

Bjørnafjorden kommune

PORTEFØLJERAPPORT - risikoreport

Periode: 1. januar 2023 - 31. oktober 2023

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

Alle

01.01.2023

31.10.2023

Sluttverdi

158,0 mill.

Resultat

8,2 mill.

Avvik budsjett

8,2 mill.

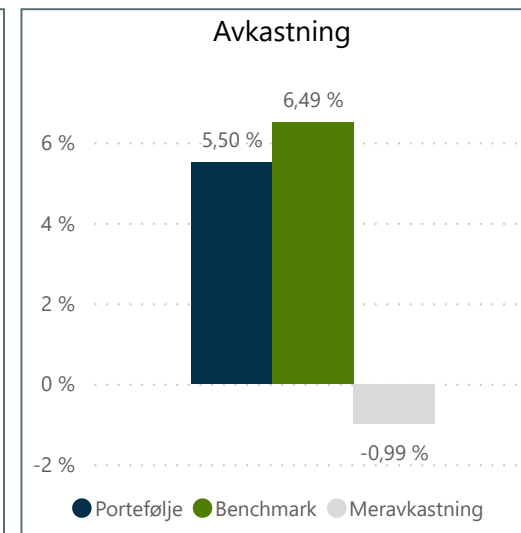
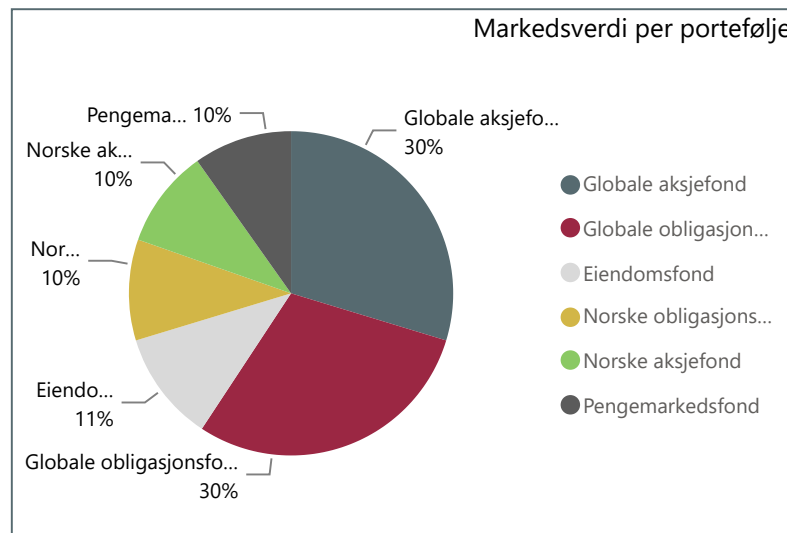
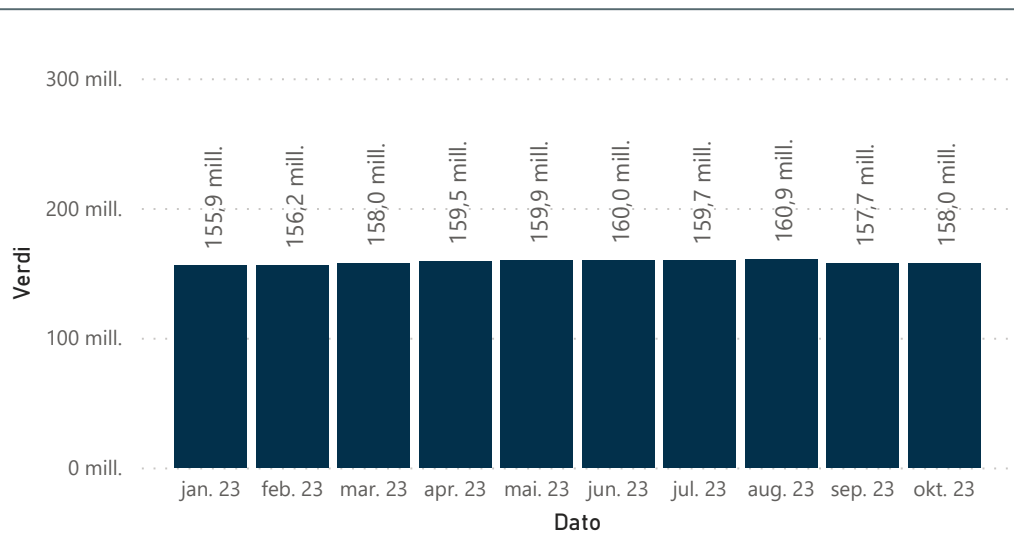
Avkastning mot benchmark

6,49 %

5,50 %

Sammendrag

ID	Beskrivelse	Sluttverdi	Resultat	Avkastning	Benchmark	Meravk. %	Strategisk vekt	Faktisk andel	Avvik	Min	Min_avvik	Maks	Maks_avvik
BJFK1	Pengemarkedsfond	15 494 134	703 234	4,57 %	2,72 %	1,85 %	10 %	9,8 %	-0,2 %	5 %	✓ 0 %	30 %	✓ 0 %
BJFK2	Norske obligasjonsfond	15 902 520	407 059	2,65 %	0,57 %	2,07 %	10 %	10,1 %	0,1 %	5 %	✓ 0 %	30 %	✓ 0 %
BJFK3	Globale obligasjonsfond	46 716 876	485 847	0,52 %	-1,00 %	1,53 %	30 %	29,6 %	-0,4 %	20 %	✓ 0 %	40 %	✓ 0 %
BJFK4	Eiendomsfond	17 431 044	-1 046 815	-5,67 %	5,31 %	-10,97 %	10 %	11,0 %	1,0 %	0 %	✓ 0 %	20 %	✓ 0 %
BJFK5	Norske aksjefond	15 507 017	1 039 904	7,04 %	6,73 %	0,30 %	10 %	9,8 %	-0,2 %	5 %	✓ 0 %	30 %	✓ 0 %
BJFK6	Globale aksjefond	46 904 143	6 653 932	16,37 %	19,29 %	-2,93 %	30 %	29,7 %	-0,3 %	20 %	✓ 0 %	40 %	✓ 0 %
Total	Total	157 955 735	8 243 161	5,50 %	6,49 %	-0,99 %	100 %	100,0 %	0,0 %	100 %	✓ 0 %	100 %	✓ 0 %



BJFK - Aktivklasser

Total

01.01.2023

31.10.2023

Resultat

8 243 161

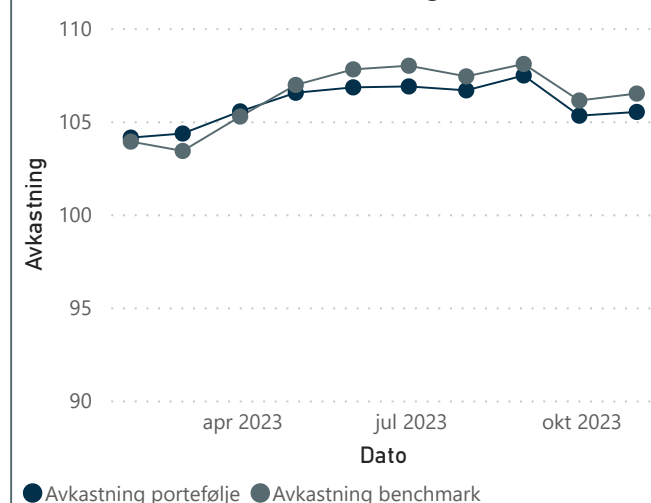
Avkastning mot benchmark



Historisk avkastning

-1,09 %	-0,86 %
Siste 3 måneder	3 Mnd benchmark
-0,97 %	-0,43 %
Siste 6 måneder	6 Mnd benchmark
5,50 %	6,49 %
Siste 12 Månedeer	12 Mnd Benchmark
2,71 %	3,19 %
Siste 2 år	2 år benchmark
1,80 %	2,12 %
Siste 3 år	3 år benchmark
1,08 %	1,27 %
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 %	-817 968
jun. 23	0,05 %	0,18 %	-0,14 %	-216 387
jul. 23	-0,20 %	-0,53 %	0,33 %	533 494
aug. 23	0,75 %	0,62 %	0,13 %	205 712
sep. 23	-2,01 %	-1,82 %	-0,19 %	-312 274
okt. 23	0,19 %	0,35 %	-0,16 %	-253 853

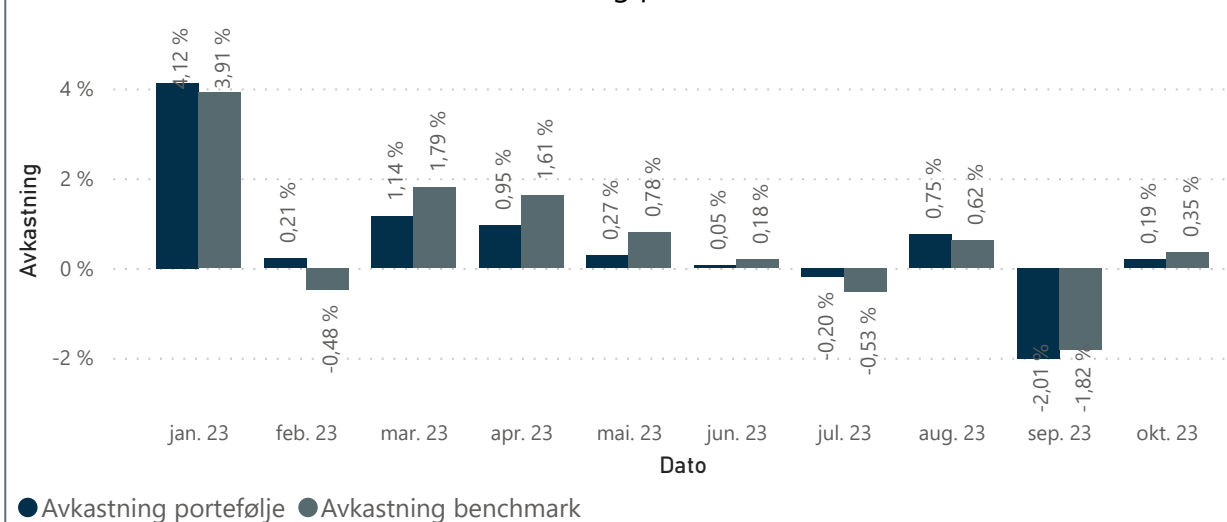
Akkumulert avkastning

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 %	-0,97 %	-1 477 535
jun. 23	6,87 %	7,98 %	-1,11 %	-1 693 922
jul. 23	6,66 %	7,41 %	-0,75 %	-1 160 428
aug. 23	7,46 %	8,08 %	-0,62 %	-954 716
sep. 23	5,30 %	6,12 %	-0,82 %	-1 266 990
okt. 23	5,50 %	6,49 %	-0,99 %	-1 520 843

Benchmark

BJFK - Sammensatt indeks Portefølje

Avkastning per måned



BJFK - Aktivklasser

Total

01.01.2023

31.10.2023

Beste måned

0,70 %

Gjennomsnitt

-0,09 %

Verste måned

-0,66 %

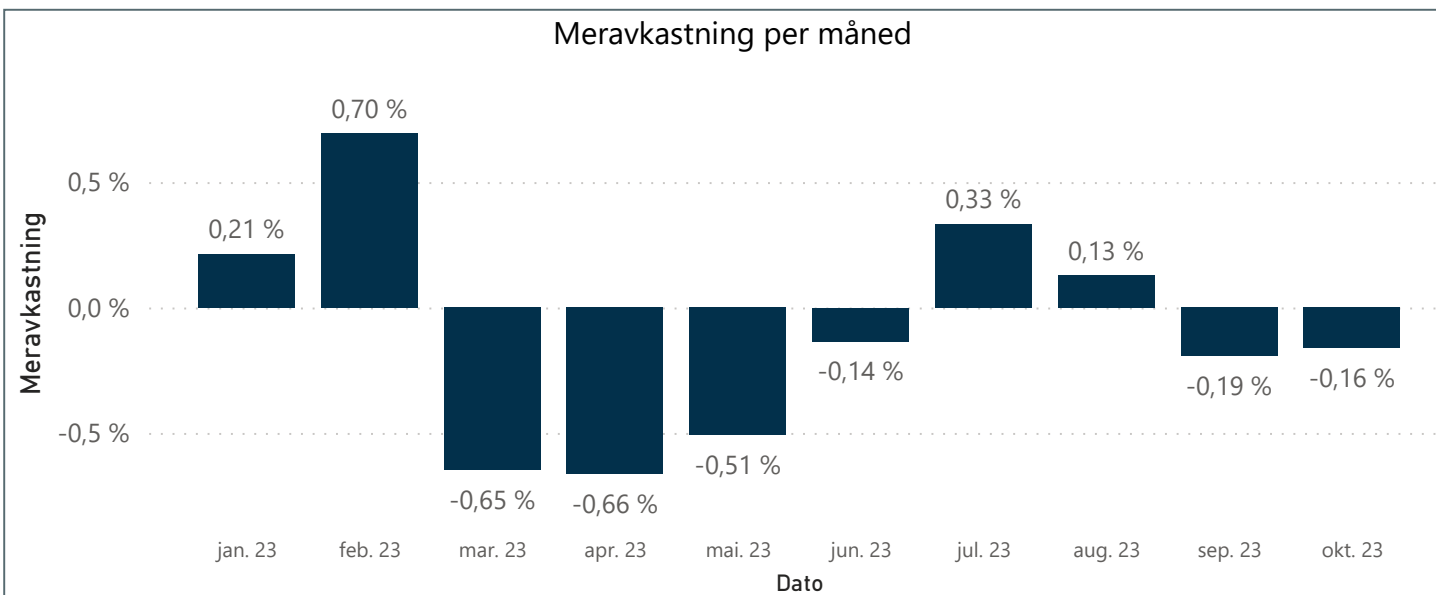
Median

-0,15 %

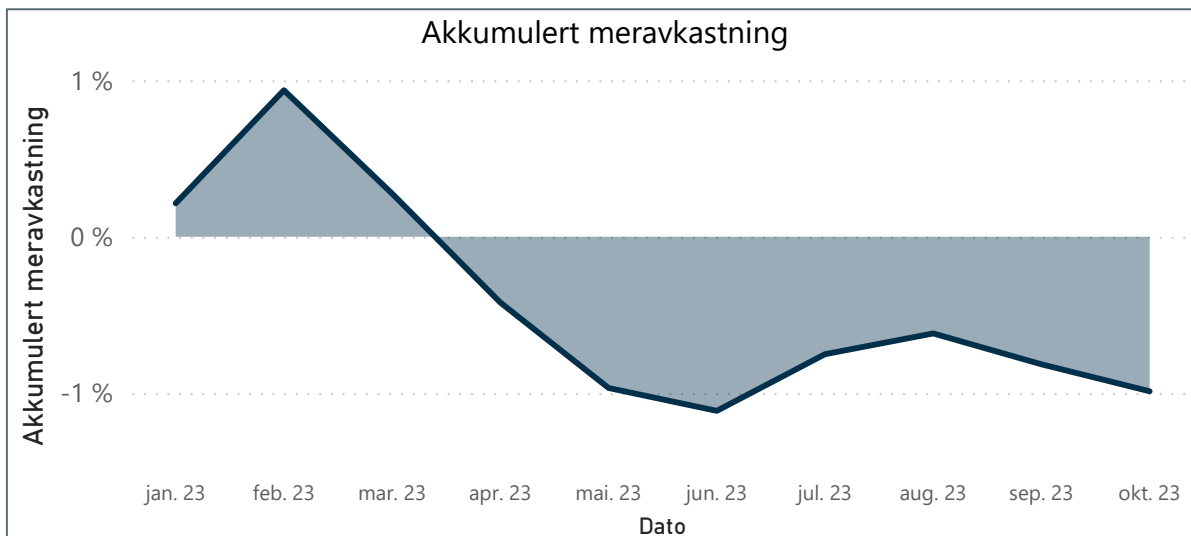
Benchmark

BJFK - Sammensatt indeks Portefølje

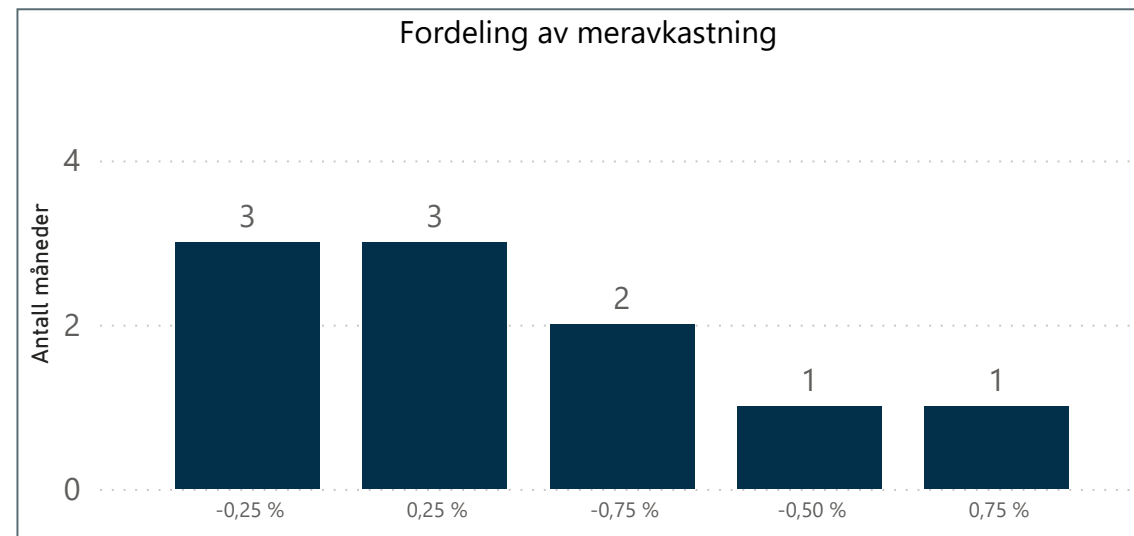
Meravkastning per måned



Akkumulert meravkastning



Fordeling av meravkastning



BJFK - Aktivaklasser

Total

01.01.2023

31.10.2023

-0,78
Information Ratio

0,67
SharpeRatio

1,46 %
Tracking Error

-0,85 %
Alfa

0,94
Beta

0,92
Determination

