

Rapport Mensuel Mars 2018
Au 29/03/2018

Profil de risque (SRRI)

1 2 3 **4** 5 6 7

STRATEGIE ET OBJECTIF

Quantology Small est un fonds quantitatif Long/Short Equity (biais net long +40%). La poche longue traque de façon systématique et selon un modèle propriétaire les valeurs les plus récemment repondérées par les gérants de la catégorie small-mid caps européennes. Le fonds cherche également à capturer la prime de risque des petites capitalisations par rapport aux grandes. 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.

PROFIL DE LA POCHE LONGUE

Nombre de positions actions	30
Poids des 10 premières lignes (%)	22,3%
Capitalisation Médiane (en Milliard d'€)	3,1
Rendement du dividende	2,0%
Liquidité < 10 jours (tiers volume)	100%

PRINCIPALES POSITIONS

PRINCIPALES POSITIONS	POIDS
FUTURES SHORT STOXX 600	-23,4%
GEMALTO	2,2%
AMBU A/S-B	2,1%
ELEN SPA	2,1%
CANCOM SE	2,1%
LEG IMMOBILIEEN AG	2,1%

PERFORMANCES PART I

	FONDS	INDICE
1 mois	NC	NC
YTD	NC	NC
1 an	NC	NC
Création (13/07/2017)	NC	NC

STATISTIQUES (1 AN)

	PART I
Volatilité (52 sem., vendredi)	NC
Max drawdown	NC
Corrélation actions	NC
Alpha	NC
Ratio de Sharpe	NC
Value at Risk (20j, 99%)	NC

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
Liquidité	Hebdomadaire
Forme juridique	FCP, UCITS 4
Indice de référence	30% Stoxx 600 TR + 70% Eonia Capitalisé
Devise de cotation	Euro
Affectation des dividendes	Capitalisation
Durée minimum	5 ans

PRESTATAIRES ET FRAIS

Dépositaire	CACEIS Bank France
Valorisateur	CACEIS Investor Services
Commissaire aux comptes	PWC Sellam
Frais de gestion fixe Part I	1,50%
Frais de gestion fixe Part R	2,00%
Frais de gestion variables	Maximum 20% TTC de la performance positive nette au-delà de l'indice de référence avec high water mark

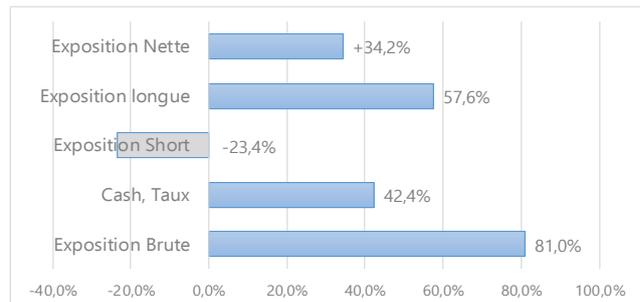
RISQUES DU FONDS

Risque de perte en capital
Risque action
Risque de liquidité
Risque de crédit

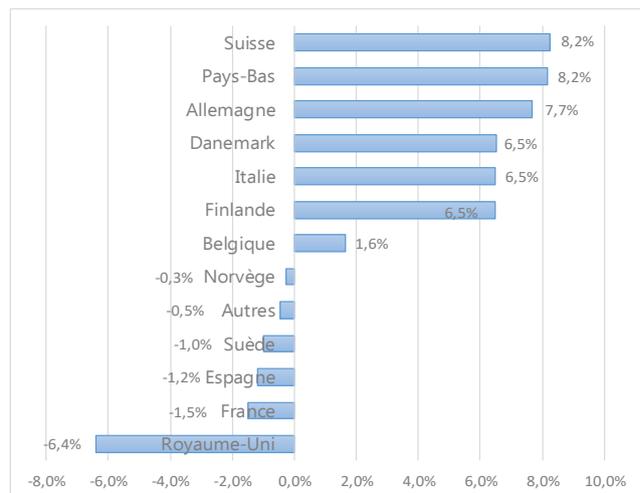
GRAPHIQUE - PART I / VL : 100594,0€

Conformément à la réglementation le fonds n'est pas autorisé à afficher ses performances avant sa première année

EXPOSITIONS DU PORTEFEUILLE



EXPOSITION NETTE GEOGRAPHIQUE



EXPOSITION NETTE SECTORIELLE

