



Asset Management

Comisión Nacional del Mercado de Valores

Autorización y Registros de Entidades

C/Edison nº 4

28046 MADRID

Madrid, 31 de enero de 2025

HECHO RELEVANTE

BBVA ASSET MANAGEMENT, S.A., SGIIC, entidad gestora del compartimento denominado BBVA GLOBAL BOND FUND (el "Fondo") perteneciente a BBVA DURBANA INTERNATIONAL FUND SICAV, constituida en Luxemburgo e inscrita en el Registro de Instituciones de Inversión Colectiva Extranjeras con el número 32, comunica como Hecho Relevante lo siguiente:

Con fecha 17 de diciembre de 2024, se produjo un error significativo en el cálculo del valor liquidativo del Fondo como consecuencia del registro de manera incorrecta, por parte del Administrador del Fondo, de un "Interest Rate Swap" (IRS). En lugar de cerrar la posición existente se procedió a dar de alta, por error, una nueva operación.

Este error supuso un impacto financiero que superó el umbral de tolerancia para el Fondo establecido por la Circular CSSF 24/856 sobre protección de inversores en casos de error de cálculo de valor liquidativo. Una vez detectado el error, con fecha 18 de diciembre de 2024, se procedió a corregirlo en la misma fecha y a calcular de nuevo el valor liquidativo del Fondo de forma inmediata.

Asimismo, se informa que en dicha fecha no hubo suscripciones ni reembolsos que hayan podido verse afectados por el valor liquidativo que ha sufrido el error indicado, por lo que ningún accionista del Fondo se ha visto afectado por el mismo.

Se han adoptado medidas correctivas para evitar que este error vuelva a repetirse en el futuro.

Atentamente,

Dña. María Belén Blanco Jerez
BBVA ASSET MANAGEMENT, S.A., S.G.I.I.C.