

# UCITS – Seven Force 10

## Programme de performance absolue

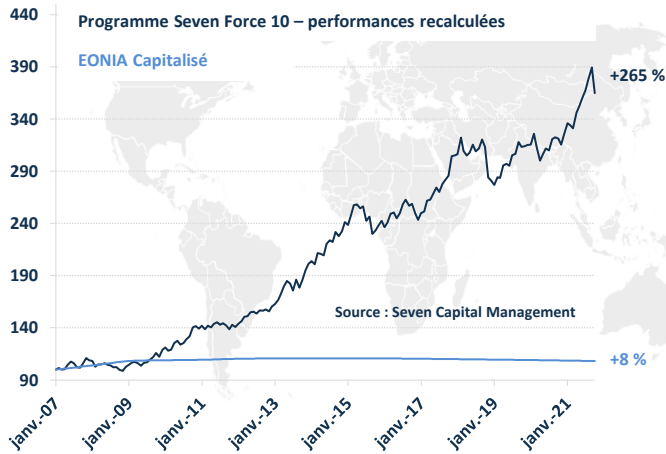


SEPTEMBRE 2021 (données au 30/09/2021)

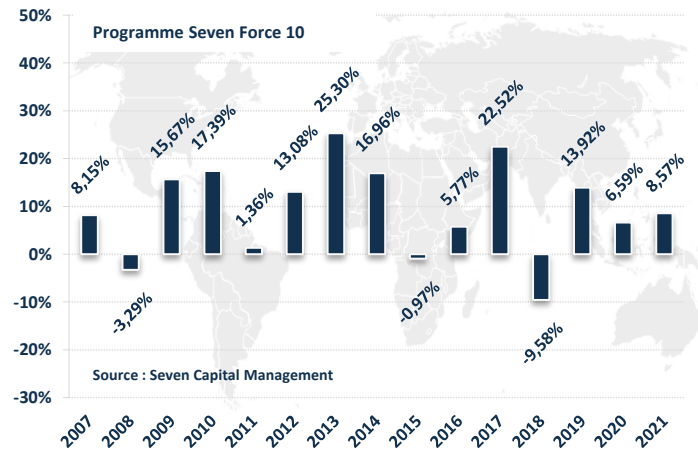
Le programme Seven Force 10 est un programme flexible diversifié de performance absolue.

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 programme vise un objectif de rendement régulier et un niveau de volatilité de 10%.

### Performances recalculées depuis le 1<sup>er</sup> janvier 2007 (base 100)



### Historique des performances annuelles recalculées depuis 2007



### Performances

Source : Seven Capital Management

	Cumulées		Annualisées	
	Programme	EONIA*	Programme	EONIA*
1 mois	-6,26 %			
YTD	+8,57 %			
1 an	+13,58 %	-0,48 %		
3 ans	+16,52 %	-1,32 %	+5,04 % / an	-0,43 % / an
5 ans	+40,97 %	-2,03 %	+6,86 % / an	-0,40 % / an
1 <sup>er</sup> janvier 2007	+264,88 %	+8,21 %	+8,85 % / an	+0,52 % / an

### Analyse de risque données mensuelles

Source : Seven Capital Management

	1 an	3 ans	5 ans	1 <sup>er</sup> janvier 2007
Volatilité	11,04 %	10,86 %	10,11 %	9,73 %
Ratio de Sharpe	1,19	0,46	0,68	0,91
Drawdown Max	-6,26 %	-11,62 %	-14,06 %	-14,06 %
Corrélation p				
vs. EuroStoxx 50	0,50	0,53	0,53	0,33
vs. Euro MTS 7-10	0,27	0,27	0,25	0,18

### Informations

Source : Seven Capital Management

Date de lancement	01/01/2007
Forme juridique attendue	SICAV Luxembourgeoise
Stratégie	Diversifiée
Région	Monde
Devise de référence	Euro
Affectation des résultats	Capitalisation
Code ISIN	
Code Bloomberg	

Encours sous gestion	
Valeur liquidative	
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 – 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

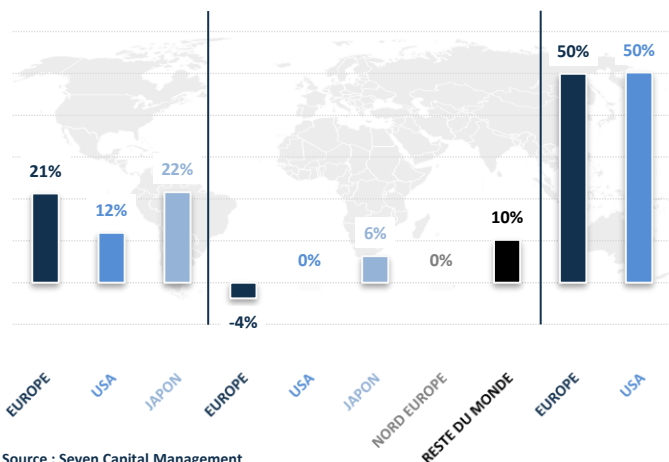
L'investisseur peut perdre tout ou partie du montant de capital investi, les OPC n'étant pas garantis en capital

SEPTEMBRE 2021 (données au 30/09/2021)

### Répartition par classe d'actif

Obligation d'Etats 55 %  
Indices Boursiers 13 %  
Actions 100 %

Ptf Duration : 3,32



Source : Seven Capital Management

### Commentaire du gérant

Notre fonds flexible diversifié de volatilité cible 10%, le Seven Force 10, clôture le mois de septembre en baisse de -6,26% contre -3,41% pour l'indice EuroStoxx 50 Net Return et -4,76% pour l'indice S&P 500.

Le fonds, comme les indices boursiers mondiaux, a souffert en septembre des tensions liées à la situation difficile du groupe immobilier chinois Evergrande et aux craintes inflationnistes au niveau mondial.

La forte exposition du fonds aux valeurs finlandaises aura constitué un des éléments de faiblesse majeur du portefeuille en septembre.

La bourse d'Helsinki abandonne ainsi plus de 5% en septembre (-5,45% pour l'indice HEX), principalement impactée par le très mauvais comportement des titres liés aux secteurs industriel et des matières premières (hors énergie).

Les valeurs financières européennes sont elles, assez logiquement, bien orientées en septembre, l'indice SX7P des valeurs bancaires européennes progressant de +3,67%.

Les titres Erste Group Bank Ag et ING Groep Nv contribuent ainsi positivement à la performance du fonds au cours du mois, Erste Group voyant son cours de bourse progresser de +12,40% et ING Groep de +7,42%.

Le portefeuille d'actions américaines lui affiche un recul important en septembre, impacté notamment par la mauvaise performance des titres Fedex (-17,23%) et Waters Corp (-13,70%).

La poche obligataire du fonds voit son niveau d'exposition diminuer significativement en septembre, passant de 146% à fin août à 55% à fin septembre.

Le Bund s'inscrit en recul de -1,48% sur le mois, les Tnotes 10-Year de -1,39% et le J.G.B de -0,24%.

### 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	3,01%	Voestalpine ag	Matières premières	Autriche	5 721	-16,56%	6	2,55%	Johnson controls internation		Etats-unis	41 905	-8,65%
2	2,97%	Kesko oyj-b shs		Finlande	11 565	-13,59%	7	2,20%	Stellantis nv		Pays-bas	51 709	-2,42%
3	2,62%	Publicis groupe	Medias	France	14 761	4,94%	8	2,16%	Asml holding nv	Technologie	Pays-bas	266 970	-8,32%
4	2,59%	Deutsche post ag-reg		Allemagne	67 504	-8,56%	9	1,75%	Neste oyj		Finlande	37 668	-4,99%
5	2,55%	Deere & co		Etats-unis	89 787	-11,10%	10	1,73%	Daimler ag-registered shares		Allemagne	82 078	7,42%

Poids du TOP 10 des positions dans le portefeuille : 24,1 %

### Principales variations actions du mois

Source : Seven Capital Management

#### Les meilleures performances

	Pondération	Société	Secteur	Pays	Capitalisation boursière	Δ sur le mois
1	0,86%	Erste group bank ag	Banques	Autriche	16 358	12,40%
2	0,88%	Omv ag	Energy	Autriche	17 077	11,19%
3	0,43%	Oneok inc	Energy	Etats-unis	22 335	10,42%
4	0,42%	Fifth third bancorp	Banques	Etats-unis	25 334	9,97%
5	1,36%	Covestro ag	Chimie	Allemagne	11 464	8,09%

Poids des 5 meilleures performances dans le portefeuille : 4,0 %

#### Les moins bonnes performances

	Pondération	Société	Secteur	Pays	Capitalisation boursière	Δ sur le mois
1	0,41%	Fedex corp	Industrial Goods and Services	Etats-unis	50 345	-17,23%
2	3,01%	Voestalpine ag	Matières premières	Autriche	5 721	-16,56%
3	0,40%	Waters corp	Industrial Goods and Services	Etats-unis	18 948	-13,70%
4	2,97%	Kesko oyj-b shs	Personal Care, Drug and Grocery Stores	Finlande	11 565	-13,59%
5	0,82%	Kone oyj-b	Industrial Goods and Services	Finlande	32 177	-13,47%

Poids des 5 moins bonnes performances dans le portefeuille : 7,6 %

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 – Agréé 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