

STRATEGIE ET OBJECTIF DE GESTION

Quantology Smart est un fonds quantitatif issu de la recherche propriétaire de Quantology CM. La stratégie vise à détecter, le jour de la publication des résultats d'une société, le signal de performance vecteur d'une tendance haussière ou baissière de l'action. 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 valeurs du Nasdaq. 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'euros) | 2,0 |

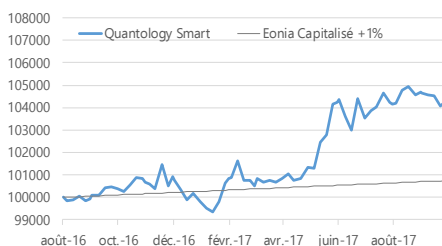
PRESTATAIRES ET FRAIS

| | |
|------------------------------|--|
| 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 |

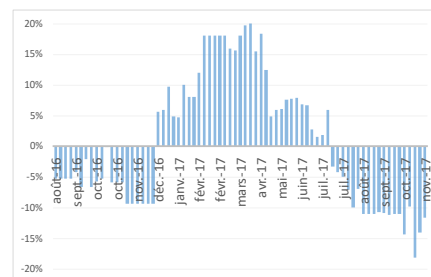
RISQUES DU FONDS

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

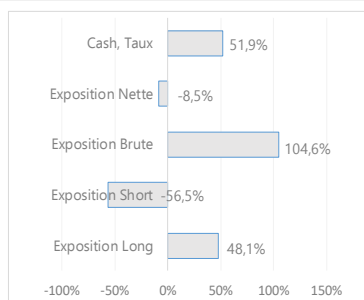
GRAPHIQUE - PART I



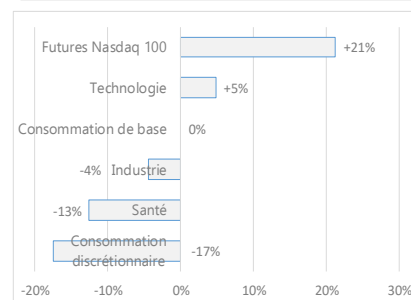
EVOLUTION DE L'EXPOSITION NETTE



ALLOCATION DU PORTEFEUILLE



EXPOSITION NETTE SECTORIELLE



PRINCIPALES POSITIONS LONGUES

| | |
|-----------------------|--------|
| NASDAQ 100 STOCK INDX | 21,24% |
| AMAZON.COM INC | 4,72% |
| ALIGN TECHNOLOGY INC | 4,61% |

PRINCIPALES POSITIONS SHORT

| | |
|-------------------------|-------|
| PRICELINE GROUP INC/THE | 4,80% |
| CELGENE CORP | 4,72% |
| HASBRO INC | 4,55% |

| PERFORMANCES | PART I | INDICE |
|-----------------------|--------|--------|
| YTD | 4,00% | 0,53% |
| 1 an | 3,08% | 0,64% |
| 3 ans | - | - |
| Création (01/08/2016) | 3,77% | 0,80% |

| STATISTIQUES 1 AN | PART I |
|--------------------------------|--------|
| Volatilité (52 sem., vendredi) | 3,63% |
| Perte Maximum | -2,10% |
| Ratio de Sharpe | 1,04 |
| Value at Risk (20j, 99%) * | 3,43% |

PERFORMANCES MENSUELLES

| | Jan | Fev | Mar | Avr | Mai | Juin | Juil | Aout | 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% | | | 4,00% |

*Cornish-Fischer adjusted