

2023 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 2023. 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, 2023. augusztus 21.

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	MBH Befektetési Bank Bank Zrt.
Székhelye	1117 Budapest, Magyar Tudósok Körútja 9. G. épület
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

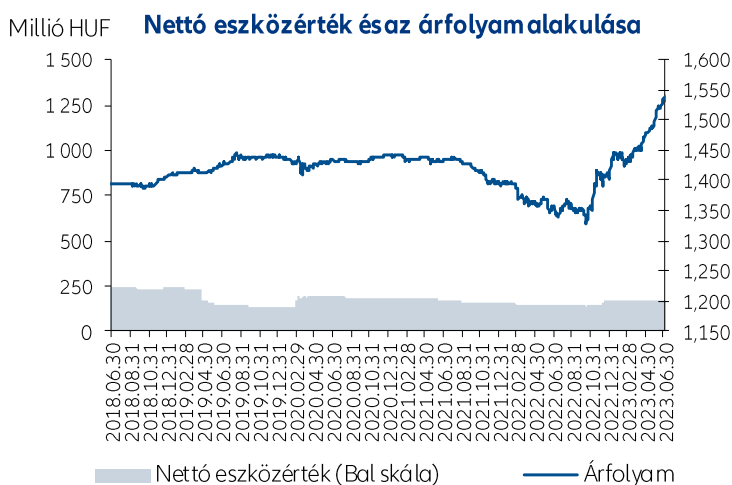
A társaság neve	MBH Befektetési Bank Bank Zrt.
Székhelye	1117 Budapest, Magyar Tudósok Körútja 9. G. épület
Alapítás időpontja	1989. április 18.
Cégbejegyzés helye	a Fővárosi Bíróság, mint Cégbíróság Budapest
Cégbejegyzés ideje	1990. július 3.
Cégbejegyzés száma	01-10-041206

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

	2022.12.31	2023.06.30
nettó eszközérték forintban	167 509 195	173 239 983
egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték forintban	1,4058	1,5371191



I. Vagyongkimutatás

	2022.12.31					2023.06.30				
	Darab	Névérték	Deviza-nem	Eszközérték forintban	Százalék	Darab	Névérték	Deviza-nem	Eszközérték forintban	Százalék
Banki egyenlegek				36 622 316	21,86%				16 148 773	9,32%
Folyószámla, készpénz			HUF	36 622 316	21,86%			HUF	16 148 773	9,32%
Lekötött betétek			HUF		0,00%			HUF	0	0,00%
Átruházható értékpapírok			HUF	133 129 968	79,48%			HUF	159 426 879	92,03%
Diszkont kincstárjegyek										
D230201	200	2 000 000	HUF	1 979 676	1,18%	0	0	HUF	0	0,00%
D230208	300	3 000 000	HUF	2 962 488	1,77%	0	0	HUF	0	0,00%
D230222	700	7 000 000	HUF	6 879 922	4,11%	0	0	HUF	0	0,00%
D230301	200	2 000 000	HUF	1 961 074	1,17%	0	0	HUF	0	0,00%
D230322	500	5 000 000	HUF	4 868 380	2,91%	0	0	HUF	0	0,00%
D230405	200	2 000 000	HUF	1 931 170	1,15%	0	0	HUF	0	0,00%
D230517	500	5 000 000	HUF	4 761 620	2,84%	0	0	HUF	0	0,00%
D231018	100	1 000 000	HUF	901 064	0,54%	100	1 000 000	HUF	971 329	0,56%
D230712	0	0	HUF	0	0,00%	300	3 000 000	HUF	2 992 497	1,73%
D230726	0	0	HUF	0	0,00%	200	2 000 000	HUF	1 987 266	1,15%
D230816	0	0	HUF	0	0,00%	200	2 000 000	HUF	1 975 780	1,14%
D230823	0	0	HUF	0	0,00%	300	3 000 000	HUF	2 957 970	1,71%
D230906	0	0	HUF	0	0,00%	200	2 000 000	HUF	1 964 424	1,13%
D230920	0	0	HUF	0	0,00%	700	7 000 000	HUF	6 849 248	3,95%
D231004	0	0	HUF	0	0,00%	200	2 000 000	HUF	1 950 018	1,13%
D231129	0	0	HUF	0	0,00%	300	3 000 000	HUF	2 876 427	1,66%
D240124	0	0	HUF	0	0,00%	800	8 000 000	HUF	7 568 952	4,37%
D240221	0	0	HUF	0	0,00%	200	2 000 000	HUF	1 879 200	1,08%
D240430	0	0	HUF	0	0,00%	450	4 500 000	HUF	4 140 486	2,39%



Államkötvények										
2023/A	0	0	HUF	0	0,00%	430	4 300 000	HUF	4 371 418	2,52%
2024/B	320	3 200 000	HUF	2 875 283	1,72%	620	6 200 000	HUF	5 778 778	3,34%
2025/B	200	2 000 000	HUF	1 807 422	1,08%	100	1 000 000	HUF	927 669	0,54%
2026/D	180	1 800 000	HUF	1 361 723	0,81%	280	2 800 000	HUF	2 371 065	1,37%
2027/A	400	4 000 000	HUF	2 949 840	1,76%	400	4 000 000	HUF	3 422 588	1,98%
2028/A	0	0	HUF	0	0,00%	50	500 000	HUF	504 129	0,29%
2031/A	300	3 000 000	HUF	2 006 085	1,20%	250	2 500 000	HUF	1 998 185	1,15%
2024/C	250	2 500 000	HUF	2 141 647	1,28%	0	0	HUF	0	0,00%
2030/A	300	3 000 000	HUF	2 074 896	1,24%	400	4 000 000	HUF	3 234 200	1,87%
2025/C	380	3 800 000	HUF	2 925 023	1,75%	330	3 300 000	HUF	2 778 629	1,60%
2038/A	450	4 500 000	HUF	2 435 899	1,45%	400	4 000 000	HUF	2 670 936	1,54%
2023/B	1 305	13 050 000	HUF	13 517 815	8,07%	1 305	13 050 000	HUF	13 488 453	7,79%
2027/B	2 050	20 500 000	HUF	21 446 976	12,80%	2 050	20 500 000	HUF	21 262 036	12,27%
2023/C	0	0	HUF	0	0,00%	0	0	HUF	0	0,00%
2029/A	400	4 000 000	HUF	2 730 036	1,63%	550	5 500 000	HUF	4 198 892	2,42%
2026/E	500	5 000 000	HUF	3 839 710	2,29%	350	3 500 000	HUF	2 889 960	1,67%
2026/F	500	5 000 000	HUF	3 708 090	2,21%	270	2 700 000	HUF	2 228 580	1,29%
2026/H	0	0	HUF	0	0,00%	117	1 170 000	HUF	1 245 337	0,72%
2028/B	330	3 300 000	HUF	2 718 734	1,62%	330	3 300 000	HUF	2 938 141	1,70%
2029/B	1 080	10 800 000	HUF	10 807 257	6,45%	1 080	10 800 000	HUF	11 032 578	6,37%
2032/A	400	4 000 000	HUF	2 940 416	1,76%	430	4 300 000	HUF	3 776 978	2,18%
2032/B	50	500 000	HUF	491 157	0,29%	50	500 000	HUF	505 330	0,29%
2032/G	200	2 000 000	HUF	1 496 442	0,89%	400	4 000 000	HUF	3 373 796	1,95%
2033/A	350	3 500 000	HUF	2 088 877	1,25%	350	3 500 000	HUF	2 424 891	1,40%
2034/A	250	2 500 000	HUF	1 421 607	0,85%	180	1 800 000	HUF	1 187 701	0,69%
2041/A	0	0	HUF	0	0,00%	200	2 000 000	HUF	1 237 142	0,71%
Állam által garantált pénzintézeti kötvények										
EXIM 2025/1	200	2 000 000	HUF	1 510 884	0,90%	200	2 000 000	HUF	1 631 188	0,94%
MFB202406/1	76	760 000	HUF	664 159	0,40%	76	760 000	HUF	693 885	0,40%
EXIM 2023/3	100	1 000 000	HUF	1 001 300	0,60%	100	1 000 000	HUF	1 075 895	0,62%
EXIM 2023/4	200	2 000 000	HUF	2 062 090	1,23%	200	2 000 000	HUF	2 214 058	1,28%
EXIM 2023/5	200	2 000 000	HUF	2 055 106	1,23%	200	2 000 000	HUF	2 216 504	1,28%
EXIM 2023/7	100	1 000 000	HUF	1 017 609	0,61%	100	1 000 000	HUF	1 098 592	0,63%
EXIM 2023/8	50	500 000	HUF	492 936	0,29%	50	500 000	HUF	539 454	0,31%
EXIM 2024/6	0	0	HUF	0	0,00%	100	1 000 000	HUF	1 038 278	0,60%
EXIM 2024/7	0	0	HUF	0	0,00%	100	1 000 000	HUF	996 484	0,58%
EXIM 2026/2	0	0	HUF	0	0,00%	100	1 000 000	HUF	1 083 211	0,63%
MFB202311/1	600	6 000 000	HUF	5 357 249	3,20%	600	6 000 000	HUF	5 771 580	3,33%
MFB202301/1	200	2 000 000	HUF	2 031 986	1,21%	0	0	HUF	0	0,00%
MFB202410/1	50	500 000	HUF	433 388	0,26%	50	500 000	HUF	468 106	0,27%
Jelzáloglevelek										
TJ24NF02	2	20 000	HUF	18 623	0,01%	2	20 000	HUF	19 370	0,01%
TJ25NF01	100	1 000 000	HUF	819 349	0,49%	100	1 000 000	HUF	871 338	0,50%
EJBFN27/A	6	60 000	HUF	41 628	0,02%	6	60 000	HUF	48 240	0,03%
TJ24NV01	86	860 000	HUF	883 590	0,53%	86	860 000	HUF	890 845	0,51%
TJ26NF02	50	500 000	HUF	346 693	0,21%	50	500 000	HUF	390 933	0,23%
TJ31NF01	0	0	HUF	0	0,00%	0	0	HUF	0	0,00%
TZJ27NF1	50	500 000	HUF	363 049	0,22%	50	500 000	HUF	417 909	0,24%
Befektetett eszközök összesen			HUF	169 752 284	101,34%			HUF	175 575 652	101,35%
Követelések			HUF	1 312	0,00%			HUF	4 484	0,00%
Kötelezettségek			HUF	2 244 401	1,34%			HUF	2 340 153	1,35%
Saját tőke (nettó eszközérték)				167 509 195	100,00%				173 239 983	100,00%



II. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

2023	Nyitó Állomány	Forgalomba hozatal	Visszaváltás	Záró állomány
Január	119 152 356	0	28 465	119 123 891
Február	119 123 891	0	1 425 481	117 698 410
Március	117 698 410	68 863	3 917 427	113 849 846
Április	113 849 846	55 179	21 372	113 883 653
Május	113 883 653	288 512	1	114 172 164
Június	114 172 164	1 892 404	3 360 237	112 704 331

III. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

2023	Az Alap saját tőkéje forintban	Egy jegyre jutó saját tőke (nettó eszközérték) forintban
2022.12.31	167 509 195	1,4058404
2023.01.31	171 071 155	1,4360776
2023.02.28	168 678 815	1,4331444
2023.03.31	164 928 658	1,4486507
2023.04.30	167 942 981	1,4746891
2023.05.31	170 326 785	1,4918416
2023.06.30	173 239 983	1,5371191



IV. Az Alap összetétele							
	2022.12.31	2022.12.31	2022.12.31	2023.06.30	2023.06.30	2023.06.30	egyes eszközöknek 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	133 129 968	79,48%	78,43%	159 426 879	92,03%	90,80%	12,37%
betétek és folyószámla	36 622 316	21,86%	21,57%	16 148 773	9,32%	9,20%	-12,37%
befektetett eszközök összesen	169 752 284	101,34%	100,00%	175 575 652	101,35%	100,00%	0,00%
követelések	1 312	0,00%		4 484	0,00%		
kötelezettségek	2 244 401	1,34%		2 340 153	1,35%		
Saját tőke (nettó eszközérték)	167 509 195	100,00%		173 239 983	100,00%		

Tőkeáttétel alkalmazására vonatkozó információk

Az Alap 2023. 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 2023. 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, illetve a 2017/565 EU rendelet 2. cikk 7. pontjában meghatározott fenntarthatósági preferenciával sem rendelkezik.

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 2023. első félévében származtatott ügyletet nem kötött.

Értékpapír finanszírozási ügyletek leírása

Az Alap 2023. első félévében értékpapír finanszírozási ügyletet nem kötött.

