



ATTESTATION DU COMMISSAIRE AUX COMPTES
Composition de l'actif au 30 septembre 2024

GSD ABSOLUTE RETURN

OPCVM CONSTITUE SOUS FORME DE FONDS COMMUN DE PLACEMENT
Régi par le Code monétaire et financier

Société de gestion

GSD GESTION
37, rue de Liège
75008 PARIS

En notre qualité de commissaire aux comptes de l'OPCVM constitué sous forme de fonds commun de placement GSD ABSOLUTE RETURN, et en application des dispositions de l'article L.214-17 du Code monétaire et financier et de l'article 411-125 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 septembre 2024 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 de l'OPCVM constitué sous forme de fonds commun de placement 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 de l'OPCVM constitué sous forme de fonds commun de placement acquise dans le cadre de notre mission de certification des comptes annuels.

Neuilly sur Seine, date de la signature électronique

Document authentifié par signature électronique

Le commissaire aux comptes
PricewaterhouseCoopers Audit
Frédéric SELLAM

2024.11.07 17:47:06 +0100

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

Société d'expertise comptable inscrite au tableau de l'ordre de Paris - Ile de France. Société de commissariat aux comptes membre de la compagnie régionale de Versailles. Société par Actions Simplifiée au capital de 2 510 460 €. Siège social : 63, rue de Villiers 92200 Neuilly-sur-Seine. RCS Nanterre 672 006 483. TVA n° FR 76 672 006 483. Siret 672 006 483 00362. Code APE 6920 Z. Bureaux : Bordeaux, Grenoble, Lille, Lyon, Marseille, Metz, Nantes, Nice, Paris, Poitiers, Rennes, Rouen, Strasbourg, Toulouse.

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock administratif au 30/09/24

Devise de fixing : FXD Dev. Bloomberg Close

PORTEFEUILLE : F5860 GSD ABSOLUTE RETURN VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR (Etat simplifie, trame : CLASST COB COMPLET(TL1)

, Tris : BVAL)

V A L E U R	STATUTS 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
PORTEFEUILLE TITRES												
Actions et valeurs assimilees												
Actions , valeurs assimilees nego. sur un marche regl. ou assimile												
Actions et valeurs ass. neg. sur un marche regl. ou ass.(sauf Warrants et Bons de Sous.)												
DEVISE VALEUR : EUR EURO												
IT0003497168	TELECOM ITALIA S	25,000.	P EUR	0.48	M 30/09/24	0.2495		12,000.20	6,237.50	0.00	-5,762.70	0.17
DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US												
US82837P4081	SILVERGATE CAP-A	33,067.	P USD	1.	M 30/09/24	1.		29,624.62	29,696.45	0.00	71.83	0.83
Actions et valeurs ass. neg. sur un marche regl. ou ass.(sauf Warrants et Bons de Sous.)												
CUMUL (EUR)								41,624.82	35,933.95	0.00	-5,690.87	1.00
Actions , valeurs assimilees nego. sur un marche regl. ou assimile												
CUMUL (EUR)								41,624.82	35,933.95	0.00	-5,690.87	1.00
Actions et valeurs assimilees												
CUMUL (EUR)								41,624.82	35,933.95	0.00	-5,690.87	1.00
Obligations et valeurs assimilees												
Autres Obligations et valeurs assimilees negociees sur un marche reglemente												
Obligations a taux fixe negociees sur un marche reglemente												
DEVISE VALEUR : EUR EURO												
BE0000342510	BGB 0 1/2 10/22/24	8,000,000.	P EUR	100.3183	% 30/09/24	99.858		80,254.65	80,264.54	378.14	9.89	2.24
ES00000126B2	SPGB 2 3/4 10/31/24	100.	P EUR	102.4756	% 30/09/24	99.956		102,475.59	102,488.10	2,532.10	12.51	2.86
EU000A1G0DQ6	EFSF 0 3/8 10/11/24	100.	P EUR	100.2868	% 30/09/24	99.927		100,286.75	100,292.78	365.78	6.03	2.80
FR0011962398	FRTR 1 3/4 11/25/24	100,000.	P EUR	101.248	% 30/09/24	99.769		101,248.02	101,260.80	1,491.80	12.78	2.82
FR0013370129	BVIFP 1 7/8 01/06/25	1.	P EUR	101.0111	% 30/09/24	99.629		101,011.07	101,012.20	1,383.20	1.13	2.82
IT0005045270	ITALY 2,5%011224	115.	P EUR	100.7103	% 30/09/24	99.873		115,816.88	115,820.13	966.18	3.25	3.23
PTPBTWGE0035	PORTB 0 11/22/24	85,000.	P EUR	99.53	% 30/09/24	99.53		84,600.50	84,600.50	0.00	0.00	2.36
XS1642590480	VW 1 3/8 01/20/25	70.	P EUR	100.283	% 30/09/24	99.321		70,198.09	70,197.92	673.22	-0.17	1.96
XS1648298559	NESNVX 0 7/8 07/18/2	60.	P EUR	98.5468	% 30/09/24	98.398		59,128.08	59,148.12	109.32	20.04	1.65
XS1732232340	DT 0 5/8 12/13/24	60.	P EUR	99.9263	% 30/09/24	99.435		59,955.80	59,962.23	301.23	6.43	1.67
XS1820748538	LXGR 1 1/8 05/16/25	60.	P EUR	98.9694	% 30/09/24	98.568		59,381.61	59,397.85	257.05	16.24	1.66
Obligations a taux fixe negociees sur un marche reglemente												
CUMUL (EUR)								934,357.04	934,445.17	8,458.02	88.13	26.06
Titres subordonnes (TSR - TSDI)												
DEVISE VALEUR : EUR EURO												
FR0012304459	CRED.AGR.3%14 TSR	90,000.	P EUR	99.9222	% 30/09/24	99.848		89,929.96	89,937.38	74.18	7.42	2.51
Titres subordonnes (TSR - TSDI)												
CUMUL (EUR)								89,929.96	89,937.38	74.18	7.42	2.51

Stock : Stock admi principal au 30/09/24

Devise de fixing : FXD Dev. Bloomberg Close

ORTEFEUILLE : F5860 GSD ABSOLUTE RETURN VL VALIDEE Devise du portefeuille : EUR (Etat simplifie, trame : CLASST COB COMPLET(TL1) , Tris : BVAL)

V A L E U R	STATUTS 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
Autres Obligations et valeurs assimilees negociees sur un marche reglemente												
CUMUL (EUR)						1,024,287.00		1,024,382.55		8,532.20		95.55 28.57
Obligations et valeurs assimilees												
CUMUL (EUR)						1,024,287.00		1,024,382.55		8,532.20		95.55 28.57
Titres d OPC												
OPCVM et equivalents d autres etats membres de l UE												
DEVISE VALEUR : EUR EURO												
FR0000009987	CIC-UNION PLUS	1.35	P EUR	198723.5556	M 30/09/24	201031.7	V	268,276.80	271,392.80	0.00	3,116.00	7.57
FR0007460951	GSD-PATRIMOINE	1,000.	P EUR	119.3604	M 30/09/24	121.5		119,360.43	121,500.00	0.00	2,139.57	3.39
FR0013245081	CAN DIVER FUT-ZEUR	85.	P EUR	1463.1566	M 30/09/24	1471.24		124,368.31	125,055.40	0.00	687.09	3.49
FR0013432143	LZD-CR OP I-PVCEUR	55.	P EUR	1180.3055	M 30/09/24	1274.74		64,916.80	70,110.70	0.00	5,193.90	1.96
FR0014001HF6	QNT ABSL RET-SI	0.312	P EUR	822680.5128	M 27/09/24	852010.2		256,676.32	265,827.18	0.00	9,150.86	7.41
IE00B59GC072	GAM-GLO RATE-AEUR	3,700.	P EUR	14.4694	M 27/09/24	14.6195		53,536.78	54,092.15	0.00	555.37	1.51
IE00BLG2W007	LI-EU STR E-A4AEUR	3,900.	P EUR	22.9195	M 30/09/24	23.1849		89,386.05	90,421.11	0.00	1,035.06	2.52
IE00BLP5S791	JUPMGLEARF-IEURA	40,000.	P EUR	1.9246	M 30/09/24	1.9308		76,984.00	77,232.00	0.00	248.00	2.15
LU0462954396	WI A DIV MC-IICE	500.	P EUR	161.29	M 27/09/24	155.28		80,645.00	77,640.00	0.00	-3,005.00	2.17
LU1001747408	JPM-E EQ ABAL-AA	650.	P EUR	150.0817	M 30/09/24	168.67		97,553.10	109,635.50	0.00	12,082.40	3.06
LU1057468818	L-BMLCXCA U-C5EURA	335.	P EUR	171.244	M 27/09/24	158.1		57,366.75	52,963.50	0.00	-4,403.25	1.48
LU1112771768	HELIUM-SELECT-SEUR	60.	P EUR	1744.055	M 27/09/24	1814.506		104,643.30	108,870.36	0.00	4,227.06	3.04
LU1234712880	DNCA-EUROSE-NEUR	450.	P EUR	125.8111	M 30/09/24	131.12		56,615.00	59,004.00	0.00	2,389.00	1.65
LU1278928657	BSF-GL E/D-E2EUR	179.	P EUR	132.8375	M 30/09/24	136.79		23,777.92	24,485.41	0.00	707.49	0.68
LU1331973468	ELE-AB RT EU-REUR	545.	P EUR	143.06	M 30/09/24	155.06		77,967.70	84,507.70	0.00	6,540.00	2.36
LU1340030060	MFH LX-NECOP-IEUR	550.	P EUR	117.672	M 30/09/24	126.68		64,719.60	69,674.00	0.00	4,954.40	1.94
LU1593227850	BSF-A/P DIV-D2EURH	700.	P EUR	121.5727	M 30/09/24	155.27		85,100.91	108,689.00	0.00	23,588.09	3.03
LU1681038243	AMUNDI NS 100-E	200.	P EUR	205.71	M 30/09/24	204.15		41,142.00	40,830.00	0.00	-312.00	1.14
LU1694789378	DNCA ALPHA B-IEUR	650.	P EUR	122.7438	M 30/09/24	129.		79,783.50	83,850.00	0.00	4,066.50	2.34
LU1832174889	IDPDE AM-EUR-XEA	300.	P EUR	155.71	M 27/09/24	152.		46,713.00	45,600.00	0.00	-1,113.00	1.27
LU1910829156	SHMK EQ L/S-EURI	950.	P EUR	105.4392	M 30/09/24	105.2568		100,167.23	99,993.96	0.00	-173.27	2.79
LU2191352629	M&G-EP MAC-EURSIHA	6,400.	P EUR	12.1729	M 30/09/24	13.242		77,906.56	84,748.80	0.00	6,842.24	2.36
LU2367662686	LU-MWTOPENV-DEURA	577.8816	P EUR	103.3878	M 27/09/24	120.5564		59,745.89	69,667.33	0.00	9,921.44	1.94
LU2367665606	LM-MW TP UC-EURF	499.9974	P EUR	151.1699	M 27/09/24	163.9231		75,584.58	81,961.12	0.00	6,376.54	2.29
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO												
CUMUL (EUR)						2,182,937.53		2,277,752.02		0.00		94,814.49 63.53
DEVISE VALEUR : GBP LIVRE STERLING												
IE00B5ZNR51	MN GL-AL S-DL-HEUR	600.	P EUR	152.7119	M 27/09/24	163.03		91,627.15	97,818.00	0.00	6,190.85	2.73
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : GBP LIVRE STERLING												
CUMUL (EUR)						91,627.15		97,818.00		0.00		6,190.85 2.73
OPCVM et equivalents d autres etats membres de l UE												
CUMUL (EUR)						2,274,564.68		2,375,570.02		0.00		101,005.34 66.25

Stock : Stock admi principal au 30/09/24

Devise de fixing : FXD Dev. Bloomberg Close

ORTEFEUILLE : F5860 GSD ABSOLUTE RETURN VL VALIDEE Devise du portefeuille : EUR (Etat simplifie, trame : CLASST COB COMPLET(TL1) , Tris : BVAL)

V A L E U R		STATUTS 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			----->		PRCT	
Titres d OPC						CUMUL (EUR)			2,274,564.68	2,375,570.02		0.00		101,005.34	66.25	
PORTEFEUILLE TITRES																
						CUMUL (EUR)			3,340,476.50	3,435,886.52		8,532.20		95,410.02	95.83	
TRESORERIE																
Dettes et creances																
Frais de gestion																
Frais de gestion																
DEVISE VALEUR : EUR EURO																
FADM.EUR	Prov frs gest admin.		-1,814.28	EUR	1.	30/09/24	1.		-1,814.28	-1,814.28		0.00		0.00	-0.05	
FGES.EUR	Prov frais gestion		-4,327.12	EUR	1.	30/09/24	1.		-4,327.12	-4,327.12		0.00		0.00	-0.12	
Frais de gestion						CUMUL (EUR)			-6,141.40	-6,141.40		0.00		0.00	-0.17	
Frais de gestion																
						CUMUL (EUR)			-6,141.40	-6,141.40		0.00		0.00	-0.17	
Dettes et creances																
						CUMUL (EUR)			-6,141.40	-6,141.40		0.00		0.00	-0.17	
Disponibilites																
Comptes a vue																
DEVISE VALEUR : EUR EURO																
BQ01.EUR	Banque		151,083.61	EUR	1.	30/09/24	1.		151,083.61	151,083.61		0.00		0.00	4.21	
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO						CUMUL (EUR)			151,083.61	151,083.61		0.00		0.00	4.21	
DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US																
BQ01.USD	Banque		5,294.51	USD	0.90878854	30/09/24	0.89806915		4,811.59	4,754.84		0.00		-56.75	0.13	
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US						CUMUL (EUR)			4,811.59	4,754.84		0.00		-56.75	0.13	
Comptes a vue																
						CUMUL (EUR)			155,895.20	155,838.45		0.00		-56.75	4.35	
Disponibilites																
						CUMUL (EUR)			155,895.20	155,838.45		0.00		-56.75	4.35	
TRESORERIE																
						CUMUL (EUR)			149,753.80	149,697.05		0.00		-56.75	4.17	

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/09/24

Portefeuille : F5860 GSD ABSOLUTE RETURN

VL VALIDEE

Devise de fixing : FXD Dev. Bloomberg Close

Devise du portefeuille : EUR (Etat simplifie, trame : CLASST COB COMPLET(TL1)

, Tris : BVAL)

V A L E U R	STATUTS	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	
PORTEFEUILLE : GSD ABSOLUTE RETURN (F5860)																			
					(EUR)			3,490,230.30			3,585,583.57			8,532.20		95,353.27	100.00		

Inventaire sur historique de valorisation (HISIV)

```
, Tris : BVAL )
```

Actif net total en EUR : 3,585,583.57

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock adm principal au 30/09/24

Portefeuille : F5860 GSD ABSOLUTE RETURN

VL VALIDEE

Devise de fixing : FXD Dev. Bloomberg Close

Devise du portefeuille : EUR (Etat simplifie, trame : CLASST COB COMPLET(TL1))

, Tris : BVAL)

COURS DES DEISES UTILISEES					
par la valorisation		par l'inventaire		par la valorisation précédente	
variation					
Cours	EUR en USD :	1.1135	cotation : 30/09/24	0.	1.1162
					cotation : 27/09/24
					-0.24189

Mixed fund - Poids calcule de 10.47 % : ATTENTION le poids des actions est en dessous du seuil (25. %)

GSD ABSOLUTE RETURN

Document d'information périodique au 30/09/2024

GSD ABSOLUTE RETURN

Sommaire

ÉTAT DU PATRIMOINE EN EUR	3
NOMBRE DE PARTS EN CIRCULATION ET VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR PART OU ACTION	4
ÉLÉMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES EN EUR	5
MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PÉRIODE EN EUR	6
DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE	7
RÉPARTITION DES ACTIFS A), B), C) ET D) PAR DEVISE	8
RÉPARTITION DES ACTIFS A), B), C) ET D) PAR SECTEUR ÉCONOMIQUE	9
RÉPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C) ET D) PAR PAYS DE RÉSIDENCE DE L'ÉMETTEUR	10
VENTILATION DES AUTRES ACTIFS DU E) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR NATURE	11
COMMISSION DE PERFORMANCE	12
INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)	13
INVENTAIRE DES OPÉRATIONS À TERME DE DEVISE	15
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – ACTIONS	16
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – TAUX D'INTÉRÊTS	17
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – DE CHANGE	18
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – SUR RISQUE DE CRÉDIT	19
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – AUTRES EXPOSITIONS	20
INVENTAIRE DES OPÉRATIONS À TERME DE DEVISE (UTILISÉES EN COUVERTURE D'UNE CATÉGORIE DE PART)	21
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – DE CHANGE (UTILISÉS EN COUVERTURE D'UNE CATÉGORIE DE PART)	22
SYNTHÈSE DE L'INVENTAIRE	23

GSD ABSOLUTE RETURN

ÉTAT DU PATRIMOINE EN EUR

Éléments de l'état du patrimoine	Montant à l'arrêté périodique *
a) Titres financiers éligibles mentionnés au 1° du I de l'article L. 214-20 du code monétaire et financier	1 060 316,50
b) Avoirs bancaires	155 838,45
c) Autres actifs détenus par l'OPCVM	2 375 570,02
d) Total des actifs détenus par l'OPCVM	3 591 724,97
e) Passif	-6 141,40
f) Valeur nette d'inventaire	3 585 583,57

* Les montants sont signés

GSD ABSOLUTE RETURN

NOMBRE DE PARTS EN CIRCULATION ET VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR PART OU ACTION

Code ISIN de la part	Libellé de la part	Affectation des sommes distribuables	Devise de la part	Actif net de la part (EUR)	Nombre de parts	Valeur liquidative (EUR)
FR0010843946	PART CAPI IC	Capitalisable	EUR	1 575 465,98	14 962,9500	105,29
FR0011136100	PART CAPI PC	Capitalisable	EUR	2 010 117,59	20 644,3162	97,36

GSD ABSOLUTE RETURN

ÉLÉMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES EN EUR

Eléments du portefeuille titres:	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
a) Titres financiers éligibles et 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	28,74	28,69
b) Titres financiers éligibles et 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) Titres financiers éligibles et 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 de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières	0,83	0,83
d) Titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier	0,00	0,00
e) Autres actifs	66,25	66,14

GSD ABSOLUTE RETURN

MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PÉRIODE EN EUR

Eléments du portefeuille titres:	Mouvements (en montant)	
	Acquisitions	Cessions
a) Titres financiers éligibles et 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	1 024 287,00	0,00
b) Titres financiers éligibles et 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) Titres financiers éligibles et 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 de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières	29 624,62	0,00
d) Titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier	0,00	0,00
e) Autres actifs	667 316,55	364 845,15

Mouvements intervenus au cours de la période	Mouvements (en montant)
Acquisitions	1 721 228,17
Cessions	364 845,15

GSD ABSOLUTE RETURN

DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE

Pas de distribution sur la période.

GSD ABSOLUTE RETURN

RÉPARTITION DES ACTIFS A), B), C) ET D) PAR DEVISE

Devise	En montant (EUR)	Pourcentage	
		Actif net	Total des actifs
Euro	1 030 620,05	28,74	28,69
Dollar americain	29 696,45	0,83	0,83
Total	1 060 316,50	29,57	29,52

GSD ABSOLUTE RETURN

RÉPARTITION DES ACTIFS A), B), C) ET D) PAR SECTEUR ÉCONOMIQUE

Secteur économique	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Souverains	13,51	13,49
Banques	3,33	3,33
Services de soutien aux entreprises	2,82	2,81
Supranational	2,80	2,79
Finance générale	1,96	1,96
Téléphonie mobile	1,67	1,67
Chimie	1,66	1,65
Divers	1,65	1,65
Téléphonie fixe	0,17	0,17
Total	29,57	29,52

GSD ABSOLUTE RETURN

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

Pays	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
France	8,15	8,14
Allemagne	3,61	3,61
Italie	3,40	3,40
Espagne	2,86	2,85
Luxembourg	2,80	2,79
États-Unis	2,48	2,47
Portugal	2,36	2,36
Belgique	2,24	2,23
Pays-Bas	1,67	1,67
Total	29,57	29,52

GSD ABSOLUTE RETURN

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

Nature d'actifs	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Parts d'OPC	66,25	66,14
OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne	66,25	66,14
FIA et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne	0,00	0,00
Autres OPC et fonds d'investissements	0,00	0,00
Autres actifs	0,00	0,00
Total	66,25	66,14

GSD ABSOLUTE RETURN

COMMISSION DE PERFORMANCE

PART CAPI IC	30/09/2024
Commission de performance (frais variables)	1 293,65
Pourcentage de commission de performance	0,13

PART CAPI PC	30/09/2024
Commission de performance (frais variables)	0,00
Pourcentage de commission de performance	0,00

GSD ABSOLUTE RETURN

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
Actions et valeurs assimilées			35 933,95	1,00
Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			35 933,95	1,00
Banques			29 696,45	0,83
SILVERGATE CAPITAL CORPORATION	USD	33 067	29 696,45	0,83
Téléphonie fixe			6 237,50	0,17
TELECOM ITALIA	EUR	25 000	6 237,50	0,17
Obligations			1 024 382,55	28,57
Autres obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			1 024 382,55	28,57
Banques			89 937,38	2,51
CRED.AGRICOLE 3%14-221224 TSR	EUR	90 000	89 937,38	2,51
Chimie			59 397,85	1,65
LXSGR 1 1/8 05/16/25	EUR	60	59 397,85	1,65
Divers			59 148,12	1,65
NESNVX 0 7/8 07/18/25	EUR	60	59 148,12	1,65
Finance générale			70 197,92	1,96
VOLKSWAGEN LEASING 1,375%17-25	EUR	70	70 197,92	1,96
Services de soutien aux entreprises			101 012,20	2,82
BUREAU VERITAS 1,875%18-060125	EUR	1	101 012,20	2,82
Souverains			484 434,07	13,51
BELGIQUE 0,5%17-221024	EUR	8 000 000	80 264,54	2,24
ESPAGNE 2,75%14-311024	EUR	100	102 488,10	2,86
ITALY 2,5%14-011224	EUR	115	115 820,13	3,23
OAT 1,75%14-25112024	EUR	100 000	101 260,80	2,82
PORTB 0 11/22/24	EUR	85 000	84 600,50	2,36
Supranational			100 292,78	2,80
EFSF 0 3/8 10/11/24	EUR	100	100 292,78	2,80
Téléphonie mobile			59 962,23	1,67
DT 0 5/8 12/13/24	EUR	60	59 962,23	1,67
Parts d'OPC et fonds d'investissements			2 375 570,02	66,26
OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne			2 375 570,02	66,26
ALMA PLAT IV-SYS ALPHA-ICE	EUR	500	77 640,00	2,16
AMUNDI NASDAQ 100-EUR	EUR	200	40 830,00	1,14
BSF-AS PAC DIV EQ A/R-D2EURH	EUR	700	108 689,00	3,03
BSF-GLB EVNT DRVN-E2 EUR	EUR	179	24 485,41	0,68
CAN DIVERSIFIED FUTURES-ZEUR	EUR	85	125 055,40	3,49
DNCA INVEST-ALPHA BONDS-IEUR	EUR	650	83 850,00	2,34
DNCA INVEST-EUROSE-N EUR	EUR	450	59 004,00	1,65
ELEV-ABSO LRET EURO FD-R EUR	EUR	545	84 507,70	2,36
GAM STAR-GLOBAL RATES-AE	EUR	3 700	54 092,15	1,51
GSD PATRIMOINE	EUR	1 000	121 500,00	3,39
HELIUM FUND-HELIUM SEL-S EUR	EUR	60	108 870,36	3,04
INDPNDNE AM SICAV- EURPE-XEA	EUR	300	45 600,00	1,27
JPM EUREQ ABSAL-A PERF AEUR	EUR	650	109 635,50	3,06

GSD ABSOLUTE RETURN

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
JUPMER GBL EQ ABRET-I EUR AC	EUR	40 000	77 232,00	2,15
LAZARD CREDIT OPP I-PVC EUR	EUR	55	70 110,70	1,96
LITRUST GF EU STRTG EQ-A4AEU	EUR	3 900	90 421,11	2,52
LUMYA-MW TOPS MR UCTS-EURFAC	EUR	499,9974	81 961,12	2,29
LUMY-B MLCX C ALPHA U-C5EURA	EUR	335	52 963,50	1,48
LUMY-MWTOP ENV MKT NEU-DEURA	EUR	577,8816	69 667,33	1,94
M&G LX EPISODE MACRO-EUR SIH	EUR	6 400	84 748,80	2,36
MAN GLG ALP SL AL-DL-HEUR	EUR	600	97 818,00	2,73
MFM LX-NO EUR CREDIT O-I EUR	EUR	550	69 674,00	1,94
QUANTOLOGY ABSOLUTE RET-SI	EUR	0,312	265 827,18	7,41
SEAHAWK EQUITY L/S-EUR I	EUR	950	99 993,96	2,79
UNION PLUS	EUR	1,35	271 392,80	7,57
Total			3 435 886,52	95,83

GSD ABSOLUTE RETURN

INVENTAIRE DES OPÉRATIONS À TERME DE DEVISE

Libellé instrument	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition en Euro (*)			
	Actif	Passif	Devises à recevoir (+)		Devises à livrer (-)	
			Devise	Montant (*)	Devise	Montant (*)
Total	0,00	0,00		0,00		0,00

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

GSD ABSOLUTE RETURN

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – ACTIONS

Instruments financiers à terme – actions				
Libellé instrument	Quantité/Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition en Euro (*)
		Actif	Passif	+/-
Futures				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Options				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Swaps				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Autres instruments				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Total		0,00	0,00	0,00

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

GSD ABSOLUTE RETURN

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – TAUX D'INTÉRÊTS

Instruments financiers à terme – taux d'intérêts				
Libellé instrument	Quantité/Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition en Euro (*)
		Actif	Passif	+/-
Futures				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Options				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Swaps				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Autres instruments				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Total		0,00	0,00	0,00

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

GSD ABSOLUTE RETURN

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – DE CHANGE

Instruments financiers à terme – de change				
Libellé instrument	Quantité/Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition en Euro (*)
		Actif	Passif	+/-
Futures				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Options				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Swaps				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Autres instruments				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Total		0,00	0,00	0,00

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

GSD ABSOLUTE RETURN

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – SUR RISQUE DE CRÉDIT

Instruments financiers à terme – sur risque de crédit				
Libellé instrument	Quantité/Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition en Euro (*)
		Actif	Passif	+/-
Futures				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Options				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Swaps				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Autres instruments				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Total		0,00	0,00	0,00

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

GSD ABSOLUTE RETURN

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – AUTRES EXPOSITIONS

Instruments financiers à terme – autres expositions				
Libellé instrument	Quantité/Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition en Euro (*)
		Actif	Passif	+/-
Futures				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Options				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Swaps				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Autres instruments				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Total		0,00	0,00	0,00

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

GSD ABSOLUTE RETURN

INVENTAIRE DES OPÉRATIONS À TERME DE DEVISE (UTILISÉES EN COUVERTURE D'UNE CATÉGORIE DE PART)

Libellé instrument	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition en Euro (*)				Classe de part couverte
	Actif	Passif	Devises à recevoir (+)		Devises à livrer (-)		
			Devise	Montant (*)	Devise	Montant (*)	
Total	0,00	0,00		0,00		0,00	

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

GSD ABSOLUTE RETURN

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – DE CHANGE (UTILISÉS EN COUVERTURE D'UNE CATÉGORIE DE PART)

Libellé instrument	Quantité/ Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition en Euro (*)	Classe de part couverte
		Actif	Passif	+/-	
Futures					
Sous total		0,00	0,00	0,00	
Options					
Sous total		0,00	0,00	0,00	
Swaps					
Sous total		0,00	0,00	0,00	
Autres instruments					
Sous total		0,00	0,00	0,00	
Total		0,00	0,00	0,00	

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

GSD ABSOLUTE RETURN

SYNTHÈSE DE L'INVENTAIRE

	Valeur actuelle présentée au bilan
Total inventaire des actifs et passifs éligibles (hors IFT)	3 435 886,52
Inventaire des IFT (hors IFT utilisés en couverture de parts émises):	
Total opérations à terme de devises	0,00
Total instruments financiers à terme - actions	0,00
Total instruments financiers à terme - taux	0,00
Total instruments financiers à terme - change	0,00
Total instruments financiers à terme - crédit	0,00
Total instruments financiers à terme - autres expositions	0,00
Inventaire des instruments financiers à terme utilisés en couverture de parts émises	0,00
Autres actifs (+)	155 838,45
Autres passifs (-)	-6 141,40
Total = actif net	3 585 583,57