

# SIF – Seven BlackSnake Fund – Part A

## Fonds long / short multi-classes d'actifs

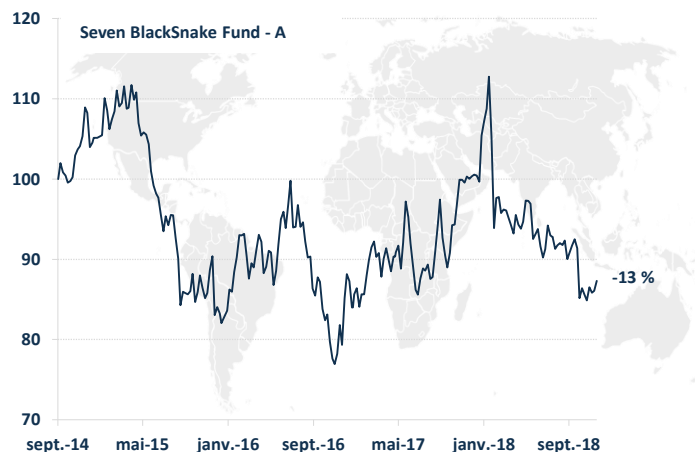
**NOVEMBRE 2018** (données au 30/11/2018)

Valeur liquidative : **873.268 euros**

Le fonds Seven BlackSnake Fund est un fonds long / short multi-classes d'actifs (indices boursiers, obligations d'Etats, devises & matières premières). Le processus d'investissement est basé sur une analyse propriétaire de Momentum déclinée sur trois différents types de données : les données de prix, les données de risque et les données macro-économiques. Le fonds a un objectif de performance absolue.

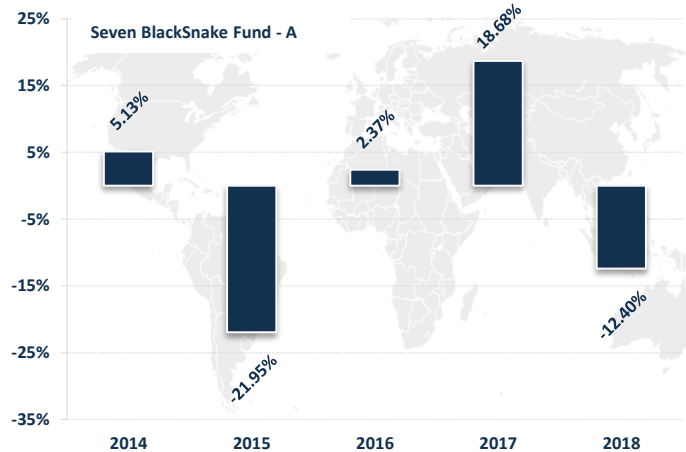
### Evolution du fonds depuis son lancement le 12 septembre 2014 (base 100)

Source : Seven Capital Management



### Historique des performances annuelles depuis 2014

Source : Seven Capital Management



### Performances

Source : Seven Capital Management

	Cumulées		Annualisées	
	Fonds	SG CTA Index	Fonds	SG CTA Index
1 mois	+2.09 %	-0.38 %		
YTD	-12.40 %	-7.13 %		
1 an	-12.95 %	-7.26 %		
3 ans	-3.37 %	-8.89 %	-1.14 % / an	-3.06 % / an
5 ans				
Lancement	-12.67 %	+3.00 %	-3.18 % / an	+0.71 % / an

### Analyse de risque

Source : Seven Capital Management

	1 an	3 ans	5 ans	Lancement
Volatilité	18.90 %	19.58 %		18.36 %
Ratio de Sharpe	-0.67	-0.06		-0.17
Drawdown Max	-24.72 %	-24.72 %		-31.14 %
Corrélation p				
vs. SG CTA Index	0.89	0.86		0.85
vs. MSCI World	0.73	0.37		0.36
vs. JP.Morgan GBI	-0.19	0.26		0.29

### Informations

Source : Seven Capital Management

Date de création	12/09/2014
Forme juridique	SICAV Luxembourgeoise
Stratégie	Performance Absolue
Région	Monde
Devise de référence	Euro
Affectation des résultats	Capitalisation
Code ISIN	LU1015295170
Code Bloomberg	SVBLINE LX Equity

Encours sous gestion	9 500 000 euros
Valeur liquidative	873.268
Frais de gestion fixes	2.00 %
Frais de gestion variables	20.00 %
Indice de référence	Aucun
Valorisation	Hebdomadaire
Dépositaire	CACEIS Bank Luxembourg

Durée minimum  
d'investissement  
recommandée



5 ans

### SEVEN CAPITAL MANAGEMENT

39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tél. +33 1 42 33 04 50

Société par Actions Simplifiée SAS – Agréée par l'AMF N° GP 06000045 – Capital de 560 000 euros – RCS B 491 390 464

www.seven-cm.com

www.amf-france.org

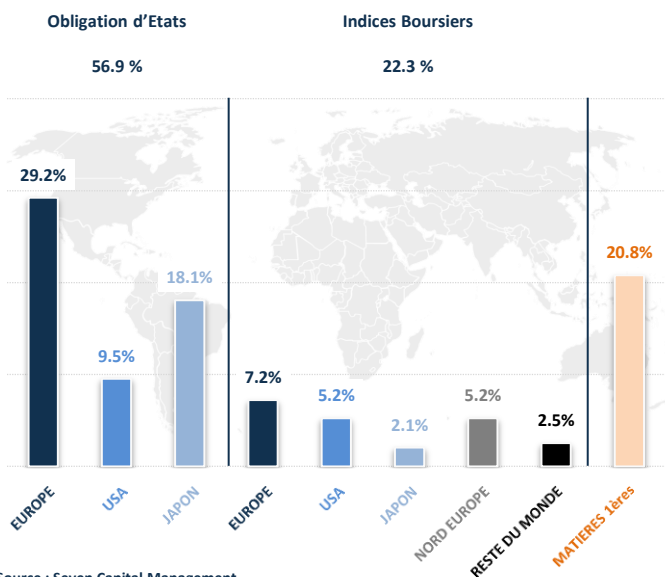
Les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures

# SIF – Seven BlackSnake Fund – Part A

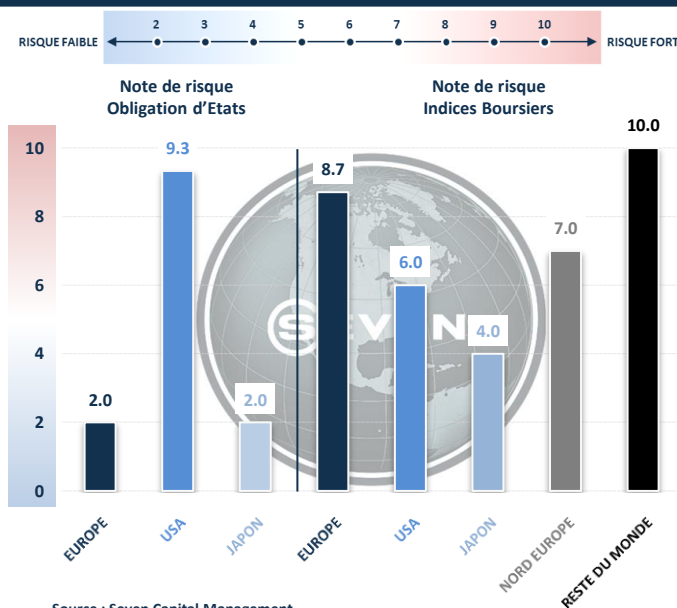
Fonds long / short multi-classes d'actifs

NOVEMBRE 2018 (données au 30/11/2018)

## Répartition du risque du portefeuille par classe d'actif (VaR 95 % 1 jour)



## Note de risque propriétaire Seven Capital Management



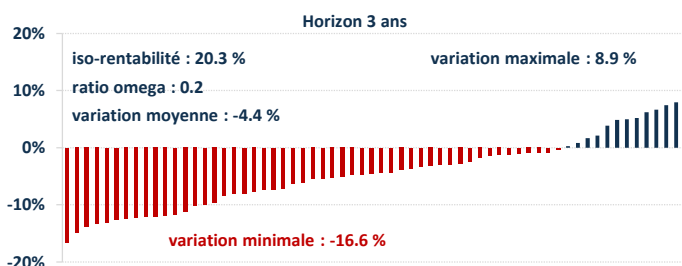
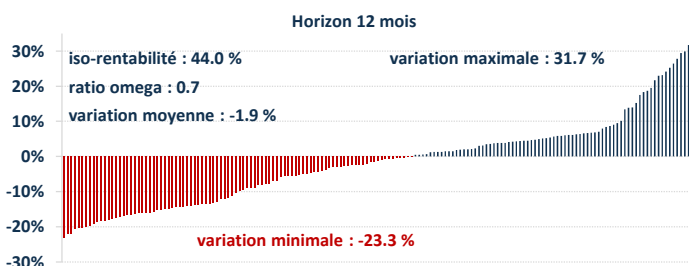
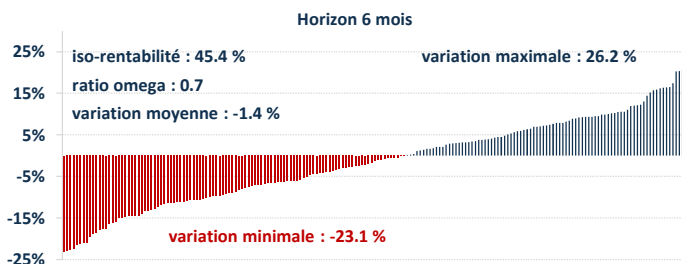
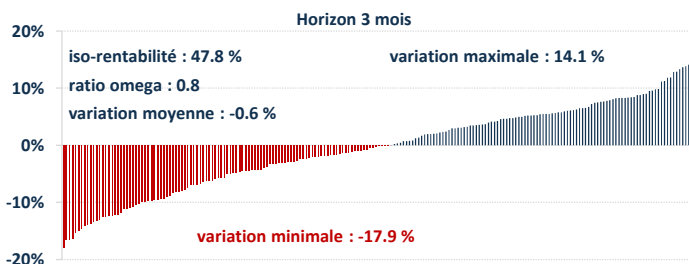
Source : Seven Capital Management

Source : Seven Capital Management

Source : Seven Capital Management

## Analyse de l'iso-rentabilité & du ratio Omega

**Iso – Rentabilité :** Probabilité historique du fonds d'afficher à un horizon donné une performance strictement supérieure à zéro  
**Ratio Omega :** Rapport entre la surface des gains du fonds et la surface des pertes de ce fonds à un horizon donné



Les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures. Document d'information sans valeur contractuelle. Pour les investisseurs professionnels uniquement. Pour plus d'informations, le prospectus, en langues française et anglaise et le DICI (Document d'Information Clé pour l'Investisseur), en langues française et anglaise, sont disponibles sur notre site internet [www.seven-cm.com](http://www.seven-cm.com).

### SEVEN CAPITAL MANAGEMENT

39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tel. +33 1 42 33 04 50  
 Société par Actions Simplifiée SAS – Agréée par l'AMF N° GP 06000045 – Capital de 560 000 euros – RCS B 491 390 464  
[www.seven-cm.com](http://www.seven-cm.com)  
[www.amf-france.org](http://www.amf-france.org)

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