

Bjørnafjorden kommune

PORTEFØLJERAPPORT - risikoreport

Periode: 1. januar 2023 - 30. juni 2023

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

Alle

01.01.2023

30.06.2023

Sluttverdi

160,0 mill.

Resultat

10,3 mill.

Avvik budsjett

10,3 mill.

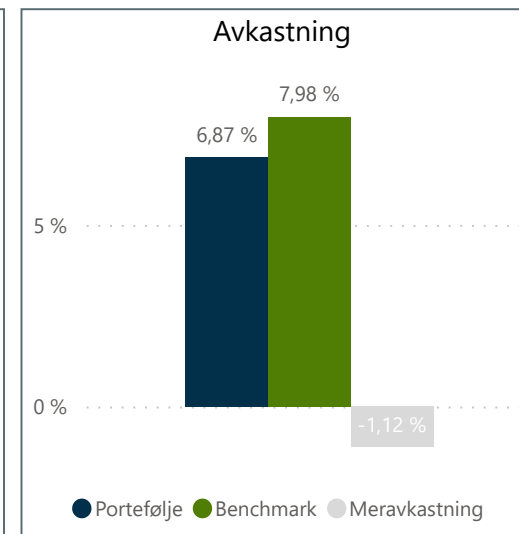
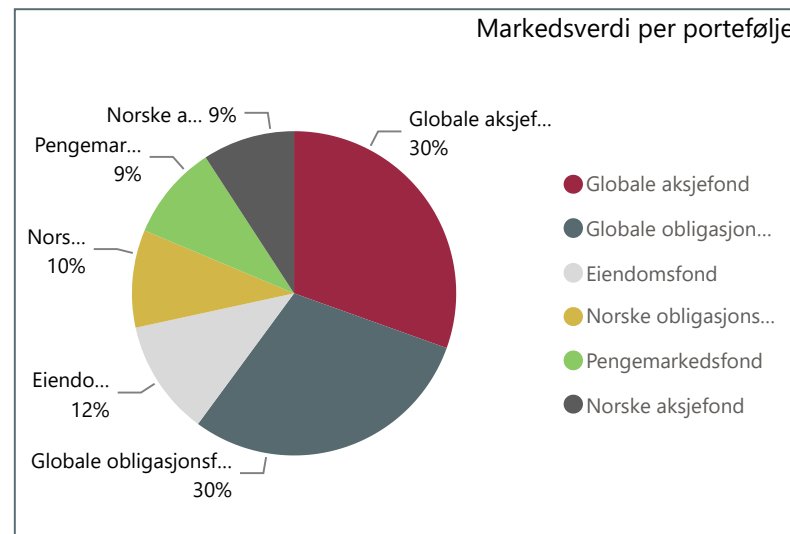
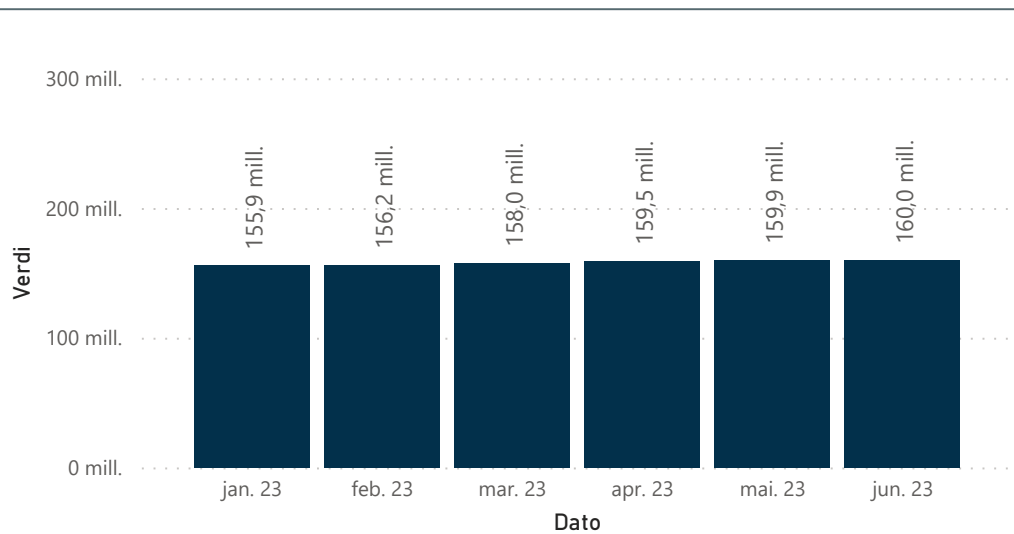
Avkastning mot benchmark

7,98 %

6,87 %

Sammendrag

ID	Beskrivelse	Sluttverdi	Resultat	Avkastning	Benchmark	Meravk. %	Strategisk vekt	Faktisk andel	Avvik	Min	Min_avvik	Maks	Maks_avvik
BJFK1	Pengemarkedsfond	15 175 325	394 931	2,49 %	1,43 %	1,06 %	10 %	9,5 %	-0,5 %	5 %	✓ 0 %	30 %	✓ 0 %
BJFK2	Norske obligasjonsfond	15 580 907	85 445	0,57 %	-1,14 %	1,71 %	10 %	9,7 %	-0,3 %	5 %	✓ 0 %	30 %	✓ 0 %
BJFK3	Globale obligasjonsfond	47 381 695	1 150 666	1,95 %	2,02 %	-0,07 %	30 %	29,6 %	-0,4 %	20 %	✓ 0 %	40 %	✓ 0 %
BJFK4	Eiendomsfond	18 404 479	-78 922	-0,43 %	2,96 %	-3,39 %	10 %	11,5 %	1,5 %	0 %	✓ 0 %	20 %	✓ 0 %
BJFK5	Norske aksjefond	14 691 446	224 333	1,41 %	3,73 %	-2,33 %	10 %	9,2 %	-0,8 %	5 %	✓ 0 %	30 %	✓ 0 %
BJFK6	Globale aksjefond	48 767 691	8 512 517	20,98 %	23,25 %	-2,28 %	30 %	30,5 %	0,5 %	20 %	✓ 0 %	40 %	✓ 0 %
Total	Total	160 001 543	10 288 970	6,87 %	7,98 %	-1,12 %	100 %	100,0 %	0,0 %	100 %	✓ 0 %	100 %	✓ 0 %



BJFK - Aktivklasser

Total

01.01.2023

30.06.2023

Resultat

10 288 970

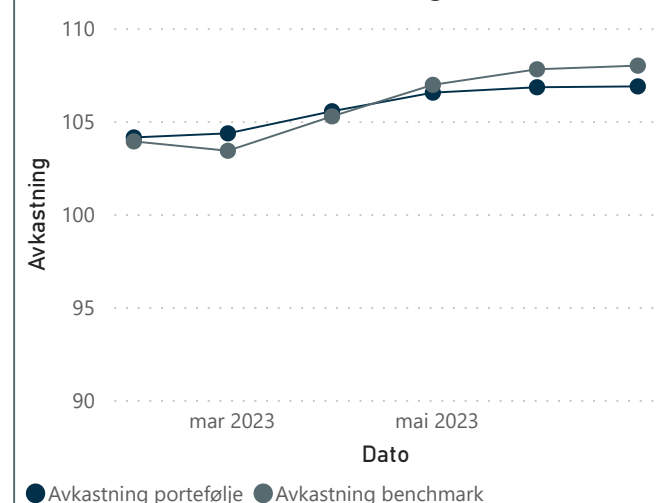
Avkastning mot benchmark



Historisk avkastning

1,27 %	2,59 %
Siste 3 måneder	3 Mnd benchmark
6,87 %	7,98 %
Siste 6 måneder	6 Mnd benchmark
6,87 %	7,98 %
Siste 12 Månedeer	12 Mnd Benchmark
3,38 %	3,92 %
Siste 2 år	2 år benchmark
2,24 %	2,59 %
Siste 3 år	3 år benchmark
1,34 %	1,55 %
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	0,04 %	0,18 %	-0,14 %	-221 547

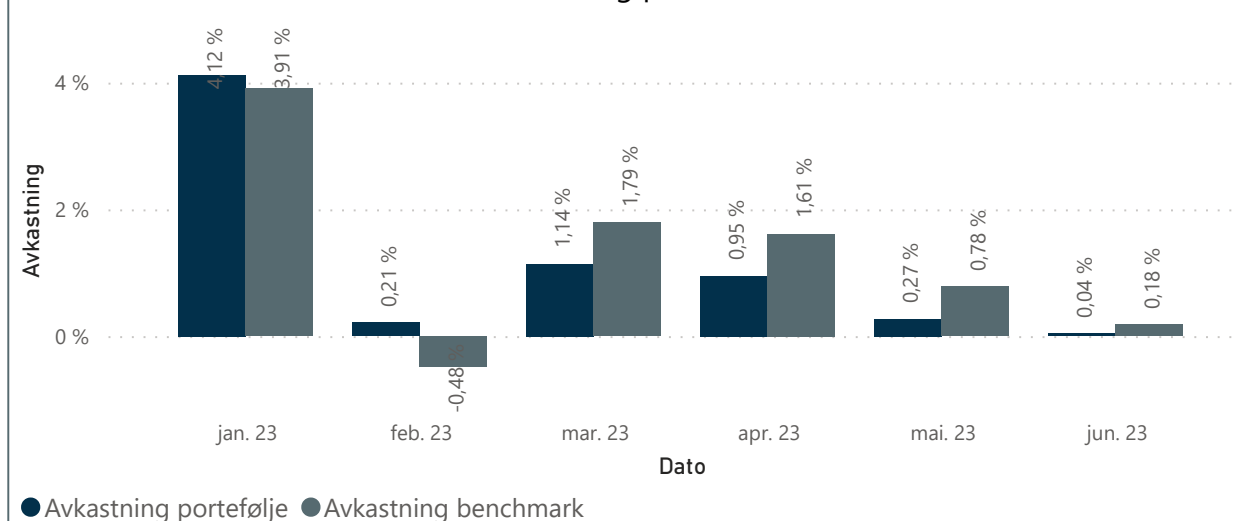
Akkumulert avkastning

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 %	-1,12 %	-1 699 082

Benchmark

BJFK - Sammensatt indeks Portefølje

Avkastning per måned



BJFK - Aktivklasser

Total

01.01.2023

30.06.2023

Beste måned

0,70 %

Gjennomsnitt

-0,18 %

Verste måned

-0,66 %

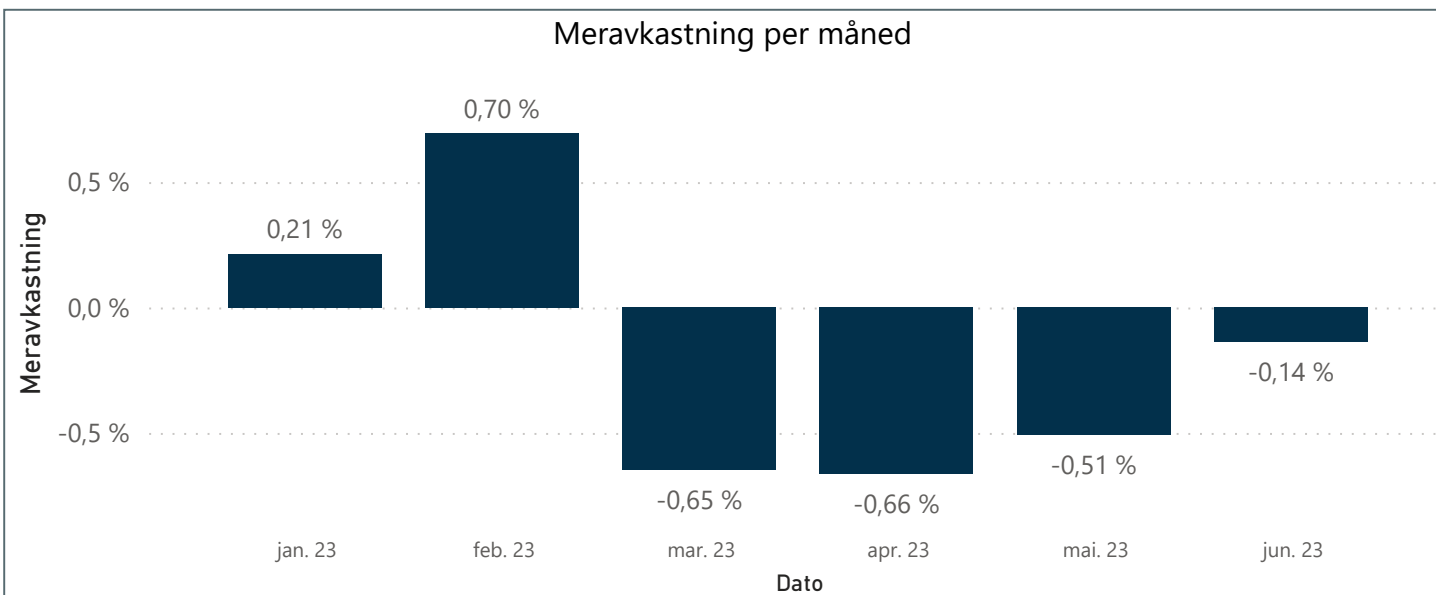
Median

-0,32 %

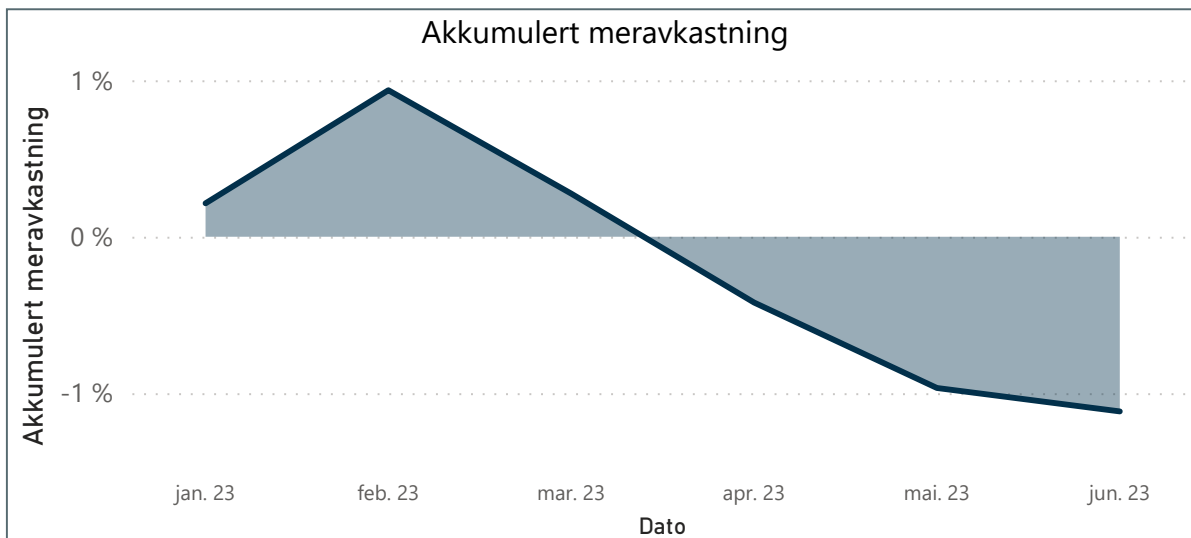
Benchmark

BJFK - Sammensatt indeks Portefølje

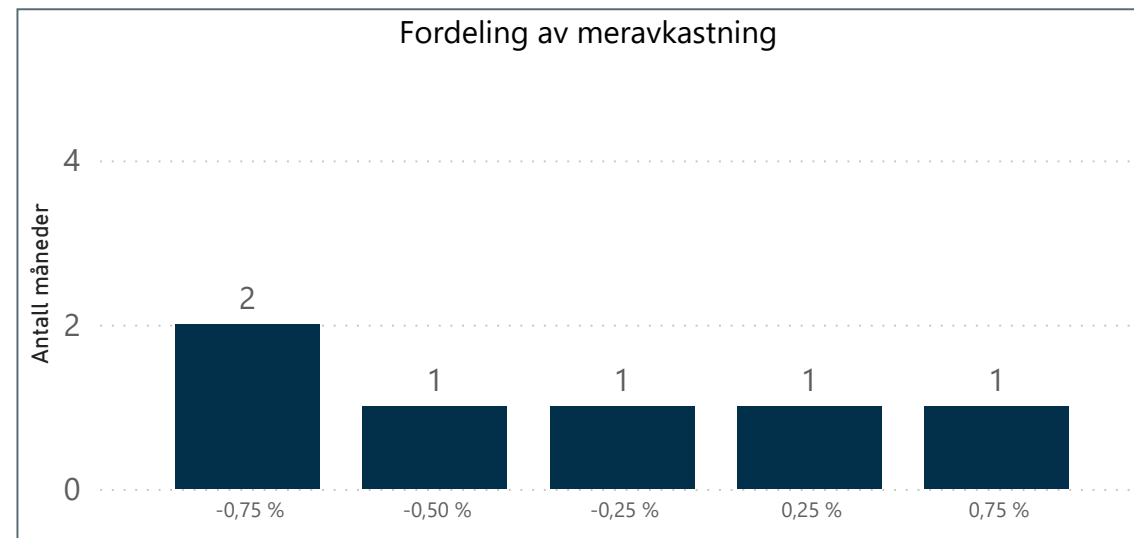
Meravkastning per måned



Akkumulert meravkastning



Fordeling av meravkastning



BJFK - Aktivaklasser

Total

01.01.2023

30.06.2023

0,00

Information Ratio

0,00

SharpeRatio

0,00 %

Tracking Error

0,00 %

Alfa

0,00

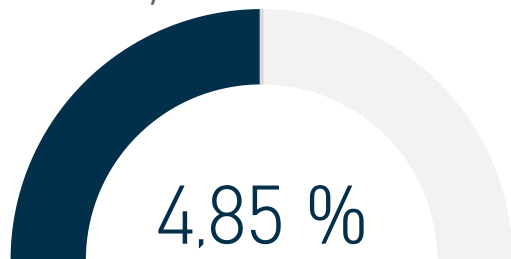
Beta

0,00

Determination

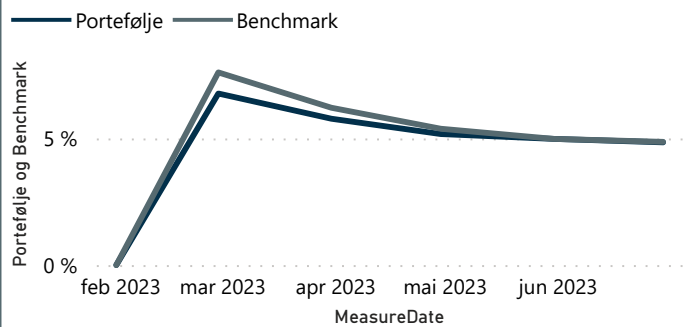
Standardavvik

4,87 %



4,85 %

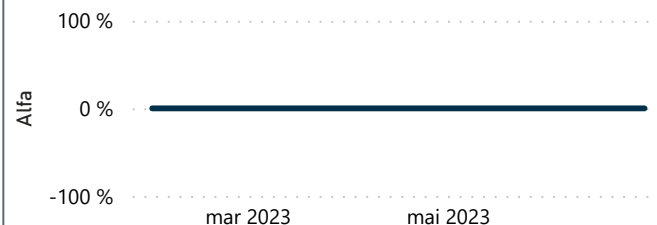
Standardavvik



Kovarians



Alfa



Tracking Error



Beta



Information Ratio



Sharpe Ratio



Determination

