



FTC Futures Fund Classic per 31|1|2025

Aktuelle NAVs: EUR B: **14.79**

USDB: **9.17**

| Ertrag* | EURB | USDB |
|--------------------------|---------|--------|
| Monat | 0.34% | 0.55% |
| 2025 | 0.34% | 0.55% |
| 1 Jahr | -9.98% | -7.75% |
| 3 Jahre | -14.31% | -7.75% |
| 5 Jahre | -5.37% | 6.38% |
| 10 Jahre | -29.94% | -9.66% |
| Anteilsklasse seit Aufl. | 75.57% | -8.30% |
| Strategie | 264.29% | n/a |

Korrelationen

| | |
|----------------------------|-------|
| MSCI WORLD \$ | -0.05 |
| BarclayCTA-Index | 0.79 |
| CS/T Index Managed Futures | 0.77 |
| REX Performance Index | 0.05 |

| Risiko/Ertrag seit Strategiestart* | |
|------------------------------------|---------|
| Annualisierter Ertrag: | 4.39% |
| Annualisierte Volatilität: | 20.43% |
| Modified Sharpe Ratio | 0.21 |
| Maximaler Wertverlust (Drawdown) | -43.65% |
| Calmar Ratio | 0.10 |

Effizienz seit Strategiestart*

| | |
|-----------------------------|-----|
| % positive Monate | 53 |
| % negative Monate | 47 |
| Positive 12-Monats-Perioden | 201 |
| Negative 12-Monats-Perioden | 149 |
| Längster Drawdown (Monate) | 191 |

| Investment Informationen | |
|--------------------------|---------------|
| ISIN Klasse EURB | LU0082076828 |
| ISIN Klasse USDB | LU0550775927 |
| Liquidität | täglich |
| Min. Investment EURB | 1 Stück |
| Min. Investment USDB | USD 250.000,- |

Stammdaten

| | |
|--------------------|-------------------------|
| Anlagekategorie | Managed Futures |
| Investmentstil | systematisch long/short |
| Domizil/Rechtsform | Luxemburg/AIF/SICAV |
| Depotbank | Quintet (Luxemburg) |
| Administrator | EFA S.A. |
| Wirtschaftsprüfer | Deloitte S.A. |
| Manager | FTCCapital GmbH |

| Erträge in %* | Jan | Feb | Mär | Apr | Mai | Juni | Juli | Aug | Sept | Okt | Nov | Dez | YTD |
|---------------|-------|--------|-------|--------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|
| 2004 | -2.09 | 15.85 | -2.00 | -11.33 | -2.83 | -6.42 | -2.32 | -7.00 | 5.57 | 1.94 | 9.02 | 0.56 | -3.93 |
| 2005 | -8.32 | 3.75 | -2.65 | -6.55 | 5.19 | 9.27 | 2.17 | 4.46 | 5.02 | -8.62 | 7.79 | 3.25 | 13.38 |
| 2006 | 2.56 | -3.08 | 8.19 | 3.10 | -6.18 | -1.34 | -9.35 | 2.04 | -4.15 | 5.24 | 1.53 | 8.39 | 5.38 |
| 2007 | 5.14 | -7.42 | -3.88 | 12.51 | 7.23 | 2.71 | -9.12 | -8.79 | 11.45 | 8.80 | -2.08 | 0.14 | 14.26 |
| 2008 | 3.77 | 8.73 | 1.01 | -2.53 | -2.76 | 8.86 | -4.19 | 1.41 | 8.61 | 10.99 | 2.67 | 0.41 | 41.95 |
| 2009 | 1.69 | 1.67 | -6.81 | -3.29 | -0.38 | -2.56 | -2.91 | 5.66 | 4.27 | -6.63 | 7.19 | -4.31 | -7.36 |
| 2010 | -7.05 | 0.09 | 8.31 | 1.64 | -5.84 | -1.34 | 0.89 | 4.79 | -4.17 | 4.08 | -6.41 | 6.23 | -0.26 |
| 2011 | 1.70 | 4.45 | -3.63 | 7.57 | -8.95 | -5.14 | 0.00 | -1.27 | -2.38 | -4.89 | -2.52 | 0.16 | -14.87 |
| 2012 | 3.31 | 2.04 | -1.85 | 0.71 | 3.63 | -4.92 | 1.90 | 2.97 | -2.10 | -4.39 | -3.55 | 0.05 | -2.68 |
| 2013 | 0.38 | -7.00 | 1.51 | -0.34 | -3.43 | -8.54 | -0.84 | -2.94 | -0.40 | 6.42 | 2.73 | -3.15 | -15.35 |
| 2014 | -7.28 | 1.52 | -4.48 | 0.50 | 3.11 | 2.47 | -2.54 | 4.87 | 6.94 | 0.12 | 13.81 | 0.05 | 18.97 |
| 2015 | 13.31 | 0.95 | 1.83 | -7.83 | 0.30 | -7.63 | 3.78 | -5.93 | 3.21 | -3.27 | 4.87 | -5.60 | -4.03 |
| 2016 | 9.00 | 4.72 | -5.44 | -1.97 | -4.55 | 1.27 | 2.19 | -4.49 | -1.01 | -5.26 | 1.73 | 3.11 | -1.79 |
| 2017 | -1.99 | 3.49 | -2.75 | -0.17 | 0.98 | -3.95 | 2.15 | -1.58 | 0.30 | 8.28 | -0.71 | 2.04 | 5.64 |
| 2018 | 11.54 | -14.69 | -1.25 | -0.23 | -3.05 | -0.24 | 1.66 | 2.51 | -1.77 | -6.56 | -1.06 | 3.20 | -11.43 |
| 2019 | -6.21 | -1.56 | 4.15 | 4.18 | -0.06 | 2.37 | 2.20 | 6.04 | -8.82 | -8.89 | 4.62 | -3.03 | -6.39 |
| 2020 | 1.63 | 0.58 | 10.69 | -0.40 | -3.81 | -3.36 | 5.09 | 1.00 | -7.72 | -2.53 | -1.50 | 8.78 | 7.15 |
| 2021 | -1.64 | 11.29 | 2.05 | 1.90 | 0.75 | -1.43 | -2.36 | -1.92 | -0.39 | 4.28 | -7.72 | -2.05 | 1.64 |
| 2022 | 3.04 | 2.20 | 6.35 | 5.92 | -2.37 | 2.06 | -3.94 | 3.52 | 5.94 | -2.01 | -5.58 | 0.00 | 15.22 |
| 2023 | -2.49 | -0.27 | -7.62 | 1.21 | 3.08 | 0.17 | -2.54 | -1.81 | 4.15 | -1.22 | -5.27 | -1.66 | -13.89 |
| 2024 | -1.14 | 5.90 | 4.02 | 0.72 | -2.03 | -3.42 | -2.67 | -8.87 | 0.65 | -6.36 | 2.08 | 0.14 | -11.31 |
| 2025 | 0.34 | | | | | | | | | | | | 0.34 |

Rechtliche Informationen

* Marketingmitteilung. Angaben beziehen sich, wenn nicht anders angegeben, auf die Stammklasse EUR B (Fondsstart 1.5.1998) und die Classic Strategie vor Fondsstart (1.1.1995-30.4.1998); die Performance vor Fondsstart beruht auf einem Vorläuferprodukt mit ähnlicher Strategie. Angaben zur Wertentwicklung beziehen sich auf die Vergangenheit. Die frühere Wertentwicklung ist kein verlässlicher Indikator für künftige Ergebnisse. Die Wertentwicklung kann in Folge von Währungsschwankungen steigen oder fallen. Performance-Angaben beruhen auf monatlichen Daten, berücksichtigen alle Gebühren im Fonds aber keinen Ausgabeaufschlag (bis max. 4,5%) und allenfalls individuelle transaktionsbezogene oder laufend ertragsmindernde Kosten (z.B. Konto- und Depotgebühren). Der Fonds weist erhöhte Volatilität auf. Prospekt und Kundeninformationsdokument sind in deutscher Sprache unter www.ftc.at kostenlos erhältlich. Datenquelle: FTC Capital.

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.

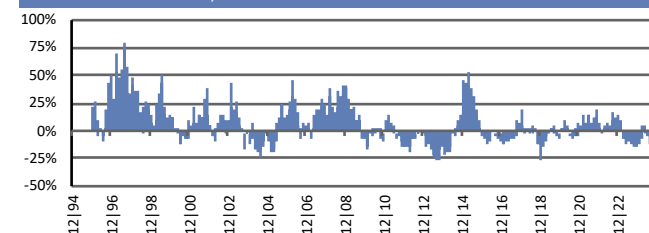
Gem. §48 (7) Z.9 AIFMG wird auf das besondere mit dieser Veranlagung verbundene Risiko hingewiesen.

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. Der FTC Futures Fund Classic unterliegt der Aufsicht der Finanzaufsichtsbehörde in Luxemburg (CSSF, Commission de Surveillance du Secteur Financier).

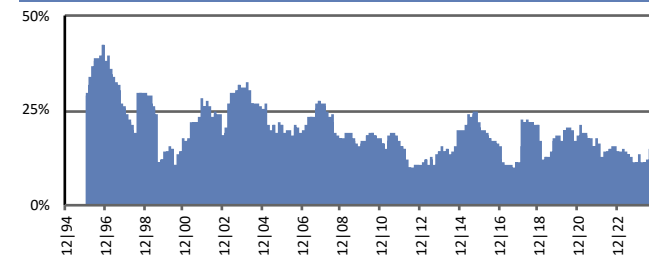
Performance in %*



12-Monatsrenditen in %*



12-Monatsvolatilitäten in %



Kontakt

FTC Capital GmbH
 Seidlgasse 36, 1030 Wien, Österreich
 +431 585 61 69-0
www.ftc.at
office@ftc.at