

Rapport Mensuel Mai 2018

Profil de risque (SRRI)

Au 31/05/2018

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**

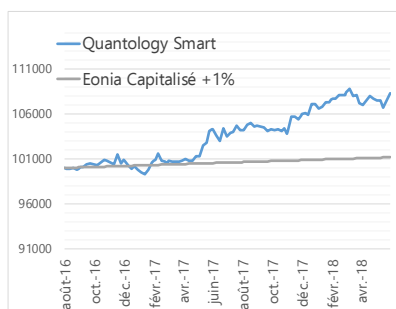
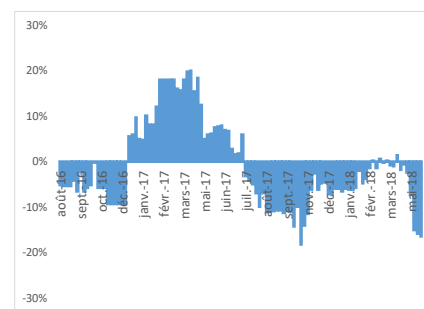
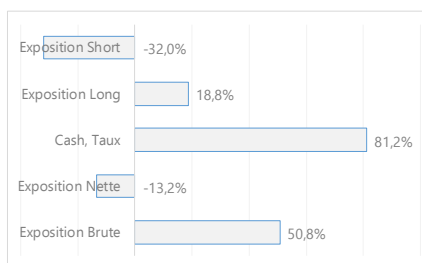
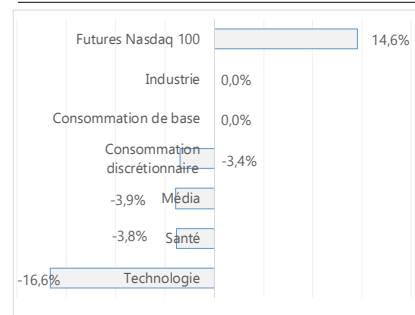
Date de création	01/08/2016
Catégorie	Performance absolue
ISIN Part I	FR0013185261
ISIN Part R	FR0013185279
Gérant	Julien Messias
Valorisation	Hebdomadaire
Forme juridique	FCP, UCITS 4
Indice	Eonia capitalisé +1%
Affectation des dividendes	Capitalisation
Durée minimum d'investissement recommandée	3 ans
Encours (en millions d'€)	7,3

**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	14,56%
OREILLY AUTOMOTIVE	4,23%

**PRINCIPALES POSITIONS SHORT**

CERNER CORP	-4,49%
HOLOGIC INC	-4,21%
CHECK POINT SOFTWARE TECH	-4,04%

PERFORMANCES	PART I	INDICE
2018	1,07%	0,27%
1 an	3,82%	0,64%
3 ans	-	-
Création (01/08/2016)	8,23%	1,17%

STATISTIQUES 1 AN	PART I
Volatilité (52 sem, vendredi)	3,76%
Perte Maximum	-1,93%
Ratio de Sharpe	1,17
Value at Risk (20j, 99%)*	3,88%

**PERFORMANCES MENSUELLES**

	Jan	Fev	Mar	Avr	Mai	Juin	Juil	Aout	Sept	Oct	Nov	Dec	YTD
<b>2016</b>								-0,06%	0,45%	0,28%	0,27%	-1,15%	<b>-0,21%</b>
<b>2017</b>	1,04%	-0,31%	0,33%	0,49%	2,88%	-0,69%	0,60%	0,53%	-0,37%	-0,53%	1,93%	1,25%	<b>7,32%</b>
<b>2018</b>	0,45%	0,43%	-0,75%	0,38%	0,56%								<b>1,07%</b>

\*Cornish-Fischer adjusted