

Bjørnafjorden kommune

PORTEFØLJERAPPORT - risikoreport

Periode: 1. januar 2023 - 31. mars 2023

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

Alle

01.01.2023

31.03.2023

Sluttverdi

158,0 mill.

Resultat

8,3 mill.

Avvik budsjett

8,3 mill.

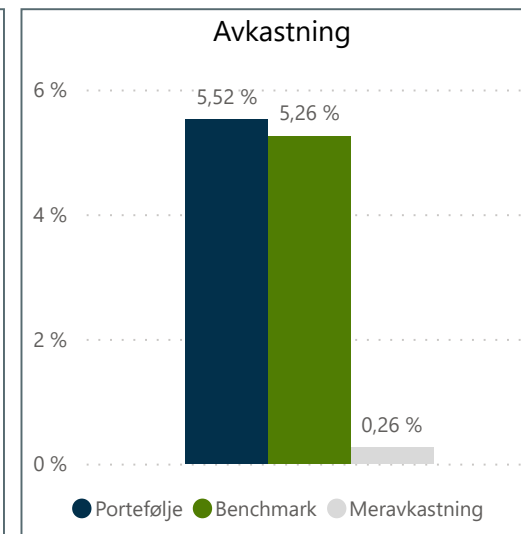
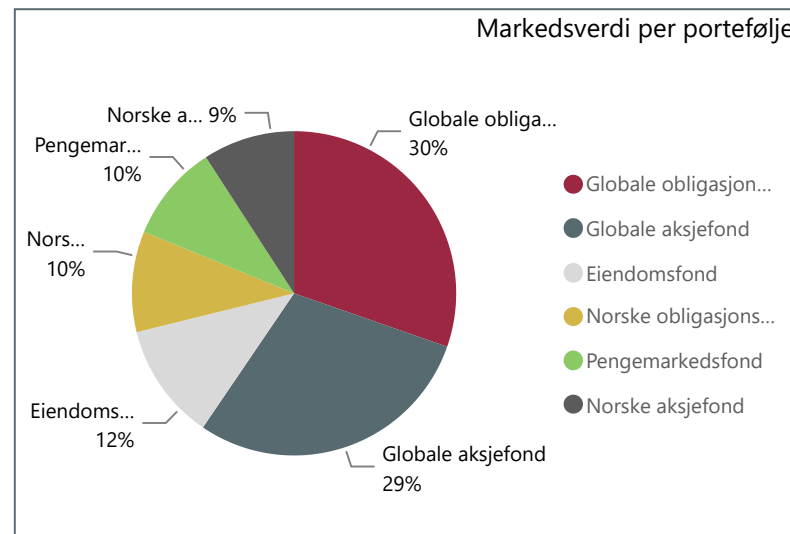
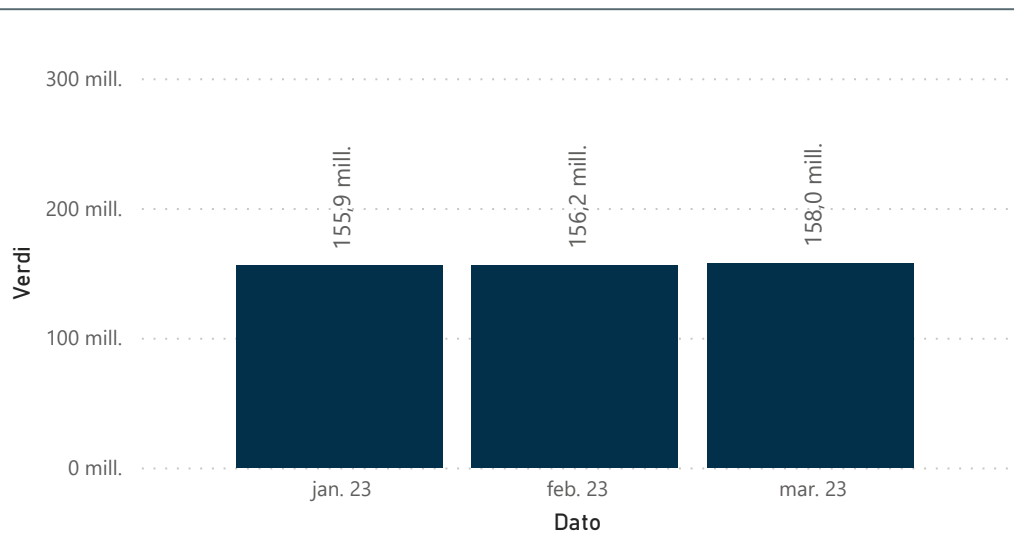
Avkastning mot benchmark

5,26 %

5,52 %

Sammendrag

ID	Beskrivelse	Sluttverdi	Resultat	Avkastning	Benchmark	Meravk. %	Strategisk vekt	Faktisk andel	Avvik	Min	Min_avvik	Maks	Maks_avvik
BJFK1	Pengemarkedsfond	15 263 345	242 318	1,63 %	0,72 %	0,92 %	10 %	9,7 %	-0,3 %	5 %	✓ 0 %	30 %	✓ 0 %
BJFK2	Norske obligasjonsfond	15 859 360	362 473	2,36 %	0,88 %	1,48 %	10 %	10,0 %	0,0 %	5 %	✓ 0 %	30 %	✓ 0 %
BJFK3	Globale obligasjonsfond	47 935 782	1 699 058	3,13 %	2,44 %	0,69 %	30 %	30,3 %	0,3 %	20 %	✓ 0 %	40 %	✓ 0 %
BJFK4	Eiendomsfond	18 408 673	101 053	0,55 %	1,47 %	-0,93 %	10 %	11,7 %	1,7 %	0 %	✓ 0 %	20 %	✓ 0 %
BJFK5	Norske aksjefond	14 456 187	-19 091	-0,27 %	2,96 %	-3,23 %	10 %	9,1 %	-0,9 %	5 %	✓ 0 %	30 %	✓ 0 %
BJFK6	Globale aksjefond	46 074 176	5 882 398	13,93 %	8,91 %	5,02 %	30 %	29,2 %	-0,8 %	20 %	✓ 0 %	40 %	✓ 0 %
Total	Total	157 997 523	8 268 209	5,52 %	5,26 %	0,26 %	100 %	100,0 %	0,0 %	100 %	✓ 0 %	100 %	✓ 0 %



BJFK - Aktivaklasser

Total

01.01.2023

31.03.2023

Resultat

8 268 209

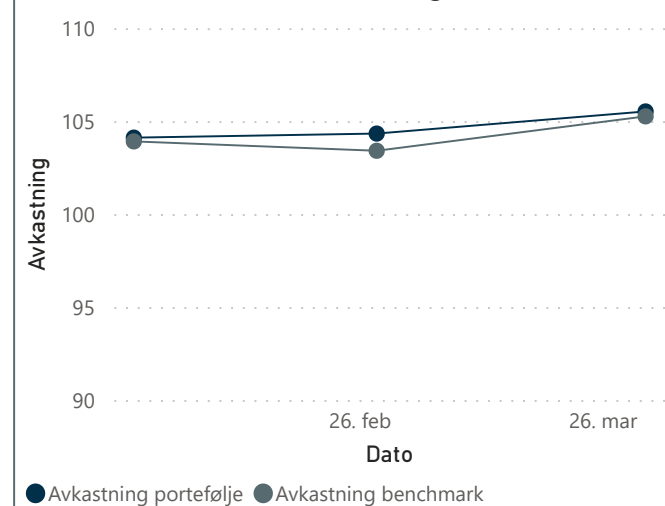
Avkastning mot benchmark



Historisk avkastning

5,52 %	5,26 %
Siste 3 måneder	3 Mnd benchmark
5,52 %	5,26 %
Siste 6 måneder	6 Mnd benchmark
5,52 %	5,26 %
Siste 12 Månedeer	12 Mnd Benchmark
2,72 %	2,59 %
Siste 2 år	2 år benchmark
1,81 %	1,72 %
Siste 3 år	3 år benchmark
1,08 %	1,03 %
Siste 5 år	5 år benchmark

Verdiutvikling



Avkastning per måned

Dato	Faktisk	Benchmark	Meravk. %	Meravkastning
jan. 23	4,11 %	3,91 %	0,20 %	302 996
feb. 23	0,21 %	-0,48 %	0,70 %	1 083 690
mar. 23	1,14 %	1,79 %	-0,65 %	-1 014 366

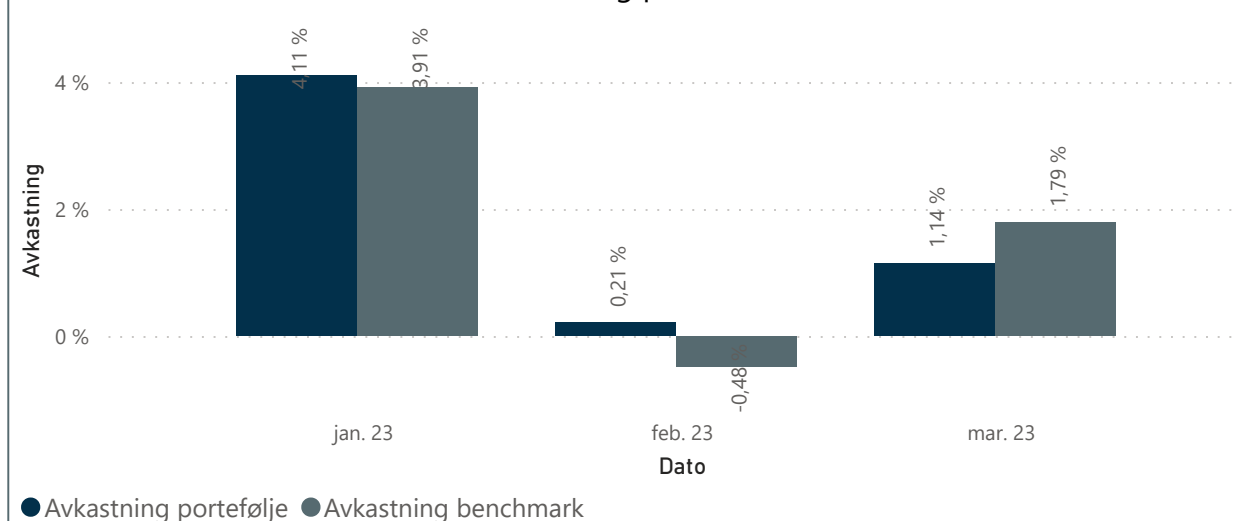
Akkumulert avkastning

Dato	Faktisk	Benchmark	Meravk %	Meravkastning
jan. 23	4,11 %	3,91 %	0,20 %	302 996
feb. 23	4,33 %	3,41 %	0,93 %	1 386 686
mar. 23	5,52 %	5,26 %	0,26 %	372 320

Benchmark

BJFK - Sammensatt indeks Portefølje

Avkastning per måned



BJFK - Aktivklasser

Total

01.02.2022

31.03.2023

Beste måned

0,70 %

Gjennomsnitt

0,08 %

Verste måned

-0,65 %

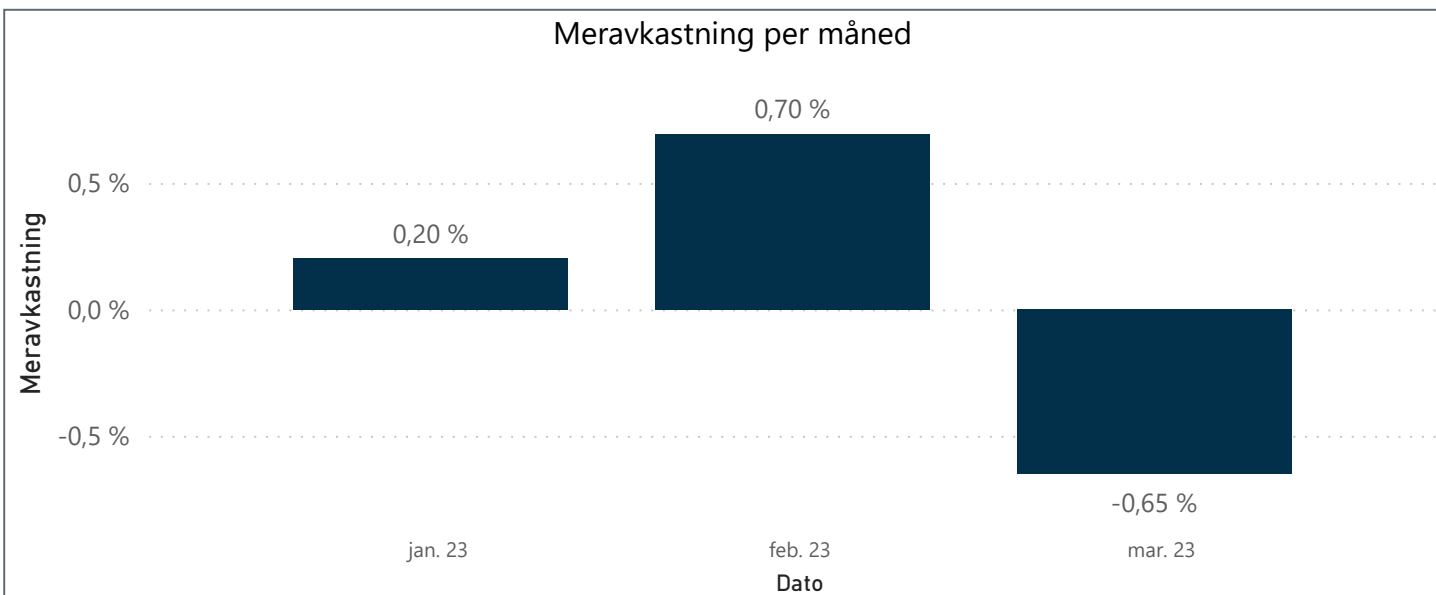
Median

0,20 %

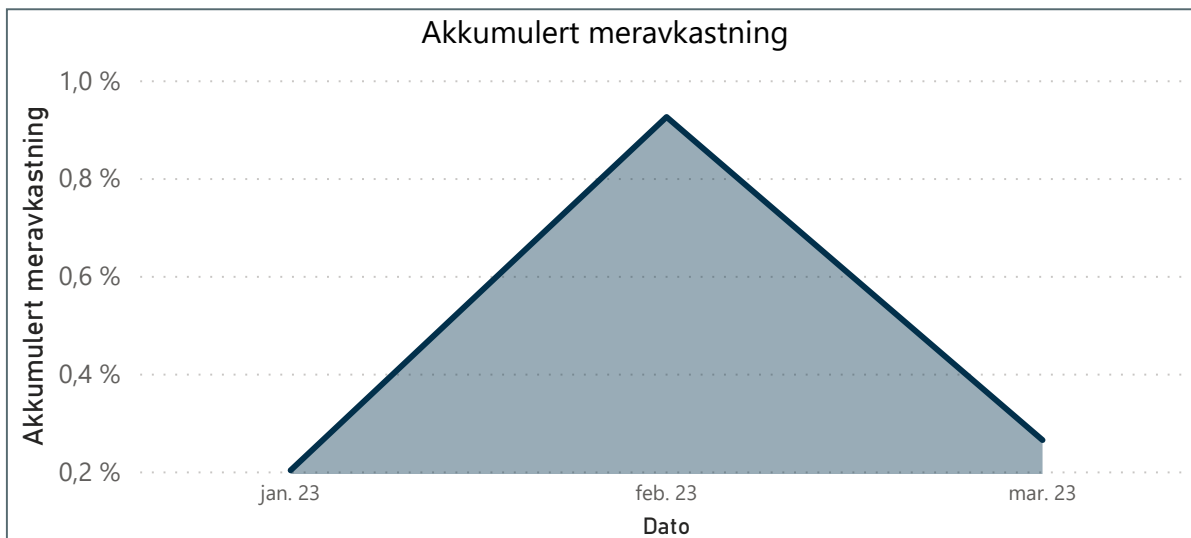
Benchmark

BJFK - Sammensatt indeks Portefølje

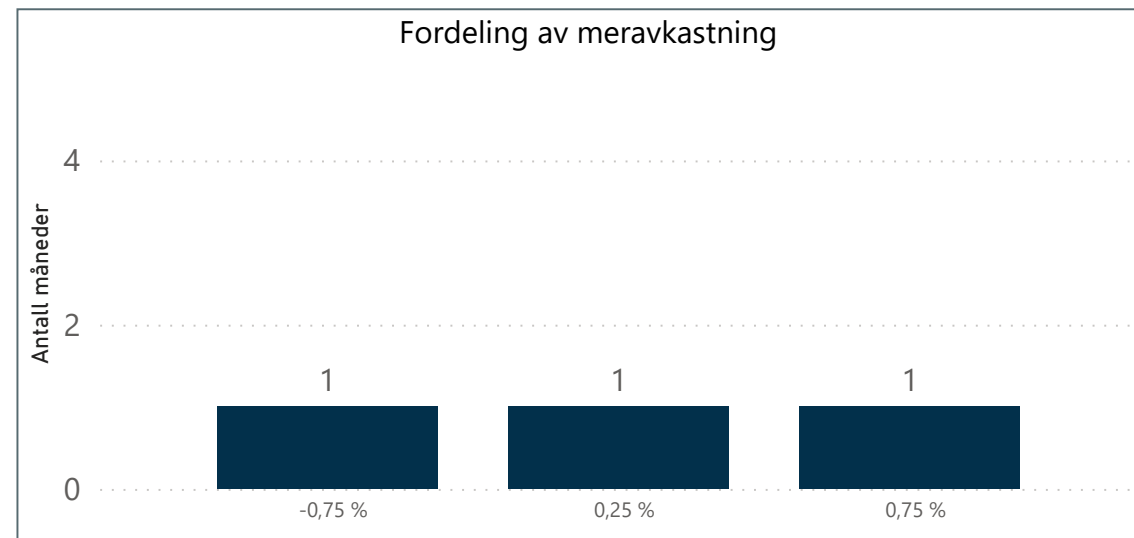
Meravkastning per måned



Akkumulert meravkastning



Fordeling av meravkastning



BJFK - Aktivklasser

Total

01.01.2023

31.03.2023

0,00

Information Ratio

0,00

SharpeRatio

0,00 %

Tracking Error

0,00 %

Alfa

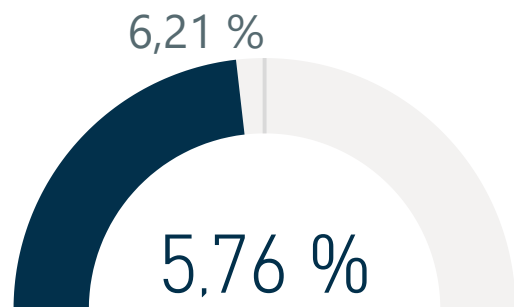
0,00

Beta

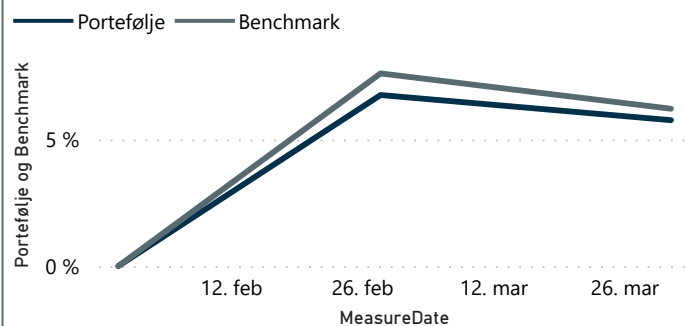
0,00

Determination

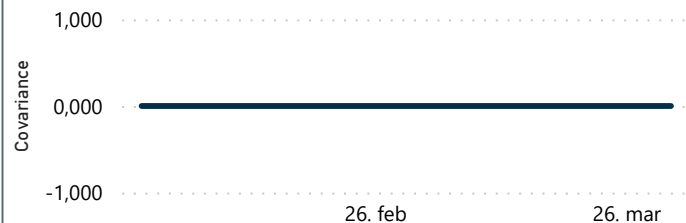
Standardavvik



Standardavvik



Kovarians



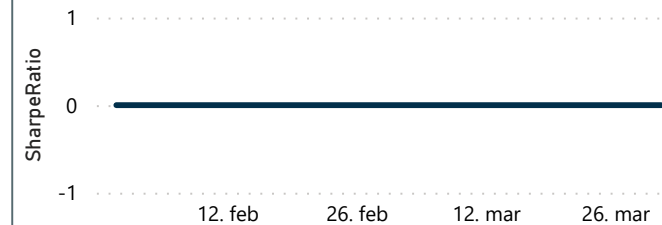
Alfa



Beta



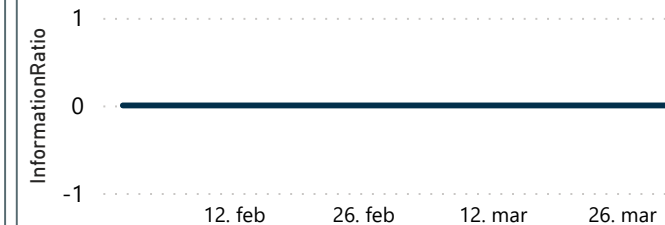
Sharpe Ratio



Tracking Error



Information Ratio



Determination

