

Bjørnafjorden kommune

PORTEFØLJERAPPORT - risikoreport

Periode: 1. januar 2024 - 31. juli 2024

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

Alle

01.01.2024

31.07.2024

Sluttverdi

177,6 mill.

Resultat

13,5 mill.

Avvik budsjett

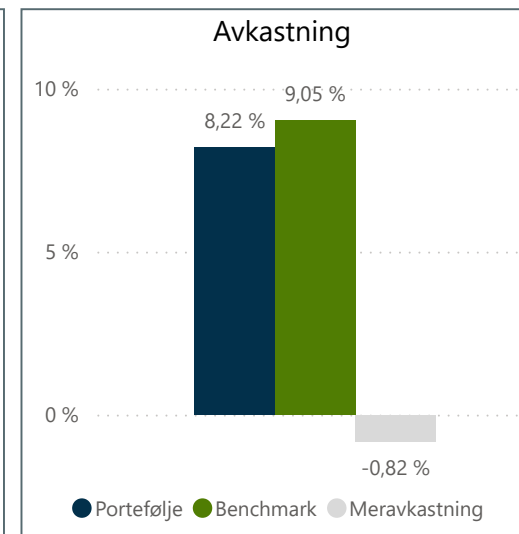
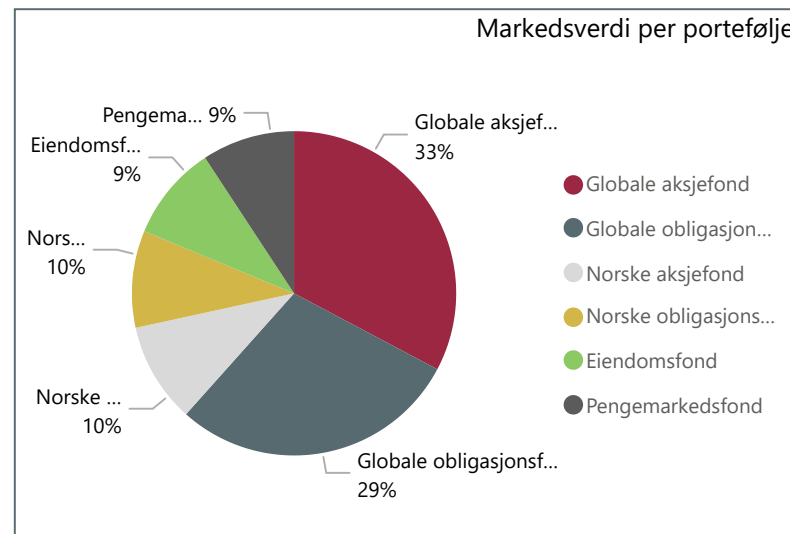
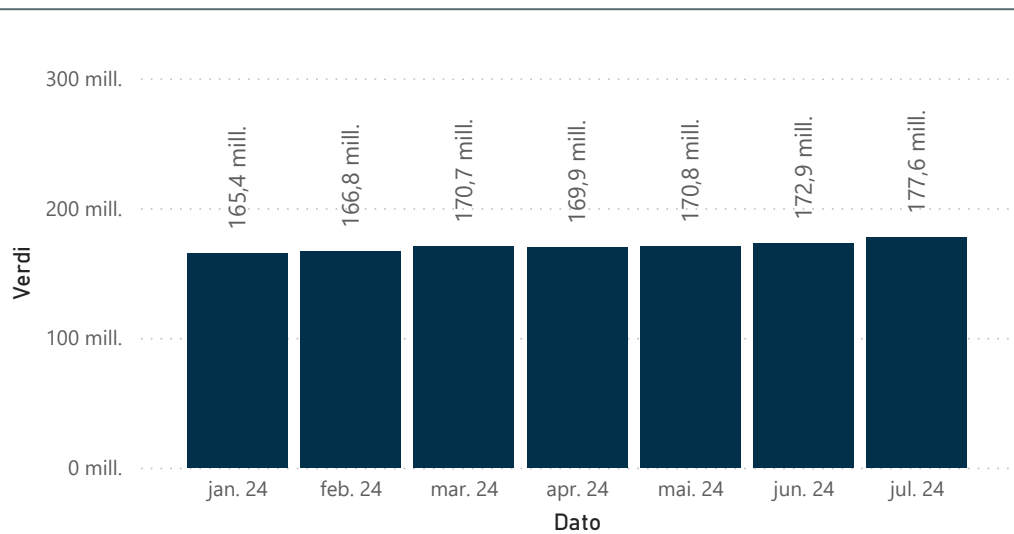
13,5 mill.

Avkastning mot benchmark



Sammendrag

ID	Beskrivelse	Sluttverdi	Resultat	Avkastning	Benchmark	Meravk. %	Strategisk vekt	Faktisk andel	Avvik	Min	Min_avvik	Maks	Maks_avvik
BJFK1	Pengemarkedsfond	16 418 779	561 331	3,55 %	2,53 %	1,02 %	10 %	9,2 %	-0,8 %	5 %	✓ 0 %	30 %	✓ 0 %
BJFK2	Norske obligasjonsfond	17 179 993	490 071	2,94 %	2,39 %	0,55 %	10 %	9,7 %	-0,3 %	5 %	✓ 0 %	30 %	✓ 0 %
BJFK3	Globale obligasjonsfond	51 224 228	1 307 309	2,62 %	1,49 %	1,13 %	30 %	28,8 %	-1,2 %	20 %	✓ 0 %	40 %	✓ 0 %
BJFK4	Eiendomsfond	16 855 185	366 582	2,19 %	4,33 %	-2,14 %	10 %	9,5 %	-0,5 %	0 %	✓ 0 %	20 %	✓ 0 %
BJFK5	Norske aksjefond	17 724 048	1 839 356	11,57 %	13,81 %	-2,24 %	10 %	10,0 %	-0,0 %	5 %	✓ 0 %	30 %	✓ 0 %
BJFK6	Globale aksjefond	58 159 427	8 924 335	18,13 %	20,15 %	-2,03 %	30 %	32,8 %	2,8 %	20 %	✓ 0 %	40 %	✓ 0 %
Total	Total	177 561 660	13 488 984	8,22 %	9,05 %	-0,82 %	100 %	100,0 %	0,0 %	100 %	✓ 0 %	100 %	✓ 0 %



BJFK - Aktivklasser

Total

01.01.2023

31.07.2024

Resultat

27 849 086

Avkastning mot benchmark

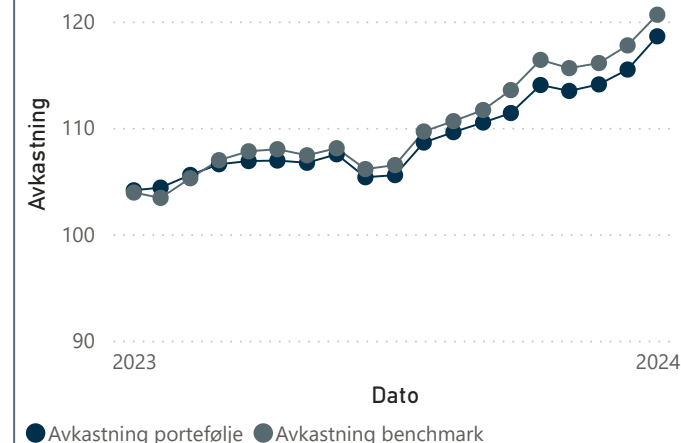
20,63 %



Historisk avkastning

4,53 %	4,35 %
Siste 3 måneder	3 Mnd benchmark
7,34 %	8,02 %
Siste 6 måneder	6 Mnd benchmark
11,14 %	12,31 %
Siste 12 Månedeer	12 Mnd Benchmark
8,90 %	9,83 %
Siste 2 år	2 år benchmark
5,85 %	6,45 %
Siste 3 år	3 år benchmark
3,47 %	3,82 %
Siste 5 år	5 år benchmark

Verdiutvikling



Avkastning per måned

Dato	Faktisk	Benchmark	Meravk. %	Meravkastning
jan. 23	4,12 %	3,91 %	0,21 %	320 393
feb. 23	0,24 %	-0,48 %	0,73 %	1 130 515
mar. 23	1,14 %	1,79 %	-0,65 %	-1 015 157
apr. 23	0,95 %	1,61 %	-0,66 %	-1 040 423
mai. 23	0,28 %	0,78 %	-0,50 %	-805 037
jun. 23	0,05 %	0,18 %	-0,14 %	-216 507
jul. 23	-0,20 %	-0,53 %	0,33 %	533 864
aug. 23	0,75 %	0,62 %	0,13 %	205 278
sep. 23	-2,01 %	-1,82 %	-0,19 %	-311 006
okt. 23	0,19 %	0,35 %	-0,16 %	-254 095
nov. 23	2,90 %	2,97 %	-0,07 %	-106 880
des. 23	0,90 %	0,89 %	0,01 %	23 122
jan. 24	0,83 %	0,95 %	-0,12 %	-200 750
feb. 24	0,81 %	1,68 %	-0,87 %	-1 435 858
mar. 24	2,36 %	2,50 %	-0,14 %	-230 002
apr. 24	-0,49 %	-0,67 %	0,18 %	310 902
mai. 24	0,54 %	0,42 %	0,12 %	210 010
jun. 24	1,22 %	1,43 %	-0,21 %	-350 835
jul. 24	2,71 %	2,45 %	0,26 %	444 345

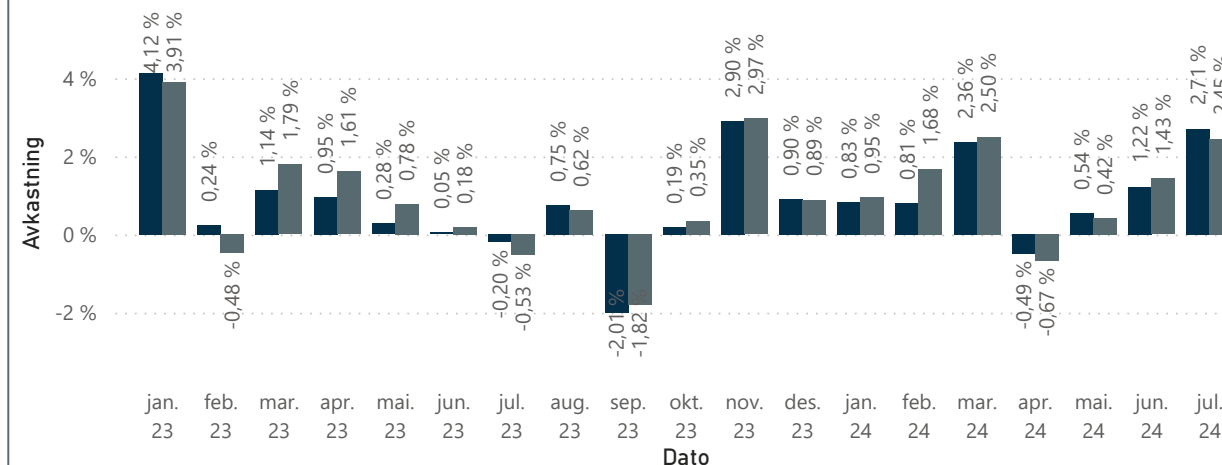
Akkumulert avkastning

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

Benchmark

BJFK - Sammensatt indeks Portefølje

Avkastning per måned



● Avkastning portefølje ● Avkastning benchmark

BJFK - Aktivaklasser

Total

01.01.2023

31.07.2024

Beste måned

0,73 %

Gjennomsnitt

-0,09 %

Verste måned

-0,87 %

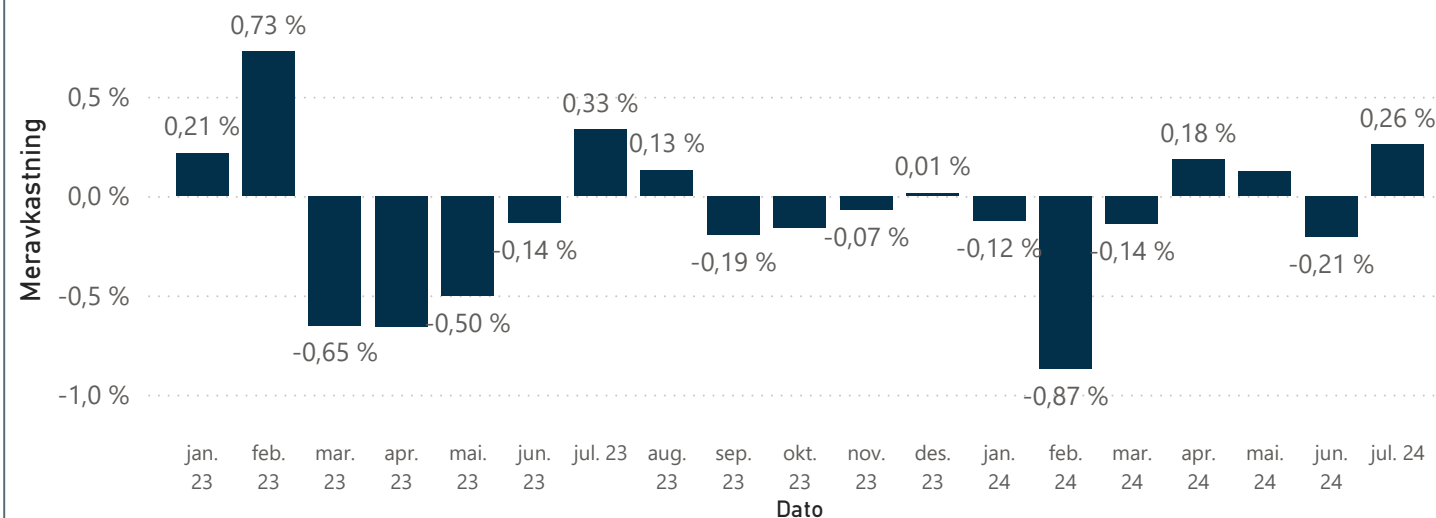
Median

-0,12 %

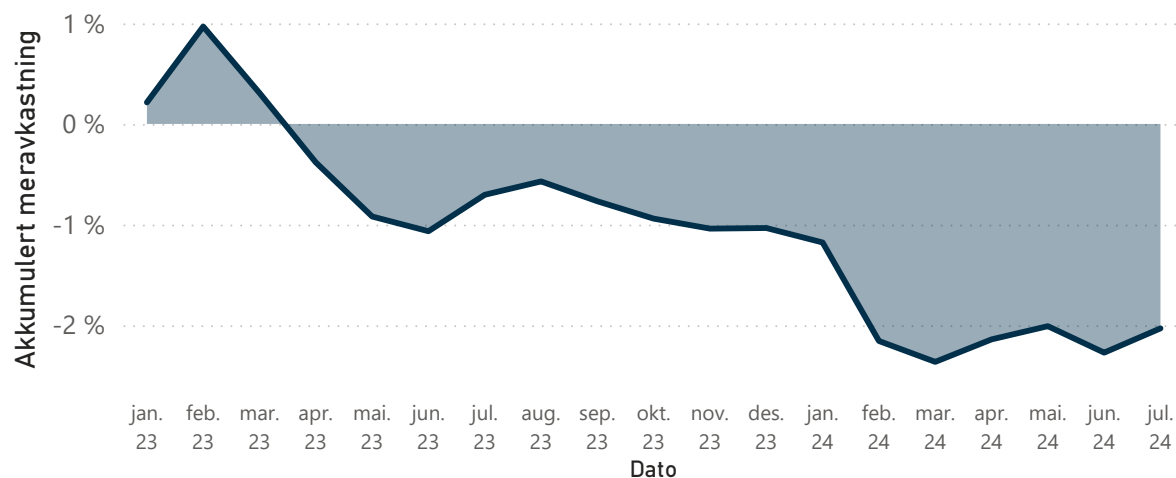
Benchmark

BJFK - Sammensatt indeks Portefølje

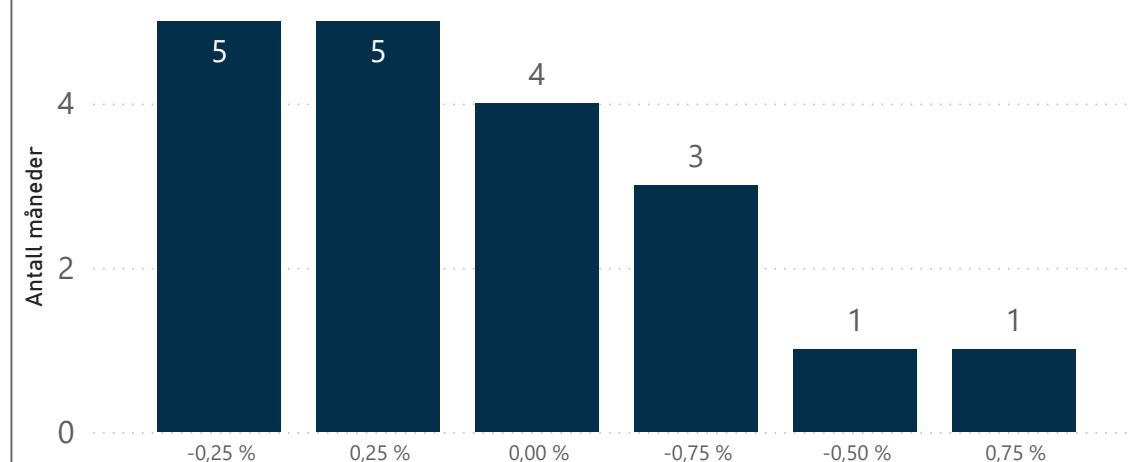
Meravkastning per måned



Akkumulert meravkastning



Fordeling av meravkastning



BJFK - Aktivklasser

Total

01.01.2023

31.07.2024

-0,84
Information Ratio

1,57
SharpeRatio

1,30 %
Tracking Error

-0,60 %
Alfa

0,94
Beta

0,92
Determination

