

Bjørnafjorden kommune

PORTEFØLJERAPPORT - risikoreport

Periode: 1. januar 2024 - 30. september 2024

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

Alle

01.01.2024

30.09.2024

Sluttverdi

179,1 mill.

Resultat

15,0 mill.

Avvik budsjett

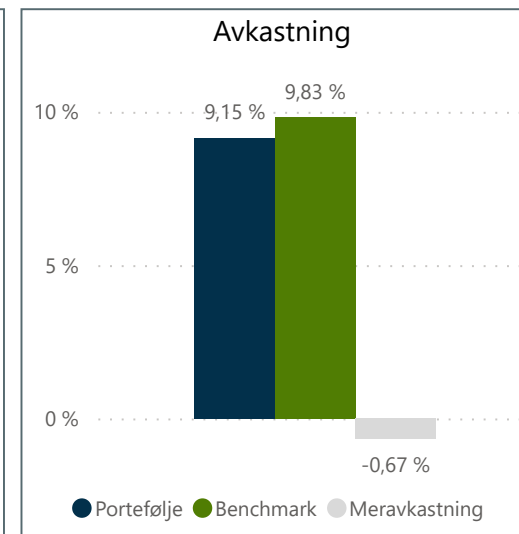
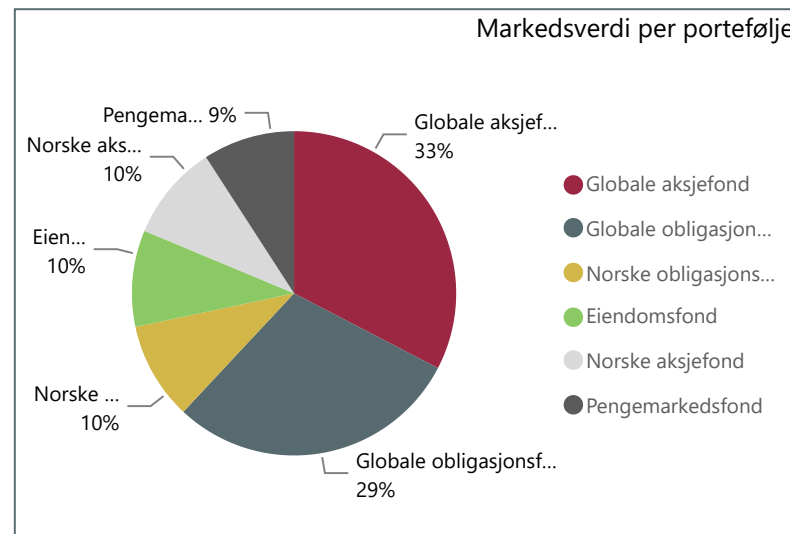
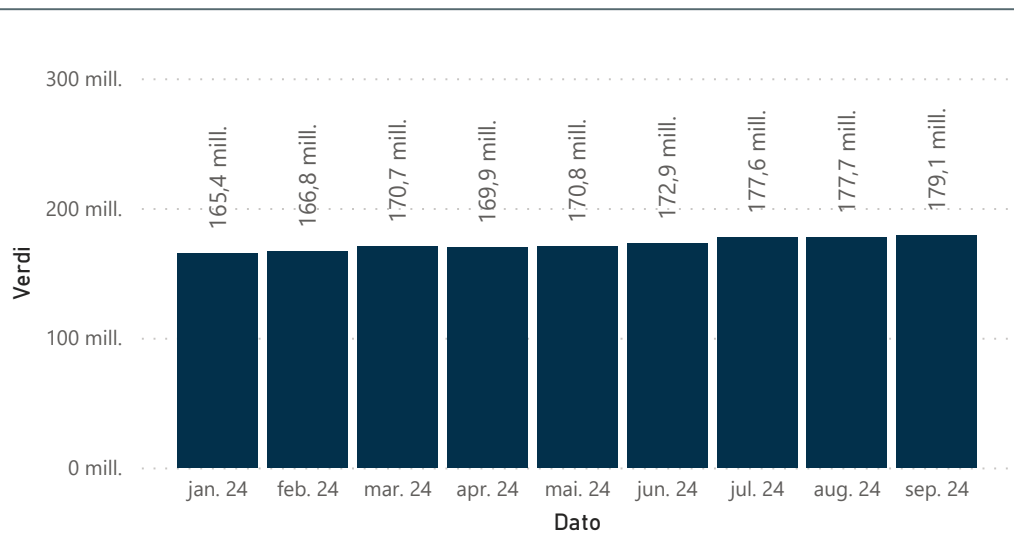
15,0 mill.

Avkastning mot benchmark



Sammendrag

ID	Beskrivelse	Sluttverdi	Resultat	Avkastning	Benchmark	Meravk. %	Strategisk vekt	Faktisk andel	Avvik	Min	Min_avvik	Maks	Maks_avvik
BJFK1	Pengemarkedsfond	16 363 769	701 244	4,44 %	3,27 %	1,17 %	10 %	9,1 %	-0,9 %	5 %	✓ 0 %	30 %	✓ 0 %
BJFK2	Norske obligasjonsfond	17 402 629	712 707	4,27 %	3,67 %	0,61 %	10 %	9,7 %	-0,3 %	5 %	✓ 0 %	30 %	✓ 0 %
BJFK3	Globale obligasjonsfond	52 532 003	2 413 049	4,82 %	3,61 %	1,21 %	30 %	29,3 %	-0,7 %	20 %	✓ 0 %	40 %	✓ 0 %
BJFK4	Eiendomsfond	17 219 269	737 777	4,44 %	5,61 %	-1,17 %	10 %	9,6 %	-0,4 %	0 %	✓ 0 %	20 %	✓ 0 %
BJFK5	Norske aksjefond	17 139 682	1 254 991	7,89 %	10,72 %	-2,83 %	10 %	9,6 %	-0,4 %	5 %	✓ 0 %	30 %	✓ 0 %
BJFK6	Globale aksjefond	58 431 754	9 196 663	18,68 %	21,03 %	-2,35 %	30 %	32,6 %	2,6 %	20 %	✓ 0 %	40 %	✓ 0 %
Total	Total	179 089 106	15 016 431	9,15 %	9,83 %	-0,67 %	100 %	100,0 %	0,0 %	100 %	✓ 0 %	100 %	✓ 0 %



BJFK - Aktivklasser

Total

01.01.2023

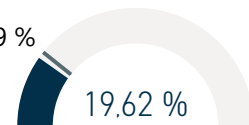
30.09.2024

Resultat

29 376 532

Avkastning mot benchmark

21,49 %



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
jan. 24	0,83 %	0,95 %	-0,12 %	-200 750
feb. 24	0,81 %	1,68 %	-0,87 %	-1 435 858
mar. 24	2,36 %	2,50 %	-0,14 %	-230 002
apr. 24	-0,49 %	-0,67 %	0,18 %	310 902
mai. 24	0,54 %	0,42 %	0,12 %	210 010
jun. 24	1,22 %	1,43 %	-0,21 %	-350 835
jul. 24	2,71 %	2,45 %	0,26 %	444 345
aug. 24	0,07 %	-0,26 %	0,33 %	588 564
sep. 24	0,78 %	0,97 %	-0,19 %	-337 586

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
jan. 24	10,49 %	11,67 %	-1,18 %	-1 736 682
feb. 24	11,38 %	13,54 %	-2,16 %	-3 172 541
mar. 24	14,02 %	16,38 %	-2,36 %	-3 402 543
apr. 24	13,46 %	15,60 %	-2,14 %	-3 091 642
mai. 24	14,07 %	16,08 %	-2,01 %	-2 881 631
jun. 24	15,47 %	17,74 %	-2,27 %	-3 232 467
jul. 24	18,60 %	20,63 %	-2,03 %	-2 788 122
aug. 24	18,69 %	20,32 %	-1,63 %	-2 199 558
sep. 24	19,62 %	21,49 %	-1,87 %	-2 537 143

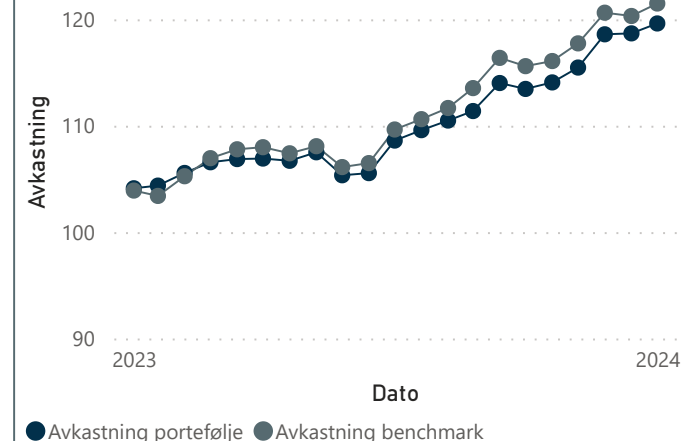
Historisk avkastning

3,59 %	3,18 %
Siste 3 måneder	3 Mnd benchmark
4,91 %	4,39 %
Siste 6 måneder	6 Mnd benchmark
13,55 %	14,49 %
Siste 12 Månedeer	12 Mnd Benchmark
9,37 %	10,22 %
Siste 2 år	2 år benchmark
6,15 %	6,70 %
Siste 3 år	3 år benchmark
3,65 %	3,97 %
Siste 5 år	5 år benchmark

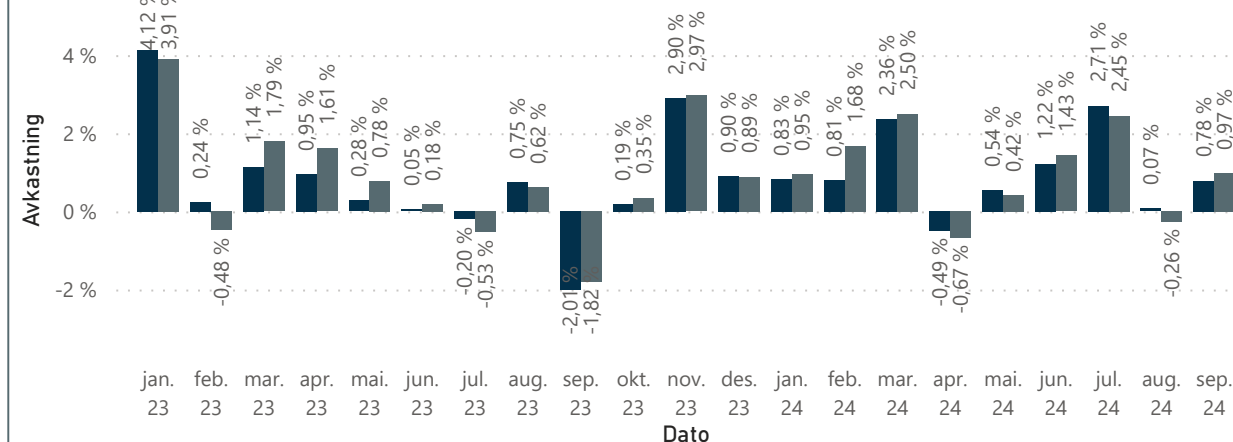
Benchmark

BJFK - Sammensatt indeks Portefølje

Verdiutvikling



Avkastning per måned



BJFK - Aktivaklasser

Total

01.01.2023

30.09.2024

Beste måned

0,73 %

Gjennomsnitt

-0,08 %

Verste måned

-0,87 %

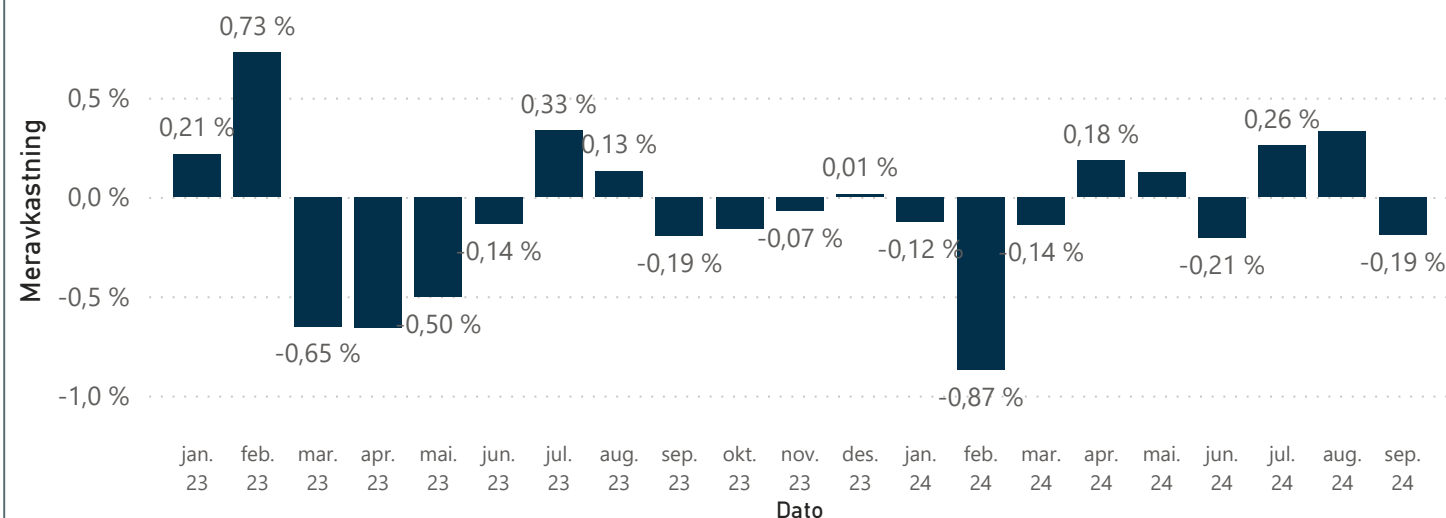
Median

-0,12 %

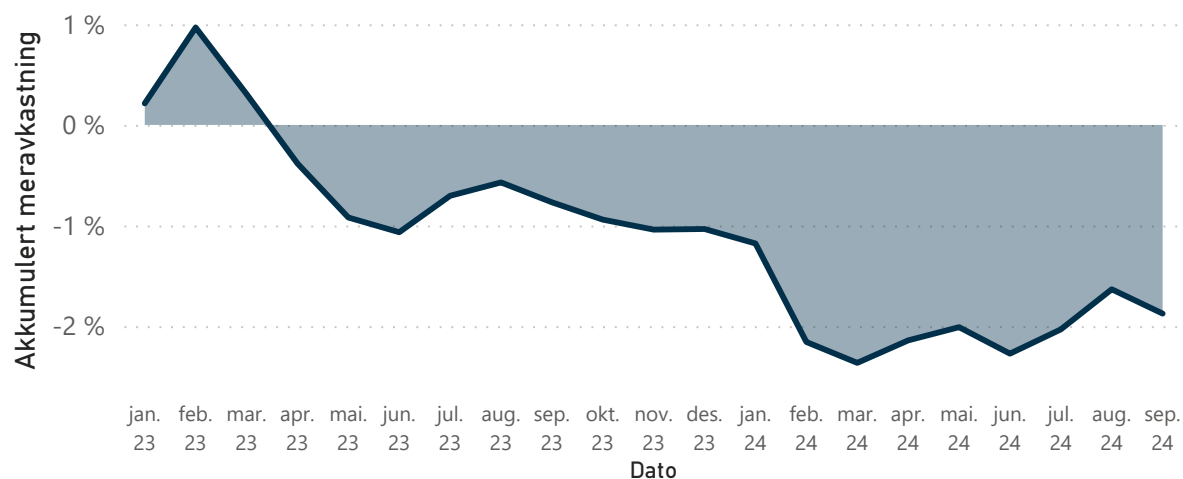
Benchmark

BJFK - Sammensatt indeks Portefølje

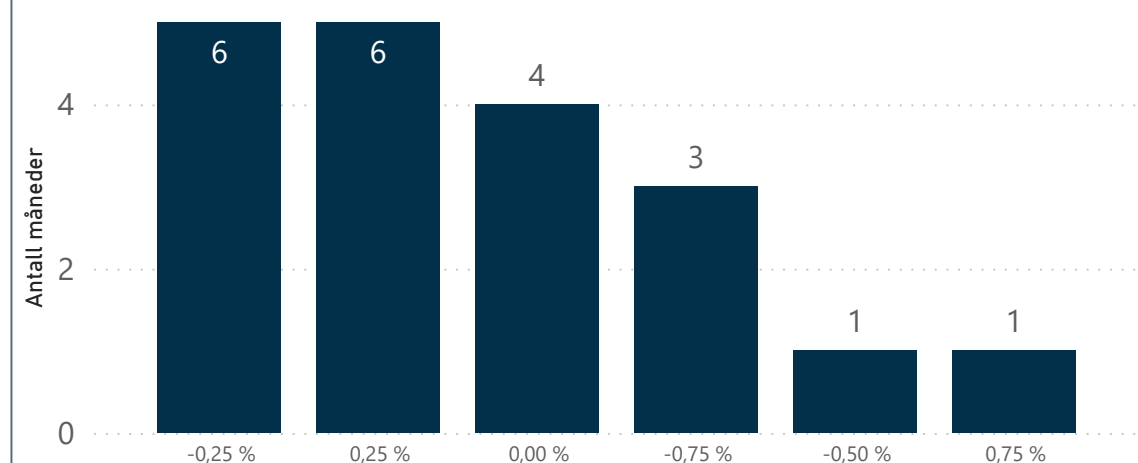
Meravkastning per måned



Akkumulert meravkastning



Fordeling av meravkastning



BJFK - Aktivklasser

Total

01.01.2023

30.09.2024

-0,71
Information Ratio

1,50
SharpeRatio

1,28 %
Tracking Error

-0,37 %
Alfa

0,93
Beta

0,92
Determination

