

Bjørnafjorden kommune

PORTEFØLJERAPPORT - risikoreport

Periode: 1. januar 2023 - 30. april 2023

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

Alle

01.01.2023

30.04.2023

Sluttverdi

159,5 mill.

Resultat

9,8 mill.

Avvik budsjett

9,8 mill.

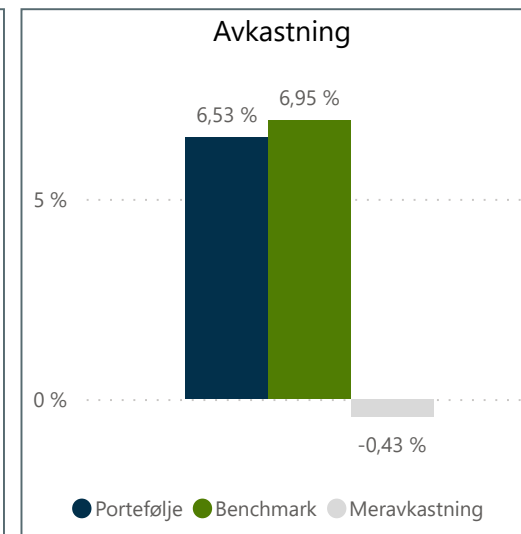
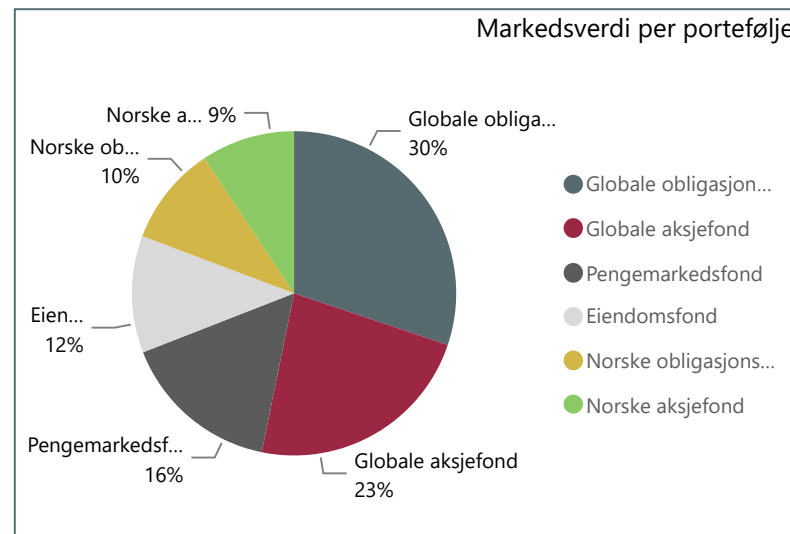
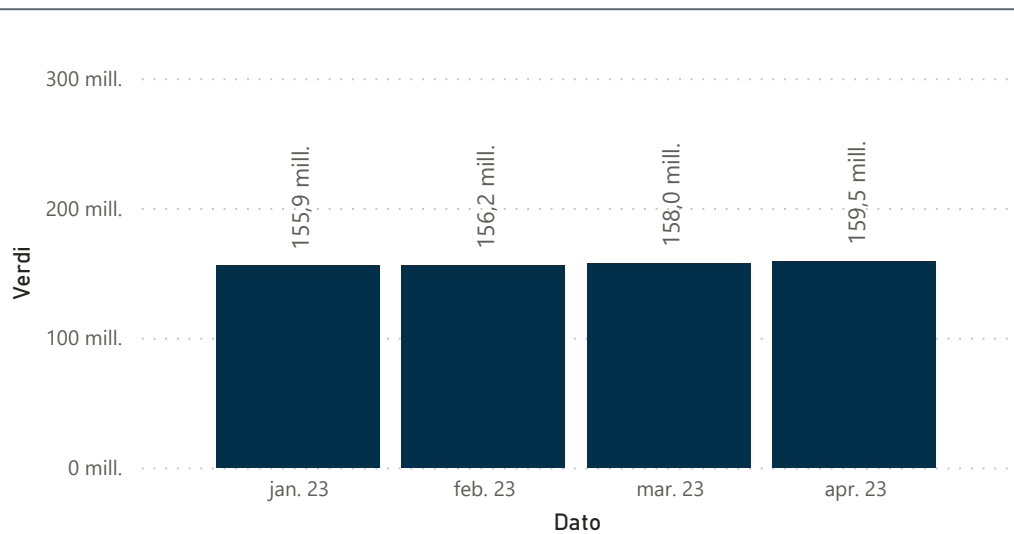
Avkastning mot benchmark

6,95 %

6,53 %

Sammendrag

ID	Beskrivelse	Sluttverdi	Resultat	Avkastning	Benchmark	Meravk. %	Strategisk vekt	Faktisk andel	Avvik	Min	Min_avvik	Maks	Maks_avvik
BJFK1	Pengemarkedsfond	25 327 064	306 999	1,98 %	0,92 %	1,05 %	10 %	15,9 %	5,9 %	5 %	✓ 0 %	30 %	✓ 0 %
BJFK2	Norske obligasjonsfond	15 869 614	372 727	2,43 %	0,78 %	1,65 %	10 %	10,0 %	-0,0 %	5 %	✓ 0 %	30 %	✓ 0 %
BJFK3	Globale obligasjonsfond	48 093 309	1 856 584	3,47 %	2,83 %	0,64 %	30 %	30,2 %	0,2 %	20 %	✓ 0 %	40 %	✓ 0 %
BJFK4	Eiendomsfond	18 600 096	116 694	0,63 %	1,93 %	-1,30 %	10 %	11,7 %	1,7 %	0 %	✓ 0 %	20 %	✓ 0 %
BJFK5	Norske aksjefond	14 852 268	382 002	2,49 %	5,76 %	-3,26 %	10 %	9,3 %	-0,7 %	5 %	✓ 0 %	30 %	✓ 0 %
BJFK6	Globale aksjefond	36 745 505	6 740 276	16,26 %	17,86 %	-1,60 %	30 %	23,0 %	-7,0 %	20 %	✓ 0 %	40 %	✓ 0 %
Total	Total	159 487 856	9 775 283	6,53 %	6,95 %	-0,43 %	100 %	100,0 %	0,0 %	100 %	✓ 0 %	100 %	✓ 0 %



BJFK - Aktivklasser

Total

01.01.2023

30.04.2023

Resultat

9 775 283

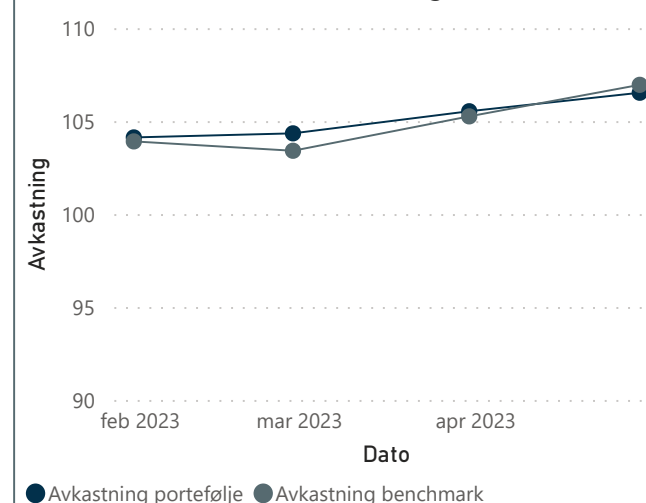
Avkastning mot benchmark



Historisk avkastning

2,31 %	2,93 %
Siste 3 måneder	3 Mnd benchmark
6,53 %	6,95 %
Siste 6 måneder	6 Mnd benchmark
6,53 %	6,95 %
Siste 12 Månedeer	12 Mnd Benchmark
3,21 %	3,42 %
Siste 2 år	2 år benchmark
2,13 %	2,27 %
Siste 3 år	3 år benchmark
1,27 %	1,35 %
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	0,94 %	1,61 %	-0,67 %	-1 056 702

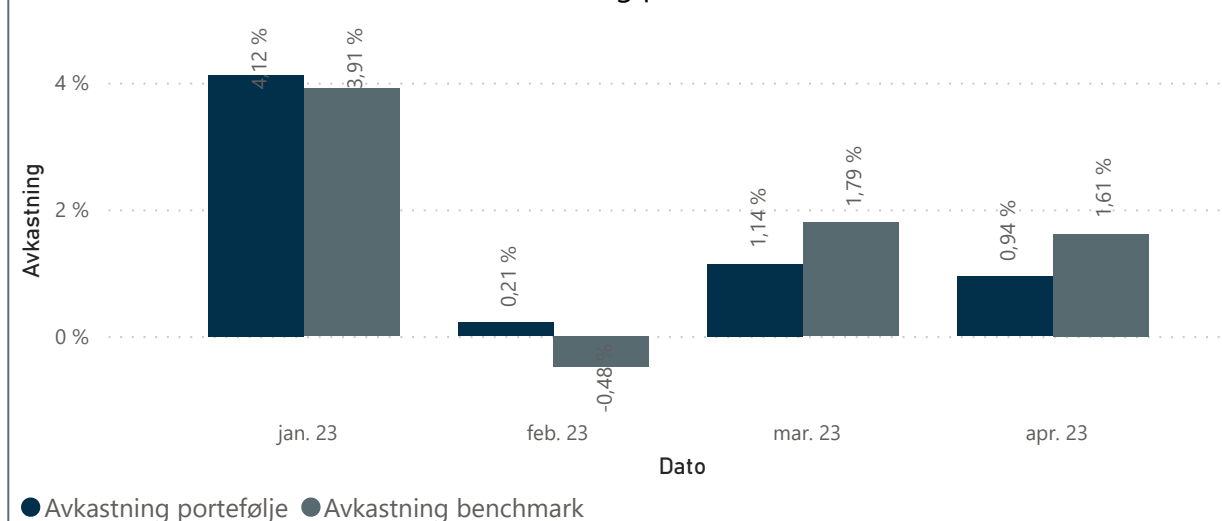
Akkumulert avkastning

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 %	389 424
apr. 23	6,53 %	6,95 %	-0,43 %	-667 278

Benchmark

BJFK - Sammensatt indeks Portefølje

Avkastning per måned



BJFK - Aktivklasser

Total

01.01.2023

30.04.2023

Beste måned

0,70 %

Gjennomsnitt

-0,10 %

Verste måned

-0,67 %

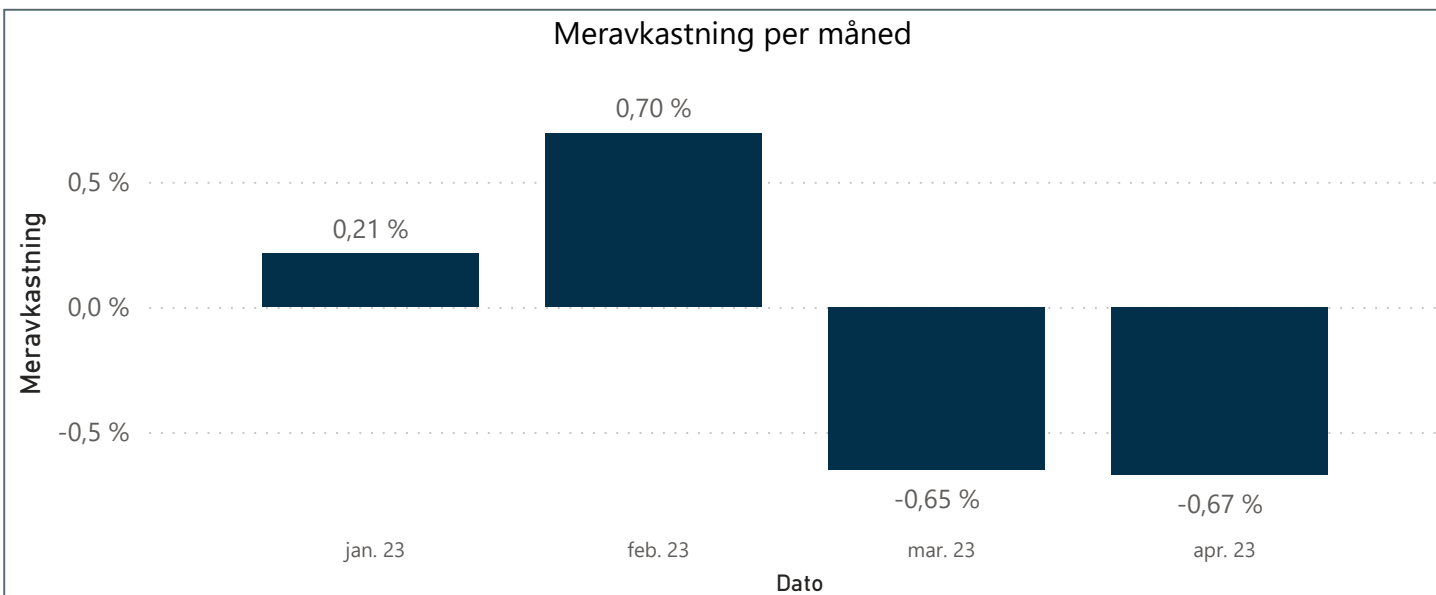
Median

-0,22 %

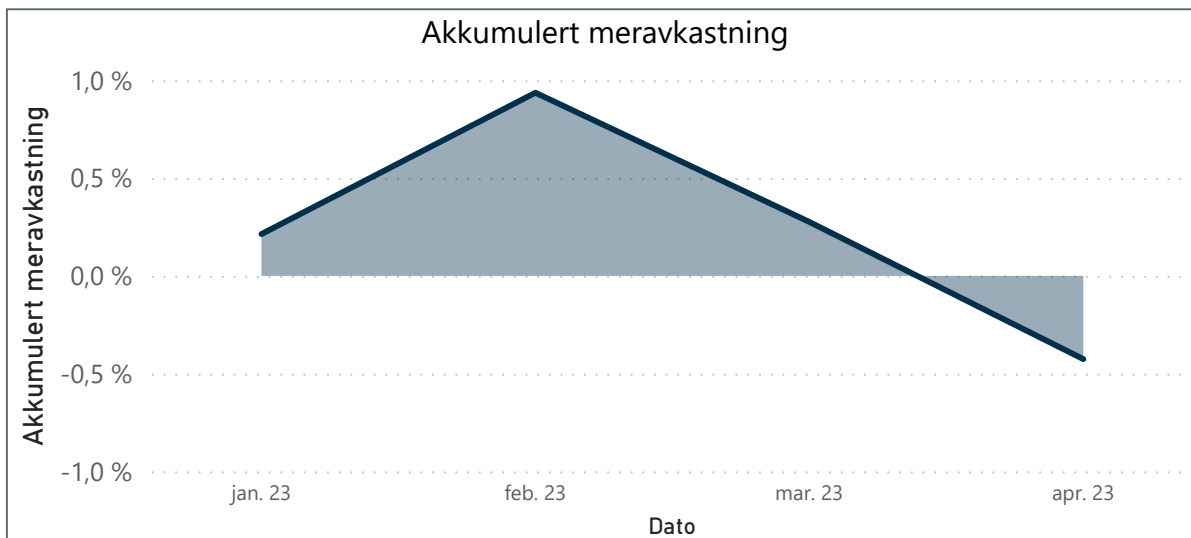
Benchmark

BJFK - Sammensatt indeks Portefølje

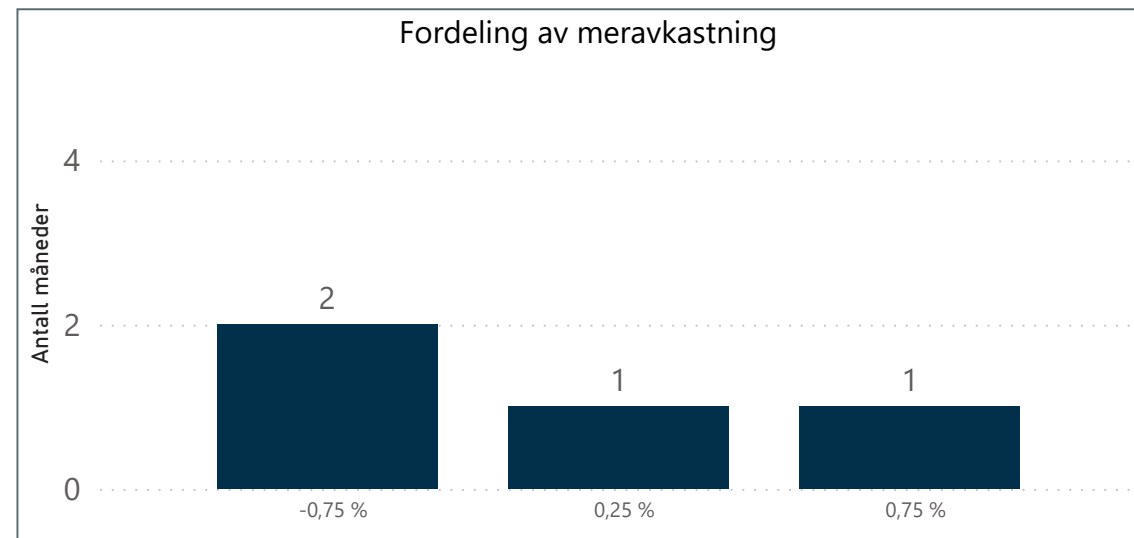
Meravkastning per måned



Akkumulert meravkastning



Fordeling av meravkastning



BJFK - Aktivklasser

Total

01.01.2023

30.04.2023

0,00

Information Ratio

0,00

SharpeRatio

0,00 %

Tracking Error

0,00 %

Alfa

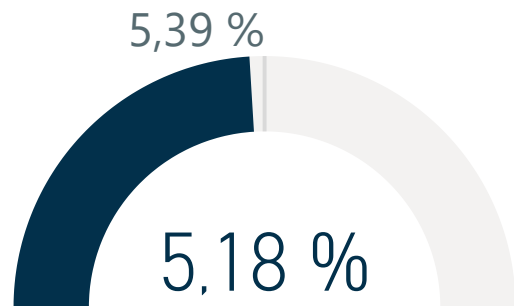
0,00

Beta

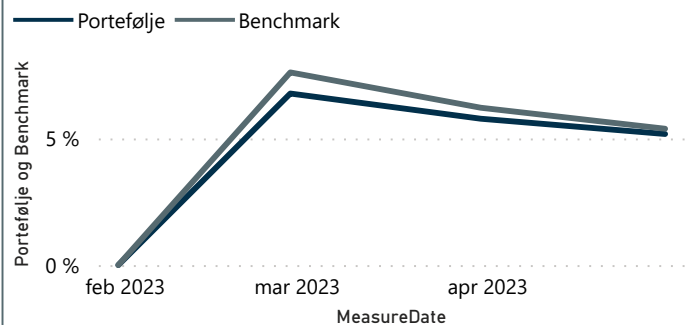
0,00

Determination

Standardavvik



Standardavvik



Kovarians



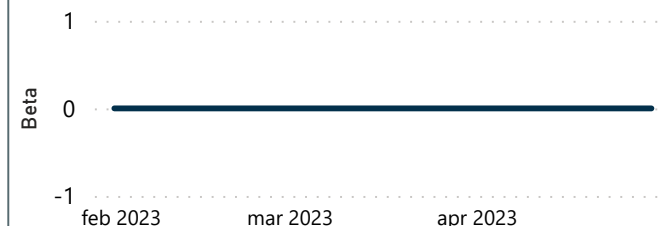
Alfa



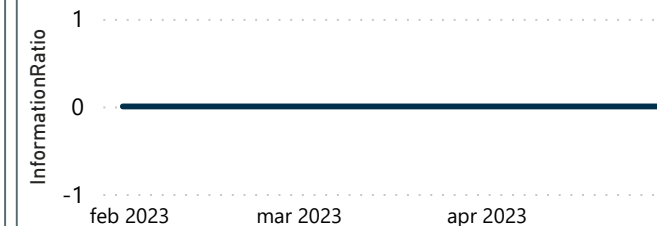
Tracking Error



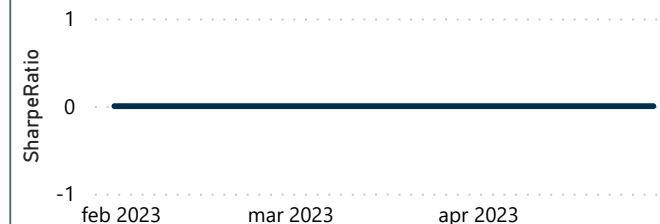
Beta



Information Ratio



Sharpe Ratio



Determination

