

Rapport Mensuel août 2018

Profil de risque (SRRI)

31/08/2018

1 2 3 **4** 5 6 7

STRATEGIE ET OBJECTIF DE GESTION

Quantology Small est un fonds quantitatif Long/Short Equity (biais net long +40% maximum) basé sur un modèle propriétaire momentum. La poche longue traque de façon systématique les valeurs les plus récemment repondérées par les gérants de la catégorie small-mid caps européennes. Le fonds applique pour la poche short, une politique de couverture systématique via la vente de contrats futures sur l'indice Stoxx Europe 600 TR. L'objectif du fonds est de surperformer l'indice de référence 70% Eonia Capitalisé + 30% Stoxx Europe 600 TR sur l'horizon d'investissement recommandé.

CARACTÉRISTIQUES

Date de création	13/07/2017
Classification	Long/Short Equity (biais Long)
ISIN Part I	FR0013256260
ISIN Part R	FR0013256278
Gérants	Julien Messias, Vincent Fourcaut
Valorisation	Hebdomadaire
Forme juridique	FCP, UCITS 4
Indice	30 Stoxx 600 + 70% Eonia Capitalisé
Devise	Euro
Affectation des dividendes	Capitalisation
Durée minimum d'investissement	5 ans
Encours (millions €)	0,7

PROFIL DE LA POCHE LONGUE

Nombre de positions actions	24
Poids des 10 premières lignes	20,4%
Capitalisation Médiane (Mds €)	2,7
Rendement du dividende	2,2%
Liquidité < 10 jours (tiers volume)	100%

PRESTATAIRES ET FRAIS

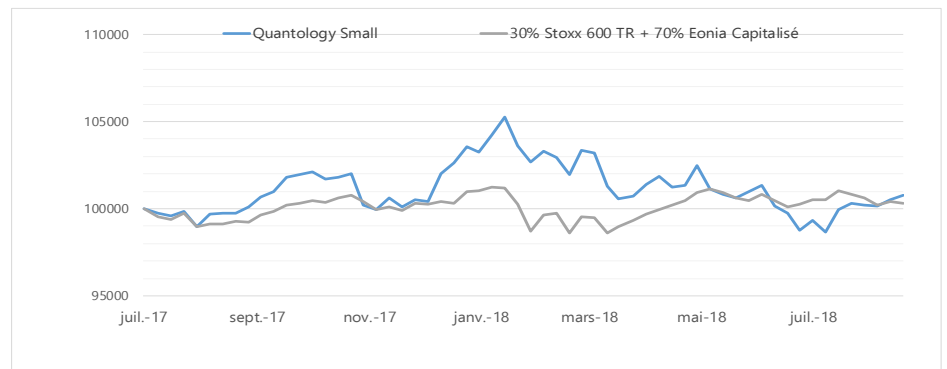
Dépositaire, Valorisateur	Caceis
Prime Broker	Global Prime Partners
Commissaire aux comptes	PWC Sellam
Frais de gestion fixe Part I	1,50% annuel TTC
Frais de gestion fixe Part R	2,00% annuel TTC
Frais de gestion variables	Maximum 20% TTC de la performance positive nette au-delà de l'indice de référence avec high water mark

RISQUES DU FONDS

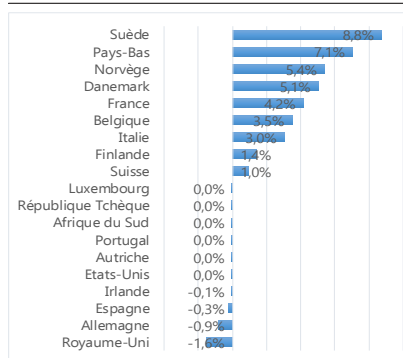
Risque de perte en capital
Risque action
Risque de crédit
Risque de contrepartie

Les chiffres cités ont trait aux années écoulées. Les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures.

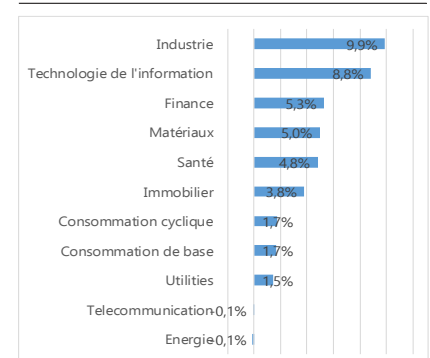
GRAPHIQUE - PART I



EXPOSITION NETTE GEOGRAPHIQUE



EXPOSITION NETTE SECTORIELLE



PRINCIPALES POSITIONS

Titre	Poids (%)
STXE 600 € NRt	-5,79%
AMBU A/S-B	3,29%
ASR NEDERLAND NV	2,07%
KLOVERN AB-B SHS	1,95%
BASIC-FIT NV	1,93%

ALLOCATION DU PORTEFEUILLE

Catégorie	Poids (%)
Expositions Short	-5,79%
Exposition Long	44,08%
Exposition Nette	38,29%
Cash, Taux	49,74%
Exposition Brute	49,86%

PERFORMANCES PART I INDICE

Période	Part I (%)	Indice (%)
2018	-1,80%	0,73%
1 an	1,03%	1,06%
3 ans	-	-
Création (01/08/2016)	0,78%	0,33%

STATISTIQUES 1 AN PART I

Metric	Value (%)
Volatilité (52 sem, vendredi)	5,54%
Perte Maximum	-6,25%
Alpha	-0,34%
Ratio de Sharpe	0,37

PERFORMANCES MENSUELLES

	Jan	Fev	Mar	Avr	Mai	Juin	Juil	Août	Sept	Oct	Nov	Dec	YTD
2017								0,13%	2,08%	0,01%	-1,18%	2,01%	2,63%
2018	2,55%	-2,19%	-2,28%	0,62%	-0,38%	-1,06%	0,16%	0,86%					-1,80%

*Cornish-Fischer adjusted

Quantology Capital Management est une société de gestion agréée par l'AMF sous le numéro GP-13000028. Adresse: 5 Avenue Ingres, 75016 Paris. Tel: 01.70.22.23.10. Les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures. Elles ne sont pas constantes dans le temps et ne font l'objet d'aucune garantie. Document d'information non contractuel. Pour plus d'informations, veuillez vous référer au DICI (Document d'Information Clé pour l'Investisseur) disponible sur le site internet www.quantology-cm.com.