

Bjørnafjorden kommune

PORTEFØLJERAPPORT - risikoreport

Periode: 1. januar 2024 - 31. desember 2024

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

Alle

01.01.2024

31.12.2024

Sluttverdi

182,5 mill.

Resultat

18,4 mill.

Avvik budsjett

18,4 mill.

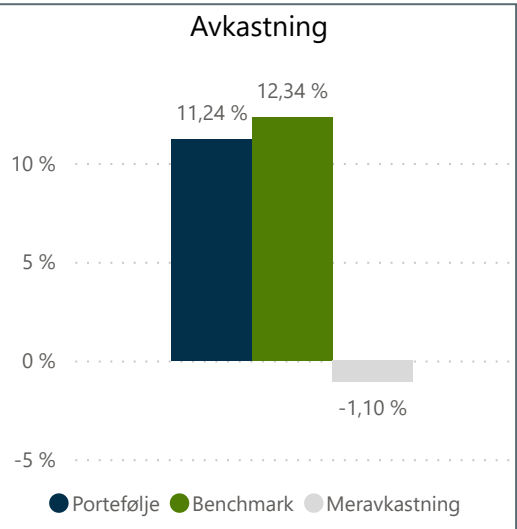
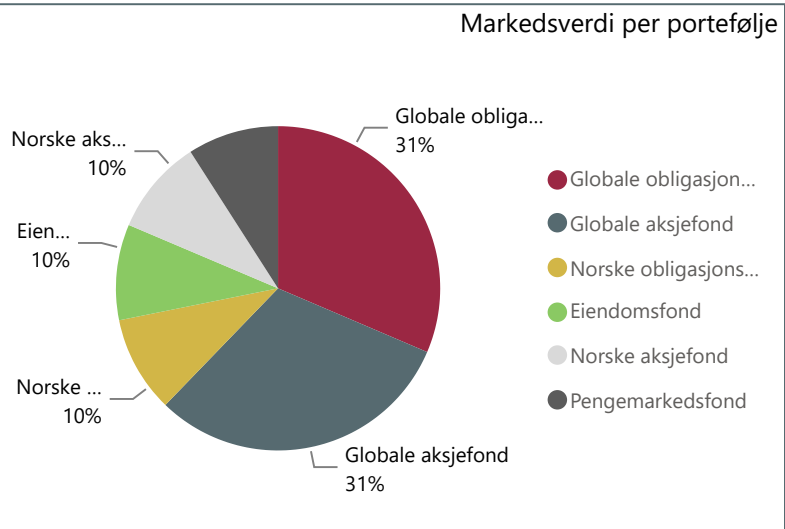
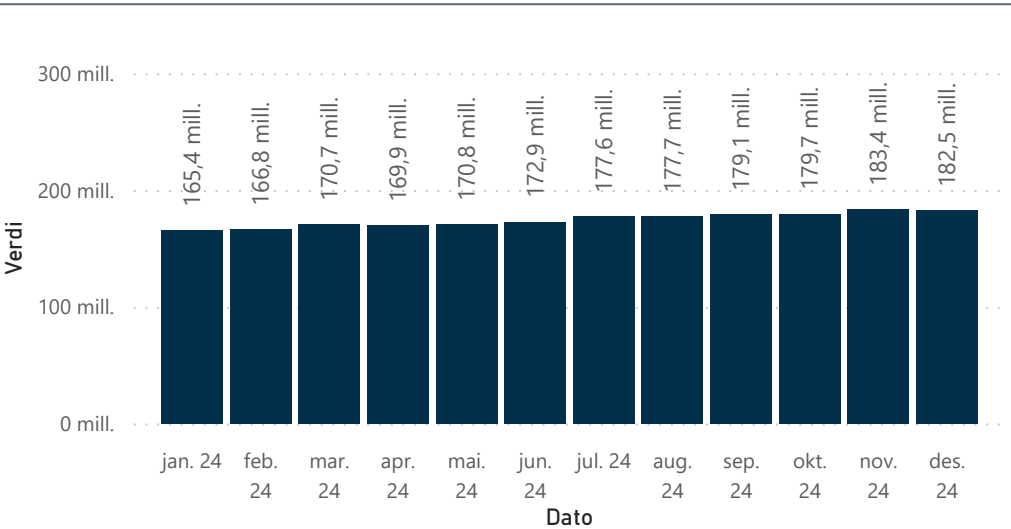
Avkastning mot benchmark

12,34 %

11,24 %

Sammendrag

ID	Beskrivelse	Sluttverdi	Resultat	Avkastning	Benchmark	Meravk. %	Strategisk vekt	Faktisk andel	Avvik	Min	Min_avvik	Maks	Maks_avvik
BJFK1	Pengemarkedsfond	16 566 635	911 218	5,77 %	4,41 %	1,36 %	10 %	9,1 %	-0,9 %	5 %	✓ 0 %	30 %	✓ 0 %
BJFK2	Norske obligasjonsfond	17 547 850	646 777	3,88 %	3,12 %	0,76 %	10 %	9,6 %	-0,4 %	5 %	✓ 0 %	30 %	✓ 0 %
BJFK3	Globale obligasjonsfond	57 359 307	1 815 178	3,65 %	2,45 %	1,19 %	30 %	31,4 %	1,4 %	20 %	✓ 0 %	40 %	✓ 0 %
BJFK4	Eiendomsfond	17 429 249	1 151 802	6,98 %	7,57 %	-0,59 %	10 %	9,5 %	-0,5 %	0 %	✓ 0 %	20 %	✓ 0 %
BJFK5	Norske aksjefond	17 403 813	1 519 122	9,56 %	11,28 %	-1,73 %	10 %	9,5 %	-0,5 %	5 %	✓ 0 %	30 %	✓ 0 %
BJFK6	Globale aksjefond	56 203 832	12 393 915	25,35 %	29,16 %	-3,82 %	30 %	30,8 %	0,8 %	20 %	✓ 0 %	40 %	✓ 0 %
Total	Total	182 510 687	18 438 012	11,24 %	12,34 %	-1,10 %	100 %	100,0 %	0,0 %	100 %	✓ 0 %	100 %	✓ 0 %



Resultat

32 798 114

Avkastning mot benchmark

24,27 %



21.90 %

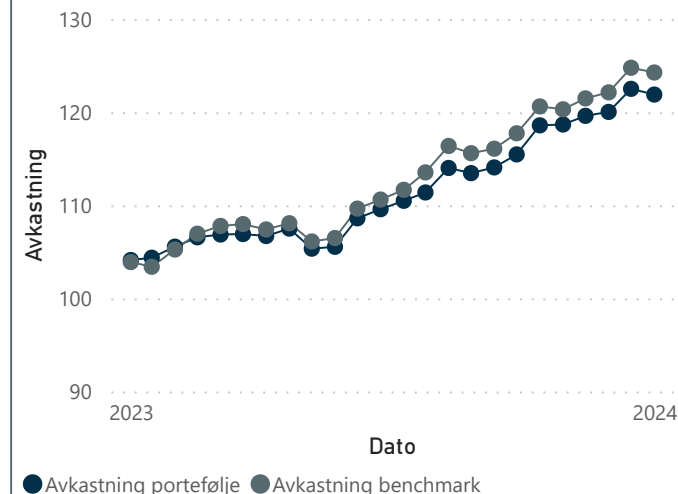
Historisk avkastning

1,91 %	2,29 %
Siste 3 måneder	3 Mnd benchmark
5,57 %	5,54 %
Siste 6 måneder	6 Mnd benchmark
11,24 %	12,34 %
Siste 12 Månedeer	12 Mnd Benchmark
10,41 %	11,48 %
Siste 2 år	2 år benchmark
6,82 %	7,51 %
Siste 3 år	3 år benchmark
4,04 %	4,44 %
Siste 5 år	5 år benchmark

Benchmark

BJFK - Sammensatt indeks Portefølje

Verdiutvikling



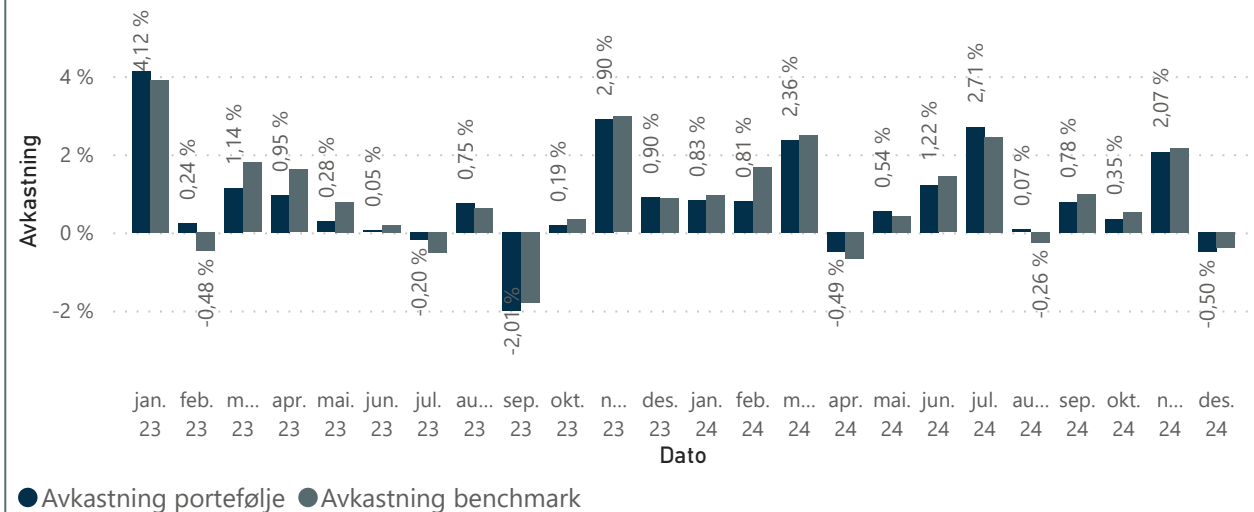
Avkastning per måned

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
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
okt. 24	0,35 %	0,53 %	-0,18 %	-322 696
nov. 24	2,07 %	2,16 %	-0,10 %	-176 844
des. 24	-0,50 %	-0,41 %	-0,09 %	-173 696

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
okt. 24	20,04 %	22,14 %	-2,10 %	-2 859 840
nov. 24	22,52 %	24,78 %	-2,26 %	-3 036 684
des. 24	21,90 %	24,27 %	-2,37 %	-3 210 380

Avkastning per måned



BJFK - Aktivaklasser

Total

01.01.2023

31.12.2024

Beste måned

0,73 %

Gjennomsnitt

-0,08 %

Verste måned

-0,87 %

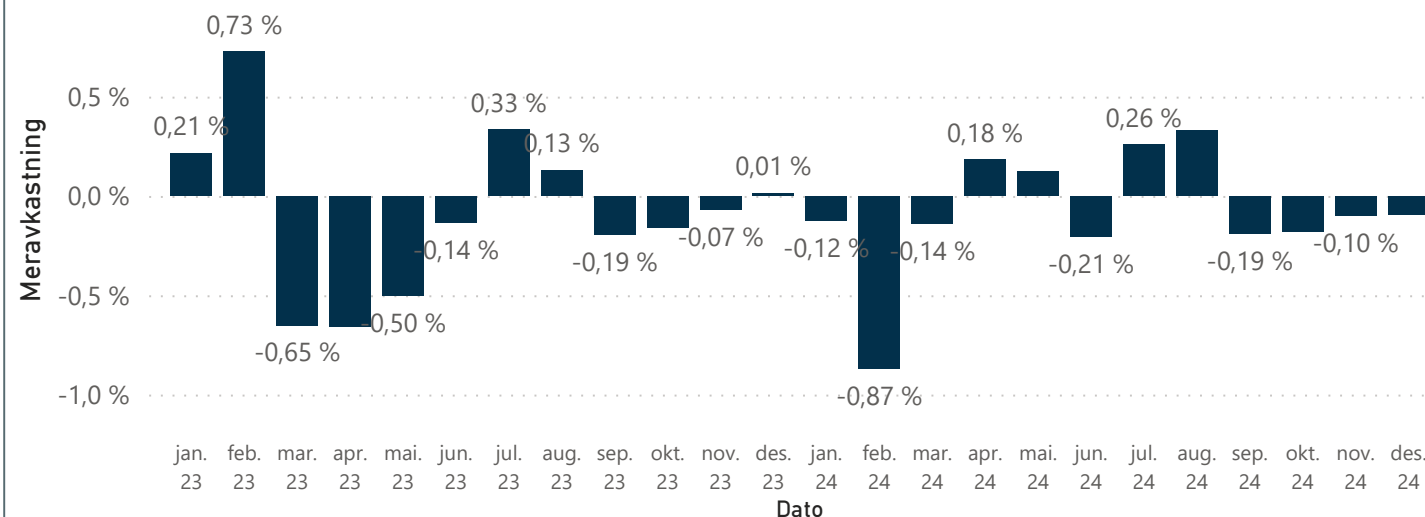
Median

-0,11 %

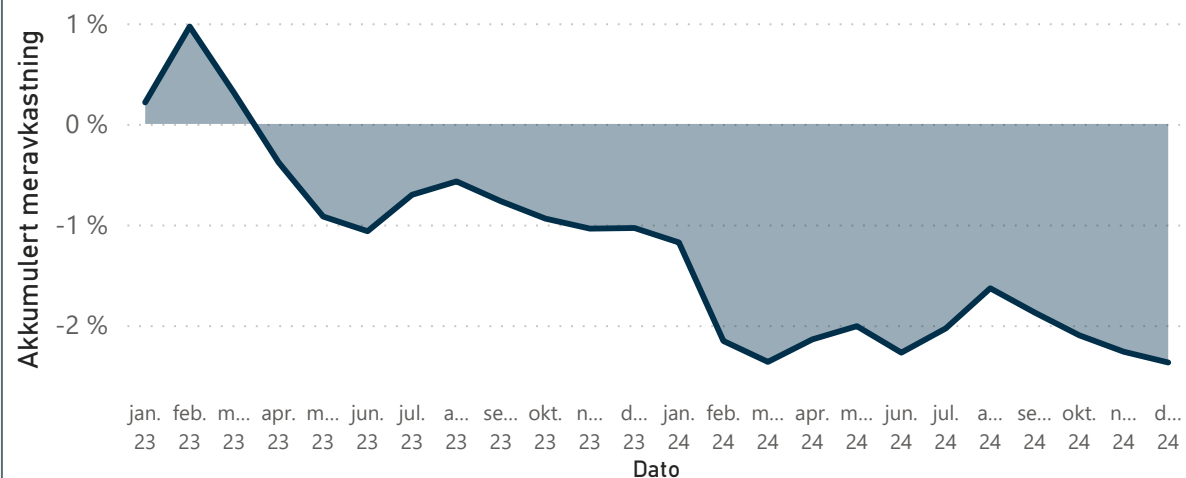
Benchmark

BJFK - Sammensatt indeks Portefølje

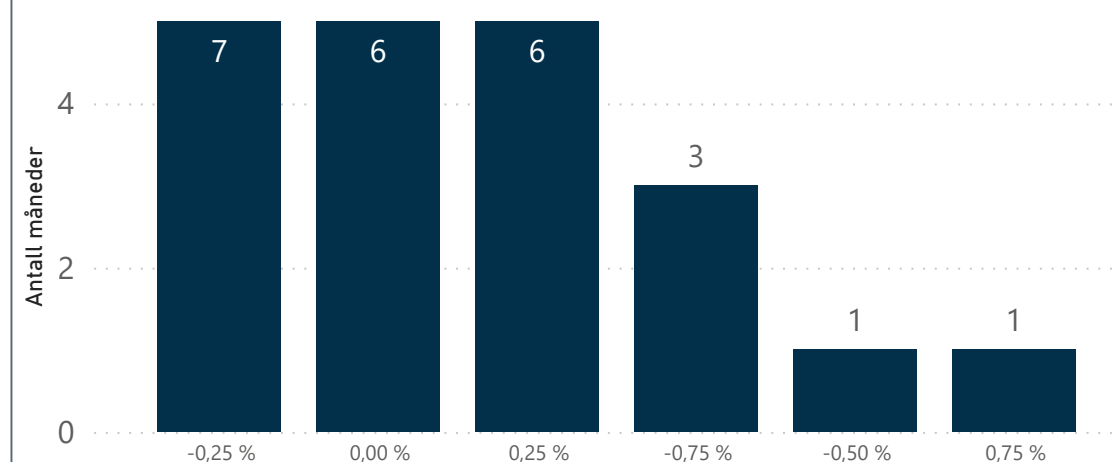
Meravkastning per måned



Akkumulert meravkastning



Fordeling av meravkastning



BJFK - Aktivaklasser

Total

01.01.2023

31.12.2024

-0,81

Information Ratio

1,43

SharpeRatio

1,20 %

Tracking Error

-0,52 %

Alfa

0,94

Beta

0,93

Determination

Standardavvik

4,48 %

4,36 %

Alfa

Alfa

2023

2024

Tracking Error

TrackingError

2 %

1 %

0 %

2023

2024

Beta

Beta

1,0

0,5

0,0

jul 2023

jan 2024

jul 2024

Information Ratio

InformationRatio

0

-1

jul 2023

jan 2024

jul 2024

Standardavvik

Portefølje Benchmark

Portefølje og Benchmark

5 %

0 %

jul 2023

jan 2024

jul 2024

MeasureDate

Kovarians

Covariance

0,002

0,000

jul 2023

jan 2024

jul 2024

Sharpe Ratio

SharpeRatio

2

1

0

jul 2023

jan 2024

jul 2024

Determination

Determination

1,0

0,5

0,0

jul 2023

jan 2024

jul 2024