

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 (en millions d'€)

8,3

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 |

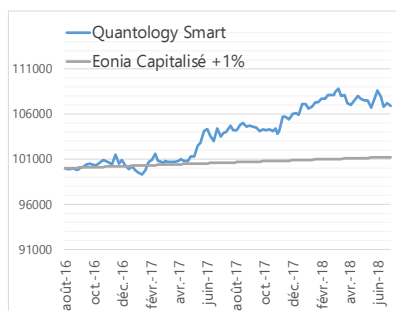
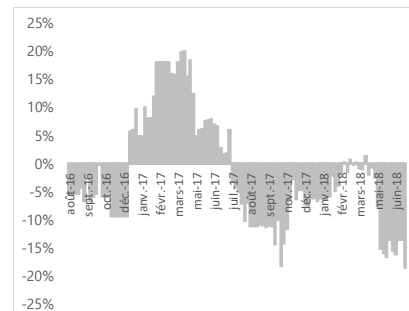
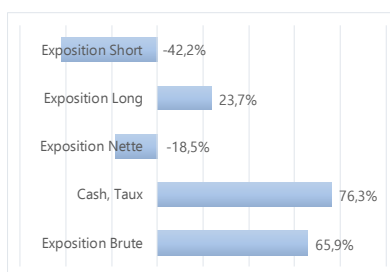
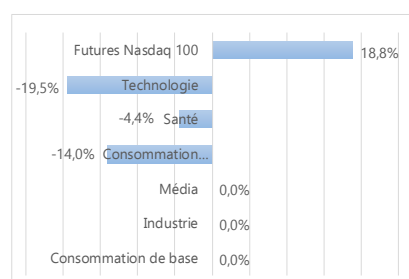
RISQUES DU FONDS

Risque de perte en capital

Risque action

Risque de crédit

Risque de contrepartie

GRAPHIQUE - PART I**EVOLUTION DE L'EXPOSITION NETTE****ALLOCATION DU PORTEFEUILLE****EXPOSITION NETTE SECTORIELLE****PRINCIPALES POSITIONS LONGUES**

| | |
|--------------------|--------|
| FUTURES NASDAQ 100 | 18,80% |
| OREILLY AUTOMOTIVE | 4,92% |

PRINCIPALES POSITIONS SHORT

| | |
|-----------------------|--------|
| CERNER CORP | -5,21% |
| CHARTER COMMUNICATION | -5,09% |
| HOLOGIC INC | -5,03% |

| PERFORMANCES | PART I | INDICE |
|-----------------------|--------|--------|
| 2018 | -0,17% | 0,32% |
| 1 an | 2,40% | 0,65% |
| 3 ans | - | - |
| Création (01/08/2016) | 6,91% | 1,22% |

| STATISTIQUES 1 AN | PART I |
|-------------------------------|--------|
| Volatilité (52 sem, vendredi) | 3,54% |
| Perte Maximum | -1,93% |
| Ratio de Sharpe | 0,76 |
| Value at Risk (20j, 99%)* | 8,16% |

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% | | | | | | | -0,17% |

*Cornish-Fischer adjusted