

First Private
Systematic Events

Halbjahresbericht zum
31.03.2023



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 <https://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
E-Mail: 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 31.03.2023

		KURSWERT IN EUR	% DES FONDSVERMÖGENS
I. Vermögensgegenstände		5.597.068,17	103,03
1. Aktien		3.198.934,57	58,88
	- Deutschland EUR	237.811,13	4,38
	- Euro-Länder EUR	364.890,05	6,72
	- Nicht EU/EWR-Länder EUR	2.596.233,39	47,79
2. Anleihen		612.939,69	11,28
	- Schuldverschreibungen, die von öffentlichen Institutionen emittiert oder gesichert werden EUR	372.705,71	6,86
	- Unternehmensanleihen EUR	240.233,98	4,42
3. Investmentanteile		266.040,00	4,90
	- Indexfonds EUR	266.040,00	4,90
4. Derivate		113.132,86	2,08
	- Futures (Verkauf) EUR	-2.195,22	-0,04
	- Futures (Kauf) EUR	125.776,54	2,32
	- Devisentermingeschäfte (Verkauf) EUR	48.639,63	0,90
	- Devisentermingeschäfte (Kauf) EUR	188,87	0,00
	- Swaps (Verkauf) EUR	-12.582,42	-0,23
	- Swaps (Kauf) EUR	-46.694,54	-0,86
5. Bankguthaben		706.054,52	13,00
	- Bankguthaben in EUR EUR	248.799,24	4,58
	- Bankguthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen EUR	1.770,67	0,03
	- Bankguthaben in Nicht EU/EWR-Währungen EUR	455.484,61	8,38
5. Sonstige Vermögensgegenstände		699.966,53	12,88
II. Verbindlichkeiten		-164.530,28	-3,03
1. Sonstige Verbindlichkeiten		-164.530,28	-3,03
III. Fondsvermögen		5.432.537,89	100,00¹⁾

1) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.03.2023

ISIN	GATTUNGSBEZEICHNUNG	STÜCK BZW. ANTEILE BZW. WÄHRUNG IN 1.000	BESTAND 31.03.2023	KÄUFE/ ZUGÄNGE IM BERICHTS- ZEITRAUM	VERKÄUFE/ ABGÄNGE IM BERICHTS- ZEITRAUM	KURS	KURSWERT IN EUR	% DES FONDS- VERMÖ- GENS
Börsengehandelte Wertpapiere						EUR	2.717.504,47	50,02
Aktien						EUR	2.153.112,13	39,63
CA4369131079	Home Capital Group Inc.	STK	4.570	4.570	0	CAD 41,3000	128.364,68	2,36
CA69946Q1046	Parex Resources Inc.	STK	2.041	0	0	CAD 25,1400	34.896,96	0,64
CA90457D1006	Uni-Select Inc.	STK	5.065	5.065	0	CAD 46,6000	160.525,73	2,95
DE000A30U9F9	Aareal Bank AG	STK	4.000	0	0	EUR 30,2000	120.800,00	2,22
NL0010273215	ASML Holding N.V.	STK	95	0	0	EUR 625,2000	59.394,00	1,09
DE000A1X3XX4	DIC Asset AG	STK	2.027	0	0	EUR 7,9100	16.033,57	0,30
DE0005313506	Energiekontor AG	STK	486	0	0	EUR 66,4000	32.270,40	0,59
IT0003132476	Eni S.p.A.	STK	2.800	0	0	EUR 12,9060	36.136,80	0,67
LU0775917882	Grand City Properties S.A.	STK	2.237	0	0	EUR 6,5350	14.618,80	0,27
DE000LEG1110	LEG Immobilien AG	STK	379	0	0	EUR 50,4800	19.131,92	0,35
FR0000120271	TotalEnergies SE	STK	750	0	0	EUR 54,3600	40.770,00	0,75
GB0007980591	BP PLC	STK	8.000	0	0	GBP 5,1080	46.505,06	0,86
US02079K3059	Alphabet Inc.	STK	660	0	0	USD 103,7300	63.014,22	1,16
US23311P1003	DCP Midstream Partners	STK	1.363	1.363	0	USD 41,7200	52.339,60	0,96
KYG289231030	Diversey Holdings Ltd.	STK	17.449	17.449	0	USD 8,0900	129.929,96	2,39
US3205171057	First Horizon National Corp.	STK	5.324	2.437	1.797	USD 17,7800	87.128,46	1,60
IE00BQPQVQZ61	Horizon Therapeutics PLC	STK	2.130	2.130	0	USD 109,1400	213.970,45	3,94
US4627261005	iRobot Corp.	STK	2.577	2.577	0	USD 43,6400	103.511,69	1,91
US57778K1051	Maxar Technologies Inc.	STK	2.819	2.819	0	USD 51,0600	132.484,83	2,44
US5949181045	Microsoft Corp.	STK	232	0	0	USD 288,3000	61.563,44	1,13
US6516391066	Newmont Corp.	STK	608	0	0	USD 49,0200	27.432,61	0,50
US67181A1079	Oak Street Health Inc.	STK	6.405	6.405	0	USD 38,6800	228.032,03	4,20
US7504811032	Radius Global Infrastructure Inc.	STK	11.934	11.934	0	USD 14,6700	161.141,13	2,97
US87901J1051	TEGNA Inc.	STK	11.765	11.765	6.641	USD 16,9100	183.115,79	3,37
Verzinsliche Wertpapiere						EUR	529.339,19	9,74
CZ0001004469	1,000% Tschechien Bds. 26.06.26	CZK	2.670	0	0	% 88,4950	100.643,89	1,85
XS2430287875	2,778% Prosus MTN 19.01.34	EUR	100	100	0	% 74,1531	74.153,13	1,36
XS1951067039	5,150% Credit Bank of Moscow Via CBOM Finance PLC	EUR	100	0	0	% 28,8900	28.890,00	0,53
IS0000020386	6,500% Island Bds. 24.01.31	ISK	28.000	0	0	% 99,9930	188.461,32	3,47
USG7052TAF87	9,750% Petrofac Nts. 15.11.26	USD	200	200	0	% 74,5255	137.190,85	2,53
Andere Wertpapiere						EUR	35.053,15	0,65
US7960508882	Samsung Electronics Co. Ltd. GDRs 144A/ 95	STK	31	0	0	USD 1.228,5000	35.053,15	0,65
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere						EUR	1.094.369,79	20,14
Aktien						EUR	1.010.769,29	18,61
DE000A1EWA4	clearvise AG	STK	21.186	0	0	EUR 2,3400	49.575,24	0,91

ISIN	GATTUNGSBEZEICHNUNG	STÜCK BZW. ANTEILE BZW. WÄHRUNG IN 1.000	BESTAND 31.03.2023	KÄUFE/ ZUGÄNGE IM BERICHTS-ZEITRAUM	VERKÄUFE/ ABGÄNGE IM BERICHTS-ZEITRAUM	KURS	KURSWERT IN EUR	% DES FONDS-VERMÖGENS
US1266771039	CVENT Holding Corp.	STK	13.831	13.831	0	USD 8,3600	106.426,58	1,96
US34417P1003	Focus Financial Partners Inc.	STK	3.360	3.360	0	USD 51,8700	160.415,30	2,95
US60878Y1082	Momentive Global Inc.	STK	15.624	15.624	0	USD 9,3200	134.028,88	2,47
US60935Y2081	MoneyGram International Inc	STK	11.756	0	1.343	USD 10,4200	112.750,26	2,08
US74374N1028	Provention Bio Inc.	STK	3.690	3.690	0	USD 24,1000	81.852,82	1,51
US7476012015	Qualtrics International Inc.	STK	8.179	8.179	0	USD 17,8300	134.227,59	2,47
US86646P1030	Sumo Logic Inc.	STK	14.842	14.842	0	USD 11,9800	163.658,85	3,01
US89421B1098	TravelCenters of America Inc.	STK	852	1.739	887	USD 86,5000	67.833,77	1,25
Verzinsliche Wertpapiere						EUR	83.600,50	1,54
XS1568888777	4,875% Petróleos Mexicanos (PEMEX) MTN 21.02.28	EUR	100	0	0	% 83,6005	83.600,50	1,54
Investmentanteile						EUR	266.040,00	4,90
Gruppenfremde Investmentanteile						EUR	266.040,00	4,90
IE00B7MXFZ59	SPDR Bloomberg Barclays EM Infl. Linked.Loc.Bd ETF	ANT	6.000	6.000	0	EUR 44,3400	266.040,00	4,90
Summe Wertpapiervermögen²⁾						EUR	4.077.914,26	75,06

2) Die Wertpapiere und Schuldscheindarlehen des Sondervermögens sind teilweise durch Geschäfte mit Finanzinstrumenten abgesichert.

GATTUNGSBEZEICHNUNG	MARKT	STÜCK BZW. ANTEILE BZW. WÄHRUNG IN 1.000	BESTAND 31.03.2023	KÄUFE/ ZUGÄNGE IM BERICHTS-ZEITRAUM	VERKÄUFE/ ABGÄNGE IM BERICHTS-ZEITRAUM	KURS	KURSWERT IN EUR	% DES FONDS-VERMÖGENS
Derivate						EUR	113.132,86	2,08
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)								
Aktienindex-Derivate						EUR	134.394,75	2,47
Forderungen/Verbindlichkeiten						EUR	134.394,75	2,47
Aktienindex-Terminkontrakte						EUR	134.394,75	2,47
EURO STOXX 50 Dividenden Index Future 12/ 23	EDT	EUR	Anzahl 2.500				31.500,00	0,58
E-Mini S&P 500 Index Future 06/ 23	NAR	USD	Anzahl 200				23.516,96	0,43
MSCI Emerging Markets Index Future 06/ 23	NAJ	USD	Anzahl -50				-2.770,49	-0,05
S&P 500 Annual Dividend Index Future 12/ 23	NAR	USD	Anzahl 11.250				82.148,28	1,51

GATTUNGSBEZEICHNUNG	MARKT	STÜCK BZW. AN- TEILE BZW. WÄHRUNG IN 1.000	BESTAND 31.03.2023	KÄUFE/ ZUGÄNGE IM BE- RICHTS- ZEITRAUM	VERKÄUFE/ ABGÄNGE IM BERICHTS- ZEITRAUM	KURS	KURSWERT IN EUR	% DES FONDS- VERMÖ- GENS
Zins-Derivate						EUR	-10.813,43	-0,20
Forderungen/Verbindlichkeiten						EUR	-10.813,43	-0,20
Zinsterminkontrakte						EUR	-10.813,43	-0,20
6,000% 10-Year Gov. of Canada Bond Future 06/ 23	NCM	CAD	300.000				-136,02	0,00
6,000% Euro Bobl Future 06/ 23	EDT	EUR	200.000				-1.430,00	-0,03
6,000% Euro Bund Future 06/ 23	EDT	EUR	100.000				-930,00	-0,02
6,000% Euro-BTP Future 06/ 23	EDT	EUR	200.000				-1.040,00	-0,02
6,000% Long Term Euro OAT Future 06/ 23	EDT	EUR	100.000				-720,00	-0,01
6,000% Long Gilt Future 06/ 23	EUT	GBP	100.000				-1.502,22	-0,03
2-Years US Treasury Notes Future 06/ 23	NAU	USD	2.400.000				-6.780,99	-0,12
5 Year U.S. Treasury Notes Future 06/ 23	NAU	USD	400.000				-402,69	-0,01
Ultra 10-Years US Treasury Notes Future 06/ 23	NAU	USD	-800.000				575,27	0,01
US Treasury Long Bond Future 06/ 23	NAU	USD	200.000				1.553,22	0,03
Devisen-Derivate						EUR	48.828,50	0,90
Forderungen/Verbindlichkeiten						EUR	48.828,50	0,90
Devisenterminkontrakte (Verkauf)						EUR	48.639,63	0,90
Offene Positionen						EUR	48.639,63	0,90
CAD/ EUR 0,4 Mio.	OTC						125,27	0,00
JPY/ EUR 11,5 Mio.	OTC						1.403,33	0,03
USD/ EUR 3,0 Mio.	OTC						47.111,03	0,87
Devisenterminkontrakte (Kauf)						EUR	188,87	0,00
Offene Positionen						EUR	188,87	0,00
JPY/ EUR 11,5 Mio.	OTC						188,87	0,00
Swaps						EUR	-59.276,96	-1,09
Forderungen/Verbindlichkeiten						EUR	-59.276,96	-1,09
Total Return Swaps						EUR	-59.276,96	-1,09
(Erhalten / Zahlen)						EUR	-59.276,96	-1,09
MS,FFM3 PEPS Index EUR Long vs. 0% 04.07.23	OTC	EUR	2.006.692				10.713,00	0,20
MS,FFM3 PEPS Index EUR Long vs. 0% 04.07.23	OTC	EUR	4.234.567				-11.238,40	-0,21
MS,FFM3 PEPS Index EUR Short vs. 0% 04.07.23	OTC	EUR	-4.086.481				-11.714,40	-0,22
MS,FFM3 PEPS Index EUR Short vs. 0% 04.07.23	OTC	EUR	-1.917.800				-868,02	-0,02
UBS,LDN Strategy Index Long vs. 0% 05.05.23	OTC	EUR	1.298.519				-69.917,88	-1,29
UBS,LDN Strategy Index Long vs. 0% 05.05.23	OTC	EUR	1.224.664				-61.456,17	-1,13
UBS,LDN Strategy Index Short vs. 0% 05.05.23	OTC	EUR	1.148.765				61.856,44	1,14
UBS,LDN Strategy Index Short vs. 0% 05.05.23	OTC	EUR	1.150.724				47.700,63	0,88

GATTUNGSBEZEICHNUNG	MARKT	STÜCK BZW. AN- TEILE BZW. WÄHRUNG IN 1.000	BESTAND 31.03.2023	KÄUFE/ ZUGÄNGE IM BE- RICHTS- ZEITRAUM	VERKÄUFE/ ABGÄNGE IM BERICHTS- ZEITRAUM	KURS	KURSWERT IN EUR	% DES FONDS- VERMÖ- GENS
UBS,LDN Strategy Index Long vs. 0% 05.05.23	OTC	USD	5.113.025				-22.492,84	-0,41
UBS,LDN Strategy Index Short vs. 0% 05.05.23	OTC	USD	4.810.976				11.799,00	0,22
UBS,LDN US Portfolio Long vs. 0% 05.05.23	OTC	USD	2.636.484				-67.878,45	-1,25
UBS,LDN US Portfolio Short vs. 0% 05.05.23	OTC	USD	2.400.307				54.220,13	1,00
Bankguthaben						EUR	706.054,52	13,00
EUR - Guthaben bei:						EUR	248.799,24	4,58
The Bank of New York Mellon SA/ NV (Verwahrstelle)		EUR	248.799,24			% 100,0000	248.799,24	4,58
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen						EUR	1.770,67	0,03
		CZK	41.136,69			% 100,0000	1.752,21	0,03
		SEK	207,96			% 100,0000	18,46	0,00
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen						EUR	455.484,61	8,38
		AUD	2.423,89			% 100,0000	1.494,20	0,03
		CAD	10.895,12			% 100,0000	7.409,89	0,14
		GBP	12.305,75			% 100,0000	14.004,50	0,26
		HKD	429,39			% 100,0000	50,35	0,00
		JPY	11.981,00			% 100,0000	82,86	0,00
		USD	469.827,49			% 100,0000	432.442,81	7,96
Sonstige Vermögensgegenstände						EUR	699.966,53	12,88
Zinsansprüche						EUR	12.286,58	0,23
	EUR	12.286,58					12.286,58	0,23
Dividendenansprüche						EUR	3.511,80	0,06
	EUR	3.511,80					3.511,80	0,06
Einschüsse (Initial Margins)						EUR	144.168,15	2,65
	EUR	144.168,15					144.168,15	2,65
Forderungen aus Collateral						EUR	540.000,00	9,94
	EUR	540.000,00					540.000,00	9,94
Sonstige Verbindlichkeiten						EUR	-164.530,28	-3,03
Kostenabgrenzung						EUR	-40.948,94	-0,75
	EUR	-40.948,94					-40.948,94	-0,75
Variation Margin						EUR	-123.581,34	-2,27
	EUR	-123.581,34					-123.581,34	-2,27
Fondsvermögen						EUR	5.432.537,89	100,00³⁾
Anteilwert First Private Systematic Events A						EUR	108,65	
Umlaufende Anteile First Private Systematic Events A						STK	50.000,00	

3) Durch Rundung der Prozent-Anteile bei der Berechnung können geringfügige Rundungsdifferenzen entstanden sein.

WERTPAPIERKURSE BZW. MARKTSÄTZE

DEWEISENKURSE (IN MENGENNOTIZ)	PER	31.03.2023	=	1 Euro (EUR)
Australische Dollar	(AUD)	1,622200	=	1 Euro (EUR)
Britische Pfund	(GBP)	0,878700	=	1 Euro (EUR)
Hongkong Dollar	(HKD)	8,528550	=	1 Euro (EUR)
Isländische Kronen	(ISK)	148,561200	=	1 Euro (EUR)
Japanische Yen	(JPY)	144,595600	=	1 Euro (EUR)
Kanadischer Dollar	(CAD)	1,470350	=	1 Euro (EUR)
Schwedische Kronen	(SEK)	11,266000	=	1 Euro (EUR)
Tschechische Kronen	(CZK)	23,477000	=	1 Euro (EUR)
US-Dollar	(USD)	1,086450	=	1 Euro (EUR)

MARKTSCHLÜSSEL	
a) Terminbörse	
EDT	EUREX
EUT	ICE Futures Europe
NAJ	New York ICE
NAR	Chicago Mercantile Exchange
NAU	Chicago (CBOT)
NCM	Montreal
b) 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
Börsengehandelte Wertpapiere				
Aktien				
US0171751003	Alleghany Corp.	STK	0	247
US02208R1068	Altra Holdings Inc.	STK	2.881	2.881
US03940F1030	Archaea Energy Inc.	STK	3.054	3.054
IT0003506190	Atlantia S.p.A.	STK	0	6.000
VGG1110E1079	Biohaven Ltd	STK	382	382
VGG111961055	Biohaven Pharmaceutical Holding Co. Ltd.	STK	763	1.526
US11778X1046	BTRS Holdings Inc	STK	20.972	20.972
US15912K1007	Change Healthcare Inc.	STK	0	7.580
US1773761002	Citrix Systems Inc.	STK	0	1.342
US2641201064	Duck Creek Technologies Inc.	STK	10.894	10.894
US3379307057	Flagstar Bancorp Inc.	STK	0	4.763
US34631B1017	ForgeRock Inc.	STK	9.129	9.129
US41043F2083	Hanger Orthopedic Group Inc.	STK	0	4.496
NL0010937058	Intertrust N.V.	STK	0	3.952
IS0000020469	Kvika banki HF.	STK	0	727.388
US5763231090	Mastec Inc.	STK	182	182
US30303M1027	Meta Platforms Inc.	STK	0	202
US6494451031	New York Community Bancorp Inc.	STK	19.124	19.124
GB00BWFY5505	Nielsen Holdings PLC	STK	0	3.351
JP3677600003	Nissin Electric Co. Ltd.	STK	6.772	6.772
US72341T1034	Ping Identity Holding Corp.	STK	966	5.735
US69349H1077	PNM Resources Inc.	STK	0	3.627
US7751331015	Rogers Corp.	STK	0	417
ES0143416115	Siemens Gamesa Renewable Energy S.A.	STK	4.550	4.550
US82671G1004	Signify Health Inc.	STK	1.472	4.099
DE000WAF3001	Siltronic AG	STK	0	1.078
US8385181081	South Jersey Industries Inc.	STK	0	3.897
US8621211007	Store Capital Corporation	STK	6.607	6.607
CA8661201167	Summit Industrial Income REIT	STK	10.048	10.048
US87105L1044	Switch Inc.	STK	0	3.170
US8803491054	Tenneco Inc.	STK	0	2.833
US88262P1021	Texas Pacific Land Corp.	STK	0	31
US91734E1010	UserTesting Inc.	STK	18.582	18.582
US9285421098	Vivint Smart Home Inc.	STK	14.112	14.112
DE000A1ML7J1	Vonovia SE	STK	0	1.327
US98936J1016	Zendesk Inc.	STK	892	2.373

ISIN	GATTUNGSBEZEICHNUNG	STÜCK BZW. ANTEILE BZW. WÄHRUNG IN 1.000	KÄUFE/ ZUGÄNGE IM BERICHTS- ZEITRAUM	VERKÄUFE/ ABGÄNGE IM BERICHTS- ZEITRAUM
Verzinsliche Wertpapiere				
XS2076099865	4,625% Netflix Nts. 15.05.29	EUR	0	100
XS1266661013	5,250% SoftBank Group Nts. 30.07.27	EUR	0	100
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				
Aktien				
US68269G1076	1Life Healthcare Inc.	STK	0	3.147
US22266L1061	Coupa Software Inc.	STK	2.936	2.936
US26927E1047	Evo Payments Inc.	STK	6.826	6.826
US45250K1079	Imago BioSciences Inc.	STK	1.544	1.544
US45686J1043	Infrastructure & Energy Alternatives Inc.	STK	0	3.770
US49926T1043	KnowBe4 Inc.	STK	6.728	6.728
US50187A1079	LHC Group Inc.	STK	840	1.766
US5895841014	Meridian Bioscience Inc.	STK	0	2.428
US70434P1030	Paya Holdings Inc.	STK	23.778	23.778
US73739W1045	Poshmark Inc.	STK	11.061	11.061
US9282541013	Virtu Financial Inc. CL A	STK	0	2.130
Andere Wertpapiere				
DE000A32VPB0	clearvise AG BZR	STK	21.186	21.186
Nichtnotierte Wertpapiere				
Aktien				
US22304C1009	Covetrus Inc.	STK	0	4.099
US90184L1026	Twitter Inc.	STK	0	848

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
Terminkontrakte				
Aktienindex-Terminkontrakte				
Gekaufte Kontrakte:				
(Basiswerte:	EUR	.		3.577
E-Mini S&P 500 Index Future)				
Verkaufte Kontrakte:				
(Basiswerte:	EUR			1.084
FTSE SGX China A50 Index Future MSCI Emerging Markets Index Future)		.		
Zinsterminkontrakte				
Gekaufte Kontrakte:				
(Basiswerte:	EUR			31.680
10-Year Gov. of Canada Bond Future 2-Years US Treasury Notes Future 5 Year U.S. Treasury Notes Future Euro Bobl Future Euro Bund Future Euro-BTP Future Long Gilt Future Long Term Euro OAT Future Ultra 10-Years US Treasury Notes Future US Treasury Long Bond Future)				
Verkaufte Kontrakte:				
(Basiswerte:	EUR			30.417
2-Years US Treasury Notes Future 5 Year U.S. Treasury Notes Future Euro Bobl Future Ultra 10-Years US Treasury Notes Future US Treasury Long Bond Future)				
Devisenterminkontrakte (Verkauf)				
Verkauf von Devisen auf Termin:				
CAD/EUR	EUR			676
JPY/EUR	EUR			79
USD/EUR	EUR			3.630
Devisenterminkontrakte (Kauf)				
Kauf von Devisen auf Termin:				
CAD/EUR	EUR			162
USD/EUR	EUR			1.058

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)
Verwendete Vermögensgegenstände	
Absolut	-59.276,96
In % des Fondsvermögens	-1,09
Zehn größte Gegenparteien	
1. Name	UBS AG [London Branch]
1. Bruttovolumen offene Geschäfte	18.593.018,00
1. Sitzstaat	Schweiz
2. Name	Morgan Stanley Europe SE
2. Bruttovolumen offene Geschäfte	12.245.540,00
2. Sitzstaat	USA
Art(en) von Abwicklung und Clearing (z.B. zweiseitig, dreiseitig, CCP)	
	zweiseitig
Geschäfte gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)	
unter 1 Tag	
1 Tag bis 1 Woche (= 7 Tage)	
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)	
1 bis 3 Monate	18.593.018,00
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)	12.245.540,00
über 1 Jahr	
unbefristet	
Art(en) und Qualität(en) der erhaltenen Sicherheiten	
	n/a
Währung(en) der erhaltenen Sicherheiten	
	EUR, USD
Sicherheiten gegliedert nach Restlaufzeiten (absolute Beträge)	
unter 1 Tag	0,00
1 Tag bis 1 Woche (= 7 Tage)	0,00
1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage)	0,00
1 bis 3 Monate	0,00
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)	0,00
über 1 Jahr	0,00
unbefristet	0,00
Ertrags- und Kostenanteile	
Ertragsanteil des Fonds	
absolut	1.556.412,22
in % der Bruttoerträge	0,00
Kostenanteil des Fonds	-1.473.187,61

Ertragsanteil des KVG		
absolut		0,00
in % der Bruttoerträge		0,00
Kostenanteil der KVG		0,00
Ertragsanteil Dritter (z.B. Leiheagent)		
absolut		0,00
in % der Bruttoerträge		0,00
Kostenanteil Dritter		0,00
Erträge für den Fonds aus Wiederanlage von Barsicherheiten, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps (absoluter Betrag)		
		n/a
Verliehene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensggt. des Fonds		
		0,00
Zehn größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps		
1. Name		Morgan Stanley Europe SE
1. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut)		540.000,00
Wiederangelegte Sicherheiten in % der empfangenen Sicherheiten, bezogen auf alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps		
		0,00
Verwahrer bzw. Kontoführer von empfangenen Sicherheiten aus WpFinGesch. und Total Return Swaps		
Gesamtzahl Verwahrer/Kontoführer		1
1. Name		The Bank of New York Mellon Corp
1. Verwahrter Betrag absolut		540.000,00
Verwahrart begebener Sicherheiten aus WpFinGesch. und Total Return Swaps in % aller begebenen Sicherheiten aus WpFinGesch. und Total Return Swaps		
gesonderte Konten / Depots		100,00
Sammelkonten / Depots		0,00
andere Konten / Depots		0,00
Verwahrart bestimmt Empfänger		0,00

Sonstige Angaben

Anteilwert First Private Systematic Events A	EUR	108,65	
Umlaufende Anteile First Private Systematic Events A	STK	50.000,00	

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 zum Stichtag enthaltenen Wertpapiere kamen, bezogen auf den Nettoinventarwert, nachfolgend dargestellte Bewertungsverfahren zum Ansatz:

74,53% Bewertung auf Basis handelbarer Kurse

0,53% 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, April 2023

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
E-Mail: info@first-private.de

Gezeichnetes und eingezahltes Kapital
am 31.12.2021: 2,557 Mio. EUR

Eigenmittel
am 31.12.2021: 4,093 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:
Messeturm
Friedrich-Ebert-Anlage 49
D-60327 Frankfurt am Main

Telefon: +49 69 12014-1000

Regulatorisches Kapital am 31.12.2021:
3.287 Mio. EUR

Gezeichnetes Kapital am 31.12.2021:
1.754,386 Mio.

Eingezahltes Kapital am 31.12.2021:
1.754,386 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:
Donau-City-Straße 7
A-1220 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

www.first-private.de