

01. januar 2018 - 31. juli 2022

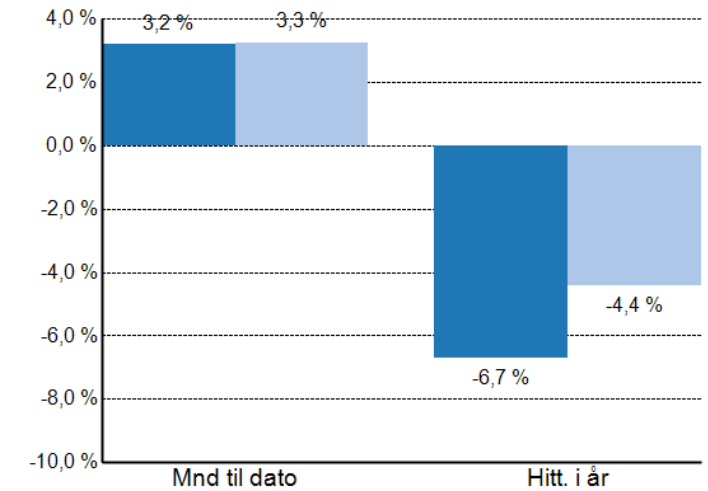
Porteføljerapport

Bjørnafjorden kommune

PERFORMIA.NXT
BY GABLER

Avkastning

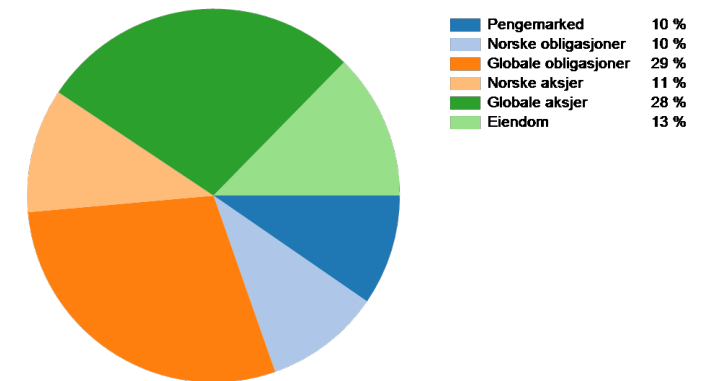
Beholdning	Mnd til dato				Hitt. i år			
	Portef. TNOK	Portef. %	Indeks %	Diff. %	Portef. TNOK	Portef. %	Indeks %	Diff. %
Pengemarked	18	0,1	0,1	0,0	51	0,3	0,4	0,0
Norske obligasjoner	160	1,0	1,0	0,1	-673	-4,2	-3,0	-1,2
Globale obligasjoner	1 189	2,7	2,4	0,3	-3 612	-7,7	-7,0	-0,7
Norske aksjer	1 038	6,7	7,3	-0,7	-557	-3,3	-1,4	-1,8
Globale aksjer	2 360	5,8	5,5	0,3	-6 959	-14,0	-7,2	-6,8
Eiendom	12	0,1	0,3	-0,2	690	3,7	1,7	1,9
Bjørnafjorden kommune	4 776	3,2	3,3	-0,1	-11 060	-6,7	-4,4	-2,3



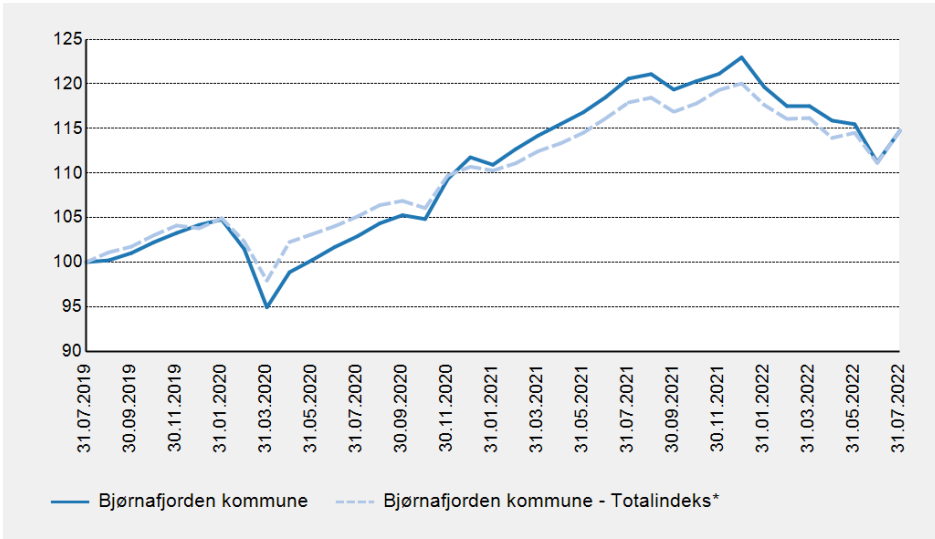
■ Bjørnafjorden kommune ■ Indeks

Allokering

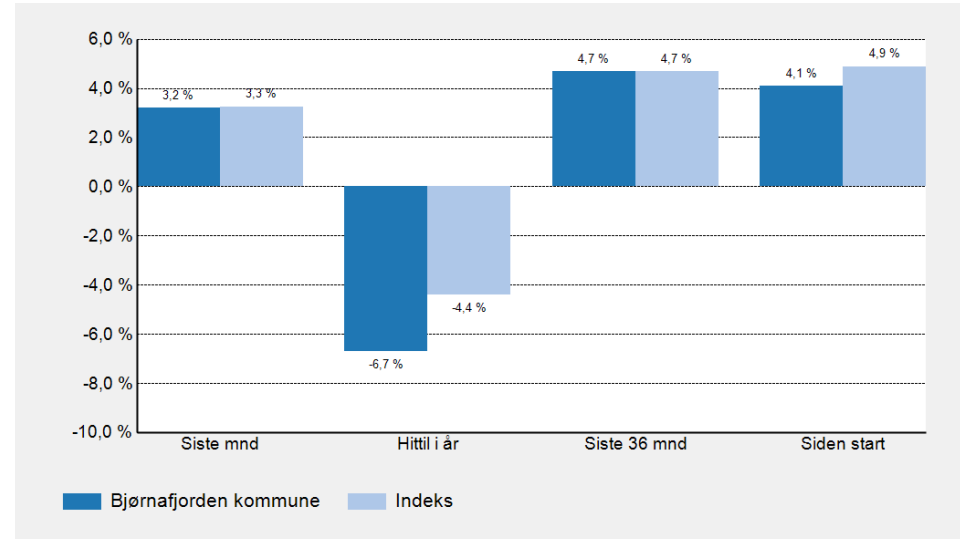
Beholdning	Verdi		Min %	Normal %	Maks %	Avvik %	Inspeksjon
	TNOK	%					
Pengemarked	14 745	9,6	5,0	10,0	30,0	-0,4	OK
Norske obligasjoner	15 442	10,0	5,0	10,0	30,0	0,0	OK
Globale obligasjoner	44 540	29,0	20,0	30,0	40,0	-1,0	OK
Norske aksjer	16 546	10,8	5,0	10,0	30,0	0,8	OK
Globale aksjer	43 087	28,0	20,0	30,0	40,0	-2,0	OK
Eiendom	19 448	12,6	0,0	10,0	20,0	2,6	OK
Bjørnafjorden kommune	153 807	100,0					



Indeksert avkastning siste 36 måneder



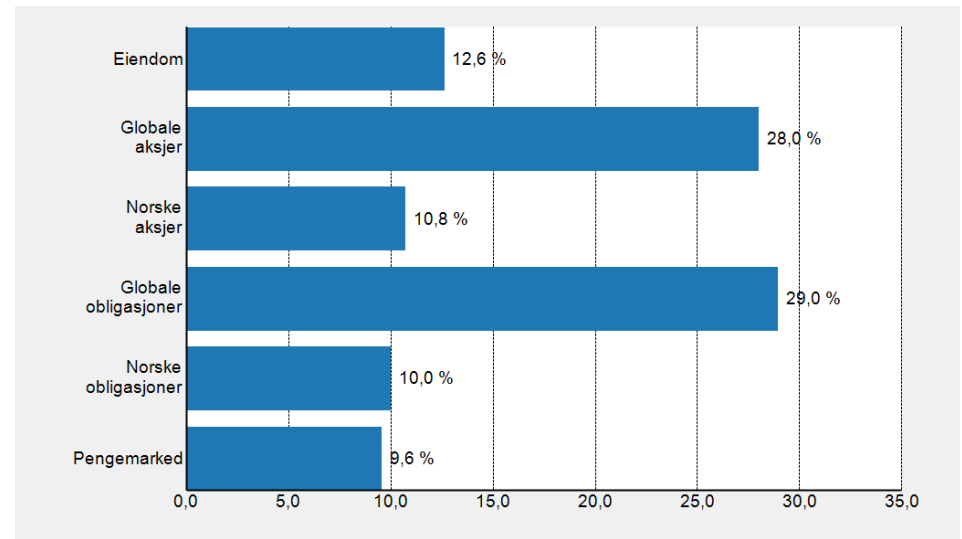
Avkastning



Verdiutvikling, TNOK

	Siste mnd	Hittil i år	Siste 36 mnd	Siden start
Inngående beholdning	149 176,9	165 310,8	222 946,3	212 821,4
Innskudd/uttak	-146,5	-444,4	-94 758,6	118 062,9
Gev/tap	4 776,4	-11 059,6	25 619,1	35 743,9
Utgående beholdning	153 806,8	153 806,8	153 806,8	153 806,8

Porteføljevekter



Beholdning	Markedsverdi, TNOK				% av portefølje				
	31.07.2022	31.12.2021	Inn/ut	Avkastning	31.07.2022	Min	Normal	Maks	Avvik
Handelskonto DNB	180	144	35	0	0,1				
Holberg Likviditet	14 565	14 600	-86	51	9,5				
Pengemarked	14 745	14 744	-51	51	9,6	5,0	10,0	30,0	-0,4
Danske Inv Norsk Obl. Inst.	15 442	16 115	0	-673	10,0				
DNB Obligasjon E	n.a	0	0	0	0,0				
Norske obligasjoner	15 442	16 115	0	-673	10,0	5,0	10,0	30,0	0,0
AMUNDI Global Agg 500 Index	8 318	n.a	8 348	-30	5,4				
AQR Global Aggregate	n.a	8 866	-8 348	-518	0,0				
BlueBay IG Global Agg	12 897	14 047	0	-1 150	8,4				
PIMCO Global Bond Fund ESG	12 998	14 075	0	-1 077	8,5				
PIMCO Income Fund	10 326	11 164	0	-837	6,7				
Globale obligasjoner	44 540	48 152	0	-3 612	29,0	20,0	30,0	40,0	-1,0
Arctic Norw. Value Creation	10 995	11 422	0	-427	7,1				
Danske Inv No. Aksjer Inst. II	5 551	5 681	0	-129	3,6				
Norske aksjer	16 546	17 103	0	-557	10,8	5,0	10,0	30,0	0,8
AKO Global L/O D1 USD	12 549	14 389	0	-1 840	8,2				
Ardevora Global Equity SRI	14 581	16 958	0	-2 377	9,5				
Danske Inv World Indeks H2N	8 151	n.a	8 900	-749	5,3				
KLP AksjeGlobal Indeks Valutasikret S	n.a	9 609	-9 258	-351	0,0				
Lansdowne Dev. Mkt L/O SRI	7 806	9 448	0	-1 642	5,1				
Globale aksjer	43 087	50 404	-358	-6 959	28,0	20,0	30,0	40,0	-2,0
DEAS Eiendomsfond Norge I	19 316	18 670	-45	690	12,6				
Reinvestering DEAS	132	123	9	0	0,1				
Eiendom	19 448	18 793	-35	690	12,6	0,0	10,0	20,0	2,6
Total (Bjørnafjorden kommune)	153 807	165 311	-444	-11 060	100,0				

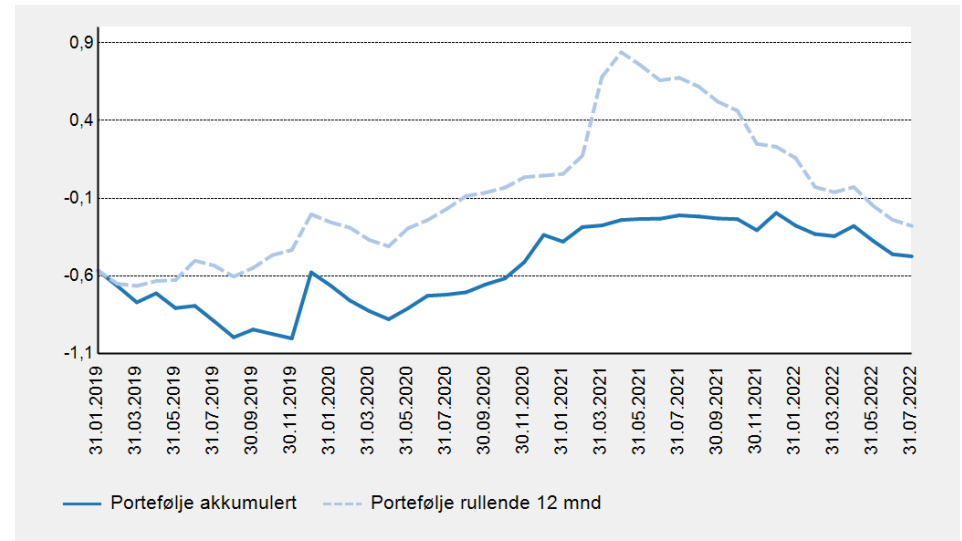
Beholdning	Avkastning, mnd. til dato, %			Avkastning, hitt. i år, %			Avkastning, siden start, %			
	Portef.	Ind.	Diff.	Portef.	Ind.	Diff.	Portef.	Ind.	Diff.	Start
Handelskonto DNB	n.a	n.a	n.a	n.a	n.a	n.a	n.a	n.a	n.a	01.01.2018
Holberg Likviditet	0,1	0,1	0,0	0,4	0,4	0,1	1,1	0,4	0,7	07.02.2020
Pengemarked	0,1	0,1	0,0	0,3	0,4	0,0	1,3	0,6	0,7	01.01.2018
Danske Inv Norsk Obl. Inst.	1,0	1,0	0,1	-4,2	-3,0	-1,2	-4,1	-2,8	-1,3	20.10.2021
Norske obligasjoner	1,0	1,0	0,1	-4,2	-3,0	-1,2	1,0	0,3	0,8	01.01.2018
AMUNDI Global Agg 500 Index	2,7	2,4	0,2	-0,4	-0,5	0,1	-0,4	-0,5	0,1	11.04.2022
BlueBay IG Global Agg	2,6	2,4	0,2	-8,2	-7,0	-1,2	1,8	1,1	0,7	26.06.2018
PIMCO Global Bond Fund ESG	2,6	2,4	0,2	-7,6	-7,0	-0,7	1,1	1,1	-0,1	26.06.2018
PIMCO Income Fund	3,1	2,4	0,7	-7,5	-7,0	-0,5	-0,6	-1,9	1,3	06.02.2020
Globale obligasjoner	2,7	2,4	0,3	-7,7	-7,0	-0,7	1,0	0,8	0,2	01.01.2018
Arctic Norw. Value Creation	7,2	7,3	-0,2	-3,7	-1,4	-2,3	11,5	10,1	1,3	06.04.2018
Danske Inv No. Aksjer Inst. II	5,7	7,3	-1,6	-2,3	-1,4	-0,9	8,6	8,3	0,3	20.06.2018
Norske aksjer	6,7	7,3	-0,7	-3,3	-1,4	-1,8	9,4	9,2	0,2	01.01.2018
AKO Global L/O D1 USD	6,5	5,0	1,5	-12,8	-5,9	-6,9	9,7	11,3	-1,5	23.09.2020
Ardevora Global Equity SRI	4,9	5,0	0,0	-14,0	-5,9	-8,2	9,9	11,8	-1,9	06.06.2018
Danske Inv World Indeks H2N	7,9	7,8	0,1	-8,4	-7,9	-0,6	-8,4	-7,9	-0,6	04.02.2022
Lansdowne Dev. Mkt L/O SRI	4,2	5,9	-1,7	-17,4	-5,4	-12,0	1,5	13,1	-11,6	31.05.2018
Globale aksjer	5,8	5,5	0,3	-14,0	-7,2	-6,8	6,6	10,4	-3,8	01.01.2018
DEAS Eiendomsfond Norge I	0,1	0,1	0,0	3,7	3,7	0,0	9,1	9,1	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	0,1	0,3	-0,2	3,7	1,7	1,9	8,5	3,5	5,0	01.01.2018
Total (Bjørnafjorden kommune)	3,2	3,3	-0,1	-6,7	-4,4	-2,3	4,1	4,9	-0,8	01.01.2018

Beholdning	% av portf.	Avkastn., mnd. til dato, %			Avkastn., hitt. i år, %			Markedsverdi MNOK				
	31.07.2022	Portef.	Indeks	Diff.	Portef.	Indeks	Diff.	31.07.2022	30.06.2022	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	9,5	0,1	0,1	0,0	0,4	0,4	0,1	14,6	14,7	-0,1	0,0	07.02.2020
Pengemarked	9,6	0,1	0,1	0,0	0,3	0,4	0,0	14,7	14,9	-0,1	0,0	01.01.2018
Danske Inv Norsk Obl. Inst.	10,0	1,0	1,0	0,1	-4,2	-3,0	-1,2	15,4	15,3	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	10,0	1,0	1,0	0,1	-4,2	-3,0	-1,2	15,4	15,3	0,0	0,2	01.01.2018
AMUNDI Global Agg 500 Index	5,4	2,7	2,4	0,2	-0,4	-0,5	0,1	8,3	8,1	0,0	0,2	11.04.2022
AQR Global Aggregate	0,0	n.a	n.a	n.a	-5,8	-5,5	-0,4	0,0	0,0	0,0	0,0	03.07.2018
BlueBay IG Global Agg	8,4	2,6	2,4	0,2	-8,2	-7,0	-1,2	12,9	12,6	0,0	0,3	26.06.2018
PIMCO Global Bond Fund ESG	8,5	2,6	2,4	0,2	-7,6	-7,0	-0,7	13,0	12,7	0,0	0,3	26.06.2018
PIMCO Income Fund	6,7	3,1	2,4	0,7	-7,5	-7,0	-0,5	10,3	10,0	0,0	0,3	06.02.2020
Globale obligasjoner	29,0	2,7	2,4	0,3	-7,7	-7,0	-0,7	44,5	43,4	0,0	1,2	01.01.2018
Arctic Norw. Value Creation	7,1	7,2	7,3	-0,2	-3,7	-1,4	-2,3	11,0	10,3	0,0	0,7	06.04.2018
Danske Inv No. Aksjer Inst. II	3,6	5,7	7,3	-1,6	-2,3	-1,4	-0,9	5,6	5,2	0,0	0,3	20.06.2018
Norske aksjer	10,8	6,7	7,3	-0,7	-3,3	-1,4	-1,8	16,5	15,5	0,0	1,0	01.01.2018
AKO Global L/O D1 USD	8,2	6,5	5,0	1,5	-12,8	-5,9	-6,9	12,5	11,8	0,0	0,8	23.09.2020
Ardevora Global Equity SRI	9,5	4,9	5,0	0,0	-14,0	-5,9	-8,2	14,6	13,9	0,0	0,7	06.06.2018
Danske Inv World Indeks H2N	5,3	7,9	7,8	0,1	-8,4	-7,9	-0,6	8,2	7,6	0,0	0,6	04.02.2022
KLP AksjeGlobal Indeks Valutasikret S	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	5,1	4,2	5,9	-1,7	-17,4	-5,4	-12,0	7,8	7,5	0,0	0,3	31.05.2018
Globale aksjer	28,0	5,8	5,5	0,3	-14,0	-7,2	-6,8	43,1	40,7	0,0	2,4	01.01.2018
DEAS Eiendomsfond Norge I	12,6	0,1	0,1	0,0	3,7	3,7	0,0	19,3	19,3	0,0	0,0	01.01.2018
Reinvestering DEAS	0,1	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,1	0,1	0,0	0,0	31.03.2019
Eiendom	12,6	0,1	0,3	-0,2	3,7	1,7	1,9	19,4	19,4	0,0	0,0	01.01.2018
Total (Bjørnafjorden kommune)	100,0	3,2	3,3	-0,1	-6,7	-4,4	-2,3	153,8	149,2	-0,1	4,8	01.01.2018

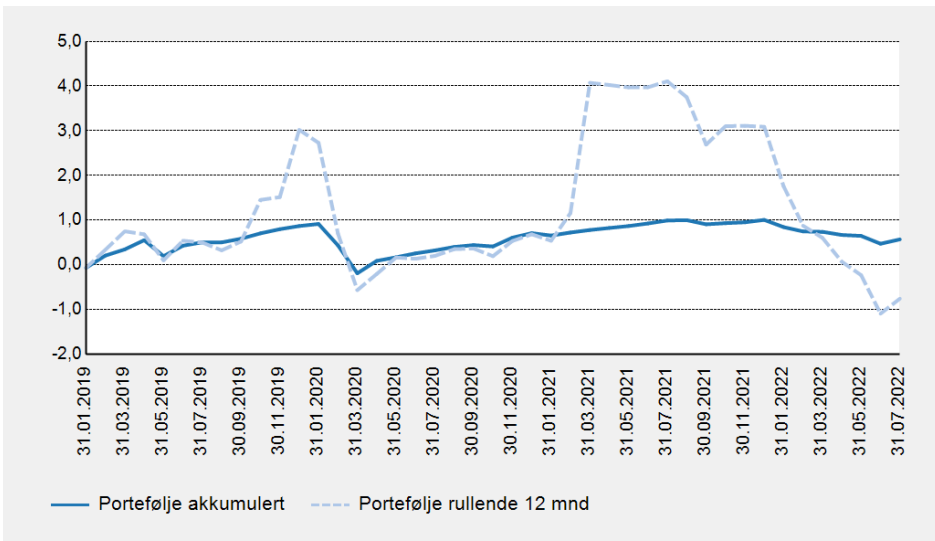
Nøkkeltall i perioden

Markedsverdi (TNOK)	153 807	Beta	1,13
Avkastning - portefølje	4,1 %	Forklaringsgrad (R2)	0,92
Avkastning - indeks	4,9 %	Tracking Error	2,0 %
Differanse	-0,8 %	Info kvot	-0,48
Standardavvik - portefølje	6,5 %	Sharpe Ratio	0,56
Standardavvik - indeks	5,5 %	Konsistens	40,7 %
		Max drawdown	-14,9 %
		Recovery time	235

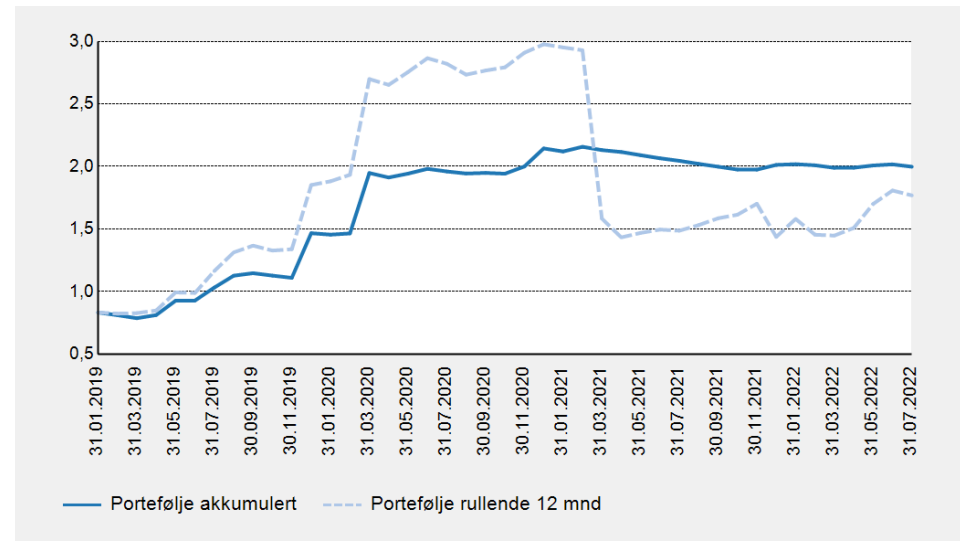
Trendanalyse - Informationskvot



Trendanalyse - Sharpe Ratio



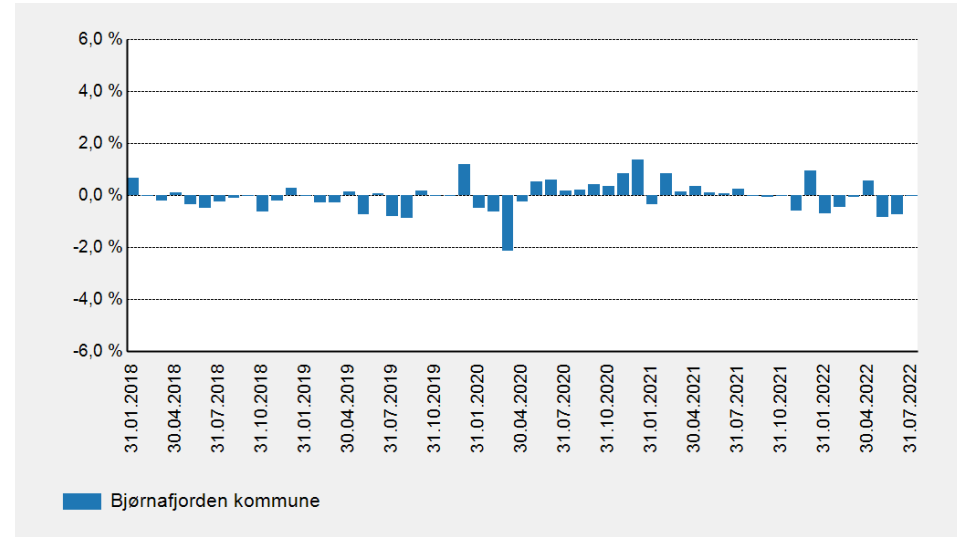
Trendanalyse - Tracking Error



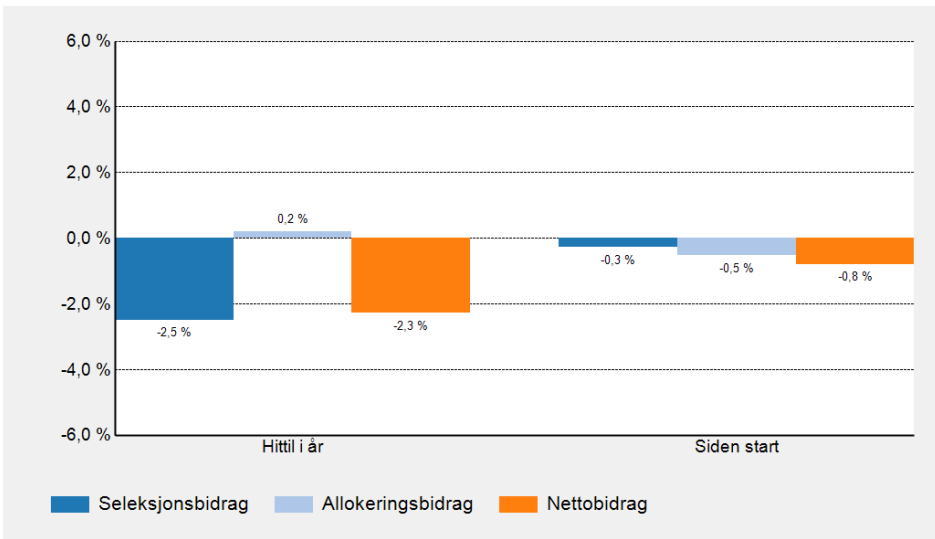
Avkastning

	2022	2021	2020	2019	2018	2017
MV (TNOK)	153 807	165 311	162 812	232 251	208 572	n.a
Portef.	-6,7 %	10,0 %	7,3 %	11,4 %	-2,0 %	n.a
Indeks	-4,4 %	8,4 %	6,6 %	13,2 %	-0,6 %	n.a
Differanse	-2,3 %	1,6 %	0,6 %	-1,9 %	-1,4 %	n.a
Avkastning	1 mnd	3 mnd	6 mnd	1 år	3 år	5 år
Portef.	3,2 %	-1,0 %	-4,1 %	-4,8 %	4,7 %	n.a
Indeks	3,3 %	0,7 %	-2,5 %	-2,7 %	4,7 %	n.a
Differanse	-0,1 %	-1,7 %	-1,6 %	-2,2 %	0,0 %	n.a

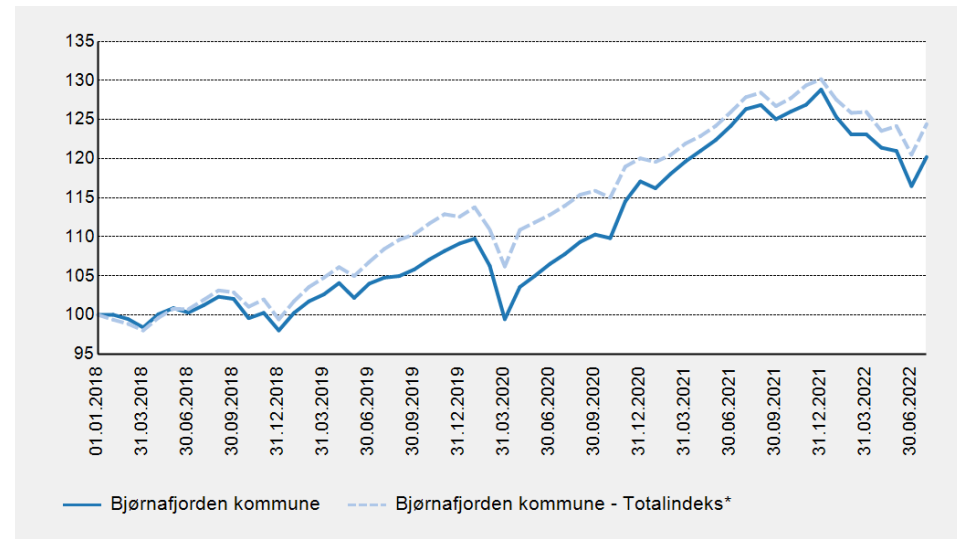
Differanseavkastning



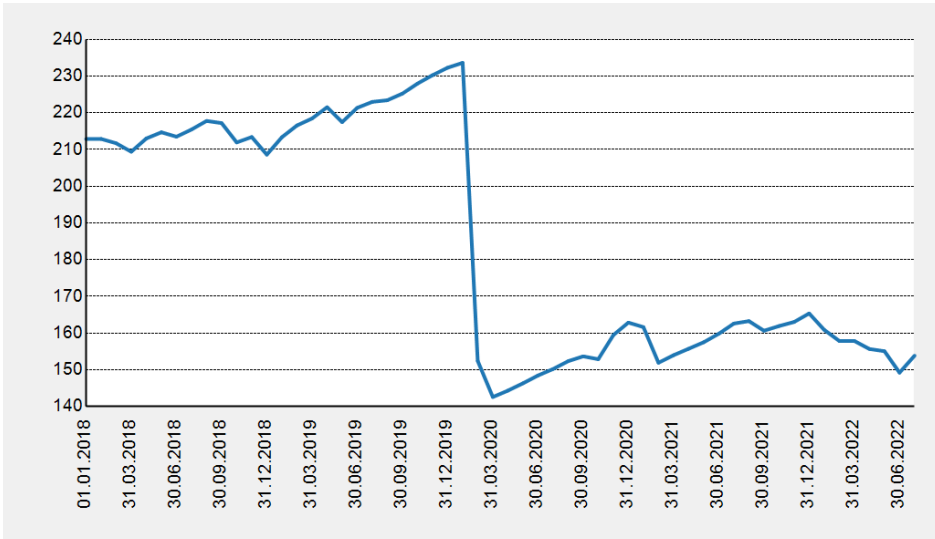
Forklaring til porteføljeresultat



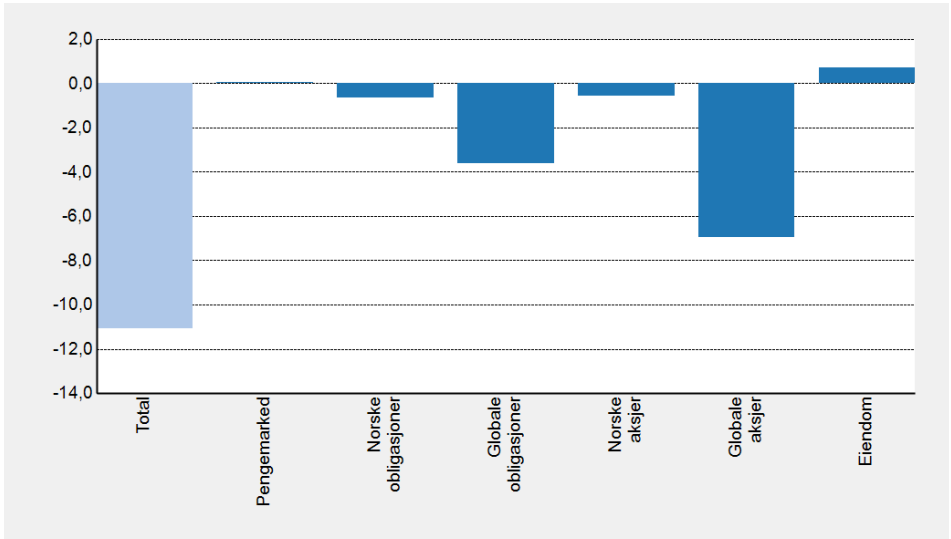
Indeksert avkastning siden start



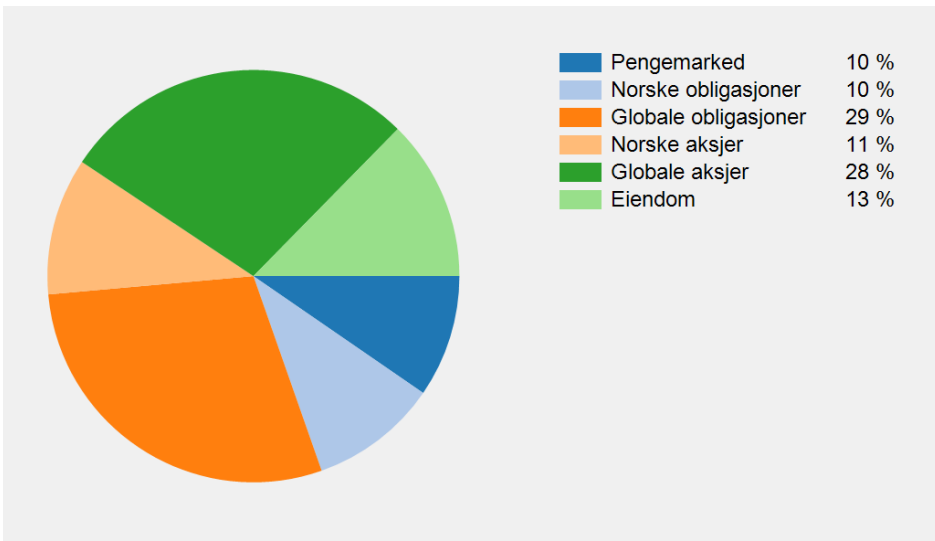
Verdiutvikling, MNOK



Porteføljeavkastning, hittil i år, MNOK



Allokering



Avkastning i beløp per aggregat

	Hittil i år	2021	Siden start
Total	-11 059 648	15 278 860	35 743 874
Pengemarked	50 948	103 686	2 181 498
Norske obligasjoner	-672 798	30 689	1 833 114
Globale obligasjoner	-3 612 051	-313 270	881 315
Norske aksjer	-556 786	4 186 684	8 415 883
Globale aksjer	-6 959 152	9 176 127	15 539 167
Eiendom	690 191	2 094 945	6 892 898