

Madrid, 28 de junio de 2012

HECHO RELEVANTE ESAF DOBLE INDICE, FI (Nº de registro CNMV: 3357)

Estimados señores:

Sirva la presente para dar cumplimiento al artículo 28 del Real Decreto 1309/2005, que aprueba el Reglamento de Instituciones de Inversión Colectiva, respecto a la obligación de hacer público cualquier hecho específicamente relevante para la situación o el desenvolvimiento de las instituciones gestionadas, que incluye, entre otros pasos, la inmediata comunicación a la CNMV.

Les informamos de que se va a proceder a modificar el valor liquidativo aplicable a las suscripciones y reembolsos. Hasta ahora, y a efectos de las suscripciones y reembolsos que solicitan en el Fondo, el valor aplicativo aplicable es el correspondiente al día siguiente de la fecha de solicitud, así si se solicita una suscripción o reembolso en el día D, el valor liquidativo aplicable es D+1. Esto es debido a que el fondo, tenía un objetivo concreto de rentabilidad no garantizado que ha vencido el pasado 22-06-12, y que estaba ligado a la evolución del DJ Eurostoxx 50 y al Nikkei 225; por lo que aplicando el valor liquidativo de D+1 se evitaba que los partícipes pudieran operar a un valor liquidativo conocido al cerrar el índice Nikkei 225 su sesión correspondiente al día D antes de la hora de corte para aceptar suscripciones y reembolsos el día D.

A partir de ahora el valor liquidativo que se va a aplicar a las suscripciones y reembolsos solicitados el día D será el correspondiente al del día D.

Adicionalmente, este hecho relevante se notificará en el próximo informe periódico a partícipes.

Sin otro particular, les saludamos atentamente,

ESPIRITO SANTO GESTION, SGIIC, S.A.