

## PUBLICATIONS PÉRIODIQUES

### SOCIÉTÉS COMMERCIALES ET INDUSTRIELLES (COMPTES ANNUELS)

#### CREDIT SUISSE QUANTITATIVE AND SYSTEMATIC ASSET MANAGEMENT LTD

Société de droit anglais au capital de 60 000 USD  
Siège social : One Cabot Square – London E14 – 4OJ

#### I. - Bilan au 31 décembre 2016

(En milliers de dollars.)

Actifs	Note annexe	2016
Espèces et avoirs en banque	7	94 391
Actifs d'impôts différés		10
Sommes dues par des sociétés du groupe CS		915
Autres actifs	9	55 568
<b>Total de l'actif</b>		<b>150 884</b>

Passifs	Note annexe	2016
Passifs d'impôts exigibles		702
Sommes dues aux sociétés du groupe CS		6 146
Autres éléments de passif	10	88 522
<b>Total du passif</b>		<b>95 370</b>
Capitaux propres		
Capital social appelé	11	60 000
Perte cumulée		-4 495
Autre revenu global		9
<b>Total des capitaux propres</b>		<b>55 514</b>
<b>Total du passif et des capitaux propres</b>		<b>150 884</b>

Les notes annexes des pages 24 à 46 font partie intégrante des présents états financiers.

#### II. - Compte de résultat

(En milliers de dollars.)

	Note annexe	Du 11/11/2015 au 31/12/2016
Produit d'intérêts	4	37
Charge d'intérêts	4	-
<b>Produits nets d'intérêts</b>		<b>37</b>
Honoraires de gestion, de conseil, de performance et d'autres services	5	2 515
Autres produits	5	3 221
<b>Produits hors intérêts</b>		<b>5 736</b>
Revenu net		5 773
Rémunération et avantages sociaux	6	-9 518
Autres charges	6	-39
<b>Total des charges d'exploitation</b>		<b>-9 557</b>
Perte nette de change		-7
<b>Perte avant impôts</b>		<b>-3 791</b>
Charge d'impôts sur les bénéfices	8	-704

Perte après impôts		-4 495
Perte attribuable aux actionnaires de la Société		-4 495

Tous les résultats pour l'exercice clos en 2016 concernent les activités poursuivies.  
Les notes annexes des pages 24 à 46 font partie intégrante des présents états financiers.

### III. - Etat du résultat global pour l'exercice clos le 31 décembre 2016

(En milliers de dollars.)

	Du 11/11/2015 au 31/12/2016
Perte après impôts	-4 495
Total des éléments qui sont ou qui sont susceptibles d'être reclassés en résultat	
Conversion des devises	31
Pertes actuarielles	-22
Autre revenu global net d'impôt	9
Total de la perte globale attribuable aux actionnaires	-4 486

Des pertes actuarielles de 22K\$ sont présentées nettes de 11K\$ d'impôts.  
Tous les résultats pour l'exercice clos en 2016 concernent les activités poursuivies.  
Les notes annexes des pages 24 à 46 font partie intégrante des présents états financiers.

Approuvé par le Conseil d'Administration le jeudi 20 avril 2017 et signé en son nom par : Pierre-Yves Morlat (Administrateur).  
Numéro d'enregistrement de la société : 9867306

### IV. - Rapport du Commissaire aux Comptes indépendant aux membres de Credit Suisse Quantitative and Systematic Asset Management Limited

Nous avons procédé à la vérification des états financiers de la société Credit Suisse Quantitative and Systematic Asset Management Limited pour l'exercice clos le 31 décembre 2016, états financiers présentés aux pages 18 à 46. Ces états financiers ont été préparés conformément à la loi applicable et aux normes IFRS (Normes internationales d'information financière) telles qu'adoptées par l'UE.  
Le présent rapport est destiné uniquement aux membres de la société, constitués en entité, conformément au Chapitre 3 de la Partie 16 de la Loi sur les Sociétés (Companies Act) de 2006. Notre mission avait pour seul et unique but de nous permettre de présenter aux membres de la société les questions sur lesquelles nous devons leur rendre compte dans un rapport d'audit. Au maximum des limites permises par la loi, nous n'acceptons ni n'assumons aucune responsabilité envers qui que ce soit d'autre que la société et les membres de la société constitués en entité, en ce qui concerne notre travail de vérification, le présent rapport ou les opinions que nous avons exprimées.

#### Responsabilités respectives du conseil d'administration et du commissaire aux comptes

Comme expliqué plus en détail dans la Déclaration relative aux Responsabilités des Administrateurs à la page 15, il incombe aux administrateurs de préparer les états financiers et de s'assurer qu'ils donnent une image sincère et fidèle. Il nous appartient de formuler une opinion sur les états financiers que nous aurons préalablement vérifiés conformément aux exigences légales applicables et aux normes ISA (Normes Internationales d'Audit) (Royaume-Uni et Irlande). Lesdites normes nous obligent à nous conformer aux normes éthiques de l'Auditing Practices Board (APB) s'appliquant aux commissaires aux comptes.

#### Étendue de l'audit des états financiers

Une description de l'étendue d'un audit des états financiers est proposée sur le site web du Financial Reporting Council (Conseil de l'information financière) à l'adresse suivante :  
[www.frc.org.uk/auditscopeukprivate](http://www.frc.org.uk/auditscopeukprivate).

#### Opinion sur les états financiers

À notre opinion, les états financiers :

- donnent une image sincère et fidèle de la situation des affaires de la société au 31 décembre 2016 et de la perte enregistrée pour l'exercice écoulé ;
- ont été dûment préparés conformément aux normes IFRS telles qu'adoptées par l'UE ; et
- ont été préparés conformément aux prescriptions de la Loi sur les Sociétés (Companies Act) de 2006.

#### Opinion sur d'autres éléments prescrits par la Loi sur les Sociétés (Companies Act) de 2006

À notre opinion, les informations fournies dans le rapport stratégique et le rapport du conseil d'administration, concernant l'exercice financier pour lequel les états financiers sont préparés, sont en cohérence avec les états financiers.

Sur la base uniquement des travaux devant être accomplis au cours de l'audit des états financiers et de la lecture du rapport stratégique et du rapport du conseil d'administration :

- nous n'avons pas identifié d'anomalies significatives dans ces rapports ; et
- à notre opinion, lesdits rapports ont été préparés conformément aux prescriptions de la Loi sur les Sociétés (Companies Act) de 2006.

#### Éléments devant figurer dans le rapport des commissaires aux comptes à titre exceptionnel

Nous n'avons aucune observation à formuler sur les éléments suivants, pour lesquels la Loi sur les Sociétés (Companies Act) de 2006 nous demande de vous fournir un rapport si, à notre opinion :

- des livres comptables adéquats n'ont pas été tenus ou des déclarations contenant des informations appropriées pour notre audit n'ont pas été obtenues des succursales dans lesquelles nous ne nous sommes pas rendus ; ou
- les états financiers ne sont pas conformes aux déclarations et documents comptables obtenus ; ou
- certaines informations relatives à la rémunération des administrateurs, exigées par la loi, n'ont pas été fournies ; ou

- nous n'avons pas obtenu toutes les informations et explications dont nous avons besoin pour notre audit.

Alison Allen (Commissaire aux Comptes Sénior)  
au nom et pour le compte de KPMG LLP, Commissaire aux Comptes Inscrit  
Experts Comptables  
15 Canada Square  
Londres  
E14 5GL  
20 avril 2017.

#### **IV. - Rapport de gestion**

Le rapport de gestion est tenu à la disposition du public 86, Boulevard Haussmann – 75008 Paris.

**1703881**