



# FTC Classic

## Monatsreport 12|2018

www.ftc.at

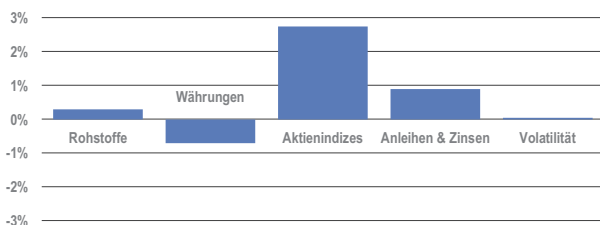
Wertentwicklung*	ISIN	NAV	12 2018	2018	12 Monate	5 Jahre	Downloads
FTC Futures Fund Classic (Euro)	LU0082076828	16,43	3,20%	-11,43%	-11,43%	4,92%	Fact Sheet
FTC Futures Fund Classic (USD)	LU0550775927	8,71	3,57%	-8,12%	-8,12%	16,60%	
SG Trend Index			1,02%	-8,04%	-8,04%	5,63%	

**Zur aktuellen Wertentwicklung:** Zu den bekannten Unsicherheiten wie Brexit, Italien oder Handelskrieg gesellten sich eine weitere Zinserhöhung in den USA, ein Vorzeichen für eine künftig etwas weniger lockere Zinspolitik der EZB und einige lahme Wirtschaftsdaten.

In diesem Umfeld zeigten sich vor allem die Aktienbörsen hoch volatil. Für Aktien war der Dezember der schlechteste Monat seit langem. Um 9,2 % ging es im S&P 500 talwärts, der Nikkei verlor 10,5 % und die Blue Chips des EuroStoxx 5,4 %. Nicht ganz so turbulent ging es an den Anleihemärkten zu, wo die Preise von deutschen Bundesanleihen

und US-Treasuries weiter stiegen – die zehnjährigen US-Papiere um 2,2, die deutschen um 0,7 %. Der US-Dollar war trotz Zinserhöhung unter Druck. Er gab gegen den Euro und stärker noch gegen den Yen nach. Im Rohstoffsegment fielen die Ölpreise nochmals stark. US-Leichtöl schloss bei 45 Dollar/Barrel um 12,5 % tiefer als Ende November. Der Fonds erzielte im Dezember eine deutliche Benchmark-Outperformance. Er konnte die intakten Trends bei Aktien und Anleihen profitabel nutzen. Höhere Gewinne im Rohstoffhandel wurden durch einen Trendabrisse bei US-Flüssiggas verhindert.

### Beiträge zur Monatsperformance



Nettobeiträge zur Monatsperformance je Handelsklasse.

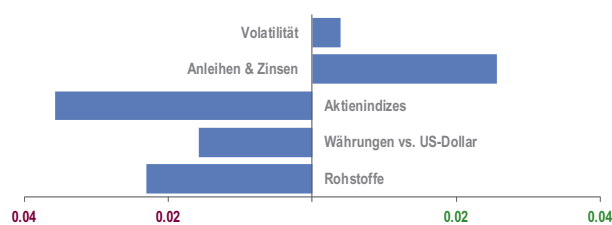
	Trend	Micro	Intraday	Quant
Währungen	-	-	-	n.v.
Zinsen	+	-	+	n.v.
Aktienindizes	++	+	-	-
Rohstoffe	+	0	+	n.v.
Volatilität	n.v.	n.v.	n.v.	+

Relative Beiträge je Handelsklasse und Strategieguppe von stark negativ (--) über (annähernd) neutral (0) bis hoch positiv (++)

### Margin/Equity-Ratio zum Monatsende

FTC Futures Fund Classic	12,8 %
--------------------------	--------

### Margin-Allokation zum Monatsende



Nettomargin (als Anteil vom Fondsvermögen) je Handelsklasse.

### Tagesrenditen im Indexvergleich

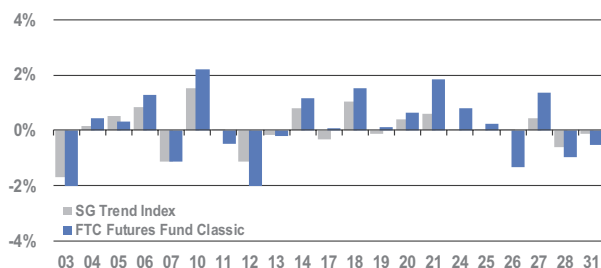


Abbildung: Tagesrenditen im FTC Futures Fund Classic (Euro) im Berichtsmontat und im Vergleich zu den Renditen des SG Trend Index. Indikative Werte für Bankfeiertage.

Quelle: FTC Datenbank

**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.



# FTC Classic

12|2018

FTC Capital GmbH | Seidlgasse 36/3 | 1030 Vienna | Austria | [www.ftc.at](http://www.ftc.at) | [office@ftc.at](mailto:office@ftc.at) | +43-1-585 61 69-0

**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 Kundeninformationsdokumente 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: <http://www.ftc.at/impresum/>