

Bjørnafjorden kommune

PORTEFØLJERAPPORT - risikoreport

Periode: 1. januar 2025 - 31. januar 2025

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

Sluttverdi

185,8 mill.

Resultat

3,3 mill.

Avvik budsjett

3,3 mill.

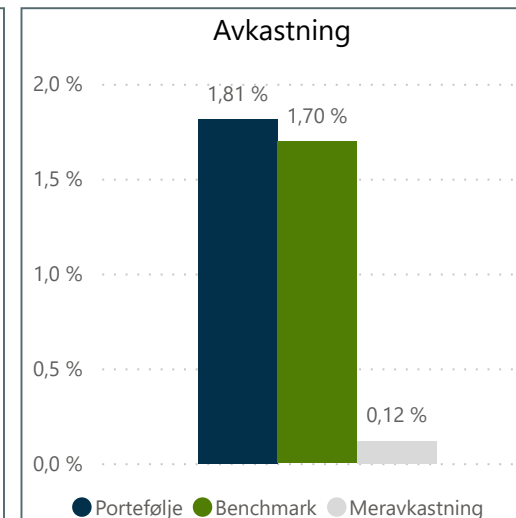
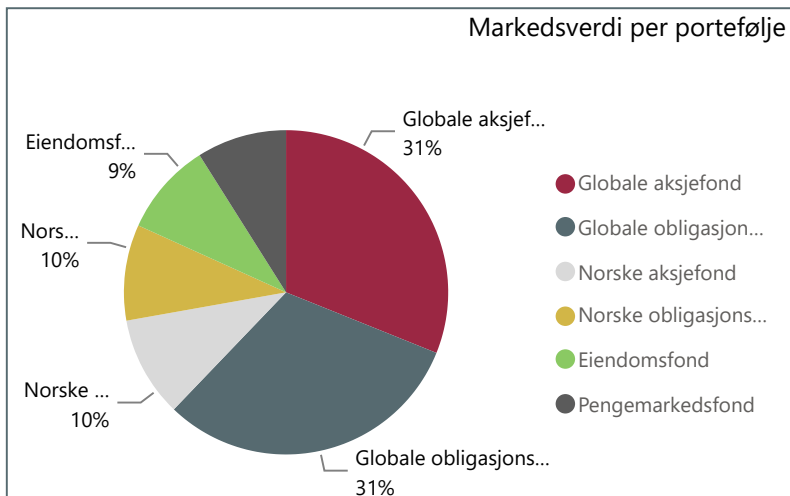
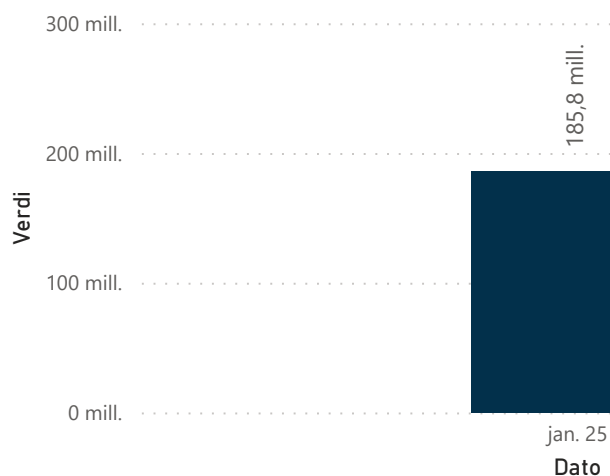
Avkastning mot benchmark

1,70 %

1,81 %

Sammendrag

ID	Beskrivelse	Sluttverdi	Resultat	Avkastning	Benchmark	Meravk. %	Strategisk vekt	Faktisk andel	Avvik	Min	Min_avvik	Maks	Maks_avvik
BJFK1	Pengemarkedsfond	16 645 653	85 085	0,51 %	0,38 %	0,13 %	10 %	9,0 %	-1,0 %	5 %	✓ 0 %	30 %	✓ 0 %
BJFK2	Norske obligasjonsfond	17 775 197	227 346	1,30 %	1,19 %	0,10 %	10 %	9,6 %	-0,4 %	5 %	✓ 0 %	30 %	✓ 0 %
BJFK3	Globale obligasjonsfond	57 730 538	371 359	0,65 %	0,39 %	0,25 %	30 %	31,1 %	1,1 %	20 %	✓ 0 %	40 %	✓ 0 %
BJFK4	Eiendomsfond	17 238 751	0	0,00 %	0,63 %	-0,63 %	10 %	9,3 %	-0,7 %	0 %	✓ 0 %	20 %	✓ 0 %
BJFK5	Norske aksjefond	18 649 294	1 048 915	6,00 %	6,70 %	-0,71 %	10 %	10,0 %	0,0 %	5 %	✓ 0 %	30 %	✓ 0 %
BJFK6	Globale aksjefond	57 781 714	1 577 882	2,81 %	2,29 %	0,51 %	30 %	31,1 %	1,1 %	20 %	✓ 0 %	40 %	✓ 0 %
Total	Total	185 821 147	3 310 587	1,81 %	1,70 %	0,12 %	100 %	100,0 %	0,0 %	100 %	✓ 0 %	100 %	✓ 0 %



Resultat

36 108 701

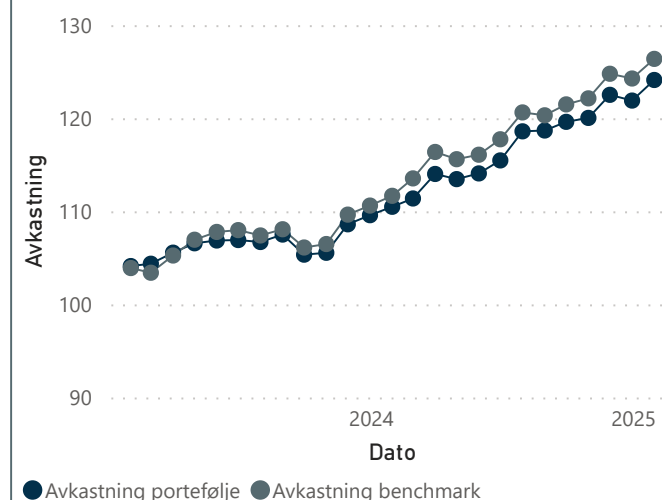
Avkastning per måned

Sort	Periode	Faktisk	Benchmark	Meravk. %	Meravkastning
31.12.2023	2023	9,32 %	10,27 %	-0,95 %	-1 535 933
31.12.2024	2024	10,76 %	11,76 %	-1,00 %	-1 674 448
31.01.2025	31.01.2025	1,81 %	1,70 %	0,12 %	214 730

Historisk avkastning

3,39 %	3,47 %
Siste 3 måneder	3 Mnd benchmark
4,65 %	4,77 %
Siste 6 måneder	6 Mnd benchmark
12,33 %	13,17 %
Siste 12 Månedeer	12 Mnd Benchmark
9,18 %	10,28 %
Siste 2 år	2 år benchmark
7,47 %	8,12 %
Siste 3 år	3 år benchmark
4,42 %	4,79 %
Siste 5 år	5 år benchmark

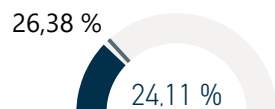
Verdiutvikling



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
jan. 25	24,11 %	26,38 %	-2,27 %	-2 995 650

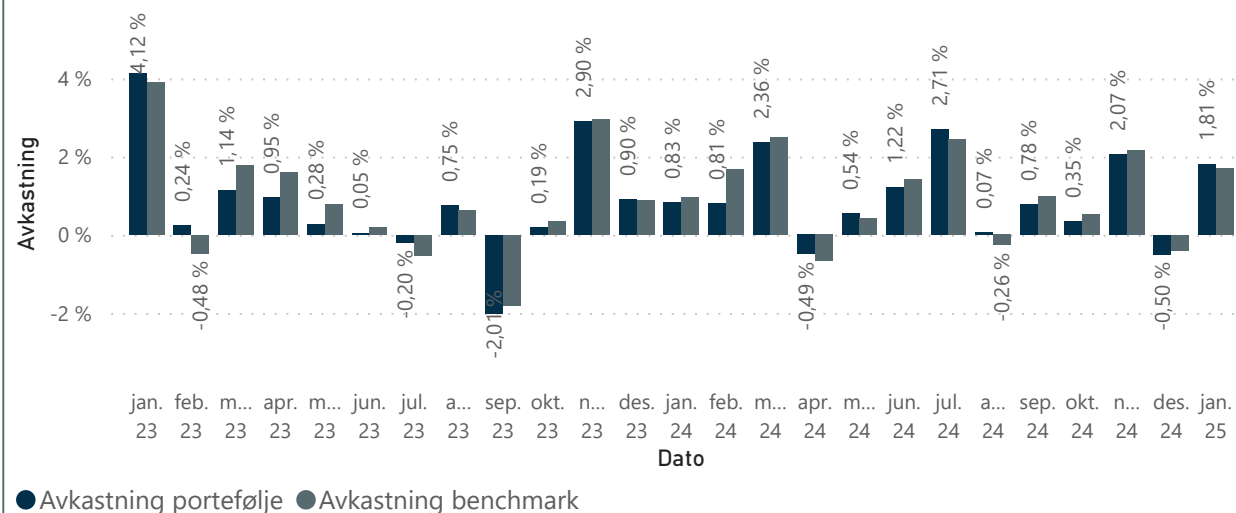
Avkastning mot benchmark



Benchmark

BJFK - Sammensatt indeks Portefølje

Avkastning per måned



BJFK - Aktivaklasser

Total

01.01.2023

31.01.2025

Beste måned

0,73 %

Gjennomsnitt

-0,07 %

Verste måned

-0,87 %

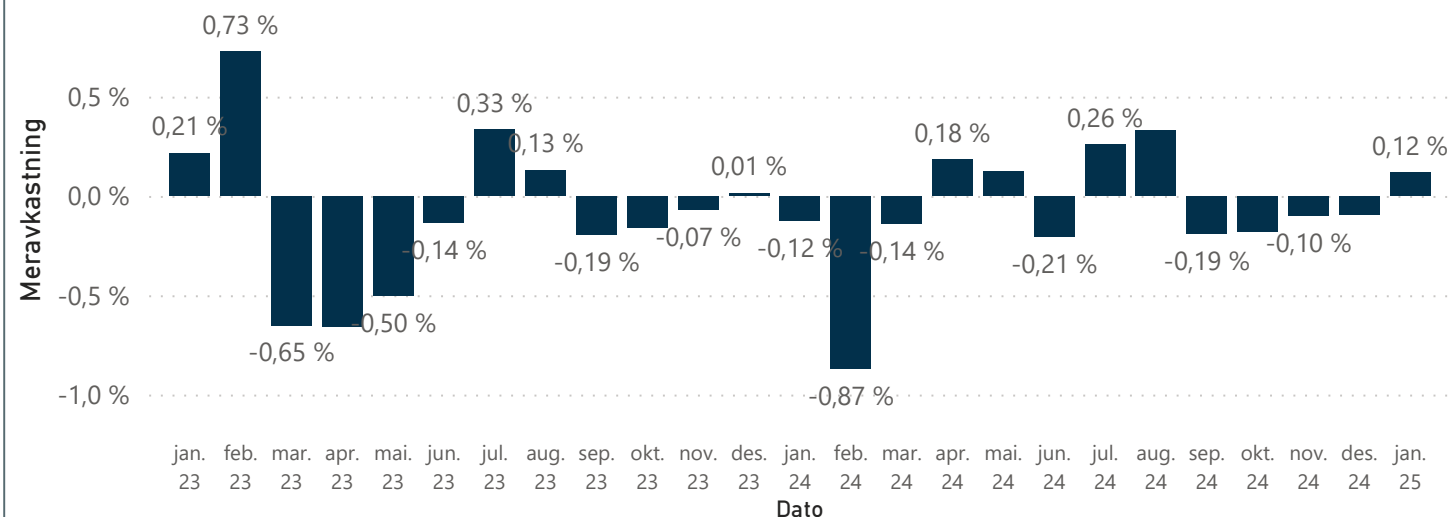
Median

-0,10 %

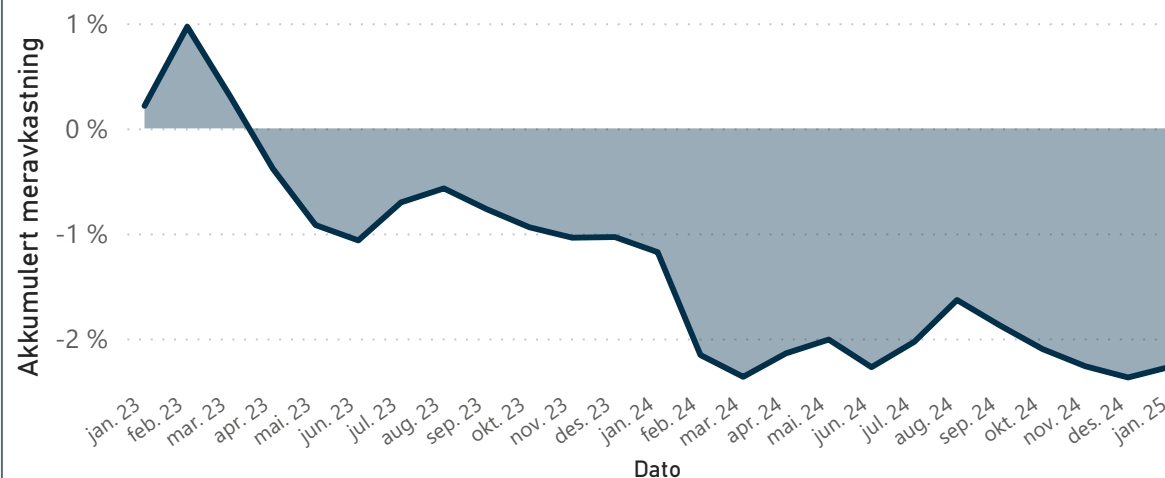
Benchmark

BJFK - Sammensatt indeks Portefølje

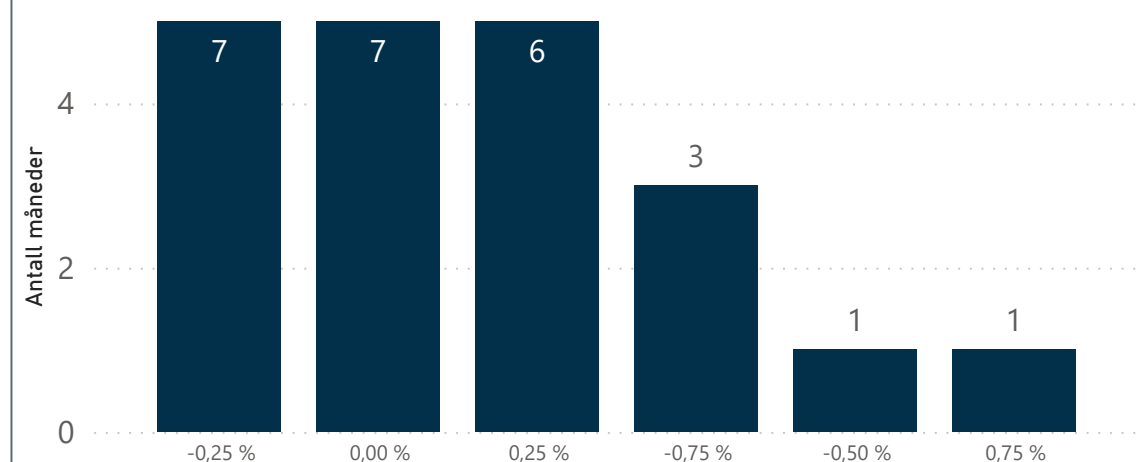
Meravkastning per måned



Akkumulert meravkastning



Fordeling av meravkastning



BJFK - Aktivaklasser

Total

01.01.2023

31.01.2025

-0,75

Information Ratio

1,54

SharpeRatio

1,18 %

Tracking Error

-0,44 %

Alfa

0,94

Beta

0,93

Determination

Standardavvik

4,42 %

4,32 %

Alfa

Alfa

2024

2025

Tracking Error

TrackingError

2024

2025

Beta

Beta

jul 2023

jan 2024

jul 2024

jan 2025

Information Ratio

InformationRatio

jul 2023

jan 2024

jul 2024

jan 2025

Sharpe Ratio

SharpeRatio

jul 2023

jan 2024

jul 2024

jan 2025

Determination

Determination

jul 2023

jan 2024

jul 2024

jan 2025

Standardavvik

Portefølje Benchmark

Portefølje og Benchmark

jul 2023

jan 2024

jul 2024

jan 2025

MeasureDate

Kovarians

Covariance

0,002

0,000

jul 2023

jan 2024

jul 2024

jan 2025