

Värdepappersfonder, tillgångar och skulder

Kvartal 2005

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: Peter Fitger, Enheten för analys
Telefon: 08-787 80 00
Telefax: 08-24 13 35
E-post: peter.fitger@fi.se

A.5 Producent

Myndighet/organisation: Statistiska centralbyrån
Box 24 300
104 51 STOCKHOLM

Kontaktperson: Marta Petersson
Telefon: 08-506 945 04
Telefax: 08-506 949 43
E-post: marta.petersson@scb.se

A.6 Uppgiftsskyldighet

Uppgiftsinsamlingen regleras av Finansinspektionens författningssamling, FFFS 2004:12

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

Gallringsföreskrifter saknas.

A.9 EU-reglering

Statistiken är ej EU-reglerad.

A.10 Syfte och historik

Syftet är att visa förändringar av tillgångar och skulder hos värdepapperfonder som står under Finansinspektionens tillsyn vilket är de fonder som är registrerade i Sverige. 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 värdepappersfonderna 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.

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 värdepappersfonder 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.

Primäruppgifterna avser fondandelar, tillgångar och skulder samt specifikationer av fondpapper och andra finansiella instrument. Insamling sker på elektronisk blankett med inbyggda kontrollfunktioner. Värdepappersfonder 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

Inga planerade förändringar.

B. Kvalitetsdeklaration

0 Inledning

Statistik för värdepappersfonder tas fram varje kvartal med syfte att visa förändringar av tillgångar och skulder hos värdepappersfonder som står under Finansinspektionens tillsyn. Genom detta visas även olika sektorer, såsom hushåll, icke-finansiella företag och utlandet, ägande i svenska fonder.

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 A1-A6	mv = marknadsvärde, ks = kvartalsslut, uk = under kvartalet
Rad A7-A13	Typ av värdepappersfond
Rad B1-B47	Fondandelar, utdelningar och avgifter, uk
Rad B48-B73	Beräkning av fondens värde, tillgångar, mv ks
Rad B74-B103	Beräkning av fondens värde, skulder, mv ks
Rad C1-C58	Fondens värde fördelat på sektorer, mv ks
Rad D,E, F,G	Transaktioner fördelat på sektorer, -inbetalt sålda/utbetalt inlösta fondandelar uk. Siffrorna inkluderar återinvesterad utdelning
	Specifikation av fondpapper och andra finansiella instrument, -tillgångar, mv ks, samt netto köp/förs uk

En fullständig blankett "Kvartalsrapport för investeringsfonder" finns som bilaga 13 i Finansinspektionens författningssamling, FFFS 2004:12 på Finansinspektionens hemsida www.fi.se.

1.1.3 Statistiska mått

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

1.1.4 Redovisningsgrupper

Från och med kvartal 2 2004 redovisas värdepappersfonderna efter fondtyp i aktie-, ränte-, bland-, fond-i-fonder och övriga fonder.

1.1.5 Referenstider

Sista dagen i varje kvartal för balanser och hela kvartal för transaktionerna.

1.2 Fullständighet

2 Tillförlitlighet

2.1 Tillförlitlighet totalt

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

2.2 Osäkerhetskällor

2.2.1 Urval

Totalundersökning av värdepappersfonder under Finansinspektionens tillsyn – därmed ingen urvalsosäkerhet.

2.2.2 Ramtäckning

Finansinspektionen tillhandahåller förteckningar över de värdepappersfonder som undersökningen skall avse. Det finns inga brister i dessa förteckningar.

2.2.3 Mätning

SCB bedömer att uppgiftslämnarna inte har några större problem att förstå vilka uppgifter som efterfrågas eller att det kan finnas några problem att finna

uppgifterna i värdepappersfondernas bokföring. Primäruppgifterna insamlas elektroniskt.

2.2.4 Svartsbortfall

Förekommer ej

2.2.5 Bearbetning

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 granskning. Framställningen av resultattabeller är relativt enkel då det är en totalundersökning utan bortfall. Risken för bearbetningsfel är mycket liten.

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 en god tidshållning.

4 Jämförbarhet och sammanvändbarhet

4.1 Jämförbarhet över tiden

- 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.
- I samband med övergången till elektronisk inrapporteringssystem fr. o. m. kv1 2001 har blanketten utökats något med bland annat en finare fördelning av olika fondtyper.

4.2 Jämförbarhet mellan grupper

4.3 Sammanvändbarhet med annan statistik

Statistiken används vid framställning av Sparbarometern.

5 Tillgänglighet och förståelighet

5.1 Spridningsformer

Värdepappersfonder publiceras i SM Värdepappersfonder FM 37 på svenska

och engelska. SM:et utkommer som web-SM samt som pdf-fil på www.scb.se. Statistiken finns även i Sveriges Statistiska Databaser, SSD, där tidsserier från kv2 1998 kan erhållas. I samband med att ett nytt SM publiceras läggs även ett pressmeddelande ut 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

Uppgiftsinsamlingen regleras av Finansinspektionens författningssamling, FFFS 2004:12 som finns tillgänglig på Finansinspektionens hemsida www.fi.se.

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

Marta Petersson SCB MP/FM tel 08-506 945 04

e-post: marta.petersson@scb.se

Daniel Hansson SCB MP/FM tel 08-506 940 98

e-post: daniel.hansson@scb.se

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