

COMISIÓN NACIONAL DEL MERCADO DE VALORES  
Dirección General de Entidades del Mercado de Valores  
Calle Edison, 4  
28006 Madrid

Madrid, a 18 de enero de 2024

Estimados señores:

Nos dirigimos a ustedes en representación del fondo de inversión UBS (Lux) Equity SICAV, constituido en Luxemburgo e inscrito en el Registro de Instituciones de Inversión Colectiva extranjeras comercializadas en España con el número de registro 344.

Se procede a notificar a esta Comisión Nacional del Mercado de Valores el siguiente hecho relevante relativo a un error significativo en el cálculo del valor liquidativo del subfondo UBS (Lux) Equity SICAV - Long Term Themes (USD).

El Equipo de Acción Corporativa de Northern Trust no pudo procesar una Acción Corporativa obligatoria con opciones de seguridad "US9285634021-VMWARE INC STK USD0.01 Clase A" en el Sistema de Contabilidad de Fondos (GP4) para el NAV con fecha del 29 de noviembre de 2023 según las instrucciones de Valor Razonable de GVC (UBS Comité de valoración global). Como resultado, el NAV del fondo UBS (Lux) Equity SICAV - Long Term Themes (USD) se vio afectado materialmente con un impacto de 68 puntos básicos.

Actualmente se están llevando a cabo investigaciones con la Acción Corporativa de Northern Trust para obtener acceso a la información electoral y de notificación previa directamente de los gestores de cartera para evitar depender totalmente de la reserva de Custodia de UBS.

Asimismo, de cara a evitar incurrir en el mismo error nuevamente se ha propuesto mejorar el proceso de comunicación entre los equipos de Northern Trust y UBS FML, en relación con eventos que tienen un impacto material en el NAV si no se procesa a tiempo y se ha recordado a NT DSDM (equipo de precios de Northern Trust) que debe asumir plenamente la comunicación con el equipo de UBS GVC y en los casos en que las instrucciones del equipo de UBS GVC no sean claras, no se puedan aplicar o requieran algún seguimiento, escalar directamente esta situación a UBS GVC y UBS FML.

Por la presente confirmamos que la información arriba mencionada ha sido objeto de comunicación a los partícipes tal y como se establece en la normativa luxemburguesa.

A la espera de que la presente notificación surta los efectos oportunos, quedamos a su entera disposición para comentar o ampliar el contenido de esta carta o cualquier otro asunto que estimen pertinente.

Atentamente,