PROGRAMME DE GESTION QUANTITATIF SYSTÉMATIQUE · LONG/SHORT MOMENTUM

Seven Absolute Return Momentum

Certificat domicilié au Luxembourg répliquant la stratégie long/short Cross-Assets de Seven Capital : un objectif de rendement régulier de 10 % par an, pour une volatilité cible de 10 %.

30 ans	10 %	10 %	≈ 15 %
D'historique	Volatilité cible	Objectif de rendement	Recul maximum visé
Stratégie momentum	Pilotée en continu	Annualisé	En données mensuelles

NOTRE APPROCHE

Capter les tendances, à la hausse comme à la baisse.

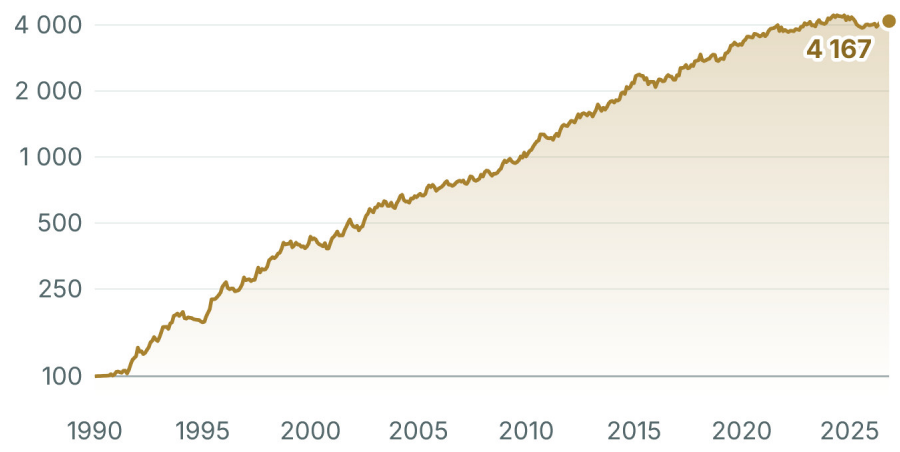
Le programme de gestion investit via des contrats à terme sur les taux et les actions de la zone Europe / US / Asie. Les actifs sont placés à 100 % en instruments du marché monétaire. Chaque marché contribue à parts égales au risque, et l'exposition s'ajuste pour maintenir la volatilité au niveau cible.

01
Détection de tendances
Des algorithmes qui identifient les tendances haussières comme baissières, à moyen et long terme.

02
Aucune discrétion
Règles appliquées systématiquement : pas de pattern recognition, pas d'optimisation, les mêmes pour tous les marchés.

03
Futures ultra liquides
Futures sur actions et taux uniquement : ni devises, ni matières premières.

Le programme F10 depuis 1990
Base 100 en janvier 1990, échelle logarithmique · simulation mensuelle, série nette NSAR Net



+10,66 %
Rendement annualisé

9,49 %
Volatilité annualisée

−15,19 %
Recul maximum

1,08
Ratio de Sharpe

Source : Seven Capital Management, série NSAR Net. Performances simulées de janvier 1990 à octobre 2026.

Les performances passées ne préjugent pas des performances futures. L'investisseur peut perdre tout ou partie du capital investi, le certificat n'étant pas garanti en capital.

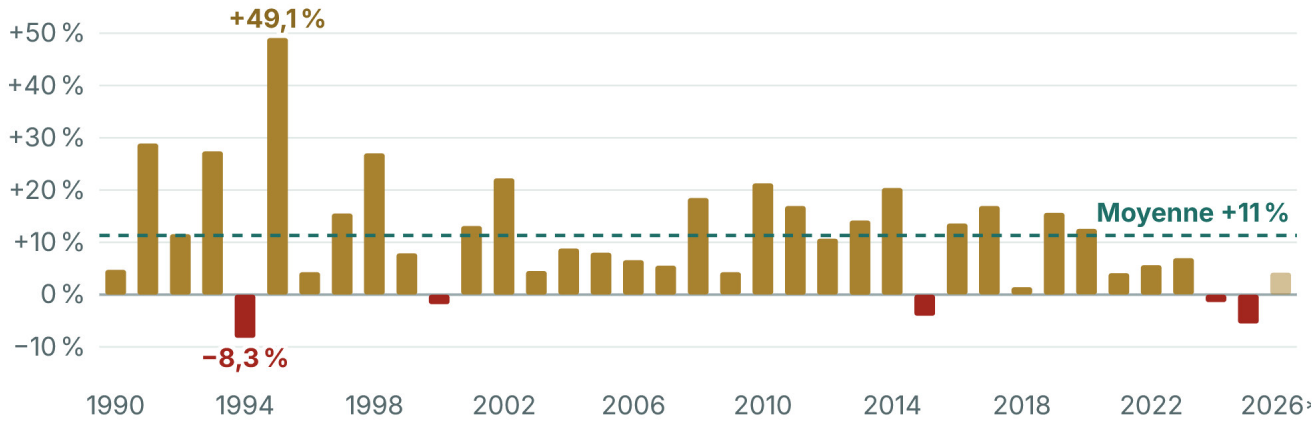
PERFORMANCE ABSOLUE

31 années positives sur 36.

L'approche performance absolue permet de retrouver, de manière systématique, de nouveaux plus hauts historiques : tout recul de la valeur est ainsi une opportunité d'investissement.

Performances annuelles du programme F10

Simulation nette (NSAR Net) de 1990 à octobre 2026



+11 %	+49,1 %	−8,3 %	5 sur 36
Performance annuelle moyenne	Meilleure année (1995)	Pire année (1994)	Années négatives

DANS UNE ALLOCATION

Un moteur de performance décorrélé.

Corrélation moyenne de 0,42 avec l'indice obligataire Bloomberg EuroAgg sur un an glissant, négative environ un cinquième du temps : le programme diversifie un portefeuille classique.

HORIZON 5 ANS GLISSANTS

+70 %	+156 %	+4 %
Médiane	Meilleure période	Pire période

Recul médian : −3,4 % (base mensuelle)

CARACTÉRISTIQUES

Forme	**Certificat AMC**
Émetteur	**Natixis · Note S&P : A+**
Code ISIN	**XS1700086850**
Liquidité	**Quotidienne**
Public	**Investisseurs qualifiés**
Actifs en portefeuille	**100 % monétaire**

Stratégie	**Macro systématique long/short**
Univers	**Futures sur taux et actions Europe / US / Asie**
Volatilité cible	**10 %**
Objectif de rendement	**10 % annualisé**
Recul maximum visé	**≈ 15 % (mensuel)**
Autres véhicules	**SICAV-FIAR Lux., mandats**

L'ÉQUIPE SEVEN CAPITAL À VOTRE DISPOSITION

Johann Schwimann
jschwimann@seven-cm.com

Renaud Labbé
rlabbe@seven-cm.com

Nicolas Kochnitzky
nk@seven-cm.com

Nathalie Alovisetti
nalovisetti@seven-cm.com

Marc Bogouslavsky
mbogouslavsky@seven-cm.com

Document non contractuel, réservé aux investisseurs qualifiés. Performances simulées. Les performances passées ne préjugent pas des performances futures ; capital non garanti. Prospectus sur www.seven-cm.com.