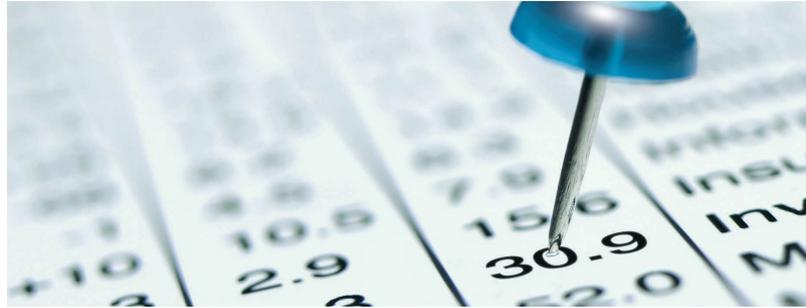


FT AccuZins
Jahresbericht

30.9.2016



Jahresbericht 30.9.2016

Marktentwicklung und Tätigkeitsbericht	4
Vermögensaufstellung im Überblick	7
Kurzdarstellung der Anteilklassen	8
Vermögensaufstellung	10
Angaben zu den Kosten gemäß § 101 Abs. 2 und 3 KAGB	34
Anhang gemäß § 7 Nr. 9 KARBV	36
Besonderer Vermerk des Abschlussprüfers	46
Ertragsverwendung	48
Steuerliche Hinweise	49

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

Marktentwicklung und Tätigkeitsbericht

Ausgangslage

Die Entwicklung der Kapitalmärkte war im Berichtszeitraum weiterhin sehr volatil. Zu Beginn des Jahres 2016 brachen die globalen Aktienmärkte nach schlechten Konjunkturdaten aus China kräftig ein und begannen sich erst im Februar wieder zu erholen. Ende Juni erwies sich dann der von den meisten Marktteilnehmern nicht erwartete Brexit als kurzfristiger Schock für Aktienanleger, während Staatsanleihen und Gold in dieser Phase als sichere Häfen gefragt waren. Die Märkte beruhigten sich aber schnell wieder, so dass das dritte Quartal 2016 sogar zu historischen Höchstständen an den Aktienmärkten führte.

Geldmarkt

Die Geldpolitik aller relevanten Notenbanken blieb im Berichtszeitraum unverändert extrem expansiv ausgerichtet. Die EZB senkte im Dezember angesichts erneut reduzierter Inflationsprognosen den Einlagenzins auf einen Satz von –0,4 Prozent. Die ohnehin schon im negativen Bereich liegenden Zinsen 3-Monats-Euribor und 1-Monats-Euribor rutschten vor diesem Hintergrund noch weiter ab.

Anleihen

Globale Konjunktursorgen und die expansive Geldpolitik prägten das Bild der Rentenmärkte im Berichtszeitraum. Zwar erhöhte die US-Zentralbank im Dezember die Zinsen seit neun Jahren zum ersten Mal leicht, diesem ersten Schritt folgten dann aber aufgrund der zunehmenden globalen Risiken bis in den Herbst hinein keine weiteren mehr. Die EZB weitete das Anleihekaufprogramm im Dezember sogar wieder aus. Die Rendite von Bundesanleihen mit zehnjähriger Laufzeit wurde Mitte Juni zum ersten Mal sogar negativ. Auf der Suche nach Rendite waren Unternehmensanleihen gefragt, die auch von der Ankündigung eines Kaufprogramms durch die EZB profitierten.

Aktien

Negative Nachrichten aus China und von den Rohstoffmärkten belasteten die Aktienmärkte zu Beginn des Jahres 2016. Ab Mitte Februar gingen dann sowohl Rohstoffpreise als auch Aktien wieder auf Erholungskurs. Nach der Entscheidung für den Brexit gerieten vor allem europäische Aktien stark unter Druck. Besonders heftig waren die Verluste bei Banktiteln. Die Erholung nach dem

Brexit-Schock setzte aber schon im Juli ein. Mit der Nominierung von Theresa May zur neuen Premierministerin stabilisierten sich die politischen Verhältnisse in Großbritannien. Gleichzeitig signalisierten die Bank of England ebenso wie die Europäische Zentralbank ihre Bereitschaft, negative Folgen des Brexits gegebenenfalls durch weitere expansive geldpolitische Maßnahmen zu bekämpfen. Gegenüber den zahlreichen Terrorakten im Juli und dem Putschversuch in der Türkei erwies sich der Aktienmarkt als robust. Zuletzt sorgten erneut Banktitel aber für fallende Kurse.

FT AccuZins

Der FT AccuZins legt weltweit in verzinsliche Wertpapiere an. Als Anlagen des Fonds kommen vor allem Staatsanleihen, Pfandbriefe und Anleihen von Unternehmen in Frage. Dabei wird auf eine hohe Kreditwürdigkeit der Schuldner geachtet. Ziel einer Anlage im FT AccuZins ist es, an der Entwicklung der globalen Zins- und Währungsmärkte teilzuhaben.

Vor dem Hintergrund der expansiven Geldpolitik der wichtigsten Notenbanken haben sich die weltweiten Anleihenmärkte in den vergangenen zwölf Monaten erneut positiv entwickelt. Wir steuerten die Duration des Portfolios flexibel an die Marktbedingungen angepasst. Über weite Strecken haben wir längere Laufzeiten bevorzugt, zuletzt lag die Duration bei 9,1 Jahren. Im Portfolio setzten wir mehrheitlich auf Staatsanleihen und profitierten von einer aktiven Steuerung der Währungsrisiken. So sicherten wir rohstofforientierte Währungen wie norwegische Kronen und die Dollar-Peripherie, aber auch US-Dollar und das britische Pfund phasenweise, bspw. im Zusammenhang mit dem Brexit, in Teilen gegen Kursverluste ab. Die Gegenposition bei diesen Devisentermingeschäften stellte dabei in den meisten Fällen der japanische Yen. Zum Ende des Berichtszeitraums haben wir unsere US-Dollar-Sicherung wieder verringert; so konnten wir vom wiedererstarkten Dollar profitieren.

Im zurückliegenden Geschäftsjahr erwirtschaftete der FT AccuZins (PT) einen erfreulichen Wertzuwachs von 7,0 Prozent.

Nähere Informationen und Kommentare zur Aufstellung des Fonds finden Sie jederzeit unter „www.frankfurt-trust.de“.

Vermögensaufstellung im Überblick

30.9.2016

Vorteile

- Chance auf Mehrertrag gegenüber reinen Euro-Anleihen
- Chance auf Währungsgewinne
- Breite weltweite Streuung in verzinsliche Wertpapiere

Risiken

- Wertverluste bei einem Zinsanstieg
- Verschlechterung der Bonität einzelner Schuldner
- Währungsverluste

Vermögensübersicht

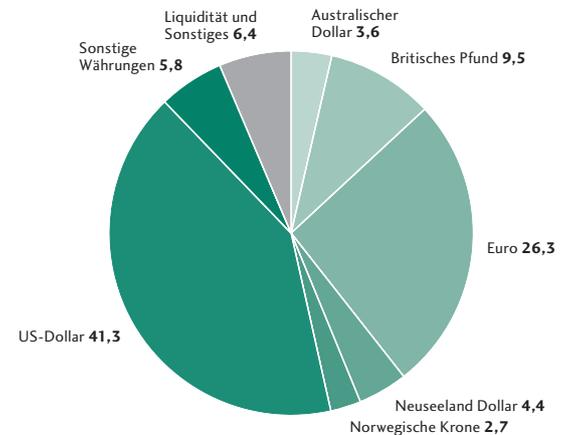
Fondsvermögen in Mio. EUR	142,9
	in % vom Fondsvermögen
I. Vermögensgegenstände	100,13
1. Verzinsliche Wertpapiere	93,62
2. Investmentfonds	3,67
3. Derivate	0,09
4. Forderungen	1,07
5. Bankguthaben	1,68
6. Sonstige Vermögensgegenstände	0,00
II. Verbindlichkeiten	- 0,13
III. Fondsvermögen	100,00

Kommentierung des Veräußerungsergebnisses

Für den Anleger ist immer die gesamte Wertentwicklung des Fonds relevant. Diese speist sich aus mehreren Quellen wie den aktuellen Bewertungen der Wertpapiere und derivativen Instrumente, Zinsen und Dividenden sowie dem Ergebnis der Veräußerungsgeschäfte. Veräußerungsgeschäfte erfolgen grundsätzlich aus taktischen und strategischen Überlegungen des Fondsmanagements. Dabei können Wertpapiere und Derivate auch mit Verlust veräußert werden, beispielsweise um das Portefeuille vor weiteren erwarteten Wertminderungen zu schützen oder um die Liquidität des Fonds sicherzustellen.

Mit den im Berichtszeitraum veräußerten Positionen hatte die Anteilklasse (PT) per saldo einen Gewinn zu verzeichnen, der vor allem aus Kurs- und Währungsgewinnen bei der Veräußerung von Staatsanleihen resultierte.

Portefeuillestruktur nach Währungen in %



Hinweis für unsere Anleger

Auflösung der Anteilklasse (IA)

Die speziell für institutionelle Anleger aufgelegte Anteilklasse FT AccuZins (IA) wird zum 30. September 2017 geschlossen.

Kurzdarstellung der Anteilklassen

FT AccuZins (PT)

Auflegung:	30. Juli 1984
Geschäftsjahr:	1. Oktober bis 30. September
WKN:	847808
ISIN:	DE0008478082
Ausschüttung:	keine, die Erträge verbleiben im Fonds
Verwaltungsvergütung:	bis zu 1,0 % p.a. vom Fondsvermögen; zzt. 1,0 % p.a.
Verwahrstellenvergütung:	bis zu 0,1 % p.a. vom Fondsvermögen; (mind. 9.800 Euro p.a.) zzt. 0,07 % p.a.
Ausgabeaufschlag:	bis zu 3 %, zzt. 3 %
Mindestanlagesumme:	2.500 Euro einmalig bzw. 50 Euro monatlich

FT AccuZins (IA)

Auflegung:	4. Mai 2015
Geschäftsjahr:	1. Oktober bis 30. September
WKN:	A1XDYG
ISIN:	DE000A1XDYG9
Ausschüttung:	Mitte November
Verwaltungsvergütung:	bis zu 1,0 % p.a. vom Fondsvermögen; zzt. 0,5 % p.a.
Verwahrstellenvergütung:	bis zu 0,1 % p.a. vom Fondsvermögen; (mind. 9.800 Euro p.a.) zzt. 0,07 % p.a.
Ausgabeaufschlag:	bis zu 3 %, wird zzt. nicht erhoben
Mindestanlagesumme:	250.000 Euro

Vermögensaufstellung

30.9.2016

Gattungsbezeichnung ISIN	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 30.9.2016	Käufe/ Zugänge		Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	in % vom Fonds- vermögen
			im Berichtszeitraum						
Börsengehandelte Wertpapiere								130.614.861,57	91,39
Verzinsliche Wertpapiere								126.836.512,14	88,75
EUR								37.594.716,28	26,31
Öffentliche Anleihen								32.836.483,98	22,98
2,500% Bundesrep. Deutschland Anl. 2014(46) DE0001102341	EUR	5.000.000	3.000.000	0	157,3888	%	7.869.437,50	5,51	
1,625% Chile, Republik EO-Bonds 2014(25) XS1151586945	EUR	1.000.000	0	0	108,6125	%	1.086.125,00	0,76	
1,750% Chile, Republik EO-Bonds 2016(26) XS1346652891	EUR	1.000.000	1.000.000	0	110,0625	%	1.100.625,00	0,77	
1,826% Comunidad Autónoma de Madrid EO-Obl. 2015(25) ES0000101651	EUR	2.000.000	0	0	106,8270	%	2.136.540,00	1,50	
1,875% Corporación Andina de Fomento EO-MTN 2014(21) XS1072571364	EUR	500.000	0	0	107,9945	%	539.972,50	0,38	
5,400% Irland EO-Treasury Bonds 2009(25) IE00B4TV0D44	EUR	1.500.000	0	0	143,2433	%	2.148.648,75	1,50	
2,000% Irland EO-Treasury Bonds 2015(45) IE00BV8C9186	EUR	1.000.000	0	0	120,1473	%	1.201.472,50	0,84	
5,000% Italien, Republik EO-B.T.P. 2011(22) IT0004759673	EUR	4.000.000	0	0	124,4432	%	4.977.727,00	3,48	
5,250% Polen, Republik EO-MTN 2010(25) XS0479333311	EUR	1.000.000	0	0	137,6105	%	1.376.105,05	0,96	
4,950% Portugal, Republik EO-Obr. 2008(23) PT0TEA0E0021	EUR	3.500.000	2.000.000	0	113,6030	%	3.976.105,00	2,78	
4,400% Spanien EO-Bonos 2013(23) ES00000123X3	EUR	3.000.000	0	0	127,4550	%	3.823.650,60	2,68	
3,450% Spanien EO-Bonos 2016(66) ES00000128E2	EUR	1.250.000	1.250.000	0	125,7183	%	1.571.478,13	1,10	
3,750% Zypern, Republik EO-MTN 2016(23) XS1457553367	EUR	1.000.000	1.000.000	0	102,8597	%	1.028.596,95	0,72	
Schuldverschreibungen der Kreditwirtschaft								1.581.149,55	1,11
5,500% Commonwealth Bank of Australia EO-MTN 2009(19) XS0443708242	EUR	500.000	0	0	115,1799	%	575.899,55	0,40	
0,111% ING Bank EO-FLR MTN 2014(19) XS1143001102	EUR	1.000.000	0	0	100,5250	%	1.005.250,00	0,71	
Andere Schuldverschreibungen/Industrie								3.177.082,75	2,22
1,450% AT & T EO-Notes 2014(22) XS1144086110	EUR	1.000.000	0	0	106,3270	%	1.063.270,15	0,74	
0,500% Berkshire Hathaway EO-Notes 2016(20) XS1380333929	EUR	1.000.000	1.000.000	0	101,7548	%	1.017.547,60	0,71	
2,250% Oracle EO-Notes 2013(21) XS0951216083	EUR	1.000.000	0	0	109,6265	%	1.096.265,00	0,77	
AUD								4.334.858,80	3,03
Öffentliche Anleihen								2.576.606,46	1,80
4,500% Australia, Commonwealth of AD-Loans 2013(33) AU000XCLWAG2	AUD	1.250.000	0	1.750.000	128,8895	%	1.094.956,33	0,76	

Gattungsbezeichnung ISIN	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 30.9.2016	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	in % vom Fonds- vermögen
3,250% Australia, Commonwealth of AD-Treasury Bonds 2015(39) AU000XCLWAP3	AUD	2.000.000	2.000.000	0	109,0050 %	1.481.650,13	1,04
Schuldverschreibungen der Kreditwirtschaft						720.663,99	0,50
4,875% Coöperative Rabobank AD-MTN 2014(20) XS1013984981	AUD	1.000.000	0	0	106,0385 %	720.663,99	0,50
Andere Schuldverschreibungen/Industrie						1.037.588,35	0,73
4,000% Telstra AD-MTN 2012(17) AU3CB0201838	AUD	1.500.000	0	0	101,7805 %	1.037.588,35	0,73
CAD						2.311.318,72	1,62
Öffentliche Anleihen						1.623.075,88	1,14
4,650% Kreditanst.f.Wiederaufbau CD-MTN 2007(23) CA500769CA08	CAD	2.000.000	0	0	119,5720 %	1.623.075,88	1,14
Andere Schuldverschreibungen/Industrie						688.242,84	0,48
1,875% Daimler Canada Finance CD-MTN 2015(20) XS1170184821	CAD	1.000.000	0	0	101,4057 %	688.242,84	0,48
GBP						13.625.342,58	9,53
Öffentliche Anleihen						7.856.226,91	5,49
0,875% Export Development Canada LS-MTN 2013(16) XS0954107313	GBP	1.000.000	0	0	100,0920 %	1.158.807,53	0,81
1,500% Finnland, Republik LS-MTN 2014(19) XS1143711064	GBP	1.000.000	1.000.000	0	103,5505 %	1.198.848,05	0,84
4,250% Großbritannien LS-Treasury Stock 2003(36) GB0032452392	GBP	750.000	750.000	0	151,0000 %	1.311.143,27	0,92
4,250% Großbritannien LS-Treasury Stock 2010(40) GB00B6460505	GBP	1.000.000	0	0	158,5800 %	1.835.947,90	1,28
1,375% Network Rail Inf.F. LS-Inf.Index Lkd MTN 2007(37)* XS0299655448	GBP	1.000.000	0	0	176,6224 %	2.351.480,16	1,64
Pfandbriefe/Kommunalobligationen						2.010.975,46	1,41
3,000% Commonwealth Bank of Australia EO-MTN 2013(19) XS0822509138	GBP	1.500.000	0	0	115,7987 %	2.010.975,46	1,41
Schuldverschreibungen der Kreditwirtschaft						1.493.860,90	1,05
4,550% Coöperative Rabobank LS-MTN 2005(29) XS0228265574	GBP	1.000.000	0	0	129,0322 %	1.493.860,90	1,05
Andere Schuldverschreibungen/Industrie						2.264.279,31	1,58
6,250% Atlantia LS-MTN 2004(22) XS0193942124	GBP	1.000.000	0	0	125,8553 %	1.457.080,06	1,02
4,750% East Japan Railway Co. LS-MTN 2006(31) XS0276809927	GBP	500.000	0	0	139,4437 %	807.199,25	0,56

* Bei diesen Wertpapieren handelt es sich um Poolfaktoranleihen, deren Kurswert sich auf Grund von Teilrückzahlung oder Teilzinskaptalisierung nicht zwangsläufig aus Kurs und Nominal ergibt.

Gattungsbezeichnung ISIN	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 30.9.2016	Käufe/ Zugänge		Verkäufe/ Abgänge		Kurs	Kurswert in EUR	in % vom Fonds- vermögen
			im Berichtszeitraum						
JPY								2.820.534,74	1,97
Öffentliche Anleihen								1.126.440,37	0,79
2,350% Asiatische Entwicklungsbank MTN 2007(27)									
XS0307424274	JPY	100.000.000	0	100.000.000	127,1465	%	1.126.440,37		0,79
Schuldverschreibungen der Kreditwirtschaft								1.694.094,37	1,18
1,700% Development Bank of Japan YN-Notes 2002(22)									
XS0159205995	JPY	172.000.000	272.000.000	100.000.000	111,1745	%	1.694.094,37		1,18
MXN								445.962,87	0,31
Andere Schuldverschreibungen/Industrie								445.962,87	0,31
6,450% América Móvil MN-Notes 2012(22)									
XS0860706935	MXN	10.000.000	0	0	97,9000	%	445.962,87		0,31
NOK								3.923.895,19	2,75
Öffentliche Anleihen								1.121.969,18	0,79
2,250% Kommunalbanken NK-MTN 2012(17)									
XS0828005909	NOK	5.000.000	0	0	101,2415	%	560.320,45		0,39
2,250% NRW.BANK NK-MTN-IHS 2013(18)									
XS0935026632	NOK	5.000.000	0	0	101,4815	%	561.648,73		0,39
Schuldverschreibungen der Kreditwirtschaft								2.243.074,97	1,57
1,750% Coöperatieve Rabobank NK-MTN 2015(21)									
XS1274034658	NOK	10.000.000	10.000.000	0	101,5320	%	1.123.856,44		0,79
3,375% Nederlandse Waterschapsbank NK-MTN 2012(17)									
XS0767065906	NOK	10.000.000	0	0	101,1130	%	1.119.218,53		0,78
Andere Schuldverschreibungen/Industrie								558.851,04	0,39
2,750% Linde MTN 2012(17)									
XS0835302513	NOK	5.000.000	0	0	100,9760	%	558.851,04		0,39
NZD								4.797.663,41	3,36
Öffentliche Anleihen								1.417.782,14	0,99
4,625% International Bank Rec. Dev. ND-Notes 2014(21)									
NZIBDDT008C4	NZD	2.000.000	0	0	109,2649	%	1.417.782,14		0,99
Schuldverschreibungen der Kreditwirtschaft								3.379.881,27	2,37
4,500% Coöperatieve Rabobank ND-MTN 2015(20)									
XS1196449687	NZD	3.000.000	3.000.000	0	104,1300	%	2.026.729,81		1,42
5,125% Export-Import Bk of Korea ND-MTN 2014(19)									
XS1120951014	NZD	2.000.000	0	0	104,2840	%	1.353.151,46		0,95
SEK								2.754.438,07	1,93
Öffentliche Anleihen								2.754.438,07	1,93
2,750% European Investment Bank SK-MTN 2012(23)									
XS0852107266	SEK	10.000.000	0	0	115,0545	%	1.194.781,80		0,84
3,500% Schweden, Königreich SK-Obl. 2009(39)									
SE0002829192	SEK	10.000.000	10.000.000	0	150,1910	%	1.559.656,27		1,09

Gattungsbezeichnung ISIN	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 30.9.2016	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	in % vom Fonds- vermögen
USD						54.227.781,48	37,94
Öffentliche Anleihen						30.256.170,50	21,17
2,875% Belgien, Königreich DL-MTN 2014(24) BE6271706747	USD	2.000.000	0	0	107,8987 %	1.929.518,96	1,35
2,000% Corporación Andina de Fomento DL-Notes 2016(19) US219868BW57	USD	1.000.000	1.000.000	0	100,8284 %	901.541,04	0,63
1,000% Erste Abwicklungsanstalt DL-MTN 2014(17) XS1039219883	USD	1.600.000	0	0	100,0219 %	1.430.928,47	1,00
4,500% Israel DL-Bonds 2013(43) US4651387N91	USD	1.000.000	1.000.000	0	114,6250 %	1.024.901,65	0,72
2,875% Israel DL-Bonds 2016(26) US46513CXR23	USD	3.000.000	3.000.000	0	104,1407 %	2.793.473,71	1,95
1,750% Japan Bk Internat. Cooperation DL-Bonds 2013(18) US471048AF59	USD	1.000.000	0	0	100,8798 %	902.000,63	0,63
2,375% Japan Finance Organ.f.Municip. DL-MTN 2015(25) XS1185955306	USD	1.500.000	0	0	101,8815 %	1.366.436,43	0,95
1,250% KommuneKredit DL-MTN 2015(18) XS1279561465	USD	2.000.000	0	0	100,4246 %	1.795.861,95	1,26
2,125% Kreditanst.f.Wiederaufbau DL-Anl. 2013(23) US500769FK50	USD	2.000.000	0	0	103,6574 %	1.853.673,10	1,30
3,050% Manitoba, Provinz DL-Debts 2014(24) US563469UD51	USD	1.000.000	0	0	108,3933 %	969.181,42	0,68
6,700% Panama, Republik DL-Bonds 2006(34-36) US698299AW45	USD	1.500.000	0	0	137,7500 %	1.847.505,36	1,29
2,375% Temasek Financial (I) DL-MTN 2012(23) US87973RAC43	USD	2.000.000	0	0	103,0074 %	1.842.049,36	1,29
3,125% United States of America DL-Bonds 2011(41) US912810QT88	USD	4.500.000	0	0	117,7715 %	4.738.660,14	3,32
3,000% United States of America DL-Bonds 2015(45) US912810RM27	USD	2.500.000	0	2.500.000	115,4727 %	2.581.201,94	1,81
0,750% United States of America DL-Inflation-Prot. Secs 2015(45)* US912810RL44	USD	4.500.000	4.500.000	0	104,0649 %	4.279.236,34	2,99
Pfandbriefe/Kommunalobligationen						4.498.164,78	3,15
2,000% Norddeutsche Landesbank -GZ- ÖPF 2013(19) US65556GAD79	USD	2.000.000	0	0	101,3309 %	1.812.068,13	1,27
1,200% Royal Bank of Canada DL-Bonds 2012(17) US78011DAC83	USD	1.000.000	0	0	100,1638 %	895.598,62	0,63
1,375% Westpac Banking DL-MT Cov.Notes 2013(18) US96122XAE85	USD	2.000.000	0	0	100,1247 %	1.790.498,03	1,25

* Bei diesen Wertpapieren handelt es sich um Poolfaktoranleihen, deren Kurswert sich auf Grund von Teilrückzahlung oder Teilzinskaptalisierung nicht zwangsläufig aus Kurs und Nominal ergibt.

Gattungsbezeichnung ISIN	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 30.9.2016	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	in % vom Fonds- vermögen
Schuldverschreibungen der Kreditwirtschaft						12.080.096,33	8,45
5,550% Bank of China (Hongkong) DL-Notes 2010(20) USY1391CAJ00	USD	1.000.000	0	0	110,2937 %	986.174,00	0,69
0,934% Caisse des Depots et Consign. DL-FLR MTN 2014(19) FR0012146587	USD	1.000.000	0	0	99,4743 %	889.434,01	0,62
11,000% Coöperatieve Rabobank DL-FLR Cap.Secs 2009(19) XS0431744282	USD	1.125.000	0	0	121,4500 %	1.221.667,11	0,85
4,000% Export-Import Bank of India DL-MTN 2012(17) XS0813393849	USD	1.500.000	0	0	101,7810 %	1.365.088,52	0,96
4,000% Export-Import Bk of Korea DL-Notes 2012(17) US302154BD08	USD	1.000.000	0	1.000.000	100,7850 %	901.153,43	0,63
3,000% HDFC Bk DL-MTN 2013(16) XS0987130266	USD	1.000.000	0	0	100,2365 %	896.249,11	0,63
4,500% Hongkong L.Finance(C.I.)Co. DL-MTN 2010(25) XS0546241075	USD	950.000	0	0	114,3151 %	971.023,76	0,68
1,697% Nordea Bank DL-FLR MTN 2015(18) US65557DAN12	USD	1.000.000	1.000.000	0	100,6879 %	900.285,23	0,63
2,200% Royal Bank of Canada DL-MTN 2013(18) US78008S7D27	USD	1.000.000	0	0	101,4624 %	907.209,85	0,63
1,750% Toronto-Dominion Bank DL-MTN 2015(18) US89114QB643	USD	1.000.000	0	0	100,6679 %	900.105,95	0,63
1,692% UBS (Stamford) DL-FLR MTN 2015(20) US90261XHN57	USD	1.000.000	1.000.000	0	99,9946 %	894.086,19	0,63
5,606% Wells Fargo & Co. DL-Notes 2013(44) US949746RF01	USD	1.142.000	0	0	122,1837 %	1.247.619,17	0,87
Andere Schuldverschreibungen/Industrie						7.393.349,87	5,17
1,998% Alphabet DL-Notes 2016(26) US02079KAC18	USD	2.500.000	2.500.000	0	98,8413 %	2.209.435,35	1,55
6,800% CITIC DL-MTN 2012(23) XS0836465608	USD	1.000.000	0	0	122,4868 %	1.095.196,71	0,77
2,750% Hyundai Capital America DL-MTN 2016(26) US44891CAK99	USD	1.000.000	1.000.000	0	99,9843 %	893.994,10	0,62
1,150% Pfizer DL-FLR Notes 2013(18) US717081DF76	USD	500.000	500.000	0	100,3372 %	448.574,75	0,31
2,125% Toyota Motor Credit DL-MTN 2014(19) US89236TBP93	USD	2.000.000	0	0	101,9801 %	1.823.678,47	1,28
2,950% Vodafone Group DL-Notes 2013(23) US92857WBC38	USD	1.000.000	0	0	103,1691 %	922.470,49	0,64

Gattungsbezeichnung ISIN	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 30.9.2016	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	in % vom Fonds- vermögen
			im Berichtszeitraum				
Zero-Bonds						3.778.349,43	2,64
0,000% British Transco Int.Fin. DL-Zero-Bonds 1991 (21) XS0034394709	USD	2.000.000	0	0	87,2527 %	1.560.312,95	1,09
0,000% European Investment Bank DL-Zero Notes 1996(26) XS0070553820	USD	3.000.000	0	0	82,6884 %	2.218.036,48	1,55
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere						1.746.027,10	1,22
Verzinsliche Wertpapiere						1.746.027,10	1,22
AUD						780.199,13	0,55
Pfandbriefe/Kommunalobligationen						780.199,13	0,55
5,000% National Australia Bank AD-Covererd Bonds 2014(24) AU3CB0219186	AUD	1.000.000	0	0	114,7985 %	780.199,13	0,55
USD						965.827,97	0,67
Andere Schuldverschreibungen/Industrie						965.827,97	0,67
3,100% Procter & Gamble Co. DL-Notes 2013(23) US742718EB11	USD	1.000.000	0	0	108,0182 %	965.827,97	0,67
Nicht notierte Wertpapiere						1.442.574,04	1,01
Verzinsliche Wertpapiere						1.442.574,04	1,01
NZD						1.442.574,04	1,01
Öffentliche Anleihen						1.442.574,04	1,01
3,500% New Zealand ND-Bonds 2015(33) NZGOVDT433C9	NZD	2.000.000	2.000.000	0	111,1756 %	1.442.574,04	1,01
Investmentfonds						5.245.585,69	3,67
Rentenfonds						5.245.585,69	3,67
Gruppenfremde Rentenfonds						5.245.585,69	3,67
iShares USD Mar.iB. Corporate Bd UCITS ETF IE0032895942	Anteile	40.000	40.000	0	118,5500 USD	4.239.985,69	2,97
SPDR Bar.Eme.Mkts Local Bd ETF IE00B4613386	Anteile	15.000	15.000	0	67,0400 EUR	1.005.600,00	0,70
Summe Wertpapiervermögen						139.049.048,40	97,29
Derivate							
Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.							
Zins-Derivate						-51.441,17	-0,04
Zinsindex-Terminkontrakte						-51.441,17	-0,04
FUTURE Euro-BUXL Futures 12.16	Anzahl	-25				-52.000,00	-0,04
FUTURE U.S.A.Treasury Bond Futures 12.16	Anzahl	-20				558,83	0,00

Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 30.9.2016	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	in % vom Fonds- vermögen
			im Berichtszeitraum				
Devisen-Derivate						188.326,38	0,13
Forderungen/Verbindlichkeiten							
Devisen-Terminkontrakte (Verkauf)						188.326,38	0,13
GBP JPY 27.10.16	GBP	- 10.000.000				104.261,14	0,07
USD EUR 27.10.16	USD	- 12.000.000				32.342,40	0,02
USD JPY 27.10.16	USD	- 12.000.000				51.722,84	0,04
Forderungen						1.532.003,95	1,07
Ausschüttung Zielfonds	EUR	34.749,64				34.749,64	0,02
Zinsansprüche	EUR	1.497.254,31				1.497.254,31	1,05
Bankguthaben						2.387.627,81	1,68
Bankguthaben EUR	EUR	1.304.522,71				1.304.522,71	0,92
Bankguthaben AUD	AUD	48.643,38				33.059,25	0,02
Bankguthaben CAD	CAD	51.773,08				35.138,51	0,03
Bankguthaben GBP	GBP	336,82				389,95	0,00
Bankguthaben JPY	JPY	34.077.733,00				301.908,03	0,21
Bankguthaben MXN	MXN	655.750,00				29.871,31	0,02
Bankguthaben NOK	NOK	499.110,01				55.246,42	0,04
Bankguthaben NZD	NZD	223.934,27				145.284,50	0,10
Bankguthaben SEK	SEK	18.584,67				1.929,92	0,00
Bankguthaben USD	USD	537.020,04				480.168,14	0,34
Bankguthaben ZAR	ZAR	1.709,04				109,07	0,00
Sonstige Vermögensgegenstände						307,01	0,00
Forderungen aus Anteilscheingeschäften*	EUR	307,01				307,01	0,00
Verbindlichkeiten						- 188.191,87	- 0,13
Sonstige Verbindlichkeiten						- 188.191,87	- 0,13
Verbindlichkeiten aus Anteilscheingeschäften*	EUR	- 10.438,34				- 10.438,34	- 0,01
Verwahrstellenvergütung	EUR	- 21.013,42				- 21.013,42	- 0,01
Verwaltungsvergütung	EUR	- 116.259,86				- 116.259,86	- 0,08
Prüfungskosten	EUR	- 10.000,00				- 10.000,00	- 0,01
Veröffentlichungskosten	EUR	- 30.480,25				- 30.480,25	- 0,02
Fondsvermögen					EUR	142.917.680,51	100,00**
Fondsvermögen FT AccuZins (PT)					EUR	142.917.680,51	
Anteilwert					EUR	307,55	
Umlaufende Anteile					Stück	464.694	
Fondsvermögen FT AccuZins (IA)					EUR	0,00	
Anteilwert					EUR	0,00	
Umlaufende Anteile					Stück	0	

* Noch nicht valutierte Transaktionen.

** Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügig Rundungsdifferenzen entstanden sein.

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück, Anteile bzw. Währung	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge
				im Berichtszeitraum
Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen				
Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag)				
Börsengehandelte Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
0,499% ABN AMRO Bank EO-FLR MTN 2014(19)	XS1040422526	EUR	0	1.000.000
6,250% BNZ Inter. Fund. (Ldn Br.) AD-Bonds 2011(16)	AU3CB0177673	AUD	0	1.000.000
3,125% Bulgarien EO-MTN 2015(35)	XS1208856341	EUR	0	500.000
0,000% Bundesrep. Deutschland Bundesobl. 2015(20)	DE0001141711	EUR	0	2.500.000
4,250% CEZ DL-Notes 2012(22)	XS0764313614	USD	0	800.000
3,625% Chile, Republik DL-Bonds 2012(42)	US168863BP27	USD	0	1.000.000
5,875% EDP Finance EO-MTN 2011(16)	XS0586598350	EUR	0	1.000.000
1,750% Emirates NBD EO-MTN 2015(22)	XS1207079499	EUR	0	1.000.000
3,750% IPIC GMTN DL-MTN 2011(17)	XS0701035320	USD	0	750.000
2,875% Israel EO-MTN 2014(24)	XS1023541847	EUR	0	2.500.000
3,000% Kroatien, Republik EO-Notes 2015(25)	XS1117298916	EUR	0	400.000
0,241% Lloyds Bank EO-FLR MTN 2015(17)	XS1278908626	EUR	0	1.000.000
2,250% National Bank of Abu Dhabi DL-MTN 2015(20)	XS1186986904	USD	0	500.000
2,750% New Brunswick, Provinz DL-Notes 2011(18)	US642869AC54	USD	0	750.000
3,000% New Zealand, Government of ... ND-Bonds 2013(20)	NZGOVDT420C6	NZD	0	2.250.000
8,375% Peru DL-Bonds 2004(16)	US715638AQ52	USD	0	1.000.000
6,000% Roche Holdings DL-Notes 2009(19)	USU75000AM82	USD	0	442.000
1,500% Schweden, Königreich SK-Obl. 2012(23)	SE0004869071	SEK	0	12.000.000
5,900% Spanien EO-Bonos 2011(26)	ES00000123C7	EUR	0	2.000.000
4,000% Spanien DL-MTN 2013(18)	XS0895794658	USD	0	2.000.000
3,375% Vodafone Group LS-MTN 2016(49)	XS1468494239	GBP	100.000	100.000
2,500% Volkswagen Fin. Services NK-MTN 2013(16)	XS0965051328	NOK	0	10.000.000
4,646% Wakala Global Sukuk Bhd DL-Trust Certs 2011(21)	USY9485PAB86	USD	0	500.000
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				
Verzinsliche Wertpapiere				
3,750% Kreditanst.f.Wiederaufbau ND-MTN 2015(20)	NZKFZDT001C5	NZD	0	3.000.000

FT AccuZins (PT)

Ertrags- und Aufwandsrechnung für den Zeitraum vom 1.10.2015 bis 30.9.2016

	Gesamtwert in EUR	je Anteil in EUR
I. Erträge		
1. Zinsen aus inl. Wertpapieren	337.790,30	0,73
2. Zinsen aus ausl. Wertpapieren (vor Quellensteuer)	3.481.714,42	7,49
3. Zinsen aus Liquiditätsanlagen im Inland	2.047,58	0,00
4. Erträge aus Investmentanteilen	158.382,78	0,34
5. Sonstige Erträge	13,70	0,00
Summe der Erträge	3.979.948,78	8,56
II. Aufwendungen		
1. Zinsen aus Kreditaufnahmen*	6.454,47	0,01
2. Verwaltungsvergütung	1.381.277,87	2,97
3. Verwahrstellenvergütung	65.573,30	0,14
4. Prüfungs- und Veröffentlichungskosten	38.987,07	0,08
5. Sonstige Aufwendungen	36.174,59	0,08
Summe der Aufwendungen	1.528.467,30	3,28
III. Ordentlicher Nettoertrag	2.451.481,48	5,28
IV. Veräußerungsgeschäfte		
1. Realisierte Gewinne	6.452.971,90	13,88
2. Realisierte Verluste	-4.872.094,42	-10,48
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	1.580.877,48	3,40
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	4.032.358,96	8,68
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	5.942.579,01	12,78
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	-787.465,68	-1,69
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	5.155.113,33	11,09
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	9.187.472,29	19,77

* Inklusive eventuell angefallener negativer Einlagenzinsen.

Verwendungsrechnung

	Gesamtwert in EUR	je Anteil in EUR
Berechnung der Wiederanlage		
I. Für die Wiederanlage verfügbar		
1. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	4.032.358,96	8,68
2. Zur Verfügung gestellter Steuerabzugsbetrag	-738.863,46	-1,59
II. Wiederanlage	3.293.495,50	7,09

Entwicklungsrechnung

	in EUR	in EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres		127.098.531,65
1. Steuerabschlag für das Vorjahr		-964.491,00
2. Mittelzufluss (netto)		7.696.370,86
a) Mittelzuflüsse aus Anteilschein-Verkäufen	19.654.364,77	
b) Mittelabflüsse aus Anteilschein-Rücknahmen	-11.957.993,91	
3. Ertragsausgleich/ Aufwandsausgleich		-100.203,29
4. Ergebnis des Geschäftsjahres		9.187.472,29
davon nicht realisierte Gewinne	5.942.579,01	
davon nicht realisierte Verluste	-787.465,68	
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres		142.917.680,51

Vergleichende Dreijahresübersicht

Geschäftsjahr	Fondsvermögen in EUR	Anteilwert in EUR
30.9.2013	118.605.277	254,80
30.9.2014	125.561.391	277,75
30.9.2015	127.098.532	289,74
30.9.2016	142.917.681	307,55

FT AccuZins (IA)

Ertrags- und Aufwandsrechnung für den Zeitraum vom 1.10.2015 bis 30.9.2016

	Gesamtwert in EUR	je Anteil in EUR
I. Erträge		
Summe der Erträge	0,00	0,00
II. Aufwendungen		
1. Verwaltungsvergütung	0,80	0,00
2. Verwahrstellenvergütung	0,06	0,00
Summe der Aufwendungen	0,86	0,00
III. Ordentlicher Nettoertrag	-0,86	0,00
IV. Veräußerungsgeschäfte		
Ergebnis aus Veräußerungsgeschäften	0,00	0,00
V. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	-0,86	0,00
1. Nettoveränderung der nicht realisierten Gewinne	130,34	0,00
2. Nettoveränderung der nicht realisierten Verluste	75,12	0,00
VI. Nicht realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	205,46	0,00
VII. Ergebnis des Geschäftsjahres	204,60	0,00

Verwendungsrechnung

	Gesamtwert in EUR	je Anteil in EUR
Berechnung der Ausschüttung		
I. Für die Ausschüttung verfügbar	162,83	0,00
1. Vortrag aus dem Vorjahr*	163,69	0,00
2. Realisiertes Ergebnis des Geschäftsjahres	-0,86	0,00

* Aufgrund der Rückgabe aller Anteile während des Geschäftsjahres war eine Ausschüttung nicht mehr vorzunehmen.

Entwicklungsrechnung

	in EUR	in EUR
I. Wert des Sondervermögens am Beginn des Geschäftsjahres		19.134,02
1. Steuerabschlag für das Vorjahr		- 72,92
2. Mittelzufluss (netto)		- 19.636,04
b) Mittelabflüsse aus		
Anteilschein-Rücknahmen	- 19.636,04	
3. Ertragsausgleich/ Aufwandsausgleich		370,34
4. Ergebnis des Geschäftsjahres		204,60
davon nicht realisierte Gewinne	130,34	
davon nicht realisierte Verluste	75,12	
II. Wert des Sondervermögens am Ende des Geschäftsjahres		0,00

Vergleichende Jahresübersicht

Geschäftsjahr	Fondsvermögen in EUR	Anteilwert in EUR
30.9.2015	19.134	4.783,51
30.9.2016	0,00	0,00

Angaben zu den Kosten gemäß § 101 Abs. 2 und 3 KAGB

Ausgabeaufschlag der in dem Fonds enthaltenen Zielfonds:

Im Berichtszeitraum fielen für die in dem Fonds enthaltenen Zielfonds keine Ausgabeaufschläge an.

Verwaltungsvergütungen* der in dem Fonds enthaltenen Zielfonds:

	% p. a.
iShares IV-DL S.D.H.Y.C.Bd UC.	0,45
iShares USD Corporate Bond UCITS ETF	0,20
iShares USD Mar.iB. Corporate Bd UCITS ETF	0,20
SPDR Bar.Eme.Mkts Local Bd ETF	0,55

* Darüber hinaus können performanceabhängige Verwaltungsvergütungen anfallen.

Anhang

gemäß § 7 Nr. 9 KARBV*

		in % vom Fonds- vermögen
Angaben nach der Derivateverordnung		
Das durch Derivate erzielte zugrundeliegende Exposure	EUR	40.843.056,52
Die Vertragspartner der Derivate-Geschäfte		
Chicago – Chicago Board of Trade (CBOT)		
Eurex – Frankfurt/Zürich		
Oddo et Cie		
Gesamtbetrag der im Zusammenhang mit Derivaten erhaltenen Sicherheiten	EUR	0,00
Bestand der Wertpapiere		97,29
Bestand der Derivate		0,09
Zusammensetzung des Vergleichsvermögens (§ 9 Abs. 5 Satz 4 DerivateV)		
JPM Japan	20%	1.10.2015 bis 30.9.2016
JPM Global	30%	1.10.2015 bis 30.9.2016
JPM GBI Europe (EUR)	50%	1.10.2015 bis 30.9.2016
Potenzieller Risikobetrag für das Marktrisiko gemäß § 10 Abs. 1 Satz 1 i. V. m. § 37 Abs. 4 Satz 2 DerivateV		
Kleinster potenzieller Risikobetrag	2,91%	(3.8.2016)
Größter potenzieller Risikobetrag	3,94%	(10.2.2016)
Durchschnittlicher potenzieller Risikobetrag	3,38%	
<p>Bei der Ermittlung des Marktrisikopotenzials wendet die Gesellschaft den qualifizierten Ansatz im Sinne der Derivate-Verordnung an. Die Risikokennzahlen wurden für den Zeitraum vom 1.10.2015 bis 30.9.2016 auf Basis des Varianz-Kovarianz Ansatzes mit Monte-Carlo add-on für nicht lineare Risiken mit den Parametern 99 Prozent Konfidenzniveau, 10 Tage Haltedauer unter Verwendung eines effektiven, historischen Beobachtungszeitraumes von einem Jahr berechnet. Als Bewertungsmaßstab wird das Risiko eines derivatfreien Vergleichsvermögens herangezogen. Unter dem Marktrisiko versteht man das Risiko, das sich aus der ungünstigsten Entwicklung von Marktpreisen für das Sondervermögen ergibt.</p> <p>Die durchschnittliche Hebelwirkung aus der Nutzung von Derivaten betrug im Geschäftsjahr 1,28. Die Berechnung erfolgte unter Verwendung des Einfachen Ansatzes nach § 15 ff DerivateV ohne Anwendung von § 15 Absatz 2 DerivateV in Bezug auf die Herausrechnung der Investmentanteile.</p>		
Sonstige Angaben		
FT AccuZins (PT)		
Anteilwert	EUR	307,55
Umlaufende Anteile	Stück	464.694
FT AccuZins (IA)		
Anteilwert	EUR	0,00
Umlaufende Anteile	Stück	0

* Kapitalanlage-Rechnungslegungs- und Bewertungsverordnung

Wertpapierart	Region	Bewertungsdatum	Bewertung mit handelbaren Kursen	Besonderheiten bei Investmentanteilen, Bankguthaben und Verbindlichkeiten
Wertpapierkurse bzw. Marktsätze				
Angabe zu dem Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände				
Renten	Inland	29.9.2016	11,00 %	
	Europa	29.9.2016	37,45 %	
	Asien	30.9.2016	12,70 %	
	Australien	29.9.2016	7,15 %	
	Nordamerika	29.9.2016	22,78 %	
	Südamerika	29.9.2016	2,54 %	
Investmentanteile	Europa	29.9.2016	3,67 %	
Derivate – Futures	Inland	29.9.2016	-0,04 %	
	Nordamerika	29.9.2016	0,00 %	
Derivate – Devisentermingeschäfte		30.9.2016	0,13 %	
Übriges Vermögen		30.9.2016		2,62 %
			97,38 %	2,62 %
Die prozentualen Angaben beziehen sich auf den Anteil der einzelnen Vermögensgegenstände am Fondsvermögen.				
Für Investmentanteile ist der Sitz der Kapitalverwaltungsgesellschaft für die Region und das Bewertungsdatum maßgebend.				
Die Bewertung erfolgt durch die Kapitalverwaltungsgesellschaft unter Kontrolle der Verwahrstelle. Die Bewertung von börsengehandelten Vermögensgegenständen erfolgt mit entsprechend handelbaren Kursen. Sollten für diese Vermögensgegenstände keine handelbaren Kurse verfügbar sein, erfolgt die Bewertung auf Basis geeigneter Modelle. Bewertungseinheiten werden nicht gebildet.				
Devisenkurse per 30.9.2016				
Australischer Dollar	(AUD)	1,471400	=	1 EUR
Britisches Pfund	(GBP)	0,863750	=	1 EUR
Japanischer Yen	(JPY)	112,874550	=	1 EUR
Kanadischer Dollar	(CAD)	1,473400	=	1 EUR
Neuer Mexikanischer Peso	(MXN)	21,952500	=	1 EUR
Neuseeland Dollar	(NZD)	1,541350	=	1 EUR
Norwegische Krone	(NOK)	9,034250	=	1 EUR
Schwedische Krone	(SEK)	9,629750	=	1 EUR
Südafrikanischer Rand	(ZAR)	15,668750	=	1 EUR
US-Dollar	(USD)	1,118400	=	1 EUR
Terminbörse				
Chicago – Chicago Board of Trade (CBOT)				
Eurex – Frankfurt/Zürich				
OTC (Over-the-Counter)				

Gesamtkostenquote (Laufende Kosten) in %

Die Laufenden Kosten drücken die Summe aller Kosten und Gebühren (ohne Transaktionskosten, inkl. Zielfondskosten) als Prozentsatz des durchschnittlichen Fondsvolumens innerhalb eines Geschäftsjahres aus.

FT AccuZins (PT)

1,10

FT AccuZins (IA)

0,74

Die Kapitalverwaltungsgesellschaft erhält keine Rückvergütungen der aus dem Sondervermögen an die Verwahrstelle oder an Dritte geleisteten Vergütungen und Aufwandsersatzungen. Ein wesentlicher Teil der aus dem Sondervermögen an die Kapitalverwaltungsgesellschaft geleisteten Vergütungen wird für Vergütungen an Vermittler von Anteilen des Sondervermögens auf den Bestand von vermittelten Anteilen verwendet.

Die Kosten aus Transaktionsumsätzen, die im Berichtszeitraum für Rechnung des Sondervermögens abgewickelt wurden, betragen 22.081,40 Euro.

Angaben zur Mitarbeitervergütung

**Gesamtsumme der im abgelaufenen Geschäftsjahr der Kapitalverwaltungs-
gesellschaft gezahlten Mitarbeitervergütung**

EUR

7.469.086,00

Davon feste Vergütung

EUR

6.129.556,00

Davon variable Vergütung

EUR

1.339.530,00

Direkt aus dem Fonds gezahlte Vergütungen

n/a

Zahl der Mitarbeiter der Kapitalverwaltungsgesellschaft

Anzahl

76

Höhe des gezahlten Carried Interest

n/a

**Gesamtsumme der im abgelaufenen Geschäftsjahr der Kapitalverwaltungs-
gesellschaft gezahlten Vergütung an Führungskräfte und andere Risikoträger**

EUR

1.562.930,00

Davon Geschäftsführer

EUR

739.960,00

Davon andere Führungskräfte

EUR

n/a

Davon andere Risikoträger

EUR

822.970,00

Davon Mitarbeiter mit Kontrollfunktionen

n/a

Davon Mitarbeiter mit gleicher Einkommensstufe

n/a

Beschreibung, wie die Vergütungen und gegebenenfalls sonstige Zuwendungen berechnet wurden

Der FRANKFURT-TRUST ist in das Vergütungssystem des BHF-BANK Konzerns eingebunden. Die BHF-BANK hat eine gruppenweite, einheitliche Vergütungsstrategie aufgestellt.

Die Gesamtvergütung der Beschäftigten des FRANKFURT-TRUST setzt sich grundsätzlich aus einer fixen und einer variablen Komponente zusammen.

Die fixe Vergütung stellt die Grundvergütung dar und orientiert sich an der jeweiligen Qualifikation und Tätigkeit des Mitarbeiters bzw. Geschäftsleiters.

Zur Grundvergütung können die Mitarbeiter und Geschäftsleiter des FRANKFURT-TRUST eine leistungs- und ergebnisabhängige variable Vergütung erhalten, welche die fixe Grundvergütung nicht beeinflusst. Die maßgeblichen Vergütungsparameter der variablen Vergütung sind die Geschäftsentwicklung der BHF-BANK bzw. des FRANKFURT-TRUST sowie die individuelle Zielerreichung und Leistung des Mitarbeiters innerhalb des eigenen Aufgabenfeldes.

Für die Höhe der variablen Vergütung sind für alle Mitarbeiter und Geschäftsleiter Obergrenzen definiert worden – grundsätzlich mit maximal 100 Prozent der jährlichen Grundvergütung. In Ausnahmefällen kann die variable Vergütung bis zu 200 Prozent der fixen Vergütung betragen. Die Gewährung einer variablen Vergütung von über 100 Prozent der jährlichen Grundvergütung ist nur mit Zustimmung der Geschäftsleitung (bzw. des Aufsichtsrats betreffend die Vergütung der Geschäftsleitung) möglich.

Für die Mitarbeiter des FRANKFURT-TRUST erfolgt die Auszahlung der variablen Vergütung jährlich als nachschüssige Einmalzahlung in Form von Bargeld; diese Regelung gilt auch für die Geschäftsleiter und die identifizierten Risk Taker.

Zur Berechnung der oben ausgewiesenen Beträge wurden die Entgeltabrechnungen für das Geschäftsjahr 2015 herangezogen.

Ergebnisse der jährlichen Überprüfung der Vergütungspolitik

Das Vergütungssystem der Mitarbeiter wird einmal jährlich durch einen Arbeitskreis „Review Vergütung“ der BHF-BANK auf Konformität mit der Geschäfts- und Risikostrategie sowie den regulatorischen und betrieblichen Regelungen hin geprüft und gegebenenfalls angepasst. Der Arbeitskreis setzt sich zusammen aus Mitarbeitern der Kontrolleinheiten (Compliance und Personal), aus Arbeitnehmervertretern sowie aus Führungskräften der Geschäfts- und Zentralbereiche der BHF-BANK oder Führungskräften des FRANKFURT-TRUST.

Im Ergebnis wurde im abgelaufenen Geschäftsjahr der Eskalationsprozess für Mitarbeiterbeurteilungen neu definiert.

Zudem überwacht der Vergütungskontrollausschuss mindestens einmal jährlich die Angemessenheit der Vergütungssysteme der Mitarbeiter und der Geschäftsleiter. Bei dieser Prüfung wurden keine Unregelmäßigkeiten festgestellt.

Angaben zu wesentlichen Änderungen der festgelegten Vergütungspolitik

Im abgelaufenen Geschäftsjahr ergaben sich keine wesentlichen Änderungen in der festgelegten Vergütungspolitik.

Angaben zu wesentlichen Änderungen

Im Rahmen der Besonderen Anlagebedingungen § 7 Absatz 3 des FT AccuZins vorgesehenen Regelungen wurde die Verwahrstellenvergütung des Fonds zum 1. Januar 2016 von zzt. 0,07 Prozent auf 0,03 Prozent gesenkt.

FRANKFURT-TRUST
Investment-Gesellschaft mbH
Geschäftsführung

Frankfurt am Main, 25. November 2016

Besonderer Vermerk des Abschlussprüfers

An die FRANKFURT-TRUST Investment-Gesellschaft mbH

Die FRANKFURT-TRUST Investment-Gesellschaft mbH hat uns beauftragt, gemäß § 102 des Kapitalanlagegesetzbuches (KAGB) den Jahresbericht des Sondervermögens **FT AccuZins** für das Geschäftsjahr vom 1. Oktober 2015 bis 30. September 2016 zu prüfen.

Verantwortung der gesetzlichen Vertreter

Die Aufstellung des Jahresberichts nach den Vorschriften des KAGB liegt in der Verantwortung der gesetzlichen Vertreter der Kapitalverwaltungsgesellschaft.

Verantwortung des Abschlussprüfers

Unsere Aufgabe ist es, auf der Grundlage der von uns durchgeführten Prüfung eine Beurteilung über den Jahresbericht abzugeben.

Wir haben unsere Prüfung nach § 102 KAGB unter Beachtung der vom Institut der Wirtschaftsprüfer (IDW) festgestellten deutschen Grundsätze ordnungsmäßiger Abschlussprüfung vorgenommen. Danach ist die Prüfung so zu planen und durchzuführen, dass Unrichtigkeiten und Verstöße, die sich auf den Jahresbericht wesentlich auswirken, mit hinreichender Sicherheit erkannt werden. Bei der Festlegung der Prüfungshandlungen werden die Kenntnisse über die Verwaltung des Sondervermögens sowie die Erwartungen über mögliche Fehler berücksichtigt.

Im Rahmen der Prüfung werden die Wirksamkeit des rechnungslegungsbezogenen internen Kontrollsystems und die Nachweise für die Angaben im Jahresbericht überwiegend auf der Basis von Stichproben beurteilt. Die Prüfung umfasst die Beurteilung der angewandten Rechnungslegungsgrundsätze für den Jahresbericht und der wesentlichen Einschätzungen der gesetzlichen Vertreter der Kapitalverwaltungsgesellschaft. Wir sind der Auffassung, dass unsere Prüfung eine hinreichend sichere Grundlage für unsere Beurteilung bildet.

Prüfungsurteil

Nach unserer Beurteilung aufgrund der bei der Prüfung gewonnenen Erkenntnisse entspricht der Jahresbericht für das Geschäftsjahr vom 1. Oktober 2015 bis 30. September 2016 den gesetzlichen Vorschriften.

Frankfurt am Main, 25. November 2016

KPMG AG
Wirtschaftsprüfungsgesellschaft

Kuppler
Wirtschaftsprüfer

Baumann
Wirtschaftsprüfer

Ertrag des Fonds

Die Zins- und Dividendenerträge eines Investmentfonds werden entweder ausgeschüttet oder im Fonds wiederangelegt (thesauriert). Bei einem ausschüttenden Fonds verringert sich der Anteilpreis am Tag der Ausschüttung um den Ausschüttungsbetrag. Bei thesaurierenden Fonds ermäßigt sich der Anteilwert des Fonds am ersten Bankarbeitstag nach Geschäftsjahresende um die pro Anteil abzuführenden Steuern.

Beim FT AccuZins (PT) wurden für das zurückliegende Geschäftsjahr pro Anteil 7,09 Euro der Wiederanlage zugeführt. Der Anteilwert ermäßigte sich am 4. Oktober 2016 um die abzuführenden Steuern in Höhe von 1,59 Euro.

Beim FT AccuZins (IA) wurden die am Tag der letzten Preisermittlung enthaltenen zu thesaurierenden Erträge im Preis berücksichtigt.

Kostenfreie Wiederanlage

Bei Anteilen, die Sie im FT-Investmentdepot verwahren, erfolgt die Wiederanlage von Ausschüttungen und Steuererstattungsbeträgen kostenfrei. Dazu schreiben wir Ihrem FT-Investmentdepot zusätzliche Anteile und Anteilbruchteile bis zu drei Nachkommastellen gut.

Steuerliche Betrachtung beim Anleger

Die für Sie als Anleger steuerpflichtigen Erträge können von den Erträgen abweichen, die der Fonds auf wirtschaftlicher Ebene erzielt hat und in seiner Verwendungsrechnung ausgewiesen werden. Maßgeblich für die Besteuerung Ihrer Erträge sind die steuerlichen Daten, die Ihnen zum Jahresende von Ihrer depotführenden Stelle übermittelt werden.

Allgemeine steuerliche Informationen finden Sie im Verkaufsprospekt des Fonds und in unserer Bibliothek unter „www.frankfurt-trust.de“.

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:
11,5 Mio. EUR

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

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

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.

Frank-Peter Martin

Zugleich Mitglied des Verwaltungsrats der
FRANKFURT-TRUST Invest Luxemburg AG

Aufsichtsrat

Joachim Häger
Vorsitzender

Mitglied des Vorstands der BHF-BANK

Christophe Tadié
stellv. Vorsitzender

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

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

Stand September 2016