

COMISIÓN NACIONAL DEL MERCADO DE VALORES  
Calle Edison, 4  
28006 MADRID

Madrid, 28 de agosto de 2024

En relación con el Sub-Fondo: CAIXABANK WEALTH SICAV – CAIXABANK WEALTH DEPENDABLE FUND (nº Registro IIC Extranjeras: 1474)

#### **HECHO RELEVANTE**

ALLFUNDS BANK, S.A., como entidad encargada de representar a CAIXABANK WEALTH SICAV ante la Comisión Nacional del Mercado de Valores (CNMV), según lo previsto en la Circular CNMV 2/2011, comunica que el 10 de julio de 2024 se produjo un incumplimiento en el Sub-Fondo indicado debido a una venta de 130 opciones de compra (*at the money*). Para esta transacción, el Banco Santander solicitó un colateral de 10.485.108,64.- euros, cuando el fondo no tenía liquidez suficiente en ese momento. Este hecho generó un descubierto en la cuenta de Santander de más del 10% del valor neto de los activos.

La situación quedó regularizada el 14 de julio, al ser consciente el gestor de inversiones del posible incumplimiento y cerrar las posiciones abiertas.

El impacto del error supuso una pérdida de 1.850,96.- euros para el Sub-Fondo, el cual fue compensado posteriormente con fecha 27 de agosto de 2024.

Atentamente,

*Allfunds Bank, S.A.*  
*En representación de CAIXABANK WEALTH SICAV*