

Féléves jelentés

2022 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 2022. 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, 2022. augusztus 23.

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

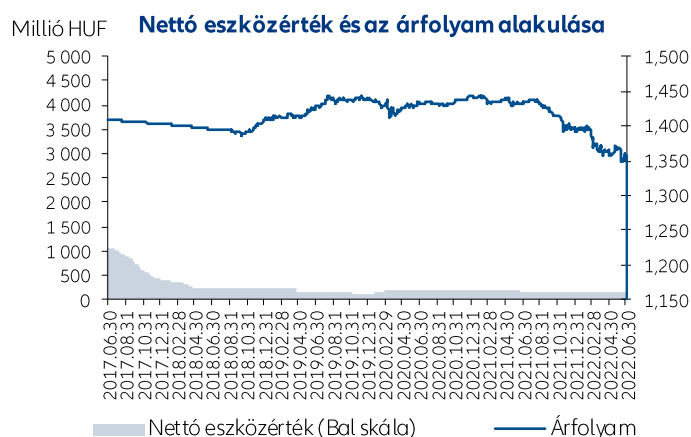
A társaság neve	MTB Magyar Takarékszövetkezeti Bank Zrt.
Székhelye	1122 Budapest, Pethényi köz 10.
Alapítás időpontja	1989. április 18.
Cégbejegyzés helye	a Fővárosi Bíróság, mint Cégbíróság Budapest
Cégbejegyzés ideje	1990. július 3.
Cégbejegyzés száma	01-10-041206

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	Forgács Gabriella
MKVK tagsági nyilvántartási száma	003228
Pénzügyi minősítés száma	E-003228/02

Alap nettó eszközértéke és az egy jegyre jutó nettó eszközértéke

	2021.12.31	2022.06.30
nettó eszközérték forintban	154 965 175	146 160 247
egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték forintban	1,3955	1,3569771



I. Vagyonkimutatás

	2021.12.31					2022.06.30				
	Darab	Névérték	Deviza-nem	Eszközérték forintban	Százalék	Darab	Névérték	Deviza-nem	Eszközérték forintban	Százalék
Banki egyenlegek				29 202 892	18,84%				30 721 931	21,02%
Folyószámla, készpénz			HUF	29 202 892	18,84%			HUF	21 111 231	14,44%
Lekötött betétek			HUF	0	0,00%			HUF	9 610 700	6,58%
Átruházható értékpapírok			HUF	127 048 772	81,99%			HUF	115 748 972	79,19%
Diszkont kincstárjegyek										
D220105	200	2 000 000	HUF	1 999 760	1,29%		0	HUF	0	0,00%
D220112	200	2 000 000	HUF	1 998 920	1,29%		0	HUF	0	0,00%
D220309	350	3 500 000	HUF	3 486 403	2,25%		0	HUF	0	0,00%
D220323	200	2 000 000	HUF	1 990 564	1,28%		0	HUF	0	0,00%
D220406	100	1 000 000	HUF	994 071	0,64%		0	HUF	0	0,00%
D220504	200	2 000 000	HUF	1 985 736	1,28%		0	HUF	0	0,00%
D220629	250	2 500 000	HUF	2 468 503	1,59%		0	HUF	0	0,00%
D220824	100	1 000 000	HUF	981 592	0,63%	100	1 000 000	HUF	990 668	0,68%
D220706	0	0	HUF	0	0,00%	200	2 000 000	HUF	1 998 258	1,37%
D220713	0	0	HUF	0	0,00%	200	2 000 000	HUF	1 995 822	1,37%
D220803	0	0	HUF	0	0,00%	200	2 000 000	HUF	1 988 552	1,36%
D220831	0	0	HUF	0	0,00%	200	2 000 000	HUF	1 978 942	1,35%
D221019	0	0	HUF	0	0,00%	200	2 000 000	HUF	1 963 382	1,34%
D221228	0	0	HUF	0	0,00%	100	1 000 000	HUF	968 455	0,66%
D230222	0	0	HUF	0	0,00%	400	4 000 000	HUF	3 832 688	2,62%
D230419	0	0	HUF	0	0,00%	100	1 000 000	HUF	947 733	0,65%



Államkötvények											
2022/B	100	1 000 000	HUF	992 938	0,64%	500	5 000 000	HUF	4 985 845	3,41%	
2023/A	50	500 000	HUF	520 181	0,34%	50	500 000	HUF	506 448	0,35%	
2024/B	300	3 000 000	HUF	2 969 064	1,92%	100	1 000 000	HUF	907 867	0,62%	
2025/B	300	3 000 000	HUF	3 208 536	2,07%	200	2 000 000	HUF	1 855 944	1,27%	
2026/D	280	2 800 000	HUF	2 604 445	1,68%	280	2 800 000	HUF	2 268 089	1,55%	
2027/A	270	2 700 000	HUF	2 523 342	1,63%	100	1 000 000	HUF	799 917	0,55%	
2028/A	150	1 500 000	HUF	1 716 267	1,11%	50	500 000	HUF	486 965	0,33%	
2031/A	250	2 500 000	HUF	2 272 957	1,47%	100	1 000 000	HUF	720 864	0,49%	
2024/C	400	4 000 000	HUF	3 844 496	2,48%	250	2 500 000	HUF	2 246 055	1,54%	
2022/C	400	4 000 000	HUF	3 991 292	2,58%	200	2 000 000	HUF	2 010 974	1,38%	
2030/A	150	1 500 000	HUF	1 358 065	0,88%	100	1 000 000	HUF	733 000	0,50%	
2025/C	400	4 000 000	HUF	3 555 324	2,29%	380	3 800 000	HUF	3 020 711	2,07%	
2038/A	100	1 000 000	HUF	808 688	0,52%	150	1 500 000	HUF	866 442	0,59%	
2023/B	2 105	21 050 000	HUF	21 194 824	13,68%	1 305	13 050 000	HUF	13 290 563	9,09%	
2027/B	1 950	19 500 000	HUF	19 302 562	12,46%	2 050	20 500 000	HUF	20 537 923	14,05%	
2028/B	0	0	HUF	0	0,00%	230	2 300 000	HUF	1 955 055	1,34%	
2023/C	50	500 000	HUF	486 578	0,31%	0	0	HUF	0	0,00%	
2029/A	400	4 000 000	HUF	3 431 840	2,21%	400	4 000 000	HUF	2 764 280	1,89%	
2026/E	550	5 500 000	HUF	4 956 413	3,20%	500	5 000 000	HUF	3 926 175	2,69%	
2026/F	500	5 000 000	HUF	4 440 215	2,87%	500	5 000 000	HUF	3 892 160	2,66%	
2029/B	500	5 000 000	HUF	4 890 520	3,16%	1 080	10 800 000	HUF	10 593 482	7,25%	
2032/A	0	0	HUF	0	0,00%	300	3 000 000	HUF	2 389 074	1,63%	
2032/G	0	0	HUF	0	0,00%	100	1 000 000	HUF	770 861	0,53%	
2033/A	250	2 500 000	HUF	2 048 585	1,32%	150	1 500 000	HUF	906 904	0,62%	
2034/A	150	1 500 000	HUF	1 177 384	0,76%	200	2 000 000	HUF	1 142 738	0,78%	
Állam által garantált pénzügyi kötvények											
EXIM 2022/1	19	190 000	HUF	188 785	0,12%	0	0	HUF	0	0,00%	
EXIM 2025/1	200	2 000 000	HUF	1 799 124	1,16%	200	2 000 000	HUF	1 615 348	1,11%	
MFB202406/1	56	560 000	HUF	540 413	0,35%	76	760 000	HUF	677 796	0,46%	
EXIM 2022/2	200	2 000 000	HUF	2 010 306	1,30%	0	0	HUF	0	0,00%	
EXIM 2022/3	400	4 000 000	HUF	3 929 384	2,54%	0	0	HUF	0	0,00%	
EXIM 2022/4	100	1 000 000	HUF	986 074	0,64%	100	1 000 000	HUF	1 001 804	0,69%	
EXIM 2022/5	200	2 000 000	HUF	1 972 552	1,27%	200	2 000 000	HUF	1 982 290	1,36%	
MFB202311/1	300	3 000 000	HUF	2 816 844	1,82%	500	5 000 000	HUF	4 573 685	3,13%	
MFB202301/1	100	1 000 000	HUF	987 487	0,64%	200	2 000 000	HUF	1 968 506	1,35%	
MFB202410/1	50	500 000	HUF	495 926	0,32%	50	500 000	HUF	465 502	0,32%	
Jelzáloglevelek											
TJ24NF02	2	20 000	HUF	20 045	0,01%	2	20 000	HUF	18 841	0,01%	
TJ25NF01	100	1 000 000	HUF	922 546	0,60%	100	1 000 000	HUF	843 652	0,58%	
EJBFN27/A	6	60 000	HUF	53 553	0,03%	6	60 000	HUF	45 965	0,03%	
TJ24NV01	86	860 000	HUF	868 259	0,56%	86	860 000	HUF	874 098	0,60%	
TJ26NF02	50	500 000	HUF	429 080	0,28%	50	500 000	HUF	374 810	0,26%	
TJ31NF01	100	1 000 000	HUF	828 330	0,53%	100	1 000 000	HUF	659 881	0,45%	
TZJ27NF1	0	0	HUF	0	0,00%	50	500 000	HUF	403 958	0,28%	
Befektetett eszközök összesen			HUF	156 251 664	100,83%			HUF	146 470 903	100,21%	
Követelések			HUF	0	0,00%			HUF	0	0,00%	
Kötelezettségek			HUF	1 286 489	0,83%			HUF	310 656	0,21%	
Saját tőke (nettó eszközérték)				154 965 175	100,00%				146 160 247	100,00%	



II. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

2022	Nyitó Állomány	Forgalomba hozatal	Visszaváltás	Záró állomány
Január	111 044 033	518 666	38 940	111 523 759
Február	111 523 759	0	3 177 868	108 345 891
Március	108 345 891	0	0	108 345 891
Április	108 345 891	183 428	601 814	107 927 505
Május	107 927 505	368 269	236 994	108 058 780
Június	108 058 780	0	348 602	107 710 178

III. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

2022	Az Alap saját tőkéje forintban	Egy jegyre jutó saját tőke (nettó eszközérték) forintban
2021.12.31	154 965 175	1,3955
2022.01.31	155 417 962	1,3936
2022.02.28	150 205 792	1,3864
2022.03.31	148 513 641	1,3707363
2022.04.30	147 077 202	1,3627407
2022.05.31	147 780 269	1,3675915
2022.06.30	146 160 247	1,3569771



IV. Az Alap összetétele							
	2021.12.31	2021.12.31	2021.12.31	2022.06.30	2022.06.30	2022.06.30	egyes eszközök az összes eszközhöz viszonyított arányának változása a
	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	127 048 772	81,99%	81,31%	115 748 972	79,19%	79,03%	-2,28%
betétek és folyószámla	29 202 892	18,84%	18,69%	30 721 931	21,02%	20,97%	2,28%
befektetett eszközök összesen	156 251 664	100,83%	100,00%	146 470 903	100,21%	100,00%	0,00%
követelések	0	0,00%		0	0,00%		
kötelezettségek	1 286 489	0,83%		310 656	0,21%		
Saját tőke (nettó eszközérték)	154 965 175	100,00%		146 160 247	100,00%		

Tőkeáttétel alkalmazására vonatkozó információk

Az Alap 2022. 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 2022. első félévében nem vett fel hitelt. Az Alap nem fizetett hozamot.

Az Alap nem minősül sem az SFDR rendelet (Az Európai Parlament és a Tanács (EU) 2019/2088 Rendelete) 8. cikke, sem pedig a 9. cikke szerinti pénzügyi terméknek.

Az Európai Parlament és a Tanács (EU) 2020/852 rendelete 7. cikkében foglaltak alapján az Alap alapjául szolgáló befektetések nem veszik figyelembe a környezeti szempontból fenntartható gazdasági tevékenységekre vonatkozó uniós kritériumokat és nem kerülnek figyelembevételre a befektetési döntéseknek az SFDR rendelet 4. és 7. cikke szerinti, a fenntarthatósági tényezőkre gyakorolt káros hatásai, tekintettel az SFDR 4. cikke (3) bekezdésében foglalt, Allianz Alapkezelő Zrt.-re vonatkozó átlagos foglalkoztatotti létszám kritériumra, illetve arra, hogy jelenleg nem állnak teljeskörűen rendelkezésre a környezeti és társadalmi tényezőket érő káros hatásokra vonatkozóan számszerűsítő, az Alapkezelő által figyelembe vehető adatok, információk.



Származtatott ügyletek leírása

Az Alap 2022. első félévében származtatott ügyletet nem kötött.

Értékpapír finanszírozási ügyletek leírása

Az Alap 2022. első félévében értékpapír finanszírozási ügyletet nem kötött.

