



## GWP-Fonds FT

HALBJAHRESBERICHT **31.3.2018**

Fondsmanager:

**GROHMANN  
WEINRAUTER**   
Institutional Asset Management GmbH

Vertrieb und Initiator:

**GROHMANN  
WEINRAUTER**   
VermögensManagement GmbH

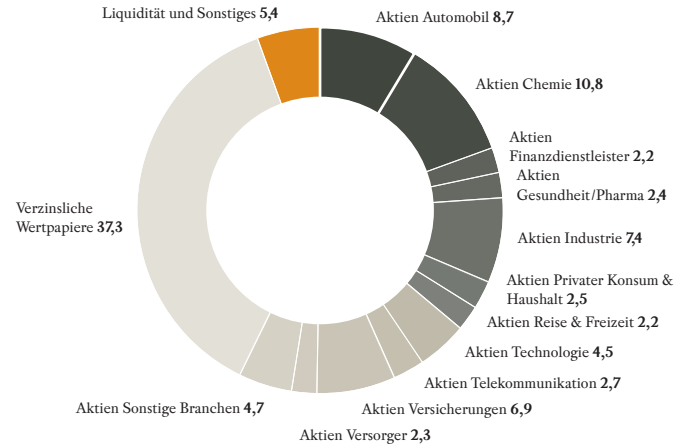
# Vermögensaufstellung im Überblick

31.3.2018

## Vermögensübersicht

Fondsvermögen in Mio. EUR	10,4
	in % vom Fondsvermögen
<b>I. Vermögensgegenstände</b>	<b>100,19</b>
1. Aktien	57,31
2. Verzinsliche Wertpapiere	37,25
3. Derivate	1,00
4. Forderungen	0,40
5. Bankguthaben	4,23
<b>II. Verbindlichkeiten</b>	<b>-0,19</b>
<b>III. Fondsvermögen</b>	<b>100,00</b>

## Portefeuillestruktur nach Assetklassen in %



# Vermögensaufstellung

31.3.2018

Gattungsbezeichnung ISIN	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 31.3.2018	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	in % vom Fonds- vermögen
					im Berichtszeitraum		
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>						<b>9.835.450,85</b>	<b>94,56</b>
<b>Aktien</b>						<b>5.960.500,06</b>	<b>57,31</b>
<b>Deutschland</b>						<b>5.960.500,06</b>	<b>57,31</b>
<b>Automobil</b>						<b>904.641,52</b>	<b>8,70</b>
BMW	Stück	2.820	0	0	87,7700 EUR	247.511,40	2,38
DE0005190003							
Continental	Stück	496	0	0	221,2000 EUR	109.715,20	1,05
DE0005439004							
Daimler NA	Stück	6.209	0	0	67,9200 EUR	421.715,28	4,05
DE0007100000							
VW Vorzugsaktien	Stück	787	0	0	159,7200 EUR	125.699,64	1,21
DE0007664039							
<b>Banken</b>						<b>124.267,28</b>	<b>1,19</b>
Commerzbank	Stück	4.732	0	0	10,6540 EUR	50.414,73	0,48
DE000CBK1001							
Deutsche Bank NA	Stück	6.531	0	0	11,3080 EUR	73.852,55	0,71
DE0005140008							
<b>Bau &amp; Materialien</b>						<b>61.661,60</b>	<b>0,59</b>
HeidelbergCement	Stück	770	0	0	80,0800 EUR	61.661,60	0,59
DE0006047004							
<b>Chemie</b>						<b>1.126.643,98</b>	<b>10,84</b>
BASF NA	Stück	5.441	0	0	82,1300 EUR	446.869,33	4,30
DE000BASF111							
Bayer NA	Stück	4.523	0	0	91,9500 EUR	415.889,85	4,00
DE000BAY0017							
Linde z. Umtausch eing.	Stück	1.536	1.536	0	171,8000 EUR	263.884,80	2,54
DE000A2E4L75							
<b>Finanzdienstleister</b>						<b>225.411,45</b>	<b>2,17</b>
Deutsche Börse NA	Stück	2.039	0	0	110,5500 EUR	225.411,45	2,17
DE0005810055							
<b>Gesundheit/Pharma</b>						<b>245.321,28</b>	<b>2,36</b>
Fresenius Medical Care	Stück	1.014	0	0	82,7200 EUR	83.878,08	0,81
DE0005785802							
Fresenius	Stück	1.856	0	0	61,8600 EUR	114.812,16	1,10
DE0005785604							
Merck	Stück	596	0	0	78,2400 EUR	46.631,04	0,45
DE0006599905							
<b>Immobilien</b>						<b>201.194,60</b>	<b>1,93</b>
Vonovia NA	Stück	4.985	0	0	40,3600 EUR	201.194,60	1,93
DE000A1ML7J1							
<b>Industrie</b>						<b>774.002,09</b>	<b>7,44</b>
Deutsche Post NA	Stück	7.711	0	0	35,3700 EUR	272.738,07	2,62
DE0005552004							
Siemens	Stück	4.414	0	0	103,2800 EUR	455.877,92	4,38
DE0007236101							
thyssenkrupp	Stück	2.110	0	0	21,5100 EUR	45.386,10	0,44
DE0007500001							

Gattungsbezeichnung ISIN	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 31.3.2018	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	in % vom Fonds- vermögen
					im Berichtszeitraum		
<b>Medien</b>						<b>96.813,50</b>	<b>0,93</b>
ProSiebenSat.1 Media NA DE000PSM7770	Stück	3.475	0	0	27,8600 EUR	96.813,50	0,93
<b>Privater Konsum &amp; Haushalt</b>						<b>262.228,50</b>	<b>2,52</b>
adidas NA DE000A1EWWO0	Stück	714	0	0	194,8500 EUR	139.122,90	1,34
Beiersdorf DE0005200000	Stück	430	0	0	91,3200 EUR	39.267,60	0,38
Henkel Inhaber-Vorzugsaktien DE0006048432	Stück	785	0	0	106,8000 EUR	83.838,00	0,81
<b>Reise &amp; Freizeit</b>						<b>227.527,00</b>	<b>2,19</b>
Deutsche Lufthansa vinkulierte NA DE0008232125	Stück	8.836	0	0	25,7500 EUR	227.527,00	2,19
<b>Technologie</b>						<b>466.813,39</b>	<b>4,49</b>
Infineon Technologies NA DE0006231004	Stück	5.138	0	0	21,4800 EUR	110.364,24	1,06
SAP DE0007164600	Stück	4.195	0	0	84,9700 EUR	356.449,15	3,43
<b>Telekommunikation</b>						<b>281.657,97</b>	<b>2,71</b>
Deutsche Telekom NA DE0005557508	Stück	21.362	0	0	13,1850 EUR	281.657,97	2,71
<b>Versicherungen</b>						<b>720.228,49</b>	<b>6,92</b>
Allianz vinkulierte NA DE0008404005	Stück	2.593	0	0	183,8800 EUR	476.800,84	4,58
Münchener Rückversicherung vinkulierte NA DE0008430026	Stück	1.289	0	0	188,8500 EUR	243.427,65	2,34
<b>Versorger</b>						<b>242.087,41</b>	<b>2,33</b>
E.ON NA DE000ENAG999	Stück	22.795	0	0	8,9590 EUR	204.220,41	1,96
RWE DE0007037129	Stück	1.900	0	0	19,9300 EUR	37.867,00	0,36



Gattungsbezeichnung	Stück, Anteile bzw. Währung	Bestand 31.3.2018	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Kurs	Kurswert in EUR	in % vom Fonds- vermögen
			im Berichtszeitraum				
<b>Derivate</b>							
Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.							
<b>Aktienindex-Derivate</b>						<b>89.793,71</b>	<b>0,86</b>
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>						<b>89.793,71</b>	<b>0,86</b>
FUTURE DAX Performance-Index 06.18	Anzahl	- 14				75.793,71	0,73
MINI FUTURE DAX Performance-Index 06.18	Anzahl	- 8				14.000,00	0,13
<b>Zins-Derivate</b>						<b>13.900,00</b>	<b>0,14</b>
<b>Zinsindex-Terminkontrakte</b>						<b>13.900,00</b>	<b>0,14</b>
FUTURE Euro-Bund-Future 06.18	Anzahl	12				13.900,00	0,14
<b>Forderungen</b>						<b>41.884,92</b>	<b>0,40</b>
Zinsansprüche	EUR	41.884,92				41.884,92	0,40
<b>Bankguthaben</b>						<b>439.996,67</b>	<b>4,23</b>
Bankguthaben EUR	EUR	439.996,67				439.996,67	4,23
<b>Verbindlichkeiten</b>						<b>- 19.827,21</b>	<b>- 0,19</b>
Sonstige Verbindlichkeiten						- 19.827,21	- 0,19
Verwahrstellenvergütung	EUR	- 1.807,99				- 1.807,99	- 0,02
Verwaltungsvergütung	EUR	- 8.242,22				- 8.242,22	- 0,08
Prüfungskosten	EUR	- 8.777,00				- 8.777,00	- 0,08
Veröffentlichungskosten	EUR	- 1.000,00				- 1.000,00	- 0,01
<b>Fondsvermögen</b>					<b>EUR</b>	<b>10.401.198,94</b>	<b>100,00*</b>
Anteilwert					EUR	117,61	
Umlaufende Anteile					Stück	88.439	
* Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügig Rundungsdifferenzen entstanden sein.							

Gattungsbezeichnung	ISIN	Stück, Anteile bzw. Währung	Käufe/ Zugänge	Verkäufe/ Abgänge	Volumen in 1.000
			im Berichtszeitraum		
<b>Während des Berichtszeitraumes abgeschlossene Geschäfte, soweit sie nicht mehr in der Vermögensaufstellung erscheinen</b>					
<b>Käufe und Verkäufe in Wertpapieren, Investmentanteilen und Schuldscheindarlehen (Marktzuordnung zum Berichtsstichtag)</b>					
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>					
<b>Aktien</b>					
Linde	DE0006483001	Stück	0	1.536	
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>					
0,500% Bundesrep.Deutschland Bundesobl. 2013(18)	DE0001141653	EUR	0	400.000	
0,000% Bundesrep.Deutschland Bundesschatzanw. 2016(18)	DE0001104636	EUR	0	600.000	
<b>Umsätze in Derivaten (In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte. Bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)</b>					
<b>Terminkontrakte</b>					
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>					
Verkaufte Kontrakte (Basiswert[e]: DAX Performance-Index)		EUR			36.452
<b>Zinsindex-Terminkontrakte</b>					
Gekaufte Kontrakte (Basiswert[e]: Euro-Bund-Future [8,5–10,5 Jahre] langfristig)		EUR			10.582
Verkaufte Kontrakte (Basiswert[e]: Euro-Bund-Future [8,5–10,5 Jahre] langfristig)		EUR			6.762

**Anhang**  
gemäß § 7 Nr. 9 KARBV\*

in % vom  
Fonds-  
vermögen

**Angaben nach der Derivateverordnung**

Bestand der Wertpapiere											94,56
Bestand der Derivate											1,00

**Sonstige Angaben**

Anteilwert												
Umlaufende Anteile									EUR		117,61	
									Stück		88.439	

\* Kapitalanlage-Rechnungslegungs- und -Bewertungsverordnung





FRANKFURT-TRUST  
Investment-Gesellschaft mbH  
Bockenheimer Landstraße 10  
60323 Frankfurt am Main  
Postanschrift:  
Postfach 1107 61  
60042 Frankfurt am Main  
Telefon (0 69) 9 20 50 - 0  
Telefax (0 69) 9 20 50 - 103

Gezeichnetes  
und eingezahltes Eigenkapital:  
16,0 Mio. EUR  
Haftendes Eigenkapital:  
14,1 Mio. EUR  
Gesellschafter von  
FRANKFURT-TRUST ist  
zu 100% die ODDO BHF  
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:  
2,7 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 - 0.

### 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](http://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 Vor-  
stands 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  
61462 Königstein

### Vertrieb und Initiator

Grohmann & Weinrauter  
VermögensManagement GmbH  
Altkönigstraße 8  
61462 Königstein

### Aufsichtsrat

Joachim Häger  
Vorsitzender  
Mitglied des Vorstands der ODDO BHF AG

Christophe Tadié  
stellv. Vorsitzender  
Mitglied des Vorstands der ODDO BHF AG

Frank Behrends  
Mitglied des Vorstands der ODDO BHF AG

Matthias Berg  
Direktor der ODDO BHF AG

Ulrich Lingenthal  
Direktor der ODDO BHF AG

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

Stand März 2018