



# FTC Vermögensverwaltung Portfolio 1

per 31.05.2018

## Anlagestrategie

Portfolio 1 investiert den Großteil des Vermögens in Geldmarkt- und Anleihen-Fonds und ist für Anleger mit dem Wunsch nach geringeren, aber konstanten Erträgen bei geringerem Risiko konzipiert.

Dieses Portfolio investiert v.a. in ETFs (börsengehandelte Fonds) und Investmentfonds aus folgenden Bereichen: Geldmarkt, Anleihen, Aktien und alternative Investments (Hedgefonds, Managed Futures, Rohstoffe). Die Auswahl der einzelnen ETFs bzw. Fonds erfolgt anhand einer quantitativen Systematik, die v.a. die historische Wertentwicklung und Volatilität der einzelnen Instrumente analysiert. Um das Risikoprofil konstant zu halten, wird das Portfolio in regelmäßigen Abständen (meist monatlich) an die Zielallokationen angepasst.

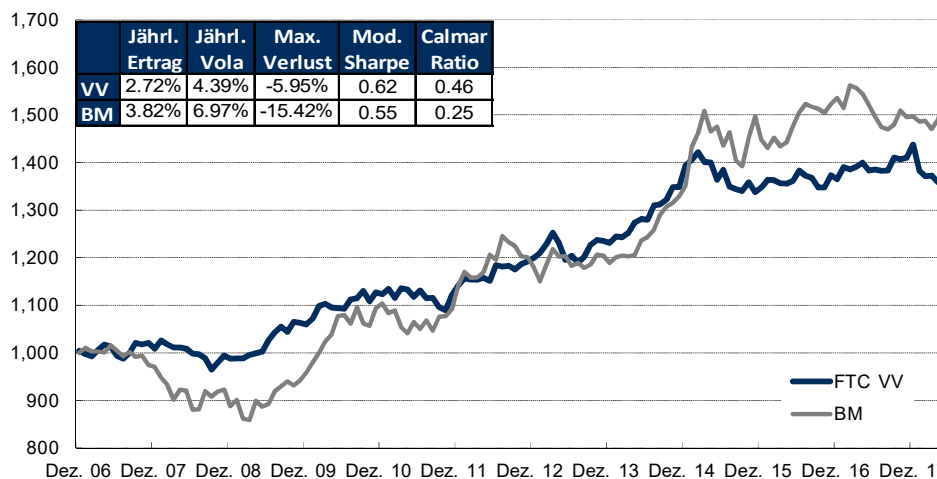
Die Zielallokationen für dieses Portfolio sind wie folgt:

Anleihen:	0% - 60%
Aktien:	0% - 20%
Alt. Inv.:	0% - 20%

Bei diesen Vorgaben handelt es sich um Richtwerte, die sich aufgrund von Marktentwicklungen auch verändern können.

Benchmark (BM): 60% Anleihen (iShares Global Govt Bond ETF), 40% Aktien (iShares Core MSCI World ETF)

Jahresergebnisse	
Jahr	Ertrag
2018	-3.63%
2017	2.68%
2016	2.63%
2015	-0.79%
2014	9.19%
2013	3.59%
2012	6.31%
2011	-0.50%
2010	6.02%
2009	6.96%
2008	-2.67%
2007	2.11%



Quelle: FTC Capital GmbH

## Ertrags- / Risikoanalyse

	seit		
	3 Jahren	5 Jahren	Dez. 06
Gesamtertrag:	-2.98%	10.40%	35.83%
Jährlicher Ertrag:	-1.00%	2.00%	2.72%
Durchschn. Monatsertrag:	-0.08%	0.17%	0.23%
Volatilität (Jährl. St.Abw.):	4.58%	4.66%	4.39%
# Pos. Monate (Mittelw.%):	17 (0.95%)	33 (1.08%)	74 (1.14%)
# Neg. Monate (Mittelw.%):	19 (-0.99%)	27 (-0.93%)	63 (-0.84%)

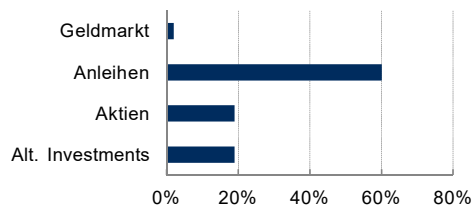
## Ertragsanalyse nach Zeitraum

Periode (Monate)	31.12.2006 bis 31.05.2018		
	Max.	Min.	Mittelwert
1	3.36%	-3.80%	0.23%
3	6.17%	-4.51%	0.73%
12	14.38%	-5.47%	3.24%
24	17.09%	-2.56%	7.14%
36	23.73%	-3.58%	11.71%
60	31.51%	9.62%	21.05%

## Analyse der temporären Wertrückgänge

5 größte Rückgänge	Länge (Monate)	Erholungsphase (Monate)	Zeitraum	
			Beginn	Ende
5.95%	8	9	Mrz. 08	Jul. 09
5.91%	9	25	Apr. 15	Jan. 18
5.50%	4	0	Feb. 18	aktuell
5.03%	4	8	Mai. 13	Apr. 14
4.10%	7	2	Mai. 11	Jan. 12

## Aktuelle Portfoliogewichtung



Die gezeigte Wertentwicklung bezieht sich inklusive Dezember 2016 auf eine historische Simulation. Diese berücksichtigt Verwaltungsgebühren und Transaktionskosten, nicht jedoch Depotgebühren und Steuern. Wertentwicklungen der Vergangenheit sind kein verlässlicher Indikator für die zukünftige Wertentwicklung.

## Rechtlicher Hinweis

Jede Investition ist mit Risiken verbunden. Beachten Sie daher unbedingt den Hinweis sowie die Anlagechancen und Anlagerisiken auf der Rückseite dieses Dokuments.



## FTC Vermögensverwaltung Portfolio 1

per 31.05.2018

### SRI (Synthetischer Risiko Rendite Indikator)

<-geringes Risiko			hohes Risiko->			
1	2	3	4	5	6	7
0%- 0.5%	0.5%- 2%	2%- 5%	5%- 10%	10%- 15%	15%- 25%	>25%
<-mögl. geringer Ertrag			mögl.hoher Ertrag->			

Der Synthetische Risiko Rendite Indikator stellt neben anderen Kennzahlen wie Maximum Drawdown und Value at Risk ein Maß zur Messung des Portfoliorisikos dar. Die Berechnung setzt auf die historische Volatilität (annualisierte Standardabweichung) der Portfoliorenditen auf und transferiert diese in einen Indikator. Berücksichtigt werden die Renditen der letzten 5 Jahre.

Portfolio 1 wurde in die Risikoklasse 3 eingestuft, da die Standardabweichung der historischen Erträge über die letzten 5 Jahre zwischen 2%-5% betrug.

### Anlagechancen

- Professionelles Portfoliomanagement durch ein Team mit langjähriger Erfahrung im Finanzbereich.
- Breite Diversifikation des Anlagekapitals auf mehrere Anlageklassen und Fonds auch bei geringen Portfoliogrößen.
- Kostengünstiger Zugang zu Investmentfonds.
- Ertragschancen sowohl auf Zinsmärkten, Aktienmärkten, Währungsmärkten als auch Rohstoffmärkten.
- Systematische Portfolioabsicherung durch Handelsstrategie und durch Beimischung von Managed Futures.

### Anlagerisiken

- Investitionen sind generell mit Risiken verbunden. Die speziellen Risiken hängen vom jeweiligen Finanzinstrument ab.
- Die einzelnen Finanzinstrumente unterliegen u.a. folgenden Risiken: Kursrisiko, Währungsrisiko, Zinsrisiko, Emittentenrisiko, ...
- Die Kurse der einzelnen Finanzinstrumente (ETFs, Fonds, ...) können erheblich schwanken. Der Gesamtwert des Portfolios kann daher Schwankungen unterliegen und auch unter den Einstandswert fallen. Kapitalverluste sind nicht auszuschließen.
- Bei Managed Futures sind Verluste bei häufigen Trendwechseln möglich, die vielleicht nur langsam in Folgejahren oder gar nicht mehr egalisiert werden können.

#### Zielgruppe

Anlagehorizont:	mind. 3 Jahre
Ertragserwartung:	gering
Risikoneigung:	gering bis mittel

#### Gebühren

Verwaltungsgebühr:	0.8% p.a.
Depotgebühren, Transaktionskosten:	siehe aktuelles Preisverzeichnis der Depotbank

#### Allgemeine Informationen

Vermögensverwalter:	FTC Capital GmbH
Depotbank:	FIL Fondsbank GmbH
Mindestanlage:	30,000 EUR
Aufstockungen:	ab 1 EUR
Sparplan:	ab 100 EUR monatlich

#### Kontakt

FTC Capital GmbH
Seidlgasse 36/3, 1030 Wien
Tel: +43-1-585 61 69
Internet: <a href="http://www.ftc.at">www.ftc.at</a>
Email: <a href="mailto:office@ftc.at">office@ftc.at</a>

### Rechtlicher Hinweis

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.

**Warnhinweise und Risiken:** Jede Kapitalanlage ist mit einem Risiko verbunden. Kurse können sowohl steigen als auch fallen. 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 andere ertragsmindernde Kosten wie individuelle 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 die Strategie und damit für die Investoren zur Folge haben kann.

**Hinweis zum Einsatz von Eigenprodukten:** Die Strategie kann auch in Fonds investieren, die von FTC verwaltet werden und für deren Verwaltung FTC eine Gebühr erhält, insbesondere in den FTC Futures Fund Classic. Der veröffentlichte Verkaufsprospekt des FTC Futures Fund Classic und das Kundeninformationsdokument (KID) sind für Investoren oder potentielle Investoren in deutscher Sprache kostenlos in Österreich in elektronischer Form insbesondere unter [www.ftc.at](http://www.ftc.at) erhältlich und verfügbar.