

Féléves jelentés

2024 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 2024. 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, 2024. augusztus 22.

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

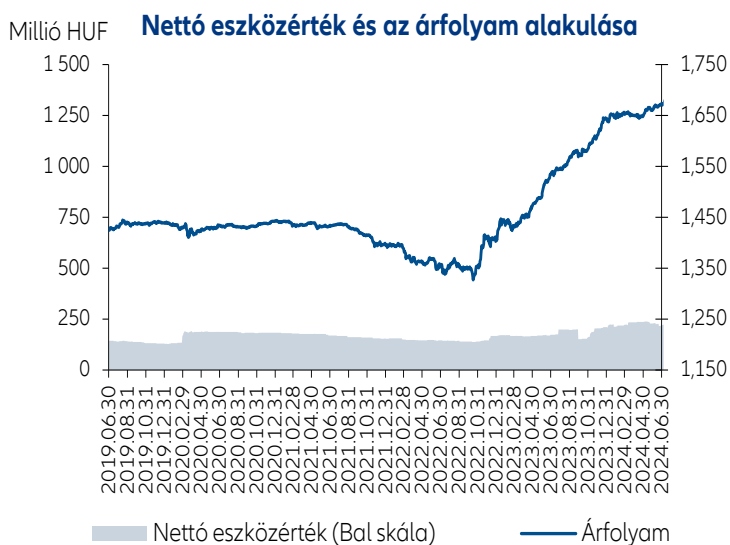
Az Alapkezelő neve:	Allianz Alapkezelő Zrt.
Székhelye:	1087 Budapest, Könyves Kálmán Krt.48-52.
Alapítás időpontja:	2008. március 11.
Cégbejegyzés helye:	a Fővárosi Bíróság, mint Cégbíróság Budapest
Cégbejegyzés ideje:	2008. április 23.
Cégbejegyzés száma:	Cg. 01-10-045969



Letétkezelő adatai	
A társaság neve	MBH Befektetési Bank 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 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 könyvvizgatótért 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

	2023.12.31	2024.06.30
nettó eszközérték forintban	210 412 670	218 195 342
egy befektetési jegyre jutó nettó eszközérték forintban	1,6429978	1,6725852



I. Vagyongkimutatás

	2023.12.31					2024.06.30				
	Darab	Névérték	Deviza-nem	Eszköztérték forintban	Százalék	Darab	Névérték	Deviza-nem	Eszköztérték forintban	Százalék
Banki egyenlegek				55 905 005	26,57%				36 071 754	16,53%
Folyósámla, készpénz			HUF	55 905 005	26,57%			HUF	36 071 754	16,53%
Lekötött betétek			HUF	0	0,00%			HUF		0,00%
Átruházható értékpapírok			HUF	159 859 488	75,97%			HUF	190 049 747	87,10%
Diszkont kincstárjegyek										
D240117	200	2 000 000	HUF	1 994 822	0,95%			HUF		0,00%
D240124	800	8 000 000	HUF	7 969 656	3,79%			HUF		0,00%
D240214	300	3 000 000	HUF	2 977 842	1,42%			HUF		0,00%
D240221	1 000	10 000 000	HUF	9 914 210	4,71%			HUF		0,00%
D240228	300	3 000 000	HUF	2 970 696	1,41%			HUF		0,00%
D240313	200	2 000 000	HUF	1 975 724	0,94%			HUF		0,00%
D240320	700	7 000 000	HUF	6 906 767	3,28%			HUF		0,00%
D240403	500	5 000 000	HUF	4 918 320	2,34%			HUF		0,00%
D240430	950	9 500 000	HUF	9 310 038	4,42%			HUF		0,00%
D240821	200	2 000 000	HUF	1 919 748	0,91%	1 600	16 000 000	HUF	15 860 464	7,27%
D241030	200	2 000 000	HUF	1 893 906	0,90%	1 900	19 000 000	HUF	18 614 376	8,53%
D240724	0	0	HUF	0	0,00%	1 400	14 000 000	HUF	13 944 672	6,39%
D240918	0	0	HUF	0	0,00%	500	5 000 000	HUF	4 932 780	2,26%



Államkötvények											
2024/B	620	6 200 000	HUF	6 184 791	2,94%	0	0	HUF	0	0,00%	
2025/B	0	0	HUF	0	0,00%	100	1 000 000	HUF	991 678	0,45%	
2026/D	280	2 800 000	HUF	2 550 590	1,21%	580	5 800 000	HUF	5 387 388	2,47%	
2027/A	400	4 000 000	HUF	3 666 012	1,74%	400	4 000 000	HUF	3 657 664	1,68%	
2028/A	550	5 500 000	HUF	5 789 894	2,75%	650	6 500 000	HUF	6 819 189	3,13%	
2031/A	250	2 500 000	HUF	2 143 535	1,02%	250	2 500 000	HUF	2 069 600	0,95%	
2024/C	450	4 500 000	HUF	4 359 883	2,07%	1 250	12 500 000	HUF	12 565 062	5,76%	
2030/A	400	4 000 000	HUF	3 474 432	1,65%	800	8 000 000	HUF	6 756 272	3,10%	
2025/C	300	3 000 000	HUF	2 731 797	1,30%	900	9 000 000	HUF	8 404 911	3,85%	
2038/A	300	3 000 000	HUF	2 124 024	1,01%	300	3 000 000	HUF	2 038 212	0,93%	
2027/B	250	2 500 000	HUF	2 608 797	1,24%	250	2 500 000	HUF	2 540 473	1,16%	
2029/A	250	2 500 000	HUF	2 119 280	1,01%	450	4 500 000	HUF	3 656 772	1,68%	
2026/E	200	2 000 000	HUF	1 824 412	0,87%	200	2 000 000	HUF	1 837 864	0,84%	
2026/F	270	2 700 000	HUF	2 418 344	1,15%	70	700 000	HUF	639 555	0,29%	
2026/H	467	4 670 000	HUF	5 149 487	2,45%	467	4 670 000	HUF	5 253 030	2,41%	
2028/B	430	4 300 000	HUF	4 249 251	2,02%	430	4 300 000	HUF	4 054 263	1,86%	
2029/B	1 280	12 800 000	HUF	13 061 798	6,21%	2 080	20 800 000	HUF	20 797 650	9,53%	
2032/A	330	3 300 000	HUF	3 068 168	1,46%	130	1 300 000	HUF	1 171 999	0,54%	
2032/B	1 150	11 500 000	HUF	11 532 430	5,48%	1 950	19 500 000	HUF	19 471 920	8,92%	
2032/G	800	8 000 000	HUF	7 506 392	3,57%	400	4 000 000	HUF	3 468 916	1,59%	
2033/A	250	2 500 000	HUF	1 935 567	0,92%	250	2 500 000	HUF	1 782 013	0,82%	
2034/A	180	1 800 000	HUF	1 333 307	0,63%	180	1 800 000	HUF	1 222 916	0,56%	
2035/A	400	4 000 000	HUF	4 316 016	2,05%	600	6 000 000	HUF	6 418 326	2,94%	
Állam által garantált pénzügyi kötvények											
EXIM 2025/1	200	2 000 000	HUF	1 814 476	0,86%	200	2 000 000	HUF	1 882 546	0,86%	
EXIM 2025/2	100	1 000 000	HUF	1 089 114	0,52%	100	1 000 000	HUF	1 136 044	0,52%	
EXIM 2025/3	200	2 000 000	HUF	2 171 870	1,03%	200	2 000 000	HUF	2 269 588	1,04%	
MFB202406/1	76	760 000	HUF	749 669	0,36%	0	0	HUF	0	0,00%	
EXIM 2024/6	100	1 000 000	HUF	1 126 095	0,54%	0	0	HUF	0	0,00%	
EXIM 2024/7	100	1 000 000	HUF	1 087 535	0,52%	0	0	HUF	0	0,00%	
EXIM 2026/2	100	1 000 000	HUF	1 134 429	0,54%	100	1 000 000	HUF	1 094 291	0,50%	
MFB202410/1	50	500 000	HUF	486 902	0,23%	50	500 000	HUF	510 010	0,23%	
MFB202902/1	0	0	HUF	0	0,00%	50	500 000	HUF	502 255	0,23%	
MNB240704	0	0	HUF	0	0,00%	500	5 000 000	HUF	4 996 550	2,29%	
Jelzáloglevelek											
TJ24NF02	2	20 000	HUF	20 568	0,01%	0	0	HUF	0	0,00%	
TJ25NF01	100	1 000 000	HUF	956 532	0,45%	100	1 000 000	HUF	978 604	0,45%	
EJBFN27/A	6	60 000	HUF	52 526	0,02%	6	60 000	HUF	53 442	0,02%	
MJ29NF01	50	500 000	HUF	517 133	0,25%	50	500 000	HUF	499 515	0,23%	
TJ24NV01	86	860 000	HUF	885 853	0,42%	86	860 000	HUF	875 750	0,40%	
TJ26NF02	50	500 000	HUF	424 094	0,20%	50	500 000	HUF	440 837	0,20%	
TZJ27NF1	50	500 000	HUF	442 756	0,21%	50	500 000	HUF	452 350	0,21%	
Befektetett eszközök összesen			HUF	215 764 493	102,54%			HUF	226 121 501	103,63%	
Követelések			HUF	9 988	0,00%			HUF	5 934	0,00%	
Kötelezettségek			HUF	5 361 811	2,55%			HUF	7 932 093	3,64%	
Saját tőke (nettó eszközérték)				210 412 670	100,00%			218 195 342	100,00%		



II. A forgalomban lévő befektetési jegyek száma

2024	Nyitó Állomány	Forgalomba hozatal	Visszaváltás	Záró állomány
Január	128 066 311	8 072 266	6 403 169	129 735 408
Február	129 735 408	5 552 677	0	135 288 085
Március	135 288 085	8 752 530	1 505 435	142 535 180
Április	142 535 180	1 266 106	35 671	143 765 615
Május	143 765 615	70 863	5 737 768	138 098 710
Június	138 098 710	1 231 292	8 876 056	130 453 946

III. Az egy befektetési jegyre eső nettó eszközérték

2024	Az Alap saját tőkéje forintban	Egy jegyre jutó saját tőke (nettó eszközérték) forintban
2023.12.31	210 412 670	1,6429978
2024.01.31	213 855 623	1,6483983
2024.02.29	223 484 298	1,6519141
2024.03.31	235 129 239	1,6496225
2024.04.30	237 130 458	1,6494240
2024.05.31	229 541 029	1,6621519
2024.06.30	218 195 342	1,6725852



IV. Az Alap összetétele							
	2023.12.31 egyes eszközök értéke forintban	2023.12.31 egyes eszközök a nettó eszközérték arányában	2023.12.31 egyes eszközök az összes eszköz arányában	2024.06.30 egyes eszközök értéke forintban	2024.06.30 egyes eszközök a nettó eszközérték arányában	2024.06.30 egyes eszközök az összes eszköz arányában	egyes eszközöknek az összes eszközhöz viszonyított arányának változása a
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	159 859 488	75,97%	74,09%	190 049 747	87,10%	84,05%	9,96%
betétek és folyószámla	55 905 005	26,57%	25,91%	36 071 754	16,53%	15,95%	-9,96%
befektetett eszközök összesen	215 764 493	102,54%	100,00%	226 121 501	103,63%	100,00%	0,00%
követelések	9 988	0,00%		5 934	0,00%		
kötelezettségek	5 361 811	2,55%		7 932 093	3,64%		
Saját tőke (nettó eszközérték)	210 412 670	100,00%		218 195 342	100,00%		

Tőkeáttétel alkalmazására vonatkozó információk

Az Alap 2024. 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

2024 első féléve során a portfólió összetételében nem történt jelentős változás, az alap befektetési politikája nem változott.

Az Alap 2024. 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 2024. első félévében származtatott ügyletet nem kötött.

Értékpapír finanszírozási ügyletek leírása

Az Alap 2024. első félévében értékpapír finanszírozási ügyletet nem kötött.

