

GWP-Fonds FT Halbjahresbericht

31.3.2017



Fondsmanager:

**GROHMANN
WEINRAUTER** 
Institutional Asset Management GmbH

Vertrieb und Initiator:

**GROHMANN
WEINRAUTER** 
VermögensManagement GmbH

Fondsgesellschaft:

 **FRANKFURT-TRUST**
ASSET MANAGEMENT

Halbjahresbericht 31.3.2017

Vermögensaufstellung im Überblick	4
Vermögensaufstellung	6
Anhang gemäß § 7 Nr. 9 KARBV	14

FRANKFURT-TRUST
Investment-Gesellschaft mbH
Bockenheimer Landstraße 10
60323 Frankfurt am Main
Postanschrift:
Postfach 11 07 61
60042 Frankfurt am Main
Telefon (0 69) 9 20 50-200
Telefax (0 69) 9 20 50-101
www.frankfurt-trust.de

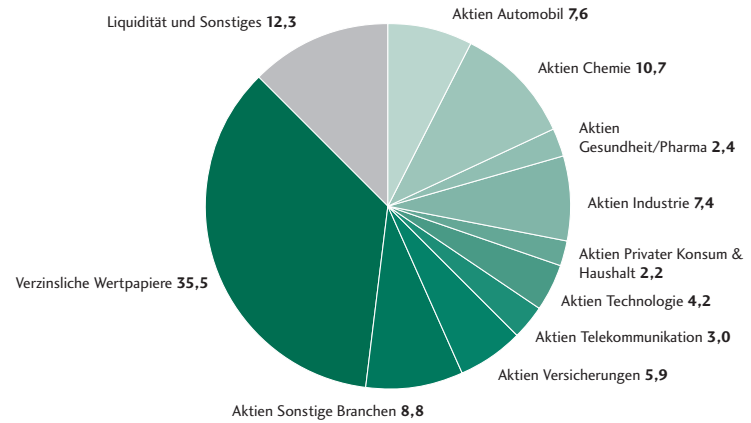
Vermögensaufstellung im Überblick

31.3.2017

Vermögensübersicht

Fondsvermögen in Mio. EUR		11,5
	in % vom	Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände		100,22
1. Aktien		52,35
2. Verzinsliche Wertpapiere		35,49
3. Derivate		-0,16
4. Forderungen		0,57
5. Bankguthaben		11,97
II. Verbindlichkeiten		-0,22
III. Fondsvermögen		100,00

Portfeuillestruktur nach Assetklassen in %



Vermögensaufstellung

31.3.2017

Gattungsbezeichnung ISIN	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 31.3.2017	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	in % vom Fonds- vermögen
Börsengehandelte Wertpapiere						10.141.679,24	87,84
Aktien						6.044.203,36	52,35
Deutschland						6.044.203,36	52,35
Automobil						878.845,16	7,61
BMW							
DE0005190003	Stück	2.820	0	1.417	85,3200 EUR	240.602,40	2,08
Continental							
DE0005439004	Stück	496	0	179	205,1500 EUR	101.754,40	0,88
Daimler NA							
DE0007100000	Stück	6.209	0	2.534	69,0400 EUR	428.669,36	3,71
VW Vorzugsaktien							
DE0007664039	Stück	787	0	0	137,0000 EUR	107.819,00	0,93
Banken						143.300,62	1,24
Commerzbank							
DE000CBK1001	Stück	4.732	0	1.436	8,4420 EUR	39.947,54	0,35
Deutsche Bank NA							
DE0005140008	Stück	6.531	0	3.964	15,8250 EUR	103.353,08	0,90
Bau & Materialien						66.843,70	0,58
HeidelbergCement							
DE0006047004	Stück	770	0	0	86,8100 EUR	66.843,70	0,58
Chemie						1.233.733,22	10,69
BASF NA							
DE000BASF111	Stück	5.441	0	2.636	93,1200 EUR	506.665,92	4,39
Bayer NA							
DE000BAY0017	Stück	4.523	0	758	107,5000 EUR	486.222,50	4,21
Linde							
DE0006483001	Stück	1.536	548	0	156,8000 EUR	240.844,80	2,09
Finanzdienstleister						175.476,34	1,52
Deutsche Börse z.Umtausch eing.NA							
DE000A2AA253	Stück	2.039	2.039	0	86,0600 EUR	175.476,34	1,52
Gesundheit / Pharma						282.205,08	2,44
Fresenius Medical Care							
DE0005785802	Stück	1.014	0	242	78,9200 EUR	80.024,88	0,69
Fresenius							
DE0005785604	Stück	1.856	0	393	74,7500 EUR	138.736,00	1,20
Merck							
DE0006599905	Stück	596	0	160	106,4500 EUR	63.444,20	0,55
Immobilien						163.009,50	1,41
Vonovia NA							
DE000A1ML7J1	Stück	4.985	856	0	32,7000 EUR	163.009,50	1,41
Industrie						852.971,27	7,39
Deutsche Post NA							
DE000552004	Stück	7.711	1.922	0	31,8150 EUR	245.325,47	2,12
Siemens							
DE0007236101	Stück	4.414	0	1.513	126,7500 EUR	559.474,50	4,85
ThyssenKrupp							
DE0007500001	Stück	2.110	0	548	22,8300 EUR	48.171,30	0,42

Gattungsbezeichnung ISIN	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 31.3.2017	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	in % vom Fonds- vermögen
Medien						142.509,75	1,24
ProSiebenSat.1 Media NA DE000PSM7770	Stück	3.475	0	2.522	41,0100 EUR	142.509,75	1,24
Privater Konsum & Haushalt						258.688,10	2,24
adidas NA DE000A1EWW00	Stück	714	0	269	177,5500 EUR	126.770,70	1,10
Beiersdorf DE0005200000	Stück	430	0	164	88,0800 EUR	37.874,40	0,33
Henkel Inhaber-Vorzugsaktien DE0006048432	Stück	785	0	152	119,8000 EUR	94.043,00	0,81
Reise & Freizeit						133.202,70	1,15
Deutsche Lufthansa vinkulierte NA DE0008232125	Stück	8.836	0	11.171	15,0750 EUR	133.202,70	1,15
Technologie						482.232,60	4,18
Infineon Technologies NA DE0006231004	Stück	5.138	0	811	19,1250 EUR	98.264,25	0,85
SAP DE0007164600	Stück	4.195	0	1.017	91,5300 EUR	383.968,35	3,33
Telekommunikation						349.802,75	3,03
Deutsche Telekom NA DE0005557508	Stück	21.362	0	10.046	16,3750 EUR	349.802,75	3,03
Versicherungen						683.631,40	5,92
Allianz vinkulierte NA DE0008404005	Stück	2.593	0	1.647	172,5500 EUR	447.422,15	3,88
Münchener Rückversicherung vinkulierte NA DE0008430026	Stück	1.289	0	740	183,2500 EUR	236.209,25	2,05
Versorger						197.751,17	1,71
E.ON NA DE000ENAG999	Stück	22.795	0	21.696	7,3870 EUR	168.386,67	1,46
RWE DE0007037129	Stück	1.900	0	1.121	15,4550 EUR	29.364,50	0,25
Verzinsliche Wertpapiere						4.097.475,88	35,49
EUR						4.097.475,88	35,49
Öffentliche Anleihen						4.097.475,88	35,49
4,750% Bundesrep.Deutschland Anl. 1998(28) DE0001135085	EUR	700.000	0	300.000	147,9069 %	1.035.348,13	8,97
4,250% Bundesrep.Deutschland Anl. 2007(17) DE0001135333	EUR	400.000	0	100.000	101,2480 %	404.992,00	3,51
1,500% Bundesrep.Deutschland Anl. 2013(23) DE0001102317	EUR	550.000	0	200.000	110,7885 %	609.336,75	5,28
0,500% Bundesrep.Deutschland Anl. 2015(25) DE0001102374	EUR	1.000.000	0	600.000	103,8743 %	1.038.742,50	9,00
0,500% Bundesrep.Deutschland Bundesobl. 2013(18) DE0001141653	EUR	400.000	0	100.000	101,1365 %	404.546,00	3,50
0,000% Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. 2016(18) DE0001104636	EUR	600.000	0	200.000	100,7518 %	604.510,50	5,23
Summe Wertpapiervermögen						10.141.679,24	87,84

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 31.3.2017	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	in % vom Fonds- vermögen
				im Berichtszeitraum			
Derivate							
Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.							
Zins-Derivate						- 18.131,61	- 0,16
Zinsindex-Terminkontrakte						- 18.131,61	- 0,16
FUTURE Euro-Bund-Future 06.17	Anzahl	- 9				- 18.131,61	- 0,16
Forderungen						65.562,82	0,57
Dividendenansprüche	EUR	20.179,25				20.179,25	0,18
Zinsansprüche	EUR	45.383,57				45.383,57	0,39
Bankguthaben						1.382.193,29	11,97
Bankguthaben EUR	EUR	1.382.193,29				1.382.193,29	11,97
Verbindlichkeiten						- 25.228,77	- 0,22
Sonstige Verbindlichkeiten						- 25.228,77	- 0,22
Verbindlichkeiten aus Anteilscheingeschäften*	EUR	- 120,27				- 120,27	0,00
Verwahrstellenvergütung	EUR	- 1.871,89				- 1.871,89	- 0,02
Verwaltungsvergütung	EUR	- 10.194,85				- 10.194,85	- 0,09
KESt-Rückstellung Cum/Cum-Geschäfte	EUR	- 8.399,81				- 8.399,81	- 0,07
Prüfungskosten	EUR	- 4.141,95				- 4.141,95	- 0,04
Veröffentlichungskosten	EUR	- 500,00				- 500,00	0,00
Fondsvermögen						EUR 11.546.074,97	100,00**
Anteilwert					EUR	120,32	
Umlaufende Anteile					Stück	95.958	
* Noch nicht valutierte Transaktionen.							
** Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügig Rundungsdifferenzen entstanden sein.							

FRANKFURT-TRUST

Investment-Gesellschaft mbH
Bockenheimer Landstraße 10
60323 Frankfurt am Main
Postanschrift:
Postfach 11 07 61
60042 Frankfurt am Main

Telefon (0 69) 9 20 50-200
Telefax (0 69) 9 20 50-101

Gezeichnetes
und eingezahltes Eigenkapital:
16,0 Mio. EUR

Haftendes Eigenkapital:
11,6 Mio. EUR

Gesellschafter von
FRANKFURT-TRUST ist zu
100 % die BHF-BANK
Aktiengesellschaft

Verwahrstelle

The Bank of New York Mellon SA/NV,
Asset Servicing, Niederlassung
Frankfurt am Main, MesseTurm
Friedrich-Ebert-Anlage 49
60327 Frankfurt am Main

Haftendes Eigenkapital:
2,4 Mrd. EUR

Fondsadministration

BNY Mellon Service
Kapitalanlage-Gesellschaft mbH
MesseTurm
Friedrich-Ebert-Anlage 49
60327 Frankfurt am Main

Servicetelefon

Für Fragen zu Ihrem FT- Investmentdepot erreichen Sie uns
montags bis freitags von 8 –18 Uhr unter der Rufnummer
(0 69) 9 20 50-200.

Fondspreise

Der telefonische Ansagedienst für Preise der FT-Fonds
ist bundesweit unter der Rufnummer 0800 38 03 66 37
geschaltet. Außerdem finden Sie die Fondspreise auf
Videotext von ARD und ZDF sowie im Internet unter
www.frankfurt-trust.de

Geschäftsführung

Karl Stäcker
Sprecher
Zugleich Mitglied der Geschäftsführung
und Vorsitzender des Verwaltungsrats
der FRANKFURT-TRUST
Invest Luxemburg AG und Mitglied
des Vorstands des BVI Bundesverband
Investment und Asset Management e. V.

Wolfgang Marx
Zugleich Mitglied des Verwaltungsrats der
FRANKFURT-TRUST Invest Luxemburg AG

Fondsmanager

GROHMANN & WEINRAUTER
Institutional Asset
Management GmbH
Altkönigstraße 8
61 462 Königstein

Vertrieb und Initiator

Grohmann & Weinrauter
VermögensManagement GmbH
Altkönigstraße 8
61 462 Königstein

Aufsichtsrat

Joachim Häger
Vorsitzender
Mitglied des Vorstands der BHF-BANK

Christophe Tadié
stellv. Vorsitzender
Mitglied des Vorstands der BHF-BANK

Frank Behrends
Mitglied des Vorstands der BHF-BANK

Matthias Berg
Direktor der BHF-BANK

Ulrich Lingenthal
Direktor der BHF-BANK

Prof. Dr. Hartwig Webersinke
Dekan an der Fakultät Wirtschaft und Recht
an der Hochschule Aschaffenburg

Stand März 2017