

FCP de droit français

QUANTOLOGY SMART

PLAQUETTE SEMESTRIELLE

au 28 février 2018

Société de Gestion : QUANTOLOGY Capital Management
Dépositaire : Caceis Bank
Commissaire aux comptes : PriceWaterhouseCoopers Audit

QUANTOLOGY Capital Management - 5, avenue Ingres - 75016 - Paris

- **ETAT DU PATRIMOINE EN EUR**

Eléments de l'état du patrimoine	Montant à l'arrêté périodique *
a) Titres financiers éligibles mentionnés au 1° du I de l'article L. 214-20 du code monétaire et financier.	4 385 958,57
b) Avoirs bancaires	811 238,72
c) Autres actifs détenus par l'OPC	282 646,10
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	5 479 843,39
e) Passif	-784 861,59
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	4 694 981,80

* Les montants sont signés

- **NOMBRE DE PARTS EN CIRCULATION ET VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR PART**

Part	Type de part	Actif net par part	Nombre de parts en circulation	Valeur nette d'inventaire par part
QUANTOLOGY SMART Part I	C	3 836 762,81	35,512	108 041,30
QUANTOLOGY SMART Part R	C	858 218,99	7 967,614	107,71

• **ELEMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES**

Eléments du portefeuille titres	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
<p>A) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-I du code monétaire et financier.</p> <p>Et B) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen.</p>	64,29	55,08
<p>C) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières.</p>	29,13	24,96
<p>D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-II du code monétaire et financier.</p>		
<p>E) Les autres actifs : Il s'agit des actifs mentionnés au II de l'article R. 214-II du code monétaire et financier.</p>		

* Se reporter au f) de l'état du patrimoine

** Se reporter au d) de l'état du patrimoine

• **RÉPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C), D) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR DEVISE**

Titres	Devise	En montant (EUR)	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
Dollar us	USD	1 367 740,22	29,13	24,96
Euro	EUR	3 018 218,35	64,29	55,08
TOTAL		4 385 958,57	93,42	80,04

* Se reporter au f) de l'état du patrimoine

** Se reporter au d) de l'état du patrimoine

- **RÉPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C), D) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR PAYS DE RÉSIDENCE DE L'ÉMETTEUR**

Pays	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
France	50,93	43,63
Etats unis americque	29,13	24,96
Autriche	8,85	7,58
Luxembourg	4,51	3,87
TOTAL	93,42	80,04

* Se reporter au f) de l'état du patrimoine

** Se reporter au d) de l'état du patrimoine

• **RÉPARTITION DES AUTRES ACTIFS DU E) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR NATURE**

Nature d'actifs	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
Organismes de placement collectif		
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays		
Autres Fonds destinés à des non professionnels et équivalents d'autres pays Etats membres de l'UE		
Fonds professionnels à vocation générale et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations cotés		
Autres Fonds d'investissement professionnels et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations non cotés		
Autres organismes non européens		
Autres		
TOTAL		

* Se reporter au f) de l'état du patrimoine

** Se reporter au d) de l'état du patrimoine

- **MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PERIODE EN EUR**

Eléments du portefeuille titres	Mouvements (en montant)	
	Acquisitions	Cessions
A) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1 du code monétaire et financier. Et B) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen.	3 422 456,91	1 281 525,18
C) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières.	2 428 884,86	1 514 822,34
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.		
E) Les autres actifs : Il s'agit des actifs mentionnés au II de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.		

- **INFORMATIONS DIVERSES**

Etablissement dépositaire : *Caceis Bank - 1-3 place Valhubert - 75013 - Paris*

Le relevé Périodicité Semestrielle détaillé de l'actif est disponible dans un délai de huit semaines à compter de la fin de la période. Il peut être transmis sur simple demande auprès de la société de gestion :

QUANTOLOGY Capital Management - 5, avenue Ingres - 75016 - Paris

- **TRANSPARENCE DES OPERATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET DE LA REUTILISATION DES INSTRUMENTS FINANCIERS – REGLEMENT SFTR – en devise de comptabilité de l'OPC (EUR)**

Au cours de l'exercice, l'OPC n'a pas fait l'objet d'opérations relevant de la réglementation SFTR.

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 28/02/2018 EN EUR**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Actions et valeurs assimilées				
Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé				
ETATS UNIS AMERIQUE				
AMAZON.COM INC	USD	160	198 354,10	4,22
EBAY INC	USD	5 240	184 087,21	3,92
FISERV INC	USD	1 660	195 104,43	4,16
NETFLIX INC	USD	920	219 729,18	4,68
PRICELINE GROUP INC/THE	USD	124	206 738,49	4,40
ROSS STORES	USD	3 130	200 345,66	4,27
WYNN RESORTS	USD	1 190	163 381,15	3,48
TOTAL ETATS UNIS AMERIQUE			1 367 740,22	29,13
TOTAL Actions & val. ass. ng. sur marchés régl. ou ass.			1 367 740,22	29,13
TOTAL Actions et valeurs assimilées			1 367 740,22	29,13
Obligations et valeurs assimilées				
Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé				
AUTRICHE				
NOVO 4 01/28/19	EUR	400 000	415 322,58	8,85
TOTAL AUTRICHE			415 322,58	8,85
FRANCE				
ARGAN 5.5% 25/11/2018	EUR	170 000	177 754,79	3,79
B E3R+0.9% 18-04-18 EMTN	EUR	100 000	100 156,20	2,13
BANQUE FED CRED MUTUEL 5.3% 06/12/2018	EUR	253 000	266 752,49	5,68
DEXIA CREDIT LOCAL 5.1% 27/04/18	EUR	300 000	314 762,50	6,71
LAFARGE 5.0% 13-04-18 EMTN	EUR	90 000	94 539,29	2,01
PEUGEOT SA 7.375% 03/2018	EUR	80 000	85 975,34	1,83
REGION PAYS LOIRE 4% 10/18	EUR	250 000	260 311,75	5,54
SG 4.35% 15/05/18 TSR	EUR	90 000	93 924,52	2,00
TOTAL FRANCE			1 394 176,88	29,69
LUXEMBOURG				
MTNA 3 03/25/19	EUR	200 000	211 929,92	4,51
TOTAL LUXEMBOURG			211 929,92	4,51
TOTAL Obligations & val. ass. ng. sur mar. régl. ou ass.			2 021 429,38	43,05
TOTAL Obligations et valeurs assimilées			2 021 429,38	43,05
Titres de créances				
Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé				
FRANCE				
ALTAREIT ZCP 20-12-18	EUR	200 000	199 739,01	4,25
CASI GUIC PERR ZCP 28-12-18	EUR	200 000	199 882,62	4,26

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 28/02/2018 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CASI GUIC PERR ZCP 29-06-18	EUR	200 000	200 000,00	4,26
VALLOUREC ZCP 05-02-19	EUR	150 000	148 467,12	3,16
VALLOUREC ZCP 20-06-18	EUR	100 000	99 787,70	2,13
VALLOUREC ZCP 26-10-18	EUR	150 000	148 912,52	3,17
TOTAL FRANCE			996 788,97	21,23
TOTAL Titres de créances négo. sur marchés régl. ou ass.			996 788,97	21,23
TOTAL Titres de créances			996 788,97	21,23
Instruments financiers à terme				
Engagements à terme ferme				
Engagements à terme ferme sur marché réglementé ou assimilé				
EC EURUSD 0318	USD	12	24 042,01	0,51
NQ USA NASDAQ 0318	USD	-2	1 438,52	0,03
TOTAL Engagements à terme fermes sur marché réglementé			25 480,53	0,54
TOTAL Engagements à terme fermes			25 480,53	0,54
Autres instruments financiers à terme				
Autres Swaps				
HOLX HOLOGIC 1230	USD	-6 550	-7 423,10	-0,16
SBUX STARB GP 1230	USD	-4 070	-2 376,16	-0,05
TOTAL Autres SWAPS			-9 799,26	-0,21
CFD				
ADSK AUTOD NO 1230	USD	-1 750	-4 662,88	-0,10
GP TEXAS INST 1230	USD	-2 080	779,64	0,02
GPP FASTENAL 1230	USD	-4 440	-1 345,66	-0,03
NS EXPEDIA 1230	USD	-2 200	-617,82	-0,01
TOTAL CFD			-5 846,72	-0,12
TOTAL Autres instruments financiers à terme			-15 645,98	-0,33
TOTAL Instruments financiers à terme			9 834,55	0,21
Appel de marge				
Appels marges C.A.I.	USD	-31 086,25	-25 480,53	-0,54
TOTAL Appel de marge			-25 480,53	-0,54
Créances			256 385,93	5,46
Dettes			-742 955,44	-15,82
Comptes financiers			811 238,72	17,28
Actif net			4 694 981,80	100,00