

2020 I. félév

Féléves jelentés

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 2020. 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 weboldalon tekinthető meg.

Budapest, 2020. augusztus 14.

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

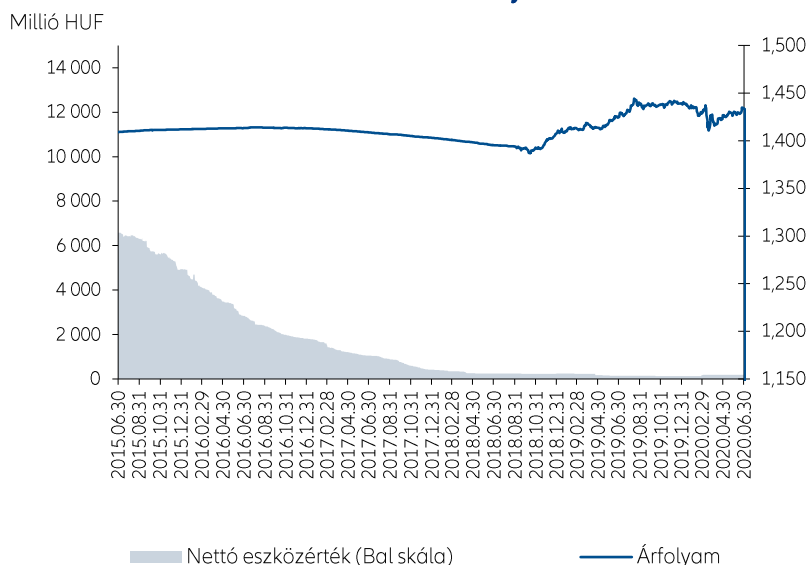
Könyvvizsgáló adatai

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

	2019.12.31	2020.06.30
nettó eszközérték forintban	129 567 247	188 442 747
egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték forintban	1,4387	1,4337

Nettó eszközérték és az árfolyam alakulása



I. Vagyonkimutatás										
	2019.12.31					2020.06.30				
	Darab	Névérték	Deviza-nem	Eszközérték forintban	Százalék	Darab	Névérték	Deviza-nem	Eszközérték forintban	Százalék
Banki egyenlegek				61 416 337	47,40%				49 332 178	26,18%
Folyószámla, készpénz			HUF	61 416 337	47,40%			HUF	49 332 178	26,18%
Lekötött betétek			HUF	0	0,00%			HUF	0	0,00%
Átruházható értékpapírok			HUF	68 590 242	52,94%			HUF	151 443 050	80,37%
Diszkont kincstárjegyek										
D200226	300	3 000 000	HUF	3 000 045	2,32%	0	0	HUF	0	0,00%
D200429	500	5 000 000	HUF	5 000 165	3,86%	0	0	HUF	0	0,00%
D200826	200	2 000 000	HUF	2 000 066	1,54%	400	4 000 000	HUF	3 998 880	2,12%
D201223	0	0	HUF	0	0,00%	300	3 000 000	HUF	2 996 526	1,59%
D210224	0	0	HUF	0	0,00%	400	4 000 000	HUF	3 993 300	2,12%
D200701	0	0	HUF	0	0,00%	300	3 000 000	HUF	2 999 985	1,59%
D200715	0	0	HUF	0	0,00%	300	3 000 000	HUF	2 999 790	1,59%
D200722	0	0	HUF	0	0,00%	200	2 000 000	HUF	1 999 790	1,06%
D200805	0	0	HUF	0	0,00%	300	3 000 000	HUF	2 999 475	1,59%
D210421	0	0	HUF	0	0,00%	700	7 000 000	HUF	6 987 204	3,71%
D200916	0	0	HUF	0	0,00%	400	4 000 000	HUF	3 998 460	2,12%
D200923	0	0	HUF	0	0,00%	300	3 000 000	HUF	2 998 740	1,59%
D201007	0	0	HUF	0	0,00%	1 000	10 000 000	HUF	9 992 170	5,30%
Államkötvények										
2021/C	300	3 000 000	HUF	3 029 097	2,34%	600	6 000 000	HUF	6 015 360	3,19%
2022/A	250	2 500 000	HUF	3 021 138	2,33%	0	0	HUF	0	0,00%
2022/B	400	4 000 000	HUF	4 173 608	3,22%	600	6 000 000	HUF	6 209 076	3,29%
2023/A	300	3 000 000	HUF	3 654 327	2,82%	100	1 000 000	HUF	1 203 081	0,64%
2024/B	300	3 000 000	HUF	3 338 136	2,58%	300	3 000 000	HUF	3 226 221	1,71%
2025/B	450	4 500 000	HUF	5 682 380	4,39%	900	9 000 000	HUF	10 852 794	5,76%
2026/D	400	4 000 000	HUF	4 362 984	3,37%	480	4 800 000	HUF	5 242 291	2,78%
2027/A	270	2 700 000	HUF	2 994 073	2,31%	470	4 700 000	HUF	5 232 435	2,78%
2028/A	200	2 000 000	HUF	2 837 768	2,19%	300	3 000 000	HUF	4 278 072	2,27%
2031/A	120	1 200 000	HUF	1 337 773	1,03%	100	1 000 000	HUF	1 128 510	0,60%
2024/C	300	3 000 000	HUF	3 237 210	2,50%	420	4 200 000	HUF	4 518 792	2,40%
2022/C	350	3 500 000	HUF	3 631 089	2,80%	155	1 550 000	HUF	1 594 888	0,85%
2030/A	100	1 000 000	HUF	1 105 676	0,85%	310	3 100 000	HUF	3 421 808	1,82%
2025/C	140	1 400 000	HUF	1 389 591	1,07%	220	2 200 000	HUF	2 181 373	1,16%
2038/A	20	200 000	HUF	207 141	0,16%	40	400 000	HUF	422 024	0,22%
2023/B	1 350	13 500 000	HUF	13 498 448	10,42%	2 405	24 050 000	HUF	23 856 830	12,66%
2020/C	0	0	HUF	0	0,00%	200	2 000 000	HUF	2 019 098	1,07%
2023/C	0	0	HUF	0	0,00%	300	3 000 000	HUF	3 058 716	1,62%
2029/A	0	0	HUF	0	0,00%	200	2 000 000	HUF	2 004 640	1,06%
2021/A	0	0	HUF	0	0,00%	1 230	12 300 000	HUF	12 308 241	6,53%
2027/B	0	0	HUF	0	0,00%	200	2 000 000	HUF	1 932 878	1,03%
Jelzáloglevelek										
TJ24NF02	100	1 000 000	HUF	1 089 527	0,84%	2	20 000	HUF	21 581	0,01%
UCJBF 2021/A	0	0	HUF	0	0,00%	200	2 000 000	HUF	2 089 164	1,11%
TJ25NF01	0	0	HUF	1	0,00%	100	1 000 000	HUF	1 020 053	0,54%
TJ24NV01	0	0	HUF	2	0,00%	86	860 000	HUF	863 696	0,46%
Állam által garantált pénzügyi kötvények										
EXIM 2022/1	0	0	HUF	0	0,00%	19	190 000	HUF	190 295	0,10%
MFB202406/1	0	0	HUF	0	0,00%	56	560 000	HUF	586 813	0,31%
Befektetett eszközök összesen			HUF	130 006 579	100,34%			HUF	200 775 228	106,54%
Követelések			HUF	152 526	0,12%			HUF	110 160	0,06%
Kötelezettségek			HUF	591 858	0,46%			HUF	12 442 641	6,60%
Saját tőke (nettó eszközérték)				129 567 247	100,00%				188 442 747	100,00%



II. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

2020	Nyitó Állomány	Forgalomba hozatal	Visszaváltás	Záró állomány
Január	90 056 447	4 872 472	2 163 539	92 765 380
Február	92 765 380	29 235 347	2 569 722	119 431 005
Március	119 431 005	17 511 532	5 406 805	131 535 732
Április	131 535 732	1 412 728	679 698	132 268 762
Május	132 268 762	0	828 403	131 440 359
Június	131 440 359	0	0	131 440 359

III. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

2020	Az Alap saját tőkéje forintban	Egy jegyre jutó saját tőke (nettó eszközérték) forintban
2019.12.31	129 567 247	1,4387
2020.01.31	133 139 081	1,4352
2020.02.29	170 662 187	1,4290
2020.03.31	186 901 397	1,4209
2020.04.30	188 620 997	1,4260
2020.05.31	187 990 795	1,4302
2020.06.30	188 442 747	1,4337



IV. Az Alap összetétele							
	2019.12.31	2019.12.31	2019.12.31	2020.06.30	2020.06.30	2020.06.30	egyes eszközök az összes eszközhöz viszonyított arányának változása
	egyes eszközök értéke forintban	egyes eszközök a nettó eszközérték arányában	egyes eszközök az összes eszköz arányában	egyes eszközök értéke forintban	egyes eszközök a nettó eszközérték arányában	egyes eszközök az összes eszköz arányában	
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	68 590 242	52,94%	52,76%	151 443 050	80,37%	75,43%	22,67%
betétek és folyószámla	61 416 337	47,40%	47,24%	49 332 178	26,18%	24,57%	-22,67%
befektetett eszközök összesen	130 006 579	100,34%	100,00%	200 775 228	106,54%	100,00%	0,00%
követelések	152 526	0,12%		110 160	0,06%		
kötelezettségek	591 858	0,46%		12 442 641	6,60%		
Saját tőke (nettó eszközérték)	129 567 247	100,00%		188 442 747	100,00%		

Tőkeáttétel alkalmazására vonatkozó információk

Az Alap 2020. 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 2020. első félévében nem vett fel hitelt. Az Alap nem fizetett hozamot.

Származtatott ügyletek leírása

Az Alap 2020. első félévében származtatott ügyletet nem kötött.

Értékpapír finanszírozási ügyletek leírása

Az Alap 2020. első félévében értékpapír finanszírozási ügyletet nem kötött.

