

Bjørnafjorden kommune

PORTEFØLJERAPPORT - risikoreport

Periode: 1. januar 2023 - 30. november 2023

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

Alle

01.01.2023

30.11.2023

Sluttverdi

162,5 mill.

Resultat

12,8 mill.

Avvik budsjett

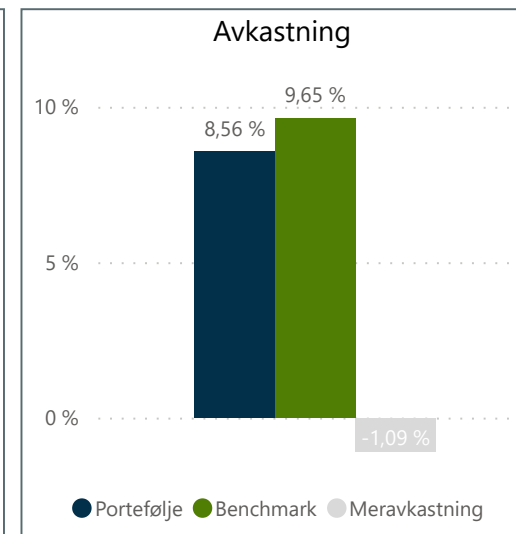
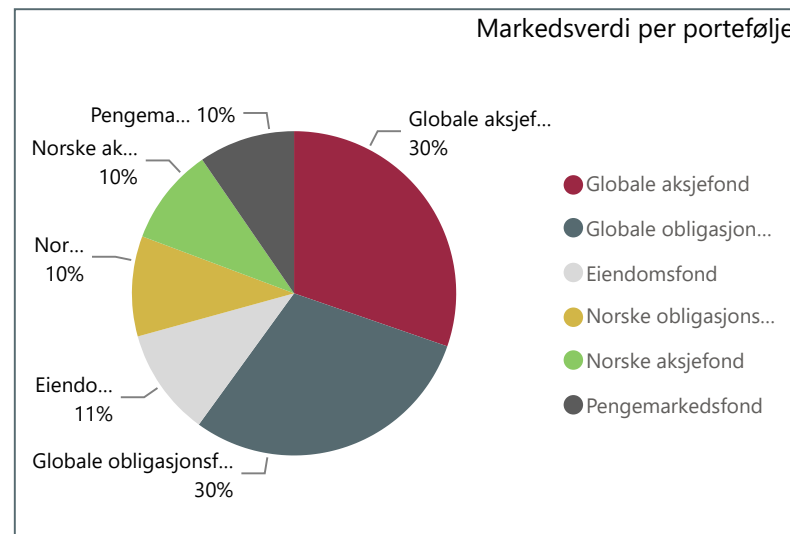
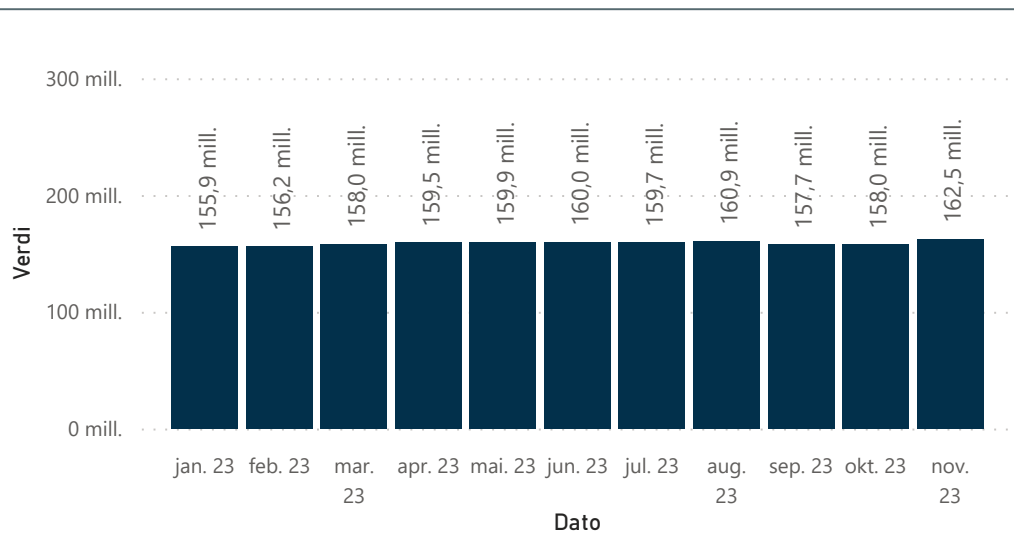
12,8 mill.

Avkastning mot benchmark



Sammendrag

ID	Beskrivelse	Sluttverdi	Resultat	Avkastning	Benchmark	Meravk. %	Strategisk vekt	Faktisk andel	Avvik	Min	Min_avvik	Maks	Maks_avvik
BJFK1	Pengemarkedsfond	15 579 794	788 893	5,15 %	3,06 %	2,09 %	10 %	9,6 %	-0,4 %	5 %	✓ 0 %	30 %	✓ 0 %
BJFK2	Norske obligasjonsfond	16 249 125	753 663	4,88 %	2,66 %	2,22 %	10 %	10,0 %	-0,0 %	5 %	✓ 0 %	30 %	✓ 0 %
BJFK3	Globale obligasjonsfond	48 255 680	2 024 651	3,83 %	2,20 %	1,63 %	30 %	29,7 %	-0,3 %	20 %	✓ 0 %	40 %	✓ 0 %
BJFK4	Eiendomsfond	17 431 044	-1 046 815	-5,67 %	5,92 %	-11,58 %	10 %	10,7 %	0,7 %	0 %	✓ 0 %	20 %	✓ 0 %
BJFK5	Norske aksjefond	15 771 253	1 304 140	8,86 %	9,88 %	-1,02 %	10 %	9,7 %	-0,3 %	5 %	✓ 0 %	30 %	✓ 0 %
BJFK6	Globale aksjefond	49 250 931	9 000 721	22,19 %	24,76 %	-2,57 %	30 %	30,3 %	0,3 %	20 %	✓ 0 %	40 %	✓ 0 %
Total	Total	162 537 827	12 825 253	8,56 %	9,65 %	-1,09 %	100 %	100,0 %	0,0 %	100 %	✓ 0 %	100 %	✓ 0 %



BJFK - Aktivklasser

Total

01.01.2023

30.11.2023

Resultat

12 825 253

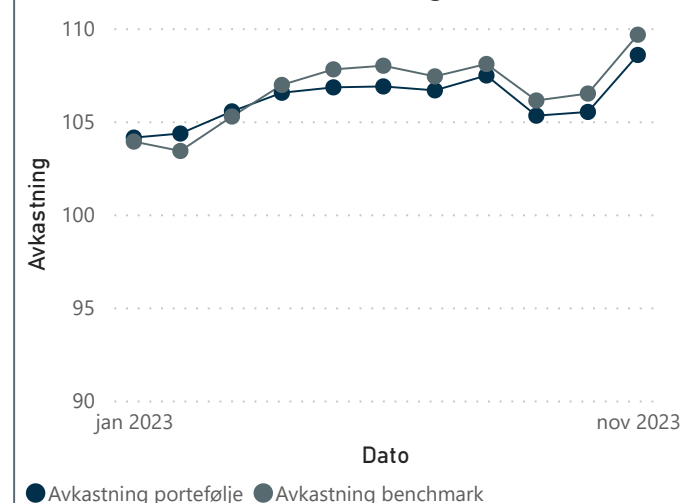
Avkastning mot benchmark



Historisk avkastning

1,03 %	1,45 %
Siste 3 måneder	3 Mnd benchmark
1,63 %	1,73 %
Siste 6 måneder	6 Mnd benchmark
8,56 %	9,65 %
Siste 12 Månedeer	12 Mnd Benchmark
4,19 %	4,71 %
Siste 2 år	2 år benchmark
2,78 %	3,12 %
Siste 3 år	3 år benchmark
1,66 %	1,86 %
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	0,95 %	1,61 %	-0,66 %	-1 048 991
mai. 23	0,27 %	0,78 %	-0,51 %	-817 968
jun. 23	0,05 %	0,18 %	-0,14 %	-216 387
jul. 23	-0,20 %	-0,53 %	0,33 %	533 494
aug. 23	0,75 %	0,62 %	0,13 %	205 712
sep. 23	-2,01 %	-1,82 %	-0,19 %	-312 274
okt. 23	0,19 %	0,35 %	-0,16 %	-253 849
nov. 23	2,90 %	2,97 %	-0,07 %	-104 807

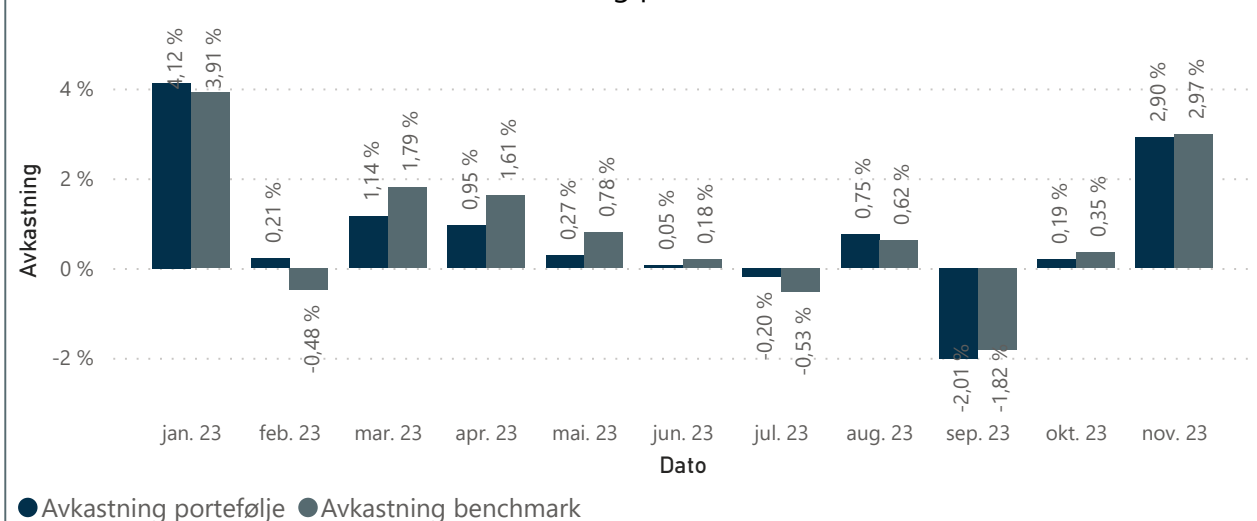
Akkumulert avkastning

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 %	389 423
apr. 23	6,53 %	6,95 %	-0,42 %	-659 567
mai. 23	6,82 %	7,79 %	-0,97 %	-1 477 535
jun. 23	6,87 %	7,98 %	-1,11 %	-1 693 922
jul. 23	6,66 %	7,41 %	-0,75 %	-1 160 428
aug. 23	7,46 %	8,08 %	-0,62 %	-954 716
sep. 23	5,30 %	6,12 %	-0,82 %	-1 266 990
okt. 23	5,50 %	6,49 %	-0,99 %	-1 520 839
nov. 23	8,56 %	9,65 %	-1,09 %	-1 625 646

Benchmark

BJFK - Sammensatt indeks Portefølje

Avkastning per måned



BJFK - Aktivklasser

Total

01.01.2023

30.11.2023

Beste måned

0,70 %

Gjennomsnitt

-0,09 %

Verste måned

-0,66 %

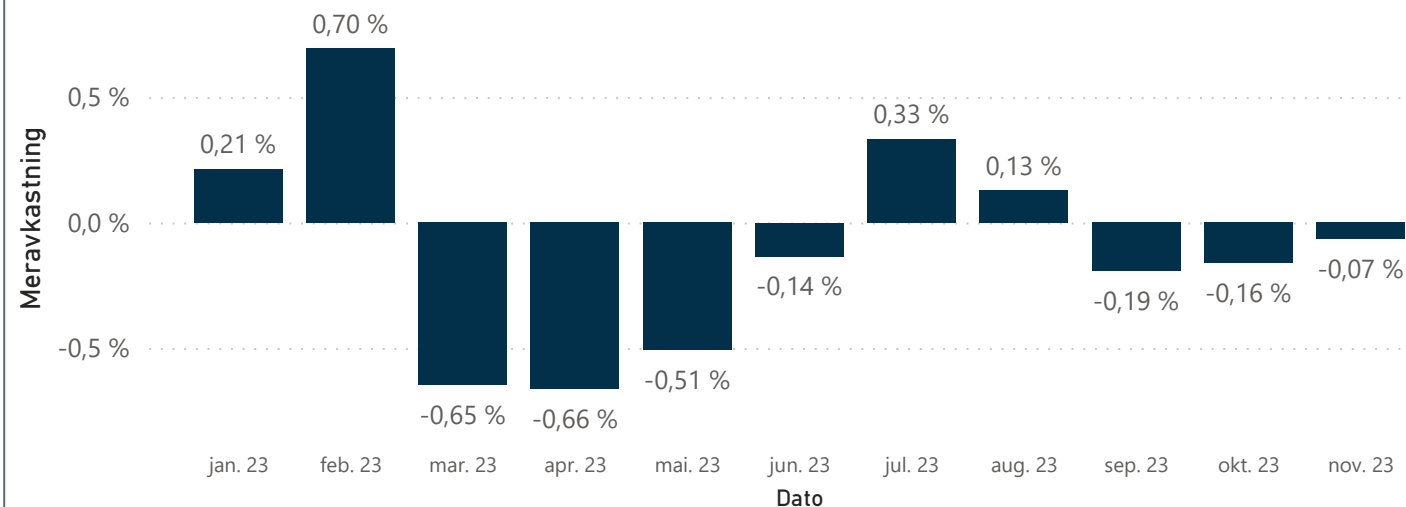
Median

-0,14 %

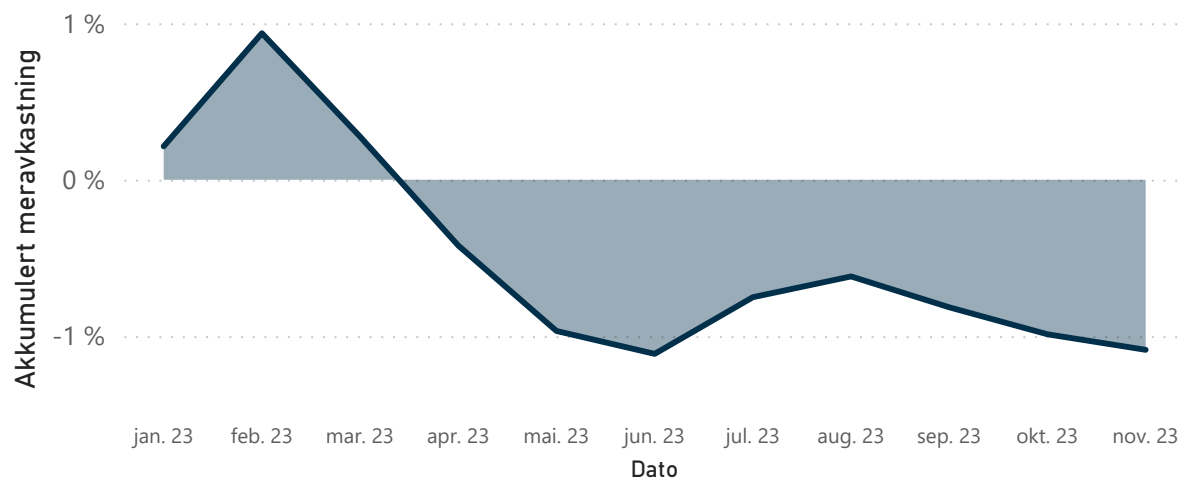
Benchmark

BJFK - Sammensatt indeks Portefølje

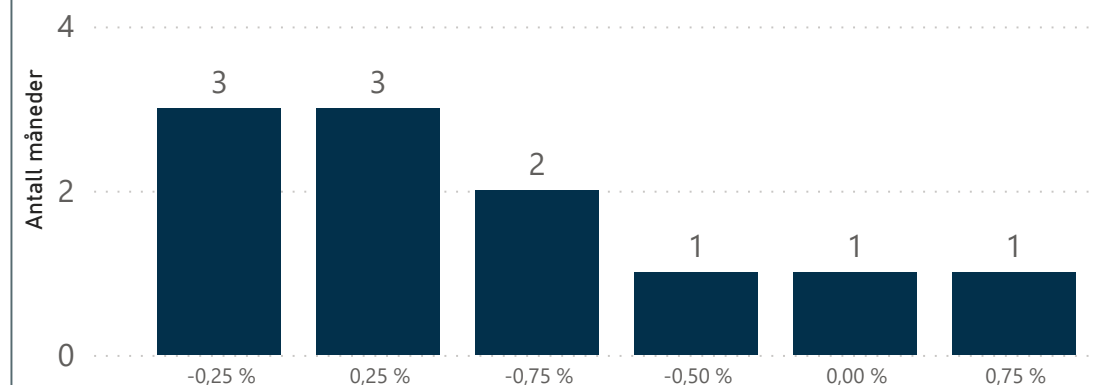
Meravkastning per måned



Akkumulert meravkastning



Fordeling av meravkastning



BJFK - Aktivklasser

Total

01.01.2023

30.11.2023

-0,79
Information Ratio

1,10
SharpeRatio

1,39 %
Tracking Error

-0,77 %
Alfa

0,95
Beta

0,93
Determination

