

Rapport Mensuel Mars 2018

Profil de risque (SRRI)

Au 29/03/2018

1 2 3 4 5 6 7

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

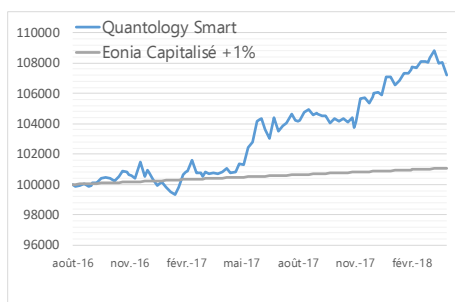
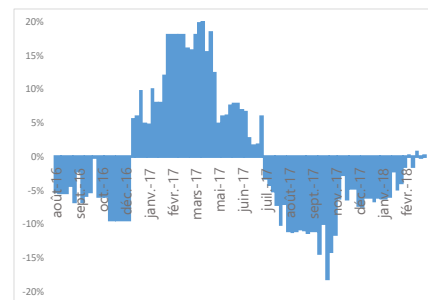
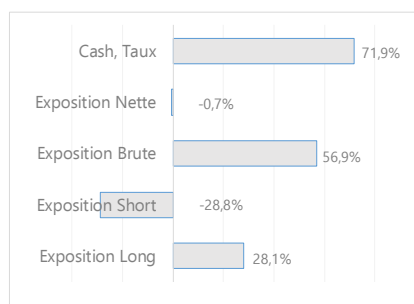
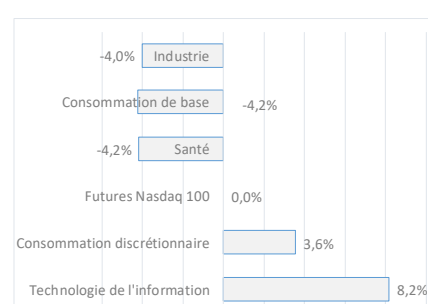
Date de création	01/08/2016
Catégorie	Performance absolue
ISIN Part I	FR0013185261
ISIN Part R	FR0013185279
Gérant	Julien Messias
Valorisation	Hebdomadaire
Forme juridique	FCP, UCITS 4
Indice	Eonia capitalisé + 1%
Affectation des dividendes	Capitalisation
Durée minimum d'investissement recommandée	3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

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**

NETFLIX INC	4,48%
BOOKING HOLDINGS INC	4,35%
AUTODESK INC	4,19%

PRINCIPALES POSITIONS SHORT

DOLLAR TREE	-4,74%
MONSTER BEVERAGE CORP	-4,22%
HOLOGIC INC	-4,18%

PERFORMANCES	PART I	INDICE
2018	0,12%	0,16%
1 an	6,50%	0,65%
3 ans	-	-
Création (01/08/2016)	7,22%	1,06%

STATISTIQUES 1 AN	PART I
Volatilité (52 sem, vendredi)	3,82%
Perte Maximum	-2,10%
Ratio de Sharpe	1,75
Value at Risk (20, 99%) *	0,72%

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%	1,93%	1,25%	7,32%
2018	0,45%	0,43%	-0,75%										0,12%

*Cornish-Fischer adjusted