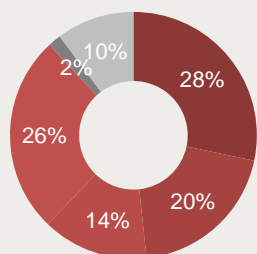


Anlagestrategie

30 September 2019

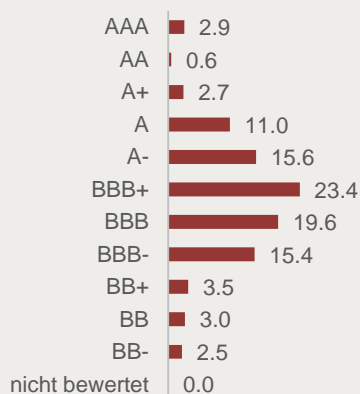
Der Cape Fixed Income Fund strebt einen Kapitalzuwachs von Euribor+250bps an und offeriert tägliche Liquidität. Er investiert in Anleihen und Kreditderivate globaler Referenz-Emittenten in verschiedenen Währungen mit einem Fokus auf Investment Grade Unternehmen. Mittels Relative Value Ansatz und umfassender fundamentaler und quantitativer Analyse wird das Risiko/Ertrag-Ratio optimiert. Umweltkriterien, Soziale Verantwortung und Unternehmensführung (ESG) werden im Anlageprozess auch berücksichtigt. Die Zinsrisiken werden generisch auf einen Korridor von 1-2 Jahren reduziert und sämtliche FX Risiken vollständig abgesichert.

Risikoallokation

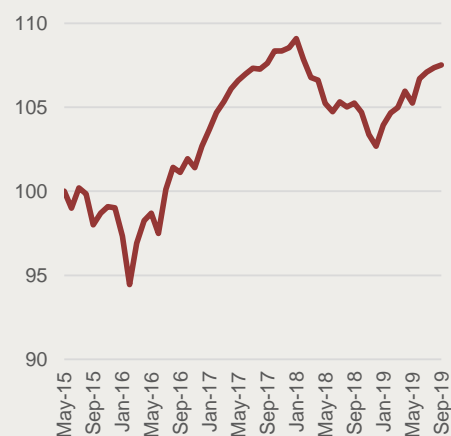


- Finanzerlöse
- Versicherungsanleihen
- Unternehmensanleihen
- CDS, Index Tranchen
- CDS, einzelne Positionen (Unternehmen)
- Vorrangige CLO Tranchen

Bonitätsverteilung (%)



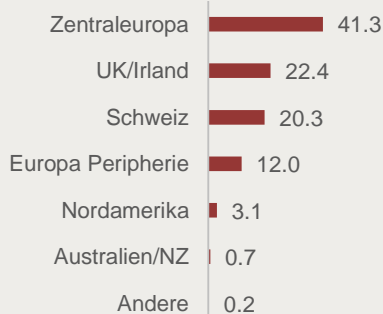
Wertentwicklung*



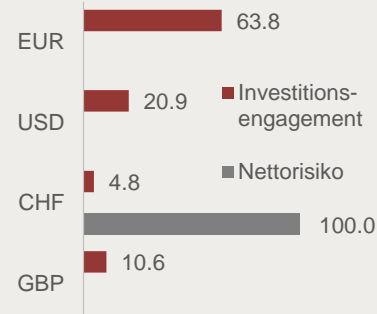
Portfoliostatistiken

(in %)	Fonds
Annualisierte Rendite	1.69
Volatilität	3.62
Sharpe Ratio	0.67
Max. Drawdown	-5.87
Wertentwicklung 1M	0.15
Wertentwicklung YTD	4.70
Wertentwicklung 1J	2.15
Zinsduration	1.6
Portfolio Bonität	BBB

Geographische Verteilung (%)



Währungsallokation (%)



Wertentwicklung*

(%)	Jan	Feb	Mär	Apr	Mai	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dez	YTD
2015						-1.01	1.22	-0.35	-1.85	0.71	0.39	-0.07	-0.99
2016	-1.70	-2.96	2.59	1.40	0.44	-1.21	2.68	1.32	-0.30	0.80	-0.52	1.25	3.71
2017	0.97	0.96	0.63	0.73	0.46	0.37	0.32	-0.06	0.33	0.69	-0.01	0.18	5.71
2018	0.51	-1.13	-1.01	-0.14	-1.30	-0.47	0.55	-0.28	0.23	-0.52	-1.27	-0.67	-5.39
2019	1.23	0.68	0.31	0.94	-0.67	1.37	0.37	0.25	0.15				4.70

*Der Fonds wurde im Juni 2015 als Cape Capital SICAV-SIF lanciert und im Juli 2017 in Cape Capital SICAV-UCITS umgewandelt.

Inventarwert Cape Capital SICAV-UCITS - Cape Fixed Income Fund - Institutional B EUR (LU1200252796): 110.43

Inventarwert Cape Capital SICAV-UCITS - Cape Fixed Income Fund - Institutional B CHF (LU1200252952): 107.52

Inventarwert Cape Capital SICAV-UCITS - Cape Fixed Income Fund - Institutional B USD (LU1200253257): 119.63

Inventarwert Cape Capital SICAV-UCITS - Cape Fixed Income Fund - Institutional B GBP (LU1200253414): 103.05

Nettovermögen insgesamt: EUR 418mm
 Bloomberg Code: CSCFCHI LX
 Thesaurierend
 Liquidität: Täglich bis 15:00 MEZ
 Verwaltungsgebühren: 0.5%

Fondsaufgagedatum: 1 Juni 2015
 Fondstyp: SICAV-UCITS
 Domizil: Luxemburg
 Portfoliomanager: Cape Capital AG
 Verwaltungsgesellschaft:
 MultiConcept Fund Management S.A.

Zentrale Administration:
 Credit Suisse Fund Services (Luxemburg) S.A.
 Unabhängiger Wirtschaftsprüfer: PwC
 (Luxemburg)
 Justiziar: Arendt & Medernach, Luxemburg
 Depotbank: Credit Suisse (Luxemburg) S.A.

Bitte beachten Sie den Haftungsausschluss auf der Rückseite.

Der Fonds ist ein Teilfonds («Fonds») des Cape Capital SICAV-UCITS Umbrellafonds, welcher gemäss Teil I des luxemburgischen Gesetzes vom 17. Dezember 2010 bezüglich für Organismen für gemeinsame Anlagen («Gesetz vom 17. Dezember 2010») umgesetzte Richtlinie 2009/65/EG des Europäischen Parlaments und des Rates vom 13. Juli 2009 zur Koordinierung der Rechts-, Verwaltungs- und Administrationsvorschriften in Bezug auf Organismen für gemeinsame Anlagen in übertragbaren Wertpapieren reguliert ist. Des Weiteren ist der Umbrellafonds von der Luxemburger Aufsichtsbehörde des Finanzsektors (Commission de Surveillance du Secteur Financier – CSSF) zugelassen. Die Vertreterin in der Schweiz ist ACOLIN Fund Services AG, Leutschenbachstrasse 50, CH-8050 Zürich. Die Zahlstelle in der Schweiz ist die Credit Suisse (Schweiz) AG, Paradeplatz 8, CH-8001 Zürich. Ein Exemplar des Verkaufsprospekts, des Dokuments mit wesentlichen Anlegerinformation, des Jahresberichts, sowie anderer Rechtsdokumente kann bei der Vertreterin in der Schweiz bezogen werden. Dieses Dokument ist nur zu Informationszwecken gedacht und stellt weder ein Angebot noch eine Aufforderung zum Kauf dar. Die Performance-Daten lassen allfällige bei der Ausgabe- und Rücknahme der Anteile erhobenen Kommissionen und Kosten unberücksichtigt. Mit Bezug auf die in oder von der Schweiz aus vertriebenen Fondsanteile sind Erfüllungsort und Gerichtsstand am Sitz des Vertreters begründet. Die vergangene Performance ist keine Garantie bzw. kein Hinweis für die künftige Wertentwicklung.

FÜR INVESTOREN IN DEUTSCHLAND: Die Informationsstelle in Deutschland ist die ACOLIN Europe GmbH mit eingetragenem Sitz in der Reichenaustrasse 11a-c, 78467 Konstanz. Die wesentlichen Fondsdokumente, einschliesslich des Prospekts (in englischer Sprache) und der KIIDs (in deutscher Sprache), sind kostenlos am Sitz der deutschen Informationsstelle erhältlich. FÜR INVESTOREN IN GROSSBRITANNIEN: Der Fonds und einige seiner Teilfonds sind gemäß § 264 des Financial Services and Markets Act 2000 registriert. Britische Anleger sollten den Anhang für britische Anleger in Verbindung mit dem Verkaufsprospekt des Fonds lesen, der bei dem Facilities Agent erhältlich ist. Der Verkaufsprospekt des Fonds und die wesentlichen Anlegerinformationen sind erhältlich unter www.fundinfo.com. FÜR INVESTOREN IN SPANIEN: Der Verkaufsprospekt des Fonds und die wesentlichen Anlegerinformationen sind erhältlich unter www.fundinfo.com.

Cape Capital AG ist eine unabhängige Vermögensverwaltung mit Sitz in Zürich, Schweiz, und durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht reguliert (www.capecapital.com).

Dieses Dokument ist für berechnigte Anleger erhältlich. Es ist kein gesetzliches Pflichtdokument, sondern dient nur zu Informations- und Werbezwecken.

WICHTIGE INFORMATIONEN

Diese Informationen stellen rechtlich eine Werbemitteilung dar, die nicht allen gesetzlichen Anforderungen zur Gewährleistung der Unvoreingenommenheit von Anlageempfehlungen und Anlagestrategieempfehlungen genügen und unterliegen nicht einem Verbot des Handels vor der Veröffentlichung von Anlageempfehlungen und Anlagestrategieempfehlungen. Die Wertentwicklung des Fonds in der Vergangenheit ist kein Indikator für die zukünftige Wertentwicklung und bietet keine Garantie für einen Erfolg in der Zukunft. Alle Angaben dienen nur der Unterstützung Ihrer selbstständigen Anlageentscheidung und stellen keine Empfehlung der auflegenden Verwaltungsgesellschaft Cape Capital AG dar. Für die Richtigkeit, Vollständigkeit und Genauigkeit der Angaben kann keine Garantie übernommen werden. Eine Haftung wegen Fehlerhaftigkeit der Angaben ist ausgeschlossen. Verbindlich sind allein die wesentlichen Anlegerinformationen und der Verkaufsprospekt, den Sie auf Anfrage bei der Verwaltungsgesellschaft oder bei den Vertriebs-, Zahl- und Informationsstellen kostenlos anfordern können. Der Nettoinventarwert des Fonds kann Schwankungen unterworfen sein. Der Verkaufsprospekt enthält dazu umfangreiche Risikohinweise. Alle Angaben können sich jederzeit ohne vorherige Ankündigung ändern. Die Ausführungen wurden lediglich auf die Vereinbarkeit mit luxemburgischem Recht geprüft. In einigen Rechtsordnungen ist die Verbreitung derartiger Informationen unter Umständen gesetzlichen Beschränkungen unterworfen. Die vorstehenden Informationen richten sich daher nicht an natürliche oder juristische Personen, deren Wohn- bzw. Geschäftssitz einer Rechtsordnung unterliegt, und Sie sollten sich über die besagten Beschränkungen informieren und diese entsprechend beachten. Die Informationen in diesem Dokument sind nicht für Gebietsansässige der Vereinigten Staaten von Amerika oder andere Personen bestimmt, die als «US-Personen» im Sinne von Rule 902 in Regulation S des US Securities Act von 1933 in der jeweils geltenden Fassung gelten und dieses Dokument ist nicht als Angebot oder Verkauf einer Beteiligung an einem von Cape Capital verwalteten Fonds an US-Personen zu verstehen. Keine US-amerikanische Wertpapieraufsichtsbehörde oder sonstige Aufsichtsbehörde auf Bundes- oder bundesstaatlicher Ebene hat die Richtigkeit oder Angemessenheit dieser Präsentation oder sonstiger Informationen, die den Anlegern ausgehändigt oder zur Verfügung gestellt wurden, bestätigt. Jede gegenteilige Äusserung stellt einen Straftatbestand dar. Hinweise zum Datenschutz entnehmen Sie bitte dem Verkaufsprospekt.