

Seven BlackSnake Program

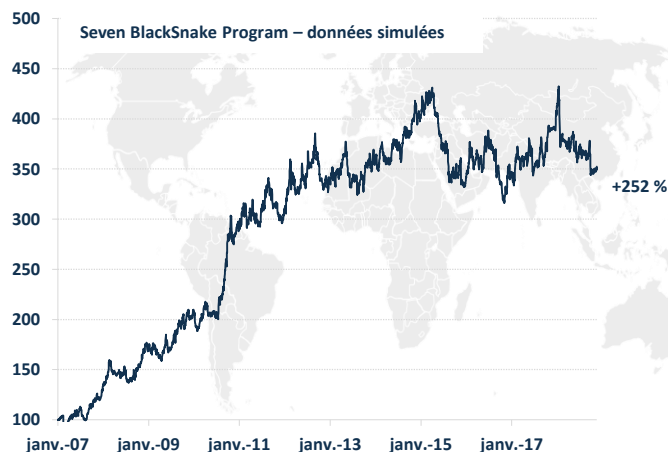
Programme long / short multi-classes d'actifs

NOVEMBRE 2018 (données au 30/11/2018)

Le Seven BlackSnake Program est un programme 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 programme a un objectif de performance absolue.

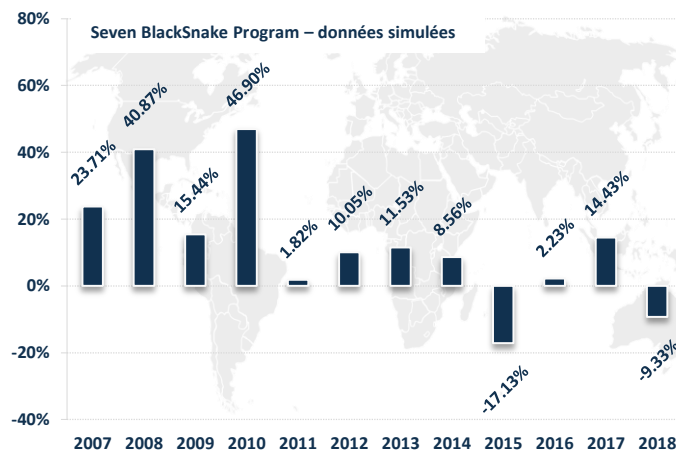
Evolution simulée du programme depuis le 15 janvier 2007 (base 100)

Source : Seven Capital Management



Historique des performances annuelles simulées depuis 2007

Source : Seven Capital Management



Performances

Source : Seven Capital Management

	Cumulées		Annualisées	
	Programme	SG CTA Index	Programme	SG CTA Index
1 mois	+0.87 %	-1.43 %		
YTD	-9.33 %	-7.50 %		
1 an	-9.58 %	-6.85 %		
3 ans	-1.35 %	-9.16 %	-0.45 % / an	-3.16 % / an
5 ans	-3.38 %	+7.14 %	-0.69 % / an	+1.40 % / an
15 janvier 2007	+252.44 %	+25.57 %	+11.24 % / an	+1.94 % / an

Analyse de risque

Source : Seven Capital Management

	1 an	3 ans	5 ans	15 janvier 2007
Volatilité	13.66 %	14.17 %	13.39 %	15.76 %
Ratio de Sharpe	-0.70	-0.03	-0.05	0.71
Drawdown Max	-20.43 %	-20.43 %	-26.67 %	-26.67 %
Corrélation p				
vs. SG CTA Index	0.80	0.82	0.82	0.77
vs. MSCI World	0.57	0.29	0.33	0.13
vs. JP.Morgan GBI	0.05	0.29	0.27	0.08

Informations

Source : Seven Capital Management

Début de la simulation	15/01/2007
Forme juridique	N/A
Stratégie	Performance Absolue
Région	Monde
Devise de référence	Euro
Affectation des résultats	Capitalisation
Code ISIN	N/A
Code Bloomberg	N/A

Encours sous gestion	N/A
Valeur liquidative	N/A
Frais de gestion fixes	2.00 %
Frais de gestion variables	20.00 %
Indice de référence	Aucun
Valorisation	Quotidienne
Dépositaire	N/A

Durée minimum
d'investissement
recommandée



5 ans

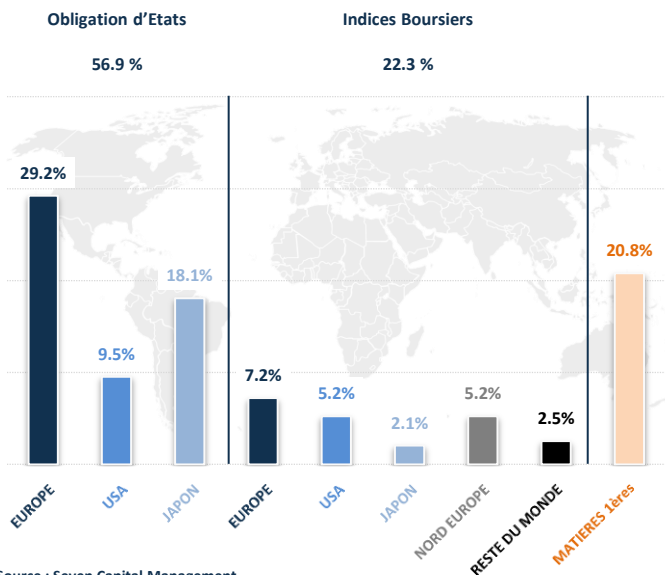
SEVEN CAPITAL MANAGEMENT

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

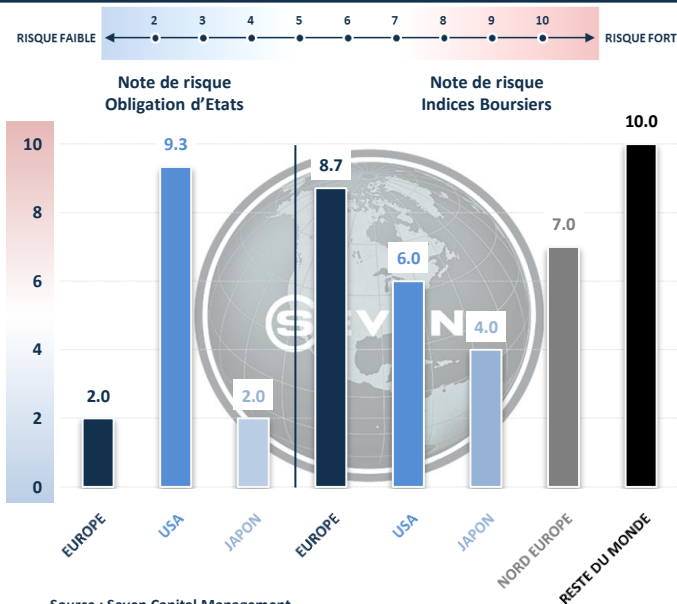
Les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures

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



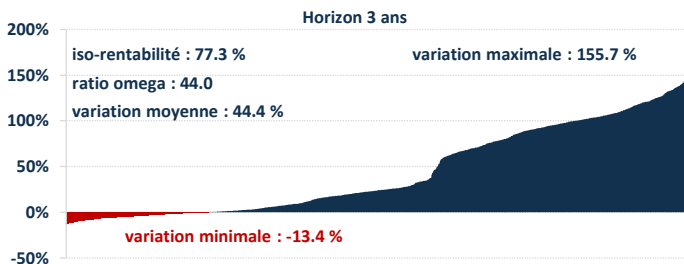
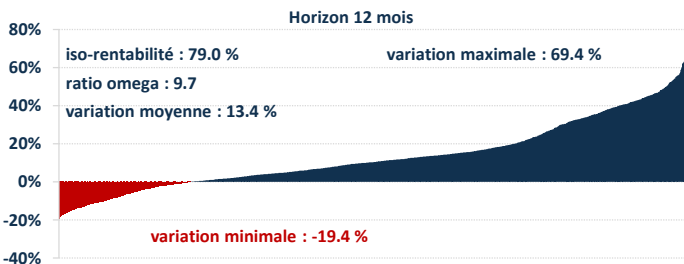
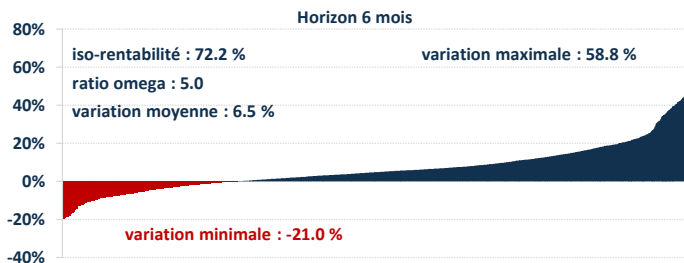
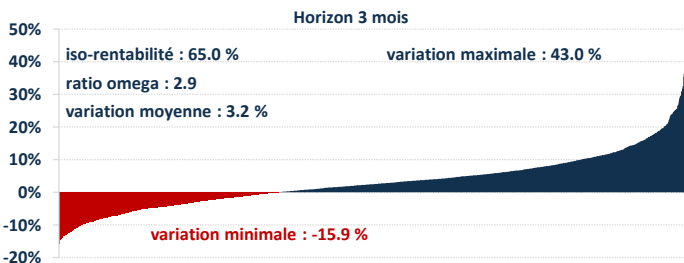
Source : Seven Capital Management

Source : Seven Capital Management

Source : Seven Capital Management

Analyse de l'iso-rentabilité & du ratio Omega

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



Les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures. Document d'information sans valeur contractuelle.

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