

# Ny versjon av Tazett porteføljestyringsystem.

## Internett-oppggradering til versjon 3.12

Versjon 3.12 av Tazett kan nå lastes ned fra internett.

Se vedlegg 'Oppdatering versjon 312.pdf' for oppgraderingsbeskrivelse.

Se vedlegg 'Ligning Proff 2012.pdf' for beskrivelse av hvordan skattetall og verdipapirregisteret oppdateres i Tazett-Stocks..

Disse filene kan også hentes fra Internett på [www.tazett.com](http://www.tazett.com).

Dette dokumentet viser hvilke endringer som finnes i denne versjonen.

Dette er en oppgradering som gir deg de siste versjonene av alle programfilene du benytter.

## Innholdsfortegnelse

|   |    |
|---|----|
| Tazett-Service.....                                       | 2  |
| <i>Address Changes List</i> .....                         | 2  |
| Tazett-Stocks .....                                       | 2  |
| <i>Stock Reservation</i> .....                            | 2  |
| <i>Find vinduet</i> .....                                 | 2  |
| <i>Short</i> .....  | 2  |
| <i>Nye felt i Maintain-Stocks</i> .....                   | 3  |
| Tazett-Ledger .....                                       | 4  |
| <i>Symbol kriterier</i> .....                             | 4  |
| <i>Ledger account totals</i> .....                        | 4  |
| Tazett-Fund .....   | 4  |
| <i>Skatterapporter</i> .....                              | 4  |
| <i>Rente og gebyr beregning i skuddår</i> .....           | 4  |
| <i>FONSA rapportering</i> .....                           | 4  |
| Tazett-Total .....  | 5  |
| <i>Nye rapporter</i> .....                                | 5  |
| <i>Benchmark rapporter</i> .....                          | 6  |
| <i>Limits rapporter</i> .....                             | 6  |
| Tazett-Reports .....                                      | 7  |
| <i>3D Kake</i> .....                                      | 7  |
| <i>Stacking og Data Series in Row på graf</i> .....       | 8  |
| <i>4 rapportkolonner på graf</i> .....                    | 9  |
| <i>Formattering av Y og X akse verdiene på graf</i> ..... | 9  |
| <i>Column Separator</i> .....                             | 9  |
| <i>6. sorteringsnivå</i> .....                            | 9  |
| Tazett-MultiReport.....                                   | 10 |
| <i>Sidenummerering</i> .....                              | 10 |
| <i>Page Setup per side</i> .....                          | 10 |
| <i>Run Page</i> .....                                     | 10 |

## Tazett-Service

I Tazett-Service er hovedendringen at alle endringer i adresseregisteret blir lagret.

### Address Changes List

Ved endring, sletting eller innlegging av nye adresser i *Maintain Address*, vil det bli lagret hva som er endret i en tabell med navn *AddressChange*. For å få ut alt som er endret, kjøres rapporten *Address Changes List* under *Reports, Maintain*.

Rapporten brukes for å spore hva som er skjedd i adresseregisteret.

## Tazett-Stocks

I Tazett-Stocks er det gjort noen mindre endringer. Den viktigste endringen her er reservasjon mot salg av aksjer (pledging).

### Stock Reservation

I *Stock Buy* bildet kan man reservere et aksjekjøp så det ikke blir solgt ut, ved å klikke på

The Stocks are Reserved :

Feltet til høyre fylles ut med antall som skal reserveres. Det er også mulig å sette reservering på flere kjøp samtidig under *File, Open, Reserved...*

### Find vinduet

Det er blitt enklere å søke opp verdipapirer under Find funksjonen i Stock Buy og Stock Sale. I Symbol feltet kan det angis deler av Ticker, VP navn, ISIN eller RIC kode.

### Short

Hvis det legges inn et kjøp, og systemet finner ut at det finnes shortposisjoner i verdipapiret, så blir man nå spurt om short posisjonen skal inndeckes. En short inndecking vil da automatisk bli fylt ut (i salgsbildet).

### Nye felt i Maintain-Stocks

Det er lagt til nye felt for *Open Date* og *Close Date* i *Maintain Stocks*:

The screenshot shows the 'Maintain Stocks' dialog box. The 'Symbol' field contains 'NO.NHY.T' and the 'Asset Number' field contains 'N0001 0577257'. The 'Name' field contains 'Norsk Hydro Tegningrett'. The 'Open Date' field is set to '01.03.2010' and the 'Close Date' field is set to '06.07.2010'. Other fields include 'Min. Quantity', 'Days to Settlement', 'Calculation Factor', 'Issuer', 'Stock Capital', 'Cusip', 'Minimum Brokerage', 'Sedol', 'Brokerage Percent', 'Volume', 'Fixed Brokerage', and 'Delay Days of DDE rate import'. The 'Category' field is set to 'UTVALG OBX'. The dialog has tabs for 'General Information', 'Tax Information', 'Additional Info', 'Analysis/User Information', 'RISK', and 'Commitment'. At the bottom, there are buttons for '2', '4', and 'Cancel'.

Disse feltene blir primært brukt av Corporate Actions for å lagre start og sluttdato for verdipapirer. Feltene kan også brukes manuelt for å sette gyldighetsperiode for et verdipapir. Verdiene kan da brukes på rapporter enten i utvalgsriterier eller i fremvisning i egne kolonner.

### Tax Reporting

Nyeste Stocks versjonen har oppdaterte skatterapporter og oppdatert sats for skjermingsfradrag.

## Tazett-Ledger

I Tazett-Ledger er det nå mulig å sette kriterier på hvilket Symbol det skal bokføres på. Det er også lagt til en tabell som viser totaler som vil bli bokført per konto per investor.

### Symbol kriterier

For å angi hvilket Symbol det skal bokføres på, velges det først i Symbol før Show Records blir trykket:

| Investor   | Account | Amount NOK  |
|------------|---------|-------------|
| CAPTURE AS | 9000    | -337.572,00 |
| CAPTURE AS | 9200    | 337.572,00  |

| Type      | Investor   | Portfolio | Broker   | Voucher | Trans Type | Transnumber | Date       | Ledger Acco | Amount NOK  | Investment Acco |
|-----------|------------|-----------|----------|---------|------------|-------------|------------|-------------|-------------|-----------------|
| StockSale | CAPTURE AS | A         | DIVIDEND |         | 7-Utbytte  | 220732      | 18.05.2011 | 9000        | -159.459,75 |                 |
| StockSale | CAPTURE AS | A         | DIVIDEND |         | 9-Bank     | 220732      | 18.05.2011 | 9200        | 159.459,75  |                 |
| StockSale | CAPTURE AS | A         | DIVIDEND |         | 7-Utbytte  | 220733      | 18.05.2011 | 9000        | -178.112,25 |                 |
| StockSale | CAPTURE AS | A         | DIVIDEND |         | 9-Bank     | 220733      | 18.05.2011 | 9200        | 178.112,25  |                 |

### Ledger account totals

For å se hvor mye som vil bli bokført per konto, krysses det av i  Show ledger account totals feltet. Tabellen vil da vise totalsummer som blir ført per investor per konto.

## Tazett-Fund

I Tazett-Fund er det gjort endring i skatterapport, samt at det er endret i hvordan renter og gebyr blir beregnet i skuddår.

### Skatterapporter

Tax Report Fund har fått med en ny linje sin viser beholdning 30.06 skatteåret ihht ny lov.

### Rente og gebyr beregning i skuddår

Systemet beregner nå påløpt rente og gebyr med 366 i nevner hvis perioden er i skuddår, mot 365 fra før.

### FONSA rapportering

Det er gjort små justeringer i FONSA rapporteringen som går ut på formatteringen i filen.

## Tazett-Total

I Tazett-Total er det lagt til noen nye rapporter, samt nye kolonner. Det er gjort en del endringer i *compliance* rapportering og oppsett av dette.

### *Nye rapporter*

#### *Money Weighted rate of Return*

Denne rapporten viser pengevektet avkastning basert på modifisert ditz prinsippet. Rapporten viser korrekte verdier uansett gruppering. Formelen for avkastning er som følger (fra Wiki):

$$R_{M\text{Ditz}} = \frac{\text{Gain}}{\text{AverageCapital}} = \frac{EMV - BMV - F}{BMV + \sum_{i=1}^n W_i \times F_i}$$

Gain er resultat i perioden

*EMV* = ending market value

*BMV* = beginning market value

*F* = the net external inflow for the period (contributions to a portfolio are entered as positive flows while withdrawals are entered as negative flows)

and

$$\sum_{i=1}^n W_i \times F_i = \text{the sum of each flow, } F_i, \text{ multiplied by its weight } W_i$$

The weight  $W_i$  is the proportion of the time period between the point in time when the flow  $F_i$  occurs and the end of the period.  $W_i$  can be calculated as:

$$W_i = \frac{CD - D_i}{CD}$$

where:

*CD* = the number of calendar days during the return period being calculated

*D<sub>i</sub>* = the number of days from the start of the return period until the day on which the flow  $F_i$  occurred.

## Benchmark rapporter

Det er lagt til *PortfolioGroup* nivå i oppsettet av *Index Performance* for *benchmark* rapportering:

| Investor | PortfolioGroup     | Portfolio | StockType | CurrencyCode | Category | IndexCode    | IndexCurrency | Weight |
|----------|--------------------|-----------|-----------|--------------|----------|--------------|---------------|--------|
|          |                    |           |           |              |          | NO_OSEBX     | NOK           |        |
|          | External portfolio |           |           |              |          | NO_OSEBX     | NOK           | 40     |
|          | External portfolio |           |           |              |          | US_FTSE100   | GBP           | 20     |
|          | Internal portfolio |           |           |              |          | US_S&P500    | USD           | 20     |
|          | Internal portfolio |           |           |              |          | US_XETRA-DAX | EUR           | 20     |

På *Positions* baserte rapporter kan det da velges kolonner for å vise avkastning for *Portfolio Group*, og tilhørende avkastning for indeksen som skal måles mot *Portfolio Group*. Eksempel på en slik rapport:

| RISIKOKLASSE              | Denne Periode MNOK | Denne Periode % | Periode MNOK | Periode % | HIST i år MNOK | HIST i år % | Siden oppstart MNOK | Siden oppstart % | Relativ Periode % | Relativ HIST i år % | Relativ Oppstart % |
|---------------------------|--------------------|-----------------|--------------|-----------|----------------|-------------|---------------------|------------------|-------------------|---------------------|--------------------|
| Aktiefond                 | 14,39              | 7,7%            | 0,53         | 3,4%      | 0,76           | 5,0%        | -14,15              | 23,2%            | -5,7%             | -10,4%              | 7,9%               |
| Utbytte aktiefond         | 0,00               | 0,0%            | 0,36         | 0,0%      | 0,36           | 0,0%        | 0,36                | 0,0%             | 0,0%              | 0,0%                | 0,0%               |
| Utenlandske aktiefond     | 0,67               | 0,4%            | 0,04         | 0,0%      | 0,04           | 0,0%        | 0,04                | 0,0%             | 66,3%             | 60,0%               | 60,0%              |
| Aktiefond                 | 15,06              | 8,0%            | 0,93         | 3,7%      | 1,16           | 5,3%        | -13,75              | 22,5%            | -5,4%             | -10,1%              | 8,1%               |
| Egenkapitalverdi          | 4,63               | 2,5%            | 0,32         | 1,5%      | 0,42           | 8,4%        | -5,80               | -20,8%           | -1,5%             | -23,8%              | -36,2%             |
| Korte utenlandske aksjer  | 3,11               | 1,7%            | -1,61        | -30,9%    | -3,34          | -48,2%      | -14,00              | -85,9%           | -40,0%            | -83,5%              | -81,2%             |
| Korttidige Norske Aksjer  | 37,95              | 20,3%           | -7,14        | -18,0%    | -12,73         | -25,3%      | -76,45              | -42,4%           | -25,1%            | -40,7%              | -57,8%             |
| Longe Norske Aksjer       | 41,28              | 22,0%           | 0,36         | 0,9%      | 1,65           | 4,2%        | 43,05               | 8,4%             | 10,0%             | -11,2%              | -23,7%             |
| Longe utenlandske aksjer  | 8,36               | 4,5%            | 0,23         | 2,6%      | -2,23          | -27,1%      | -22,10              | -66,0%           | 11,7%             | -36,4%              | -73,3%             |
| VPS regasert Utbytte      | 0,00               | 0,0%            | 0,10         | 179,4%    | 2,10           | 102,2%      | 2,10                | 188,5%           | 117,6%            | 117,6%              | 117,6%             |
| Aksjer                    | 95,31              | 50,9%           | -8,92        | -9,5%     | -14,90         | -13,6%      | -159,29             | -33,9%           | -17,6%            | -20,9%              | -49,3%             |
| Deiaktelignende selskaper | 42,13              | 22,5%           | 10,56        | 31,3%     | -2,24          | -4,8%       | -47,80              | 12,8%            | 22,2%             | -20,2%              | -2,6%              |
| Alternative investeringer | 42,13              | 22,5%           | 10,56        | 31,3%     | -2,24          | -4,8%       | -47,80              | 12,8%            | 22,2%             | -20,2%              | -2,6%              |
| Bank                      | 13,60              | 7,3%            | 0,22         | 0,0%      | 0,22           | 0,0%        | 0,22                | 0,0%             | -8,2%             | -14,5%              | -14,5%             |
| Bank                      | 13,60              | 7,3%            | 0,22         | 0,0%      | 0,22           | 0,0%        | 0,22                | 0,0%             | -8,2%             | -14,5%              | -14,5%             |
| Norske obligasjoner       | 14,25              | 7,6%            | 0,60         | 4,2%      | 1,26           | 3,2%        | -6,03               | 6,9%             | -4,9%             | -6,2%               | -8,5%              |
| Obligasjoner              | 14,25              | 7,6%            | 0,60         | 4,2%      | 1,26           | 3,2%        | -6,03               | 6,9%             | -4,9%             | -6,2%               | -8,5%              |
| Obligasjonsfond           | 6,89               | 3,7%            | 0,30         | 4,7%      | 0,25           | 4,0%        | -5,43               | 4,0%             | -4,3%             | -11,4%              | -11,4%             |
| Obligasjonsfond           | 6,89               | 3,7%            | 0,30         | 4,7%      | 0,25           | 4,0%        | -5,43               | 4,0%             | -4,3%             | -11,4%              | -11,4%             |
| TOTAL                     | 187,24             | 100,0%          | 3,69         | 1,7%      | -14,33         | -6,7%       | -232,17             | -16,3%           | -7,4%             | -22,1%              | -31,6%             |

## Limits rapporter

Det er gjort endringer på rapporten Compliance Report i Total.

Rapporten viser nå som standard limits per Investor og Issuer. Hvilken Limits som velges, skjer nå automatisk basert på oppsettet under File, Open, Limits. På denne måten kan man enkelt lage alle typer compliance rapporter basert på ønsket nivå. Relative To fra Limits oppsettet vil nå bli brukt for det siste grupperingsnivået på en limitsrapport, og ikke mot første som det var før.

Den mest spesifikke limits vil bli valgt fremfor en mer generell på limits rapporter.

F.eks hvis det på en limits grense er spesifisert Investor, så vil denne bli valgt fremfor en limits linje uten investor.

Portfolio Group er også lagt til som et nivå under File, Open, Limits. Rapporter som er gruppert på Portfolio Group vil da benytte seg av dette.



## Stacking og Data Series in Row på graf

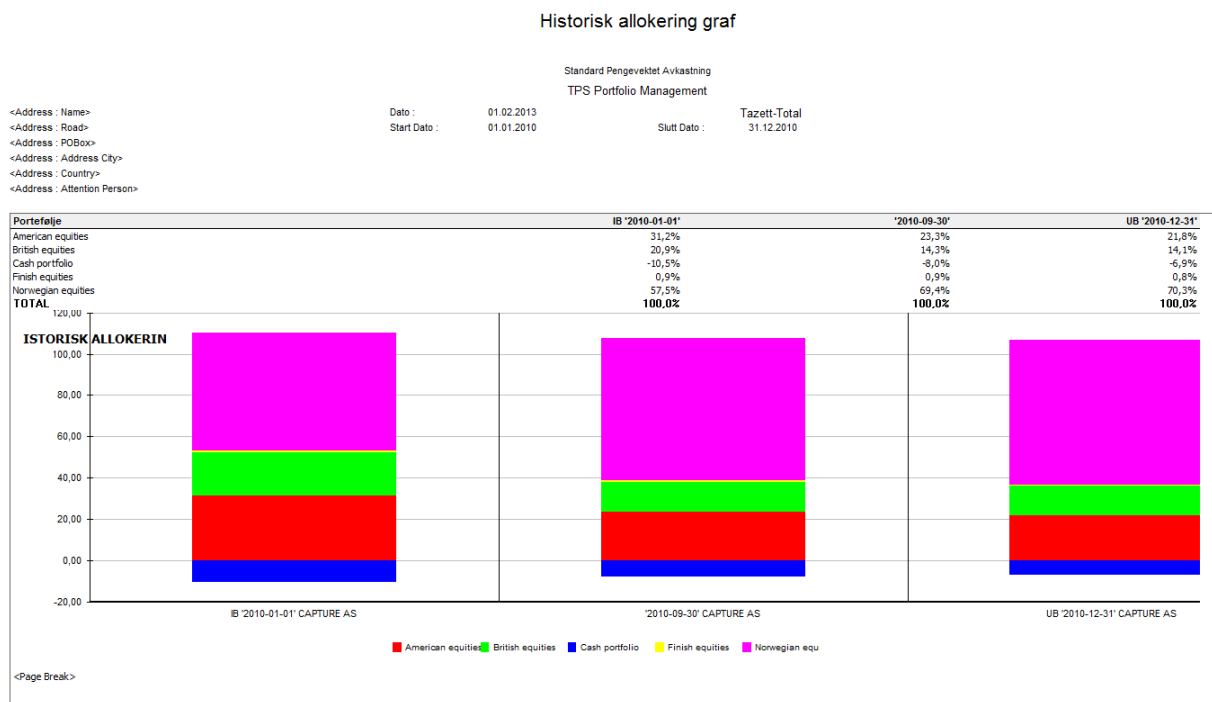
Det er lagt til mulighet for å vise data på en graf etter en metode som heter Stacking, samt at dataseriene kan hentes fra verrdiene nedover i rapporten (radene), og ikke fra kolonnene som er standard.. Dette vil da kombinere alle forekomstene av data i en søyle (se under).

For å få på stacking som vist under, gjør som følger:

- Hent opp rapporten som skal ha stacking, f. eks *Positions* i *Total*.
- Legg til kolonner for Markedsverdi Start (Opening Value), Markedsverdi Siste Kvartal (Markedvalue LastMonthLastDate) og Markedsverdi. Andre kolonner kan slettes.
- Gå på *Graph Setup* fliken, og fyll ut slik:

- Høyreklikk på grafkontrollen, dobbeltklikk på *Stacking* så verdien blir True.
- Høyreklikk på *DataSeriesInRow* så verdien blir True.

Rapporten skal da se ut som dette:



#### 4 rapportkolonner på graf

Før kunne man kun ha med verdier fra 2 rapportkolonner på en graf, nå kan man ha med 4. Dette settes opp under *Graph Setup* (se forrige side for eksempel).

#### Formattering av Y og X akse verdiene på graf

Det kan nå settes formattering på akseverdiene på graf. Dette gjøres i *Properties* for grafen (høyreklikk på grafen i *Graph Setup*), og velge *AxisLabelsX.VtFont.Format* og *AxisLabelsY.VtFont.Format*. Eksempel på dette er rapport som viser datoer på X akse. Format kan da settes til *mmm. yyyy* for å få måned og år, og ikke hele datoen.

#### Column Separator

Det kan nå legges inn skillelinje på rapportene mellom kolonner. Dette gjøres ved å legge til kolonnen *Column Separator* fra *Layout* kolonnene i *Column Setup*. En rapport vil da kunne se ut som dette:

Beholdningsoversikt etter sektor

Standard Beholdningsoversikt  
TPS Portfolio Management

<Address : Name> Dato : 01.02.2013 Tazett-Total  
<Address : Road> Start Dato : 01.01.1990 Slutt Dato : 01.02.2013  
<Address : POBox>  
<Address : Address City>  
<Address : Country>  
<Address : Attention Person>

| Investor                    | Verdipapir Type | Verdipapir       | Verdipapir navn | Beskrivelse     | Modul | Beholdning    | Inngangs kurs | Kostpris i NOK    | Markeds kurs | Markedsverdi i NOK | % Vekt        |
|-----------------------------|-----------------|------------------|-----------------|-----------------|-------|---------------|---------------|-------------------|--------------|--------------------|---------------|
| <b>Investor : HUNDO AS</b>  |                 |                  |                 |                 |       |               |               |                   |              |                    |               |
| <b>Sektor: Cash</b>         |                 |                  |                 |                 |       |               |               |                   |              |                    |               |
| HUNDO AS                    | Cash            | 6544.65.45664    | Brukskonto      | Brukskonto      | Money | 620.000,00    | 1,00          | 620.000           | 1,00         | 620.000            | -15,85        |
| HUNDO AS                    | Cash            | HUNDO-ACCOUNT    | Deposits        | Deposits        | Money | 101.281,03    | 1,00          | 1.417.934         | 1,00         | 1.417.934          | -36,26        |
| HUNDO AS                    | Cash            | HUNDO-TRANSJELÅN | Transjelaen for | Transjelaen for | Money | -3.079.200,00 | 1,00          | -6.158.400        | 1,00         | -6.158.400         | 157,49        |
| <b>Totalt Cash</b>          |                 |                  |                 |                 |       |               |               | <b>-4.120.466</b> |              | <b>-4.120.466</b>  | <b>105,37</b> |
| <b>Sektor: Obligasjoner</b> |                 |                  |                 |                 |       |               |               |                   |              |                    |               |
| HUNDO AS                    | Obligasjoner    | NO.RG54          | Bergenshalvøens | Bergenshalvøens | Bonds | 70.000,00     | 100,00        | 70.000            | 100,00       | 70.000             | -1,79         |
| HUNDO AS                    | Obligasjoner    | NO.ZW31          | Linstow ASA     | Linstow ASA     | Bonds | 140.000,00    | 102,43        | 143.402           | 100,00       | 140.000            | -3,58         |
| <b>Totalt</b>               |                 |                  |                 |                 |       |               |               | <b>213.402</b>    |              | <b>210.000</b>     | <b>-5,37</b>  |
| <b>Investor Total</b>       |                 |                  |                 |                 |       |               |               | <b>-3.907.064</b> |              | <b>-3.910.466</b>  | <b>100,00</b> |

<Page Break>

#### 6. sorteringsnivå

I noen tilfeller er de 5 sorteringsnivåene som er under *Sorting & Grouping* for lite. Det er derfor innført et 6. sorteringsnivå. I dette feltet angis alle sorteringsfelt som ønskes etter det 5. Feltene skilles med komma.

#### Eksempel på *Sorting & Grouping*:

Simple Criteria | Column Setup | **Sorting and Grouping** | Advanced Criteria | Page Setup | Report Header | Graph Setup | File Output | Mail

Sort order for Report: Sum Text: Header Text:  Distinct

1. Address.InvestorGroup  Descending  Insert Sum    Insert Header

2. Transactions.Investor  Descending  Insert Sum    Insert Header

3. Portfolio.PortfolioGroup  Descending  Insert Sum    Insert Header

4. Portfolio.Name  Descending  Insert Sum    Insert Header

5. Transactions.StockType  Descending  Insert Sum    Insert Header

6+ Transactions.Symbol,Transact ...  Aggregate  Grand Total   Line Spacing on Report Lines

Grouping | Start Total | Top n |

Group Field: Transactions.TradeDate

Page break after change in: Transactions.Investor

Sort Column  Descending

| Portefølje navn   | Portefølje      | Markedsverdi i «BaseCurrency» | Indeks Kode | Indeks Avkastning | Indeks Vel |
|-------------------|-----------------|-------------------------------|-------------|-------------------|------------|
| Investor:         | Investor1       |                               |             |                   |            |
| PortfolioGroup:   | PortfolioGroup1 |                               |             |                   |            |
| Name:             | Name1           |                               |             |                   |            |
| AAA               | BBB             | 2.000                         | DDD         | 400,00            |            |
| <b>Name Total</b> |                 | <b>2.000</b>                  |             |                   |            |

## Tazett-MultiReport

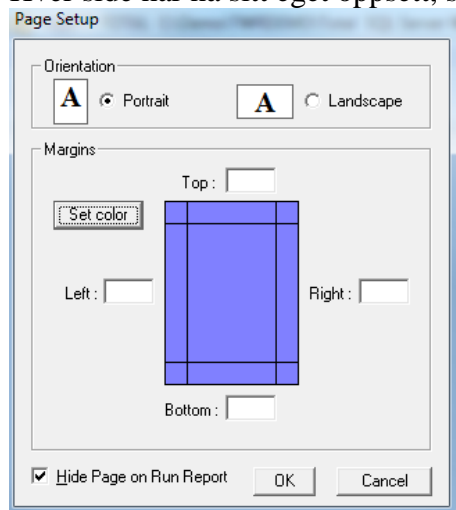
Det er gjort en del endringer på *Multi Report* (Under *Report* menyen).

### **Sidenummerering**

Man kan sette inn en formel for sidenummerering på *MultiReport* i et felt. Dette gjøres ved å angi denne verdien i *Formula* property på feltet : Side «PageNumber»

### **Page Setup per side**

Hver side har nå sitt eget oppsett, som finnes under *File, Page Setup...*



*Portrait / Landscape* er om siden skal være stående eller liggende.

*Set color* bestemmer bakgrunnsfarge på siden.

*Hide Page on Run Report* gjør at siden ikke blir skrevet ut når rapporten kjøres.

### **Run Page**

Det er mulig å kjøre kun siden man står på i *MultiReport*, for å slippe å kjøre hele rapporten.

Dette brukes hvis det er mange sider på rapporten, og den er ganske tung å kjøre.

Dette gjøres fra *Design Mode*, under *File, Run Page*.