

Värdepappersfonderna 2:a kvartalet 2002

Mutual funds – second quarter 2002

I korta drag

10,1 mdkr nettosparades i fonder 2:a kvartalet 2002

Det sammanlagda värdet för fonder registrerade i Sverige minskade under andra kvartalet 2002 från 746,3 mdkr till 634,4 mdkr. Då nettoköpen av fondandelar, inkl. återinvesterade utdelningar, var 10,1 mdkr innebär detta att den genomsnittliga värdeminskningen var 16,3 procent. Under andra kvartalet sjönk generalindex med 21,2 procent. Nettoköpen av fondandelar totalt, 10,1 mdkr, var 19,1 mdkr lägre än föregående kvartal vilket beror på de stora insättningarna i premiepensionssystemet under första kvartalet.

Hushållens fondsparande negativt

Hushållen nettosålde fondandelar för 0,5 mdkr under andra kvartalet 2002. Förra kvartalet uppgick hushållens sparande till 2,3 mdkr medan det var 1,1 mdkr, motsvarande kvartal förra året. Hushållens fondförmögenhet har nu minskat med 208 mdkr från toppen första kvartalet 2000 till 277 mdkr.

Nettosparandet i livförsäkringsanknutna fonder, s.k. unit-linked uppgick till 7,1 mdkr, vilket är en ökning jämfört med föregående kvartal då det uppgick till 2,6 mdkr. Fondförmögenheten i unit-linked fonder minskade från 169,4 mdkr till 145,9 mdkr.

Aktiefondernas andel minskar

Största delen av det totala fondsparandet under andra kvartalet gick till aktiefonder, 4,2 mdkr. 2,0 mdkr sparades i räntefonder medan sparandet i andra fonder, än aktie- och räntefonder var 3,9 mdkr. Aktiefondernas andel av den totala fondförmögenheten under kvartalet minskade från 66,1 procent till 62,4 procent. Räntefonder och andra fonder ökade sin andel något och andelarna uppgår nu till 12,2 procent respektive 25,3 procent. Antal aktiva fonder ökade med 3 jämfört med föregående kvartal och uppgick till 573 vid slutet av andra kvartalet.



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 0203. Utgivet den 22 augusti 2002.
Tidigare publicering: Se avsnittet Fakta om statistiken.
Utgivare av Statistiska meddelanden är Svante Öberg, SCB.

Innehåll

Tabeller	3
<hr/>	
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
<hr/>	
1. Nettosparande, totalt exkl. hushåll samt hushåll, mdkr	7
2. Nettosparande, fördelat på fondtyp, mdkr	7
3. Fondtypernas andel av det totala fondvärdet, 634,4 mdkr 2:a kvartalet 2002	8
Fakta om statistiken	9
<hr/>	
Detta omfattar statistiken	9
Definitioner och förklaringar	9
Så görs statistiken	9
Statistikens tillförlitlighet	9
Bra att veta	9
Annan statistik	10
In English	11
<hr/>	
Summary	11
List of tables	11

Tabeller

1. Antal aktiva fonder

1. Number of active funds

		02kv2	02kv1	01kv4	01kv3	01kv2	01kv1	00kv4
Aktiefonder	<i>Equity funds</i>	352	350	349	338	333	345	345
Räntefonder	<i>Bond and money market funds</i>	93	93	92	92	92	90	90
Andra fonder	<i>Other funds</i>	128	127	118	111	113	111	110
SUMMA	TOTAL	573	570	559	541	538	546	545

2. Fondförmögenhet, mkr

2. Market value of funds, SEK million

		02kv2	02kv1	01kv4	01kv3	01kv2	01kv1	00kv4
Aktiefonder	<i>Equity funds</i>	396 062	492 915	491 399	419 510	527 449	477 396	556 219
Räntefonder	<i>Bond and money market funds</i>	77 778	75 391	72 292	72 372	63 492	63 745	57 344
Andra fonder	<i>Other funds</i>	160 550	177 944	168 209	153 106	168 617	147 708	154 222
SUMMA	TOTAL	634 390	746 250	731 900	644 988	759 558	688 849	767 785

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

3. Net savings incl. reinvested dividends specified by sector, SEK million

		02kv2	02kv1	01kv4	01kv3	01kv2	Summa 01kv1-4
Hushåll	<i>Households</i>	-468	2 349	2 128	-3571	1 063	-3 275
Hushållens ideella organisationer	<i>Non profit institutions serving households</i>	-42	472	739	374	349	1 716
Svenska finansiella företag	<i>Sw. Financial corporations</i>	7 724	4 579	6 781	3558	11 138	30 309
varav unit linked	<i>of which unit linked</i>	7 114	2 606	5 058	2353	9 377	23 855
Svenska icke finansiella företag	<i>Sw. non-financial corporations</i>	1 977	1 924	1 846	74	1 615	5 597
Kommuner	<i>Local government</i>	-199	427	115	126	1 315	1 975
Socialförsäkring	<i>Social security funds</i>	529	17 516	-256	55	16 863	16 766
varav PPM	<i>of which PPM</i>	530	17 323	-248	54	16 795	16 702
Övriga svenska innehavare	<i>Other domestic owners</i>	-6	148	213	50	90	414
Utländska innehavare	<i>Foreign owners</i>	610	1 785	1 642	1765	791	5 072
SUMMA	TOTAL	10 125	29 200	13 208	2432	33 224	58 573

4. Fondförmögenhet fördelat på sektorer, mkr

4. Market value of funds specified by sector, SEK million

	02kv2	02kv1	01kv4	01kv3	01kv2	01kv1
Hushåll <i>Households</i>	277 146	342 202	355 296	310 203	379 937	356 425
Hushållens ideella organisationer <i>Non profit institutions serving households</i>	31 341	36 714	36 410	32 978	36 572	35 246
Svenska finansiella företag <i>Sw. financial corporations</i>	188 121	211 643	204 592	180 790	207 471	187 341
varav unit linked <i>of which unit linked</i>	145 949	169 419	162 277	138 937	162 771	149 377
Svenska icke finansiella företag <i>Sw. non-financial corporations</i>	42 837	44 145	43 935	40 006	42 349	40 368
Kommuner <i>Local government</i>	6 778	8 130	7 617	7 412	7 828	6 376
Socialförsäkring <i>Social security funds</i>	63 135	76 733	59 396	52 448	63 715	42 958
varav PPM <i>of which PPM</i>	61 363	75 964	59 254	51 940	61 707	42 013
Övriga svenska innehavare <i>Other domestic owners</i>	4 998	5 428	4 198	4 107	4 608	4 808
Utländska innehavare <i>Foreign owners</i>	20 036	21 255	20 407	17 043	17 077	15 327
SUMMA TOTAL	634 390	746 250	731 852	644 988	759 558	688 849

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

5. Gross savings in funds, SEK million

	02kv2	02kv1	01kv4	01kv3	01kv2	Summa 01kv1-4
Aktiefonder <i>Equity funds</i>						
Inbetalt <i>Sales</i>	22 164	30 676	24 489	13 653	33 074	94 058
Utbetalt <i>Redemptions</i>	17 953	15 668	16 729	18 675	16 196	73 581
Nettosparande <i>Net savings</i>	4 211	15 008	7 760	-5 022	16 878	20 477
Räntefonder <i>Bond and money market funds</i>						
Inbetalt <i>Sales</i>	13 137	11 913	16 276	14 682	13 058	58 282
Utbetalt <i>Redemptions</i>	11 115	10 824	15 856	8 312	12 556	45 523
Nettosparande <i>Net savings</i>	2 022	1 089	420	6 370	502	12 759
Andra fonder <i>Other funds</i>						
Inbetalt <i>Sales</i>	8 023	16 260	8 405	5 084	18 791	39 773
Utbetalt <i>Redemptions</i>	4 131	3 157	3 377	4 000	2 947	14 436
Nettosparande <i>Net savings</i>	3 892	13 103	5 028	1 084	15 844	25 337
TOTAL TOTAL						
Inbetalt <i>Sales</i>	43 324	58 849	49 169	33 419	64 922	192 113
Utbetalt <i>Redemptions</i>	33 199	29 649	35 961	30 987	31 698	133 540
Nettosparande <i>Net savings</i>	10 125	29 200	13 208	2 432	33 224	58 573

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

6. Gross savings in funds, SEK million

	02kv2	02kv1	01kv4	01kv3	01kv2	Summa 01kv1-4
Aktiefonder <i>Equity funds</i>						
Inbetalt <i>Sales</i>	7 326	8 022	10 777	6 112	8 814	35 336
Utbetalt <i>Redemptions</i>	8 048	6 718	9 456	10 170	8 483	40 818
Nettosparande <i>Net savings</i>	-722	1 304	1 321	-4 058	331	-5 482
Räntefonder <i>Bond and money market funds</i>						
Inbetalt <i>Sales</i>	1 899	2 282	3 385	3 062	2 490	11 471
Utbetalt <i>Redemptions</i>	1 854	1 854	3 498	1 761	2 027	9 230
Nettosparande <i>Net savings</i>	45	428	-113	1 301	463	2 241
Andra fonder <i>Other funds</i>						
Inbetalt <i>Sales</i>	1 464	1 586	2 188	856	1 362	5 959
Utbetalt <i>Redemptions</i>	1 255	969	1 268	1 669	1 093	5 993
Nettosparande <i>Net savings</i>	209	617	920	-813	269	-34
TOTAL TOTAL						
Inbetalt <i>Sales</i>	10 689	11 889	16 351	10 030	12 666	52 766
Utbetalt <i>Redemptions</i>	11 157	9 540	14 223	13 600	11 603	56 041
Nettosparande <i>Net savings</i>	-468	2 349	2 128	-3 570	1 063	-3 275

7. Placeringar, fonder totalt, mkr

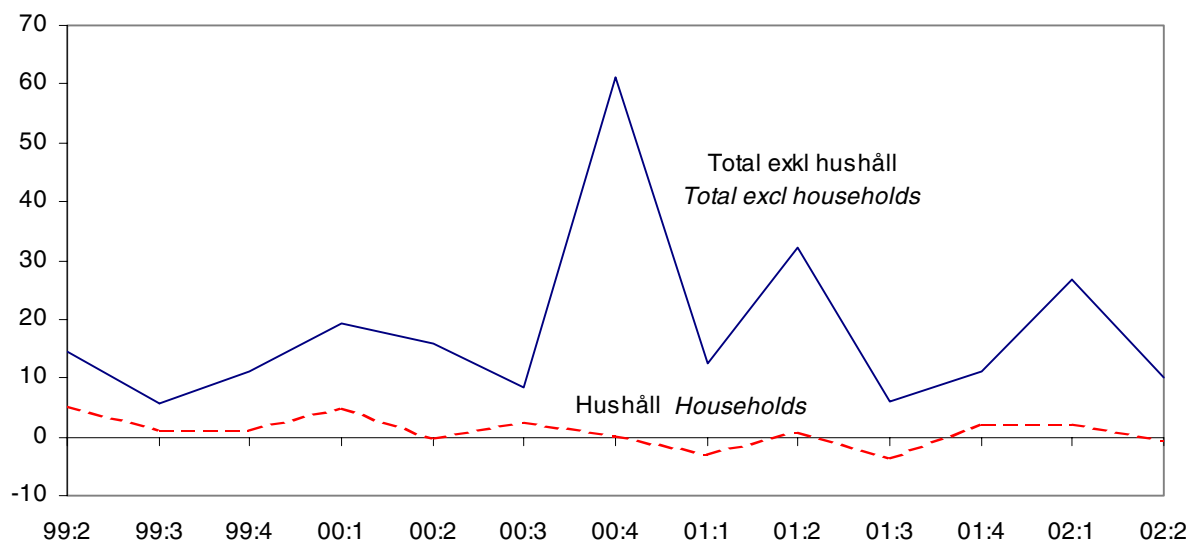
7. Fund investments at market value, total, SEK million

	02kv2	02kv1	01kv4	01kv3	01kv2	01kv1
Likvida medel <i>Liquid funds</i>	41 782	36 537	43 612	41 094	52 824	52 741
Aktier <i>Shares</i>	470 436	580 607	568 805	483 577	601 953	532 590
Noterade <i>Listed</i>	461 152	575 363	563 680	480 730	598 442	529 282
finansiella företag <i>financial corp.</i>	51 733	58 778	57 299	45 138	56 828	50 926
icke fin. företag <i>non-financial corp.</i>	166 972	213 993	211 082	173 213	213 541	198 031
utländska företag <i>foreign corp.</i>	242 446	302 592	295 299	262 379	328 073	280 325
Onoterade <i>Not listed</i>	9 284	5 243	5 124	2 847	3 511	3 308
finansiella företag <i>financial corp.</i>	1 731	33	3	3	1	30
icke fin. företag <i>non-financial corp.</i>	5 671	2 002	2 675	1 188	1 480	1 460
utländska företag <i>foreign corp.</i>	1 883	3 209	2 447	1 657	2 030	1 818
Räntebärande papper	181 835	189 856	179 263	164 272	161 718	139 167
<i>Interest bearing securities</i>						
Certifikat <i>Short term securities</i>	58 793	54 573	50 366	50 238	46 262	38 529
stat <i>central government</i>	46 789	45 916	41 682	40 442	37 024	32 025
kommun <i>local government</i>	27	75	27	0	0	0
finansinstitut <i>financial institutions</i>	7 553	2 582	3 661	3 371	3 241	1 454
övriga svenska <i>other domestic</i>	4 329	5 987	4 977	6 307	5 984	4 660
utlandet <i>rest of the world</i>	96	14	19	118	13	391
Obligationer <i>Long-term securities</i>	123 042	135 283	128 897	114 034	115 456	100 638
stat <i>central government</i>	68 345	78 781	71 834	67 091	60 714	47 501
kommun <i>local government</i>	11	44	26	26	25	15
finansinstitut <i>financial institutions</i>	40 596	42 928	43 564	34 181	42 992	42 140
övriga svenska <i>other domestic</i>	7 029	5 484	5 355	4 592	3 618	3 088
utlandet <i>rest of the world</i>	7 061	8 045	8 118	8 144	8 107	7 895
Andelar i svenska vp-fonder	1 036	785	3 259	2 430	2 517	2 014
<i>Dom. mutual funds</i>						
Andelar i utländska vp-fonder	776	529	2 047	771	803	670
<i>Foreign mutual funds</i>						
Derivatinstrument <i>Derivatives</i>	2 570	2 431	2 916	1 421	936	681
SUMMA TOTAL	698 434	810 745	799 902	693 564	820 750	727 864
därav övriga fordringar/skulder	-64 043	-64 496	-68 050	-48 576	-61 193	-39 015
<i>of which other claims/debts</i>						
Fondernas värde	634 390	746 250	731 852	644 988	759 558	688 849
<i>Market value of funds</i>						

Diagram

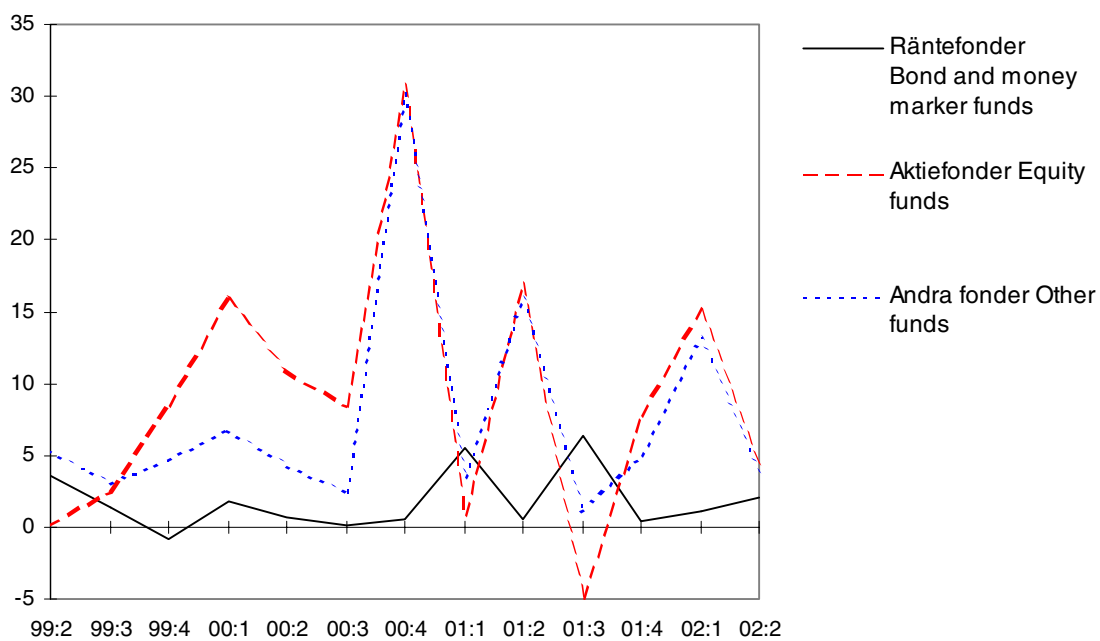
1. Nettosparande, totalt exkl. hushåll samt hushåll, mdkr

1. Net Savings, total excl. households and households, SEK billion



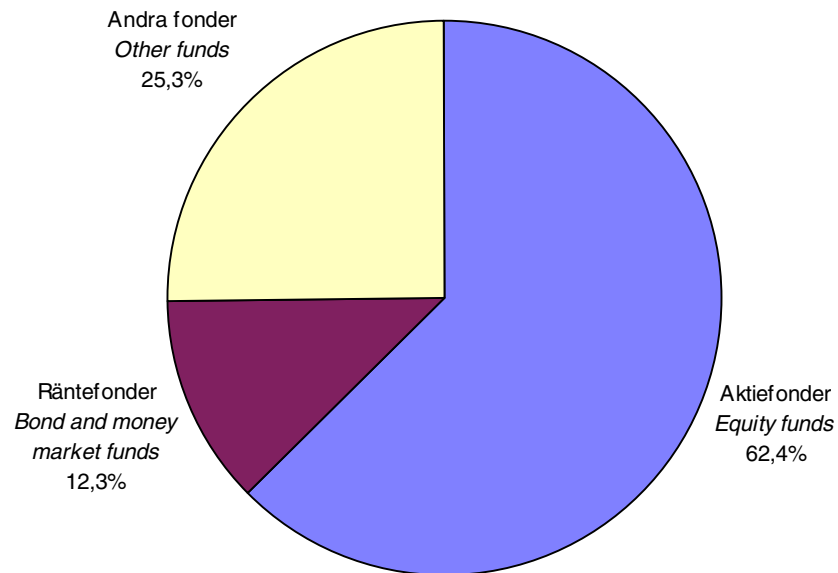
2. Nettosparande, fördelat på fondtyp, mdkr

2. Net savings, by type of fund, SEK billion



3. Fondtypernas andel av det totala fondvärdet, 634,4 mdkr 2:a kvartalet 2002

3. Type of fund as a proportion of the total value of funds, 634.4 SEK billion, second quarter 2002



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 2002-06-30 var antalet aktiva fonder 573. 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.

In English

Summary

SEK 10.1 billion in net savings for mutual funds in the second quarter 2002

The outstanding value for mutual funds registered in Sweden decreased during the second quarter 2002 from SEK 746 billion to SEK 634 billion. Since net savings included reinvested dividends amounting to SEK 10.1 billion, the average decrease in value of the funds was 16.3 percent. During the second quarter, the SX General index decreased by 21.2 percent. The total net savings for mutual funds, SEK 10.1 billion, was SEK 19 billion less than in the previous quarter, which is due to large savings in the Premium Pension System previous quarter.

Negative savings in the household sector

Net savings in mutual funds for the household sector were SEK –0.5 billion in the second quarter 2002. Last quarter the net savings amounted to SEK 2.3 billion and the corresponding quarter last year to SEK 1.1 billion. The outstanding value of funds for the household sector has decreased by SEK 208 billion from the peak in the first quarter 2000 amounting to SEK 277 billion second quarter 2002.

Net savings for unit linked funds amounted to SEK 7.1 billion during the second quarter, which is an increase compared to last quarter when it amounted to SEK 2.6 billion. The outstanding value for unit linked funds registered in Sweden decreased to SEK 146 billion.

Decreasing share in Equity funds

The dominant amount of net savings in mutual funds during the second quarter was in equity funds, SEK 4.2 billion. The savings in other funds was SEK 3.9 billion while savings in bond and money market funds was SEK 2.0 billion. The share of equity funds in the total fund value during the quarter decreased from 66.1 to 62.4 percent. The share of other funds and bond and money market funds increased to 25.3 percent and 12.2 percent respectively. The number of active mutual funds amounted to 573 at the end of the second quarter 2002, an increase with 3 funds compared to last quarter.

List of tables

1. Number of active funds	3
2. Market value of funds, SEK million	3
3. Net savings incl. reinvested dividends specified by sector, SEK million	3
4. Market value of funds specified by sector, SEK million	4
5. Gross savings in funds, SEK million	4
6. Gross savings in funds, SEK million	5
7. Fund investments at market value, total, SEK million	6