



# Futures Fund Classic

12 | 2021

FTC Futures Fund SICAV | 88 Grand Rue | L-1660 Luxembourg

## Wesentliche Anlegerinformationen über den FTC Futures Fund Classic B USD (ISIN: LU0550775927)

Gegenstand dieses Dokuments sind wesentliche Informationen für den Anleger über den FTC Futures Fund Classic. Es handelt sich nicht um Werbematerial. Diese Informationen sind gesetzlich vorgeschrieben, um Ihnen die Wesensart des FTC Futures Fund Classic und die Risiken einer Anlage in diesen zu erläutern. Wir raten Ihnen zur Lektüre dieses Dokuments, so dass Sie eine fundierte Anlageentscheidung treffen können.

Der FTC Futures Fund Classic darf gem. AIFMG an Privatkunden vertrieben werden.

Der Fondsmanager FTC Capital GmbH, Seidlgasse 36/3, 1030 Wien, ist ein konzessionierter Alternativer Investment Fonds Manager (AIFM).

## Ziele und Anlagepolitik

Der FTC Futures Fund Classic investiert in ein breit gestreutes Portfolio aus börsengehandelten Futureskontrakten aus allen Klassen (Aktienindizes, Geldmarktzinsen, Anleihen, Währungen, Rohstoffe). Erträge verbleiben im Fonds und erhöhen den Wert der Anteile.

Der Fonds bietet die erwünschten Eigenschaften der Trendfolgestrategie (positive Marktkorrelation in Aufwärtstrends sowie negative Korrelation in Abwärtszyklen), verbunden mit einem Schwerpunkt auf Verlustbegrenzung. Das Ziel sind überlegene Risiko adjustierte Renditen.

Anteile an Investmentfonds (OGAW, OGA) dürfen insgesamt bis zu 10% des Fondsvermögens erworben werden. Detaillier-

tere Angaben zu Veranlagungsmöglichkeiten und Risiken finden Sie im Prospekt.

Sie können die Rücknahme Ihrer Fondsanteile borsertäglich verlangen. Die FTC Futures Fund SICAV kann die Anteilswertberechnung, die Ausgabe und die Rücknahme von Anteilen am Fonds aussetzen, wenn außergewöhnliche Umstände dies erforderlich erscheinen lassen. Der Rücknahmepreis entspricht dem Anteilswert, abgerundet auf den nächsten USD-Cent. Die Berechnung des Anteilswertes erfolgt in US-Dollar.

Dieser Fonds ist unter Umständen für jene Anleger nicht geeignet, die ihr Geld innerhalb eines Zeitraums von 5 Jahren aus dem Fonds wieder zurückziehen wollen. Der FTC Futures Fund Classic weist erhöhte Volatilität auf.

## Risiko- und Ertragsprofil

← Typischerweise geringere Rendite und geringeres Risiko



Typischerweise höhere Rendite und höheres Risiko →

Der Indikator gibt die Schwankung des Fondsanteilspreises in den Kategorien 1 bis 7 auf Basis der Entwicklung in der Vergangenheit an. Er beschreibt das Verhältnis der Chancen auf Wertsteigerungen zum Risiko von Wertrückgängen. Die Einstufung ist kein verlässlicher Hinweis auf die künftige Entwicklung und kann sich im Laufe der Zeit ändern. Eine Einstufung in Kategorie 1 bedeutet nicht, dass es sich um eine risikofreie Anlage handelt. Die Einstufung stellt auch kein Ziel und keine Garantie dar. Aufgrund der in der Vergangenheit gemessenen Kurschwankungen erfolgt eine Einstufung in die Kategorie 6.

**Risiken, die typischerweise von der Risikoeinstufung nicht angemessen erfasst werden und trotzdem für den Fonds von Bedeutung sind:**

**Kredit- und Kontrahentenrisiko:** Der Fonds schließt Geschäfte mit verschiedenen Vertragspartnern ab. Wenn ein Vertragspartner insolvent wird, kann er offene Forderungen des Fonds nicht mehr oder nur noch teilweise begleichen.

**Liquiditätsrisiko:** Risiko, dass eine Position im Fondsvermögen nicht innerhalb hinreichend kurzer Zeit mit begrenzten Kosten

veräußert, liquidiert oder geschlossen werden kann und dass dies die Fähigkeit des Fonds, die Rücknahme und Auszahlungsverpflichtung jederzeit nachzukommen, beeinträchtigt.

**Operationelles Risiko:** Das Verlustrisiko für den Fonds, das aus unzureichenden internen Prozessen sowie aus menschlichem oder Systemversagen bei der Verwaltungsgesellschaft oder aus externen Ereignissen resultiert und Rechts- und Dokumentationsrisiken sowie Risiken, die aus den für den Fonds betriebenen Handels-, Abrechnungs- und Bewertungsverfahren resultieren, einschließt.

**Verwahrrisiko:** Der Fonds kann durch Fehler der Verwahrstelle der Vermögensgegenstände geschädigt werden.

**Risiken aus Derivateinsatz:** Der Fonds setzt Derivatgeschäfte als aktives Veranlagungsinstrument ein, wodurch das Risiko des Fonds erhöht wird.

**Währungsrisiko:** Das Risiko eines Verlusts aufgrund von Wechselkursschwankungen oder aufgrund von devisenrechtlichen Bestimmungen.

**Umfassende Erläuterungen der Risiken des Fonds erfolgen im Prospekt.**

## Kosten

Die entnommenen Gebühren werden für die Verwaltung des Fonds verwendet. Darin enthalten sind auch die Kosten für den Vertrieb und das Marketing der Fondsanteile. Durch die Entnahme der Kosten wird die mögliche Wertentwicklung geschmälert.

### Einmalige Kosten vor und nach der Anlage:

Ausgabeaufschlag	4,5%
Rücknahmeabschlag	0%

Dabei handelt es sich jeweils um den Höchstbetrag, der vor der Anlage abgezogen wird. Die tatsächlichen Gebühren hängen von der jeweiligen Vertriebsstelle ab und können jederzeit bei dieser erfragt werden.

### Kosten, die vom Fonds im Laufe des Jahres abgezogen werden (ohne Broker-Fee):

Laufende Kosten	3,6%
-----------------	------

Die „laufenden Kosten“ wurden auf Basis der Zahlen des letzten Geschäftsjahres berechnet, welches am 30.9.2021 endete. Sie können von Jahr zu Jahr schwanken. Die laufenden Kosten beinhalten die Verwaltungsvergütung und alle Gebühren, die im Laufe eines Jahres anfallen. Transaktionskosten und Erfolgshonorar sind nicht enthalten. Eine genaue Darstellung der in den laufenden Kosten enthaltenen Bestandteile findet sich im aktuellen Rechenschaftsbericht.

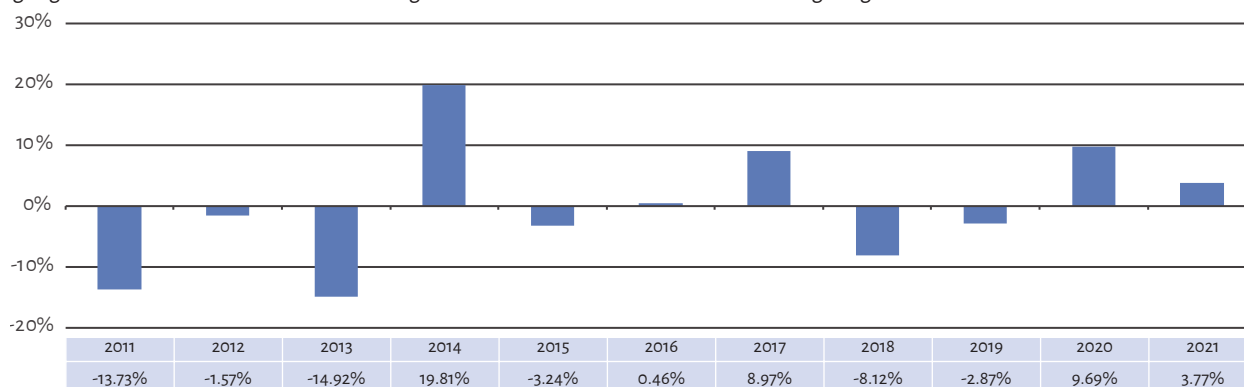
### An die Wertentwicklung des Fonds gebundene Kosten:

Erfolgshonorar	20%
----------------	-----

Es wird täglich ein Erfolgshonorar (Performance-Fee) in Höhe von 20% der kumulativen Handelsgewinne im Abrechnungszeitraum (High Watermark) ermittelt, das monatlich zahlbar ist. Im letzten Geschäftsjahr fielen keine Kosten für die Performance-Fee an. Nähere Angaben zu Höhe, Art und Berechnungsmethode dieser Vergütung finden sich im Prospekt und im Rechenschaftsbericht.

## Wertentwicklung in der Vergangenheit

Die nachstehende Grafik zeigt die Wertentwicklung des Fonds in USD unter Berücksichtigung sämtlicher Kosten und Gebühren, mit Ausnahme der Ausgabeaufschläge und Rücknahmeabschläge. Angaben zu Wertentwicklungen beziehen sich auf die Vergangenheit. Die frühere Wertentwicklung ist kein verlässlicher Indikator für künftige Ergebnisse.



## Praktische Informationen

Depotbank: Quintet Private Bank (Europe) S.A. (vormals KBL European Private Bankers S.A.) 43, Boulevard Royal L-2955 Luxemburg.

Die aktuellen Anteilspreise werden im Internet veröffentlicht ([www.ftc.at](http://www.ftc.at)). Sonstige Informationen für die Anleger werden im „Amtsblatt zur Wiener Zeitung“ bekanntgemacht. Hinsichtlich etwaiger Verkaufsbeschränkungen bzw. hinsichtlich weiterführender Angaben zum Fonds wird auf den Prospekt verwiesen. Der Prospekt, die Rechenschafts- und Halbjahres-

berichte sowie sonstige Informationen sind jederzeit kostenlos bei FTC Capital GmbH sowie unter [www.ftc.at](http://www.ftc.at) in deutscher Sprache erhältlich.

Die Besteuerung von Erträgen oder Kapitalgewinnen aus dem Fonds hängt von der Steuersituation des jeweiligen Anlegers und/oder von dem Ort, an dem das Kapital investiert wird, ab. Bei Fragen sollte professioneller Rat eingeholt werden. Der Fonds ist in Luxemburg zugelassen und wird durch die dortige Aufsichtsbehörde CSSF reguliert.

Literatur: Majcen, MiFID II für Managed Futures – eine Standortbestimmung, ÖBA 3/18, S196ff

Die Informationen gem. § 21 (4), (5) AIFMG werden im jeweils aktuellen Fonds-Rechenschaftsbericht offengelegt.