OCTOBRE 2026

Part S · LU3325331422

Part I · LU3325331265

Part R · LU3325331349

Communication promotionnelle

MOMENTUM · ACTIONS ZONE EURO · GRANDES CAPITALISATIONS · COUVERTURE DYNAMIQUE

Seven αlpha βeta Equity Europe

Les grandes capitalisations de la zone euro, **protégées par une couverture dynamique et systématique**.
Se libérer du « timing » de la couverture. Liquidité quotidienne, UCITS, éligible au PEA.

30 ans

D'expertise momentum

Gestion de portefeuilles actions depuis 2007

UCITS

SICAV Luxembourgeoise

Art. 8 SFDR · Éligible PEA

0–60 %

Couverture dynamique

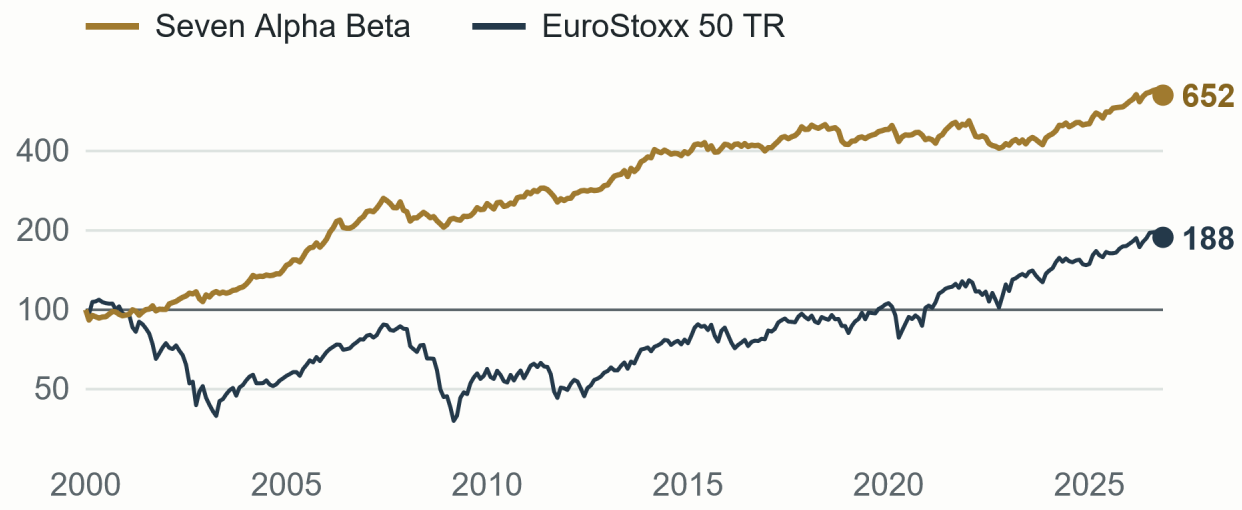
Via futures sur EuroStoxx 50

PERFORMANCE DEPUIS 2000

+7,2 % par an depuis 2000, contre +2,4 % pour l'indice.

Une stratégie performante, complémentaire des stratégies actions classiques.

Base 100 en janvier 2000, échelle logarithmique



Données mensuelles simulées avant le lancement du 1er juin 2026.

PERFORMANCE CUMULÉE

+552 %

EuroStoxx 50 TR : +88 %

	Fonds	Indice
Rendement / an	7,24 %	2,39 %
Volatilité	12,40 %	22,66 %
Perte maximale	−25,53 %	−69,17 %
Ratio de Sharpe	0,61	0,21

EN 10 POINTS CLÉS

Seven Alpha Beta Equity Europe en 10 points.

01 20 ans de track record robuste et éprouvé sur la sélection de titres large cap de la zone euro.

02 Gestion 100 % active sans contrainte sectorielle ou géographique et sans biais de style.

03 Gestion à 2/3 systématique et 1/3 quantitative, alliée à une couverture dynamique pilotée par nos algorithmes momentum.

04 Couverture systématique maîtrisée et appliquée avec succès par Seven Capital depuis plus de 30 ans.

05 Surperformance significative par rapport aux indices depuis le lancement de la stratégie actions.

06 Discipline et rigueur de l'approche momentum systématique pour la couverture.

07 Robustesse éprouvée à travers de nombreux cycles de marché depuis 2007.

08 Diversification par rapport aux styles de gestion active classiques.

09 Valorisation et liquidité quotidiennes.

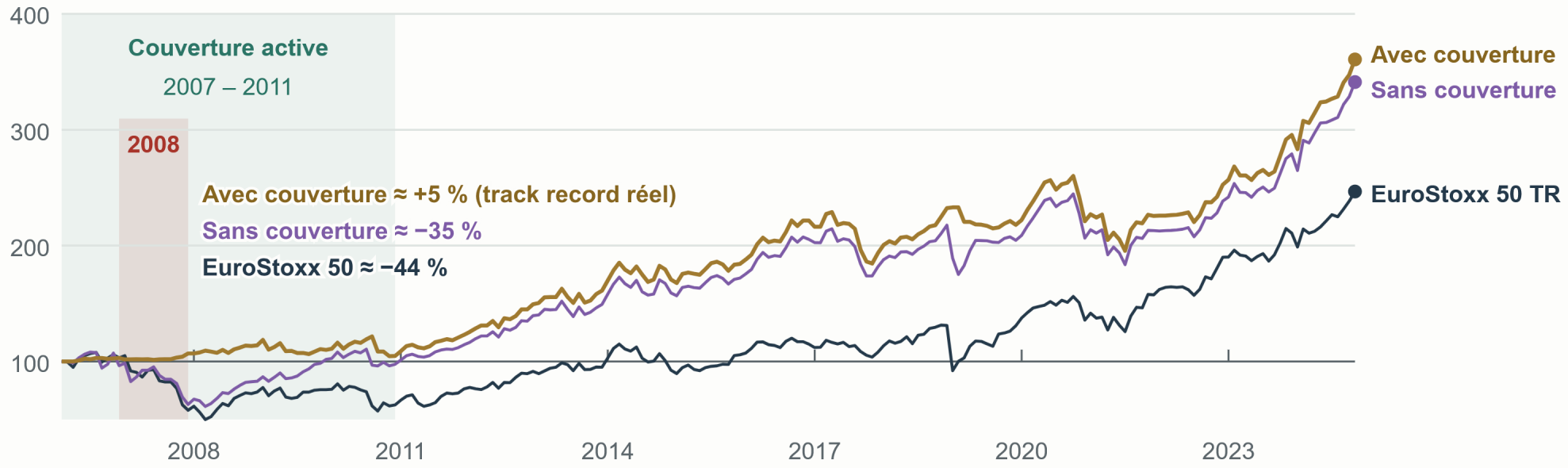
10 UCITS de droit luxembourgeois, Art. 8 SFDR, éligible au PEA.

UNE STRATÉGIE ÉPROUVÉE · SEVEN EUROPEAN EQUITY FUND

La couverture a déjà fait ses preuves, de 2007 à 2011.

Le Seven European Equity Fund a été couvert dynamiquement pendant la crise : l'écart créé ne s'est jamais refermé.

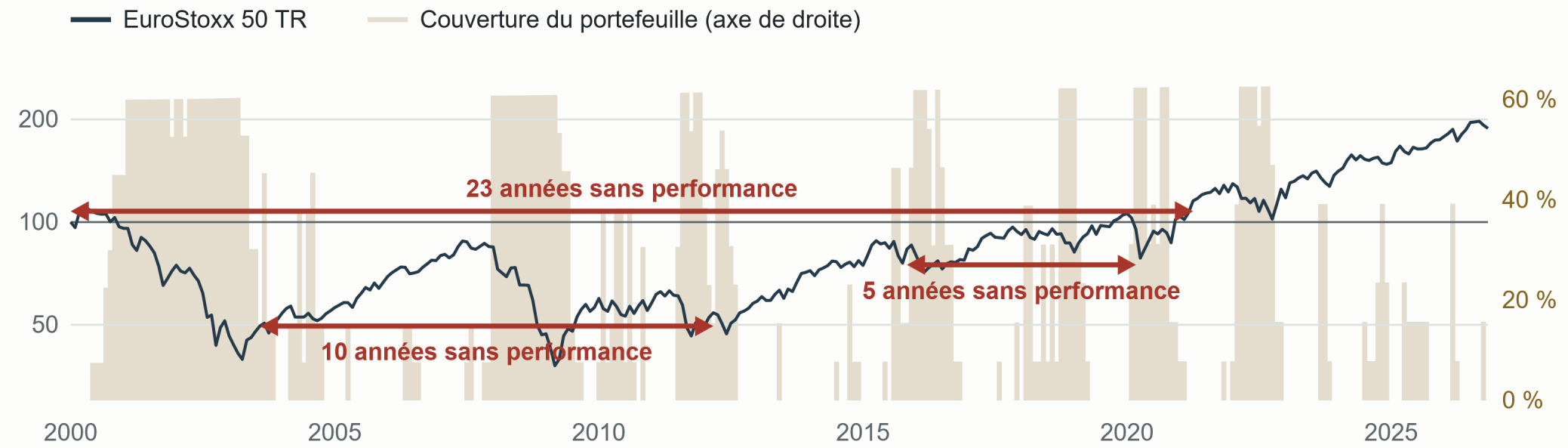
Seven European Equity, avec et sans couverture, face à l'EuroStoxx 50 TR · base 100 en février 2007



VOUS AVEZ DIT « MARKET TIMING » ?

Sur l'EuroStoxx 50, jusqu'à 23 ans sans performance.

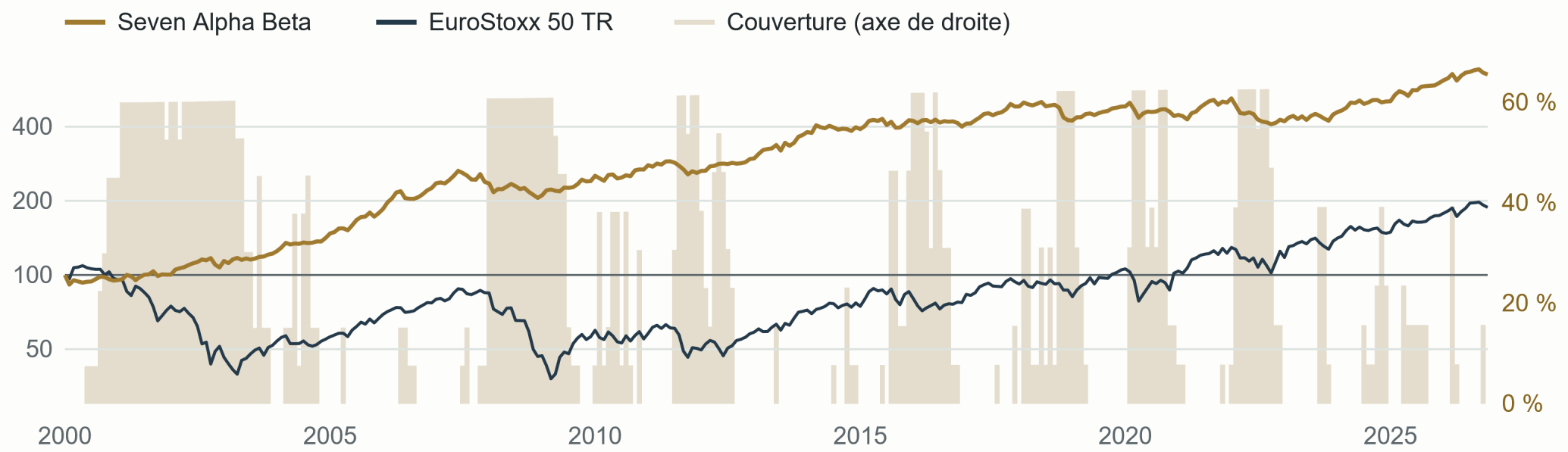
Plutôt que de deviner le bon moment, nos algorithmes momentum ajustent la couverture de 0 à 60 % au fil des tendances.



UNE COUVERTURE EFFICACE GRÂCE AU MOMENTUM

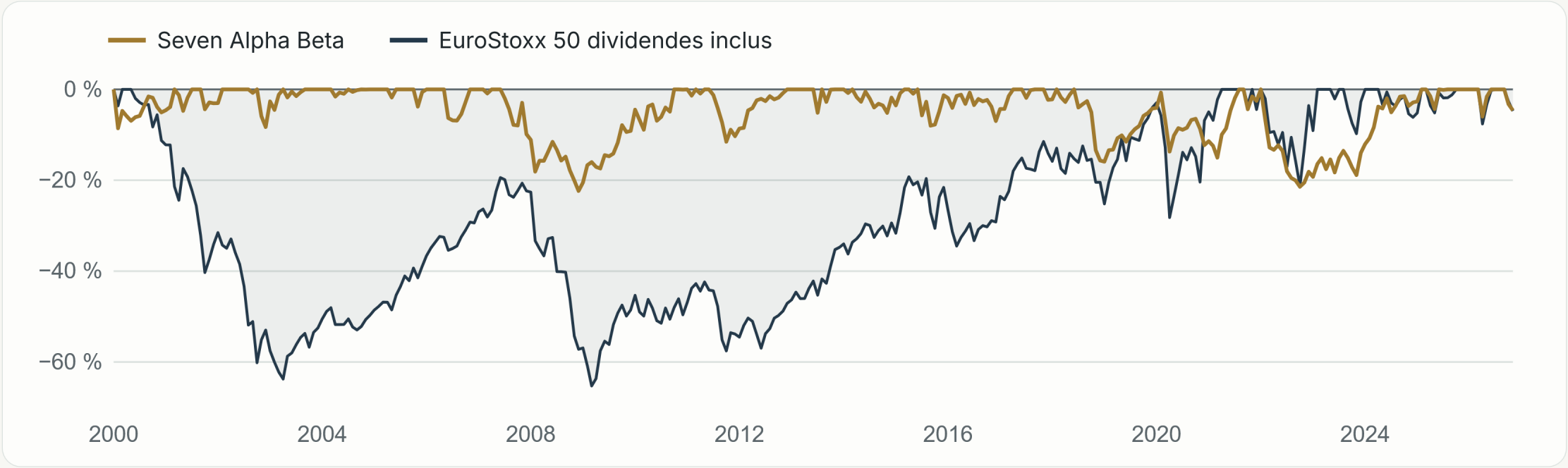
La couverture s’active dans les phases de baisse.

Seven Alpha Beta face à l’EuroStoxx 50 dividendes inclus, avec le niveau de couverture du portefeuille.



ÉVOLUTION COMPARATIVE DES REPLIS

Au pire −25,5 %, contre −69,2 % pour l'indice.



−25,5 %

Perte maximale · Alpha Beta

−69,2 %

Perte maximale · EuroStoxx 50

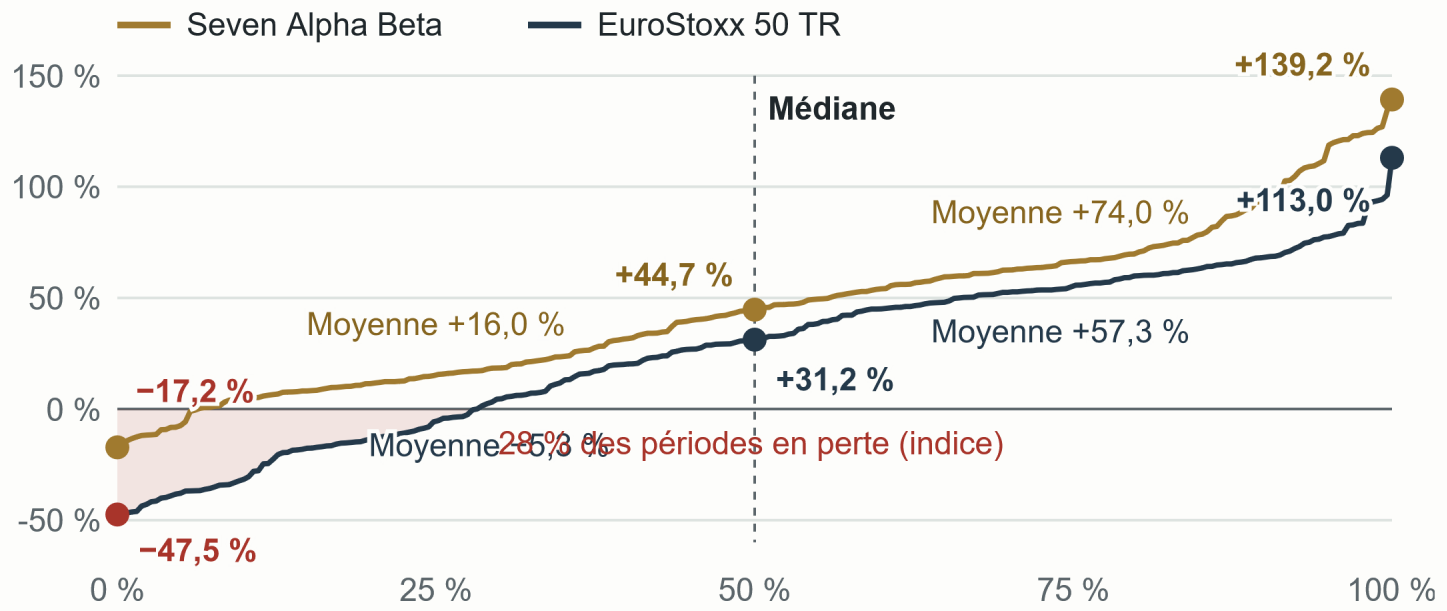
−22,3 % contre −65,3 %

Crise de 2008 – 2009, fin de mois

HORIZON 5 ANS

Sur 5 ans, une médiane de +45 % contre +31 %.

Périodes glissantes classées de la pire à la meilleure



Janvier 2000 – octobre 2026 · source : fichier de calcul Seven Capital Management.

+44,7 %

Médiane · indice +31,2 %

+139,2 %

Meilleure période · indice +113,0 %

−17,2 %

Pire période · indice −47,5 %

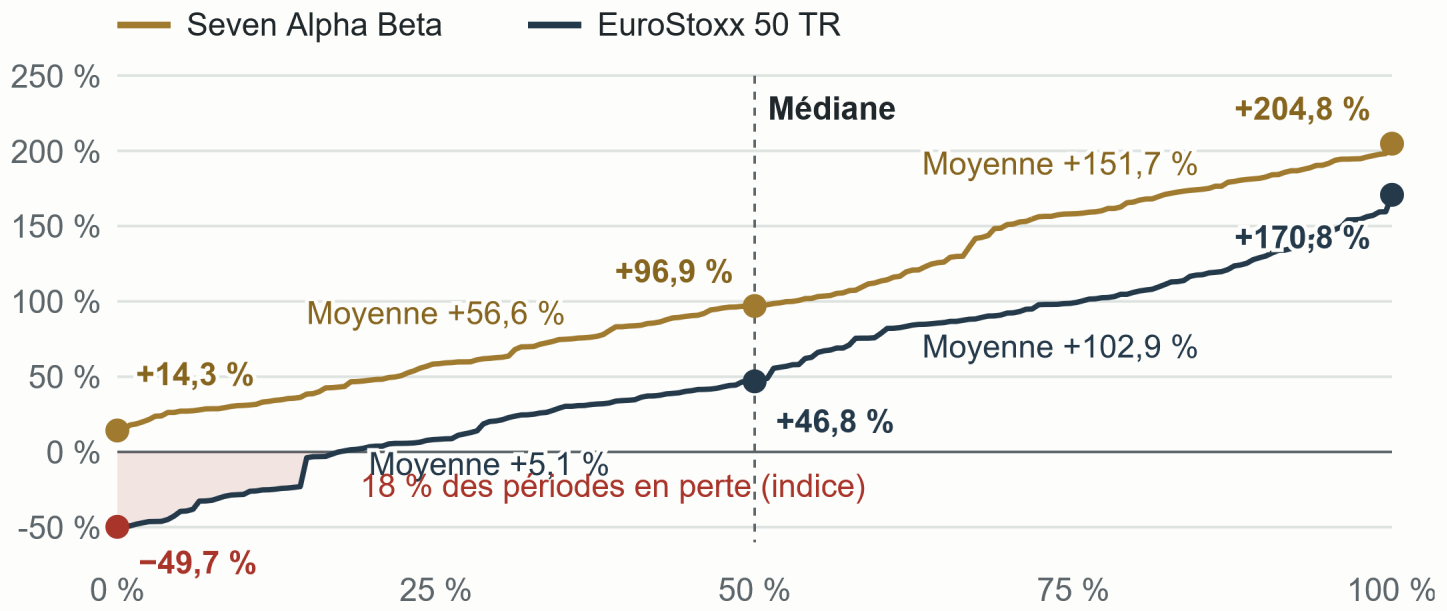
+16,0 % / +74,0 %

Moyennes des moitiés basse et haute · indice −5,3 % / +57,3 %

HORIZON 10 ANS

Au pire +14 % sur 10 ans, l'indice −50 %.

Périodes glissantes classées de la pire à la meilleure



Janvier 2000 – octobre 2026 · source : fichier de calcul Seven Capital Management.

+96,9 %

Médiane · indice +46,8 %

+204,8 %

Meilleure période · indice +170,8 %

+14,3 %

Pire période · indice −49,7 %

+56,6 % / +151,7 %

Moyennes des moitiés basse et haute · indice +5,1 % / +102,9 %

ALLOCATION DE CŒUR DE PORTEFEUILLE

Une exposition résiliente aux actions européennes.

01

Large exposition aux actions européennes

Portefeuille diversifié de grandes capitalisations de la zone euro, sans contrainte sectorielle.

02

Approche d'investissement équilibrée

Multi-stratégies (Momentum, Dividend Yield, Quantitatif micro), sans biais de style (Croissance / Value).

03

Couverture dynamique et systématique

Nos modèles momentum déclenchent la couverture progressive du portefeuille par le biais de futures sur EuroStoxx 50 quand le marché se détériore.

04

Transparence et liquidité

Transparence totale du portefeuille et liquidité quotidienne : actions de grandes capitalisations et contrats futures sur EuroStoxx 50.

05

Intégration ESG

Approche ESG « light green » non exclusive. Rapport annuel ESG indépendant.

06

Un fonds prêt pour l'investisseur

Compartiment dédié d'un UCITS luxembourgeois, Art. 8 SFDR, éligible au PEA.

UN PORTEFEUILLE, TROIS APPROCHES

Capter la hausse, amortir les baisses.

Le fonds investit dans les grandes capitalisations de la zone euro, sélectionnées par trois approches complémentaires.

QUANTITATIF SYSTÉMATIQUE · 70 %

QUANTITATIF MICRO · 30 %

01 — 35 %

Momentum

Les titres ayant le mieux performé tout en présentant un niveau de risque parmi les plus faibles.

02 — 35 %

Dividend Yield

Les titres délivrant de manière durable les dividendes les plus importants.

03 — 30 %

Quantitatif micro

Des critères exigeants : ROIC, endettement, marges, free cash flow, croissance des bénéfices.

SOUS-PORTEFEUILLES MOMENTUM ET DIVIDEND YIELD

Chaque mois, le top 10 est intégré pour 12 mois.

01

Univers d'investissement

Actions de la zone euro représentées dans l'indice Stoxx 600 échangeant plus de 10 M€ par jour avec un niveau de volatilité à 6 mois inférieur à 30 %.

02

Classement

Les titres sont classés selon nos critères propriétaires de momentum et de rendement du dividende ; les 10 premiers sont identifiés et retenus.

03

Rotation

Le top 10 du mois intègre chaque sous-portefeuille (Momentum et Dividend Yield) pour 12 mois ; les titres détenus depuis un an sont revendus.

1/12e de chaque sous-portefeuille est renouvelé chaque mois · top 10 du mois : 0,416 % par titre

JAN	FÉV	MAR	AVR	MAI	JUIN	JUIL	AOÛT	SEPT	OCT	NOV	DÉC
8,3 %	8,3 %	8,3 %	8,3 %	8,3 %	8,3 %	8,3 %	8,3 %	8,3 %	8,3 %	8,3 %	8,3 %

105	18	10	26,2 %
Positions au 30/10/2026	Secteurs	Pays	Poids du top 10

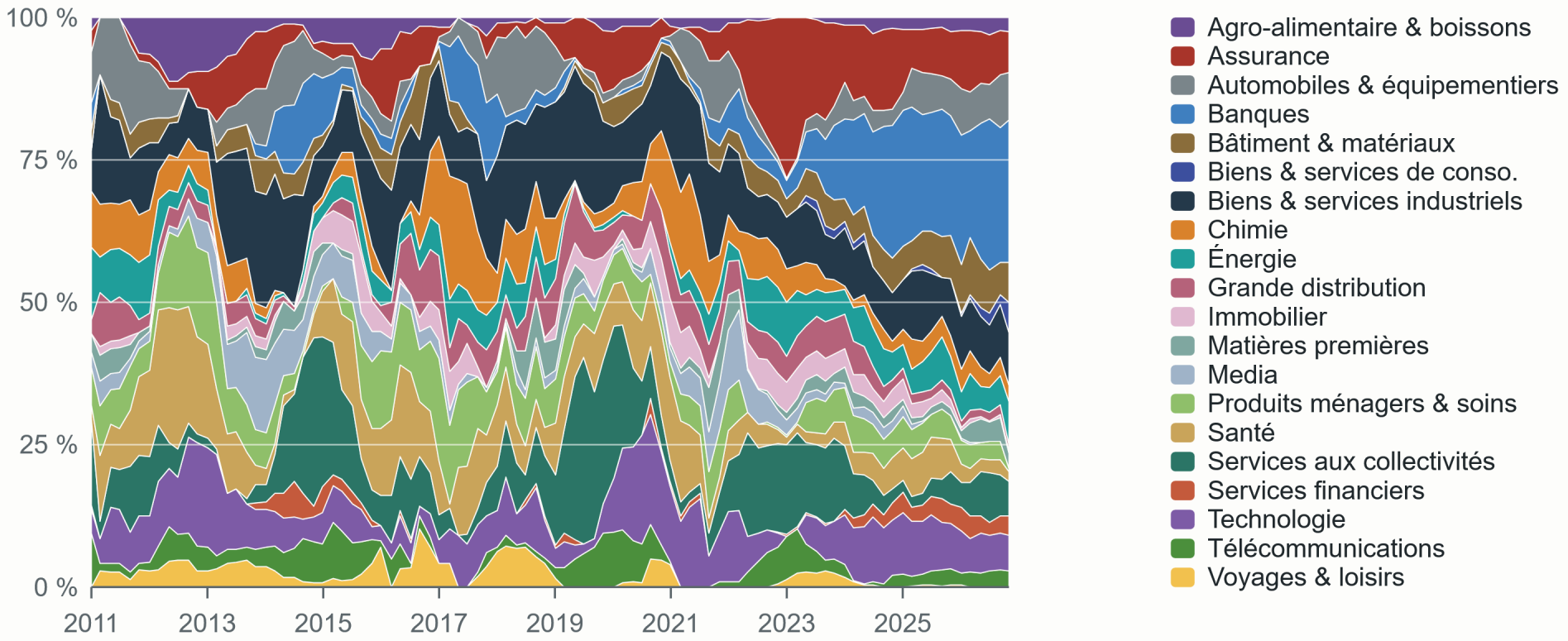
SOUS-PORTEFEUILLE QUANTITATIF MICRO · 30 %

Critères rigoureux pour sélectionner la qualité.

- ✓ ROIC
- ✓ Endettement / EBIT et endettement / capital
- ✓ Marge opérationnelle
- ✓ Ratio de liquidité
- ✓ Free cash flow
- ✓ ROE
- ✓ Croissance des revenus attendue
- ✓ Croissance passée des revenus
- ✓ Croissance passée des bénéfices

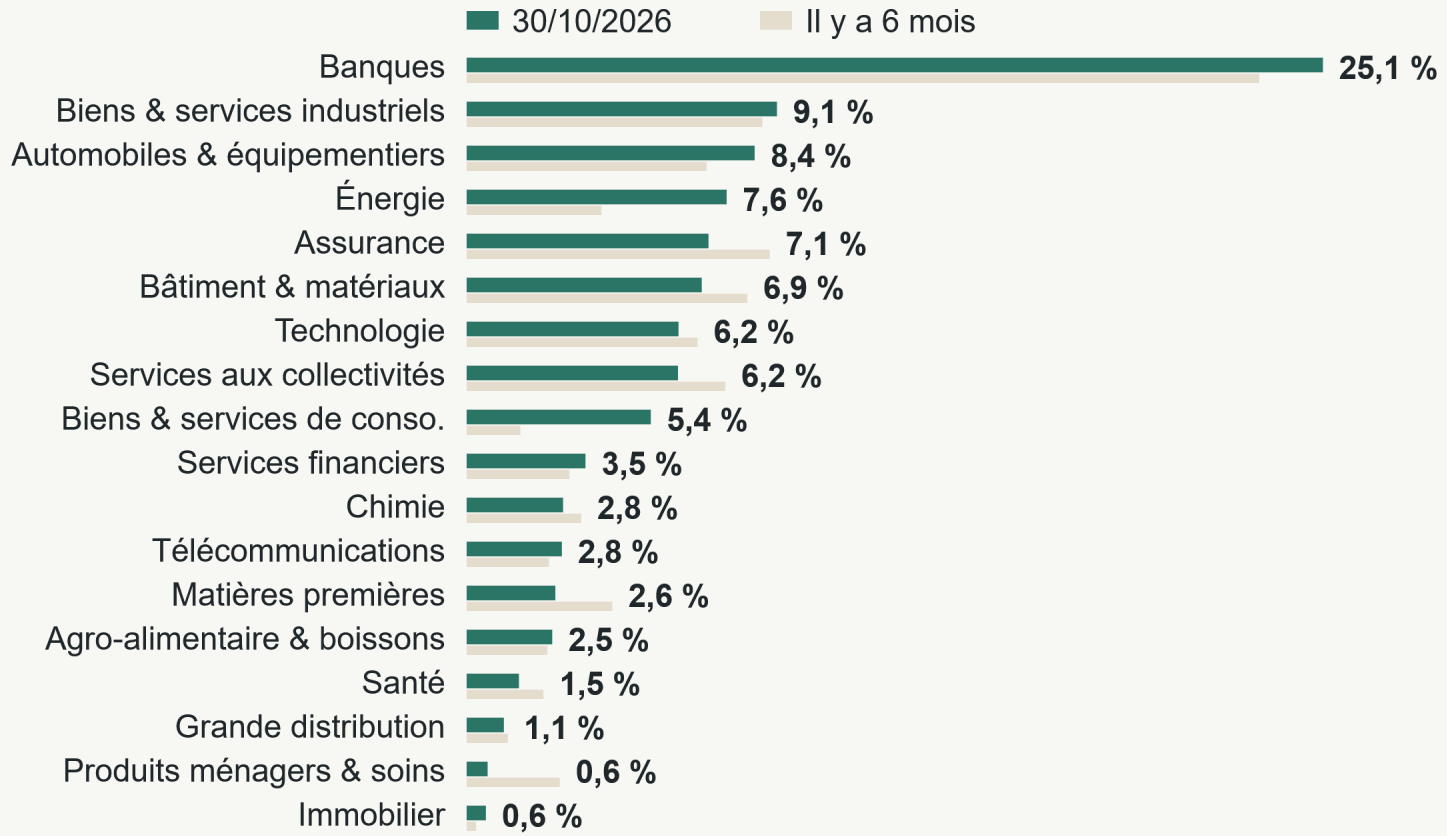
ÉVOLUTION HISTORIQUE DE L'ALLOCATION SECTORIELLE · 2011 – 2026

Rotation lente du portefeuille, allocation sectorielle dynamique.



RÉPARTITION SECTORIELLE AU 30/10/2026

Allocation sectorielle indépendante de l'indice.



CAPITALISATION MOYENNE

53,6 Md€

RÉPARTITION PAR CAPITALISATIONS

> 10 Md€	87,7 %
5 – 10 Md€	10,3 %
1 – 5 Md€	2,0 %
< 1 Md€	0,0 %

PRINCIPALES POSITIONS AU 30/10/2026

Les dix premières représentent 26,2 % du portefeuille.

	Société	Poids	Secteur	Pays	Cap. boursière (M€)
01	**Banco Bilbao Vizcaya Argentaria**	**4,00 %**	Banques	Espagne	125 372
02	**BMW**	**3,00 %**	Automobiles	Allemagne	36 579
03	**Mercedes-Benz Group**	**2,89 %**	Automobiles	Allemagne	39 946
04	**UniCredit**	**2,72 %**	Banques	Italie	115 494
05	**BAWAG Group**	**2,46 %**	Banques	Autriche	12 574
06	**BNP Paribas**	**2,36 %**	Banques	France	100 852
07	**Telefónica**	**2,24 %**	Télécommunications	Espagne	18 938
08	**Repsol**	**2,24 %**	Énergie	Espagne	32 623
09	**ACS Actividades**	**2,19 %**	Bâtiment & matériaux	Espagne	23 900
10	**Tenaris**	**2,09 %**	Énergie	Italie	26 493

Trois sous-portefeuilles, 105 titres au total.

MOMENTUM

63 titres

Cinq premiers poids du sous-portefeuille

ACS Actividades	**3,83 %**
Repsol	**3,59 %**
Wärtsilä	**3,46 %**
RWE	**3,42 %**
Tenaris	**3,36 %**

14 titres en commun avec Dividend Yield, 7 avec Quantitatif

DIVIDEND YIELD

27 titres

Cinq premiers poids du sous-portefeuille

BMW	**8,62 %**
Mercedes-Benz Group	**8,30 %**
UniCredit	**7,82 %**
BBVA	**7,01 %**
BNP Paribas	**6,78 %**

14 titres en commun avec Momentum, 1 avec Quantitatif

QUANTITATIF MICRO

36 titres

Cinq premiers poids du sous-portefeuille

Inditex	**3,63 %**
L'Oréal	**3,63 %**
Air Liquide	**3,52 %**
Anheuser-Busch InBev	**3,25 %**
Adidas	**3,25 %**

7 titres en commun avec Momentum, 1 avec Dividend Yield

CARACTÉRISTIQUES

Un UCITS luxembourgeois éligible au PEA.

Forme juridique	**SICAV UCITS, Luxembourg**
Classification	**Actions Europe · SFDR art. 8 · PEA**
Indice de référence	**EuroStoxx 50 Net Return**
Commission de performance	**15 % au-delà de l'indice**
Valorisation · devises	**Quotidienne · EUR, USD, CHF**
Dépositaire	**Banque de Luxembourg**
Administrateur · Auditeur	**UI efa · Deloitte Audit**

PAR PART	Part S	Part I	Part R
Code ISIN	**LU3325331422**	**LU3325331265**	**LU3325331349**
Frais de gestion	**0,50 %**	**1,00 %**	**1,50 %**
Souscription min.	**1 000 €**	**1 000 €**	**100 €**

Échelle de risque (AMF)
Horizon recommandé 5 ans

1 2 3 **4** 5 6 7

L'ÉQUIPE SEVEN CAPITAL À VOTRE DISPOSITION

Parlons de votre allocation actions.

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

SAS au capital de 560 000 € · Agréée AMF n° GP-06000045 · RCS B 491 390 464 · www.seven-cm.com

Les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures.

Le présent document a été créé par Seven Capital Management, une société de gestion agréée par l'Autorité des Marchés Financiers en France le 13 septembre 2006 (AMF, http://www.amf-france.org) en tant que société de gestion de portefeuilles sous le numéro GP-06000045 et dont le siège social est situé 39, rue Marbeuf - 75008 Paris, France.

Le présent document n'a été établi qu'à des fins d'information et ne constitue ni une offre, ni une recommandation personnalisée, ni une sollicitation en vue d'acheter les produits ou services présentés. L'investisseur sera le seul juge du caractère bien-fondé des transactions qu'il peut conclure.

Seven Capital Management ne saura être tenue responsable de toute décision d'investissement ou de désinvestissement prise sur la base des informations contenues dans le présent site. Les informations, services et produits présentés sont susceptibles d'être modifiés sans préavis.

La souscription de parts ou d'actions d'OPCVM peut présenter certains risques. Les OPCVM ne sont ni garantis ni protégés, leur valeur nette d'inventaire peut augmenter ou diminuer en fonction des fluctuations du marché et il est possible que les investisseurs ne récupèrent pas les sommes investies.

En outre, préalablement à toute transaction, les investisseurs doivent : se familiariser avec le document d'informations clés pour l'investisseur et le prospectus de chaque OPCVM, comprendre la nature de l'investissement sélectionné, ses caractéristiques et ses risques ; s'assurer que les investissements sélectionnés sont appropriés, qu'il s'agisse de leur situation financière, des objectifs d'investissement ou des risques que les investisseurs sont préparés à accepter.

Veuillez noter que les chiffres se réfèrent à des simulations des performances passées et les performances passées ne préjugent pas des performances futures. Par conséquent, les décisions d'investissement ne doivent pas se fonder essentiellement sur les performances passées : d'autres éléments, détaillés dans les fiches descriptives de chaque OPCVM, doivent être pris en compte. Les documents d'informations clés pour l'investisseur et les prospectus des OPCVM présentés peuvent être obtenus auprès de Seven Capital Management sur demande écrite à info@seven-cm.com, ou à partir du site Internet de la société, www.seven-cm.com.

Enfin, l'imposition à laquelle est soumis tout investissement dans des parts ou des actions d'OPCVM dépend de la situation personnelle de chaque investisseur. Il est par conséquent recommandé aux investisseurs de consulter leur conseiller fiscal. Document d'information sans valeur contractuelle.

Pour plus d'informations, le prospectus, en langues française et anglaise, et le DICI, en langues française, anglaise, allemande, espagnole et italienne, sont disponibles sur www.seven-cm.com. En Suisse, le Fonds a nommé comme représentant Waystone Fund Services (Switzerland) SA, Av. Villamont 17, 1005 Lausanne, Suisse, tél. +41 21 311 17 77, switzerland@waystone.com. Le service de paiement du Fonds en Suisse est la Helvetische Bank, Seefeldstrasse 215, 8008 Zürich, Suisse, tél. +41 44 204 56 00, info@helvetischebank.ch.