

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

Madrid, a 26 de abril de 2022

Estimados señores:

Nos dirigimos a ustedes en representación del fondo de inversión UBS (Lux) Key Selection SICAV, constituido en Luxemburgo e inscrito en el Registro de Instituciones de Inversión Colectiva extranjeras comercializadas en España con el número 336.

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) Key Selection SICAV - Global Allocation (CHF).

Debido al cambio de código de mercado de Six-Financials, el equipo de TechMahindra (proveedor de precios bajo la supervisión de NT) desplegó una secuencia de comandos a primera hora de la mañana del 21 de enero de 2022 para modificar los activos del ámbito de aplicación al nuevo código de mercado 1703. Como el cambio de código de mercado se procesó antes del cálculo del valor liquidativo, los precios con el código de mercado anterior no se han reconocido en el sistema de contabilidad del fondo GP3, lo que ha dado lugar a la falta de precios. En el valor liquidativo del 18 de febrero de 2022, se ha detectado una excepción de precio para IE00B4WPHX27 - ETFX DJ-UBS ALL COMMODITIES FWD 3m FUND USD. Tras una investigación con TechM (proveedor de precios) se ha confirmado que Northern Trust ha introducido manualmente el precio en una moneda incorrecta, el euro, en lugar del dólar, lo que ha provocado una diferencia de valor de mercado de 582.461 CHF (56 puntos básicos).

Por la presente le 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,