

# CAPE CAPITAL SICAV-UCITS

(Investmentgesellschaft luxemburgischen Rechts mit variablem Kapital)

Luxemburg R.C.S. B196061

Ungeprüfter Halbjahresbericht zum 30.06.2023

---

<b>Verwaltung und Organe</b>	<b>3</b>
<b>Kombinierter Bericht</b>	<b>4</b>
<b>Erläuterungen</b>	<b>6</b>
<b>Bericht per Subfonds</b>	
Cape Capital SICAV-UCITS - Cape Equity Fund	9
Cape Capital SICAV-UCITS - Cape Fixed Income Fund	13
Cape Capital SICAV-UCITS - Cape Select Bond Fund	19
<b>Ungeprüfte Informationen</b>	<b>24</b>

## Verwaltung und Organe

---

### Gesellschaft

---

Cape Capital SICAV-UCITS  
5, rue Jean Monnet, L-2180 Luxemburg  
R.C.S. Luxemburg B196061

### Verwaltungsrat der Gesellschaft

---

Johan Holgersson  
Cape Capital AG

Antonio Silva  
CEO, Credit Suisse Fund Services (Luxembourg) S.A., Luxemburg

Véronique Trausch  
FinDeal Advisors S.A.

### Verwaltungsgesellschaft

---

MultiConcept Fund Management S.A.  
5, rue Jean Monnet  
L-2180 Luxemburg

### Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft

---

Annemarie Arens, Mitglied des Verwaltungsrats  
Independent Director, Luxemburg

Hans Peter Bär, Mitglied des Verwaltungsrats (seit dem 24.05.2023)  
Head of Fund Management Companies, Credit Suisse (Schweiz) AG, Schweiz

Marcus Ulm, Mitglied des Verwaltungsrats (seit dem 24.05.2023)  
CEO, MultiConcept Fund Management S.A., Luxemburg

Arnold Spruit, Mitglied des Verwaltungsrats  
Independent Director, Luxemburg

Patrick Tschumper, Mitglied des Verwaltungsrats (bis zum 24.05.2023)  
Managing Director, Credit Suisse Funds AG, Zürich

Richard Browne, Mitglied des Verwaltungsrats  
Director, Credit Suisse Fund Services (Luxembourg) S.A., Luxemburg

### Abschlussprüfer der Gesellschaft

---

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative  
2, rue Gerhard Mercator  
L-2182 Luxemburg

### Abschlussprüfer der Verwaltungsgesellschaft

---

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative  
2, rue Gerhard Mercator  
L-2182 Luxemburg

### Depotbank und Zahlstelle in Luxemburg

---

Credit Suisse (Luxembourg) S.A.  
5, rue Jean Monnet  
L-2180 Luxemburg

### Zentrale Verwaltungsstelle

---

Credit Suisse Fund Services (Luxembourg) S.A.  
5, rue Jean Monnet  
L-2180 Luxemburg

### Anlageverwalter

---

Cape Capital AG  
Utoquai 55  
CH-8008 Zürich

### Informationsstelle in Deutschland

---

ACOLIN Europe AG  
Reichenaustrasse 11 a-c  
D-78467 Konstanz

### Zahlstelle in der Schweiz

---

Credit Suisse (Switzerland) Ltd  
Paradeplatz 8  
CH-8001 Zürich

### Vertreter in der Schweiz

---

ACOLIN Fund Services AG  
Leutschenbachstrasse 50  
CH-8050 Zürich

Keine Zeichnung darf auf der Grundlage der Geschäftsberichte entgegengenommen werden. Die Zeichnungen erfolgen nur auf der Grundlage des aktuellen Verkaufsprospektes, dem der letzte Jahresbericht beigelegt ist.

Sonstige Informationen über die Gesellschaft sowie des Nettoinventarwerts und der Ausgabe- und Rücknahmepreise der Aktien werden am Sitz der Verwaltungsgesellschaft kostenlos bereitgehalten.

Der Verkaufsprospekt, das Basisinformationsblatt oder die wesentlichen Anlegerinformationen, die letzten geprüften Jahresberichte und ungeprüften Halbjahresberichte sowie Kopien der Satzung und der Aufstellung von Käufen und Verkäufen sind am Sitz der Gesellschaft und des lokalen Vertreters in der Schweiz kostenlos in Papierform erhältlich.

Mit Bezug auf die in oder von der Schweiz aus vertriebenen Fondsanteile sind Erfüllungsort und Gerichtsstand am Sitz des Vertreters begründet.

**Nettovermögensaufstellung (in EUR)****30.06.2023****Aktiva**

Wertpapierbestand zum Marktwert	1.092.755.020,01
Bareinlagen bei Banken und Brokern	28.681.183,54
Forderungen aus Zeichnungen	3.103,16
Forderungen aus Erträgen	8.402.822,54
Gründungskosten	6.433,80
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften	66.147,45
	<b>1.129.914.710,50</b>

**Passiva**

Bankverbindlichkeiten und sonstige	3.272.172,87
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen	12.000.577,36
Rückstellungen für Aufwendungen	636.061,48
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften	292.437,86
Andere Passiva	247,93
	<b>16.201.497,50</b>

**Nettovermögen 1.113.713.213,00**

**Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Nettovermögens (in EUR)**Für die Periode vom  
01.01.2023 bis zum  
30.06.2023

<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>	<b>798.537.444,54</b>
<b>Erträge</b>	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	9.091.714,88
Dividenden (Netto)	3.410.717,40
Bankzinsen	411.674,64
	<b>12.914.106,92</b>
<b>Aufwendungen</b>	
Verwaltungsgebühr	1.970.356,65
Depotbank- und Depotgebühr	169.821,35
Zentralverwaltungsvergütung	152.916,65
Druck- und Veröffentlichungskosten	3.603,37
Zinsen und Bankspesen	105.240,34
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	464.345,47
"Taxe d'abonnement"	211.135,86
Abschreibung der Gründungskosten	2.723,14
	<b>3.080.142,83</b>
<b>Nettoerträge (-verluste)</b>	<b>9.833.964,09</b>
<b>Realisierter Gewinn (Verlust)</b>	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-4.935.783,87
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Swapkontrakten	4.194.278,24
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	-2.231.130,75
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	86.844,27
	<b>-2.885.792,11</b>
<b>Realisierter Nettogewinn (-verlust)</b>	<b>6.948.171,98</b>
<b>Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)</b>	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	22.813.871,31
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Swapkontrakten	-3.374.185,09
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	2.055.976,10
	<b>21.495.662,32</b>
<b>Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung</b>	<b>28.443.834,30</b>
<b>Zeichnungen / Rücknahmen</b>	
Zeichnungen	396.663.051,88
Rücknahmen	-109.931.117,72
	<b>286.731.934,16</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>1.113.713.213,00</b>

## Allgemeines

Cape Capital SICAV-UCITS (die "Gesellschaft") ist ein Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren in der Rechtsform einer Investmentgesellschaft mit variablem Kapital (société d'investissement à capital variable, SICAV) gemäss Teil I des luxemburgischen Gesetzes von Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen in seiner jeweils geltenden Fassung (das "Gesetz vom 17.12.2010").

Die Gesellschaft wurde ursprünglich gegründet als spezialisierter Investmentfonds gemäss dem Gesetz vom 13.02.2007 über spezialisierte Investmentfonds und wurde im Juli 2017 in eine Gesellschaft gemäss Teil I des Gesetzes vom 17.12.2010 umgewandelt.

Die Gesellschaft hat eine Umbrella-Struktur und kann daher getrennte Subfonds betreiben.

Zum 30.06.2023 hatte die Gesellschaft 3 Subfonds aufgelegt.

## Wesentliche Bilanzierungs- und Bewertungsgrundsätze

### a) Darstellung des Abschlusses

Die Darstellung des Abschlusses erfolgt gemäss den Anforderungen der luxemburgischen Aufsichtsbehörden.

Die Abschlüsse wurden gemäß den in Luxemburg für Investmentfonds geltenden gesetzlichen und aufsichtsrechtlichen Bestimmungen unter der Annahme der Fortführung der Geschäftstätigkeit (going concern) erstellt.

### b) Berechnung des Nettoinventarwerts des jeweiligen Subfonds

Der Nettoinventarwert pro Aktie wird an jedem Geschäftstag, an dem Banken in Luxemburg, der Schweiz und im Kanton Zürich normalerweise für den Geschäftsverkehr geöffnet sind (ein "Bewertungstag"), berechnet.

Für den Subfonds Cape Capital SICAV-UCITS - Cape Fixed Income Fund muss der Anlageverwalter Transaktionen ausführen, um die gewünschte Vermögensallokation nach Zeichnungen oder Rücknahmen aufrechtzuerhalten. Hierdurch können zusätzliche Kosten für die Gesellschaft und die Aktionäre entstehen. Um die Interessen der vorhandenen Aktionäre vor solchen Kapitalschwankungen zu schützen, wird daher eine Anpassung des verwendeten NIW pro Aktie vorgenommen, wenn die Netto-Kapitalschwankungen einen vom Verwaltungsrat festgelegten Grenzwert überschreiten. Diese Anpassung spiegelt die geschätzten Steuer- und Handelskosten wider, die der Gesellschaft durch diese Transaktionen entstehen können, sowie den geschätzten Spread-Effekt der Vermögenswerte, in denen die Gesellschaft anlegt. Es wird regelmässig überprüft, ob der angewendete Swing-Faktor angemessen ist.

Der berechnete Nettoinventarwert wird bei einem Nettoüberschuss von Zeichnungsangeboten von mehr als 3,0% des Nettoinventarwerts am betreffenden Bewertungstag um höchstens 0,25% je Anteil erhöht.

Belaufen sich Nettorücknahmen auf mehr als 2,0% des Nettoinventarwerts an einem Geschäftstag, wird der Nettoinventarwert um 0,30% gesenkt, um die Transaktionskosten zwischen den einlösenden und den übrigen Anlegern gerecht aufzuteilen.

Überschreiten die Nettorücknahmen 5% des Nettoinventarwerts, kann die Gesellschaft im Interesse der Anleger beschliessen, den Swing-Faktor auf 2% zu erhöhen.

Zum 30.06.2023 wurde kein Swing-Pricing angewendet.

### c) Bewertung des Wertpapierbestands des jeweiligen Subfonds

Wertpapiere, die an einer Börse notiert sind, werden zum letzten Schlussmittelkurs (Mittelwert zwischen dem Schlussgeld- und Schlussbriefkurs) bewertet. Ist ein solcher Kurs für einen bestimmten Handelstag nicht verfügbar, kann der letzte verfügbare Handelskurs oder alternativ der Schlussgeldkurs als Grundlage der Bewertung verwendet werden. Wenn ein Wertpapier an mehreren Börsen gehandelt wird, erfolgt die Bewertung unter Bezugnahme auf die Börse, an der es vorwiegend gehandelt wird.

Im Fall von Wertpapieren, die nur in geringem Masse an einer Börse gehandelt werden, für die es jedoch einen geregelten Handel unter Wertpapierhändlern an einem Sekundärmarkt gibt, kann sich die Bewertung auf diesen Sekundärmarkt stützen.

An einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere werden auf dieselbe Weise wie an einer Wertpapierbörse notierte Wertpapiere bewertet.

Wertpapiere, die nicht an einer Börse notiert sind und nicht an einem geregelten Markt gehandelt werden, werden zum letzten vorliegenden Marktpreis bewertet. Ist ein solcher nicht verfügbar, erfolgt die Bewertung der Wertpapiere durch den Verwaltungsrat gemäss anderen vom Verwaltungsrat festzulegenden Kriterien und auf der Grundlage des voraussichtlich möglichen Verkaufspreises, dessen Wert mit der gebührenden Sorgfalt und nach bestem Wissen veranschlagt wird.

Aktien und Anteile von OGA werden auf Basis ihres jüngsten berechneten Nettoinventarwerts bewertet, wobei zu zahlende Rücknahmegebühren berücksichtigt werden. Sofern für Aktien oder Anteile solcher OGA kein Nettoinventarwert, sondern nur Kauf- und Verkaufspreise vorliegen, können die Anteile dieser OGA zum Mittelwert dieser Kauf- und Verkaufspreise berechnet werden.

Derivate werden gemäss den vorhergehenden Abschnitten behandelt.

Festgelder und ähnliche Vermögenswerte werden zum jeweiligen Nennwert zuzüglich der aufgelaufenen Zinsen bewertet.

Der Bewertungspreis eines Geldmarktinstruments wird basierend auf dem Netto-Anschaffungspreis unter Beibehaltung der daraus resultierenden Anlagerendite schrittweise an den Rücknahmepreis angepasst. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen muss die Grundlage für die Bewertung verschiedener Anlagen an den neuen Marktrenditen ausgerichtet werden.

### d) Realisierte Nettogewinne/-verluste aus dem Verkauf von Wertpapieren der einzelnen Subfonds

Die aus Verkäufen von Wertpapieren resultierenden realisierten Gewinne oder Verluste werden auf der Basis des durchschnittlichen Einstandspreises berechnet.

### e) Umrechnung der ausländischen Währungen

Der Abschluss wird in der Referenzwährung der einzelnen Subfonds erstellt, und der konsolidierte Abschluss wird in EUR erstellt.

Bankguthaben und sonstige Nettovermögenswerte sowie der Wert von Wertpapieren des Portfolios, die auf andere Währungen lauten als die Referenzwährung des jeweiligen Subfonds, werden zu dem am Bewertungstag geltenden Wechselkurs in die Referenzwährung umgerechnet.

Erträge und Aufwendungen, die auf eine andere als die Referenzwährung jedes Subfonds lauten, werden zu dem Wechselkurs, der an dem Tag gilt, an dem sie dem Subfonds entstehen, in die Referenzwährung umgerechnet.

Realisierte Währungsgewinne oder -verluste werden in der "Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderungen des Nettovermögens" ausgewiesen.

Der Einstandswert der Wertpapiere in anderen Währungen als der Referenzwährung des jeweiligen Subfonds wird zu dem am Tag des Erwerbs geltenden Wechselkurs in die Referenzwährung umgerechnet.

### f) Gründungskosten jedes Subfonds

Die Gründungskosten werden über einen Zeitraum von fünf Jahren abgeschrieben.

### g) Buchung von Wertpapiertransaktionen der einzelnen Subfonds

Die Wertpapiergeschäfte werden an den Transaktionstagen gebucht.

### h) Bewertung von Finanzterminkontrakten der einzelnen Subfonds

Noch nicht fällige Finanzterminkontrakte werden mit den am Bewertungstag gültigen Marktpreisen bewertet, und die daraus resultierenden nicht realisierten Gewinne oder Verluste werden in der "Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Nettovermögens" verbucht und unter "Nicht realisierter Nettogewinn/-verlust aus Finanzterminkontrakten" in der Aufstellung des Nettovermögens ausgewiesen. Realisierte Gewinne oder Verluste werden auch in der "Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Nettovermögens" unter "Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Finanzterminkontrakten" verbucht.

### i) Bewertung von Devisenterminkontrakten der einzelnen Subfonds

Noch nicht fällige Devisenterminkontrakte werden mit den am Bewertungstag gültigen Terminwechsellkursen bewertet, und die daraus resultierenden nicht realisierten Gewinne oder Verluste werden in der "Ertrags- und Aufwandsrechnung" verbucht und unter "Nichtrealisierter Nettogewinn/-verlust aus Devisentermingeschäften" in der Nettovermögensaufstellung ausgewiesen. Realisierte Gewinne oder Verluste werden auch in der "Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Nettovermögens" unter "Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften" verbucht.

## Erläuterungen

### j) Bewertung von Optionen jedes Subfonds

Noch nicht fällige Optionen werden mit den am Bewertungstag gültigen Marktsätzen bewertet, und die daraus resultierenden Veränderungen der nicht realisierten Gewinne oder Verluste werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung verbucht. Realisierte und nicht realisierte Gewinne oder Verluste werden in der "Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderungen des Nettovermögens" ausgewiesen.

### k) Bewertung von Swaps

An jedem Bewertungstag werden Swap-Vereinbarungen zum Nettobarwert der künftigen Cashflows anhand der betreffenden Zinsstrukturkurve am Bewertungstag bewertet.

Asset-Swap-Kontrakte und die mit den Asset-Swaps verbundenen Wertpapiere werden nicht neu bewertet, da das Wertpapier und der Asset-Swap für die Zwecke der Bewertung als ein einziges Instrument betrachtet werden.

Die daraus resultierenden nicht realisierten Gewinne und Verluste werden unter "Nicht realisierter Nettogewinn/-verlust aus Swap-Kontrakten" in der Aufstellung des Nettovermögens ausgewiesen. Realisierte Gewinne oder Verluste werden auch in der "Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Nettovermögens" unter "Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Swap-Kontrakten" verbucht.

### l) Zuordnung der Aufwendungen

Jedem Subfonds werden die Aufwendungen belastet, die ihm direkt zugerechnet werden können. Nicht direkt zurechenbare Aufwendungen werden proportional zum Nettovermögen der jeweiligen Subfonds zwischen den Subfonds aufgeteilt.

### m) Buchung von Erträgen

Dividenden werden zum Ex-Dividenddatum gebucht, nach Abzug der Quellensteuer. Zinsen werden auf täglicher Basis gebucht.

## Gebühren und Aufwendungen

(siehe Einzelheiten auf Subfondsebene)

- Für seine Anlageverwaltungsdienste erhält der Anlageverwalter eine Anlageverwaltungsgebühr, die von der jeweiligen Aktienklasse abhängt.

Für den Subfonds Cape Capital SICAV-UCITS - Cape Fixed Income Fund gelten folgende Sätze:

- Institutional A: 0,30% p.a.
- Institutional B: 0,50% p.a.
- Limited A: 0,10% p.a.
- Internal A: 0,30% p.a.
- Retail A: 0,80% p.a.

Für den Subfonds Cape Capital SICAV-UCITS - Cape Equity Fund gelten folgende Sätze:

- Institutional A: 0,50% p.a.
- Institutional B: 1,00% p.a.
- Limited A: 0,10% p.a.
- Internal A: 0,50% p.a.
- Retail A: 1,50% p.a.

Für den Subfonds Cape Capital SICAV-UCITS - Cape Select Bond Fund gelten folgende Sätze:

- Institutional A: 0,20% p.a.
- Institutional B: 0,25% p.a.
- Internal A: 0,25% p.a.
- Retail A: 0,35% p.a.

Die Verwaltungsgesellschaft erhält für ihre Dienstleistungen eine Verwaltungsgebühr. Die Anlageverwaltungsgebühr wird aus der Verwaltungsgebühr bezahlt.

Die Verwaltungsgebühr besteht aus der Anlageverwaltungsgebühr für die jeweiligen Anteilsklassen zuzüglich höchstens 0,05% p.a. (mit Ausnahme des Subfonds Cape Capital SICAV-UCITS - Cape Equity Fund mit höchstens 0,04% p.a.) für die von der Verwaltungsgesellschaft erbrachten Dienstleistungen.

Die Verwaltungsgebühr und die Anlageverwaltungsgebühr werden monatlich auf der Basis des durchschnittlichen Nettoinventarwerts der betreffenden Klasse berechnet und sind monatlich rückwirkend in dem Monat zahlbar, der auf das Ende des entsprechenden Monats folgt.

- Die Gebühr für die Rechnungslegungsdienste der zentralen Verwaltungsstelle, die aus dem Subfondsvermögen gezahlt wird, beläuft sich auf höchstens 0,04% p.a. (mit Ausnahme für den Cape Capital SICAV-UCITS - Cape Select Bond Fund mit höchstens 0,05% p.a.) und wird auf der Basis des durchschnittlichen monatlichen Nettoinventarwerts der betreffenden Klasse berechnet.

- Die an die Depotbank zu zahlende Gebühr, die aus dem Subfondsvermögen gezahlt wird, beläuft sich im Prinzip auf höchstens 0,04% p.a. (mit Ausnahme für den Subfonds Cape Capital SICAV-UCITS - Cape Fixed Income Fund mit höchstens 0,07% p.a.) und wird auf der Basis des durchschnittlichen monatlichen Nettoinventarwerts der betreffenden Klasse berechnet.

## "Taxe d'abonnement"

Nach den geltenden Gesetzen und Vorschriften unterliegt die Gesellschaft in Luxemburg auf Basis ihrer Anlagen einer "Taxe d'abonnement", die zu einem jährlichen Satz von 0,05% vierteljährlich zahlbar ist. Sie wird anhand des Nettovermögens jedes Subfonds am Ende jedes Quartals berechnet.

Der Satz beträgt jedoch 0,01% p.a.:

- bei einzelnen Subfonds, deren ausschliessliches Ziel die gemeinsame Anlage in Geldmarktinstrumenten und die Tätigkeit von Einlagen bei Kreditinstituten ist;
- bei einzelnen Subfonds, deren ausschliessliches Ziel die gemeinsame Anlage in Einlagen bei Kreditinstituten ist; und
- bei einzelnen Subfonds und bei einzelnen Klassen, wenn die Anteile eines solchen Subfonds oder einer solchen Klasse einem oder mehreren institutionellen Anlegern vorbehalten sind.

## Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestandes

Die Aufstellung aller während der Berichtsperiode eingetretenen Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestandes kann von den Anlegern am Sitz der Verwaltungsgesellschaft oder der lokalen Vertreter in den Ländern, in denen die Gesellschaft registriert ist, kostenlos bezogen werden.

## Gesamtkostenquote (Total Expense Ratio, TER)

(siehe Einzelheiten auf Subfondsebene)

Die TER entspricht der Summe aller Kosten und Provisionen, die dem Subfondsvermögen laufend belastet werden, und zwar rückwirkend als Prozentsatz dieses Vermögens.

Die Total Expense Ratio ("TER") wurde auf Basis der aktuell gültigen Fassung der "Richtlinien zur Berechnung und Offenlegung der Total Expense Ratio (TER) von kollektiven Kapitalanlagen" der Asset Management Association Switzerland (AMAS) berechnet.

Die TER wird für die vergangenen 12 Monate berechnet.

Für Aktienklassen, die weniger als 6 Monate vor dem Abschlussdatum aufgelegt wurden, wird keine TER ausgewiesen.

## Fondsperformance

(siehe Einzelheiten auf Subfondsebene)

Die Performance basiert auf den am letzten Geschäftstag des Berichtszeitraums errechneten Nettoinventarwerten. Diese Nettoinventarwerte spiegeln die Marktpreise der Anlagen am letzten Geschäftstag des Jahres wider.

Die Performance seit Jahresbeginn (YTD) deckt das Jahr vom 01.01.2023 bis zum 30.06.2023 ab.

Die Performance in der Vergangenheit ist kein Hinweis auf gegenwärtige oder künftige Wertentwicklungen.

Bei den Performanceangaben sind bei der Zeichnung und Rücknahme von Aktien der Subfonds erhobene Kosten und Provisionen nicht berücksichtigt.

Für Aktien, die vor mehr als 3 Jahren aufgelegt wurden, wird keine Performance seit Auflegung ausgewiesen.

Die Performance von ausschüttenden Aktien versteht sich mit Wiederanlage der Dividenden.

## Transaktionskosten

Transaktionskosten beinhalten Brokergebühren, Stempelsteuern, lokale Steuern und andere ausländische Gebühren, die im Berichtszeitraum entstanden sind. Die Transaktionskosten sind in den Kosten der gekauften und verkauften Wertpapiere enthalten.

In dem am 30.06.2023 abgeschlossenen Berichtszeitraum entstanden der Gesellschaft folgende Transaktionskosten im Zusammenhang mit dem Kauf oder Verkauf von Wertpapieren und ähnlichen Geschäften (einschliesslich derivativer Finanzinstrumente oder anderer zulässiger Vermögenswerte):

Subfonds	Währung	Transaktionskosten
Cape Capital SICAV-UCITS - Cape Equity Fund	EUR	310.066,47
Cape Capital SICAV-UCITS - Cape Fixed Income Fund	EUR	165,00
Cape Capital SICAV-UCITS - Cape Select Bond Fund	EUR	0,00

Nicht alle Transaktionskosten sind einzeln identifizierbar. Bei festverzinslichen Anlagen, Devisenterminkontrakten und einigen anderen Derivatekontrakten sind die Transaktionskosten im Kauf- und Verkaufspreis der Anlage enthalten. Obwohl sie nicht einzeln identifizierbar sind, werden diese Transaktionskosten in der Performance der einzelnen Subfonds erfasst.

#### Derivative Finanzinstrumente

Der Subfonds kann Derivategeschäfte zum Zweck der effizienten Portfolioverwaltung tätigen. Details der Derivate sind in den Erläuterungen aufgeführt.

Je nach Art der gehaltenen Derivate können Sicherheiten von verschiedenen Gegenparteien entgegengenommen werden, um das Gegenparteirisiko zu mindern. Für andere Arten von Derivaten können Margenkonten genutzt werden.

Per 30.06.2023 hat folgender Subfonds folgende Vermögenswerte als Sicherheit von folgenden Gegenparteien in folgender Höhe erhalten:

Cape Capital SICAV-UCITS - Cape Fixed Income Fund:

Art	Gegenpartei	Währung	Betrag
Barmittel	Credit Suisse (Schweiz) AG	EUR	175.000,00
Barmittel	Goldman Sachs International London	USD	170.000,00
Barmittel	Citigroup Global Markets Limited - London	EUR	110.000,00

#### Barsicherheiten

In der folgenden Tabelle sind die Barsicherheiten aufgeführt, die in den Guthaben bei Banken und Maklern in der Aufstellung des Nettovermögens enthalten sind:

Subfonds	Art	Gegenpartei	Betrag
Cape Capital SICAV-UCITS - Cape Fixed Income Fund	Barmittel	UBS AG, Niederlassung London	EUR 110.000,00
Cape Capital SICAV-UCITS - Cape Fixed Income Fund	Barmittel	JP Morgan Securities Plc London	EUR 1.060.000,00
Cape Capital SICAV-UCITS - Cape Select Bond Fund	Barmittel	Credit Suisse (Schweiz) AG	EUR 145.000,00

#### Bedeutende Ereignisse während des Berichtszeitraums

Am 12. Juni 2023 wurde die Credit Suisse Group AG mit der UBS Group AG fusioniert. Das konsolidierte Unternehmen fungiert nun als konsolidierte Bankengruppe (die "Fusion"). Der Fonds bezieht verschiedene Dienstleistungen und unterhält Bankbeziehungen zu konsolidierten Tochtergesellschaften der Credit Suisse Group AG. Diese Beziehungen und Dienstleister können sich in der Zukunft infolge der Fusion ändern.

#### Krieg in der Ukraine

Ende Februar 2022 trat Osteuropa infolge der Militäraktion von Russland gegen die Ukraine (die "Situation") in eine Phase der Instabilität ein. In der Folge verhängten einige weltweit führende Länder, wie beispielsweise Kanada, die Europäische Union, Japan, Neuseeland, Taiwan, das Vereinigte Königreich und die Vereinigten Staaten, eine Reihe von Sanktionen gegen Russland, um gezielt wirtschaftlich wichtige Banken, Ölraffinerien, Militärexporte etc. lahmzulegen. Andererseits und in Anbetracht der sich verschlechternden Lage in der Ukraine aufgrund der vorherrschenden militärischen Situation scheinen eine Verschlechterung der wirtschaftlichen Lage und Volatilität in der Ukraine unausweichlich. Neben den direkten Auswirkungen auf die betreffenden Volkswirtschaften und Parteien Russland und die Ukraine sind auch Auswirkungen auf andere Volkswirtschaften unvermeidlich. Insbesondere sind die Wirtschaften Europas und Russland so stark verknüpft, dass die Auswirkungen die westliche Wirtschaft härter treffen und auch die US-Wirtschaft beeinträchtigen könnten.

Der Verwaltungsrat verfolgt eingehend die Auswirkungen der Situation auf die Anleger, die Anlagen und andere Stakeholder und ist zu dem Schluss gekommen, dass die Situation keine Auswirkungen auf den Abschluss zum 30.06.2023 hat und das Fortbestehen der Gesellschaft und ihrer Subfonds nicht gefährdet.

#### Ereignisse nach dem Bilanzstichtag

Nach dem Ende des Berichtszeitraums sind keine bedeutenden Ereignisse eingetreten.

## Technische Daten und Erläuterungen

### Technische Daten

		Valoren	ISIN	Verwaltungsgebühr	Total Expense Ratio
A - Thesaurierend	EUR	27388870	LU1200255203	0,54%	0,73%
B-Institutional - Thesaurierend	EUR	27385638	LU1200254495	1,04%	1,19%

### Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2022	2021	2020
A - Thesaurierend	EUR	7,33%	/	-11,62%	26,81%	9,92%
B-Institutional - Thesaurierend	EUR	7,09%	28,47%	-12,02%	26,23%	/

**Nettovermögensaufstellung (in EUR) und Fondsentwicklung**

		<b>30.06.2023</b>			
<b>Aktiva</b>					
Wertpapierbestand zum Marktwert		414.613.948,36			
Bareinlagen bei Banken und Brokern		3.841.593,11			
Forderungen aus Erträgen		240.325,14			
		<b>418.695.866,61</b>			
<b>Passiva</b>					
Bankverbindlichkeiten und sonstige Rückstellungen für Aufwendungen		742.962,42			
Andere Passiva		247,93			
		<b>1.015.489,00</b>			
<b>Nettovermögen</b>		<b>417.680.377,61</b>			
<b>Teilfondsentwicklung</b>					
		<b>30.06.2023</b>	<b>31.12.2022</b>	<b>31.12.2021</b>	
<b>Teilfondsvermögen</b>	<b>EUR</b>	<b>417.680.377,61</b>	<b>257.975.183,03</b>	<b>210.793.499,83</b>	
<b>Nettoinventarwert pro Aktie</b>					
A - Thesaurierend	EUR	192,44	179,31	202,87	
B-Institutional - Thesaurierend	EUR	128,47	119,97	136,36	
<b>Anzahl der Aktien im Umlauf</b>					
		<b>am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>zu Beginn der Berichtsperiode</b>	<b>Anzahl der ausgegebenen Aktien</b>	<b>Anzahl der zurückgenommenen Aktien</b>
A - Thesaurierend	EUR	2.159.785,903	1.425.348,006	755.353,169	20.915,272
B-Institutional - Thesaurierend	EUR	15.885,202	20.008,734	4.164,098	8.287,630

**Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Netto-Teilfondsvermögen (in EUR)**Für die Periode vom  
01.01.2023 bis zum  
30.06.2023

<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>	<b>257.975.183,03</b>
<b>Erträge</b>	
Dividenden (Netto)	3.192.054,33
Bankzinsen	37.520,57
	<b>3.229.574,90</b>
<b>Aufwendungen</b>	
Verwaltungsgebühr	869.400,90
Depotbank- und Depotgebühr	59.241,18
Zentralverwaltungsvergütung	53.606,40
Druck- und Veröffentlichungskosten	1.201,11
Zinsen und Bankspesen	2.613,55
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	108.058,37
"Taxe d'abonnement"	91.976,46
	<b>1.186.097,97</b>
<b>Nettoerträge (-verluste)</b>	<b>2.043.476,93</b>
<b>Realisierter Gewinn (Verlust)</b>	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	4.026.196,69
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	-370.679,34
	<b>3.655.517,35</b>
<b>Realisierter Nettogewinn (-verlust)</b>	<b>5.698.994,28</b>
<b>Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)</b>	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	16.672.874,05
	<b>16.672.874,05</b>
<b>Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung</b>	<b>22.371.868,33</b>
<b>Zeichnungen / Rücknahmen</b>	
Zeichnungen	142.340.482,90
Rücknahmen	-5.007.156,65
	<b>137.333.326,25</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>417.680.377,61</b>

## Aufstellung des Wertpapierbestandes

### Geographische Aufteilung

Vereinigte Staaten	36,79
Frankreich	12,56
Schweiz	11,92
Deutschland	8,51
Hongkong	6,66
Irland	4,36
Taiwan	4,27
Japan	4,19
Niederlande	3,39
Grossbritannien	3,36
Finnland	3,26
<b>Total</b>	<b>99,27</b>

### Wirtschaftliche Aufteilung

Elektronik und Halbleiter	19,73
Chemie	11,27
Pharmazeutik, Kosmetik und med. Produkte	9,74
Elektrische Geräte und Komponenten	6,85
Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	4,99
Telekommunikation	4,68
Maschinenbau und Industrieanlagen	4,62
Verpackungsindustrie	4,46
Landwirtschaft und Fischerei	4,23
Internet, Software und IT-Dienstleistungen	4,21
Energie- und Wasserversorgung	4,20
Fotografie und Optik	3,58
Gesundheits- und Sozialdienste	3,55
Versicherungsgesellschaften	3,38
Textilien, Bekleidung und Lederwaren	3,28
Petroleum	3,26
Nahrungsmittel und alkoholfreie Getränke	1,78
Länder und Zentralregierungen	1,47
<b>Total</b>	<b>99,27</b>

### Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in EUR)	% des Nettovermö- gens
<b>Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere</b>			
<b>Aktien</b>			
HKD AIA GROUP	1.525.800	14.116.376,01	3,38
EUR AIR LIQUIDE	91.510	15.025.942,00	3,60
USD ALBEMARBLE CORPORATION	91.700	18.751.011,00	4,49
CHF ALCON INC	195.200	14.819.240,82	3,55
HKD ANTA SPORTS PRODUCTS	1.463.400	13.701.670,23	3,28
EUR ASML HOLDING	21.350	14.155.050,00	3,39
USD BALL	349.200	18.631.468,38	4,46
USD BRISTOL MYERS SQUIBB	122.800	7.198.038,50	1,72
USD CORNING	608.800	19.553.026,58	4,68
USD CORTEVA INC	336.300	17.662.685,61	4,23
USD DARLING INGREDIENTS	239.700	17.523.247,48	4,20
USD DEERE & CO	52.000	19.312.447,30	4,62
EUR DSM-FIRMENICH AG	68.929	6.797.777,98	1,63
EUR ESSILORLUXOTTICA	96.600	14.947.160,00	3,58
JPY HITACHI	310.500	17.516.932,81	4,19
EUR INFINEON TECHNOLOGIES (REG. SHARES)	409.200	15.461.622,00	3,70
CHF LONZA REG	24.300	13.279.668,05	3,18
GBP LSE GROUP	144.000	14.038.384,90	3,36
USD MEDTRONIC	225.700	18.226.637,03	4,36
USD MICROSOFT	56.300	17.573.237,40	4,21
EUR NESTE OYJ	385.800	13.603.308,00	3,26
CHF NESTLE REG	67.300	7.419.169,10	1,78
CHF NOVARTIS REG	81.000	7.468.879,67	1,79
EUR SANOFI	79.300	7.787.260,00	1,86
EUR SCHNEIDER ELECTRIC	88.200	14.681.772,00	3,52
EUR SIEMENS REG	91.300	13.926.902,00	3,33
USD TAIWAN SEMICONDUCTOR ADR	192.800	17.834.441,80	4,27
USD THERMO FISHER SCIENTIFIC	36.500	17.455.430,80	4,18
<b>Total Aktien</b>		<b>408.467.807,45</b>	<b>97,79</b>
<b>Total börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere</b>			
		<b>408.467.807,45</b>	<b>97,79</b>
<b>Geldmarktinstrumente</b>			
EUR GERMAN TREASURY BILL 0%/22-230823	6.170.000	6.146.140,91	1,47
<b>Total Geldmarktinstrumente</b>		<b>6.146.140,91</b>	<b>1,47</b>
<b>Total des Wertpapierbestandes</b>		<b>414.613.948,36</b>	<b>99,27</b>
Bareinlagen bei Banken und Brokern		3.841.593,11	0,92
Bankverbindlichkeiten und sonstige		-742.962,42	-0,18
Andere Passiva		-32.201,44	-0,01
<b>Teilfondsvermögen</b>		<b>417.680.377,61</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.  
Mögliche Differenzen im Prozentsatz des Nettofondsvermögens sind das Resultat von Rundungen.

## Technische Daten und Erläuterungen

### Technische Daten

		Valoren	ISIN	Verwaltungsgebühr	Total Expense Ratio
A-Internal - Thesaurierend	EUR	27384778	LU1200253687	0,34%	0,56%
A-Retail - Thesaurierend	EUR	37224827	LU1635380246	0,84%	1,05%
B-Institutional - Thesaurierend	EUR	27381385	LU1200252796	0,54%	0,71%
A-Internal - Thesaurierend	CHF	27384781	LU1200253760	0,34%	0,55%
A-Retail - Thesaurierend	CHF	37224830	LU1635380592	0,84%	1,05%
B-Institutional - Thesaurierend	CHF	27384704	LU1200252952	0,54%	0,71%
B-Institutional - Ausschüttend	CHF	42965940	LU1860542452	0,54%	0,71%
A-Internal - Thesaurierend	GBP	27384845	LU1200254222	0,34%	0,56%
B-Institutional - Thesaurierend	GBP	27384777	LU1200253414	0,54%	0,71%
A-Internal - Thesaurierend	USD	27384844	LU1200254065	0,34%	0,56%
B-Institutional - Thesaurierend	USD	27384775	LU1200253257	0,54%	0,71%

### Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2022	2021	2020
A-Internal - Thesaurierend	EUR	0,74%	/	-8,46%	1,48%	2,42%
A-Retail - Thesaurierend	EUR	0,49%	/	-8,90%	0,98%	1,91%
B-Institutional - Thesaurierend	EUR	0,66%	/	-8,61%	1,32%	2,26%
A-Internal - Thesaurierend	CHF	-0,14%	/	-8,73%	1,27%	2,15%
A-Retail - Thesaurierend	CHF	-0,40%	/	-9,18%	0,76%	1,64%
B-Institutional - Thesaurierend	CHF	-0,23%	/	-8,89%	1,10%	2,02%
B-Institutional - Ausschüttend	CHF	-0,21%	/	-8,89%	1,10%	1,99%
A-Internal - Thesaurierend	GBP	1,40%	/	-6,96%	2,20%	3,10%
B-Institutional - Thesaurierend	GBP	1,32%	/	-7,11%	2,05%	2,93%
A-Internal - Thesaurierend	USD	1,83%	/	-6,42%	2,25%	3,95%
B-Institutional - Thesaurierend	USD	1,76%	/	-6,58%	2,14%	3,79%

### Erläuterungen

#### Devisentermingeschäfte

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
Gegenpartei					(In EUR)
CHF	800.000	EUR	-822.076	23.08.2023	-115,72
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	19.137	GBP	-16.500	23.08.2023	-43,15
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>					
CHF	9.815.000	EUR	-10.105.440	23.08.2023	-21.014,86
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>					
CHF	9.780.000	EUR	-10.007.357	23.08.2023	41.107,69
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	4.766.547	CHF	-4.650.000	23.08.2023	-11.066,02
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	368.000	EUR	-376.847	23.08.2023	1.254,88
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	576.658	USD	-640.000	23.08.2023	-8.379,24
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>					
CHF	330.000	EUR	-339.212	23.08.2023	-153,25
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>					
EUR	416.908	USD	-460.000	23.08.2023	-3.580,67
<i>Citigroup Global Markets Limited - London - Vereinigtes Königreich</i>					
EUR	292.997	CHF	-285.000	23.08.2023	172,91
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	1.400.000	EUR	-1.438.117	23.08.2023	313,55
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>					
CHF	9.780.000	EUR	-10.001.391	23.08.2023	47.074,05
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					

**Technische Daten und Erläuterungen (Fortsetzung)****Devisentermingeschäfte**

<b>Käufe</b>		<b>Verkäufe</b>		<b>Fälligkeit</b>	<b>Bewertung</b>
<i>Gegenpartei</i>					(In EUR)
EUR	22.574	GBP	-20.000	23.08.2023	-675,32
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>					
EUR	407.639	USD	-450.000	23.08.2023	-3.709,48
<i>Citigroup Global Markets Limited - London - Vereinigtes Königreich</i>					
GBP	70.000	EUR	-79.140	23.08.2023	2.227,51
<i>UBS AG - London - United Kingdom</i>					
CHF	3.300.000	EUR	-3.380.133	23.08.2023	10.453,14
<i>Citigroup Global Markets Limited - London - Vereinigtes Königreich</i>					
CHF	9.750.000	EUR	-9.986.040	23.08.2023	31.601,29
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	48.511.113	EUR	-43.727.263	23.08.2023	615.983,90
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>					
GBP	4.844.663	EUR	-5.477.389	23.08.2023	154.041,02
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>					
EUR	63.886.731	USD	-70.875.390	23.08.2023	-901.815,96
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>					
EUR	44.069.190	GBP	-38.977.458	23.08.2023	-1.241.244,96
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>					
CHF	292.654.737	EUR	-299.665.409	23.08.2023	1.022.815,04
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	9.900.000	EUR	-10.107.311	23.08.2023	64.447,82
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	44.348	USD	-49.000	23.08.2023	-443,80
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>					
EUR	22.490	GBP	-20.000	23.08.2023	-760,25
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>					
EUR	109.208	USD	-120.000	23.08.2023	-483,49
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>					
CHF	9.755.000	EUR	-10.085.398	23.08.2023	-62.619,05
<i>UBS AG - London - United Kingdom</i>					
EUR	1.092.852	CHF	-1.055.000	23.08.2023	8.866,65
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	9.750.000	EUR	-10.073.042	23.08.2023	-55.401,15
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	1.565.071	CHF	-1.515.000	23.08.2023	8.459,94
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	405.707	USD	-450.000	23.08.2023	-5.646,46
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>					
CHF	2.773.000	EUR	-2.864.305	23.08.2023	-15.185,53
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	2.766.000	EUR	-2.852.917	23.08.2023	-10.989,19
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	1.500.000	EUR	-1.541.950	23.08.2023	-774,71
<i>JP Morgan Securities PLC - London - United Kingdom</i>					
EUR	824.149	CHF	-798.000	23.08.2023	4.232,00
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	9.815.000	EUR	-10.045.813	23.08.2023	38.613,01
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
<b>Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften</b>					<b>-292.437,86</b>

**Nettovermögensaufstellung (in EUR) und Fondsentwicklung**

		<b>30.06.2023</b>			
<b>Aktiva</b>					
Wertpapierbestand zum Marktwert		502.705.454,16			
Bareinlagen bei Banken und Brokern		18.183.408,36			
Forderungen aus Zeichnungen		3.103,16			
Forderungen aus Erträgen		5.396.875,69			
		<b>526.288.841,37</b>			
<b>Passiva</b>					
Bankverbindlichkeiten und sonstige		2.288.112,05			
Verbindlichkeiten aus Rücknahmen		11.997.038,45			
Rückstellungen für Aufwendungen		280.360,84			
Nichtrealisierter Nettoverlust aus Devisentermingeschäften		292.437,86			
		<b>14.857.949,20</b>			
<b>Nettovermögen</b>		<b>511.430.892,17</b>			
<b>Teilfondsentwicklung</b>		<b>30.06.2023</b>	<b>31.12.2022</b>	<b>31.12.2021</b>	
<b>Teilfondsvermögen</b>	<b>EUR</b>	<b>511.430.892,17</b>	<b>398.203.653,81</b>	<b>413.592.464,10</b>	
<b>Nettoinventarwert pro Aktie</b>					
A-Internal - Thesaurierend	EUR	107,72	106,93	116,81	
A-Retail - Thesaurierend	EUR	95,18	94,72	103,97	
B-Institutional - Thesaurierend	EUR	106,38	105,68	115,63	
A-Internal - Thesaurierend	CHF	103,33	103,48	113,38	
A-Retail - Thesaurierend	CHF	92,73	93,10	102,51	
B-Institutional - Thesaurierend	CHF	101,77	102,00	111,95	
B-Institutional - Ausschüttend	CHF	93,08	93,28	102,38	
A-Internal - Thesaurierend	GBP	110,19	108,67	116,80	
B-Institutional - Thesaurierend	GBP	103,30	101,95	109,75	
A-Internal - Thesaurierend	USD	109,04	107,08	114,43	
B-Institutional - Thesaurierend	USD	122,74	120,62	129,11	
<b>Anzahl der Aktien im Umlauf</b>		<b>am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>zu Beginn der Berichtsperiode</b>	<b>Anzahl der ausgegebenen Aktien</b>	<b>Anzahl der zurückgenommenen Aktien</b>
A-Internal - Thesaurierend	EUR	309.700,903	403.591,729	19.552,388	113.443,214
A-Retail - Thesaurierend	EUR	26.292,279	22.031,738	4.958,586	698,045
B-Institutional - Thesaurierend	EUR	417.133,718	478.525,038	37.076,743	98.468,063
A-Internal - Thesaurierend	CHF	2.945.683,636	1.734.319,752	1.232.302,925	20.939,041
A-Retail - Thesaurierend	CHF	71.969,317	76.583,550	2.847,997	7.462,230
B-Institutional - Thesaurierend	CHF	609.098,239	658.186,650	61.395,695	110.484,106
B-Institutional - Ausschüttend	CHF	6.835,000	1.815,000	5.515,000	495,000
A-Internal - Thesaurierend	GBP	7.993,040	8.848,040	0,000	855,000
B-Institutional - Thesaurierend	GBP	38.493,000	38.643,000	0,000	150,000
A-Internal - Thesaurierend	USD	315.592,544	248.719,105	66.873,439	0,000
B-Institutional - Thesaurierend	USD	98.965,879	130.695,790	1.100,892	32.830,803

**Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Netto-Teilfondsvermögen (in EUR)**Für die Periode vom  
01.01.2023 bis zum  
30.06.2023

<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>	<b>398.203.653,81</b>
<b>Erträge</b>	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	7.161.206,82
Dividenden (Netto)	218.663,07
Bankzinsen	221.866,86
	<b>7.601.736,75</b>
<b>Aufwendungen</b>	
Verwaltungsgebühr	923.753,86
Depotbank- und Depotgebühr	78.054,83
Zentralverwaltungsvergütung	72.419,88
Druck- und Veröffentlichungskosten	1.201,15
Zinsen und Bankspesen	84.197,01
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	255.712,05
"Taxe d'abonnement"	92.985,14
	<b>1.508.323,92</b>
<b>Nettoerträge (-verluste)</b>	<b>6.093.412,83</b>
<b>Realisierter Gewinn (Verlust)</b>	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-8.068.155,09
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Swapkontrakten	4.173.944,90
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	-2.389.431,03
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	922.288,59
	<b>-5.361.352,63</b>
<b>Realisierter Nettogewinn (-verlust)</b>	<b>732.060,20</b>
<b>Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)</b>	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	5.376.496,48
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Swapkontrakten	-3.362.787,26
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	1.675.651,28
	<b>3.689.360,50</b>
<b>Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung</b>	<b>4.421.420,70</b>
<b>Zeichnungen / Rücknahmen</b>	
Zeichnungen	149.869.517,56
Rücknahmen	-41.063.699,90
	<b>108.805.817,66</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>511.430.892,17</b>

## Aufstellung des Wertpapierbestandes

### Geographische Aufteilung

Irland	27,33
Frankreich	15,07
Niederlande	13,31
Grossbritannien	11,52
Deutschland	10,10
Belgien	4,10
Vereinigte Staaten	2,67
Italien	2,48
Kaimaninseln	2,02
Supranational	1,86
Schweden	1,77
Spanien	1,33
Luxemburg	1,20
Dänemark	1,00
Finnland	0,78
Österreich	0,57
Jersey	0,46
Schweiz	0,38
Portugal	0,34
<b>Total</b>	<b>98,29</b>

### Wirtschaftliche Aufteilung

Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	19,77
Länder und Zentralregierungen	17,80
Versicherungsgesellschaften	16,75
Hypotheken- und Finanzierungsinstitute (MBS, ABS)	10,82
Anlagefonds	9,35
Banken und andere Kreditinstitute	5,64
Energie- und Wasserversorgung	4,74
Telekommunikation	3,80
Supranationale Organisationen	1,86
Petroleum	1,74
Elektronik und Halbleiter	1,49
Elektrische Geräte und Komponenten	1,40
Diverse Dienstleistungen	1,37
Pharmazeutik, Kosmetik und med. Produkte	0,65
Nicht klassifizierbare / nicht klassifizierte Institute	0,52
Verkehr und Transport	0,29
Immobilien	0,26
Index	0,03
<b>Total</b>	<b>98,29</b>

### Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in EUR)	% des Nettovermö- gens
<b>Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere</b>			
<b>Anleihen</b>			
EUR AIB GROUP PLC SUB FF FRN/20-300531	1.000.000	908.130,00	0,18
EUR ALLIANZ FF 3.375%/14-PERPET	500.000	487.735,00	0,10
EUR ALLIANZ SE SUB FF FRN/22-070938	4.000.000	3.898.080,00	0,76
EUR ARGENTUM (ZURICH INS) (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN FRN/19-19.02.2049	7.000.000	6.141.940,00	1,20
EUR AROUNDTOWN FF 2.125%/18-PERPET	500.000	171.125,00	0,03
EUR AROUNDTOWN SA SUB FF FRN/21-PERPET	300.000	92.331,00	0,02
EUR ASR NEDERLAND NV SUB FF FRN/19-020549	3.000.000	2.610.480,00	0,51
EUR ASR NEDERLAND NV SUB FF FRN/22-071243	3.500.000	3.647.420,00	0,71
EUR ASSICURAZIONI GENERALI (SUBORDINATED) 3.875%/19-29.01.2029	2.000.000	1.923.080,00	0,38
EUR ATHORA NETHERLANDS FRN/22-310832	2.000.000	1.853.080,00	0,36
GBP AVIVA FF 6.125%/01-141136	3.000.000	3.365.740,26	0,66
GBP AVIVA PLC SUB FF FRN/22-PERPET	1.000.000	973.011,71	0,19
EUR AVIVA REG S FF 3.375%/15-041245	1.500.000	1.422.870,00	0,28
GBP AVIVA REG S FF 5.125%/15-040650	2.000.000	2.028.643,01	0,40
EUR AXA (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN 3.375%/16-06.07.2047	6.000.000	5.607.000,00	1,10
USD AXA 8.6%/00-15.12.2030	2.500.000	2.764.482,13	0,54
USD AXA FF 5.125%/17-170147	6.300.000	5.617.856,10	1,10
USD AXA S B REG S FF 6.379%/06-PERPET	3.055.000	2.980.263,11	0,58
EUR AXA SA SUB FF FRN/21-071041	1.000.000	762.060,00	0,15
EUR BANCO BPM SPA FF FRN/23-140628	2.500.000	2.486.850,00	0,49
EUR BANCO DE SABADELL SA FF FRN/23-070229	2.000.000	1.962.840,00	0,38
EUR BANK OF IRELAND GROUP FRN/23-040731	1.500.000	1.500.060,00	0,29
USD BARCLAYS BANK SUB S 1 FF FRN/05-PERPET	1.000.000	892.034,83	0,17
USD BARCLAYS PLC SUB FF FRN/21-PERPET	1.000.000	920.623,28	0,12
EUR BELGIUM OLO S 74 REG S 0.6%/15-220625	10.000.000	9.546.800,00	1,87
EUR BELGIUM S 78 144 A REG S 1%/16-220626	10.000.000	9.427.500,00	1,84
EUR BP CAPITAL MARKETS PLC (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN FRN/20-PERPETUAL	7.000.000	6.471.150,00	1,27
EUR BUINDESSCHATZANWEISUNGEN 2.5%/23-130325	20.000.000	19.754.000,00	3,86
EUR CATTOLICA ASS SUB FF 4.25%/17-141247	1.000.000	962.070,00	0,19
USD CLOVERIE PLC (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN 14-11.09.2044	2.500.000	2.194.042,16	0,43
USD CLOVERIE PLC FF 5.625%/16-240646	2.450.000	2.207.515,12	0,43
EUR CNP ASSURANCES SUB 1.25%/22-270129	2.000.000	1.656.500,00	0,32
EUR COFACE SA SUB 6%/22-220932	1.500.000	1.525.455,00	0,30
EUR COMMERZBANK AG SUB FF FRN/23-051033	2.000.000	1.986.890,00	0,39
CHF CPI PROPERTY GROUP SA 1.63%/18-251023	300.000	302.074,69	0,06
EUR CREDIT AGRICOLE ASSURANCES (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN 2.625%/18-29.01.2048	7.000.000	6.155.590,00	1,20
EUR CREDIT SUISSE AG 0.25%/21-010928	1.000.000	803.710,00	0,16
EUR CREDIT SUISSE GROUP AG FF FRN/20-140128	1.000.000	860.260,00	0,17
USD DEMETER INVESTMENTS FIX-TO-FRN 5.75%/15-15.08.2050	3.000.000	2.656.498,63	0,52
EUR DEUTSCHE POST AG CV 0.05%/17-300625	1.500.000	1.457.955,00	0,29
GBP DIRECT LINE SUB FF 4.75%/17-PERPET	300.000	233.808,77	0,05
USD DRESDNER FNDG TRUST I SUB 8.151%/300631	5.000.000	4.899.129,24	0,96
GBP ELI LILLY & CO 1.625%/21-140943	1.000.000	663.298,96	0,13
EUR ELM FF 3.375%/17-290947	6.000.000	5.420.280,00	1,06
EUR ELM FF 4.5%/16-PERPET	6.000.000	5.723.460,00	1,12
EUR ENBW (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN FRN/19-05.08.2079	5.000.000	4.268.650,00	0,83
EUR ENEL SPA SUB FF FRN/18-241181	1.500.000	1.380.360,00	0,27
EUR ENEL SPA SUB FF FRN/20-PERPET	3.000.000	2.602.500,00	0,51
EUR ENGIE SA SUB FF FRN/19-PERPET	5.000.000	4.637.550,00	0,91
EUR ENI SPA SUB FF FRN/21-PERPET	3.000.000	2.552.730,00	0,50
GBP ESURE GROUP 6.75%/14-191224	227.000	262.953,90	0,05
EUR ETHIAS SA SUB 6.75%/23-050533	2.000.000	1.992.020,00	0,39
EUR EUROCLEAR INVESTMENTS S.A. SUB FF FRN/18	3.500.000	3.161.130,00	0,62
EUR EUROPEAN UNION 0.8%/22-040725	10.000.000	9.490.100,00	1,86
EUR FIDELIDADE COMPA SE SUB FF FRN/21-040931	2.000.000	1.737.320,00	0,34
EUR FRANCE 0%/22-250225	20.000.000	18.942.200,00	3,70
EUR GOVERNOR & CO FF FRN/22-010333	4.000.000	4.066.440,00	0,80
EUR GROUPAMA ASSURANCE MUT. SUB 6%/17-230127	1.000.000	1.050.270,00	0,21
EUR GROUPE ACM SUB FF FRN/21-210442	1.000.000	734.770,00	0,14
EUR GRPM ASSURANCES MUTUELLE SUB 3.375%/240928	1.500.000	1.394.205,00	0,27
EUR HANNOVER RE SUB FF FRN/21-300642	1.000.000	736.380,00	0,14
EUR HELVETIA EUROPE SA SUB FF FRN/20-300941	3.000.000	2.390.340,00	0,47
GBP HSBC BANK FUNDING FF 5.844%/03-PERPET	2.000.000	2.343.529,69	0,46
EUR IBERDROLA INTL BV SUB FF FRN/20-PERPET	6.000.000	5.413.440,00	1,06
EUR INFINEON TECHNO AG SUB FF FRN/19-PERPET	8.000.000	7.629.680,00	1,49
EUR INTESA SANPAOLO VIT SUB 2.375%/20-221230	1.000.000	757.510,00	0,15
GBP JUST GROUP PLC SUB FF FRN/20-150431	3.500.000	3.910.668,30	0,76
EUR KONINKLIJKE KPN NV FF FRN/22-PERPET	3.500.000	3.549.245,00	0,69
USD LA MONDIALE FF 5.875%/17-260147	3.347.000	2.951.403,62	0,58
EUR LA POSTE SA SUB FF FRN/18-PERPET	6.000.000	5.580.900,00	1,09
EUR LIBERTY MUTUAL GRP S FF 144A FRN/230559	1.000.000	951.960,00	0,19
EUR MAPFRE SA SUB 2.875%/22-130430	4.000.000	3.446.480,00	0,67
EUR MAPFRE SA SUB FF FRN/18-070948	1.500.000	1.378.200,00	0,27
EUR MERCK KGAA (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN FRN/20-09.09.2080	3.000.000	2.683.260,00	0,52
EUR MUNICH RE (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN FRN/18-26.05.2049	3.000.000	2.729.850,00	0,53
EUR NETHERLANDS 0%/22-150126	15.000.000	13.897.500,00	2,72
EUR NGG FINANCE PLC SUB FF FRN/19-050982	5.000.000	4.318.350,00	0,84
EUR NN GROUP NV SUB FF FRN/23-031143	4.000.000	4.009.600,00	0,78

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

Mögliche Differenzen im Prozentsatz des Nettofondsvermögens sind das Resultat von Rundungen.

## Cape Capital SICAV-UCITS - Cape Fixed Income Fund

## Aufstellung des Wertpapierbestandes (Fortsetzung)

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in EUR)	% des Nettovermö- gens
EUR ORSTED A/S (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN FRN/19-09-12-3019	6.000.000	5.124.600,00	1,00
GBP PENSION INSURANCE 8%/16-231126	610.000	709.487,97	0,14
EUR PERMANENT TSB GROUP FF FRN/23-250428	1.000.000	1.002.230,00	0,20
EUR PERMANENT TSB GROUP FF FRN/23-300629	2.000.000	2.004.320,00	0,39
USD PHOENIX GRP HLD PLC SUB FF FRN/20-PERPET	3.000.000	2.431.127,41	0,48
GBP PRUDENTIAL PLC SUB FF FRN/18-201051	2.000.000	2.063.065,90	0,40
EUR RAFFEISEN BANK INTL FF FRN/23-260127	2.000.000	1.960.240,00	0,38
EUR REPSOL INTL FINANCE SUB FF FRN/20-PERPET	4.700.000	4.241.327,00	0,83
GBP ROTHESAY LIFE SUB 8%/15-301025	4.000.000	4.659.045,62	0,91
EUR RRE LOAN MANAGEMENT S 3X A FRN/19- 150732	1.600.000	1.563.920,00	0,31
EUR SAMPO OYJ SUB FF FRN/19-230549	4.500.000	4.012.785,00	0,78
EUR SCHNEIDER ELECTRIC SE CV 0%/20-150626	9.200	1.758.451,20	0,34
USD SOCIETE GENERALE SUB FF FRN/20-PERPET	1.000.000	681.842,35	0,13
USD STANDARD CHARTERED PLC SUB FF FRN/PERPET	2.000.000	1.770.394,13	0,35
EUR STEDIN HOLDING NV SUB FF FRN/21-PERPET	5.000.000	4.287.200,00	0,84
EUR TALANX AG (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN 2,25%/17-05-12-2047	6.000.000	5.236.500,00	1,02
EUR TELEFONICA EUROPE FF 3,875%/18-PERPET	5.000.000	4.631.350,00	0,91
EUR TELIA CO AB SUB FF FRN/20-110581	5.000.000	4.470.700,00	0,87
EUR TOTAL SE SUB FF FRN/21-PERPET	5.000.000	4.167.150,00	0,81
EUR TOTALENERGIES SE SUB FF FRN/22-PERPET	2.500.000	2.182.275,00	0,43
GBP UK TSY 0 3/8% 2026 0,375%/21-221026	7.000.000	6.990.537,78	1,37
GBP UK TSY 0 5/8% 2025 0,625%/19-07-06-2025	5.000.000	5.337.877,99	1,04
USD US TREASURY N/B 3,625%/23-150526	8.000.000	7.155.132,91	1,40
EUR VATTENFALL AB FF 15-190377	5.000.000	4.602.250,00	0,90
EUR VEOLIA ENVIRONNEMENT FRN/21-PERPET	6.000.000	5.006.820,00	0,98
EUR VEOLIA ENVIRONNEMENT SA CV 0%/19-010125	28.000	903.195,00	0,18
EUR VIENNA INSURANCE FF FRN/22-150642	1.000.000	940.100,00	0,18
GBP VIRGIN MONEY UK PLC S 3 FF FRN/18-141228	1.000.000	1.156.895,65	0,23
EUR VODAFONE GROUP PLC S NCS FRN/20-270880	7.500.000	6.781.725,00	1,33
EUR VONOVIA SE 1,625%/21-010951	1.600.000	783.104,00	0,15
<b>Total Anleihen</b>		<b>365.192.859,42</b>	<b>71,41</b>

## Hypothesen, Asset-Back-Securities

EUR ACCUNIA EUROPEAN CLO 2X A FRN/17-151030	1.200.000	604.611,72	0,12
EUR ACCUNIA EUROPEAN CLO S 3X A FRN/200131	1.000.000	980.322,32	0,19
EUR ADAGIO CLO S X-X A FRN/22-200736	2.000.000	2.001.700,00	0,39
EUR ALME LOAN FUNDING BV 4X AR FRN/18-150132	2.500.000	2.384.080,23	0,47
EUR ANCHORAGE EUROPE CLO S 4X A FRN/21- 25043	2.800.000	2.715.300,00	0,53
EUR AQUEDUCT EUR S 2019-3X AR FRN/21-150834	2.000.000	1.939.300,00	0,38
EUR ARES EURO CLO S 14X A FRN/20-211033	2.000.000	1.970.520,00	0,39
EUR ARES EURO CLO S 8X AR FRN/19-170432	2.000.000	1.962.500,00	0,38
EUR ARES EURO CLO SUB 11X A2R FRN/21-150432	2.000.000	1.942.700,00	0,38
EUR AURIUM CLO S 3X AR FRN/19-160430	2.000.000	1.948.552,10	0,38
EUR AVOCA CLO S 21X A1 FRN/20-150433	2.000.000	1.951.300,00	0,38
EUR BARINGS 2018-2 B.V. A1A FRN/18-151031	3.000.000	2.936.910,74	0,57
EUR BILBAO CLO S 3X A1R FRN/21-170534	1.500.000	1.447.275,00	0,28
EUR BLACKROCK EU CLO DAC 7X AR FRN/21-151031	2.800.000	2.733.500,00	0,53
EUR BLACKROCK EUR CLO DAC S1X AR FRN/150331	2.000.000	1.798.911,72	0,35
EUR BLUEMOUNTAIN S 2016-1X AR FRN/18-250432	3.000.000	2.813.232,71	0,55
EUR BLUEMOUNTAIN S 3X A1R FRN/21-150131	3.400.000	3.304.125,53	0,65
EUR BOSPHORUS CLO S 5X A1 FRN/19-121232	1.500.000	1.470.375,00	0,29
EUR BRIDGEPOINT CLO S 1X A FRN/20-150134	2.000.000	1.973.700,00	0,39
EUR CAIRN CLO BV S 2016-7X A1R FRN/19-310130	1.200.000	1.006.977,60	0,20
EUR CAIRN CLO BV S 2018-9X A FRN/18-250432	2.000.000	1.965.385,07	0,38
USD CARBONE CLO LTD S 2017-1X A1 FRN/17-2001	3.000.000	2.655.321,08	0,52
EUR CARLYLE GL MKT STR S 15-1X FRN/20-160133	1.500.000	1.462.875,00	0,29
EUR CORDATUS CLO PLC S 10X A1 FRN/18-270131	2.000.000	1.940.921,54	0,38
EUR CORDATUS CLO PLC S 7X ARR FRN/21-150931	1.780.000	1.742.628,57	0,34
EUR DRYDEN LEV LN CDO S2013 FRN/18-150732	2.000.000	1.838.963,21	0,36
EUR DRYDEN LEVERAGED S17-59X A FRN/18- 150532	2.000.000	1.888.256,03	0,37
EUR HARVEST CLO S 17X AR FRN/19-110532	2.500.000	2.444.375,00	0,48
EUR HARVEST CLO S 20X AR FRN/21-201031	2.500.000	2.444.375,00	0,48
EUR HARVEST CLO S 22X AR FRN/21-150132	2.400.000	2.340.360,00	0,46
EUR JUBILEE CDO BV 16-17X A1RR FRN/21-150431	4.000.000	3.901.000,00	0,76
EUR JUBILEE CDO BV S 2014-12X ARRR FRN/21-15	3.000.000	2.943.150,00	0,58
EUR MADISON PK EUR FD S 10X A1 FRN/18-251030	2.000.000	1.962.793,90	0,38
EUR MADISON PK EUR FDNG 13X AR FRN/21-150132	2.000.000	1.950.000,00	0,38
EUR MAN GLG EURO CLO S 2X A1R FRN/19-150130	3.700.000	1.609.223,63	0,31
USD NEUBERGER BERMAN S 2019-31X AR FRN/21- 20	2.000.000	1.809.990,83	0,35
EUR OAK HILL EURP S 2015-4X A1R FRN/18-2001	3.000.000	2.729.882,14	0,53
EUR OAK HILL EURP S2017-6X A1R FRN/18-200132	2.000.000	1.646.986,19	0,32
EUR PALMER SQ EUR LN 23-1X A FRN/23-151132	1.500.000	1.482.075,00	0,29
EUR PALMER SQUARE -3X A FRN/22-120432	2.000.000	1.912.518,07	0,37
EUR PENTA CLO 3 S 2017-3X AR FRN/22-170435	2.000.000	1.928.500,00	0,38
EUR RRE LOAN MANAGS 6X A1 FRN/21-150435	1.200.000	1.165.560,00	0,23
EUR TORO EUROPEAN CLO S 7X AR FRN/21-150234	2.000.000	1.949.500,00	0,38
EUR VOYA EURO CLO S 6X A FRN/23-150437	2.000.000	1.993.100,00	0,39
<b>Total Hypothesen, Asset-Back-Securities</b>		<b>89.593.634,93</b>	<b>17,52</b>

Total börsennotierte / an einem geregelten Markt  
gehandelte Wertpapiere

454.786.494,35 88,92

## Nicht börsennotierte Wertpapiere

Anleihen	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in EUR)	% des Nettovermö- gens
GBP ESURE GROUP PLC FF FRN/23-201233	2.000.000	2.387.298,26	0,47
<b>Total Anleihen</b>		<b>2.387.298,26</b>	<b>0,47</b>

## Hypothesen, Asset-Back-Securities

USD ALLEGRO CLO LTD 2018-1X A FRN/18-130631	2.000.000	1.815.307,06	0,35
USD APIDOS CLO S 2017-27X A1R FRN/21-170730	1.700.000	1.529.366,18	0,30

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

Mögliche Differenzen im Prozentsatz des Nettofondsvermögens sind das Resultat von Rundungen.

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in EUR)	% des Nettovermö- gens
USD BARINGS CLO LTD 2016-II S 2016-2X AR2 F	2.807.000	2.546.239,73	0,50
<b>Total Hypothesen, Asset-Back-Securities</b>		<b>5.890.912,97</b>	<b>1,15</b>
<b>Swaptions</b>			
USD CALL SOFRRATE INDEX 16/11/2023 3.3525	5.000.000	139.046,75	0,03
EUR PUT ITRAXX EUROPE S39 1-V1 09/23 85	50.000.000	81.500,00	0,02
EUR PUT ITRAXX EUROPE S39 1-V1 09/23 85	50.000.000	81.500,00	0,02
EUR PUT ITRAXX EUROPE S39 1-V1 10/23 85	25.000.000	58.750,00	0,01
EUR PUT ITRAXX EUROPE S39 1-V1 10/23 85	25.000.000	58.750,00	0,01
<b>Total Swaptions</b>		<b>419.546,75</b>	<b>0,08</b>
<b>Nicht börsennotierte Wertpapiere</b>			
		<b>8.697.757,98</b>	<b>1,70</b>
<b>Investmentfonds</b>			
<b>Fondsanteile (Open-End)</b>			
GBP ISHARES - GBP CORPORATE BOND FUND	40.000	5.391.132,09	1,05
EUR ISHARES EURO CORPORATE BOND UCITS ETF	170.500	19.736.375,00	3,86
USD ISHARES PLC - ISHARES MARKIT IBOXX USD CORPORATE BOND	151.350	14.094.694,74	2,76
<b>Total Fondsanteile (Open-End)</b>		<b>39.221.201,83</b>	<b>7,67</b>
<b>Total Investmentfonds</b>		<b>39.221.201,83</b>	<b>7,67</b>
<b>Total des Wertpapierbestandes</b>		<b>502.705.454,16</b>	<b>98,29</b>
Bareinlagen bei Banken und Brokern			
		18.183.408,36	3,56
Bankverbindlichkeiten und sonstige			
		-2.288.112,05	-0,45
Andere Passiva			
		-7.169.858,30	-1,40
<b>Teilfondsvermögen</b>		<b>511.430.892,17</b>	<b>100,00</b>

## Technische Daten und Erläuterungen

### Technische Daten

		Valoren	ISIN	Verwaltungsgebühr	Total Expense Ratio
A-Institutional - Thesaurierend	EUR	47049046	LU1968841145	0,20%	0,44%
A-Internal - Thesaurierend	EUR	47049131	LU1968842978	0,25%	0,52%
B-Institutional - Thesaurierend	EUR	47049118	LU1968842036	0,25%	0,49%
A-Institutional - Thesaurierend	CHF	47049048	LU1968841491	0,20%	0,44%
A-Internal - Thesaurierend	CHF	47049133	LU1968843273	0,25%	0,52%
A-Retail - Thesaurierend	CHF	47049143	LU1968844164	0,35%	0,60%
B-Institutional - Thesaurierend	CHF	47049123	LU1968842200	0,25%	0,49%
B-Institutional - Thesaurierend	USD	47049119	LU1968842119	0,25%	0,49%

### Fondsperformance

		YTD	Seit Auflegung	2022	2021	2020
A-Institutional - Thesaurierend	EUR	1,08%	0,43%	-1,07%	0,24%	/
A-Internal - Thesaurierend	EUR	1,03%	/	-1,14%	0,14%	0,21%
B-Institutional - Thesaurierend	EUR	1,05%	/	-1,10%	0,19%	0,25%
A-Institutional - Thesaurierend	CHF	0,21%	-1,10%	-1,38%	/	/
A-Internal - Thesaurierend	CHF	0,15%	/	-1,46%	-0,03%	-0,10%
A-Retail - Thesaurierend	CHF	0,12%	-1,74%	-1,54%	-0,11%	/
B-Institutional - Thesaurierend	CHF	0,17%	/	-1,43%	0,02%	-0,05%
B-Institutional - Thesaurierend	USD	2,17%	/	0,88%	0,96%	1,62%

### Erläuterungen

#### Devisentermingeschäfte

Käufe		Verkäufe		Fälligkeit	Bewertung
<i>Gegenpartei</i>					(In EUR)
USD	84.500	EUR	-77.076	25.08.2023	156,04
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
EUR	15.282.320	CHF	-14.882.000	25.08.2023	-9.879,77
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	20.000	EUR	-18.532	25.08.2023	-252,63
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	16.036.872	CHF	-15.616.000	25.08.2023	-9.562,48
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	1.500.000	EUR	-1.550.293	25.08.2023	-8.944,85
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	6.500.000	EUR	-6.714.058	25.08.2023	-34.882,02
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	14.250.000	EUR	-14.583.212	25.08.2023	59.596,16
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	6.500.000	EUR	-6.672.847	25.08.2023	6.328,81
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	83.662	USD	-93.000	25.08.2023	-1.342,51
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	1.500.000	EUR	-1.535.372	25.08.2023	5.976,31
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	13.859.000	EUR	-12.563.434	25.08.2023	103.552,35
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	6.541.515	GBP	-5.787.900	25.08.2023	-186.110,92
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	1.500.000	EUR	-1.531.670	25.08.2023	9.677,86
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
CHF	485.000	EUR	-495.367	25.08.2023	3.002,71
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					

**Technische Daten und Erläuterungen (Fortsetzung)****Devisentermingeschäfte**

<b>Käufe</b>		<b>Verkäufe</b>		<b>Fälligkeit</b>	<b>Bewertung</b>
<i>Gegenpartei</i>					(In EUR)
CHF	1.000.000	EUR	-1.027.531	25.08.2023	34,84
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	49.000	EUR	-44.557	25.08.2023	228,50
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	3.487.000	EUR	-3.611.855	25.08.2023	-28.733,79
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	1.500.000	EUR	-1.550.867	25.08.2023	-9.518,67
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
CHF	5.675.000	EUR	-5.850.968	25.08.2023	-19.533,81
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	9.750.000	EUR	-10.006.137	25.08.2023	12.626,25
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	725.841	USD	-800.000	25.08.2023	-5.366,30
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
CHF	90.000	EUR	-91.676	25.08.2023	804,50
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	1.500.000	EUR	-1.534.158	25.08.2023	7.190,18
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
EUR	20.347.500	USD	-22.432.000	25.08.2023	-155.562,33
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	200.000	EUR	-204.654	25.08.2023	858,63
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	500.000	EUR	-516.514	25.08.2023	-2.731,25
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	570.000	EUR	-587.990	25.08.2023	-2.277,22
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	6.458.000	EUR	-6.663.647	25.08.2023	-27.628,99
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	15.150.000	EUR	-15.593.077	25.08.2023	-25.460,40
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
USD	70.481	EUR	-63.578	25.08.2023	840,62
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
GBP	600.000	EUR	-679.704	25.08.2023	17.662,13
<i>UBS AG London Branch - London - United Kingdom</i>					
USD	29.000	EUR	-26.290	25.08.2023	215,59
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	78.658.000	EUR	-80.465.908	25.08.2023	360.336,82
<i>Credit Suisse (Schweiz) AG - Zurich - Switzerland</i>					
CHF	1.500.000	EUR	-1.536.501	25.08.2023	4.847,09
<i>UBS AG - London - United Kingdom</i>					
<b>Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften</b>					<b>66.147,45</b>

**Nettovermögensaufstellung (in EUR) und Fondsentwicklung**

	<b>30.06.2023</b>
<b>Aktiva</b>	
Wertpapierbestand zum Marktwert	175.435.617,49
Bareinlagen bei Banken und Brokern	6.656.182,07
Forderungen aus Erträgen	2.765.621,71
Gründungskosten	6.433,80
Nichtrealisierter Nettomehrwert aus Devisentermingeschäften	66.147,45
	<b>184.930.002,52</b>
<b>Passiva</b>	
Bankverbindlichkeiten und sonstige Verbindlichkeiten aus Rücknahmen	241.098,40
Rückstellungen für Aufwendungen	3.538,91
	83.421,99
	<b>328.059,30</b>
<b>Nettovermögen</b>	<b>184.601.943,22</b>

<b>Teilfondsentwicklung</b>		<b>30.06.2023</b>	<b>31.12.2022</b>	<b>31.12.2021</b>
<b>Teilfondsvermögen</b>	<b>EUR</b>	<b>184.601.943,22</b>	<b>142.358.607,70</b>	<b>129.028.437,82</b>
<b>Nettoinventarwert pro Aktie</b>				
A-Institutional - Thesaurierend	EUR	100,43	99,36	100,43
A-Internal - Thesaurierend	EUR	100,38	99,36	100,51
B-Institutional - Thesaurierend	EUR	100,54	99,50	100,61
A-Institutional - Thesaurierend	CHF	98,90	98,69	100,07
A-Internal - Thesaurierend	CHF	98,57	98,42	99,88
A-Retail - Thesaurierend	CHF	98,26	98,14	99,67
B-Institutional - Thesaurierend	CHF	98,70	98,53	99,96
B-Institutional - Thesaurierend	USD	106,63	104,37	103,46

<b>Anzahl der Aktien im Umlauf</b>		<b>am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>zu Beginn der Berichtsperiode</b>	<b>Anzahl der ausgegebenen Aktien</b>	<b>Anzahl der zurückgenommenen Aktien</b>
A-Institutional - Thesaurierend	EUR	150.949,371	194.056,644	1.105,000	44.212,273
A-Internal - Thesaurierend	EUR	193.282,957	62.236,843	166.030,852	34.984,738
B-Institutional - Thesaurierend	EUR	61.588,530	187.161,841	1.300,000	126.873,311
A-Institutional - Thesaurierend	CHF	32.200,000	47.661,114	0,000	15.461,114
A-Internal - Thesaurierend	CHF	1.211.819,724	394.780,395	867.039,329	50.000,000
A-Retail - Thesaurierend	CHF	100,000	100,000	0,000	0,000
B-Institutional - Thesaurierend	CHF	52.638,873	353.307,632	3.495,000	304.163,759
B-Institutional - Thesaurierend	USD	131.722,201	193.216,416	1.048,129	62.542,344

**Ertrags- und Aufwandsrechnung / Veränderung des Netto-Teilfondsvermögen (in EUR)**Für die Periode vom  
01.01.2023 bis zum  
30.06.2023

<b>Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode</b>	<b>142.358.607,70</b>
<b>Erträge</b>	
Zinsen auf den Wertpapierbestand (Netto)	1.930.508,06
Bankzinsen	152.287,21
	<b>2.082.795,27</b>
<b>Aufwendungen</b>	
Verwaltungsgebühr	177.201,89
Depotbank- und Depotgebühr	32.525,34
Zentralverwaltungsvergütung	26.890,37
Druck- und Veröffentlichungskosten	1.201,11
Zinsen und Bankspesen	18.429,78
Kosten für Prüfung, Rechtsberatung, Vertreter u.a.	100.575,05
"Taxe d'abonnement"	26.174,26
Abschreibung der Gründungskosten	2.723,14
	<b>385.720,94</b>
<b>Nettoerträge (-verluste)</b>	<b>1.697.074,33</b>
<b>Realisierter Gewinn (Verlust)</b>	
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapieren	-893.825,47
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Swapkontrakten	20.333,34
Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Devisentermingeschäften	158.300,28
Realisierter Nettowährungsgewinn (-verlust)	-464.764,98
	<b>-1.179.956,83</b>
<b>Realisierter Nettogewinn (-verlust)</b>	<b>517.117,50</b>
<b>Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung)</b>	
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Wertpapieren	764.500,78
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Swapkontrakten	-11.397,83
Veränderung des (der) nicht realisierten Nettomehrwertes (-wertminderung) aus Devisentermingeschäften	380.324,82
	<b>1.133.427,77</b>
<b>Nettoerhöhung (-minderung) des Nettovermögens gemäss Ertrags- und Aufwandsrechnung</b>	<b>1.650.545,27</b>
<b>Zeichnungen / Rücknahmen</b>	
Zeichnungen	104.453.051,42
Rücknahmen	-63.860.261,17
	<b>40.592.790,25</b>
<b>Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>184.601.943,22</b>

## Aufstellung des Wertpapierbestandes

### Geographische Aufteilung

Niederlande	22,81
Grossbritannien	18,26
Frankreich	16,03
Deutschland	12,26
Irland	5,41
Belgien	4,43
Schweiz	4,01
Italien	3,80
Vereinigte Staaten	3,75
Österreich	2,16
Spanien	1,85
Luxemburg	0,22
Finnland	0,05
<b>Total</b>	<b>95,03</b>

### Wirtschaftliche Aufteilung

Banken und andere Kreditinstitute	27,90
Versicherungsgesellschaften	24,86
Finanz-, Investitions- und andere Div. Firmen	16,55
Länder und Zentralregierungen	10,41
Energie- und Wasserversorgung	3,92
Elektrische Geräte und Komponenten	2,40
Petroleum	2,17
Diverse Dienstleistungen	1,84
Verkehr und Transport	1,66
Fahrzeuge	1,06
Telekommunikation	0,80
Hypotheken- und Finanzierungsinstitute (MBS, ABS)	0,71
Einzelhandel und Warenhäuser	0,54
Immobilien	0,22
<b>Total</b>	<b>95,03</b>

### Aufstellung des Wertpapierbestandes

Beschreibung	Anzahl / Nennwert	Bewertung (in EUR)	% des Nettvermö- gens
<b>Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere</b>			
<b>Anleihen</b>			
EUR AEGON FF 4%/14-250444	6.500.000	6.377.995,00	3,45
EUR ALLIANZ SE FIX-TO-FRN (SUBORDINATED) 6,25%13-PERPETUAL	2.000.000	1.993.140,00	1,08
EUR AQUARIUS & INVESTMENTS FIX-TO-FLOATER 4,25%/13-02.10.2043	5.709.000	5.686.164,00	3,08
EUR AUCHAN HOLDING SADIR 2.625%/19-300124	1.000.000	988.510,00	0,54
EUR AVIVA FF 3,875%/14-030744	5.150.000	5.046.897,00	2,73
EUR AVIVA FF 6,125%/13-050743	6.000.000	6.002.280,00	3,25
EUR AXA FF 13-040743	8.000.000	7.999.520,00	4,33
EUR BANCO DE SABADELL SA 1.625%/18-070324	1.000.000	983.320,00	0,53
EUR BANCO DE SABADELL SA 1.75%/19-10.05.2024	2.500.000	2.440.700,00	1,32
EUR BARCLAYS PLC FF FRN/19-090625	5.000.000	4.812.400,00	2,61
EUR BPCE 4,625%/13-18.07.2023	1.000.000	1.000.000,00	0,54
USD BPCE 5,75%/13-231023	2.000.000	1.824.766,27	0,99
USD BPCE REG S 5,15%/14-210724	1.000.000	976.130,00	0,49
EUR BUNDESSCHATZANW 0%/22-150324	1.000.000	976.130,00	0,53
USD CLOVERIE PLC (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN 14-11.09.2044	1.500.000	1.315.462,88	0,71
EUR COMMERZBANK 0,5%/16-130923	4.300.000	4.273.555,00	2,32
USD COMMERZBANK T 1 REG S 8,125%/13-190923	4.000.000	3.660.898,26	1,98
CHF CPI PROPERTY GROUP SA 1,63%/18-251023	400.000	400.799,14	0,22
EUR CREDIT SUISSE GROUP FINANCE FIX-TO-FRN 1,25%/17-17.07.2025	3.500.000	3.349.500,00	1,81
USD CREDIT SUISSE NEW YORK 0,495%/21-020224	1.500.000	1.320.783,68	0,72
EUR CTP BV 0,625%/20-271123	500.000	489.445,00	0,27
EUR DELTA LLOYD FF 4,375%/14-PERPET	4.000.000	3.948.280,00	2,14
EUR DEUTSCHE BANK AG 1,125%/18-300823	2.000.000	1.990.880,00	1,08
GBP DEUTSCHE BANK AG 3,875%/19-120224	500.000	569.818,80	0,31
EUR DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN 2,875%/17-28.06.2027	1.000.000	783.550,00	0,42
EUR EASYJET 1,125%/16-181023	3.000.000	2.972.190,00	1,61
EUR EDP FINANCE 1,125%/16-12.02.2024	4.000.000	3.934.680,00	2,13
EUR ELIA SYSTEM OP SA/NV (SUBORDINATED) FIX-TO-FRN FRN/18-PERPETUAL	300.000	297.000,00	0,16
EUR ENI 3,25%/13-100723	4.000.000	3.999.680,00	2,17
EUR FINNAIR OYJ SUB FF FRN/20-PERPET	100.000	96.358,00	0,05
EUR FRESENIUS FINANCE (REG. -S-) 4%/14-01.02.2024	3.000.000	2.997.450,00	1,62
EUR GDF SUEZ FF 3,875%/14-PERPET	5.000.000	4.947.400,00	2,68
EUR GOLDMAN SACHS GROUP 2%/15-270723	1.500.000	1.498.230,00	0,81
EUR GROUPAMA FF 6,375%/14-PERPET	3.000.000	3.004.710,00	1,63
USD HSBC HOLDINGS PLC FF FRN/21-170824	3.000.000	2.729.752,52	1,48
EUR IBERDROLA INTERNATIONAL FIX-TO-FRN 2,625%/18-PERPETUAL	4.500.000	4.430.835,00	2,40
EUR ING VERZEKERING SUB FF 4,625%/14-080444	5.100.000	5.056.446,00	2,74
EUR INTESA SANPAOLO REGS 790 6,625%13-130923	3.000.000	3.010.500,00	1,63
EUR LA MONDIALE SUB FF FRN/13-250444	2.000.000	2.011.880,00	1,09
EUR LIBERTY MUTUAL GRP S FF 144A FRN/230559	500.000	474.535,00	0,26
USD NEDER WATERSCHAPS BANK 1,125%/22-150324	1.000.000	888.395,97	0,48
EUR PERMANENT TSB GROUP FF FRN/19-260924	3.000.000	2.977.260,00	1,61
EUR RABOBANK NEDERLAND 3,875%/13-25.07.2023	2.000.000	1.998.960,00	1,08
USD RABOBANK NEDERLAND 4,625%/13-01.12.2023	3.000.000	2.727.635,20	1,48
USD ROYAL BANK OF SCOTLAND 5,125%14-280524	845.000	760.879,51	0,41
EUR SANTANDER UK GRP HLDGS FF FRN/20-280225	5.000.000	4.853.200,00	2,63
USD SANTANDER UK REG S 5%/13-071123	1.266.000	1.150.946,01	0,62
EUR SCHAEFFLER AG 1,875%/19-280324	2.000.000	1.963.580,00	1,06
USD SIEMENS FINANCIERIN 144A 0,65%/21-110324	1.000.000	885.499,54	0,48
EUR SIEMENS FINANCIERINGSMAT 0,375/18-060923	3.000.000	2.982.150,00	1,62
EUR SSE 1,75%/15-080923	2.000.000	1.992.700,00	1,08
EUR TELEFONICA EUROPE FF 3%/18-PERPET	1.500.000	1.485.000,00	0,80
USD UBS AG SUB 5,125%/14-150524	1.000.000	900.879,93	0,49
USD UBS GROUP AG FIX-TO-FRN FRN/20-30.07.2024	2.000.000	1.825.316,22	0,99
EUR VIENNA INSURANCE GROUP FF 13-091043	4.000.000	3.980.440,00	2,16
EUR VIRGIN MONEY UK PLC FF FRN/20-240625	3.500.000	3.390.905,00	1,84
GBP WELLS FARGO REG S C 5,25%/06-010823	4.250.000	4.946.719,69	2,68
EUR WINTERSHALL DEA FINANCE 0,452%/19-25.09.2023	4.000.000	3.964.560,00	2,15
EUR WIZZ AIR FINANCE COMPANY 1,35%/21-190124	3.000.000	2.932.020,00	1,59
<b>Total Anleihen</b>		<b>157.203.626,11</b>	<b>85,16</b>
<b>Total börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere</b>			
		<b>157.203.626,11</b>	<b>85,16</b>
<b>Geldmarktinstrumente</b>			
EUR FRENCH DISCOUNT T-BILL 0%/22-291123	7.000.000	6.917.483,79	3,75
EUR GERMAN TREASURY BILL 0%/23-210224	3.500.000	3.430.067,00	1,86
EUR TREASURY CERTIFICATES 0%/22-140923	5.000.000	4.966.567,06	2,69
EUR TREASURY CERTIFICATES 0%/23-090524	3.000.000	2.917.873,53	1,58
<b>Total Geldmarktinstrumente</b>		<b>18.231.991,38</b>	<b>9,88</b>
<b>Total des Wertpapierbestandes</b>		<b>175.435.617,49</b>	<b>95,03</b>
Bareinlagen bei Banken und Brokern		6.656.182,07	3,61
Bankverbindlichkeiten und sonstige		-241.098,40	-0,13
Andere Nettvermögenswerte		2.751.242,06	1,49
<b>Teilfondsvermögen</b>		<b>184.601.943,22</b>	<b>100,00</b>

Die Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil der Aufstellungen.

Mögliche Differenzen im Prozentsatz des Nettfondsvermögens sind das Resultat von Rundungen.

## Ungeprüfte Informationen

### Risikomanagement

Das Gesamtrisiko der Subfonds wird nach dem Absolute-VaR-Ansatz berechnet und überwacht, mit Ausnahme des Subfonds Cape Capital SICAV-UCITS – Cape Equity Fund, bei dem es nach dem Commitment-Ansatz berechnet und überwacht wird.

### VaR-Informationen

Bei den in der unten stehenden Tabelle aufgeführten Subfonds erfolgt die Berechnung des Gesamtrisikos mithilfe des Absolute-VaR-Ansatzes. Die während des Berichtszeitraums erreichten VaR-Niveaus sind in der unten stehenden Tabelle aufgeführt:

Name des Fonds	Gerings-ter VaR	Durchsch-nittlicher VaR	Höchster VaR	Interner Grenzwert für das Marktrisiko	Aufsich-tsrechtli-cher Grenzw-ert
Cape Capital SICAV-UCITS – Cape Fixed Income Fund	1,79%	2,67%	4,32%	6,50%	20%
Cape Capital SICAV-UCITS – Cape Select Bond Fund	0,22%	0,39%	0,88%	5,00%	20%

### Angewendete Berechnungsstandards

Die folgenden Berechnungsstandards wurden für die tägliche Berechnung des VaR verwendet:

- Konfidenzintervall: 99,00%
- Haltedauer: 20 Tage
- Effektiver Beobachtungszeitraum: 250 Tage
- Häufigkeit der Berechnung: täglich
- Modell: Monte Historical Simulation

Die durchschnittliche Hebelfinanzierung während des Berichtszeitraums lag bei 0,5156 für den Cape Capital SICAV-UCITS - Cape Fixed Income Fund und bei 0,3307 für den Cape Capital SICAV-UCITS - Cape Select Bond Fund.

### Vergütung

Informationen zur Vergütung werden gemäss Paragraf 111bis und 111ter des Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen in seiner jeweils geltenden Fassung offengelegt, sobald ein vollständiges Geschäftsjahr abgeschlossen wurde.

### Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

Die Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte ("SFT-Verordnung") führt Berichtsanforderungen für Wertpapierfinanzierungsgeschäfte ("SFT") und Total Return Swaps ein.

Ein Wertpapierfinanzierungsgeschäft ("SFT") ist gemäss Artikel 3 (11) der SFT-Verordnung definiert als:

- ein Pensionsgeschäft,
- ein Wertpapier- oder Warenleihgeschäft,
- ein Kauf-/Rückverkaufgeschäft oder ein Verkauf-/Rückkaufgeschäft,
- ein Kauf-/Rückverkaufgeschäft oder ein Verkauf-/Rückkaufgeschäft,

Die Gesellschaft hielt in dem zum 30.06.2023 endenden Berichtszeitraum keine Total Return Swaps und hat in diesem Zeitraum keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte abgeschlossen.

