OCTOBRE 2026

ISIN · LU3134536427

Bloomberg · SVLCRP3 LX

Stratégie Risk Parity · Approche Momentum · Taux & Actions Monde

Seven Long Cash Risk Parity 3 %

Une stratégie Risk Parity proposant une allocation flexible globale et long only reposant sur une approche momentum. La stratégie optimise le couple rendement/risque et vise un niveau de volatilité cible de 3 % pour un rendement de + 4 %.

30 ans
D'expertise momentum
Algorithmes propriétaires

3 %
Volatilité cible

4 %
Objectif de rendement
Annuel, non garanti

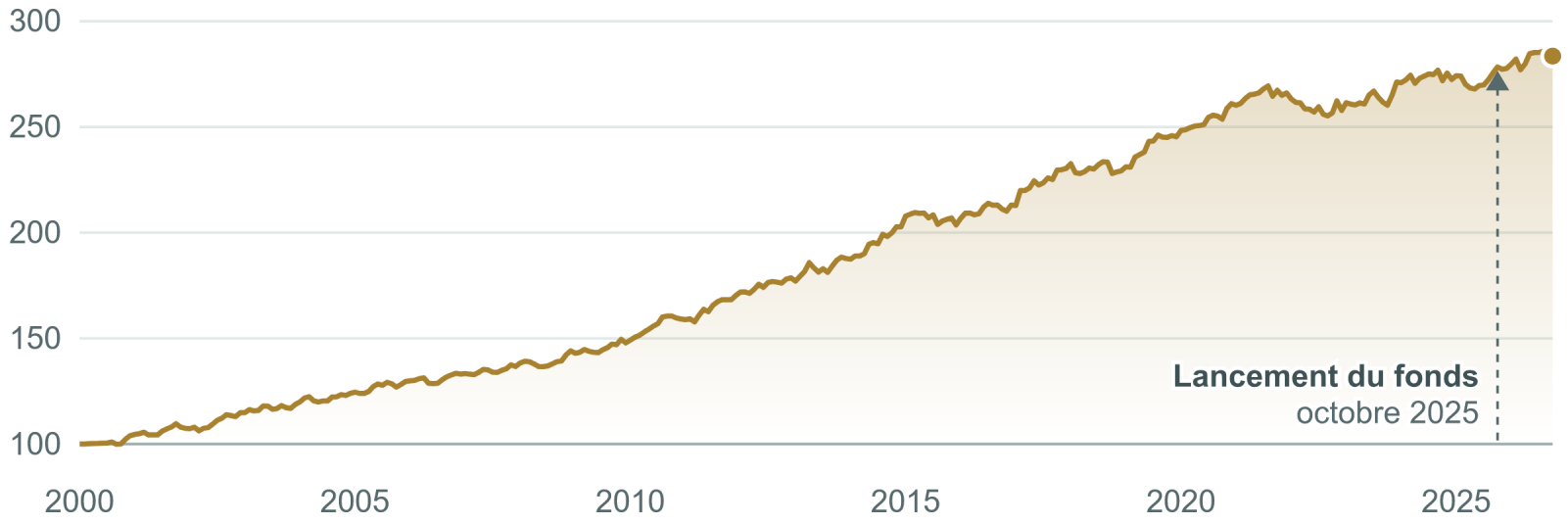
FIAR
SICAV luxembourgeoise
Liquidité quotidienne

PERFORMANCE DEPUIS 2000

Un rendement de 4 % par an, pour 3 % de volatilité.

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

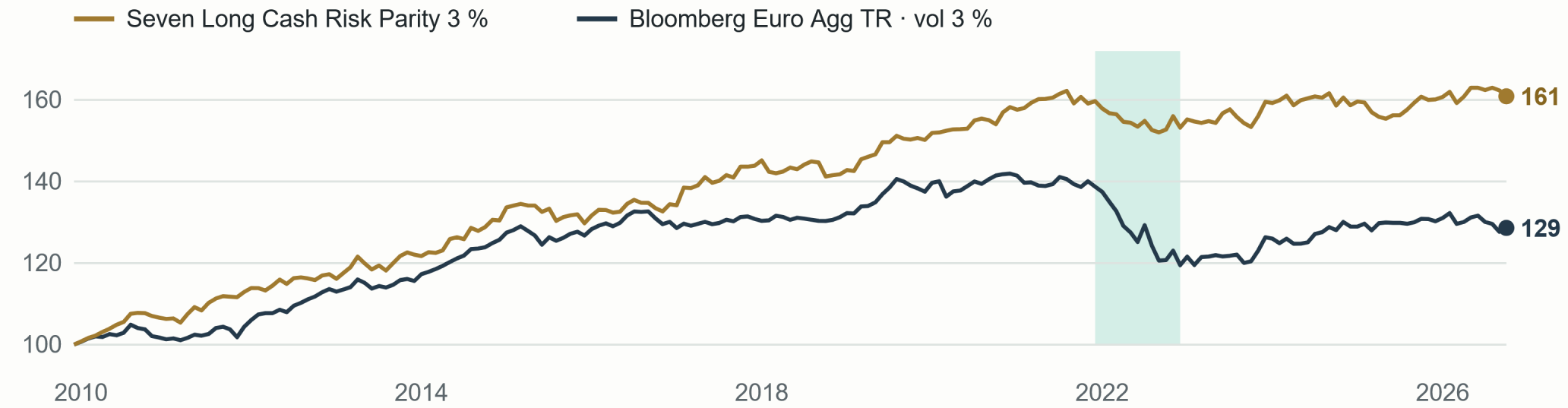
Source : Seven Capital Management. Hypothèses : monétaire rémunéré à 2 %, frais de gestion 1 %, delta +1 %.

FACE À L'OBLIGATAIRE · BLOOMBERG EURO AGG TR

Un complément à l'obligataire, à risque égal.

Comparée à l'indice ajusté à une volatilité de 3 %, la stratégie a mieux traversé la remontée des taux de 2022.

Base 100 en décembre 2009, données mensuelles



Décembre 2009 – octobre 2026 · indice ramené à 3 % de volatilité.

UNIVERS D'INVESTISSEMENT

100 % de monétaire, 22 contrats à terme.

ACTIFS EN PORTEFEUILLE

100 %

Monétaire

Exposition via les marchés à terme · Liquidité journalière

Taux Europe	Taux US	Actions Europe	Actions US	Actions Asie
Futures	**Futures**	**Futures**	**Futures**	**Futures**
• Euribor	• Eurodollar	• Euro Stoxx 50	• Dow Jones mini	• Nikkei
• Schatz	• T-Note 2 ans	• CAC 40	• S&P 500 mini	• Taïwan
• Bobl	• T-Note 5 ans	• DAX	• Nasdaq mini	• Singapour
• Bund	• T-Note 10 ans	• FTSE 100		• Hong Kong
	• T-Bond	• AEX		
		• IBEX 35		

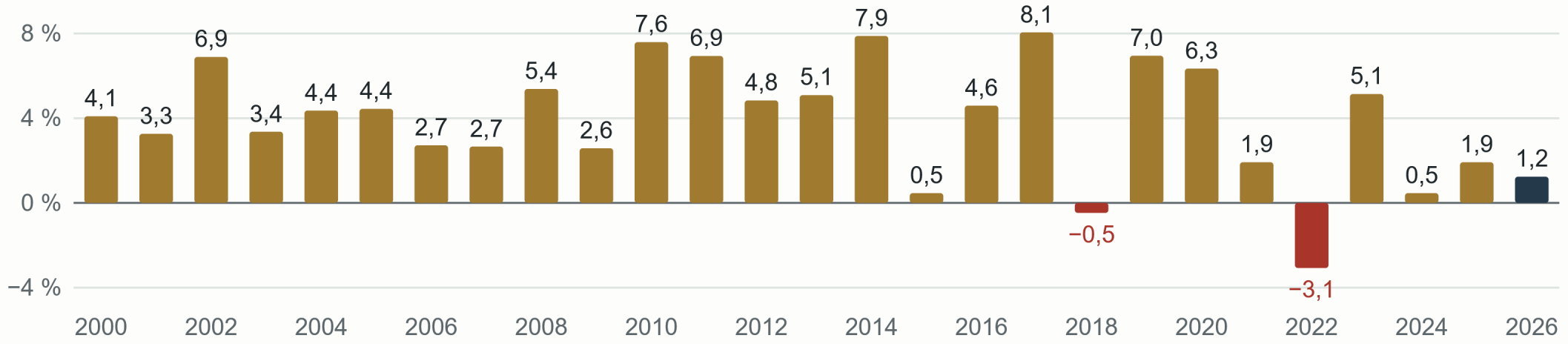
(liste non exhaustive)

PERFORMANCES ANNUELLES

25 années positives sur 27.

Pire année : −3,1 % en 2022 · Meilleure année : +8,1 % en 2017 · Année en cours : Rendement YTD

Performance nette par année civile, en %

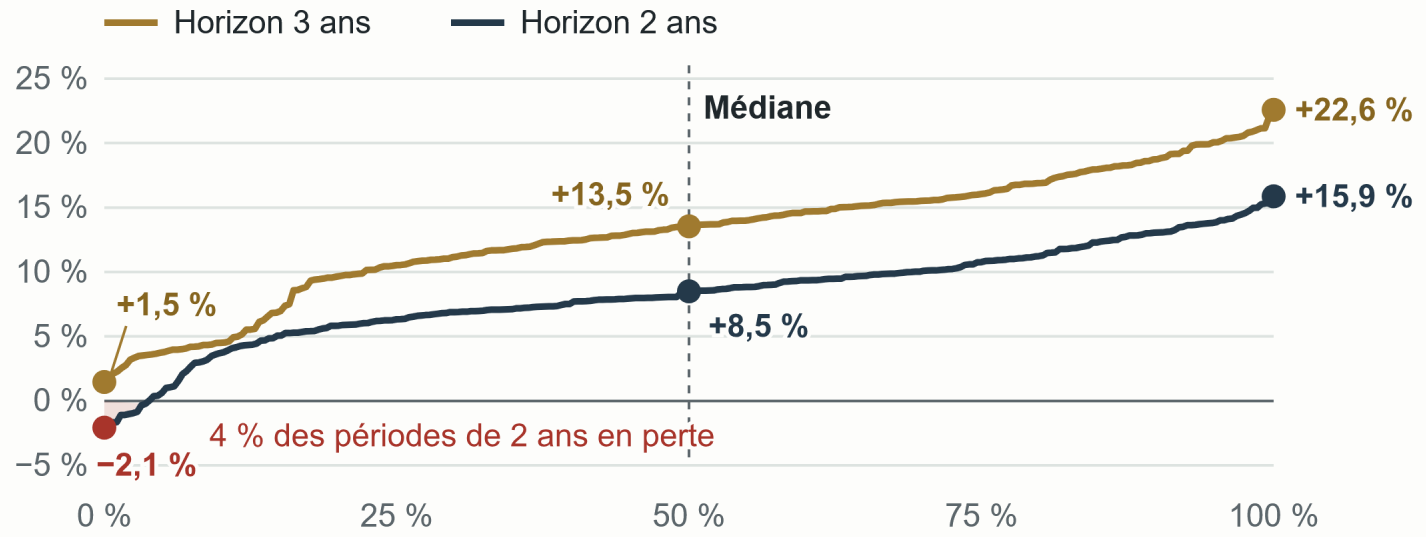


Données simulées jusqu'en octobre 2025, réelles ensuite. Monétaire 2 %, frais de gestion 1 %, delta +1 %.

PERFORMANCES GLISSANTES · 2 ET 3 ANS

Sur 3 ans, aucune période en perte depuis 2000.

Périodes glissantes classées de la pire à la meilleure



Toutes les périodes glissantes de janvier 2000 à octobre 2026, performances nettes.

+13,5 %
Médiane à 3 ans
moyenne de la moitié haute +16,7 %

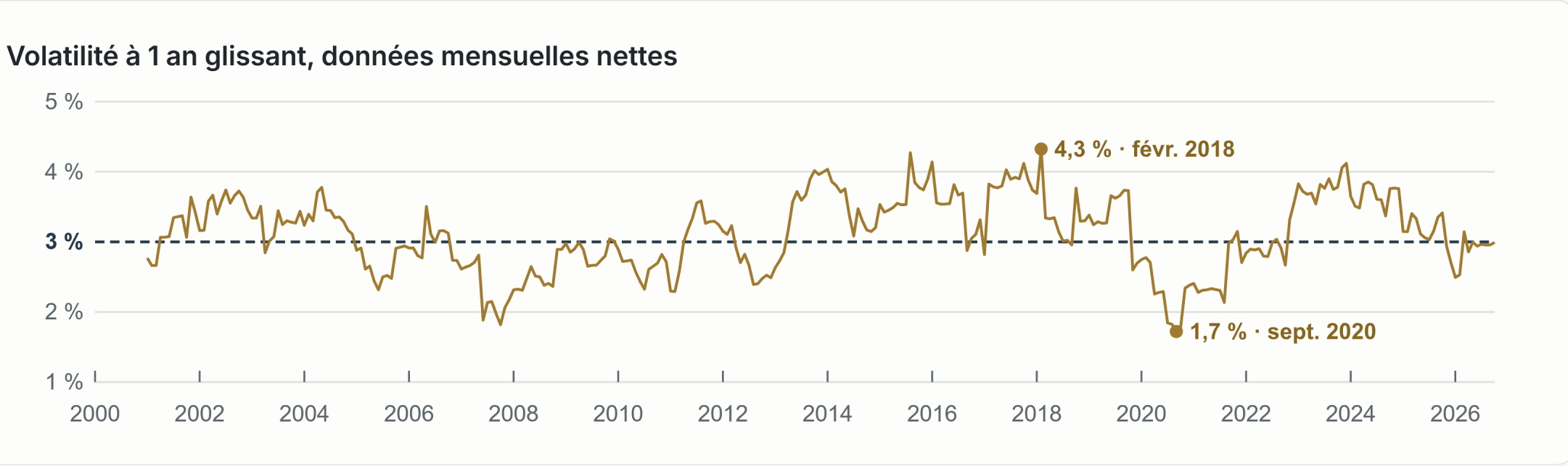
+1,5 %
Pire période glissante de 3 ans

+8,5 %
Médiane à 2 ans
Moyenne de la moitié haute +11,1 %

−2,1 %
Pire période glissantede 2 ans

CONTRÔLE DE LA VOLATILITÉ · CIBLE 3 %

3,22 % de volatilité réalisée, pour 3 % visés.



3,22 %

Volatilité annualisée réalisée, 2000 – 2026

Min 1,7% / Max 4,3 %

Intervalle de la volatilité à 1 an glissant

Centrée sur 3 %

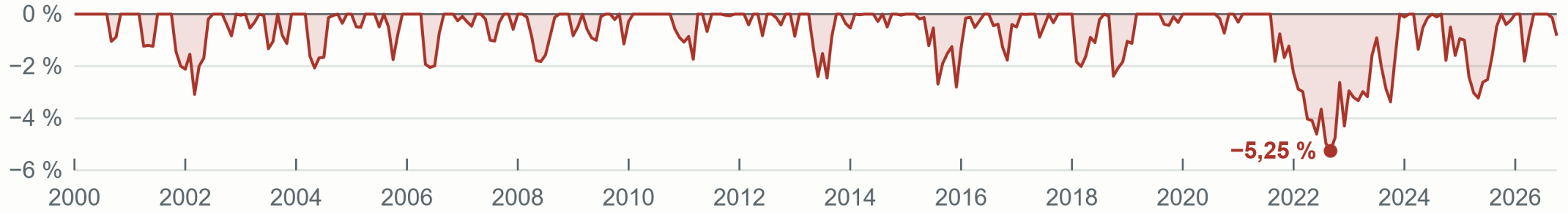
Les positions sont ajustées en continu

ANALYSE DES RISQUES · REPLIS MAXIMUMS

Un repli maximal de 5,3 % depuis 2000.

Évolution des drawdowns depuis janvier 2000

Données mensuelles nettes



REPLI MAXIMAL

−5,25 %

Hors 2022, aucun repli n'a dépassé 3,4 % depuis 2000.

2022

−5,3 %

Hausse des taux, baisse simultanée des obligations et des actions

2025

−3,2 %

Repli du printemps

2002

−3,1 %

Marché baissier actions

2015

−2,8 %

Remontée des taux longs européens

NOTRE APPROCHE · LA LOI DE NEWTON APPLIQUÉE À LA GESTION

« À moins que des forces et facteurs extérieurs ne s'exercent, la tendance boursière d'un actif financier devrait rester la même. »

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 règles pour tous les marchés.

03

Futures ultra liquides

Actions et taux uniquement : ni devises, ni matières premières.

LA STRATÉGIE

Capter les tendances, à risque constant.

Une allocation dynamique qui vise à surperformer les rendements monétaires et obligataires avec une volatilité maîtrisée.

01

3 %

Niveau de risque prédéfini

Le niveau de risque global du portefeuille est fixé à l'avance et peut être personnalisé.

02

Parité de risque

Chaque position est calibrée pour contribuer de manière égale à la volatilité cible du portefeuille.

03

Long only

Seuls les signaux acheteurs des algorithmes momentum sont retenus.

04

Liquide et transparent

Algorithmes propriétaires, portefeuille diversifié sur les taux et actions mondiaux, totalement liquide et transparent.

VARIANTES D'INVESTISSEMENT

Quatre façons d'accéder à la stratégie.

01

SICAV-FIAR

Disponible

Compartiment dédié de Seven Patrimoine Opportunistic SICAV-FIAR, de droit luxembourgeois. ISIN LU3134536427.

02

Fonds UCITS

Selon la taille

Un compartiment dédié peut être ouvert dans SEVEN UCITS, SICAV de droit luxembourgeois.

03

AMC

Selon la taille

Actively Managed Certificate de droit luxembourgeois, émis par une grande banque française.

04

Mandat de gestion

Selon la taille

Compte géré entièrement personnalisé.

Seven Capital Management est agréée AIFM — AMF / CSSF.

CARACTÉRISTIQUES

Un compartiment de SICAV-FIAR luxembourgeoise.

Forme juridique	**SICAV-FIAR, Luxembourg**
Classification	**Diversifié taux / actions monde**
Stratégie	**Momentum investing**
Valorisation	**Quotidienne**
Devise	**EUR**
Code ISIN (EuroClass)	**LU3134536427**
Code Bloomberg	**SVLCRP3 LX**

Frais de gestion	**0,8 %**
Frais de performance	**10 % max. au-delà de l'€STR, HWM**
Souscription minimum	**100 000 €**
Dépositaire	**Banque de Luxembourg**
Administrateur	**UI efa**
Auditeur	**Deloitte Audit**
Société de gestion	**Seven Capital Management**

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.

INFORMATIONS LÉGALES

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 (Autorité des Marchés Financiers – 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 de FIAR peut présenter certains risques. Les FIAR 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 les documents d'information destinés aux investisseurs et le prospectus de chaque FIAR, 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 FIAR, doivent être pris en compte. Les documents d'information et les prospectus des FIAR 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 de FIAR 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 est disponible sur notre site internet www.seven-cm.com.