

Bjørnafjorden kommune

PORTEFØLJERAPPORT - risikoreport

Periode: 1. januar 2024 - 31. januar 2024

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

Alle

01.01.2024

31.01.2024

Sluttverdi

165,4 mill.

Resultat

1,4 mill.

Avvik budsjett

1,4 mill.

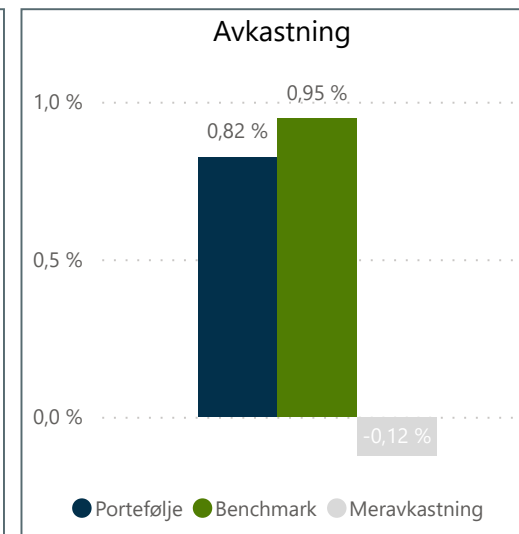
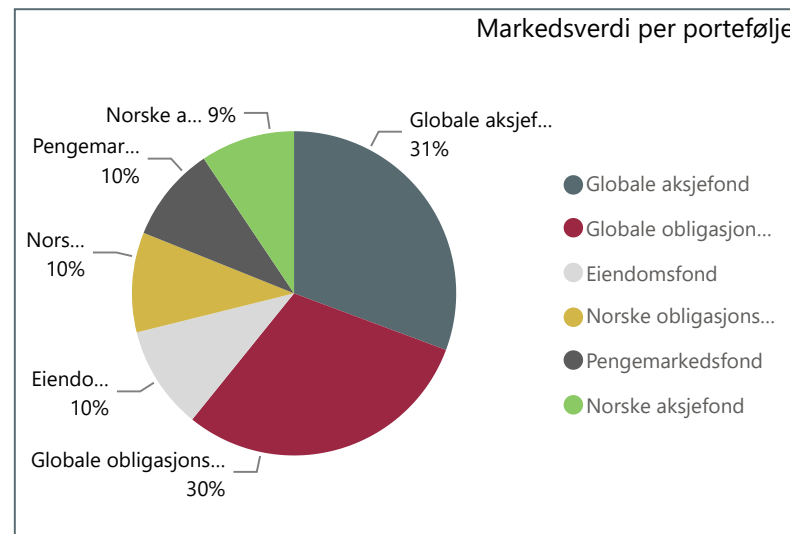
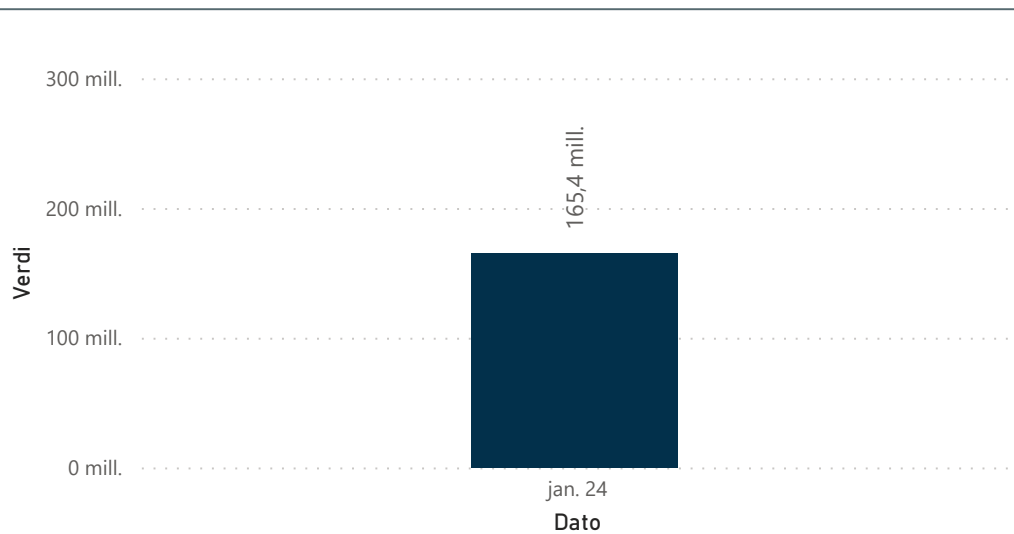
Avkastning mot benchmark

0,95 %

0,82 %

Sammendrag

ID	Beskrivelse	Sluttverdi	Resultat	Avkastning	Benchmark	Meravk. %	Strategisk vekt	Faktisk andel	Avvik	Min	Min_avvik	Maks	Maks_avvik
BJFK1	Pengemarkedsfond	15 744 848	89 435	0,57 %	0,34 %	0,23 %	10 %	9,5 %	-0,5 %	5 %	✓ 0 %	30 %	✓ 0 %
BJFK2	Norske obligasjonsfond	16 472 576	-38 261	-0,23 %	-0,35 %	0,12 %	10 %	10,0 %	-0,0 %	5 %	✓ 0 %	30 %	✓ 0 %
BJFK3	Globale obligasjonsfond	49 835 946	119 164	0,24 %	-0,29 %	0,53 %	30 %	30,1 %	0,1 %	20 %	✓ 0 %	40 %	✓ 0 %
BJFK4	Eiendomsfond	17 069 861	0	0,00 %	0,59 %	-0,59 %	10 %	10,3 %	0,3 %	0 %	✓ 0 %	20 %	✓ 0 %
BJFK5	Norske aksjefond	15 548 633	-336 059	-2,12 %	-1,49 %	-0,63 %	10 %	9,4 %	-0,6 %	5 %	✓ 0 %	30 %	✓ 0 %
BJFK6	Globale aksjefond	50 754 033	1 518 941	3,09 %	3,51 %	-0,43 %	30 %	30,7 %	0,7 %	20 %	✓ 0 %	40 %	✓ 0 %
Total	Total	165 425 897	1 353 221	0,82 %	0,95 %	-0,12 %	100 %	100,0 %	0,0 %	100 %	✓ 0 %	100 %	✓ 0 %



BJFK - Aktivaklasser

Total

01.01.2023

31.01.2024

Resultat

15 713 323

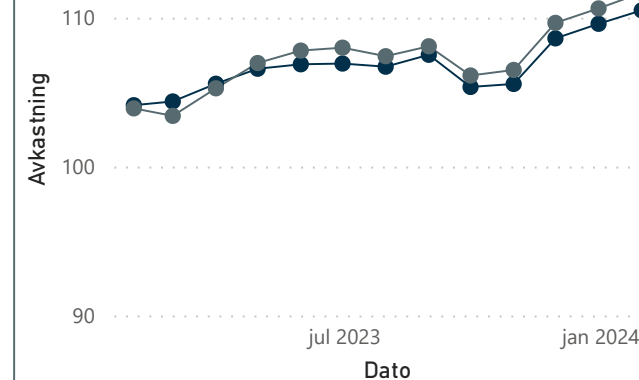
Avkastning mot benchmark

11,67 %
10,49 %

Historisk avkastning

4,68 %	4,86 %
Siste 3 måneder	3 Mnd benchmark
3,55 %	3,96 %
Siste 6 måneder	6 Mnd benchmark
6,12 %	7,47 %
Siste 12 Månedeer	12 Mnd Benchmark
5,11 %	5,67 %
Siste 2 år	2 år benchmark
3,38 %	3,75 %
Siste 3 år	3 år benchmark
2,02 %	2,23 %
Siste 5 år	5 år benchmark

Verdiutvikling



Benchmark

BJFK - Sammensatt indeks Portefølje

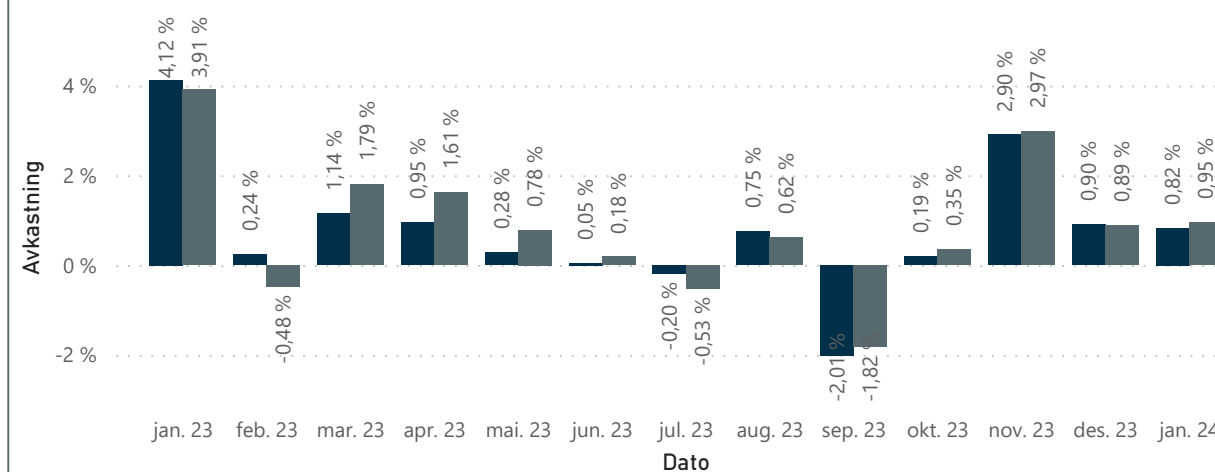
Avkastning per måned

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	0,82 %	0,95 %	-0,12 %	-201 270

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 %	-1 737 203

Avkastning per måned



● Avkastning portefølje ● Avkastning benchmark

BJFK - Aktivklasser

Total

01.01.2023

31.01.2024

Beste måned

0,73 %

Gjennomsnitt

-0,08 %

Verste måned

-0,66 %

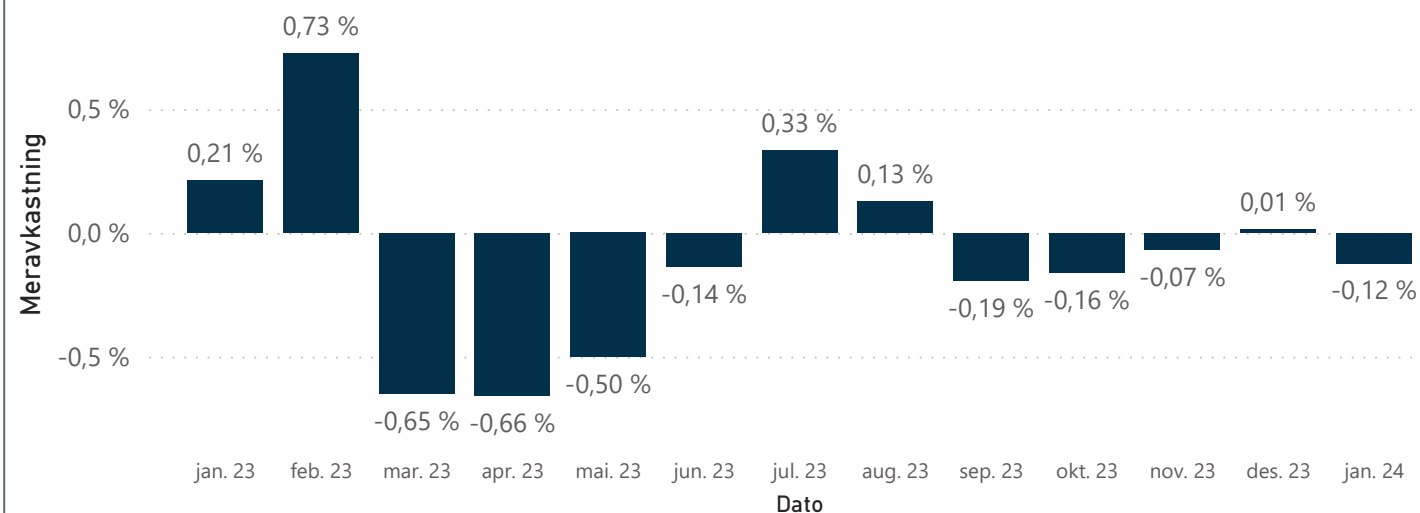
Median

-0,12 %

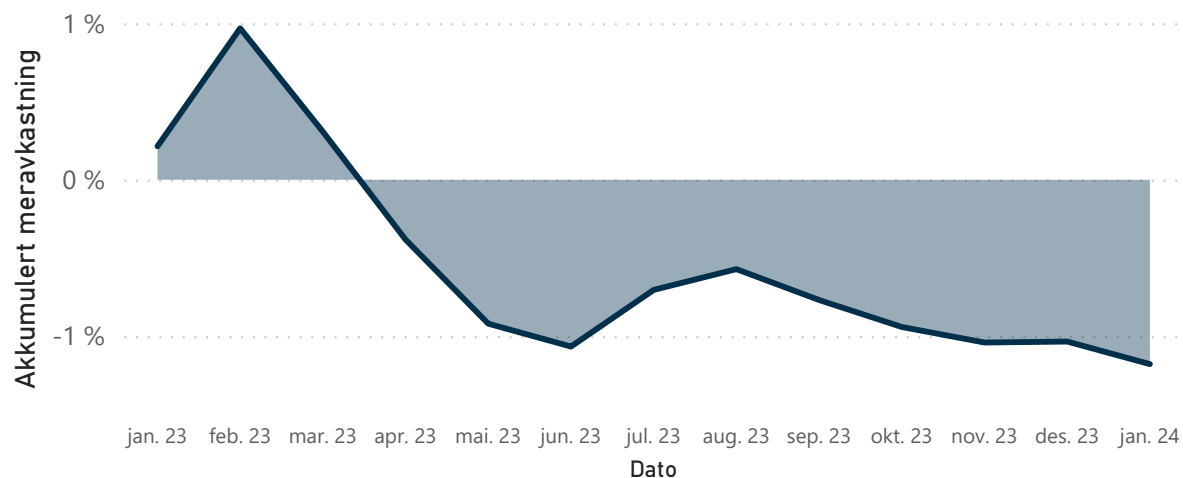
Benchmark

BJFK - Sammensatt indeks Portefølje

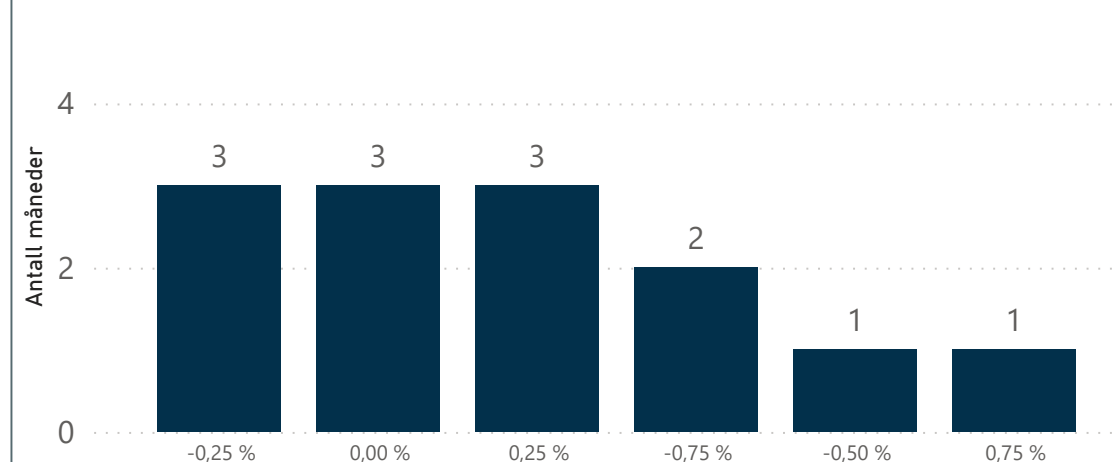
Meravkastning per måned



Akkumulert meravkastning



Fordeling av meravkastning



BJFK - Aktivklasser

Total

01.01.2023

31.01.2024

-0,77
Information Ratio

1,22
SharpeRatio

1,30 %
Tracking Error

-0,64 %
Alfa

0,95
Beta

0,93
Determination

