

**FCP de droit français**

**QUANTOLOGY LONG  
SHORT EUROPE**

**PLAQUETTE SEMESTRIELLE**

au 28 février 2022

**Société de gestion : QUANTOLOGY Capital Management  
Dépositaire : CACEIS Bank  
Commissaire aux comptes : PriceWaterhouseCoopers Audit**

QUANTOLOGY Capital Management - 14, rue de Tilsitt - 75008 - 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	1 017 299,44
b) Avoirs bancaires	114 552,03
c) Autres actifs détenus par l'OPC	190 298,21
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	1 322 149,68
e) Passif	-207 940,40
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	1 114 209,28

\* 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 LONG SHORT EUROPE Part I en EUR	C	326 925,03	3,730	87 647,46
QUANTOLOGY LONG SHORT EUROPE Part R en EUR	C	787 284,25	9 180,379	85,75

## ELEMENT DU PORTEFEUILLE TITRES

Eléments du portefeuille titres	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
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. 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.	87,22	73,50
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.	4,08	3,44
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-I I du code monétaire et financier.		
E) Les autres actifs.	8,62	7,26

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

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

**REPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C) ET D) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR DEVISE**

Titres	Devise	En montant (EUR)	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
Euro	EUR	665 393,89	59,72	50,33
Couronne Suédoise	SEK	203 701,80	18,28	15,41
Couronne Norvégienne	NOK	71 149,35	6,39	5,38
Couronne Danoise	DKK	31 596,07	2,84	2,39
Livre Sterling	GBP	22 915,28	2,06	1,73
Franc Suisse	CHF	22 543,05	2,02	1,71
TOTAL		1 017 299,44	91,30	76,94

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

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

**REPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C) ET D) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR PAYS DE RESIDENCE DE L'EMETTEUR**

<b>Pays</b>	<b>Pourcentage actif net *</b>	<b>Pourcentage total des actifs **</b>
SUEDE	18,28	15,41
ITALIE	14,04	11,83
ALLEMAGNE	11,60	9,78
PAYS-BAS	9,49	7,99
FRANCE	8,12	6,85
AUTRICHE	7,73	6,51
NORVEGE	6,39	5,38
BELGIQUE	5,12	4,31
DANEMARK	2,84	2,39
FINLANDE	2,29	1,93
ROYAUME-UNI	2,06	1,73
SUISSE	2,02	1,71
ESPAGNE	1,34	1,13
TOTAL	91,30	76,94

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

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

## REPARTITION DES AUTRES ACTIFS DU E) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR NATURE

Nature d'actifs	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
<b>Organismes de placement collectif</b>		
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays	8,62	7,26
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		
<b>Autres actifs</b>		
Autres		
<b>TOTAL</b>	<b>8,62</b>	<b>7,26</b>

\* 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-I 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.	1 754 090,30	1 503 145,37
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.	152 468,60	169 993,68
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.	239 162,34	120 267,99

## INFORMATION SUR LES FRAIS DE GESTION VARIABLES

	28/02/2022
<b>Parts QUANTOLOGY LONG SHORT EUROPE Part I</b> Frais de gestion variables provisionnés Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés Frais de gestion variables acquis Pourcentage de frais de gestion variables acquis	
<b>Parts QUANTOLOGY LONG SHORT EUROPE Part R</b> Frais de gestion variables provisionnés Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés Frais de gestion variables acquis Pourcentage de frais de gestion variables acquis	

« Le montant des frais de gestion variables affiché ci-dessus correspond à la somme des provisions et reprises de provisions ayant impacté l'actif net au cours de la période sous revue. »

## **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** - *14, rue de Tilsitt - 75008 - 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 28/02/2022 EN EUR**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
<b>Actions et valeurs assimilées</b>				
<b>Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>				
<b>ALLEMAGNE</b>				
AURUBIS AG	EUR	350	36 767,50	3,30
EVOTEC OAI AG	EUR	696	18 471,84	1,66
FREENET NOM.	EUR	1 312	31 461,76	2,83
METRO WHOLESAL & FOOD SPECI	EUR	780	6 520,80	0,58
SURTECO GROUP AG	EUR	120	3 684,00	0,33
VERBIO VEREINIGTE BIOENERGIE AG	EUR	458	32 334,80	2,90
<b>TOTAL ALLEMAGNE</b>			<b>129 240,70</b>	<b>11,60</b>
<b>AUTRICHE</b>				
AT&S	EUR	600	29 340,00	2,64
EVN AG	EUR	1 116	27 732,60	2,49
TELEKOM AUSTRIA AG	EUR	3 981	29 021,49	2,60
<b>TOTAL AUTRICHE</b>			<b>86 094,09</b>	<b>7,73</b>
<b>BELGIQUE</b>				
ACKERMANS HAAREN	EUR	185	30 895,00	2,77
WAREHOUSES DE PAUW SCA	EUR	741	26 098,02	2,34
<b>TOTAL BELGIQUE</b>			<b>56 993,02</b>	<b>5,11</b>
<b>DANEMARK</b>				
TOPDANMARK AS	DKK	620	31 596,07	2,83
<b>TOTAL DANEMARK</b>			<b>31 596,07</b>	<b>2,83</b>
<b>ESPAGNE</b>				
ACCIONA S.A.	EUR	50	7 655,00	0,69
ALMIRALL SA	EUR	620	7 278,80	0,65
<b>TOTAL ESPAGNE</b>			<b>14 933,80</b>	<b>1,34</b>
<b>FINLANDE</b>				
VALMET CORP	EUR	820	25 502,00	2,29
<b>TOTAL FINLANDE</b>			<b>25 502,00</b>	<b>2,29</b>
<b>FRANCE</b>				
ALD SA	EUR	2 361	29 512,50	2,65
ALTEN	EUR	202	27 512,40	2,47
BOIRON	EUR	180	7 515,00	0,67
VIRBAC SA	EUR	71	25 986,00	2,34
<b>TOTAL FRANCE</b>			<b>90 525,90</b>	<b>8,13</b>
<b>ITALIE</b>				
BANCA GENERALI SPA	EUR	772	25 499,16	2,29
BANCA MEDIOLANUM	EUR	3 526	25 958,41	2,33

**PORTEFEUILLE TITRES AU 28/02/2022 EN EUR (suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
BREMBO SPA	EUR	2 409	25 535,40	2,29
ITALMOBILIARE - REGISTERED	EUR	927	28 458,90	2,56
PIRELLI & C. SPA	EUR	5 210	25 753,03	2,31
REPLY FRAZION	EUR	173	25 206,10	2,26
<b>TOTAL ITALIE</b>			<b>156 411,00</b>	<b>14,04</b>
<b>NORVEGE</b>				
KONGBERG GRUPPEN	NOK	1 136	35 593,95	3,19
NORSK HYDRO ASA	NOK	1 000	8 440,23	0,76
TOMRA SYSTEMS ASA	NOK	503	21 095,09	1,90
XXL ASA	NOK	5 000	6 020,08	0,54
<b>TOTAL NORVEGE</b>			<b>71 149,35</b>	<b>6,39</b>
<b>PAYS-BAS</b>				
ACCELL GROUP	EUR	160	9 216,00	0,83
ARCADIS	EUR	180	7 315,20	0,66
ASR NEDERLAND NV	EUR	756	29 128,68	2,61
FUGRO NV	EUR	800	6 864,00	0,61
IMCD BV	EUR	280	40 516,00	3,64
TKH GROUP	EUR	100	4 930,00	0,44
WERELDHAVE NV	EUR	475	7 723,50	0,69
<b>TOTAL PAYS-BAS</b>			<b>105 693,38</b>	<b>9,48</b>
<b>ROYAUME-UNI</b>				
ALFA FINANCIAL SOFTWARE H-WI	GBP	2 600	4 973,76	0,44
CONVATEC GROUP PLC	GBP	3 000	6 465,29	0,58
FEVERTREE DRINKS PLC	GBP	0,000000039		
INDIVIOR PLC	GBP	1 700	5 707,39	0,51
MAN GROUP PLC	GBP	2 500	5 768,84	0,52
<b>TOTAL ROYAUME-UNI</b>			<b>22 915,28</b>	<b>2,05</b>
<b>SUEDE</b>				
ALIMAK GROUP AB	SEK	660	6 710,54	0,60
AXFOOD AB	SEK	1 800	42 161,15	3,78
BETSSON AB	SEK	1 350	7 174,43	0,64
BHG GROUP AB	SEK	800	6 401,75	0,58
CASTELLUM AB	SEK	1 257	25 040,36	2,25
DUNI	SEK	10	95,08	0,01
GETINGE INDUSTRIER AB -B-	SEK	130	4 535,64	0,41
GRANGES AB	SEK	625	5 995,75	0,54
HOLMEN AB-B SHARES	SEK	836	36 801,91	3,30
INTRUM AB	SEK	260	5 960,22	0,54
LOOMIS AB	SEK	280	7 040,79	0,63

**PORTEFEUILLE TITRES AU 28/02/2022 EN EUR (suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
SAMHALLSBYGGNADSBOLAGET I NO	SEK	7 248	30 153,09	2,70
TRELLEBORG AB B	SEK	1 418	25 631,09	2,30
<b>TOTAL SUEDE</b>			<b>203 701,80</b>	<b>18,28</b>
<b>SUISSE</b>				
BOBST GRP	CHF	85	6 905,60	0,62
LANDIS+GYR GROUP AG	CHF	95	5 534,63	0,50
STADLER RAIL AG	CHF	90	3 096,15	0,28
TAMEDIA NOM.	CHF	50	7 006,67	0,63
<b>TOTAL SUISSE</b>			<b>22 543,05</b>	<b>2,03</b>
<b>TOTAL Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>			<b>1 017 299,44</b>	<b>91,30</b>
<b>TOTAL Actions et valeurs assimilées</b>			<b>1 017 299,44</b>	<b>91,30</b>
<b>Organismes de placement collectif</b>				
<b>OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays</b>				
<b>FRANCE</b>				
QUANTOLOGY METAVERSE Part I	EUR	1,12	96 008,93	8,62
<b>TOTAL FRANCE</b>			<b>96 008,93</b>	<b>8,62</b>
<b>TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays</b>			<b>96 008,93</b>	<b>8,62</b>
<b>TOTAL Organismes de placement collectif</b>			<b>96 008,93</b>	<b>8,62</b>
<b>Instrument financier à terme</b>				
<b>Engagements à terme fermes</b>				
<b>Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé</b>				
DJE 600 EUROP 0322	EUR	-23	4 755,00	0,43
E-MINI MICRO 0322	USD	-8	29 323,59	2,63
KE EURSEK 0322	SEK	2	7 484,40	0,67
<b>TOTAL Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé</b>			<b>41 562,99</b>	<b>3,73</b>
<b>TOTAL Engagements à terme fermes</b>			<b>41 562,99</b>	<b>3,73</b>
<b>TOTAL Instrument financier à terme</b>			<b>41 562,99</b>	<b>3,73</b>
<b>Appel de marge</b>				
APPEL MARGE CACEIS	USD	-32 904	-29 323,59	-2,63
APPEL MARGE CACEIS	SEK	-79 500	-7 484,40	-0,67
APPEL MARGE CACEIS	EUR	-4 755	-4 755,00	-0,43
<b>TOTAL Appel de marge</b>			<b>-41 562,99</b>	<b>-3,73</b>
<b>Créances</b>			<b>52 726,29</b>	<b>4,73</b>
<b>Dettes</b>			<b>-14 797,25</b>	<b>-1,33</b>
<b>Comptes financiers</b>			<b>-37 028,13</b>	<b>-3,32</b>
<b>Actif net</b>			<b>1 114 209,28</b>	<b>100,00</b>