

MEGSZŰNÉSI JELENTÉS

K&H plusz származtatott zártvégű értékpapír befektetési alap

1) Alapadatok

a) az Alap megnevezése, típusa, futamideje

Az Alap neve: K&H plusz származtatott zártvégű értékpapír befektetési alap
Az Alap típusa: származtatott
Az Alap futamideje: 2008. december 15. - 2010. június 11.

b) Az Alapkezelő, az igénybe vett forgalmazó és a letétkezelő társaság neve és székhelye

Alapkezelő: K&H Befektetési Alapkezelő Zrt. (1051 Budapest, Vigadó tér 1.)
Letétkezelő: K&H Bank Zrt. (1051 Budapest, Vigadó tér 1.)
Forgalmazó: K&H Bank Zrt. (1051 Budapest, Vigadó tér 1.)

c) Könyvvizsgáló neve és székhelye

KPMG Hungária Kft. (1139 Budapest, Váci út 99.) Guttman Gabriella

2) A befektetési eszközök összetétele fajtánként, típusonként, illetve a befektetési politikában meghatározott kategóriák szerint az időszak elején és végén

a) a befektetési politikában meghatározott eszközcsoportok szerinti megoszlás

| Befektetési eszköz kategória | 2009.12.31. |
|-------------------------------|-------------------|
| bankbetétek | min. 0% max. 100% |
| kosárra szóló összetett opció | min. 0% max. 100% |

| Befektetési eszköz kategória | 2010.06.11. |
|-------------------------------|-------------------|
| bankbetétek | min. 0% max. 100% |
| kosárra szóló összetett opció | min. 0% max. 100% |

b) a befektetési eszközök összetétele a befektetési politika szerinti bontásban

a tárgyidőszak elején: betét: 641268; származtatott ügylet: 110046; bankszámla: 4208; elhatárolt díj: -2286 (adatok eFt (HUF)-ban); a tárgyidőszak végén: bankszámla: 799368 (adatok e Ft (HUF)-ban)

c) származtatott ügyletekre vonatkozó adatok

Az Alap portfóliójában nemzetközi részvénykosárra vonatkozó opció szerepelt.

3) Az Alap működésével kapcsolatos információk

a) Az Alap részére igénybe vett hitel feltételei

Az Alap hitellel, valamint hitelkerettel nem rendelkezett.

b) Az Alapkezelő működésében bekövetkezett változások, a befektetési politika alakulására ható fontosabb tényezők

Az Alapkezelőnél 2010.01.01. és 2010.06.11. közötti időszakban 1 felügyelő bizottsági tag és 3 igazgatósági tag változás történt.

Az Alap a céljait úgy tudta megvalósítani, hogy az indulásakor meghirdetett befektetési politika nem módosult, a befektetett eszközöket lejáratig megtartotta.

c) Az Alap könyvvizsgáló által hitelesített mérlege, valamint a könyvvizsgálói jelentés

Az Alap könyvvizsgáló által hitelesített mérlege, valamint a könyvvizsgálói jelentés a mellékletben található

d) Az Alap bevételei, az Alap által fizetett adók, díjak értékvesztés és egyéb hatások

| | |
|---|--------------------|
| a befektetésekből származó bevételek | 159 214 (eHUF-ban) |
| egyéb bevételek | 0 (eHUF-ban) |
| az alapkezelőnek fizetett díjak | 2 415 (eHUF-ban) |
| a letétkezelőnek fizetett díjak | 118 (eHUF-ban) |
| egyéb díjak és adók | 818 (eHUF-ban) |
| kifizetett és újra befektetett bevételek | 0 (eHUF-ban) |
| a befektetett eszközökre elszámolt értékvesztés | 0 (eHUF-ban) |
| más, az eszközök értékét befolyásoló változások | 0 (eHUF-ban) |

4) Nettó eszközérték- és hozam adatok

a) a befektetési jegy darabszámok alakulása

| | |
|---|-------------|
| 2009.12.31. napján a forgalomban lévő befektetési jegyek száma: | 66 614 |
| 2010. évben eladott befektetési jegyek száma: | 0 |
| 2010. évben visszaváltott befektetési jegyek száma: | 0 |
| 2010.06.11. napján a forgalomban lévő befektetési jegyek száma: | 66 614 |
| a portfólió összesített nettó eszközértéke 2010.06.11. napján (Ft (HUF)): | 799 368 000 |
| egy jegyre jutó nettó eszközérték 2010.06.11. napján (Ft (HUF)): | 12 000,00 |

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

| Tárgyhó utolsó nettó eszközértékének napja | Nettó eszközérték (saját tőke, (Ft (HUF)) | Egy jegyre jutó nettó eszközérték (Ft (HUF)) |
|--|---|--|
| 2010.01.29. | 771 991 222 | 11 589,023659 |
| 2010.02.26. | 770 875 425 | 11 572,273471 |
| 2010.03.31. | 786 511 262 | 11 806,996457 |
| 2010.04.30. | 791 829 665 | 11 886,835575 |
| 2009.05.31. | 796 905 959 | 11 963,040187 |
| 2009.06.11. | 799 368 000 | 12 000,000000 |

Az Alap a tárgyidőszak során hozamot nem fizetett.

c) Az Alap és referenciahozamainak hozamadatai 5 naptári évre visszamenően

Az Alap meghirdetett benchmarkkal nem rendelkezik.

A nettó hozam az egy jegyre jutó nettó eszközérték változását fejezi ki nominálisan kifejezve.

2005:-- 2006:-- 2007:-- 2008:-0,74%* 2009:13,91%

*2008.12.15-2008.12.31 időszakra vonatkozó nem évesített adat

d) a tárgyévben számolt utolsó összesített nettó eszközérték

vonatkozási napja: 2010.06.11. 799 368 000 Ft (HUF)

e) 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 |
|---------|-----------------|-----------------------------------|
| 2007 | - | - |
| 2008 | 2008.12.31. | 9926,433873 |
| 2009 | 2009.12.31. | 11307,479224 |

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

| | |
|---|--|
| az egyes értékesített eszközök befolyt ellenértéke (Ft (HUF)): | 799 368 000 |
| az esetleges járulékos és egyéb bevételek (Ft (HUF)): | 0 |
| a végelszámolás során felmerült költségek és felszámított díjak tétélesen (Ft (HUF)): | 0 |
| a befektetők között felosztható tőke (Ft (HUF)): | 799 368 000 |
| az egy befektetési jegyre kifizethető összeg (Ft (HUF)): | 12 000,00 |
| a kifizetés kezdő napja : | 2010.06.22. |
| a kifizetés helye: | az értékpapírok letéti őrzésével megbízott pénzügyintézet vagy befektetési szolgáltató |

Budapest, 2010. június 17.

Horváth Barnabás sk. Ziaja György sk.
K&H Befektetési Alapkezelő Zrt.

Jelen dokumentum sajátkezű aláírásképet biztonsági okból nem tartalmaz. Jelen dokumentum tartalma az eredeti, cégszerű aláírással és egyéb felelős személy aláírásával ellátott papír alapú dokumentum tartalmával mindenben egyező és sajátkezű aláírás nélkül is cégszerűnek illetve hitelesnek tekinthető.