

# UCITS – Seven Fortress Fund – Part I



## Fonds equity market neutral

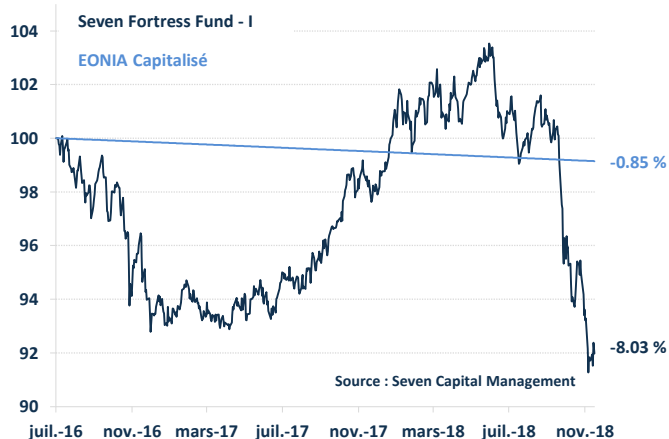
**NOVEMBRE 2018** (données au 30/11/2018)

Valeur liquidative : **91.97 euros**

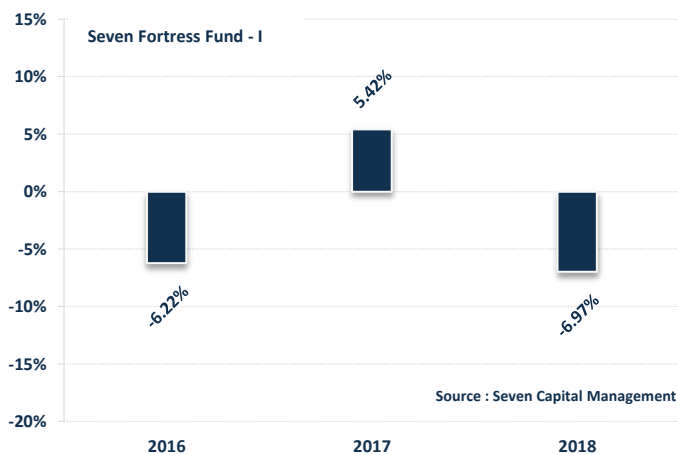
Le fonds Seven Fortress Fund est un fonds action non directionnel de performance absolue.

Le processus d'investissement est basé sur une analyse propriétaire de Momentum des actions de grandes capitalisations boursières européennes & américaines. Le portefeuille de titres boursiers détenus à l'achat est couvert par des positions à la vente sur des contrats futures sur indices boursiers.

Evolution du fonds depuis son lancement le 15 juillet 2016 (base 100)



Historique des performances annuelles depuis 2016



### Performances

Source : Seven Capital Management

	Cumulées		Annualisées	
	Fonds	EONIA*	Fonds	EONIA*
1 mois	-2.63 %			
YTD	-6.97 %			
1 an	-6.34 %	-0.37 %		
3 ans				
5 ans				
Lancement	-8.03 %	-0.85 %	-3.46 % / an	-0.36 % / an

### Analyse de risque

Source : Seven Capital Management

	1 an	3 ans	5 ans	Lancement
Volatilité	6.48 %			5.81 %
Ratio de Sharpe	-0.98			-0.60
Drawdown Max	-11.84 %			-11.84 %
Beta $\beta$				
vs. EuroStoxx 50	0.18			0.11
vs. S&P 500	0.23			0.22

### Informations

Source : Seven Capital Management

Date de création	15/07/2016
Forme juridique	SICAV Luxembourgeoise
Stratégie	Equity Market Neutral
Région	Monde
Devise de référence	Euro
Affectation des résultats	Capitalisation
Code ISIN	LU1388503580
Code Bloomberg	SVFOE1 LX Equity

Encours sous gestion	6 200 000 euros
Valeur liquidative	91.97
Frais de gestion fixes	1.00 %
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



### 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

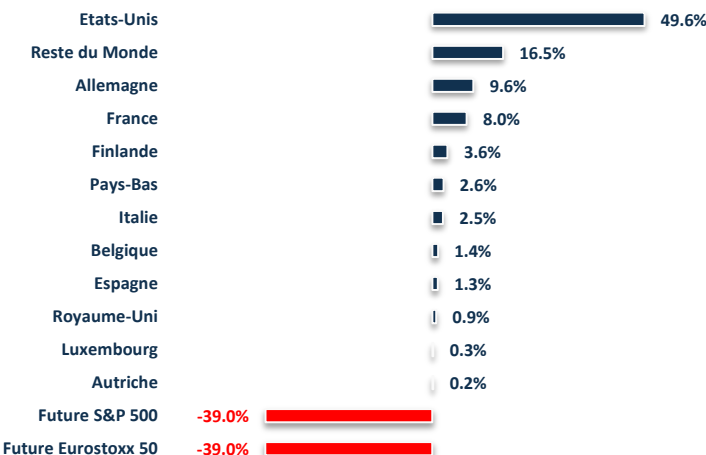
www.amf-france.org

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

NOVEMBRE 2018 (données au 30/11/2018)

### Répartition géographique

Source : Seven Capital Management



### Répartition sectorielle

Source : Seven Capital Management



### Répartition par taille de capitalisation boursière

Source : Seven Capital Management

< 1 000 M€	Entre 1 000 M€ & 5 000 M€	Entre 5 000 M€ & 10 000 M€	> 10 000 M€	Capitalisation moyenne
0.0 %	5.1 %	26.6 %	64.8 %	42 994 M€

### Principales positions

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	2.5%	Aker bp asa	Pétrole & gaz	Reste du monde	9 014	-11.54%	6	1.6%	Wirecard ag	Biens & services industriels	Allemagne	16 490	-19.32%
2	1.9%	Amazon.com inc	Distribution	Etats-unis	730 393	5.77%	7	1.5%	Hollyfrontier corp	Pétrole & gaz	Etats-unis	9 566	-6.88%
3	1.8%	Swedish orphan biovitrum ab	Santé	Reste du monde	5 215	5.25%	8	1.4%	Abiomed inc	Santé	Etats-unis	13 242	-2.50%
4	1.7%	Swedish match ab	Produits ménagers & de soin personnel	Reste du monde	6 068	-23.78%	9	1.4%	Copart inc	Distribution	Etats-unis	10 585	4.64%
5	1.6%	Neste oyj	Pétrole & gaz	Finlande	17 697	-5.14%	10	1.4%	Seagate technology	Technologie	Etats-unis	10 899	7.11%

Poids du TOP 10 des positions dans le portefeuille : 16.8 %

### Principales variations du mois

Source : Seven Capital Management

#### Les meilleures performances

Pondération	Société	Secteur	Pays	Capitalisation boursière	Δ sur le mois	
1	0.6%	Abbvie inc	Santé	Etats-unis	125 323	21.09%
2	1.0%	Deutsche lufthansa-reg	Voyage & loisirs	Allemagne	10 217	21.06%
3	0.3%	Deere & co	Biens & services industriels	Etats-unis	44 031	14.35%
4	0.3%	1&1 drillisch ag	Télécommunications	Allemagne	7 848	12.58%
5	0.6%	Koninklijke ahold delhalze n	Distribution	Pays-bas	26 876	12.23%

Poids des 5 meilleurs performances dans le portefeuille : 2.8 %

#### Les moins bonnes performances

Pondération	Société	Secteur	Pays	Capitalisation boursière	Δ sur le mois	
1	1.7%	Swedish match ab	Produits ménagers & de soin personnel	Reste du monde	6 068	-23.78%
2	1.0%	Faurecia	Automobiles & équipementiers	France	4 751	-19.79%
3	1.6%	Wirecard ag	Biens & services industriels	Allemagne	16 490	-19.32%
4	1.0%	Gn store nord a/s	Santé	Reste du monde	4 496	-17.66%
5	0.7%	Upm-kymmene oyj	Matières premières	Finlande	12 559	-17.18%

Poids des 5 moins bonnes performances dans le portefeuille : 5.9 %

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](http://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](mailto: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 – 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