MOMENTUM SYSTÉMATIQUE · LONG ONLY · ALLOCATION RISK PARITY

Seven Force 5

Fonds de cœur de portefeuille. L'allocation se fait à partir des méthodologies de Risk Parity assurant ainsi une gestion et une maîtrise optimale des risques. La stratégie vise à émuler les rendements d'instruments obligataires de haute qualité – 5 à 7 % – dans le cadre d'une volatilité cible de 5 %.

30 ans	5 %	5 %	5 ans
D'expertise momentum	Volatilité cible Pilotée en continu	Objectif de rendement	Horizon recommandé Échelle de risque 3/7

NOTRE APPROCHE

Chaque classe d'actifs pèse autant dans le risque.

Le fonds repose sur un processus rigoureux, fondé sur l'analyse momentum des actifs financiers. L'allocation suit une méthodologie Risk Parity : chaque position contribue à parts égales au risque du portefeuille, et l'exposition s'ajuste dynamiquement pour optimiser le couple rendement/risque.

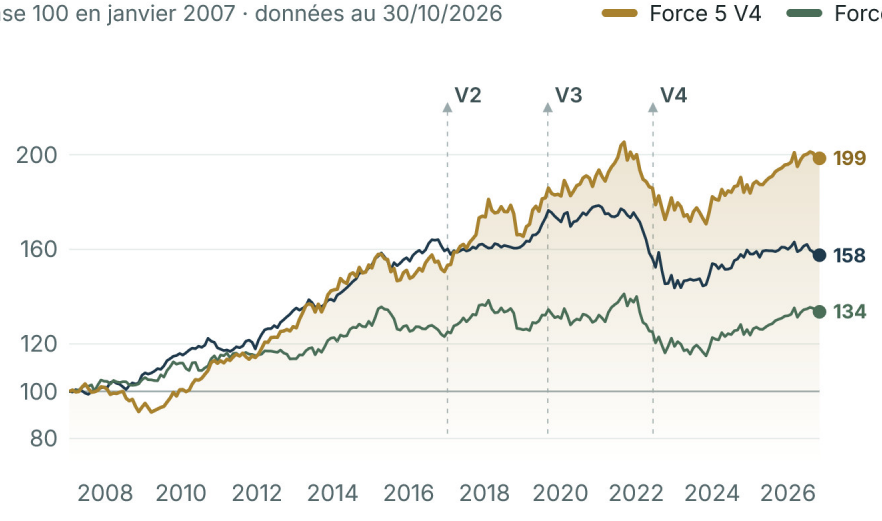
01
Actions en direct
Grandes capitalisations américaines et de la zone euro, en titres vifs.

02
Contrats à terme liquides
Futures sur les taux d'intérêt Europe / États-Unis / Japon et sur les indices boursiers en Asie. Ni devises, ni matières premières.

03
Trésorerie prudente
Les liquidités sont placées en instruments monétaires : bons du Trésor européens.

Le fonds depuis sa création

Base 100 en janvier 2007 · données au 30/10/2026



+98,6 %
Force 5 V4 depuis 2007 · indice +57,6 %

+33,7 %
Part I depuis 2007

+3,5 %
Rendement annualisé V4 · indice +2,3 %

5,8 %
Volatilité V4 · indice 4,4 %

Source : reporting mensuel, octobre 2026. V4 : performance recalculée avec la version 4 de la stratégie, en production depuis le 31 mai 2022.

Les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures. L'investisseur peut perdre tout ou partie du capital investi, les OPC n'étant pas garantis en capital.

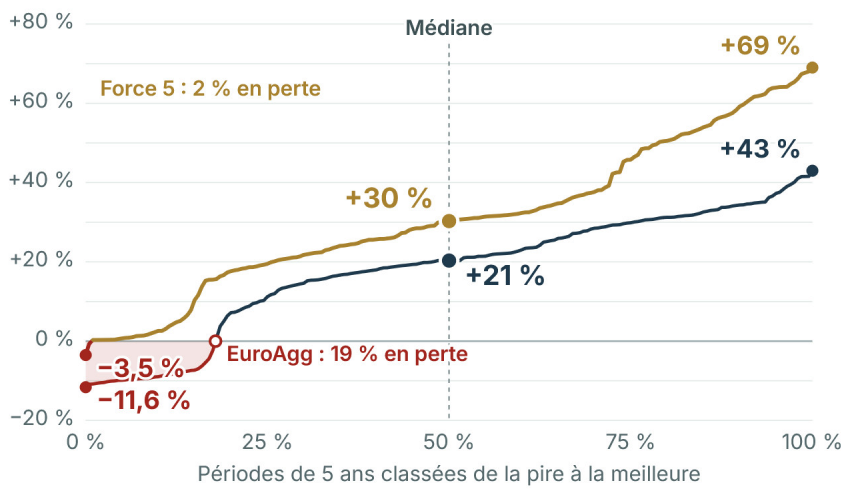
HORIZON D'ANALYSE : 5 ANS

+30 % de rendement médian à 5 ans.

Sur toutes les périodes glissantes de 5 ans depuis 2000, la stratégie a été positive dans 98 % des cas, contre 81 % pour les obligations européennes.

Performance sur 5 ans glissants

Distribution des rendements nets, de 2000 à septembre 2026



+30 %
Médiane à 5 ans · indice +21 %

98 %
Des périodes positives · indice 81 %

+69 %
Meilleure période 5 ans · indice +43 %

−3,5 %
Pire période 5 ans · indice −11,6 %

DANS UNE ALLOCATION

Un pilier central, résilient dans les cycles.

Corrélation positive en phase de hausse de marché, flexibilité lors des baisses grâce à une décorrélation adaptative : le fonds renforce la résilience du portefeuille en situation de marchés volatils.

PART I AU 30/10/2026

133,67 €
Valeur liquidative

+1,32 %
YTD · indice −1,58 %

Échelle de risque (AMF)

1	2	**3**	4	5	6	7

CARACTÉRISTIQUES

Forme juridique	**SICAV UCITS, Luxembourg**
Classification	**Diversifié flexible · SFDR art. 8**
Indice de référence	**€STR capitalisé**
Liquidité	**Quotidienne**
Devises	**EUR · USD · CHF**
Code Bloomberg (I)	**SVRAEIC**

Frais de gestion	**Part I 1 % · Part R 1,50 %**
Frais de performance	**10 % au-delà de l'€STR, HWM**
Souscription minimum	**I 1000 · R 100 (EUR, USD, CHF)**
Dépositaire	**Banque de Luxembourg**
Administrateur	**UI efa**
Auditeur	**Deloitte Audit**

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 professionnels. Performances V4 recalculées depuis 2007, simulées de 2000 à 2006. Les performances passées ne préjugent pas des performances futures ; capital non garanti.