



FTC Classic

Monatsreport 03|2026

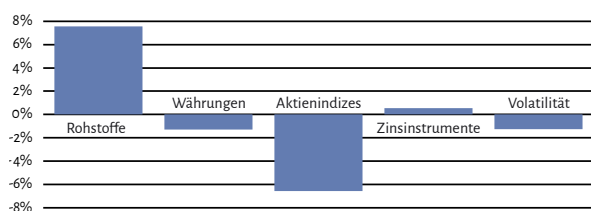
www.ftc.at

Der **FTC Futures Fund Classic** ist ein 1998 in Luxemburg aufgelegter Alternativer Investmentfonds der Anlageklasse Managed Futures. Er investiert trendfolgend und regelbasiert in börsengehandelte Terminkontrakte (Futures) auf einer großen Anzahl internationaler Märkte und in allen liquiden Asset-Klassen (Aktien, Anleihen, Zinsen, Währungen und Rohstoffe).

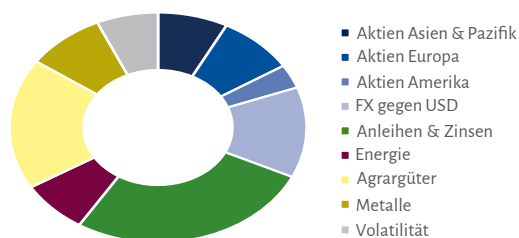
Ertrag ¹	ISIN	NAV	Monat	2026	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Kennzahlen ²	B EUR	B USD	CEUR
B EUR	LU0082076828	14.58	-1.02%	8.16%	8.40%	-15.92%	-20.80%	-24.46%	Ertrag p.a.	-2.77%	-0.10%	-0.50%
B USD	LU0550775927	9.33	-0.85%	8.87%	11.60%	-9.06%	-10.55%	-0.96%	Volatilität (ann.)	15.07%	15.22%	15.12%
CEUR	LU0888918488	17.64	-0.84%	8.69%	10.87%	-9.95%	-10.86%	-4.87%	Sharpe Ratio (mod.)	neg.	neg.	neg.
									Max Wertverlust	-42.33%	-38.49%	-38.57%

Zur aktuellen Wertentwicklung: Der Militärschlag der USA und Israels auf den Iran vom 28. Februar hat sich im Monatsverlauf des März zu einem Krieg ausgeweitet, der nicht nur den gesamten Nahen Osten betrifft, sondern auch die internationalen Lieferketten. Angesichts galoppierender Energiepreise stiegen zuletzt auch die Inflationserwartungen. In diesem Klima stürzten die Aktienindizes weltweit ab. In den USA gab der S&P 500 um etwas mehr als fünf Prozent nach, in Europa lag die Bandbreite der Verluste zwischen -6,7 (FTSE) und -10 Prozent (DAX). Der Nikkei in Japan brach sogar um 13,3 Prozent ein. Preise für Staatsanleihen, die in Stress-Szenarien oft durch eine Flucht in die Qualität zulegen, tendier-

Beiträge zur Monatsperformance

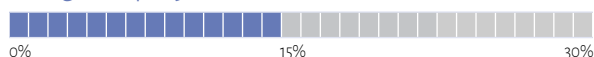


Margin-Allokation nach Sektoren



Anteile der einzelnen Sektoren an der Summe aller Einschuss-Margins

Margin/Equity-Ratio zum Monatsende

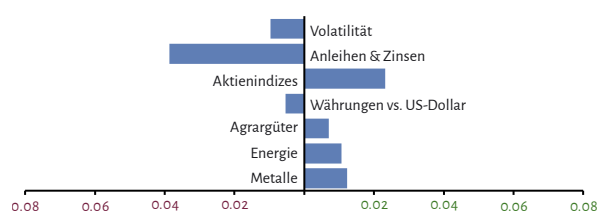


Quelle für alle Daten: FTC Datenbank

ten diesmal ebenfalls talwärts. Zehnjährige US-Treasuries etwa handelten 2,4 Prozent tiefer als Ende Februar. Die Faustregel, dass der Dollar in Krisenzeiten als Fluchtwährung gilt, bestätigte sich dagegen. Der Dollar-Index-Future legte im März um 2,6 Prozent zu. Öl- und Ölprodukte verteuerten sich massiv. Der nächst fällige Future auf die Nordsee-Sorte Brent handelte zeitweilig auf über 110 Dollar und kletterte um 43 Prozent. Gold dagegen wurde verkauft. Auf dem Terminmarkt lag der Monatsverlust bei 11 Prozent.

Für den Fonds war der neue und extrem dynamische Aufwärtstrend im Energiesegment hoch profitabel. Dagegen standen die massiven Trendbrüche im Aktiensegment.

Positionierung in den Handelsklassen



Margineinsatz (long oder short als Anteil des Fondsvermögens) je Handelsklasse

Performance seit Strategiestart¹



Entwicklung der Stammklasse EUR B (Fondsstart 1.5.1998) und des Vorläuferproduktes vor Fondsstart (30.12.1994-30.4.1998).

¹ Jede Veranlagung ist mit einem Risiko verbunden. Kurse können sowohl steigen als auch fallen. Die historische Performance ist kein Indikator für die zukünftige Entwicklung. **Beachten Sie auch die Hinweise auf Seite 2.**

² Berechnung auf Basis der Monatsendwerte der letzten 10 Jahre.



FTC Classic

03|2026

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. Die veröffentlichten Prospekte und Basisinformationsblätter sämtlicher hierin genannten Fonds können in deutscher Sprache kostenlos insbesondere bei FTC Capital GmbH bezogen werden. Auf die darin enthaltenen Risikohinweise wird ausdrücklich verwiesen.

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.**

Der AIFM ist berechtigt, den Vertrieb des Fonds oder einzelner Anteilsklassen einzustellen.

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.

Warnhinweise und Risiken:

Der Fonds weist erhöhte Volatilität auf. Er kann zu wesentlichen Teilen in derivative Instrumente sowie Sichteinlagen oder kündbare Einlagen mit einer Laufzeit von höchstens 12 Monaten investieren. 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. Die Informationen gem. § 21 (4), (5) AIFMG werden im jeweils aktuellen Fonds-Rechenschaftsbericht offengelegt.

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.

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: www.ftc.at/impresum/

Stammdaten

Anteilsklassen	ISIN
B EUR	LU0082076828
B USD	LU0550775927
C EUR	LU0888918488

Bewertungstage: Täglich (Bankarbeitstage)

Ertragsverwendung: Thesaurierend

Struktur

Domizil:	Luxemburg
Rechtsform:	Alternative Investment Fund (AIF)
AIF:	FTC Futures Fund SICAV
Depotbank:	Quintet Private Bank (LU)
Administrator:	UI efa S.A. (LU)
Portfolioverwalter:	FTC Capital GmbH
Wirtschaftsprüfer:	Deloitte S.A. (LU)
Gründungsdatum:	1.5.1998
Rechnungswährung des AIF:	Euro
Aufsichtsbehörde:	CSSF, Commission de Surveillance du Secteur Financier

Mindestanlagebeträge

B EUR	EUR	1
B USD	USD	250.000,-
C EUR	EUR	250.000,-

Vertrieb:

FTC Capital GmbH
Seidlgasse 36/3, 1030 Wien
www.ftc-capital.com
sales@ftc.at
+431 585 61 69-0