



SWISSQUOTE QUANT FUND

**Rapport annuel audité
30 juin 2023**

CACEIS (Switzerland) SA

Route de Signy 35 - Case postale 2259 CH-1260 Nyon 2
Tél. +41 58 261 94 00 - Fax +41 58 261 94 60
www.caceis.com

TABLE DES MATIÈRES

Présentation du fonds	3
Intervenants dans la vie du fonds	4
Informations générales sur le fonds ombrelle et les compartiments	5
Performances	6
Rémunérations	7
Principes d'évaluation et de calcul de la valeur nette d'inventaire	8
Indications sur les affaires d'une importance économique ou juridique particulière.....	9
Swissquote Quant Swiss Equities (CHF).....	10
Swissquote Quant European Equities (EUR)	16

Fonds ombrelle contractuel de droit suisse, relevant du type «fonds en valeurs mobilières», subdivisé en compartiments suivants :

- Swissquote Quant Swiss Equities (CHF)
- Swissquote Quant European Equities (EUR)

Direction

CACEIS (Switzerland) SA

Route de Signy, 35
Case postale 2259
CH-1260 Nyon

Banque dépositaire

Swissquote Bank SA

Chemin de la Crétaux 33
CH-1196 Gland

CACEIS (Switzerland) SA**Conseil d'administration :**

Thies Clemenz	Président
Yvar Mentha	Vice-président
Jacques Bourachot	Administrateur
Jean-François Deroche	Administrateur (jusqu'au 30.11.2022)
Philippe Durand	Administrateur
Marc-André Poirier	Administrateur (depuis le 07.12.2022)
Jean-Pierre Valentini	Administrateur

Direction :

Oscar Garcia	Directeur Général
Sandra Czich	Directrice (jusqu'au 30.11.2022)
Claude Marchal	Sous-directeur
Lionel Bauer	Sous-directeur

Gestionnaire mandaté :

Swissquote Bank SA
Chemin de la Crétaux 33, 1196 Gland

Banque dépositaire :

Swissquote Bank SA
Chemin de la Crétaux 33, 1196 Gland

Société d'audit :

KPMG SA
Esplanade de Pont-Rouge 6, 1211 Genève

SWISSQUOTE QUANT FUND est un fonds ombrelle contractuel de droit suisse, relevant du type «Fonds en valeurs mobilières» selon la loi fédérale sur les placements collectifs de capitaux du 23 juin 2006, subdivisé en compartiments suivants :

- Swissquote Quant Swiss Equities (CHF)
- Swissquote Quant European Equities (EUR)

Le contrat de fonds de placement a été établi par CACEIS (Switzerland) SA, en tant que direction du fonds, et soumis avec l'approbation de Swissquote Bank SA en tant que banque dépositaire à l'Autorité fédérale de surveillance des marchés financiers (FINMA) et approuvé par celle-ci la première fois le 8 août 2008.

Les compartiments sont basés sur un contrat de placement collectif (contrat de fonds) aux termes duquel la direction du fonds s'engage à faire participer l'investisseur au compartiment correspondant, proportionnellement aux parts qu'il a acquises, et à gérer le compartiment conformément aux dispositions de la loi et du contrat de fonds, à titre autonome et en son propre nom. La banque dépositaire est partie au contrat conformément aux tâches qui lui sont dévolues par la loi et le contrat de fonds.

L'investisseur n'a droit qu'à la fortune et au revenu du compartiment auquel il participe. Pour les engagements revenant à un compartiment, seul le compartiment en question en répond.

Conformément au contrat de fonds, la direction est en droit, avec le consentement de la banque dépositaire et l'autorisation de l'autorité de surveillance, de créer à tout moment d'autres classes de parts pour chaque compartiment, de les supprimer ou de les regrouper.

Les classes de parts suivantes existent actuellement pour chaque compartiment :

- Classe «A» destinée à tous les investisseurs
- Classe «Q»¹ destinée aux investisseurs qualifiés ; montant d'investissement initial minimal de CHF/EUR 30 millions, en fonction de l'unité de compte du compartiment dans lequel l'investissement est effectué.

Pour le compartiment Swissquote Quant European Equities (EUR), il existe les classes de parts supplémentaires suivantes :

- Classe «A CHF» destinée à tous les investisseurs ; la monnaie de référence est le franc suisse
- Classe «Q CHF»¹ destinée aux investisseurs qualifiés : montant d'investissement initial minimal de CHF 30 millions.
La monnaie de référence est le franc suisse.

Les classes de parts ne représentent pas une fortune segmentée. Il ne peut ainsi pas être exclu qu'une classe de parts réponde des engagements d'une autre classe de parts, même si les coûts ne sont imputés en principe qu'à la classe de parts profitant d'une prestation définie.

¹ Classes non commercialisées au 30 juin 2023

Performances

	Lancement	2022	2023 ¹	Depuis le lancement ¹
Swissquote Quant Swiss Equities (CHF) Class A CHF	07.01.09	-16.65%	7.12%	156.16%
Swiss Performance Index	-	-16.48%	8.20%	212.43%
Swissquote Quant European Equities (EUR) Class A EUR	01.04.10	-16.49%	5.38%	79.42%
Swissquote Quant European Equities (EUR) Class A CHF	01.04.10	-16.50%	4.02%	63.95%
Europe Stoxx 50 (EUR)	-	-4.36%	9.64%	50.03%

¹ Jusqu'au 30.06.2023

Les références aux performances passées ne sauraient garantir leur évolution future. Les données de performance ne tiennent pas compte des commissions et frais qui peuvent être perçus lors de la souscription et du rachat de parts.

Rémunérations :**Rémunérations et frais à la charge de l'investisseur** (extrait du § 18 du contrat de fonds)**Pour chacun des compartiments, par compartiment**

Commission d'émission en faveur de la direction du fonds, de la banque dépositaire et/ou des distributeurs en Suisse et à l'étranger au maximum **2.00%**
de la valeur nette d'inventaire

Commission de rachat en faveur de la direction du fonds, de la banque dépositaire et/ou des distributeurs en Suisse et à l'étranger au maximum **2.00%**
de la valeur nette d'inventaire

Rémunérations et frais à la charge de la fortune du fonds (extrait du § 19 du contrat de fonds)**Pour tous les compartiments**

Commission de gestion de la direction du fonds, par compartiment (calculée sur la valeur nette d'inventaire des compartiments)

- pour la classe «A» au maximum p.a. **1.00%**

- pour la classe «Q»¹ au maximum p.a. **0.50%**

Elle est utilisée pour la direction, l'Asset Management et la commercialisation du compartiment.

Commission de la banque dépositaire (calculée sur la valeur nette d'inventaire des compartiments) au maximum p.a. **0.10%**

Commission de la direction pour le versement du produit de liquidation en cas de dissolution **0.50%**
de la valeur d'inventaire

Commission de performance : **10.00%**
la direction perçoit, pour le compte du gestionnaire, une commission de la sur-performance réalisée de performance relative à chacun des compartiments durant l'exercice comptable

Taux effectivement appliqués pour les rémunérations et frais à la charge de la fortune du fonds

Commission de gestion :

- Swissquote Quant Swiss Equities (CHF) **1.00%**
- Swissquote Quant European Equities (EUR) **1.00%**

Commission de la banque dépositaire **0.10%**

En supplément, les autres rémunérations et frais accessoires énumérés dans le § 19 du contrat de fonds peuvent être facturés aux compartiments.

«Soft commissions»

La direction du fonds n'a pas conclu de conventions concernant des «soft commissions».

¹ Classes non commercialisées au 30 juin 2023

Principes d'évaluation et de calcul de la valeur nette d'inventaire

La valeur nette d'inventaire de chaque compartiment et la quote-part des différentes classes sont déterminées à la valeur vénale à la fin de l'exercice annuel et chaque jour où des parts sont émises ou rachetées, soit chaque jour ouvrable bancaire (du lundi au vendredi), dans l'unité de compte du compartiment correspondant. Les jours où les bourses ou marchés des pays principaux d'un compartiment sont fermés (par exemple : jours bancaires et boursiers fériés), il n'est pas effectué de calcul de la fortune dudit compartiment.

Les placements négociés en bourse ou sur un autre marché réglementé ouvert au public doivent être évalués selon les cours du marché principal. D'autres placements ou les placements pour lesquels aucun cours du jour n'est disponible doivent être évalués au prix qui pourrait en être obtenu s'ils étaient vendus avec soin au moment de l'évaluation. Pour la détermination de la valeur vénale, la direction du fonds utilise dans ce cas des modèles et principes d'évaluation appropriés et reconnus dans la pratique.

Les placements collectifs ouverts de capitaux sont évalués à leur prix de rachat ou à la valeur nette d'inventaire. S'ils sont négociés régulièrement à une bourse ou sur un autre marché réglementé ouvert au public, la direction du fonds peut les évaluer selon le paragraphe précédent.

La valeur d'instruments du marché monétaire qui ne sont pas négociés à une bourse ou sur un marché réglementé ouvert au public est déterminée de la manière suivante : le prix d'évaluation de tels placements est adapté successivement au prix de rachat, en partant du prix net d'acquisition, avec maintien constant du rendement de placement calculé en résultant. En cas de changements notables des conditions du marché, la base d'évaluation des différents placements est adaptée aux nouveaux rendements du marché. En cas de prix actuel manquant du marché, on se réfère normalement à l'évaluation d'instruments du marché monétaire présentant des caractéristiques identiques (qualité et siège de l'émetteur, monnaie d'émission, durée).

Les avoirs en banque sont évalués avec leur montant plus les intérêts courus. En cas de changements notables des conditions du marché ou de la solvabilité, la base d'évaluation des avoirs en banque à terme est adaptées aux nouvelles circonstances.

La valeur nette d'inventaire de la part d'une classe d'un compartiment résulte de la quote-part à la valeur vénale de la fortune du compartiment, revenant à la classe en question, réduite d'éventuels engagements du compartiment attribués à cette classe, divisée par le nombre de parts en circulation de cette même classe. Il y a arrondi à CHF/EUR 0.01.

Les quotes-parts à la valeur vénale de la fortune nette d'un compartiment (fortune d'un compartiment, moins les engagements) revenant aux différentes classes de parts sont définies la première fois lors de la première émission de plusieurs classes de parts (lorsque celle-ci intervient en même temps) ou lors de la première émission d'une autre classe sur la base des résultats entrant pour chaque classe de parts correspondant audit compartiment. La quote-part fait l'objet d'un nouveau calcul lors de chaque événement suivant :

- a) lors de l'émission et du rachat de parts ;
- b) à la date de référence de distribution, si
 - (i) de telles distributions ne reviennent qu'à différentes classes de parts (classes de distribution) ou si
 - (ii) les distributions aux différentes classes de parts sont différentes en pour cent de la valeur nette d'inventaire ou si
 - (iii) des commissions ou des frais différents sont appliqués aux distributions des différentes classes de parts en pour cent de la distribution ;
- c) lors du calcul de la valeur d'inventaire, dans le cadre de l'attribution d'engagements (y compris les frais et commissions échus ou courus) aux différentes classes de parts, pour autant que les engagements des différentes classes de parts en pour cent de leur valeur nette d'inventaire soient différents, à savoir lorsque :
 - (i) des taux de commission différents sont appliqués pour les différentes classes ou si
 - (ii) des charges de frais spécifiques aux classes de parts sont imputées ;
- d) lors du calcul de la valeur d'inventaire, dans le cadre de l'attribution de produits ou de gains en capital aux différentes classes de parts, pour autant que les produits ou gains en capital résultent de transactions intervenant seulement en faveur d'une classe ou de plusieurs classes de parts, mais toutefois pas proportionnellement à leur quote-part à la fortune d'un compartiment.

Indications sur les affaires d'une importance économique ou juridique particulière

La version actuelle du contrat de fonds a été mise à jour pour refléter les modifications réglementaires liées à l'entrée en vigueur de la loi fédérale sur les services financiers (LSFin) et son ordonnance (OSFin).

Le contrat de fonds a été approuvé par la FINMA le 12.07.2022 et est entré en vigueur le 18.07.2022.

Swissquote Quant Swiss Equities (CHF)

Compte de fortune

	30.06.23	30.06.22
(Valeur vénale)	CHF	CHF
Valeurs mobilières		
Actions et autres titres de participation et droits-valeurs	26'994'964.72	24'610'579.42
Avoirs en banque		
à vue	2'280'238.41	1'120'831.40
Autres actifs	358'670.40	158'011.87
Fortune totale du fonds à la fin de la période comptable	29'633'873.53	25'889'422.69
Autres engagements	-92'815.27	-90'331.08
Fortune nette du fonds à la fin de la période comptable	29'541'058.26	25'799'091.61

Variation de la fortune nette

	01.07.22	01.07.21
	30.06.23	30.06.22
	CHF	CHF
Fortune nette du fonds au début de la période comptable	25'799'091.61	30'115'012.75
Paiement de l'impôt anticipé sur le résultat reporté capitalisé	-21'044.05	-43'240.85
Solde des mouvements de parts	1'158'113.69	118'202.04
Résultat total	2'604'897.01	-4'390'882.33
Fortune nette du fonds à la fin de la période comptable	29'541'058.26	25'799'091.61

Evolution du nombre de parts

Swissquote Quant Swiss Equities (CHF)

	01.07.22	01.07.21
	30.06.23	30.06.22
Situation en début de période comptable	222'904	224'082
Parts émises	32'648	65'450
Parts rachetées	22'913	66'628
Situation à la fin de la période comptable	232'639	222'904
Valeur nette d'inventaire par part à la fin de la période comptable	CHF 126.98	115.74

Swissquote Quant Swiss Equities (CHF)

Compte de résultats	01.07.22	01.07.21
	30.06.23	30.06.22
	CHF	CHF
Revenus		
Revenus des valeurs mobilières		
Actions et autres titres de participation	597'799.73	444'881.50
Revenus des avoirs		
à vue	0.09	0.00
Participation des souscripteurs aux revenus courus	-6'423.33	-26'841.58
Total des revenus	591'376.49	418'039.92
Charges		
Rémunérations réglementaires versées :		
à la direction	-42'082.67	-47'056.07
à la banque dépositaire	-28'162.92	-31'370.70
au gestionnaire	-238'468.75	-266'651.12
Frais de révision	-10'231.50	-10'231.50
Intérêts négatifs	-1'107.54	-22'832.30
Intérêts passifs	-16.35	0.00
Autres charges	-4'203.54	-12'890.95
Participation des porteurs de parts sortants aux revenus courus	1'644.57	30'974.59
Total des charges	-322'628.70	-360'058.05
Résultat net	268'747.79	57'981.87
Gains/pertes du capital réalisés(-es)	24'624.79	-2'018'675.16
Résultat réalisé	293'372.58	-1'960'693.29
Variations des gains/pertes du capital non-réalisés(-es)	2'311'524.43	-2'430'189.04
Résultat total	2'604'897.01	-4'390'882.33
<u>TER en %:</u>	1.15	1.17

Utilisation du résultat

	01.07.22	01.07.21
	30.06.23	30.06.22
	CHF	CHF
Résultat net	268'747.79	57'981.87
Report de la période précédente	0.22	0.58
Résultat disponible pour être réparti	268'748.01	57'982.45
Paiement de l'impôt anticipé sur le résultat reporté thésaurisé	-94'061.74	-20'293.78
Résultat net réinvesti transféré au compte de parts	-174'686.09	-37'688.45
Report à nouveau	0.18	0.22

Swissquote Quant Swiss Equities (CHF)

Inventaire de la fortune

Désignation	Total au 30.06.22	Achats	Ventes	Total au 30.06.23	Cours	Valeur vénale CHF	en %
Actions et autres titres de participations et droits-valeurs							
Actions et autres titres de participations							
PIERER MOBILITY AG	0	12'558	0	12'558	76.40	959'431.20	3.24
<i>Autriche</i>						<i>959'431.20</i>	<i>3.24</i>
ABB LTD PREFERENTIAL SHARE	0	31'824	0	31'824	35.18	1'119'568.32	3.78
ALCON - REGISTERED SHS	13'562	0	13'562	0	0.00	0.00	0.00
ASCOM HOLDING AG REG.	0	122'671	0	122'671	10.92	1'339'567.32	4.52
BACHEM HOLDING LTD SHARES	12'565	0	298	12'267	78.00	956'826.00	3.23
BALOISE HOLDING REG.SHS	6'068	0	6'068	0	0.00	0.00	0.00
BANQUE CANTONALE DE ST GALL- ACT NOM-	0	2'040	0	2'040	485.00	989'400.00	3.34
BARRY CALLEBAUT - NAMEN-AKT	444	0	444	0	0.00	0.00	0.00
BC VAUDOISE - REGISTERED SHS	11'796	0	7'109	4'687	94.50	442'921.50	1.49
BELL SA	1'202	0	1'202	0	0.00	0.00	0.00
BKW AG	8'767	0	1'173	7'594	158.00	1'199'852.00	4.05
BURCKHARDT COMPRESSION HOLDING	1'045	681	0	1'726	525.00	906'150.00	3.06
BYSTRONIC AG	0	1'458	0	1'458	595.00	867'510.00	2.93
CEMBRA MONEY BANK SA	12'524	19	0	12'543	74.20	930'690.60	3.14
COLTENE HOLDING NAM.AKT	5'394	0	5'394	0	0.00	0.00	0.00
DKSH HOLDING SA	11'957	632	0	12'589	66.55	837'797.95	2.83
GALENICA SA	12'946	0	2'660	10'286	72.25	743'163.50	2.51
GIVAUDAN SA REG.SHS	98	0	98	0	0.00	0.00	0.00
HELVETIA HLDG - REGISTERED SHS	8'166	0	8'166	0	0.00	0.00	0.00
HOLCIM LTD	16'041	3'023	0	19'064	60.20	1'147'652.80	3.87
HUBER + SUHNER AG	6'748	4'378	0	11'126	73.80	821'098.80	2.77
IMPLENIA AG	2'130	23'664	0	25'794	43.45	1'120'749.30	3.78
JULIUS BAER GROUP NAMEN AKT	0	1'078	0	1'078	56.34	60'734.52	0.20
KOMAX HOLDING NAMEN	3'494	0	3'494	0	0.00	0.00	0.00
LANDIS+GYR GR	0	13'734	0	13'734	76.80	1'054'771.20	3.56
LECLANCHE	0	24'669	0	24'669	0.50	12'383.84	0.04
LEM HOLDING SANOM	0	511	0	511	2'240.00	1'144'640.00	3.86
LONZA GROUP	650	0	650	0	0.00	0.00	0.00
MEDARTIS HOLDING	6'480	0	2'236	4'244	76.70	325'514.80	1.10
MEYER BURGER TECHNOLOGY NAMEN AKT	0	1'664'747	0	1'664'747	0.60	1'005'507.19	3.39
MOBILEZONE HLDG	24'325	0	24'325	0	0.00	0.00	0.00
NESTLE SA PREFERENTIAL SHARE	0	8'877	0	8'877	107.60	955'165.20	3.22
NOVARTIS AG PREFERENTIAL SHARE	11'199	561	0	11'760	90.00	1'058'400.00	3.57
ORELL FUESSLI LTD	3'659	0	3'659	0	0.00	0.00	0.00
ORIOR NAMEN AKT	715	0	715	0	0.00	0.00	0.00
PSP SWISS PROPERTY AG	8'623	0	8'623	0	0.00	0.00	0.00
ROCHE HOLDING LTD	2'994	0	2'994	0	0.00	0.00	0.00
SIEGFRIED HOLDING	720	0	720	0	0.00	0.00	0.00
SIG GROUP PREFERENTIAL SHARE	45'273	0	45'273	0	0.00	0.00	0.00
SONOVA HOLDING NAM-AKT	2'880	0	2'880	0	0.00	0.00	0.00
STADLER RAIL AG	0	27'316	0	27'316	34.96	954'967.36	3.22
SULZER AG NOM	0	1'061	0	1'061	76.90	81'590.90	0.28
SWISSCOM SHS NOM	1'745	0	1'745	0	0.00	0.00	0.00
SWISS PRIME SITE AG-NAMEN AKT	10'357	0	10'357	0	0.00	0.00	0.00
SWISS RE REG SHS	0	10'668	0	10'668	90.04	960'546.72	3.24
TECAN GROUP NAM.AKT	0	2'493	0	2'493	343.20	855'597.60	2.89
THE SWATCH GROUP	0	3'279	0	3'279	261.10	856'146.90	2.89
U BLOX HOLDING AG NAMEN AKT	9'750	9'750	19'500	0	0.00	0.00	0.00
VALIANT HOLDING	5'941	3'664	0	9'605	93.20	895'186.00	3.02
VALORA HOLDING NOM.	3'672	0	3'672	0	0.00	0.00	0.00

Swissquote Quant Swiss Equities (CHF)

Inventaire de la fortune

Désignation	Total au 30.06.22	Achats	Ventes	Total au 30.06.23	Cours	Valeur vénale CHF	en %
Actions et autres titres de participations							
YPSOMED HOLDING AG NAM.AKT	0	5'288	0	5'288	270.00	1'427'760.00	4.82
ZHENDER GROUP NAMEN AKT -A-	9'961	0	9'961	0	0.00	0.00	0.00
ZURICH INSURANCE GROUP NAMEN AKT	2'225	43	0	2'268	424.90	963'673.20	3.25
<i>Suisse</i>						26'035'533.52	87.85
Franc Suisse						26'994'964.72	91.09
Valeurs mobilières négociées en bourse						26'994'964.72	91.09
Actions et autres titres de participations						26'994'964.72	91.09
Actions et autres titres de participations et droits-valeurs						26'994'964.72	91.09

Swissquote Quant Swiss Equities (CHF)

Désignation	Valeur vénale CHF	en %
Avoirs en banque		
à vue	2'280'238.41	7.69
Avoirs en banque	2'280'238.41	7.69

Cours de change

1 EUR	=	CHF	0.97605
1 USD	=	CHF	0.89464

Swissquote Quant Swiss Equities (CHF)

Informations des années précédentes

Date	Valeur nette d'inventaire par part		Nombre de parts en circulation	Fortune nette du fonds		Thésaurisation du revenu net par part
30.06.21	CHF	134.39	224'082	CHF	30'115'012.75	0.519000
30.06.22	CHF	115.74	222'904	CHF	25'799'091.61	0.260122
30.06.23	CHF	126.98	232'639	CHF	29'541'058.26	1.155214

Swissquote Quant European Equities (EUR)

Compte de fortune

	30.06.23	30.06.22
(Valeur vénale)	EUR	EUR
Valeurs mobilières		
Actions et autres titres de participation et droits-valeurs	11'657'949.70	10'378'881.70
Instruments financiers dérivés	26'130.12	43'806.93
Avoirs en banque		
à vue	493'567.59	764'166.42
Autres actifs	97.88	10'169.25
Fortune totale du fonds à la fin de la période comptable	12'177'745.29	11'197'024.30
Engagements en banque	-129'789.74	-42'860.75
Autres engagements	-48'715.68	-48'825.46
Fortune nette du fonds à la fin de la période comptable	11'999'239.87	11'105'338.09

Variation de la fortune nette

	01.07.22	01.07.21
	30.06.23	30.06.22
	EUR	EUR
Fortune nette du fonds au début de la période comptable	11'105'338.09	12'907'953.48
Paiement de l'impôt anticipé sur le résultat reporté capitalisé	-27'122.78	-15'830.75
Solde des mouvements de parts	-217'016.01	161'808.49
Résultat total	1'138'040.57	-1'948'593.13
Fortune nette du fonds à la fin de la période comptable	11'999'239.87	11'105'338.09

Swissquote Quant European Equities (EUR)

Evolution du nombre de parts

Swissquote Quant European Equities (EUR) - Classe A EUR

		01.07.22	01.07.21
		30.06.23	30.06.22
Situation en début de période comptable		69'207	71'432
Parts émises		16'194	31'143
Parts rachetées		21'809	33'368
Situation à la fin de la période comptable		63'592	69'207
Valeur nette d'inventaire par part à la fin de la période comptable	EUR	88.99	81.53

Swissquote Quant European Equities (EUR) - Classe A CHF

		01.07.22	01.07.21
		30.06.23	30.06.22
Situation en début de période comptable		51'020	47'823
Parts émises		3'965	11'501
Parts rachetées		1'330	8'304
Situation à la fin de la période comptable		53'655	51'020
Valeur nette d'inventaire par part à la fin de la période comptable	CHF	115.34	107.17

Swissquote Quant European Equities (EUR)

Compte de résultats	01.07.22	01.07.21
	30.06.23	30.06.22
	EUR	EUR
Revenus		
Revenus des valeurs mobilières		
Actions et autres titres de participation	200'969.24	245'640.91
Revenus des avoirs		
à vue	279.66	0,00
Participation des souscripteurs aux revenus courus	-2'203.88	-2'936.39
Total des revenus	199'045.02	242'704.52
Charges		
Rémunérations réglementaires versées :		
à la direction	-18'056.49	-19'583.53
à la banque dépositaire	-12'037.68	-13'055.77
au gestionnaire	-102'320.09	-110'973.78
Frais de révision	-12'065.44	-11'286.05
Intérêts négatifs	-183.35	-8'581.10
Intérêts passifs	-2'774.47	0,00
Autres charges	-6'698.02	-6'311.26
Participation des porteurs de parts sortants aux revenus courus	3'524.14	2'297.78
Total des charges	-150'611.40	-167'493.71
Résultat net	48'433.62	75'210.81
Gains/pertes du capital réalisés(-es)	124'841.72	-758'061.69
Commissions sur la performance	0,00	-914.29
Résultat réalisé	173'275.34	-683'765.17
Variations des gains/pertes du capital non-réalisés(-es)	964'765.23	-1'264'827.96
Résultat total	1'138'040.57	-1'948'593.13
TER en % : Classe A EUR	1.26	1.24
<i>dont la commission pour la performance en %</i>	0.00	0.01
TER en % : Classe A CHF	1.26	1.24

Swissquote Quant European Equities (EUR)

Utilisation du résultat

Swissquote Quant European Equities (EUR) - Classe A EUR	01.07.22 30.06.23 EUR	01.07.21 30.06.22 EUR
Résultat net	22'992.08	38'537.77
Report de la période précédente	0.06	0.62
Résultat disponible pour être réparti	22'992.14	38'538.39
Paiement de l'impôt anticipé sur le résultat reporté thésaurisé	-8'047.25	-13'488.42
Résultat net réinvesti transféré au compte de parts	-14'944.89	-25'049.92
Report à nouveau	0.01	0.06

Utilisation du résultat

Swissquote Quant European Equities (EUR) - Classe A CHF	01.07.22 30.06.23 EUR	01.07.21 30.06.22 EUR
Résultat net	25'441.54	36'673.04
Report de la période précédente	0.02	0.51
Résultat disponible pour être réparti	25'441.56	36'673.55
Paiement de l'impôt anticipé sur le résultat reporté thésaurisé	-8'904.54	-12'835.74
Résultat net réinvesti transféré au compte de parts	-16'537.00	-23'837.80
Report à nouveau	0.02	0.02

Swissquote Quant European Equities (EUR)

Inventaire de la fortune

Désignation	Total au 30.06.22	Achats	Ventes	Total au 30.06.23	Cours	Valeur vénale EUR	en %
Actions et autres titres de participations et droits-valeurs							
Actions et autres titres de participations							
AURUBIS	0	4'527	0	4'527	78.54	355'550.58	2.92
BAYER AG REG SHS	6'615	0	6'615	0	0.00	0.00	0.00
BAYWA VINKULIERTE NAMEN-AKTIE	8'938	0	8'938	0	0.00	0.00	0.00
CAPITAL STAGE AG	21'921	0	21'921	0	0.00	0.00	0.00
DEUTSCHE LUFTHANSA AG REG SHS	0	44'137	0	44'137	9.38	413'960.92	3.40
DEUTSCHE TELEKOM AG REG SHS	23'402	0	23'402	0	0.00	0.00	0.00
DUERR AG	0	12'133	0	12'133	29.64	359'622.12	2.95
GERRESHEIMER AG	0	6'225	0	6'225	103.10	641'797.50	5.27
HENSOLDT --- BEARER SHS	0	16'294	0	16'294	30.08	490'123.52	4.02
JOST WERKE SE	0	7'818	0	7'818	49.60	387'772.80	3.18
K+S	14'360	0	14'360	0	0.00	0.00	0.00
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	0	1'875	0	1'875	237.40	445'125.00	3.66
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG REG SHS	0	1'285	0	1'285	343.60	441'526.00	3.63
NORMA GROUP - NAMEN AKT	0	22'169	0	22'169	16.92	375'099.48	3.08
PNE AG	0	21'146	0	21'146	14.16	299'427.36	2.46
RHEINMETALL AG	2'225	0	316	1'909	250.80	478'777.20	3.93
SALZGITTER AG	12'071	0	12'071	0	0.00	0.00	0.00
SIEMENS ENERGY - REGISTERED SHS	0	22'497	0	22'497	16.18	364'001.46	2.99
SMA SOLAR TECHNOLOGY AG	0	5'537	0	5'537	111.90	619'590.30	5.09
SUEDZUCKER AG	0	28'635	0	28'635	16.33	467'609.55	3.84
TEAMVIEWER - BEARER SHS	0	31'893	0	31'893	14.71	469'146.03	3.85
VERBIO VGT BIOENERGIE AG	8'072	0	8'072	0	0.00	0.00	0.00
<i>Allemagne</i>						6'609'129.82	54.27
ASCENCIO ACT	4'563	0	4'563	0	0.00	0.00	0.00
EURONAV NV	40'626	0	40'626	0	0.00	0.00	0.00
RECTICEL PART.SOC.	22'855	0	22'855	0	0.00	0.00	0.00
<i>Belgique</i>						0.00	0.00
REPSOL SA	19'746	0	19'746	0	0.00	0.00	0.00
<i>Espagne</i>						0.00	0.00
FORTUM CORP	0	4'887	0	4'887	12.27	59'939.06	0.49
ORION CORPORATION (NEW) -B-	0	1'972	0	1'972	38.02	74'975.44	0.62
<i>Finlande</i>						134'914.50	1.11
AEROPORTS DE PARIS-ADP-	3'173	0	3'173	0	0.00	0.00	0.00
ALBIOMA	8'507	0	8'507	0	0.00	0.00	0.00
BENETEAU	10'518	0	10'518	0	0.00	0.00	0.00
DASSAULT AVIATION SA	2'697	0	2'697	0	0.00	0.00	0.00
DBV TECHNOLOGIES	26'250	0	26'250	0	0.00	0.00	0.00
ERAMET SA	3'260	0	3'260	0	0.00	0.00	0.00
ETABLISSEMENTS MAUREL ET PROM SA	84'119	0	84'119	0	0.00	0.00	0.00
GAZTRANSPORT ET TECHNIGAZ SA	3'589	0	3'589	0	0.00	0.00	0.00
IPSEN	4'477	0	4'477	0	0.00	0.00	0.00
IPSOS SA	4'678	2'400	0	7'078	50.95	360'624.10	2.96
JACQUET METAL	13'559	0	13'559	0	0.00	0.00	0.00
LA FRANCAISE DES JEUX SA	0	10'599	0	10'599	36.04	381'987.96	3.14
SES IMAGOTAG SA	0	3'545	0	3'545	94.00	333'230.00	2.74

Swissquote Quant European Equities (EUR)

Inventaire de la fortune

Désignation	Total au 30.06.22	Achats	Ventes	Total au 30.06.23	Cours	Valeur vénale EUR	en %
Actions et autres titres de participations							
THALES	3'674	0	3'674	0	0.00	0.00	0.00
VALLOUREC - SHS	0	28'900	0	28'900	10.83	312'842.50	2.57
<i>France</i>						1'388'684.56	11.41
ATLANTIA SPA	18'531	0	18'531	0	0.00	0.00	0.00
FINECOBANK	0	26'606	0	26'606	12.32	327'652.89	2.69
LEONARDO SPA	33'003	0	33'003	0	0.00	0.00	0.00
<i>Italie</i>						327'652.89	2.69
INPOST SA	0	45'819	0	45'819	9.94	455'257.58	3.74
TENARIS SA - REG.SHS	27'209	0	27'209	0	0.00	0.00	0.00
<i>Luxembourg</i>						455'257.58	3.74
ABN AMRO GROUP DEP RECEIPT	0	28'810	0	28'810	14.23	409'966.30	3.37
ADVANCED METALLURGICAL GROUP NV	13'044	0	927	12'117	47.49	575'436.33	4.73
BESI -REGISTERED SHS	0	5'023	0	5'023	99.30	498'783.90	4.10
CNH INDUSTRIAL REG SHS (USD)	0	26'994	0	26'994	13.21	356'455.77	2.93
ING GROUP NV	0	30'558	0	30'558	12.34	377'024.60	3.10
JUST EAT TAKEAWAY.COM N.V	0	1'500	0	1'500	14.04	21'054.00	0.17
KONINKLIJKE VOPAK	0	15'405	0	15'405	32.69	503'589.45	4.14
OCI REG.SHS	11'133	0	11'133	0	0.00	0.00	0.00
WERELDHAVE NV	13'257	0	13'257	0	0.00	0.00	0.00
<i>Pays-Bas</i>						2'742'310.35	22.54
SHELL PLC	10'245	0	10'245	0	0.00	0.00	0.00
<i>Royaume-Uni</i>						0.00	0.00
Euro						11'657'949.70	95.76
Valeurs mobilières négociées en bourse						11'657'949.70	95.76
Actions et autres titres de participations						11'657'949.70	95.76
Actions et autres titres de participations et droits-valeurs						11'657'949.70	95.76

Swissquote Quant European Equities (EUR)

Inventaire de la fortune

	Echéance	Achats	Devise	Ventes	Devise	Valeur vénale EUR	en %
Instruments Financiers Dérivés							
Contrat de change à terme ¹							
	31.07.23	1'240.47	CHF	1'275.69	EUR	-2.86	0.00
	31.07.23	1'702.65	CHF	1'750.99	EUR	-3.92	0.00
	31.07.23	3'429.90	CHF	3'527.29	EUR	-7.91	0.00
	31.07.23	6'044'494.64	CHF	6'176'040.98	EUR	26'144.81	0.21
	30.06.23	1'350.36	CHF	1'385.92	EUR	0.00	0.00
	30.06.23	351.06	CHF	360.99	EUR	0.00	0.00
	30.06.23	231.92	CHF	238.48	EUR	0.00	0.00
	30.06.23	234.56	CHF	242.29	EUR	0.00	0.00
	30.06.23	112.25	CHF	115.30	EUR	0.00	0.00
	30.06.23	6'177'715.51	CHF	6'383'256.38	EUR	0.00	0.00
	30.06.23	116.63	CHF	120.47	EUR	0.00	0.00
	30.06.23	1'059.75	CHF	1'089.72	EUR	0.00	0.00
	30.06.23	117.00	CHF	119.95	EUR	0.00	0.00
	30.06.23	347.64	CHF	357.47	EUR	0.00	0.00
	30.06.23	11'657.85	EUR	11'391.36	CHF	0.00	0.00
	30.06.23	116.05	CHF	119.27	EUR	0.00	0.00
	30.06.23	11'553.67	CHF	11'844.57	EUR	0.00	0.00
	30.06.23	235.38	CHF	241.01	EUR	0.00	0.00
	30.06.23	10'404.10	CHF	10'698.30	EUR	0.00	0.00
	30.06.23	35'277.00	CHF	36'120.76	EUR	0.00	0.00
	30.06.23	119.52	CHF	122.45	EUR	0.00	0.00
	31.05.23	353.88	CHF	363.64	EUR	0.00	0.00
	31.05.23	594.05	CHF	605.22	EUR	0.00	0.00
	31.05.23	45'195.75	CHF	46'045.75	EUR	0.00	0.00
	31.05.23	117.27	CHF	119.48	EUR	0.00	0.00
	31.05.23	1'418.52	CHF	1'446.24	EUR	0.00	0.00
	31.05.23	19'290.64	EUR	18'960.00	CHF	0.00	0.00
	31.05.23	6'178'762.42	CHF	6'305'503.05	EUR	0.00	0.00
	31.05.23	467.68	CHF	478.45	EUR	0.00	0.00
	31.05.23	347.49	CHF	358.44	EUR	0.00	0.00
	31.05.23	11'702.79	CHF	12'071.45	EUR	0.00	0.00
	31.05.23	117.97	CHF	121.13	EUR	0.00	0.00
	31.05.23	2'779.74	EUR	2'708.94	CHF	0.00	0.00
	31.05.23	118.86	CHF	122.60	EUR	0.00	0.00
	28.04.23	241.79	EUR	237.86	CHF	0.00	0.00
	28.04.23	117.50	CHF	119.80	EUR	0.00	0.00
	28.04.23	707.52	CHF	719.65	EUR	0.00	0.00
	28.04.23	57'715.20	CHF	58'833.63	EUR	0.00	0.00
	28.04.23	692.52	CHF	701.83	EUR	0.00	0.00
	28.04.23	685.92	CHF	696.14	EUR	0.00	0.00
	28.04.23	116.47	CHF	117.34	EUR	0.00	0.00
	28.04.23	580.60	CHF	584.60	EUR	0.00	0.00
	28.04.23	234.86	CHF	239.82	EUR	0.00	0.00
	28.04.23	234.86	CHF	239.95	EUR	0.00	0.00
	28.04.23	5'905'800.81	CHF	5'929'518.88	EUR	0.00	0.00
	28.04.23	464.12	CHF	465.48	EUR	0.00	0.00
	28.04.23	341.70	CHF	343.95	EUR	0.00	0.00
	28.04.23	1'355.04	CHF	1'363.27	EUR	0.00	0.00
	31.03.23	2'976.98	EUR	2'958.50	CHF	0.00	0.00
	31.03.23	4'248.72	CHF	4'261.88	EUR	0.00	0.00
	31.03.23	6'098'378.98	CHF	6'172'448.37	EUR	0.00	0.00

Swissquote Quant European Equities (EUR)

Inventaire de la fortune

	Echéance	Achats	Devise	Ventes	Devise	Valeur vénale EUR	en %
Instruments Financiers Dérivés							
Contrat de change à terme ¹							
	31.03.23	9'344.80	CHF	9'534.88	EUR	0.00	0.00
	31.03.23	19'002.93	CHF	19'464.73	EUR	0.00	0.00
	31.03.23	239.06	CHF	243.30	EUR	0.00	0.00
	31.03.23	117.81	CHF	119.90	EUR	0.00	0.00
	31.03.23	957.76	CHF	965.50	EUR	0.00	0.00
	31.03.23	119.97	CHF	121.15	EUR	0.00	0.00
	31.03.23	121.74	EUR	120.72	CHF	0.00	0.00
	31.03.23	120.72	CHF	121.74	EUR	0.00	0.00
	31.03.23	832.16	CHF	833.31	EUR	0.00	0.00
	31.03.23	4'630.08	CHF	4'654.59	EUR	0.00	0.00
	31.03.23	1'695.90	CHF	1'716.74	EUR	0.00	0.00
	31.03.23	447.96	CHF	453.41	EUR	0.00	0.00
	31.03.23	341.25	CHF	343.15	EUR	0.00	0.00
	31.03.23	27'534.25	CHF	27'727.79	EUR	0.00	0.00
	31.03.23	553.65	CHF	558.40	EUR	0.00	0.00
	31.03.23	1'572.46	EUR	1'565.34	CHF	0.00	0.00
	31.03.23	113.01	CHF	114.76	EUR	0.00	0.00
	28.02.23	1'845.28	CHF	1'874.35	EUR	0.00	0.00
	28.02.23	9'661.95	CHF	9'759.42	EUR	0.00	0.00
	28.02.23	1'260.71	CHF	1'277.76	EUR	0.00	0.00
	28.02.23	455.44	CHF	457.13	EUR	0.00	0.00
	28.02.23	473.16	CHF	477.29	EUR	0.00	0.00
	28.02.23	118.13	CHF	119.72	EUR	0.00	0.00
	28.02.23	1'077.25	EUR	1'068.57	CHF	0.00	0.00
	28.02.23	116.05	CHF	117.52	EUR	0.00	0.00
	28.02.23	6'366.12	EUR	6'288.84	CHF	0.00	0.00
	28.02.23	11'412.61	EUR	11'440.00	CHF	0.00	0.00
	28.02.23	575.10	CHF	574.64	EUR	0.00	0.00
	28.02.23	5'916'481.94	CHF	5'905'851.41	EUR	0.00	0.00
	28.02.23	5'461.44	CHF	5'440.76	EUR	0.00	0.00
	31.01.23	671.88	CHF	681.83	EUR	0.00	0.00
	31.01.23	5'480.48	EUR	5'388.96	CHF	0.00	0.00
	31.01.23	111.48	CHF	113.38	EUR	0.00	0.00
	31.01.23	110.88	CHF	112.29	EUR	0.00	0.00
	31.01.23	5'751'861.46	CHF	5'837'082.88	EUR	0.00	0.00
	31.01.23	440.64	CHF	448.17	EUR	0.00	0.00
	31.01.23	39'649.95	CHF	40'302.98	EUR	0.00	0.00
	31.01.23	1'239.48	CHF	1'254.92	EUR	0.00	0.00
	31.01.23	8'538.37	EUR	8'412.00	CHF	0.00	0.00
	31.01.23	225.34	CHF	224.49	EUR	0.00	0.00
	31.01.23	223.04	CHF	227.01	EUR	0.00	0.00
	31.01.23	3'413.24	EUR	3'407.10	CHF	0.00	0.00
	31.01.23	5'653.50	CHF	5'641.65	EUR	0.00	0.00
	31.01.23	922.88	CHF	931.65	EUR	0.00	0.00
	31.01.23	5'292.30	CHF	5'337.67	EUR	0.00	0.00
	31.01.23	347.33	CHF	347.18	EUR	0.00	0.00
	31.01.23	2'047.32	CHF	2'047.32	EUR	0.00	0.00
	31.12.22	19'009.40	CHF	19'213.06	EUR	0.00	0.00
	30.12.22	224.54	CHF	228.54	EUR	0.00	0.00
	30.12.22	110.75	CHF	112.73	EUR	0.00	0.00
	30.12.22	19'213.06	EUR	19'009.40	CHF	0.00	0.00

Swissquote Quant European Equities (EUR)

Inventaire de la fortune

	Echéance	Achats	Devise	Ventes	Devise	Valeur vénale EUR	en %
Instruments Financiers Dérivés							
Contrat de change à terme ¹							
	30.12.22	671.88	CHF	681.83	EUR	0.00	0.00
	30.12.22	6'031'708.60	CHF	6'147'277.46	EUR	0.00	0.00
	30.12.22	115.69	CHF	117.55	EUR	0.00	0.00
	30.12.22	935.84	CHF	950.77	EUR	0.00	0.00
	30.12.22	7'078.05	EUR	6'964.80	CHF	0.00	0.00
	30.12.22	116.03	CHF	117.30	EUR	0.00	0.00
	30.12.22	1'984.24	CHF	2'020.20	EUR	0.00	0.00
	30.12.22	679.14	CHF	686.62	EUR	0.00	0.00
	30.12.22	230.24	CHF	233.30	EUR	0.00	0.00
	30.12.22	1'021.86	CHF	1'038.58	EUR	0.00	0.00
	30.12.22	114.05	CHF	115.94	EUR	0.00	0.00
	30.12.22	567.70	CHF	575.82	EUR	0.00	0.00
	30.12.22	887.92	CHF	901.99	EUR	0.00	0.00
	30.12.22	222.36	CHF	225.04	EUR	0.00	0.00
	30.11.22	5'856'211.06	CHF	5'923'142.57	EUR	0.00	0.00
	30.11.22	11'455.00	CHF	11'638.85	EUR	0.00	0.00
	30.11.22	680.94	CHF	690.82	EUR	0.00	0.00
	30.11.22	5'015.87	EUR	4'959.19	CHF	0.00	0.00
	30.11.22	1'829.60	CHF	1'856.33	EUR	0.00	0.00
	30.11.22	115.23	CHF	117.71	EUR	0.00	0.00
	30.11.22	4'730.17	CHF	4'791.50	EUR	0.00	0.00
	30.11.22	457.04	CHF	463.48	EUR	0.00	0.00
	30.11.22	1'426.85	EUR	1'400.88	CHF	0.00	0.00
	30.11.22	114.82	CHF	116.88	EUR	0.00	0.00
	30.11.22	233.70	CHF	237.55	EUR	0.00	0.00
	31.10.22	332.88	CHF	336.85	EUR	0.00	0.00
	31.10.22	103.74	CHF	109.89	EUR	0.00	0.00
	31.10.22	310.56	CHF	326.80	EUR	0.00	0.00
	31.10.22	5'341'018.27	CHF	5'648'882.36	EUR	0.00	0.00
	31.10.22	1'336.01	CHF	1'394.87	EUR	0.00	0.00
	31.10.22	8'411.36	EUR	8'220.42	CHF	0.00	0.00
	31.10.22	1'071.52	EUR	1'036.70	CHF	0.00	0.00
	31.10.22	105.75	CHF	108.98	EUR	0.00	0.00
	31.10.22	2'036.23	CHF	2'088.15	EUR	0.00	0.00
	31.10.22	4'709.54	EUR	4'564.02	CHF	0.00	0.00
	31.10.22	531.40	CHF	549.15	EUR	0.00	0.00
	31.10.22	212.96	CHF	218.38	EUR	0.00	0.00
	31.10.22	314.04	CHF	323.39	EUR	0.00	0.00
	31.10.22	434.32	CHF	442.64	EUR	0.00	0.00
	31.10.22	541.55	CHF	553.05	EUR	0.00	0.00
	30.09.22	440.96	CHF	452.78	EUR	0.00	0.00
	30.09.22	1'521.10	CHF	1'544.26	EUR	0.00	0.00
	30.09.22	110.23	CHF	113.16	EUR	0.00	0.00
	30.09.22	2'709.90	EUR	2'644.32	CHF	0.00	0.00
	30.09.22	547.75	CHF	562.60	EUR	0.00	0.00
	30.09.22	109.78	CHF	113.89	EUR	0.00	0.00
	30.09.22	11'749.50	CHF	12'176.90	EUR	0.00	0.00
	30.09.22	1'225.73	CHF	1'269.00	EUR	0.00	0.00
	30.09.22	19'355.40	CHF	20'222.97	EUR	0.00	0.00
	30.09.22	761.60	CHF	789.14	EUR	0.00	0.00
	30.09.22	308.88	CHF	324.88	EUR	0.00	0.00

Swissquote Quant European Equities (EUR)

Inventaire de la fortune

	Echéance	Achats	Devise	Ventes	Devise	Valeur vénale EUR	en %
Instruments Financiers Dérivés							
Contrat de change à terme ¹							
	30.09.22	107.05	CHF	111.77	EUR	0.00	0.00
	30.09.22	454.27	CHF	466.20	EUR	0.00	0.00
	30.09.22	110.74	CHF	112.92	EUR	0.00	0.00
	30.09.22	5'841'766.32	CHF	6'041'210.88	EUR	0.00	0.00
	31.08.22	561.25	CHF	574.40	EUR	0.00	0.00
	31.08.22	562.75	CHF	576.12	EUR	0.00	0.00
	31.08.22	797.65	CHF	826.15	EUR	0.00	0.00
	31.08.22	1'010.07	CHF	1'036.61	EUR	0.00	0.00
	31.08.22	115.17	CHF	119.15	EUR	0.00	0.00
	31.08.22	113.94	CHF	118.34	EUR	0.00	0.00
	31.08.22	113.90	CHF	118.83	EUR	0.00	0.00
	31.08.22	344.49	CHF	355.58	EUR	0.00	0.00
	31.08.22	2'168.66	CHF	2'267.52	EUR	0.00	0.00
	31.08.22	339.09	CHF	353.44	EUR	0.00	0.00
	31.08.22	114.39	CHF	118.95	EUR	0.00	0.00
	31.08.22	973.98	CHF	998.65	EUR	0.00	0.00
	31.08.22	1'558.34	CHF	1'602.74	EUR	0.00	0.00
	31.08.22	328.71	CHF	337.17	EUR	0.00	0.00
	31.08.22	11'187.00	CHF	11'485.63	EUR	0.00	0.00
	31.08.22	5'518'207.40	CHF	5'656'155.37	EUR	0.00	0.00
	29.07.22	319.38	CHF	324.94	EUR	0.00	0.00
	29.07.22	106.23	CHF	107.86	EUR	0.00	0.00
	29.07.22	206.44	CHF	209.99	EUR	0.00	0.00
	29.07.22	527.85	CHF	535.13	EUR	0.00	0.00
	29.07.22	426.40	CHF	429.54	EUR	0.00	0.00
	29.07.22	209.62	CHF	211.82	EUR	0.00	0.00
	29.07.22	213.96	CHF	217.84	EUR	0.00	0.00
	29.07.22	430.92	CHF	435.01	EUR	0.00	0.00
	29.07.22	324.33	CHF	329.64	EUR	0.00	0.00
	29.07.22	3'248.10	CHF	3'218.49	EUR	0.00	0.00
	29.07.22	5'506'720.14	CHF	5'457'363.74	EUR	0.00	0.00
	29.07.22	14'146.14	CHF	14'140.48	EUR	0.00	0.00
	29.07.22	212.98	CHF	212.53	EUR	0.00	0.00
	29.07.22	2'143.40	CHF	2'135.07	EUR	0.00	0.00
	29.07.22	3'933.64	EUR	3'903.74	CHF	0.00	0.00
	29.07.22	7'424.25	EUR	7'377.48	CHF	0.00	0.00
	29.07.22	2'455.48	CHF	2'475.28	EUR	0.00	0.00
	29.07.22	845.36	CHF	853.73	EUR	0.00	0.00
Contrat de change à terme						26'130.12	0.21
Instruments Financiers Dérivés						26'130.12	0.21

¹ Cocontractant des opérations OTC: Swissquote Bank SA

Swissquote Quant European Equities (EUR)

Désignation	Valeur vénale EUR	en %
Avoirs en banque		
à vue	493'567.59	4.05
Avoirs en banque	493'567.59	4.05

Engagements en banque	-129'789.74	-1.07
------------------------------	--------------------	--------------

Cours de change

1 CHF	=	EUR	1.02454
1 USD	=	EUR	0.91659

Swissquote Quant European Equities (EUR)

Risques sur instruments dérivés selon le Commitment I

Positions réduisant l'engagement

Contrats de change à terme

6'182'594.95

Total en USD**6'182'594.95**

Total en % de la fortune nette du fonds

51.52

Swissquote Quant European Equities (EUR)

Informations des années précédentes

Date	Classe	Valeur nette d'inventaire par part		Nombre de parts en circulation	Fortune nette du fonds		Thésaurisation du revenu net par part
30.06.21	Classe A EUR	EUR	100.19	71'432	EUR	7'156'780.27	0.327740
30.06.22	Classe A EUR	EUR	81.53	69'207	EUR	5'642'483.76	0.556856
30.06.23	Classe A EUR	EUR	88.99	63'592	EUR	5'659'043.26	0.361557
30.06.21	Classe A CHF	CHF	131.83	47'823	CHF	6'304'436.07	0.473780
30.06.22	Classe A CHF	CHF	107.17	51'020	CHF	5'467'770.90	0.719454
30.06.23	Classe A CHF	CHF	115.34	53'655	CHF	6'188'348.90	0.462813

RAPPORT ABRÉGÉ DE LA SOCIÉTÉ D'AUDIT SELON LA LOI SUR LES PLACEMENTS COLLECTIFS

À l'attention du Conseil d'administration de la direction de fonds sur les comptes annuels de SWISSQUOTE QUANT FUND

Rapport sur l'audit des comptes annuels

Opinion d'audit

Nous avons effectué l'audit des comptes annuels du fonds de placement SWISSQUOTE QUANT FUND avec les compartiments suivants :

- Swissquote Quant Swiss Equities (CHF)
- Swissquote Quant European Equities (EUR)

comprenant le compte de fortune au 30 juin 2023, le compte de résultat pour l'exercice clos à cette date, les indications relatives à l'utilisation du résultat et à la présentation des coûts ainsi que les informations supplémentaires selon l'art. 89, al. 1, let. b-h de la loi suisse sur les placements collectifs (LPCC).

Selon notre appréciation, les comptes annuels ci-joints sont conformes à la loi suisse sur les placements collectifs, aux ordonnances y relatives ainsi qu'au contrat de fonds et au prospectus.

Fondement de l'opinion d'audit

Nous avons effectué notre audit conformément à la loi suisse et aux Normes suisses d'audit des états financiers (NA-CH). Les responsabilités qui nous incombent en vertu de ces dispositions et de ces normes sont plus amplement décrites dans la section « Responsabilités de la société d'audit selon la loi sur les placements collectifs relatives à l'audit des comptes annuels » de notre rapport. Nous sommes indépendants du fonds de placement ainsi que de la direction de fonds, conformément aux dispositions légales suisses et aux exigences de la profession, et avons satisfait aux autres obligations éthiques professionnelles qui nous incombent dans le respect de ces exigences.

Nous estimons que les éléments probants recueillis sont suffisants et appropriés pour fonder notre opinion.

Autres informations

La responsabilité des autres informations incombe au conseil d'administration de la direction de fonds. Les autres informations comprennent les informations présentées dans le rapport annuel, à l'exception des comptes annuels et de notre rapport correspondant.

Notre opinion sur les comptes annuels ne s'étend pas aux autres informations et nous n'exprimons aucune conclusion d'audit sous quelque forme que ce soit sur ces informations.

Dans le cadre de notre audit des états financiers, notre responsabilité consiste à lire les autres informations et, ce faisant, à apprécier si elles présentent des incohérences significatives par rapport aux comptes annuels ou aux connaissances que nous avons acquises au cours de notre audit ou si elles semblent par ailleurs comporter des anomalies significatives.

Si, sur la base des travaux que nous avons effectués, nous arrivons à la conclusion que les autres informations présentent une anomalie significative, nous sommes tenus de le déclarer. Nous n'avons aucune remarque à formuler à cet égard.

Responsabilités du Conseil d'administration de la direction de fonds relatives aux comptes annuels

Le Conseil d'administration de la direction de fonds est responsable de l'établissement des comptes annuels conformément à la loi suisse sur les placements collectifs, aux ordonnances y relatives ainsi qu'au contrat de fonds et au prospectus. Il est en outre responsable des contrôles internes qu'il juge nécessaires pour permettre l'établissement de comptes annuels ne comportant pas d'anomalies significatives, que celles-ci proviennent de fraudes ou résultent d'erreurs.

Responsabilités de la société d'audit selon la loi sur les placements collectifs relatives à l'audit des comptes annuels

Notre objectif est d'obtenir l'assurance raisonnable que les comptes annuels pris dans leur ensemble ne comportent pas d'anomalies significatives, que celles-ci proviennent de fraudes ou résultent d'erreurs, et de délivrer un rapport contenant notre opinion. L'assurance raisonnable correspond à un niveau élevé d'assurance, mais ne garantit toutefois pas qu'un audit réalisé conformément à la loi suisse et aux NA-CH permettra de toujours détecter toute anomalie significative qui pourrait exister. Les anomalies peuvent provenir de fraudes ou résulter d'erreurs et elles sont considérées comme significatives lorsqu'il est raisonnable de s'attendre à ce que, prises individuellement collectivement, elles puissent influencer les décisions économiques que les utilisateurs des comptes annuels prennent en se fondant sur ceux-ci.

Dans le cadre d'un audit réalisé conformément à la loi suisse et aux NA-CH, nous exerçons notre jugement professionnel tout au long de l'audit et faisons preuve d'esprit critique. En outre :

- nous identifions et évaluons les risques que les comptes annuels comportent des anomalies significatives, que celles-ci proviennent de fraudes ou résultent d'erreurs, concevons et mettons en œuvre des procédures d'audit en réponse à ces risques, et réunissons des éléments probants suffisants et appropriés pour fonder notre opinion d'audit. Le risque de non-détection d'une anomalie significative provenant de fraudes est plus élevé que celui d'une anomalie significative résultant d'une erreur, car la fraude peut impliquer la collusion, la falsification, des omissions volontaires, de fausses déclarations ou le contournement de contrôles internes.
- nous acquérons une compréhension du système de contrôle interne pertinent pour l'audit afin de concevoir des procédures d'audit appropriées aux circonstances, mais non dans le but d'exprimer une opinion sur l'efficacité du système de contrôle interne du fonds de placement.
- nous évaluons le caractère approprié des méthodes comptables appliquées et le caractère raisonnable des estimations comptables ainsi que des informations y afférentes.

Nous communiquons au Conseil d'administration de la direction de fonds, notamment l'étendue des travaux d'audit et le calendrier de réalisation prévus ainsi que nos constatations d'audit importantes, y compris toute déficience majeure dans le système de contrôle interne, relevée au cours de notre audit.

KPMG SA

Santiago Ramos
Expert-réviseur agréé
Auditeur responsable

Felipe Vranken

Genève, le 30 octobre 2023

Annexe :

Comptes annuels comprenant le compte de fortune au 30 juin 2023, le compte de résultat pour l'exercice arrêté à cette date, des indications relatives à l'utilisation du résultat et à la présentation des coûts, ainsi que les informations supplémentaires selon l'art. 89, al. 1, let. b-h de la loi suisse sur les placements collectifs (LPCC)