

# 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.

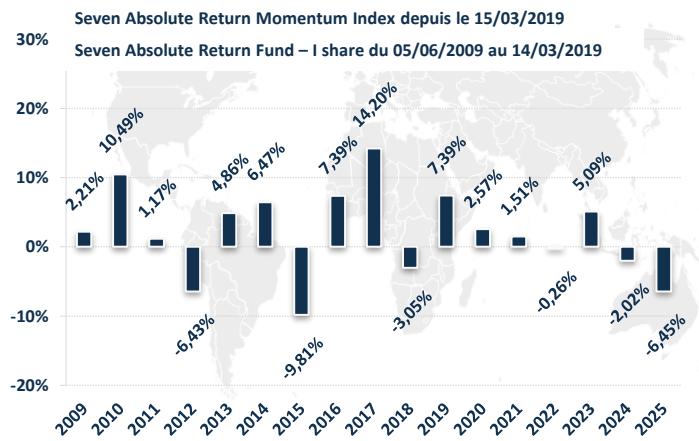
#### Evolution du programme depuis le 5 juin 2009

Source : Seven Capital Management



#### Historique des performances annuelles depuis 2009

Source : Seven Capital Management



Source : Seven Capital Management

#### Performances

|             | 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 |

Source : Seven Capital Management

#### Analyse de risque

|                   | 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        |

Source : Seven Capital Management

#### Informations

|                           |                     |
|---------------------------|---------------------|
| Date de création          | 05/06/2009          |
| Forme juridique           | Certificat          |
| Stratégie                 | Performance Absolue |
| Région                    | Monde               |
| Devise de référence       | Euro                |
| Affectation des résultats | Capitalisation      |
| Code ISIN                 | XS1710008680        |
| 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



#### SEVEN CAPITAL MANAGEMENT

39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tel. +33 1 42 33 04 50

Société par Actions Simplifiée SAS – Agrée 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

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

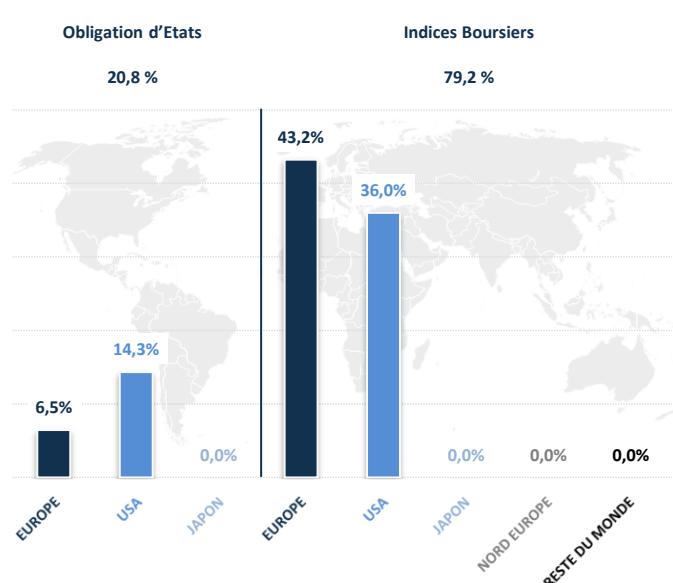
# Seven Absolute Return Program

SEVENCAPITAL  
MANAGEMENT

## Programme long / short multi-classes d'actifs

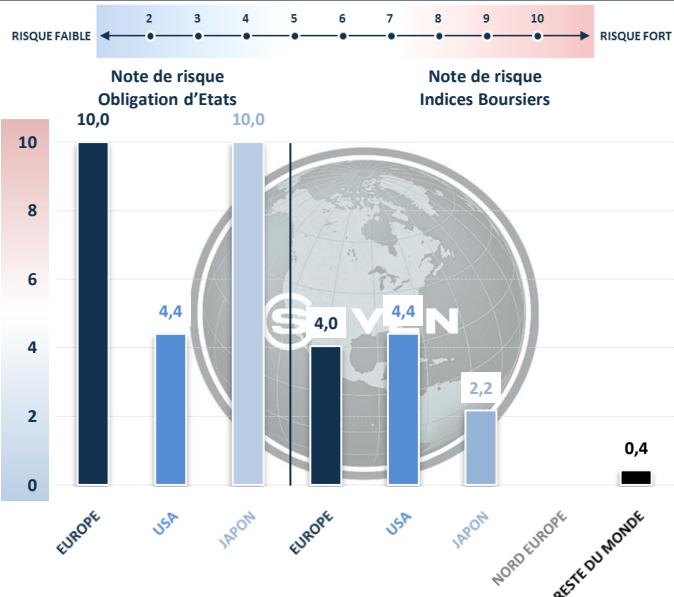
DÉCEMBRE 2025 (données au 31/12/2025)

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



Source : Seven Capital Management

### Note de risque propriétaire Seven Capital Management

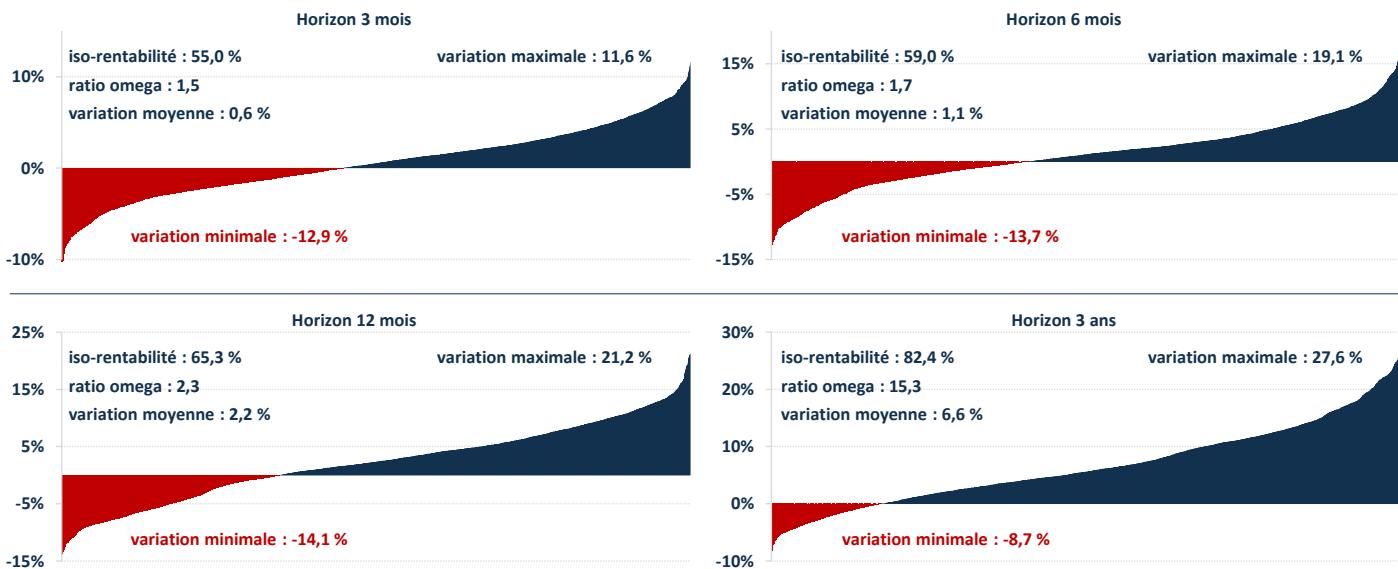


Source : Seven Capital Management

### Analyse de l'iso-rentabilité & du ratio Omega

Source : Seven Capital Management

- 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](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 – Agrée 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

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