

Bjørnafjorden kommune

PORTEFØLJERAPPORT - risikoreport

Periode: 1. januar 2023 - 31. august 2023

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

Alle

01.01.2023

31.08.2023

Sluttverdi

160,9 mill.

Resultat

11,2 mill.

Avvik budsjett

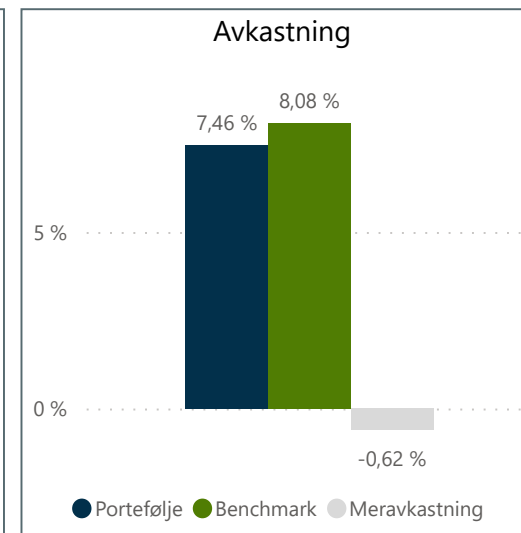
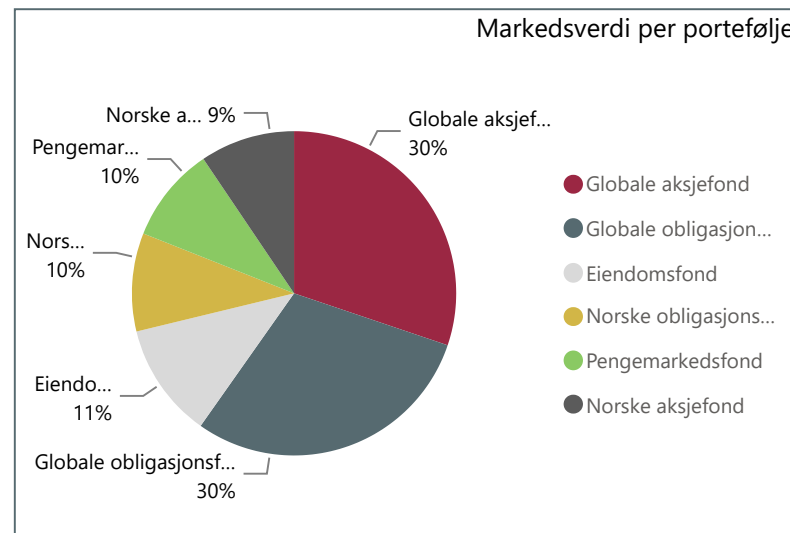
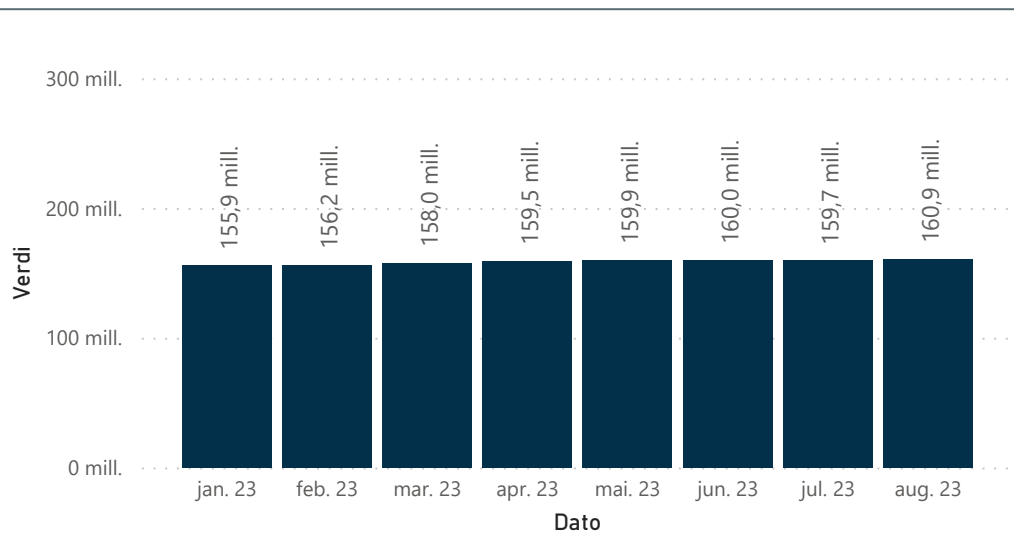
11,2 mill.

Avkastning mot benchmark

8,08 % 7,46 %

Sammendrag

ID	Beskrivelse	Sluttverdi	Resultat	Avkastning	Benchmark	Meravk. %	Strategisk vekt	Faktisk andel	Avvik	Min	Min_avvik	Maks	Maks_avvik
BJFK1	Pengemarkedsfond	15 350 183	559 282	3,60 %	2,06 %	1,54 %	10 %	9,5 %	-0,5 %	5 %	✓ 0 %	30 %	✓ 0 %
BJFK2	Norske obligasjonsfond	15 767 235	271 774	1,77 %	-0,24 %	2,01 %	10 %	9,8 %	-0,2 %	5 %	✓ 0 %	30 %	✓ 0 %
BJFK3	Globale obligasjonsfond	47 597 176	1 366 147	2,42 %	1,69 %	0,72 %	30 %	29,6 %	-0,4 %	20 %	✓ 0 %	40 %	✓ 0 %
BJFK4	Eiendomsfond	18 404 479	-73 380	-0,40 %	4,11 %	-4,51 %	10 %	11,4 %	1,4 %	0 %	✓ 0 %	20 %	✓ 0 %
BJFK5	Norske aksjefond	15 196 958	729 845	4,90 %	6,33 %	-1,44 %	10 %	9,4 %	-0,6 %	5 %	✓ 0 %	30 %	✓ 0 %
BJFK6	Globale aksjefond	48 571 473	8 321 263	20,50 %	22,52 %	-2,01 %	30 %	30,2 %	0,2 %	20 %	✓ 0 %	40 %	✓ 0 %
Total	Total	160 887 504	11 174 930	7,46 %	8,08 %	-0,62 %	100 %	100,0 %	0,0 %	100 %	✓ 0 %	100 %	✓ 0 %



BJFK - Aktivklasser

Total

01.01.2023

31.08.2023

Resultat

11 174 930

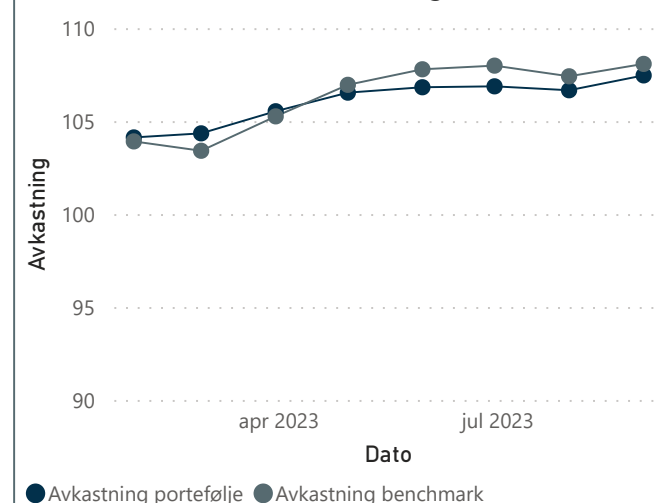
Avkastning mot benchmark



Historisk avkastning

0,60 %	0,27 %
Siste 3 måneder	3 Mnd benchmark
2,99 %	4,52 %
Siste 6 måneder	6 Mnd benchmark
7,46 %	8,08 %
Siste 12 Månedeer	12 Mnd Benchmark
3,66 %	3,96 %
Siste 2 år	2 år benchmark
2,43 %	2,62 %
Siste 3 år	3 år benchmark
1,45 %	1,57 %
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 %	-216 864
jul. 23	-0,20 %	-0,53 %	0,33 %	533 491
aug. 23	0,75 %	0,62 %	0,13 %	205 715

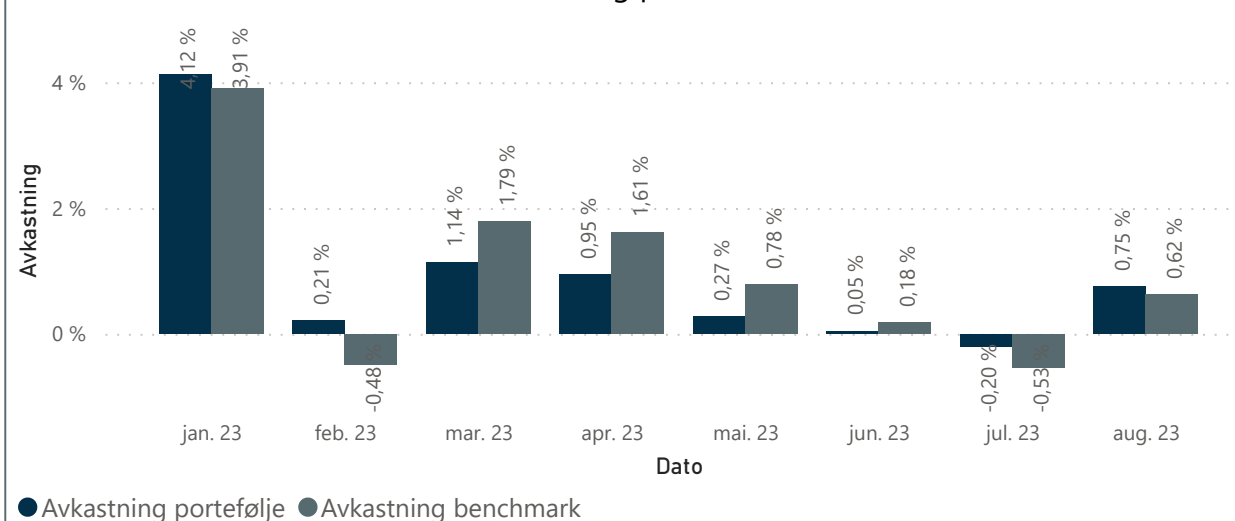
Akkumulert avkastning

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 %	-1 694 399
jul. 23	6,66 %	7,41 %	-0,75 %	-1 160 908
aug. 23	7,46 %	8,08 %	-0,62 %	-955 193

Benchmark

BJFK - Sammensatt indeks Portefølje

Avkastning per måned



BJFK - Aktivklasser

Total

01.01.2023

31.08.2023

Beste måned

0,70 %

Gjennomsnitt

-0,07 %

Verste måned

-0,66 %

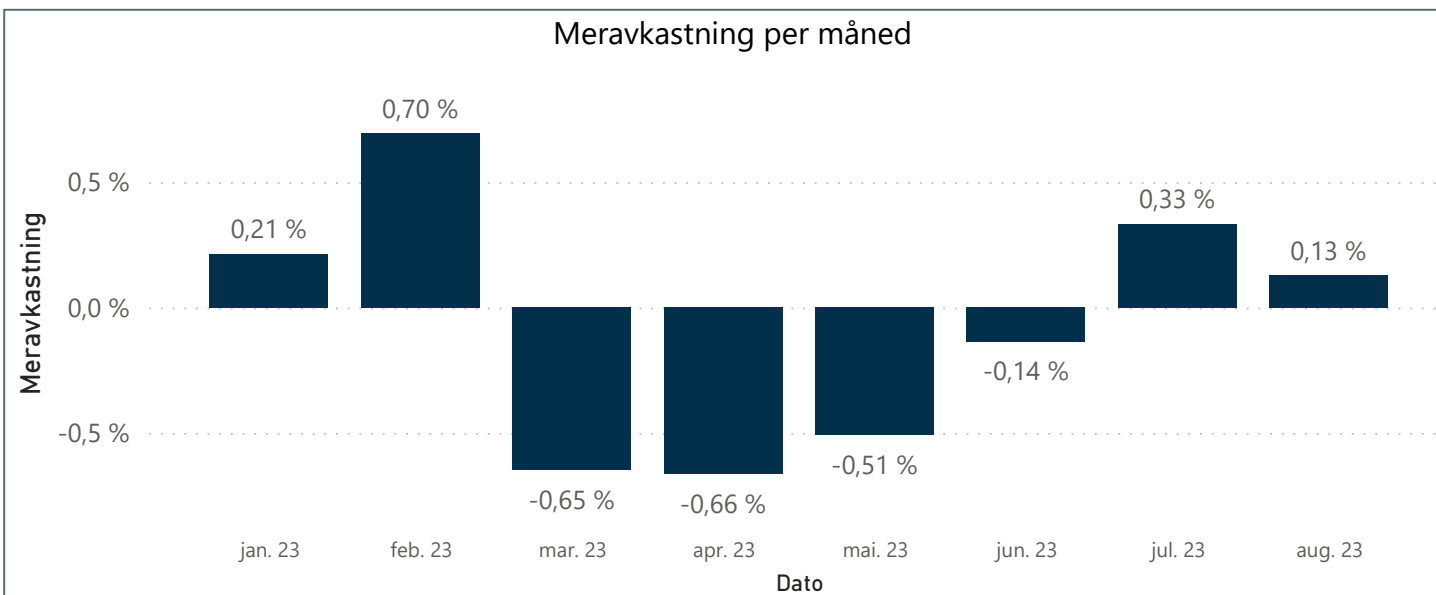
Median

-0,00 %

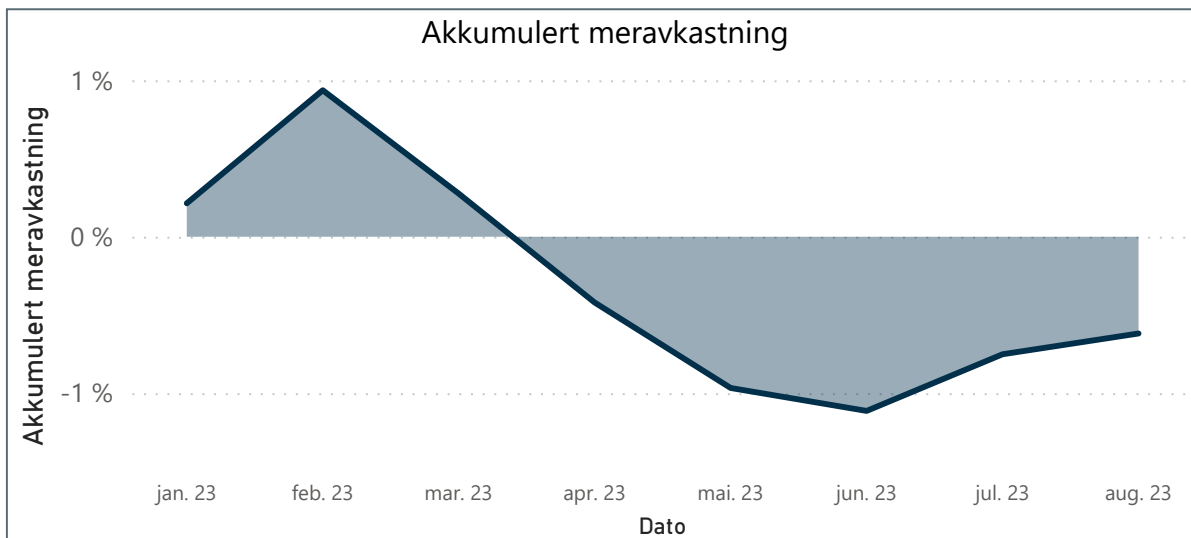
Benchmark

BJFK - Sammensatt indeks Portefølje

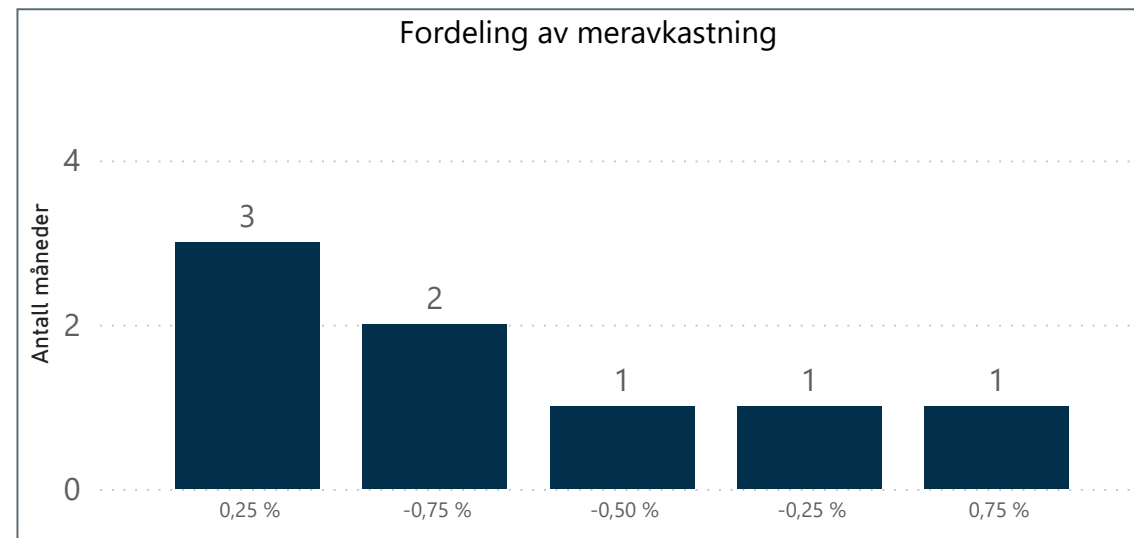
Meravkastning per måned



Akkumulert meravkastning



Fordeling av meravkastning



BJFK - Aktivaklasser

Total

01.01.2023

31.08.2023

-0,54
Information Ratio

1,77
SharpeRatio

1,62 %
Tracking Error

0,11 %
Alfa

0,89
Beta

0,88
Determination

