

MEGSZŰNÉSI JELENTÉS**K&H Euró Fix 2 Származtatott Zártvégű Értékpapír Befektetési Alap**

1. Az Alap megnevezése, típusa, futamideje

Az Alap neve: K&H Fix Euro Fix 2 Származtatott Zártvégű Értékpapír Befektetési Alap

Az Alap típusa: származtatott alap

Az Alap futamideje: 2004. július 7 - 2006. július 6

2. Az Alapkezelő, az igénybe vett forgalmazó és a letétkezelő társaság neve és székhelye

Alapkezelő:

K&H Értékpapír Befektetési Alapkezelő Rt. (1051 Budapest, Vigadó tér 1)

Forgalmazó:

Kereskedelmi és Hitelbank Rt. (1051 Budapest, Vigadó tér 1.)

Letétkezelő:

Kereskedelmi és Hitelbank Rt. (1051 Budapest, Vigadó tér 1.)

3. Könyvvizsgáló neve és székhelye

Ernst & Young Kft.

1132 Budapest, Váci út 20.

4. A befektetési eszközök összetétele fajtánként, típusonként, illetve a befektetési politikában meghatározott kategóriák szerint, az év elején illetve a futamidő lejáratakor (TpT. 19.sz. melléklet a) pont)

Befektetési eszköz	2005.12.31	2006.07.06, a futamidő lejáratkor
Kereskedelmi bankoknál nyitott betétek	Min 80% 11 620 045 € (100,36%)	Min 80% 3 211 440 379 HUF (100%)
Hitelviszonyt megtestesítő magyar állampapírok	-	-
OECD tagországokban kibocsátott kötvények	-	-
Tőzsdére bevezetett részvények	-	-
Kollektív befektetési eszközök	-	-
Határidős, opciós és egyéb származékos ügyletek	- 41 124 € (-0,36%)	0 (max 20%)

A Tpt. 19. melléklet szerinti megszűnési tájékoztató adatok a következők:

b) az egyes értékesített eszközök befolyt ellenértéke	3 211 440 379 HUF
c) az esetleges járulékos és egyéb bevételek	0 €
d) a végelszámolás során felmerült költségek és felszámított díjak tételiesen,	0 €
e) a befektetők között felosztható tőkét,	3 211 440 379 HUF
f) az egy befektetési jegyre kifizethető összeget,	29 562,29 HUF
g) a kifizetés kezdő napja és helye	A kifizetés megkezdésének napja 2006.07.13. Helye az értékpapírok letéti őrzésével megbízott pénzügyintézet vagy befektetési szolgáltató

5. A tárgyidőszak elején forgalomban lévő, a tárgyidőszakban eladott, a tárgyidőszakban visszaváltott és az Alap lejártakor forgalomban lévő befektetési jegyek száma, a portfólió összesített nettó eszközértéke és az egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték

2005.12.31-én a forgalomban lévő befektetési jegyek száma:	108 633
2006-ban eladott befektetési jegyek száma:	--
2006-ban visszaváltott befektetési jegyek száma:	--
2006.07.06-án a forgalomban lévő befektetési jegyek száma:	108 633
a portfólió összesített nettó eszközértéke 2006.07.06-án:	3 211 440 379 HUF
egy jegyre jutó nettó eszközérték 2006.07.06-án:	29 562,29 HUF

6. Az Alap részére igénybe vett hitel feltételei
Az Alap hitellel, valamint hitelkerettel nem rendelkezik.

7. Az Alap saját tőkéjének és az egy jegyre jutó nettó eszközértékének változása havi bontásban, valamint a kifizetett hozamok.

Hónap (tárgyhó utolsó nettó eszközértékének napja)	Nettó eszközérték (saját tőke) €-ban	Egy jegyre jutó nettó eszközérték €-ban
2006.01.31	11 561 738	106
2006.02.28	11 612 156	107
2006.03.31	11 531 894	106
2006.04.28	11 615 036	107
2006.05.31	11 682 153	108
2006.06.30	11 391 837	105

Az Alap hozamot az év során nem fizetett.

8. Az Alapkezelő működésében bekövetkezett változások, a befektetési politika alakulására ható fontosabb tényezők

A tárgyév során az Alapkezelő személyében változás nem történt. A tárgyidőszak során az Alap befektetési politikájában változás nem történt.

9. Az Alap könyvvizsgáló által hitelesített mérlege

A mérleg és eredménykimutatás a mellékletben található.

10. Az Alap könyvvizsgálói jelentése

A könyvvizsgálói jelentés a mellékletben található.

11. Az Alap bevételei, az Alap által fizetett adók, díjak értékvesztés és egyéb hatások (ezer forintban)

a befektetésekből származó bevételek	285 375
egyéb bevételek	0
az alapkezelőnek fizetett díjak	6 097
a letétkezelőnek fizetett díjak	0
egyéb díjak és adók	0
a végelszámolás során felmerült költségek és felszámított díjak	0
kifizetett és újra befektetett bevételek	0
a befektetett eszközökre elszámolt értékvesztés	0
Más, az eszközök értékét befolyásoló változások	0

12. Az Alap nettó eszközértéke és egy jegyre jutó nettó eszközértéke az utolsó három évben ide nem értve a tárgyidőszakot

Időszak	Egy jegyre jutó nettó eszközérték
2003	Nem volt
2004	101
2005	107

A tárgyévben számolt utolsó összesített nettó eszközérték

- vonatkozási napja: 2006.07.06

- értéke: 3 211 440 379 HUF , mely a befektetők között teljes mértékben felosztható.

Az egy jegyre jutó nettó eszközérték 2007.07.06-án 29 562,29 HUF

Budapest, 2006. július 11.

K&H Értékpapír Befektetési Alapkezelő Zrt.