

Rapport Mensuel Septembre 2017
Au 29/09/2017

Profil de risque (SRR)

1 2 3 4 5 6 7

STRATEGIE ET OBJECTIF

Quantology Small est un fonds quantitatif Long/Short Equity (biais net long +20% à +40%). La poche longue traque de façon systématique et selon un modèle propriétaire les valeurs les plus récemment repondérées par les gérants de la catégorie small-mid caps européennes. Le fonds cherche également à capturer la prime de risque des petites capitalisations par rapport aux grandes. Le fonds applique pour la poche short, une politique de couverture systématique via la vente de contrats futures sur l'indice Stoxx Europe 600 TR. L'objectif du fonds est de surperformer l'indice de référence 70% Eonia Capitalisé + 30% Stoxx Europe 600 TR sur l'horizon d'investissement recommandé.

PROFIL DE LA POCHE LONGUE

| | POIDS |
|-------------------------------------|-------|
| Nombre de positions actions | 28 |
| Poids des 10 premières lignes (%) | 23,4% |
| Capitalisation Médiane (Mds d' €) | 2,5 |
| Liquidité < 10 jours (tiers volume) | 100% |

PRINCIPALES POSITIONS

| | POIDS |
|-------------------------|--------|
| FUTURES SHORT STOXX 600 | -19,0% |
| DUERR AG | 2,2% |
| KARDEX AG-REG | 2,2% |
| OUTOTEC OYJ | 2,2% |
| RHEINMETALL AG | 2,1% |
| BET AT HOME.COM AG | 2,1% |

PERFORMANCES PART I

| | FONDS | INDICE |
|-----------------------|-------|--------|
| 1 mois | NC | NC |
| YTD | NC | NC |
| 1 an | NC | NC |
| Création (13/07/2017) | NC | NC |

STATISTIQUES (1 AN)

| | PART I |
|--------------------------------|--------|
| Volatilité (52 sem., vendredi) | NC |
| Max drawdown | NC |
| Corrélation actions | NC |
| Alpha | NC |
| Ratio de Sharpe | NC |
| Value at Risk (20j, 99%) | NC |

CARACTÉRISTIQUES

| | |
|--|---|
| Date de création | 13/07/2017 |
| Classification | Long/Short Equity |
| ISIN Part I | FR0013256260 |
| ISIN Part R | FR0013256278 |
| Gérants | Julien Messias, Vincent Fourcaut |
| Liquidité | Hebdomadaire |
| Forme juridique | FCP, UCITS 4 |
| Indice de référence | 30% Stoxx 600 TR + 70% Eonia Capitalisé |
| Devise de cotation | Euro |
| Affectation des dividendes | Capitalisation |
| Durée minimum d'investissement recommandée | 5 ans |

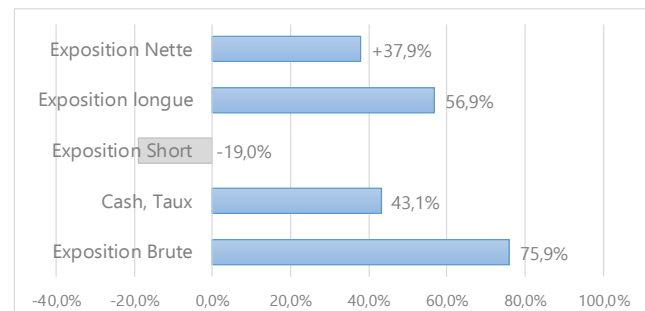
PRESTATAIRES ET FRAIS

| | |
|------------------------------|--|
| Dépositaire | CACEIS Bank France |
| Valorisateur | CACEIS Investor Services |
| Commissaire aux comptes | PWC Sellam |
| Frais de gestion fixe Part I | 1,50% |
| Frais de gestion fixe Part R | 2,00% |
| Frais de gestion variables | Maximum 20% TTC de la performance positive nette au-delà de l'indice de référence avec high water mark |

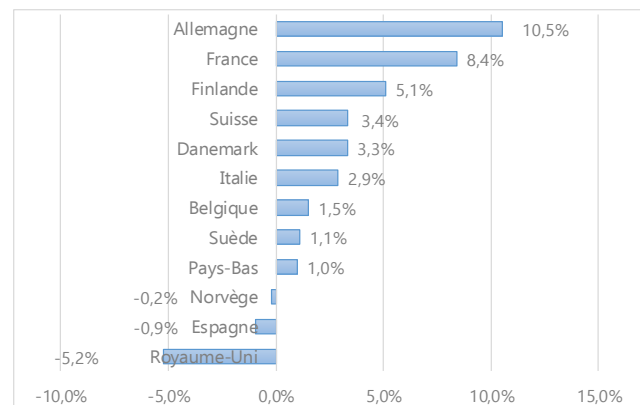
GRAPHIQUE - PART I / VL : 101794,63€

Conformément à la réglementation le fonds n'est pas autorisé à afficher ses performances avant sa première année

EXPOSITIONS DU PORTEFEUILLE



EXPOSITION NETTE GEOGRAPHIQUE



EXPOSITION NETTE SECTORIELLE

