

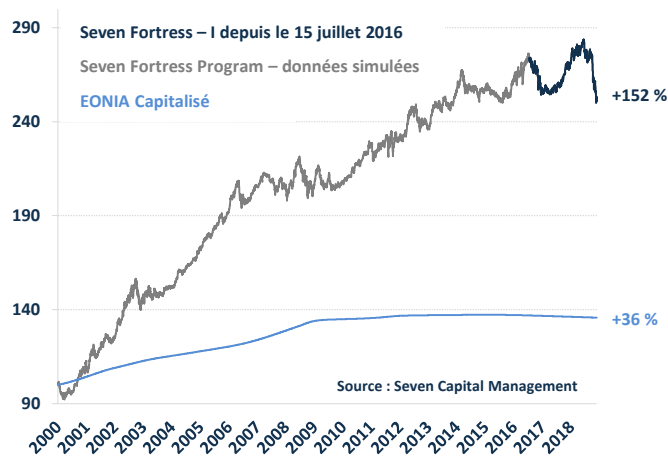
Seven Fortress Program

Programme equity market neutral

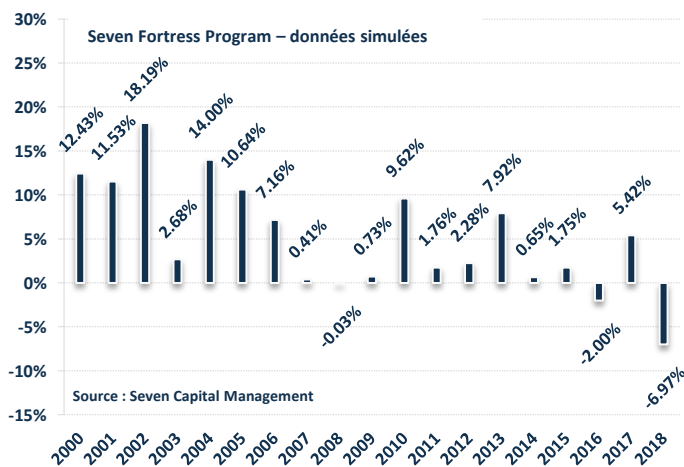
NOVEMBRE 2018 (données au 30/11/2018)

Le Seven Fortress Program est un programme 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 simulée du programme depuis le 3 janvier 2000 (base 100)



Historique des performances annuelles simulées depuis 2000



Source : Seven Capital Management

Performances

	Cumulées		Annualisées	
	Programme	EONIA*	Programme	EONIA*
1 mois	-2.63 %			
YTD	-6.97 %			
1 an	-6.34 %	-0.37 %		
3 ans	-1.98 %	-1.03 %	-0.66 % / an	-0.34 % / an
5 ans	-0.43 %	-1.01 %	-0.08 % / an	-0.20 % / an
3 janvier 2000	+152.06 %	+35.74 %	+4.86 % / an	+1.58 % / an

Source : Seven Capital Management

Analyse de risque

	1 an	3 ans	5 ans	3 janvier 2000
Volatilité	6.48 %	5.96 %	5.59 %	6.59 %
Ratio de Sharpe	-0.98	-0.11	-0.02	0.74
Drawdown Max	-11.84 %	-11.84 %	-11.84 %	-11.84 %
Beta β				
vs. EuroStoxx 50	0.18	0.03	0.03	-0.08
vs. S&P 500	0.23	0.10	0.04	-0.06

Source : Seven Capital Management

Informations

Début de la simulation	03/01/2000
Forme juridique	N/A
Stratégie	Equity Market Neutral
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	1.00 %
Frais de gestion variables	10.00 %
Indice de référence*	EONIA Capitalisé
Valorisation	Quotidienne
Dépositaire	N/A

Echelle de risque AMF



Durée minimum d'investissement recommandée



SEVEN CAPITAL MANAGEMENT

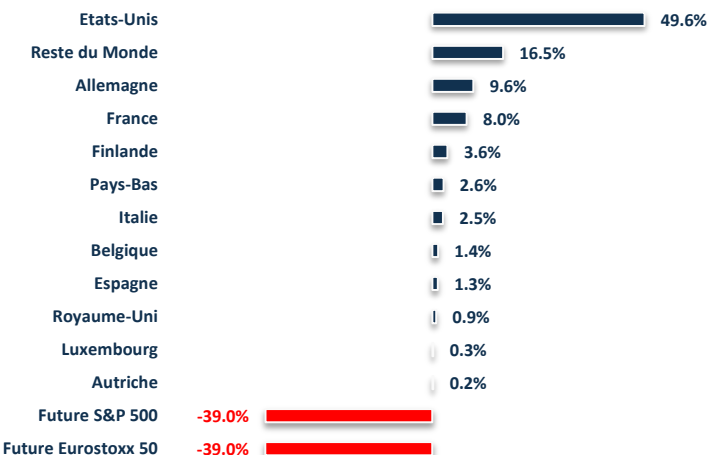
39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tel. +33 1 42 33 04 50
Société par Actions Simplifiée SAS – Agréée par l'AMF N° GP 06000045 – Capital de 560 000 euros – RCS B 491 390 464
www.seven-cm.com
www.amf-france.org

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 meilleures 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.

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