

01. januar 2018 - 31. mars 2022

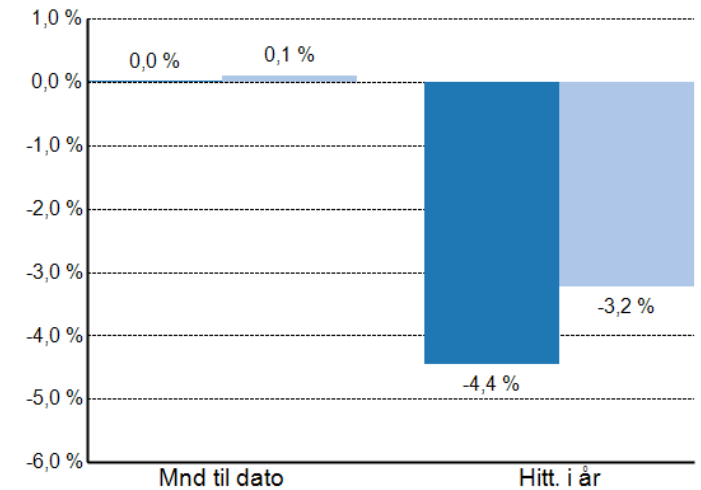
Porteføljerapport

Bjørnafjorden kommune

PERFORMIA.NXT
BY GABLER

Avkastning

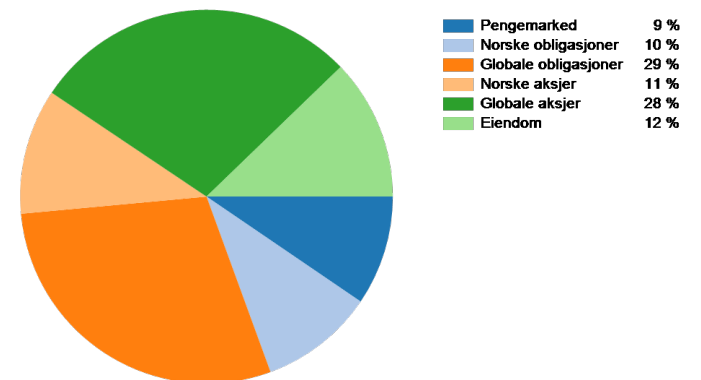
Beholdning	Mnd til dato				Hitt. i år			
	Portef. TNOK	Portef. %	Indeks %	Diff. %	Portef. TNOK	Portef. %	Indeks %	Diff. %
Pengemarked	3	0,0	0,1	-0,1	22	0,2	0,1	0,0
Norske obligasjoner	-233	-1,5	-1,4	-0,1	-459	-2,8	-2,5	-0,4
Globale obligasjoner	-738	-1,6	-2,1	0,5	-2 193	-4,6	-4,8	0,3
Norske aksjer	464	2,8	3,2	-0,4	22	0,1	1,5	-1,4
Globale aksjer	35	0,1	1,7	-1,6	-5 223	-10,6	-5,9	-4,7
Eiendom	473	2,5	0,3	2,3	484	2,6	0,7	1,8
Bjørnafjorden kommune	4	0,0	0,1	-0,1	-7 346	-4,4	-3,2	-1,2



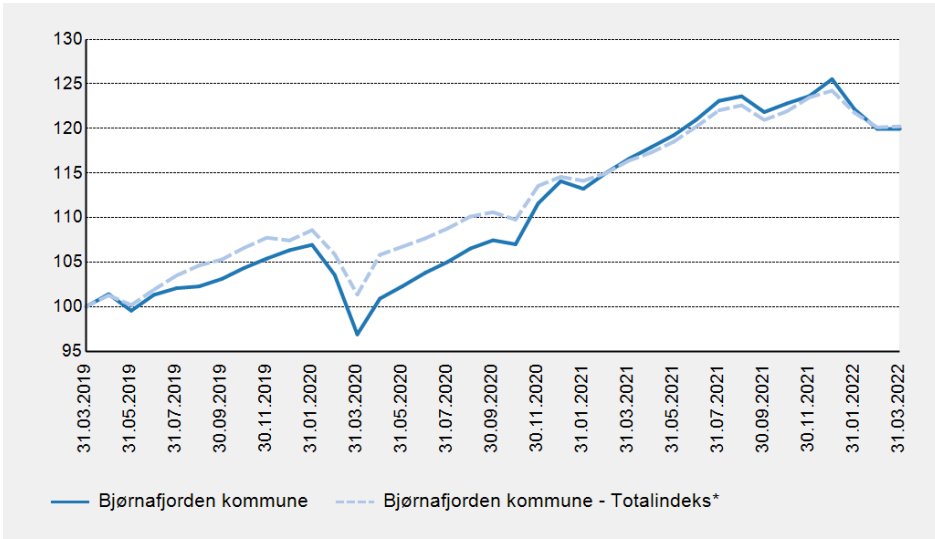
■ Bjørnafjorden kommune ■ Indeks

Allokering

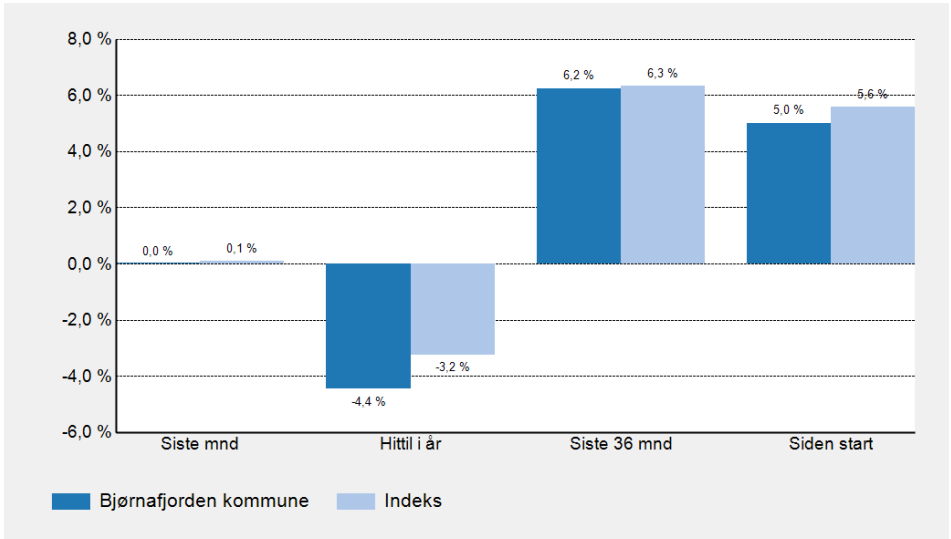
Beholdning	Verdi		Min %	Normal %	Maks %	Avvik %	Inspeksjon
	TNOK	%					
Pengemarked	14 986	9,5	5,0	10,0	30,0	-0,5	OK
Norske obligasjoner	15 656	9,9	5,0	10,0	30,0	-0,1	OK
Globale obligasjoner	45 959	29,1	20,0	30,0	40,0	-0,9	OK
Norske aksjer	17 125	10,9	5,0	10,0	30,0	0,9	OK
Globale aksjer	44 823	28,4	20,0	30,0	40,0	-1,6	OK
Eiendom	19 266	12,2	0,0	10,0	20,0	2,2	OK
Bjørnafjorden kommune	157 814	100,0					



Indeksert avkastning siste 36 måneder



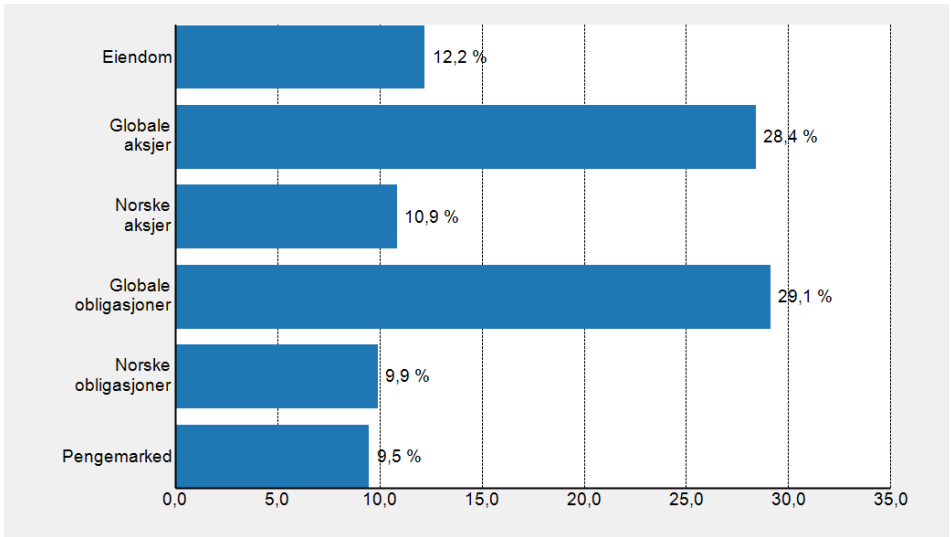
Avkastning



Verdiutvikling, TNOK

	Siste mnd	Hittil i år	Siste 36 mnd	Siden start
Inngående beholdning	157 810,3	165 310,8	218 415,7	212 821,4
Innskudd/uttak	0,0	-151,1	-94 465,3	118 356,2
Gev/tap	3,8	-7 345,5	33 863,8	39 458,0
Utgående beholdning	157 814,1	157 814,1	157 814,1	157 814,1

Porteføljevekter



Beholdning	Markedsverdi, TNOK				% av portefølje				
	31.03.2022	31.12.2021	Inn/ut	Avkastning	31.03.2022	Min	Normal	Maks	Avvik
Handelskonto DNB	156	144	12	0	0,1				
Holberg Likviditet	14 830	14 600	207	22	9,4				
Pengemarked	14 986	14 744	219	22	9,5	5,0	10,0	30,0	-0,5
Danske Inv Norsk Obl. Inst.	15 656	16 115	0	-459	9,9				
DNB Obligasjon E	n.a	0	0	0	0,0				
Norske obligasjoner	15 656	16 115	0	-459	9,9	5,0	10,0	30,0	-0,1
AQR Global Aggregate	8 348	8 866	0	-518	5,3				
BlueBay IG Global Agg	13 491	14 047	0	-556	8,5				
PIMCO Global Bond Fund ESG	13 457	14 075	0	-618	8,5				
PIMCO Income Fund	10 663	11 164	0	-501	6,8				
Globale obligasjoner	45 959	48 152	0	-2 193	29,1	20,0	30,0	40,0	-0,9
Arctic Norw. Value Creation	11 301	11 422	0	-121	7,2				
Danske Inv No. Aksjer Inst. II	5 824	5 681	0	143	3,7				
Norske aksjer	17 125	17 103	0	22	10,9	5,0	10,0	30,0	0,9
AKO Global L/O D1 USD	12 437	14 389	0	-1 952	7,9				
Ardevora Global Equity SRI	14 890	16 958	0	-2 068	9,4				
Danske Inv World Indeks H2N	9 076	n.a	8 900	176	5,8				
KLP AksjeGlobal Indeks II H2N	n.a	9 609	-9 258	-351	0,0				
Lansdowne Dev. Mkt L/O SRI	8 420	9 448	0	-1 028	5,3				
Globale aksjer	44 823	50 404	-358	-5 223	28,4	20,0	30,0	40,0	-1,6
DEAS Eiendomsfond Norge I	19 125	18 670	-29	484	12,1				
Reinvestering DEAS	140	123	18	0	0,1				
Eiendom	19 266	18 793	-12	484	12,2	0,0	10,0	20,0	2,2
Total (Bjørnafjorden kommune)	157 814	165 311	-151	-7 346	100,0				

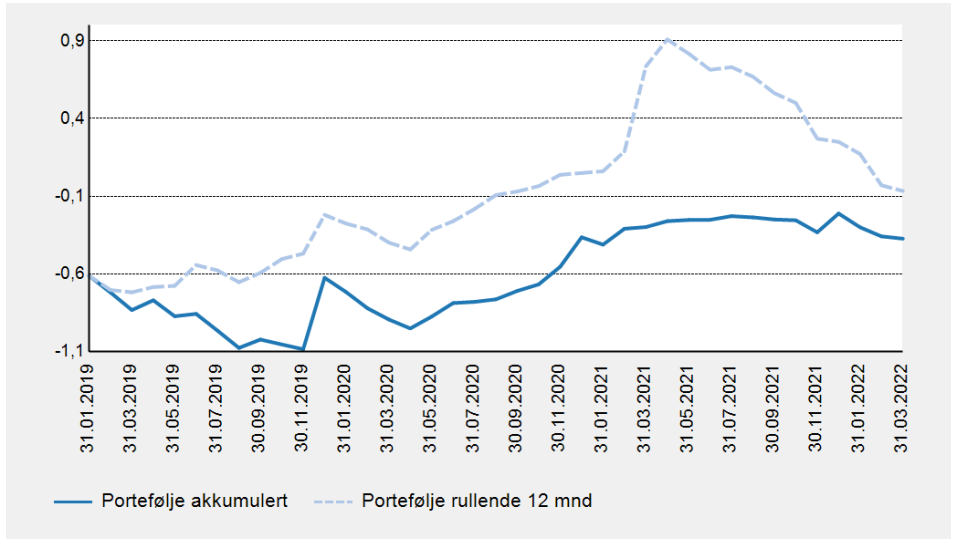
Beholdning	Avkastning, mnd. til dato, %			Avkastning, hitt. i år, %			Avkastning, siden start, %			
	Portef.	Ind.	Diff.	Portef.	Ind.	Diff.	Portef.	Ind.	Diff.	Start
Handelskonto DNB	n.a	n.a	n.a	n.a	n.a	n.a	n.a	n.a	n.a	01.01.2018
Holberg Likviditet	0,0	0,1	-0,1	0,2	0,1	0,1	1,2	0,4	0,9	07.02.2020
Pengemarked	0,0	0,1	-0,1	0,2	0,1	0,0	1,3	0,6	0,7	01.01.2018
Danske Inv Norsk Obl. Inst.	-1,5	-1,4	-0,1	-2,8	-2,5	-0,4	-2,8	-2,3	-0,5	20.10.2021
Norske obligasjoner	-1,5	-1,4	-0,1	-2,8	-2,5	-0,4	1,5	0,4	1,1	01.01.2018
AQR Global Aggregate	-2,9	-2,1	-0,8	-5,8	-4,8	-1,0	0,7	1,7	-1,1	03.07.2018
BlueBay IG Global Agg	-1,0	-2,1	1,1	-4,0	-4,8	0,9	3,2	1,8	1,3	26.06.2018
PIMCO Global Bond Fund ESG	-1,8	-2,1	0,3	-4,4	-4,8	0,4	2,1	1,8	0,3	26.06.2018
PIMCO Income Fund	-0,9	-2,1	1,2	-4,5	-4,8	0,4	0,8	-1,2	2,0	06.02.2020
Globale obligasjoner	-1,6	-2,1	0,5	-4,6	-4,8	0,3	1,9	1,4	0,4	01.01.2018
Arctic Norw. Value Creation	2,3	3,2	-0,9	-1,1	1,5	-2,6	13,3	11,9	1,4	06.04.2018
Danske Inv No. Aksjer Inst. II	3,7	3,2	0,6	2,5	1,5	1,0	10,8	10,0	0,8	20.06.2018
Norske aksjer	2,8	3,2	-0,4	0,1	1,5	-1,4	11,1	10,7	0,4	01.01.2018
AKO Global L/O D1 USD	0,1	1,4	-1,2	-13,6	-6,2	-7,3	11,4	13,6	-2,3	23.09.2020
Ardevora Global Equity SRI	-0,5	1,4	-1,8	-12,2	-6,2	-6,0	11,4	12,8	-1,3	06.06.2018
Danske Inv World Indeks H2N	5,8	3,1	2,7	2,0	0,7	1,3	2,0	0,7	1,3	04.02.2022
Lansdowne Dev. Mkt L/O SRI	-4,6	1,9	-6,6	-10,9	-6,0	-4,8	3,7	14,1	-10,4	31.05.2018
Globale aksjer	0,1	1,7	-1,6	-10,6	-5,9	-4,7	8,1	11,6	-3,5	01.01.2018
DEAS Eiendomsfond Norge I	2,5	2,5	0,0	2,6	2,6	0,0	9,5	9,5	0,0	01.01.2018
Reinvestering DEAS	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	31.03.2019
Eiendom	2,5	0,3	2,3	2,6	0,7	1,8	8,9	3,6	5,4	01.01.2018
Total (Bjørnafjorden kommune)	0,0	0,1	-0,1	-4,4	-3,2	-1,2	5,0	5,6	-0,6	01.01.2018

Beholdning	% av portf.	Avkastn., mnd. til dato, %			Avkastn., hitt. i år, %			Markedsverdi MNOK				
	31.03.2022	Portef.	Indeks	Diff.	Portef.	Indeks	Diff.	31.03.2022	28.02.2022	Bev.	Gev/tap	Startdato
Handelskonto DNB	0,1	n.a	n.a	n.a	n.a	n.a	n.a	0,2	0,2	0,0	0,0	01.01.2018
Holberg Likviditet	9,4	0,0	0,1	-0,1	0,2	0,1	0,1	14,8	14,8	0,0	0,0	07.02.2020
Pengemarked	9,5	0,0	0,1	-0,1	0,2	0,1	0,0	15,0	15,0	0,0	0,0	01.01.2018
Danske Inv Norsk Obl. Inst.	9,9	-1,5	-1,4	-0,1	-2,8	-2,5	-0,4	15,7	15,9	0,0	-0,2	20.10.2021
DNB Obligasjon E	0,0	n.a	n.a	n.a	-1,2	-1,0	-0,2	0,0	0,0	0,0	0,0	20.12.2021
Norske obligasjoner	9,9	-1,5	-1,4	-0,1	-2,8	-2,5	-0,4	15,7	15,9	0,0	-0,2	01.01.2018
AQR Global Aggregate	5,3	-2,9	-2,1	-0,8	-5,8	-4,8	-1,0	8,3	8,6	0,0	-0,2	03.07.2018
BlueBay IG Global Agg	8,5	-1,0	-2,1	1,1	-4,0	-4,8	0,9	13,5	13,6	0,0	-0,1	26.06.2018
PIMCO Global Bond Fund ESG	8,5	-1,8	-2,1	0,3	-4,4	-4,8	0,4	13,5	13,7	0,0	-0,2	26.06.2018
PIMCO Income Fund	6,8	-0,9	-2,1	1,2	-4,5	-4,8	0,4	10,7	10,8	0,0	-0,1	06.02.2020
Globale obligasjoner	29,1	-1,6	-2,1	0,5	-4,6	-4,8	0,3	46,0	46,7	0,0	-0,7	01.01.2018
Arctic Norw. Value Creation	7,2	2,3	3,2	-0,9	-1,1	1,5	-2,6	11,3	11,0	0,0	0,3	06.04.2018
Danske Inv No. Aksjer Inst. II	3,7	3,7	3,2	0,6	2,5	1,5	1,0	5,8	5,6	0,0	0,2	20.06.2018
Norske aksjer	10,9	2,8	3,2	-0,4	0,1	1,5	-1,4	17,1	16,7	0,0	0,5	01.01.2018
AKO Global L/O D1 USD	7,9	0,1	1,4	-1,2	-13,6	-6,2	-7,3	12,4	12,4	0,0	0,0	23.09.2020
Ardevora Global Equity SRI	9,4	-0,5	1,4	-1,8	-12,2	-6,2	-6,0	14,9	15,0	0,0	-0,1	06.06.2018
Danske Inv World Indeks H2N	5,8	5,8	3,1	2,7	2,0	0,7	1,3	9,1	8,6	0,0	0,5	04.02.2022
KLP AksjeGlobal Indeks II H2N	0,0	n.a	n.a	n.a	-8,8	-8,4	-0,4	0,0	0,0	0,0	0,0	01.01.2018
Lansdowne Dev. Mkt L/O SRI	5,3	-4,6	1,9	-6,6	-10,9	-6,0	-4,8	8,4	8,8	0,0	-0,4	31.05.2018
Globale aksjer	28,4	0,1	1,7	-1,6	-10,6	-5,9	-4,7	44,8	44,8	0,0	0,0	01.01.2018
DEAS Eiendomsfond Norge I	12,1	2,5	2,5	0,0	2,6	2,6	0,0	19,1	18,8	-0,1	0,5	01.01.2018
Reinvestering DEAS	0,1	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,1	0,0	0,1	0,0	31.03.2019
Eiendom	12,2	2,5	0,3	2,3	2,6	0,7	1,8	19,3	18,8	0,0	0,5	01.01.2018
Total (Bjørnafjorden kommune)	100,0	0,0	0,1	-0,1	-4,4	-3,2	-1,2	157,8	157,8	0,0	0,0	01.01.2018

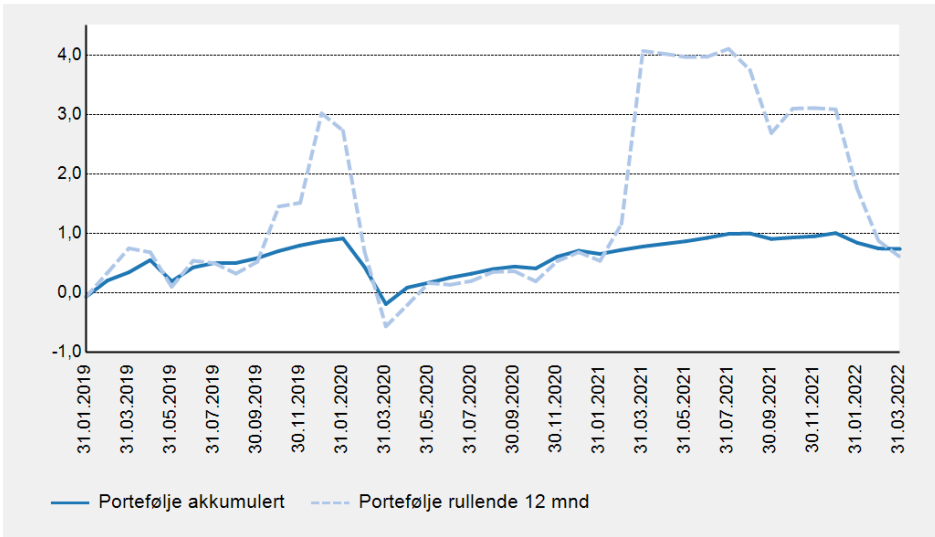
Nøkkeltall i perioden

Markedsverdi (TNOK)	157 814	Beta	1,15
Avkastning - portefølje	5,0 %	Forklaringsgrad (R2)	0,91
Avkastning - indeks	5,6 %	Tracking Error	2,0 %
Differanse	-0,6 %	Info kvot	-0,37
Standardavvik - portefølje	6,2 %	Sharpe Ratio	0,73
Standardavvik - indeks	5,1 %	Konsistens	42,0 %
		Max drawdown	-14,9 %
		Recovery time	235

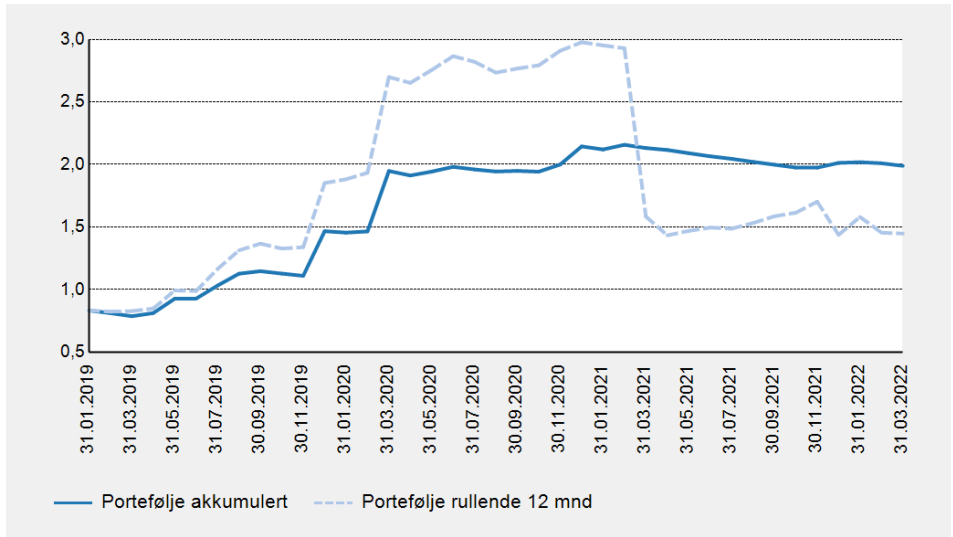
Trendanalyse - Informationskvot



Trendanalyse - Sharpe Ratio



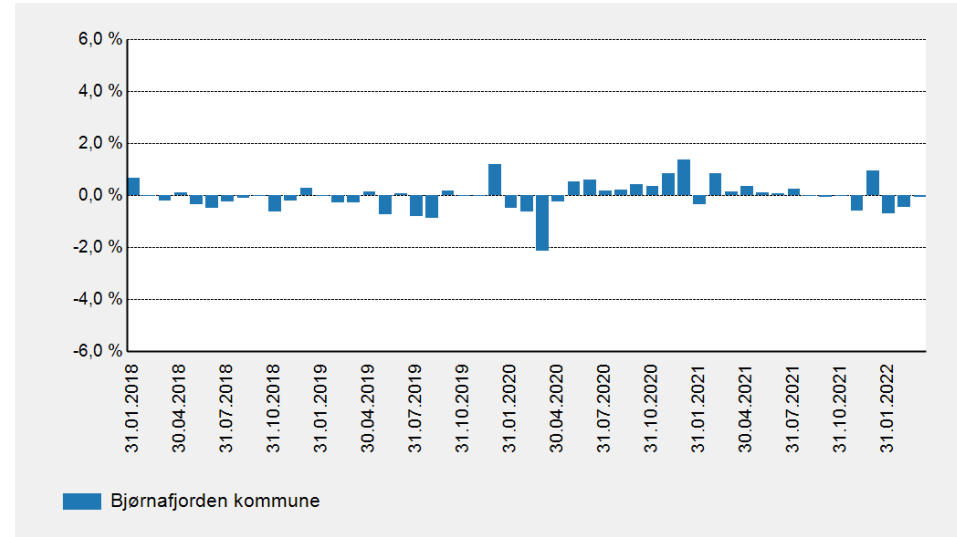
Trendanalyse - Tracking Error



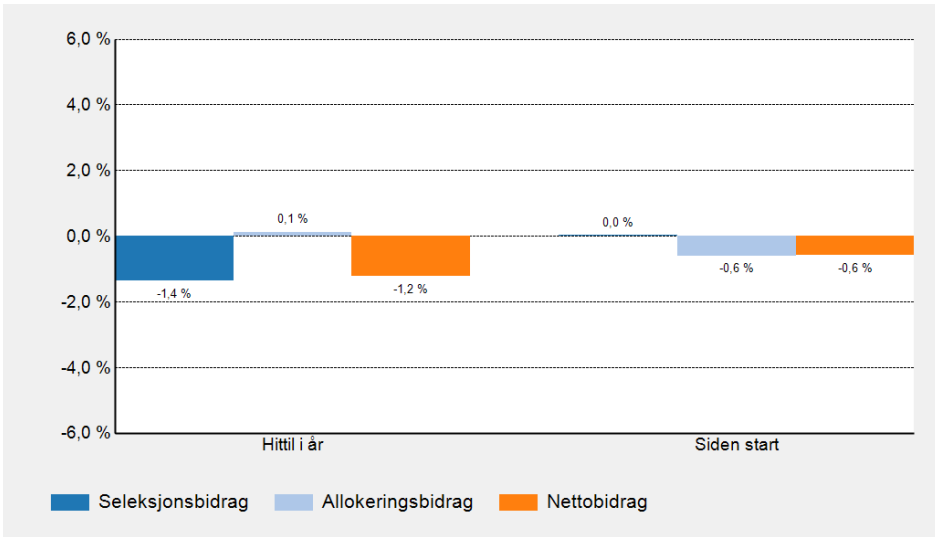
Avkastning

	2022	2021	2020	2019	2018	2017
MV (TNOK)	157 814	165 311	162 812	232 251	208 572	n.a
Portef.	-4,4 %	10,0 %	7,3 %	11,4 %	-2,0 %	n.a
Indeks	-3,2 %	8,4 %	6,6 %	13,2 %	-0,6 %	n.a
Differanse	-1,2 %	1,6 %	0,6 %	-1,9 %	-1,4 %	n.a
Avkastning	1 mnd	3 mnd	6 mnd	1 år	3 år	5 år
Portef.	0,0 %	-4,4 %	-1,6 %	2,9 %	6,2 %	n.a
Indeks	0,1 %	-3,2 %	-0,6 %	3,3 %	6,3 %	n.a
Differanse	-0,1 %	-1,2 %	-1,0 %	-0,4 %	-0,1 %	n.a

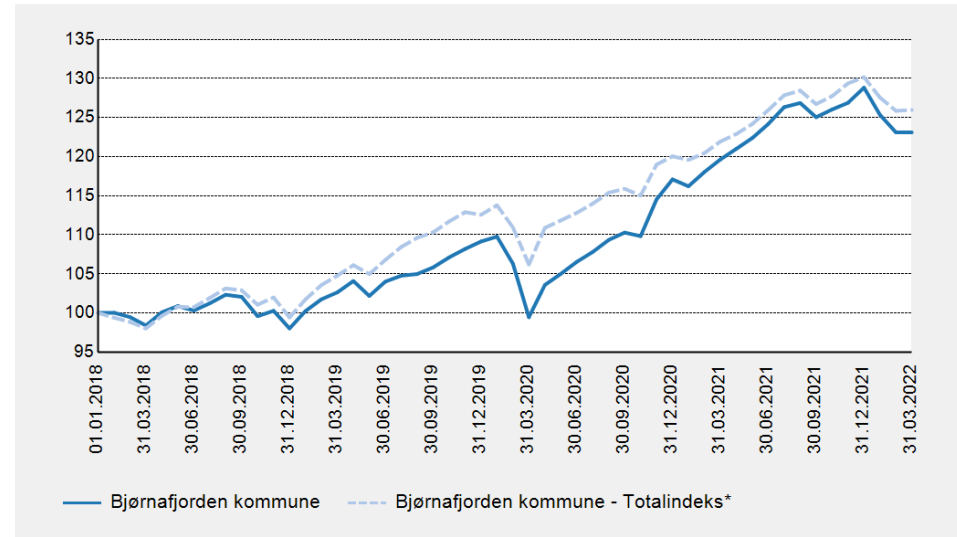
Differanseavkastning



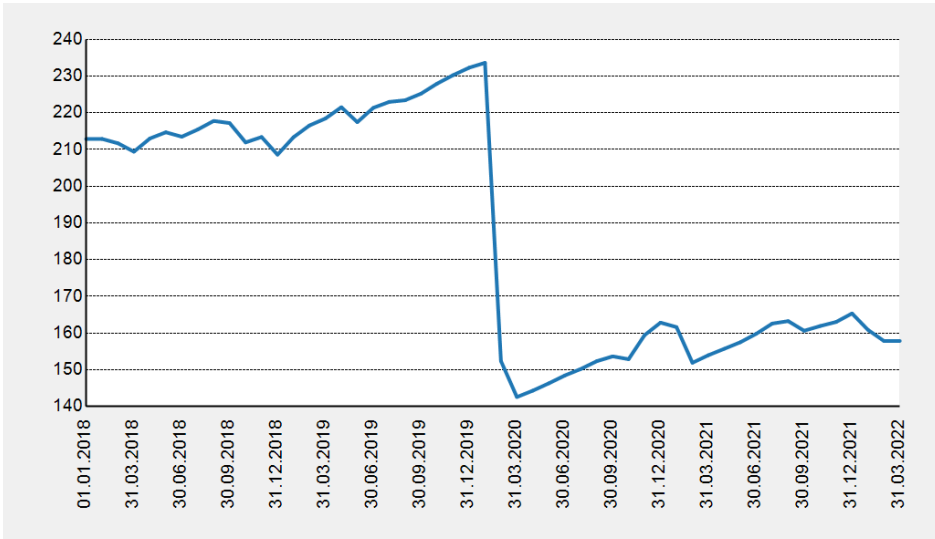
Forklaring til porteføljeresultat



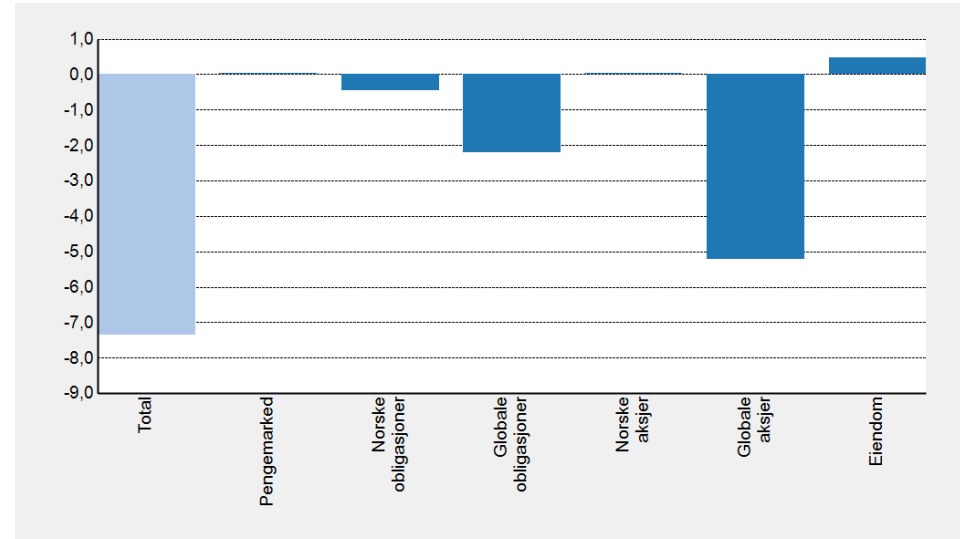
Indeksert avkastning siden start



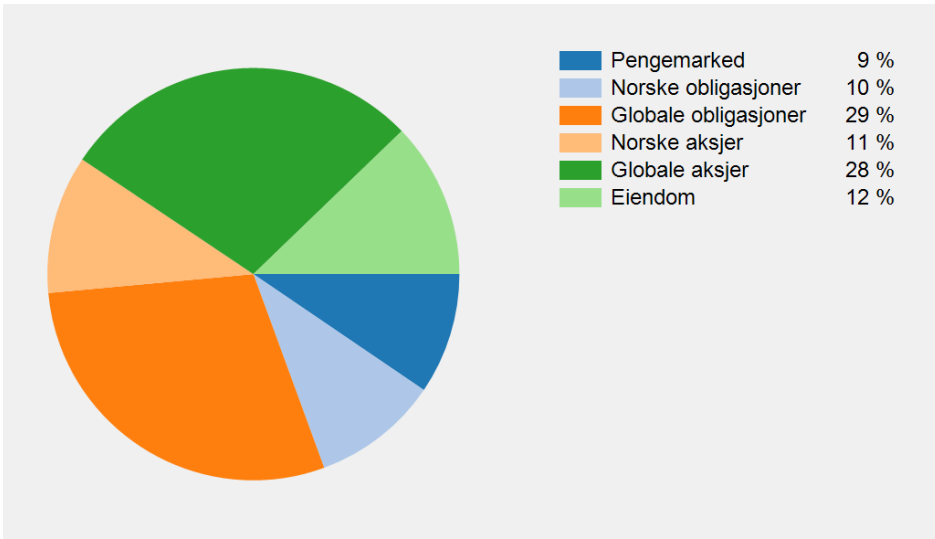
Verdiutvikling, MNOK



Porteføljeavkastning, hittil i år, MNOK



Allokering



Avkastning i beløp per aggregat

	Hittil i år	2021	Siden start
Total	-7 345 524	15 278 860	39 457 998
Pengemarked	22 404	103 686	2 152 954
Norske obligasjoner	-458 706	30 689	2 047 206
Globale obligasjoner	-2 192 501	-313 270	2 300 865
Norske aksjer	22 296	4 186 684	8 994 965
Globale aksjer	-5 223 182	9 176 127	17 275 137
Eiendom	484 165	2 094 945	6 686 872