

Informations clés pour l'investisseur

Ce document fournit des informations essentielles aux investisseurs de cet OPCVM. Il ne s'agit pas d'un document promotionnel. Les informations qu'il contient vous sont fournies conformément à une obligation légale, afin de vous aider à comprendre en quoi consiste un investissement dans cet OPCVM et quels risques y sont associés. Il vous est conseillé de le lire pour décider en connaissance de cause d'investir ou non.

QUANTOLOGY LONG SHORT EUROPE – PART I – CODE ISIN FR0013256260

Cet OPCVM est géré par QUANTOLOGY CAPITAL MANAGEMENT et est soumis au droit français

Objectifs et Politique d'Investissement

Les caractéristiques essentielles de l'OPCVM sont les suivantes :

- L'OPCVM QUANTOLOGY LONG SHORT EUROPE Part I est un fonds poursuivant une stratégie « Long/Short actions ».
- L'objectif de gestion est d'offrir, sur la durée de placement recommandée minimale de 5 ans, une performance supérieure à l'indice composé de 25% d'indice Stoxx 600 et de 75% d'€ster capitalisé, tout en présentant une volatilité inférieure aux indices des marchés actions européennes.
- La gestion financière pratiquée est de type « Long/Short actions » et s'exerce au travers de deux stratégies actives d'achats et de ventes d'actions sélectionnées suivant un processus quantitatif. L'exposition nette est assurée par l'utilisation de *Contract for Difference* (« CFD ») sur actions et de contrats « Futures » sur l'indice Stoxx 600, l'indice des grandes valeurs européennes.
- **Stratégie 1 :** la sélection de valeurs est réalisée uniquement de façon quantitative au sein de l'indice MSCI Europe Small Cap Net Total Return, grâce à un système de scoring développé en interne de typologie *smart beta* reposant sur les caractéristiques intrinsèques de chaque valeur.
- **Stratégie 2 :** la sélection de valeurs est basée sur le phénomène de momentum post-publications de résultats ou Post-Earnings Announcement Drift (PEAD). Ce phénomène repose sur l'idée que la performance d'un titre le jour de sa publication de résultats trimestriels est un signal annonciateur de la tendance à venir jusqu'à la prochaine publication de résultats trimestriels. Ainsi, un signal acheteur ou vendeur est déclenché en fonction de la performance du titre le jour de sa publication de résultat. Le fonds prendra donc des positions acheteuses ou vendeuses en fonction des signaux détectés par le modèle propriétaire au sein des indices MSCI Europe Small Cap Net Total Return et Stoxx Europe 600.

- L'exposition nette du portefeuille au marché est comprise entre +0% et +50% de l'actif. Au regard du caractère « directionnel » du portefeuille, la gestion est corrélée aux marchés actions européennes.

Autres informations :

- QUANTOLOGY LONG SHORT EUROPE Part I est investi sur des valeurs dont la liquidité est appréciée comme suffisante par l'équipe de gestion.
- Le fonds capitalise les revenus encaissés.
- Le fonds est investi sur les actifs suivants :
 - Actions de sociétés cotées sur l'indice MSCI Europe Small Cap Net Total Return en Euro et Stoxx Europe 600.
 - Contract for Difference (« CFD ») sur actions. Le CFD réplique le mouvement de l'action sous-jacente mais ne donne pas lieu au transfert de propriété des titres.
 - Instruments financiers à terme, options indices actions, négociés ou non sur des marchés réglementés ou de gré à gré (de 0% à 100% de l'actif)
 - Dépôts à terme, produits obligataires, titres de créances négociables d'émetteurs privés ou publics notés au moins BBB- ou équivalent. Toute notation inférieure à BBB- ou jugées équivalentes par la société de gestion ne dépassera pas 35% de l'actif du fonds. Le gestionnaire dispose de moyens internes d'évaluation des risques de crédit. Les notations mentionnées ci-dessus, ne sont pas utilisées de manière exclusive ou systématique mais participent à l'évaluation globale de la qualité de crédit sur laquelle se fonde le gestionnaire pour définir ses propres convictions en matière de sélection des titres
- Le FCP peut avoir recours à des swaps de change, options de change pour couvrir le portefeuille contre le risque de change qui ne pourra excéder 10% de l'actif.
- La valeur liquidative est hebdomadaire. Les demandes de souscription et de rachat sont centralisées à 12h00 auprès du centralisateur CACEIS Bank France et exécutées sur la valeur liquidative calculée sur les cours de clôture du jour de centralisation.

Profil de Risque et de Rendement

Indicateur de Risque



Cette donnée se base sur les résultats passés en matière de volatilité. Les données historiques utilisées pour le calcul de l'indicateur de risque synthétique pourraient ne pas constituer une indication fiable du profil de risque futur de l'OPCVM. La catégorie de risque associée à cet OPCVM n'est pas garantie et pourra évoluer dans le temps. La catégorie la plus faible ne signifie pas « sans risque ». Le capital initialement investi ne bénéficie d'aucune garantie.

Risque de liquidité : le FCP investit dans des marchés qui peuvent être affectés par une baisse de la liquidité. Ces conditions de marchés peuvent impacter les prix auxquels les gérants initient ou liquident les positions.

Risque de crédit : le FCP peut investir dans des titres émis par des émetteurs de premier ordre qui peuvent néanmoins se retrouver dans la situation où ils ne peuvent pas faire face à leurs engagements.

Risque de contrepartie : le FCP peut encourir des pertes au titre de ses engagements vis-à-vis d'une contrepartie sur ses opérations de swaps ou de contrats à terme en cas de défaillance de celle-ci ou de son incapacité à faire face à ses obligations contractuelles.

Pour des informations supplémentaires sur les risques, vous pouvez vous référer au prospectus de l'OPCVM.

Votre OPCVM se situe actuellement au niveau 4 de l'indicateur synthétique en raison de l'exposition du FCP aux actions et la mise en place d'une stratégie « Long/Short ».

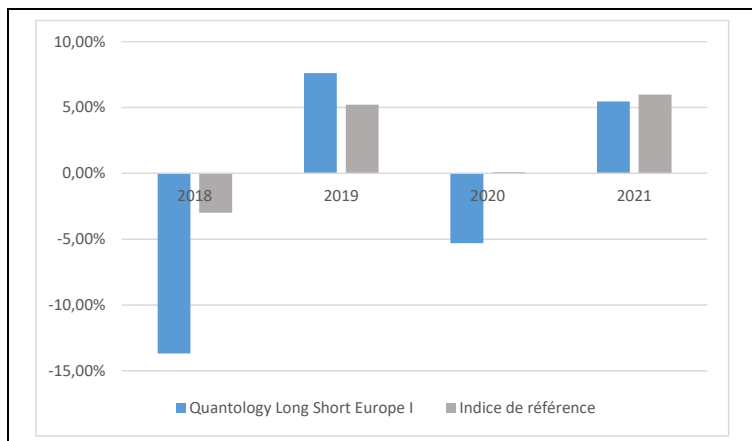
Frais

Les frais courants ne comprennent pas : les commissions de surperformance et les frais d'intermédiation excepté dans le cas des frais d'entrée et/ou de sortie payés par l'OPCVM lorsqu'il achète ou vend des parts d'un autre OPCVM. Les frais et commissions servent à couvrir les coûts d'exploitation de l'OPCVM, y compris les coûts de commercialisation et la distribution. Ces frais réduisent la croissance potentielle des investissements.

Frais ponctuels prélevés avant ou après investissement		
Frais d'entrée	Néant	Le pourcentage indiqué est le maximum pouvant être prélevé sur votre capital avant que celui-ci ne soit investi.
Frais de sortie	Néant	Dans certains cas des frais inférieurs sont appliqués. L'investisseur peut obtenir de son conseil ou de son distributeur le montant effectif des frais d'entrée et de sortie.
Frais prélevés par le fonds sur une année		
Frais courants	1.5% TTC	L'attention de l'investisseur est appelée sur le fait que le chiffre des « frais courants » se fonde sur les frais de l'exercice précédent. Ces frais sont susceptibles de varier d'un exercice à l'autre.
Frais prélevés par le fonds dans certaines circonstances		
Commission de performance	0.0% TTC	Applicable à hauteur de 20% TTC maximum de la performance positive nette au-delà de l'indice composé de 25% de l'indice Stoxx 600 et de 75% de l'€ster capitalisé. Ces frais peuvent varier d'un exercice à l'autre.

Vous pouvez obtenir des informations supplémentaires sur les frais dans le prospectus disponible sur demande auprès de :
QUANTOLOGY CAPITAL MANAGEMENT, 14 rue de Tilsitt 75008 Paris ou sur le site internet www.quantology-cm.com

Performances passées



Les performances présentées ne sont pas constantes dans le temps et ne constituent pas une indication fiable des performances futures.

La performance de l'OPCVM est calculée coupons nets réinvestis.

Le calcul des performances tient compte de l'ensemble des frais et commissions.

La part I du fonds QUANTOLOGY LONG SHORT EUROPE a été créée le 13/07/2017.

Les performances sont calculées en euros.

>la stratégie a été modifiée le 21/12/2018

Informations pratiques

Le dépositaire de l'OPCVM est CACEIS Bank

Forme juridique : FCP

Le prospectus de l'OPCVM, les derniers documents annuels et périodiques sont adressés sur simple demande écrite auprès de QUANTOLOGY CAPITAL MANAGEMENT, 14 rue de Tilsitt 75008 Paris. D'autres informations pratiques sont indiquées dans le prospectus de l'OPCVM. La valeur liquidative, la politique de rémunération ainsi que le prospectus sont disponibles auprès de la société de gestion et sur le site internet www.quantology-cm.com. Les informations relatives aux autres catégories de parts et la politique de vote sont disponibles selon les mêmes modalités.

Selon votre régime fiscal les plus-values et revenus éventuels liés à la détention de parts de l'OPCVM peuvent être soumis à taxation. Nous vous conseillons de vous renseigner à ce sujet auprès du commercialisateur de l'OPCVM ou de votre conseiller fiscal. Le FCP est éligible au dispositif français des plans d'épargne en actions (PEA).

La responsabilité de QUANTOLOGY CAPITAL MANAGEMENT ne peut être engagée que sur la base des déclarations contenues dans le présent document qui seraient trompeuses, inexactes ou non cohérentes avec les parties correspondantes du prospectus de l'OPCVM.

Cet OPCVM est agréé en France et réglementé par l'AMF. QUANTOLOGY CAPITAL MANAGEMENT est agréée en France et réglementée par l'AMF (GP 13000028)

Les informations clés pour l'investisseur ici fournies sont exactes et à jour au 04/01/2022.