Quantology | Capital Management

## 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 ABSOLUTE RETURN – PART SI – CODE ISIN FR0014001HF6

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

## Objectifs et Politique d'Investissement

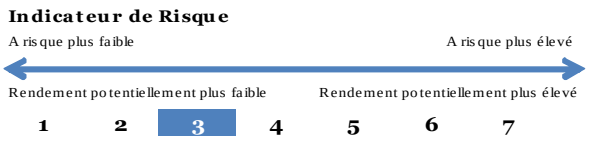
**Les caractéristiques essentielles de l'OPCVM sont les suivantes :**

- OPCVM de classification « Non Applicable », QUANTOLOGY ABSOLUTE RETURN Part U est un fonds poursuivant une stratégie « *Long/Short Equity Market Neutral* ». L'objectif de gestion est d'offrir sur la durée de placement recommandée une performance supérieure à celle de son indicateur de référence tout en présentant une volatilité faible et inférieure à 5%.
- La stratégie du fonds est basée sur une approche systématique. Les mécanismes des décisions d'investissement (les signaux) sont élaborés en amont et découlent d'années de recherche et développement propriétaire. Ainsi, un signal acheteur ou vendeur est déclenché en fonction des signaux avant le lancement du trading quotidien. Le fonds prend des positions acheteuses ou vendeuses dans les limites présentées dans le prospectus.
- La gestion financière pratiquée est de type « *Long/Short Equity Market Neutral* » et s'exerce au travers d'une stratégie active d'achats et de ventes d'actions sélectionnées suivant un process systématique. La neutralité est assurée par l'utilisation systématique de contrats Futures des indices actions U.S., qui est l'univers choisi pour cette stratégie.
- L'exposition nette du portefeuille au marché est comprise entre -20% et +20% de l'actif. L'exposition brute (somme des positions acheteuses et vendeuses) est fixée à 200% maximum.
- Au regard du caractère « *Market Neutral* » du portefeuille, la gestion n'est corrélée à aucun indice. Toutefois la performance pourra être comparée a posteriori à celle de l'indice « €STR » capitalisé.

**Autres informations :**

- QUANTOLOGY ABSOLUTE RETURN Part SI est investi dans des capitalisations supérieures à 1 Milliard USD. Toutefois le fonds se réserve la possibilité de s'exposer via des positions acheteuses ou vendeuses, dans la limite de 20% de l'actif net, sur des capitalisations inférieures à 1 Milliard USD.
- Le fonds capitalise les revenus encaissés.
- Le fonds est investi sur les actifs suivants :
  - Actions de sociétés cotées sur le NYSE,le NASDAQ et OTC US.
  - 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 sur actions ou indices actions, négociés ou non sur des marchés réglementés ou de gré à gré (de 0% à 100% de l'actif)
  - Dépôts à terme et Titres de créances négociables d'émetteurs privés ou publics notés au moins BBB- ou équivalent. La part des titres de créances négociables dont la notation est inférieure à BBB- ou jugées équivalentes par la société de gestion ne dépassera pas 35% de l'actif du fonds.
  - Produits obligataires d'émetteurs publics ou privés notés au moins BBB- ou équivalent. La part des produits obligataires dont la notation est inférieure à BBB-, ou obligations spéculatives, ou jugées équivalentes par la société de gestion ne dépassera pas 35% de l'actif.
- 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 durée de placement recommandée est de 2 ans minimum.
- La valeur liquidative est hebdomadaire. Les demandes de souscription et de rachat sont centralisées à 12h00 auprès du centralisateur CACEIS Bank et exécutées sur la valeur liquidative calculée sur les cours de clôture du jour de centralisation.

## Profil de Risque et de Rendement




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, de CFD, de contrats à terme, d'emprunt ou de prêt de titres 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 3 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<br>Frais de sortie | Néant<br>Néant | Le pourcentage indiqué est le maximum pouvant être prélevé sur votre capital avant que celui-ci ne soit investi.<br>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 | 0.6% 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 | 0.00% TTC | Applicable à hauteur de 10% TTC maximum de la performance positive nette au-delà de l'indice EONIA capitalisé +1%. Le pourcentage indiqué se fonde sur les commissions de l'exercice précédent. 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 SI du fonds QUANTOLOGY ABSOLUTE RETURN a été créée le 15/01/2021.

Les performances sont calculées en euros

## 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 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.

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.