



FTC Classic

Monatsreport 09|2025

www.ftc.at

Der **FTC Futures Fund Classic** ist ein 1998 in Luxemburg aufgelegter Alternativer Investmentfonds der Anlageklasse Managed Futures. Er investiert trendfolgend und regelbasiert in börsengehandelte Terminkontrakte (Futures) auf einer großen Anzahl internationaler Märkte und in allen liquiden Asset-Klassen (Aktien, Anleihen, Zinsen, Währungen und Rohstoffe).

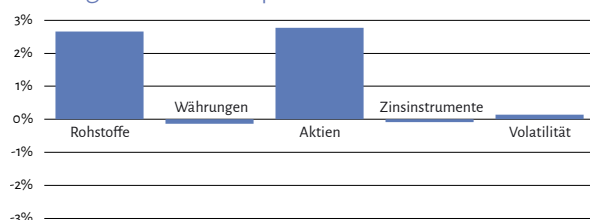
Ertrag ¹	ISIN	NAV	Monat	2025	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre
B EUR	LU0082076828	13.18	5.36%	-10.58%	-14.42%	-36.82%	-16.48%	-29.41%
B USD	LU0550775927	8.31	5.73%	-8.88%	-12.34%	-31.94%	-5.78%	-8.18%
C EUR	LU0888918488	15.77	5.56%	-9.00%	-12.44%	-32.35%	-5.91%	-11.15%

Kennzahlen ²	B EUR	B USD	C EUR
Ertrag p.a.	-3.42%	-0.85%	-1.18%
Volatilität (ann.)	15.50%	15.63%	15.55%
Sharpe Ratio (mod.)	neg.	neg.	neg.
Max Wertverlust	-42.33%	-38.49%	-38.57%

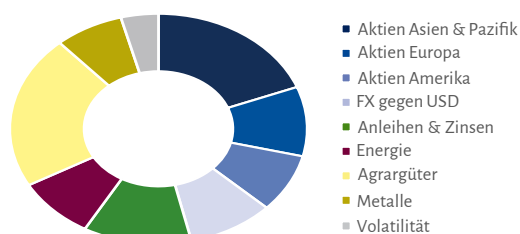
Zur aktuellen Wertentwicklung: Aus den USA kamen schwache Arbeitsmarktdaten und eine Senkung der Leitzinsen. Die Nicht-Einigung über ein Budget im Kongress führte Ende des Monats zu einem teilweisen Shutdown der staatlichen Dienste. In Europa ließ die EZB die Zinsen ungeachtet der Rezession in Deutschland unverändert. Die wichtigsten Aktienmärkte blieben trotz einer Serie von politischen Turbulenzen in den USA in ruhigem Fahrwasser. Mit Ausnahme des DAX legten die Leitindizes durchwegs zu – teils sogar kräftig. In Asien waren der Nikkei und der Hang Seng mit

Gewinnen von 5,2 bzw. 7,1 Prozent im Rally-Modus. In den Zins- und Währungssegmenten dominierten gering volatile Seitwärtsbewegungen. Die Monatsveränderungen waren entsprechend gering. Der Dollar-Index schloss bis auf die zweite Kommastelle auf dem Niveau von Ende August. Stärkere Bewegungen gab es bei Rohstoffen. Gold etwa legte gut zehn Prozent zu. Für den Fonds waren im September der anhaltende Aufwärtstrend an den Aktienmärkten sowie insbesondere die Edelmetalle aus dem Rohstoff-Segment bestimmend für das starke Monatsergebnis.

Beiträge zur Monatsperformance

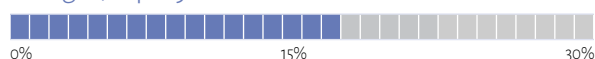


Margin-Allokation nach Sektoren



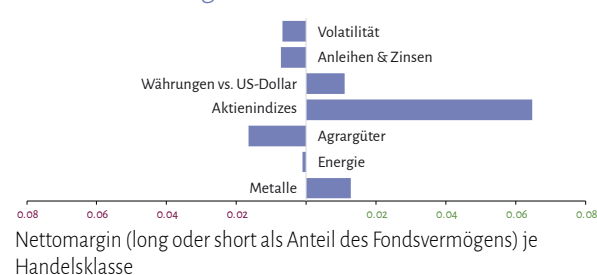
Anteile der einzelnen Sektoren an der Summe aller Einschuss-Margins

Margin/Equity-Ratio zum Monatsende



Quelle für alle Daten: FTC Datenbank

Positionierung in den Handelsklassen



Performance seit Strategiestart¹



Entwicklung der Stammklasse EUR B (Fondsstart 1.5.1998) und des Vorläuferproduktes vor Fondsstart (30.12.1994-30.4.1998).

¹ Jede Veranlagung ist mit einem Risiko verbunden. Kurse können sowohl steigen als auch fallen. Die historische Performance ist kein Indikator für die zukünftige Entwicklung. **Beachten Sie auch die Hinweise auf Seite 2.**

² Berechnung auf Basis der Monatsendwerte der letzten 10 Jahre.



FTC Classic

09|2025

Rechtliche Hinweise: Dies ist eine Marketingmitteilung. Die Inhalte dieser Unterlage dienen ausschließlich der unverbindlichen Information und sind weder als Angebot noch als Aufforderung zum Kauf bzw. Verkauf oder als eine Empfehlung zugunsten irgendwelcher Finanzinstrumente zu verstehen. FTC kann keinerlei Haftung oder Garantie für die Aktualität, Richtigkeit, Vollständigkeit oder dauernde Verfügbarkeit von in dieser Unterlage bereitgestellten Informationen übernehmen. Die veröffentlichten Prospekte und Basisinformationsblätter sämtlicher hierin genannten Fonds können in deutscher Sprache kostenlos insbesondere bei FTC Capital GmbH bezogen werden. Auf die darin enthaltenen Risikohinweise wird ausdrücklich verwiesen.

Der Vertrieb an professionelle Kunden in Deutschland ist zulässig. **Anteile am FTC Futures Fund Classic dürfen nicht an Privatkunden im Geltungsbereich des deutschen KAGB vertrieben werden.**

Der AIFM ist berechtigt, den Vertrieb des Fonds oder einzelner Anteilsklassen einzustellen.

Der FTC Futures Fund Classic unterliegt nicht der Aufsicht durch eine österreichische Behörde. Der Verkaufsprospekt und das Basisinformationsblatt gemäß der Verordnung (EU) Nr. 1286/2014 wurden von keiner österreichischen Behörde geprüft und keine österreichische Behörde übernimmt die Haftung für Richtigkeit oder Vollständigkeit dieser Unterlagen.

Warnhinweise und Risiken:

Der Fonds weist erhöhte Volatilität auf. Er kann zu wesentlichen Teilen in derivative Instrumente sowie Sichteinlagen oder kündbare Einlagen mit einer Laufzeit von höchstens 12 Monaten investieren. Warnhinweis zu FTC Futures Fund Classic (USD): Diese Anteilsklasse notiert in US Dollar; bei Anlagen in Fremdwährungen kann die Rendite infolge von Währungsschwankungen steigen oder fallen. Die Informationen gem. § 21 (4), (5) AIFMG werden im jeweils aktuellen Fonds-Rechenschaftsbericht offengelegt.

Jede Kapitalanlage ist mit einem Risiko verbunden. Kurse können sowohl steigen als auch fallen. Die Angaben zur Wertentwicklung beziehen sich auf die Vergangenheit. Die frühere Wertentwicklung ist kein verlässlicher Indikator für künftige Ergebnisse. Performance-Angaben berücksichtigen alle Gebühren im Fonds aber keinen Ausgabeaufschlag (AGA) oder allenfalls individuelle transaktionsbezogene oder laufend ertragsmindernde Kosten (z.B. Konto- und Depotgebühren). Das von FTC zum Einsatz gebrachte Computersystem verwendet bestimmte Strategien, die auf der Zuverlässigkeit und der Genauigkeit von Analysemodellen beruhen. Sollten sich diese Modelle (oder die ihnen zugrunde liegenden Annahmen) als nicht richtig erweisen, so entspricht die Performance möglicherweise nicht den Erwartungen, was substantielle Verluste für den Fonds und damit für die Investoren zur Folge haben kann.

Impressum: Medieninhaber, Herausgeber und Redaktion: FTC Capital GmbH, Seidlgasse 36/3, A-1030 Wien; Firmenbuchnummer: 131215p; Firmenbuchgericht: Handelsgericht Wien, Rechtsform: Gesellschaft mit beschränkter Haftung (GmbH), Aufsichtsbehörde gemäß ECG: Österreichische Finanzmarktaufsicht (FMA). Weitere Informationen gemäß Mediengesetz: www.ftc.at/impressum/

Stammdaten

Anteilsklassen	ISIN
B EUR	LU0082076828
B USD	LU0550775927
C EUR	LU0888918488

Bewertungstage: Täglich (Bankarbeitstage)

Ertragsverwendung: Thesaurierend

Struktur

Domizil:	Luxemburg
Rechtsform:	Alternative Investment Fund (AIF)
AIF:	FTC Futures Fund SICAV
Depotbank:	Quintet Private Bank (LU)
Administrator:	UI efa S.A. (LU)
Portfolioverwalter:	FTC Capital GmbH
Wirtschaftsprüfer:	Deloitte S.A. (LU)
Gründungsdatum:	1.5.1998
Rechnungswährung des AIF:	Euro
Aufsichtsbehörde:	CSSF, Commission de Surveillance du Secteur Financier

Mindestanlagebeträge

B EUR	EUR	1
B USD	USD	250.000,-
C EUR	EUR	250.000,-

Vertrieb:

FTC Capital GmbH
Seidlgasse 36/3, 1030 Wien
www.ftc-capital.com
sales@ftc.at
+431 585 61 69-0