

Seven Absolute Return (Part I)

juin-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 | 122,04 | Dépositaire | CACEIS Luxembourg |
| Affectation des résultats | Capitalisation | Echelle de risque | 1 2 3 4 5 6 7 | | |

Performances

| | |
|---------------------------|---------|
| Mois en cours | -3,69% |
| Année en cours | 5,59% |
| 1 an | 2,30% |
| 3 ans | 4,67% |
| 5 ans | 8,18% |
| Performance annualisée | 2,50% |
| Volatilité annualisée | 8,51% |
| Perte maximale historique | -15,38% |
| Perte maximale en cours | -5,53% |
| Ratio Sharpe | 0,27 |

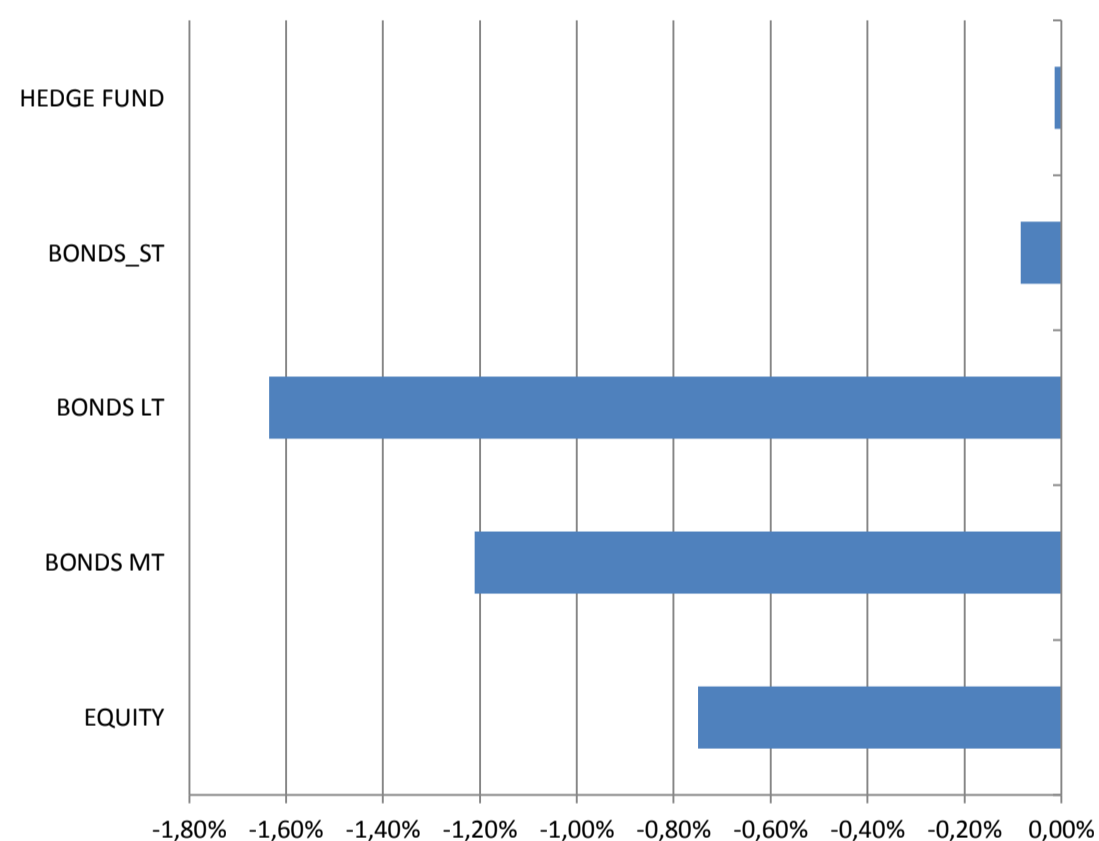
Mot du Gérant

Le mois de juin a connu une baisse des indices européens et une hausse des indices américains (Euro Stoxx 50 -3.17%, S&P500 +0.48%). Le marché obligataire s'est fortement déprécié (Bund -1.48% et TNOTE10Y -0.61%). L'or a baissé de -2.60% et le Crudeoil a continué sa baisse avec -5.19%. Le mois de juillet est en général bénéfique aux obligations européennes et aux métaux (cuivre et argent).

Performances nettes mensuelles

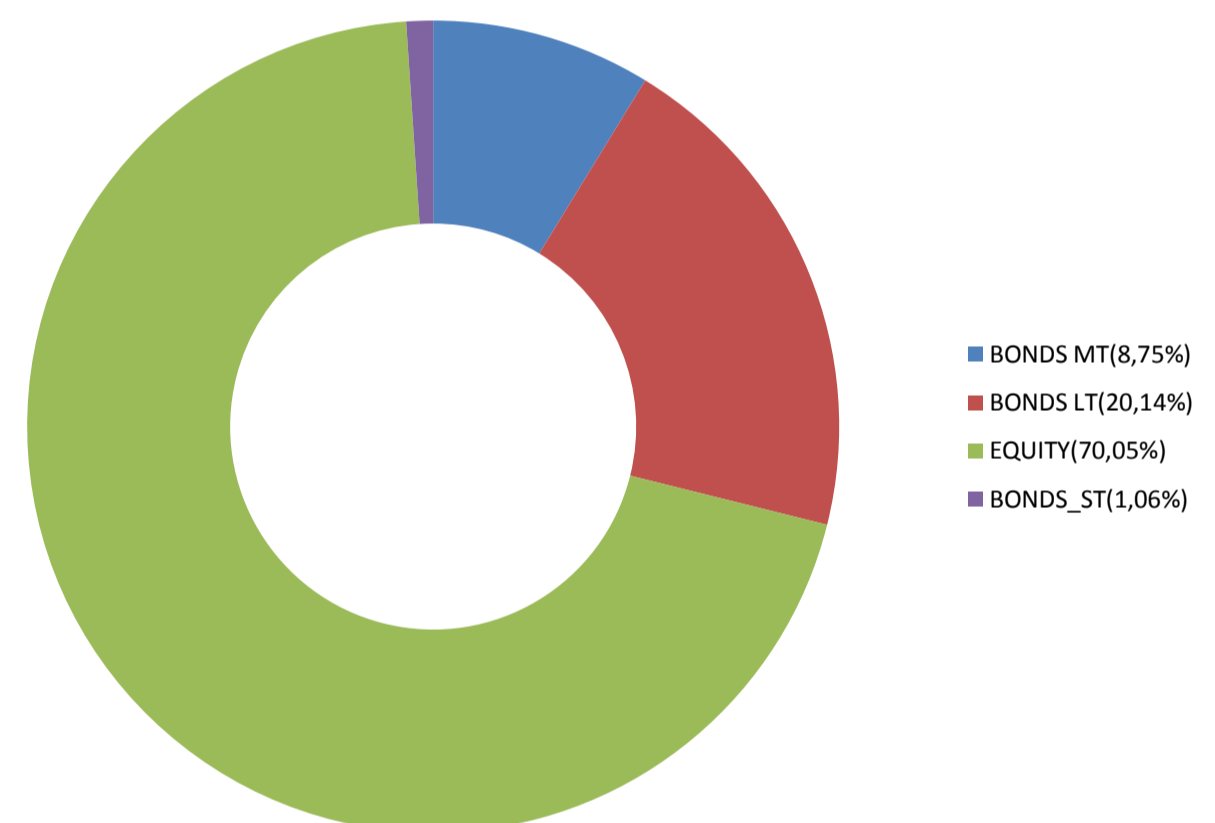
| | janv. | févr. | mars | avr. | mai | juin | juil. | août | sept. | oct. | nov. | déc. | Annuel |
|------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 2009 | | | | | | 0,97% | -0,39% | 1,22% | 0,23% | -1,80% | 2,95% | -0,92% | 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% | 0,45% | 2,45% | -3,69% | | | | | | | 5,59% |

Performances mensuelles brutes par secteur



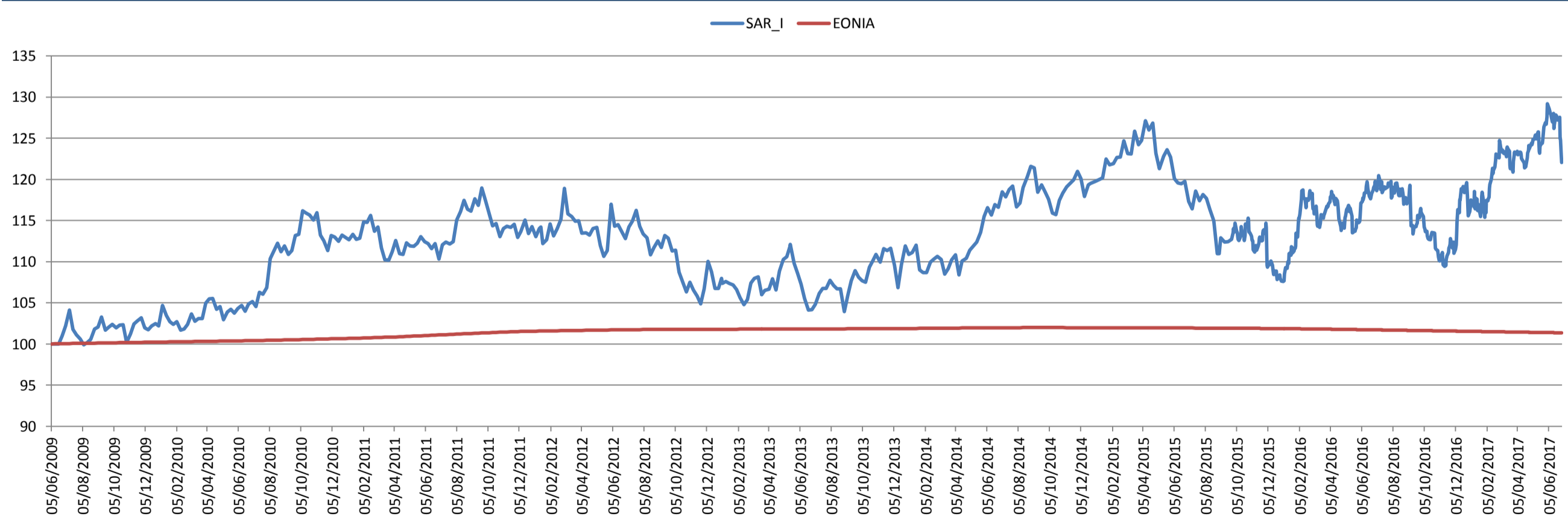
Source Seven CM

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.

SEVEN CAPITAL MANAGEMENT

39, rue Marbeuf 75008 Paris - France - Tel. +33 1 42 33 04 50
Société par Action 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