

# Bjørnafjorden kommune

PORTEFØLJERAPPORT - risikoreport

Periode: 1. januar 2023 - 31. desember 2023

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

Alle

01.01.2023

31.12.2023

Sluttverdi

164,1 mill.

Resultat

14,4 mill.

Avvik budsjett

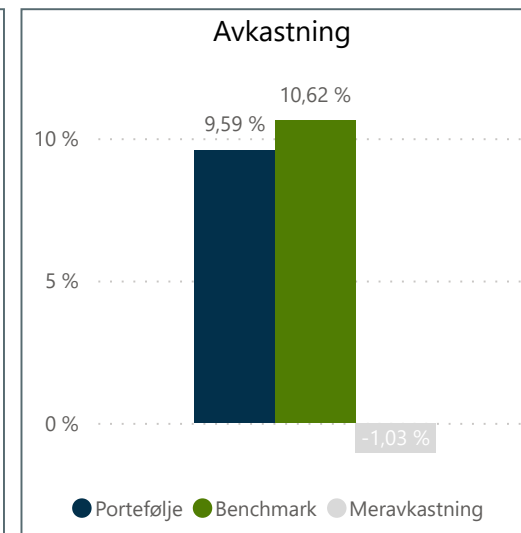
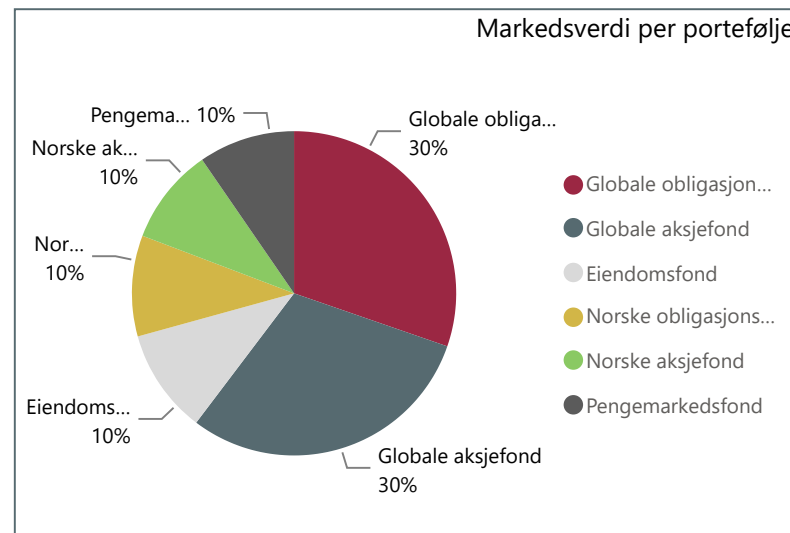
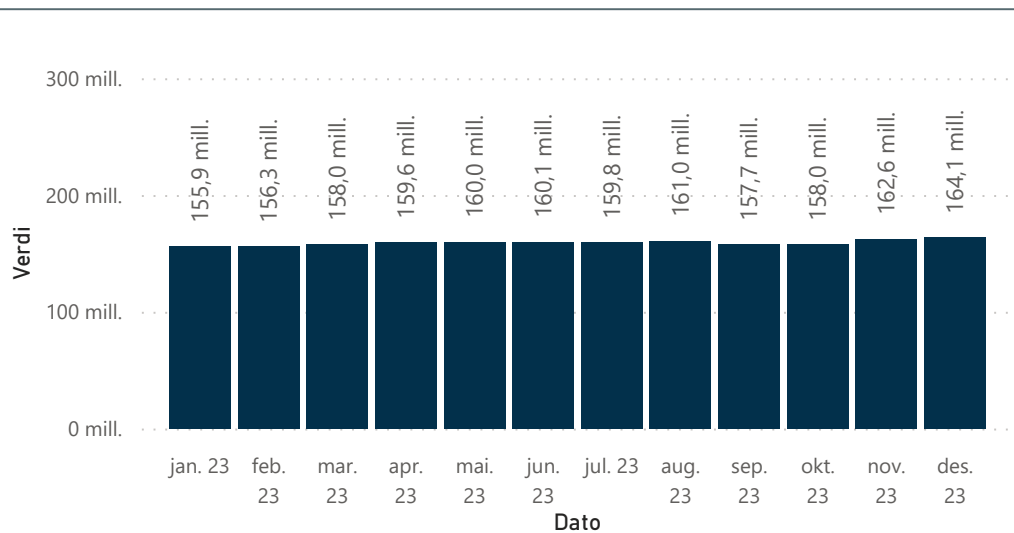
14,4 mill.

Avkastning mot benchmark

10,62 %  
9,59 %

### Sammendrag

ID	Beskrivelse	Sluttverdi	Resultat	Avkastning	Benchmark	Meravk. %	Strategisk vekt	Faktisk andel	Avvik	Min	Min_avvik	Maks	Maks_avvik
BJFK1	Pengemarkedsfond	15 740 182	949 282	5,99 %	3,37 %	2,62 %	10 %	9,6 %	-0,4 %	5 %	✓ 0 %	30 %	✓ 0 %
BJFK2	Norske obligasjonsfond	16 510 837	1 015 375	6,57 %	4,22 %	2,35 %	10 %	10,1 %	0,1 %	5 %	✓ 0 %	30 %	✓ 0 %
BJFK3	Globale obligasjonsfond	49 716 782	3 485 752	6,98 %	5,21 %	1,77 %	30 %	30,3 %	0,3 %	20 %	✓ 0 %	40 %	✓ 0 %
BJFK4	Eiendomsfond	17 069 861	-1 407 998	-7,62 %	6,51 %	-14,13 %	10 %	10,4 %	0,4 %	0 %	✓ 0 %	20 %	✓ 0 %
BJFK5	Norske aksjefond	15 799 923	1 332 810	9,06 %	11,19 %	-2,14 %	10 %	9,6 %	-0,4 %	5 %	✓ 0 %	30 %	✓ 0 %
BJFK6	Globale aksjefond	49 235 091	8 984 881	22,15 %	23,93 %	-1,78 %	30 %	30,0 %	0,0 %	20 %	✓ 0 %	40 %	✓ 0 %
Total	Total	164 072 676	14 360 102	9,59 %	10,62 %	-1,03 %	100 %	100,0 %	0,0 %	100 %	✓ 0 %	100 %	✓ 0 %



BJFK - Aktivklasser

Total

01.01.2023

31.12.2023

Resultat

## 14 360 102

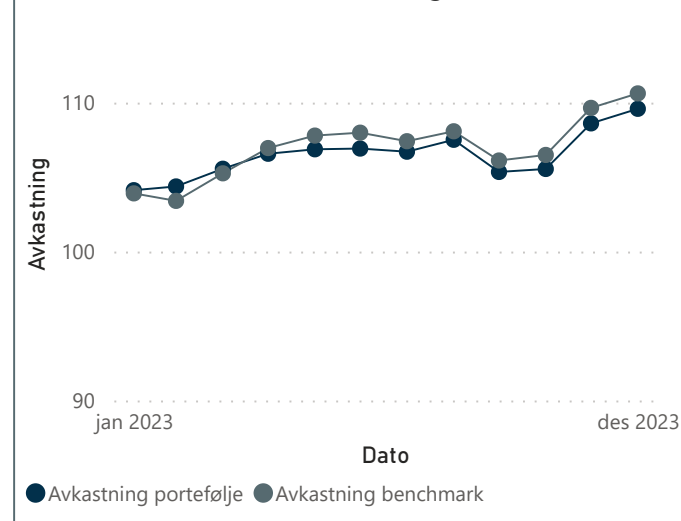
Avkastning mot benchmark



Historisk avkastning

4,02 %	4,25 %
Siste 3 måneder	3 Mnd benchmark
2,50 %	2,44 %
Siste 6 måneder	6 Mnd benchmark
9,59 %	10,62 %
Siste 12 Månedeer	12 Mnd Benchmark
4,68 %	5,18 %
Siste 2 år	2 år benchmark
3,10 %	3,42 %
Siste 3 år	3 år benchmark
1,85 %	2,04 %
Siste 5 år	5 år benchmark

Verdiutvikling



Avkastning per måned

Dato	Faktisk	Benchmark	Meravk. %	Meravkastning
jan. 23	4,12 %	3,91 %	0,21 %	320 393
feb. 23	0,24 %	-0,48 %	0,73 %	1 130 515
mar. 23	1,14 %	1,79 %	-0,65 %	-1 015 157
apr. 23	0,95 %	1,61 %	-0,66 %	-1 040 423
mai. 23	0,28 %	0,78 %	-0,50 %	-805 037
jun. 23	0,05 %	0,18 %	-0,14 %	-216 507
jul. 23	-0,20 %	-0,53 %	0,33 %	533 864
aug. 23	0,75 %	0,62 %	0,13 %	205 278
sep. 23	-2,01 %	-1,82 %	-0,19 %	-311 006
okt. 23	0,19 %	0,35 %	-0,16 %	-254 095
nov. 23	2,90 %	2,97 %	-0,07 %	-106 880
des. 23	0,90 %	0,89 %	0,01 %	23 122

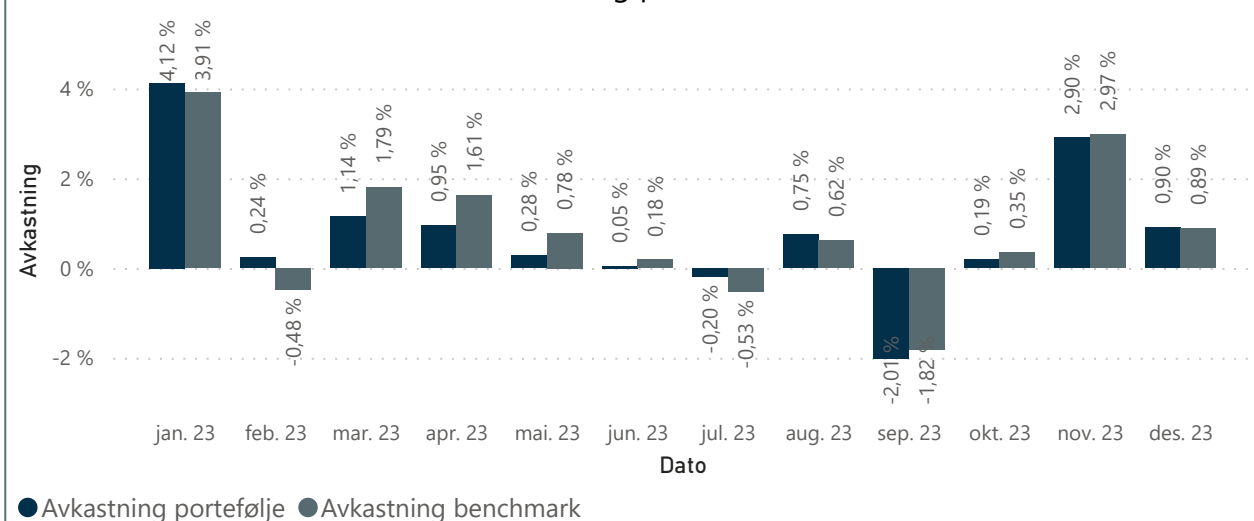
Akkumulert avkastning

Dato	Faktisk	Benchmark	Meravk %	Meravkastning
jan. 23	4,12 %	3,91 %	0,21 %	320 393
feb. 23	4,37 %	3,41 %	0,97 %	1 450 907
mar. 23	5,56 %	5,26 %	0,31 %	435 750
apr. 23	6,57 %	6,95 %	-0,38 %	-604 673
mai. 23	6,87 %	7,79 %	-0,92 %	-1 409 710
jun. 23	6,92 %	7,98 %	-1,07 %	-1 626 217
jul. 23	6,71 %	7,41 %	-0,70 %	-1 092 352
aug. 23	7,51 %	8,08 %	-0,57 %	-887 074
sep. 23	5,35 %	6,12 %	-0,77 %	-1 198 080
okt. 23	5,55 %	6,49 %	-0,94 %	-1 452 174
nov. 23	8,61 %	9,65 %	-1,04 %	-1 559 055
des. 23	9,59 %	10,62 %	-1,03 %	-1 535 933

Benchmark

BJFK - Sammensatt indeks Portefølje

Avkastning per måned



BJFK - Aktivklasser

Total

01.01.2023

31.12.2023

Beste måned

0,73 %

Gjennomsnitt

-0,08 %

Verste måned

-0,66 %

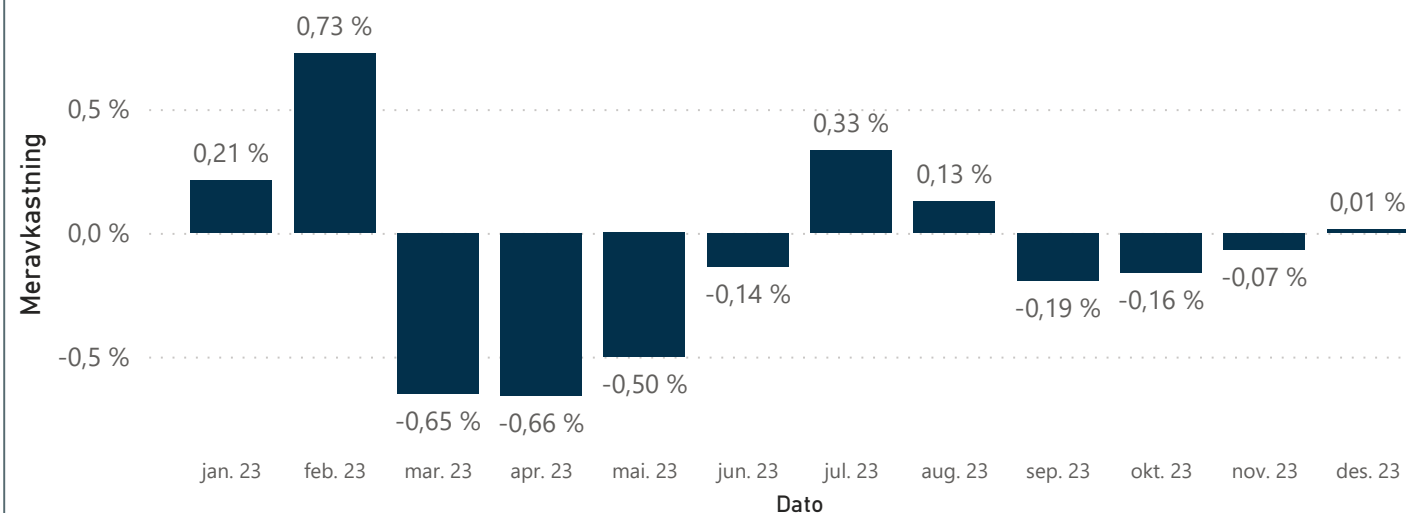
Median

-0,10 %

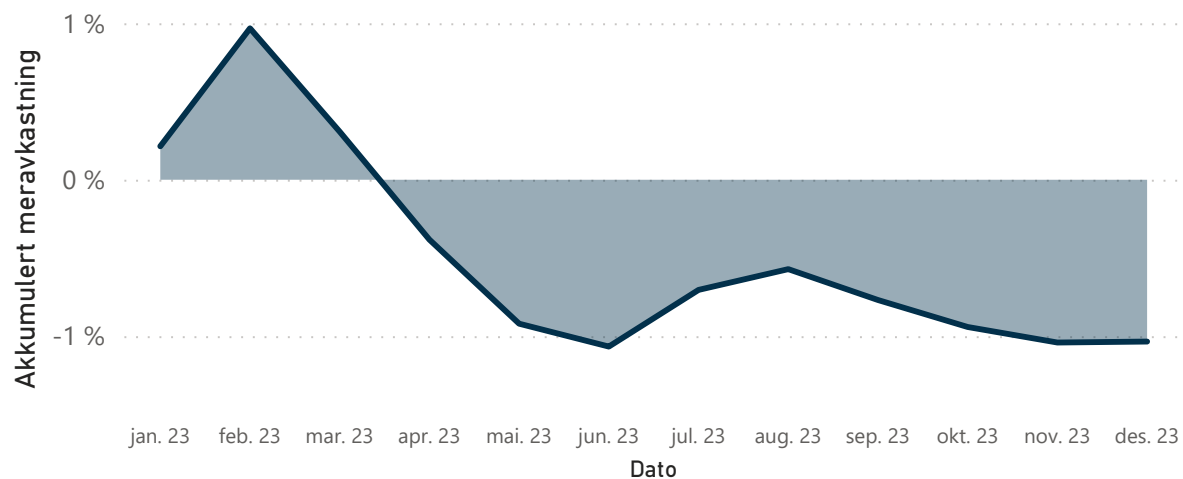
Benchmark

BJFK - Sammensatt indeks Portefølje

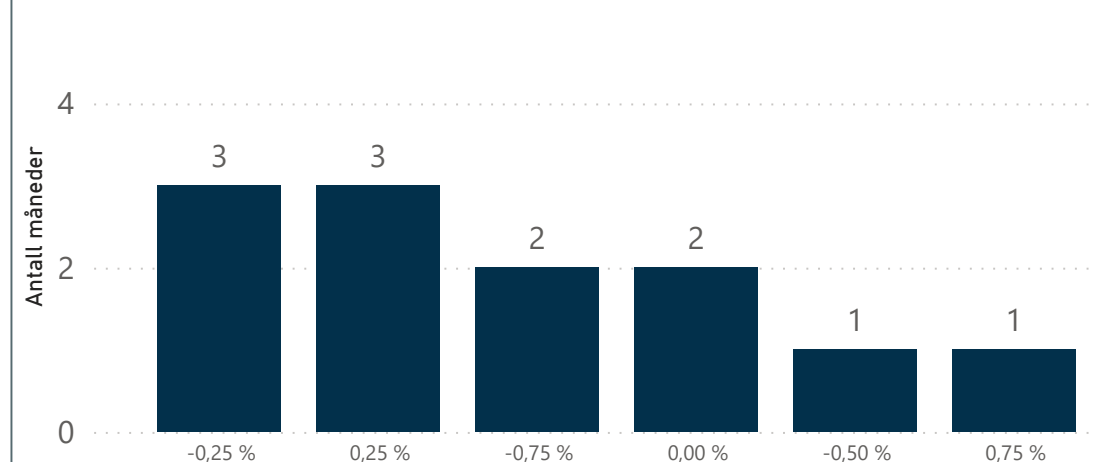
Meravkastning per måned



Akkumulert meravkastning



Fordeling av meravkastning



BJFK - Aktivklasser

Total

01.01.2023

31.12.2023

-0,71  
Information Ratio

1,18  
SharpeRatio

1,35 %  
Tracking Error

-0,61 %  
Alfa

0,95  
Beta

0,93  
Determination

