

HECHO RELEVANTE DE XTRACKERS NIFTY 50 SWAP UCITS ETF

14 de julio de 2021

Xtrackers (la IIC)

DWS Investment SA (la Sociedad Gestora)

Error en el cálculo del valor liquidativo del compartimento Xtrackers Nifty 50 Swap UCITS ETF (el Compartimento)

Nos dirigimos a usted para notificarle un error en el cálculo del valor liquidativo del compartimento Xtrackers Nifty 50 Swap UCITS ETF. El compartimento Xtrackers Nifty 50 Swap UCITS ETF es un compartimento de Xtrackers que está constituida en Luxemburgo y está inscrita en el Registro de Instituciones de Inversión Colectiva extranjeras de la Comisión Nacional del Mercado de Valores con el número **508**.

A continuación, exponemos los detalles del problema identificado, las medidas adoptadas hasta la fecha y si se ha notificado a otras autoridades competentes.

Detalles del error

El Compartimento Xtrackers Nifty 50 Swap UCITS ETF es un ETF sintético. El Compartimento invierte en un índice swap que proporciona la rentabilidad del Compartimento. De acuerdo con el proceso habitual, el cálculo del valor liquidativo a 26 de mayo de 2021 tuvo lugar la mañana del 27 de mayo 2021 con el último precio del índice disponible a 26 de mayo de 2021 en Bloomberg. El 28 de mayo de 2021, el proveedor del índice revisó el valor del índice del 26 de mayo de 2021 de 21639,04 a 21771,35.

La Sociedad Gestora decidió que el valor liquidativo del 26 de mayo de 2021 se actualizara con el valor del índice de 21771,35. Fue el proveedor del índice el que proporcionó el valor del índice incorrecto a partir del 26 de mayo de 2021.

Medidas propuestas para mitigar el riesgo de repetición

Ninguna, ya que el valor del índice utilizado para calcular el valor liquidativo era correcto el día de la valoración del fondo y fue el proveedor del índice el que proporcionó el valor del índice incorrecto. Asimismo, el cliente aprobó el valor liquidativo de ese día.

Notificación a otras autoridades competentes

La Sociedad Gestora se ha presentado una notificación a su autoridad competente, la *Commission de Surveillance du Secteur Financier* (CSSF), para comunicarle el error en el cálculo del valor liquidativo el 8 de julio de 2021. Aunque el error está por debajo del umbral para la obligación de comunicación a la CSSF, dicho error se comunicó debido a que el umbral para la comunicación en Hong Kong es más bajo.