

Madrid, 16 de marzo de 2016

HECHO RELEVANTE

En relación con los Compartimentos de Propósito Especial (en adelante "CPE") inscritos el 6 de julio de 2015 por Renta 4 Gestora, SGIIC, S.A. tras nuestra designación como Sociedad Gestora temporal de los fondos de inversión gestionados por Banco Madrid Gestión, SGIIC, S.A. y como continuación del hecho relevante publicado el pasado 24 de julio de 2015 nº 226659 de registro, Renta 4 Gestora, SGIIC, S.A. (en adelante "Renta 4") pone en conocimiento del Mercado y del resto de interesados las actuaciones que se van a llevar a cabo en relación a dichos CPE:

A) Canje de participaciones para partícipes que aún no han reembolsado la parte que se liberó el 24 de julio de 2015.

Con el fin de preservar el tratamiento equitativo de los todos los partícipes, Renta 4 va a iniciar un procedimiento de canje de participaciones del CPE, que afectará a aquellos partícipes que aún no han reembolsado o traspasado la parte líquida que se puso a su disposición, conforme al hecho relevante de 24 de julio de 2015.

Estos partícipes dispondrán hasta el 29 de marzo de 2016 para ordenar el reembolso o traspaso de estas participaciones; transcurrido este plazo, Renta 4, a los efectos de garantizar un tratamiento equitativo entre los inversores, procederá a canjear las participaciones no traspasadas o reembolsadas por participaciones del fondo origen desde el que se escindió el CPE. El valor liquidativo aplicable a dicha operación será el correspondiente al 30 de marzo de 2016.

Se adjunta como Anexo 1 una tabla con el porcentaje de cada CPE que se liberó, de acuerdo con el hecho relevante publicado el 24 de julio de 2015, para que los partícipes que deseen reembolsar o traspasar conozcan el número de participaciones disponibles (saldo de participaciones por el porcentaje liberado).

B) Valoración de los CPE y ajuste de participaciones.

A partir del 30 de marzo, una vez finalizado el proceso descrito en el apartado anterior, Renta 4 ajustará el valor liquidativo de cada CPE, a los efectos de que todos los partícipes asuman en la misma proporción los beneficios y las pérdidas de los activos y pasivos que, con posterioridad al 24 de julio de 2015 y hasta el momento, han sido liquidados.

Adicionalmente, para corregir el impacto de la evolución del mercado en los valores liquidativos aplicados a los reembolsos de la primera ventana de liquidez, Renta 4 procederá a reajustar las participaciones de determinados inversores en diversos CPE (en aplicación del procedimiento establecido por Renta 4), si bien el caso con impacto más elevado se produce en Banco Madrid SICAV Selección CPE (se ha reembolsado a los partícipes 93.637 euros de menos, 1,09 % del efectivo medio reembolsado).

C) Apertura adicional de liquidez en algunos CPE

Dado que en algunos CPE se ha generado liquidez con posterioridad al 24 de julio de 2015, se procederá a una nueva apertura a reembolsos y traspasos de un porcentaje de la parte previamente bloqueada, en los términos indicados en el Anexo 2.

Para ello, desde el 30 de marzo hasta el 17 de mayo de 2016 los partícipes podrán solicitar traspasos o reembolsos conforme al calendario y al procedimiento de identificación de partícipes que se adjunta como Anexo 3. Transcurrido este plazo, Renta 4 procederá a canjear las participaciones no reembolsadas o traspasadas por participaciones del fondo origen desde el que se escindió el CPE. El valor liquidativo aplicable a dicha operación será el del 18 de mayo de 2016.

En algunos CPE, finalizada esta fase, aún quedarían activos ilíquidos, mientras que otros quedarán sin patrimonio. En el siguiente apartado "D)" se describe la situación de cada uno de los CPE.

D) Proceso de extinción de los CPE

Una vez finalizadas las actuaciones anteriores de reparto de la tesorería disponible, la situación de los CPE será:

- CPE que no mantendrán ningún activo, por lo que se iniciará el proceso de extinción a finales de mayo de 2016¹:
 - Pentathlon CPE
 - Renta Fija Mixta España Flexible CPE
- El resto de CPE, debido a que aún mantendrán activos ilíquidos (básicamente, retenciones practicadas por las Administraciones Públicas en operaciones sobre activos financieros), el proceso de extinción se iniciará con posterioridad, una vez que se hagan líquidos tales activos, o se hayan amortizado aquéllos que, en su caso, se consideren de difícil o imposible recuperación.

E) Otros asuntos

Se comunica que con efectos desde el día 1 de marzo de 2016, incluido, se han eliminado las comisiones de gestión y depositaría para todos los CPE.

La información sobre el procedimiento de reembolso también estará disponible en:

www.r4.com/bancomadrid

¹ La extinción de los CPE se realiza de conformidad con el artículo 75.8 del Reglamento que desarrolla la Ley 35/2003, de IIC (Reglamento aprobado por RD 1082/2012, de 13 de julio).

Anexo 1: porcentaje de cada CPE que se abrió, según el hecho relevante de 24/7/2015

Compartimento de Propósito Especial (CPE)	Nº Registro	% liberado
BANCO MADRID AHORRO CPE	2.895	98
BANCO MADRID DOLPHIN ACCIONES CPE	2.859	87
BANCO MADRID IBERICO ACCIONES CPE	3.868	95
BANCO MADRID RENTA FIJA CPE	2.779	97
BOLSA EURO VALOR CPE	3.113	97
ESPAÑA FLEXIBLE CPE	2.781	91
PENTATHLON CPE	1.731	98
PREMIUM JB BOLSA EURO CPE	2.978	83
PREMIUM JB BOLSA INTERNACIONAL CPE	3.203	97
PREMIUM JB MODERADO CPE	294	98
PREMIUM PLAN RENTABILIDAD IV CPE	4.575	99
PREMIUM PLAN RENTABILIDAD V CPE	4.642	96
PREMIUM PLAN RENTABILIDAD VI CPE	4.684	97
PREMIUM PLAN RENTABILIDAD VII CPE	4.735	99
RENDA FIJA MIXTA ESPAÑA FLEXIBLE CPE	4.707	99
BANCO MADRID CONFIANZA CPE	4.761	92
BANCO MADRID DINÁMICO CPE	4.762	59
BANCO MADRID EQUILIBRIO, FI	4.763	86,5
BANCO MADRID RENDIMIENTO CPE	2.153	57
BANCO MADRID SICAV SELECCIÓN CPE	4.621	67
WORLD SOLIDARITY FUND CPE	2.782	59

Anexo 2: Patrimonio remanente al inicio de la fase correspondiente con el apartado “C” de este Hecho Relevante y porcentaje de cada CPE que se liberará.

Compartimento de Propósito Especial (CPE)	Nº Registro CNMV	Patrimonio CPE en EUROS	% Patrimonio liberado del CPE	% Pendiente de apertura del fondo original
BANCO MADRID AHORRO CPE	2.895	224.457	73,24	0,05
BANCO MADRID DOLPHIN ACCIONES CPE	2.859	130.702	87,43	0,17
BANCO MADRID IBERICO ACCIONES CPE	3.868	929.252	72,11	0,20
BANCO MADRID RENTA FIJA CPE	2.779	2.452.185	99,00	0,008
BOLSA EURO VALOR CPE	3.113	13.570	0,00	0,43
ESPAÑA FLEXIBLE CPE	2.781	48.326	0,00	0,41
PENTATHLON CPE	1.731	166.979	100,00	0,00
PREMIUM IB BOLSA EURO CPE	2.978	213.826	0,00	1,91
PREMIUM IB BOLSA INTERNACIONAL CPE	3.203	46.379	0,00	0,37
PREMIUM IB MODERADO CPE	294	60.286	0,00	0,26
PREMIUM PLAN RENTABILIDAD IV CPE	4.575	1.304	0,00	0,02
PREMIUM PLAN RENTABILIDAD V CPE	4.642	78.769	99,00	0,004
PREMIUM PLAN RENTABILIDAD VI CPE *	4.684	0	0,00	0,00
PREMIUM PLAN RENTABILIDAD VII CPE	4.735	2.426	0,00	0,01
RENDA FIJA MIXTA ESPAÑA FLEXIBLE CPE	4.707	16.739	100,00	0,00
BANCO MADRID CONFIANZA CPE **	4.761	297.180	11,59	0,86
BANCO MADRID DINÁMICO CPE **	4.762	300.048	61,66	2,00
BANCO MADRID EQUILIBRIO, FI **	4.763	375.923	11,94	1,05
BANCO MADRID RENDIMIENTO CPE **	2.153	216.149	67,83	1,50
BANCO MADRID SICAV SELECCIÓN CPE **	4.621	4.378.409	94,76	0,40
WORLD SOLIDARITY FUND CPE **	2.782	1.799.714	95,72	0,51

Con independencia del porcentaje liberado, los partícipes deberán solicitar a la gestora reembolso o traspaso TOTAL.

* Este CPE, al igual que otros, dispone de activos provisionados en su totalidad que, en caso de recuperación, el importe obtenido se repartirá de manera equitativa entre los partícipes.

** Los porcentajes de estos CPE pueden verse modificados en función del importe neto final de la venta de los otros CPE de su cartera.

Anexo 3. Procedimiento de identificación de partícipes y calendario de reembolsos y traspasos de los CPE.

Documentación necesaria para personas físicas y jurídicas residentes y no residentes fiscalmente en España

Personas Físicas:

- Pasaporte, DNI en vigor
- Certificado bancario emitido por la entidad en la que se vaya a abonar el importe del reembolso, que contendrá al menos:
 - IBAN en el que se abonará el importe
 - Nombre, apellidos y NIF de los titulares

Persona Jurídica:

- Pasaporte, DNI, Tarjeta de residencia del/ los apoderado/s
- Certificado del Registro Mercantil (que contenga como mínimo: denominación social, domicilio, identidad de administradores y NIF)
- Declaración de titularidad Real
- Certificado bancario que contendrá:
 - IBAN en el que se abonará el reembolso
 - Nombre, apellidos y NIF titular cuenta
 - Apoderados (forma de actuación, mancomunada y solidaria)
 - Nacionalidad y País de residencia

Para aquellos partícipes que sean Entidades financieras, Sociedades Cotizadas en mercados regulados domiciliadas en España o la UE, se estará a lo establecido en el artículo 17 del Real Decreto 304/2014 por el que se aprueba el reglamento de la Ley de PBC

En el caso concreto de PERSONAS FÍSICAS NO RESIDENTES FISCALMENTE EN ESPAÑA O PERSONAS JURÍDICAS, si con anterioridad a la publicación de este Hecho Relevante se procesaron órdenes de reembolso de participaciones de los CPE y éstas no fueron rechazadas, Renta 4 procederá a reembolsar las participaciones de los CPE **sin necesidad de que los partícipes cursen ninguna instrucción**, aplicando el valor liquidativo que corresponda según el calendario adjunto, realizándose el abono mediante transferencia bancaria en las mismas cuentas corrientes ya facilitadas por los partícipes para atender las órdenes ya ejecutadas para los fondos de inversión y los CPE.

**PERÍODO DE TRAMITACIÓN DE ÓRDENES Y FECHA DEL VALOR LIQUIDATIVO
APLICABLE A LOS COMPARTIMENTOS ESPECIALES**

Denominación Fondo de Inversión	Código ISIN	Desde	Hasta las 14:00h	Fecha Valor Liq.	Desde las 14:01h	VL DIARIO desde
BANCO MADRID DOLPHIN AC. FI CPE	ES0170642005	30/03/2016	07/04/2016	07/04/2016	07/04/2016	08/04/2016
BANCO MADRID RF FI CPE	ES0170602009	30/03/2016	07/04/2016	07/04/2016	07/04/2016	08/04/2016
BANCO MADRID IBERICO AC. FI CPE	ES0114903018	30/03/2016	07/04/2016	07/04/2016	07/04/2016	08/04/2016
PREMIUM PLAN RENTABILIDAD V FI CPE	ES0170654018	30/03/2016	07/04/2016	07/04/2016	07/04/2016	08/04/2016
RF MIXTA ESPAÑA FLEXIBLE FI CPE	ES0173366016	30/03/2016	07/04/2016	07/04/2016	07/04/2016	08/04/2016
PENTATHLON FI CPE	ES0162858007	30/03/2016	07/04/2016	07/04/2016	07/04/2016	08/04/2016
BANCO MADRID AHORRO FI CPE	ES0170613006	30/03/2016	07/04/2016	07/04/2016	07/04/2016	08/04/2016
BANCO MADRID SICAV SELECCION FI CPE	ES0170614012	30/03/2016	11/04/2016	11/04/2016	11/04/2016	12/04/2016
BANCO MADRID DINAMICO FI CPE	ES0113112017	30/03/2016	13/04/2016	13/04/2016	13/04/2016	14/04/2016
BANCO MADRID RENDIMIENTO FI CPE	ES0155527007	30/03/2016	13/04/2016	13/04/2016	13/04/2016	14/04/2016
WORLD SOLIDARITY FUND FI CPE	ES0170646006	30/03/2016	13/04/2016	13/04/2016	13/04/2016	14/04/2016
BANCO MADRID CONFIANZA FI CPE	ES0113384012	30/03/2016	13/04/2016	13/04/2016	13/04/2016	14/04/2016
BANCO MADRID EQUILIBRIO FI CPE	ES0113379012	30/03/2016	13/04/2016	13/04/2016	13/04/2016	14/04/2016