

## Rapport Mensuel 2017

Au 31/07/2017

### Profil de risque (SRRI)

1 2 3 **4** 5 6 7

### STRATEGIE ET OBJECTIF

Uncia Small Premia est un fonds quantitatif Long/Short Equity (biais net long +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	30
Poids des 10 premières lignes (%)	21,8%
Capitalisation Médiane (Mds d'€)	2,5

### PRINCIPALES POSITIONS

	POIDS
Futures short Stoxx Europe 600	22,0%
Yoox Net à Porter	2,2%
Banca IFIS	2,2%
Pfeiffer Vaccum Tech	2,2%
Industria Machine Automatic	2,2%
Outotec OYJ	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	NC
Max drowdown	
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	30% stoxx 600 TR + 70% Eonia Capitalisé
Devise de cotation	Euro
Affectation des dividendes	Capitalisation
Durée minimum d'investissement recommandée	5 ans

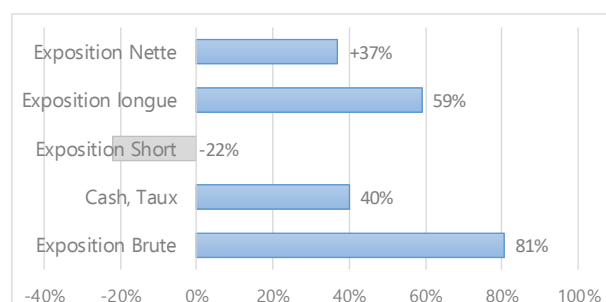
### PRESTATAIRES ET FRAIS

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	Max 20% TTC de la surperformance de l'indice du fonds

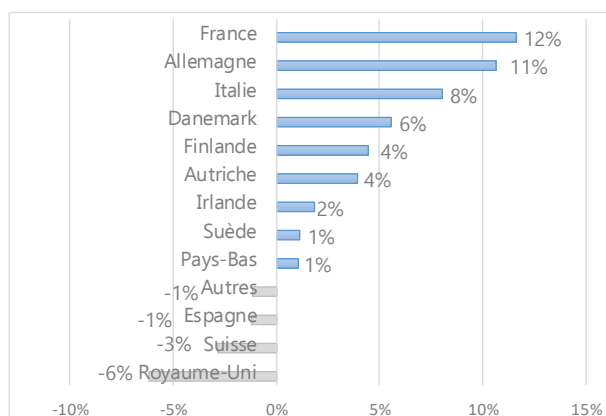
### GRAPHIQUE - PART I / VL : 99590,85€

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

