

ДОПЪЛНИТЕЛНА ИНФОРМАЦИЯ КЪМ

ГОДИШЕН ОТЧЕТ ЗА 2022 Г.

ЗА ДЕЙНОСТТА НА ДФ РАЙФАЙЗЕН (БЪЛГАРИЯ) ГЛОБАЛЕН БАЛАНСИРАН ФОНД,  
ОРГАНИЗИРАН И УПРАВЛЯВАН ОТ УПРАВЛЯВАЩО ДРУЖЕСТВО  
КЕЙ БИ СИ УПРАВЛЕНИЕ НА ИНВЕСТИЦИИ ЕАД

**1. Информация съгласно чл. 76, ал. 2 и ал. 4 от НАРЕДБА 44 от 20.10.2011 г. за изискванията към дейността на колективните инвестиционни схеми, управляващите дружества, националните инвестиционни фондове, алтернативните инвестиционни фондове и лицата, управляващи алтернативни инвестиционни фондове.**

Фондът не притежава финансови инструменти закупени, съответно продадени по репо сделки по чл. 50, ал. 1 от НАРЕДБА 44 от 20.10.2011 г. за изискванията към дейността на колективните инвестиционни схеми, управляващите дружества, националните инвестиционни фондове, алтернативните инвестиционни фондове и лицата, управляващи алтернативни инвестиционни фондове.

За периода Фондът няма рискова експозиция, постигната посредством техники за ефективно управление на портфейла, съответно няма базисна експозиция, получена посредством деривативни финансови инструменти.

**2. Информация по чл. 73 т. 7 от Наредба 44 относно метода, използван за изчисляване на общата рискова експозиция, съгласно Насоките на CESR за измерване на риска и изчисляване на общата рискова експозиция и риска на насрещната страна при колективните инвестиционни схеми (CESR/10-788), в случай че в инвестиционната политика на колективната инвестиционна схема изрично е предвидена възможността за инвестиране в деривативни финансови инструменти**

Фондът изчислява общата си рискова експозиция, като комбинира собствената си пряка рискова експозиция към деривативни инструменти с действителната рискова експозиция към деривативни финансови инструменти на Главния му фонд, пропорционално на размера на инвестицията си в Главния фонд, или с максималната обща експозиция на Главния фонд към деривативни финансови инструменти, предвидени в неговите вътрешни документи, пропорционално на размера на инвестицията на фонда в Главния фонд. Рисковата експозиция и риска на насрещната страна на Фонда се изчисляват в съответствие с изискванията на Наредба № 44 и Насоките на Комитета на европейските регулатори по ценни книжа (CESR) за измерване на риска и изчисляване на общата рискова експозиция и риска на насрещната страна при колективните инвестиционни схеми (Реф.: CESR/10-788). За изчисляване на общата рискова експозиция се използва метода на поетите задължения.

**3. Информация по чл. 73 т. 8 относно въздействието на таксите за постигнати резултати върху колективната инвестиционна схема, която включва общия размер на начислените и/или изплатени такси за постигнати резултати през отчетния период, както и процента на таксите на база нетната стойност на класа дялове на колективната инвестиционна схема**

За периода няма начислени и/или изплатени такси за постигнати резултати.

30.03.2023 г., София

.....  
Катина Пейчева  
Председател на Управителния съвет на УД  
КЕЙ БИ СИ УПРАВЛЕНИЕ НА  
ИНВЕСТИЦИИ ЕАД



.....  
Христо Великов  
Член на Управителния съвет на УД  
КЕЙ БИ СИ УПРАВЛЕНИЕ НА  
ИНВЕСТИЦИИ ЕАД