

2021 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 2021. 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, 2021. augusztus 17.

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

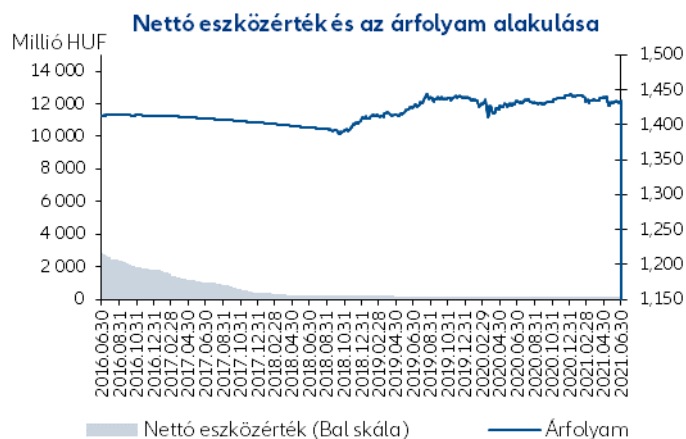
A társaság neve	MTB Magyar Takarékszövetkezeti Bank Zrt.
Székhelye	1122 Budapest, Pethényi köz 10.
Alapítás időpontja	1989. április 18.
Cégbejegyzés helye	a Fővárosi Bíróság, mint Cégbíróság Budapest
Cégbejegyzés ideje	1990. július 3.
Cégbejegyzés száma	01-10-041206

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

	2020.12.31	2021.06.30
nettó eszközérték forintban	182 897 575	170 477 513
egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték forintban	1,4429	1,4341



I. Vagyongkimutatás

	2020.12.31					2021.06.30				
	Darab	Névérték	Deviza-nem	Eszközérték forintban	Százalék	Darab	Névérték	Deviza-nem	Eszközérték forintban	Százalék
Banki egyenlegek				33 621 047	18,38%				43 524 148	25,53%
Folyószámla, készpénz			HUF	33 621 047	18,38%			HUF	43 524 148	25,53%
Lekötött betétek			HUF	0	0,00%			HUF		0,00%
Átruházható értékpapírok			HUF	153 600 566	83,98%			HUF	129 248 261	75,82%
Diszkont kincstárjegyek										
D210203	300	3 000 000	HUF	2 999 301	1,64%	0	0	HUF	0	0,00%
D210210	200	2 000 000	HUF	1 999 424	1,09%	0	0	HUF	0	0,00%
D210224	600	6 000 000	HUF	5 997 618	3,28%	0	0	HUF	0	0,00%
D210303	200	2 000 000	HUF	1 999 098	1,09%	0	0	HUF	0	0,00%
D210310	200	2 000 000	HUF	1 998 990	1,09%	0	0	HUF	0	0,00%
D210317	200	2 000 000	HUF	1 998 880	1,09%	0	0	HUF	0	0,00%
D210331	200	2 000 000	HUF	1 998 664	1,09%	0	0	HUF	0	0,00%
D210407	400	4 000 000	HUF	3 997 136	2,19%	0	0	HUF	0	0,00%
D210421	700	7 000 000	HUF	6 994 337	3,82%	0	0	HUF	0	0,00%
D210630	200	2 000 000	HUF	1 996 828	1,09%	0	0	HUF	0	0,00%
D210728	0	0	HUF	0	0,00%	500	5 000 000	HUF	4 998 315	2,93%
D210804	0	0	HUF	0	0,00%	200	2 000 000	HUF	1 999 150	1,17%
D210811	0	0	HUF	0	0,00%	200	2 000 000	HUF	1 998 976	1,17%
D210818	0	0	HUF	0	0,00%	200	2 000 000	HUF	1 998 800	1,17%
D210825	350	3 500 000	HUF	3 492 685	1,91%	400	4 000 000	HUF	3 997 252	2,34%
D210901	0	0	HUF	0	0,00%	200	2 000 000	HUF	1 998 452	1,17%
D210922	0	0	HUF	0	0,00%	200	2 000 000	HUF	1 997 928	1,17%
D211006	0	0	HUF	0	0,00%	200	2 000 000	HUF	1 997 122	1,17%
D211020	200	2 000 000	HUF	1 994 974	1,09%	200	2 000 000	HUF	1 997 224	1,17%
D220309	0	0	HUF	0	0,00%	50	500 000	HUF	497 719	0,29%



	2020.12.31					2021.06.30				
	Darab	Névérték	Deviza-nem	Eszköztérték forintban	Százalék	Darab	Névérték	Deviza-nem	Eszköztérték forintban	Százalék
Államkötvények										
2021/C	500	5 000 000	HUF	5 020 360	2,74%	0	0	HUF	0	0,00%
2023/A	100	1 000 000	HUF	1 157 222	0,63%	50	500 000	HUF	570 900	0,33%
2024/B	300	3 000 000	HUF	3 259 548	1,78%	450	4 500 000	HUF	4 678 924	2,74%
2025/B	220	2 200 000	HUF	2 685 096	1,47%	220	2 200 000	HUF	2 503 134	1,47%
2026/D	380	3 800 000	HUF	4 098 547	2,24%	380	3 800 000	HUF	3 976 643	2,33%
2027/A	670	6 700 000	HUF	7 395 118	4,04%	470	4 700 000	HUF	5 010 106	2,94%
2028/A	200	2 000 000	HUF	2 766 940	1,51%	200	2 000 000	HUF	2 681 756	1,57%
2031/A	400	4 000 000	HUF	4 475 144	2,45%	250	2 500 000	HUF	2 717 202	1,59%
2024/C	350	3 500 000	HUF	3 722 498	2,04%	350	3 500 000	HUF	3 648 984	2,14%
2022/C	5	50 000	HUF	51 109	0,03%	5	50 000	HUF	50 971	0,03%
2030/A	150	1 500 000	HUF	1 646 352	0,90%	150	1 500 000	HUF	1 606 599	0,94%
2025/C	670	6 700 000	HUF	6 690 466	3,66%	570	5 700 000	HUF	5 504 952	3,23%
2038/A	50	500 000	HUF	557 183	0,30%	50	500 000	HUF	501 153	0,29%
2021/A	1 230	12 300 000	HUF	12 322 964	6,74%	0	0	HUF	0	0,00%
2023/B	2 405	24 050 000	HUF	24 053 896	13,15%	2 105	21 050 000	HUF	21 143 167	12,40%
2027/B	1 550	15 500 000	HUF	15 124 079	8,27%	1 850	18 500 000	HUF	18 319 884	10,75%
2023/C	350	3 500 000	HUF	3 592 372	1,96%	300	3 000 000	HUF	3 051 855	1,79%
2029/A	200	2 000 000	HUF	2 040 664	1,12%	200	2 000 000	HUF	1 954 246	1,15%
2026/E	500	5 000 000	HUF	5 062 655	2,77%	550	5 500 000	HUF	5 380 831	3,16%
2026/F	0	0	HUF	0	0,00%	250	2 500 000	HUF	2 444 560	1,43%
2029/B	0	0	HUF	0	0,00%	200	2 000 000	HUF	1 963 428	1,15%
2033/A	150	1 500 000	HUF	1 524 427	0,83%	250	2 500 000	HUF	2 368 317	1,39%
2034/A	0	0	HUF	0	0,00%	100	1 000 000	HUF	919 365	0,54%
Állam által garantált pénzügyi kötvények										
EXIM 2021/1	200	2 000 000	HUF	2 006 028	1,10%	200	2 000 000	HUF	2 015 806	1,18%
EXIM 2022/1	19	190 000	HUF	193 404	0,11%	19	190 000	HUF	190 897	0,11%
EXIM 2022/2	0	0	HUF	0	0,00%	200	2 000 000	HUF	2 005 570	1,18%
EXIM 2022/3	0	0	HUF	0	0,00%	400	4 000 000	HUF	4 001 060	2,35%
EXIM 2025/1	200	2 000 000	HUF	2 061 552	1,13%	200	2 000 000	HUF	2 008 516	1,18%
MFB202406/1	56	560 000	HUF	594 461	0,33%	56	560 000	HUF	575 454	0,34%
Jelzáloglevelek										
TJ24NF02	2	20 000	HUF	21 946	0,01%	2	20 000	HUF	20 842	0,01%
UCJBF 2021/A	200	2 000 000	HUF	2 038 714	1,11%	200	2 000 000	HUF	2 043 458	1,20%
TJ25NF01	100	1 000 000	HUF	1 036 495	0,57%	100	1 000 000	HUF	979 314	0,57%
EJBFN27/A	6	60 000	HUF	62 285	0,03%	6	60 000	HUF	60 894	0,04%
TJ24NV01	86	860 000	HUF	871 106	0,48%	86	860 000	HUF	868 535	0,51%
Befektetett eszközök összesen			HUF	187 221 613	102,36%			HUF	172 772 409	101,35%
Követelések			HUF	0	0,00%			HUF	1 678	0,00%
Kötelezettségek			HUF	4 324 038	2,36%			HUF	2 296 574	1,35%
Saját tőke (nettó eszköztérték)				182 897 575	100,00%				170 477 513	100,00%



II. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

2021	Nyitó Állomány	Forgalomba hozatal	Visszaváltás	Záró állomány
Január	126 755 768	222 700	834 957	126 143 511
Február	126 143 511	34 739	693 043	125 485 207
Március	125 485 207	0	1 610 677	123 874 530
Április	123 874 530	208 879	750 052	123 333 357
Május	123 333 357	1 209 828	813 165	123 730 020
Június	123 730 020	17 430	4 874 212	118 873 238

III. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

2021	Az Alap saját tőkéje forintban	Egy jegyre jutó saját tőke (nettó eszközérték) forintban
2020.12.31	182 897 574	1,4429
2021.01.31	181 901 240	1,4420
2021.02.28	179 919 459	1,4338
2021.03.31	177 684 282	1,4344
2021.04.30	177 476 914	1,4390
2021.05.31	177 194 306	1,4321
2021.06.30	170 477 513	1,4341



IV. Az Alap összetétele							
	2020.12.31	2020.12.31	2020.12.31	2021.06.30	2021.06.30	2021.06.30	egyres eszközök az
	egyres eszközök	egyres eszközök a	egyres eszközök az	egyres eszközök	egyres eszközök a	egyres eszközök az	összes eszközhöz
	értéke forintban	nettó eszközérték	összes eszköz	értéke forintban	nettó eszközérték	összes eszköz	viszonyított
		arányában	arányában		arányában	arányában	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	153 600 566	83,98%	82,04%	129 248 261	75,82%	74,81%	-7,23%
betétek és folyószámla	33 621 047	18,38%	17,96%	43 524 148	25,53%	25,19%	7,23%
befektetett eszközök összesen	187 221 613	102,36%	100,00%	172 772 409	101,35%	100,00%	0,00%
követelések	0	0,00%		1 678	0,00%		
kötelezettségek	4 324 038	2,36%		2 296 574	1,35%		
Saját tőke (nettó eszközérték)	182 897 575	100,00%		170 477 513	100,00%		

Tőkeáttétel alkalmazására vonatkozó információk

Az Alap 2021. első félévében tőkeáttételt nem alkalmazott. Az Alap 78/2014. Kormányrendelet, és a Kezelési Szabályzat szerinti nettó kockázati kitettsége nem haladhatja meg a nettó eszközérték 200 %-át.

Egyéb információk

Az Alap 2021. első félévében nem vett fel hitelt. Az Alap nem fizetett hozamot.

Származtatott ügyletek leírása

Az Alap 2021. első félévében származtatott ügyletet nem kötött.

Értékpapír finanszírozási ügyletek leírása

Az Alap 2021. első félévében értékpapír finanszírozási ügyletet nem kötött.

