OCTOBRE 2026
ISIN LU3134536427
Bloomberg SVLCRP3 LX

MOMENTUM SYSTÉMATIQUE · LONG ONLY · ALLOCATION RISK PARITY

Seven Long Cash Risk Parity 3 %

Pour rémunérer vos actifs à moyen terme, sur 2 à 3 ans, avec un risque faible : un objectif de rendement de 4 % par an pour une volatilité cible de 3 %, appuyé sur 30 ans de gestion momentum.

30 ans	3 %	4 %	2–3 ans
D'historique	Volatilité cible	Objectif de rendement	Horizon recommandé
Sur la stratégie momentum	Pilotée en continu	Annualisé, net de frais	Échelle de risque 3/7

NOTRE APPROCHE

Suivre les tendances, maîtriser le risque.

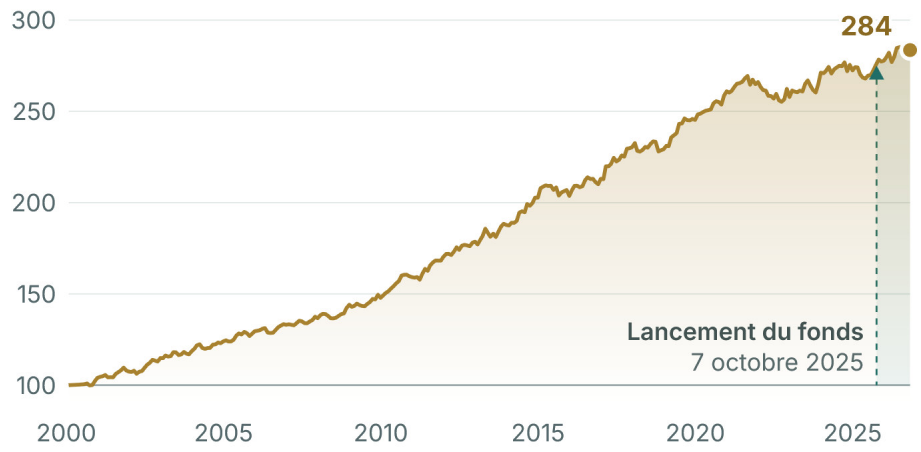
Le fonds repose sur un processus rigoureux, fondé sur l'analyse momentum des actifs financiers. L'allocation suit une méthodologie Risk Parity : chaque position contribue à parts égales au risque du portefeuille, et l'exposition s'ajuste dynamiquement pour optimiser le couple rendement/risque.

01
Marchés à terme liquides
Futures sur les taux d'intérêt Europe / États-Unis et sur les indices Europe / US / Asie. Ni devises, ni matières premières.

02
Trésorerie prudente
100 % des liquidités placées en instruments du marché monétaire : collatéral sécurisé et trésorerie optimisée.

03
100 % systématique
Algorithmes propriétaires appliqués avec discipline, identiques sur tous les marchés, sans discrétion du gérant.

La stratégie depuis 2000
Base 100 en janvier 2000 · performances nettes simulées jusqu'en octobre 2025, réelles ensuite



+3,95 %
Rendement annualisé

3,22 %
Volatilité annualisée

−5,25 %
Perte maximale

1,23
Ratio de Sharpe

Source : Seven Capital Management. Hypothèses : rémunération du monétaire 2 %, frais de gestion 1 %, delta +1 %.

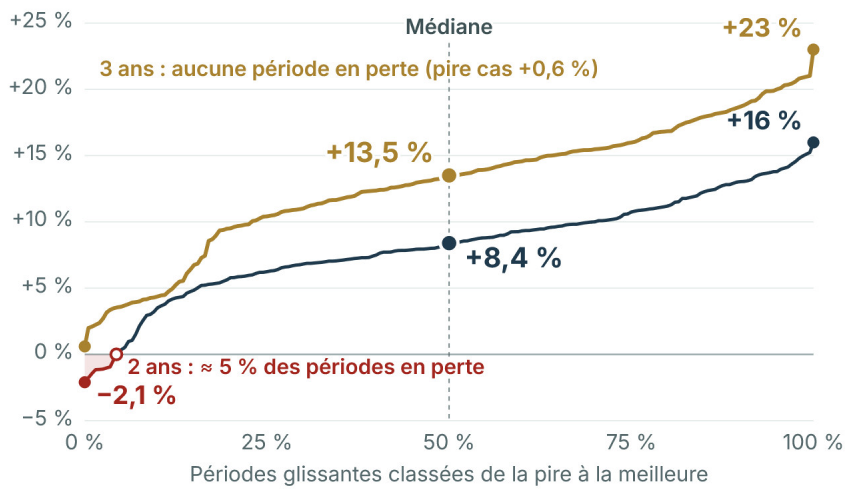
HORIZON RECOMMANDÉ : 2 À 3 ANS

+13,5% de rendement médian à 3 ans.

Le fonds expose à un risque de perte en capital. Les rendements sur toutes les périodes glissantes de 2 et 3 ans depuis 2000 en montrent le potentiel et les risques.

Rendements sur périodes glissantes

Distribution des rendements nets, de 2000 à octobre 2026



+13,5%
Médiane à 3 ans (rendement attendu)

+8,4%
Médiane à 2 ans (rendement attendu)

+23%
Meilleure période de 3 ans

+0,6%
Pire période de 3 ans

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.

LE FONDS AU 30/10/2026

101,27 €
Valeur liquidative

+1,24%
Depuis le 1er janvier 2026

Échelle de risque (AMF)

1	2	**3**	4	5	6	7

CARACTÉRISTIQUES

Forme juridique	**SICAV-FIAR (RAIF), Luxembourg**	Frais de gestion	**0,80 % maximum**
Code ISIN	**LU3134536427**	Frais de performance	**10 % au-delà de l'€STR, HWM**
Code Bloomberg	**SVLCRP3 LX**	Indice de référence	**€STR**
Devise · résultats	**EUR · Capitalisation**	Dépositaire	**Banque de Luxembourg**
Valorisation	**Quotidienne**	Administrateur	**UI efa**
Souscription minimum	**100 000 €**	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

Seven Capital Management · 39 rue Marbeuf, 75008 Paris · +33 1 42 33 04 50 · Agréée AMF n° GP-06000045 · www.seven-cm.com

Document d'information non contractuel, réservé aux investisseurs professionnels. Performances simulées de 2000 à octobre 2025, réelles ensuite. Les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures ; le capital n'est pas garanti. Prospectus disponible sur www.seven-cm.com.