



www.seven-cm.com

## SEVEN CAPITAL MANAGEMENT

### SYNTHÈSE

**Un Gestionnaire expérimenté : spécialiste des stratégies macro-systématiques** depuis plus de 26 ans, l'équipe de gestion a construit son succès à partir d'une longue expérience acquise dans la gestion alternative (Rivoli fund Management) et les activités de marché en banque (SG Warburg, BNP)

Basée à Paris, Seven Capital est réglementée par l'AMF et la CSSF.

**Un processus de gestion clair et systématique:** le principe de gestion appliqué à tous les fonds gérés par Seven Capital repose:

- d'une part sur la recherche des tendances de marché (momentum) à partir d'analyses quantitatives,
- d'autre part sur des techniques d'allocations d'actifs permettant d'ajuster les risques à la dynamique des marchés et à la structure globale des portefeuilles .

Chaque fonds est ainsi **rebalancé quotidiennement** à partir du couple risque/rendement souhaité et des contraintes du processus.

Par ailleurs Seven Capital a pour principe de n'utiliser pour tous ses fonds que des **sous-jacents à forte liquidité** (marchés à terme régulés, actions grande capitalisation et obligations ou bons du trésor souverains)

### **Une gamme de fonds ultra-liquides...**

La gamme de fonds se décompose en deux univers :

#### **1. un univers long only UCITS composé des compartiments d'une SICAV Luxembourgeoise :**

- un fonds actions européennes grandes capitalisations
- un fonds absolute return taux/actions de volatilité cible 2%
- un fonds absolute return taux/actions de volatilité cible 5%
- un fonds absolute return taux/actions de volatilité cible 10%

#### **2. un univers long-short directionnel**

- un AMC (Active Managed Certificate) multi-actifs long short directionnel avec cible de volatilité 10% ; celui-ci est émis par Natixis.

**Tous les fonds/AMC de la gamme sont valorisées quotidiennement et les souscriptions/rachats se font sur base quotidienne.**

### **...et entièrement personnalisables**

Le processus de gestion systématique de Seven Capital permet de construire des véhicules adaptés aux profils de risques souhaités par les investisseurs qui peuvent choisir leur cible de volatilité et par conséquent choisir leur niveau de draw-down max, leur univers (long-only ou long short) et la structure du véhicule (fonds, compartiment dédié, AMC)

A titre d'exemple l'AMC de volatilité 10% a une espérance de rendement de 10% et un max draw-down indicatif autour de 15%.

Un AMC avec une volatilité cible de 20% aurait une espérance de rendement de 20% et un max draw-down de 27%.