



FTC Classic

Monatsreport 02 | 2023

www.ftc.at

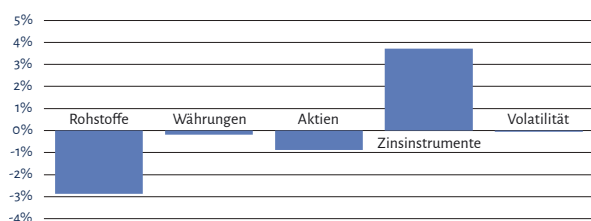
Wertentwicklung*	ISIN	NAV	02 2023	2023	12 Monate	5 Jahre	10 Jahre	Download
FTC Futures Fund Classic B EUR	LU0082076828	18,77	-0,3%	-2,8%	6,4%	6,4%	8,7%	Fund Fact Sheet
FTC Futures Fund Classic B USD	LU0550775927	11,09	-0,1%	-2,3%	9,1%	22,0%	34,6%	Fund Fact Sheet
FTC Futures Fund Classic C EUR**	LU0888918488	21,17	-0,1%	-2,4%	9,4%	19,8%	n.v.	Fund Fact Sheet

Zur aktuellen Wertentwicklung: Sowohl in den USA als auch in der Euro-Zone wurden die Leitzinsen Anfang Februar erneut und wie erwartet angehoben. In weiterer Folge kamen Inflationsdaten, die etwas über und Konjunkturdaten, die teilweise etwas unter den Erwartungen lagen. Die meisten etablierten Aktienmärkte legten zunächst noch kräftig zu, die Rallye verlor jedoch rasch an Schwung und verebbte schließlich ganz. Die Volatilitäten blieben dabei auf relativ niedrigem Niveau. Die amerikanischen Leitbörsen schlossen, ebenso wie Australien und Hong Kong, mit Verlusten, jene in Europa vorwiegend mit Gewinnen. Anleihen – vor al-

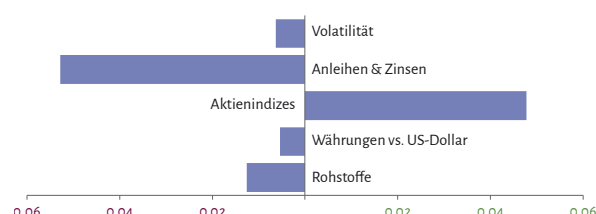
lem am langen Ende – fielen deutlich. Der 10jährige Bund-Future gab ebenso wie der Kontrakt auf Treasury Notes gleicher Laufzeit fast drei Prozent nach. Auch Metalle, Energie-Rohstoffe und Getreide wurden mit starken Abschlägen zum Januar gehandelt.

Der Fonds profitierte von den fortgesetzten Kursrückgängen auf den Anleihenmärkten, die von der Erwartung auf weiter steigende Zinsen getrieben wurden. Die Umschwünge auf den Aktien- und Rohstoffmärkten führten nicht nur zu einer Positionsumkehr im Commodity-Segment sondern erodierten leider auch die Profite.

Beiträge zur Monatsperformance

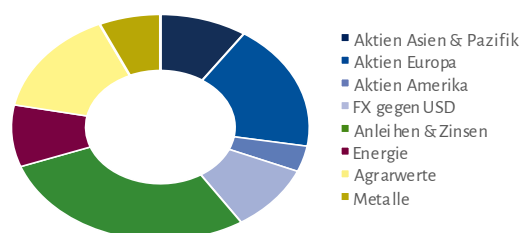


Positionierung in den Handelsklassen



Nettomargin (long oder short als Anteil des Fondsvermögens) je Handelsklasse

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

Tagesrenditen im Indexvergleich

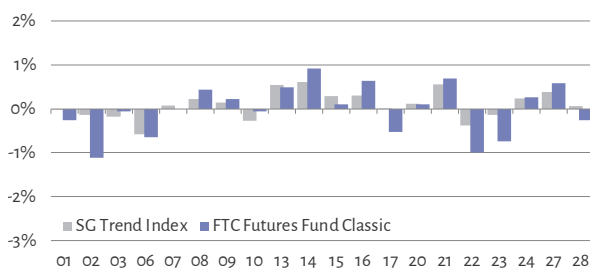


Abbildung: Tagesrenditen im FTC Futures Fund Classic (Euro) im Berichtsmonat und im Vergleich zu den Renditen des SG Trend Index. Indikative Werte für Bankfeiertage.

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.
 FTC Futures Fund Classic kann zu wesentlichen Teilen in börsengehandelte Futures sowie in Sichteinlagen oder kündbare Einlagen mit einer Laufzeit von höchstens 12 Monaten investieren.
 Gem. § 48 (7) Z.9 AIFMG wird auf das besondere mit dieser Veranlagung verbundene Risiko hingewiesen.
 Die Informationen gem. § 21 (4), (5) AIFMG werden im jeweils aktuellen Fonds-Rechenschaftsbericht offengelegt.

* Jede Veranlagung ist mit einem Risiko verbunden. Kurse können sowohl steigen als auch fallen. Beachten Sie auch die rechtlichen Hinweise sowie die Risikohinweise auf Seite 2.

** Start der institutionellen Anteilsklasse C EUR war der 3.2.2018; die Performance vor dem Start der Anteilsklasse beruht auf der Netto-Performance der Stammklasse (= Performance vor Management- und Performance-Fees) und den Gebühren der institutionellen Klasse C EUR.



FTC Classic

02|2023

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. Vervielfältigung oder Weitergabe von Informationen oder Daten, insbesondere die Verwendung von Texten, Textteilen oder Bildmaterial bedürfen der vorherigen Zustimmung der FTC Capital GmbH. Die veröffentlichten Prospekte und Basisinformationsblätter sämtlicher hierin genannten Fonds können kostenlos insbesondere bei FTC Capital GmbH bezogen werden. Weitere Abholstellen – auch in Ländern, in welchen die Fonds zum öffentlichen Vertrieb zugelassen sind - geben wir auf Wunsch gerne bekannt. Alle Angaben erfolgen ohne Gewähr. 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.**

Warnhinweise und Risiken: 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. **Alle genannten Fonds weisen eine erhöhte Volatilität auf.**

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/