

# Féléves jelentés

2019 I. félév

Allianz Rövid Kötvény Befektetési Alap



A jelen féléves jelentést az Allianz Alapkezelő Zrt., mint az Allianz Rövid Kötvény Befektetési Alap (továbbiakban: az Alap) alapkezelője - a befektetési alapkezelőkről és a kollektív befektetési formákról szóló 2014. évi XVI. törvény előírásai szerint- az Alap 2019. első félévi működésének bemutatása céljából készítette. Az Alap általános működésével kapcsolatos további adatok az Alap tájékoztatójában és kezelési szabályzatában találhatóak meg. A hivatkozott tájékoztató és kezelési szabályzat az Allianz Alapkezelőnél, az Alap befektetési jegyeinek forgalmazójánál, az Alap befektetési jegyeinek forgalmazási helyein, valamint az Alapkezelő honlapján: [www.allianzalapkezelo.hu](http://www.allianzalapkezelo.hu) weboldalon tekinthető meg.

Budapest, 2019. augusztus 26.

Allianz Alapkezelő Zrt.



## Általános információk

### Az Alap adatai

Neve:	Allianz Rövid Kötvény Befektetési Alap
ISIN kódja:	HU0000707146
Felügyeleti lajtsrom száma:	1111-296
Felügyeleti lajstromba vételi határozat száma:	E-III/110.689-1/2008
típusa:	nyilvános
fajtája:	nyíltvégű értékpapír befektetési alap
futamideje:	a nyilvántartásba vételtől határozatlan ideig terjed
befektetőinek köre:	devizabelföldi magán- és jogi személyek, valamint jogi személyiséggel nem rendelkező gazdálkodó szervezetek, és egyéb szervezetek vásárolhatják
célja:	Az Alap célja, hogy középtávon a rövid lejáratú magyar állampapír befektetésekkel versenyképes hozamot érjen el, mérsékelt kockázati szint mellett.
jegyének típusa:	dematerializált, névre szóló
jegyének névértéke:	1,- Ft
jegyének sorozata:	a befektetési jegyek egy sorozatot képeznek

### Az Alapkezelő adatai

Az Alapkezelő neve:	Allianz Alapkezelő Zrt.
Székhelye:	1087 Budapest, Könyves Kálmán Krt.48-52.
Alapítás időpontja:	2008. március 11.
Cégbejegyzés helye:	a Fővárosi Bíróság, mint Cégbíróság Budapest
Cégbejegyzés ideje:	2008. április 23.
Cégbejegyzés száma:	Cg. 01-10-045969



### Letétkezelő adatai

A társaság neve	MTB Magyar Takarékszövetkezeti Bank Zrt.
Székhelye	1122 Budapest, Pethényi köz 10.
Alapítás időpontja	1989. április 18.
Cégbejegyzés helye	a Fővárosi Bíróság, mint Cégbíróság Budapest
Cégbejegyzés ideje	1990. július 3.
Cégbejegyzés száma	01-10-041206

### Vezető forgalmazó adatai

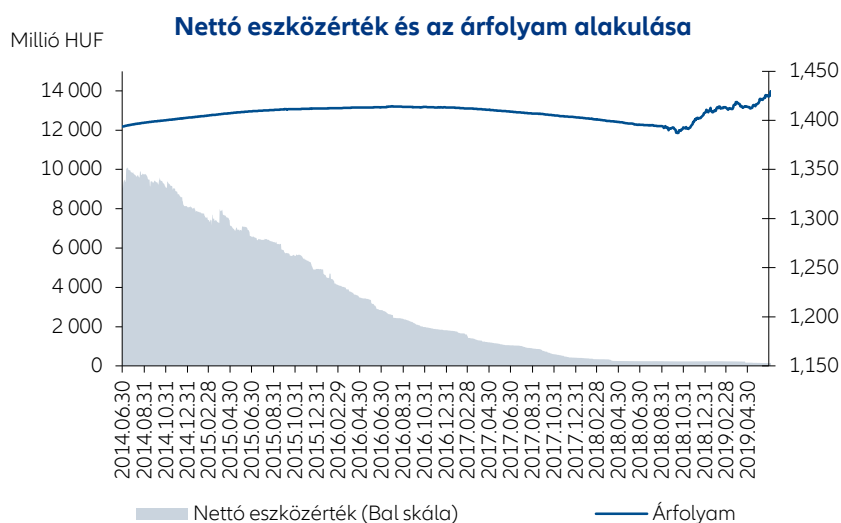
A társaság neve	MTB Magyar Takarékszövetkezeti Bank Zrt.
Székhelye	1122 Budapest, Pethényi köz 10.
Alapítás időpontja	1989. április 18.
Cégbejegyzés helye	a Fővárosi Bíróság, mint Cégbíróság Budapest
Cégbejegyzés ideje	1990. július 3.
Cégbejegyzés száma	01-10-041206

### Könyvvizsgáló adatai

Az Alap könyvvizsgálója	TRUSTED ADVISER Könyvvizsgáló és Tanácsadó Kft.
Székhelye	1082 Budapest, Baross utca 66-68. 3. em. 11.
Kamarai száma	002588
A könyvvizsgálatért felelős személy	Szovics Zsolt
MKVK tagsági nyilvántartási száma	005784
Pénzügyi minősítés száma	E-005784/04

### Alap nettó eszközértéke és az egy jegyre jutó nettó eszközértéke

	2018.12.31	2019.06.30
nettó eszközérték forintban	237 425 629	144 694 098
egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték forintban	1,4079	1,4243



## I. Vagyongkimutatás

	2018.12.31					2019.06.30				
	Darab	Névérték	Deviza-nem	Eszközérték forintban	Százalék	Darab	Névérték	Deviza-nem	Eszközérték forintban	Százalék
<b>Banki egyenlegek</b>				<b>95 855 459</b>	40,37%				<b>50 629 099</b>	34,99%
Folyószámla, készpénz			HUF	55 844 348	23,52%			HUF	50 629 099	34,99%
Lekötött betétek			HUF	40 011 111	16,85%			HUF	0	0,00%
<b>Átruházható értékpapírok</b>			HUF	<b>141 954 125</b>	59,79%				<b>97 226 541</b>	67,19%
Diszkont kincstárjegyek										
D190227	3 500	35 000 000	HUF	35 000 000	14,74%	0	0	HUF	0	0,00%
D190522	2 000	20 000 000	HUF	19 997 300	8,42%	0	0	HUF	0	0,00%
D190731	1 500	15 000 000	HUF	14 989 560	6,31%	1 500	15 000 000	HUF	14 997 375	10,36%
D190925	100	1 000 000	HUF	998 751	0,42%	1 100	11 000 000	HUF	10 994 489	7,60%
D191120	100	1 000 000	HUF	996 491	0,42%	100	1 000 000	HUF	999 198	0,69%
D200226	0	0	HUF	0	0,00%	300	3 000 000	HUF	2 995 725	2,07%
D200429	0	0	HUF	0	0,00%	500	5 000 000	HUF	4 990 375	3,45%
D190911	0	0	HUF	0	0,00%	500	5 000 000	HUF	4 997 900	3,45%
D190918	0	0	HUF	0	0,00%	200	2 000 000	HUF	1 999 078	1,38%
D191002	0	0	HUF	0	0,00%	300	3 000 000	HUF	2 999 703	2,07%
Államkötvények										
2020/A		4 500 000	HUF	5 122 980	2,16%	100	1 000 000	HUF	1 148 321	0,79%
2020/B		4 000 000	HUF	4 245 216	1,79%	270	2 700 000	HUF	2 793 031	1,93%
2021/C		4 500 000	HUF	4 450 199	1,87%	400	4 000 000	HUF	4 009 560	2,77%
2022/A		0		0	0,00%	250	2 500 000	HUF	2 955 990	2,04%
2022/B		15 000 000	HUF	15 110 385	6,36%	800	8 000 000	HUF	8 315 912	5,75%
2023/A		4 900 000	HUF	5 909 057	2,49%	490	4 900 000	HUF	6 068 537	4,19%
2024/B		15 000 000	HUF	15 823 815	6,66%	300	3 000 000	HUF	3 220 008	2,23%
2025/B		4 000 000	HUF	4 813 568	2,03%	450	4 500 000	HUF	5 458 293	3,77%
2026/D		3 700 000	HUF	3 649 317	1,54%	500	5 000 000	HUF	5 302 685	3,66%
2027/A		7 000 000	HUF	7 036 988	2,96%	300	3 000 000	HUF	3 238 818	2,24%
2028/A		2 000 000	HUF	2 644 390	1,11%	200	2 000 000	HUF	2 818 520	1,95%
2031/A		1 200 000	HUF	1 166 108	0,49%	120	1 200 000	HUF	1 290 565	0,89%
2024/C		0	HUF	0	0,00%	200	2 000 000	HUF	2 141 328	1,48%
2022/C		0	HUF	0	0,00%	50	500 000	HUF	511 400	0,35%
2030/A		0	HUF	0	0,00%	50	500 000	HUF	524 007	0,36%
2023/B		0	HUF	0	0,00%	250	2 500 000	HUF	2 455 723	1,70%
<b>Befektetett eszközök összesen</b>			HUF	<b>237 809 584</b>	100,16%				<b>147 855 640</b>	102,18%
<b>Követelések</b>			HUF	0	0,00%			HUF	80 133	0,06%
<b>Kötelezettségek</b>			HUF	383 955	0,16%			HUF	3 241 675	2,24%
<b>Saját tőke (nettó eszközérték)</b>				<b>237 425 629</b>	100,00%				<b>144 694 098</b>	100,00%



## II. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

2019	Nyitó Állomány	Forgalomba hozatal	Visszaváltás	Záró állomány
Január	168 632 608	1 422 414	53 759	170 001 263
Február	170 001 263	184 551	4 029 045	166 156 769
Március	166 156 769	35 243	3 897 580	162 294 432
Április	162 294 432	1 105 125	44 049 379	119 350 178
Május	119 350 178	0	9 359 328	109 990 850
Június	109 990 850	30 960	8 428 842	101 592 968

## III. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

2019	Az Alap saját tőkéje forintban	Egy jegyre jutó saját tőke (nettó eszközérték) forintban
2018.12.31	237 425 629	1,4079
2019.01.31	239 956 107	1,4115
2019.02.28	234 684 574	1,4124
2019.03.31	230 210 152	1,4185
2019.04.30	168 654 226	1,4131
2019.05.31	156 121 041	1,4194
2019.06.30	144 694 098	1,4243



IV. Az Alap összetétele							
	2018.12.31 egyes eszközök értéke forintban	2018.12.31 egyes eszközök a nettó eszközérték arányában	2018.12.31 egyes eszközök az összes eszköz arányában	2019.06.30 egyes eszközök értéke forintban	2019.06.30 egyes eszközök a nettó eszközérték arányában	2019.06.30 egyes eszközök az összes eszköz arányában	egyes eszközöknek az összes eszközhöz viszonyított arányának változása
a tőzsdén hivatalosan jegyzett átruházható értékpapírok	0	0,00%	0,00%		0,00%	0,00%	0,00%
más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok	0	0,00%	0,00%		0,00%	0,00%	0,00%
a közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok	0	0,00%	0,00%		0,00%	0,00%	0,00%
egyéb átruházható értékpapírok (kollektív befektetési ép)	0	0,00%	0,00%		0,00%	0,00%	0,00%
hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	141 954 125	59,79%	59,69%	97 226 541	67,19%	65,76%	6,07%
betétek és folyószámla	95 855 459	40,37%	40,31%	50 629 099	34,99%	34,24%	-6,07%
befektetett eszközök összesen	237 809 584	100,16%	100,00%	147 855 640	102,18%	100,00%	0,00%
követelések	0	0,00%		80 133	0,06%		
kötelezettségek	383 955	0,16%		3 241 675	2,24%		
Saját tőke (nettó eszközérték)	<b>237 425 629</b>	<b>100,00%</b>		<b>144 694 098</b>	<b>100,00%</b>		

### Tőkeáttétel alkalmazására vonatkozó információk

Az Alap 2019. első félévében tőkeáttételt nem alkalmazott. Az Alap 78/2014. Kormányrendelet, és a Kezelési Szabályzat szerinti nettó kockázati kitétsége nem haladhatja meg a nettó eszközérték 200 %-át.

### Egyéb információk

Az Alap 2019. első félévében nem vett fel hitelt. Az Alap nem fizetett hozamot.

### Származtatott ügyletek leírása

Az Alap 2019. első félévében származtatott ügyletet nem kötött.

### Értékpapír finanszírozási ügyletek leírása

Az Alap 2019. első félévében értékpapír finanszírozási ügyletet nem kötött.

