

Värdepappersfonder, tillgångar och skulder

Kvartal 2001

FM0403

A. Allmänna uppgifter

A.1 Ämnesområde

Finansmarknad

A.2 Statistikområde

Finansiella företag utom försäkringsföretag.

A.3 Statistikprodukten ingår i Sveriges officiella statistik

Ja

A.4 Ansvarig

Myndighet/organisation:

Finansinspektionen

Box 7831

103 98 STOCKHOLM

Kontaktperson: Brita Åberg, Enheten för statistik

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: Hans Olsson

Telefon: 08-506 942 29

Telefax: 08-506 945 71

E-post: hans.olsson@scb.se

A.6 Uppgiftsskyldighet

Uppgiftsinsamlingen regleras av Finansinspektionens föreskrifter, FFFS 1998:10

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) och datalagen (1973:289) för behandling som påbörjats före personuppgiftslagens ikraftträdande. På statistikområdet finns dessutom särskilda regler för personuppgiftsbehandling i lagen (1995:606) och förordningen (1995:1060) om vissa personregister för officiell statistik.

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 aktietransaktioner 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.

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 SCB 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 blankett. För att öka kvaliteten bifogas en diskett, med kontrollfunktioner, där de institut som vill kan fylla i sina blankettvärden. Instituterna erbjuds 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

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. De utgör cirka 20 procent av det totala fondsparandet.

1.1.2 Variabler

<u>Variabel</u>	<u>Beskrivning</u>
Rad 101-107	mv = marknadsvärde, ks = kvartalsslut, uk = under kvartalet Fondandelar, utdelningar och avgifter, uk
Rad 201-205	Typ av värdepappersfond
Rad 301-305	Noteringar m.m., andel av tillgångarna ks
Rad 400-430	Beräkning av fondens värde, tillgångar, mv ks
Rad 501-520	Beräkning av fondens värde, skulder, mv ks
varav Rad 511-518	Fondens värde fördelat på sektorer, mv ks
Rad 600-608	Transaktioner fördelat på sektorer, -inbetalt sålda/utbetalt inlösta fondandelar uk. Siffrorna inkluderar återinvesterad utdelning
Rad 700-780	Specifikation av fondpapper och andra finansiella instrument, -tillgångar, mv ks, samt netto köp/förs uk
varav Rad 701-710	Belåningsbara statsskuldförbindelser m.m. uppdelade efter emittent
varav Rad 711-720	Certifikat, uppdelade efter emittent
varav Rad 721-740	Obligationer, uppdelade efter emittent
varav Rad 741-750	Noterade aktier, uppdelade efter emittent
varav Rad 751-760	Onoterade aktier, uppdelade efter emittent
varav Rad 761-770	Andelar i andra fonder
varav Rad 780	Derivatinstrument

1.1.3 Statistiska mått

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

1.1.4 Redovisningsgrupper

Värdepappersfonderna efter fondtyp i aktie-, ränte- 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 manuellt. 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 7-8 veckor

3.3 Punktlighet

Kvartalsstatistiken har normalt en god tidshållning. Enstaka förseningar på upp till två veckor har förekommit.

4 Jämförbarhet och sammanvändbarhet

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 Premiepensionsmyndigheten, PPM, för att tydliggöra sparandet i form av premiepensionsmedel.

4.2 Jämförbarhet mellan grupper

4.3 Sammanvändbarhet med annan statistik

5 Tillgänglighet och förståelighet

5.1 Spridningsformer

Värdepappersfonder publiceras i SM Värdepappersfonder FM 37. SM:et utkommer även som web-SM samt som pdf-fil på www.scb.se.

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 Upplýsningstjänster

Kontaktpersoner betr. statistiken
Hans Olsson SCB ES/FM tel 08-506 942 29
e-post: hans.olsson@scb.se

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