di consulenza/gestione	(5)	-300,472.16
Commissione di consulenza	(6)	-8,876.85
Commissioni sulla performance	(7)	-51,203.61
Commissioni della Banca Depositaria	(8)	-15,162.82
Tassa di registrazione	(3)	-7,660.02
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(8)	-19,798.80
Commissioni del Transfer Agent		-3,580.63
Compensi professionali	(9)	-6,600.35
Pubblicazioni		-1,320.72
Altre spese e tasse	(4)	-15,906.20
Totale costi		-430,582.16
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		870,154.20
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(2b)	842,002.07
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		-207,669.48
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		-1,125,056.90
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(2c)	22,018.27
Risultato netto delle operazioni per il periodo		401,448.16
Distribuzioni di dividendi	(14)	-35,101.20
Sottoscrizioni del periodo		1,964,338.42
Rimborsi del periodo		-21,183,287.15
Attivo netto alla fine del periodo		49,325,943.28

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			48,508,423.27	47,991,605.67	97.30
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			46,043,068.85	46,934,503.25	95.15
Obbligazioni ordinarie			16,308,282.05	16,525,150.00	33.50
ITALIA			14,372,972.05	14,574,080.00	29.55
Finanza			5,086,466.25	5,270,971.00	10.68
2,100,000.00	VITTORIA ASSICURAZIONI SPA 5.75% 11/07/2028	EUR	2,212,375.00	2,183,202.00	4.42
2,300,000.00	INTESA SANPAOLO VITA SPA 2.38% 22/12/2030	EUR	1,977,281.25	2,174,604.00	4.41
500,000.00	BANCA IFIS SPA 5.50% 27/02/2029	EUR	496,810.00	509,845.00	1.03
400,000.00	NET INSURANCE SPA 5.10% 28/09/2031	EUR	400,000.00	403,320.00	0.82
Industria			4,403,390.80	4,408,890.00	8.94
2,200,000.00	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA 3.75% 01/04/2030	EUR	2,206,300.80	2,183,390.00	4.43
1,200,000.00	WEBUILD SPA 4.50% 08/05/2032	EUR	1,202,500.00	1,203,540.00	2.44
1,000,000.00	PRYSMIAN SPA 3.88% 28/11/2031	EUR	994,590.00	1,021,960.00	2.07
Servizi di telecomunicazione			2,341,300.00	2,356,802.00	4.78
1,300,000.00	RAI-RADIOTELEVISIONE ITALIANA SPA 4.38% 10/07/2029	EUR	1,341,300.00	1,336,062.00	2.71
1,000,000.00	FIBEROP SPA 4.75% 30/06/2030	EUR	1,000,000.00	1,020,740.00	2.07
Enti Governativi			1,015,000.00	1,027,210.00	2.08
1,000,000.00	FIBEROP SPA 5.13% 30/06/2032	EUR	1,015,000.00	1,027,210.00	2.08
Informatica			700,534.00	683,837.00	1.39
700,000.00	ALMAVIVA-THE ITALIAN INNOVATION CO. SPA 5.00% 30/10/2030	EUR	700,534.00	683,837.00	1.39
Beni voluttuari			528,450.00	521,930.00	1.06
500,000.00	PIAGGIO & C SPA 6.50% 05/10/2030	EUR	528,450.00	521,930.00	1.06
Energia			297,831.00	304,440.00	0.62
300,000.00	ENI SPA 3.88% 15/01/2034	EUR	297,831.00	304,440.00	0.62
PAESI BASSI			1,935,310.00	1,951,070.00	3.95
Enti Governativi			989,110.00	976,680.00	1.98
1,000,000.00	STELLANTIS NV 4.63% 06/06/2035	EUR	989,110.00	976,680.00	1.98
Beni di prima necessità			946,200.00	974,390.00	1.97
1,000,000.00	DAVIDE CAMPARI-MILANO NV 2.38% 17/01/2029	EUR	946,200.00	974,390.00	1.97
Obbligazioni a tasso variabile			28,792,176.98	29,468,053.25	59.74
ITALIA			26,129,625.30	26,622,428.75	53.97
Finanza			15,264,619.01	15,603,170.75	31.63
2,000,000.00	BANCA SELLA HOLDING SPA FRN 18/07/2029	EUR	2,044,670.61	2,054,280.00	4.16
2,000,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 31/12/2099	EUR	1,991,000.00	2,008,500.00	4.07
1,500,000.00	BPER BANCA SPA FRN 31/12/2099	EUR	1,507,400.00	1,525,440.00	3.09
1,500,000.00	GENERALI FRN 31/12/2099	EUR	1,508,625.00	1,510,725.00	3.06
1,425,000.00	FINECOBANK BANCA FINECO SPA FRN 23/02/2029	EUR	1,436,323.50	1,454,568.75	2.95
1,100,000.00	UNIPOLSAI ASSICURAZIONI SPA FRN 31/12/2099	EUR	1,087,579.56	1,170,466.00	2.37
1,000,000.00	BPER BANCA SPA FRN 31/12/2099	EUR	1,040,600.00	1,089,990.00	2.21
1,000,000.00	CREDITO EMILIANO SPA FRN 30/05/2029	EUR	1,002,445.00	1,044,830.00	2.12
1,000,000.00	ICCREA BANCA SPA FRN 05/02/2030	EUR	995,020.00	1,021,830.00	2.07
800,000.00	FINECOBANK BANCA FINECO SPA FRN 31/12/2099	EUR	828,913.34	861,336.00	1.75
700,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 31/12/2099	EUR	723,800.00	743,036.00	1.51
600,000.00	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA FRN 01/02/2030	EUR	598,242.00	615,714.00	1.25
500,000.00	UNICREDIT SPA FRN 31/12/2099	EUR	500,000.00	502,455.00	1.02
Servizi di pubblica utilità			6,931,387.00	7,254,433.00	14.71
2,500,000.00	ENEL SPA FRN 31/12/2099	EUR	2,548,500.00	2,757,900.00	5.59
2,400,000.00	TERNA - RETE ELETTRICA NAZIONALE FRN 31/12/2099	EUR	2,388,912.00	2,466,168.00	5.00

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
1,500,000.00	A2A SPA FRN 31/12/2099	EUR	1,507,800.00	1,537,785.00	3.12
500,000.00	ENEL SPA FRN 31/12/2099	EUR	486,175.00	492,580.00	1.00
Energia			2,257,214.29	2,465,200.00	5.00
2,500,000.00	ENI SPA FRN 31/12/2099	EUR	2,257,214.29	2,465,200.00	5.00
Beni voluttuari			500,125.00	476,850.00	0.97
500,000.00	RINO MASTROTTO GROUP SPA FRN 31/07/2031	EUR	500,125.00	476,850.00	0.97
Industria			828,030.00	470,216.50	0.95
350,000.00	POSTE ITALIANE SPA FRN 31/12/2099	EUR	338,030.00	337,396.50	0.68
500,000.00	RENO DE MEDICI SPA FRN 15/04/2029	EUR	490,000.00	132,820.00	0.27
Beni di prima necessità			348,250.00	352,558.50	0.71
350,000.00	SAMMONTANA ITALIA SPA FRN 15/10/2031	EUR	348,250.00	352,558.50	0.71
LUSSEMBURGO			1,679,426.68	1,869,354.50	3.79
Finanza			1,208,400.00	1,398,380.00	2.84
2,000,000.00	MITSUBISHI UFJ INVESTOR SERVICES & BANKING LUXEMBOURG SA FRN 15/12/2050	EUR	1,208,400.00	1,398,380.00	2.84
Salute			471,026.68	470,974.50	0.95
466,694.91	ROSSINI SARL FRN 31/12/2029	EUR	471,026.68	470,974.50	0.95
PAESI BASSI			983,125.00	976,270.00	1.98
Beni voluttuari			983,125.00	976,270.00	1.98
1,000,000.00	STELLANTIS NV FRN 31/12/2099	EUR	983,125.00	976,270.00	1.98
Obbligazioni zero coupon			942,609.82	941,300.00	1.91
ITALIA			942,609.82	941,300.00	1.91
Beni voluttuari			942,609.82	941,300.00	1.91
1,000,000.00	NEXI SPA 0.00% 24/02/2028	EUR	942,609.82	941,300.00	1.91
ALTRI VALORI MOBILIARI			1,465,354.42	1.46	0.00
Titoli garantiti da Ipoteche immobiliari e da collaterale			1,465,354.42	1.46	0.00
ITALIA			1,465,354.42	1.46	0.00
Finanza			1,465,354.42	1.46	0.00
990,000.00	SIERRA ONE SPV SRL 7.00% 30/06/2025*	EUR	990,070.72	0.99	0.00
474,571.86	SPV PROJECT SRL 7.00% 15/11/2037*	EUR	475,283.70	0.47	0.00
QUOTE DI OICR			1,000,000.00	1,057,100.96	2.15
Azioni di OICR			1,000,000.00	1,057,100.96	2.15
LUSSEMBURGO			1,000,000.00	1,057,100.96	2.15
Finanza			1,000,000.00	1,057,100.96	2.15
5,856.52	NEW MILLENNIUM SICAV - AUGUSTUM HIGH QUALITY BOND -I- EUR - (0.700%)	EUR	1,000,000.00	1,057,100.96	2.15
Totale del Portafoglio Titoli			48,508,423.27	47,991,605.67	97.30

* Strumenti finanziari prezzati al fair value

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

NEW MILLENNIUM - Alpha Active Allocation

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Attività	Note	
Portafoglio Titoli al valore di mercato	(2a)	47,689,817.57
Liquidità bancarie a vista		258,561.56
Importi dovuti dai broker		1,303,864.87
Utili non realizzati su contratti futures	(2d, 13)	87,084.68
Dividendi da ricevere		2,988.41
Interessi da ricevere		313,498.08
Da ricevere su sottoscrizioni		108.55
Altre attività		4,513.93
Totale attività		49,660,437.65

Passività		
Perdite non realizzate su contratti futures	(2d, 13)	-304,174.08
Altre passività		-187,500.45
Totale passività		-491,674.53

Totale attivo netto		49,168,763.12
----------------------------	--	----------------------

	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	97.66	2,371.642
Azione D	EUR	64.43	11.557
Azione I	EUR	111.05	440,574.270
Azione L	EUR	108.75	90.000

NEW MILLENNIUM - Alpha Active Allocation

PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Attivo netto all'inizio del periodo	Note	49,267,942.89
Risultato netto degli investimenti	(2h)	587,921.01
Altri ricavi		6.13
Totale ricavi		587,927.14
Commissioni di consulenza/gestione	(5)	-292,648.41
Commissione di consulenza	(6)	-8,804.91
Commissioni della Banca Depositaria	(8)	-13,680.15
Tassa di registrazione	(3)	-2,478.01
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(8)	-21,634.36
Commissioni del Transfer Agent		-124.66
Compensi professionali	(9)	-6,585.90
Pubblicazioni		-1,139.98
Altre spese e tasse	(4)	-14,989.44
Totale costi		-362,085.82
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		225,841.32
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(2b)	254,394.79
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		-76,734.65
- di contratti futures		-1,557,340.76
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		1,271,959.18
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(2c)	45,072.49
- su contratti futures	(2d)	-250,991.74
Risultato netto delle operazioni per il periodo		-87,799.37
Distribuzioni di dividendi	(14)	-45.07
Sottoscrizioni del periodo		2,003,097.55
Rimborsi del periodo		-2,014,432.88
Attivo netto alla fine del periodo		49,168,763.12

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

NEW MILLENNIUM - Alpha Active Allocation

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			43,545,274.50	47,689,817.57	96.99
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			41,773,256.30	45,700,593.37	92.95
Azioni			8,957,849.19	11,921,343.99	24.25
STATI UNITI			7,710,502.27	10,058,267.33	20.46
Informatica			3,352,959.62	4,291,171.77	8.73
8,050.00	NVIDIA CORP.	USD	1,012,328.70	1,408,837.90	2.87
4,988.00	APPLE, INC.	USD	893,265.48	1,262,422.43	2.57
2,618.00	MICROSOFT CORP.	USD	1,047,401.18	854,164.51	1.74
1,770.00	BROADCOM, INC.	USD	107,849.01	584,813.65	1.19
602.00	ORACLE CORP.	USD	120,137.13	77,165.30	0.16
369.00	SALESFORCE, INC.	USD	70,258.90	50,562.00	0.10
256.00	ADOBE, INC.	USD	85,811.94	45,906.69	0.09
96.00	STRATEGY, INC.	USD	15,907.28	7,299.29	0.01
Servizi di telecomunicazione			2,062,071.55	2,816,174.96	5.73
3,803.00	AMAZON.COM, INC.	USD	584,472.26	792,798.87	1.61
1,867.00	ALPHABET, INC.	USD	287,479.81	576,985.09	1.17
1,705.00	ALPHABET, INC.	USD	183,479.99	532,944.81	1.08
772.00	META PLATFORMS, INC.	USD	468,448.32	380,354.98	0.77
1,447.00	SPACE EXPLORATION TECHNOLOGIES CORP.	USD	225,400.75	216,246.31	0.44
1,461.00	CISCO SYSTEMS, INC.	USD	66,671.21	150,099.75	0.31
1,690.00	NETFLIX, INC.	USD	184,851.77	105,541.84	0.22
727.00	WALT DISNEY CO.	USD	61,267.44	61,203.31	0.13
Finanza			634,334.06	1,001,120.11	2.04
978.00	JPMORGAN CHASE & CO.	USD	124,980.54	280,004.12	0.57
634.00	BERKSHIRE HATHAWAY, INC.	USD	193,707.26	277,483.81	0.57
591.00	VISA, INC.	USD	128,204.56	177,351.68	0.36
2,774.00	BANK OF AMERICA CORP.	USD	85,950.63	138,251.12	0.28
285.00	MASTERCARD, INC.	USD	101,491.07	128,029.38	0.26
Salute			670,597.82	828,001.37	1.68
347.00	ELI LILLY & CO.	USD	233,555.95	364,035.84	0.74
845.00	JOHNSON & JOHNSON	USD	126,113.26	187,706.32	0.38
486.00	UNITEDHEALTH GROUP, INC.	USD	218,445.52	176,678.18	0.36
886.00	MERCK & CO., INC.	USD	92,483.09	99,581.03	0.20
Energia			483,205.75	499,265.39	1.02
2,491.00	EXXON MOBIL CORP.	USD	269,744.42	297,882.88	0.61
1,389.00	CHEVRON CORP.	USD	213,461.33	201,382.51	0.41
Beni voluttuari			344,381.31	464,511.66	0.94
1,348.00	WALMART, INC.	USD	63,589.42	133,538.41	0.27
142.00	COSTCO WHOLESALE CORP.	USD	66,799.85	116,187.12	0.24
357.00	HOME DEPOT, INC.	USD	98,224.87	110,125.73	0.22
816.00	PROCTER & GAMBLE CO.	USD	115,767.17	104,660.40	0.21
Beni di prima necessità			162,952.16	158,022.07	0.32
1,435.00	COCA-COLA CO.	USD	81,941.38	102,005.11	0.21
473.00	PEPSICO, INC.	USD	81,010.78	56,016.96	0.11
REGNO UNITO			402,191.08	536,791.89	1.09
Salute			235,895.44	288,087.24	0.59
1,760.00	ASTRAZENECA PLC	GBP	235,895.44	288,087.24	0.59
Finanza			47,687.07	115,257.20	0.23
6,939.00	HSBC HOLDINGS PLC	GBP	47,687.07	115,257.20	0.23
Energia			71,254.16	86,143.96	0.17
2,530.00	SHELL PLC	GBP	71,254.16	86,143.96	0.17

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

NEW MILLENNIUM - Alpha Active Allocation

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Beni voluttuari			47,354.41	47,303.49	0.10
900.00	UNILEVER PLC	GBP	47,354.41	47,303.49	0.10
TAIWAN			229,090.74	484,545.75	0.99
Informatica			229,090.74	484,545.75	0.99
1,160.00	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO. LTD.	USD	229,090.74	484,545.75	0.99
SVIZZERA			244,152.93	285,119.25	0.58
Salute			148,892.94	210,348.94	0.43
778.00	NOVARTIS AG	CHF	68,291.70	106,782.31	0.22
287.00	ROCHE HOLDING AG	CHF	80,601.24	103,566.63	0.21
Beni di prima necessità			95,259.99	74,770.31	0.15
830.00	NESTLE SA	CHF	95,259.99	74,770.31	0.15
PAESI BASSI			94,706.23	266,449.67	0.54
Informatica			92,304.22	263,374.20	0.53
153.00	ASML HOLDING NV	EUR	92,304.22	263,374.20	0.53
Beni di prima necessità			2,402.01	3,075.47	0.01
202.00	MAGNUM ICE CREAM CO. NV	GBP	2,402.01	3,075.47	0.01
GERMANIA			92,652.59	138,092.15	0.28
Industria			43,849.43	84,626.15	0.17
301.00	SIEMENS AG	EUR	43,849.43	84,626.15	0.17
Informatica			48,803.16	53,466.00	0.11
399.00	SAP SE	EUR	48,803.16	53,466.00	0.11
IRLANDA			71,345.86	86,240.35	0.18
Materie prime			71,345.86	86,240.35	0.18
190.00	LINDE PLC	USD	71,345.86	86,240.35	0.18
FRANCIA			113,207.49	65,837.60	0.13
Beni voluttuari			113,207.49	65,837.60	0.13
136.00	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	EUR	113,207.49	65,837.60	0.13
Obbligazioni ordinarie			28,731,441.60	28,267,405.36	57.49
STATI UNITI			14,984,662.19	14,625,720.79	29.75
Enti Governativi			12,992,304.66	12,700,984.27	25.83
3,868,000.00	U.S. TREASURY NOTES 0.63% 15/08/2030	USD	2,878,352.66	2,927,779.84	5.95
3,141,000.00	U.S. TREASURY BONDS 5.25% 15/02/2029	USD	3,104,213.19	2,828,227.08	5.75
2,013,000.00	U.S. TREASURY NOTES 4.13% 31/10/2026	USD	1,904,478.16	1,761,999.36	3.58
1,246,000.00	U.S. TREASURY NOTES 4.13% 15/02/2036	USD	1,039,721.68	1,061,560.21	2.16
1,047,000.00	U.S. TREASURY NOTES 2.63% 31/05/2027	USD	870,137.86	903,625.38	1.84
1,011,000.00	U.S. TREASURY NOTES 3.50% 30/11/2030	USD	857,368.60	858,651.90	1.75
912,000.00	U.S. TREASURY NOTES 1.25% 15/08/2031	USD	682,501.80	688,756.18	1.40
799,000.00	U.S. TREASURY NOTES 3.88% 30/04/2031	USD	676,411.35	688,152.93	1.40
722,000.00	U.S. TREASURY NOTES 4.25% 15/08/2035	USD	617,201.59	622,427.35	1.27
417,000.00	U.S. TREASURY NOTES 4.25% 15/05/2035	USD	361,917.77	359,804.04	0.73
Beni voluttuari			1,166,133.74	1,159,862.62	2.36
700,000.00	PROCTER & GAMBLE CO. 3.15% 29/04/2028	EUR	711,897.65	705,117.00	1.43
517,000.00	GENERAL MOTORS FINANCIAL CO., INC. 5.05% 04/04/2028	USD	454,236.09	454,745.62	0.93
Finanza			826,223.79	764,873.90	1.56
865,000.00	ARES CAPITAL CORP. 7.00% 15/01/2027	USD	826,223.79	764,873.90	1.56

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

NEW MILLENNIUM - Alpha Active Allocation

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
ITALIA			4,673,827.70	4,641,388.73	9.44
Enti Governativi			4,040,589.24	4,015,094.50	8.17
2,059,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.80% 01/08/2028	EUR	2,144,600.60	2,104,503.90	4.28
920,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 2.95% 01/07/2030	EUR	930,761.52	921,564.00	1.88
790,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 0.90% 01/04/2031	EUR	694,343.44	718,347.00	1.46
263,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.85% 01/02/2035	EUR	270,883.68	270,679.60	0.55
Finanza			633,238.46	626,294.23	1.27
693,000.00	CASSA DEPOSITI E PRESTITI SPA 5.88% 30/04/2029	USD	633,238.46	626,294.23	1.27
FRANCIA			2,418,878.32	2,393,111.24	4.87
Enti Governativi			1,705,267.04	1,684,390.92	3.43
736,000.00	FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BONDS OAT 2.75% 25/02/2029	EUR	744,687.34	736,161.92	1.50
485,000.00	FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BONDS OAT 3.00% 25/05/2033	EUR	476,137.81	477,860.80	0.97
438,000.00	FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BONDS OAT 5.50% 25/04/2029	EUR	484,441.89	470,368.20	0.96
Finanza			713,611.28	708,720.32	1.44
800,000.00	AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT EPIC 4.88% 16/01/2030	USD	713,611.28	708,720.32	1.44
GIAPPONE			1,492,683.16	1,498,119.27	3.05
Finanza			1,492,683.16	1,498,119.27	3.05
925,000.00	SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP, INC. 1.90% 17/09/2028	USD	751,660.87	763,511.27	1.55
700,000.00	MIZUHO FINANCIAL GROUP, INC. 4.42% 20/05/2033	EUR	741,022.29	734,608.00	1.50
SPAGNA			1,499,507.13	1,471,243.83	2.99
Finanza			759,428.53	735,876.79	1.50
800,000.00	BANCO SANTANDER SA 6.03% 17/01/2035	USD	759,428.53	735,876.79	1.50
Enti Governativi			740,078.60	735,367.04	1.49
736,000.00	SPAIN GOVERNMENT BONDS 2.50% 31/05/2027	EUR	740,078.60	735,367.04	1.49
AUSTRIA			902,790.97	894,465.00	1.82
Enti Governativi			902,790.97	894,465.00	1.82
900,000.00	OPEC FUND FOR INTERNATIONAL DEVELOPMENT 2.75% 24/09/2030	EUR	902,790.97	894,465.00	1.82
CANADA			746,083.31	738,787.50	1.50
Finanza			746,083.31	738,787.50	1.50
750,000.00	CDP FINANCIAL, INC. 2.75% 13/02/2032	EUR	746,083.31	738,787.50	1.50
POLONIA			698,330.47	698,361.75	1.42
Finanza			698,330.47	698,361.75	1.42
675,000.00	BANK GOSPODARSTWA KRAJOWEGO 4.00% 13/03/2032	EUR	698,330.47	698,361.75	1.42
GERMANIA			699,306.08	693,864.96	1.41
Enti Governativi			699,306.08	693,864.96	1.41
444,000.00	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 2.50% 14/06/2028	EUR	443,848.95	443,755.80	0.90
228,000.00	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 4.00% 04/01/2037	EUR	255,457.13	250,109.16	0.51
CINA			615,372.27	612,342.29	1.24
Enti Governativi			615,372.27	612,342.29	1.24
700,000.00	NEW DEVELOPMENT BANK 4.38% 31/03/2028	USD	615,372.27	612,342.29	1.24

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

NEW MILLENNIUM - Alpha Active Allocation

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Obbligazioni zero coupon			678,696.88	644,174.76	1.31
GERMANIA			678,696.88	644,174.76	1.31
Enti Governativi			678,696.88	644,174.76	1.31
453,000.00	GERMAN TREASURY BILLS 0.00% 12/05/2027	EUR	443,914.32	443,677.26	0.90
450,000.00	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 0.00% 15/08/2050	EUR	234,782.56	200,497.50	0.41
Warrants			3,405,268.63	4,867,669.26	9.90
FRANCIA			1,693,536.50	2,449,684.06	4.98
Finanza			1,693,536.50	2,449,684.06	4.98
1,691.00	BNP PARIBAS SA 22/01/2094	EUR	1,693,536.50	2,449,684.06	4.98
PAESI BASSI			1,711,732.13	2,417,985.20	4.92
Finanza			1,711,732.13	2,417,985.20	4.92
1,711.00	BNP PARIBAS ISSUANCE BV 29/12/2093	EUR	1,711,732.13	2,417,985.20	4.92
ALTRI VALORI MOBILIARI			28,539.45	0.00	0.00
Azioni			28,539.45	0.00	0.00
ITALIA			28,539.45	0.00	0.00
Beni voluttuari			28,539.45	0.00	0.00
14,430.00	SEMPLICEMENTE SPA*	EUR	28,539.45	0.00	0.00
QUOTE DI OICR			1,743,478.75	1,989,224.20	4.04
Azioni di OICR			1,743,478.75	1,989,224.20	4.04
IRLANDA			1,743,478.75	1,989,224.20	4.04
Finanza			1,743,478.75	1,989,224.20	4.04
50,392.00	INVESCO MARKETS II PLC - INVESCO EURO CORPORATE HYBRID BOND UCITS ETF EUR - (0.390%)	EUR	1,743,478.75	1,989,224.20	4.04
Totale del Portafoglio Titoli			43,545,274.50	47,689,817.57	96.99

* Inadempiente / delistata

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

NEW MILLENNIUM - Alpha Active Allocation

IMPEGNI SU ACQUISTO / VENDITA DI CONTRATTI FUTURES AL 30 GIUGNO 2026

Valore nominale	Quantità	Acquisto / Vendita	Contratto	Scadenza	Valore di mercato al 30 Giugno 2026	Valuta	Plus/(minus) valenza non realizzata (EUR)	Impegno (EUR)
							-217,089.40	34,940,303.31
100,000	26	Acquisto	EURO-BUND	08/09/2026	127.34	EUR	39,260.00	3,310,840.00
100,000	17	Acquisto	EURO-BTP	08/09/2026	119.35	EUR	25,670.00	2,028,950.00
100,000	27	Acquisto	EURO-BOBL	08/09/2026	115.38	EUR	19,710.00	3,115,260.00
1,000	13	Acquisto	IBIG IBOXx ISHARES	01/09/2026	129.57	USD	2,444.68	1,684,382.79
125,000	198	Acquisto	EURO FX CURRENCY	14/09/2026	1.00	USD	-304,174.08	24,800,870.52

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond¹**CONTO ECONOMICO E VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO DAL 1° GENNAIO 2026 AL 3 FEBBRAIO 2026 (DATA DI LIQUIDAZIONE) IN EURO**

Attivo netto all'inizio del periodo	Note	14,172,631.70
Risultato netto degli investimenti	(2h)	5,914.07
Altri ricavi		1,052.29
Totale ricavi		6,966.36
Commissioni di consulenza/gestione	(5)	-8,406.45
Commissione di consulenza	(6)	-1,907.18
Commissioni della Banca Depositaria	(8)	-574.86
Tassa di registrazione	(3)	-77.65
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(8)	-4,624.55
Commissioni del Transfer Agent		-304.54
Compensi professionali	(9)	-1,651.67
Pubblicazioni		-141.56
Altre spese e tasse	(4)	-24,149.93
Totale costi		-41,838.39
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		-34,872.03
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(2b)	-405,045,856.44
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		404,192,018.26
- di contratti futures		0.19
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		818,618.43
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(2c)	154,593.36
Risultato netto delle operazioni per il periodo		84,501.77
Distribuzioni di dividendi	(14)	-4,772.00
Sottoscrizioni del periodo		3,943.56
Rimborsi del periodo		-14,256,305.03
Attivo netto alla fine del periodo		0.00

Il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond è stato chiuso il 3 febbraio 2026.
Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Attività		Note	
Portafoglio Titoli al valore di mercato		(2a)	14,384,688.63
Liquidità bancarie a vista			661,263.60
Importi dovuti dai broker			193,918.19
Premio pagato su contratti swap		(2f)	4,879.27
Interessi da ricevere			256,941.16
Altre attività			2,448.14
Totale attività			15,504,138.99
Passività			
Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine		(2c, 13)	-84,994.61
Perdite non realizzate su contratti swap		(2f, 13)	-23,910.15
Interessi da pagare su contratti swap			-375.00
Altre passività			-77,025.16
Totale passività			-186,304.92
Totale attivo netto			15,317,834.07
	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	107.41	19,653.385
Azione I	EUR	115.27	113,838.280
Azione L	EUR	98.78	860.001

NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond

PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Attivo netto all'inizio del periodo	Note	11,599,172.21
Risultato netto degli investimenti	(2h)	360,943.61
Altri ricavi		314.79
Totale ricavi		361,258.40
Commissioni di consulenza/gestione	(5)	-57,355.14
Commissione di consulenza	(6)	-9,397.36
Commissioni sulla performance	(7)	-17,054.41
Commissioni della Banca Depositaria	(8)	-3,803.02
Tassa di registrazione	(3)	-997.33
Interessi pagati su contratti swap		-7,541.67
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(8)	-12,256.20
Commissioni del Transfer Agent		-113.35
Compensi professionali	(9)	-5,443.31
Pubblicazioni		-296.95
Altre spese e tasse	(4)	-9,212.80
Totale costi		-123,471.54
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		237,786.86
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(2b)	329,566.39
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		-102,143.07
- di contratti futures		-48,817.98
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		-68,621.11
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(2c)	-51,612.25
- su contratti swap		-7,091.72
Risultato netto delle operazioni per il periodo		289,067.12
Sottoscrizioni del periodo		3,786,623.39
Rimborsi del periodo		-357,028.65
Attivo netto alla fine del periodo		15,317,834.07

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

NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			14,702,335.05	14,384,688.63	93.91
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			12,524,296.29	12,741,105.57	83.18
Obbligazioni ordinarie			5,558,299.74	5,495,625.27	35.88
COLOMBIA			1,186,683.43	1,238,338.91	8.08
Enti Governativi			582,070.00	596,322.00	3.89
600,000.00	COLOMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BONDS 5.00% 19/09/2032	EUR	582,070.00	596,322.00	3.89
Energia			450,123.44	475,757.85	3.11
300,000.00	ECOPETROL SA 8.88% 13/01/2033	USD	271,440.61	287,646.26	1.88
200,000.00	ECOPETROL SA 8.38% 19/01/2036	USD	178,682.83	188,111.59	1.23
Servizi di telecomunicazione			154,489.99	166,259.06	1.08
200,000.00	COLOMBIA TELECOMUNICACIONES SA ESP 4.95% 17/07/2030	USD	154,489.99	166,259.06	1.08
ITALIA			709,800.00	717,106.00	4.68
Enti Governativi			406,800.00	410,884.00	2.68
400,000.00	FIBERCOP SPA 5.13% 30/06/2032	EUR	406,800.00	410,884.00	2.68
Servizi di telecomunicazione			303,000.00	306,222.00	2.00
300,000.00	FIBERCOP SPA 4.75% 30/06/2030	EUR	303,000.00	306,222.00	2.00
FRANCIA			601,086.00	601,336.00	3.93
Servizi di telecomunicazione			202,640.00	205,024.00	1.34
200,000.00	EUTELSAT COMMUNICATIONS SACA 5.75% 15/03/2031	EUR	202,640.00	205,024.00	1.34
Materie prime			198,426.00	198,288.00	1.30
200,000.00	ERAMET SA 6.50% 30/11/2029	EUR	198,426.00	198,288.00	1.30
Informatica			200,020.00	198,024.00	1.29
200,000.00	ATOS GROUP 8.13% 21/05/2031	EUR	200,020.00	198,024.00	1.29
LUSSEMBURGO			413,709.78	413,520.85	2.70
Servizi di telecomunicazione			239,909.78	239,044.85	1.56
250,000.00	TELECOM ITALIA CAPITAL SA 7.20% 18/07/2036	USD	239,909.78	239,044.85	1.56
Finanza			173,800.00	174,476.00	1.14
200,000.00	CPI PROPERTY GROUP SA 1.75% 14/01/2030	EUR	173,800.00	174,476.00	1.14
REGNO UNITO			349,696.46	367,940.53	2.40
Materie prime			178,700.00	190,638.00	1.24
200,000.00	INEOS FINANCE PLC 7.25% 31/03/2031	EUR	178,700.00	190,638.00	1.24
Energia			170,996.46	177,302.53	1.16
200,000.00	SERICA ENERGY PLC 7.88% 12/05/2031	USD	170,996.46	177,302.53	1.16
BRASILE			326,298.25	334,892.09	2.19
Enti Governativi			326,298.25	334,892.09	2.19
2,000,000.00	BRAZIL GOVERNMENT INTERNATIONAL BONDS 10.25% 10/01/2028	BRL	326,298.25	334,892.09	2.19
PAESI BASSI			321,600.00	319,284.00	2.08
Beni voluttuari			321,600.00	319,284.00	2.08
300,000.00	ZF EUROPE FINANCE BV 7.00% 12/06/2030	EUR	321,600.00	319,284.00	2.08
STATI UNITI			302,424.55	309,846.10	2.02
Sovranazionale			160,715.36	165,460.56	1.08
1,000,000.00	INTERNATIONAL FINANCE CORP. 11.75% 18/07/2030	BRL	160,715.36	165,460.56	1.08

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

NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Beni voluttuari			141,709.19	144,385.54	0.94
200,000.00	MACY'S RETAIL HOLDINGS LLC 5.13% 15/01/2042	USD	141,709.19	144,385.54	0.94
MESSICO			251,426.02	259,351.86	1.69
Energia			251,426.02	259,351.86	1.69
300,000.00	PETROLEOS MEXICANOS 5.95% 28/01/2031	USD	251,426.02	259,351.86	1.69
CANADA			211,446.49	212,866.25	1.39
Industria			211,446.49	212,866.25	1.39
250,000.00	CANADA CARTAGE CORP. 9.75% 08/05/2031	USD	211,446.49	212,866.25	1.39
DANIMARCA			201,700.00	202,880.00	1.33
Servizi di telecomunicazione			201,700.00	202,880.00	1.33
200,000.00	TDC BRANDS AS 8.00% 30/04/2031	EUR	201,700.00	202,880.00	1.33
SVEZIA			201,850.00	201,544.00	1.32
Enti Governativi			201,850.00	201,544.00	1.32
200,000.00	VOLVO CAR AB 4.20% 10/06/2029	EUR	201,850.00	201,544.00	1.32
JERSEY			186,969.56	139,786.57	0.91
Beni voluttuari			186,969.56	139,786.57	0.91
200,000.00	ASTON MARTIN CAPITAL HOLDINGS LTD. 10.00% 31/03/2029	USD	186,969.56	139,786.57	0.91
NORVEGIA			127,652.74	131,224.08	0.86
Energia			127,652.74	131,224.08	0.86
150,000.00	BLUENORD ASA 7.88% 19/05/2031	USD	127,652.74	131,224.08	0.86
LIBANO			165,956.46	45,708.03	0.30
Enti Governativi			165,956.46	45,708.03	0.30
200,000.00	LEBANON GOVERNMENT INTERNATIONAL BONDS 0.00% 02/11/2035	USD	165,956.46	45,708.03	0.30
Obbligazioni a tasso variabile			6,965,996.55	7,245,480.30	47.30
ITALIA			1,716,530.00	1,744,337.00	11.39
Finanza			1,212,430.00	1,238,172.00	8.08
300,000.00	UNICREDIT SPA FRN 31/12/2099	EUR	305,568.00	306,234.00	2.00
300,000.00	BPER BANCA SPA FRN 31/12/2099	EUR	305,382.00	305,088.00	1.99
200,000.00	BANCO BPM SPA FRN 31/12/2099	EUR	200,980.00	217,416.00	1.42
200,000.00	BANCA POPOLARE DI SONDRIO SPA FRN 13/03/2034	EUR	200,000.00	208,584.00	1.36
200,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 31/12/2099	EUR	200,500.00	200,850.00	1.31
Industria			504,100.00	506,165.00	3.31
500,000.00	IMA INDUSTRIA MACCHINE AUTOMATICHE SPA FRN 15/04/2029	EUR	504,100.00	506,165.00	3.31
LUSSEMBURGO			1,076,684.00	1,188,203.00	7.76
Finanza			585,240.00	695,117.00	4.54
700,000.00	MITSUBISHI UFJ INVESTOR SERVICES & BANKING LUXEMBOURG SA FRN 15/12/2050	EUR	396,700.00	489,433.00	3.20
200,000.00	BANQUE INTERNATIONALE A LUXEMBOURG SA FRN 01/05/2033	EUR	188,540.00	205,684.00	1.34
Servizi di telecomunicazione			297,594.00	301,086.00	1.97
300,000.00	SES SA FRN 12/09/2054	EUR	297,594.00	301,086.00	1.97
Enti Governativi			193,850.00	192,000.00	1.25
200,000.00	CPI PROPERTY GROUP SA FRN 31/12/2099	EUR	193,850.00	192,000.00	1.25

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

NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
GERMANIA			1,027,998.00	1,076,490.00	7.03
Finanza			617,238.00	649,458.00	4.24
200,000.00	COMMERZBANK AG FRN 31/12/2099	EUR	202,160.00	226,322.00	1.48
200,000.00	DEUTSCHE BANK AG FRN 31/12/2099	EUR	214,500.00	218,336.00	1.42
200,000.00	DEUTSCHE BANK AG FRN 31/12/2099	EUR	200,578.00	204,800.00	1.34
Salute			206,660.00	221,578.00	1.45
200,000.00	BAYER AG FRN 25/09/2083	EUR	206,660.00	221,578.00	1.45
Industria			204,100.00	205,454.00	1.34
200,000.00	VOSSLOH AG FRN 12/01/2033	EUR	204,100.00	205,454.00	1.34
REGNO UNITO			779,920.00	823,698.92	5.38
Finanza			429,424.00	438,178.92	2.86
500,000.00	MAREX GROUP PLC FRN 31/12/2099	USD	429,424.00	438,178.92	2.86
Servizi di telecomunicazione			350,496.00	385,520.00	2.52
400,000.00	VODAFONE GROUP PLC FRN 27/08/2080	EUR	350,496.00	385,520.00	2.52
PAESI BASSI			498,575.00	504,569.00	3.29
Beni voluttuari			298,575.00	292,881.00	1.91
300,000.00	STELLANTIS NV FRN 31/12/2099	EUR	298,575.00	292,881.00	1.91
Servizi di telecomunicazione			200,000.00	211,688.00	1.38
200,000.00	TELEFONICA EUROPE BV FRN 31/12/2099	EUR	200,000.00	211,688.00	1.38
STATI UNITI			468,547.56	482,801.51	3.15
Industria			257,077.31	260,926.25	1.70
300,000.00	STANLEY BLACK & DECKER INC FRN 15/03/2060	USD	257,077.31	260,926.25	1.70
Finanza			211,470.25	221,875.26	1.45
250,000.00	HA SUSTAINABLE INFRASTRUCTURE CAPITAL, INC. FRN 15/11/2056	USD	211,470.25	221,875.26	1.45
AUSTRIA			400,180.00	408,858.00	2.67
Finanza			400,180.00	408,858.00	2.67
200,000.00	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG FRN 31/12/2099	EUR	200,000.00	206,478.00	1.35
200,000.00	RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG FRN 31/12/2099	EUR	200,180.00	202,380.00	1.32
NORVEGIA			298,575.00	299,946.00	1.96
Energia			298,575.00	299,946.00	1.96
300,000.00	VAR ENERGI ASA FRN 29/04/2086	EUR	298,575.00	299,946.00	1.96
SPAGNA			200,000.00	211,120.00	1.38
Energia			200,000.00	211,120.00	1.38
200,000.00	BANCO DE SABADELL SA FRN 31/12/2099	EUR	200,000.00	211,120.00	1.38
FINLANDIA			199,470.00	204,107.00	1.33
Industria			199,470.00	204,107.00	1.33
100,000.00	STORA ENSO OYJ FRN 31/12/2099	EUR	99,470.00	102,146.00	0.67
100,000.00	STORA ENSO OYJ FRN 31/12/2099	EUR	100,000.00	101,961.00	0.66
FRANCIA			199,458.00	202,620.00	1.32
Finanza			199,458.00	202,620.00	1.32
200,000.00	SOCIETE GENERALE SA FRN 31/12/2099	EUR	199,458.00	202,620.00	1.32
BERMUDA			100,058.99	98,729.87	0.64
Finanza			100,058.99	98,729.87	0.64
300,000.00	AEGON LTD. FRN 29/03/2049	NLG	100,058.99	98,729.87	0.64

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

NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
NEGOZIATI SU UN ALTRO MERCATO REGOLAMENTATO			341,801.88	363,231.88	2.37
Obbligazioni ordinarie			341,801.88	363,231.88	2.37
LUSSEMBURGO			170,364.17	190,185.45	1.24
Energia			170,364.17	190,185.45	1.24
210,909.29	ACU PETROLEO LUXEMBOURG SARL 7.50% 13/01/2032	USD	170,364.17	190,185.45	1.24
STATI UNITI			171,437.71	173,046.43	1.13
Informatica			171,437.71	173,046.43	1.13
200,000.00	COREWEAVE, INC. 9.00% 01/02/2031	USD	171,437.71	173,046.43	1.13
ALTRI VALORI MOBILIARI			579,857.46	0.00	0.00
Obbligazioni ordinarie			579,857.46	0.00	0.00
BERMUDA			324,190.83	0.00	0.00
Servizi di telecomunicazione			324,190.83	0.00	0.00
400,000.00	DGL3 LTD. 0.00% 30/09/2020*	USD	324,190.83	0.00	0.00
CANADA			183,075.17	0.00	0.00
Industria			183,075.17	0.00	0.00
300,000.00	ENTREC CORP. 8.50% 30/06/2021*	CAD	183,075.17	0.00	0.00
STATI UNITI			72,591.46	0.00	0.00
Energia			72,591.46	0.00	0.00
100,000.00	SANCHEZ ENERGY CORP. 0.00% 15/06/2021*	USD	72,591.46	0.00	0.00
QUOTE DI OICR			1,256,379.42	1,280,351.18	8.36
Azioni di OICR			1,256,379.42	1,280,351.18	8.36
LUSSEMBURGO			1,256,379.42	1,280,351.18	8.36
Finanza			1,256,379.42	1,280,351.18	8.36
35,050.83	SUMUS - HYBRID BONDS FUND -PREMIUM EUR- EUR - (0.200%)	EUR	400,000.00	407,676.13	2.66
2,359.00	NEW MILLENNIUM SICAV - AUGUSTUM ITALIAN DIVERSIFIED BOND -I- EUR - (0.750%)	EUR	382,747.75	390,320.14	2.55
1,861.65	NEW MILLENNIUM SICAV - AUGUSTUM HIGH QUALITY BOND -I- EUR - (0.700%)	EUR	331,299.77	336,028.37	2.19
499.95	NEW MILLENNIUM SICAV - AUGUSTUM CORPORATE BOND -I- EUR - (0.750%)	EUR	142,331.90	146,326.54	0.96
Totale del Portafoglio Titoli			14,702,335.05	14,384,688.63	93.91

* Inadempiente / delistata

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

NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond

CONTRATTI FINANZIARI A TERMINE AL 30 GIUGNO 2026

Scadenza	Ammontare comprato	Valuta comprata	Ammontare venduto	Valuta venduta	Plus/(minus)-valenza non realizzata (EUR)
					-84,994.61
22/07/2026	136,259.51	EUR	160,000.00	USD	-3,572.97
22/07/2026	170,431.79	EUR	200,000.00	USD	-4,358.81
22/07/2026	431,179.45	EUR	500,000.00	USD	-5,797.05
22/07/2026	323,310.70	EUR	380,000.00	USD	-8,791.44
22/07/2026	1,947,617.56	EUR	2,300,000.00	USD	-62,474.34

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond

CONTRATTI SWAP AL 30 GIUGNO 2026

Sottostante	Valuta	Posizione	Nominale	Controparte	Scadenza	Interessi da ricevere / pagare (EUR)	Plus/(minus) -valenza non realizzata(EUR)
CONTRATTI CREDIT DEFAULT SWAP						-375.00	-23,910.15
ITRAXX EUROPE SUB FINANCIALS SERIES 43 VERSION 1	EUR	Long	1,500,000.00	J.P. MORGAN SE	06/20/2030	-375.00	-23,910.15

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Attività		Note	
Portafoglio Titoli al valore di mercato		(2a)	75,576,052.18
Liquidità bancarie a vista			986,364.53
Importi dovuti dai broker			1,760,057.00
Utili non realizzati su contratti futures		(2d, 13)	88,949.97
Dividendi da ricevere			4,232.80
Interessi da ricevere			519,479.75
Da ricevere su vendita titoli			224,113.89
Altre attività			5,591.43
Totale attività			79,164,841.55
Passività			
Perdite non realizzate su contratti futures		(2d, 13)	-9,741.54
Da pagare su rimborsi			-24,812.00
Altre passività			-370,034.48
Totale passività			-404,588.02
Totale attivo netto			78,760,253.53
	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	118.71	195,530.911
Azione I	EUR	124.38	36,082.643
Azione L	EUR	122.37	417,250.000

NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity

PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Attivo netto all'inizio del periodo	Note	78,530,610.54
Risultato netto degli investimenti	(2h)	949,205.41
Altri ricavi		15.92
Totale ricavi		949,221.33
Commissioni di consulenza/gestione	(5)	-608,231.82
Commissione di consulenza	(6)	-9,177.58
Commissioni sulla performance	(7)	-17,872.59
Commissioni della Banca Depositaria	(8)	-21,657.59
Tassa di registrazione	(3)	-17,712.50
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(8)	-20,391.49
Commissioni del Transfer Agent		-704.19
Compensi professionali	(9)	-6,858.74
Pubblicazioni		-1,812.99
Altre spese e tasse	(4)	-19,453.73
Totale costi		-723,873.22
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		225,348.11
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(2b)	286,845.63
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		-1,449.43
- di contratti futures		231,425.33
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		1,824,243.14
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(2c)	25,577.26
- su contratti futures	(2d)	125,470.66
Risultato netto delle operazioni per il periodo		2,717,460.70
Sottoscrizioni del periodo		200,008.62
Rimborsi del periodo		-2,687,826.33
Attivo netto alla fine del periodo		78,760,253.53

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

NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			71,315,549.79	75,576,052.18	95.96
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			56,453,895.28	56,632,519.18	71.91
Obbligazioni ordinarie			35,169,033.02	35,055,800.26	44.51
ITALIA			16,864,355.75	17,185,692.00	21.82
Enti Governativi			6,901,228.47	7,262,140.00	9.22
4,500,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 0.95% 01/08/2030	EUR	3,820,586.46	4,166,550.00	5.29
1,700,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.35% 01/03/2035	EUR	1,668,427.62	1,689,290.00	2.14
1,400,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.15% 15/11/2031	EUR	1,412,214.39	1,406,300.00	1.79
Finanza			5,448,581.99	5,428,400.00	6.89
2,000,000.00	CASSA DEPOSITI E PRESTITI SPA 3.63% 13/01/2030	EUR	1,997,227.56	2,034,240.00	2.58
1,000,000.00	CDP RETI SPA 3.88% 04/09/2031	EUR	1,006,571.49	1,020,200.00	1.29
1,000,000.00	GENERALI 4.16% 03/01/2035	EUR	1,015,707.07	1,005,600.00	1.28
1,000,000.00	CASSA DEPOSITI E PRESTITI SPA 1.00% 21/09/2028	EUR	1,017,962.28	961,600.00	1.22
400,000.00	TAMBURI INVESTMENT PARTNERS SPA 4.63% 21/06/2029	EUR	411,113.59	406,760.00	0.52
Industria			3,529,281.08	3,507,292.00	4.45
1,100,000.00	NEXI SPA 1.75% 24/04/2027	EUR	1,080,255.65	1,085,447.00	1.38
1,000,000.00	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA 3.63% 13/10/2032	EUR	993,302.65	960,950.00	1.22
600,000.00	PRYSMIAN SPA 3.88% 28/11/2031	EUR	604,496.85	613,176.00	0.78
600,000.00	IMA INDUSTRIA MACCHINE AUTOMATICHE SPA 3.75% 15/01/2028	EUR	601,740.93	600,984.00	0.76
250,000.00	POSTE ITALIANE SPA 3.00% 03/12/2030	EUR	249,485.00	246,735.00	0.31
Beni voluttuari			985,264.21	987,860.00	1.26
500,000.00	LOTTOMATICA GROUP SPA 4.63% 30/04/2032	EUR	501,801.02	504,765.00	0.64
500,000.00	NEXI SPA 2.13% 30/04/2029	EUR	483,463.19	483,095.00	0.62
SPAGNA			4,906,741.17	4,628,701.00	5.88
Enti Governativi			4,906,741.17	4,628,701.00	5.88
3,500,000.00	SPAIN GOVERNMENT BONDS 1.45% 30/04/2029	EUR	3,653,299.03	3,390,205.00	4.31
1,200,000.00	SPAIN GOVERNMENT BONDS 3.55% 31/10/2033	EUR	1,253,442.14	1,238,496.00	1.57
PORTOGALLO			3,893,253.27	3,826,406.00	4.86
Enti Governativi			3,099,422.98	3,029,878.00	3.85
3,100,000.00	PORTUGAL OBRIGACOES DO TESOURO OT 0.70% 15/10/2027	EUR	3,099,422.98	3,029,878.00	3.85
Industria			793,830.29	796,528.00	1.01
800,000.00	TRANSPORTES AEREOS PORTUGUESES SA 4.75% 30/06/2031	EUR	793,830.29	796,528.00	1.01
FRANCIA			3,718,446.82	3,721,216.00	4.73
Enti Governativi			2,862,107.80	2,855,704.00	3.63
2,200,000.00	FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BONDS OAT 1.25% 25/05/2034	EUR	1,877,314.28	1,880,824.00	2.39
1,000,000.00	COUNCIL OF EUROPE DEVELOPMENT BANK 2.63% 11/01/2034	EUR	984,793.52	974,880.00	1.24
Industria			856,339.02	865,512.00	1.10
800,000.00	VINCI SA 0.70% 18/02/2030	EUR	856,339.02	865,512.00	1.10
BELGIO			3,467,923.81	3,354,735.00	4.26
Enti Governativi			3,467,923.81	3,354,735.00	4.26
2,000,000.00	EUROPEAN UNION 1.63% 04/12/2029	EUR	1,876,583.23	1,930,900.00	2.45
1,700,000.00	EUROPEAN UNION 3.00% 04/03/2053	EUR	1,591,340.58	1,423,835.00	1.81
PAESI BASSI			1,373,319.23	1,358,351.00	1.72
Beni di prima necessità			853,780.81	876,951.00	1.11
900,000.00	DAVIDE CAMPARI-MILANO NV 2.38% 17/01/2029	EUR	853,780.81	876,951.00	1.11
Servizi di telecomunicazione			519,538.42	481,400.00	0.61
500,000.00	PROSUS NV 1.54% 03/08/2028	EUR	519,538.42	481,400.00	0.61

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

NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
STATI UNITI			501,225.61	504,765.00	0.64
Beni voluttuari			501,225.61	504,765.00	0.64
500,000.00	FORD MOTOR CREDIT CO. LLC 4.45% 16/09/2032	EUR	501,225.61	504,765.00	0.64
REGNO UNITO			443,767.36	475,934.26	0.60
Enti Governativi			443,767.36	475,934.26	0.60
500,000.00	U.K. GILTS 0.25% 31/07/2031	GBP	443,767.36	475,934.26	0.60
Obbligazioni a tasso variabile			15,678,359.40	15,797,259.92	20.06
ITALIA			6,257,836.84	6,480,087.92	8.23
Finanza			5,142,033.34	5,355,075.50	6.80
1,000,000.00	UNICREDIT SPA FRN 31/12/2099	EUR	965,621.63	1,020,780.00	1.30
1,000,000.00	SACE SPA FRN 10/02/2049	EUR	1,011,932.86	1,005,070.00	1.28
600,000.00	UNICREDIT SPA FRN 31/12/2099	EUR	515,595.67	599,274.00	0.76
550,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 16/09/2032	EUR	549,169.50	558,277.50	0.71
500,000.00	UNICREDIT SPA FRN 16/04/2034	EUR	499,992.16	522,030.00	0.66
500,000.00	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA FRN 01/02/2030	EUR	500,521.93	513,095.00	0.65
500,000.00	UNICREDIT SPA FRN 10/06/2031	EUR	499,500.00	497,235.00	0.63
400,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 31/12/2099	EUR	399,699.59	438,464.00	0.56
200,000.00	INTESA SANPAOLO SPA FRN 31/12/2099	EUR	200,000.00	200,850.00	0.25
Energia			596,517.27	594,192.00	0.75
600,000.00	ENI SPA FRN 31/12/2099	EUR	596,517.27	594,192.00	0.75
Industria			402,053.23	414,096.00	0.53
400,000.00	PRYSMIAN SPA FRN 31/12/2099	EUR	402,053.23	414,096.00	0.53
Servizi di pubblica utilità			117,233.00	116,724.42	0.15
118,000.00	ENEL SPA FRN 31/12/2099	EUR	117,233.00	116,724.42	0.15
GERMANIA			1,988,793.18	1,803,670.00	2.29
Finanza			1,988,793.18	1,803,670.00	2.29
1,000,000.00	ALLIANZ SE FRN 31/12/2099	EUR	983,590.03	913,160.00	1.16
1,000,000.00	ALLIANZ SE FRN 31/12/2099	EUR	1,005,203.15	890,510.00	1.13
PAESI BASSI			1,804,952.73	1,795,834.00	2.28
Finanza			1,004,302.52	980,330.00	1.24
1,000,000.00	COOPERATIEVE RABOBANK UA FRN 31/12/2099	EUR	1,004,302.52	980,330.00	1.24
Beni voluttuari			800,650.21	815,504.00	1.04
800,000.00	VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN 31/12/2099	EUR	800,650.21	815,504.00	1.04
SPAGNA			1,487,688.65	1,552,352.00	1.97
Finanza			1,487,688.65	1,552,352.00	1.97
1,600,000.00	BANCO SANTANDER SA FRN 31/12/2099	EUR	1,487,688.65	1,552,352.00	1.97
BERMUDA			1,404,229.53	1,414,824.00	1.80
Finanza			1,404,229.53	1,414,824.00	1.80
1,000,000.00	AEGON LTD. FRN 29/07/2049	EUR	796,340.31	799,230.00	1.02
600,000.00	AEGON LTD. FRN 31/12/2099	EUR	607,889.22	615,594.00	0.78
IRLANDA			1,032,412.18	1,038,930.00	1.32
Finanza			1,032,412.18	1,038,930.00	1.32
1,000,000.00	AIB GROUP PLC FRN 31/12/2099	EUR	1,032,412.18	1,038,930.00	1.32
FRANCIA			808,565.60	822,968.00	1.04
Finanza			808,565.60	822,968.00	1.04
800,000.00	CREDIT AGRICOLE SA FRN 31/12/2099	EUR	808,565.60	822,968.00	1.04

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

NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
REGNO UNITO			597,117.69	590,346.00	0.75
Servizi di telecomunicazione			597,117.69	590,346.00	0.75
600,000.00	VODAFONE GROUP PLC FRN 12/09/2055	EUR	597,117.69	590,346.00	0.75
AUSTRIA			296,763.00	298,248.00	0.38
Energia			296,763.00	298,248.00	0.38
300,000.00	OMV AG FRN 31/12/2099	EUR	296,763.00	298,248.00	0.38
Obbligazioni zero coupon			5,606,502.86	5,779,459.00	7.34
FRANCIA			2,693,243.85	2,853,223.00	3.62
Enti Governativi			2,693,243.85	2,853,223.00	3.62
2,900,000.00	FRENCH REPUBLIC GOVERNMENT BONDS OAT 0.00% 25/02/2027	EUR	2,693,243.85	2,853,223.00	3.62
GERMANIA			1,889,783.38	1,889,420.00	2.40
Finanza			1,889,783.38	1,889,420.00	2.40
2,000,000.00	KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU 0.00% 15/09/2028	EUR	1,889,783.38	1,889,420.00	2.40
ITALIA			1,023,475.63	1,036,816.00	1.32
Salute			1,023,475.63	1,036,816.00	1.32
1,100,000.00	DIASORIN SPA 0.00% 05/05/2028	EUR	1,023,475.63	1,036,816.00	1.32
QUOTE DI OICR			14,861,654.51	18,943,533.00	24.05
Azioni di OICR			14,861,654.51	18,943,533.00	24.05
IRLANDA			8,411,599.67	11,247,778.00	14.28
Finanza			8,411,599.67	11,247,778.00	14.28
55,000.00	ISHARES PLC - ISHARES MSCI EUROPE EX-UK UCITS ETF EUR - (0.400%)	EUR	1,907,527.02	3,056,350.00	3.88
70,000.00	ISHARES II PLC - ISHARES CORE MSCI EUROPE UCITS ETF EUR - (0.120%)	EUR	1,698,831.68	2,817,500.00	3.58
130,000.00	ISHARES IV PLC - ISHARES MSCI WORLD SRI UCITS ETF EUR - (0.200%)	EUR	1,580,325.22	1,824,160.00	2.31
24,000.00	LEGAL & GENERAL UCITS ETF PLC - L&G CYBER SECURITY UCITS ETF EUR - (0.690%)	EUR	520,564.56	929,160.00	1.18
100,000.00	ISHARES IV PLC - ISHARES HEALTHCARE INNOVATION UCITS ETF EUR - (0.400%)	EUR	766,732.37	840,600.00	1.07
1,100.00	INVESCO MARKETS III PLC - INVESCO EQQQ NASDAQ-100 UCITS ETF EUR - (0.300%)	EUR	569,417.53	709,753.00	0.90
11,700.00	SSGA SPDR ETFS EUROPE I PLC - SPDR BLOOMBERG EMERGING MARKETS LOCAL BOND UCITS ETF EUR - (0.550%)	EUR	692,037.24	590,265.00	0.75
7,000.00	ISHARES VI PLC - ISHARES J.P. MORGAN \$ EM BOND EUR HEDGED UCITS ETF EUR (HEDGED) - (0.500%)	EUR	676,164.05	479,990.00	0.61
LUSSEMBURGO			4,464,282.21	5,556,315.00	7.05
Finanza			4,464,282.21	5,556,315.00	7.05
25,500.00	AMUNDI INDEX SOLUTIONS - AMUNDI INDEX MSCI EUROPE SRI UCITS ETF DR EUR - (0.180%)	EUR	1,510,449.99	2,363,850.00	3.00
75,000.00	XTRACKERS - HARVEST CSI300 UCITS ETF -1D- EUR - (0.450%)	EUR	829,129.39	932,700.00	1.19
1,500.00	MULTI UNITS LUXEMBOURG - LYXOR MSCI WORLD HEALTH CARE TR UCITS ETF EUR - (0.300%)	EUR	675,968.42	758,265.00	0.96
4,000.00	MULTI UNITS LUXEMBOURG - AMUNDI STOXX EUROPE 600 HEALTHCARE UCITS ETF EUR - (0.300%)	EUR	575,913.21	624,880.00	0.79
3,000.00	AMUNDI INDEX SOLUTIONS - AMUNDI S&P GLOBAL LUXURY UCITS ETF EUR - (0.250%)	EUR	639,413.05	624,720.00	0.79
500.00	MULTI UNITS LUXEMBOURG - LYXOR MSCI WORLD HEALTH CARE TR UCITS ETF EUR - (0.300%)	EUR	233,408.15	251,900.00	0.32

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

NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
GERMANIA			1,236,676.50	1,303,700.00	1.66
Finanza			1,236,676.50	1,303,700.00	1.66
10,000.00	ISHARES (DE) I - ISHARES STOXX EUROPE 600 CONSTRUCTION & MATERIALS UCITS ETF (DE) EUR - (0.450%)	EUR	850,647.58	916,100.00	1.17
1,500.00	ISHARES MDAX (R) UCITS ETF (DE) EUR - (0.510%)	EUR	386,028.92	387,600.00	0.49
FRANCIA			749,096.13	835,740.00	1.06
Finanza			749,096.13	835,740.00	1.06
1,800.00	LYXOR DOW JONES INDUSTRIAL AVERAGE UCITS ETF EUR - (0.500%)	EUR	749,096.13	835,740.00	1.06
Totale del Portafoglio Titoli			71,315,549.79	75,576,052.18	95.96

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 2026

Valore nominale	Quantità	Acquisto / Vendita	Contratto	Scadenza	Valore di mercato al 30 Giugno 2026	Valuta	Plus/(minus) valenza non realizzata (EUR)	Impegno (EUR)
							79,208.43	8,795,779.64
100,000	35	Acquisto	EURO-BUND	08/09/2026	127.34	EUR	53,050.00	4,456,900.00
10	30	Acquisto	EURO STOXX 50	18/09/2026	6,356.00	EUR	31,800.00	1,906,800.00
100,000	15	Acquisto	US 10YR NOTE (CBT)	21/09/2026	96.12	USD	4,099.97	1,441,755.66
50	3	Acquisto	S&P 500 EMINI	18/09/2026	6,602.16	USD	-9,741.54	990,323.98

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia

PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Attività		Note	
Portafoglio Titoli al valore di mercato		(2a)	5,185,303.35
Liquidità bancarie a vista			274,167.64
Importi dovuti dai broker			30,006.21
Interessi da ricevere			37,488.13
Da ricevere su vendita titoli			988.70
Altre attività			2,491.40
Totale attività			5,530,445.43
Passività			
Da pagare su rimborsi			-69,524.32
Altre passività			-36,888.91
Totale passività			-106,413.23
Totale attivo netto			5,424,032.20
	Valuta	Valore Netto d'Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A	EUR	116.46	15,734.373
Azione I	EUR	122.96	27,948.638
Azione L	EUR	120.96	1,283.000

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

NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia

PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Attivo netto all'inizio del periodo	Note	5,607,267.80
Risultato netto degli investimenti	(2h)	78,768.26
Altri ricavi		7.93
Totale ricavi		78,776.19
Commissioni di consulenza/gestione	(5)	-21,209.00
Commissione di consulenza	(6)	-8,315.19
Commissioni della Banca Depositaria	(8)	-1,928.08
Tassa di registrazione	(3)	-636.26
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(8)	-16,250.36
Commissioni del Transfer Agent		-261.44
Compensi professionali	(9)	-7,450.93
Pubblicazioni		-126.43
Altre spese e tasse	(4)	-8,078.32
Totale costi		-64,256.01
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		14,520.18
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(2b)	121,423.90
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		-26,083.80
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(2c)	56.27
Risultato netto delle operazioni per il periodo		109,916.55
Sottoscrizioni del periodo		10,404.88
Rimborsi del periodo		-303,557.03
Attivo netto alla fine del periodo		5,424,032.20

NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			5,165,545.09	5,185,303.35	95.60
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			4,836,527.96	4,992,030.38	92.03
Azioni			1,757,419.18	1,884,804.36	34.75
ITALIA			1,660,791.85	1,791,826.86	33.04
Finanza			819,468.58	934,935.00	17.24
20,000.00	INTESA SANPAOLO SPA	EUR	102,697.83	119,800.00	2.21
7,500.00	BPER BANCA SPA	EUR	77,743.88	102,990.00	1.90
2,000.00	GENERALI	EUR	83,360.74	85,220.00	1.57
27,500.00	BFF BANK SPA	EUR	68,373.49	84,590.00	1.56
20,000.00	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE SIIQ SPA	EUR	72,357.87	84,300.00	1.55
1,000.00	UNICREDIT SPA	EUR	74,138.58	78,260.00	1.44
3,500.00	BANCA MEDIOLANUM SPA	EUR	58,262.16	76,230.00	1.41
1,000.00	BANCA GENERALI SPA	EUR	55,945.12	65,200.00	1.20
1,500.00	AZIMUT HOLDING SPA	EUR	52,683.75	53,220.00	0.98
15,000.00	NEXI SPA	EUR	53,195.54	53,130.00	0.98
2,000.00	UNIPOL GRUPPO SPA	EUR	42,427.98	48,820.00	0.90
7,500.00	EQUITA GROUP SPA	EUR	44,676.93	43,725.00	0.81
1,500.00	REVO INSURANCE SPA	EUR	33,604.71	39,450.00	0.73
Beni voluttuari			305,581.66	299,796.31	5.53
2,500.00	DE' LONGHI SPA	EUR	88,679.30	92,850.00	1.71
1,000.00	BRUNELLO CUCINELLI SPA	EUR	81,974.71	82,600.00	1.52
3,000.00	LOTTOMATICA GROUP SPA	EUR	76,757.72	72,900.00	1.35
7,500.00	ESPRINET SPA	EUR	51,714.98	50,362.50	0.93
50.00	POWERSOFT SPA	EUR	163.64	825.00	0.02
152.00	PORTOBELLO SPA	EUR	6,152.81	158.08	0.00
100.00	RADICI PIETRO INDUSTRIES & BRANDS SPA	EUR	0.00	92.00	0.00
30.00	SOSTRAVEL.COM SPA	EUR	138.50	8.73	0.00
Salute			183,327.82	183,146.00	3.38
2,000.00	RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA E FARMACEUTICA SPA	EUR	99,386.67	102,600.00	1.89
8,500.00	AMPLIFON SPA	EUR	83,941.15	80,546.00	1.49
Industria			112,793.40	143,100.00	2.64
5,000.00	POSTE ITALIANE SPA	EUR	112,793.40	143,100.00	2.64
Servizi di pubblica utilità			119,822.27	120,562.00	2.22
40,000.00	A2A SPA	EUR	90,270.40	90,400.00	1.67
3,000.00	ENEL SPA	EUR	29,551.87	30,162.00	0.55
Informatica			66,518.60	62,825.00	1.16
700.00	SESA SPA	EUR	66,518.60	62,825.00	1.16
Servizi di telecomunicazione			53,279.52	47,462.55	0.87
519.00	REPLY SPA	EUR	53,279.52	47,462.55	0.87
PAESI BASSI			96,627.33	92,977.50	1.71
Beni di prima necessità			68,269.86	68,100.00	1.25
12,500.00	DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	EUR	68,269.86	68,100.00	1.25
Beni voluttuari			28,357.47	24,877.50	0.46
5,000.00	STELLANTIS NV	EUR	28,357.47	24,877.50	0.46
Obbligazioni ordinarie			2,405,570.03	2,445,071.10	45.08
ITALIA			2,012,372.61	2,051,388.00	37.82
Industria			543,898.76	547,917.00	10.10
150,000.00	POSTE ITALIANE SPA 0.50% 10/12/2028	EUR	138,559.70	141,525.00	2.61
100,000.00	FERROVIE DELLO STATO ITALIANE SPA 4.50% 23/05/2033	EUR	104,918.95	106,406.00	1.96
100,000.00	MAIRE SPA 4.00% 13/11/2030	EUR	102,721.07	100,877.00	1.86

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

NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
100,000.00	WEBUILD SPA 4.13% 03/07/2031	EUR	100,850.32	100,285.00	1.85
100,000.00	AEROPORTI DI ROMA SPA REG 1.63% 08/06/2027	EUR	96,848.72	98,824.00	1.82
Energia			442,490.43	454,119.00	8.37
300,000.00	ERG SPA 0.50% 11/09/2027	EUR	279,395.22	290,967.00	5.36
200,000.00	ENI SPA 1.00% 11/10/2034	EUR	163,095.21	163,152.00	3.01
Finanza			381,083.97	388,699.00	7.17
100,000.00	UNIPOL GRUPPO SPA 3.25% 23/09/2030	EUR	95,870.33	101,294.00	1.87
100,000.00	ANIMA HOLDING SPA 1.50% 22/04/2028	EUR	95,111.63	97,028.00	1.79
100,000.00	ASSICURAZIONI GENERALI SPA 2.43% 14/07/2031	EUR	95,883.34	95,318.00	1.76
100,000.00	BPER BANCA SPA 0.63% 28/10/2028	EUR	94,218.67	95,059.00	1.75
Beni voluttuari			270,329.08	284,589.00	5.25
200,000.00	ASTM SPA 1.50% 25/01/2030	EUR	179,232.66	187,970.00	3.47
100,000.00	NEXI SPA 2.13% 30/04/2029	EUR	91,096.42	96,619.00	1.78
Servizi di pubblica utilità			189,284.68	192,632.00	3.55
100,000.00	A2A SPA 4.50% 19/09/2030	EUR	102,530.99	104,542.00	1.93
100,000.00	ITALGAS SPA 1.00% 11/12/2031	EUR	86,753.69	88,090.00	1.62
Enti Governativi			185,285.69	183,432.00	3.38
200,000.00	UNICREDIT SPA 1.63% 18/01/2032	EUR	185,285.69	183,432.00	3.38
GERMANIA			235,198.04	235,977.50	4.35
Enti Governativi			235,198.04	235,977.50	4.35
250,000.00	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 0.25% 15/02/2029	EUR	235,198.04	235,977.50	4.35
SPAGNA			157,999.38	157,705.60	2.91
Enti Governativi			157,999.38	157,705.60	2.91
160,000.00	SPAIN GOVERNMENT BONDS 1.45% 31/10/2027	EUR	157,999.38	157,705.60	2.91
Obbligazioni a tasso variabile			575,237.70	563,785.50	10.39
ITALIA			575,237.70	563,785.50	10.39
Finanza			575,237.70	563,785.50	10.39
150,000.00	BPER BANCA FRN 11/09/2029	EUR	162,636.53	157,774.50	2.91
100,000.00	BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA FRN 15/03/2029	EUR	103,041.20	102,552.00	1.89
100,000.00	BANCA POPOLARE DI SONDRIO SPA FRN 04/06/2030	EUR	102,720.07	102,474.00	1.89
100,000.00	ICCREA BANCA SPA FRN 20/01/2028	EUR	106,652.64	102,105.00	1.88
100,000.00	MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA FRN 22/08/2031	EUR	100,187.26	98,880.00	1.82
Obbligazioni zero coupon			98,301.05	98,323.00	1.81
GERMANIA			98,301.05	98,323.00	1.81
Enti Governativi			98,301.05	98,323.00	1.81
100,000.00	GERMAN TREASURY BILLS 0.00% 17/03/2027	EUR	98,301.05	98,323.00	1.81
Warrants			0.00	46.42	0.00
ITALIA			0.00	46.42	0.00
Servizi di telecomunicazione			0.00	46.42	0.00
666.00	EXECUS SPA 16/10/2026	EUR	0.00	46.42	0.00
ALTRI VALORI MOBILIARI			123,331.98	1,419.60	0.03
Obbligazioni ordinarie			123,331.98	1,419.60	0.03
ITALIA			123,331.98	1,419.60	0.03
Servizi di telecomunicazione			31,589.15	1,419.60	0.03
31,413.81	PRISMI SPA 6.00% 18/08/2026	EUR	31,589.15	1,419.60	0.03

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

NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
Energia			91,742.83	0.00	0.00
97,200.00	ENERTRONICA SANTERNO SPA 7.00% 31/12/2022*	EUR	91,742.83	0.00	0.00
QUOTE DI OICR			205,685.15	191,853.37	3.54
Azioni di OICR			205,685.15	191,853.37	3.54
LUSSEMBURGO			205,685.15	191,853.37	3.54
Finanza			205,685.15	191,853.37	3.54
1,911.49	NEW MILLENNIUM SIF-SICAV - EGM SISTEMA ITALIA PIR -I- EUR - (1.100%)	EUR	205,685.15	191,853.37	3.54
Totale del Portafoglio Titoli			5,165,545.09	5,185,303.35	95.60

* Strumenti finanziari prezzati al fair value

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

NEW MILLENNIUM - Augustum Flexible Equity¹**PROSPETTO DEL PATRIMONIO NETTO AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR**

Attività		Note	
Portafoglio Titoli al valore di mercato		(2a)	12,027,362.74
Liquidità bancarie a vista			2,280,643.22
Importi dovuti dai broker			723,767.53
Contratti di opzioni al valore di mercato		(2e, 13)	29,198.35
Utili non realizzati su contratti futures		(2d, 13)	4,316.45
Dividendi da ricevere			74.63
Interessi da ricevere			80,170.90
Altre attività			18,706.12
Totale attività			15,164,239.94
Passività			
Perdite non realizzate su contratti di cambio a termine		(2c, 13)	-48,039.32
Perdite non realizzate su contratti futures		(2d, 13)	-49,597.65
Da pagare su acquisto titoli			-167,343.63
Altre passività			-40,964.11
Totale passività			-305,944.71
Totale attivo netto			14,858,295.23
Valuta		Valore Netto d’Inventario per Azione	Numero di Azioni in circolazione
Azione A Acc	EUR	103.25	49.450
Azione I	EUR	106.00	140,119.570

Il Comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Flexible Equity è partito il 10 aprile 2026.
Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Augustum Flexible Equity¹**PROSPETTO DELLE VARIAZIONI DEL PATRIMONIO NETTO PER IL PERIODO CHIUSO AL DAL 10 APRILE (DATA DI LANCIO) AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR**

Attivo netto all'inizio del periodo	Note	0.00
Risultato netto degli investimenti	(2h)	37,756.29
Altri ricavi		20.57
Totale ricavi		37,776.86
Commissioni di consulenza/gestione	(5)	-25,202.05
Commissione di consulenza	(6)	-3,234.33
Commissioni della Banca Depositaria	(8)	-1,446.61
Tassa di registrazione	(3)	-358.78
Commissioni dell'Amministrazione Centrale	(8)	-6,279.89
Commissioni del Transfer Agent		-440.64
Compensi professionali	(9)	-3,072.48
Pubblicazioni		-85.05
Altre spese e tasse	(4)	-3,583.60
Totale costi		-43,703.43
Utile / (perdita) netto(a) degli investimenti		-5,926.57
Utile / (perdita) netto(a) realizzato(a) sulla vendita		
- di titoli	(2b)	4,020.00
- di contratti di cambio a termine e su valute estere		-366.31
- di contratti di opzioni		50,676.28
- di contratti futures		256,640.03
Variazione della plus / (minus)-valenza non realizzata		
- sugli investimenti		226,378.37
- su contratti di cambio a termine e su valute estere	(2c)	-36,685.84
- sulle opzioni	(2e)	-3,821.27
- su contratti futures	(2d)	-45,281.20
Risultato netto delle operazioni per il periodo		445,633.49
Sottoscrizioni del periodo		14,439,942.97
Rimborsi del periodo		-27,281.23
Attivo netto alla fine del periodo		14,858,295.23

Il Comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Flexible Equity è partito il 10 aprile 2026.
Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Augustum Flexible Equity¹

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
VALORI MOBILIARI			11,800,984.37	12,027,362.74	80.95
AMMESSI ALLA QUOTAZIONE UFFICIALE			8,080,739.16	8,168,226.24	54.98
Azioni			879,214.31	940,098.48	6.33
STATI UNITI			879,214.31	940,098.48	6.33
Informatica			252,966.94	258,623.25	1.74
380.00	APPLE, INC.	USD	83,470.26	96,174.92	0.65
250.00	MICROSOFT CORP.	USD	89,714.80	81,566.51	0.55
330.00	NVIDIA CORP.	USD	55,997.40	57,753.60	0.39
70.00	BROADCOM, INC.	USD	23,784.48	23,128.22	0.15
Finanza			230,396.32	241,187.16	1.62
310.00	VISA, INC.	USD	81,553.27	93,027.11	0.62
310.00	JPMORGAN CHASE & CO.	USD	81,660.82	88,753.86	0.60
600.00	CIRCLE INTERNET GROUP, INC.	USD	44,404.10	32,868.01	0.22
30.00	GOLDMAN SACHS GROUP, INC.	USD	22,778.13	26,538.18	0.18
Servizi di telecomunicazione			135,263.15	134,067.14	0.90
200.00	ALPHABET, INC.	USD	57,668.01	62,515.52	0.42
220.00	AMAZON.COM, INC.	USD	46,306.97	45,862.67	0.31
42.00	META PLATFORMS, INC.	USD	24,189.18	20,692.89	0.14
80.00	NETFLIX, INC.	USD	7,098.99	4,996.06	0.03
Salute			93,777.45	119,807.13	0.81
50.00	ELI LILLY & CO.	USD	39,662.17	52,454.73	0.36
115.00	UNITEDHEALTH GROUP, INC.	USD	30,962.01	41,806.57	0.28
115.00	JOHNSON & JOHNSON	USD	23,153.27	25,545.83	0.17
Industria			53,759.34	67,757.31	0.46
34.00	CATERPILLAR, INC.	USD	22,873.14	31,668.50	0.21
58.00	GENERAL ELECTRIC CO.	USD	15,573.75	18,959.45	0.13
72.00	UNION PACIFIC CORP.	USD	15,312.45	17,129.36	0.12
Beni voluttuari			60,126.99	66,718.75	0.45
75.00	TESLA, INC.	USD	23,046.02	27,591.18	0.19
180.00	PROCTER & GAMBLE CO.	USD	22,047.07	23,086.85	0.15
52.00	HOME DEPOT, INC.	USD	15,033.90	16,040.72	0.11
Energia			38,001.00	35,588.49	0.24
180.00	EXXON MOBIL CORP.	USD	22,644.82	21,525.06	0.15
97.00	CHEVRON CORP.	USD	15,356.18	14,063.43	0.09
Beni di prima necessità			14,923.12	16,349.25	0.11
230.00	COCA-COLA CO.	USD	14,923.12	16,349.25	0.11
Obbligazioni ordinarie			6,546,791.90	6,576,026.00	44.26
ITALIA			2,406,918.00	2,409,090.00	16.21
Enti Governativi			2,205,518.00	2,204,698.00	14.84
1,900,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 2.65% 01/12/2027	EUR	1,898,738.00	1,900,000.00	12.79
300,000.00	ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 7.25% 01/11/2026	EUR	306,780.00	304,698.00	2.05
Industria			201,400.00	204,392.00	1.37
200,000.00	PRYSMIAN SPA 3.88% 28/11/2031	EUR	201,400.00	204,392.00	1.37
GERMANIA			1,970,977.20	1,982,830.00	13.35
Enti Governativi			1,970,977.20	1,982,830.00	13.35
800,000.00	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 2.50% 15/11/2032	EUR	782,196.00	791,800.00	5.33
600,000.00	BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 2.00% 10/12/2026	EUR	598,662.00	598,998.00	4.03
600,000.00	BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 0.25% 15/02/2027	EUR	590,119.20	592,032.00	3.99

Il Comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Flexible Equity è partito il 10 aprile 2026.
Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Augustum Flexible Equity¹

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
SPAGNA			1,649,111.70	1,656,427.50	11.15
Enti Governativi			1,649,111.70	1,656,427.50	11.15
1,150,000.00	SPAIN GOVERNMENT BONDS 2.70% 31/01/2030	EUR	1,145,141.70	1,149,712.50	7.74
500,000.00	SPAIN GOVERNMENT BONDS 3.10% 30/07/2031	EUR	503,970.00	506,715.00	3.41
ROMANIA			206,200.00	207,022.00	1.39
Enti Governativi			206,200.00	207,022.00	1.39
200,000.00	ROMANIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BONDS 5.38% 22/03/2031	EUR	206,200.00	207,022.00	1.39
TOGO			169,120.00	171,576.00	1.16
Sovranazionale			169,120.00	171,576.00	1.16
200,000.00	BANQUE OUEST AFRICAINE DE DEVELOPPEMENT 2.75% 22/01/2033	EUR	169,120.00	171,576.00	1.16
COLOMBIA			144,465.00	149,080.50	1.00
Enti Governativi			144,465.00	149,080.50	1.00
150,000.00	COLOMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BONDS 5.00% 19/09/2032	EUR	144,465.00	149,080.50	1.00
Obbligazioni a tasso variabile			327,000.00	339,944.00	2.29
FRANCIA			194,900.00	200,106.00	1.35
Finanza			194,900.00	200,106.00	1.35
200,000.00	BNP PARIBAS SA FRN 31/12/2099	EUR	194,900.00	200,106.00	1.35
LUSSEMBURGO			132,100.00	139,838.00	0.94
Finanza			132,100.00	139,838.00	0.94
200,000.00	MITSUBISHI UFJ INVESTOR SERVICES & BANKING LUXEMBOURG SA FRN 15/12/2050	EUR	132,100.00	139,838.00	0.94
Obbligazioni zero coupon			327,732.95	312,157.76	2.10
ISOLE CAYMAN			327,732.95	312,157.76	2.10
Beni voluttuari			327,732.95	312,157.76	2.10
200,000.00	ALIBABA GROUP HOLDING LTD. 0.00% 15/09/2032	USD	166,988.56	156,503.09	1.05
200,000.00	BAIDU, INC. 0.00% 12/03/2032	USD	160,744.39	155,654.67	1.05
QUOTE DI OICR			3,720,245.21	3,859,136.50	25.97
Azioni di OICR			3,720,245.21	3,859,136.50	25.97
IRLANDA			3,171,174.30	3,274,726.50	22.04
Finanza			3,171,174.30	3,274,726.50	22.04
300,000.00	ISHARES IV PLC - ISHARES MSCI USA SCREENED UCITS ETF EUR (HEDGED) - (0.100%)	EUR	2,400,894.85	2,524,200.00	16.99
15,000.00	ISHARES VII PLC - ISHARES NASDAQ 100 UCITS ETF EUR (HEDGED) - (0.360%)	EUR	263,636.75	262,440.00	1.77
20,000.00	KRANESHARES ICAV - KRANESHARES CSI CHINA INTERNET UCITS ETF EUR - (0.750%)	EUR	252,993.44	226,400.00	1.52
850.00	ISHARES VII PLC - ISHARES MSCI CANADA UCITS ETF EUR - (0.480%)	EUR	215,305.10	222,445.00	1.50
150.00	ISHARES VII PLC - ISHARES MSCI CANADA UCITS ETF EUR - (0.480%)	EUR	38,344.16	39,241.50	0.26
LUSSEMBURGO			397,114.97	429,850.00	2.89
Finanza			397,114.97	429,850.00	2.89
8,500.00	UBS (LUX) FUND SOLUTIONS SICAV - UBS CORE MSCI JAPAN UCITS ETF -A- EUR - (0.120%)	EUR	236,002.95	254,830.00	1.71
10,000.00	BNP PARIBAS EASY SICAV - MSCI EMERGING MIN TE UCITS ETF EUR - (0.130%)	EUR	161,112.02	175,020.00	1.18

Il Comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Flexible Equity è partito il 10 aprile 2026.
Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Augustum Flexible Equity¹

PORTAFOGLIO TITOLI AL 30 GIUGNO 2026 IN EUR

Quantità	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	% Attivo Netto
GERMANIA			151,955.94	154,560.00	1.04
Finanza			151,955.94	154,560.00	1.04
20,000.00	ISHARES STOXX EUROPE 600 UCITS ETF (DE) EUR - (0.200%)	EUR	151,955.94	154,560.00	1.04
Totale del Portafoglio Titoli			11,800,984.37	12,027,362.74	80.95

Il Comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Flexible Equity è partito il 10 aprile 2026.
Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Augustum Flexible Equity¹**IMPEGNI SU ACQUISTO / VENDITA DI CONTRATTI FUTURES AL 30 GIUGNO 2026**

Valore nominale	Quantità	Acquisto / Vendita	Contratto	Scadenza	Valore di mercato al 30 Giugno 2026	Valuta	Plus/(minus) valenza non realizzata (EUR)	Impegno (EUR)
							-45,281.20	6,586,730.88
50	2	Acquisto	S&P 500 EMINI	18/09/2026	6,602.16	USD	4,316.45	660,215.99
			MSCI EMERGING MARKETS					
50	2	Acquisto	INDEX	18/09/2026	1,537.04	USD	-2,667.72	153,704.18
50	7	Acquisto	MSCI EAFE	18/09/2026	2,751.07	USD	-9,888.04	962,874.94
10	35	Acquisto	MSCI WORLD INDEX	18/09/2026	13,742.68	USD	-37,041.89	4,809,935.77

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

Il Comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Flexible Equity è partito il 10 aprile 2026.
Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Augustum Flexible Equity¹

CONTRATTI DI OPZIONI AL 30 GIUGNO 2026

Quantità	Acquisto /		Call/Put	Descrizione	Valuta	Costo di acquisto	Valore di mercato	Impegno (EUR)	
	Vendita								
CONTRATTI DI OPZIONI						33,019.62	29,198.35	0.00	
OPZIONI ACQUISTATE						33,019.62	29,198.35	0.00	
20	Acquisto	CALL	EURO STOXX 50 Index 6,500.00 18/09/2026			EUR	20,700.00	21,720.00	0.00
2	Acquisto	CALL	CME E-mini S&P 500 Index Futures 7,800.00 18/09/2026			USD	12,319.62	7,478.35	0.00

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

Il Comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Flexible Equity è partito il 10 aprile 2026.
Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NEW MILLENNIUM - Augustum Flexible Equity¹

CONTRATTI FINANZIARI A TERMINE AL 30 GIUGNO 2026

Scadenza	Ammontare comprato	Valuta comprata	Ammontare venduto	Valuta venduta	Plus/(minus)-valenza non realizzata (EUR)
					-48,039.32
22/07/2026	170,386.52	EUR	200,000.00	USD	-4,404.08
22/07/2026	423,428.43	EUR	500,000.00	USD	-13,548.07
22/07/2026	843,865.83	EUR	1,000,000.00	USD	-30,087.17

Le controparti sono indicate nella Nota 13.

Il Comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Flexible Equity è partito il 10 aprile 2026.
Le note allegate ai presenti rendiconti finanziari sono parte integrante degli stessi.

NOTE AI RENDICONTI FINANZIARI

1. INFORMAZIONI DI CARATTERE GENERALE

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

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

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

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

I comparti operativi al 30 Giugno 2026 sono i seguenti:

- NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond
- NEW MILLENNIUM - Euro Equities
- NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)
- NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term
- NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond
- NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate
- NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative
- NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible
- NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe
- NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond
- NEW MILLENNIUM - Alpha Active Allocation
- NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond
- NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity
- NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia
- NEW MILLENNIUM - Augustum Flexible Equity¹

¹Il Comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Flexible Equity è partito il 10 aprile 2026.

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

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

2. SOMMARIO DEI PRINCIPALI METODI CONTABILI

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

a) Valutazione del portafoglio titoli

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

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

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

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

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

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

c) Contratti di cambio a termine

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

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

d) Contratti Futures

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

e) Contratti di opzioni

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

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

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

f) Contratti Swap

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

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

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

g) Costo d'acquisto dei titoli in portafoglio

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

h) Ricavi

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

i) Conversioni delle voci in valute estere

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

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

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

j) Valore del Patrimonio Netto per Azione

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

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

k) Prospetto finanziario

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

l) Tassi di cambio

I principali tassi di cambio utilizzati al 30 Giugno 2026 sono:

1 EUR =	1.650260	AUD
1 EUR =	5.917664	BRL
1 EUR =	1.622057	CAD
1 EUR =	0.922243	CHF
1 EUR =	7.757748	CNY
1 EUR =	7.474896	DKK
1 EUR =	0.861406	GBP
1 EUR =	8.965816	HKD
1 EUR =	143.998646	ISK
1 EUR =	185.814847	JPY
1 EUR =	19.977740	MXN
1 EUR =	2.203710	NLG
1 EUR =	11.313526	NOK
1 EUR =	4.297494	PLN
1 EUR =	89.863387	RUB
1 EUR =	11.065030	SEK
1 EUR =	53.341237	TRY
1 EUR =	1.143300	USD
1 EUR =	18.738688	ZAR

m) Investimenti incrociati

Il Prospetto del Patrimonio Netto consolidato mostra un totale del Patrimonio Netto a EUR 938,400,581.22. Al 30 giugno 2026, i comparti NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond e il NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond hanno investito un valore totale di EUR 1,929,776.01 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 936,470,805.21.

3. REGIME FISCALE

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

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

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

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

4. ALTRE SPESE E TASSE

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

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

Comparti	Tasse di segnalazione	Commissioni dell'agente di collocamento	Tasse di autorità	Co Sponship	Spese varie	Totale
NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term	3,082.67	580.46	2,139.91	154.82	2,654.77	8,612.63
NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe	3,129.30	1,424.38	2,480.69	373.69	3,212.21	10,620.27
NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond ¹	1,749.10	208.62	2,182.01	28.30	19,981.90	24,149.93
NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia	3,041.64	369.07	2,056.49	96.54	2,514.58	8,078.32

¹ Il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond è stato chiuso il 3 febbraio 2026.

Le suddette spese varie sono composte da: diritti di licenza, diritti contributivi, diritti di regolamentazione e spese di quotazione.

5. COMMISSIONE DI GESTIONE

Il Gestore, la Società di Gestione ed i Gestori dei comparti ricevono una commissione di Gestione calcolata sulla base del Valore del Patrimonio Netto di ciascun Comparto del Fondo. Al 30 Giugno 2026, 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	I (H-CHF)	L	Y	Z
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	1.50%	1.50%	0.75%	0.60%	0.90%	0.75%	0.50%
NEW MILLENNIUM - Euro Equities	1.50%		0.70%		0.85%	0.70%	
NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)	1.60%		0.80%		0.95%		
NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term	0.55%	0.55%	0.30%		0.45%	0.30%	
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond	1.20%	1.20%	0.70%		0.85%		
NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate	0.90%	0.90%	0.45%		0.60%	0.45%	
NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative	1.10%		0.55%		0.70%		
NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible	1.35%		0.70%		0.95% ¹		
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 - Alpha Active Allocation	2.00%	2.00%	1.30%		1.45%		
NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond	1.70%		0.85%		1.00%		
NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity	1.80%		1.35%		1.50%		
NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia	1.20%		0.60%		0.75%		
NEW MILLENNIUM - Augustum Flexible Equity	1.80%		1.00%				

¹ La Commissione di gestione era 1,15% fino al 28 febbraio 2026 e 0,95% dal 1 marzo 2026.

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

6. COMMISSIONE DI CONSULENZA

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

7. COMMISSIONI SULLA PERFORMANCE

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

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

a) Per i Comparti con commissioni sulla performance assoluta:

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

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

b) Per i Comparti con commissioni sulla performance relative:

Per i Comparti:

NEW MILLENNIUM - Alpha Active Allocation
NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond¹
NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond

¹Il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond è stato chiuso il 3 febbraio 2026.

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

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

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

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

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

Per i Comparti:

NEW MILLENNIUM - Euro Equities
NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)
NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term
NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe
NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate
NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative
NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible
NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity
NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia
NEW MILLENNIUM - Augustum Flexible Equity¹

¹Il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Flexible Equity è partito il 10 aprile 2026.

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 Return EUR Hedged Index 5% BCE euro short-term Rate Index	20%
NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term	90% Bloomberg Barclays Euro Aggregate Government 1-3 Years Total Return Index EUR 10% Bloomberg Barclays Pan-European Corporate FRN Index Total Return Hedged EUR	15%
NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate	95% Bloomberg Euro Corporate Bonds 1-5 Years Total Return Index EUR 5% BCE euro short-term Rate Index	20%
NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative	20% Bloomberg World Large & Mid Cap Net Return Index EUR 50% Bloomberg Euro Aggregate Government 3-5 Years Total Return Index EUR 30% Bloomberg Global Aggregate Corporate 1-3 Years Total Return Index Value Hedged EUR	20%
NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible	Euribor 6M + 300 bps	10%
NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe	80% Bloomberg Barclays Euro Government Inflation-Linked Bond 3-5 Years Total Return Index 20% Bloomberg Barclays FRN Total Return Index EUR	15%
NEW MILLENNIUM - Alpha Active Allocation	70% Bloomberg Global Aggregate Total Return Index Value Hedged EUR 30% Bloomberg World Large & Mid Cap Net Return EUR Hedged Index	10%
NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond ¹	60% ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Years Global Government Excluding Euro Governments Index in LOC 40% ICE BofA Merrill Lynch 3-5 Years Global Government Excluding Euro Governments Index in LOC	20%
NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond	40% Bloomberg Barclays Global High Yield Total Return Index Value Hedged EUR 30% Bloomberg Barclays Pan-European High Yield Total Return Index Value Unhedged EUR 20% Bloomberg Barclays Euro Aggregate Corporate Total Return Index Value Unhedged EUR 10% BCE euro short-term Rate Index	20%
NEW MILLENNIUM – Multi Asset Opportunity	15% Bloomberg Europe Developed Markets Large & Mid Cap Net Return Index EUR 10% Bloomberg World Large & Mid Cap Net Return Index EUR 40% Bloomberg Euro Aggregate Government 3-5 Years Total Return Index EUR 25% Bloomberg Global Aggregate Corporate Total Return Index Value Hedged EUR 10% BCE euro short-term Rate Index	20%

Commissioni sulla performance relative	Benchmark	Percentuale
NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia	15% Bloomberg Italy Large & Mid Cap Net Return Index 25% Bloomberg Italy Small Cap Net Return Index 45% Bloomberg Euro Aggregate Corporate Italy Index Unhedged EUR 15% Bloomberg Euro Treasury/Corp Short Term Index EUR	20%
NEW MILLENNIUM - Augustum Flexible Equity ²	65% Bloomberg World Large & Mid Cap Net Return EUR Hedged Index 30% Bloomberg Global Aggregate Total Return Index Value Hedged EUR 5% BCE euro short-term Rate Index	20%

¹Il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond è stato chiuso il 3 febbraio 2026.

²Il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Flexible Equity è partito il 10 aprile 2026.

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

Comparti	Classe	Valuta	Importo della commissione di performance	Percentuale del valore del Patrimonio Netto della Classe a fine periodo
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	A	EUR	250,091.27	0.16%
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	A (H-USD)	USD	8,180.63	0.20%
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	D	EUR	34,060.42	0.17%
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	I	EUR	394,456.75	0.20%
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	I (H-CHF)	CHF	9,336.30	0.08%
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	L	EUR	625.06	0.19%
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	Z	EUR	10,616.01	0.21%
NEW MILLENNIUM - Euro Equities	A	EUR	10,217.61	0.25%
NEW MILLENNIUM - Euro Equities	I	EUR	92,365.36	0.31%
NEW MILLENNIUM - Euro Equities	L	EUR	371.97	0.32%
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond	A	EUR	18,047.27	0.04%
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond	A (H-USD)	USD	2,993.38	0.08%
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond	D	EUR	7,439.18	0.03%
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond	I	EUR	17,008.66	0.06%
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond	L	EUR	70.89	0.04%
NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond	A	EUR	20,114.95	0.08%
NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond	D	EUR	886.60	0.08%
NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond	I	EUR	29,872.63	0.13%

Comparti	Classe	Valuta	Importo della commissione di performance	Percentuale del valore del Patrimonio Netto della Classe a fine periodo
NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond	L	EUR	329.43	0.11%
NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond	A	EUR	1,106.84	0.05%
NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond	I	EUR	15,847.58	0.12%
NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond	L	EUR	99.99	0.12%
NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity	A	EUR	33.89	0.00%
NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity	I	EUR	2,265.17	0.05%
NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity	L	EUR	15,573.53	0.03%

8. COMMISSIONE DELLA BANCA DEPOSITARIA E DELL'AMMINISTRAZIONE CENTRALE

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

9. COMPENSI PROFESSIONALI

I compensi professionali sono principalmente composti da spese legali e spese di revisione.

10. LE AZIONI DEL FONDO

Le Classi di Azioni in circolazione al 30 Giugno 2026 sono le seguenti:

Comparti	Azioni in circolazione
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	A,A (H-CHF),A (H-USD),D,I,I (H-CHF) ¹ ,L,Z
NEW MILLENNIUM - Euro Equities	A,I,L
NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)	A,I,L
NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term	A,D,I,L,Y
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond	A,A (H-USD),D,I,L
NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate	A,D,I,L,Y
NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative	A,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 - Alpha Active Allocation	A,D,I,L
NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond	A,I,L
NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity	A,I,L
NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia	A,I,L
NEW MILLENNIUM - Augustum Flexible Equity	A ACC ² , I ³

¹NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond Classe I-CHF (Hedged) è attiva dall'8 aprile 2026.

²NEW MILLENNIUM - Augustum Flexible Equity Class A Acc è attiva dall'23 aprile 2026.

³NEW MILLENNIUM - Augustum Flexible Equity Class I è attiva dall'10 aprile 2026.

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 2026 è disponibile presso la sede sociale della Sicav.

12. COSTI DI TRANSAZIONE

Per il periodo che termina il 30 Giugno 2026, 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 2026, sono inclusi nel costo degli investimenti e ammontano ai seguenti importi (in EUR):

Comparti	Costi di transazione
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	473.44
NEW MILLENNIUM - Euro Equities	115,036.53
NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)	18,860.38
NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term	581.95
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond	97.44
NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate	24,549.50
NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative	64,935.71
NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible	20,033.10
NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe	4,353.45
NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond	0.00
NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing	0.00
NEW MILLENNIUM - Alpha Active Allocation	12,860.54
NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond ¹	0.00
NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond	873.48
NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity	10,085.69
NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia	27,364.23
NEW MILLENNIUM - Augustum Flexible Equity ²	2,019.62

¹ Il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond è stato chiuso il 3 febbraio 2026.

² Il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Flexible Equity è partito il 10 aprile 2026.

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 E CONTRATTI SWAP

Nell'esercizio finanziario in rassegna, alcuni comparti hanno stipulato contratti finanziari a termine su valute e contratti swap. Informazioni dettagliate relative alle posizioni aperte al 30 Giugno 2026 sono riportate in seguito ai Portafogli dei comparti interessati.

Le controparti per le posizioni aperte su contratti finanziari su cambi a termine sono Nomura International Plc., è per le posizioni aperte su credit default swap la controparte è J.P. Morgan SE.

Al 30 Giugno 2026 il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 2,195,895.44 da Nomura International Plc. come garanzia per i contratti finanziari a termine.

Al 30 Giugno 2026 il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 808,097.06 da J.P. Morgan SE come garanzia per i contratti swap.

Al 30 Giugno 2026 il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 482,655.75 da Nomura International Plc. come garanzia per i contratti finanziari a termine.

Al 30 Giugno 2026 il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 451,929.18 da J.P. Morgan SE come garanzia per i contratti swap.

Al 30 Giugno 2026 il comparto NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 158,434.53 da Nomura International Plc. come garanzia per i contratti finanziari a termine.

Al 30 Giugno 2026 il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond ha ricevuto un importo in denaro pari a EUR 280,689.87 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 e Z per il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond, per le Azioni D NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond, NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond, NEW MILLENNIUM - Alpha Active Allocation and NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond¹, per le Azioni Y per il comparto NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe, per le Azioni D e Y per i comparti NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term e NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate e' stato pagato come da tabella seguente, con la data dello stacco cedola al 2 Gennaio 2026 e data valuta 7 Gennaio 2026:

Il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond è stato chiuso il 3 febbraio 2026.

Comparti	Nome della classe	Dividendo per azione	Valuta	Somma da pagare
NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate	D	2.80	EUR	1,389.10
	Y	3.62	EUR	76.67
NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term	D	2.18	EUR	602.65
	Y	3.25	EUR	68.65
NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond	D	3.13	EUR	35,101.20
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	D	3.52	EUR	788,049.04
	Z	0.54	EUR	24,463.17
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond	D	2.21	EUR	664,089.83
NEW MILLENNIUM - Alpha Active Allocation	D	3.90	EUR	45.07
NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond ¹	D	2.72	EUR	4,772.00
NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe	Y	3.06	EUR	67,307.84

¹Il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond è stato chiuso il 3 febbraio 2026.

Un dividendo per le Azioni Z per il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond e' stato pagato come da tabella seguente, con la data dello stacco cedola al 1o aprile 2026 e data valuta 8 aprile 2026:

Comparti	Nome della classe	Dividendo per azione	Valuta	Somma da pagare
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	Z	0.94	EUR	42,584.04

Crisi Russia-Ucraina:

Continuano le tensioni tra Russia e Ucraina. Gran parte della comunità internazionale ha risposto con imposizioni economiche contro le persone russe (individui ed entità) che sono state inasprite nel corso dei mesi. I mercati finanziari hanno vissuto e potrebbero continuare a vivere esperienze significative di volatilità. I titoli emessi da entità russe e/o denominati in rubli hanno subito forti ribassi di valore come così come le restrizioni commerciali. Alcuni dei comparti gestiti detengono tali titoli: quando l'emittente e il titolo è soggetto a sanzione, è stata applicata una cancellazione totale, negli altri casi il titolo è stato valorizzato al fair value secondo la decisione del Consiglio di Amministrazione. Al 30 Giugno 2026, solo una obbligazione di un emittente russo è detenuta ed è attualmente soggetta a sanzione e quindi non negoziabile (XS2249778247 GTLK EUROPE CAPITAL DAC per il comparto Augustum Corporate Bond). Questo titolo è valutato a zero sulla base del fatto che non esiste un mercato attivo su cui il titolo può essere negoziato. Il Fondo ha posto in essere tramite l'attività di NATAM e dei suoi delegati, la misura adeguata per garantire il monitoraggio del rischio, sanzioni e antiriciclaggio.

Comparto chiuso nel corso del periodo:

Il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond è stato chiuso il 3 febbraio 2026.

Comparto partito nel corso del periodo:

Il Comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Flexible Equity è partito il 10 aprile 2026.

Classe chiusa nel corso del periodo:

NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond Classe A è inattiva dal 3 febbraio 2026 a seguito della liquidazione del Comparto.

NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond Classe D è inattiva dal 3 febbraio 2026 a seguito della liquidazione del Comparto.

NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond Classe I è inattiva dal 3 febbraio 2026 a seguito della liquidazione del Comparto.

NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond Classe L è inattiva dal 3 febbraio 2026 a seguito della liquidazione del Comparto.

Classe partita nel corso del periodo:

NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond Classe I-CHF (Hedged) è attiva dall'8 aprile 2026.

NEW MILLENNIUM - Augustum Flexible Equity Classe I è attiva dall'10 aprile 2026.

NEW MILLENNIUM - Augustum Flexible Equity Classe A Acc è attiva dall'23 aprile 2026.

15. EVENTI SUCCESSIVI

Il 6 luglio 2026, l'Autorità di vigilanza del settore finanziario lussemburghese (Commission de Surveillance du Secteur Financier - CSSF) ha approvato la creazione di un nuovo Comparto all'interno della SICAV, denominato NEW MILLENNIUM – AUGUSTUM MEDUSA FINANCIAL FLEX. Il lancio di questo Comparto è previsto per settembre 2026.

APPENDICE NON CERTIFICATA

1. ESPOSIZIONE GLOBALE E LIVELLO DI LEVA ATTESO

Nell'ambito del Processo di Gestione del Rischio, l'esposizione globale viene misurata e controllata tramite l'approccio VAR assoluto (determinato sulla base di un intervallo di confidenza del 99% e di un periodo di detenzione di 1 mese) o tramite l'approccio del commitment. Tutti i Comparti applicano l'approccio VAR assoluto, ad eccezione dei comparti NEW MILLENNIUM - Euro Equities e NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged) per i quali viene applicato l'approccio del commitment.

Periodo: 01.01-30.06.2026	Limite VaR	VaR			Riferimento
		% Utilizzo Limite VaR			
		Minimo	Medio	Massimo	
Fondo					
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	20.00%	7.30	12.30	18.58	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Euro Equities	20.00%	43.67	50.20	56.03	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)	20.00%	32.29	42.35	47.74	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term	20.00%	2.08	5.37	8.99	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond	20.00%	5.75	10.35	15.23	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate	20.00%	5.03	7.69	12.00	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative	20.00%	7.78	10.92	14.44	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible	20.00%	6.18	8.97	11.96	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe	20.00%	6.38	9.99	13.64	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond	20.00%	4.56	9.46	14.39	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Alpha Active Allocation	20.00%	14.53	19.07	25.52	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond1	20.00%	6.55	17.05	23.00	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond	20.00%	8.19	17.46	30.30	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity	20.00%	11.43	14.69	20.10	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia	20.00%	16.74	19.50	24.23	Absolute VaR
NEW MILLENNIUM - Augustum Flexible Equity2	20.00%	28.66	33.84	38.59	Absolute VaR

¹Il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond è stato chiuso il 3 febbraio 2026.

²Il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Flexible Equity è partito il 10 aprile 2026.

La leva finanziaria è calcolata sulla base della metodologia della somma dei nozionali come indicato nelle linee guida emanate dall'ESMA, ad eccezione dei Comparti NEW MILLENNIUM - Euro Equities e NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged) per i quali viene applicato il metodo degli impegni.

Fondo	Leva					
	Somma dei nozionali			Metodo degli impegni		
	Min	Medio	Max	Min	Medio	Max
NEW MILLENNIUM - Augustum Corporate Bond	49.31	62.93	117.05	0.36	12.42	21.40
NEW MILLENNIUM - Euro Equities	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
NEW MILLENNIUM - Global Equities (Eur Hedged)	0.00	0.00	0.00	0.00	3.96	9.61
NEW MILLENNIUM - Euro Bonds Short Term	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00

Fondo	Leva					
	Somma dei nozionali			Metodo degli impegni		
	Min	Medio	Max	Min	Medio	Max
NEW MILLENNIUM - Augustum High Quality Bond	31.40	47.43	100.11	0.00	3.40	12.45
NEW MILLENNIUM - Large Europe Corporate	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
NEW MILLENNIUM - Balanced World Conservative	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
NEW MILLENNIUM - Total Return Flexible	16.70	22.77	56.49	0.00	1.44	9.94
NEW MILLENNIUM - Inflation Linked Bond Europe	0.00	0.02	3.01	0.00	0.00	0.00
NEW MILLENNIUM - Augustum Italian Diversified Bond	2.11	7.93	18.91	0.17	0.52	0.73
NEW MILLENNIUM - Augustum Market Timing	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
NEW MILLENNIUM - Alpha Active Allocation	75.03	81.49	94.35	9.50	29.41	35.86
NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond ¹	14.83	31.35	68.01	0.00	0.00	0.00
NEW MILLENNIUM - Evergreen Global High Yield Bond	25.76	32.04	69.65	0.08	0.62	0.84
NEW MILLENNIUM - Multi Asset Opportunity	9.04	10.75	12.67	3.60	8.06	11.31
NEW MILLENNIUM - PIR Bilanciato Sistema Italia	0.01	0.01	0.02	0.00	0.00	0.00
NEW MILLENNIUM - Augustum Flexible Equity ²	60.28	74.32	96.71	0.73	38.98	64.61

¹Il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Extra Euro High Quality Bond è stato chiuso il 3 febbraio 2026.

²Il comparto NEW MILLENNIUM - Augustum Flexible Equity è partito il 10 aprile 2026.

2. REGOLAMENTO DELLE TRANSAZIONI DI TITOLI FINANZIARI

Securities Financing Transaction Regulation (SFTR) 2015/2365 sulla trasparenza delle operazioni di finanziamento tramite titoli e del riutilizzo, è entrato in vigore il 12 Gennaio 2016 e introduce nuovi obblighi di informativa per le operazioni di finanziamento di titoli e per gli swap total return.

Un'operazione di finanziamento tramite titoli finanziari è definita dall' articolo 3 (11) del SFTR come:

- contratti con patto di riacquisto / riacquisto inverso
- la concessione e assunzione di titoli o merci in prestito
- un'operazione di buy-sell-back o di sell-buy back
- un finanziamento con margini

Al 30 Giugno 2025 la SICAV non è impattata dal regolamento sulle operazioni di finanziamento tramite titoli (SFTR).

4. PROMOZIONE DELLE CARATTERISTICHE AMBIENTALI O SOCIALI

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

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

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

I comparti classificati ai sensi dell'art. 8 SFDR

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

I comparti classificati ai sensi dell'art. 6 SFDR

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

APPENDICE NON AUDITATA PER INVESTITORI SVIZZERI

1. Performance e TER

Fondo	Classe	Performance YTD	Benchmark YTD	TER	Performance Fee (%)
Augustum Corporate Bond	A	1.51	1.27	1.91	0.16
Augustum Corporate Bond	A (H-CHF)	-0.41	1.27	2.59	0.00
Augustum Corporate Bond	A (H-USD)	2.03	1.27	2.29	0.20
Augustum Corporate Bond	D	1.50	1.27	1.92	0.17
Augustum Corporate Bond	I	1.87	1.27	1.16	0.20
Augustum Corporate Bond	I (H-CHF) ¹	1.30	1.30	1.12	0.08
Augustum Corporate Bond	L	1.77	1.27	1.34	0.19
Augustum Corporate Bond	Y	-	-	-	-
Augustum Corporate Bond	Z	1.95	1.27	0.93	0.21
Euro Equities	A	12.67	11.70	2.27	0.25
Euro Equities	I	13.03	11.70	1.48	0.31
Euro Equities	L	12.91	11.70	1.71	0.32
Euro Equities	Y	-	-	-	-
Global Equities (Eur Hedged)	A	7.88	9.04	1.99	0.00
Global Equities (Eur Hedged)	I	8.33	9.04	1.15	0.00
Global Equities (Eur Hedged)	L	8.23	9.04	1.34	0.00
Euro Bonds Short Term	A	0.25	0.61	1.54	0.00
Euro Bonds Short Term	D	0.24	0.61	1.59	0.00
Euro Bonds Short Term	I	0.40	0.61	1.30	0.00
Euro Bonds Short Term	L	0.31	0.61	1.48	0.00
Euro Bonds Short Term	Y	-	-	-	-
Augustum High Quality Bond	A	0.39	0.90	1.50	0.04
Augustum High Quality Bond	A (H-USD)	1.00	0.90	1.82	0.08
Augustum High Quality Bond	D	0.39	0.90	1.49	0.03
Augustum High Quality Bond	I	0.64	0.90	0.98	0.06
Augustum High Quality Bond	L	0.54	0.90	1.17	0.04
Augustum High Quality Bond	Y	-	-	-	-
Large Europe Corporate	A	0.40	0.99	1.20	0.00
Large Europe Corporate	D	0.39	0.99	1.19	0.00
Large Europe Corporate	I	0.64	0.99	0.71	0.00
Large Europe Corporate	L	0.55	0.99	0.90	0.00
Large Europe Corporate	Y	0.69	0.99	0.60	0.00
Balanced World Conservative	A	1.94	3.25	1.68	0.00
Balanced World Conservative	D	-	-	-	-
Balanced World Conservative	I	2.24	3.25	1.10	0.00
Balanced World Conservative	L	2.15	3.25	1.28	0.00
Total Return Flexible	A	-0.43	2.66	1.93	0.00
Total Return Flexible	I	-0.09	2.66	1.53	0.00
Total Return Flexible	L	-0.26	2.66	1.24	0.00
Inflation Linked Bond Europe	A	1.77	2.25	1.31	0.00
Inflation Linked Bond Europe	I	2.00	2.25	0.87	0.00
Inflation Linked Bond Europe	L	1.90	2.25	1.06	0.00
Inflation Linked Bond Europe	Y	2.00	2.25	0.87	0.00
Augustum Italian Diversified Bond	A	0.74	1.01	1.87	0.08
Augustum Italian Diversified Bond	D	0.74	1.01	1.87	0.08
Augustum Italian Diversified Bond	I	1.09	1.01	1.14	0.13
Augustum Italian Diversified Bond	L	1.00	1.01	1.31	0.11
Augustum Italian Diversified Bond	Y	-	-	-	-
Alpha Active Allocation	A	-0.55	3.46	2.26	0.00
Alpha Active Allocation	D	-0.63	3.46	1.67	0.00
Alpha Active Allocation	I	-0.18	3.46	2.09	0.00
Alpha Active Allocation	L	-0.26	3.46	1.49	0.00

Fondo	Classe	Performance YTD	Benchmark YTD	TER	Performance Fee (%)
Evergreen Global High Yield Bond	A	1.90	1.67	2.40	0.05
Evergreen Global High Yield Bond	I	2.20	1.67	1.64	0.12
Evergreen Global High Yield Bond	L	2.13	1.67	1.80	0.12
Multi Asset Opportunity	A	3.45	3.41	2.13	0.00
Multi Asset Opportunity	I	3.65	3.41	1.69	0.05
Multi Asset Opportunity	L	3.56	3.41	1.86	0.03
PIR Bilanciato Sistema Italia	A	1.88	4.71	2.98	0.00
PIR Bilanciato Sistema Italia	I	2.19	4.71	2.36	0.00
PIR Bilanciato Sistema Italia	L	2.09	4.71	2.54	0.00
Augustum Flexible Equity	A ²	3.25	4.01	2.50	0.00
Augustum Flexible Equity	I ³	6.00	6.19	1.76	0.00

¹Data di lancio 8 Aprile 2026.

²Data di lancio 23 Aprile 2026.

³Data di lancio 10 Aprile 2026.