

First Private
Systematic Flows

Halbjahresbericht zum
30.04.2023



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 Grafik- und Zahlenangaben geben den zum Berichtsstichtag verfügbaren Stand wieder.

INFORMATIONEN FÜR DEN VERTRIEB DES SONDERVERMÖGENS IN DER SCHWEIZ

PORTFOLIUMSCHLAGRATE UND TOTAL EXPENSE RATIO
(vom 04.07.2022 bis 30.04.2023)

Portfolioumschlagrate (PUR)* = 0,52%

Die PUR gilt als Indikator für die Bedeutung der Nebenkosten, die bei Kauf und Verkauf von Anlagen erwachsen. Sie zeigt auf, wie viele Wertpapiertransaktionen freiwillig auf Grund gezielter Umschichtungen erfolgten, und zwar im Verhältnis zum durchschnittlichen Nettofondsvermögen. Dabei werden Transaktionen, die auf Grund von nicht beeinflussbaren Zeichnungen und Rücknahmen resultierten, nicht berücksichtigt.

Total Expense Ratio (TER)

TER Anteilklasse EUR S: 0,89%

TER Anteilklasse EUR I: 1,01%

TER Anteilklasse EUR R: 1,88%

Diese Kennziffer wurde gemäss der „Richtlinie zur Berechnung und Offenlegung der Total Expense Ratio (TER) von kollektiven Kapitalanlagen“ der „Asset Management Association Switzerland (AMAS)“ in der aktuell gültigen Fassung berechnet und drückt die Gesamtheit derjenigen Kommissionen und Kosten, die laufend dem Nettovermögen belastet werden (Betriebsaufwand), retrospektiv in einem Prozentsatz des Nettovermögens aus.

Frankfurt am Main, Mai 2023

Die Geschäftsführung

First Private Investment Management KAG mbH

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

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

* Englische Bezeichnung: PTR = Portfolio Turnover Rate.

VERMÖGENSÜBERSICHT

GEM. § 9 KARBV

FIRST PRIVATE SYSTEMATIC FLOWS, STICHTAG: 30.04.2023

| | | KURSWERT IN EUR | % DES FONDSVERMÖGENS |
|---|---|----------------------|----------------------|
| I. Vermögensgegenstände | | 28.477.331,12 | 100,23 |
| 1. Anleihen | | 26.426.027,68 | 93,01 |
| | - Schuldverschreibungen, die von öffentlichen Institutionen emittiert oder gesichert werden | EUR 25.489.907,68 | 89,71 |
| | - Unternehmensanleihen | EUR 936.120,00 | 3,29 |
| 2. Derivate | | -627.286,19 | -2,21 |
| | - Futures (Verkauf) | EUR -143.792,86 | -0,51 |
| | - Futures (Kauf) | EUR 54.176,21 | 0,19 |
| | - Swaps (Kauf) | EUR -537.669,54 | -1,89 |
| 3. Bankguthaben | | -147.289,88 | -0,52 |
| | - Bankguthaben in EUR | EUR 33.038,67 | 0,12 |
| | - Bankguthaben in Nicht EU/EWR-Währungen | EUR -180.328,55 | -0,63 |
| 4. Sonstige Vermögensgegenstände | | 2.825.879,51 | 9,95 |
| II. Verbindlichkeiten | | -64.576,01 | -0,23 |
| 1. Sonstige Verbindlichkeiten | | EUR -64.576,01 | -0,23 |
| III. Fondsvermögen | | 28.412.755,11 | 100,00 |

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

VERMÖGENSAUFSTELLUNG ZUM 30.04.2023

| ISIN | GATTUNGSBEZEICHNUNG | STÜCK BZW. ANTEILE BZW. WÄHRUNG IN 1.000 | BESTAND 30.04.2023 | KÄUFE/ ZUGÄNGE IM BERICHTS- ZEITRAUM | VERKÄUFE/ ABGÄNGE IM BERICHTS- ZEITRAUM | KURS | KURSWERT IN EUR | % DES FONDS- VERMÖ- GENS | |
|--|---|---|-----------------------|---|--|-----------|--------------------|-----------------------------------|--------------|
| Börsengehandelte Wertpapiere | | | | | | | EUR | 23.430.407,68 | 82,46 |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | | | | EUR | 23.430.407,68 | 82,46 |
| DE0001030732 | 0,000% BRD Anl. 15.08.31 | EUR | 3.790 | 0 | 3.710 | % 83,2819 | 3.156.384,96 | 11,11 | |
| DE0001030716 | 0,000% BRD BO 10.10.25 | EUR | 8.000 | 10.000 | 12.000 | % 94,0850 | 7.526.800,00 | 26,49 | |
| XS1933817824 | 0,000% EIB MTN 10.01.24 | EUR | 1.450 | 0 | 0 | % 97,6145 | 1.415.410,25 | 4,98 | |
| XS1414146669 | 0,050% KfW MTN 30.05.24 | EUR | 1.000 | 0 | 0 | % 96,7578 | 967.578,45 | 3,41 | |
| FR0013296373 | 0,125% Agence Française Dé- veloppement MTN 15.11.23 | EUR | 500 | 0 | 0 | % 98,2135 | 491.067,50 | 1,73 | |
| XS1612940558 | 0,250% KfW MTN 30.06.25 | EUR | 6.000 | 5.000 | 0 | % 94,3505 | 5.661.030,00 | 19,92 | |
| XS1280834992 | 0,500% EIB MTN 15.11.23 | EUR | 1.200 | 1.200 | 0 | % 98,5715 | 1.182.858,00 | 4,16 | |
| XS1897340854 | 0,500% KfW Anl.28.09.26 | EUR | 2.048 | 0 | 0 | % 92,4553 | 1.893.483,52 | 6,66 | |
| XS1815070633 | 0,500% Nordic Investment Bank MTN 03.11.25 | EUR | 1.000 | 0 | 0 | % 93,6120 | 936.120,00 | 3,29 | |
| DE0001102317 | 1,500% BRD Anl. 15.05.23 | EUR | 100 | 0 | 0 | % 99,9350 | 99.935,00 | 0,35 | |
| DE0001102325 | 2,000% BRD Anl. 15.08.23 | EUR | 100 | 0 | 0 | % 99,7400 | 99.740,00 | 0,35 | |
| Nichtnotierte Wertpapiere | | | | | | | EUR | 2.995.620,00 | 10,54 |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | | | | EUR | 2.995.620,00 | 10,54 |
| AT0000A321T2 | 0,000% Österreich TBI 25.05.23 | EUR | 3.000 | 3.000 | 0 | % 99,8540 | 2.995.620,00 | 10,54 | |
| Summe Wertpapiervermögen²⁾ | | | | | | | EUR | 26.426.027,68 | 93,01 |

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

| GATTUNGSBEZEICHNUNG | MARKT | STÜCK BZW. AN- TEILE BZW. WÄHRUNG IN 1.000 | BESTAND 30.04.2023 | KÄUFE/ ZUGÄNGE IM BE- RICHTS- ZEITRAUM | VERKÄUFE/ ABGÄNGE IM BERICHTS- ZEITRAUM | KURS | KURSWERT IN EUR | % DES FONDS- VERMÖ- GENS |
|--|-------|--|-----------------------|--|---|------------|--------------------|-----------------------------------|
| Derivate | | | | | | EUR | -627.286,19 | -2,21 |
| Bei den mit Minus gekennzeichneten Beständen handelt es sich um verkaufte Positionen. | | | | | | | | |
| Aktienindex-Derivate | | | | | | EUR | -1.578,35 | -0,01 |
| Forderungen/Verbindlichkeiten | | | | | | EUR | -1.578,35 | -0,01 |
| Aktienindex-Terminkontrakte | | | | | | EUR | -1.578,35 | -0,01 |
| E-Mini S&P 500 Index Future 06/ 23 | NAR | USD | Anzahl 500 | | | | 16.134,51 | 0,06 |
| MSCI Emerging Markets Index Future 06/ 23 | NAJ | USD | Anzahl -400 | | | | -17.712,86 | -0,06 |
| Zins-Derivate | | | | | | EUR | -88.038,30 | -0,31 |
| Forderungen/Verbindlichkeiten | | | | | | EUR | -88.038,30 | -0,31 |
| Zinsterminkontrakte | | | | | | EUR | -88.038,30 | -0,31 |
| 6,000% 10-Year Gov. of Canada Bond Future 06/ 23 | NCM | CAD | 700.000 | | | | 2.063,65 | 0,01 |
| 6,000% Euro Bobl Future 06/ 23 | EDT | EUR | 700.000 | | | | 8.540,00 | 0,03 |
| 6,000% Euro Bund Future 06/ 23 | EDT | EUR | -1.900.000 | | | | -65.480,00 | -0,23 |
| 6,000% Euro Schatz Future 06/ 23 | EDT | EUR | -6.000.000 | | | | -60.600,00 | -0,21 |
| 6,000% Euro-BTP Future 06/ 23 | EDT | EUR | 500.000 | | | | 7.890,00 | 0,03 |
| 6,000% Long Term Euro OAT Future 06/ 23 | EDT | EUR | 400.000 | | | | 7.330,00 | 0,03 |
| 6,000% Long Gilt Future 06/ 23 | EUT | GBP | 400.000 | | | | 2.777,94 | 0,01 |
| 5 Year U.S. Treasury Notes Future 06/ 23 | NAU | USD | 1.100.000 | | | | 2.306,96 | 0,01 |
| Ultra 10-Years US Treasury Notes Future 06/ 23 | NAU | USD | 700.000 | | | | 3.368,43 | 0,01 |
| US Treasury Long Bond Future 06/ 23 | NAU | USD | 500.000 | | | | 3.764,72 | 0,01 |
| Swaps | | | | | | EUR | -537.669,54 | -1,89 |
| Forderungen/Verbindlichkeiten | | | | | | EUR | -537.669,54 | -1,89 |
| Total Return Swaps | | | | | | EUR | -537.669,54 | -1,89 |
| (Erhalten / Zahlen) | | | | | | EUR | -537.669,54 | -1,89 |
| UBS,LDN Strategie Index EUR Long2 vs. 0% 05.05.23 | OTC | EUR | 5.366.116 | | | | -37.855,45 | -0,13 |
| UBS,LDN Strategie Index EUR Long vs. 0% 05.05.23 | OTC | EUR | 5.693.216 | | | | -167.235,41 | -0,59 |
| UBS,LDN Strategie Index EUR Short vs. 0% 05.05.23 | OTC | EUR | 5.750.829 | | | | 74.751,05 | 0,26 |
| UBS,LDN Strategy Index EUR Short 2 vs.0 % 05.05.23 | OTC | EUR | 5.690.456 | | | | -116.198,57 | -0,41 |
| GSBE,FFM Marquee FP 2 lx USD Short vs. 0% 14.12.23 | OTC | USD | 19.114.683 | | | | -203.731,06 | -0,72 |
| GSBE,FFM Marquee FP Index USD Long vs. 0% 14.12.23 | OTC | USD | 20.563.677 | | | | 62.825,25 | 0,22 |
| UBS,LDN US Portfolio Long 4 vs. 0% 05.05.23 | OTC | USD | 20.748.152 | | | | 96.554,54 | 0,34 |
| UBS,LDN US Portfolio Long vs. 0% 05.05.23 | OTC | USD | 9.979.271 | | | | 1.543,58 | 0,01 |
| UBS,LDN US Portfolio Short 4 vs. 0% 05.05.23 | OTC | USD | 19.461.644 | | | | -243.500,87 | -0,86 |
| UBS,LDN US Portfolio Short vs. 0% 06.05.23 | OTC | USD | 9.833.342 | | | | -1.088,14 | 0,00 |
| UBS,LDN USD Comdty Basket Flow Long 0% 28.09.23 | OTC | USD | 20.304.831 | | | | -3.734,46 | -0,01 |

| GATTUNGSBEZEICHNUNG | STÜCK BZW. ANTEILE BZW. WÄHRUNG IN 1.000 | BESTAND 30.04.2023 | KÄUFE/ ZUGÄNGE IM BERICHTS- ZEITRAUM | VERKÄUFE/ ABGÄN- GE IM BERICHTS- ZEITRAUM | KURS | KURSWERT IN EUR | % DES FONDS- VERMÖ- GENS |
|--|---|-----------------------|---|---|------------|----------------------|-----------------------------------|
| Bankguthaben | | | | | EUR | 76.653,45 | 0,27 |
| EUR-Guthaben bei: | | | | | EUR | 33.038,67 | 0,12 |
| The Bank of New York Mellon SA/ NV (Verwahrstelle) | EUR | 33.038,67 | | | % 100,0000 | 33.038,67 | 0,12 |
| Guthaben in Nicht-EU/EWR-Währungen | | | | | EUR | 43.614,78 | 0,15 |
| | CAD | 28.346,58 | | | % 100,0000 | 18.931,16 | 0,07 |
| | GBP | 21.680,85 | | | % 100,0000 | 24.683,62 | 0,09 |
| Sonstige Vermögensgegenstände | | | | | EUR | 2.825.879,51 | 9,95 |
| Zinsansprüche | | | | | EUR | 36.262,87 | 0,13 |
| | EUR | 36.262,87 | | | | 36.262,87 | 0,13 |
| Forderungen aus Collateral | | | | | EUR | 2.700.000,00 | 9,50 |
| | EUR | 2.700.000,00 | | | | 2.700.000,00 | 9,50 |
| Variation Margin | | | | | EUR | 89.616,64 | 0,32 |
| | EUR | 89.616,64 | | | | 89.616,64 | 0,32 |
| Kurzfristige Verbindlichkeiten | | | | | EUR | -223.943,33 | -0,79 |
| Banksaldo in nicht EU/EWR-Währungen | | | | | EUR | -223.943,33 | -0,79 |
| | USD | -247.233,44 | | | % 100,0000 | -223.943,33 | -0,79 |
| Sonstige Verbindlichkeiten | | | | | EUR | -64.576,01 | -0,23 |
| Verbindlichkeiten aus Anteilscheingeschäften | | | | | EUR | -3.603,16 | -0,01 |
| | EUR | -3.603,16 | | | | -3.603,16 | -0,01 |
| Kostenabgrenzung | | | | | EUR | -60.972,85 | -0,21 |
| | EUR | -60.972,85 | | | | -60.972,85 | -0,21 |
| Fondsvermögen | | | | | EUR | 28.412.755,11 | 100,00 |
| Anteilwert First Private Systematic Flows EUR S | | | | | EUR | 94,77 | |
| Anteilwert First Private Systematic Flows EUR I | | | | | EUR | 94,64 | |
| Anteilwert First Private Systematic Flows EUR R | | | | | EUR | 93,84 | |
| Umlaufende Anteile First Private Systematic Flows EUR S | | | | | STK | 292.987,00 | |
| Umlaufende Anteile First Private Systematic Flows EUR I | | | | | STK | 55,00 | |
| Umlaufende Anteile First Private Systematic Flows EUR R | | | | | STK | 6.835,79 | |

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

WERTPAPIERKURSE BZW. MARKTSÄTZE

| DEISENKURSE (IN MENGENNOTIZ) | PER | 28.04.2023 | = | 1 Euro (EUR) |
|------------------------------|-------|------------|---|--------------|
| Britische Pfund | (GBP) | 0,878350 | = | 1 Euro (EUR) |
| Kanadischer Dollar | (CAD) | 1,497350 | = | 1 Euro (EUR) |
| US-Dollar | (USD) | 1,104000 | = | 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 | | | | |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | |
| DE000A14JZS6 | 0,010% Landesbank Baden-Württemberg LSA. 07.03.31 | EUR | 0 | 100 |
| An organisierten Märkten zugelassene oder in diese einbezogene Wertpapiere | | | | |
| Verzinsliche Wertpapiere | | | | |
| DE0001030708 | 0,000% BRD Anl. (Green Bond) 15.08.30 | EUR | 0 | 10.500 |

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: E-Mini S&P 500 Index Future) | EUR | | | 13.844 |
| Verkaufte Kontrakte | | | | |
| (Basiswerte: FTSE SGX China A50 Index Future MSCI Emerging Markets Index Future) | EUR | | | 5.127 |
| Zinsterminkontrakte | | | | |
| Gekaufte Kontrakte | | | | |
| (Basiswerte: 10-Year Gov. of Canada Bond Future 2-Years US Treasury Notes Future 5 Year U.S. Treasury Notes Future Euro Bobl Future Euro-BTP Future Long Gilt Future Long Term Euro OAT Future Ultra 10-Years US Treasury Notes Future US Treasury Long Bond Future) | EUR | | | 240.130 |
| Verkaufte Kontrakte | | | | |
| (Basiswerte: 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 Schatz Future Ultra 10-Years US Treasury Notes Future US Treasury Long Bond Future) | EUR | | | 271.158 |

SONDERVERMÖGEN FIRST PRIVATE SYSTEMATIC FLOWS

| ANTEILKLASSEN- BEZEICHNUNG | EUR S* | EUR I** | EUR R |
|--------------------------------|--|--|--|
| Mindestanlagesumme | 1.000.000,00 EUR | 1.000.000,00 EUR | keine |
| Fondsaufgabe | 04.07.2022 | 04.07.2022 | 04.07.2022 |
| Ausgabeaufschlag | 0,00% | 0,00% | 5,00% |
| Rücknahmeabschlag | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| Verwaltungsvergütung p.a. | 0,75% | 0,95% | 1,80% |
| Stückelung | Globalurkunde | Globalurkunde | Globalurkunde |
| Ertragsverwendung | ausschüttend | ausschüttend | ausschüttend |
| Währung | EUR | EUR | EUR |
| ISIN | DE000A0Q95R0 | DE000A0Q95S8 | DE000A0Q95T6 |
| Performanceabhängige Vergütung | 15% des über dem Referenzwert liegenden Wertzuwachses | 20% des über dem Referenzwert liegenden Wertzuwachses | 20% des über dem Referenzwert liegenden Wertzuwachses |
| Kleinste handelbare Einheit: | 1 Anteil | 1 Anteil | 0,001 Anteil (sparplanfähig) |

* Anteilklasse EUR S ist institutionellen Anlegern vorbehalten. Die Anteilklasse „EUR S“ bietet früh investierenden Anlegern (sog. Seed-Investoren) den Vorteil geringerer Vergütungen, die Ausgabe von Anteilen dieser Anteilklasse wird nach Ermessen der Gesellschaft eingestellt.

** Anteilklasse EUR I 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 | -537.669,54 |
| In % des Fondsvermögens | -1,89 |
| Zehn größte Gegenparteien | |
| 1. Name | UBS AG [London Branch] |
| 1. Bruttovolumen offene Geschäfte | 95.260.799,00 |
| 1. Sitzstaat | Schweiz |
| 2. Name | Goldman Sachs Bank Europe SE |
| 2. Bruttovolumen offene Geschäfte | 35.940.543,00 |
| 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) | 76.868.742,00 |
| 1 Woche bis 1 Monat (= 30 Tage) | |
| 1 bis 3 Monate | |
| 3 Monate bis 1 Jahr (=365 Tage) | 54.332.600,00 |
| 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 | 9.605.676,48 |
| in % der Bruttoerträge | 0,00 |
| Kostenanteil des Fonds | |
| | -9.585.080,74 |
| Ertragsanteil der 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 WpFinGesch. und Total Return Swaps (absoluter Betrag) | | n/a |
| Verliehene Wertpapiere in % aller verleihbaren Vermögensgsgt. des Fonds | | 0,00 |
| Zehn größte Sicherheitenaussteller, bezogen auf alle WpFinGesch. und Total Return Swaps | | |
| 1. Name | Goldman Sachs Bank Europe SE | |
| 1. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut) | 2.430.000,00 | |
| 2. Name | UBS AG [London Branch] | |
| 2. Volumen empfangene Sicherheiten (absolut) | 270.000,00 | |
| Wiederangelegte Sicherheiten in % der empfangenen Sicherheiten, bezogen auf alle WpFinGesch. 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 | 2.700.000,00 | |
| 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 Flows EUR S | EUR | 94,77 | |
| Anteilwert First Private Systematic Flows EUR I | EUR | 94,64 | |
| Anteilwert First Private Systematic Flows EUR R | EUR | 93,84 | |
| Umlaufende Anteile First Private Systematic Flows EUR S | STK | 292.987,00 | |
| Umlaufende Anteile First Private Systematic Flows EUS I | STK | 55,00 | |
| Umlaufende Anteile First Private Systematic Flows EUR R | STK | 6.835,79 | |

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

93,01% 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, Mai 2023

First Private Investment Management KAG mbH
Die Geschäftsführung

MANAGEMENT UND VERWALTUNG DES First Private **Systematic Flows**

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. EUR

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

4. VERTRIEB IN DER SCHWEIZ

Zahlstelle:
Tellco AG

Hausanschrift:
Bahnhofstrasse 4
CH-6430 Schwyz
Schweiz
www.tellco.ch

Vertreter:
1741 Fund Solutions AG

Hausanschrift:
Burggraben 16
CH-9000 St. Gallen
Schweiz
www.1741group.com

ZUSÄTZLICHE INFORMATIONEN FÜR DIE ANLEGER IN DER SCHWEIZ

Herkunftsland des OGAW-Sondervermögens: Deutschland. Der Prospekt inkl. Allgemeiner und Besonderer Anlagebedingungen, die Basisinformationsblätter sowie der Jahres- und Halbjahresbericht können kostenlos beim Vertreter sowie bei der Kapitalverwaltungsgesellschaft, First Private Investment Management KAG mbH, Westhafenplatz 8, D-60327 Frankfurt am Main bezogen werden. Die Unterlagen werden ferner unter www.first-private.de zum kostenlosen Download bereit gehalten.



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