

VERARE TMS

Rapporterings tjänst

VARFÖR VERARE?

**EN BREDARE BILD AV HUR
PORTFÖLJENS
SAMMANSÄTTNING PÅVERKAR
RESULTATET.**

**MODERNT, KOMPLET, ENKELT,
EFFEKTIVISERA FÖRVALTNINGEN
IFRÅN FRONT TILL MID OCH BACK
OFFICE**

**SNABBARE RAPPORTERING
BÄTTRE KONTROLL**

**SÄKRA TILLVÄXT,
KOSTNADSEFFEKTIVITET OCH
AFFÄRSRÖRLIGHET.**



Verare AB har utvecklat en rapporteringstjänst för förmögenhets förvaltare som bygger på sitt portföljvärderings system TMS .

Portföljvärderings systemet TMS:

Är ett registreringsverktyg för att hålla samman alla transaktioner; köp och sälj, kuponger, utbetalningar, dokument osv.

Kan generar historik av kassaflöden och ger ett total värde av portföljen i nutid och historiskt.

Rapport design kan skräddarsys till dina önskemål med risk data, grafer och värderingsdata. Allt för att kunna mer effektivt följa investeringar gentemot risk, risk policy, placerings policy och andra väsentliga data samt länkas till bokföring.

Är GIPS compliant beroende på marknadsdata och vilken komplexitet i form av investeringsinstrument som används. Allt som har en daglig notering kan värderas och systemet generar en daglig uppfattning om hur en investering portfölj mår.

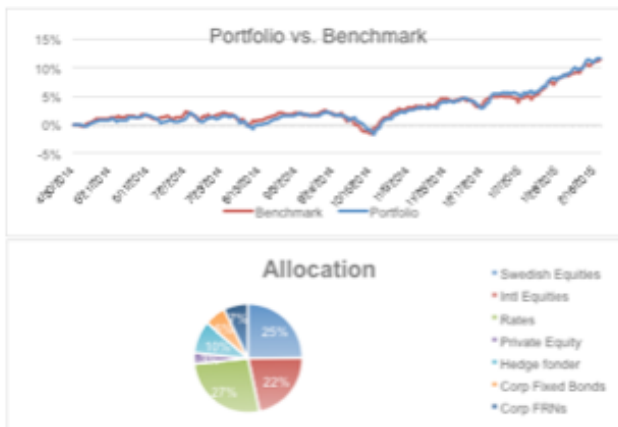
Instrument:

- Aktier
- Obligationer
- Penningmarknad
- Fonder
- Råvaror

Alla instrument som handlas eller listas via en marknadsplats och där ett dagligt eller periodvis värde kan erhållas kan hanteras.

Benchmark kan designas och definieras för total

"VERARE's värdering och rapporterings verktyg kan utifrån en standard mall skräddarsys till det behov och krav en förvaltning har av design och innehåll"...



	NAV	AltTime	YTD	3M	6M	9M	12M	Vol	Sharpe	TE	IK	K
Totalportföljen	SEK 100 000 000	11.15%	5.31%	6.43%	9.09%	9.80%	11.15%	5.36%	2.08	6.87%	0.07	0.52
Benchmark		10.64%	5.59%	6.37%	8.37%	9.02%	10.64%	5.84%	1.82			



"Grafik på totalportfölj och delportföljer, tabeller med avkastning, risk och bidrags analys"....

Exempel på output

	Tabell	Graf		Tabell	Graf
Marknadsutveckling historisk	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	Informations kvot	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Värdeutveckling historisk	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	Konsistens	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Värdeutveckling år/år	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	Maximum Drawdown	<input checked="" type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>
Volatilitet	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	Stress Test	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Aktiv Risk	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	Korrelations jämförelser	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Sharpe kvot	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	Kredit risk	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>

Ytterligare nyckeltal kan läggas till beroende på tillgångslag i portföljen.

RAPPORTERINGS TJÄNSTER

Verare ger inga placeringsråd men erbjuder rapporterings tjänster för förvaltare som endast har behov av periodvisa rapporter. Verare kan snabbt och enkelt generera månads och kvartals rapporter med risk analys och värdering utifrån en stor mängd olika analyser. Utöver den kvantitativa analysen kan Verare också göra en risk analys som tar hänsyn till mikro och makro trender som relaterad till investerings mandatet och hur portföljen är allokerad.

Verare's rapportering är GIPS compliant och ger:

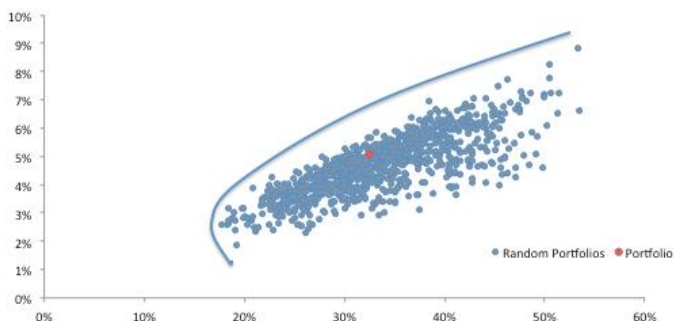
Olika typer av risk värdering som:

- Marknads risk
- Koncentrations risk
- Kredit risk
- Hållbarhets risk

Exempel på analyser

EFFEKTIVA FRONTEN

En simulering över en given tidsperiod av alla möjliga taktisk allokeringar givet min och max allokeringar enligt policy – hur effektivt har min portfölj varit och har mina taktiska beslut haft förväntad effekt Den effektiva fronten är de kombinationer av värdepapper som ger mest avkastning i förhållande till en given risk.



BIDRAGS ANALYS

Hur mycket har en allokering eller en enskild investering bidragit till portfölj resultatet? Bidragsanalys visar vad varje enskild investering genererat i avkastning till totalportföljen vägd till sin nominella storlek på varje enskild investering

