

FCP de droit français

QUANTOLOGY SMALL

PLAQUETTE SEMESTRIELLE

au 23 février 2018

Société de Gestion : QUANTOLOGY Capital Management

Dépositaire : Caceis Bank

Commissaire aux comptes : PriceWaterhouseCoopers Audit

QUANTOLOGY Capital Management - 5, avenue Ingres - 75016 - Paris

- **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. 214-20 du code monétaire et financier.	371 124,89
b) Avoirs bancaires	77 034,56
c) Autres actifs détenus par l'OPC	52 593,66
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	500 753,11
e) Passif	-16 515,09
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	484 238,02

* Les montants sont signés

- **NOMBRE DE PARTS EN CIRCULATION ET VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR PART**

Part	Type de part	Actif net par part	Nombre de parts en circulation	Valeur nette d'inventaire par part
QUANTOLOGY SMALL Part I	C	308 815,26	3,000	102 938,42
QUANTOLOGY SMALL Part R	C	175 422,76	1 709,000	102,64

• **ELEMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES**

Eléments du portefeuille titres	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
<p>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-I du code monétaire et financier.</p> <p>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.</p>	74,47	72,01
<p>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 de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières.</p>	2,17	2,10
<p>D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-II du code monétaire et financier.</p>		
<p>E) Les autres actifs : Il s'agit des actifs mentionnés au II de l'article R. 214-II du code monétaire et financier.</p>		

* 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 **
Euro	EUR	360 598,16	74,47	72,01
Franc suisse	CHF	10 526,73	2,17	2,10
TOTAL		371 124,89	76,64	74,11

* 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 **
France	20,57	19,89
Allemagne	16,45	15,91
Autriche	12,70	12,28
Italie	8,60	8,32
Espagne	4,20	4,06
Finlande	3,97	3,84
Belgique	3,86	3,73
Suisse	2,17	2,10
Pays-bas	2,07	2,00
Irlande	2,05	1,98
TOTAL	76,64	74,11

* 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		
Autres Fonds destinés à des non professionnels et équivalents d'autres pays Etats membres de l'UE		
Fonds professionnels à vocation générale et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations cotés		
Autres Fonds d'investissement professionnels et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations non cotés		
Autres organismes non européens		
Autres		
TOTAL		

* 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 PERIODE 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-I 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.	1 028 177,15	681 650,68
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 de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières.	48 094,16	36 704,98
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-II du code monétaire et financier.		
E) Les autres actifs : Il s'agit des actifs mentionnés au II de l'article R. 214-II du code monétaire et financier.		

- **INFORMATIONS DIVERSES**

Etablissement dépositaire : - - -

Le relevé Périodicité Semestrielle détaillé de l'actif est disponible dans un délai de huit semaines à compter de la fin de la période. Il peut être transmis sur simple demande auprès de la société de gestion :

QUANTOLOGY Capital Management - 5, avenue Ingres - 75016 - Paris

- **TRANSPARENCE DES OPERATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET DE LA REUTILISATION DES INSTRUMENTS FINANCIERS – REGLEMENT SFTR – en devise de comptabilité de l'OPC (EUR)**

Au cours de l'exercice, l'OPC n'a pas fait l'objet d'opérations relevant de la réglementation SFTR.

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 23/02/2018 EN EUR**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Actions et valeurs assimilées				
Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé				
ALLEMAGNE				
BERTRANDT AG	EUR	97	9 447,80	1,95
BET-AT-HOME.COM AG	EUR	82	8 171,30	1,69
CARL ZEISS MEDITEC AG	EUR	180	9 027,00	1,86
ELRINGKLINGER AG	EUR	616	10 398,08	2,15
MLP GROUP	EUR	1 826	9 842,14	2,03
RIB SOFTWARE	EUR	420	11 575,20	2,39
ROCKET INTERNET AG	EUR	461	11 008,68	2,27
STADA AEZNEIMITTEL AG NAMEN	EUR	118	10 183,40	2,10
TOTAL ALLEMAGNE			79 653,60	16,44
AUTRICHE				
TELEKOM AUSTRIA AG	EUR	1 242	9 588,24	1,98
TOTAL AUTRICHE			9 588,24	1,98
BELGIQUE				
ECONOCOM GROUP NV	EUR	1 566	10 351,26	2,14
ION BEAM APPLICATIONS NV	EUR	405	8 326,80	1,72
TOTAL BELGIQUE			18 678,06	3,86
ESPAGNE				
CIE AUTOMOTIVE SA	EUR	393	10 783,92	2,23
MELIA HOTELS INTERNATIONAL	EUR	849	9 534,27	1,97
TOTAL ESPAGNE			20 318,19	4,20
FINLANDE				
KESKO OYJ B	EUR	211	10 178,64	2,10
KONECRANES SHS	EUR	250	9 067,50	1,87
TOTAL FINLANDE			19 246,14	3,97
FRANCE				
CHARGEURS INTERNATIONAL	EUR	390	9 945,00	2,05
DBV TECHNOLOGIES	EUR	260	9 557,60	1,97
GUERBET	EUR	128	8 563,20	1,77
ID LOGISTICS GROUP	EUR	71	9 514,00	1,96
JACQUET METAL SERVICE SA	EUR	360	10 368,00	2,15
MAISONS DU MONDE	EUR	263	9 362,80	1,93
RUBIS	EUR	181	10 769,50	2,23
TOTAL FRANCE			68 080,10	14,06

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 23/02/2018 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
IRLANDE				
SMURFIT KAPPA PLC	EUR	349	9 911,60	2,05
TOTAL IRLANDE			9 911,60	2,05
ITALIE				
ANIMA HOLDING SPA	EUR	1 653	10 182,48	2,10
MARR SPA	EUR	447	9 646,26	1,99
UBI BANCA AZ / EX-BANCHE POPOLARI UNITE SCARL	EUR	2 568	10 243,75	2,12
YOOX NetAPorter Group	EUR	307	11 595,39	2,39
TOTAL ITALIE			41 667,88	8,60
PAYS-BAS				
GEMALTO	EUR	203	10 028,20	2,07
TOTAL PAYS-BAS			10 028,20	2,07
SUISSE				
FEINTOOL INTL-RG	CHF	97	10 526,73	2,17
TOTAL SUISSE			10 526,73	2,17
TOTAL Actions & val. ass. ng. sur marchés régl. ou ass.			287 698,74	59,40
TOTAL Actions et valeurs assimilées			287 698,74	59,40
Obligations et valeurs assimilées				
Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé				
AUTRICHE				
NOVO 4 01/28/19	EUR	50 000	51 911,88	10,72
TOTAL AUTRICHE			51 911,88	10,72
FRANCE				
LAFARGE 5.0% 13-04-18 EMTN	EUR	30 000	31 514,27	6,51
TOTAL FRANCE			31 514,27	6,51
TOTAL Obligations & val. ass. ng. sur mar. régl. ou ass.			83 426,15	17,23
TOTAL Obligations et valeurs assimilées			83 426,15	17,23
Organismes de placement collectif				
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays				
FRANCE				
QUANTOLOGY SMART PART I	EUR	0,4	43 233,52	8,93
TOTAL FRANCE			43 233,52	8,93
TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays			43 233,52	8,93
TOTAL Organismes de placement collectif			43 233,52	8,93

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 23/02/2018 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Instruments financiers à terme				
Engagements à terme ferme				
Engagements à terme ferme sur marché réglementé ou assimilé				
EUR DJE 600 EUR 0318	EUR	-6	2 403,00	0,50
TOTAL Engagements à terme fermes sur marché réglementé			2 403,00	0,50
TOTAL Engagements à terme fermes			2 403,00	0,50
TOTAL Instruments financiers à terme			2 403,00	0,50
Appel de marge				
Appels de marges C.A.Indo en euro	EUR	-2 403	-2 403,00	-0,50
TOTAL Appel de marge			-2 403,00	-0,50
Créances			6 957,14	1,44
Dettes			-3 400,76	-0,70
Comptes financiers			66 323,23	13,70
Actif net			484 238,02	100,00