Seven Alpha Beta Equity Europe

Stratégie Equity Europe avec Protection de Portefeuille Systématique et Dynamique

Se Libérer du « Timing » de la Couverture

ISR - ESG
SFDR ARTICLE - 8
INVESTISSEMENT SOCIALEMENT RESPONSABLE ENVIRONNEMENTAUX, SOCIAUX ET DE GOUVERNANCE

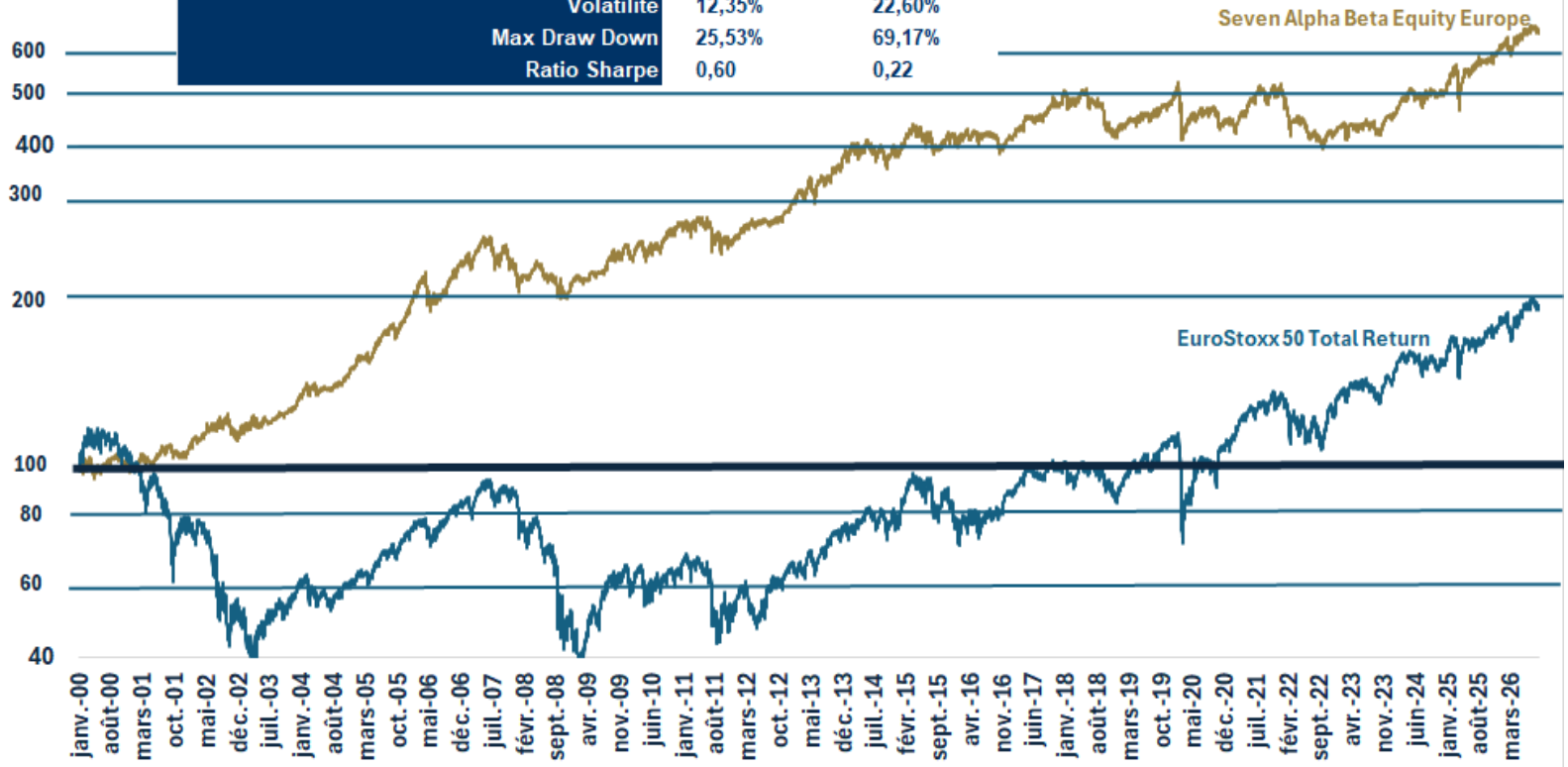
[Septembre 2026] Communication promotionnelle

SEVEN CAPITAL MANAGEMENT
39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tel. +33 1 42 33 04 05
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
www.amf-france.org
Les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures

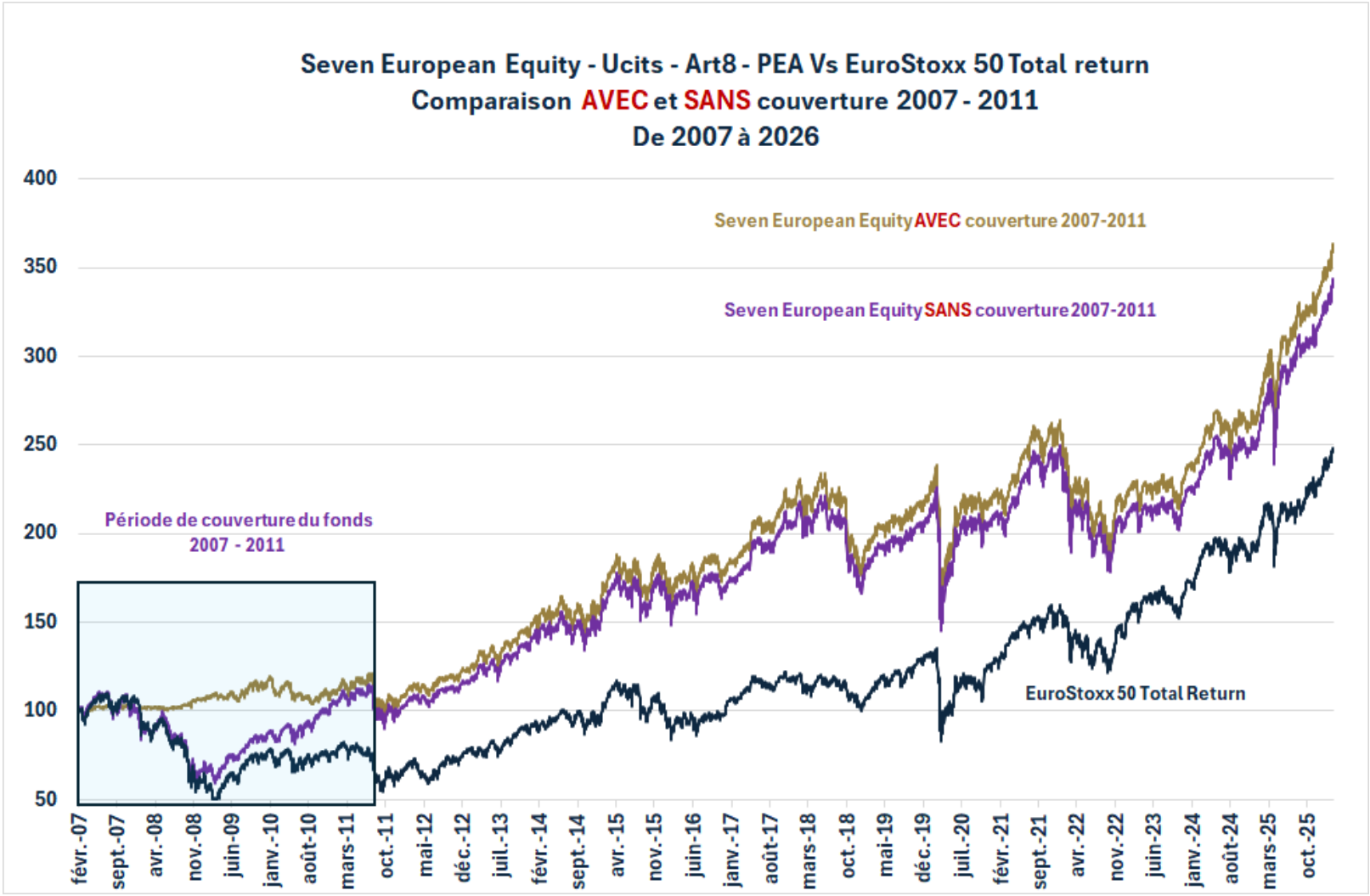
Une Stratégie Performante, Complémentaire des Stratégies Actions Classiques

Seven Alpha Beta Equity Europe Vs EuroStoxx 50 Total Return de 2000 - 2026-09

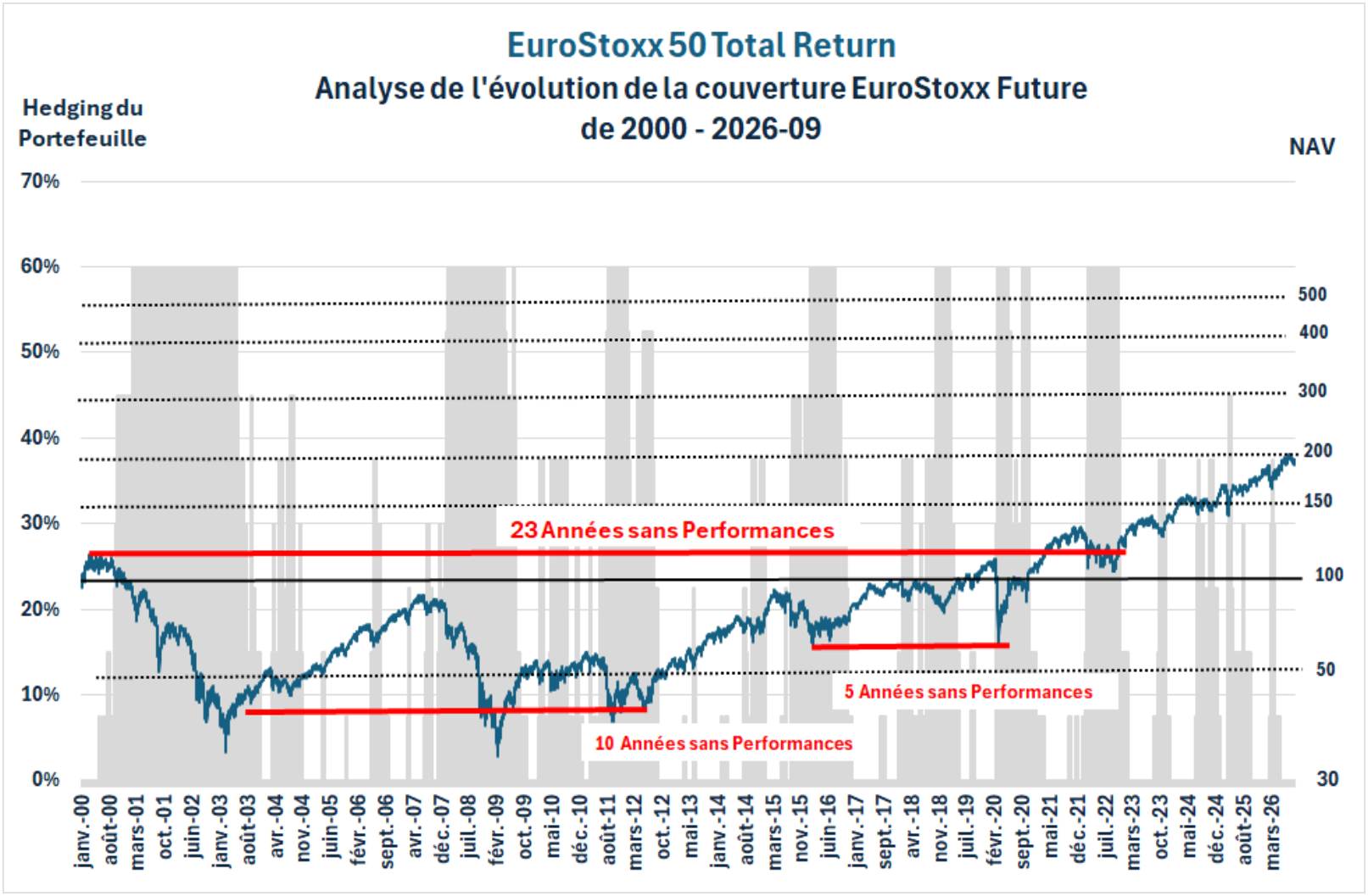
		Seven Alpha Beta	EuroStoxx Net
Start :	01-janv.-00		
End :	02-oct.-26		
	Total return	550,05%	90,45%
	Rendement annualisé	7,24%	2,44%
	Volatilité	12,35%	22,60%
	Max Draw Down	25,53%	69,17%
	Ratio Sharpe	0,60	0,22



Une Stratégie Éprouvée: Déjà Active de 2007 à 2011 Dans le Seven European Equity Fund



Vous Avez Dit « Market Timing » ?



Allocation de Coeur de Portefeuille : une Exposition Résiliente sur Actions Européennes

- **Large Exposition aux Actions Européennes**
  Portefeuille diversifié d'actions de grandes capitalisations de la zone euro sans contraintes sectorielles.
- **Approche d'Investissement Équilibrée**
  Approche d'investissement multi-stratégies (Momentum, Dividend Yield et Quantitatif Micro) sans biais de croissance ou de valeur.
- **Couverture Dynamique et Systématique Active dans les Phases de Baisse de Marché**
  Utilisation dynamique et systématique de nos modèles propriétaires Momentum et de futures EuroStoxx 50 pour couvrir le portefeuille en périodes de détérioration de marché.
- **Transparence et Liquidité**
  Transparence totale du portefeuille et liquidité quotidienne.
- **Intégration ESG**
  Approche ESG "Light Green" non exclusive. Rapport annuel ESG indépendant.
- **Fonds d'investissement Prêt pour l'Investisseur**
  Compartiment dédié d'un UCITS luxembourgeois, catégorisé comme SFDR art. 8

Seven Alpha Beta Equity Europe en 10 Points Clés

- 20 années de track record robuste sur la sélection de titres Large Cap de l'eurozone.
- Stratégie de gestion 100% active sur les marchés actions européens éprouvée par 20 ans de gestion du fonds Seven European Equity Fund.
- Approche de couverture systématique maîtrisée et appliquée avec succès par Seven Capital depuis plus de 30 ans.
- Une gestion à 2/3 systématique et 1/3 quantitative alliée à une stratégie de couverture dynamique de l'exposition marché exécutée par nos algorithmes propriétaires de Momentum.
- Sur-performance significative par rapport aux indices de marché depuis le lancement de la stratégie equity.
- Discipline et rigueur de l'approche systématique Momentum pour la couverture.
- Robustesse éprouvée au travers de nombreux cycles de marches depuis 2007.
- Diversification par rapport aux styles de gestion active classiques.
- Valorisation et liquidité quotidienne.
- UCITS de droit luxembourgeois, art. 8.

ISR - ESG
SFDR ARTICLE - 8
INVESTISSEMENT SOCIALEMENT RESPONSABLE ENVIRONNEMENTAUX, SOCIAUX ET DE GOUVERNANCE

Seven Alpha Beta Equity Europe : Un Portefeuille - 3 Approches Complémentaires

UNIVERS D'INVESTISSEMENT

QUANTITATIF SYSTÉMATIQUE
70%

MOMENTUM
35%

DIVIDENDE
35%

QUANTITATIF MICRO
30%

QUANTITATIF
30%

Stratégie Momentum : Processus de Construction du Sous-Portefeuille

1 Univers d'Investissement : Actions de l'Eurozone Affichant un Volume de Transaction Quotidien > 10M € + Volatilité < 30%

2 Les titres de l'univers sont triés selon un critère commun

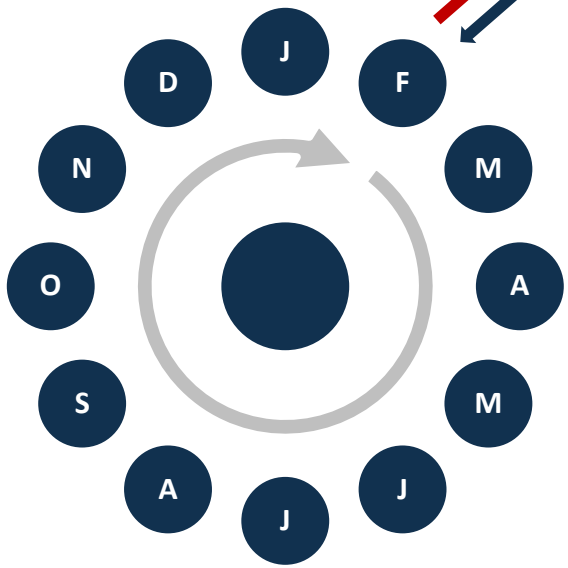
Rang 1
Rang 2
Rang 3
Rang 4
Rang n

10 Identification des titres appartenant au Top 10 de l'univers selon notre critère de sélection

3

Les titres détenus dans le sous-portefeuille depuis 1 an sont revendus

Le Top 10 du mois est intégré dans le sous-portefeuille pour 12 mois



- Pas de contrainte sectorielle
- Pas d'objectif de tracking error
- Une gestion 100% active

1/12ème du Sous-Portefeuille est sujet à changement chaque mois

Sous-Portefeuilles Systématiques : Momentum et Dividend Yield

SEVEN ALPHA BETA EQUITY EUROPE

	JAN	FEV	MAR	AVR	MAI	JUI	JUI	AOU	SEP	OCT	NOV	DEC
	1/12 8,3%											1/12 8,3%
MOMENTUM	Top 10 0,416%	.....										Top 10 0,416%
DIVIDENDE	Top 10 0,416%	.....										Top 10 0,416%

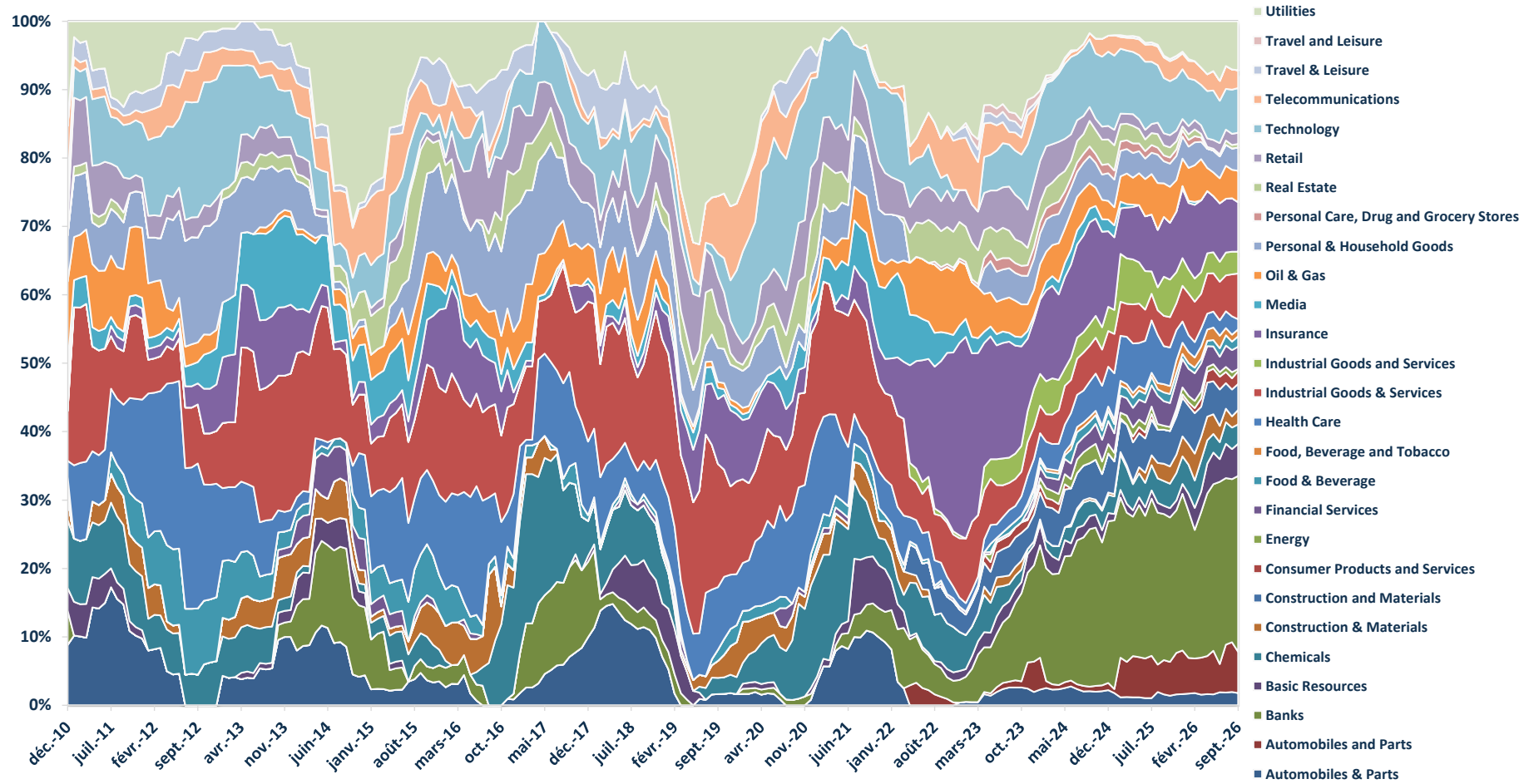
SEVEN ALPHA BETA EQUITY EUROPE

MICRO QUANTITATIF

- ✓ **ROIC**
- ✓ **Endettement VS EBIT / Endettement vs capital**
- ✓ **Marge opérationnelle**
- ✓ **Ratio Liquidité**
- ✓ **Free Cash Flow**
- ✓ **ROE**
- ✓ **Croissance des revenus forward**
- ✓ **Croissance des revenus passes**
- ✓ **Croissance des bénéfices passés**

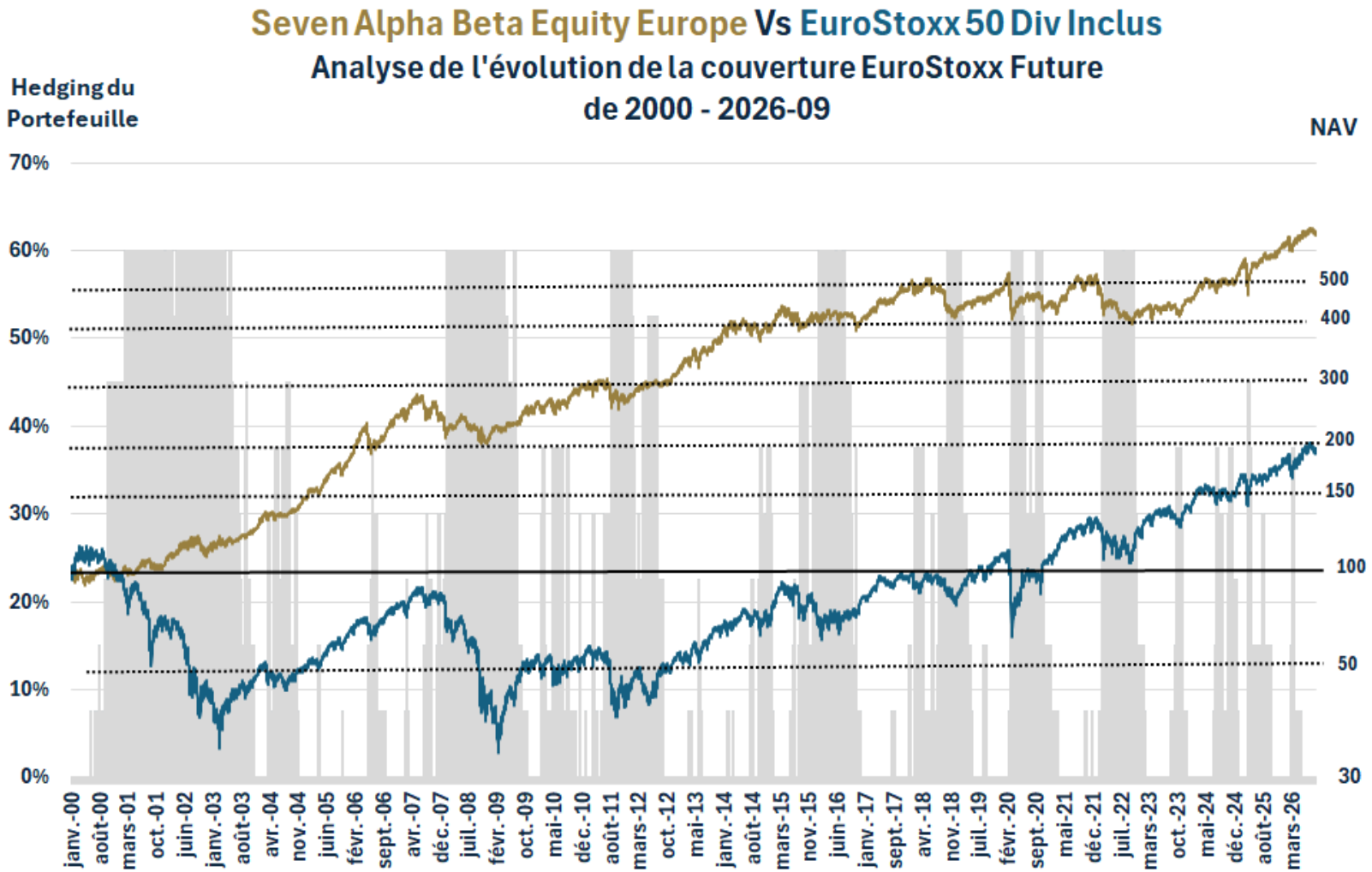
Seven European Equity Fund, un Fonds au Profil Sectoriel Evolutif

Evolution de la Structure Sectorielle du Portefeuille

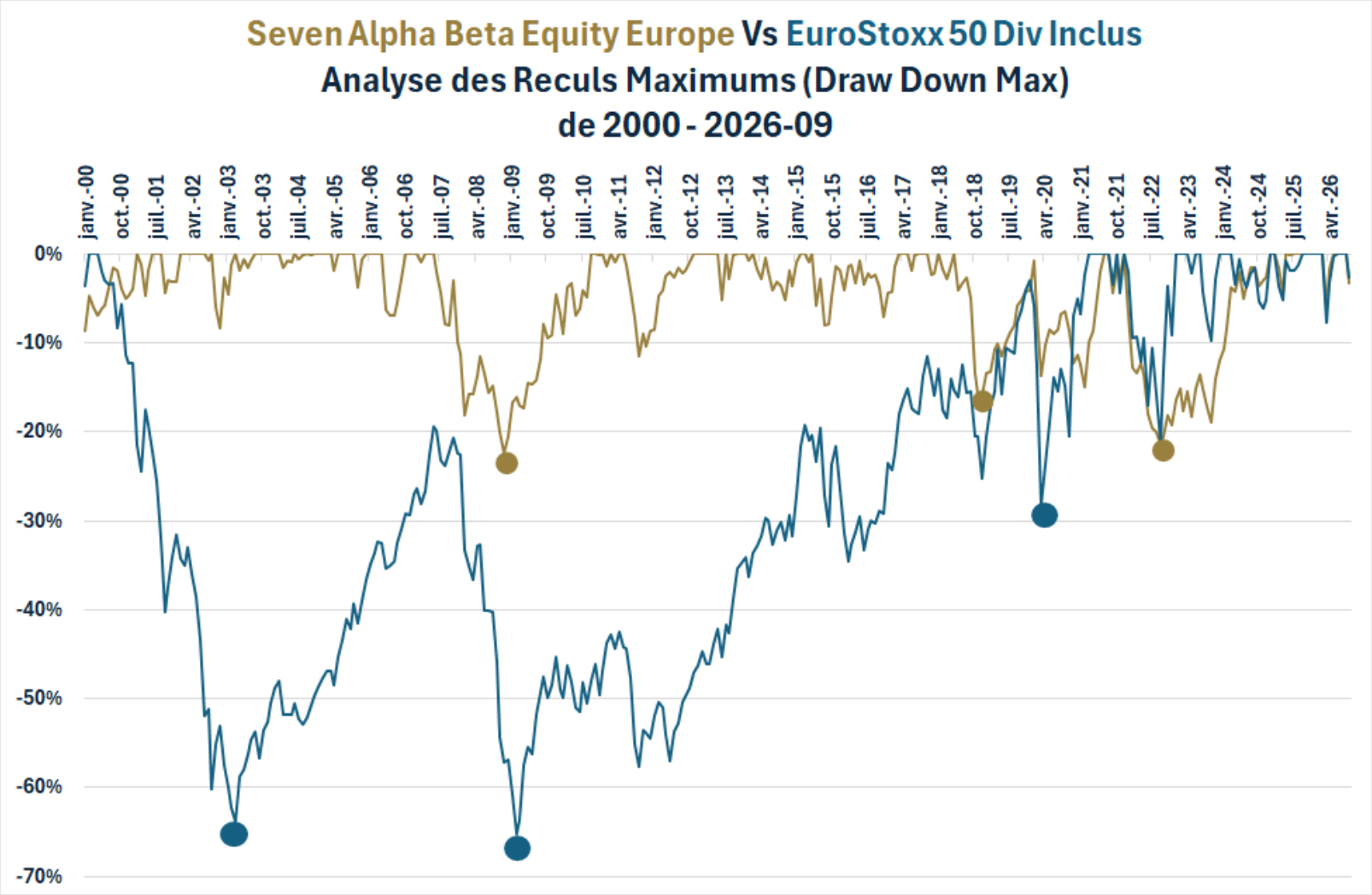


Source : Seven Capital Management

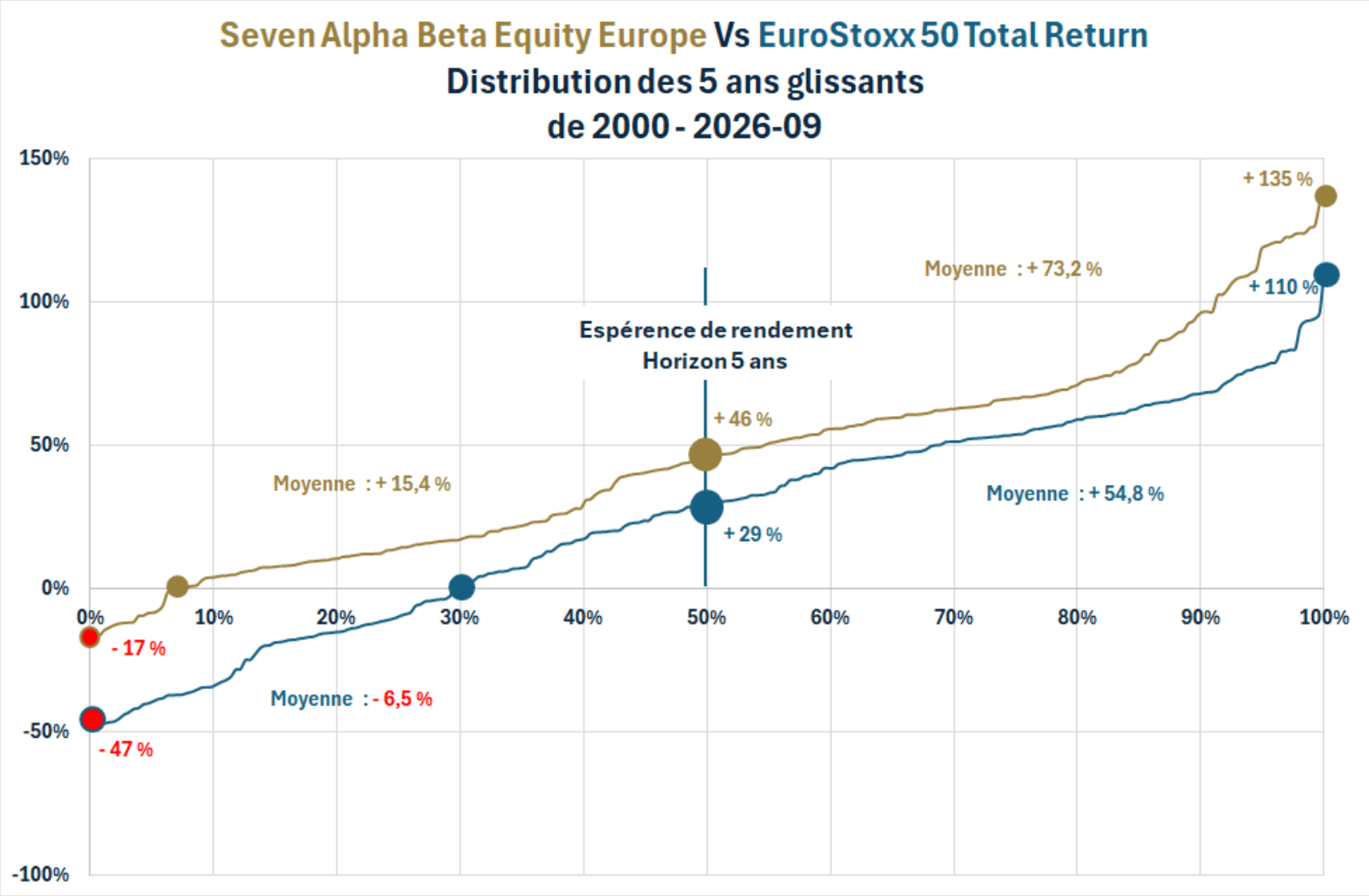
Une Couverture de Portefeuille Efficace Grâce au Momentum



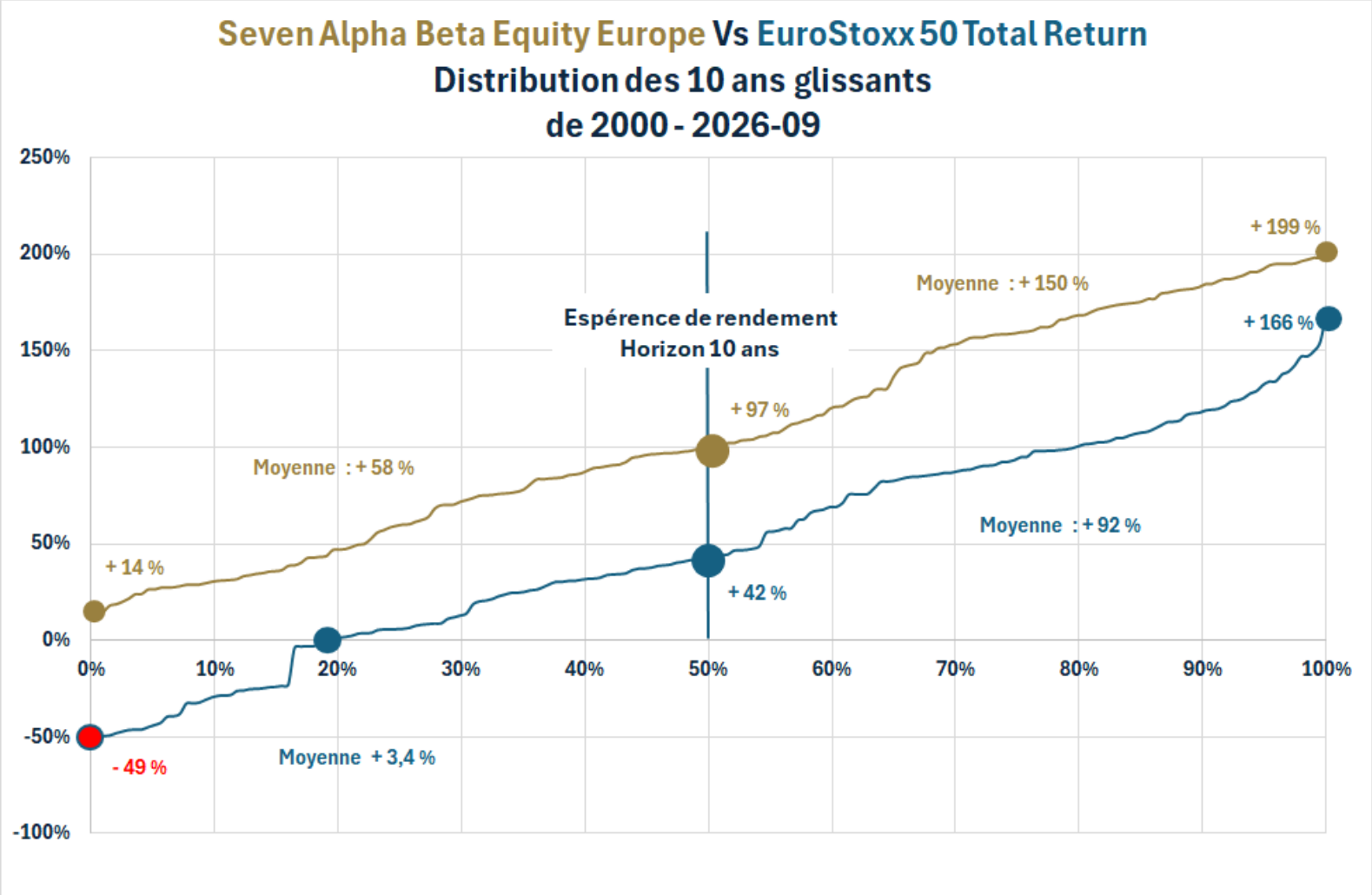
Evolution Comparative des DrawDowns



Un Investissement à 5 Ans à Forte Valeur Ajoutée !



… Et un Investissement à 10 Ans à Très Forte Valeur Ajoutée !

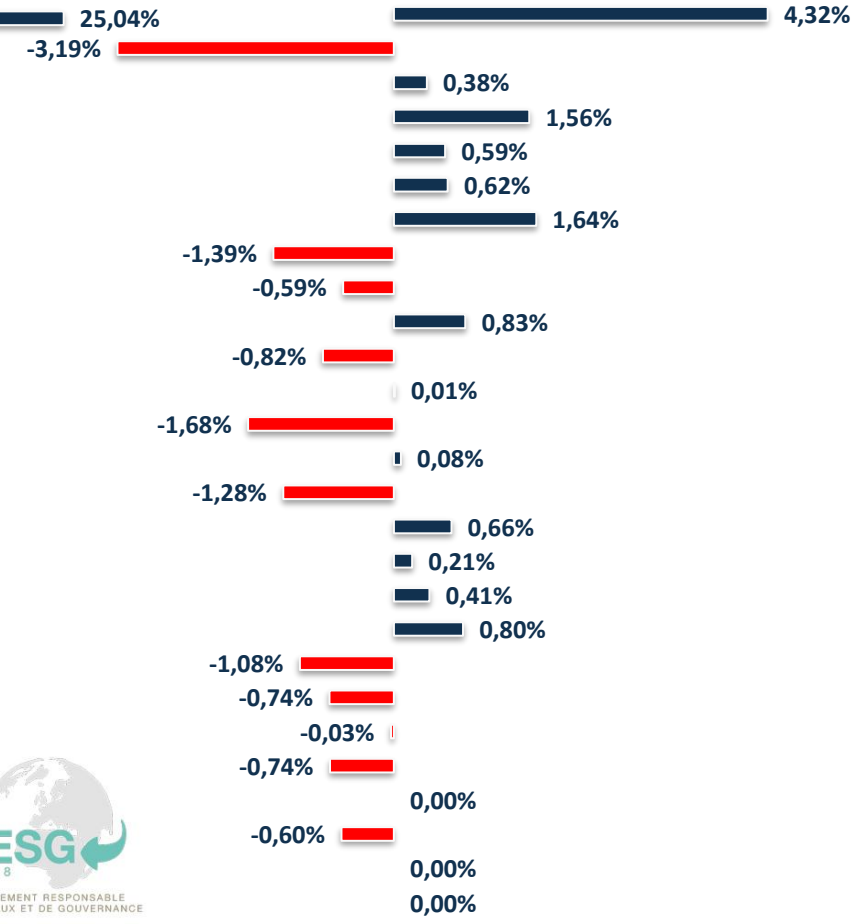


Revue de Portefeuille

31 mars 2026 - 30 septembre 2026 : revue de l'exposition sectorielle

Exposition Sectorielle Fin de Période

Variation de l'Exposition Sectorielle sur la Période



ISR - ESG
SFDR ARTICLE - 8
INVESTISSEMENT SOCIALEMENT RESPONSABLE ENVIRONNEMENTAUX, SOCIAUX ET DE GOUVERNANCE

Principales Caractéristiques – Seven Equity Alpha Beta Fund

Code ISIN	• EuroClass S : LU33255331422/ EuroClass I : LU3325331265/ EuroClass R : LU3325331349
Format	• SICAV de droit luxembourgeois UCITS – Article 8 – SFDR - PEA
Classification	• Fonds Actions Europe
Stratégie	• Momentum Investing / High Dividends systematic / Discretionary
Valorisation	• Quotidienne
Devise	• EUR – USD – CHF
Banque Dépositaire	• Banque de Luxembourg, 14 boulevard Royal, L-2449 Luxembourg
Valorisateur	• UI efa S.A., 2 rue d'Alsace, L-1122 Luxembourg
Auditeur	• Deloitte Audit, 20 boulevard de Kockelscheuer, L-1821 Luxembourg
Souscription minimum	• Classe S : 1 000 EUR / Classe I : 1 000 EUR / Class R : 100 EUR
Commission de gestion	• Classe S : maximum 0,5% / Classe I : maximum 1% / Classe R : maximum 1,50%
Commission de performance	• 15% maximum au-delà de l'indice EuroStoxx 50 Net Return

Informations Légales

Le présent document a été créé par Seven Capital Management, une société de gestion agréée par l'Autorité des Marchés Financiers en France le 13 septembre 2006 (Autorité des Marchés Financiers – AMF, http://www.amf-france.org) en tant que société de gestion de portefeuilles sous le numéro GP-06000045 et dont le siège social est situé 39, rue Marbeuf - 75008 Paris, France.

Le présent document n'a été établi qu'à des fins d'information et ne constitue ni une offre, ni une recommandation personnalisée, ni une sollicitation en vue d'acheter les produits ou services présentés. L'investisseur sera le seul juge du caractère bien-fondé des transactions qu'il peut conclure.

Seven Capital Management ne saura être tenue responsable de toute décision d'investissement ou de désinvestissement prise sur la base des informations contenues dans le présent site. Les informations, services et produits présentés sont susceptibles d'être modifiés sans préavis.

La souscription de parts ou d'actions d'OPCVM peut présenter certains risques. Les OPCVM ne sont ni garantis ni protégés, leur valeur nette d'inventaire peut augmenter ou diminuer en fonction des fluctuations du marché et il est possible que les investisseurs ne récupèrent pas les sommes investies.

En outre, préalablement à toute transaction, les investisseurs doivent :

- **se familiariser avec le document d'informations clés pour l'investisseur et le prospectus de chaque OPCVM, comprendre la nature de l'investissement sélectionné, ses caractéristiques et ses risques.**
- **s'assurer que les investissements sélectionnés sont appropriés, qu'il s'agisse de leur situation financière, des objectifs d'investissement ou des risques que les investisseurs sont préparés à accepter.**

Veuillez noter que les chiffres se réfèrent à des simulations des performances passées et les performances passées ne préjugent pas des performances futures. Par conséquent, les décisions d'investissement ne doivent pas se fonder essentiellement sur les performances passées : d'autres éléments, détaillés dans les fiches descriptives de chaque OPCVM, doivent être pris en compte. Les documents d'informations clés pour l'investisseur et les prospectus des OPCVM présentés peuvent être obtenus auprès de Seven Capital Management sur demande écrite à info@seven-cm.com, ou à partir du site Internet de la société, www.seven-cm.com

Enfin, l'imposition à laquelle est soumis tout investissement dans des parts ou des actions d'OPCVM dépend de la situation personnelle de chaque investisseur. Il est par conséquent recommandé aux investisseurs de consulter leur conseiller fiscal.

Document d'information sans valeur contractuelle.

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 Waystone Fund Services (Switzerland) SA, Av. Villamont 17, 1005 Lausanne, Suisse, Tel : +41 21 311 17 77, Email : switzerland@waystone.com. Le service de paiement du Fonds en Suisse est la Helvetische Bank, SeefeldStrasse 215, 8008 Zürich, Suisse, Tel: +41 44 204 56 00, Email : info@helvetischebank.ch.