

SM Fm37

Sverige N

P3/7 Fm37 2001/1

Ex 1

2001-02-21

SCB:s bibliotek
Box 24 300
S-104 51 STOCKHOLM

Värdepappersfonderna 4:e kvartale

Mutual Funds – fourth quarter 2000



» i korta drag

61,3 mdkr nettosparades i fonder 4:e kvartalet 2000

Det sammanlagda värdet för fonder registrerade i Sverige minskade under fjärde kvartalet 2000 från 777,6 mdkr till 767,7 mdkr. Då nettoköpen av fondandelar, inkl. återinvesterade utdelningar, var 61,3 mdkr, innebär detta att den genomsnittliga värdeförändringen var minus 9,2 procent. Under fjärde kvartalet sjönk generalindex med 12,0 procent. Nettoköpen av fondandelar totalt, 61,3 mdkr, var 50,3 mdkr högre än föregående kvartal, vilket beror på sparandet i premiepensionssystemet som var 51,2 mdkr. Om sparandet i premiepensionssystemet exkluderas var sparandet 0,8 mdkr lägre än föregående kvartal och 2,1 mdkr lägre än motsvarande period förra året.

Hushållen fondsparande för 0,2 mdkr 4:e kvartalet 2000

Hushållen nettoköpte för 0,2 mdkr under fjärde kvartalet 2000, vilket är en minskning jämfört med föregående kvartal och även jämfört med kvartal fyra 1999. Hushållen har minskat sin fondförmögenhet med 41,2 mdkr under kvartalet, från 454,3 till 413,1 mdkr.

Nettosparande i livförsäkringsanknutna fonder, s.k. unit-linked, uppgick till 7,0 mdkr för fjärde kvartalet, vilket är något lägre än under fjärde kvartalet 1999, då det var 7,3 mdkr.

Aktiefondernas andel minskar

Aktiefondernas andel av det totala fondsparandet under kvartalet minskade från 77,3 procent till 50,0 procent. Andra fonder ökade sin andel kraftigt från 22,0 procent till 49,2 procent. Detta beror till stor del på PPM valet där många valde att spara i blandfonder. Aktiefonderna minskade sin andel av den totala fondförmögenheten under kvartalet från 76,0 till 72,4 procent. Räntefondernas andel ökade med 0,2 procentenheter medan andra fonder ökade sin andel, från 16,7 till 20,1 procent.



Statistiska centralbyrån
Statistics Sweden

Hans Olsson, SCB, tfn 08-506 942 29, hans.olsson@scb.se

Statistiken har producerats av SCB, på uppdrag av Finansinspektionen, som ansvarar för officiell statistik inom området.

ISSN 1402-2125 Serie FM – Finansmarknad 37 SM 0101. Utkom den 16 februari 2001.

Tidigare publicering: Se avsnittet Fakta om statistiken.

Utgivare av Statistiska meddelanden är Svante Öberg, SCB.

Innehåll

Tabeller	3
1. Antal aktiva fonder	3
2. Fondförmögenhet, mkr	3
3. Nettosparande inkl. återinvesterad utdelning fördelat på sektorer, mkr	3
4. Fondförmögenhet fördelat på sektorer, mkr	4
5. Bruttosparande i fonder, totalt, fördelat på fondtyp, mkr	4
6. Bruttosparande i fonder, hushåll, fördelat på fondtyp, mkr	5
7. Placeringar, fonder totalt, mkr	6
 Diagram	 7
1. Nettosparande, totalt exkl. hushåll samt hushåll, mdkr	7
2. Nettosparande, fördelat på fondtyp, mdkr	7
3. Fondtypernas andel av det totala fondvärdet, 767,7 mdkr 4:e kvartalet 2000-12-31	8
 Fakta om statistiken	 9
Detta omfattar statistiken	9
Definitioner och förklaringar	9
Så görs statistiken	9
Statistikens tillförlitlighet	9
Bra att veta	9
Annan statistik	10
 Summary	 11
SEK 61.3 billion in net savings for mutual funds in the fourth quarter 2000	11
SEK 0.2 billion in net savings for the household sector in the second quarter 2000	11
Lower share of net saving in equity funds	11

Tabeller

1. Antal aktiva fonder

Number of active funds

		00kv4	00kv3	00kv2	00kv1	99kv4	99kv3	99kv2
Aktiefonder	<i>Equity funds</i>	344	341	309	295	288	271	289
Räntefonder	<i>Bond and money market funds</i>	90	90	89	89	89	85	91
Andra fonder	<i>Other funds</i>	110	79	64	60	54	52	50
SUMMA	TOTAL	544	510	462	444	431	408	430

2. Fondförmögenhet, mkr

Market value of funds, SEK million

		00kv4	00kv3	00kv2	00kv1	99kv4	99kv3	99kv2
Aktiefonder	<i>Equity funds</i>	556 165	590 975	585 454	603 497	551 094	412 520	406 600
Räntefonder	<i>Bond and money market funds</i>	57 344	56 609	55 823	55 144	53 099	53 962	52 630
Andra fonder	<i>Other funds</i>	154 222	130 048	125 746	130 453	116 095	90 555	88 396
SUMMA	TOTAL	767 731	777 632	767 023	789 094	720 288	557 037	547 626

3. Nettosparande inkl. återinvesterad utdelning fördelat på sektorer, mkr

Net savings incl. Reinvested dividends specified on sectors, SEK million

		00kv4	00kv3	00kv2	00kv1	99kv4	Summa 00kv1-4
Hushåll	<i>Households</i>	205	2 443	-274	5 101	1 138	7 475
Hushållens ideella organisationer	<i>Non profit institutions serving households</i>	-74	-114	1 886	756	2 242	2 454
Svenska finansiella företag Sw.	<i>financial corporations</i>	7 198	6 410	10 920	13 576	8 157	38 104
varav unit linked	<i>of which unit linked</i>	6 968	5 129	8 527	11 434	7 329	32 058
Svenska icke finansiella företag Sw.	<i>Non-financial corporations</i>	991	892	1 847	2 167	849	5 897
Kommuner	<i>Local government</i>	641	495	445	692	-760	2 273
Socialförsäkring	<i>Social security funds</i>	51 592	-	-	-	-	51 592
varav PPM	<i>of which PPM</i>	51 192	-	-	-	-	51 192
Övriga svenska innehavare	<i>Other domestic owners</i>	87	-31	-180	5	-560	-119
Utländska innehavare	<i>Foreign owners</i>	672	867	1 079	2 223	1 222	4 841
SUMMA	TOTAL	61 312	10 962	15 723	24 520	12 288	112 517

4. Fondförmögenhet fördelat på sektorer, mkr

Market value of funds specified on sector, SEK million

	00kv4	00kv3	00kv2	00kv1	99kv4	99kv3
Hushåll <i>Households</i>	413 140	454 334	453 621	485 325	452 421	346 279
Hushållens ideella organisationer <i>Non profit institutions serving households</i>	37 651	38 530	38 070	37 496	35 258	19 143
Svenska finansiella företag <i>Sw. financial corporations</i>	201 254	213 189	205 488	196 101	173 443	132 636
varav unit linked <i>of which unit linked</i>	157 280	173 397	168 187	166 782	146 162	108 425
Svenska icke finansiella företag <i>Sw. non-financial corporations</i>	39 922	41 422	40 356	40 823	34 539	25 665
Kommuner <i>Local government</i>	6 481	6 053	6 466	6 397	5 421	10 126
Socialförsäkring <i>Social security funds</i>	48 702	-	-	-	-	-
varav PPM <i>of which PPM</i>	47 663	-	-	-	-	-
Övriga svenska innehavare <i>Other domestic owners</i>	4 995	5 843	4 988	6 678	6 388	15 187
Utländska innehavare <i>Foreign owners</i>	15 586	18 261	18 034	16 274	12 818	8 001
SUMMA TOTAL	767 731	777 632	767 023	789 094	720 288	557 037

5. Bruttosparande i fonder, totalt, fördelat på fondtyp, mkr

Gross savings in funds, SEK million

	00kv4	00kv3	00kv2	00kv1	99kv4	Summa 00kv1-4
Aktiefonder <i>Equity funds</i>						
Inbetalt <i>Sales</i>	52 494	26 321	33 596	51 532	32 166	163 943
Utbetalt <i>Redemptions</i>	21 841	17 839	22 746	35 569	23 722	97 995
Nettosparande <i>Net saving</i>	30 653	8 482	10 850	15 963	8 444	65 948
Räntefonder						
<i>Bond and money market funds</i>						
Inbetalt <i>Sales</i>	14 005	6 812	13 584	16 519	12 907	50 920
Utbetalt <i>Redemptions</i>	13 519	6 748	12 933	14 767	13 756	47 967
Nettosparande <i>Net saving</i>	486	64	651	1 752	-849	2 953
Andra fonder <i>Other funds</i>						
Inbetalt <i>Sales</i>	39 008	4 733	6 939	11 867	8 533	62 547
Utbetalt <i>Redemptions</i>	8 835	2 317	2 717	5 062	3 840	18 931
Nettosparande <i>Net saving</i>	30 173	2 416	4 222	6 805	4 693	43 616
TOTAL TOTAL						
Inbetalt <i>Sales</i>	105 507	37 866	54 119	79 918	53 606	277 410
Utbetalt <i>Redemptions</i>	44 196	26 904	38 396	55 398	41 318	164 893
Nettosparande <i>Net saving</i>	61 312	10 962	15 723	24 520	12 288	112 517

6. Bruttosparande i fonder, hushåll, fördelat på fondtyp, mkr

Gross savings in funds, SEK million

	00kv4	00kv3	00kv2	00kv1	99kv4	Summa 00kv1-4
Aktiefonder <i>Equity funds</i>						
Inbetalt <i>Sales</i>	13 895	13 025	14 240	25 254	17 569	66 414
Utbetalt <i>Redemptions</i>	13 793	11 525	14 436	24 078	16 633	63 832
Nettosparande <i>Net saving</i>	102	1 500	-196	1 176	936	2 582
Räntefonder <i>Bond and money market funds</i>						
Inbetalt <i>Sales</i>	2 740	2 410	2 632	5 646	2 654	13 428
Utbetalt <i>Redemptions</i>	2 898	1 864	3 426	4 058	3 550	12 246
Nettosparande <i>Net saving</i>	-158	546	-794	1 588	-896	1 182
Andra fonder <i>Other funds</i>						
Inbetalt <i>Sales</i>	1 971	1 528	2 179	5 384	3 312	11 062
Utbetalt <i>Redemptions</i>	1 710	1 131	1 463	3 047	2 214	7 351
Nettosparande <i>Net saving</i>	261	397	716	2 337	1 098	3 711
TOTAL <i>TOTAL</i>						
Inbetalt <i>Sales</i>	18 606	16 963	19 051	36 284	23 535	90 904
Utbetalt <i>Redemptions</i>	18 401	14 520	19 325	31 183	22 397	83 429
Nettosparande <i>Net saving</i>	205	2 443	-274	5 101	1 138	7 475

7. Placeringar, fonder totalt, mkr

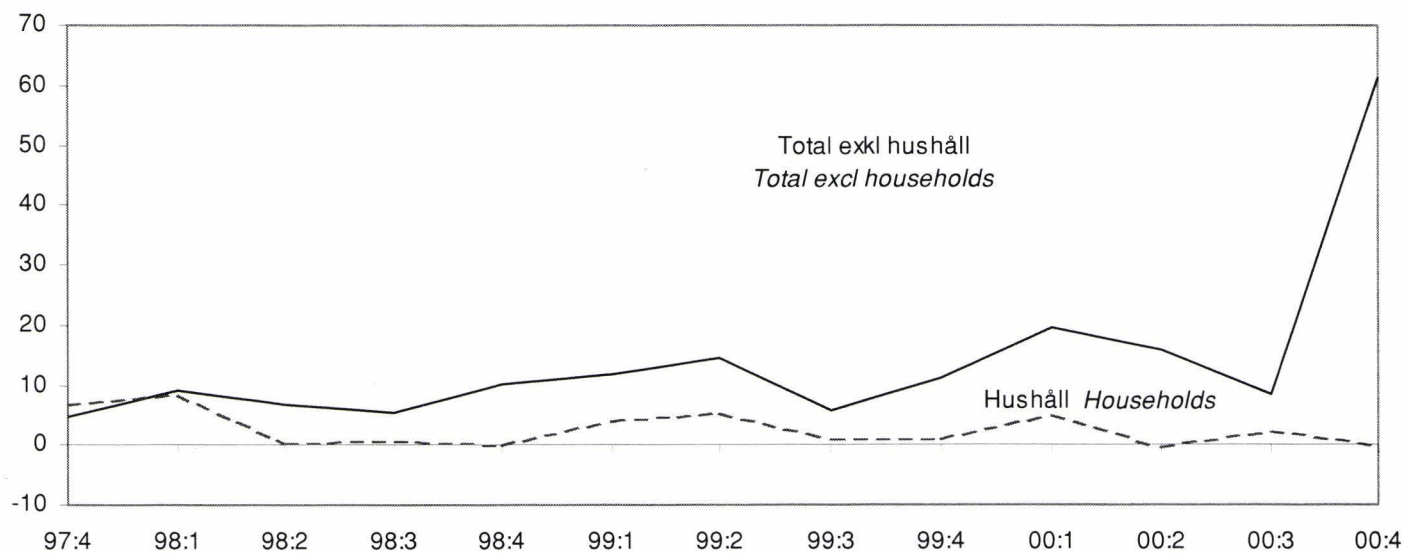
Fund investments at market value, total, SEK million

	00kv4	00kv3	00kv2	00kv1	99kv4	99kv3
Likvida medel <i>Liquid funds</i>	56 376	42 297	35 449	29 351	25 406	22 262
Aktier <i>Shares</i>	612 628	638 855	636 931	659 992	606 091	450 311
Noterade <i>Quoted</i>	610 095	635 430	632 770	650 847	598 897	447 658
finansiella företag <i>financial corp.</i>	65 525	66 045	64 968	54 848	42 735	38 668
icke fin. företag <i>non-financial corp.</i>	231 153	240 494	249 475	268 143	268 751	206 879
utländska företag <i>foreign corp.</i>	313 416	328 891	318 328	327 855	287 410	202 111
Onoterade <i>Unquoted</i>	2 534	3 425	4 161	9 146	7 195	2 652
finansiella företag <i>financial corp.</i>	1	2	51	75	43	451
icke fin. företag <i>non-financial corp.</i>	1 556	1 771	2 431	4 012	2 951	1 348
utländska företag <i>foreign corp.</i>	977	1 653	1 679	5 058	4 200	854
Räntebärande papper	124 181	112 067	99 668	101 359	96 108	91 083
<i>Interest bearing securities</i>						
Certifikat <i>Short term securities</i>	42 165	40 028	45 828	41 321	39 086	39 916
stat <i>central government</i>	31 536	29 141	32 631	27 140	26 459	31 651
kommun <i>local government</i>	4	0	0	0	2	2
finansinstitut <i>financial institutions</i>	5 947	6 921	8 962	8 757	9 513	6 215
övriga svenska <i>other domestic</i>	4 658	3 957	4 225	5 414	3 103	1 973
utlandet <i>rest of the world</i>	20	10	10	10	10	75
Obligationer <i>Long term securities</i>	82 016	72 039	53 840	60 037	57 022	51 167
stat <i>central government</i>	49 797	39 277	27 950	36 429	35 001	31 498
kommun <i>local government</i>	15	15	28	28	29	29
finansinstitut <i>financial institutions</i>	26 540	26 023	19 041	18 811	17 104	16 215
övriga svenska <i>other domestic</i>	1 817	1 955	2 069	1 097	1 254	1 013
utlandet <i>rest of the world</i>	3 848	4 768	4 753	3 672	3 635	2 412
Andelar i svenska vp-fonder	2 252	2 550	2 421	2 682	2 416	1 798
<i>Dom. mutual funds</i>						
Andelar i utländska vp-fonder	412	516	713	593	564	420
<i>Foreign mutual funds</i>						
Derivatinstrument <i>Derivatives</i>	1 410	1 567	232	2 731	3 845	1 239
SUMMA TOTAL	797 258	797 853	775 415	796 708	734 430	567 113
därav övriga fordringar/skulder <i>of which other demands/debts</i>	-29 527	-20 221	-8 391	-7 614	-14 141	-10 076
Fondernas värde	767 731	777 632	767 023	789 094	720 288	557 037
<i>Market value of funds</i>						

Diagram

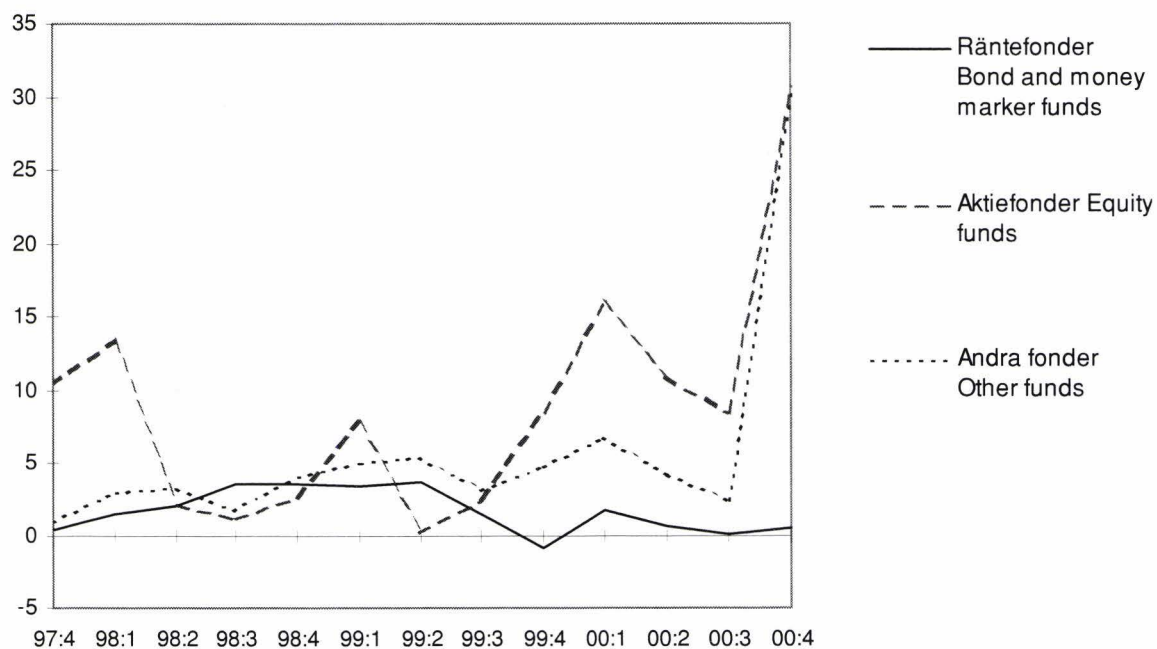
1. Nettosparande, totalt exkl. hushåll samt hushåll, mdkr

Net savings, total excl. households and households, SEK billion



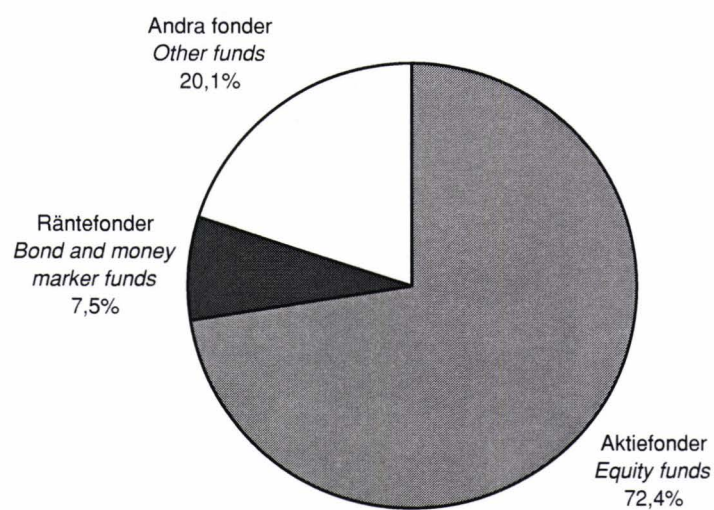
2. Nettosparande, fördelat på fondtyp, mdkr

Net savings, divided on type of fund, SEK billion



3. Fondtypernas andel av det totala fondvärdet, 767,7 mdkr 4:e kvartalet 2000-12-31

Type of fund as a proportion of total funds value, 767,7 SEK billion, forth quarter 2000



Fakta om statistiken

Detta omfattar statistiken

Undersökningen sker kvartalsvis och omfattar alla värdepappersfonder som står under Finansinspektionens tillsyn. Här ingår även fonder som inte är öppna för allmänheten. Per 2000-12-31 var antalet aktiva fonder 544. Undersökningen täcker ej in utlandsregistrerade fonder. De marknadsförs och säljs i Sverige men fondföretaget har sitt säte i ett annat land. Informationskraven som gäller i fondföretagets hemland gäller då för fonden, enligt 7b §, lagen (1990:1114) om värdepappersfonder.

Definitioner och förklaringar

Från och med fjärde kvartalet 1991 görs även en uppdelning på typ av fond. Uppdelningen som följer Finansinspektionens författningssamling, gör det lättare att få en rättvis bild av fonderna då det finns stora skillnader inom gruppen, framför allt vad gäller riskspridning. Det finns fyra typer av fonder. Allemansfonder är fonder bildade enligt 10 § lagen (1983:890) om allemanssparande. Då denna lag är upphävd skiljer vi inte ut allemansfonder från aktiefonder fr.o.m. första kvartalet 1999. Till aktiefonder hör de fonder som enligt sin placeringsinriktning har minst 75 procent av värdepappersinnehavet placerade i svenska eller utländska aktier. Räntefonder måste ha 100 procent av värdepappersinnehavet placerat i räntebärande papper. Sista typen är andra fonder, som innehåller de fonder som inte kan klassificeras enligt någon av de andra typerna. Nationella fonder har vidare placeringsmöjligheter än värdepappersfonder och behöver inte uppfylla samtliga krav i lagen (1990:1114) om värdepappersfonder. De klassificeras efter sin inriktning och ingår i redovisningen under respektive fondtyp, aktiefond, räntefond eller annan fond. Nationella fonder kallas de eftersom de endast får marknadsföras och säljas i sitt hemland, Sverige i detta fallet.

Teckenförklaring till tabellerna

- Inget finns att redovisa
- . Uppgift kan ej förekomma
- .. Uppgift inte tillgänglig eller alltför osäker för att anges

Så görs statistiken

Svenskregistrerade värdepappersfonder som står under Finansinspektionens tillsyn rapporterar in en detaljerad balansräkning och transaktionsuppgifter varje kvartal. Dessa uppgifter granskas och sammanställs av SCB. Publikationen redovisar totaler samt fördelning på sektorer och fondtyper.

Statistikens tillförlitlighet

Granskning och rimlighetsbedömning utförs kontinuerligt.

Bra att veta

I inrapporteringen skall värdepappersinnehaven marknadsvärderas. Förändringar i ränte- och kursnivåer påverkar därför fördelningen mellan olika balansposter. Underlaget utgörs av rapportformulär, där detaljerade uppgifter om fondernas tillgångar och skulder, transaktioner samt intäkter och kostnader lämnas till

SCB. I denna publikation redovisas endast en del av de uppgifter som finns på rapportformulären. De som önskar mer detaljerade uppgifter på total- eller fondtypsnivå ombedes kontakta Hans Olsson, tfn 08-506 942 29. Från och med andra kvartalet 1998 används ett nytt rapportformulär vilket bland annat innebär att uppgifter till tabell 2 inte finns att få bakåt i tiden. Tabell 4 är omarbetad från och med samma tidpunkt.

Publicera gärna statistiken men var vänlig ange SCB som källa

Annan statistik

Fondbolagens Förening publicerar statistik över värdepappersfondernas transaktioner på månadsbasis. Populationen är dock inte helt överensstämmande. SCB täcker in alla fonder som är sverigeregistrerade medan Fondbolagens Förening täcker in de svensk- och utlandsregistrerade fonder vars fondbolag är medlem i föreningen.

Mer information om statistiken och dess kvalitet ges i en särskild Beskrivning av statistiken på SCB:s webbplats, www.scb.se.

Summary

SEK 61.3 billion in net savings for mutual funds in the fourth quarter 2000

The outstanding value for mutual funds registered in Sweden decreased during the fourth quarter 2000 from SEK 777.6 billion to SEK 767.7 billion. Since net savings included reinvested dividends amounting to SEK 61.3 billion, the average decrease in value of the funds was 9.2 percent. During the fourth quarter, the SX General index declined by 12.0 percent. The total net savings for mutual funds, SEK 61.3 billion, was SEK 50.3 billion more than in the previous quarter, which is due to savings in the Premium Pension System in the amount of SEK 51.2 billion. The net savings, excluding the Premium Pension System were SEK 0.8 billion less than last quarter and SEK 2.1 billion less than for the corresponding period last year.

SEK 0.2 billion in net savings for the household sector in the second quarter 2000

Net savings in mutual funds for the household sector were SEK 0.2 billion in the fourth quarter 2000. This is a decrease compared to the corresponding quarter 1999, and also compared to last quarter. The outstanding value of funds for the household sector decreased from SEK 454.3 to 413.1 billion.

Net savings for unit linked funds amounted to SEK 7.0 billion during the fourth quarter, which is a small decrease compared to SEK 7.3 billion during the fourth quarter 1999.

Lower share of net saving in equity funds

The share of savings in equity funds as part of the total net savings decreased from 77.3 percent to 50.0 percent during the fourth quarter. At the same time there was a sharp increase in the share of net savings of other funds, from 22.0 to 49.2 percent. This is due to savings in the new Premium Pension System, where many investors choose to invest their money in mixed funds. The share of equity funds in the total fund value during the quarter decreased from 76.0 to 72.4 percent. The share of other funds increased, from 16.7 to 20.1 percent, while bond and money market funds increased their share by 0.2 percentage points.