

UCITS – Seven Absolute Return Fund – Part R

Fonds long / short multi-classes d'actifs



JANVIER 2018

(données au 31/01/2018)

Valeur liquidative :

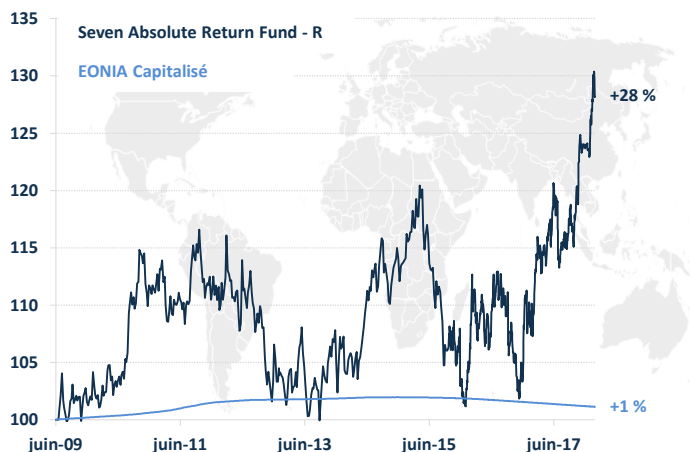
137.7 euros

Le fonds Seven Absolute Return Fund est un fonds long / short multi-classes d'actifs (indices boursiers & obligations d'Etats).

Le processus d'investissement est basé sur une analyse propriétaire de Momentum déclinée sur trois différents types de données : les données de prix, les données de risque et les données macro-économiques. Le fonds a un objectif de performance absolue.

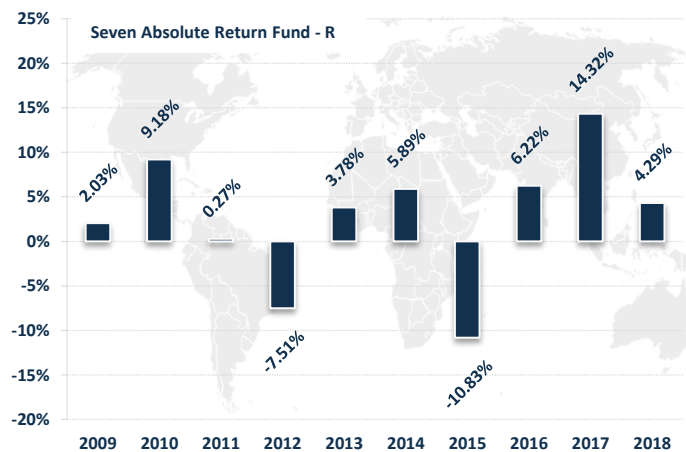
Evolution du fonds depuis son lancement le 5 juin 2009 (base 100)

Source : Seven Capital Management



Historique des performances annuelles depuis 2009

Source : Seven Capital Management



Performances

Source : Seven Capital Management

	Cumulées		Annualisées	
	Fonds	EONIA*	Fonds	EONIA*
1 mois	+4.29 %			
YTD	+4.29 %			
1 an	+19.49 %	-0.36 %		
3 ans	+10.94 %	-0.82 %	+3.53 % / an	-0.27 % / an
5 ans	+24.55 %	-0.64 %	+4.52 % / an	-0.13 % / an
Lancement	+28.20 %	+1.14 %	+2.92 % / an	+0.13 % / an

Analyse de risque

Source : Seven Capital Management

	1 an	3 ans	5 ans	Lancement
Volatilité	8.02 %	9.34 %	8.83 %	8.48 %
Ratio de Sharpe	2.45	0.38	0.51	0.34
Drawdown Max	-6.15 %	-16.00 %	-16.00 %	-16.00 %
Corrélation p				
vs. SG CTA Index	0.73	0.74	0.70	0.69
vs. MSCI World	0.68	0.18	0.38	0.17
vs. JP.Morgan GBI	0.21	0.34	0.21	0.17

Informations

Source : Seven Capital Management

Date de création	05/06/2009
Forme juridique	SICAV Luxembourgeoise
Stratégie	Performance Absolue
Région	Monde
Devise de référence	Euro
Affectation des résultats	Capitalisation
Code ISIN	LU1229129496
Code Bloomberg	SVARERC LX Equity

Encours sous gestion	24 600 000 euros
Valeur liquidative	128.2
Frais de gestion fixes	1.50 %
Frais de gestion variables	10.00 %
Indice de référence*	EONIA Capitalisé
Valorisation	Quotidienne
Dépositaire	CACEIS Bank Luxembourg

Echelle de risque AMF



Durée minimum d'investissement recommandée



SEVEN CAPITAL MANAGEMENT

39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tel. +33 1 42 33 04 50

Société par Actions Simplifiée SAS – Agréée par l'AMF N° GP 06000045 – Capital de 560 000 euros – RCS B 491 390 464

www.seven-cm.com

www.amf-france.org

Les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures

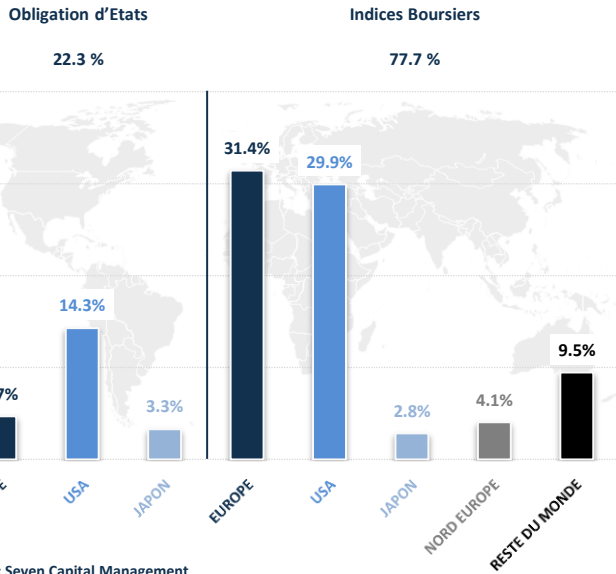
UCITS – Seven Absolute Return Fund – Part R

Fonds long / short multi-classes d'actifs

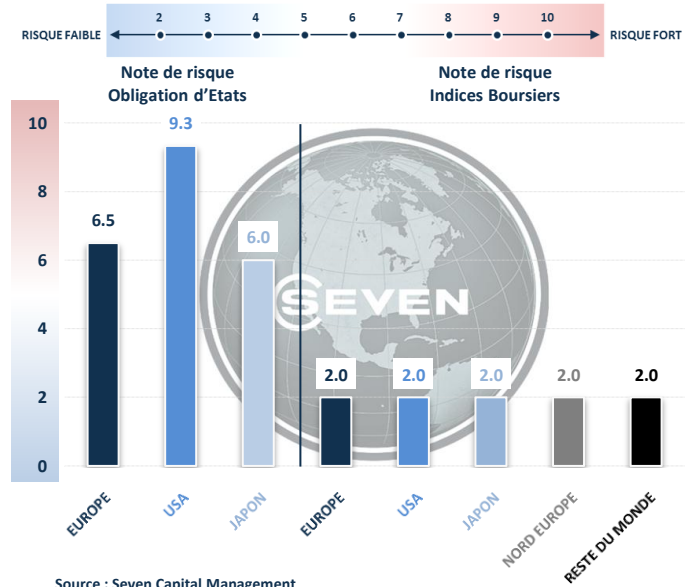
JANVIER 2018

(données au 31/01/2018)

Répartition du risque du portefeuille par classe d'actif (VaR 95 % 1 jour)



Note de risque propriétaire Seven Capital Management



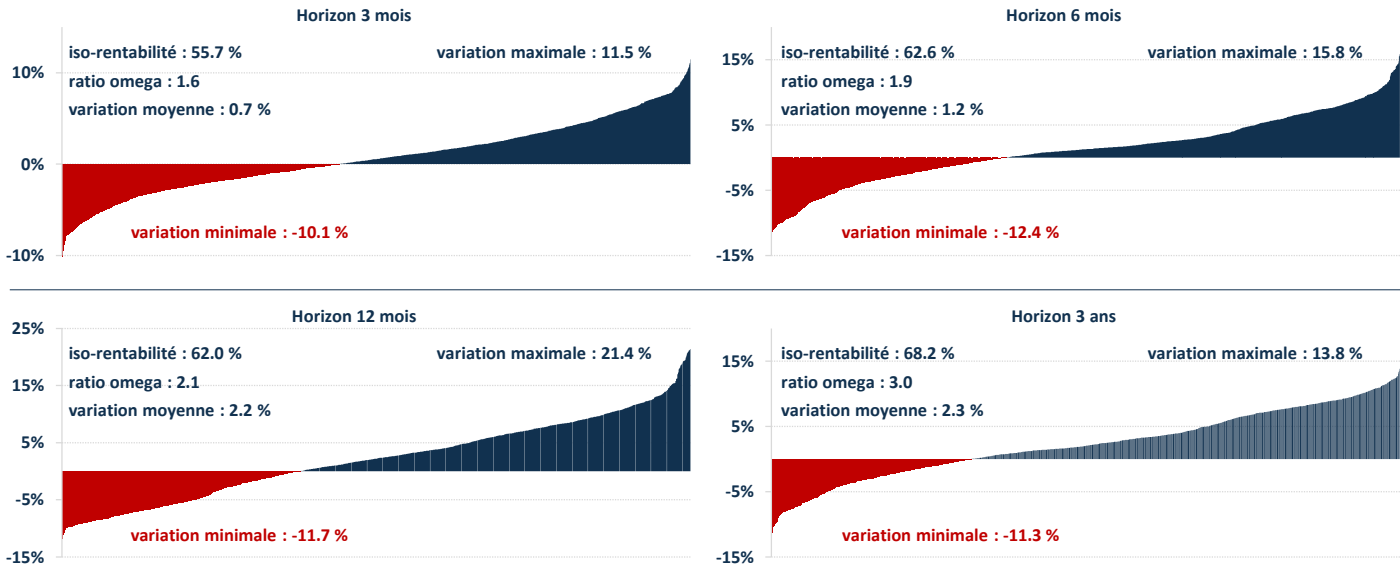
Source : Seven Capital Management

Source : Seven Capital Management

Source : Seven Capital Management

Analyse de l'iso-rentabilité & du ratio Omega

Iso – Rentabilité : Probabilité historique du fonds d'afficher à un horizon donné une performance strictement supérieure à zéro
Ratio Omega : Rapport entre la surface des gains du fonds et la surface des pertes de ce fonds à un horizon donné



Les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures. Document d'information sans valeur contractuelle. Pour les investisseurs professionnels uniquement. Pour plus d'informations, le prospectus, en langues française et anglaise et le DICI (Document d'Information Clé pour l'Investisseur), en langues française, anglaise, allemande, espagnole et italienne sont disponibles sur notre site internet www.seven-cm.com. En Suisse, le Fonds a nommé comme représentant Oligo Swiss Fund Services SA, Av. Villamont 17, 1005 Lausanne, Suisse, Tél : +41 21 311 17 77, e-mail : info@oligofunds.ch. Le service de paiement du Fonds en Suisse est la Neue Helvetische Bank.

SEVEN CAPITAL MANAGEMENT

39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tél. +33 1 42 33 04 50
 Société par Actions Simplifiée SAS – Agréée par l'AMF N° GP 06000045 – Capital de 560 000 euros – RCS B 491 390 464
www.seven-cm.com
www.amf-france.org

Les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures