SEVEN CAPITAL MANAGEMENT

OCTOBRE 2026

Seven αlpha βeta Equity Europe — Part R

FONDS ACTIONS · ZONE EURO · GRANDES CAP. · COUVERTURE DYNAMIQUE DU PORTEFEUILLE

96,55 €

Valeur liquidative — données au 30/10/2026

MORNINGSTAR	QUANTALYS	ISR / ESG
☆☆☆☆☆	☆☆☆☆☆	SFDR 8

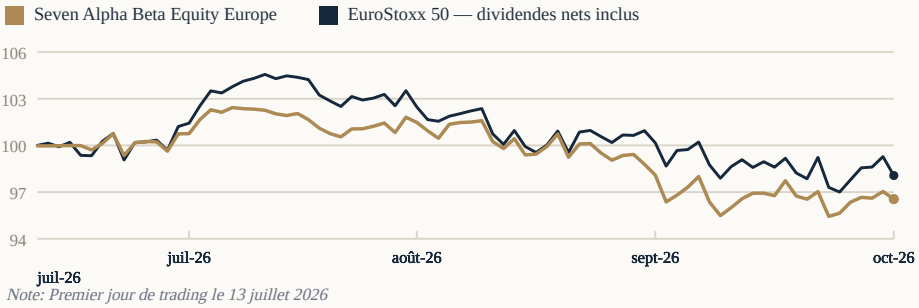
Seven Alpha Beta Equity Europe est une stratégie actions systématique et activement gérée, dont la couverture dynamique de l'exposition au marché — fondée sur la technologie Momentum de Seven Capital — vise à préserver le capital dans les phases de baisse de marché. Elle complète les stratégies actions traditionnelles en investissant dans les grandes capitalisations de la zone euro, avec pour objectif de surperformer l'indice EuroStoxx 50 (rendement net). Eligible au PEA.

PERFORMANCE

PERFORMANCE — 1 MOIS
-1,57 %
Indice : -2,09 %

PERFORMANCE — YTD
-3,45 %
Indice : -1,93 %

DEPUIS CRÉATION (13/07/2026)
-3,45 %
Indice : -1,93 %



Note: Premier jour de trading le 13 juillet 2026

PERFORMANCES CUMULÉES & ANNUALISÉES

PÉRIODE	FONDS	INDICE
1 mois	-1,57 %	-2,09 %
YTD	-3,45 %	-1,93 %
1 an		
3 ans		
5 ans		
Depuis création	-3,45 %	-1,93 %
ANNUALISÉES		
3 ans		
5 ans		
Depuis création	-10,00 %	-5,69 %

ANALYSE DE RISQUE

INDICATEUR	1 AN	3 ANS	5 ANS	DEPUIS CRÉATION
Volatilité — Fonds (%)				6,86 %
Volatilité — Indice (%)				6,83 %
Ratio de Sharpe — Fonds				-1,74
Ratio de Sharpe — Indice				-1,12
Beta — Fonds				0,94
Alpha — Fonds				-0,05

HISTORIQUE DES PERFORMANCES ANNUELLES DEPUIS 2026

ANNÉE	FONDS	INDICE	RELATIVE
Total	**-3,45 %**	**-1,93 %**	**-1,52 %**
2026	-3,45 %	-1,93 %	-1,52 %

ANNÉE	FONDS	INDICE	RELATIVE

INFORMATIONS GÉNÉRALES

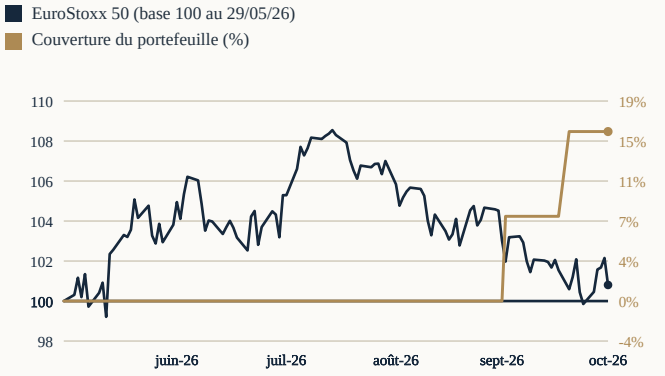
Date de création	01/06/2026	Encours de la stratégie	29 740 000 €
Forme juridique	SICAV Luxembourgeoise	Encours du fonds	490 000 €
Stratégie	Actions - Long Only - Couverture Dynamique du Portefeuille	Valeur liquidative	101,48 €
Région	Eurozone	Frais de gestion fixes	1,50 %
Devise de référence	EUR	Frais de gestion variables	15,00 %
Affectation des résultats	Capitalisation	Indice de référence	EuroStoxx 50 NR
Code ISIN	LU3325331349	Valorisation	Quotidienne
Code Bloomberg	SEVSABR LX Equity	Dépositaire	Banque de Luxembourg

Document d'information sans valeur contractuelle. Pour les investisseurs professionnels uniquement. Les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures. L'investisseur peut perdre tout ou partie du montant du capital investi, les OPC n'étant pas garantis en capital.

Seven αlpha βeta Equity Europe — Part R

Composition du portefeuille

COUVERTURE DYNAMIQUE DU PORTEFEUILLE



RÉPARTITION PAR CAPITALISATION

< 1 000 M€	1 000 – 5 000 M€	5 000 – 10 000 M€	> 10 000 M€	CAPITALISATION MOYENNE
0,0 %	1,9 %	14,0 %	84,1 %	48 836 M€

INFORMATIONS SUR LE RISQUE

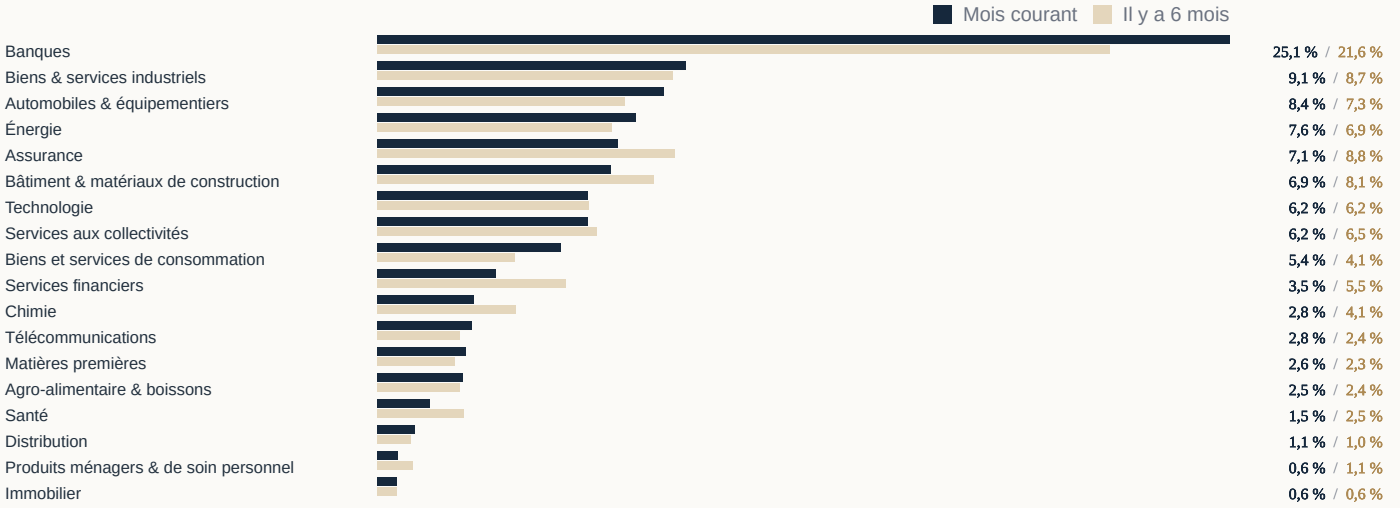
ÉCHELLE DE RISQUE (AMF)

1	2	3	**4**	5	6	7

DURÉE MIN. RECOMMANDÉE

5 ans

RÉPARTITION SECTORIELLE



PRINCIPALES POSITIONS

SOCIÉTÉ	PONDÉRATION	SECTEUR	PAYS	CAP. BOURSIÈRE (M€)	Δ SUR LE MOIS
1. BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	4,00 %	Banques	Espagne	44 216	-15,11 %
2. BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	3,00 %	Automobiles & équipementiers	Allemagne	102 008	+3,90 %
3. MERCEDES-BENZ GROUP AG	2,89 %	Automobiles & équipementiers	Allemagne	189 904	+0,52 %
4. UNICREDIT SPA	2,72 %	Banques	Italie	13 675	-11,88 %
5. BAWAG GROUP AG	2,46 %	Banques	Autriche	13 606	-11,35 %
6. BNP PARIBAS	2,36 %	Banques	France	29 176	-9,84 %
7. TELEFONICA SA	2,24 %	Télécommunications	Espagne	5 139	+1,08 %
8. REPSOL SA	2,24 %	Énergie	Espagne	32 154	+2,67 %
9. ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	2,19 %	Bâtiment & matériaux de construction	Espagne	24 994	-0,44 %
10. TENARIS SA	2,09 %	Énergie	Italie	18 649	+10,27 %

Poids du Top 10 dans le portefeuille : 26,2 %

MEILLEURES PERFORMANCES DU MOIS

SOCIÉTÉ	POIDS	SECTEUR	PAYS	PERF.
1. DASSAULT SYSTEMES SE	0,73 %	Technologie	France	+23,28 %
2. CAPGEMINI SE	0,65 %	Technologie	France	+22,27 %
3. ORION OYJ-CLASS B	0,73 %	Santé	Finlande	+20,34 %
4. ADIDAS AG	0,98 %	Biens et services de consommation	Allemagne	+15,51 %
5. L'OREAL	1,09 %	Biens et services de consommation	France	+15,15 %

Poids cumulé : 4,2 %

MOINS BONNES PERFORMANCES DU MOIS

SOCIÉTÉ	POIDS	SECTEUR	PAYS	PERF.
1. SCHNEIDER ELECTRIC SE	0,98 %	Biens & services industriels	France	-18,66 %
2. CARREFOUR SA	0,61 %	Produits ménagers & de soin perso…	France	-18,01 %
3. BANCO SANTANDER SA	1,20 %	Banques	Espagne	-17,93 %
4. ASM INTERNATIONAL NV	0,98 %	Technologie	Pays-Bas	-17,82 %
5. AURUBIS AG	0,84 %	Matières premières	Allemagne	-16,33 %

Poids cumulé : 4,6 %

Document d'information sans valeur contractuelle. Pour les investisseurs professionnels uniquement. Le prospectus et le DICI sont disponibles en français et en anglais (DICI également en allemand, espagnol et italien) sur www.seven-cm.com. En Suisse, représentant : Waystone Fund Services (Switzerland) SA, Av. Villamont 17, 1005 Lausanne — Tel. +41 21 311 17 77. Service de paiement en Suisse : Helvetische Bank, Seefeldstrasse 215, 8008 Zürich — Tel. +41 44 204 56 00.