

## MEGSZŰNÉSI JELENTÉS

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

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

Az Alap neve: K&H Fix Plusz Extra Származtatott Zártvégű Értékpapír Befektetési Alap  
Az Alap típusa: származtatott  
Az Alap futamideje: 2004. március 04 - 2007. március 02

#### 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:

az Alap 2006. Éves Jelentés "Éves beszámoló" Portfóliójelentés részében található adatok eFt-ban: Folyószámla, készpénz: 4.294 (0,13%); egyéb köv.: 2,152 (0,07%); Max. 3 hó lek.bankbetét: 2.419.608(75,2%); aktív időbeli elhat.(egyéb követelés - kamat): 772.432 (24%); származtatott ügyletek (ezen belül opció) értékelési különbözete: 19.323 (0,6%)

- 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

Befektetési eszköz kategória	2006.12.29-én	2007.03.02-án a futamidő lejártakor
bankbetétek, pénzeszközök	85-98%	85-98%
részvényindexekre szóló opciós ügyletek	2-15%	2-15%

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

az egyes értékesített eszközök befolyt ellenértéke	3 273 910 022 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	3 273 910 022 Ft (HUF)
az egy befektetési jegyre kifizethető összeg	12 538,00 Ft (HUF)
a kifizetés kezdő napja	2007.03.12
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: 261 119
- 2007. évben eladott befektetési jegyek száma: 0
- 2007. évben visszaváltott befektetési jegyek száma: 0
- a forgalomban lévő befektetési jegyek száma 2007.03.02-án: 261 119
- a portfólió összesített nettó eszközértéke 2007.03.02-án: 3 273 910 022 Ft (HUF)
- egy jegyre jutó nettó eszközérték 2007.03.02-án: 12 538 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	3237558185	12398,784405
2007.02.28	3263555720	12498,346424

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	81 870
egyéb bevételek	0
az alapkezelőnek fizetett díjak	2 299
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: 2007.03.02
- értéke: 3 273 910 022Ft (HUF)  
mely a befektetők között teljes mértékben felosztható
- egy jegyre jutó nettó eszközérték: 12 538Ft (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	10 599,000000
2005	2005.12.30	11 677,000000
2006	2006.12.29	12 287,372026

**c) A származtatott ügyletekre vonatkozó adatok**

Az Alap portfóliójában nemzetközi részvényindexekre vonatkozó vételi opciók szerepeltek.

Budapest, 2007. március 07.



K&H Befektetési Alapkezelő Zrt.

 K&H Befektetési Alapkezelő Zrt.