

Rapport Mensuel Juillet 2017

Profil de risque (SRII)

Au 31/07/2017

1 2 **3** 4 5 6 7

STRATEGIE ET OBJECTIF DE GESTION

Uncia Smart Premia est un fonds quantitatif issu de la recherche propriétaire d'Uncia AM. 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.

CORRELATION (52 SEMAINES GLISSANTES)

	NASDAQ 100	BARCLAYS GLOBAL AGREGATE BONDS INDEX
UNCIA SMART PREMIA	30%	0%

CLASSEMENT QUANTALYS

2017

Perf. Absolue euro L/S Market Neutre 5/146

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

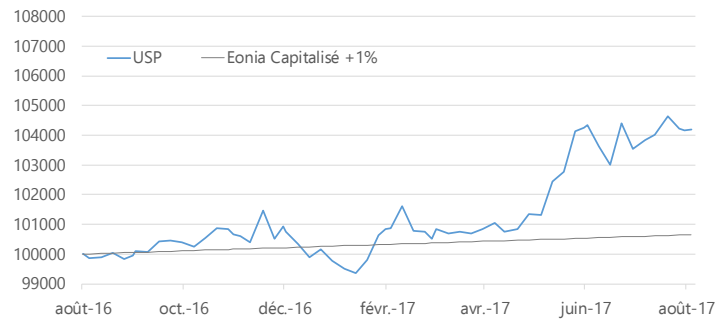
PRESTATAIRES ET FRAIS

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	max 10% TTC de la surperformance de l'indice Eonia capitalisé +1%

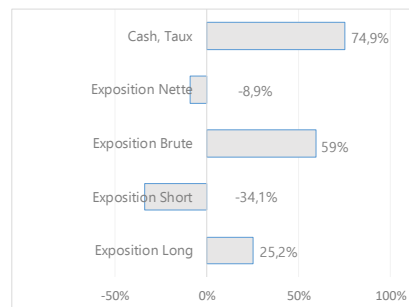
RISQUES DU FONDS

Risque de perte en capital
Risque de crédit
Risque de contrepartie

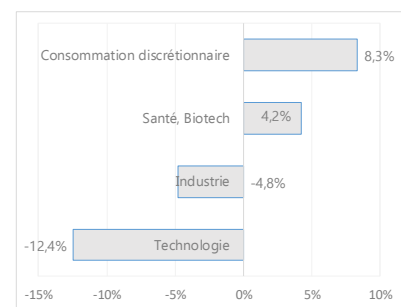
GRAPHIQUE - PART I



ALLOCATION DU PORTEFEUILLE



EXPOSITION NETTE SECTORIELLE



PRINCIPALES POSITIONS LONGUES

NETFLIX	4,5%
AUTODESK INC	4,3%
WALGREENS BOOTS ALLIANCE	4,3%

PRINCIPALES POSITIONS SHORT

VERISK ANALYTICS	5,0%
LIBERTY GLOBAL PLC	4,4%
SEAGATE TECHNOLOGY PLC	4,4%

PERFORMANCES	PART I	INDICE
YTD	4,38%	0,37%
1 an	4,16%	0,60%
3 ans	-	-
Création (01/08/2016)	4,16%	0,60%

STATISTIQUES 1 AN	PART I
Volatilité	3,6%
Perte Maximum	-2,1%
Ratio de sharpe	1,14
Value at Risk (20j, 99%) *	3,3%

PERF. 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%						+4,38%

*Cornish ficher adjusted

Uncia AM est une société de gestion agréée par l'AMF sous le numéro GP-13000028.

Adresse: 5 Avenue Ingres, 75016 Paris. Tel: 01.70.22.23.10. www.uncia-am.com. Twitter: @uncia_am

Les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures. Elles ne sont pas constantes dans le temps et ne font l'objet d'aucune garantie. Document d'information non contractuel. Pour plus d'informations, veuillez vous référer au DICI (Document d'Information Clé pour l'Investisseur) disponible sur le site internet www.uncia-am.com.