

Rapport Mensuel août 2018

31/08/2018

Profil de risque (SRRI)

1 2 3 4 5 6 7

STRATEGIE ET OBJECTIF DE GESTION

Quantology Smart est un fonds d'arbitrage actions US basé sur un modèle quantitatif propriétaire. La stratégie consiste à capturer les tendances post publications de résultats. Le fonds adopte une approche systématique en prenant des positions acheteuses ou vendeuses en fonction du déclenchement du signal. L'univers d'investissement est composé des actions américaines. L'objectif du fonds est d'offrir au travers d'un véhicule long/short market neutre (+/-20%) une performance régulière, faiblement volatile et décorrélée des actifs traditionnels.

CARACTÉRISTIQUES

Date de création	01/08/2016
Catégorie	Performance absolue
ISIN Part I	FR0013185261
ISIN Part R	FR0013185279
Gérant	Julien Messias
Valorisation	Hebdomadaire
Forme juridique	FCP, UCITS 4
Indice	Eonia capitalisé +1%
Affectation des dividendes	Capitalisation
Durée minimum d'investissement recommandée	3 ans
Encours (millions €)	9,0

PRESTATAIRES ET FRAIS

Dépositaire, Valorisateur	Caceis
Prime Broker	Global Prime Partners
Commissaire aux comptes	PWC Sellam
Frais de gestion fixe Part I	1% annuel TTC
Frais de gestion fixe Part R	1,2% annuel TTC
Frais de gestion variables	Maximum 10% TTC de la performance positive nette au-delà de l'indice de référence avec high water mark

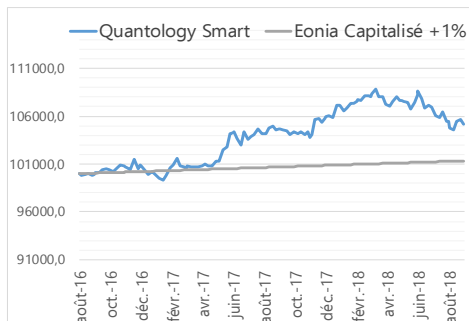
RISQUES DU FONDS

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

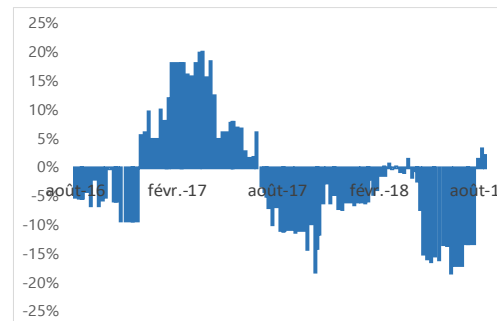
Les chiffres cités ont trait aux années écoulées.

Les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures.

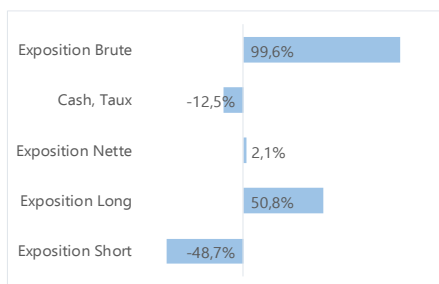
GRAPHIQUE - PART I



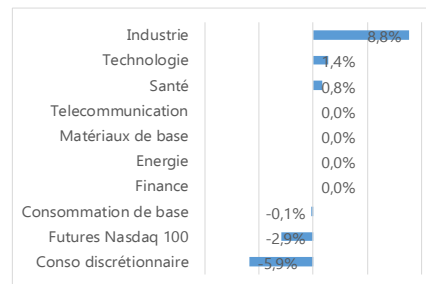
EVOLUTION DE L'EXPOSITION NETTE



ALLOCATION DU PORTEFEUILLE



EXPOSITION NETTE SECTORIELLE



PRINCIPALES POSITIONS LONGUES

ILLUMINA INC	5,31%
QUALCOMM INC	4,94%
XILINX INC	4,82%

PRINCIPALES POSITIONS SHORT

DOLLAR TREE INC	-5,37%
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	-4,63%
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	-4,60%

PERFORMANCES PART I INDICE

PERFORMANCES	PART I	INDICE
2018	-1,77%	0,43%
1 an	0,50%	0,64%
3 ans	-	-
Création (01/08/2016)	5,20%	1,34%

STATISTIQUES 1 AN PART I

STATISTIQUES 1 AN	PART I
Volatilité (52 sem, vendredi)	3,75%
Perte Maximum	-3,86%
Ratio de Sharpe	0,22
Value at Risk (20j, 99%)*	6,75%

PERFORMANCES MENSUELLES

	Jan	Fev	Mar	Avr	Mai	Juin	Juil	Août	Sept	Oct	Nov	Dec	YTD
2016								-0,06%	0,45%	0,28%	0,27%	-1,15%	-0,21%
2017	1,04%	-0,31%	0,33%	0,49%	2,88%	-0,69%	0,60%	0,53%	-0,37%	-0,53%	1,93%	1,25%	7,32%
2018	0,45%	0,43%	-0,75%	0,38%	0,56%	-1,23%	-1,36%	-0,25%					-1,77%

*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