FTC Systematic Global Trend

Monatsbericht & Datenblatt 10|2026

www.ftc-capital.com

FTC Systematic Global Trend ist ein global diversizifizierter, alternativer Dachfonds. Er investiert in überwiegend trendfolgende und systematische Global-Macro-Fonds, die ihrerseits in einem breiten Universum aus allen liquiden Assetklassen handeln, darunter Derivate auf Aktien, Anleihen, Geldmarktinstrumente, Währungen und Rohstoffe. Der FTC Systematic Global Trend eignet sich insbesondere zur Diversifikation von traditionellen Portfolios aus Aktien und Anleihen.

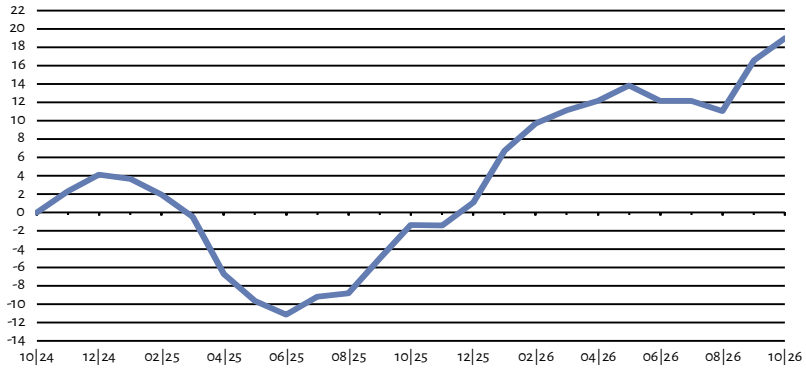
Kurse und Wertentwicklung[1]	Kurs	Monat	2026	1 Jahr	5 Jahre	Seit Start
FTC Systematic Global Trend EUR I	1169.52	2.10%	17.74%	20.64%	n.v.	19.00%
FTC Systematic Global Trend USD I	1204.15	0.21%	11.83%	16.55%	n.v.	22.65%
FTC Systematic Global Trend EUR R	1147.00	1.99%	15.95%	18.72%	n.v.	16.65%

Kennzahlen[1]	EUR-I	USD-I	EUR-R
Annualisierter Ertrag	9.09%	10.75%	8.00%
Annualisierte Volatilität	9.53%	8.31%	9.31%
Modified Sharpe Ratio	0.95	1.29	0.86
Maximaler Wertverlust	-14.63%	-6.16%	-14.80%

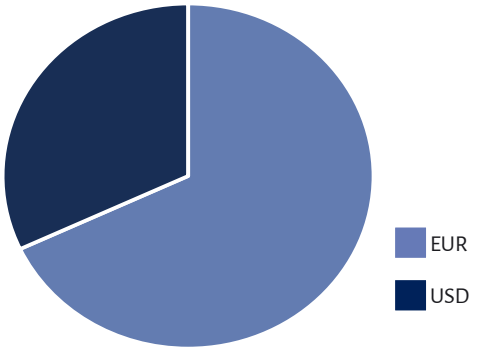
Erträge in %[1]	Jan	Feb	Mär	Apr	Mai	Juni	Juli	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez	YTD
2024											2.29	1.77	**4.10**
2025	-0.41	-1.69	-2.35	-6.26	-3.15	-1.65	2.22	0.39	4.13	3.88	-0.09	2.55	**-2.91**
2026	5.56	2.81	1.31	0.93	1.49	-1.48	0.01	-0.98	4.95	2.10			**17.74**

Monatskommentar: Trotz der aktuell hohen Inflationsraten beließen sowohl die US-Notenbank FED als auch die EZB die Leitzinsen unverändert. Sowohl in den USA als auch in der Eurozone fielen die Daten zum Wirtschaftswachstum etwas besser aus als erwartet. Im Fokus der Berichterstattung waren in den USA vor allem die bevorstehenden Kongresswahlen, in Europa dagegen stärker die Kriege in der Ukraine und im Nahen Osten sowie die Jugendproteste in mehreren Ländern. Die Aktienmärkte entwickelten sich unterschiedlich, aber in der Mehrzahl negativ. Der S&P 500 gab knapp ein Prozent ab, der Nikkei fiel gar um mehr als fünf Prozent. Die Standardwerte im Euro Stoxx 50 schlossen 1,2 Prozent tiefer. Eine Ausnahme war der DAX mit einem Gewinn von 2,5 Prozent. Anleihenpreise legten teils kräftig zu, was etwa die Rendite für 10jährige US-Treasuries wieder unter die Marke von fünf Prozent drückte. Im Währungssegment zeigte sich der US-Dollar den zweiten Monat in Folge etwas stärker. Gegen den Korb der anderen Majors legte der Dollar-Index um 0,4, gegen den Euro um 1,5 Prozent zu. Energie-Rohstoffe blieben überwiegend im dynamischen Aufwärtstrend mit zweistelligen Monatsveränderungen, während Agrar- und Metallpreise im Schnitt etwas nachgaben. Für die Mehrzahl der gehaltenen Managed-Futures-Fonds war der fortgesetzte Preistrend bei Erdöl und Ölprodukten entscheidend am positiven Monatsergebnis beteiligt.

Wertentwicklung seit Fondsstart (in %)[1]



Fondswährungen der Subfonds



[1]Performance-Angaben und Kennzahlen beruhen auf monatlichen Daten und wurden auf Basis monatlicher ausschüttungsbereinigter Rechenwerte entsprechend der ÖKB-Methode berechnet.
Angaben zur Wertentwicklung beziehen sich auf die Vergangenheit. Die frühere Wertentwicklung ist kein verlässlicher Indikator für künftige Erträge. Wenn nicht anders angegeben, beziehen sich die Werte auf die Stammklasse „EUR-I". **Beachten Sie auch die Hinweise auf Seite 2.**

Die Finanzmarktaufsicht warnt: Der FTC Systematic Global Trend kann bis zu 100 v.H. in Veranlagungen gemäß § 166 Abs. 1 Z 3 InvFG (Alternative Investments) investieren, die im Vergleich zu traditionellen Anlagen ein erhöhtes Anlagerisiko mit sich bringen. Insbesondere bei diesen Veranlagungen kann es zu einem Verlust bis hin zum Totalausfall des darin veranlagten Kapitals kommen.
Auf Grund der unterschiedlichen Ausgestaltung der einzelnen Anteilsgattungen kann das wirtschaftliche Ergebnis, das der Anleger mit seinem Investment erzielt, variieren, je nachdem zu welcher Anteilsgattung die von ihm erworbenen Anteile gehören.

FTC Systematic Global Trend

Fund Facts

ftc-capital.com

Charakteristik des Fonds

Der FTC Systematic Global Trend richtet sich an Investoren, welche die Risiko-/Ertragseigenschaften ihres Anlageportfolios zu verbessern suchen. Die im Dachfonds enthaltenen, systematischen und trendfolgenden Global-Macro-Strategien sind dazu besonders geeignet, da sie sowohl von steigenden als auch von fallenden Preisen der gehandelten Finanzinstrumente profitieren können.

Diese Szenarien sind günstig für die Wertentwicklung: Phasen, in denen eine Mehrzahl der einzelnen Märkte stabile Trends ausbilden, wobei es im Prinzip unerheblich ist, ob diese Trends aufwärts oder abwärts gerichtet sind. In der Vergangenheit war das aber am deutlichsten in Krisenzeiten der Fall – etwa im Verlauf der Welt-Finanzkrise 2008 oder zu Beginn der Corona-Pandemie 2020. Der Grund:In Krisenzeiten kommt es typischerweise zu einem Ausverkauf von sogenannten Risiko-Assets wie Aktien, Unternehmensanleihen oder Energie-Rohstoffen und einer Umschichtung des Anlagekapitals in sicherere Assets wie Staatsanleihen, den US-Dollar oder Gold. Es bilden sich also über viele Märkte hinweg starke Trends aus, von denen die Global-Macro-Strategien stark profitieren können.Der FTC Systematic Global Trend kann daher maßgeblich dazu beitragen, hohe Wertverluste eines typischen Portfolios während Krisenmärkten zu reduzieren.

Diese Szenarien sind ungünstig für die Wertentwicklung: Phasen, in denen es über mehrere Märkte hinweg zu häufigen Umkehrbewegungen kommt. Eine solche überwiegend „trendlose" Zeit war in der Vergangenheit zum Beispiel dann zu beobachten, wenn Notenbanken eine aktionistische Geldpolitik verfolgt haben, wie etwa nach der Finanzkrise von 2018, oder wenn günstige und ungünstige marktrelevante Informationen im Nachrichtenfluss häufig wechselten. In solchen Marktumgebungen, die man auch als volatile Seitwärtsmärkte bezeichnet, mussten trendfolgende Fonds, wie jene in die der FTC Systematic Global Trend investiert, Verluste hinnehmen.

Rechtliche Hinweise

Marketingmitteilung. 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. Der veröffentlichte Prospekt und das Basisinformationsblatt des FTC Systematic Global Trend kann in deutscher Sprache kostenlos insbesondere bei FTC Capital GmbH bezogen werden. Auf die darin enthaltenen Risikohinweise wird ausdrücklich verwiesen.
Alle Angaben erfolgen ohne Gewähr. Der Fonds darf in Österreich an Privatkunden und in Deutschland an professionelle und semiprofessionelle Kunden vertrieben werden.

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

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. Die Wertentwicklung kann infolge von Währungsschwankungen steigen oder fallen. Performance-Angaben beruhen auf monatlichen Daten, berücksichtigen alle Gebühren im Fonds aber keinen Ausgabeaufschlag (AGA) oder allenfalls individuelle transaktionsbezogene oder laufend ertragsmindernde Kosten (z.B. Konto- und Depotgebühren).

Quelle für alle Daten: FTC Datenbank.

Medieninhaber, Herausgeber und Redaktion: FTC Capital GmbH, Seidlgasse 36/3, A-1030 Wien. Ein vollständiges Impressum kann auf ftc-capital.com abgerufen werden.

Stammdaten

Anteilsklassen	ISIN	BB-Ticker
EUR-I	AT0000A3EYY6	FTCSGTI AV
USD-I	AT0000A3EYX8	FTCSGLI AV
EUR-R	AT0000A3EYZ3	FTCSGTR AV

Bewertungstage: Letzter Bankarbeitstag jedes Monats

Ertragsverwendung: Thesaurierend

Struktur

Domizil:	Österreich
Rechtsform:	Alternative Investment Fund (AIF)
KAG/AIFM:	LLB Invest KAG
Depotbank:	Liechtensteinische Landesbank Österreich AG
Portfolioverwalter:	FTC Capital GmbH
Wirtschaftsprüfer:	BDO Assurance GmbH, Wien
Gründungsdatum:	31.10.2024
Rechnungswährung :	Euro
Aufsichtsbehörde:	Österreichische Finanzmarktaufsicht (FMA); fma.gv.at

Handelsinformationen

Annahmeschluss für Zeichnungen und Rücklösungen ist jeweils fünf Bankarbeitstage vor dem letzten Bankarbeitstag des Monats, 10.00 Uhr (Ortszeit) bei der Verwahrstelle. Der 31. Dezember ist kein Bankarbeitstag in Bezug auf den Fondshandel. Verspätet eingehende Orders werden nach dem jeweils nächstfolgenden Annahmeschluss durchgeführt. Valuta Ausgabe- und Rücknahmetag ist zwei Bankarbeitstage nach dem Bewertungstag.

Mindestanlagebeträge (Erstanlage/Folgezeichnung)

EUR-I	EUR	250.000,- / 10.000,-
USD-I	USD	250.000,- / 10.000,-
EUR-R	EUR	keine

Risikoindikator laut BIB:

1	2	3	**4**	5	6	7

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