

## MEGSZŰNÉSI JELENTÉS

### K&H Fix Plusz 3 Származtatott Zártvégű Értékpapír Befektetési Alap

#### 1 Az Alap megnevezése, típusa, futamideje

Az Alap neve: K&H Fix Plusz 3 Származtatott Zártvégű Értékpapír Befektetési Alap  
Az Alap típusa: származtatott  
Az Alap futamideje: 2003. június 20 - 2007. február 20

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

Alapkezelő: K&H Befektetési Alapkezelő Zrt.  
(1051 Budapest, Vigadó tér 1)  
Forgalmazó: Kereskedelmi és Hitelbank Nyrt.  
(1051 Budapest, Vigadó tér 1.)  
Letétkezelő: Kereskedelmi és Hitelbank Nyrt.  
(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 időszak elején és végén

a) a befektetési eszközállomány összetétele fajtánként, típusonként részletezve az időszak elején és az időszak végén (a futamidő lejártakor)

- az időszak elejére vonatkozóan:

Folyószámla, készpénz: 852 (0,05%); 3 hónapnál hosszabb lekötésű bankbetét: 1.122.141 (63,93%); aktív időbeli elhatárolás (egyéb követelés - kamat): 220.024 (12,54%); származtatott ügyletek (ezen belül opció) értékelési különbözete: 412.125 (23,48%)

- az időszak végére vonatkozóan a Mellékletben, a „Tevékenységet lezáró éves beszámoló” Portfólió jelentés részében található.

b) a befektetési politikában meghatározott kategóriák szerint részletezve az időszak elején és a futamidő lejártakor (devizanem: Ft (HUF))

Befektetési eszköz - befektetési politikában meghatározott kategória és annak kezelési szabályzatban meghatározott lehetséges aránya (portfólión belüli aránya) - árfolyamértéke a tárgynapon	2006.12.29-én	2007.02.20-án a futamidő lejártakor
bankbetétek, pénzeszközök	85-98% ( 76,62%) 1 342 139 797	85-98% (100%) 1 790 019 880
részvényindexekre szóló opciós ügyletek	2-15% ( 23,38%) 409 500 000	2-15% (0%) 0

c) Az alap megszűnése miatti kiegészítő adatok (a Tpt. 19. sz. Melléklete szerint, a kifizetés devizanemében)

az egyes értékesített eszközök befolyt ellenértéke	1 790 019 880 Ft (HUF)
az esetleges járulékos és egyéb bevételek	0 Ft (HUF)
a végelszámolás során felmerült költségek és felszámított díjak tételesen	0 Ft (HUF)
a befektetők között felosztható tőke	1 790 019 880 Ft (HUF)
az egy befektetési jegyre kifizethető összeg	14 311,00 Ft (HUF)
a kifizetés kezdő napja	2007.02.27
a kifizetés helye: az értékpapírok letéti őrzésével megbízott pénzügyintézet vagy befektetési szolgáltató	

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

- 2006.12.29-én a forgalomban lévő befektetési jegyek száma: 125 080
- 2007. évben eladott befektetési jegyek száma: 0
- 2007. évben visszaváltott befektetési jegyek száma: 0
- a forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2007.02.20-án: 125 080

- a portfólió összesített nettó eszközértéke 2007.02.20-án: 1 790 019 880 Ft (HUF)
- egy jegyre jutó nettó eszközérték 2007.02.20-án: 14 311 Ft (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) Ft (HUF)-ban	Egy jegyre jutó nettó eszközérték Ft (HUF)-ban
2007.01.31	1 762 071 848	14 087,558746

Az Alap az időszak során hozamot nem fizetett.

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

Az Alapkezelő elnevezése 2007. során módosult, nevéből az "értékpapír" szó kikerült. A tárgyidőszak alatt az Alapkezelő testületeinek összetételében változás nem történt.

Az Alap a céljait úgy tudta megvalósítani, hogy az indulásakor meghirdetett befektetési politika nem módosul, a befektetett eszközöket lejáratig megtartja; így a tárgyidőszakban a befektetési politika nem módosult.

## 9 Az Alap könyvvizsgáló által hitelesített mérlege

A könyvvizsgáló által hitelesített 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 a tárgyidőszakban (ezer forintban)

a befektetésekből származó bevételek	447 855
egyéb bevételek	0
az alapkezelőnek fizetett díjak	304
a letétkezelőnek fizetett díjak	0
egyéb díjak és adók	0
kifizetett és újrabefektetett 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

### a) a tárgyévben számolt utolsó összesített nettó eszközérték

- vonatkozási napja: 2007.02.20
- értéke: 1 790 019 880 Ft (HUF)  
mely a befektetők között teljes mértékben felosztható
- egy jegyre jutó nettó eszközérték: 14 311 Ft (HUF)


### b) az egy jegyre jutó nettó eszközérték az utolsó három év végére vonatkozóan ide nem értve a tárgyidőszakot


Időszak	Vonatkozási nap	Egy jegyre jutó nettó eszközérték Ft (HUF)
2004	2004.12.31	10 189,000000
2005	2005.12.30	12 077,000000
2006	2006.12.29	14 004,155716

### c) A származtatott ügyletekre vonatkozó adatok

Az Alap portfóliójában nemzetközi részvényindexekre vonatkozó eladási opciók szerepeltek.

Budapest, 2007. február 23 .

  
K&H Befektetési Alapkezelő Zrt.

 K&H Befektetési Alapkezelő Zrt.