

UCITS – Euro Low Volatility – Part I

Fonds de performance absolue à faible volatilité

OCTOBRE 2020

(données au 30/10/2020)

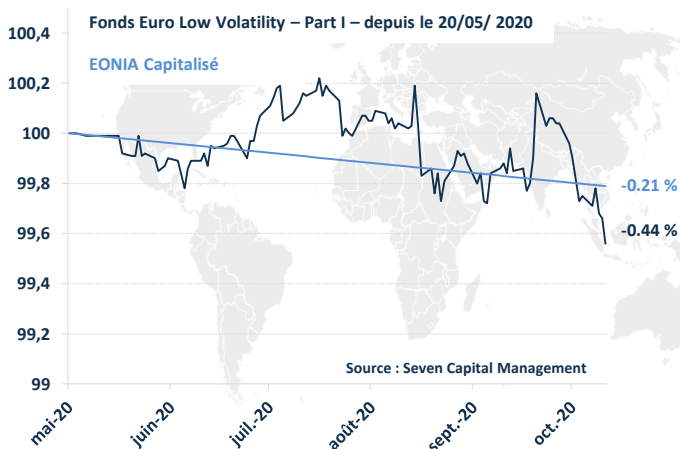
Valeur liquidative :

99.56 euros

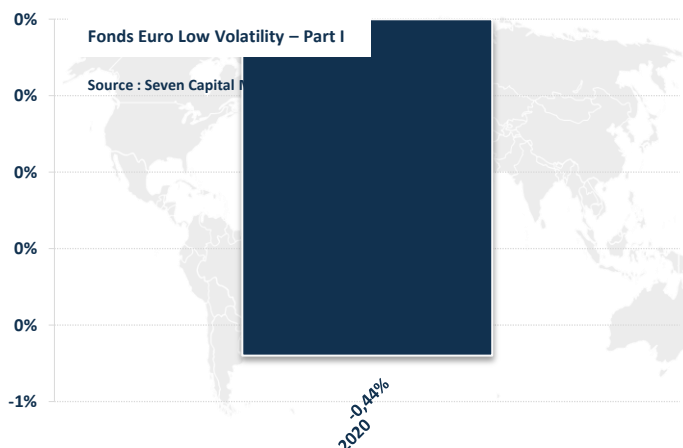
Le fonds Euro Low Volatility est un fonds flexible diversifié de performance absolue à faible volatilité.

Le processus d'investissement est basé sur une analyse propriétaire de Momentum déclinée sur trois différents types de données : les données macro-économiques, les données de prix et les données de risque. Le fonds vise un objectif de rendement régulier et un faible niveau de volatilité.

Performances depuis le 20 mai 2020 (base 100)



Historique des performances annuelles



Performances

Source : Seven Capital Management

	Cumulées		Annualisées	
	Programme	EONIA*	Programme	EONIA*
1 mois	-0.28 %			
YTD	-0.44 %			
1 an				
3 ans				
5 ans				
20 mai 2020	-0.44 %	-0.21 %	-0.97 % / an	-0.46 % / an

Analyse de risque données mensuelles

Source : Seven Capital Management

	1 an	3 ans	5 ans	20 mai 2020
Volatilité				1.04 %
Ratio de Sharpe				-0.93
Drawdown Max				-0.66 %
Corrélation p				
vs. EuroStoxx 50				0.20
vs. Euro MTS 7-10				0.33

Informations

Source : Seven Capital Management

Date de lancement du fonds	20/05/2020
Forme juridique attendue	SICAV Luxembourgeoise
Stratégie	Diversifiée
Région	Monde
Devise de référence	Euro
Affectation des résultats	Capitalisation
Code ISIN	LU2109939087
Code Bloomberg	EURLVEI LX Equity

Encours sous gestion	7 900 000 euros
Valeur liquidative	99.56
Frais de gestion fixes	0.60 %
Frais de gestion variables	10.00 %
Indice de référence*	EONIA Capitalisé
Valorisation	Quotidienne
Dépositaire	CACEIS Bank Luxembourg

Echelle de risque AMF



Durée minimum d'investissement recommandée

3 ans

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

L'investisseur peut perdre tout ou partie du montant de capital investi, les OPC n'étant pas garantis en capital

UCITS – Euro Low Volatility – Part I

Fonds flexible diversifié de performance absolue à faible volatilité

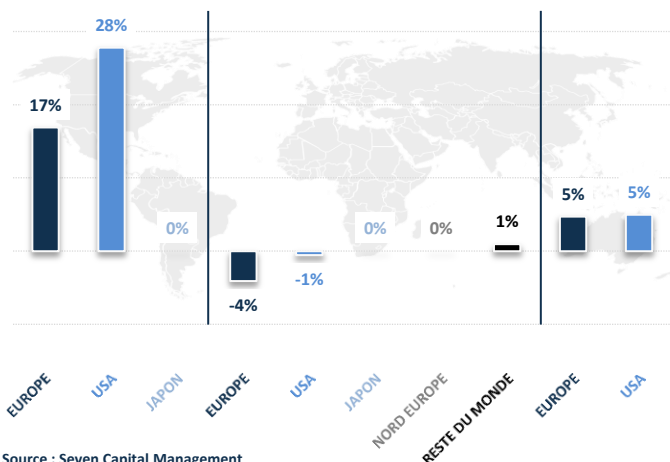
OCTOBRE 2020

(données au 30/10/2020)

Répartition par classe d'actif

Obligation d'Etats 45 %
Indices Boursiers -4 %
Actions 10 %

Ptf Duration : 2.38



Commentaire du gérant

Source : Seven Capital Management

Principales positions actions

Source : Seven Capital Management

Pondération	Société	Secteur	Pays	Capitalisation boursière	Δ sur le mois	Pondération	Société	Secteur	Pays	Capitalisation boursière	Δ sur le mois		
1	0.3%	Apple inc	Technologie	Etats-unis	1 589 200	-6.00%	6	0.2%	Accenture plc-cl a	Biens & services industriels	Irlande	118 182	-3.64%
2	0.3%	Bristol-myers squibb co	Santé	Etats-unis	113 123	-2.32%	7	0.2%	Kone oyj-b	Biens & services industriels	Finlande	36 179	-8.95%
3	0.3%	Scout24 ag	Technologie	Allemagne	7 441	-7.18%	8	0.2%	Abbvie inc	Santé	Etats-unis	128 960	-1.52%
4	0.3%	Deutsche wohnen se	Immobilier	Allemagne	15 592	1.50%	9	0.2%	Adobe inc	Technologie	Etats-unis	184 168	-8.84%
5	0.3%	Abbott laboratories	Santé	Etats-unis	159 798	-3.10%	10	0.2%	Symrise ag	Chimie	Allemagne	14 335	-10.30%

Poids du TOP 10 des positions dans le portefeuille : 2.6 %

Principales variations actions du mois

Source : Seven Capital Management

Les meilleures performances

Pondération	Société	Secteur	Pays	Capitalisation boursière	Δ sur le mois	
1	0.2%	Tiffany & co	Produits ménagers & de soin personnel	Etats-unis	13 635	12.94%
2	0.2%	Tyler technologies inc	Technologie	Etats-unis	13 282	10.28%
3	0.2%	Flutter entertainment plc	Voyage & loisirs	Irlande	23 177	10.21%
4	0.1%	Hermes international	Produits ménagers & de soin personnel	France	84 350	8.53%
5	0.1%	Idexx laboratories inc	Santé	Etats-unis	31 115	8.07%

Poids des 5 meilleurs performances dans le portefeuille : 0.7 %

Les moins bonnes performances

Pondération	Société	Secteur	Pays	Capitalisation boursière	Δ sur le mois	
1	0.1%	Nexi spa	Biens & services industriels	Italie	8 280	-22.96%
2	0.0%	Morphosys ag	Santé	Allemagne	2 880	-19.19%
3	0.0%	Citrix systems inc	Technologie	Etats-unis	11 975	-17.75%
4	0.0%	Euronext nv	Services financiers	Pays-bas	6 269	-16.23%
5	0.0%	Elisa oyj	Télécommunications	Finlande	7 068	-15.99%

Poids des 5 moins bonnes performances dans le portefeuille : 0.2 %

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, anglaise, allemande, espagnole et italienne sont disponibles sur notre site internet www.seven-cm.com. En Suisse, le Fonds a nommé comme représentant Oligo Swiss Fund Services SA, Av. Villamont 17, 1005 Lausanne, Suisse, Tél : +41 21 311 17 77, e-mail : info@oligofunds.ch. Le service de paiement du Fonds en Suisse est la Helvetische Bank.

SEVEN CAPITAL MANAGEMENT

39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tel. +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

L'investisseur peut perdre tout ou partie du montant de capital investi, les OPC n'étant pas garantis en capital