

MEGSZŰNÉSI JELENTÉS**K&H Euró Fix 5 Származtatott Zártvégű Értékpapír Befektetési Alap**

1. Az Alap megnevezése, típusa, futamideje

Az Alap neve: K&H Fix Euro Fix 5 Származtatott Zártvégű Értékpapír Befektetési Alap

Az Alap típusa: származtatott alap

Az Alap futamideje: 2005. június 6 - 2006. június 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	2006.06.06, a futamidő lejáratkor
Kereskedelmi bankoknál nyitott betétek	7 103 010 € (100,81%)	7 163 444 €(100%)
Hitelviszonyt megtestesítő magyar állampapírok	-	-
OECD tagországokban kibocsátott kötvények	-	-
Tőzsdére bevezetett részvények	-	-
Kollektív befektetési eszközök	-	-
Határidős, opciós és egyéb származékos ügyletek	-57 236 € (-0,81%)	

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

b) az egyes értékesített eszközök befolyt ellenértéke	7 163 444 €
c) az esetleges járulékos és egyéb bevételek	0 €
d) a végelszámolás során felmerült költségek és felszámított díjak tételesen,	0 €
e) a befektetők között felosztható tőkét,	7 163 444 €
f) az egy befektetési jegyre kifizethető összeget,	103 €
g) a kifizetés kezdő napja és helye	A kifizetés megkezdésének napja 2006.06.13. 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:	69 548
2006-ban eladott befektetési jegyek száma:	--
2006-ban visszaváltott befektetési jegyek száma:	--
2006.06.06-án a forgalomban lévő befektetési jegyek száma:	69 548
a portfólió összesített nettó eszközértéke 2006.03.20-án:	7 163 444 €
egy jegyre jutó nettó eszközérték 2006.06.06-án:	103 €

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)	Egy jegyre jutó nettó eszközérték
2006.01.31	7 064 586 €	102
2006.02.28	7 088 469 €	102
2006.03.31	6 990 912 €	101
2006.04.28	7 070 967 €	102
2006.05.31	7 164 060 €	103
2006.06.06	7 163 444 €	103

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	92 810
egyéb bevételek	0
az alapkezelőnek fizetett díjak	4 279
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	Nettó eszközérték	Egy jegyre jutó nettó eszközérték
2003	Nem volt	Nem volt
2004	Nem volt	Nem volt
2005	7 045 774 €	101 €

A tárgyévben számolt utolsó összesített nettó eszközérték

- vonatkozási napja: 2006.06.06

- értéke: 7 163 444 €, mely a befektetők között teljes mértékben felosztható.

Az egy jegyre jutó nettó eszközérték 2006.06.06-án: 103 €

Budapest, 2006. június 8.

K&H Értékpapír Befektetési Alapkezelő Zrt.