

Seven Absolute Return (Part I)

mars-2017

Informations

| | | | | | |
|---------------------------|-----------------------|----------------------------|----------------------|----------------------------|-------------------|
| Date de création | 05/06/2009 | Code ISIN | LU1229129140 | Frais de gestion fixes | 1,00% |
| Forme juridique | SICAV Luxembourgeoise | Code Bloomberg | SVAREIC LX Equity | Frais de gestion variables | 10,00% |
| Stratégie | Diversifiée | Actif Net Total (M€ / M\$) | 18 / 20 | Valorisation | Quotidienne |
| Devise | EUR | Valeur Liquidative | 123,13 | Dépositaire | CACEIS Luxembourg |
| Affectation des résultats | Capitalisation | Echelle de risque | 1 2 3 4 5 6 7 | | |

Performances

| | |
|---------------------------|---------|
| Mois en cours | 0,43% |
| Année en cours | 6,53% |
| 1 an | 5,46% |
| 3 ans | 11,70% |
| 5 ans | 7,10% |
| Performance annualisée | 2,69% |
| Volatilité annualisée | 8,46% |
| Perte maximale historique | -15,38% |
| Perte maximale en cours | -3,15% |
| Ratio Sharpe | 0,30 |

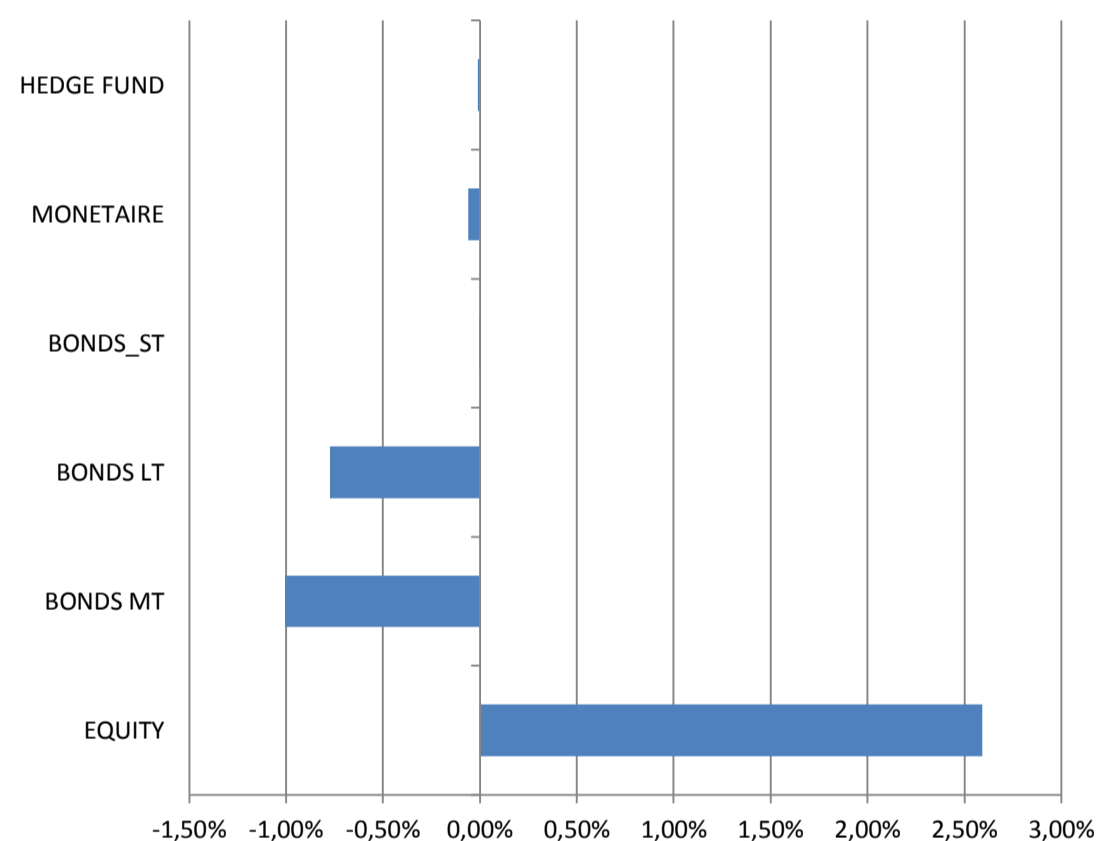
Mot du Gérant

Le mois de mars a connu une hausse des indices européens et une stagnation des indices américains (Euro Stoxx 50 +5.46%, S&P500 -0.04%, et Nasdaq +1.48%). Le marché obligataire s'est déprécié particulièrement en Allemagne (Bund -0.85% et TNOTE10Y -0.01%). L'or s'est déprécié de -0.48% après deux mois positifs et le Crudeoil a connu une forte baisse de -7.04%. Le mois d'avril est historiquement un très bon mois pour les actions et les grains.

Performances nettes mensuelles

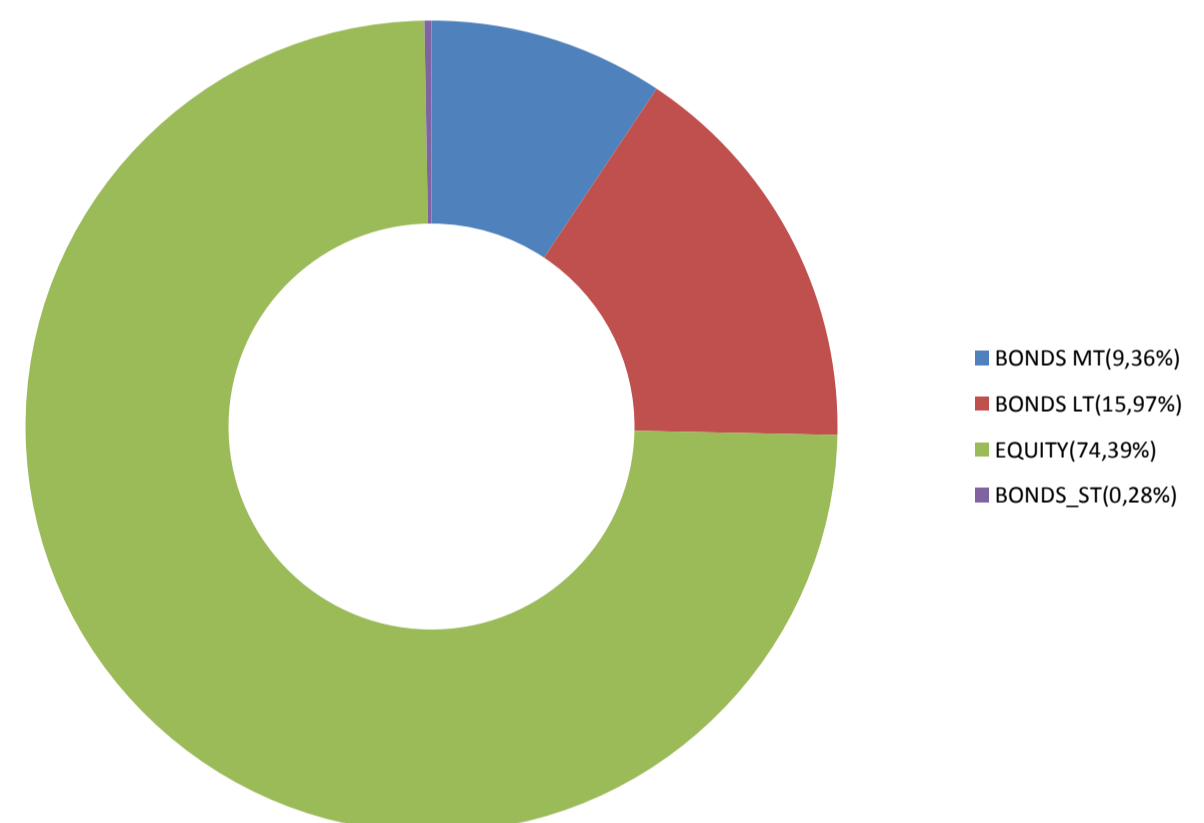
| | janv. | févr. | mars | avr. | mai | juin | juil. | août | sept. | oct. | nov. | déc. | Annuel |
|------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 2009 | | | | | | 0,97% | -0,39% | 1,22% | 0,23% | -1,80% | 2,95% | -0,92% | 2,21% |
| 2010 | 0,16% | 0,01% | 0,71% | 1,41% | -0,78% | 1,08% | 1,90% | 4,08% | 1,75% | 1,66% | -3,22% | 1,44% | 10,49% |
| 2011 | -0,08% | 0,76% | -3,11% | 1,94% | 0,64% | -0,72% | 0,20% | 3,51% | 0,83% | -3,69% | 1,35% | -0,27% | 1,17% |
| 2012 | -1,39% | 2,21% | -0,16% | -0,84% | -2,33% | 1,32% | 1,32% | -1,54% | -1,10% | -4,48% | 0,36% | 0,04% | -6,58% |
| 2013 | 0,41% | -1,64% | 1,06% | 2,18% | -0,25% | -4,05% | 2,46% | -2,61% | 3,99% | 2,55% | 0,71% | 0,23% | 4,85% |
| 2014 | -2,90% | 1,81% | -0,37% | 0,18% | 4,58% | 0,95% | 2,21% | 2,02% | -2,55% | -0,10% | 2,21% | -1,22% | 6,79% |
| 2015 | 1,87% | 2,39% | -0,34% | -0,86% | -0,37% | -2,40% | -1,34% | -6,08% | 2,36% | -0,03% | -0,11% | -5,11% | -9,94% |
| 2016 | 5,40% | 4,27% | -1,29% | -2,18% | 0,53% | 3,91% | -0,02% | -1,63% | -1,32% | -3,82% | 0,77% | 2,98% | 7,39% |
| 2017 | -0,18% | 6,27% | 0,43% | | | | | | | | | | 6,53% |

Performances mensuelles brutes par secteur



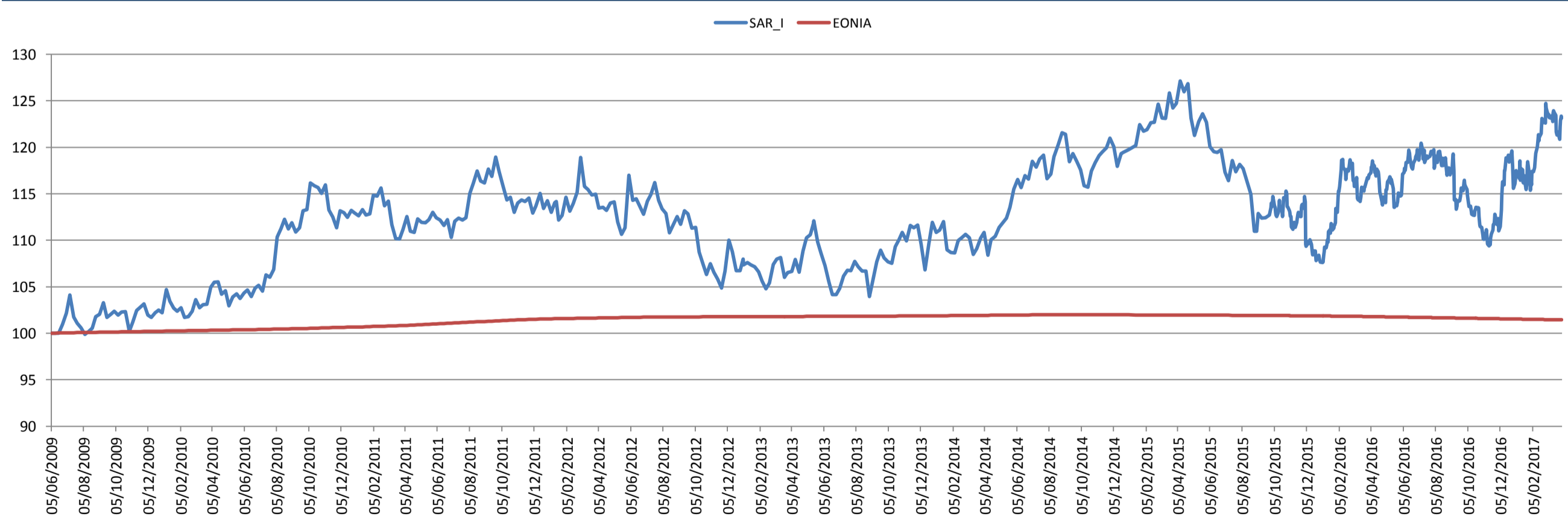
Source Seven CM

Risque par secteur (VaR 95% 1 jour)



Source Seven CM

Performance depuis le lancement



Source Seven CM

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.