

First Private  
**Systematic Events**

Halbjahresbericht zum  
31.03.2019



## ALLGEMEINE HINWEISE

Der Kauf von Fondsanteilen erfolgt auf Basis des zur Zeit gültigen Verkaufsprospektes einschließlich der darin enthaltenen gültigen Anlagebedingungen. Sofern der Stichtag des Jahresberichtes länger als acht Monate zurückliegt, ist dem Erwerber auch ein Halbjahresbericht auszuhändigen. Die alleinverbindlichen Verkaufsprospekte können kostenfrei bei der Kapitalverwaltungsgesellschaft und den Vertriebspartnern bezogen werden bzw. stehen unter <http://www.first-private.de> zum Download zur Verfügung.

Alle Zahlenangaben geben den zum Berichtstichtag verfügbaren Stand wieder.

### HERAUSGEBER

Kapitalverwaltungsgesellschaft  
**FIRST PRIVATE** Investment Management KAG mbH

Westhafenplatz 8 | 60327 Frankfurt am Main  
Postfach 11 16 63 | 60051 Frankfurt am Main

Telefon: +49 69 505082-0  
Telefax: +49 69 505082-440  
Internet: [www.first-private.de](http://www.first-private.de)  
E-Mail: [info@first-private.de](mailto:info@first-private.de)

Geschäftsführer:  
Tobias Klein, Thorsten Wegner, Richard Zellmann

Registergericht: Amtsgericht Frankfurt am Main  
Handelsregister-Nr.: HRB 32877

# VERMÖGENSÜBERSICHT

## GEM. § 9 KARBV

### VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.03.2019

		KURSWERT IN EUR	% DES FONDSVERMÖGENS
<b>I. Vermögensgegenstände</b>			
1. Aktien			
	Euro-Länder	EUR 555.019,14	17,68
	Sonstige EU/EWR-Länder	EUR 256.482,62	8,18
	Nicht EU/EWR-Länder	EUR 1.382.597,90	44,05
2. Anleihen			
	Schuldverschreibungen, die von öffentlichen Institutionen emittiert oder gesichert werden	EUR 171.466,52	5,46
	Unternehmensanleihen	EUR 198.706,10	6,33
3. Derivate			
	Futures (Verkauf)	EUR -2.360,08	-0,07
	Futures (Kauf)	EUR 17.028,38	0,54
	Devisentermingeschäfte (Verkauf)	EUR -26.661,34	-0,85
	Devisentermingeschäfte (Kauf)	EUR 82,08	0,00
	Swaps (Verkauf)	EUR -13.872,19	-0,44
	Swaps (Kauf)	EUR -2.703,02	-0,09
4. Bankguthaben			
	Bankguthaben in EUR	EUR 365.577,21	11,65
	Bankguthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen	EUR 13.316,36	0,42
	Bankguthaben in Nicht EU/EWR-Währungen	EUR 34.502,87	1,10
5. Sonstige Vermögensgegenstände		EUR 260.328,15	8,29
<b>II. Verbindlichkeiten</b>			
1. Kurzfristige Verbindlichkeiten			
	Kurzfristige Verbindlichkeiten in Nicht EU/EWR-Währungen	EUR -36.207,86	-1,15
2. Sonstige Verbindlichkeiten		EUR -34.636,39	-1,10
<b>III. Fondsvermögen</b>		<b>EUR 3.138.666,45</b>	<b>100,00*</b>

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

# VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.03.2019

ISIN	GATTUNGSBEZEICHNUNG	STÜCK BZW. ANTEILE BZW. WÄHRUNG IN 1.000	BESTAND 31.03.2019	KÄUFE/ ZUGÄNGE IM BERICHTS- ZEITRAUM	VERKÄUFE/ ABGÄNGE IM BERICHTS- ZEITRAUM	KURS	KURSWERT IN EUR	% DES FONDS- VERMÖ- GENS
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>						<b>EUR</b>	<b>1.913.788,36</b>	<b>60,97</b>
<b>Aktien</b>								
AU000000NTC2	Netcomm Wireless Ltd.	STK	9.068	9.068	0	AUD 1,0700	6.138,27	0,20
CA0012641001	AGT Food and Ingredients Inc.	STK	11.249	11.249	0	CAD 17,9000	134.233,59	4,28
NL0000335578	BinckBank N.V.	STK	20.325	20.325	0	EUR 6,3000	128.047,50	4,08
NL0000400653	Gemalto N.V.	STK	2.977	2.977	0	EUR 50,9800	151.767,46	4,84
IE0002325243	IFG Group PLC	STK	45.045	45.045	0	EUR 2,2200	99.999,90	3,19
NL0000362648	KAS Bank N.V. CVA	STK	6.078	6.078	0	EUR 12,2600	74.516,28	2,37
ES0165515117	Natra S.A.	STK	112.000	112.000	0	EUR 0,8990	100.688,00	3,21
GB00BZ21RF93	Stallergenes Greer PLC	STK	624	624	0	EUR 36,5000	22.776,00	0,73
GB0005203376	Jardine Lloyd Thompson Group PLC	STK	5.831	5.831	0	GBP 19,1400	129.517,63	4,13
US5024131071	L3 Technologies Inc.	STK	555	555	0	USD 206,3700	102.004,14	3,25
US50218P1075	LSC Communications, Inc.	STK	14.000	14.000	0	USD 6,5300	81.417,82	2,59
VGG572791041	Luxoft Holding Inc. A	STK	1.501	1.501	0	USD 58,7100	78.482,17	2,50
US7565771026	Red Hat Inc.	STK	829	829	0	USD 182,7000	134.887,38	4,30
US85207U1051	Sprint Corp. 1	STK	18.312	18.312	0	USD 5,6500	92.143,03	2,94
US9032934054	USG Corp.	STK	2.702	2.702	0	USD 43,3000	104.196,11	3,32
US9815581098	Worldpay Inc.	STK	1.017	1.017	0	USD 113,5000	102.800,46	3,28
<b>Verzinsliche Wertpapiere</b>								
XS1210352784	0,500% Aabar Investments EXB 27.03.20	EUR	100	100	0	% 96,7491	96.749,10	3,08
XS1586710185	3,250% Motor Oil Finance Nts. 01.04.22	EUR	100	100	0	% 101,9570	101.957,00	3,25
IS0000020386	6,500% Island Bds. 24.01.31	ISK	20.000	20.000	0	% 118,0505	171.466,52	5,46
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>						<b>EUR</b>	<b>559.817,65</b>	<b>17,84</b>
<b>Aktien</b>								
GB00BZ04Y379	ARRIS International PLC	STK	3.701	3.701	0	USD 31,6100	104.188,99	3,32
US05573H1086	BSB Bancorp Inc.	STK	5.132	5.132	0	USD 32,8400	150.095,63	4,78
US2077971016	Connecticut Water Service Inc.	STK	1.662	1.662	0	USD 68,6500	101.613,13	3,24
US31787A5074	Finisar Corp.	STK	5.014	5.014	0	USD 23,1700	103.463,85	3,30
IL0011017329	Mellanox Technologies Ltd.	STK	953	953	0	USD 118,3600	100.456,05	3,20
<b>Nichtnotierte Wertpapiere</b>						<b>EUR</b>	<b>90.666,27</b>	<b>2,89</b>
<b>Aktien</b>								
JP3392200006	Eighteenth Bank Ltd.	STK	4.108	4.108	0	JPY 2.743,0000	90.666,27	2,89
<b>Summe Wertpapiervermögen</b>						<b>EUR</b>	<b>2.564.272,28</b>	<b>81,70</b>

GATTUNGSBEZEICHNUNG	MARKT	STÜCK BZW. AN- TEILE BZW. WÄHRUNG IN 1.000	BESTAND 31.12.2018	KÄUFE/ ZUGÄNGE IM BE- RICHTS- ZEITRAUM	VERKÄUFE/ ABGÄNGE IM BERICHTS- ZEITRAUM	KURS	KURSWERT IN EUR	% DES FONDS- VERMÖ- GENS
<b>Derivate</b>								
Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen.								
<b>Derivate auf einzelne Wertpapiere</b>							<b>-3.450,00</b>	<b>-0,11</b>
<b>Wertpapier-Terminkontrakte</b>								
<b>Wertpapier-Terminkontrakte auf Aktien</b>								
Deutsche Telekom (SSDF) Dividend Future 12/20	EDT	STK	230.000			EUR 0,6500	0,00	0,00
Société Générale Dividend Future 12/20	EDT	STK	30.000			EUR 1,8300	-3.450,00	-0,11
<b>Aktienindex-Derivate</b>						<b>EUR</b>	<b>31.337,97</b>	<b>1,00</b>
<b>Forderungen/Verbindlichkeiten</b>								
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>								
CME E-Mini Russell 2000 Index Future 06/19	NAR	USD	Anzahl -50				1.157,77	0,04
CME E-Mini Russell 2000 Index Future 06/19	NAR	USD	Anzahl 200				-890,59	-0,03
E-Mini S&P 500 Index Future 06/19	NAR	USD	Anzahl -100				-512,09	-0,02
EURO STOXX 50 Dividenden Index Future 12/19	EDT	EUR	Anzahl 10.000				20.650,00	0,66
S&P 500 Annual Dividend Index Future 12/19	NAR	USD	Anzahl 10.000				4.898,25	0,16
SGX Nikkei Stock Av. Div. Point Index Future 12/19	FMS	JPY	Anzahl 50.000				6.034,63	0,19
<b>Zins-Derivate</b>						<b>EUR</b>	<b>-13.219,67</b>	<b>-0,42</b>
<b>Forderungen/Verbindlichkeiten</b>								
<b>Zinsterminkontrakte</b>								
6,000% 2-Year U.S. Treasury Notes Future 06/19	NAU	USD	8.200.000				-1.948,11	-0,06
6,000% 30-Year U.S. Treasury Long Bond Fut. 06/19	NAU	USD	-600.000				-500,96	-0,02
6,000% 5-Year U.S. Treasury Notes Future 06/19	NAU	USD	2.200.000				-8.265,80	-0,26
6,000% Ultra10-Year U.S. Treasury Notes Fut. 06/19	NAU	USD	-1.300.000				-2.504,80	-0,08
<b>Devisen-Derivate</b>						<b>EUR</b>	<b>-26.579,26</b>	<b>-0,85</b>
<b>Forderungen/Verbindlichkeiten</b>								
<b>Devisenterminkontrakte</b>								
<b>Devisentermingeschäfte (Verkauf)</b>								
<b>Offene Positionen</b>								
CAD/EUR	0,2 Mio.	OTC					-992,64	-0,03
GBP/EUR	0,2 Mio.	OTC					-2.640,60	-0,08
JPY/EUR	11,0 Mio.	OTC					-204,11	-0,01
USD/EUR	1,6 Mio.	OTC					-22.823,99	-0,73

GATTUNGSBEZEICHNUNG	MARKT	STÜCK BZW. AN- TEILE BZW. WÄHRUNG IN 1.000	BESTAND 31.12.2018	KÄUFE/ ZUGÄNGE IM BE- RICHTS- ZEITRAUM	VERKÄUFE/ ABGÄNGE IM BERICHTS- ZEITRAUM	KURS	KURSWERT IN EUR	% DES FONDS- VERMÖ- GENS
<b>Devisentermingeschäfte (Kauf)</b>								
<b>Offene Positionen</b>								
USD/EUR	0,2 Mio.	OTC					82,08	0,00
<b>Swaps</b>						<b>EUR</b>	<b>-16.575,21</b>	<b>-0,53</b>
<b>Total Return Swaps</b>								
<b>Forderungen/Verbindlichkeiten</b>								
(Erhalten / Zahlen)								
JPM,LDN Strategy Index Long vs. EURi-BORM3 20.03.21	OTC	EUR	300.000				1.396,01	0,04
JPM,LDN Strategy Indx Short vs. EURi-BORM3 20.03.21	OTC	EUR	-300.000				-972,14	-0,03
MS,FFM CAD Aktien Basket Long vs. CADISC 24.03.21	OTC	CAD	124.627				-6.366,24	-0,20
MS,FFM EUR Aktien Basket Long vs. EONIA 09.03.20	OTC	EUR	28.585				189,64	0,01
MS,FFM GBP Aktien Basket Long vs. SONIA 09.03.20	OTC	GBP	154.982				4.175,57	0,13
MS,FFM GBP Aktien Basket Short vs. SONIA 09.03.20	OTC	GBP	-32.401				-761,19	-0,02
MS,FFM JPY Aktien Basket Long vs. YENON 25.03.21	OTC	JPY	12.772.500				-2.100,60	-0,07
MS,FFM JPY Aktien Basket Short vs. YENON 25.03.21	OTC	JPY	-24.720.700				-2.075,62	-0,07
MS,FFM USD Aktien Basket Long vs. FED-FDS 24.03.20	OTC	USD	3.554.248				2,60	0,00
MS,FFM USD Aktien Basket Short vs. FED-FDS 24.03.20	OTC	USD	-720.262				-10.063,24	-0,32
MS,LDN GBP Aktien Basket Long vs. SONIA 17.12.19	OTC	GBP	0				-27,28	0,00
<b>Bankguthaben</b>						<b>EUR</b>	<b>413.396,44</b>	<b>13,17</b>
The Bank of New York Mellon SA/NV (Verwahrstelle)		EUR	365.577,21			% 100,0000	365.577,21	11,65
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen (Verwahrstelle)								
		GBP	8.812,29			% 100,0000	10.226,64	0,32
		PLN	246,85			% 100,0000	57,34	0,00
		SEK	31.581,51			% 100,0000	3.032,38	0,10
Guthaben in Nicht EU/EWR-Währungen (Verwahrstelle)								
		CHF	1.670,05			% 100,0000	1.493,45	0,05
		HKD	231.564,56			% 100,0000	26.271,31	0,84
		JPY	734.775,00			% 100,0000	5.912,13	0,19
		MXN	10.211,42			% 100,0000	468,83	0,01
		ZAR	5.783,26			% 100,0000	357,15	0,01
<b>Sonstige Vermögensgegenstände</b>						<b>EUR</b>	<b>260.328,15</b>	<b>8,29</b>
Dividendenansprüche		EUR	839,75				839,75	0,03
Einschüsse (Initial Margin)		EUR	116.281,73				116.281,73	3,70
Forderungen aus Collateral		EUR	140.000,00				140.000,00	4,46
Zinsansprüche		EUR	3.206,67				3.206,67	0,10

GATTUNGSBEZEICHNUNG	MARKT	STÜCK BZW. AN- TEILE BZW. WÄHRUNG IN 1.000	BESTAND 31.12.2018	KÄUFE/ ZUGÄNGE IM BE- RICHTS- ZEITRAUM	VERKÄUFE/ ABGÄNGE IM BERICHTS- ZEITRAUM	KURS	KURSWERT IN EUR	% DES FONDS- VERMÖ- GENS
<b>Kurzfristige Verbindlichkeiten</b>						<b>EUR</b>	<b>-36.207,86</b>	<b>-1,15</b>
Banksaldo in Nicht-EU/EWR-Währungen (Verwahrstelle)								
		AUD	-3.865,25			% 100,0000	-2.445,28	-0,08
		CAD	-17.203,94			% 100,0000	-11.468,91	-0,36
		USD	-25.032,44			% 100,0000	-22.293,67	-0,71
<b>Sonstige Verbindlichkeiten</b>						<b>EUR</b>	<b>-34.636,39</b>	<b>-1,10</b>
Kostenabgrenzung		EUR	-19.972,54				-19.972,54	-0,63
Variation Margin		EUR	-14.663,85				-14.663,85	-0,47
<b>Fondsvermögen</b>						<b>EUR</b>	<b>3.138.666,45</b>	<b>100,00*)</b>
<b>Anteilwert First Private Systematic Events A</b>						<b>EUR</b>	<b>97,05</b>	
<b>Umlaufende Anteile First Private Systematic Events A</b>						<b>STK</b>	<b>32.340</b>	

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

**WERTPAPIERKURSE BZW. MARKTSÄTZE**

DEVISENKURSE (IN MENGENNOTIZ)	PER	29.03.2019		
Australische Dollar	(AUD)	1,580700	=	1 EUR
Baht (Thailand)	(THB)	35,633650	=	1 EUR
Britische Pfund	(GBP)	0,861700	=	1 EUR
Hongkong Dollar	(HKD)	8,814350	=	1 EUR
Indonesische Rupiah	(IDR)	15.989,384750	=	1 EUR
Isländische Kronen	(ISK)	137,695100	=	1 EUR
Japanische Yen	(JPY)	124,282650	=	1 EUR
Kanadischer Dollar	(CAD)	1,500050	=	1 EUR
Malaysische Ringgit	(MYR)	4,584050	=	1 EUR
Mexikanische Peso	(MXN)	21,780500	=	1 EUR
Neue Taiwan-Dollar	(TWD)	34,606800	=	1 EUR
Real (Brasilien)	(BRL)	4,369800	=	1 EUR
Schwedische Kronen	(SEK)	10,414750	=	1 EUR
Schweizer Franken	(CHF)	1,118250	=	1 EUR
Südafrikanische Rand	(ZAR)	16,192950	=	1 EUR
Südkoreanische Won	(KRW)	1.274,547050	=	1 EUR
US-Dollar	(USD)	1,122850	=	1 EUR
Yuan Renminbi	(CNY)	7,545800	=	1 EUR
Zloty	(PLN)	4,304800	=	1 EUR

MARKTSCHLÜSSEL	
b) Terminbörse	
EDT	EUREX Terminbörse Deutschland
FMS	Singapur
NAR	Chicago Mercantile Exchange
NAU	Chicago Board of Trade
c) OTC	Over-the-Counter



## WÄHREND DES BERICHTSZEITRAUMS ABGESCHLOSSENE GESCHÄFTE, SOWEIT SIE NICHT IN DER VERMÖGENSAUFSTELLUNG ERSCHEINEN

### KÄUFE UND VERKÄUFE IN WERTPAPIEREN, INVESTMENTANTEILEN UND SCHULDSCHEINDARLEHEN (MARKTZUORDNUNG ZUM BERICHTSSTICHTAG):

ISIN	GATTUNGSBEZEICHNUNG	STÜCK BZW. ANTEILE BZW. WÄHRUNG IN 1.000	KÄUFE/ ZUGÄNGE IM BERICHTS- ZEITRAUM	VERKÄUFE/ ABGÄNGE IM BERICHTS- ZEITRAUM
<b>Börsengehandelte Wertpapiere</b>				
<b>Aktien</b>				
US00817Y1082	Aetna Inc.	STK	580	580
FI0009000285	Amer Sports Corp. A	STK	1.965	1.965
CA09251U1003	Blackpearl Resources Inc.	STK	119.636	119.636
US12673P1057	CA Inc.	STK	1.974	1.974
US1510201049	Celgene Corp.	STK	800	800
CH0413237394	CEVA Logistics AG	STK	4.740	4.740
SE0010133256	Cherry Ab B	STK	14.871	14.871
US12572Q1058	CME Group Inc.	STK	361	361
SE0005999778	Com Hem Holding AB	STK	7.204	7.204
US1266501006	CVS Health Corp.	STK	486	486
GB00B8KJH563	Esure Group PLC	STK	23.755	23.755
US30255G1031	FCB Financial Holdings Inc. A	STK	4.600	4.600
AU000000GXL9	Greencross Ltd.	STK	28.863	28.863
CA46016U1084	International Petroleum Corp.	STK	26.320	26.320
US4771771098	Jetpay Corp.	STK	12.163	12.163
US55024U1097	Lumentum Holdings Inc.	STK	856	856
CA60671Q1046	Mitel Networks Corp.	STK	7.839	7.839
GB00BZ02MH16	Nex Group PLC	STK	8.135	8.135
ES0168561019	Papeles y Cartones de Europa [Europ&c] S.A.	STK	4.486	4.486
US7504591097	Radisys Corp.	STK	54.377	54.377
US76009N1000	Rent -A- Center Inc. (New)	STK	6.013	6.013
AU000000SCO2	Scottish Pacific Group Ltd.	STK	28.172	28.172
AU000000SFI7	Spookfish Ltd.	STK	920.528	920.528
US87161C5013	Synovus Financial Corp.	STK	2.787	2.787
SE0005190238	Tele2 A.B. Redemption Shares B	STK	7.473	7.473
<b>An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere</b>				
<b>Aktien</b>				
US2852291002	Electro Scientific Inds Inc.	STK	3.929	3.929
US4824801009	KLA-Tencor Corp.	STK	532	532
US67555N2062	Oclaro Inc.	STK	13.462	13.462
IL0010823388	Orbotech Ltd.	STK	2.127	2.127
US8815691071	Tesaro Inc.	STK	1.171	1.171
<b>Nichtnotierte Wertpapiere</b>				
<b>Aktien</b>				
JP3269200006	Clarion Co. Ltd.	STK	5.221	5.221
US26483E1001	Dun & Bradstreet Corp. [Del.]	STK	608	608

## DERIVATE

(In Opening-Transaktionen umgesetzte Optionsprämien bzw. Volumen der Optionsgeschäfte, bei Optionsscheinen Angabe der Käufe und Verkäufe.)

GATTUNGSBEZEICHNUNG	STÜCK BZW. ANTEILE BZW. WÄHRUNG IN 1.000	KÄUFE/ ZUGÄNGE	VERKÄUFE/ ABGÄNGE	VOLUMEN IN 1.000
<b>Terminkontrakte</b>				
<b>Aktienindex-Terminkontrakte</b>				
Gekaufte Kontrakte:				
(Basiswerte:				
E-Mini S&P 500 Index Future, S&P 500 Annual Dividend Index Future, VStoxx Index Future)	EUR	.		1.868
Verkaufte Kontrakte:				
(Basiswerte:				
CBOE Volatility Index Future, CME E-Mini Russell 2000 Index Future, E-Mini S&P 500 Index Future, H-Shares Index Future, Mini MSCI Emerging Markets Index Future, MSCI SGX Taiwan Index Future, SGX FTSE China A50 Index Future)	EUR	.		2.811
<b>Zinsterminkontrakte</b>				
Gekaufte Kontrakte:				
(Basiswerte:				
2-Year U.S. Treasury Notes Future, 30-Year U.S. Treasury Long Bond Fut., 5-Year U.S. Treasury Notes Future, Ultra10-Year U.S. Treasury Notes Fut.)	EUR			49.042
Verkaufte Kontrakte:				
(Basiswerte:				
2-Year U.S. Treasury Notes Future, 30-Year U.S. Treasury Long Bond Fut., 5-Year U.S. Treasury Notes Future, Ultra10-Year U.S. Treasury Notes Fut.)	EUR			47.92
<b>Devisenterminkontrakte</b>				
<b>Devisentermingeschäfte (Verkauf)</b>				
Verkauf von Devisen auf Termin:				
AUD/EUR	EUR			330
CAD/EUR	EUR			131
CHF/EUR	EUR			265
GBP/EUR	EUR			251
JPY/EUR	EUR			195
SEK/EUR	EUR			343
USD/EUR	EUR			2.169
<b>Devisentermingeschäfte (Kauf)</b>				
Kauf von Devisen auf Termin:				
AUD/EUR	EUR			102
CHF/EUR	EUR			131
GBP/EUR	EUR			154
HKD/EUR	EUR			11
JPY/EUR	EUR			101

GATTUNGSBEZEICHNUNG	STÜCK BZW. ANTEILE BZW. WÄHRUNG IN 1.000	KÄUFE/ ZUGÄNGE	VERKÄUFE/ ABGÄNGE	VOLUMEN IN 1.000
SEK/EUR	EUR			12
USD/EUR	EUR			2.728
ZAR/EUR	EUR			4
<b>Swaps (in Opening-Transaktionen umgesetzte Volumen)</b>				
<b>Total Return Swaps</b>				
MS,LDN BRL Aktien Basket Long vs. FEDFDS 14.11.19	BRL			310
MS,LDN BRL Aktien Basket Short vs. FEDFDS 22.11.19	BRL			174
MS,LDN CAD Aktien Basket Long vs. CADISC 12.01.21	CAD			163
MS,LDN CAD Aktien Basket Long vs. CADISC 26.10.20	CAD			115
MS,LDN CAD Aktien basket Short vs. CADISC 12.11.20	CAD			146
MS,LDN CNY Aktien Basket Long vs. FEDFDS 03.02.21	CNY			1.413
MS,LDN EUR Aktien Basket Long vs. EONIA 25.10.19	EUR			294
MS,LDN EUR Aktien Basket Short vs. EONIA 25.10.19	EUR			208
MS,LDN GBP Aktien Basket Long vs. SONIA 17.12.19	GBP			155
MS,LDN GBP Aktien Basket Short vs. SONIA 25.10.19	GBP			183
MS,LDN HKD Aktien Basket Short vs. HONIA 29.10.20	HKD			478
MS,LDN HKD Aktien Basket Long vs. HONIA 28.01.21	HKD			913
MS,LDN IDR Aktien Basket Long vs. FEDFDS 17.11.20	IDR			2.133
MS,LDN JPY Aktien Basket Long vs. YENON 28.10.20	JPY			20.808
MS,LDN JPY Aktien Basket Long vs. YENON 28.10.2020	JPY			13.208
MS,LDN JPY Aktien Basket Short vs. YENON 28.10.20	JPY			24.429
MS,LDN KRW Aktien Basket Long vs. FEDFDS 17.11.20	KRW			253.472
MS,LDN KRW Aktien Basket Short vs. FEDFDS 17.11.20	KRW			158.928
MS,LDN MXN Aktien Basket Long vs. MXNTNZT1 12.11.20	MXN			1.609
MS,LDN MYR Aktien Basket Long vs. FEDFDS 17.11.20	MYR			327
MS,LDN MYR Aktien Basket Short vs. FEDFDS 17.11.20	MYR			576
MS,LDN PLN Aktien Basket Short vs. 0% 12.11.20	PLN			359
MS,LDN SEK Aktien Basket Short vs. STIBOR 04.11.20	SEK			897
MS,LDN THB Aktien Basket Long vs. FEDFDS 17.11.20	THB			5.229
MS,LDN TWD Aktien Basket Long vs. FEDFDS 17.11.20	TWD			2.363
MS,LDN TWD Aktien Basket Short vs. FEDFDS 17.11.20	TWD			5.167
MS,LDN USD Aktien Basket Long vs. FEDFDS 14.02.20	USD			290
MS,LDN USD Aktien Basket Long vs. FEDFDS 24.10.19	USD			580
MS,LDN USD Aktien Basket Short vs. FEDFDS 24.10.19	USD			678
MS,LDN ZAR Aktien Basket Short vs. SABOR 12.11.20	ZAR			2.484

## SONDERVERMÖGEN

### First Private **Systematic Events**

ANTEILKLASSEN- BEZEICHNUNG	A*
Mindestanlagesumme	1.000.000 EUR
Fondsaufgabe	15.10.2018
Ausgabeaufschlag	0,00%
Rücknahmeabschlag	0,00%
Verwaltungsvergütung p.a.	0,50%
Stückelung	Globalurkunde
Ertragsverwendung	ausschüttend
Währung	EUR
ISIN	DE000A0Q95C2
WKN	A0Q95C
Performanceabhängige Vergütung	10% des über dem Referenzwert liegenden Wertzuwachses
Kleinste handelbare Einheit:	1 Anteil

\* Diese Anteilklasse ist institutionellen Anlegern vorbehalten

# ANHANG

## GEM. § 7 NR.9 KARBV

### Zusätzliche Anhangangaben gemäß der Verordnung (EU) 2015/2365 betreffend Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

	TOTAL RETURN SWAPS
	(Betragsangaben in EUR)
<b>Verwendete Vermögensgegenstände</b>	JPM,LDN Strategy Index Long vs. EURiBORM3 20.03.21 JPM,LDN Strategy Index Short vs. EURiBORM3 20.03.21 MS,FFM CAD Aktien Basket Long vs. CADISC 24.03.21 MS,FFM EUR Aktien Basket Long vs. EONIA 09.03.20 MS,FFM GBP Aktien Basket Long vs. SONIA 09.03.20 MS,FFM GBP Aktien Basket Short vs. SONIA 09.03.20 MS,FFM JPY Aktien Basket Long vs. YENON 25.03.21 MS,FFM JPY Aktien Basket Short vs. YENON 25.03.21 MS,FFM USD Aktien Basket Long vs. FEDFDS 24.03.20 MS,FFM USD Aktien Basket Short vs. FEDFDS 24.03.20
absolut	-16.575,21
in % des Fondsvermögens	-0,53
<b>Zehn größte Gegenparteien</b>	
1. Name	Morgan Stanley Frankfurt
1. Bruttovolumen offene Geschäfte	-211.955,07
1. Sitzstaat	USA
2. Name	JP Morgan London
2. Bruttovolumen offene Geschäfte	0,00
2. Sitzstaat	Großbritannien
<b>Art(en) von Abwicklung und Clearing (z.B. zweiseitig, dreiseitig, CCP)</b>	
	zweiseitig
<b>Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)</b>	
unter 1 Tag	
1 Tag bis 1 Woche (= 7 Tage)	
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)	
1 bis 3 Monate	
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)	-211.955,07
über 1 Jahr	
unbefristet	
<b>Art(en) und Qualität(en) der erhaltenen Sicherheiten</b>	
	n/a
<b>Währung(en) der erhaltenen Sicherheiten</b>	
	n/a
<b>Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)</b>	
	n/a
<b>Ertrags- und Kostenanteile</b>	
Ertragsanteil des Fonds	
absolut	314.253,34
in % der Bruttoerträge	100
Kostenanteil des Fonds	305.228,06

Ertragsanteil des KVG	
absolut	
in % der Bruttoerträge	
Kostenanteil der KVG	
Ertragsanteil Dritter (z.B. Leiheagent)	
absolut	
in % der Bruttoerträge	
Kostenanteil Dritter	
<b>Erträge für den Fonds aus Wiederanlage von Barsicherheiten, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps (absoluter Betrag)</b>	<b>n/a</b>

<b>Anteilwert First Private Systematic Events A</b>	EUR	97,05	
<b>Umlaufende Anteile First Private Systematic Events A</b>	STK	32.340	

#### Angabe zu den Verfahren zur Bewertung der Vermögensgegenstände

Die Bewertung erfolgt durch die Verwahrstelle unter Mitwirkung der Kapitalverwaltungsgesellschaft. 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. Die Kapitalverwaltungsgesellschaft beauftragte die Société Générale Securities Services GmbH in Ihrem Namen unter Mitwirkung der Verwahrstelle den täglichen NAV zu ermitteln.

Für die im Sondervermögen First Private Systematic Events enthaltenen Wertpapiere kamen, bezogen auf den Nettoinventarwert, nachfolgend dargestellte Bewertungsverfahren zum Ansatz:

81,70% Bewertung auf Basis handelbarer Kurse

0,00% Bewertung auf Basis nicht handelbarer Kurse (u.a. anhand der Quelle Interactive Data, indikativer Quotes bzw. Bewertungsmodellen).

Die Bewertung von Investmentanteilen erfolgt grundsätzlich auf Basis des Rücknahmepreises des Vortages oder – sofern kein Rücknahmepreis verfügbar ist – auf Basis von Börsenkursen.

Exchange-Traded-Funds werden zum Börsenkurs bewertet.

Die Bewertung von Futures und Optionen, die an einer Börse oder an einem anderen organisierten Markt gehandelt werden, erfolgt grundsätzlich anhand des letzten verfügbaren handelbaren Kurses. Nicht börsengehandelte Derivate (wie z.B. Devisentermingeschäfte oder Swaps) werden mittels marktgängiger Verfahren unter Einbeziehung der relevanten Marktinformationen bewertet.

Bankguthaben und sonstige Vermögensgegenstände sind zum Nennwert bewertet. Verbindlichkeiten werden mit ihrem Rückzahlungsbetrag angesetzt.

Frankfurt am Main, den 08. Mai 2019

**First Private Investment Management KAG mbH**  
**Die Geschäftsführung**

# MANAGEMENT UND VERWALTUNG DES First Private **Systematic Events**

## 1. KAPITALVERWALTUNGSGESELLSCHAFT First Private Investment Management KAG mbH

Hausanschrift:  
Westhafenplatz 8  
D-60327 Frankfurt am Main

Postanschrift:  
Postfach 11 16 63  
D-60051 Frankfurt am Main

Telefon: +49 69 505082-0  
Telefax: +49 69 505082-440

Internet: [www.first-private.de](http://www.first-private.de)  
E-Mail: [info@first-private.de](mailto:info@first-private.de)

**Eigenmittel**  
am 31.12.2017: 4,077 Mio. EUR

**Gezeichnetes und eingezahltes Kapital**  
am 31.12.2017: 2,557 Mio. EUR

Aufsichtsrat:  
**Michael Christ**, Frankfurt am Main  
**Christian Behring**, Bad Soden-Salmünster  
**Clemens Lansing**, London, Großbritannien

Geschäftsführung:  
**Tobias Klein**, Frankfurt am Main  
**Thorsten Wegner**, Wiesbaden  
**Richard Zellmann**, Frankfurt am Main

Gesellschafter:  
**FP Management Holding GmbH**,  
Frankfurt am Main

Die Aktualisierung der Angaben zu Mitgliedern der Geschäftsleitung, des Aufsichtsrates, der Gesellschafter, des Eigenkapitals und der Verwahrstelle erfolgt in den regelmäßig zu erstellenden Halbjahres- und Jahresberichten.

## 2. VERWAHRSTELLE The Bank of New York Mellon SA/NV

Hausanschrift:  
Messturm  
Friedrich-Ebert-Anlage 49  
D-60327 Frankfurt am Main

Telefon: +49 69 12014-1000

**Regulatorisches Kapital** am 31.12.2017:  
3.120 Mio. EUR

**Gezeichnetes Kapital** am 31.12.2017:  
1.723,486 Mio. EUR

**Eingezahltes Kapital** am 31.12.2017:  
1.723,486 Mio. EUR

## 3. VERTRIEB IN DER REPUBLIK ÖSTERREICH Zahl- und Informationsstelle: UniCredit Bank Austria AG

Hausanschrift:  
Schottengasse 6-8  
A-1010 Wien  
Österreich

**Steuerlicher Vertreter:**  
PwC PricewaterhouseCoopers  
Wirtschaftsprüfung und  
Steuerberatung GmbH

Hausanschrift:  
Erdbergstraße 200  
A-1030 Wien



**FIRST PRIVATE** Investment Management KAG mbH

Westhafenplatz 8 | 60327 Frankfurt am Main  
Postfach 11 16 63 | 60051 Frankfurt am Main

Telefon: +49 69 505082-0  
Telefax: +49 69 505082-440  
E-Mail: [info@first-private.de](mailto:info@first-private.de)

[www.first-private.de](http://www.first-private.de)