



ATTESTATION DU COMMISSAIRE AUX COMPTES
Composition de l'actif au 30 juin 2023

AFER PREMIUM

FONDS PROFESSIONNEL A VOCATION GENERALE CONSTITUE SOUS FORME DE SOCIETE
D'INVESTISSEMENT A CAPITAL VARIABLE

Régi par le Code monétaire et financier

Société de gestion

Rothschild & Co Asset Management
29, avenue de Messine
75008 PARIS

En notre qualité de commissaire aux comptes du fonds professionnel à vocation générale constitué sous forme de société d'investissement à capital variable AFER PREMIUM, et en application des dispositions de l'article L.214-24-49 du Code monétaire et financier et de l'article 422-83 du Règlement général de l'Autorité des marchés financiers relatives au contrôle de la composition de l'actif, nous avons établi la présente attestation sur les informations figurant dans la composition de l'actif au 30 juin 2023 ci-jointe.

Ces informations ont été établies sous la responsabilité de la société de gestion. Il nous appartient de nous prononcer sur la cohérence des informations contenues dans la composition de l'actif avec la connaissance que nous avons du fonds professionnel à vocation générale constitué sous forme de société d'investissement à capital variable acquise dans le cadre de notre mission de certification des comptes annuels.

Nous avons mis en œuvre les diligences que nous avons estimé nécessaires au regard de la doctrine professionnelle de la Compagnie nationale des commissaires aux comptes relative à cette mission. Ces diligences, qui ne constituent ni un audit ni un examen limité, ont consisté essentiellement à réaliser des procédures analytiques et des entretiens avec les personnes qui produisent et contrôlent les informations données.

Sur la base de nos travaux, nous n'avons pas d'observation à formuler sur la cohérence des informations figurant dans le document joint avec la connaissance que nous avons du fonds professionnel à vocation générale constitué sous forme de société d'investissement à capital variable acquise dans le cadre de notre mission de certification des comptes annuels.

Sans remettre en cause la conclusion exprimée ci-dessus, nous attirons votre attention sur la note annexe au document joint, décrivant les modalités de valorisation de titres émis ou exposés à des émetteurs Russes.

Neuilly sur Seine, date de la signature électronique

Document authentifié par signature électronique

Le commissaire aux comptes
PricewaterhouseCoopers Audit

Frédéric SELLAM

.....
PricewaterhouseCoopers Audit, 63, rue de Villiers, 92208 Neuilly-sur-Seine Cedex
T: +33 (0) 1 56 57 58 59, F: +33 (0) 1 56 57 58 60, www.pwc.fr

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 640063 AFER PREMIUM

VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : NPC - TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVAL04)

| V A L E U R | STATUTS DOSSIER VAL/LIGNE | QUANTITE ET EXPR. QUANTITE | DEV COT | P.R.U EN DEVISE ET EXPR. COURS | DATE COTA | COURS VALEUR | I F | <-----> PRIX REVIENT TOTA | Devise du portefeuille VALEUR BOURSIERE | COUPON COURU TOTA | >-----> PLUS OU MOINS VAL | PRCT ACT NET |
|-------------|------------------------------|-------------------------------|------------|-----------------------------------|--------------|-----------------|--------|------------------------------|--|-------------------|------------------------------|-----------------|
|-------------|------------------------------|-------------------------------|------------|-----------------------------------|--------------|-----------------|--------|------------------------------|--|-------------------|------------------------------|-----------------|

III - Titres d'OPCVM

FCPR - FCPI - FIP

DEVISE VALEUR : EUR EURO

| | | | | | | | | | | | | |
|--|---------------------|---------|-------|--------|------------|-----------|---|--------------|--------------|------|--------------|------|
| FR0013426798 | CAP ENTREPREN 2 A | 1,920. | P EUR | 943.75 | M 30/06/23 | 1105.8907 | E | 1,812,000.00 | 2,123,310.14 | 0.00 | 311,310.14 | 0.75 |
| XFCS00X2MMX4 | F.ARROWS PRI EQT I1 | 60,000. | P EUR | 59.667 | M 30/06/23 | 74.676 | E | 3,580,019.50 | 4,480,560.00 | 0.00 | 900,540.50 | 1.58 |
| SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO | | | | | | | | | | | | |
| CUMUL (EUR) | | | | | | | | 5,392,019.50 | 6,603,870.14 | 0.00 | 1,211,850.64 | 2.34 |

OPCVM français à vocation générale

DEVISE VALEUR : EUR EURO

| | | | | | | | | | | | | |
|--|----------------------|----------|-------|-------------|------------|------------|---|---------------|---------------|------|--------------|-------|
| IT0005250847 | AGRITALY B | 3. | P EUR | 482046.8867 | M 08/02/23 | 462750.7 | V | 1,446,140.66 | 1,388,252.10 | 0.00 | -57,888.56 | 0.49 |
| FR0013401098 | ARD BUY FD VII A-A1 | 2,100.09 | P EUR | 857.6712 | M 31/03/23 | 1087.3182 | M | 1,801,186.62 | 2,283,466.08 | 0.00 | 482,279.46 | 0.81 |
| FR0000978371 | AXA IM EURO 4DEC | 629. | P EUR | 44497.7065 | M 29/06/23 | 44923.9885 | 0 | 27,989,057.36 | 28,257,188.77 | 0.00 | 268,131.41 | 10.00 |
| FR0010838722 | CPR FOCUS INFLAT. I | 53,470. | P EUR | 155.6193 | M 29/06/23 | 162.18 | 5 | 8,320,961.48 | 8,671,764.60 | 0.00 | 350,803.12 | 3.07 |
| FR001400C8U2 | FAPEP I11 SLP A2 | 30,000. | P EUR | 10. | M 22/05/23 | 10. | M | 300,000.00 | 300,000.00 | 0.00 | 0.00 | 0.11 |
| FR0012353407 | HSBC EURO ACTIONS I | 3,559. | P EUR | 1587.7892 | M 29/06/23 | 1622.3 | 5 | 5,650,941.65 | 5,773,765.70 | 0.00 | 122,824.05 | 2.04 |
| FR0010839555 | R-CO CVICT EQ VAL I | 42. | P EUR | 174848.091 | M 29/06/23 | 188580.03 | 5 | 7,343,619.82 | 7,920,361.26 | 0.00 | 576,741.44 | 2.80 |
| FR0013417532 | R-CO VALOR BOND OPPI | 16,538. | P EUR | 1063.5761 | M 29/06/23 | 1069.54 | 5 | 17,589,421.52 | 17,688,052.52 | 0.00 | 98,631.00 | 6.26 |
| SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO | | | | | | | | | | | | |
| CUMUL (EUR) | | | | | | | | 70,441,329.11 | 72,282,851.03 | 0.00 | 1,841,521.92 | 25.57 |

DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US

| | | | | | | | | | | | | |
|--------------|----------------------|----------|-------|------|------------|------|---|--------------|--------------|------|------------|------|
| FR00140077L6 | RMM US 1 SLP Command | 15,172.5 | P USD | 100. | M 30/05/23 | 100. | M | 1,418,567.63 | 1,396,328.00 | 0.00 | -22,239.63 | 0.49 |
|--------------|----------------------|----------|-------|------|------------|------|---|--------------|--------------|------|------------|------|

OPCVM européens coordonnés et assimilables

DEVISE VALEUR : EUR EURO

| | | | | | | | | | | | | |
|--|----------------------|---------------|-------|------------|------------|-----------|---|----------------|----------------|------|-------------|-------|
| LU1883337708 | 5919 I2EURC | 7,261. | P EUR | 2075.6908 | M 30/06/23 | 2018.89 | Y | 15,071,590.62 | 14,659,160.29 | 0.00 | -412,430.33 | 5.19 |
| LU0235308482 | ALKEN EU OPP RC | 9,741. | P EUR | 303.4912 | M 29/06/23 | 293.88 | 0 | 2,956,308.06 | 2,862,685.08 | 0.00 | -93,622.98 | 1.01 |
| LU1681047236 | AMUNDI ETF EURO | 54,513. | P EUR | 105.02 | M 30/06/23 | 108.3277 | 5 | 5,724,955.26 | 5,905,267.91 | 0.00 | 180,312.65 | 2.09 |
| FR0000985558 | AVIVA INV.MON.C 4D | 7,525. | P EUR | 2226.3669 | M 29/06/23 | 2243.45 | 0 | 16,753,410.77 | 16,881,961.25 | 0.00 | 128,550.48 | 5.97 |
| FR0013289535 | BDL CONVICTIONS I | 4,493. | P EUR | 1195.5628 | M 29/06/23 | 1262.52 | 5 | 5,371,663.60 | 5,672,502.36 | 0.00 | 300,838.76 | 2.01 |
| FR0011790492 | BDL REMPART PART I | 58,389. | P EUR | 136.3123 | M 29/06/23 | 143.7 | 5 | 7,959,136.81 | 8,390,499.30 | 0.00 | 431,362.49 | 2.97 |
| LU0225310266 | BLUEB.INV.GRA.I C. | 101,508. | P EUR | 178.079 | M 29/06/23 | 169.48 | 0 | 18,076,440.39 | 17,203,575.84 | 0.00 | -872,864.55 | 6.09 |
| LU1753045928 | BNPP E MSCI Japan SR | 512,422. | P EUR | 22.3533 | M 29/06/23 | 21.7776 | Y | 11,454,322.69 | 11,159,321.35 | 0.00 | -295,001.34 | 3.95 |
| LU0284395984 | DNCA IN VAL EU IC | 26,918. | P EUR | 199.6148 | M 29/06/23 | 214.81 | 0 | 5,373,232.48 | 5,782,255.58 | 0.00 | 409,023.10 | 2.05 |
| FR0010383448 | ECHIQUIER CONV.EUR.I | 3,122. | P EUR | 1375.57 | M 29/06/23 | 1372.37 | 0 | 4,294,529.54 | 4,284,539.14 | 0.00 | -9,990.40 | 1.52 |
| LU0259348570 | ENCORE+ FD-AEUR | 4,078,499.404 | P EUR | 0.928 | M 31/05/23 | 0.8578 | 0 | 3,784,764.11 | 3,498,536.79 | 0.00 | -286,227.32 | 1.24 |
| IE00B3Q19T94 | EURO STOXX OPTIM ETF | 80,000. | P EUR | 61.93 | M 29/06/23 | 72.4494 | Y | 4,954,400.52 | 5,795,952.00 | 0.00 | 841,551.48 | 2.05 |
| LU0804756087 | Em.Mkts Local Cur.C | 225,898. | P EUR | 71.217 | M 30/06/23 | 73.08 | 0 | 16,087,769.60 | 16,508,625.84 | 0.00 | 420,856.24 | 5.84 |
| LU0571100584 | G FUND EUROPEAN CONV | 2,909. | P EUR | 1532.3719 | M 29/06/23 | 1514.38 | 5 | 4,457,669.92 | 4,405,331.42 | 0.00 | -52,338.50 | 1.56 |
| FR0000098683 | LAZ CV GB Act PC eur | 2,619. | P EUR | 1705.9608 | M 29/06/23 | 1732.04 | 5 | 4,467,911.38 | 4,536,212.76 | 0.00 | 68,301.38 | 1.60 |
| FR0013311446 | LAZARD CAPI SC EUR | 1,065. | P EUR | 11964.3184 | M 29/06/23 | 11293.29 | 5 | 12,741,999.05 | 12,027,353.85 | 0.00 | -714,645.20 | 4.25 |
| LU1437625723 | Moonstone Lending 1 | 15,769.968 | P EUR | 126.8233 | M 31/05/23 | 127.59 | 0 | 2,000,000.00 | 2,012,090.22 | 0.00 | 12,090.22 | 0.71 |
| LU2016896511 | R-co 4C IF ICEH | 2,956.387 | P EUR | 1014.7521 | M 31/05/23 | 1040.3 | 5 | 3,000,000.00 | 3,075,529.40 | 0.00 | 75,529.40 | 1.09 |
| LU1850108306 | TIKEHAU DI IV 1ST LI | 257.87 | P EUR | 6898.2597 | M 30/06/23 | 7426.5939 | E | 1,778,854.22 | 1,915,095.77 | 0.00 | 136,241.55 | 0.68 |
| SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO | | | | | | | | | | | | |
| CUMUL (EUR) | | | | | | | | 146,308,959.02 | 146,576,496.15 | 0.00 | 267,537.13 | 51.85 |

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

PORTEFEUILLE : 640063 AFER PREMIUM

VL VALIDEE

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : NPC - TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVAL04)

| V A L E U R | STATUTS DOSSIER VAL/LIGNE | QUANTITE ET EXPR. QUANTITE | DEV COT | P. R. U EN DEVISE ET EXPR. COURS | DATE COTA | COURS VALEUR | I F | <-----> PRIX REVIENT TOTA | Devise du portefeuille VALEUR BOURSIERE | COUPON COURU TOTA | >-----> PLUS OU MOINS VAL | PRCT ACT NET | |
|---|------------------------------|-------------------------------|------------|-------------------------------------|--------------|-----------------|--------|------------------------------|--|-------------------|------------------------------|-----------------|-------|
| DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US | | | | | | | | | | | | | |
| IE0031814852 | FIRST ST GR CH I | 52,048. | P USD | 123.4914 | M 30/06/23 | 118.3349 | 0 | 6,079,465.40 | 5,668,226.47 | 0.00 | -411,238.93 | 2.00 | |
| LU0345776172 | IGS ASIAN I C.3DEC | 194,608. | P USD | 31.3766 | M 30/06/23 | 32.06 | Y | 5,802,664.49 | 5,741,885.22 | 0.00 | -60,779.27 | 2.03 | |
| LU2018762653 | LYX US CURVE ST | 70,000. | P EUR | 90.0966 | M 30/06/23 | 81.99 | N | 5,794,523.00 | 5,739,300.00 | 0.00 | -55,223.00 | 2.03 | |
| LU1378878604 | MSIF AS OPP ZC | 129,631. | P USD | 55.4537 | M 30/06/23 | 48.28 | 0 | 6,560,159.52 | 5,759,787.12 | 0.00 | -800,372.40 | 2.04 | |
| LU1079841513 | OSS SHL BRC CP \$ | 5,227. | P USD | 1089.3182 | M 29/06/23 | 1184.582 | Y | 4,943,328.70 | 5,698,334.35 | 0.00 | 755,005.65 | 2.02 | |
| LU0429319774 | TROME-US EQ-I-A | 62,134. | P USD | 54.542 | M 30/06/23 | 55.47 | 0 | 3,114,780.54 | 3,171,887.52 | 0.00 | 57,106.98 | 1.12 | |
| LU0225244705 | WPS SELECT GROWTH IC | 923. | P USD | 10018.5339 | M 29/06/23 | 10719.6411 | 0 | 8,418,236.50 | 9,105,677.10 | 0.00 | 687,440.60 | 3.22 | |
| SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US | | | | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | CUMUL (EUR) | 40,713,158.15 | 40,885,097.78 | 0.00 | 171,939.63 | 14.46 |
| Autres OPC cotés | | | | | | | | | | | | | |
| DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US | | | | | | | | | | | | | |
| IE00B5V87390 | ISHR RUS ADR/GDR | 68,819. | P USD | 132.4929 | M 09/03/22 | 0. | E | 9,118,028.36 | 0.00 | 0.00 | -9,118,028.36 | 0.00 | |
| III - Titres d'OPCVM | | | | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | CUMUL (EUR) | 273,392,061.77 | 267,744,643.10 | 0.00 | -5,647,418.67 | 94.71 |
| VI - ENGAGEMENTS SUR MARCHES A TERME | | | | | | | | | | | | | |
| Engagements à terme fermes | | | | | | | | | | | | | |
| Futures étrangers | | | | | | | | | | | | | |
| SOUS-JACENT : NDX NASDAQ 100 INDEX | | | | | | | | | | | | | |
| INQ___U3 | NQ USA NASDAQ 0923 | -50. | USD | 15097.8 | M 30/06/23 | 15337. | 4 | 0.00 | -220,136.20 | 0.00 | -220,136.20 | -0.08 | |
| SOUS-JACENT : SX5E DJ STOXX50 E | | | | | | | | | | | | | |
| IVG___U3 | EURO STOXX 50 0923 | 40. | EUR | 4415. | M 30/06/23 | 4427. | 4 | 0.00 | 4,800.00 | 0.00 | 4,800.00 | 0.00 | |
| Futures étrangers | | | | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | CUMUL (EUR) | 0.00 | -215,336.20 | 0.00 | -215,336.20 | -0.08 |
| VIII - TRESORERIE | | | | | | | | | | | | | |
| Dettes et créances | | | | | | | | | | | | | |
| Deposit | | | | | | | | | | | | | |
| DEVISE VALEUR : EUR EURO | | | | | | | | | | | | | |
| DGMCI EUR | Dépôt gar. CACEIS BK | 135,342.8 | EUR | 1. | 30/06/23 | 1. | | 135,342.80 | 135,342.80 | 0.00 | 0.00 | 0.05 | |
| DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US | | | | | | | | | | | | | |
| DGMCI USD | Dépôt gar. CACEIS BK | 1,201,200. | USD | 0.94126532 | 30/06/23 | 0.92030186 | | 1,130,647.90 | 1,105,466.59 | 0.00 | -25,181.31 | 0.39 | |

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 640063 AFER PREMIUM

VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : NPC - TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVAL04)

| V | A | L | E | U | R | STATUTS | DOSSIER | QUANTITE ET | DEV | P. R. U EN DEVISE | DATE | COURS | I | <-----> | Devise du portefeuille | | | >-----> | PRCT | | |
|---|-----|--------|-------|------------|---|-----------|---------|----------------|-----|-------------------|----------|-------------|---|----------------|------------------------|----------------|--------------|-------------------|-------------------|---------------|--------|
| | | | | | | VAL/LIGNE | | EXPR. QUANTITE | COT | ET EXPR. COURS | COTA | VALEUR | F | PRIX | REVIENT TOTA | VALEUR | BOURSIERE | COUPON COURU TOTA | PLUS OU MOINS VAL | ACT NET | |
| Deposit | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | CUMUL (EUR) | | 1,265,990.70 | | 1,240,809.39 | | 0.00 | | -25,181.31 | 0.44 |
| Appels de marge | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| <i>DEVISE VALEUR : EUR EURO</i> | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| MARCI | EUR | Appel | Marge | CACEIS | | | | -4,800. | EUR | 1. | 30/06/23 | 1. | | | -4,800.00 | | -4,800.00 | | 0.00 | 0.00 | |
| <i>DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US</i> | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| MARCI | USD | Appel | Marge | CACEIS | | | | 239,200. | USD | 0.92023512 | 30/06/23 | 0.92030186 | | | 220,120.24 | | 220,136.20 | | 0.00 | 15.96 | |
| Appels de marge | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | CUMUL (EUR) | | 215,320.24 | | 215,336.20 | | 0.00 | | 15.96 | 0.08 |
| Frais de gestion | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| <i>DEVISE VALEUR : EUR EURO</i> | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| FGANNEURD1 | | Prov | frais | annexes | | | | -797,476.87 | EUR | 1. | 30/06/23 | 1. | | | -797,476.87 | | -797,476.87 | | 0.00 | 0.00 | |
| FGPREUR | | Frais | gest. | rétro. | | | | 36,371.62 | EUR | 1. | 30/06/23 | 1. | | | 36,371.62 | | 36,371.62 | | 0.00 | 0.00 | |
| FGPVFEUR | | Frais | de | Gest. Fixe | | | | -100,043.2 | EUR | 1. | 30/06/23 | 1. | | | -100,043.20 | | -100,043.20 | | 0.00 | 0.00 | |
| <i>SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO</i> | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | CUMUL (EUR) | | -861,148.45 | | -861,148.45 | | 0.00 | | 0.00 | -0.30 |
| Dettes et créances | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | CUMUL (EUR) | | 620,162.49 | | 594,997.14 | | 0.00 | | -25,165.35 | 0.21 |
| Disponibilités | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Avoirs en france | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| <i>DEVISE VALEUR : EUR EURO</i> | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| BQCI | EUR | CACEIS | Bank | | | | | 4,771,228.9 | EUR | 1. | 30/06/23 | 1. | | | 4,771,228.90 | | 4,771,228.90 | | 0.00 | 0.00 | |
| <i>DEVISE VALEUR : GBP LIVRE STERLING</i> | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| BQCI | GBP | CACEIS | Bank | | | | | 461,068.1 | GBP | 1.1691186 | 30/06/23 | 1.16512094 | | | 539,043.29 | | 537,200.10 | | 0.00 | -1,843.19 | |
| <i>DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US</i> | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| BQCI | USD | CACEIS | Bank | | | | | 10,080,510.9 | USD | 0.91956538 | 30/06/23 | 0.92030186 | | | 9,269,688.84 | | 9,277,112.92 | | 0.00 | 7,424.08 | |
| Avoirs en france | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | CUMUL (EUR) | | 14,579,961.03 | | 14,585,541.92 | | 0.00 | | 5,580.89 | 5.16 |
| VIII - TRESORERIE | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | CUMUL (EUR) | | 15,200,123.52 | | 15,180,539.06 | | 0.00 | | -19,584.46 | 5.37 |
| PORTEFEUILLE : AFER PREMIUM (640063) | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | (EUR) | | 288,592,185.29 | | 282,709,845.96 | | 0.00 | | -5,882,339.33 | 100.00 |

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

PORTEFEUILLE : 640063 AFER PREMIUM

VL VALIDEE

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : NPC - TRI AMF/TYPER INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVAL04)

Portefeuille titres : 267,529,306.9

Frais de gestion du jour

Prov frais annexes : 16,576.43 EUR

Frais de Gest. Fixe : 2,379.38 EUR

Frais de gestion charge Entreprise

Frais maximum notice : 22,928.14 EUR

| Part | Devise | Actif net | Nombre de parts | Valeur liquidative | Coefficient | Coeff resultat | Change | Prix std Souscript. | Prix std Rachat |
|--------------------------------|--------|----------------|-----------------|--------------------|-------------|----------------|--------|---------------------|-----------------|
| D1 FR0013358389 AFER PREMIUM R | EUR | 282,709,845.96 | 2,549,829. | 110.87 | 100. | | | 116.41 | 110.87 |

Actif net total en EUR : 282,709,845.96

Precedente VL en date du 28/06/23 :

| | | | | | | |
|----|----------------|------------|--------|-------|-------------|---------|
| D1 | AFER PREMIUM R | Prec. VL : | 110.49 | (EUR) | Variation : | +0.344% |
|----|----------------|------------|--------|-------|-------------|---------|

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

PORTEFEUILLE : 640063 AFER PREMIUM

VL VALIDEE

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : NPC - TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVAL04)

COURS DES DEVICES UTILISEES

| | par la valorisation | | par l'inventaire | | par la valorisation précédente | variation | |
|--------------------|---------------------|------------|------------------|----|--------------------------------|---------------------|----------|
| Cours EUR en GBP : | 0.85828 | cotation : | 30/06/23 | 0. | 0.8642 | cotation : 28/06/23 | -0.68503 |
| Cours EUR en USD : | 1.0866 | cotation : | 30/06/23 | 0. | 1.0938 | cotation : 28/06/23 | -0.65826 |

COURS INVERSEES DES DEVICES UTILISEES

| | par la valorisation | | par l'inventaire | | par la valorisation précédente | |
|--------------------|---------------------|------------|------------------|----|--------------------------------|---------------------|
| Cours GBP en EUR : | 1.1651209395 | cotation : | 30/06/23 | 0. | 1.157139551 | cotation : 28/06/23 |
| Cours USD en EUR : | 0.920301859 | cotation : | 30/06/23 | 0. | 0.9142439202 | cotation : 28/06/23 |

Annexe

La crise liée au conflit entre la Russie et l'Ukraine crée des conditions particulières pour la valorisation des instruments financiers exposés à ces pays. En effet, la société de gestion a été conduite à mettre en place une politique de valorisation particulière pour ces instruments afin de tenir compte :

- de la fermeture de marchés financiers de certains pays,
- des incertitudes pesant sur les recouvrements à venir de titres de créances sur ces états,
- des incertitudes pesant sur les recouvrements à venir de titres de créances d'entreprises dont le siège social se situe dans ces pays, ou dont l'activité est significativement exposée ou dépendante de ces pays.
- des mesures exceptionnelles prises dans le cadre des sanctions contre la Russie,

Compte tenu de la nature des titres dans le portefeuille de la SICAV AFER PREMIUM la société de gestion a décidé de les valoriser à zéro depuis le 09/03/22.

Les évaluations ainsi retenues présentent des incertitudes et ne sauraient présenter le même degré de précision que celles provenant de cours issus de cotations sur des marchés réglementés. En conséquence, il pourrait exister un écart significatif entre les valeurs retenues, évaluées comme indiqué ci-dessus, et les prix auxquels seraient effectivement réalisées les cessions si une part de ces actifs en portefeuille devait être cédée à brève échéance. La valeur de ces titres peut également dépendre d'éventuels recouvrement à venir.

AFER PREMIUM

DOCUMENT D'INFORMATION PÉRIODIQUE AU 30/06/2023

ETAT DU PATRIMOINE EN EUR

| Eléments de l'état du patrimoine | Montant à l'arrêté périodique * |
|---|---------------------------------|
| a) Titres financiers éligibles mentionnés au 1° du I de l'article L. 214-24-55 du code monétaire et financier | 0,00 |
| b) Avoirs bancaires | 14 585 541,92 |
| c) Autres actifs détenus par l'OPC | 269 246 760,31 |
| d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c) | 283 832 302,23 |
| e) Passif | -1 122 456,27 |
| f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC) | 282 709 845,96 |

* Les montants sont signés

NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION ET VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

| Action | Type d'action | Actif net par action | Nombre d'actions en circulation | Valeur nette d'inventaire par action |
|-------------------------------|---------------|----------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| AFER PREMIUM ACTIONS R en EUR | D | 282 709 845,96 | 2 549 829,0000 | 110,87 |

ÉLÉMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES

| Éléments du portefeuille titres | Pourcentage actif net * | Pourcentage total des actifs ** |
|--|-------------------------|---------------------------------|
| A) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1 du code monétaire et financier. | 0,00 | 0,00 |
| Et B) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen. | | |
| C) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts du fonds d'investissement à vocation générale. | 0,00 | 0,00 |
| D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4 ° du I de l'article R.214-32-18 du code monétaire et financier. | 0,00 | 0,00 |
| E) Les autres actifs. | 94,71 | 94,33 |

* Se reporter au f) de l'état du patrimoine

** Se reporter au d) de l'état du patrimoine

RÉPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C), D) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR DEVISE

| Titres | Devise | En montant (EUR) | Pourcentage actif net * | Pourcentage total des actifs ** |
|--------|--------|------------------|-------------------------|---------------------------------|
| NEANT | | | | |

* Se reporter au f) de l'état du patrimoine

** Se reporter au d) de l'état du patrimoine

RÉPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C), D) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR PAYS DE RÉSIDENCE DE L'ÉMETTEUR

| Pays | Pourcentage actif net * | Pourcentage total des actifs ** |
|-------------|--------------------------------|--|
| NEANT | | |

* Se reporter au f) de l'état du patrimoine

** Se reporter au d) de l'état du patrimoine

RÉPARTITION DES AUTRES ACTIFS DU E) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR NATURE

| Nature d'actifs | Pourcentage actif net * | Pourcentage total des actifs ** |
|--|-------------------------|---------------------------------|
| Organismes de placement collectif | | |
| OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays | 88,66 | 88,31 |
| Autres Fonds destinés à des non professionnels et équivalents d'autres pays Etats membres de l'UE | 6,04 | 6,02 |
| Fonds professionnels à vocation générale et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations cotés | 0,00 | 0,00 |
| Autres Fonds d'investissement professionnels et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations non cotés | 0,00 | 0,00 |
| Autres organismes non européens | 0,00 | 0,00 |
| Autres actifs | | |
| Autres | 0,00 | 0,00 |
| TOTAL | 94,71 | 94,33 |

* Se reporter au f) de l'état du patrimoine

** Se reporter au d) de l'état du patrimoine

MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PÉRIODE EN EUR

| Eléments du portefeuille titres | Mouvements (en montant) | |
|--|-------------------------|----------------|
| | Acquisitions | Cessions |
| A) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1 du code monétaire et financier. Et B) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen. | 0,00 | 0,00 |
| C) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts du fonds d'investissement à vocation générale. | 0,00 | 0,00 |
| D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4 ° du I de l'article R.214-32-18 du code monétaire et financier. | 0,00 | 0,00 |
| E) Les autres actifs. | 148 189 891,01 | 168 761 572,83 |

DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE

| | Action | Montant net unitaire EUR | Crédit d'impôt EUR | Montant brut unitaire EUR |
|----------------------------|------------------------|-----------------------------|-----------------------|---------------------------------|
| Dividendes versés | | | | |
| 15/02/2023 | AFER PREMIUM ACTIONS R | 0,14 | 0,00 | 0,14 |
| 21/06/2023 | AFER PREMIUM ACTIONS R | 0,15 | 0,00 | 0,15 |
| Dividendes à verser | | | | |
| | AFER PREMIUM ACTIONS R | | | |

PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 30/06/2023 EN EUR

| Désignation des valeurs | Devise | Qté Nbre ou nominal | Valeur actuelle | % Actif Net |
|--|--------|---------------------|-----------------------|--------------|
| Organismes de placement collectif | | | | |
| OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays | | | | |
| FRANCE | | | | |
| AVIVA INV.MON.PART C FCP 4 DEC | EUR | 7 525 | 16 881 961,25 | 5,97 |
| AXA IM EURO LIQUIDITY FCP 4DEC | EUR | 629 | 28 257 188,77 | 9,99 |
| BDL CONVICTIONS I | EUR | 4 493 | 5 672 502,36 | 2,00 |
| BDL REMPART PART I | EUR | 58 389 | 8 390 499,30 | 2,97 |
| CPR FOCUS INFLATION FCP I | EUR | 53 470 | 8 671 764,60 | 3,06 |
| ECHIQUIER CONVERTIBLES EUROPE FCP | EUR | 3 122 | 4 284 539,14 | 1,52 |
| FAPEP III SLP PART A2 | EUR | 30 000 | 300 000,00 | 0,11 |
| HSBC EURO ACTIONS Part I - C | EUR | 3 559 | 5 773 765,70 | 2,05 |
| LAZARD CAPITAL FI SC EUR | EUR | 1 065 | 12 027 353,85 | 4,25 |
| LAZARD CONVERTIBLE GLOBAL Action PC Eur | EUR | 2 619 | 4 536 212,76 | 1,61 |
| R-CO CONVICTION EQUITY VALUE EURO I EUR | EUR | 42 | 7 920 361,26 | 2,80 |
| R-CO VALOR BOND OPPORTUNITIES I EUR | EUR | 16 538 | 17 688 052,52 | 6,26 |
| TOTAL FRANCE | | | 120 404 201,51 | 42,59 |
| IRLANDE | | | | |
| EURO STOXX OPTIM BKS SCE ETF | EUR | 80 000 | 5 795 952,00 | 2,05 |
| FIRST STATE GR CHINA GRW FD CL I | USD | 52 048 | 5 668 226,47 | 2,00 |
| iShares VII PLC - iShares MSCI Russia ADR/GDR ETF USD Acc | USD | 68 819 | 0,00 | 0,00 |
| TOTAL IRLANDE | | | 11 464 178,47 | 4,05 |
| LUXEMBOURG | | | | |
| ALKEN FD EUROP.OPPOR.R C. | EUR | 9 741 | 2 862 685,08 | 1,01 |
| AMUNDI EURO STOXX 50 UCITS ETF DR - EUR C | EUR | 54 513 | 5 905 267,91 | 2,09 |
| AMUNDI FUNDS OPTIMAL YIELD I2 EUR C | EUR | 7 261 | 14 659 160,29 | 5,18 |
| BLUEBAY INV.GRADE BD BASE I C. | EUR | 101 508 | 17 203 575,84 | 6,09 |
| BNP Paribas Easy MSCI Japan SRI S-Series 5 Capped UCITS ETF | EUR | 512 422 | 11 159 321,35 | 3,95 |
| COM SELECT.WPS SELECT GROWTH I C | USD | 923 | 9 105 677,10 | 3,22 |
| DNCA INVEST VALUE EUROPE IC | EUR | 26 918 | 5 782 255,58 | 2,05 |
| Emerg.Mkts Local Curr.Debt C EUR Hgd Cap | EUR | 225 898 | 16 508 625,84 | 5,84 |
| G FUND EUROPEAN CONV BD CAP EUR IC | EUR | 2 909 | 4 405 331,42 | 1,56 |
| IGS ASIAN EQ.CL.I USD C.3DEC | USD | 194 608 | 5 741 885,22 | 2,03 |
| Moonstone Lending S.C.A. SICAV-SIF - Moonstone Lending Fund | EUR | 15 769,968 | 2 012 090,22 | 0,71 |
| MORGAN STANLEY INVESTMENT FUNDS ASIA OPPORTUNITY Z | USD | 129 631 | 5 759 787,12 | 2,04 |
| MULTI-UNITS LUXEMBOURG - Lyxor US Curve Steepening 2-10 UCIT | EUR | 70 000 | 5 739 300,00 | 2,03 |
| Ossiam Shiller Barclays Cape® US Sector Value TR 1C (USD) | USD | 5 227 | 5 698 334,35 | 2,01 |
| R-co 4Change Imp Finance - IC EUR H | EUR | 2 956,387 | 3 075 529,40 | 1,09 |
| TROWE PRICE-US EQTY-IACC | USD | 62 134 | 3 171 887,52 | 1,12 |
| TOTAL LUXEMBOURG | | | 118 790 714,24 | 42,02 |
| TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays | | | 250 659 094,22 | 88,66 |
| Autres Fonds destinés à des non professionnels et équivalents d'autres pays Etats membres de l'UE | | | | |
| FRANCE | | | | |
| ARDIAN BUYOUT FUND VII A-CLASS A1 | EUR | 2 100,09 | 2 283 466,08 | 0,80 |
| FIVE ARROWS PRIVATE EQUIT PROGRAM II SLP | EUR | 60 000 | 4 480 560,00 | 1,58 |
| RMM US 1 SLP Parts Commanditaire | USD | 15 172,5 | 1 396 328,00 | 0,50 |
| TOTAL FRANCE | | | 8 160 354,08 | 2,88 |

PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 30/06/2023 EN EUR (suite)

| Désignation des valeurs | Devise | Qté Nbre ou nominal | Valeur actuelle | % Actif Net |
|--|--------|---------------------|-----------------------|---------------|
| ITALIE | | | | |
| AGRITALY PART B | EUR | 3 | 1 388 252,10 | 0,50 |
| TOTAL ITALIE | | | 1 388 252,10 | 0,50 |
| LUXEMBOURG | | | | |
| CAP ENTREPRENEURS 2 PART A | EUR | 1 920 | 2 123 310,14 | 0,76 |
| ENCORE PLUS FUND A EUR | EUR | 4 078 499,404 | 3 498 536,79 | 1,23 |
| TIKEHAU DIRECT LENDING IV 1ST LIEN | EUR | 257,87 | 1 915 095,77 | 0,68 |
| TOTAL LUXEMBOURG | | | 7 536 942,70 | 2,67 |
| TOTAL Autres Fonds destinés à des non professionnels et équivalents d'autres pays Etats membres de l'UE | | | 17 085 548,88 | 6,05 |
| TOTAL Organismes de placement collectif | | | 267 744 643,10 | 94,71 |
| Instrument financier à terme | | | | |
| Engagements à terme fermes | | | | |
| Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé | | | | |
| EURO STOXX 50 0923 | EUR | 40 | 4 800,00 | 0,00 |
| NQ USA NASDAQ 0923 | USD | -50 | -220 136,20 | -0,08 |
| TOTAL Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé | | | -215 336,20 | -0,08 |
| TOTAL Engagements à terme fermes | | | -215 336,20 | -0,08 |
| TOTAL Instrument financier à terme | | | -215 336,20 | -0,08 |
| Appel de marge | | | | |
| APPEL MARGE CACEIS | USD | 239 200 | 220 136,20 | 0,08 |
| APPEL MARGE CACEIS | EUR | -4 800 | -4 800,00 | 0,00 |
| TOTAL Appel de marge | | | 215 336,20 | 0,08 |
| Créances | | | 1 277 181,01 | 0,45 |
| Dettes | | | -897 520,07 | -0,32 |
| Comptes financiers | | | 14 585 541,92 | 5,16 |
| Actif net | | | 282 709 845,96 | 100,00 |

| | | | |
|-------------------------------------|------------|-----------------------|---------------|
| Parts AFER PREMIUM ACTIONS R | EUR | 2 549 829,0000 | 110,87 |
|-------------------------------------|------------|-----------------------|---------------|