

Seven Absolute Return Program

Programme long / short multi-classes d'actifs

Placement privé réservé aux investisseurs qualifiés

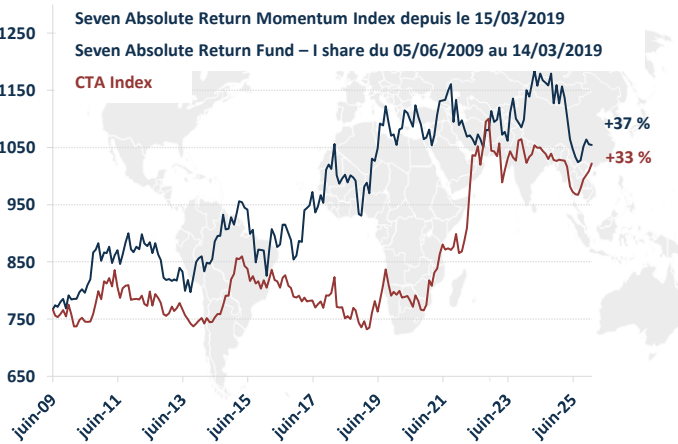
DÉCEMBRE 2025 (données au 31/12/2025)

Valeur liquidative indicative : 1054.4

Le Seven Absolute Return Program est un programme long / short multi-classes d'actifs (indices boursiers & obligations d'Etats). 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. Les données figurant dans le présent reporting font référence au fonds UCITS Seven Absolute Return Fund – I share du 05/06/2009 au 14/03/2019 et au Seven Absolute Return Momentum Index depuis le 15/03/2019.

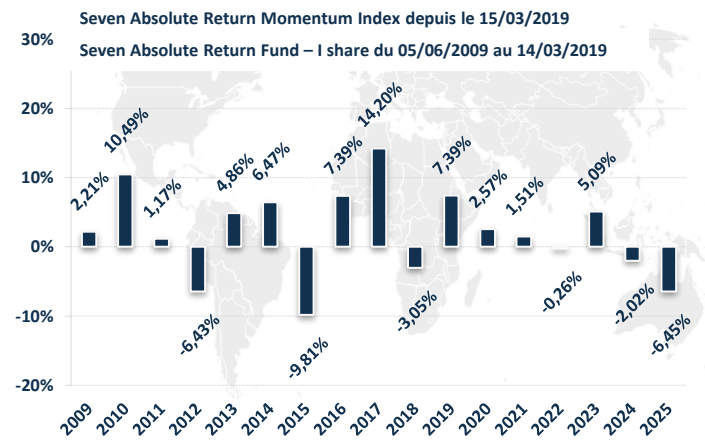
Evolution du programme depuis le 5 juin 2009

Source : Seven Capital Management



Historique des performances annuelles depuis 2009

Source : Seven Capital Management



Performances

Source : Seven Capital Management

	Cumulées	Annualisées
1 mois	-0,11 %	
YTD	-6,45 %	
1 an	-6,45 %	
3 ans	-3,68 %	-1,25 % / an
5 ans	-2,48 %	-0,50 % / an
5 juin 2009	+37,46 %	+1,95 % / an

Analyse de risque

Source : Seven Capital Management

	1 an	3 ans	5 ans	5 juin 2009
Volatilité	11,52 %	9,60 %	9,12 %	8,94 %
Ratio de Sharpe	-0,57	-0,13	-0,06	0,22
Drawdown Max	-16,00 %	-16,00 %	-16,00 %	-16,00 %
Corrélation p				
vs. CTA Index	0,43	0,43	0,36	0,41
vs. MSCI World	0,34	0,53	0,48	0,24
vs. JP.Morgan GBI	-0,08	-0,17	-0,20	0,09

Informations

Source : Seven Capital Management

Date de création	05/06/2009
Forme juridique	Certificat
Stratégie	Performance Absolue
Région	Monde
Devise de référence	Euro
Affectation des résultats	Capitalisation
Code ISIN	XS1700086850
Code Bloomberg	NXSRSEVA Index

Montant de l'émission	30 000 000 euros
Valeur liquidative	1054.4
Quotité	1 000 euros
Frais Index advisor	0.50 %
Frais Index Sponsor	0.70 %
Frais de gestion variables (HWM)	10.00 %
Valorisation	Quotidienne

Echelle de risque indicative



Durée minimum
d'investissement
recommandée

5 ans

SEVEN CAPITAL MANAGEMENT

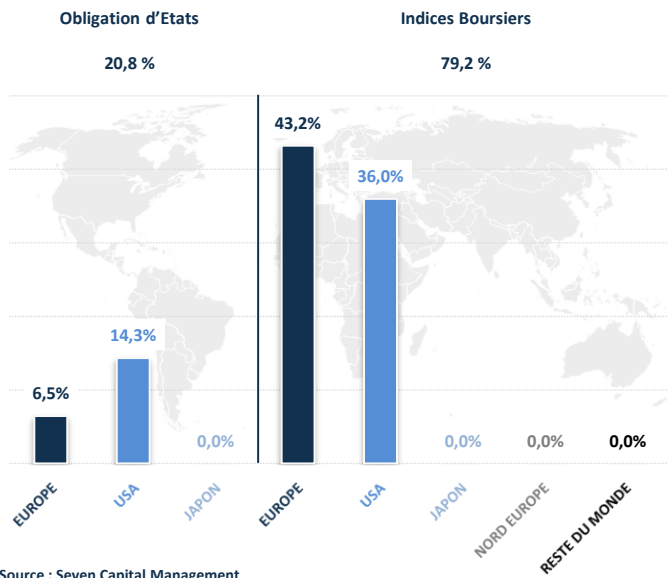
39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tel. +33 1 42 33 04 50
Société par Actions Simplifiée SAS – Agréée par l'AMF N° GP 06000045 – Capital de 560 000 euros – RCS B 491 390 464
www.seven-cm.com www.amf-france.org
Les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures
L'investisseur peut perdre tout ou partie du montant de capital investi, les OPC n'étant pas garantis en capital

Seven Absolute Return Program

Programme long / short multi-classes d'actifs

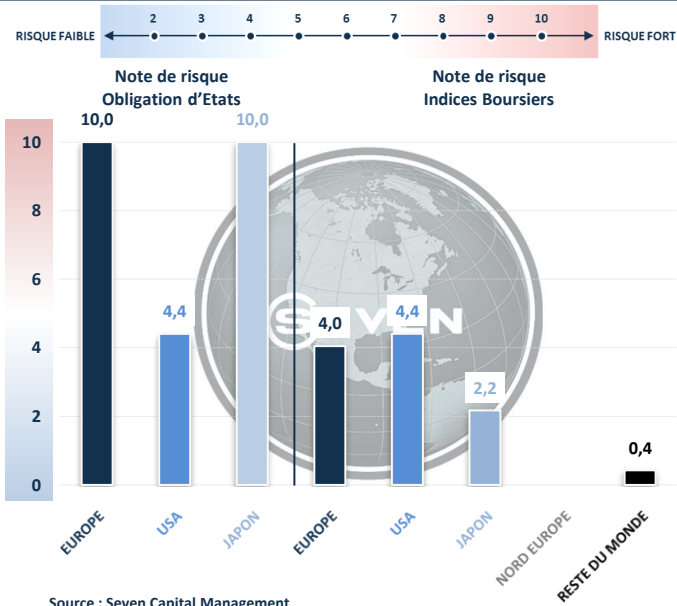
DÉCEMBRE 2025 (données au 31/12/2025)

Répartition du risque du portefeuille par classe d'actif (VaR 95 % 1 jour)



Source : Seven Capital Management

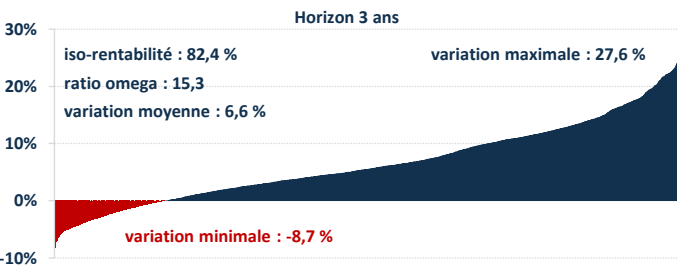
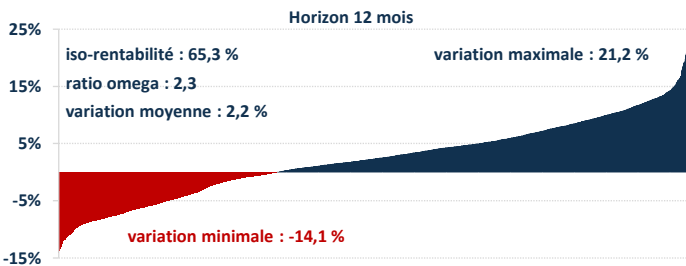
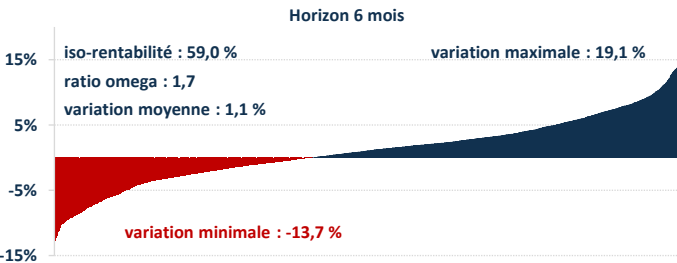
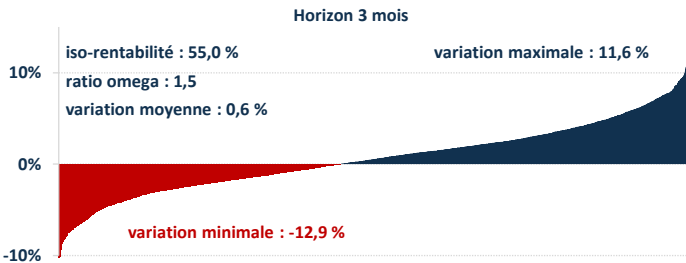
Note de risque propriétaire Seven Capital Management



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