

SIF – Seven BlackSnake Fund – Part S

Fonds long / short multi-classes d'actifs

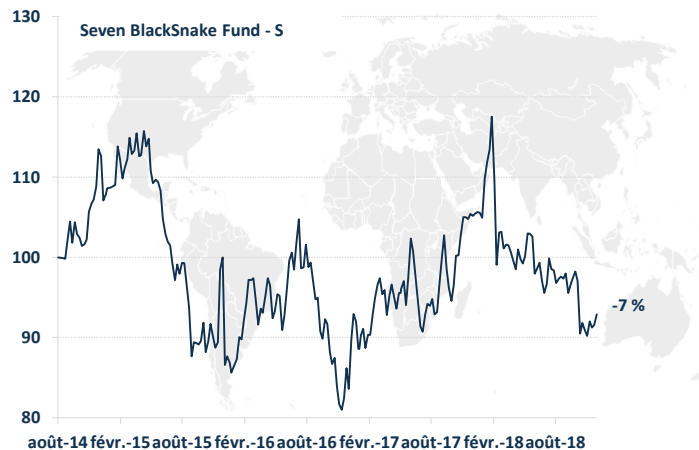
NOVEMBRE 2018 (données au 30/11/2018)

Valeur liquidative : 929 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.

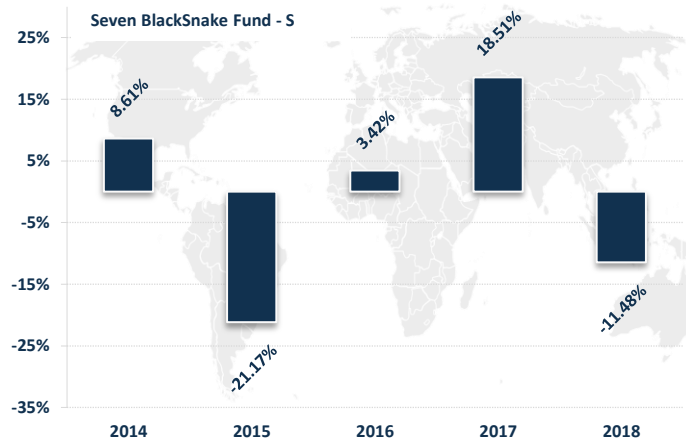
Evolution du fonds depuis son lancement le 1er août 2014 (base 100)

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	+2.19 %	-0.38 %		
YTD	-11.48 %	-7.13 %		
1 an	-11.86 %	-7.26 %		
3 ans	-7.07 %	-8.89 %	-2.41 % / an	-3.06 % / an
5 ans				
Lancement	-7.10 %	+7.14 %	-1.70 % / an	+1.61 % / an

Analyse de risque

Source : Seven Capital Management

	1 an	3 ans	5 ans	Lancement
Volatilité	18.01 %	20.04 %		19.25 %
Ratio de Sharpe	-0.65	-0.12		-0.09
Drawdown Max	-23.24 %	-23.24 %		-29.99 %
Corrélation p				
vs. SG CTA Index	0.89	0.84		0.81
vs. MSCI World	0.74	0.35		0.36
vs. JP.Morgan GBI	-0.18	0.30		0.31

Informations

Source : Seven Capital Management

Date de création	01/08/2014
Forme juridique	SICAV Luxembourgeoise
Stratégie	Performance Absolue
Région	Monde
Devise de référence	Euro
Affectation des résultats	Capitalisation
Code ISIN	LU1015295840
Code Bloomberg	SVBLEBE LX Equity

Encours sous gestion	9 500 000 euros
Valeur liquidative	929
Frais de gestion fixes	1.00 %
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

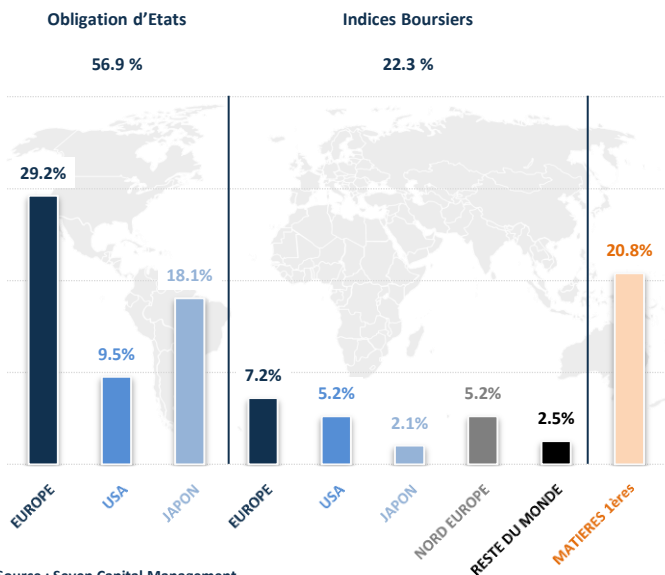
Les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures

SIF – Seven BlackSnake Fund – Part S

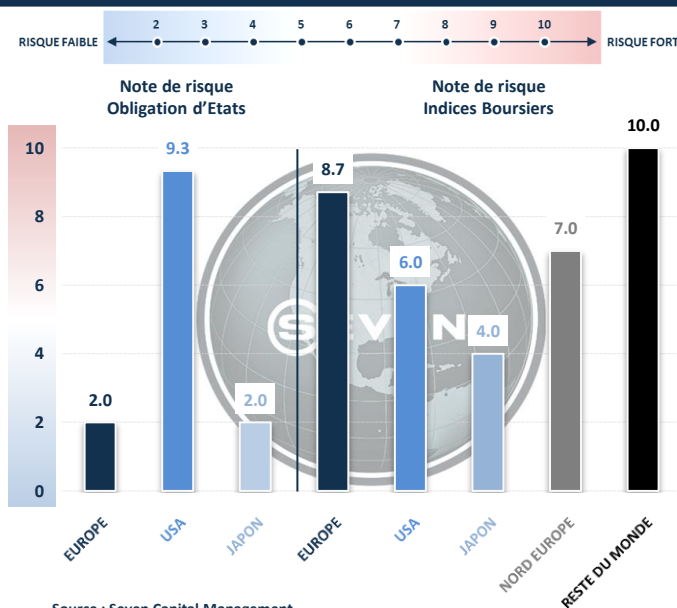
Fonds long / short multi-classes d'actifs

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



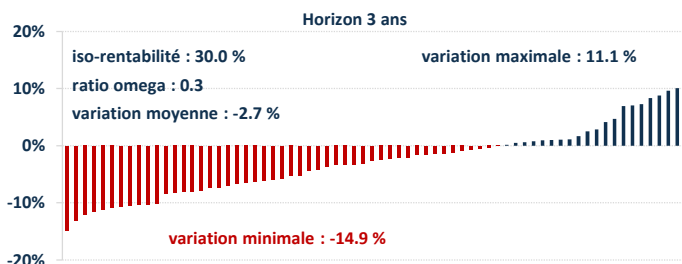
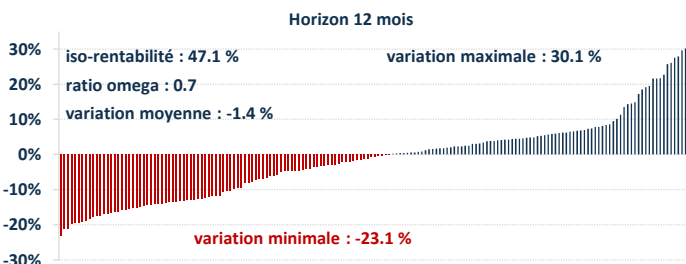
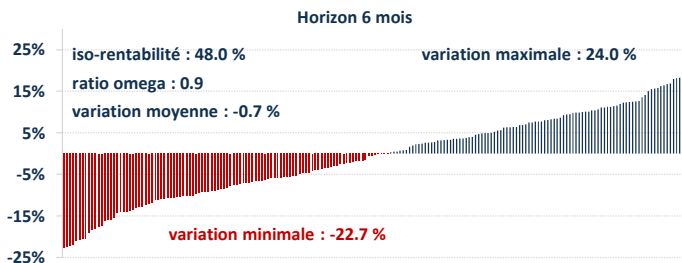
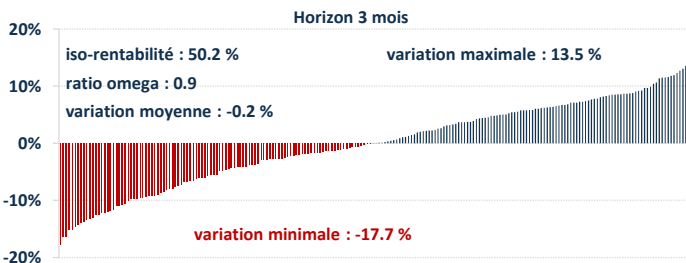
Source : Seven Capital Management

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.

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
www.amf-france.org

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