

FTC Futures Fund Classic per 31|12|2018



Aktuelle NAVs: EUR B: 16.43

USD B: 8.71

Ertrag*	EUR B	USD B
Monat	3.20%	3.57%
2018	-11.43%	-8.12%
1 Jahr	-11.43%	-8.12%
3 Jahre	-8.11%	0.58%
5 Jahre	4.92%	16.60%
Anteilsklasse seit Auf System	95.04%	-12.90%
	304.68%	n/a

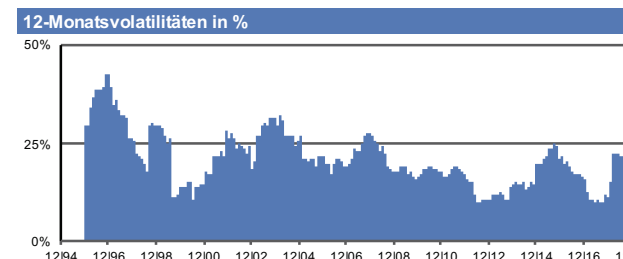
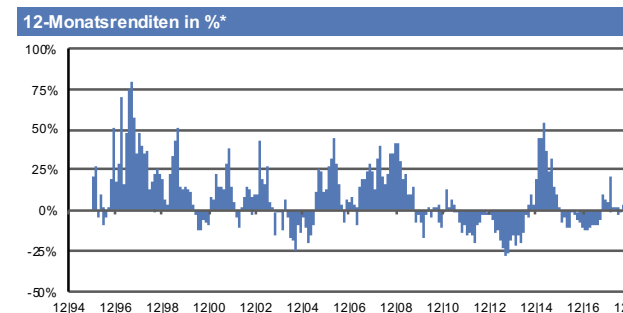
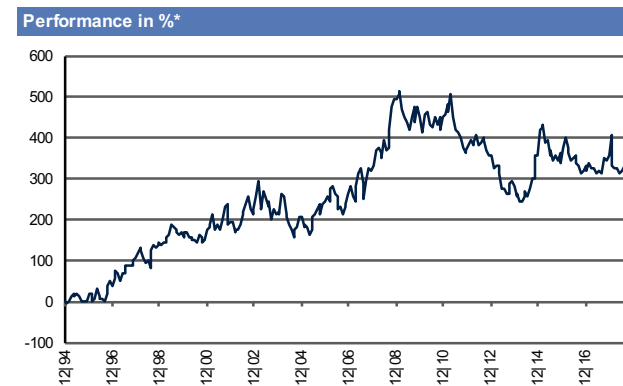
Risiko/Ertrag seit Systemstart*	
Annualisierter Ertrag:	6.00%
Annualisierte Volatilität:	21.55%
Ertrag/Volatilität (Mod. Sharpe Ratio)	0.28
Maximaler Wertverlust (Drawdown)	-43.65%
Ertrag/Max DD (Mod. Calmar Ratio)	0.14
Annualisierte Downside Deviation	19.42%
Ertrag/Downs. Dev. (Sortino Ratio)	0.31

Investment Information	
ISIN Klasse EUR B	LU0082076828
ISIN Klasse USD B	LU0550775927
Liquidität	täglich
Max. Ausgabeaufschlag	4.50%
Managem. Fee (EUR B)	4.00%
Perf. Fee (EUR B)	23% (High Watermark)
Anlagekategorie	Managed Futures
Investmentstil	systematisch long/short
Domizil/Rechtsform	Luxemburg/SICAV
Depotbank	KBL (Luxemburg)
Administrator	EFA S.A.
Wirtschaftsprüfer	Deloitte S.A.
Manager	FTC Capital GmbH

KORRELATIONEN	
MSCI WORLD INDEX (EUR)	-0.01
MSCI WORLD \$	-0.01
Barclay CTA-Index	0.79
CS/T Index Managed Futures	0.76
REX Performance Index	0.21

Effizienz seit Systemstart	
% positive Monate	54
% negative Monate	46
Positive 12-Monats-Perioden	164
Negative 12-Monats-Perioden	113
Längster Drawdown (Monate)	118

Erträge in %	Jan	Feb	Mär	Apr	Mai	Juni	Juli	Aug	Sept	Okt	Nov	Dez	YTD
1995	-3.12	4.82	12.67	3.57	-4.00	5.07	-5.05	-8.34	-4.20	-0.68	-0.09	22.19	20.83
1996	2.00	-15.59	5.49	18.57	-10.22	-6.88	-0.20	-3.73	14.53	17.79	5.72	-4.48	17.86
1997	11.30	11.78	-5.22	-9.42	13.10	-1.28	11.27	-0.88	0.97	0.43	4.80	5.49	47.45
1998	5.93	5.33	-3.14	-8.57	-5.80	2.42	-7.36	23.55	3.99	-1.67	1.43	2.11	15.57
1999	-2.08	2.57	1.72	3.17	2.59	9.34	-2.00	-0.95	-1.82	-3.10	3.18	-5.85	6.07
2000	4.34	0.86	-5.70	0.78	-1.60	-0.62	-2.05	7.65	-3.36	-4.56	2.46	11.49	8.65
2001	1.04	1.80	8.65	-10.95	4.00	-0.03	-3.90	7.68	10.38	2.79	-15.20	2.78	5.89
2002	-0.12	-7.56	2.10	0.21	4.03	7.80	1.98	6.53	5.74	-8.76	-4.12	3.37	10.05
2003	9.79	9.85	-15.23	-1.92	13.52	-5.20	-4.51	2.97	-12.53	7.31	-3.38	1.95	-1.90
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



Rechtliche Informationen

* Marketingmitteilung. Angaben zur Wertentwicklung beziehen sich auf die Vergangenheit. Die frühere Wertentwicklung ist kein verlässlicher Indikator für künftige Ergebnisse. Die Wertentwicklung kann infolge 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 Kundeninformations-dokument sind in deutscher Sprache unter www.ftc.at kostenlos erhältlich. Datenquelle: FTC Capital. 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.

FTC Futures Fund Classic kann zu wesentlichen Teilen in börsenhandelte 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.

Kontakt

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