

## MEGSZŰNÉSI JELENTÉS

### K&H Fix Plusz 2 Származtatott Zártvégű Értékpapír Befektetési Alap

1. Az Alap megnevezése, típusa, futamideje

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

Az Alap típusa: származtatott alap

Az Alap futamideje: 2003. március 21 - 2006. július 31.

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

Alapkezelő:

K&H Értékpapír Befektetési Alapkezelő Zrt. (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                               | 2006.07.31, a futamidő lejáratkor      |
|---|--|--|
| Kereskedelmi bankoknál nyitott betétek          | Min 80%<br>5 269 998 020 HUF<br>(91,11%) | Min 80%<br>6 281 743 000 HUF<br>(100%) |
| Hitelviszonyt megtestesítő magyar állampapírok  | -  | -                                      |
| OECD tagországokban kibocsátott kötvények       | -  | -                                      |
| Tőzsdére bevezetett részvények                  | -  | -                                      |
| Kollektív befektetési eszközök                  | -  | -                                      |
| Határidős, opciós és egyéb származékos ügyletek | 513 853 075 HUF<br>(8,88%)               | 0 (max 20%)                            |

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

|   |   |
|---|---|
| b) az egyes értékesített eszközök befolyt ellenértéke                         | 6 281 743 000 HUF   |
| c) az esetleges járulékos és egyéb bevételek                                  | 0 HUF   |
| d) a végelszámolás során felmerült költségek és felszámított díjak tételesen, | 0 HUF   |
| e) a befektetők között felosztható tőkét,                                     | 6 281 743 000 HUF   |
| f) az egy befektetési jegyre kifizethető összeget,                            | 13 000 HUF  |
| g) a kifizetés kezdő napja és helye   | A kifizetés megkezdésének napja 2006.08.07.<br>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: | 483 211           |
| 2006-ban eladott befektetési jegyek száma:                 | --                |
| 2006-ban visszaváltott befektetési jegyek száma:           | --                |
| 2006.07.31-én a forgalomban lévő befektetési jegyek száma: | 483 211           |
| a portfólió összesített nettó eszközértéke 2006.07.31-én:  | 6 281 743 000 HUF |
| egy jegyre jutó nettó eszközérték 2006.07.31-én:           | 13 000 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) HUF-ban | Egy jegyre jutó nettó eszközérték HUF-ban |
|--|--|---|
| 2006.01.31   | 5 793 757 588                          | 11 990                                    |
| 2006.02.28   | 5 815 689 690                          | 12 036                                    |
| 2006.03.31   | 5 823 504 920                          | 12 052                                    |
| 2006.04.28   | 5 860 443 372                          | 12 128                                    |
| 2006.05.31   | 5 899 006 257                          | 12 208                                    |
| 2006.06.30   | 5 918 209 092                          | 12 248                                    |

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                            | 1 052 867 |
| egyéb bevételek   | 0         |
| az alapkezelőnek fizetett díjak                                 | 41 122    |
| 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 (HUF) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték |
|---------|-------------------------|-----------------------------------|
| 2003    | 4 738 191 325           | 9 806                             |
| 2004    | 5 323 390 421           | 11 017                            |
| 2005    | 5 783 851 095           | 11 970                            |

A tárgyévben számolt utolsó összesített nettó eszközérték

- vonatkozási napja: 2006.07.31

- értéke: 6 281 743 000 HUF , mely a befektetők között teljes mértékben felosztható.

Az egy jegyre jutó nettó eszközérték 2007.07.31-én 13 000 HUF

Budapest, 2006. augusztus 04.

-----  
K&H Értékpapír Befektetési Alapkezelő Zrt.