

NOTIFICACIÓN DE INCUMPLIMIENTO DE LAS POLÍTICAS DE INVERSIÓN SEGÚN LA CIRCULAR CSSF 02/77

1 Details relating to the investment breach

Type of procedure applied^{1, 2, 3}

simplified procedure

Detection date of the investment breach (format DD/MM/YYYY)

16/10/2020

Period of the investment breach - Start Date (format DD/MM/YYYY)³

14/10/2020

Period of the investment breach - End Date (format DD/MM/YYYY)³

19/10/2020

^{1, 5} Incumplimiento de la Política de Inversión

Non-compliance with the investment policy

Descripción y motivo del incumplimiento

Debido a la compraventa del fondo LU0290358497 XTRACKERS II EUR OVERNIGHT RATE SWAP UCI, en el NAV 14/10/20, las inversiones en fondos abiertos constituyeron el 11.00%, porcentaje que supera el 10% fijado en la política de inversión.

Medidas correctivas respecto al incumplimiento

Esta infracción se resolvió en el NAV de fecha 19/10/2020 tras la venta de 400 acciones de LU0290358497 XTRACKERS II EUR OVERNIGHT RATE SWAP UCI.

Página 3

Medidas correctivas para evitar dicho evento en el futuro

Los datos estadísticos de todos los ETF en el sistema serán comprobados para comprobar que este campo se rellena de forma adecuada. En el futuro, para todos los nuevos ETFs importados en el sistema, el campo será debidamente rellenado

Impacto del incumplimiento

Cuantía del impacto en EUR

fuese diferente a EUR)

Loss

10,82

Please indicate the currency

Método de cálculo para determinar la cuantía del impacto

accounting method

Detalles concernientes al método aplicado u otra información / comentarios^{4, 8}

El impacto se ha calculado teniendo en cuenta las pérdidas y ganancias de los valores comprados en exceso sobre el valor liquidativo con fecha de 14.10.20 con el método LIFO

LIFO

El impacto de la pérdida en el NAV es mayor que el umbral de tolerancia de tesorería aplicado

No