

Bjørnafjorden kommune

PORTEFØLJERAPPORT - risikoreport

Periode: 1. januar 2023 - 31. juli 2023

(Sammendrag totalt, sammendrag aksjer, sammendrag renter, avkastning, meravkastning og risikomål)

Alle

01.01.2023

31.07.2023

Sluttverdi

159,7 mill.

Resultat

10,0 mill.

Avvik budsjett

10,0 mill.

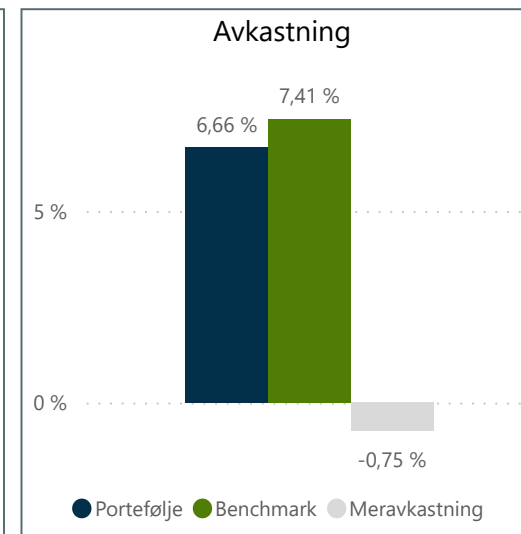
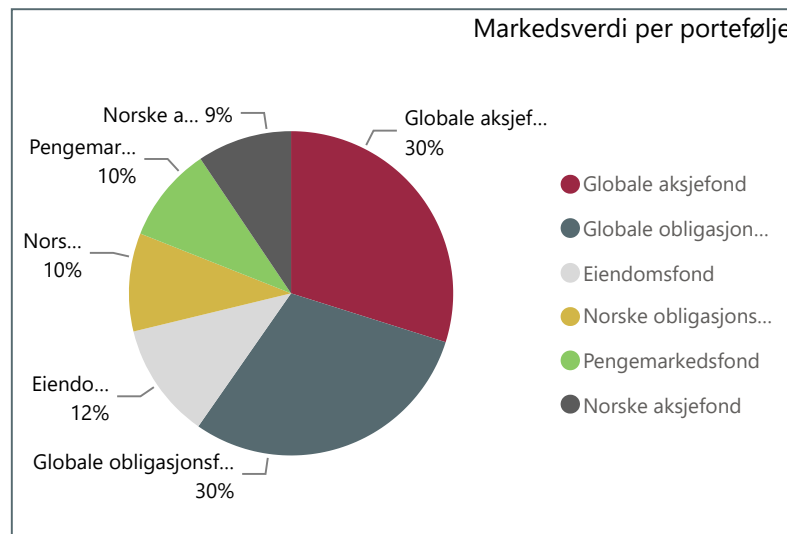
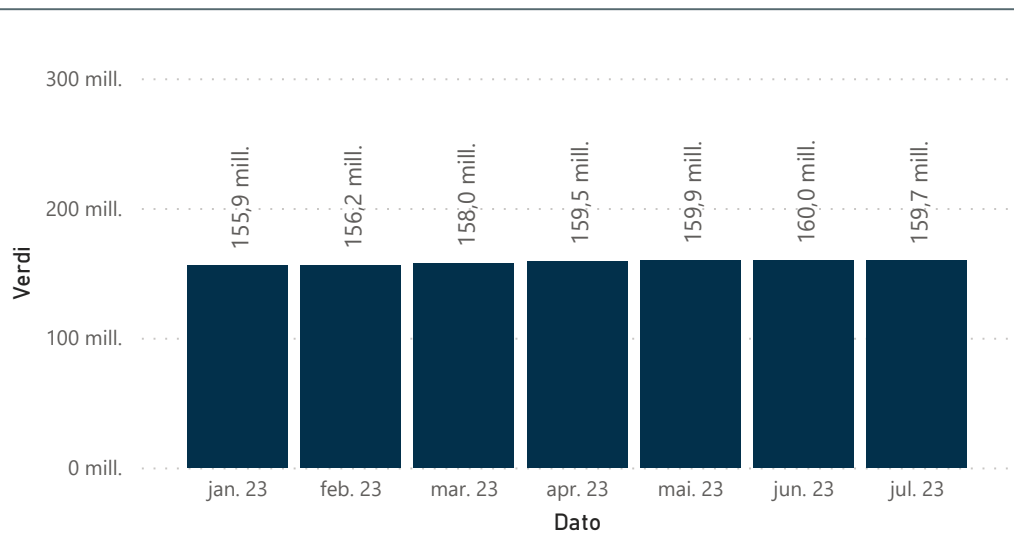
Avkastning mot benchmark

7,41 %

6,66 %

Sammendrag

ID	Beskrivelse	Sluttverdi	Resultat	Avkastning	Benchmark	Meravk. %	Strategisk vekt	Faktisk andel	Avvik	Min	Min_avvik	Maks	Maks_avvik
BJFK1	Pengemarkedsfond	15 264 728	475 655	3,03 %	1,70 %	1,33 %	10 %	9,6 %	-0,4 %	5 %	✓ 0 %	30 %	✓ 0 %
BJFK2	Norske obligasjonsfond	15 638 764	143 302	0,94 %	-0,98 %	1,92 %	10 %	9,8 %	-0,2 %	5 %	✓ 0 %	30 %	✓ 0 %
BJFK3	Globale obligasjonsfond	47 617 257	1 389 942	2,47 %	1,97 %	0,50 %	30 %	29,8 %	-0,2 %	20 %	✓ 0 %	40 %	✓ 0 %
BJFK4	Eiendomsfond	18 404 479	-78 922	-0,43 %	3,49 %	-3,92 %	10 %	11,5 %	1,5 %	0 %	✓ 0 %	20 %	✓ 0 %
BJFK5	Norske aksjefond	15 065 751	598 638	3,99 %	6,90 %	-2,91 %	10 %	9,4 %	-0,6 %	5 %	✓ 0 %	30 %	✓ 0 %
BJFK6	Globale aksjefond	47 703 147	7 452 937	18,35 %	20,19 %	-1,84 %	30 %	29,9 %	-0,1 %	20 %	✓ 0 %	40 %	✓ 0 %
Total	Total	159 694 127	9 981 553	6,66 %	7,41 %	-0,75 %	100 %	100,0 %	0,0 %	100 %	✓ 0 %	100 %	✓ 0 %



BJFK - Aktivklasser

Total

01.01.2023

31.07.2023

Resultat

9 981 553

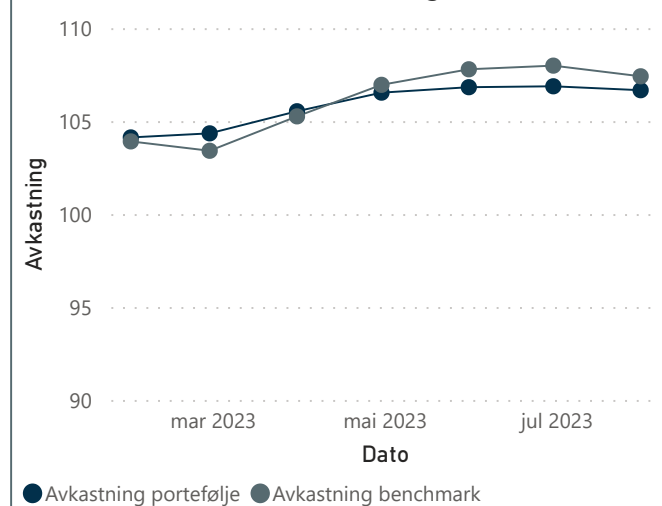
Avkastning mot benchmark



Historisk avkastning

0,12 %	0,43 %
Siste 3 måneder	3 Mnd benchmark
2,44 %	3,37 %
Siste 6 måneder	6 Mnd benchmark
6,66 %	7,41 %
Siste 12 Månedeer	12 Mnd Benchmark
3,28 %	3,64 %
Siste 2 år	2 år benchmark
2,17 %	2,41 %
Siste 3 år	3 år benchmark
1,30 %	1,44 %
Siste 5 år	5 år benchmark

Verdiutvikling



Avkastning per måned

Dato	Faktisk	Benchmark	Meravk. %	Meravkastning
jan. 23	4,12 %	3,91 %	0,21 %	320 099
feb. 23	0,21 %	-0,48 %	0,70 %	1 083 690
mar. 23	1,14 %	1,79 %	-0,65 %	-1 014 366
apr. 23	0,95 %	1,61 %	-0,66 %	-1 048 991
mai. 23	0,27 %	0,78 %	-0,51 %	-814 197
jun. 23	0,05 %	0,18 %	-0,14 %	-216 927
jul. 23	-0,20 %	-0,53 %	0,33 %	533 525

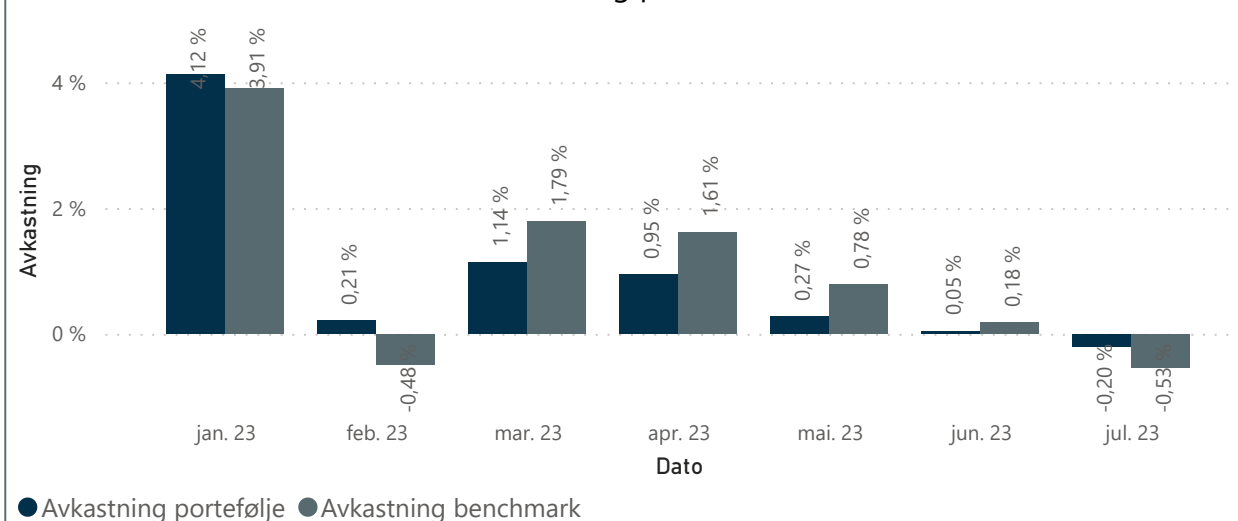
Akkumulert avkastning

Dato	Faktisk	Benchmark	Meravk %	Meravkastning
jan. 23	4,12 %	3,91 %	0,21 %	320 099
feb. 23	4,34 %	3,41 %	0,94 %	1 403 789
mar. 23	5,53 %	5,26 %	0,28 %	389 423
apr. 23	6,53 %	6,95 %	-0,42 %	-659 567
mai. 23	6,82 %	7,79 %	-0,96 %	-1 473 764
jun. 23	6,87 %	7,98 %	-1,11 %	-1 690 691
jul. 23	6,66 %	7,41 %	-0,75 %	-1 157 166

Benchmark

BJFK - Sammensatt indeks Portefølje

Avkastning per måned



BJFK - Aktivklasser

Total

01.01.2023

31.07.2023

Beste måned

0,70 %

Gjennomsnitt

-0,10 %

Verste måned

-0,66 %

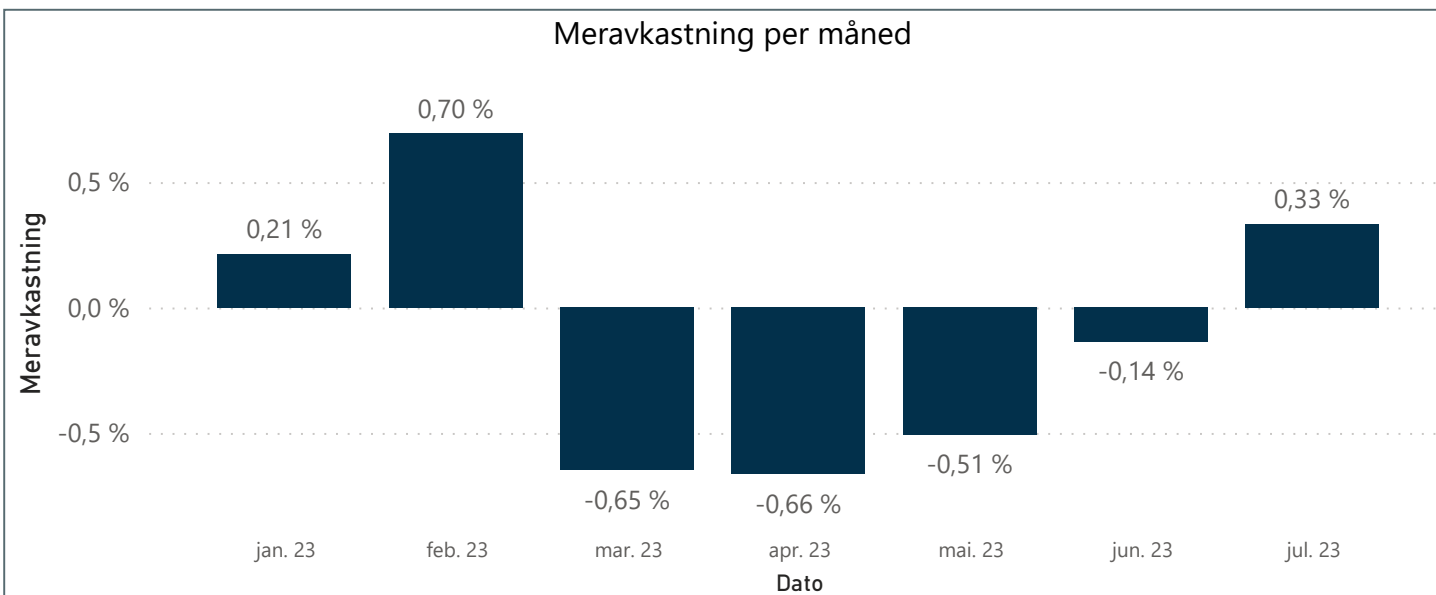
Median

-0,14 %

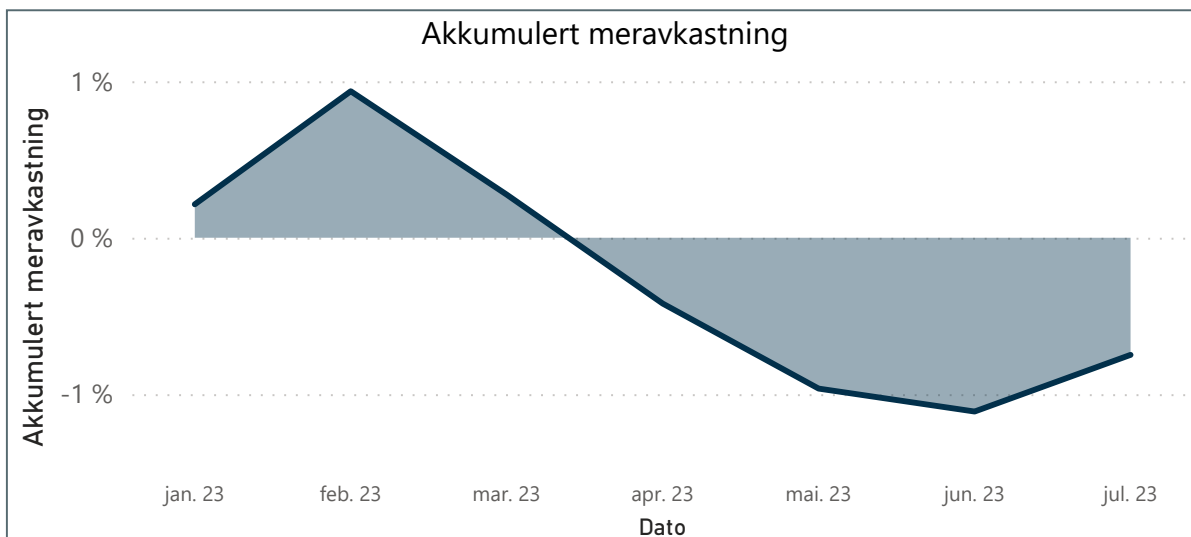
Benchmark

BJFK - Sammensatt indeks Portefølje

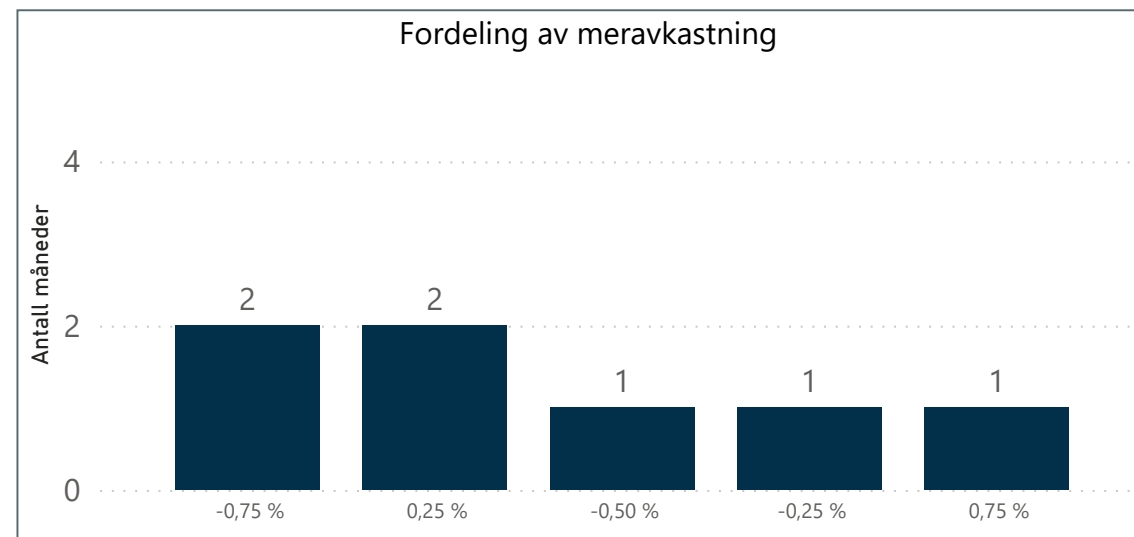
Meravkastning per måned



Akkumulert meravkastning



Fordeling av meravkastning



BJFK - Aktivaklasser

Total

01.01.2023

31.07.2023

-0,72
Information Ratio

1,75
SharpeRatio

1,71 %
Tracking Error

-0,19 %
Alfa

0,89
Beta

0,88
Determination

