



# Gamme Seven Force

*Performance absolue et Risque choisi*



**ISR - ESG**  
SFDR ARTICLE - 8

INVESTISSEMENT SOCIALEMENT RESPONSABLE  
ENVIRONNEMENTAUX, SOCIAUX ET DE GOUVERNANCE

[Mise à jour au 31 juillet 2024]

SEVEN CAPITAL MANAGEMENT

39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tel. +33 1 42 33 04 05

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](http://www.seven-cm.com)

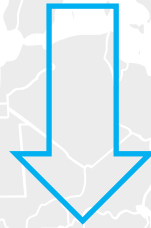
[www.amf-france.org](http://www.amf-france.org)

Les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures

## Transformation de la gamme existante

Euro Low Volatility

Seven Diversified



# SEVEN FORCE

Gamme Long Only de Performance Absolue

**SEVEN FORCE 2**

**SEVEN FORCE 5**

**SEVEN FORCE 10**

SEVEN CAPITAL MANAGEMENT

39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tel. +33 1 42 33 04 05

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](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

## OBJECTIFS

➤ Fournir une performance absolue décorrélée de tout indice dans un univers :

- ultra liquide : actions large cap et marchés à terme régulés
- diversifié : actions monde / taux d'intérêt monde

➤ Choisir son degré de risque

➤ Contrôler les reculs

SEVEN FORCE 2

SEVEN FORCE 5

SEVEN FORCE 10

SEVEN CAPITAL MANAGEMENT

39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tel. +33 1 42 33 04 05

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](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

## OBJECTIFS

**SEVEN FORCE 2**

**SEVEN FORCE 5**

**SEVEN FORCE 10**

**RENDEMENT**

2%

5%

10%

**VOLATILITÉ**

2%

6%

10%

**Recul potentiel**

3%

9%

15%

**MÊME  
UNIVERS**

**SEVEN**

**FORCE 2  
FORCE 5  
FORCE 10**

**MÊME  
PROCESSUS**

**SEVEN CAPITAL MANAGEMENT**

39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tel. +33 1 42 33 04 05

Société par Actions Simplifiée SAS – Agréée par l'AMF N° GP 06000045 – Capital de 560 000 euros – RCS B 491 390 464

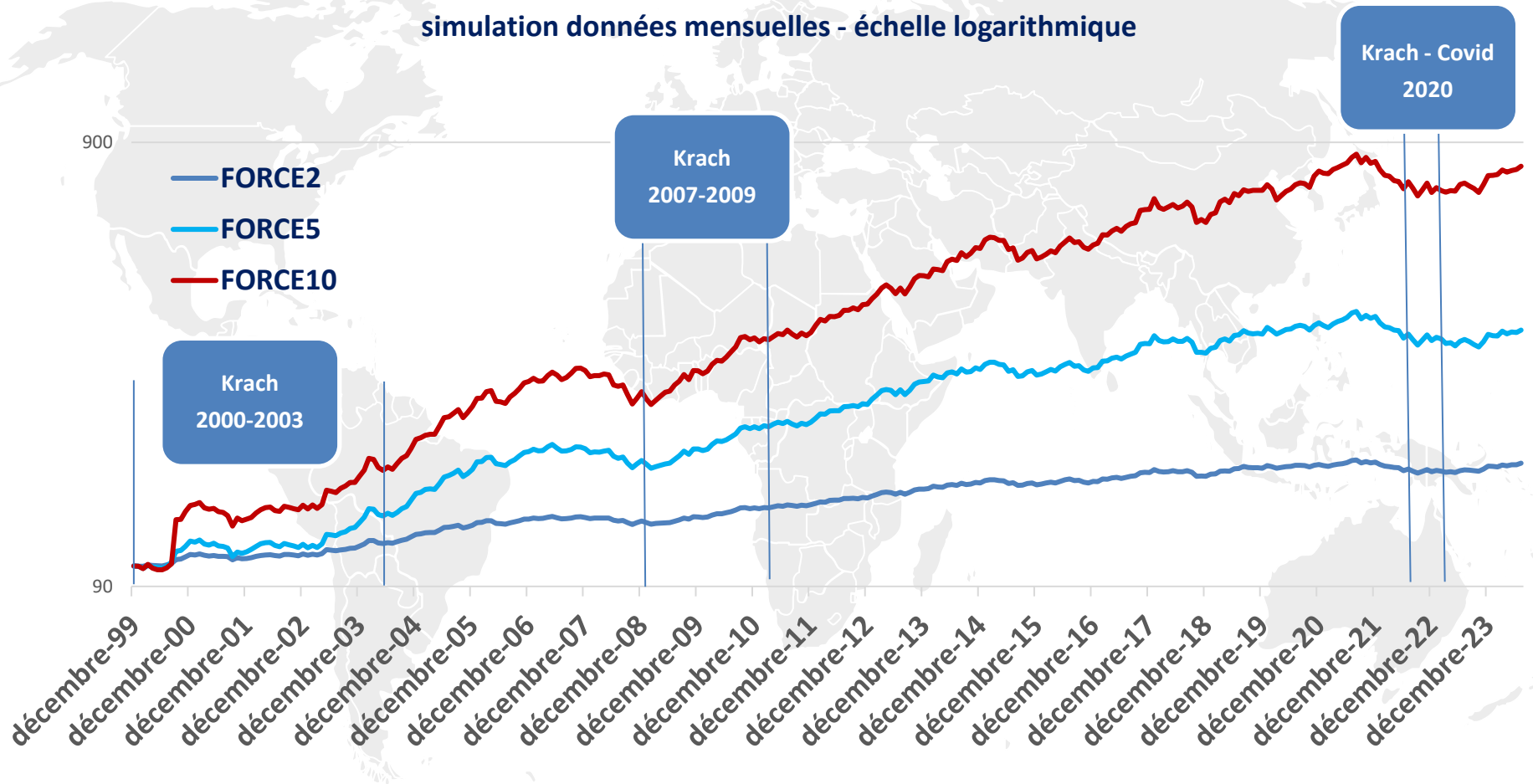
[www.seven-cm.com](http://www.seven-cm.com)

[www.amf-france.org](http://www.amf-france.org)



# GAMME SEVEN FORCE – Performance Absolue

simulation données mensuelles - échelle logarithmique



SEVEN CAPITAL MANAGEMENT

39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tel. +33 1 42 33 04 05

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](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



# PROCESSUS D'INVESTISSEMENT

**SEVEN CAPITAL MANAGEMENT**

39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tel. +33 1 42 33 04 05

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

## PROCESSUS D'INVESTISSEMENT: 4 PRINCIPES

- actions large cap
- futures sur indices et taux
- emprunt d'état zone euro court terme

**LIQUIDITÉ**

- contrôle de la volatilité
- contrôle des reculs

**FLEXIBILITÉ**

**MOMENTUM**

- moyen-terme / long-terme
- prix des actifs - Risk / indicateurs macro

**SYSTÉMATIQUE**

- rigueur et discipline
- ni émotion ni biais

SEVEN CAPITAL MANAGEMENT

39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tel. +33 1 42 33 04 05

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](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

## UNIVERS D'INVESTISSEMENT : PRINCIPE DE LIQUIDITÉ

### TAUX

#### Futures sur emprunt d'état



US : 5,10,30 ans



Europe : 5,10 ans



Japon : 10 ans

### ACTIONS

#### Titres vifs



US large cap



Europe large cap

#### Indices boursiers

#### FUTURES

- S&P500
- EuroStoxx 50
- Nasdaq
- Nikkei
- Nifty
- FTSE Taiwan
- MSCI Singapour
- Hangseng

### LIQUIDITÉS

#### Bons du Trésor



État zone euro  
maturité < 12 mois

## PROCESSUS D'INVESTISSEMENT: 3 ÉTAPES

### 1/ ALLOCATION MAX THÉORIQUE

Fonction de :

- volatilité
- Reculs potentiels

### 2/ POSITIONNEMENT

Fonction de :

- indicateurs macros
- Indicateurs techniques

### 3 ALLOCATION FINALE

SEVEN CAPITAL MANAGEMENT

39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tel. +33 1 42 33 04 05

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](http://www.seven-cm.com)

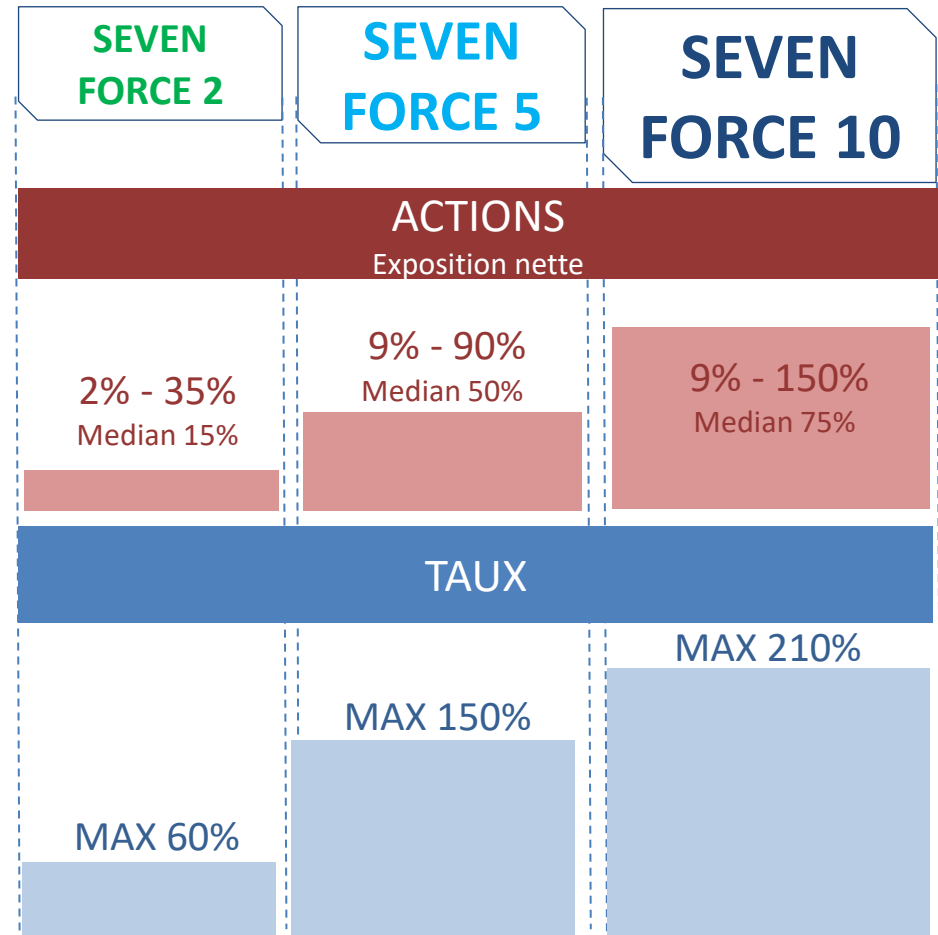
[www.amf-france.org](http://www.amf-france.org)

Les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures

## ÉTAPE 1 : ALLOCATION MAX THÉORIQUE

Les **MAX** par classe sont définis pour respecter contraintes de :

- **volatilité**
- **Reculs potentiels**



**SEVEN CAPITAL MANAGEMENT**

39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tel. +33 1 42 33 04 05  
 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](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

## ÉTAPE 2 : POSITIONNEMENT : PRINCIPE DE MOMENTUM SYSTÉMATIQUE

A l'intérieur de chaque classe et **pour chaque marché**, l'allocation finale est déterminée et ajustée **quotidiennement** en utilisant **trois approches distinctes** :

### 1 Momentum macro



- Les indicateurs économiques donnent le pouls de l'économie mondiale
- Analyser leurs tendances apporte des informations précieuses
- Des coupes-circuits sont mis en place pour palier les risques de découplage entre macroéconomie et marchés boursiers

### 2 Momentum de prix



- Des stratégies d'investissement ayant fait leur preuve
- La loi de Newton appliquée à l'investissement :  
« à moins que des forces et facteurs extérieurs ne s'exercent, la dynamique d'un marché devrait rester la même »

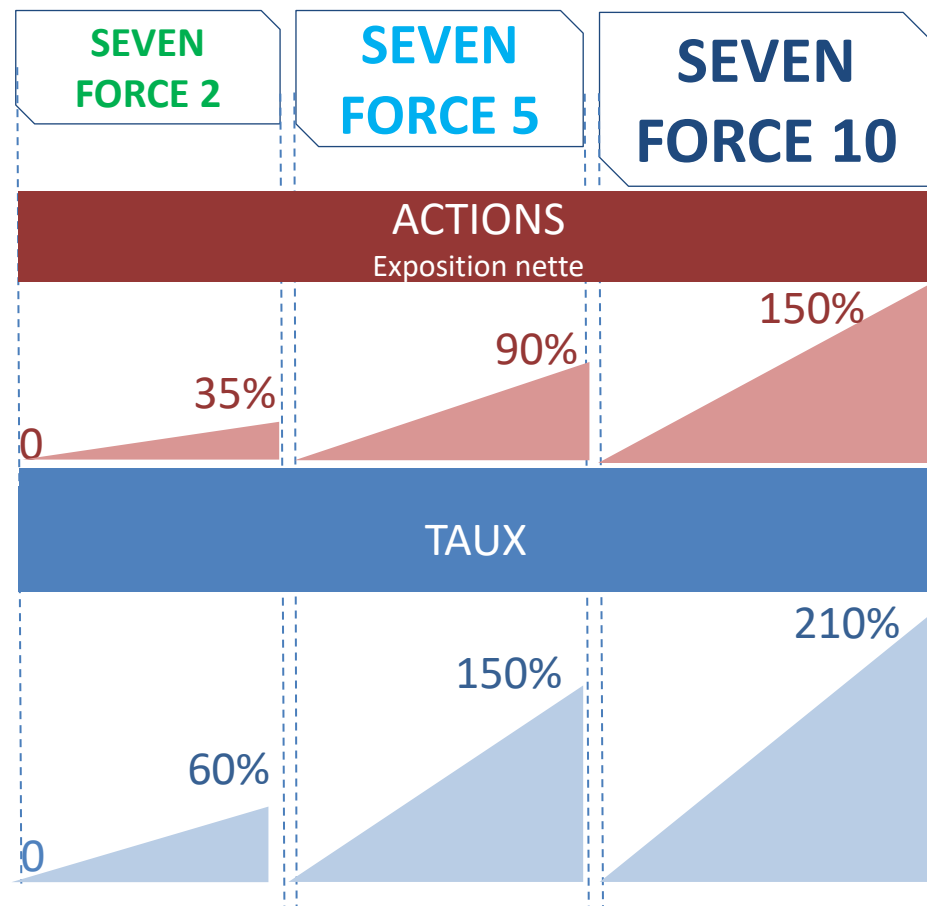
### 3 Momentum de risque



- Un niveau élevé de volatilité est associé à un marché baissier
- Un faible niveau de volatilité est associé à un marché haussier

## ÉTAPE 3 : ALLOCATION FINALE : PRINCIPE DE FLEXIBILITÉ

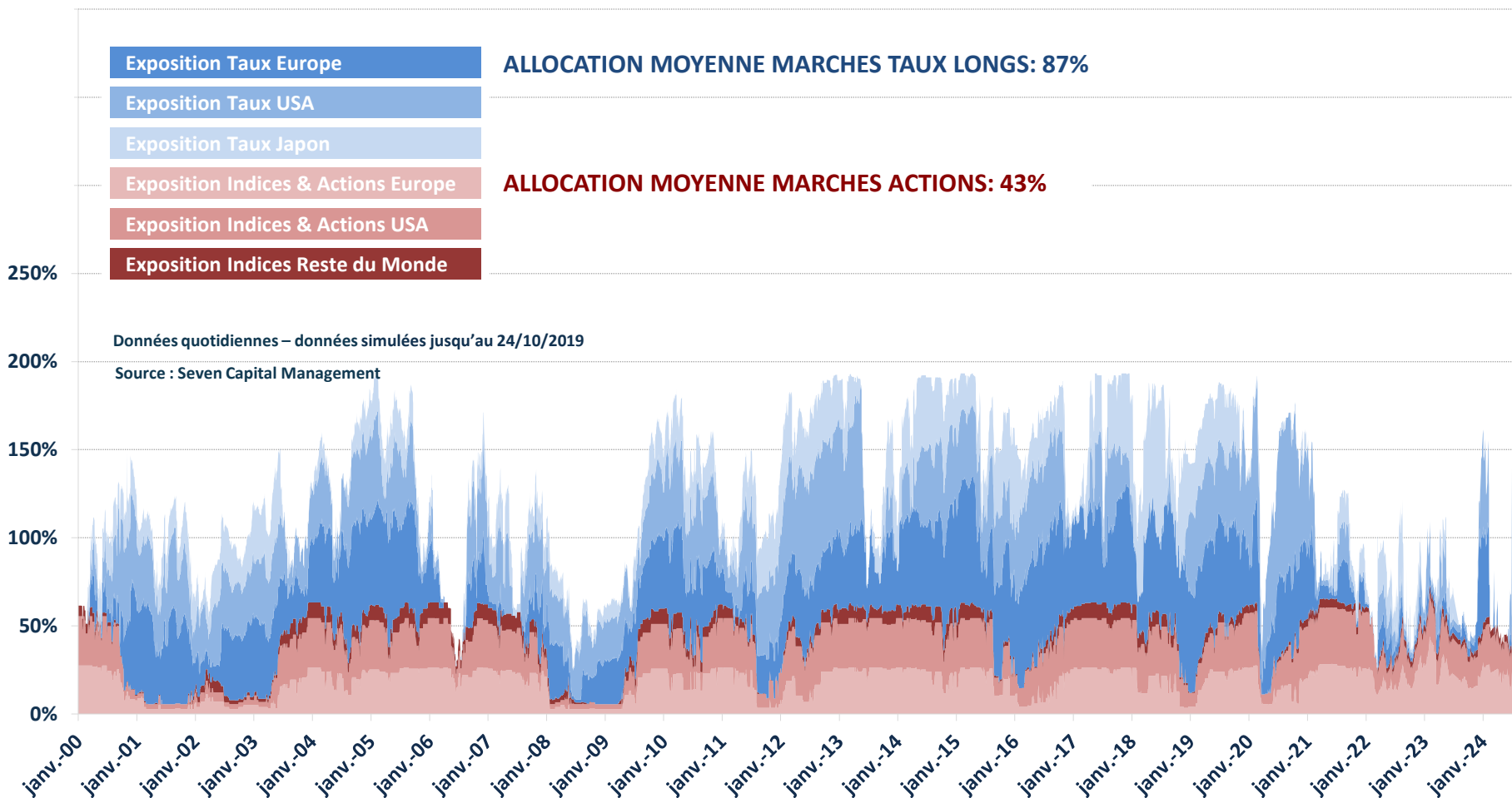
Le principe de **FLEXIBILITÉ** peut amener à des expositions nettes nulles sur les taux et les actions





Exposition

# SEVEN FORCE 5 – Illustration Flexibilité



SEVEN CAPITAL MANAGEMENT

39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tel. +33 1 42 33 04 05

Société par Actions Simplifiée SAS – Agréée par l'AMF N° GP 06000045 – Capital de 560 000 euros – RCS B 491 390 464

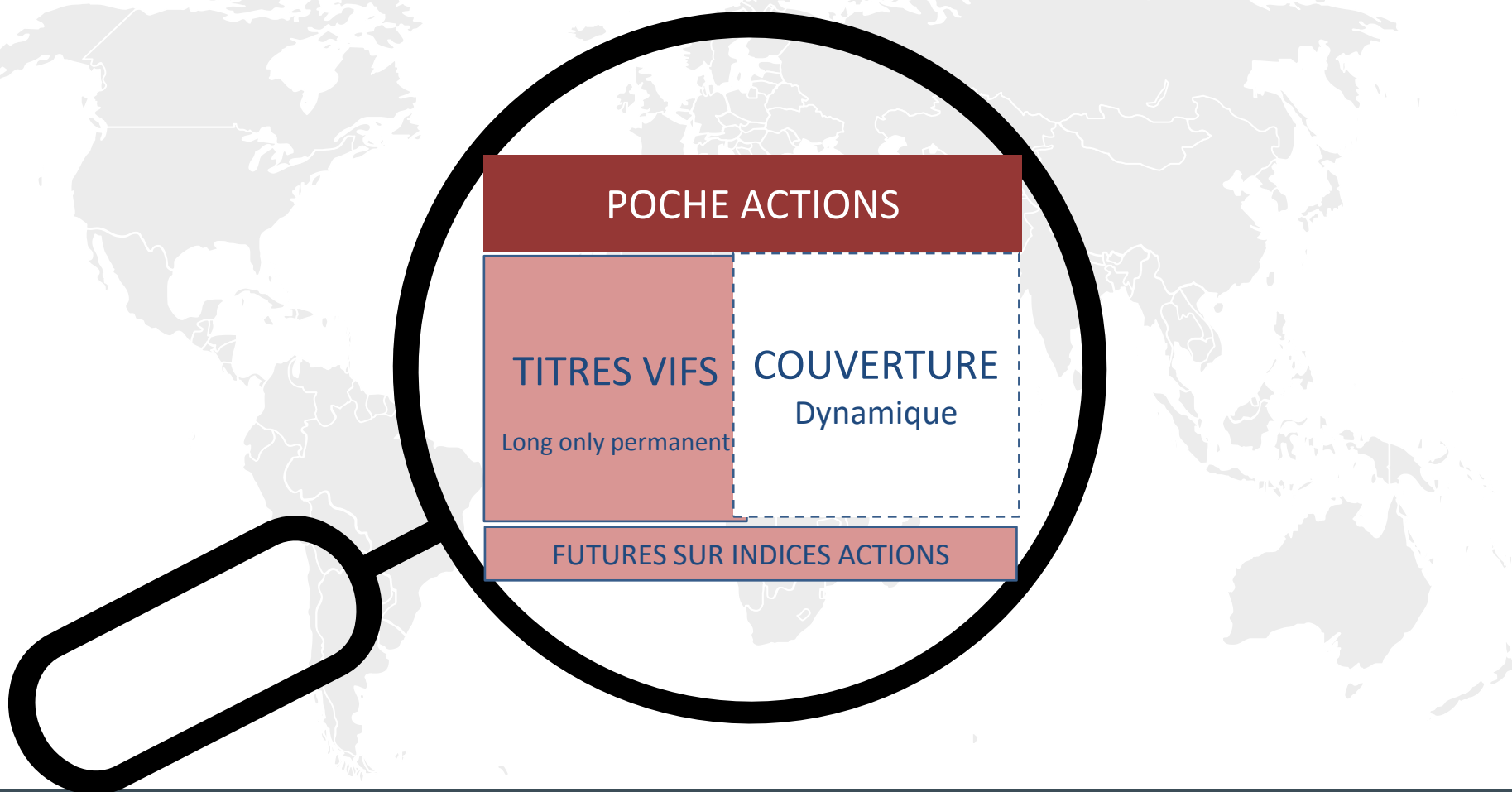
www.seven-cm.com

www.amf-france.org

Les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures



## PROCESSUS D'INVESTISSEMENT: ALLOCATION – Détail POCHÉ ACTIONS



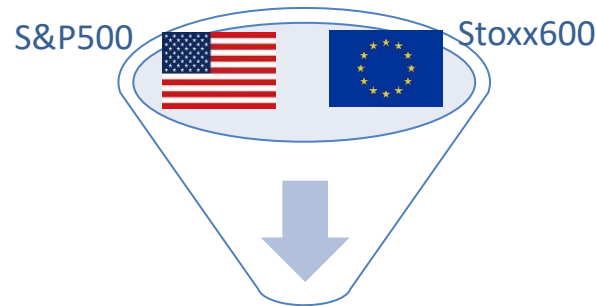
**SEVEN CAPITAL MANAGEMENT**

39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tel. +33 1 42 33 04 05  
 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)

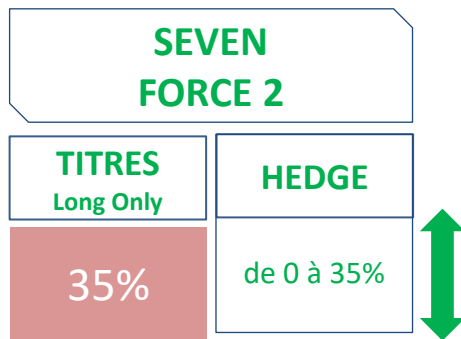
Les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures



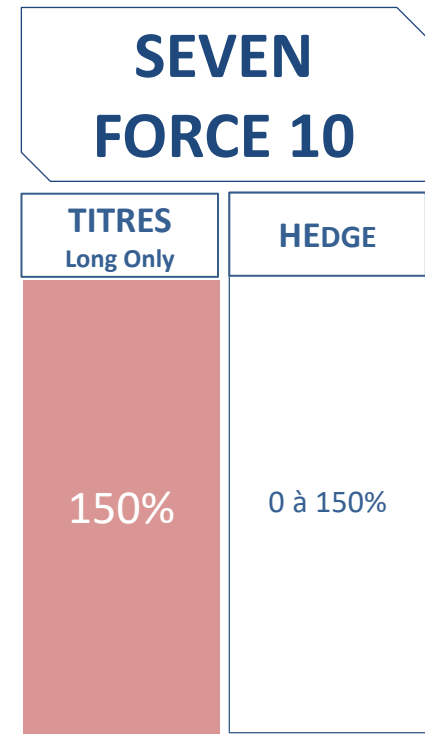
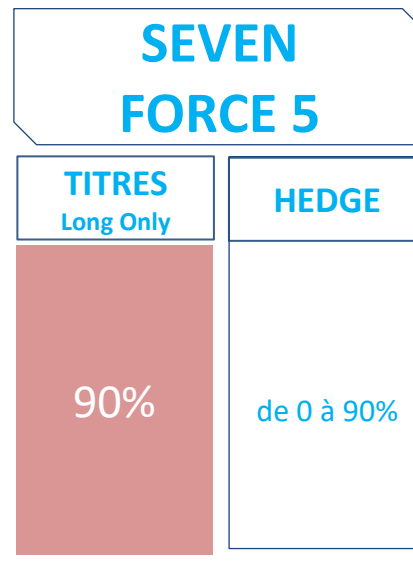
# PROCESSUS D'INVESTISSEMENT: Détail POCHÉ ACTIONS – TITRES VIFS



La sélection de titres est la même pour tous les fonds de la gamme Seven Force.



## SELECTION TITRES

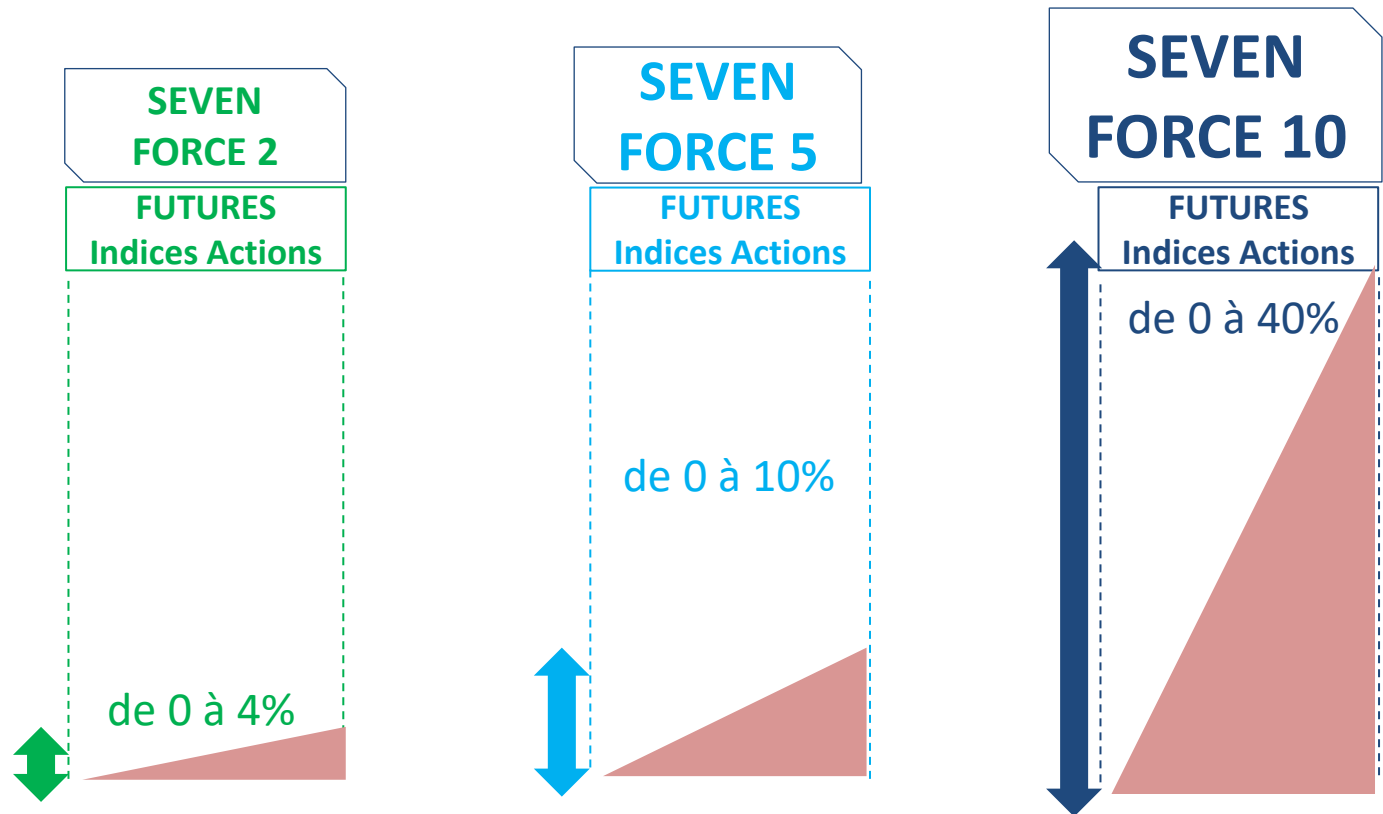
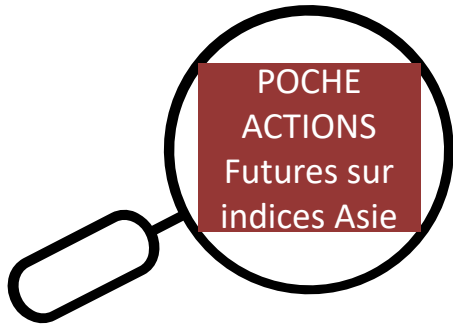


SEVEN CAPITAL MANAGEMENT

39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tel. +33 1 42 33 04 05  
 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](http://www.seven-cm.com)  
[www.amf-france.org](http://www.amf-france.org)



# PROCESSUS D'INVESTISSEMENT: Détail POCHE ACTIONS Asie FUTURES INDICES



## SEVEN CAPITAL MANAGEMENT

39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tel. +33 1 42 33 04 05  
 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](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





# ANALYSE PERFORMANCES

**SEVEN CAPITAL MANAGEMENT**

39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tel. +33 1 42 33 04 05

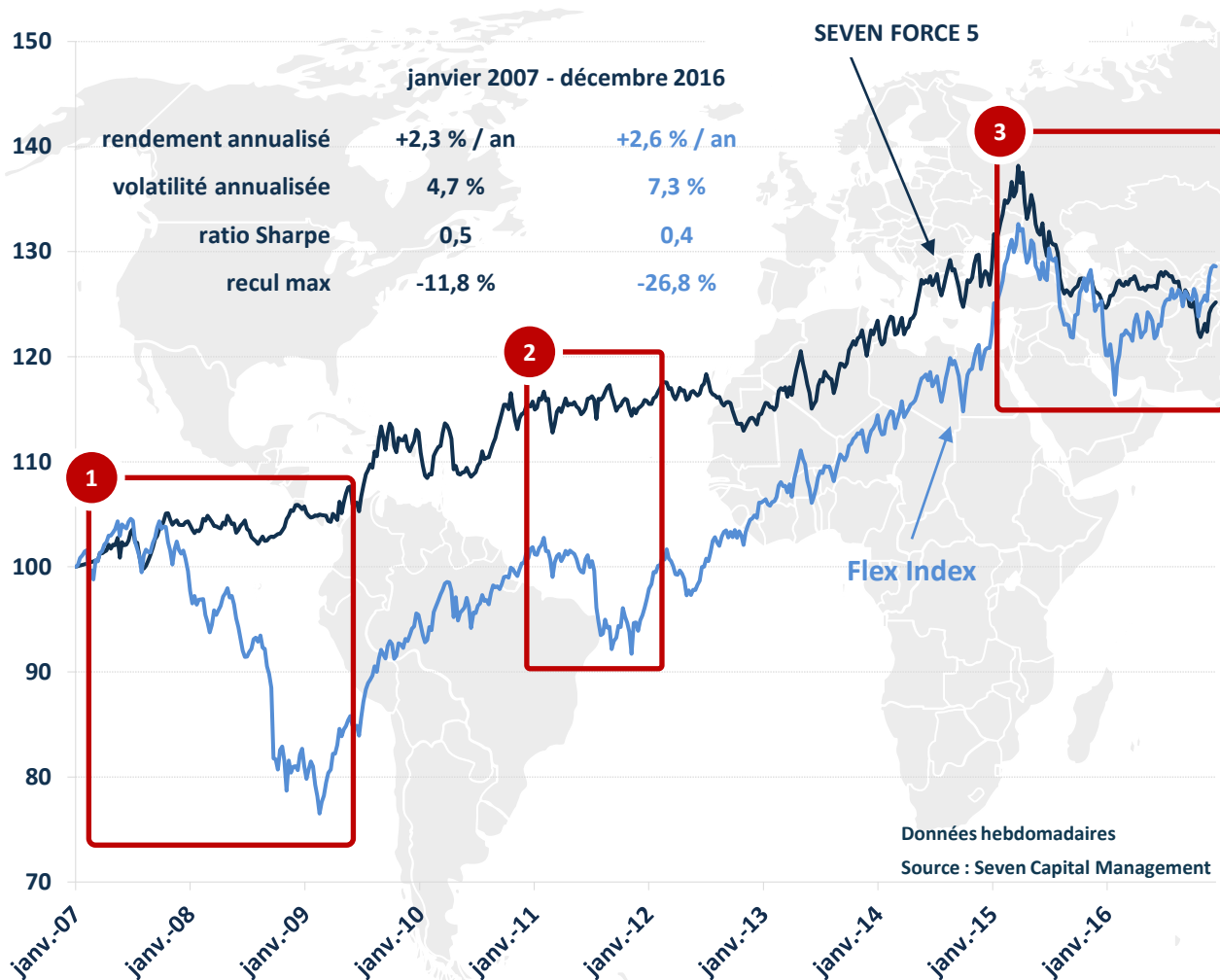
Société par Actions Simplifiée SAS – Agréé par l'AMF N° GP 06000045 – Capital de 560 000 euros – RCS B 491 390 464

[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

# SEVEN FORCE 5 Analyse VERSION 1 – allocation par nominal (2007 -2016)



- 1 Crise financière de 2008**  
13 juillet 2007 – 6 mars 2009

SEVEN FORCE 5	+1,6 %
Flex Index	-26,8 %

**Année calendaire 2008**

SEVEN FORCE 5	+1,8 %
Flex Index	-20,6 %
- 2 Crise de la dette souveraine de 2011**  
18 février 2011 – 25 novembre 2011

SEVEN FORCE 5	-2,0 %
Flex Index	-10,8 %
- 3 Séquence de drawdown max**  
10 avril 2015 – 11 novembre 2016

SEVEN FORCE 5	-11,8 %
Flex Index	-12,2 %

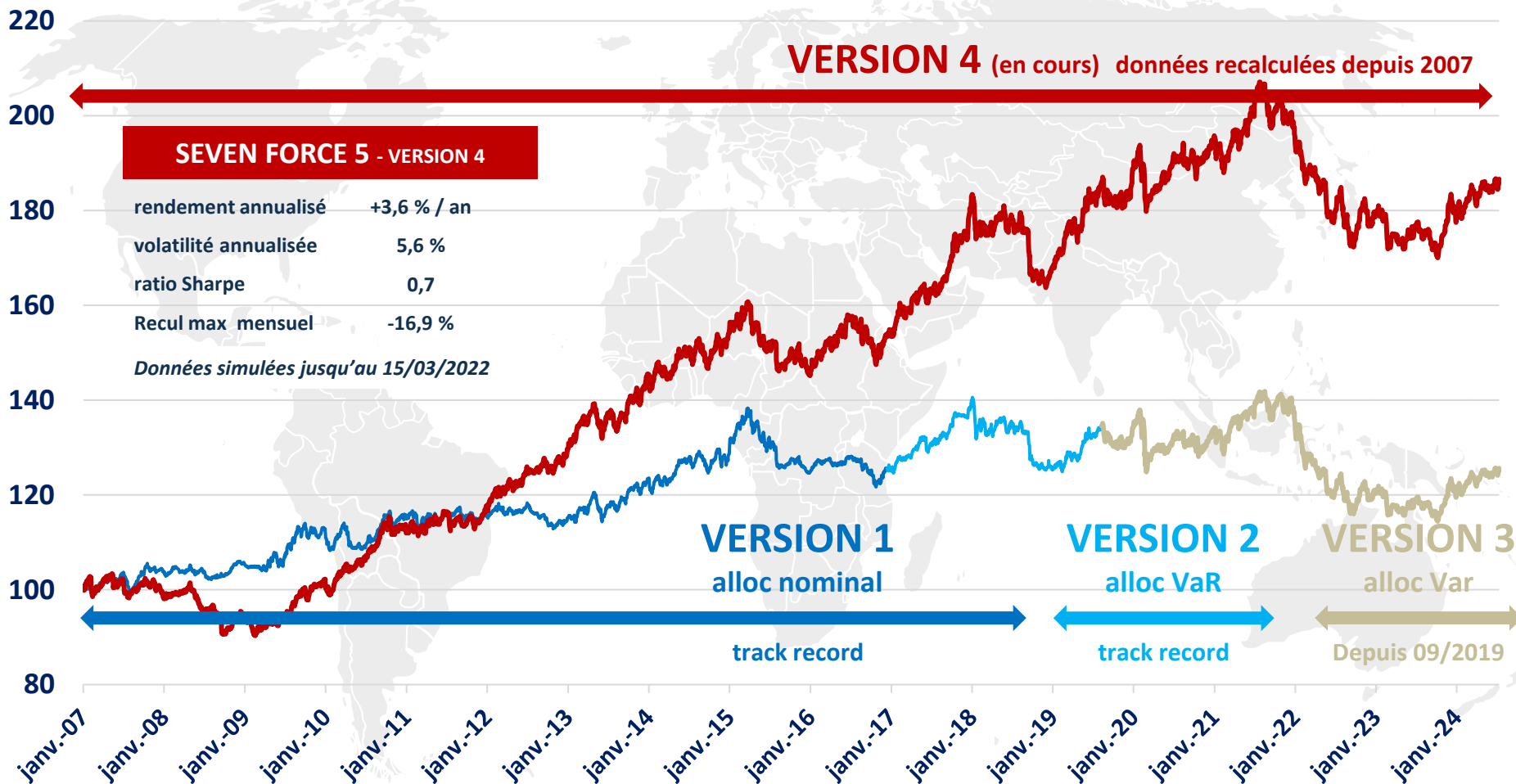
SEVEN CAPITAL MANAGEMENT

39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tel. +33 1 42 33 04 05  
 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](http://www.seven-cm.com)  
[www.amf-france.org](http://www.amf-france.org)



# SEVEN FORCE 5 VERSION 4 vs VERSION 1 & 2 & 3

## SEVEN FORCE 5 Version V4



SEVEN CAPITAL MANAGEMENT

39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tel. +33 1 42 33 04 05

Société par Actions Simplifiée SAS – Agréée par l'AMF N° GP 06000045 – Capital de 560 000 euros – RCS B 491 390 464

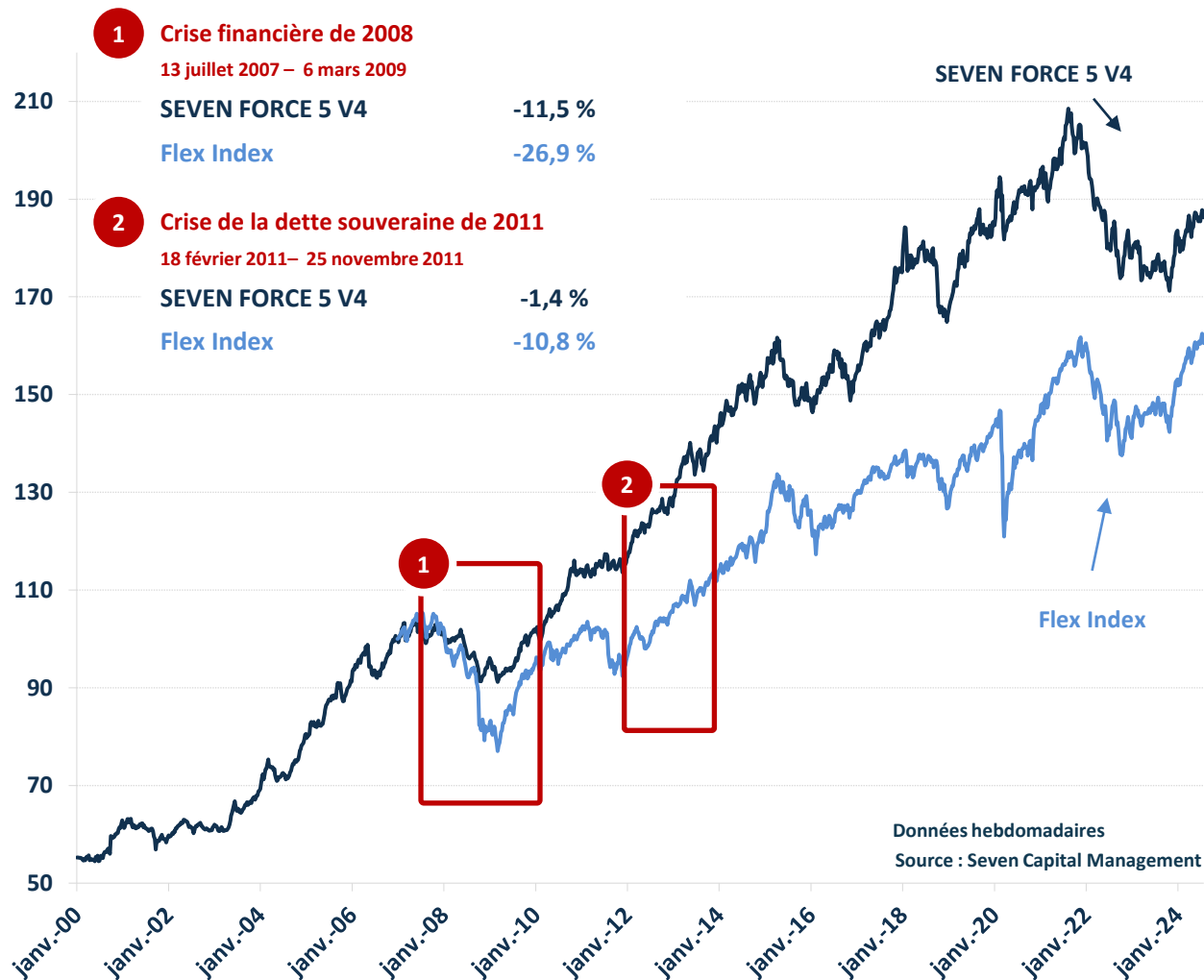
www.seven-cm.com

www.amf-france.org

Les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures



# SEVEN FORCE 5 V4: Que peut-on en attendre sur longue période ?



janvier 2000 - juillet 2024

## SEVEN FORCE 5 V4

rendement annualisé	+5,1 % / an
volatilité annualisée	6,2 %
ratio Sharpe	0,8
recul max	-17,9 %

Données simulées jusqu'au 14/03/2022

décembre 2006 - juillet 2024

## Flex Index

rendement annualisé	+2,7 % / an
volatilité annualisée	7,3 %
ratio Sharpe	0,4
recul max	-26,9 %

## SEVEN CAPITAL MANAGEMENT

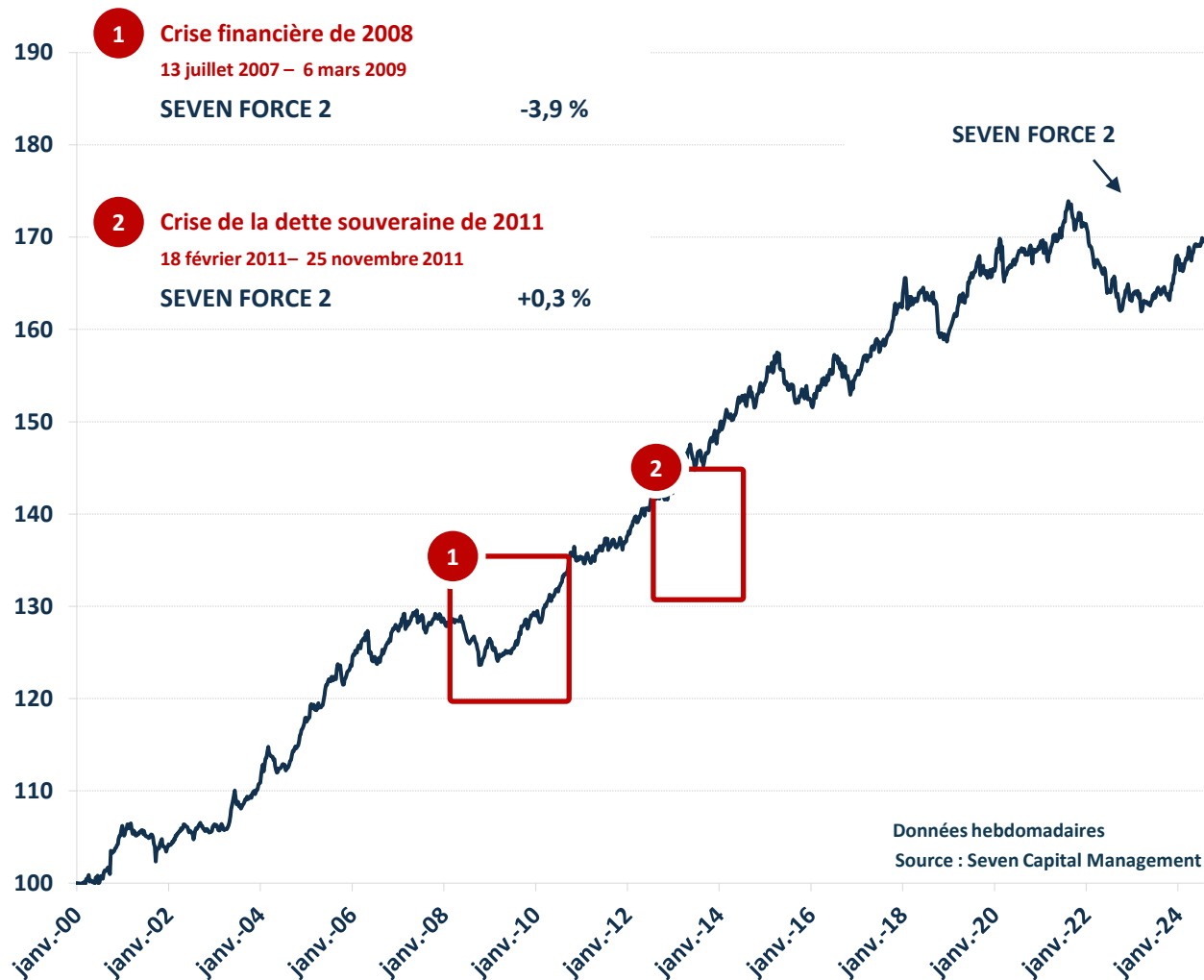
39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tel. +33 1 42 33 04 05  
Société par Actions Simplifiée SAS – Agréée par l'AMF N° GP 06000045 – Capital de 560 000 euros – RCS B 491 390 464  
www.seven-cm.com  
www.amf-france.org

Les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures





# SEVEN FORCE 2 : Que peut-on en attendre sur longue période ?



janvier 2000 - juillet 2024

## SEVEN FORCE 2

rendement annualisé	+2,2 % / an
volatilité annualisée	2,5 %
ratio Sharpe	0,9
recul max	-6,9 %

*Données simulées jusqu'au 24/10/2019*

### SEVEN CAPITAL MANAGEMENT

39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tel. +33 1 42 33 04 05  
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



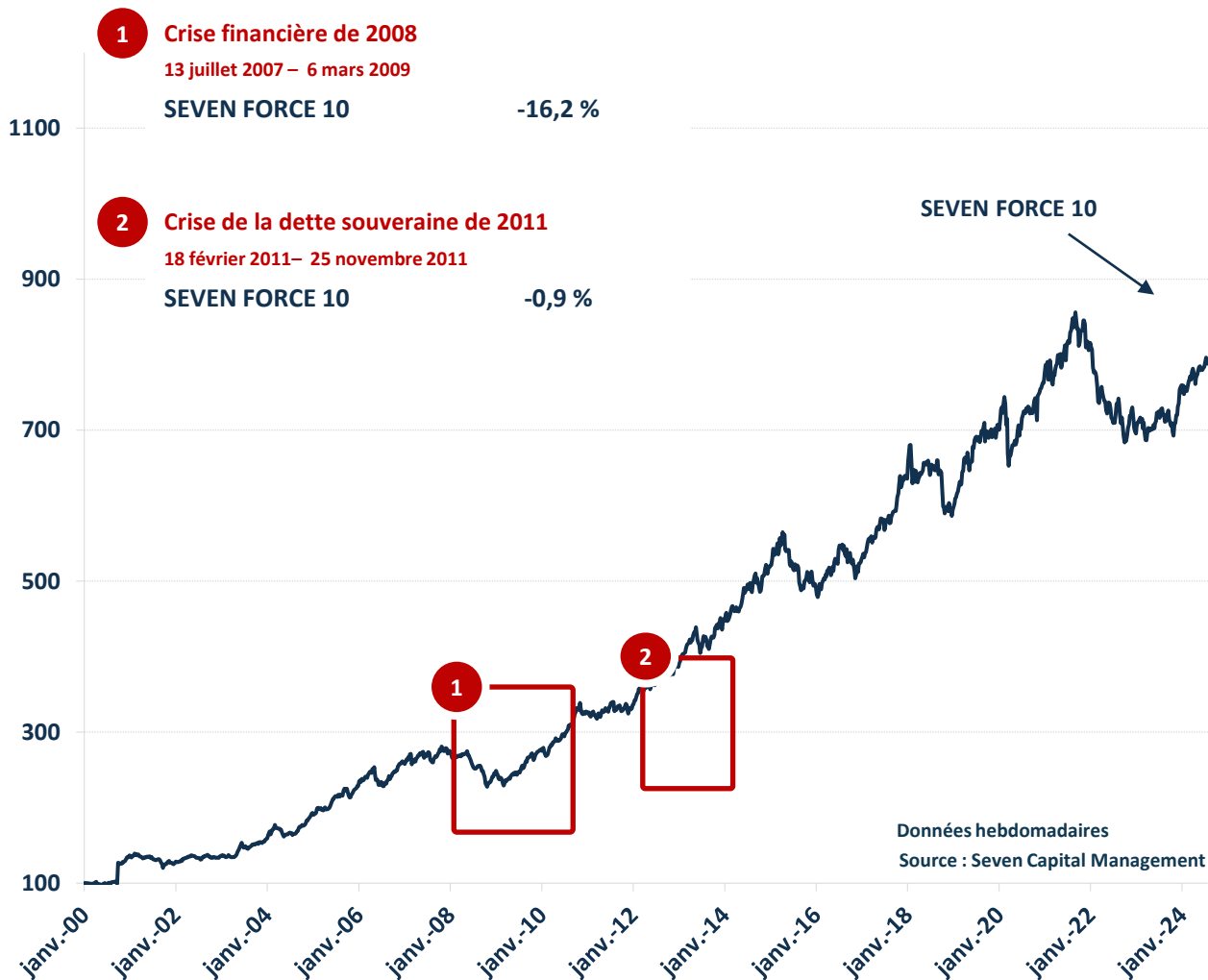
# SEVEN FORCE 10 : Que peut-on en attendre sur longue période ?

janvier 2000 - juillet 2024

## SEVEN FORCE 10

rendement annualisé	+8,7 % / an
volatilité annualisée	10,3 %
ratio Sharpe	0,8
recul max	-20,1 %

*Données simulées jusqu'au 24/10/2019*



### SEVEN CAPITAL MANAGEMENT

39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tel. +33 1 42 33 04 05  
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



# ANALYSE RISQUES

**SEVEN CAPITAL MANAGEMENT**

39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tel. +33 1 42 33 04 05

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)

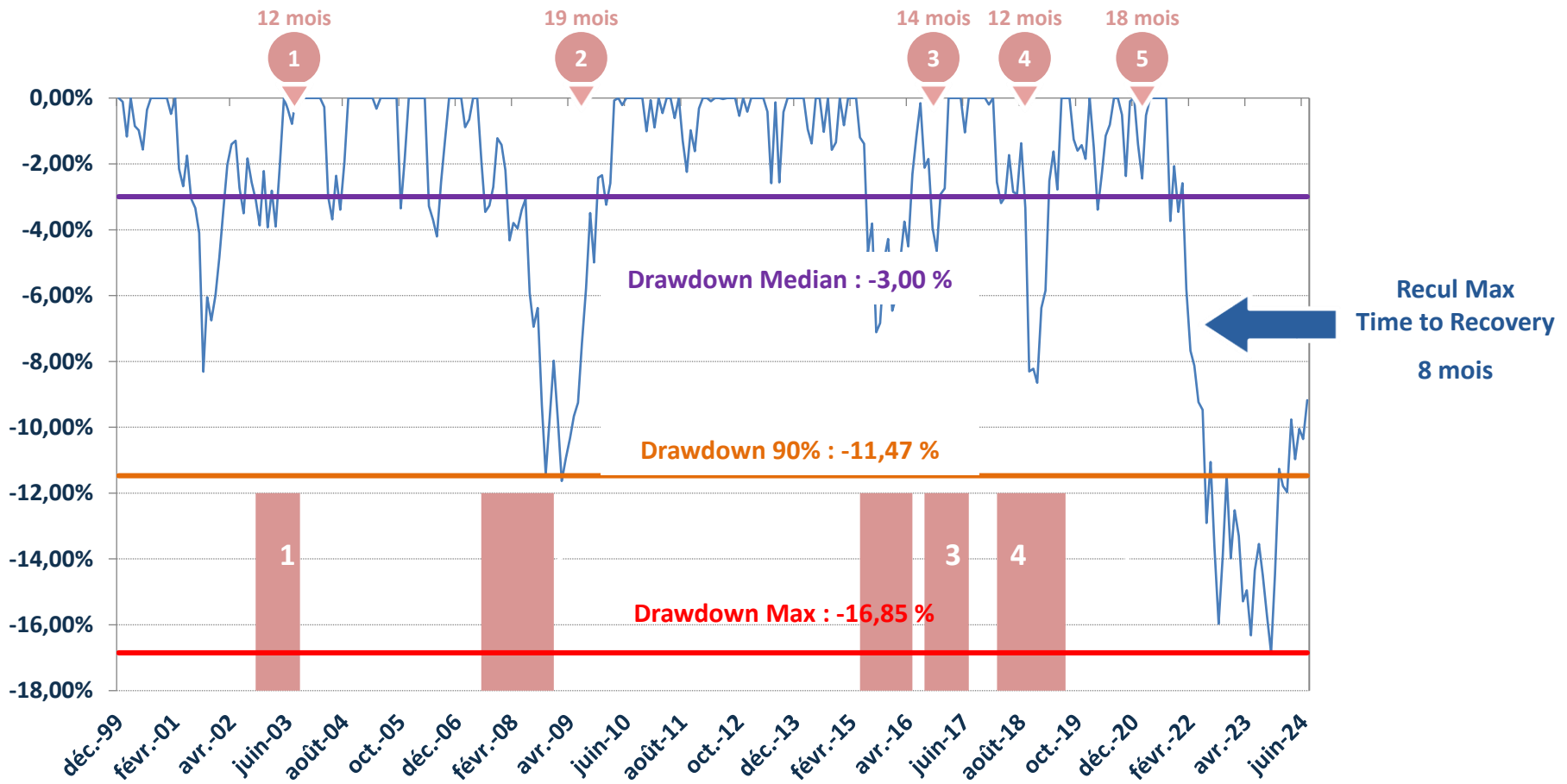
[www.amf-france.org](http://www.amf-france.org)

Les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures

# SEVEN FORCE 5 V4

## Analyse historique du recul max – données simulées & réalisées

Drawdown historique - base mensuelle - du 31 décembre 1999 au 31 juillet 2024



**SEVEN CAPITAL MANAGEMENT**

39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tel. +33 1 42 33 04 05  
 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](http://www.seven-cm.com)  
[www.amf-france.org](http://www.amf-france.org)

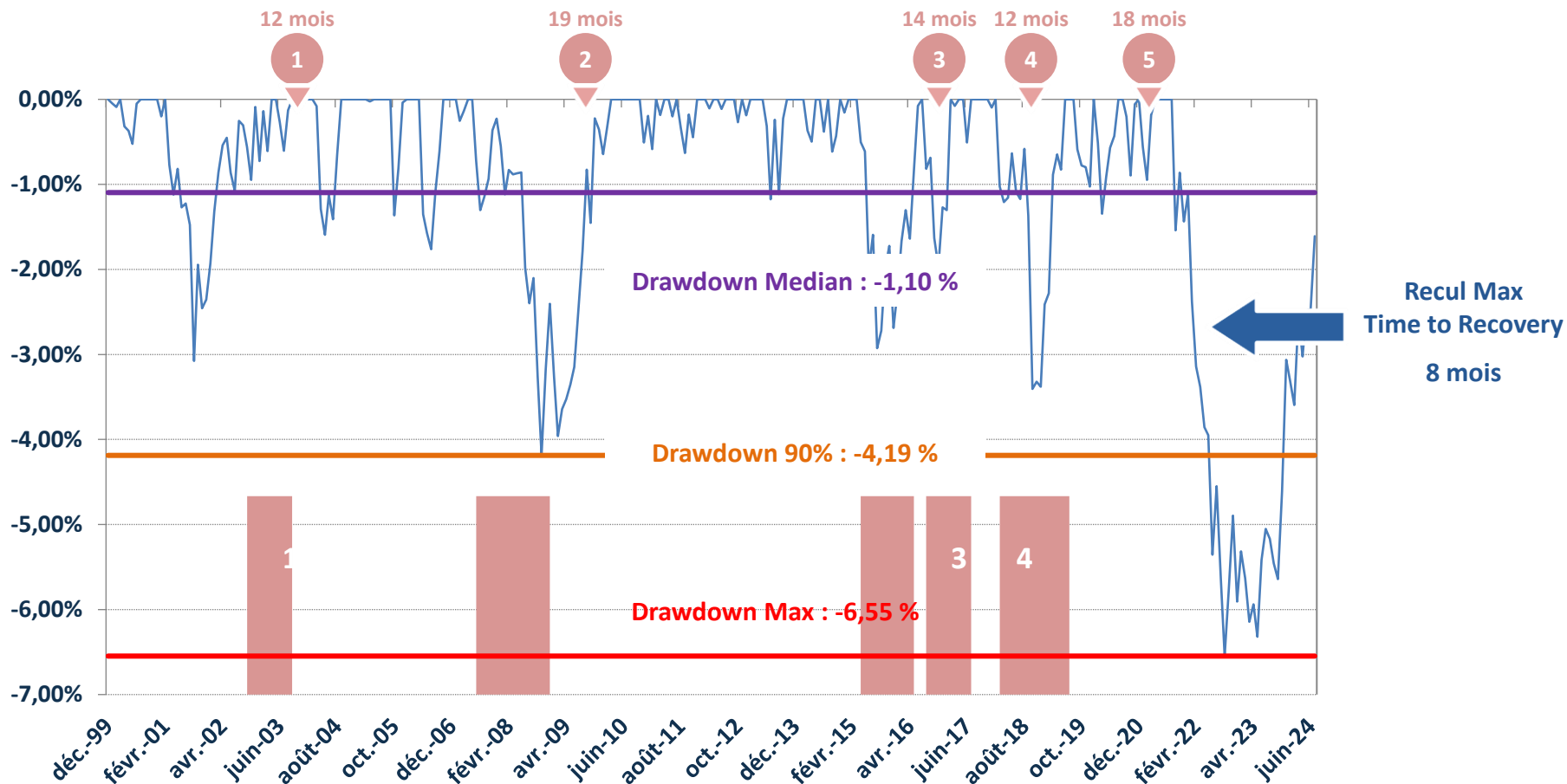
Les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures



# SEVEN FORCE 2

## Analyse historique du recul max – données simulées & réalisées

Drawdown historique - base mensuelle - du 31 décembre 1999 au 31 juillet 2024



SEVEN CAPITAL MANAGEMENT

39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tel. +33 1 42 33 04 05

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

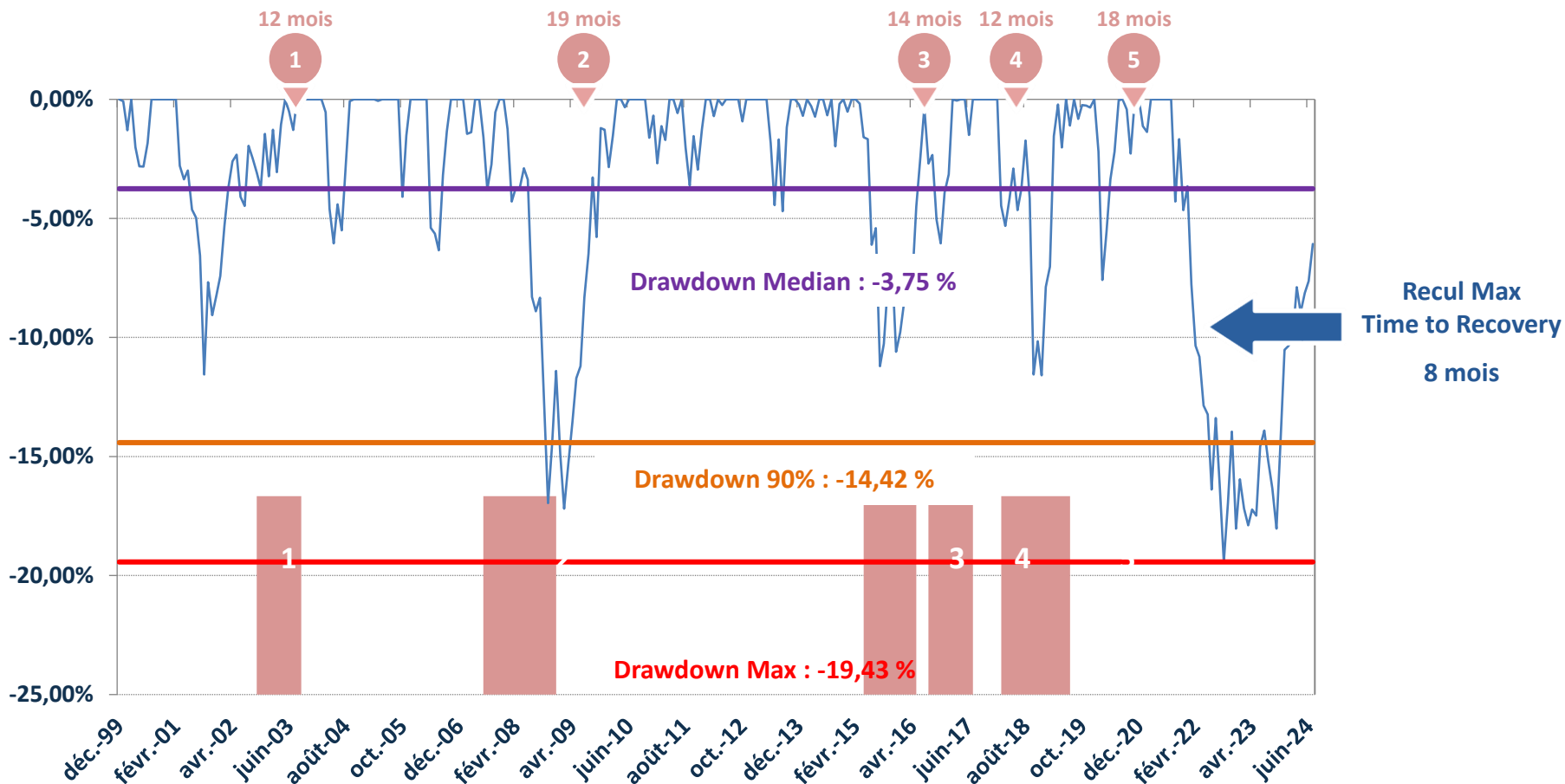
Les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures



# SEVEN FORCE 10

## Analyse historique du recul max – données simulées & réalisées

Drawdown historique - base mensuelle - du 31 décembre 1999 au 31 juillet 2024



SEVEN CAPITAL MANAGEMENT

39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tel. +33 1 42 33 04 05

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

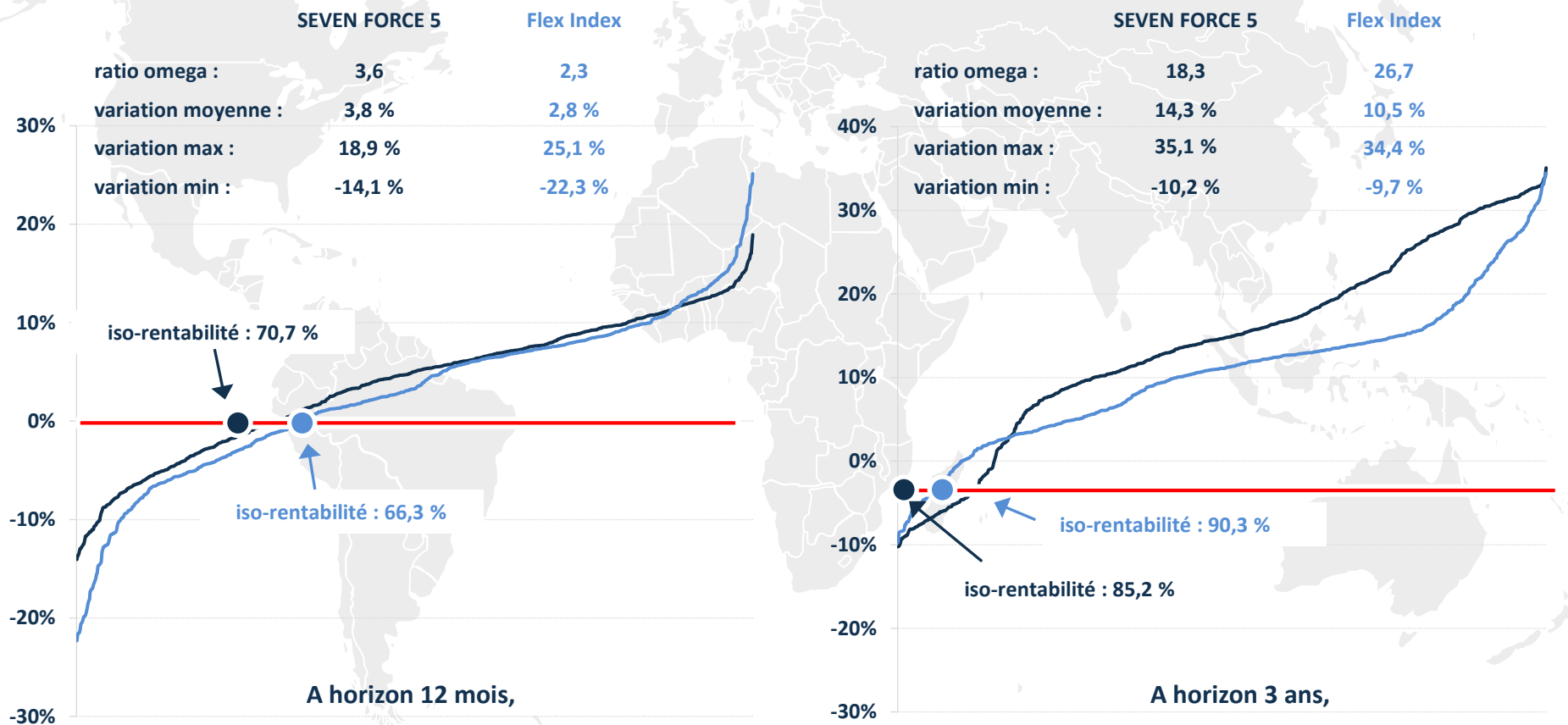


# SEVEN FORCE 5

## Analyse de l'iso-rentabilité & du ratio Omega – données simulées & réalisées

**Iso – Rentabilité :** Probabilité historique d'un fonds d'afficher à un horizon donné une performance strictement supérieure à zéro

**Ratio Omega :** Rapport entre la surface des gains d'un fonds et la surface des pertes de ce fonds à un horizon donné



Source : Seven Capital Management

SEVEN CAPITAL MANAGEMENT  
 39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tel. +33 1 42 33 04 05  
 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](http://www.seven-cm.com)  
[www.amf-france.org](http://www.amf-france.org)

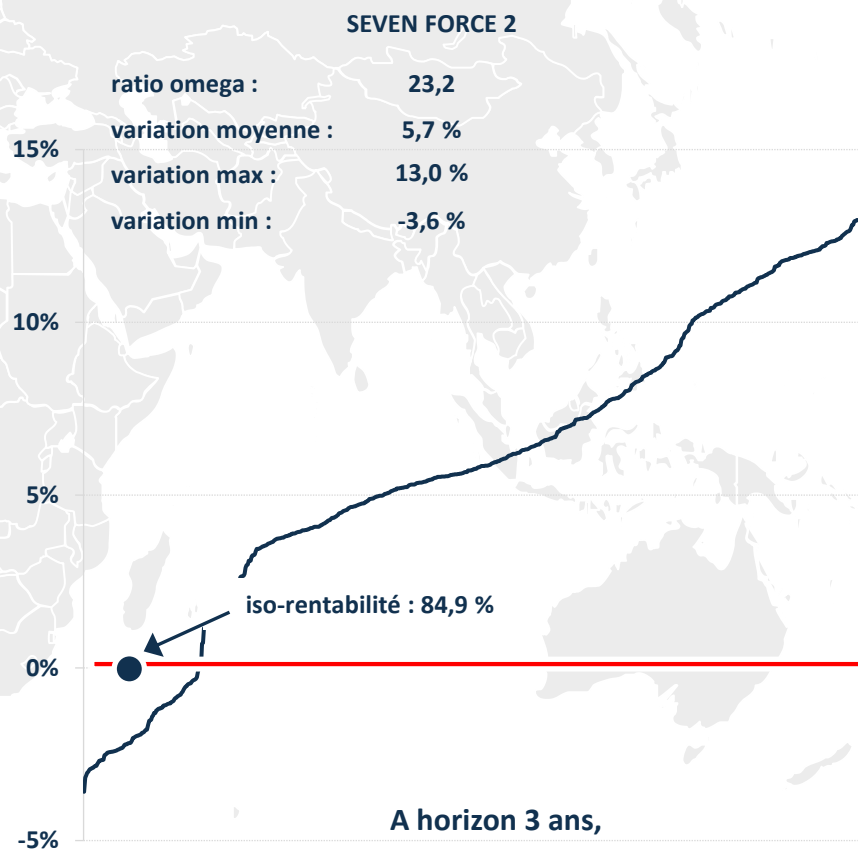
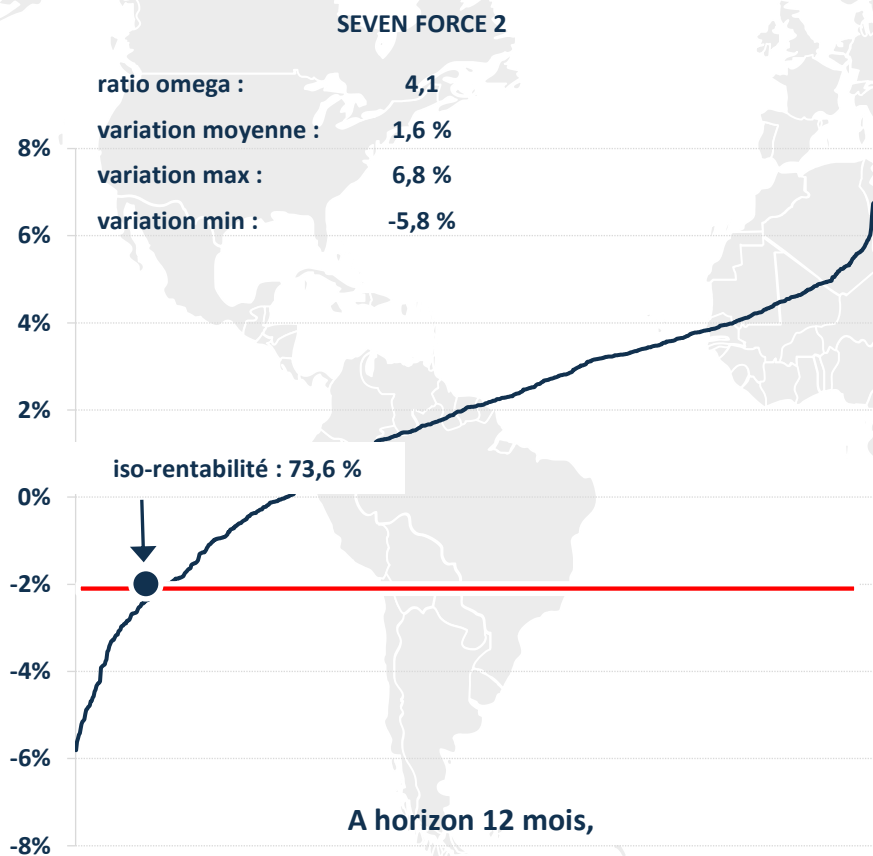


# SEVEN FORCE 2

## Analyse de l'iso-rentabilité & du ratio Omega – données simulées & réalisées

**Iso – Rentabilité :** Probabilité historique d'un fonds d'afficher à un horizon donné une performance strictement supérieure à zéro

**Ratio Omega :** Rapport entre la surface des gains d'un fonds et la surface des pertes de ce fonds à un horizon donné



Source : Seven Capital Management

SEVEN CAPITAL MANAGEMENT

39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tel. +33 1 42 33 04 05

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



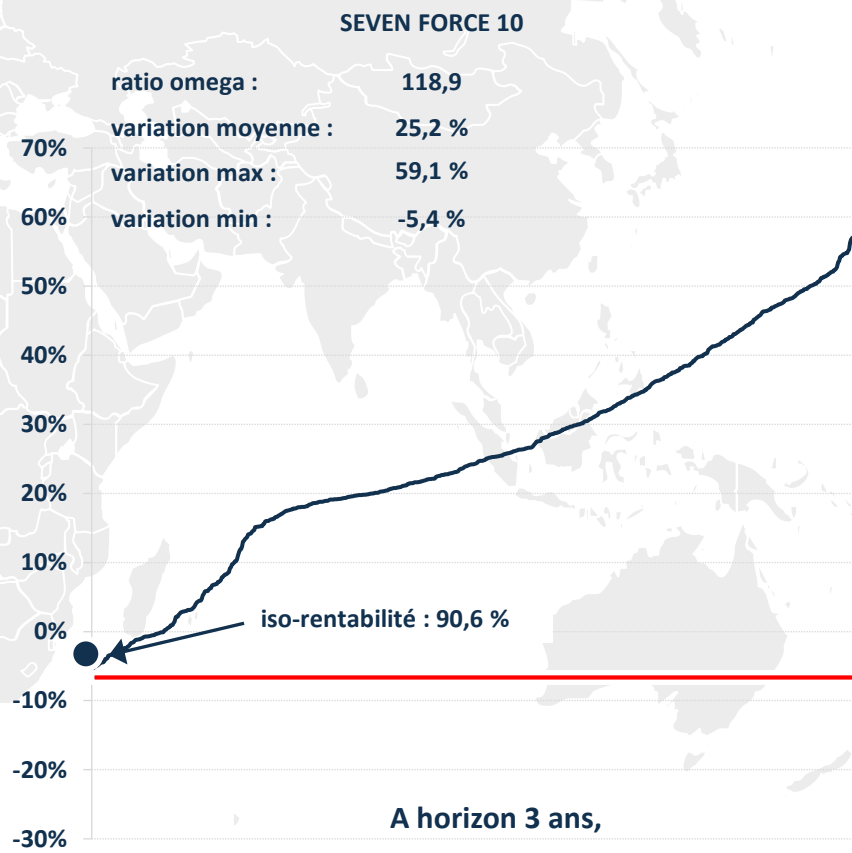
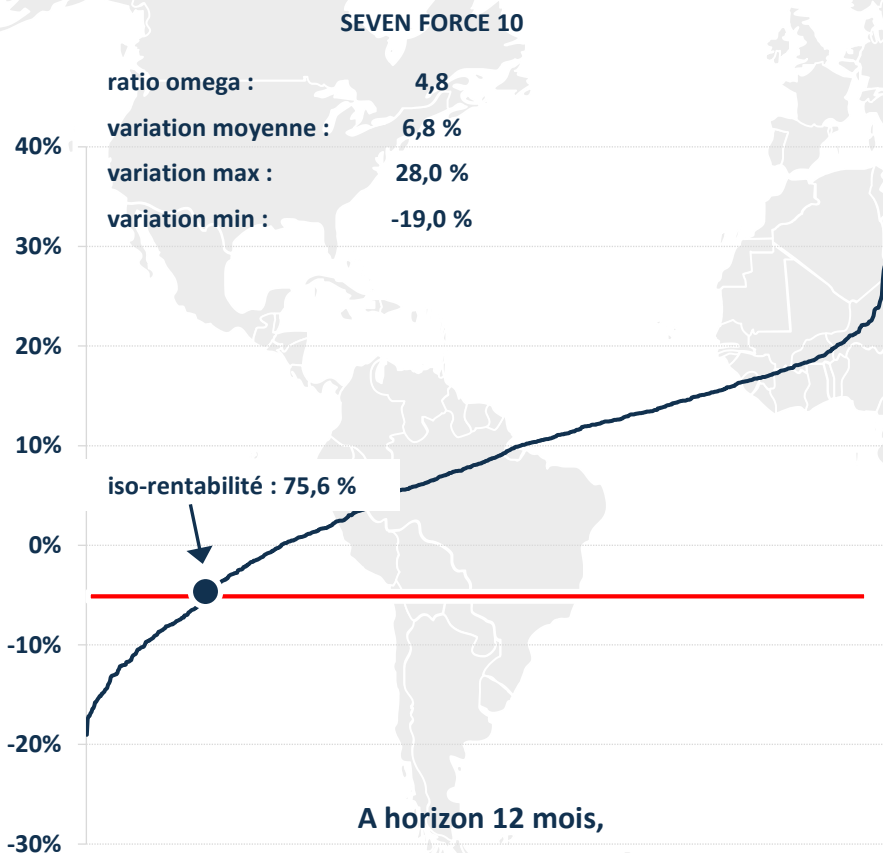


# SEVEN FORCE 10

## Analyse de l'iso-rentabilité & du ratio Omega – données simulées & réalisées

**Iso – Rentabilité :** Probabilité historique d'un fonds d'afficher à un horizon donné une performance strictement supérieure à zéro

**Ratio Omega :** Rapport entre la surface des gains d'un fonds et la surface des pertes de ce fonds à un horizon donné



Source : Seven Capital Management

SEVEN CAPITAL MANAGEMENT

39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tel. +33 1 42 33 04 05

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



# ANNEXES

**SEVEN CAPITAL MANAGEMENT**

39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tel. +33 1 42 33 04 05

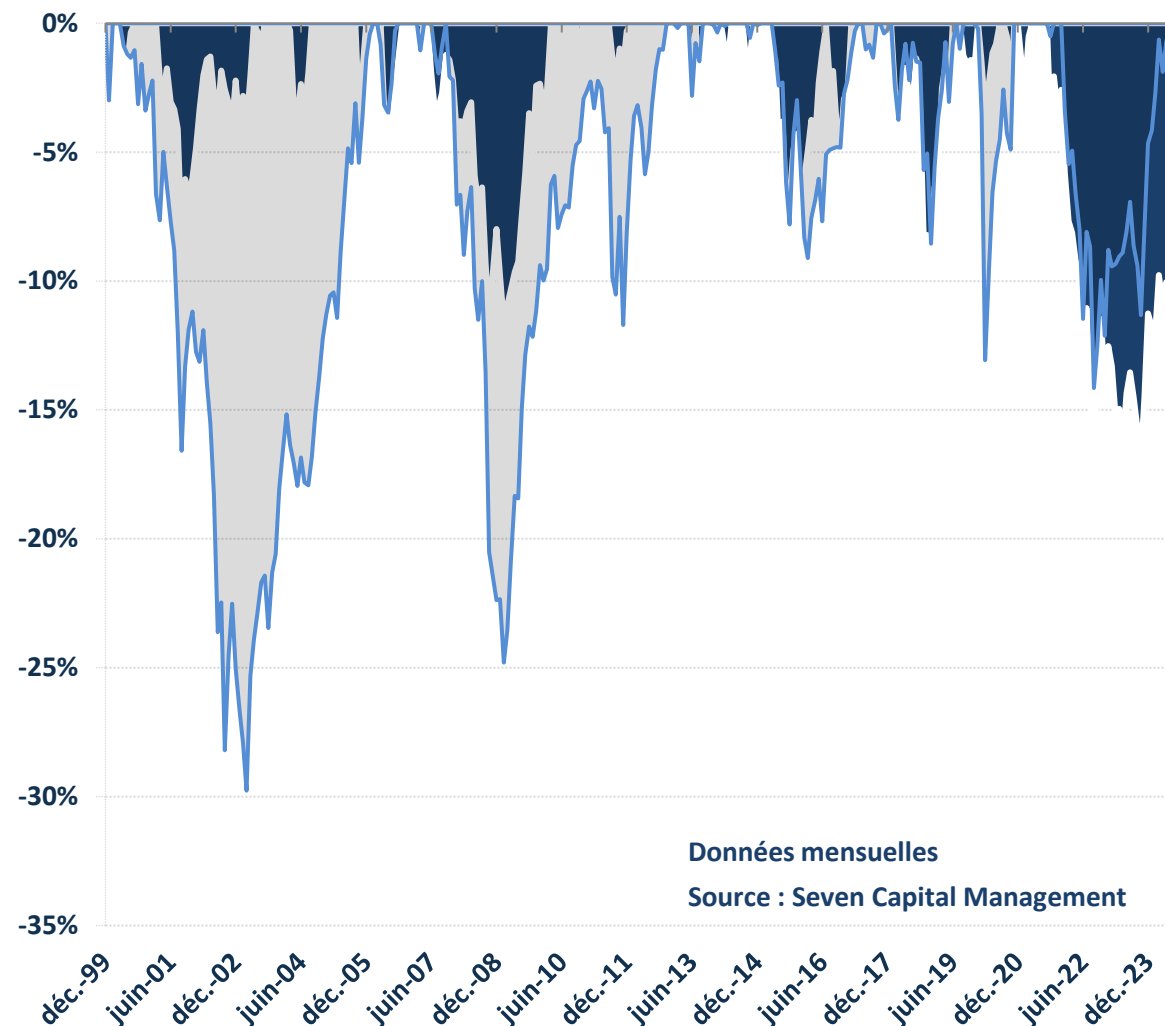
Société par Actions Simplifiée SAS – Agrée par l'AMF N° GP 06000045 – Capital de 560 000 euros – RCS B 491 390 464

[www.seven-cm.com](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

# Analyse comparative du drawdown : Seven Force 5 vs. Flex Index



## Seven Force 5

Drawdown Median	-3,00 %
Drawdown 90%	-11,47 %
Drawdown Max	-16,85 %

## Flex Index

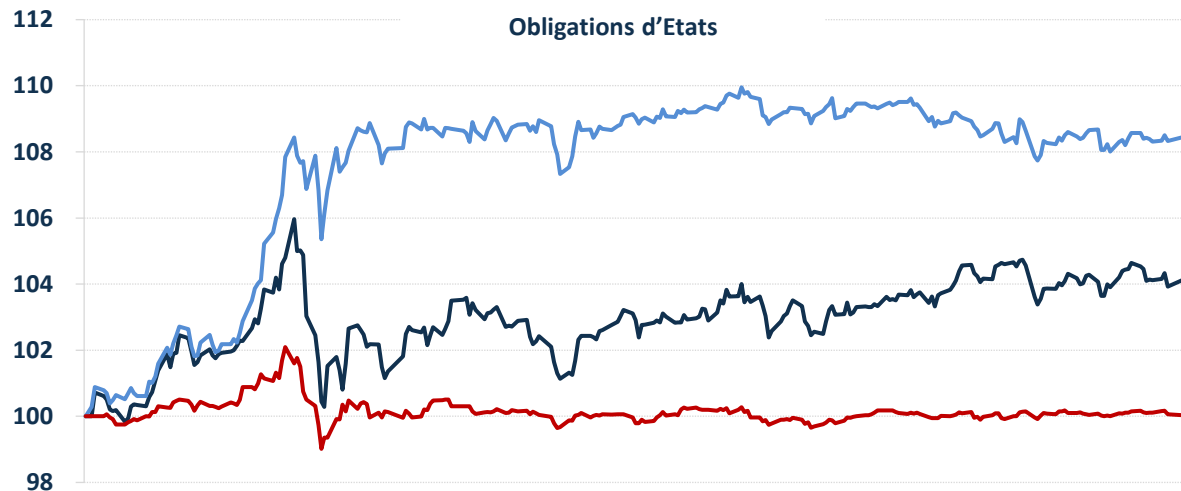
Drawdown Median	-6,25 %
Drawdown 90%	-20,59 %
Drawdown Max	-29,77 %

### SEVEN CAPITAL MANAGEMENT

39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tel. +33 1 42 33 04 05  
 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](http://www.seven-cm.com)  
[www.amf-france.org](http://www.amf-france.org)

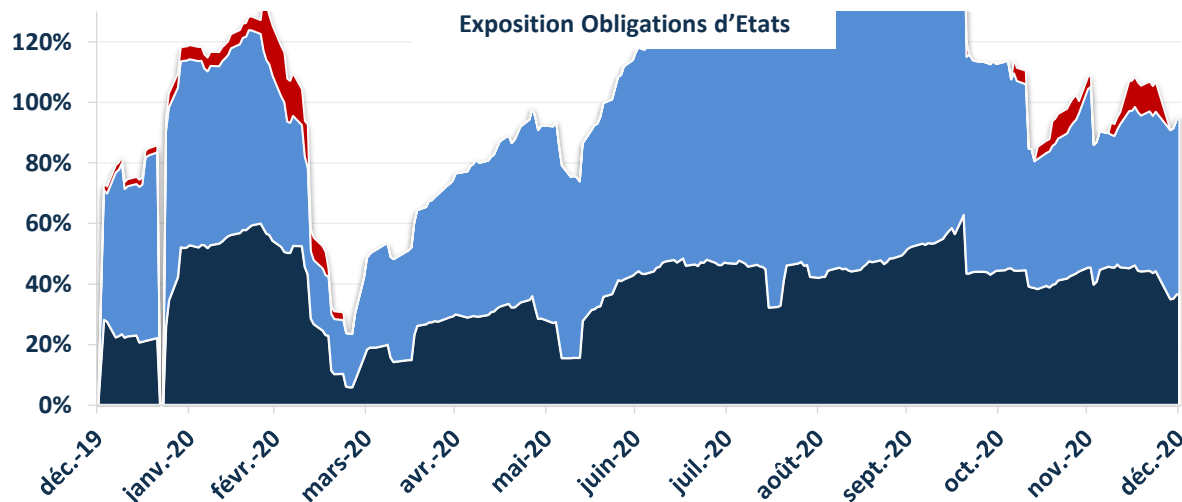
# Seven Force 5

## Focus "Obligations d'Etats" : 31 décembre 2019 - 31 décembre 2020 – COVID



### Variation sur la période de focus

Future Bund (10 ans Allemagne)	+4,2 %
Future T.Notes 10Yrs (10 ans USA)	+8,5 %
Future JGB (10 ans Japon)	0,0 %



### Ventilation de l'exposition au 31 décembre 2020

EUROPE	36,8 %
USA	58,8 %
JAPON	0,0 %
<hr/>	
Global obligations d'Etats	95,6 %

Source : Seven Capital Management

SEVEN CAPITAL MANAGEMENT

39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tel. +33 1 42 33 04 05

Société par Actions Simplifiée SAS – Agréée par l'AMF N° GP 06000045 – Capital de 560 000 euros – RCS B 491 390 464

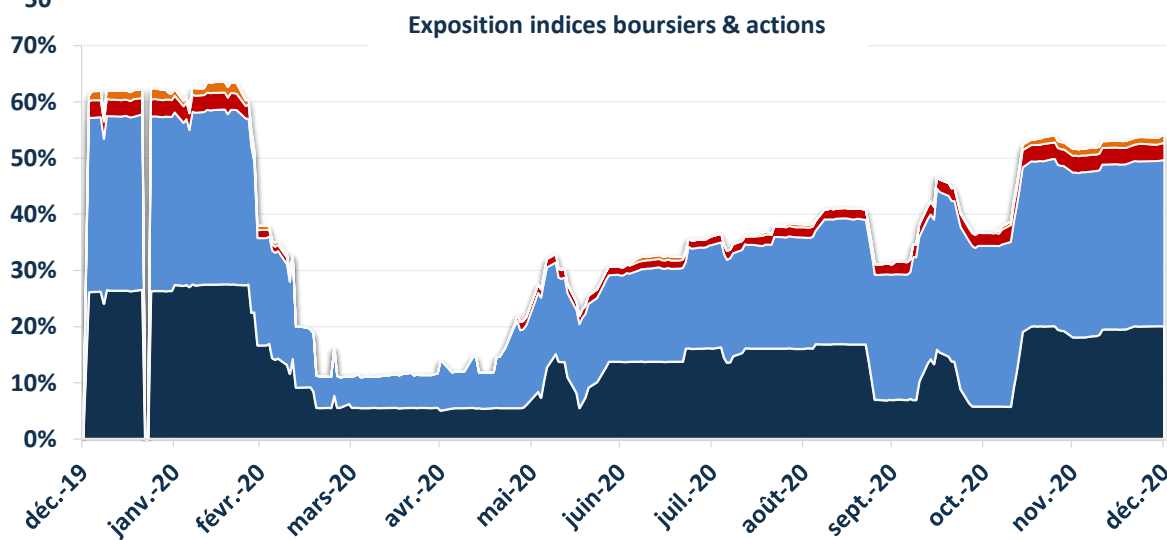
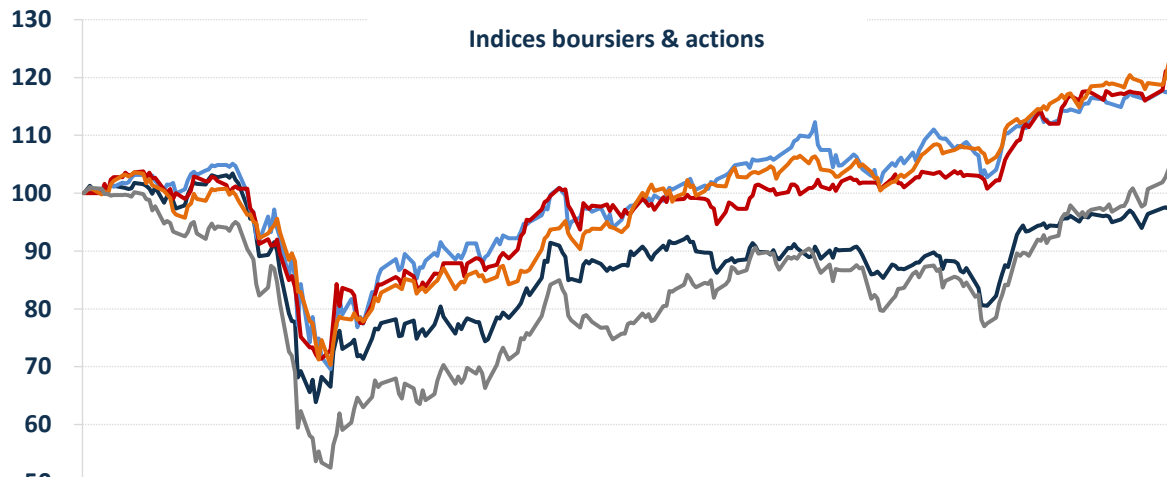
www.seven-cm.com

www.amf-france.org

Les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures

# Seven Force 5

## Focus "Indices boursiers & actions" : 31 décembre 2019 - 31 décembre 2020 – COVID



### Variation sur la période de focus

DJ EUROSTOXX 50 – Div Inc	-3,2 %
S&P 500 – Div Inc	+18,4 %
NIKKEI – Div Inc	+20,6 %
MSCI NORDIC – Div Inc	+3,9 %
MSCI ASIA PACIFIC – Div Inc	+22,4 %

### Ventilation de l'exposition au 31 décembre 2020

EUROPE	20,1 %
USA	29,5 %
JAPON	3,0 %
EUROPE DU NORD	0,0 %
RESTE DU MONDE	1,4 %

---

Global indices boursiers & actions 54,0 %

Source : Seven Capital Management

SEVEN CAPITAL MANAGEMENT

39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tel. +33 1 42 33 04 05

Société par Actions Simplifiée SAS – Agréée par l'AMF N° GP 06000045 – Capital de 560 000 euros – RCS B 491 390 464

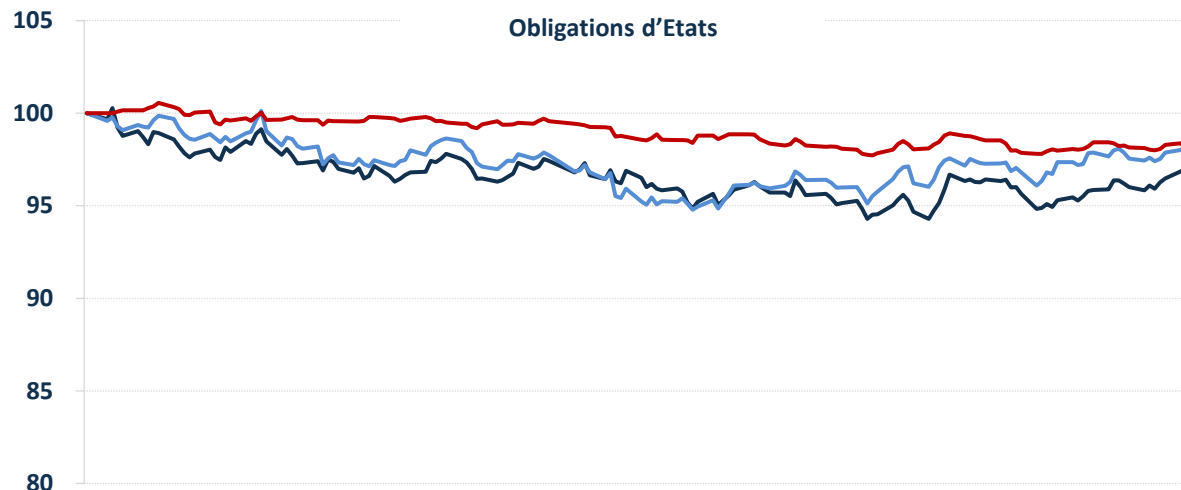
www.seven-cm.com

www.amf-france.org

Les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures

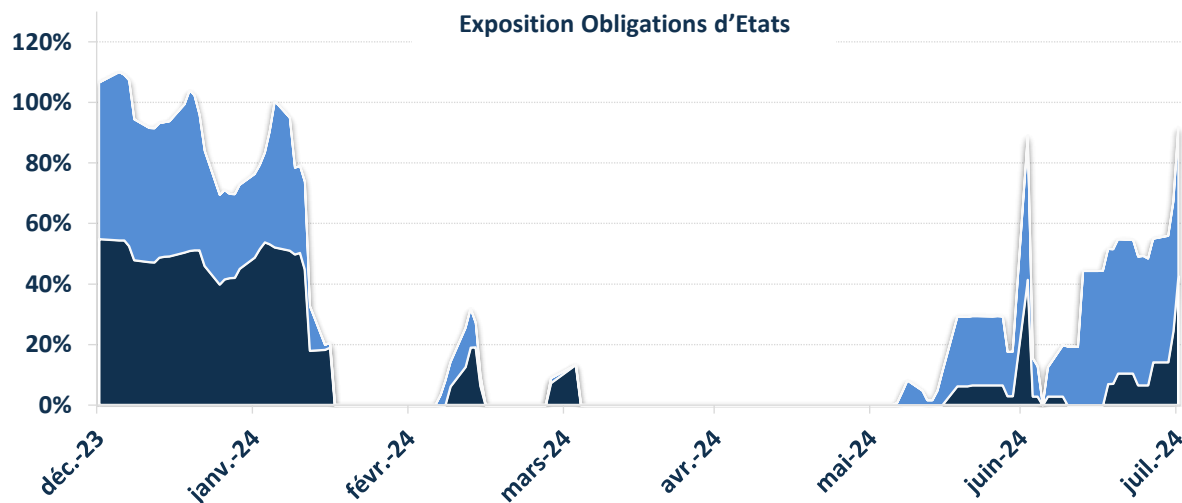
# Seven Force 5

## Focus "Obligations d'Etats" : 29 décembre 2023 - 31 juillet 2024



### Variation sur la période de focus

Future Bund (10 ans Allemagne)	-2,5 %
Future T.Notes 10Yrs (10 ans USA)	-1,6 %
Future JGB (10 ans Japon)	-1,9 %



### Ventilation de l'exposition au 31 juillet 2024

EUROPE	42,6 %
USA	49,2 %
JAPON	0,0 %
<hr/>	
Global obligations d'Etats	91,9 %

Source : Seven Capital Management

SEVEN CAPITAL MANAGEMENT

39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tel. +33 1 42 33 04 05

Société par Actions Simplifiée SAS – Agréée par l'AMF N° GP 06000045 – Capital de 560 000 euros – RCS B 491 390 464

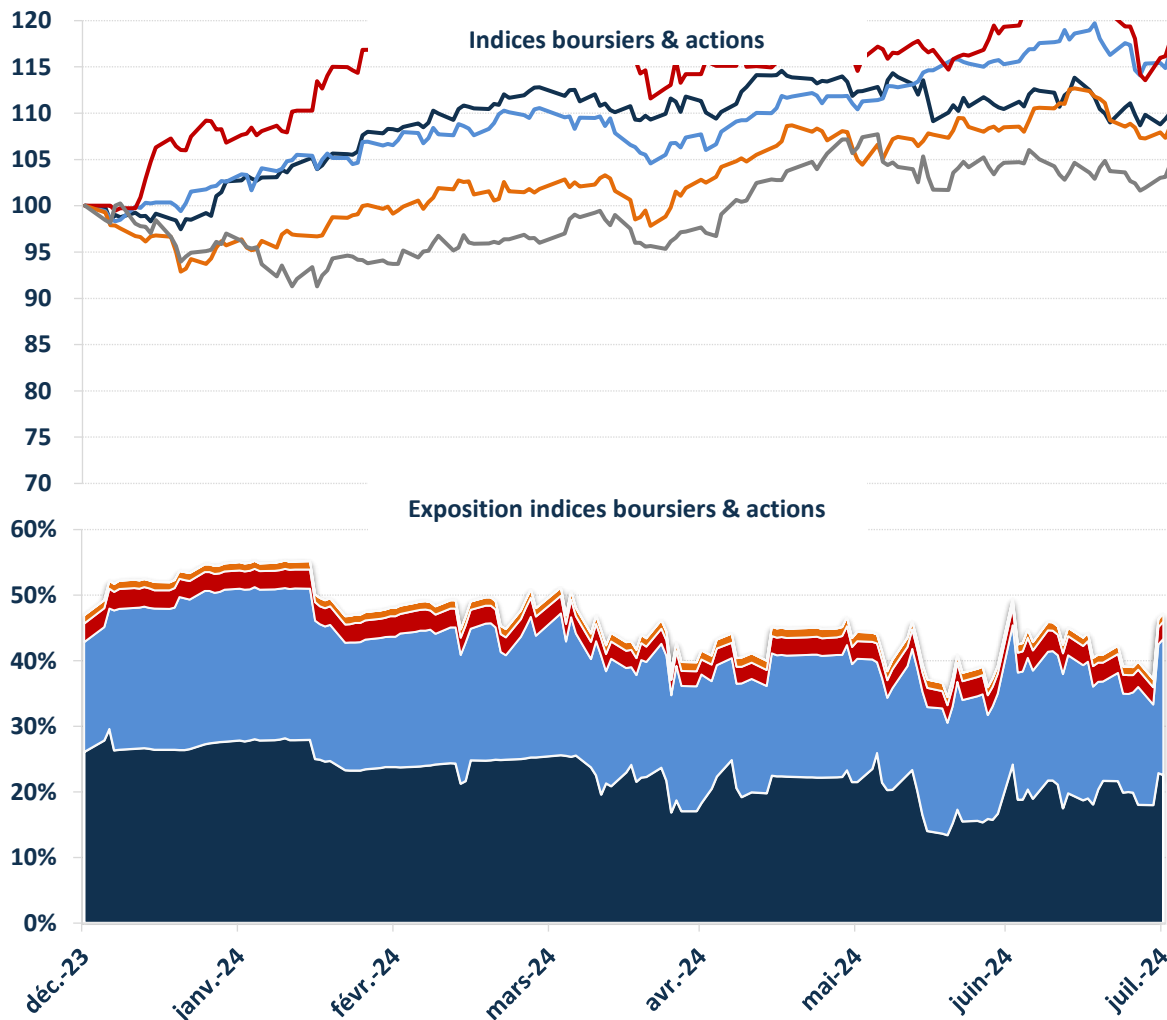
[www.seven-cm.com](http://www.seven-cm.com)

[www.amf-france.org](http://www.amf-france.org)

Les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures

# Seven Force 5

## Focus "Indices boursiers & actions" : 29 décembre 2023 - 31 juillet 2024



### Variation sur la période de focus

DJ EUROSTOXX 50 – Div Inc	+10,1 %
S&P 500 – Div Inc	+16,7 %
NIKKEI – Div Inc	+17,9 %
MSCI NORDIC – Div Inc	+4,6 %
MSCI ASIA PACIFIC – Div Inc	+8,7 %

### Ventilation de l'exposition au 31 juillet 2024

EUROPE	22,6 %
USA	20,7 %
JAPON	2,6 %
EUROPE DU NORD	0,0 %
RESTE DU MONDE	1,2 %

---

Global indices boursiers & actions 47,2 %

Source : Seven Capital Management

SEVEN CAPITAL MANAGEMENT

39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tel. +33 1 42 33 04 05

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

# Seven Force 5

*“ Il n’y pas de performance durable, régulière et maîtrisée sans contrôle des risques ”*

	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	Seven Force 5 - Total	Seven Force 5 - v4
2007	0,09%	0,28%	0,21%	1,00%	0,87%	-0,36%	0,62%	-2,56%	2,52%	2,06%	-0,45%	-0,11%	4,15%	0,90%
2008	-1,08%	1,49%	-0,57%	-0,26%	0,36%	-0,05%	-1,22%	-0,18%	0,12%	0,45%	1,67%	0,93%	1,61%	-5,91%
2009	-0,90%	-0,03%	-0,31%	-0,07%	2,41%	-0,91%	2,64%	1,47%	1,89%	-0,93%	0,47%	0,00%	5,79%	6,12%
2010	-2,08%	-0,78%	2,98%	0,15%	-2,98%	-0,06%	1,07%	0,66%	2,78%	1,09%	-1,90%	2,26%	3,04%	12,09%
2011	-0,27%	1,00%	-1,81%	1,70%	0,09%	-1,04%	0,82%	0,48%	-0,62%	-0,10%	-0,45%	0,31%	0,06%	2,51%
2012	0,23%	1,20%	-0,08%	-0,01%	-0,22%	-0,22%	0,83%	-1,08%	-0,40%	-1,75%	0,09%	-0,02%	-1,44%	9,56%
2013	1,44%	-0,10%	1,57%	0,84%	0,30%	-2,51%	1,93%	-1,00%	1,96%	2,24%	0,86%	0,15%	7,84%	12,71%
2014	-1,25%	2,19%	-0,42%	0,14%	2,20%	0,72%	-0,14%	1,20%	-0,78%	-0,11%	1,83%	-1,40%	4,16%	6,45%
2015	2,57%	2,91%	0,61%	-0,76%	-0,14%	-1,33%	-1,55%	-3,33%	-0,33%	1,26%	0,27%	-1,91%	-1,91%	-2,89%
2016	0,34%	1,22%	-0,05%	-0,65%	-0,06%	0,94%	0,27%	-0,70%	-0,82%	-1,48%	-0,77%	1,64%	-0,15%	3,78%
2017	-0,42%	2,41%	0,42%	0,80%	1,41%	-1,24%	1,06%	1,37%	-0,23%	3,09%	0,26%	-0,31%	8,87%	13,32%
2018	1,64%	-2,65%	-1,22%	0,16%	1,42%	-1,32%	0,35%	0,78%	-1,45%	-4,88%	-0,15%	-0,28%	-7,51%	-4,74%
2019	0,25%	-0,52%	2,71%	-0,22%	0,75%	1,93%	-0,05%	1,82%	-1,30%	-1,26%	0,40%	-0,68%	3,78%	10,29%
2020	3,20%	-2,14%	-3,01%	1,19%	0,69%	-0,32%	1,93%	-0,32%	-0,79%	-1,55%	0,63%	1,76%	1,10%	6,07%
2021	-0,91%	-1,24%	3,02%	1,61%	0,86%	0,70%	1,43%	1,20%	-3,62%	2,15%	-0,97%	1,74%	5,94%	3,35%
2022	-4,80%	-3,22%	-0,65%	-2,16%	-0,22%	-3,80%	2,13%	-2,94%	-2,66%	2,47%	2,81%	-2,83%	-15,08%	-11,70%
2023	1,70%	-0,89%	-2,29%	0,39%	-1,61%	2,36%	0,94%	-1,10%	-1,42%	-1,35%	2,84%	3,77%	3,16%	3,16%
2024	-0,59%	-0,21%	2,51%	-1,34%	1,04%	-0,35%	1,32%						2,35%	2,35%

## SEVEN CAPITAL MANAGEMENT

39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tel. +33 1 42 33 04 05

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](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



# Seven Force 2

*“ Il n’y pas de performance durable, régulière et maîtrisée sans contrôle des risques ”*

	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	Seven Force 2 - Total
2007	0,45%	-0,25%	0,08%	0,65%	0,47%	-0,72%	-0,62%	0,12%	0,19%	0,57%	0,10%	-0,34%	0,67%
2008	-0,58%	0,31%	-0,10%	0,05%	0,05%	-1,16%	-0,44%	0,30%	-1,11%	-1,08%	1,11%	0,83%	-1,83%
2009	-0,85%	-0,67%	0,46%	0,14%	0,20%	0,16%	0,69%	0,63%	0,98%	-0,56%	1,18%	-0,17%	2,18%
2010	-0,29%	0,31%	0,91%	0,72%	0,04%	0,46%	0,60%	0,85%	1,07%	0,15%	-0,51%	0,34%	4,74%
2011	-0,33%	0,59%	-0,26%	0,58%	0,49%	-0,23%	0,68%	-0,30%	-0,27%	0,44%	-0,29%	0,65%	1,75%
2012	0,72%	0,68%	-0,07%	0,81%	0,27%	-0,15%	0,89%	0,05%	0,08%	-0,34%	0,68%	-0,15%	3,51%
2013	0,85%	0,95%	0,97%	0,35%	-0,30%	-0,93%	0,91%	-0,89%	0,87%	1,27%	0,44%	0,05%	4,60%
2014	0,14%	1,24%	-0,37%	-0,17%	1,09%	0,18%	-0,38%	1,14%	-0,60%	0,17%	0,84%	-0,21%	3,10%
2015	1,26%	0,35%	0,08%	-0,52%	-0,11%	-1,36%	0,42%	-1,40%	0,30%	0,74%	0,25%	-1,09%	-1,11%
2016	0,44%	0,56%	0,38%	-0,36%	0,86%	0,70%	0,44%	-0,74%	0,12%	-0,98%	-0,34%	0,72%	1,80%
2017	-0,05%	1,30%	-0,10%	0,61%	0,22%	-0,51%	0,56%	0,48%	0,31%	1,63%	0,12%	-0,08%	4,57%
2018	1,58%	-1,03%	-0,20%	0,05%	0,57%	-0,46%	-0,03%	0,62%	-0,77%	-2,07%	0,07%	-0,10%	-1,80%
2019	1,00%	0,13%	1,43%	0,25%	-0,17%	1,21%	0,15%	1,17%	-0,61%	-0,22%	0,01%	-0,22%	4,18%
2020	1,37%	-0,50%	-0,91%	0,47%	0,33%	0,10%	0,60%	0,00%	-0,18%	-0,65%	0,90%	0,46%	1,98%
2021	-0,49%	-0,42%	0,80%	0,42%	0,35%	0,48%	1,11%	0,26%	-1,49%	0,69%	-0,44%	0,33%	1,59%
2022	-1,25%	-0,79%	-0,26%	-0,70%	-0,13%	-1,46%	0,85%	-1,12%	-0,98%	0,84%	0,92%	-1,07%	-5,08%
2023	0,63%	-0,33%	-0,54%	0,22%	-0,41%	0,97%	0,38%	-0,12%	-0,30%	-0,20%	1,09%	1,62%	3,02%
2024	-0,25%	-0,30%	1,09%	-0,49%	0,56%	0,01%	0,89%	-0,15%					1,35%

## 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](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

# Seven Force 10

*“ Il n’y pas de performance durable, régulière et maîtrisée sans contrôle des risques ”*

	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	Seven Force 10 - Total
2007	1,61%	-1,39%	-0,08%	2,85%	1,99%	-1,62%	-2,28%	0,91%	2,16%	2,49%	-0,06%	-1,36%	5,18%
2008	-3,00%	0,67%	-0,26%	1,03%	-0,39%	-5,16%	-0,66%	0,62%	-4,52%	-5,07%	3,39%	3,75%	-9,65%
2009	-3,81%	-2,45%	2,81%	2,07%	2,15%	0,32%	3,23%	1,72%	3,49%	-2,24%	4,61%	-0,25%	11,88%
2010	-1,44%	1,42%	3,59%	2,05%	-0,16%	1,96%	2,78%	2,72%	4,66%	0,55%	-1,51%	1,11%	19,01%
2011	-1,75%	1,55%	-0,81%	1,72%	1,58%	-0,68%	2,65%	-1,75%	-1,48%	2,12%	-1,43%	1,91%	3,52%
2012	3,82%	3,04%	-0,50%	2,23%	-0,13%	0,49%	2,78%	0,17%	1,07%	-1,12%	2,72%	0,45%	15,95%
2013	2,71%	2,43%	3,06%	2,31%	-1,76%	-2,86%	2,79%	-3,11%	3,54%	4,29%	1,75%	-0,11%	15,70%
2014	-0,66%	3,93%	-0,33%	-0,54%	4,73%	1,26%	-0,68%	4,12%	-1,89%	1,74%	3,10%	-0,73%	14,66%
2015	4,68%	1,46%	-0,05%	-1,48%	-0,02%	-4,30%	0,82%	-6,23%	1,35%	2,91%	0,91%	-4,56%	-4,98%
2016	0,89%	1,29%	1,93%	-1,11%	3,58%	2,10%	2,27%	-2,03%	0,37%	-2,86%	-0,96%	2,34%	7,87%
2017	0,72%	4,49%	-0,12%	1,96%	1,31%	-1,45%	2,43%	1,32%	0,62%	6,89%	0,15%	0,24%	19,92%
2018	5,72%	-4,40%	-0,90%	1,21%	1,55%	-1,79%	1,14%	2,21%	-2,40%	-7,68%	1,51%	-1,72%	-6,06%
2019	4,22%	0,91%	5,92%	1,42%	-1,64%	4,82%	-0,97%	3,09%	-0,86%	0,48%	0,10%	-0,10%	18,44%
2020	3,07%	-2,02%	-5,66%	2,33%	2,26%	1,09%	2,50%	0,83%	-0,29%	-1,64%	6,15%	2,87%	11,55%
2021	-0,87%	-0,32%	2,41%	1,11%	1,39%	1,11%	2,96%	1,66%	-4,10%	2,76%	-2,50%	1,07%	6,64%
2022	-4,19%	-2,79%	-0,35%	-1,52%	0,08%	-3,64%	3,60%	-3,21%	-3,89%	3,09%	3,59%	-4,73%	-13,59%
2023	2,53%	-1,46%	-0,85%	0,82%	-0,32%	3,52%	0,79%	-1,47%	-1,37%	-2,02%	4,29%	4,67%	9,16%
2024	0,19%	0,33%	2,41%	-1,15%	0,89%	0,55%	1,69%	-0,46%					4,50%

## SEVEN CAPITAL MANAGEMENT

39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tel. +33 1 42 33 04 05

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](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

# Référencement des fonds

Assureurs & Distributeurs	Seven Diversified Fund	Seven European Equity Fund	Seven Absolute Return Fund
APICIL (GRESHAM)	✓	✓	
AEP	✓		✓
AGICAM - AG2R	✓	✓	
ALLFUND BANK	✓	✓	
ALLIANZ			
AXA	✓	✓	
AXELTIS	✓	✓	✓
BANCO INVERDIS	✓	✓	
BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL	✓	✓	✓
BNP PARIBAS AM (DEXIA BIL)	✓	✓	✓
CNP	✓	✓	
CREDIT MUTUEL (ACMN VIE)	✓	✓	
FEREDAL FINANCE - SURAVENIR - CREDIT MUTUEL AKEA	✓	✓	✓
GENERALIE VIE - PRUDENCE - E-CIE-VIE	✓	✓	✓
MFEX	✓	✓	✓
NEUFLIZE OBC - ABN AMRO	✓	✓	✓
NORTIA	✓	✓	
SPIRICA	✓	✓	

## SEVEN CAPITAL MANAGEMENT

39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tel. +33 1 42 33 04 05  
 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](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



# Caractéristiques du Fonds Ucits Seven Force 2

ISIN Code	• Class I: LU 2109939087 / Class R: LU 2109939160
Format	• SICAV Luxembourg UCITS
Classification	• Fonds diversifié flexible
Objectif	• Performance Absolue
Liquidité	• Journalière
Devises	• EUR– USD - CHF
Dépositaire	• CACEIS Bank Luxembourg – 5 Allée Scheffer – L2520 Luxembourg
Valorisateur	• CACEIS Bank Luxembourg – 5 Allée Scheffer – L2520 Luxembourg
Auditeur	• Deloitte Audit – 560 Rue Neudorf – L 2220 Luxembourg
Souscription Minimum	• Class I: EUR 1 000 – USD 1 000 – CHF 1 000 / Class P: EUR 100 – USD 100 – CHF 100
Management Fees	• Class I: 0,60 % maximum / Class R: 0,90 % maximum
Performance Fees	• 10% au dessus de l'Eonia capitalisé; High Water Mark

## SEVEN CAPITAL MANAGEMENT

39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tel. +33 1 42 33 04 05  
 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



# Caractéristiques du Fonds Ucits Seven Force 5

ISIN Code	• Class I: LU 1229132441 / Class R: LU 1229132797
Format	• SICAV Luxembourg UCITS
Classification	• Fonds diversifié flexible
Objectif	• Performance Absolue
Liquidité	• Journalière
Devises	• EUR– USD - CHF
Dépositaire	• CACEIS Bank Luxembourg – 5 Allée Scheffer – L2520 Luxembourg
Valorisateur	• CACEIS Bank Luxembourg – 5 Allée Scheffer – L2520 Luxembourg
Auditeur	• Deloitte Audit – 560 Rue Neudorf – L 2220 Luxembourg
Souscription Minimum	• Class I: EUR 1 000 – USD 1 000 – CHF 1 000 / Class P: EUR 100 – USD 100 – CHF 100
Management Fees	• Class I: 1 % maximum / Class R: 1,50 % maximum
Performance Fees	• 10% au dessus de l'Eonia capitalisé; High Water Mark

## SEVEN CAPITAL MANAGEMENT

39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tel. +33 1 42 33 04 05  
 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](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



# Caractéristiques du Fonds Ucits Seven Force 10

ISIN Code	• Class A: LU 2383069221 / Class R: LU 2383069494
Format	• SICAV Luxembourg UCITS
Classification	• Fonds diversifié flexible
Objectif	• Performance Absolue
Liquidité	• Journalière
Devises	• EUR– USD - CHF
Dépositaire	• CACEIS Bank Luxembourg – 5 Allée Scheffer – L2520 Luxembourg
Valorisateur	• CACEIS Bank Luxembourg – 5 Allée Scheffer – L2520 Luxembourg
Auditeur	• Deloitte Audit – 560 Rue Neudorf – L 2220 Luxembourg
Souscription Minimum	• Class I: EUR 1 000 – USD 1 000 – CHF 1 000 / Class P: EUR 100 – USD 100 – CHF 100
Management Fees	• Class I: 1 % maximum / Class R: 1,50 % maximum
Performance Fees	• 10% au dessus de l'Eonia capitalisé; High Water Mark

## SEVEN CAPITAL MANAGEMENT

39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tel. +33 1 42 33 04 05  
 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](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



# 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.

Veillez 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](mailto:info@seven-cm.com), ou à partir du site Internet de la société, [www.seven-cm.com](http://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](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 05

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](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





## Annexe 1 : méthode construction du Flex Index

Le Flex Index est un indice propriétaire constitué de 507 fonds identifiés à partir de la fonction « FUND SCREENER » de Bloomberg et des critères d'inclusion suivants :

1. Fonds de droit français et luxembourgeois
2. Fonds existant depuis au minimum le 1er janvier 2008
3. Fonds ayant des encours sous gestion à fin mars 2015 de 100 millions d'euros minimum
4. Fonds libellés en euro
5. Seuls sont retenues les performances de la part du fonds ayant le plus d'encours sous gestion
6. La classification Bloomberg du fonds est " MIXED ALLOCATION "

Il est important de signaler que notre sélection souffre d'un biais du survivant, car elle n'inclut pas les fonds ayant été liquidés au cours de la période 2008 – 2015, ni ceux, qui du fait de leurs mauvaises performances, sont descendus sous la barre des 100 millions d'euros d'encours sous gestion.

Ainsi les performances de l'indice Flex Index ont tendance à être supérieures à la performance réelle de l'univers des fonds Diversifiés / Flexibles / Mixtes / Balanced / Absolute Return / Patrimoine dans leur ensemble.

### SEVEN CAPITAL MANAGEMENT

39 rue Marbeuf 75008 Paris – France – Tel. +33 1 42 33 04 05  
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](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