

Värdepappersfonder, tillgångar och skulder

Kvartal 2004

FM0403

A. Allmänna uppgifter

A.1 Ämnesområde

Finansmarknad

A.2 Statistikområde

Finansiella företag utom försäkringsföretag.

A.3 Statistikprodukten ingår i Sveriges officiella statistik

A.4 Ansvarig

Myndighet/organisation:

Finansinspektionen

Box 7831

103 98 STOCKHOLM

Kontaktperson: Brita Åberg, Enheten för statistik , t om 1:a oktober

Telefon: 08-787 81 49

Telefax: 08-24 13 35

E-post: brita.aberg@fi.se

A.5 Producent

Myndighet/organisation: Statistiska centralbyrån

Box 24 300

104 51 STOCKHOLM

Kontaktperson: Julie Bonde

Telefon: 08-506 945 39

Telefax: 08-506 949 43

E-post: julie.bonde@scb.se

A.6 Uppgiftsskyldighet

Uppgiftsinsamlingen regleras av Finansinspektionens föreskrifter, FFFS 2001:18

A.7 Sekretess och regler för behandling av personuppgifter

I myndigheternas särskilda verksamhet för framställning av statistik gäller sekretess enligt 9 kap. 4 § sekretesslagen (1980:100).

Vid automatiserad behandling av personuppgifter gäller reglerna i personuppgiftslagen (1998:204). På statistikområdet finns dessutom särskilda regler för personuppgiftsbehandling i lagen (2001:99) och förordningen (2001:100) om den officiella statistiken.

A.8 Gallringsföreskrifter

A.9 EU-reglering

A.10 Syfte och historik

Syftet är att visa förändringar i fondernas tillgångar och skulder. Statistiken ska också redovisa antalet fondandelar, fondandelsvärde, placering av likvida medel samt belopp för sålda och inlösta fondandelar. Slutligen ska statistiken redogöra för hur fondernas tillgångar är fördelade samt värdepapperstransaktioner under kvartalet. Statistik för värdepappersfonder sammanställs varje kvartal sedan 1985. T.o.m. tredje kvartalet 1991 redovisades endast gruppen värdepappersfonder totalt. Därefter gjordes även en uppdelning på typ av fond enligt gällande lagstiftning. Till värdepappersfonder räknas aktiefonder, räntefonder och övriga fonder. Tidigare särredovisades också allemansfonder och försäkringspremiefonder. Uppgiftslämnare är fonder som står under Finansinspektionens tillsyn, vilket är de fonder som är registrerade i Sverige.

A.11 Statistikanvändning

Statistiken utgör ett viktigt underlag i finans- och nationalräkenskaperna. Den används därutöver bl.a. av Finansinspektionen i dess tillsynsverksamhet, av Riksbanken, av instituten själva för marknadsanalyser och av media.

A.12 Uppläggning och genomförande

Uppgifterna insamlas av Finansinspektionen den 20:e i månad efter kvartalsskifte från samtliga värdepappersfonder som står under tillsyn av Finansinspektionen. Undersökningen är en totalundersökning. Primäruppgifterna avser fondandelar, tillgångar och skulder samt specifikationer av fondpapper och andra finansiella instrument. Insamling sker på elektronisk blankett med inbyggda kontrollfunktioner. Institutet erbjuder tillgång till SCB:s företagsregister för fördelning av konton på motparternas institutionella sektorer (banker, icke-finansiella företag, hushåll etc.).

A.13 Planerade förändringar i kommande undersökningar

Under 2004 utformas en ny blankett för inrapportering. Den planeras tas i bruk från och med 1:a kvartalet 2005.

B. Kvalitetsdeklaration

0 Inledning

1 Innehåll

1.1 Statistiska målstorheter

Värden i miljoner kronor för ekonomiska variabler (finansiella instrument) samt antalsuppgifter. Uppgifter om ställningsvärden och transaktioner.

1.1.1 Objekt och population

Statistiken avser samtliga Värdepappersfonder som står under Finansinspektionens tillsyn. Utlandsregistrerade värdepappersfonder med verksamhet i Sverige ingår inte.

1.1.2 Variabler

<u>Variabel</u>	<u>Beskrivning</u>
Rad A13-A19	mv = marknadsvärde, ks = kvartalsslut, uk = under kvartalet
Rad A1-A12	Fondandelar, utdelningar och avgifter, uk Typ av värdepappersfond

Rad A20-A26	Noteringar m.m., andel av tillgångarna ks
Rad B1-B20, C1-C20	Beräkning av fondens värde, tillgångar, mv ks
Rad B21-B41, C21-C41	Beräkning av fondens värde, skulder, mv ks
varav Rad B29-B41, C29-C41	Fondens värde fördelat på sektorer, mv ks
Rad D1-D24	Transaktioner fördelat på sektorer, -inbetalt sålda/utbetalt inlösta fondandelar uk. Siffrorna inkluderar återinvesterad utdelning
Rad E, F, 1-30, G, H, I, 1-53	Specifikation av fondpapper och andra finansiella instrument, -tillgångar, mv ks, samt netto köp/förs uk
varav Rad E, F, G, H, I 1-9	Belåningsbara statsskuldförbindelser m.m. uppdelade efter emittent
varav Rad E, F, G, H, I 10-19	Certifikat, uppdelade efter emittent
varav Rad E, F, G, H, I, 20-30	Obligationer, uppdelade efter emittent
varav Rad G, H, I 31-39	Börsnoterade instrument, uppdelade efter emittent
varav Rad G, H, I 40-49	Övriga handelsnoterade instrument, uppdelade efter emittent
varav Rad G, H, I 50	Konvertibla skuldebrev
varav Rad G, H, I 51	Derivatinstrument
varav Rad G, H, I 52	Övriga innehav

1.1.3 Statistiska mått

Summa i miljoner kronor av resp tillgångs- och skuldpost. Antalet aktiva fonder.

1.1.4 Redovisningsgrupper

Under kvartal 1 redovisas värdepappersfonderna efter fondtyp i aktie-, ränte- och övriga fonder. Från och med kvartal 2 redovisas aktie-, ränte-, bland-, fond-i-fond- och övriga fonder.

1.1.5 Referenstider

Sista dagen i varje kvartal, samt transaktioner under respektive kvartal.

1.2 Fullständighet

2 Tillförlitlighet

2.1 Tillförlitlighet totalt

Totalundersökningar. Ekonomiska uppgifter som hämtas eller beräknas från redovisningen möjliggör bra kvalitet på uppgifterna. Begränsade resurser för granskning av uppgifterna kan något minska kvalitén.

2.2 Osäkerhetskällor

2.2.1 Urval

Totalundersökning av värdepappersfonder under Finansinspektionens tillsyn.

2.2.2 Ramtäckning

2.2.3 Mätning

2.2.4 Svartsbortfall

Förekommer ej

2.2.5 Bearbetning

Primäruppgifterna insamlas elektroniskt. Uppgifterna jämförs med närmast föregående kvartal för att identifiera och kontrollera felaktigheter och större förändringar, ofta i samråd med uppgiftslämnarna. Konsistenskontroller görs inom resp blankett. Värdepappersfonder med större balansomslutning granskas mer noga än mindre fonder. Granskningskontrollerna fångar de större felen. Få kvarstående ifyllnadsfel av mindre betydelse kan förekomma t.ex. att belopp placerats på fel rad i specifikationer. På aggregerad nivå görs motsvarande kontroller.

2.2.6 Modellantaganden

Används ej

2.3 Redovisning av osäkerhetsmått

Redovisas ej

3 Aktualitet

3.1 Frekvens

Kvartal

3.2 Framställningstid

Ca 7 veckor efter det undersökta kvartalets utgång.

3.3 Punktlighet

Kvartalsstatistiken har normalt en god tidshållning. Fr.o.m. kv1 2002 används ett nytt elektroniskt inrapporteringssystem.

4 Jämförbarhet och sam användbarhet

4.1 Jämförbarhet över tiden

Växelkursförändringar är en källa till osäkerhet vid studier över tiden av utvecklingen av poster i utländsk valuta.

En omarbetad blankett infördes fr.o.m.1998 kv 2 med syftet att bättre motsvara de krav som ställs i bl.a. European System of Accounts (ESA 95).

Fr.o.m. 2000 kv 4 tillkom sektorn socialförsäkring, med undersektor Premiensionsmyndigheten, PPM, för att tydliggöra sparandet i form av premiensionsmedel.

I samband med övergången till elektronisk inrapporteringssystem har blanketten utökats något med bland annat en finare fördelning av olika fondtyper.

4.2 Jämförbarhet mellan grupper

4.3 Sam användbarhet med annan statistik

5 Tillgänglighet och förståelighet

5.1 Spridningsformer

Värdepappersfonder publiceras i SM Värdepappersfonder FM 37 på svenska och engelska. SM:et utkommer även som web-SM samt som pdf-fil på www.scb.se. Statistiken finns även i de offentliga databaserna där längre tidsserier kan erhållas. I samband med att ett nytt SM publiceras publiceras även ett pressmeddelande på svenska och engelska.

5.2 Presentation

Tabeller och diagram över värdepappersfonderna totalt samt undergrupperna aktiefonder, räntefonder och övriga fonder för de senaste kvartalen med beskrivande text. Nettosparande samt fondförmögenhet fördelat på sektorer.

5.3 Dokumentation

5.4 Tillgång till primärmaterial

Primäruppgifterna är skyddade av sekretesslagen. Se pkt A7 ovan. Specialbearbetningar kan göras av SCB på beställning mot ersättning enligt fastställd taxa.

5.5 Upplysningstjänster

Kontaktpersoner betr. statistiken
Julie Bonde SCB ES/FM tel 08-506 945 39
e-post: julie.bonde@scb.se

SCB:s publikationer kan beställas från Publikationstjänsten, 701 89 Örebro, tfn. 019-17 68 00 .

2004-10-05