

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'euros)	2,4

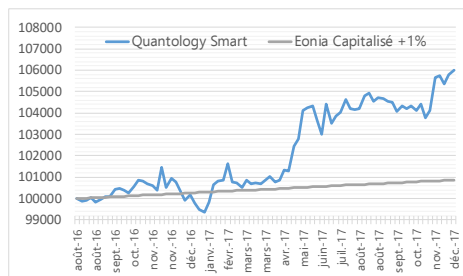
PRESTATAIRES ET FRAIS

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

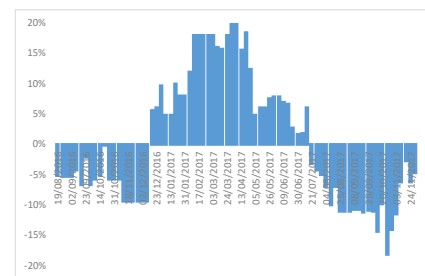
RISQUES DU FONDS

- Risque de perte en capital
- Risque action
- Risque de crédit
- Risque de contrepartie

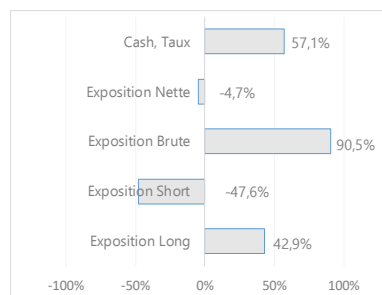
GRAPHIQUE - PART I



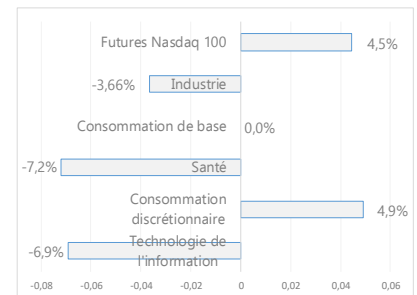
EVOLUTION DE L'EXPOSITION NETTE



ALLOCATION DU PORTEFEUILLE



EXPOSITION NETTE SECTORIELLE



PRINCIPALES POSITIONS LONGUES

NASDAQ 100 STOCK INDEX	4,46%
ALIGN TECHNOLOGY INC	4,18%
AMAZON.COM	4,07%

PRINCIPALES POSITIONS SHORT

CERNER CORP	3,93%
CELGENE CORP	3,93%
FISERV INC	3,83%

PERFORMANCES	PART I	INDICE
YTD	6,00%	0,59%
1 an	4,80%	0,64%
3 ans	-	-
Création (01/08/2016)	5,80%	0,86%

STATISTIQUES 1 AN	PART I
Volatilité (52 sem., vendredi)	3,72%
Perte Maximum	-2,10%
Ratio de Sharpe	1,41
Value at Risk (20j, 99%) *	2,69%

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%	1,90%		6,00%

*Cornish-Fischer adjusted