SEVEN CAPITAL MANAGEMENT

Seven Long Cash Risk Parity 3%

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

OCTOBRE 2026

101,27 €

Valeur liquidative — données au 30/10/2026

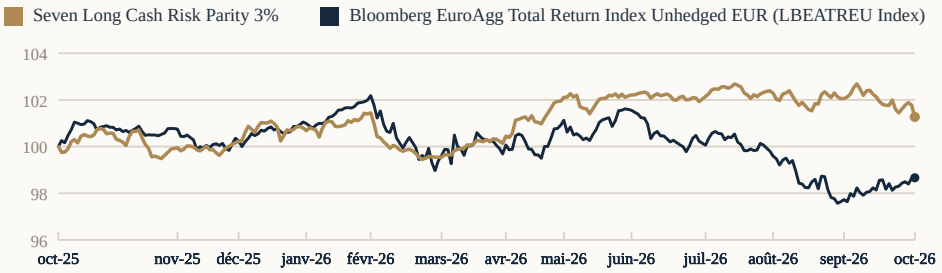
Fonds d'allocation flexible global et long only reposant sur un processus d'investissement rigoureux, fondé sur l'analyse momentum des actifs financiers. L'allocation se fait à partir des méthodologies de Risk Parity assurant ainsi une gestion et une maitrise optimale des risques. La stratégie vise un niveau de volatilité cible de 3% pour un rendement de + 4% et met en œuvre un processus d'allocation dynamique des actifs afin d'optimiser le couple rendement/risque.

PERFORMANCE

PERFORMANCE — 1 MOIS
-0,78 %
Indice : +0,96 %

PERFORMANCE — YTD
+1,24 %
Indice : -1,58 %

DEPUIS CRÉATION (07/10/2025)
+1,27 %
Indice : -1,34 %



PERFORMANCES CUMULÉES & ANNUALISÉES

PÉRIODE	FONDS	INDICE
1 mois	-0,78 %	+0,96 %
YTD	+1,24 %	-1,58 %
1 an	+0,53 %	-2,17 %
3 ans		
5 ans		
Depuis création	+1,27 %	-1,34 %
ANNUALISÉES		
3 ans		
5 ans		
Depuis création	+1,20 %	-1,27 %

ANALYSE DE RISQUE

INDICATEUR	1 AN	3 ANS	5 ANS	DEPUIS CRÉATION
Volatilité — Fonds (%)	2,57 %			2,56 %
Volatilité — Indice (%)	3,75 %			3,71 %
Ratio de Sharpe — Fonds	-0,55			-0,28
Ratio de Sharpe — Indice	-1,09			-0,86
Beta — Fonds	0,29			0,28
Alpha — Fonds	-0,00			0,00
CORRÉLATIONS				
Bloomberg EuroAgg. TR Unhedged EUR	0,42			0,40
EuroStoxx 50	0,65			0,61

HISTORIQUE DES PERFORMANCES ANNUELLES DEPUIS 2025

ANNÉE	FONDS	INDICE	RELATIVE
Total	**+1,27 %**	**-1,34 %**	**+2,61 %**
2026	+1,24 %	-1,58 %	+2,82 %
2025	+0,03 %	+0,25 %	-0,22 %

ANNÉE	FONDS	INDICE	RELATIVE

INFORMATIONS GÉNÉRALES

Date de création	07/10/2025
Forme juridique	FIAR Luxembourgeois
Stratégie	Risk Parity (Target de Volatilité : 3%)
Région	Global
Devise de référence	Euro
Affectation des résultats	Capitalisation
Code ISIN	LU3134536427
Code Bloomberg	SVLCRP3 LX Equity

Encours de la stratégie	67 280 000 €
Encours du fonds	10 130 000 €
Valeur liquidative	101,27 €
Frais de gestion fixes	0,80 %
Frais de gestion variables	10,00 %
Indice de référence	€STR
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 Long Cash Risk Parity 3%

Composition du portefeuille

RÉPARTITION PAR CLASSE D'ACTIFS

EXPOSITION ACTIONS: +30,2 %



EXPOSITION TAUX D'INTÉRÊT: +0,0 %

Actuellement, aucune exposition aux taux d'intérêt

Exposition brute, en % des actifs du portefeuille

INFORMATIONS GÉNÉRALES

ÉCHELLE DE RISQUE (AMF)

1	2	**3**	4	5	6	7

DURÉE MIN. RECOMMANDÉE

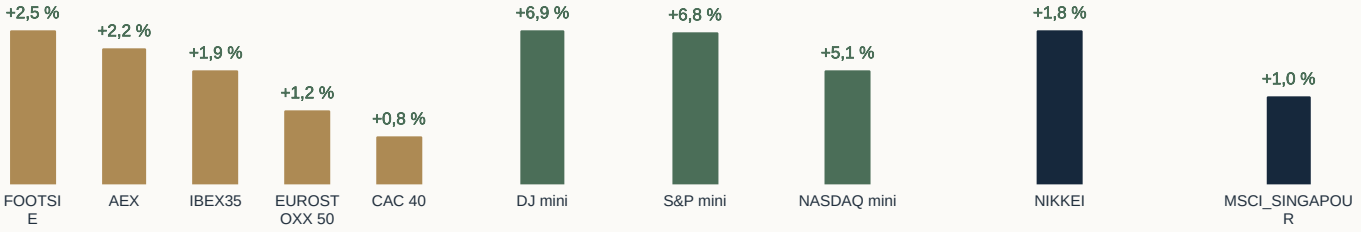
2 - 3 Ans

POCHE ACTIONS — RÉPARTITION PAR PAYS

ACTIONS EUROPE: +8,6 %

ACTIONS US: +18,8 %

ACTIONS ASIE: +2,8 %



POCHE TAUX D'INTÉRÊT - RÉPARTITION PAR PAYS

TAUX EUROPÉENS: +0,0 %

Actuellement, aucune exposition aux taux d'intérêt européens

TAUX US: +0,0 %

Actuellement, aucune exposition aux taux d'intérêt américains

Exposition brute, en % des actifs du portefeuille

PRINCIPALES POSITIONS

SOCIÉTÉ	PONDÉRATION	SECTEUR	PAYS
1. DJ mini	6,92 %	Futures sur Indices Boursiers	US
2. S&P mini	6,77 %	Futures sur Indices Boursiers	US
3. NASDAQ mini	5,13 %	Futures sur Indices Boursiers	US
4. FOOTSIE	2,53 %	Futures sur Indices Boursiers	Royaume-Uni
5. AEX	2,24 %	Futures sur Indices Boursiers	Pays-Bas
6. IBEX35	1,85 %	Futures sur Indices Boursiers	Espagne
7. NIKKEI	1,76 %	Futures sur Indices Boursiers	Japon
8. EUROSTOXX 50	1,22 %	Futures sur Indices Boursiers	Zone Euro
9. MSCI_SINGAPOUR	1,01 %	Futures sur Indices Boursiers	Singapour
10. CAC 40	0,79 %	Futures sur Indices Boursiers	France

Poids du Top 10 dans le portefeuille : 30,2 %

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.