

# Bjørnafjorden kommune

PORTEFØLJERAPPORT - risikorapport

Periode: 1. januar 2025 - 30. april 2025

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

Sluttverdi

181,3 mill.

Resultat

-1,2 mill.

Avvik budsjett

-1,2 mill.

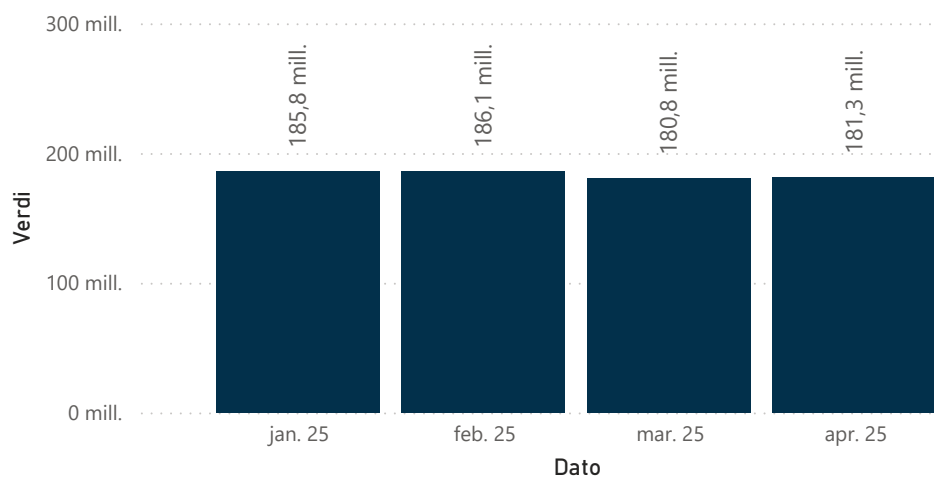
Avkastning mot benchmark

-0,95 %

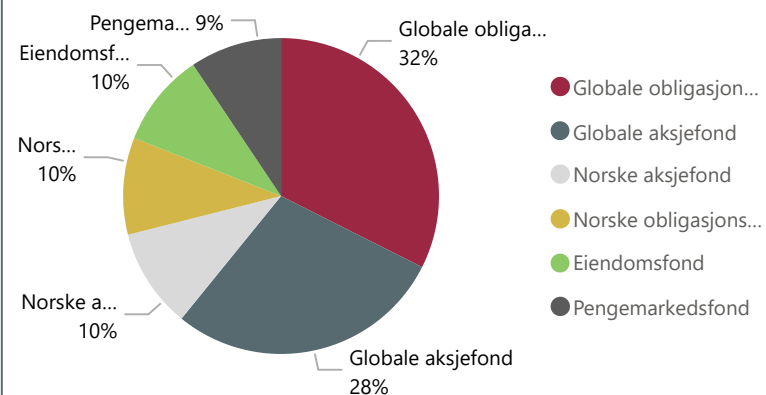
-0,67 %

### Sammendrag

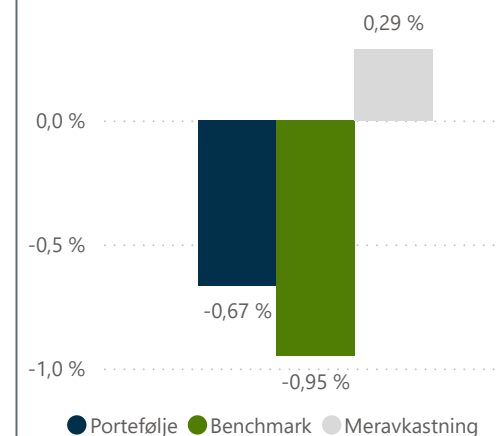
| ID    | Beskrivelse             | Sluttverdi  | Resultat   | Avkastning | Benchmark | Meravk. % | Strategisk vekt | Faktisk andel | Avvik  | Min   | Min_avvik | Maks  | Maks_avvik |
|-------|-------------------------|-------------|------------|------------|-----------|-----------|-----------------|---------------|--------|-------|-----------|-------|------------|
| BJFK1 | Pengemarkedsfond        | 17 033 732  | 267 940    | 1,61 %     | 1,45 %    | 0,16 %    | 10 %            | 9,4 %         | -0,6 % | 5 %   | ✓ 0 %     | 30 %  | ✓ 0 %      |
| BJFK2 | Norske obligasjonsfond  | 17 983 548  | 435 697    | 2,48 %     | 2,14 %    | 0,34 %    | 10 %            | 9,9 %         | -0,1 % | 5 %   | ✓ 0 %     | 30 %  | ✓ 0 %      |
| BJFK3 | Globale obligasjonsfond | 58 785 652  | 1 426 473  | 2,49 %     | 2,21 %    | 0,27 %    | 30 %            | 32,4 %        | 2,4 %  | 20 %  | ✓ 0 %     | 40 %  | ✓ 0 %      |
| BJFK4 | Eiendomsfond            | 17 447 228  | 413 917    | 2,40 %     | 2,47 %    | -0,07 %   | 10 %            | 9,6 %         | -0,4 % | 0 %   | ✓ 0 %     | 20 %  | ✓ 0 %      |
| BJFK5 | Norske aksjefond        | 18 502 486  | 902 108    | 5,16 %     | 4,88 %    | 0,28 %    | 10 %            | 10,2 %        | 0,2 %  | 5 %   | ✓ 0 %     | 30 %  | ✓ 0 %      |
| BJFK6 | Globale aksjefond       | 51 542 564  | -4 661 268 | -8,29 %    | -9,02 %   | 0,72 %    | 30 %            | 28,4 %        | -1,6 % | 20 %  | ✓ 0 %     | 40 %  | ✓ 0 %      |
| Total | Total                   | 181 295 209 | -1 215 134 | -0,67 %    | -0,95 %   | 0,28 %    | 100 %           | 100,0 %       | 0,0 %  | 100 % | ✓ 0 %     | 100 % | ✓ 0 %      |



### Markedsverdi per portefølje



### Avkastning



BJFK - Aktivaklasser

Total

01.01.2023

30.04.2025

Resultat

31 582 980

Avkastning mot benchmark



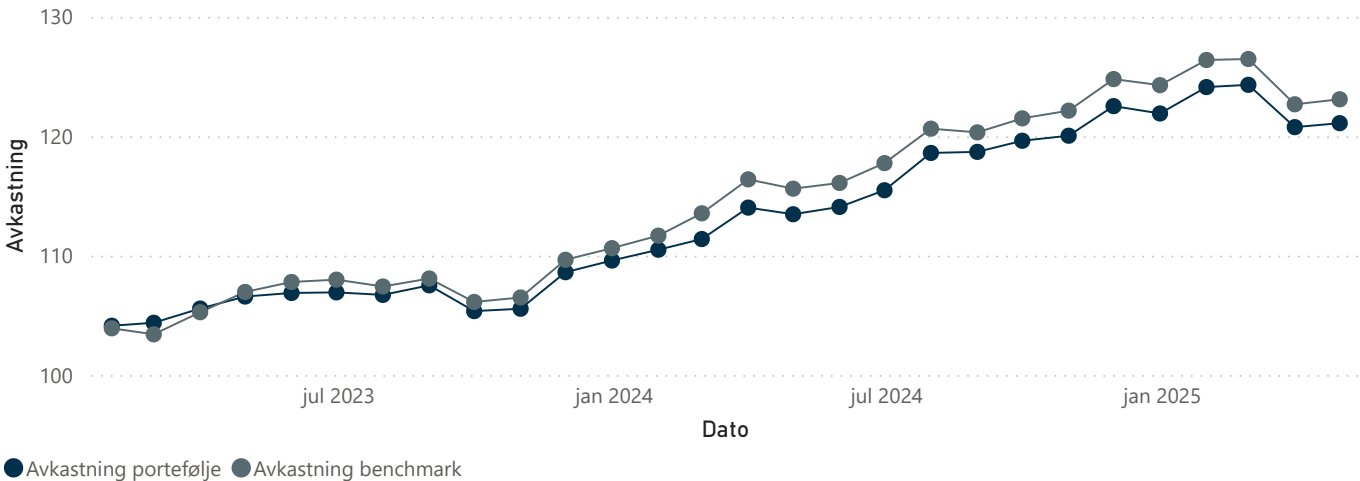
Benchmark

BJFK - Sammensatt indeks Portefølje

Historisk avkastning

|                   |                  |
|-------------------|------------------|
| -2,44 %           | -2,60 %          |
| Siste 3 måneder   | 3 Mnd benchmark  |
| 0,88 %            | 0,78 %           |
| Siste 6 måneder   | 6 Mnd benchmark  |
| 6,72 %            | 6,48 %           |
| Siste 12 Månedeer | 12 Mnd Benchmark |
| 6,60 %            | 7,28 %           |
| Siste 2 år        | 2 år benchmark   |
| 6,59 %            | 7,17 %           |
| Siste 3 år        | 3 år benchmark   |
| 3,90 %            | 4,24 %           |
| Siste 5 år        | 5 år benchmark   |

Verdiutvikling



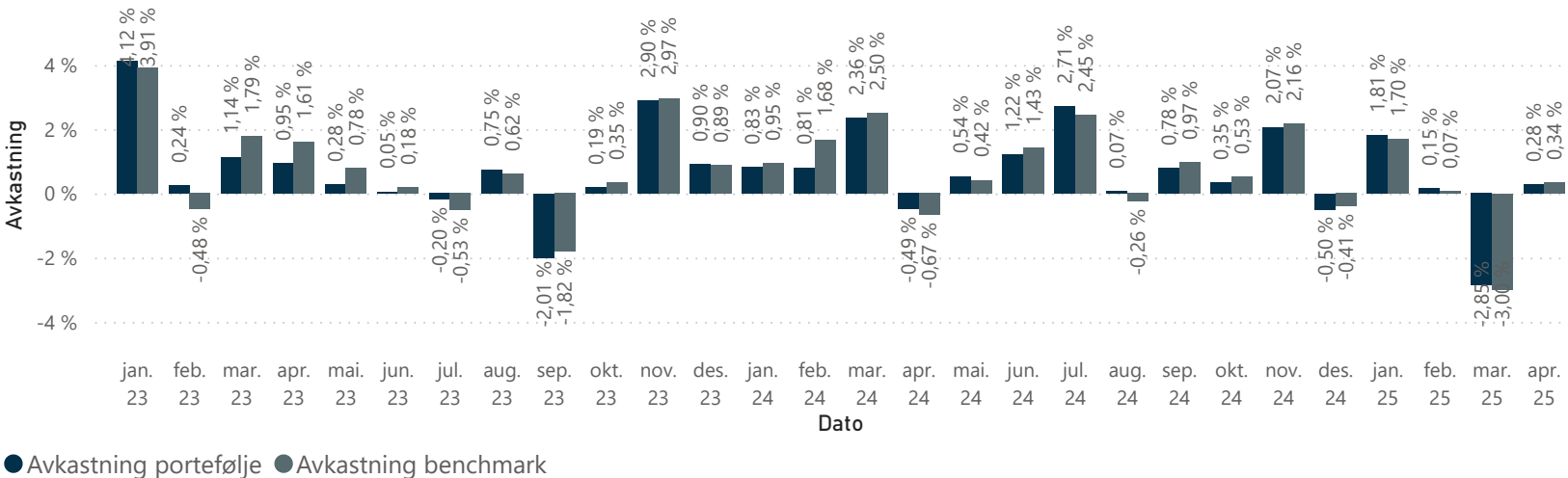
Avkastning per måned (inneværende år)

| År   | Faktisk | Benchmark | Meravk. % | Meravkastning |
|------|---------|-----------|-----------|---------------|
| 2023 | 9,59 %  | 10,62 %   | -0,95 %   | -1 535 933    |
| 2024 | 11,24 % | 12,34 %   | -1,00 %   | -1 674 448    |
| 2025 | -0,67 % | -0,95 %   | 0,28 %    | 528 842       |

Akkumulert avkastning

| År            | Faktisk        | Benchmark      | Meravk %       | Meravkastning     |
|---------------|----------------|----------------|----------------|-------------------|
| 2023          | 9,59 %         | 10,62 %        | -0,93 %        | -1 535 933        |
| 2024          | 21,90 %        | 24,27 %        | -1,91 %        | -3 210 380        |
| 2025          | 21,09 %        | 23,09 %        | -1,63 %        | -2 681 538        |
| <b>Totalt</b> | <b>21,09 %</b> | <b>23,09 %</b> | <b>-1,63 %</b> | <b>-2 681 538</b> |

Avkastning per måned



BJFK - Aktivaklasser

Total

01.01.2023

30.04.2025

Beste måned

0,73 %

Gjennomsnitt

-0,06 %

Verste måned

-0,87 %

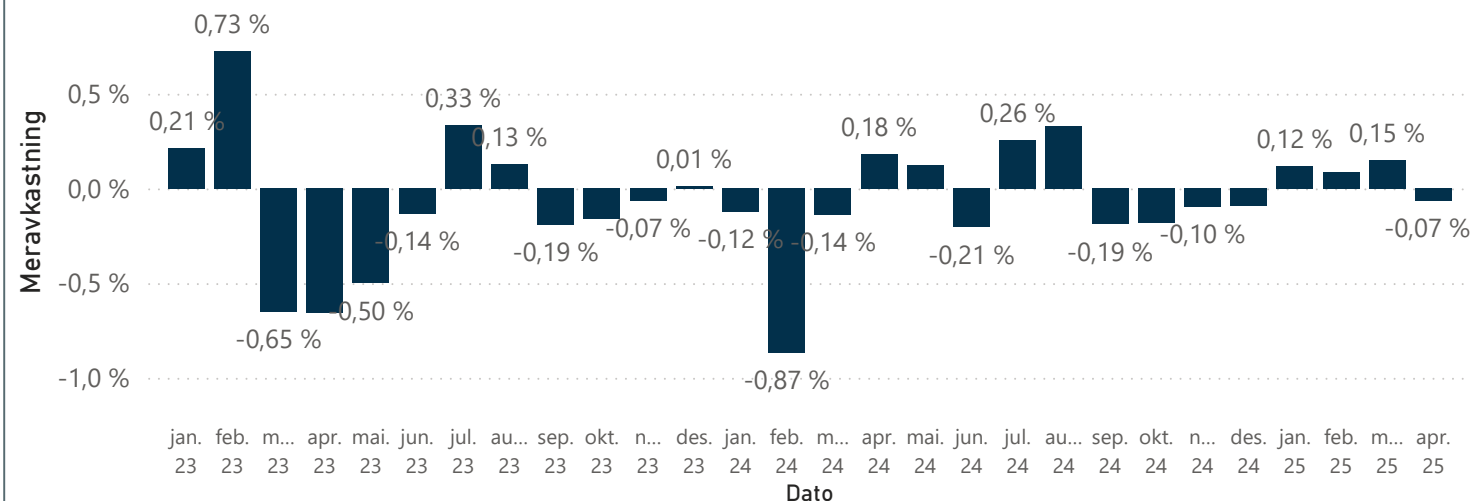
Median

-0,08 %

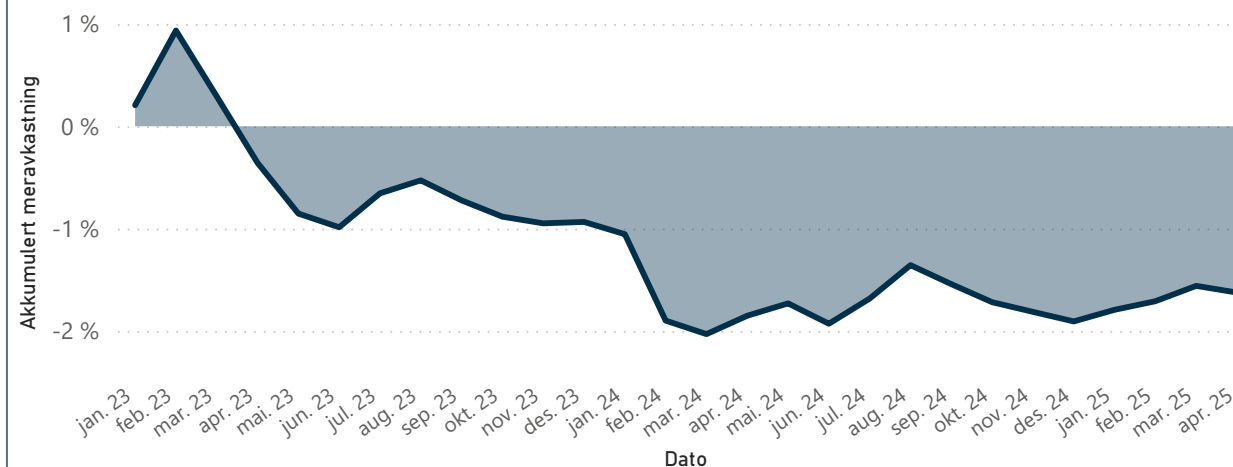
Benchmark

BJFK - Sammensatt indeks Portefølje

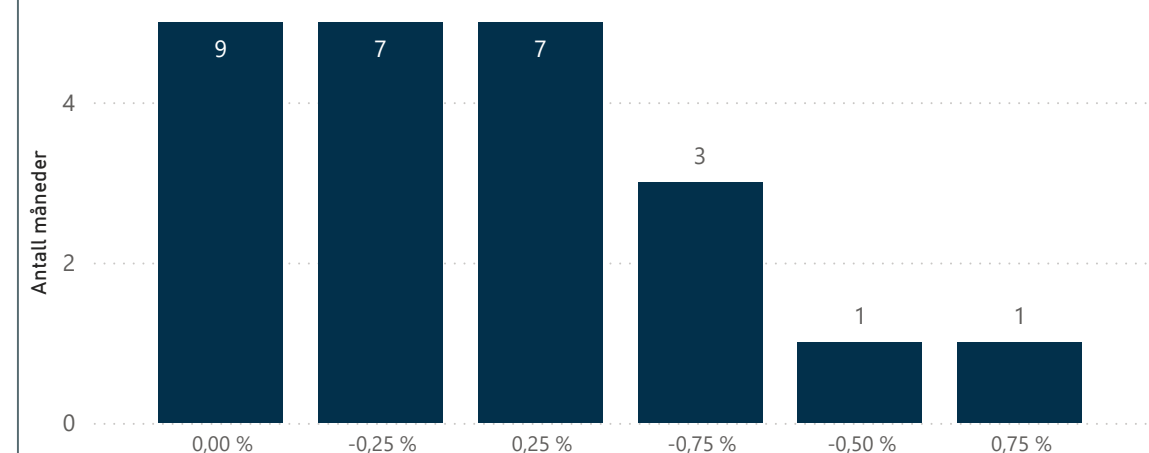
Meravkastning per måned



Akkumulert meravkastning



Fordeling av meravkastning



BJFK - Aktivaklasser

Total

01.01.2023

30.04.2025

**-0,63**

Information Ratio

**0,93**

SharpeRatio

**1,13 %**

Tracking Error

**-0,41 %**

Alfa

**0,94**

Beta

**0,95**

Determination

Standardavvik

4,92 %

4,76 %

Alfa

Alfa

0 %  
-1 %

2024  
MeasureDate 2025

Tracking Error

2 %  
1 %  
0 %  
TrackingError

2024  
MeasureDate 2025

Standardavvik

Portefølje Benchmark

Portefølje og Benchm...  
5 %  
0 %  
jul 2023 jan 2024 jul 2024 jan 2025  
MeasureDate

Beta

Beta  
1,0  
0,5  
0,0

jul 2023 jan 2024 jul 2024 jan 2025  
MeasureDate

Information Ratio

InformationRatio  
0  
-1

jul 2023 jan 2024 jul 2024 jan 2025  
MeasureDate

Kovarians

Covariance  
0,002  
0,000  
jul 2023 jan 2024 jul 2024 jan 2025  
MeasureDate

Sharpe Ratio

SharpeRatio  
2  
1  
0

jul 2023 jan 2024 jul 2024 jan 2025  
MeasureDate

Determination

Determination  
1,0  
0,5  
0,0

jul 2023 jan 2024 jul 2024 jan 2025  
MeasureDate