

UCITS – Seven Absolute Return Fund – Part I

Fonds long / short multi-classes d'actifs



MAI 2018

(données au 31/05/2018)

Valeur liquidative :

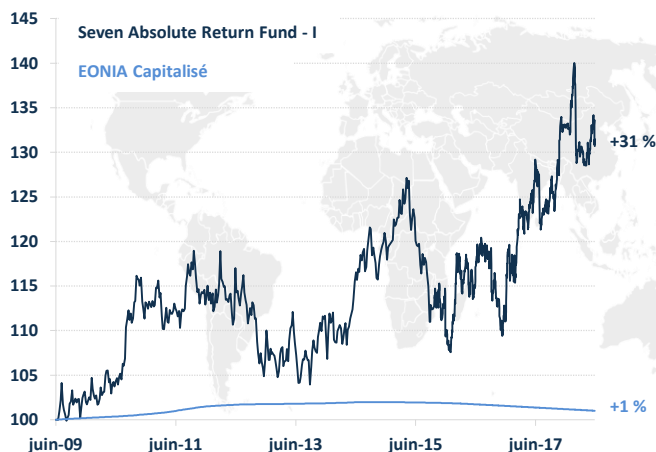
130.68 euros

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.

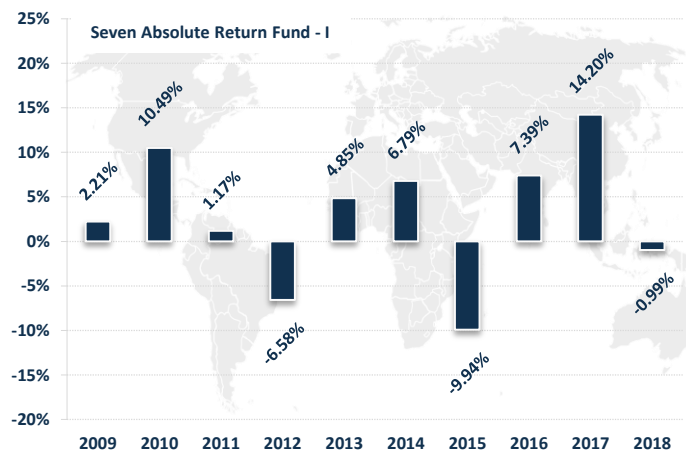
Evolution du fonds depuis son lancement le 5 juin 2009 (base 100)

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	+0.66 %			
YTD	-0.99 %			
1 an	+3.12 %	-0.36 %		
3 ans	+6.50 %	-0.92 %	+2.12 % / an	-0.31 % / an
5 ans	+20.35 %	-0.78 %	+3.80 % / an	-0.16 % / an
Lancement	+30.68 %	+1.02 %	+3.04 % / an	+0.11 % / an

Analyse de risque

Source : Seven Capital Management

	1 an	3 ans	5 ans	Lancement
Volatilité	8.56 %	9.34 %	8.88 %	8.46 %
Ratio de Sharpe	0.37	0.23	0.43	0.36
Drawdown Max	-8.24 %	-12.31 %	-15.38 %	-15.38 %
Corrélation p				
vs. SG CTA Index	0.77	0.73	0.71	0.70
vs. MSCI World	0.67	0.23	0.41	0.20
vs. JP.Morgan GBI	0.15	0.28	0.20	0.15

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	LU1229129140
Code Bloomberg	SVAREIC LX Equity

Encours sous gestion	25 700 000 euros
Valeur liquidative	130.68
Frais de gestion fixes	1.00 %
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

MAI 2018

(données au 31/05/2018)

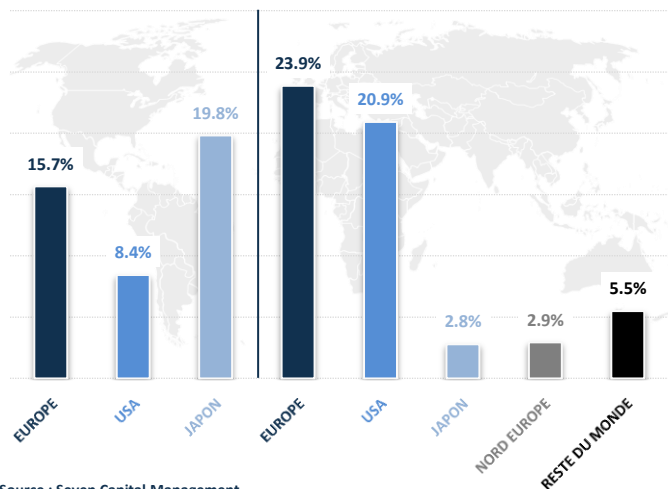
Répartition du risque du portefeuille par classe d'actif (VaR 95 % 1 jour)

Obligation d'Etats

44.0 %

Indices Boursiers

56.0 %

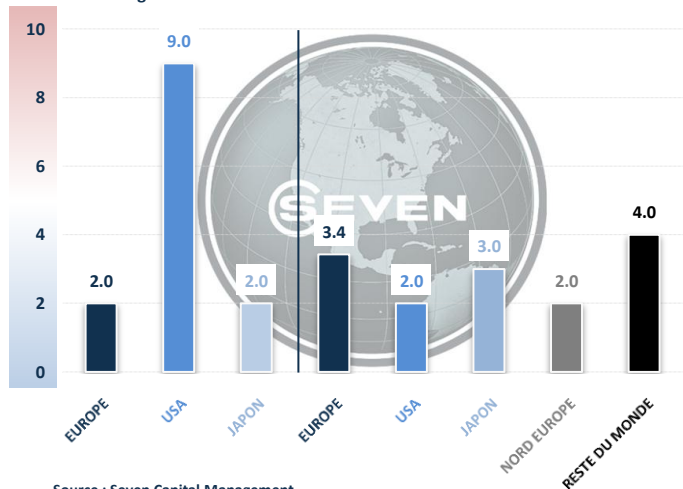


Note de risque propriétaire Seven Capital Management

RISQUE FAIBLE ← 2 3 4 5 6 7 8 9 10 → RISQUE FORT

Note de risque Obligation d'Etats

Note de risque Indices Boursiers



Source : Seven Capital Management

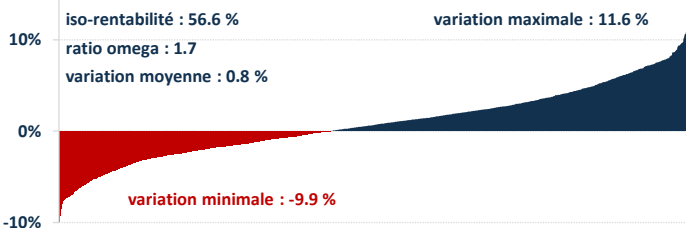
Source : Seven Capital Management

Source : Seven Capital Management

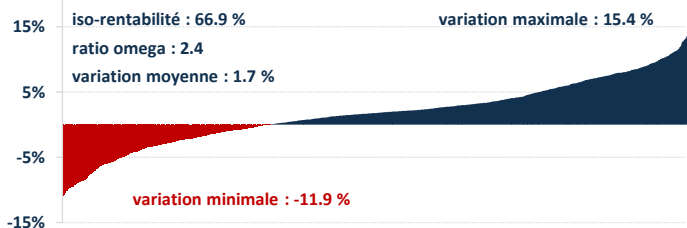
Analyse de l'iso-rentabilité & du ratio Omega

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

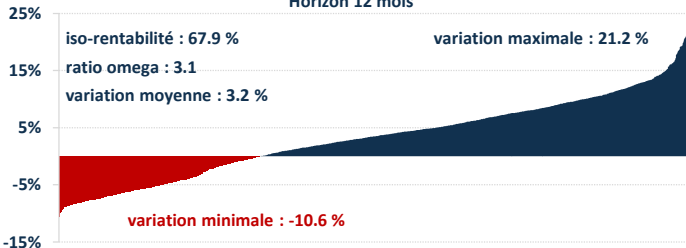
Horizon 3 mois



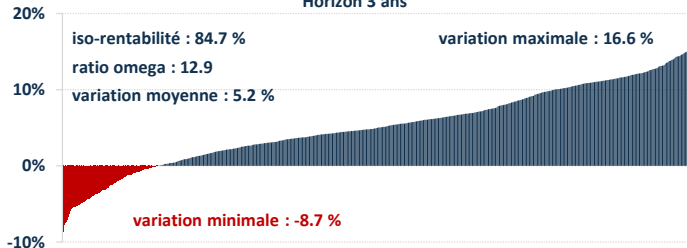
Horizon 6 mois



Horizon 12 mois



Horizon 3 ans



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