SEVEN CAPITAL MANAGEMENT

Seven Force 5 — Part I

FONDS D'ALLOCATION FLEXIBLE · LONG ONLY · MARCHÉS ACTIONS & TAUX · GLOBAL

OCTOBRE 2026

133,67 €

Valeur liquidative — données au 30/10/2026

ISR / ESG

SFDR 8

Fonds d'allocation flexible global et long only reposant sur un processus d'investissement rigoureux, fondé sur l'analyse momentum des actifs financiers. L'allocation se fait à partir des méthodologies de Risk Parity assurant ainsi une gestion et une maitrise optimale des risques. La stratégie vise à reproduire le profil de rendement d'instruments obligataires de haute qualité, dans le cadre d'une volatilité cible de 5 %, conformément à l'objectif structurel du programme. La Version 4 ("V4") de la stratégie est active depuis le 31 mai 2022.

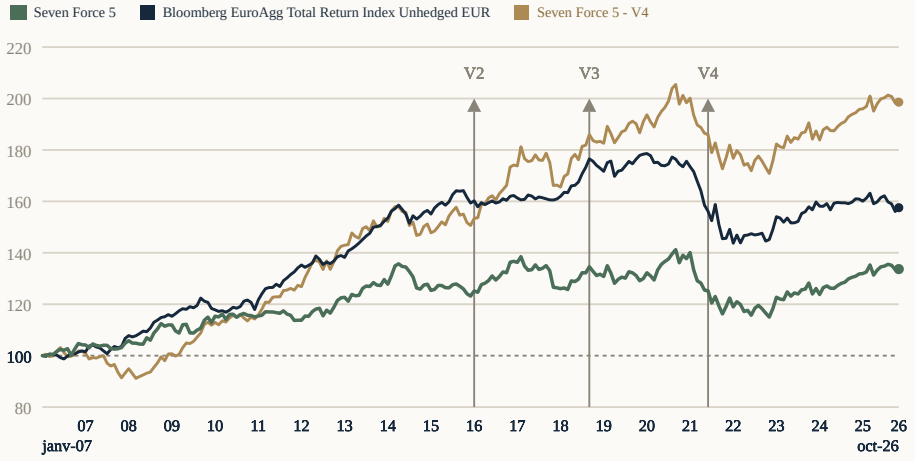
PERFORMANCE

PERFORMANCE — 1 MOIS
+0,16 %
Indice : +0,96 %

PERFORMANCE — YTD
+1,32 %
Indice : -1,58 %

DEPUIS CRÉATION (22/01/2007)
+33,67 %
Indice : +57,55 %

DEPUIS CRÉATION - FORCE 5 - V4 (22/01/2007)
+98,57 %
Indice : +57,55 %



SEVEN FORCE 5 - V4 — PERFORMANCES CUMULÉES & ANNUALISÉES ET ANALYSE DE RISQUE

PÉRIODE	FORCE 5 - V4	INDICE
1 mois	+0,16 %	+0,96 %
YTD	+1,32 %	-1,58 %
1 an	+2,11 %	-2,14 %
3 ans	+16,23 %	+8,55 %
5 ans	-1,31 %	-9,17 %
Depuis création	+98,57 %	+57,55 %
ANNUALISÉES		
3 ans	+5,14 %	+2,77 %
5 ans	-0,26 %	-1,91 %
Depuis création	+3,52 %	+2,32 %

INDICATEUR	1 AN	3 ANS	5 ANS	DEPUIS CRÉATION
Volatilité — Fonds (%)	4,45 %	5,07 %	6,07 %	5,81 %
Volatilité — Indice (%)	4,24 %	4,36 %	6,07 %	4,35 %
Ratio de Sharpe — Fonds	0,04	0,63	-0,36	0,27
Ratio de Sharpe — Indice	-0,96	0,19	-0,63	0,09
Beta — Fonds	0,85	0,90	0,69	0,69
Alpha — Fonds	0,04	0,02	0,00	0,01
CORRÉLATIONS				
Bloomberg EuroAgg. TR Unhedged EUR	0,81	0,77	0,69	0,51
EuroStoxx 50	0,86	0,66	0,79	0,58

PERFORMANCES CUMULÉES & ANNUALISÉES

PÉRIODE	FONDS	INDICE
1 mois	+0,16 %	+0,96 %
YTD	+1,32 %	-1,58 %
1 an	+2,12 %	-2,14 %
3 ans	+16,23 %	+8,55 %
5 ans	-3,87 %	-9,17 %
Depuis création	+33,67 %	+57,55 %
ANNUALISÉES		
3 ans	+5,14 %	+2,77 %
5 ans	-0,79 %	-1,91 %
Depuis création	+1,47 %	+2,32 %

ANALYSE DE RISQUE

INDICATEUR	1 AN	3 ANS	5 ANS	DEPUIS CRÉATION
Volatilité — Fonds (%)	4,45 %	5,07 %	6,44 %	5,31 %
Volatilité — Indice (%)	4,24 %	4,36 %	6,07 %	4,35 %
Ratio de Sharpe — Fonds	0,04	0,63	-0,42	-0,09
Ratio de Sharpe — Indice	-0,96	0,19	-0,63	0,09
Beta — Fonds	0,85	0,90	0,73	0,59
Alpha — Fonds	0,04	0,02	0,00	-0,01
CORRÉLATIONS				
Bloomberg EuroAgg. TR Unhedged EUR	0,81	0,77	0,69	0,49
EuroStoxx 50	0,86	0,66	0,79	0,52

INFORMATIONS GÉNÉRALES

Date de création	22/01/2007
Forme juridique	UCITS Luxembourgeois
Stratégie	Risk Parity (Target de Volatilité 5%)
Région	Global
Devise de référence	Euro
Affectation des résultats	Capitalisation
Code ISIN	LU1229132441
Code Bloomberg	SVRAEIC LX Equity

Encours de la stratégie	67 280 000 €
Encours du fonds	53 010 000 €
Valeur liquidative	133,67 €
Frais de gestion fixes	1,00 %
Frais de gestion variables	10,00 %
Indice de référence	€STR Capitalisé
Valorisation	Quotidienne
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 Force 5 — Part I

ALLOCATION DU PORTEFEUILLE

ALLOCATION NETTE TOTALE	=	ACTIONS US + EUROPE	+	ACTIONS ASIE	+	TAUX D'INTÉRÊT	+	FUTURES (COUVERTURE)
+19,9 %		+24,1 %		+5,5 %		0,0 %		-9,7 %
En % des actifs du portefeuille		Titres vifs		Futures sur indices boursiers		Futures sur taux d'intérêt		Futures sur indices boursiers

ACTIONS EUROPE

Exposition nette	+6,9 %
Titres vifs	+9,4 %
Couverture (futures)	-2,5 %

ACTIONS ÉTATS-UNIS

Exposition nette	+7,4 %
Titres vifs	+14,7 %
Couverture (futures)	-7,2 %

ACTIONS ASIE

Exposition nette	+5,5 %
Inde	+2,5 %
Japon	+1,3 %
Singapore	+0,8 %
Taïwan	+0,5 %
Hong Kong	+0,5 %

TAUX D'INTÉRÊT

Exposition nette	0,0 %
Taux États-Unis	0,0 %
Taux européens	0,0 %

Exposition nette en % des actifs du portefeuille. Les positions vendeuses sur futures États-Unis et Europe correspondent à une couverture de la poche titres vifs.

POCHE TAUX — RÉPARTITION PAR DURATION

PAR DURATION — EUROPE

2 ans	0,0 %
5 ans	0,0 %
10 ans	0,0 %
30 ans	0,0 %

PAR DURATION — ÉTATS-UNIS

2 ans	0,0 %
5 ans	0,0 %
10 ans	0,0 %
30 ans	0,0 %

Actuellement, aucune exposition aux taux d'intérêt. Exposition via des futures sur emprunts d'État, en % des actifs du portefeuille.

PRINCIPALES POSITIONS

SOCIÉTÉ	PONDÉRATION	SECTEUR	PAYS	CAP. BOURSIÈRE (M)	Δ SUR LE MOIS
1. NIFTY INDE	2,5 %	Future sur Indice	Inde	—	—
2. NIKKEI	1,3 %	Future sur Indice	Japon	—	—
3. EBAY INC	0,8 %	Produits et Services de Consommation	États-Unis	54 109 USD	+14,7 %
4. MSCI SINGAPOUR	0,8 %	Future sur Indice	Singapore	—	—
5. CITIGROUP INC	0,7 %	Banques	États-Unis	208 489 USD	-5,3 %
6. FIDELITY NATIONAL INFO SERV	0,6 %	Biens et Services Industriels	États-Unis	20 128 USD	+17,2 %
7. JOHNSON & JOHNSON	0,6 %	Santé	États-Unis	644 509 USD	+3,2 %
8. MORGAN STANLEY	0,6 %	Services Financiers	États-Unis	295 259 USD	-2,0 %
9. TAPESTRY INC	0,5 %	Distribution	États-Unis	23 366 USD	+1,1 %
10. LOCKHEED MARTIN CORP	0,5 %	Biens et Services Industriels	États-Unis	146 343 USD	+25,1 %

Poids du Top 10 dans le portefeuille : 8,8 %

INFORMATIONS GÉNÉRALES

ÉCHELLE DE RISQUE (AMF) 1 2 **3** 4 5 6 7

DURÉE MIN. RECOMMANDÉE 3 Ans

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.