OCTOBRE 2026

Part I · LU1229132441

Part R · LU1229132797

Communication promotionnelle

STRATÉGIE RISK PARITY · GESTION MOMENTUM SYSTÉMATIQUE · LONG ONLY

Seven Force 5

Optimiser le rendement par une stratégie de **performance absolue à risque maîtrisé** : une allocation momentum long only sur les actions et les taux mondiaux, en parité de risque. Liquidité quotidienne.

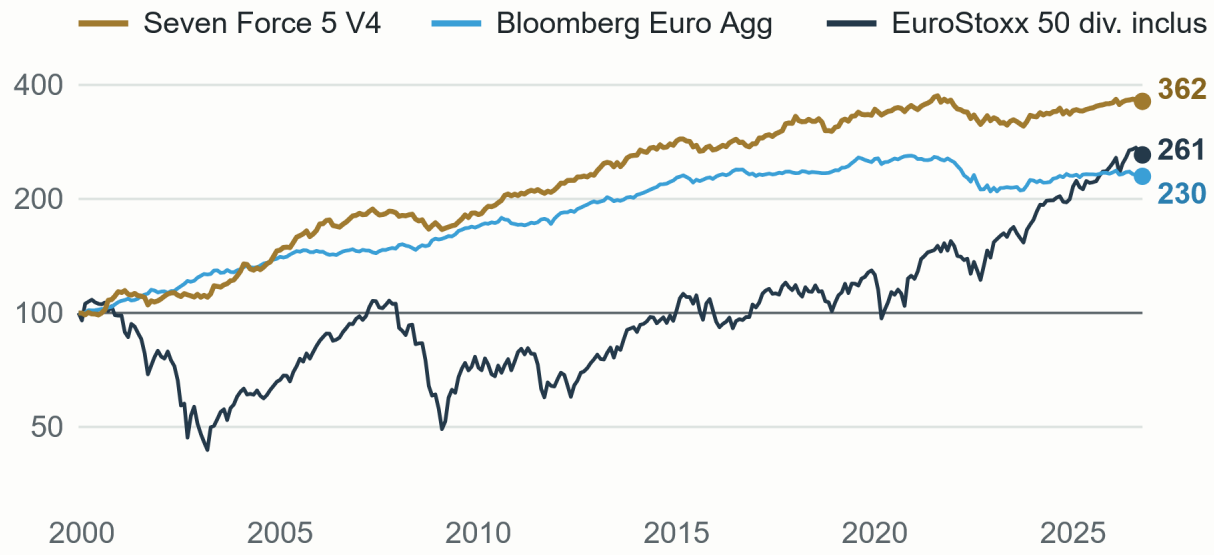
30 ans	**5 %**	**5 %**	**UCITS**
D'expertise momentum	Volatilité cible	Objectif de rendement	SICAV Luxembourgeoise
Track record de plus de 20 ans			Art. 8 SFDR

SEVEN FORCE 5 V4 DEPUIS 2000

+4,9 % par an depuis 2000, pour 5,6 % de volatilité.

Des rendements supérieurs aux actions et aux obligations européennes, avec une volatilité basse et contrôlée.

Base 100 en décembre 1999, échelle logarithmique



V4 recalculée depuis 2007, simulée de 2000 à 2006.

PERFORMANCE CUMULÉE

+262 %

Euro Agg : +130 % · EuroStoxx 50 : +161 %

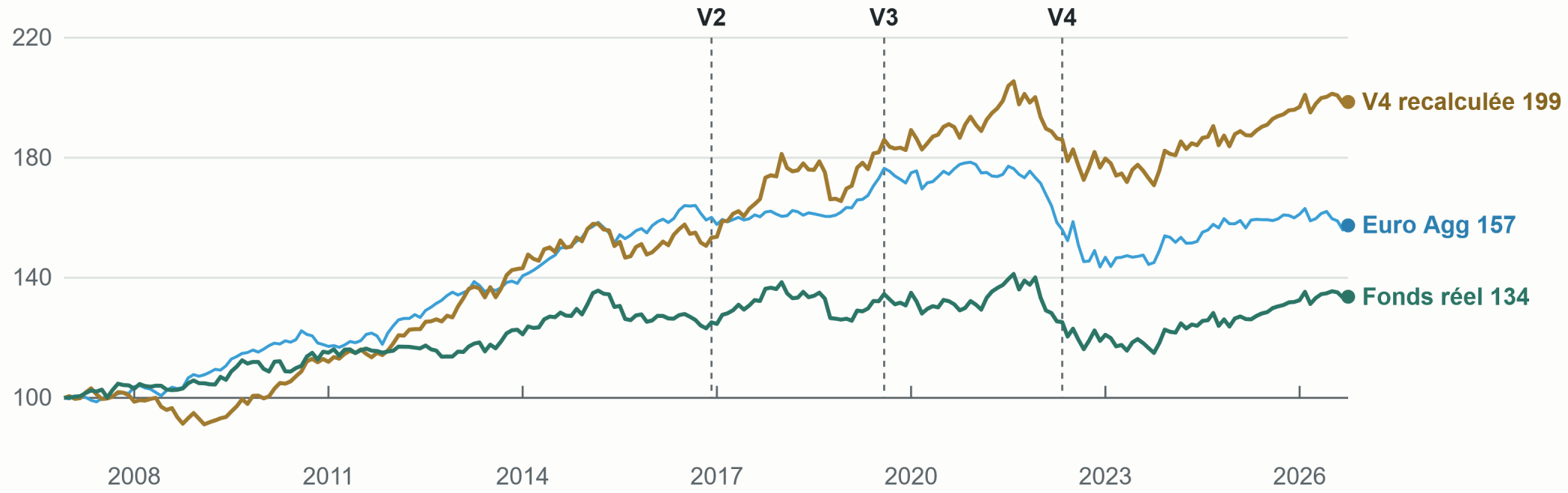
	SF5	Euro Agg	SX5T
Rendement*	4,85 %	3,07 %	3,69 %
Volatilité*	5,60 %	4,00 %	17,68 %
Perte max.	-16,85 %	-19,54 %	-59,90 %
Sharpe	0,87	0,77	0,21

(*) : Valeurs annualisées depuis 2000

HISTORIQUE DEPUIS LA CRÉATION · JANVIER 2007

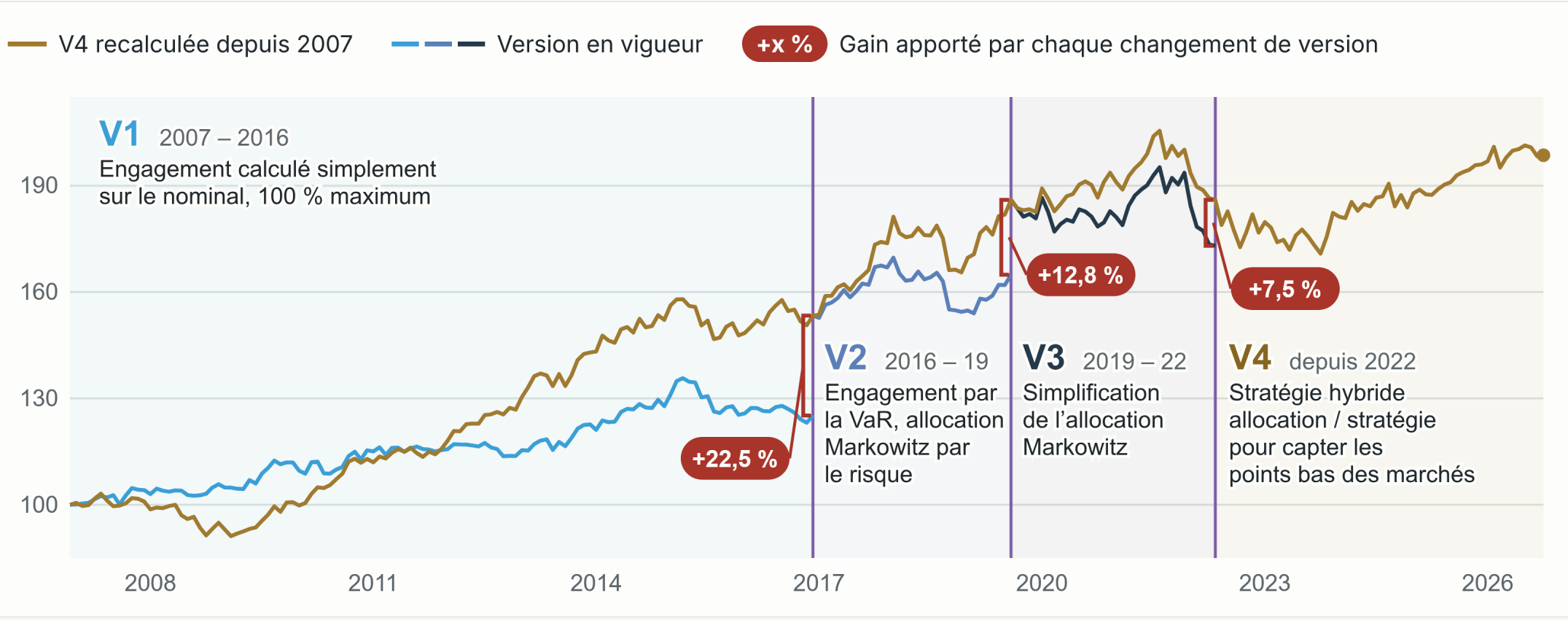
Une approche marquée par 4 évolutions depuis 2007

Le fonds réel (Part I) a progressé de +33,7 % ; la Version 4 ("V4"), appliquée sur toute la période, aurait fait +98,6 %.



ÉVOLUTION DEPUIS LE LANCEMENT · JANVIER 2007

Chaque nouvelle évolution a créé de la valeur.



POINTS CLÉS DE LA STRATÉGIE

Une performance absolue, à risque maîtrisé.

01
Optimisation du rendement
Allocation dynamique Cross-Assets pour surperformer à long terme le monétaire et l'obligataire.

02
Risque prédéterminé
L'objectif de volatilité est défini à l'avance et ajustable ; standard : 5 %.

03
Parité de risque
Chaque position contribue de manière équivalente à la volatilité cible du portefeuille.

04
Stratégie éprouvée
30 ans d'expertise de Seven Capital dans les stratégies momentum systématiques.

05
Long only
La stratégie ne retient que les signaux acheteurs.

06
Approche systématique
Gestion entièrement pilotée par des algorithmes propriétaires.

07
Large diversification
Marchés mondiaux de taux et d'actions.

08
Liquidité et transparence
Portefeuille entièrement liquide et transparent.

09
Track record de plus de 20 ans
Plusieurs cycles de marché traversés depuis 2007.

PROCESSUS D'INVESTISSEMENT · UNIVERS

Des sources de rendement liquides et diversifiées.

LIQUIDITÉS DU PORTEFEUILLE

Instruments monétaires : bons du Trésor européens

Les expositions en devises sont entièrement couvertes.

Taux Europe	Taux US	Actions Europe	Actions US	Actions Asie
Futures	**Futures**	**Titres vifs**	**Titres vifs**	**Futures**
• Bobl • Bund	• T-Note 5 ans • T-Note 10 ans • T-Bond	• Grandes capitalisations • Zone euro	• Grandes capitalisations • S&P 500	• Japon • Taïwan • Singapour • Inde • Hong Kong

PROCESSUS D'INVESTISSEMENT · VUE D'ENSEMBLE

Quatre principes fondamentaux.

01

Liquidité

- Grandes capitalisations US et zone euro : titres vifs
- Courbes de taux EUR / US : futures
- Indices actions et taux Asie : futures
- Monétaire : bons du Trésor EUR

02

Flexibilité

- Portefeuille Cross-Assets
- Gestion active des expositions

03

Momentum

- Moyen et long terme
- Piloté par le rapport prix / risque

04

Approche systématique

- Rigueur et discipline
- Pas d'émotions, pas de biais

CONSTRUCTION DU PORTEFEUILLE

Trois étapes pour construire le portefeuille.

ÉTAPE 1

Allocation théorique maximale

Fonction du niveau de volatilité et des reculs potentiels

Actions 0 – 105 %

- Titres vifs US → **45 % max**
- Titres vifs européens → **45 % max**
- Futures Asie → **15 % max**

Taux 0 – 150 %

ÉTAPE 2

Positionnement du portefeuille

Fonction des indicateurs macro et techniques

Price momentum

« À moins que des forces extérieures ne s'exercent, la tendance d'un actif devrait rester la même. »

Risk momentum

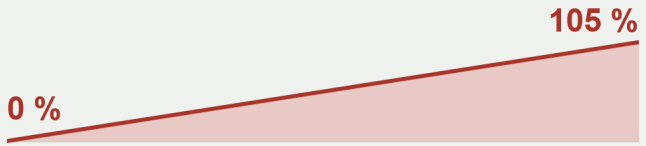
Une volatilité élevée accompagne un marché baissier, et inversement.

ÉTAPE 3

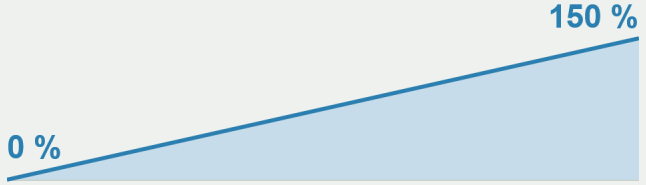
Allocation finale

Flexibilité totale : exposition nette nulle si le marché l'exige

Actions



Taux

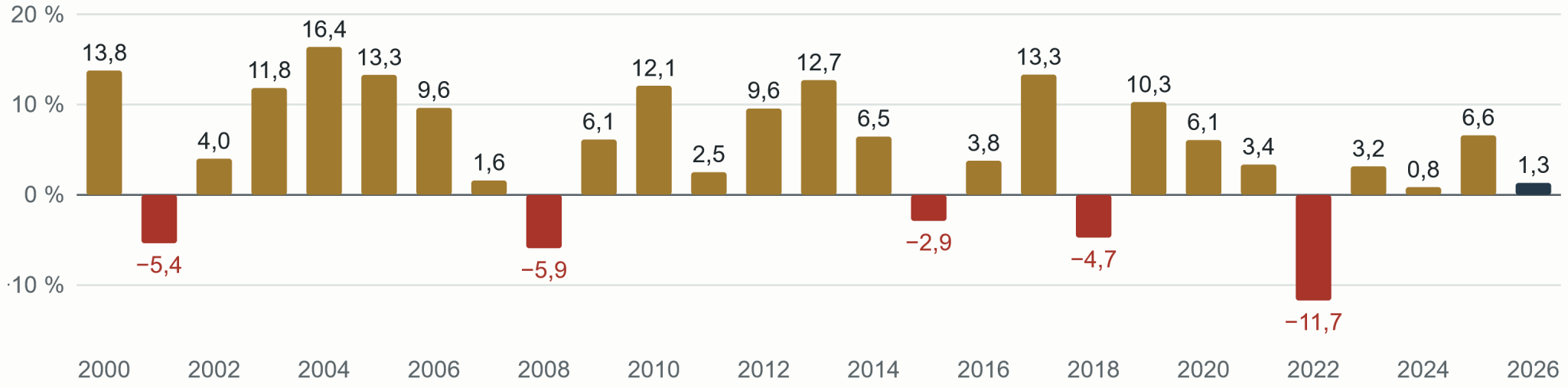


RENDEMENTS ANNUELS DEPUIS 2000

22 années positives sur 27.

Pire année : −11,7 % en 2022 · Meilleure année : +16,4 % en 2004 · Année en cours : Rendement YTD

Seven Force 5 V4, performance par année civile, en %

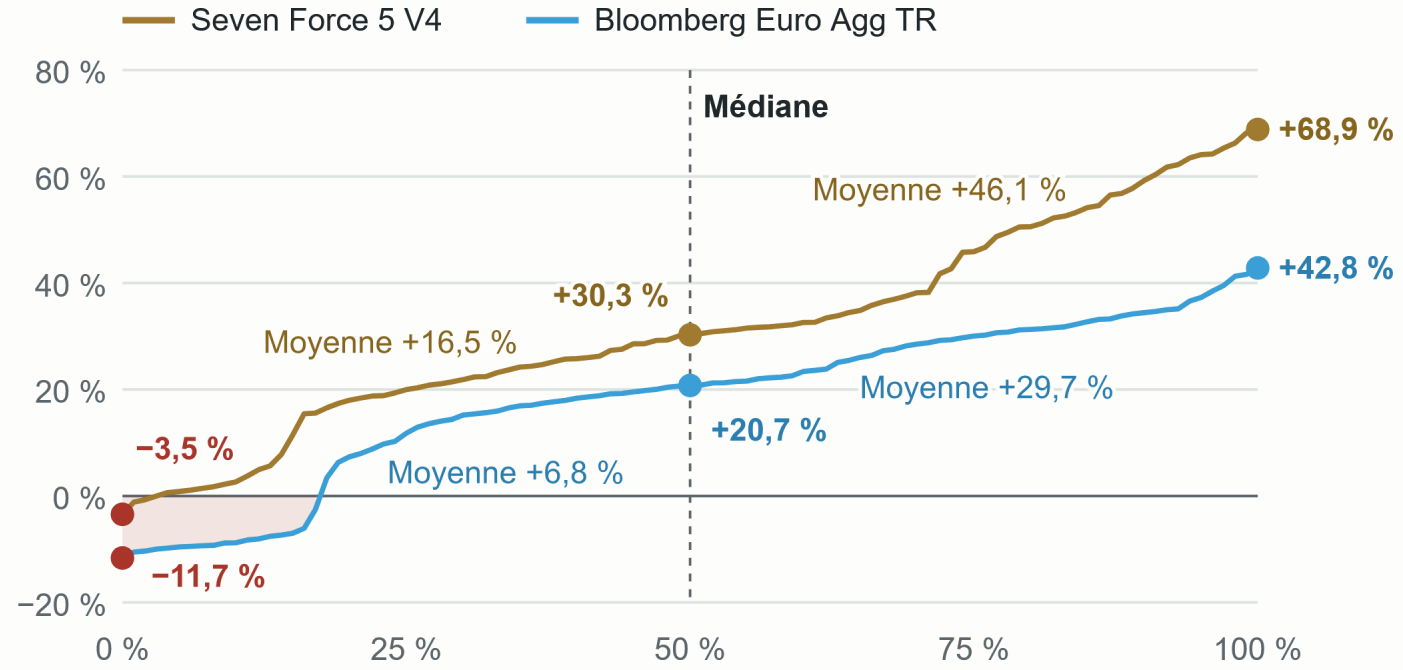


V4 recalculée depuis 2007, simulée de 2000 à 2006.

RENDEMENTS GLISSANTS SUR 5 ANS

Rendement médian +30 %, contre +21 % Euro Agg.

Performances sur 5 ans glissants, de la pire à la meilleure



Décembre 1999 – octobre 2026.

+30,3 %
Médiane · Euro Agg +20,7 %

+68,9 %
Meilleure période · Euro Agg +42,8 %

−3,5 %
Pire période · Euro Agg −11,7 %

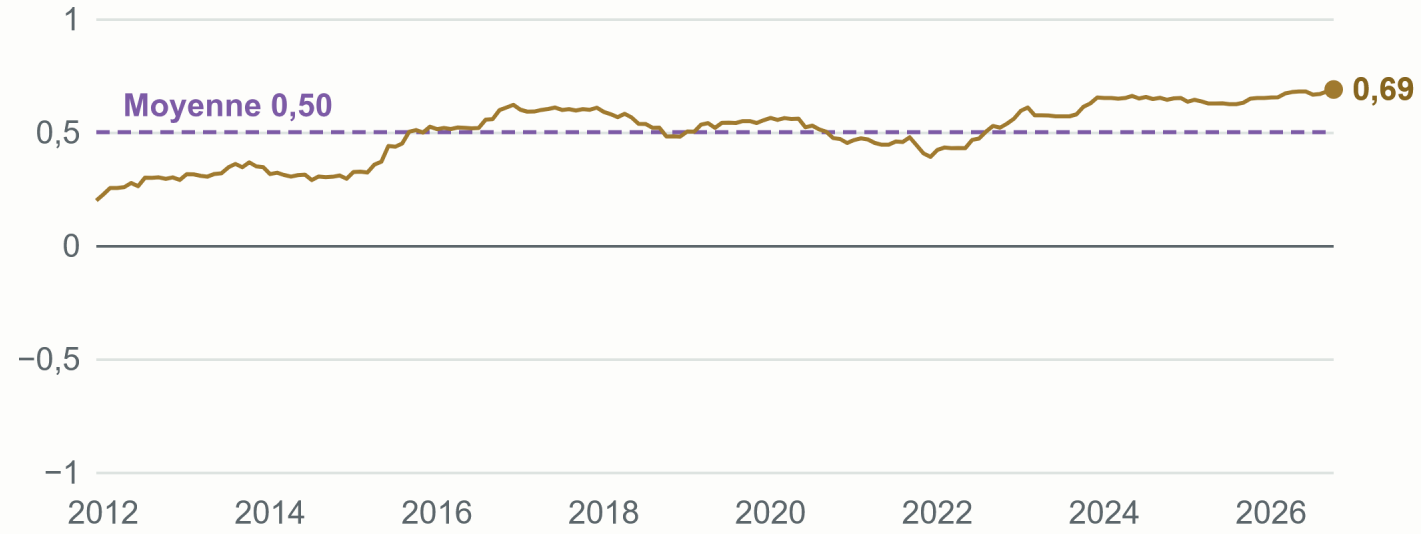
3 %
Périodes négatives · SF5

18 %
Périodes négatives · Euro Agg

FACE À L'OBLIGATAIRE · BLOOMBERG EURO AGG TR

Une corrélation de 0,5 en moyenne sur 5 ans.

Corrélation sur 5 ans glissants avec le Bloomberg Euro Agg TR



Fenêtres de 5 ans glissants, décembre 2011 – octobre 2026.

0,50
Corrélation moyenne sur 5 ans

0,69
Corrélation à fin octobre 2026

0,20
Corrélation minimale · déc. 2011

0,69
Corrélation maximale · oct. 2026

SEVEN FORCE 5 V4 · PERFORMANCES AU 30/10/2026

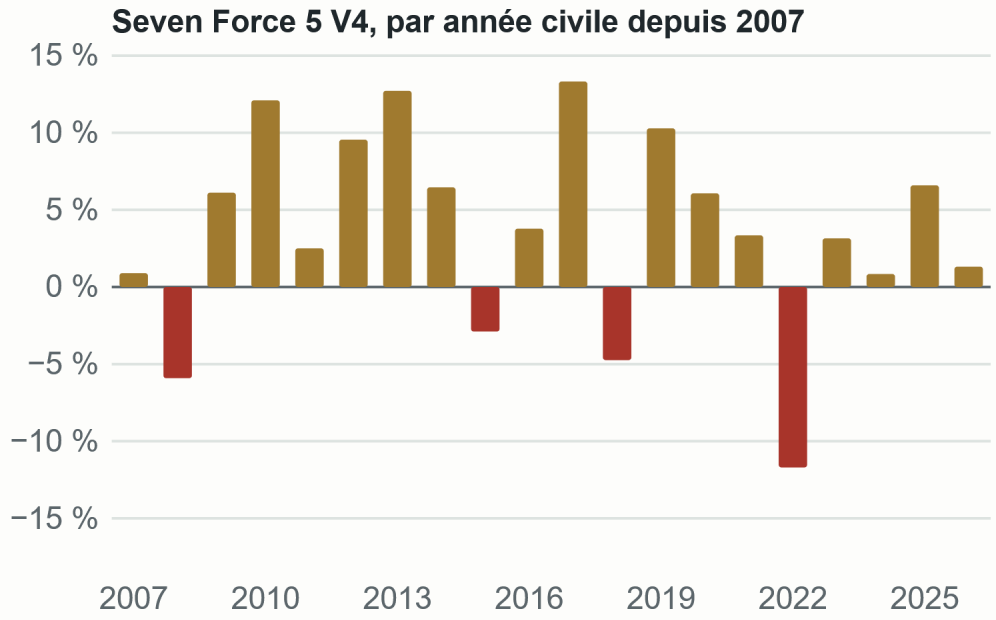
Des rendements robustes vs l'obligataire.

VL PART I · 30/10/2026

133,67 €

Encours du fonds 57,2 M€
Stratégie Risk Parity 67,3 M€

FORCE 5 V4	V4	Euro Agg
1 mois	+0,16 %	+0,96 %
Depuis le 1er janvier	+1,32 %	-1,58 %
1 an	+2,11 %	-2,14 %
3 ans	+16,23 %	+8,55 %
5 ans	-1,31 %	-9,17 %
Depuis la création (22/01/2007)	+98,57 %	+57,46 %
3 ans annualisé	+5,14 %	+2,77 %
Depuis la création, annualisé	+3,52 %	+2,32 %



CARACTÉRISTIQUES

Un UCITS luxembourgeois à liquidité quotidienne.

Forme juridique	**SICAV UCITS, Luxembourg**
Classification	**Diversifié flexible · SFDR art. 8**
Objectif	**Performance absolue · volatilité 5 %**
Indice de référence	**€STR capitalisé**
Commission de performance	**10 % au-delà de l'€STR · HWM**
Valorisation · devises	**Quotidienne · EUR, USD, CHF**
Dépositaire	**Banque de Luxembourg**
Administrateur · auditeur	**UI efa · Deloitte Audit**

PAR PART	Part I	Part R
Code ISIN	**LU1229132441**	**LU1229132797**
Frais de gestion max.	**1,00 %**	**1,50 %**
Souscription min. (EUR, USD, CHF)	**1 000**	**100**
Code Bloomberg	**SVRAEIC LX**	**SVRAERC LX**

Échelle de risque (AMF)
Durée minimale recommandée 3 ans

1 2 **3** 4 5 6 7

L'ÉQUIPE SEVEN CAPITAL À VOTRE DISPOSITION

Parlons de votre allocation.

Johann Schwimann
jschwimann@seven-cm.com

Renaud Labbé
rlabbe@seven-cm.com

Nathalie Alovisetti
nalovisetti@seven-cm.com

Nicolas Kochnitzky
nk@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.