

First Private
Systematic Events

Halbjahresbericht zum
31.03.2022



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
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 31.03.2022

		KURSWERT IN EUR	% DES FONDSVERMÖGENS
I. Vermögensgegenstände		5.486.261,24	101,27
1. Aktien		3.416.597,92	63,07
	- Deutschland EUR	433.727,99	8,01
	- Euro-Länder EUR	682.191,54	12,59
	- Sonstige EU/EWR-Länder EUR	119.858,97	2,21
	- Nicht EU/EWR-Länder EUR	2.180.819,42	40,26
2. Anleihen		631.199,59	11,65
	- Schuldverschreibungen, die von öffentlichen Institutionen emittiert oder gesichert werden EUR	407.197,09	7,52
	- Unternehmensanleihen EUR	224.002,50	4,13
3. Derivate		37.750,74	0,70
	- Futures (Verkauf) EUR	-39.674,43	-0,73
	- Futures (Kauf) EUR	48.025,05	0,89
	- Devisentermingeschäfte (Verkauf) EUR	18.590,50	0,34
	- Swaps (Verkauf) EUR	13.878,32	0,26
	- Swaps (Kauf) EUR	-3.068,70	-0,06
4. Bankguthaben		568.477,25	10,49
	- Bankguthaben in EUR EUR	409.943,36	7,57
	- Bankguthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen EUR	47.223,64	0,87
	- Bankguthaben in Nicht EU/EWR-Währungen EUR	111.310,25	2,05
5. Sonstige Vermögensgegenstände		832.235,74	15,36
II. Verbindlichkeiten		-68.820,89	-1,27
1. Sonstige Verbindlichkeiten		-68.820,89	-1,27
III. Fondsvermögen		5.417.440,35	100,00¹⁾

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

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 31.03.2022

ISIN	GATTUNGSBEZEICHNUNG	STÜCK BZW. ANTEILE BZW. WÄHRUNG IN 1.000	BESTAND 31.03.2022	KÄUFE/ ZUGÄNGE IM BERICHTS- ZEITRAUM	VERKÄUFE/ ABGÄNGE IM BERICHTS- ZEITRAUM	KURS	KURSWERT IN EUR	% DES FONDS- VERMÖ- GENS
Börsengehandelte Wertpapiere						EUR	3.327.225,46	61,42
Aktien						EUR	2.751.796,03	50,80
AU000000LNK2	Link Administration Holdings Ltd.	STK	29.516	29.516	0	AUD 5,1700	102.988,27	1,90
CA3518581051	Franco-Nevada Corp.	STK	273	0	0	CAD 198,9400	39.079,42	0,72
CA4609191032	Intertape Polymer Group Inc.	STK	2.400	2.400	0	CAD 39,6800	68.524,55	1,26
CA69946Q1046	Parex Resources Inc.	STK	2.041	2.041	0	CAD 25,6500	37.669,83	0,70
DE0005408116	Aareal Bank AG	STK	4.000	17.326	13.326	EUR 28,5000	114.000,00	2,10
NL0009767532	Accell Group N.V.	STK	3.819	3.819	0	EUR 57,4000	219.210,60	4,05
FR0004180537	Akka Technologies	STK	1.033	0	0	EUR 48,9800	50.596,34	0,93
NL0010273215	ASML Holding N.V.	STK	95	0	0	EUR 610,0000	57.950,00	1,07
DE000A1X3XX4	DIC Asset AG	STK	2.027	0	0	EUR 14,4900	29.371,23	0,54
DE0005313506	Energiekontor AG	STK	486	0	0	EUR 87,3000	42.427,80	0,78
IT0003132476	Eni S.p.A.	STK	2.800	4.165	1.365	EUR 13,2940	37.223,20	0,69
LU0775917882	Grand City Properties S.A.	STK	2.237	0	0	EUR 18,1200	40.534,44	0,75
NL0010937058	Intertrust N.V.	STK	1.994	1.994	0	EUR 19,6400	39.162,16	0,72
DE000LEG1110	LEG Immobilien AG	STK	379	0	0	EUR 103,2500	39.131,75	0,72
DE000WAF3001	Siltronic AG	STK	1.078	1.078	0	EUR 93,2600	100.534,28	1,86
FR0000120271	TotalEnergies SE	STK	750	1.133	383	EUR 46,0300	34.522,50	0,64
DE000A1ML7J1	Vonovia SE	STK	1.327	344	0	EUR 42,3100	56.145,37	1,04
GB0007980591	BP PLC	STK	8.000	11.761	3.761	GBP 3,7535	35.533,99	0,66
IS0000020469	Kvika banki HF.	STK	727.388	0	0	ISK 23,4000	119.858,97	2,21
US02079K3059	Alphabet Inc.	STK	33	0	0	USD 2.781,3500	82.491,84	1,52
JE00BMVMZ478	Atotech Ltd.	STK	7.369	7.369	0	USD 21,9500	145.373,25	2,68
US1567821046	Cerner Corp.	STK	1.526	1.526	0	USD 93,5600	128.317,58	2,37
US15912K1007	Change Healthcare Inc.	STK	7.580	0	0	USD 21,8000	148.513,91	2,74
US1773761002	Citrix Systems Inc.	STK	1.342	1.342	0	USD 100,9000	121.698,47	2,25
US12571T1007	CMC Materials Inc.	STK	590	590	0	USD 185,4000	98.311,24	1,81
US21925D1090	Cornerstone Building Brands Inc.	STK	9.081	9.081	0	USD 24,3200	198.490,02	3,66
US3154051003	Ferro Corp.	STK	4.248	4.248	0	USD 21,7400	83.001,41	1,53
US30303M1027	Meta Platforms Inc.	STK	202	0	0	USD 222,3600	40.369,14	0,75
US5949181045	Microsoft Corp.	STK	232	0	0	USD 308,3100	64.286,09	1,19
US64051T1007	NeoPhotonics Corp.	STK	5.548	5.548	0	USD 15,2100	75.841,53	1,40
US6516391066	Newmont Corp.	STK	608	0	0	USD 79,4500	43.414,91	0,80
US69349H1077	PNM Resources Inc.	STK	3.627	0	0	USD 47,6700	155.393,96	2,87
US7751331015	Rogers Corp.	STK	417	417	0	USD 271,7000	101.827,98	1,88
Verzinsliche Wertpapiere						EUR	535.894,09	9,89
CZ0001004469	1,000% Tschechien Bds. 26.06.26	CZK	2.670	0	0	% 87,2100	95.330,99	1,76
XS2076099865	4,625% Netflix Nts. 15.05.29	EUR	100	0	0	% 113,0725	113.072,50	2,09
XS1951067039	5,150% Credit Bank of Moscow Via CBOM Finance PLC	EUR	100	0	0	% 13,5000	13.500,00	0,25

ISIN	GATTUNGSBEZEICHNUNG	STÜCK BZW. ANTEILE BZW. WÄHRUNG IN 1.000	BESTAND 31.03.2022	KÄUFE/ ZUGÄNGE IM BERICHTS-ZEITRAUM	VERKÄUFE/ ABGÄNGE IM BERICHTS-ZEITRAUM	KURS	KURSWERT IN EUR	% DES FONDS-VERMÖGENS
XS1266661013	5,250% SoftBank Group Nts. 30.07.27	EUR	100	0	0	% 97,4300	97430,00	1,80
IS0000020386	6,500% Island Bds. 24.01.31	ISK	28.000	0	0	% 109,8330	216.560,60	4,00
Andere Wertpapiere						EUR	39.535,34	0,73
US7960508882	Samsung Electronics Co. Ltd. GDRs 144A/ 95	STK	31	0	0	USD 1.419,0000	39.535,34	0,73
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere						EUR	720.572,05	13,30
Aktien						EUR	625.266,55	11,54
DE000A1EWXA4	clearwise AG	STK	21.186	21.186	0	EUR 2.4600	52.117,56	0,96
IT0003198790	Falck Renewables S.p.A.	STK	23.015	23.015	0	EUR 8,8200	202.992,30	3,75
US75972A3014	Renewable Energy Group	STK	3.638	3.638	0	USD 60,6500	198.305,58	3,66
US8000131040	Sanderson Farms Inc.	STK	597	597	0	USD 187,4900	100.599,05	1,86
US9282541013	Virtu Financial Inc. Cl. A	STK	2.130	0	0	USD 37,2200	71.252,06	1,32
Verzinsliche Wertpapiere						EUR	95.305,50	1,76
XS1568888777	4,875% Petróleos Mexicanos (PEMEX) MTN 21.02.28	EUR	100	0	0	% 95,3055	95.305,50	1,76
Summe Wertpapiervermögen²⁾						EUR	4.047.797,51	74,72

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

GATTUNGSBEZEICHNUNG	MARKT	STÜCK BZW. ANTEILE BZW. WÄHRUNG IN 1.000	BESTAND 31.03.2022	KÄUFE/ ZUGÄNGE IM BERICHTS-ZEITRAUM	VERKÄUFE/ ABGÄNGE IM BERICHTS-ZEITRAUM	KURS	KURSWERT IN EUR	% DES FONDS-VERMÖGENS
Derivate						EUR	37.750,74	0,70
(Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen)								
Aktienindex-Derivate						EUR	5.545,41	0,10
Forderungen/Verbindlichkeiten						EUR	5.545,41	0,10
Aktienindex-Terminkontrakte						EUR	5.545,41	0,10
EURO STOXX 30 Dividenden Index Future 12/ 22	EDT	EUR	Anzahl 10.000				-83.000,00	-1,53
FTSE 100 Dividend Index Future RDSA 12/ 22	EUT	GBP	Anzahl 500				55.381,34	1,02
E-Mini S&P 500 Index Future 06/ 22	NAR	USD	Anzahl 200				1.190,85	0,02
MSCI Emerging Markets Index Future 06/ 22	NAJ	USD	Anzahl -200				-8.807,80	-0,16
S&P 500 Annual Dividend Index Future 12/ 23	NAR	USD	Anzahl 11.250				40.781,02	0,75

GATTUNGSBEZEICHNUNG	MARKT	STÜCK BZW. AN- TEILE BZW. WÄHRUNG IN 1.000	BESTAND 31.03.2022	KÄUFE/ ZUGÄNGE IM BE- RICHTS- ZEITRAUM	VERKÄUFE/ ABGÄNGE IM BERICHTS- ZEITRAUM	KURS	KURSWERT IN EUR	% DES FONDS- VERMÖ- GENS
Zins-Derivate						EUR	2.805,21	0,05
Forderungen/Verbindlichkeiten						EUR	2.805,21	0,05
Zinsterminkontrakte						EUR	2.805,21	0,05
6,000% 10-Year Gov. of Canada Bond Future 06/ 22	NCM	CAD	200.000				2.144,27	0,04
6,000% Euro Bobl Future 06/ 22	EDT	EUR	200.000				-660,00	-0,01
6,000% Euro Bund Future 06/ 22	EDT	EUR	100.000				150,00	0,00
6,000% Euro-BTP Future 06/ 22	EDT	EUR	100.000				310,00	0,01
6,000% Long Term Euro OAT Future 06/ 22	EDT	EUR	100.000				240,00	0,00
6,000% Long Gilt Future 06/ 22	EUT	GBP	100.000				698,18	0,01
2-Years US Treasury Notes Future 06/ 22	NAU	USD	6.600.000				9.057,77	0,17
5 Year U.S. Treasury Notes Future 06/ 22	NAU	USD	3.300.000				17.406,36	0,32
Ultra 10-Years US Treasury Notes Future 06/ 22	NAU	USD	100.000				1.741,34	0,03
Ultra 10-Years US Treasury Notes Future 06/ 22	NAU	USD	-1.000.000				-13.846,45	-0,26
US Treasury Long Bond Future 06/ 22	NAU	USD	100.000				2.583,92	0,05
US Treasury Long Bond Future 06/ 22	NAU	USD	-900.000				-17.020,18	-0,31
Devisen-Derivate						EUR	18.590,50	0,34
Forderungen/Verbindlichkeiten						EUR	18.590,50	0,34
Devisenterminkontrakte (Verkauf)						EUR	18.590,50	0,34
Offene Positionen						EUR	18.590,50	0,34
AUD/ EUR 0,2 Mio.	OTC						-2.170,33	-0,04
CAD/ EUR 0,1 Mio.	OTC						402,34	0,01
USD/ EUR 1,7 Mio.	OTC						20.358,49	0,38
Swaps						EUR	10.809,62	0,20
Forderungen/Verbindlichkeiten						EUR	10.809,62	0,20
Total Return Swaps						EUR	10.809,62	0,20
(Erhalten / Zahlen)						EUR	10.809,62	0,20
MS,FFM3 PEPS Index EUR Long vs. 0% 05.07.22	OTC	EUR	2.022.354				-6.477,00	-0,12
MS,FFM3 PEPS Index EUR Long vs. 0% 05.07.22	OTC	EUR	4.181.186				23.939,20	0,44
MS,FFM3 PEPS Index EUR Short vs. 0% 05.07.22	OTC	EUR	-4.159.998				18.127,20	0,33
MS,FFM3 PEPS Index EUR Short vs. 0% 05.07.22	OTC	EUR	-1.972.390				-4.248,88	-0,08
UBS,LDN Strategy Index Long vs. 0% 06.05.22	OTC	EUR	1.487.355				-7.373,36	-0,14
UBS,LDN Strategy Index Long vs. 0% 06.05.22	OTC	EUR	1.383.432				10.907,90	0,20
UBS,LDN Strategy Index Short vs. 0% 06.05.22	OTC	EUR	1.674.653				-23.342,28	-0,43
UBS,LDN Strategy Index Short vs. 0% 06.05.22	OTC	EUR	1.554.639				-12.287,84	-0,23
UBS,LDN US Postfolio Long vs. 0% 06.05.2022	OTC	USD	10.166.020				-8.342,67	-0,15

GATTUNGSBEZEICHNUNG	MARKT	STÜCK BZW. AN- TEILE BZW. WÄHRUNG IN 1.000	BESTAND 31.03.2022	KÄUFE/ ZUGÄNGE IM BE- RICHTS- ZEITRAUM	VERKÄUFE/ ABGÄNGE IM BERICHTS- ZEITRAUM	KURS	KURSWERT IN EUR	% DES FONDS- VERMÖ- GENS
UBS,LDN US Portfolio Short vs. 0% 06.05.2022	OTC	USD	10.097.600				19.907,35	0,37
Bankguthaben						EUR	569.899,50	10,52
EUR - Guthaben bei:						EUR	409.943,36	7,57
The Bank of New York Mellon SA/ NV (Verwahrstelle)		EUR	409.943,36			% 100,0000	409.943,36	7,57
Guthaben in sonstigen EU/EWR-Währungen						EUR	47.223,64	0,87
		CZK	23.781,69			% 100,0000	973,64	0,02
		ISK	6.565.000,00			% 100,0000	46.229,94	0,85
		SEK	207,96			% 100,0000	20,06	0,00
Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen						EUR	112.732,50	2,08
		AUD	848,81			% 100,0000	572,86	0,01
		GBP	16.059,53			% 100,0000	19.004,23	0,35
		HKD	429,39			% 100,0000	49,28	0,00
		JPY	17.852,00			% 100,0000	132,19	0,00
		USD	103.447,45			% 100,0000	92.973,94	1,72
Sonstige Vermögensgegenstände						EUR	832.235,74	15,36
Zinsansprüche						EUR	6.758,25	0,12
	EUR	6.758,25					6.758,25	0,12
Dividendenansprüche						EUR	3.011,32	0,06
	EUR	3.011,32					3.011,32	0,06
Einschüsse (Initial Margins)						EUR	282.466,17	5,21
	EUR	282.466,17					282.466,17	5,21
Forderungen aus Collateral						EUR	540.000,00	9,97
	EUR	540.000,00					540.000,00	9,97
Kurzfristige Verbindlichkeiten						EUR	-1.422,25	-0,03
Banksaldo in nicht EU/EWR-Währungen						EUR	-1.422,25	-0,03
		CAD	-1.976,56			% 100,0000	-1.422,25	-0,03
Sonstige Verbindlichkeiten						EUR	-68.820,89	-1,27
Kostenabgrenzung						EUR	-60.470,21	-1,12
	EUR	-60.470,21					-60.470,21	-1,12
Variation Margin						EUR	-8.350,68	-0,15
	EUR	-8.350,68					-8.350,68	-0,15
Fondsvermögen						EUR	5.417.440,35	100,00³⁾
Anteilwert First Private Systematic Events A						EUR	106,64	
Umlaufende Anteile First Private Systematic Events A						STK	50.800,00	

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

WERTPAPIERKURSE BZW. MARKTSÄTZE

DEWEISENKURSE (IN MENGENNOTIZ)	PER	31.03.2022	=	1 Euro (EUR)
Australische Dollar	(AUD)	1,481700	=	1 Euro (EUR)
Britische Pfund	(GBP)	0,845050	=	1 Euro (EUR)
Hongkong Dollar	(HKD)	8,713600	=	1 Euro (EUR)
Isländische Kronen	(ISK)	142,007550	=	1 Euro (EUR)
Japanische Yen	(JPY)	135,047900	=	1 Euro (EUR)
Kanadischer Dollar	(CAD)	1,389750	=	1 Euro (EUR)
Schwedische Kronen	(SEK)	10,369250	=	1 Euro (EUR)
Tschechische Kronen	(CZK)	24,425500	=	1 Euro (EUR)
US-Dollar	(USD)	1,12650	=	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				
US0079031078	Advanced Micro Devices Inc.	STK	1.199	1.199
US03769M1062	Apollo Global Management Inc. [New]	STK	2.241	2.241
US0400476075	Arena Pharmaceuticals Inc.	STK	910	910
CA04016A1012	Argonaut Gold Inc.	STK	0	19.055
US0482692037	Atlantic Capital Bancshares Inc.	STK	10.897	10.897
US1476261052	Casper Sleep Inc.	STK	13.025	13.025
US1255818015	Cit Group Inc. New	STK	3.362	3.362
US21872L1044	CorePoint Lodging Inc.	STK	142	142
US2575592033	Domtar Corp.New	STK	2.176	2.176
CA29446Y5020	Equinox Gold Corp. New	STK	0	4.050
CA3499151080	Fortuna Silver Mines Inc.	STK	0	5.735
US4314751029	Hill-Rom Holdings Inc.	STK	782	782
BMG475671050	Ihs Markit Ltd DI -,01	STK	0	2.081
JP3153850007	Infroneer Holdings Inc.	STK	45.600	45.600
JP3861600009	Maeda Road Construction Co. Ltd.	STK	0	20.000
US55933J2033	Magnachip Semiconductor Corp.	STK	0	4.600
US67020Y1001	Nuance Communications Inc.	STK	0	3.940
US78409V1044	S&P Global Inc.	STK	590	590
US79466L3024	Salesforce.com Inc	STK	0	0
US8404411097	South State Corp.	STK	2.713	2.713
US9839191015	Xilinx Inc.	STK	0	696
Andere Wertpapiere				
DE000A3MQB30	Vonovia SE	STK	983	983
An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere				
Aktien				
US23332B1061	DSP Group Inc.	STK	0	8.125
US27875T1016	Echo Global Logistics Inc.	STK	2.466	2.466
US31946M1036	First Citizens Bancshares Inc. A	STK	208	208
US34960W1062	Forterra Inc.	STK	8.891	8.891
US48283N1063	Kadmon Holdings Inc.	STK	0	9.823
US5590792074	Magellan Health Inc.	STK	1.697	1.697
US69355F1021	PPD Inc.	STK	0	4.750
US84920Y1064	Sportsman's Warehouse Holdings Inc.	STK	0	10.335
IE00BDB6Q211	Willis Towers Watson PLC	STK	0	428

ISIN	GATTUNGSBEZEICHNUNG	STÜCK BZW. ANTEILE BZW. WÄHRUNG IN 1.000	KÄUFE/ ZUGÄNGE IM BERICHTS- ZEITRAUM	VERKÄUFE/ ABGÄNGE IM BERICHTS- ZEITRAUM
Nichtnotierte Wertpapiere				
Aktien				
DE000A3MQCM4	Aareal Bank AG	STK	8.663	8.663
BMG0684D1074	Athene Holding A	STK	1.951	1.951
SE0007185418	Nobina AB	STK	11.976	11.976
DE000WAF3019	Siltronic Ag Na Z.Verk.	STK	0	1.078
ES0105385001	Solarpack Corporation Tecnologica S.A.	STK	0	5.736

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	.		5.376
E-Mini S&P 500 Index Future)				
Verkaufte Kontrakte:				
(Basiswerte:	EUR	.		695
FTSE SGX China A50 Index Future MSCI Emerging Markets Index Future)				
Zinsterminkontrakte				
Gekaufte Kontrakte:				
(Basiswerte:	EUR			44.378
2-Year U.S. Treasury Notes Future 2-Years US Treasury Notes Future 5 Year U.S. Treasury Notes Future 5-Year U.S. Treasury Notes Future US Treasury Long Bond Future)				
Verkaufte Kontrakte:				
(Basiswerte:	EUR			12.699
5 Year U.S. Treasury Notes Future Ultra 10-Year US Treasury Notes Future Ultra 10-Years US Treasury Notes Future US Treasury Long Bond Future)				
Devisenterminkontrakte (Verkauf)				
Verkauf von Devisen auf Termin:				
AUD/EUR	EUR			96
SEK/EUR	EUR			124
USD/EUR	EUR			3.919
Devisenterminkontrakte (Kauf)				
Kauf von Devisen auf Termin:				
AUD/EUR	EUR			96
CAD/EUR	EUR			269
GBP/EUR	EUR			49
JPY/EUR	EUR			314
SEK/EUR	EUR			246
USD/EUR	EUR			2.475

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	10.809,62
In % des Fondsvermögens	0,20
Zehn größte Gegenparteien	
1. Name	UBS AG [London Branch]
1. Bruttovolumen offene Geschäfte	24.312.114,00
1. Sitzstaat	Schweiz
2. Name	Morgan Stanley Europe SE
2. Bruttovolumen offene Geschäfte	12.335.928,00
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	24.312.114,00
3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage)	12.335.928,00
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	1.894.367,24
in % der Bruttoerträge	0,00
Kostenanteil des Fonds	-1.318.100,52

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	106,64	
Umlaufende Anteile First Private Systematic Events A	STK	50.800,00	

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:

74,47% Bewertung auf Basis handelbarer Kurse

0,25% 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 2022

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 31.12.2020: 2,557 Mio. EUR

Eigenmittel
am 31.12.2020: 4,100 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 31.12.2020:
3.543 Mio. EUR

Gezeichnetes Kapital am 31.12.2020:
1.754,386 Mio.

Eingezahltes Kapital am 31.12.2020:
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