

Värdepappersfonderna 2008

FM0403

I denna beskrivning redovisas först allmänna och legala uppgifter om undersökningen samt dess syfte och historik. Därefter redovisas undersökningens innehåll och tillförlitlighet samt hur den genomförs och hur man kan ta del av resultaten. Genom att klicka på en rubrik i innehållsförteckningen kommer man direkt till aktuellt avsnitt.

Innehållsförteckning

Innehållsförteckning	1
A Administrativa och legala uppgifter	2
A.1 Ämnesområde	2
A.2 Statistikområde	2
A.3 SOS-klassificering	2
A.4 Statistikansvarig	2
A.5 Statistikproducent	3
A.6 Uppgiftsskyldighet	3
A.7 Sekretess och regler för behandling av personuppgifter	3
A.8 Gallringsföreskrifter	3
A.9 EU-reglering	3
A.10 Syfte och historik	3
A.11 Statistik användning	4
A.12 Uppläggning och genomförande	4
A.13 Internationell rapportering	4
A.14 Planerade förändringar i kommande undersökningar	4
B Kvalitetsdeklaration	4
B.1 Inledning	4
B.2 Innehåll	4
2.1 Statistiska målstorheter	4
2.1.1 Objekt och population	4
2.1.2 Variabler	5
2.1.3 Statistiska mått	5
2.1.4 Redovisningsgrupper	5
2.1.5 Referenstider	5
2.2 Fullständighet	5
B.3 Tillförlitlighet	5
3.1 Tillförlitlighet totalt	5
3.2 Osäkerhetskällor	5
3.2.1 Urval	5
3.2.2 Ramtäckning	5

3.2.3	Mätning	5
3.2.4	Svarsbortfall	5
3.2.5	Bearbetning	5
3.2.6	Modellantaganden	5
3.3	Redovisning av osäkerhetsmått	6
B.4	<i>Aktualitet</i>	6
4.1	Frekvens	6
4.2	Framställningstid	6
4.3	Punktlighet	6
B.5	<i>Jämförbarhet och sam användbarhet</i>	7
5.1	Jämförbarhet över tiden	7
5.2	Jämförbarhet mellan grupper	7
5.3	Sam användbarhet med annan statistik	7
B.6	<i>Tillgänglighet och förståelighet</i>	7
6.1	Spridningsformer	7
6.2	Presentation	7
6.3	Dokumentation	7
6.4	Tillgång till primärmaterial	7
6.5	Uppl ynningstjänster	8

A Administrativa och legala uppgifter

A.1 Ämnesområde

Ämnesområde: Finansmarknad

A.2 Statistikområde

Statistikområde: Finansiella företag utom försäkringsföretag.

A.3 SOS-klassificering

Tillhör (SOS): Ja

För undersökningar som ingår i Sveriges officiella statistik  Sveriges officiella statistik gäller särskilda regler när det gäller kvalitet och tillgänglighet, se http://www.scb.se/templates/Standard_55322.asp

A.4 Statistikansvarig

Myndighet/organisation: Finansinspektionen
Postadress: Box 7821, 103 97 STOCKHOLM
Besöksadress: Brunnsgatan 3
Kontaktperson: Peter Fitger
Telefon: 08-787 80 00
Telefax: 08-24 13 35

A.5 Statistikproducent

Myndighet/organisation: Statistiska centralbyrån

Postadress: Box 24 300

104 51 STOCKHOLM

Besöksadress: Karlavägen 100

Kontaktperson: Marta Petersson

Telefon: 08-506 945 04

Telefax: 08-66 777 88

E-post: förnamn.efternamn@scb.se

A.6 Uppgiftsskyldighet

Uppgiftsskyldighet föreligger och regleras i Finansinspektionens författningssamling, FFFS 2004:12 enligt förordning 2004:75 och lag 2004:46 om investeringsfonder.

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

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 värdepappersfonder som står under Finansinspektionens tillsyn (fonder som är registrerade i Sverige). Statistiken ska också redovisa fondandförmögenheten samt belopp för sålda och inlösta fondandelar. Slutligen ska statistiken redogöra för hur fondernas tillgångar är fördelade samt sektorfördelat fondvärde.

Statistik för värdepappersfonder har sammanställts varje kvartal sedan 1985. T.o.m. tredje kvartalet 1991 redovisades värdepappersfonderna totalt. Därefter gjordes även en uppdelning på typ av fond enligt FFFS 2004:12. Fondtyperna som redovisas är aktiefonder, korta och långa räntefonder, blandfonder, fond-i-fonder och övriga fonder. Tidigare särredovisades också allemansfonder och försäkringspremiefonder. Under 2007 har premiepensionsmyndigheten (PPM) flyttats från socialförsäkringssektorn till sektorn finansiella företag enligt riktlinjer från Eurostat.

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 branchintressenter för marknadsanalyser, av media samt vid beräkning av penningmängden M3.

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 Internationell rapportering

Ingen internationell rapportering sker.

A.14 Planerade förändringar i kommande undersökningar

Nya föreskrifter planeras att träda i kraft den 23 juli 2008.

B Kvalitetsdeklaration

B.1 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.

B.2 Innehåll

2.1 Statistiska målstorheter

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

2.1.1 Objekt och population

Statistiken avser samtliga värdepappersfonder som står under Finansinspektionens tillsyn. Utlandsregistrerade värdepappersfonder med verksamhet i Sverige liksom svenska fondbolags utlandsregistrerade fonder ingår inte.

2.1.2 Variabler

- Typ av värdepappersfond
- Fondandelar, utdelningar och avgifter
- Fondens tillgångar och skulder
- Fondens värde fördelat på fondandelsägare
- Transaktioner fördelat på fondandelsägare
Inbetalt sålda/utbetalt inlösta fondandelar (inkl. återinvesterad utdelning)
- Specifikation av fondens investeringar i finansiella instrument.
Marknadsvärden vid kvartalets utgång samt transaktioner under kvartalet.

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

2.1.3 Statistiska mått

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

2.1.4 Redovisningsgrupper

Från och med andra kvartalet 2004 redovisas värdepappersfonderna efter fondtyp uppdelad på aktiefond, kort och lång räntefond, blandfond, fond-i-fonder och övriga fonder.

2.1.5 Referenstider

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

2.2. Fullständighet

B.3 Tillförlitlighet

3.1 Tillförlitlighet totalt

Totalundersökning. Ekonomiska uppgifter som hämtas eller beräknas från redovisningen möjliggör bra kvalitet på statistiken.

3.2 Osäkerhetskällor

3.2.1 Urval

Ingen urvalsosäkerhet förekommer då det är totalundersökningarna av värdepappersfonder som är under Finansinspektionens tillsyn.

3.2.2 Ramtäckning

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

3.2.3 Mätning

SCB bedömer att uppgiftslämnarna inte har några större problem att förstå vilka uppgifter som efterfrågas.

Ägande av fonder via depå eller liknande, exempelvis genom nätmäklare, hamnar i statistiken under finansiella företag. I dagens läge går det inte att urskilja hur mycket som är förvaltade depåer och hur mycket som direktägs av finansiella företag och inte heller vem som är slutlig ägare till depåerna.

Det uppkommer en dubbelräkning i samband med att fonder placerar i andra fonder som också är rapportörer. Dubbelräkningen sker då, exempelvis hushållen, köper andelar i en fond-i-fond som sedan i sin tur köper fondandelar i egna och/eller andra fondbolag.

Primäruppgifterna insamlas elektroniskt. För sektorfördelning finns SCB:s företagsdatabas att tillgå för rapportörerna.

3.2.4 Svartsbortfall

Förekommer ej.

3.2.5 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 anses mycket liten.

3.2.6 Modellantaganden

Används ej.

3.3 Redovisning av osäkerhetsmått

Redovisas ej.

B.4 Aktualitet

4.1 Frekvens

Kvartal.

4.2 Framställningstid

Ca 7 veckor.

4.3 Punktlighet

Mycket god.

B.5 Jämförbarhet och sam användbarhet

5.1 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 Premiensionsmyndigheten, PPM, för att tydliggöra sparandet i form av premiensionsmedel. PPM har fr.o.m. andra kvartalet 2007 omklassificerats till sektorn finansiella företag.
- I samband med övergången till elektroniskt inrapporteringssystem fr. o. m. första kvartalet 2001 har blanketten utökats något med bland annat en finare fördelning av olika fondtyper.
- Första kvartalet 2005 ändrades blanketten med finare motpartsnedbrytning samt att uppdelningen SEK/utländsk valuta togs bort.

5.2 Jämförbarhet mellan grupper

Redovisningen följer den sektorindelning som finns i INSEKT 2000.

5.3 Sam användbarhet med annan statistik

Statistiken används vid framställning av Sparbarometern, finansräkenskaperna samt finansmarknadsstatistik.

B.6 Tillgänglighet och förståelighet

6.1 Spridningsformer

Värdepappersfonder publiceras i SM Värdepappersfonder FM 37 på svenska och engelska. SM:et utkommer som webb-SM samt som pdf-fil på www.scb.se. Statistiken finns även i Sveriges Statistiska Databaser, SSD, där tidsserier från andra kvartalet 1998 kan erhållas. I samband med att ett nytt SM publiceras läggs även ett pressmeddelande ut på svenska och engelska.

6.2 Presentation

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

6.3 Dokumentation

Uppgiftsinsamlingen regleras av Finansinspektionens författningssamling, FFFS 2004:2, 2004:12 och 2005:14 som finns tillgängliga på Finansinspektionens hemsida www.fi.se.

6.4 Tillgång till primärmaterial

Primäruppgifterna är skyddade av sekretesslagen, se punkt A7. Specialbearbetningar kan göras av SCB på beställning mot ersättning enligt fastställd taxa.

6.5 Upplysningstjänster

Kontaktpersoner beträffande statistiken

Johannes Holmberg SCB MP/BFM tel 08-506 945 11

e-post: förnamn.efternamn@scb.se

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

e-post: förnamn.efternamn@scb.se

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

e-post: förnamn.efternamn@scb.se

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