

Värdepappersfonderna 3:e kvartalet 2002

Mutual funds – third quarter 2002

I korta drag

4,2 mdkr nettosparades i fonder 3:e kvartalet 2002

Det sammanlagda värdet för fonder registrerade i Sverige minskade under andra kvartalet 2002 från 634 mdkr till 534 mdkr. Då nettoköpen av fondandelar, inkl. återinvesterade utdelningar, var 4,2 mdkr innebär detta att den genomsnittliga värdeminskningen var 16,4 procent. Under tredje kvartalet sjönk generalindex med 26,4 procent. Nettoköpen av fondandelar som totalt uppgick till 4,2 mdkr var 5,9 mdkr lägre än föregående kvartal men högre än tredje kvartalet 2001 då sparandet uppgick till 2,4 mdkr.

Hushållen säljer aktiefonder och köper räntefonder

Hushållen nettosålde fondandelar för 2,1 mdkr under tredje kvartalet 2002. Förra kvartalet nettosålde hushållens fondandelar för 0,5 mdkr. Hushållens fondförmögenhet har nu minskat med 267 mdkr från toppen första kvartalet 2000 till 218 mdkr. Under tredje kvartalet var minskningen 59 mdkr.

Nettosparandet i livförsäkringsanknutna fonder, s.k. unit-linked uppgick till 5,8 mdkr, vilket är en minskning jämfört med föregående kvartal då det uppgick till 7,1 mdkr. Fondförmögenheten i unit-linked fonder minskade från 146 mdkr till 133 mdkr.

Aktiefondernas andel minskar

Största delen av det totala fondsparandet under tredje kvartalet gick till räntefonder, 4,2 mdkr. Hos aktiefonderna nettosålde fondandelar för 3,6 mdkr, vilket innebär att uttagen var större än insättningarna. 3,6 mdkr sparades i andra fonder, än aktie- och räntefonder. Aktiefondernas andel av den totala fondförmögenheten under kvartalet minskade från 62,4 procent till 57,2 procent. Räntefonder och andra fonder ökade sin andel något och andelarna uppgår nu till 15,7 procent respektive 27,1 procent. Antalet aktiva fonder uppgick till 582 vid slutet av tredje kvartalet, en ökning med nio fonder jämfört med föregående kvartal.



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 0204. Utgivet den 15 november 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, 534,0 mdkr 3:e 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

		02kv3	02kv2	02kv1	01kv4	01kv3	01kv2	01kv1
Aktiefonder	<i>Equity funds</i>	356	352	350	349	338	333	345
Räntefonder	<i>Bond and money market funds</i>	93	93	93	92	92	92	90
Andra fonder	<i>Other funds</i>	133	128	127	118	111	113	111
SUMMA	TOTAL	582	573	570	559	541	538	546

2. Fondförmögenhet, mkr

2. Market value of funds, SEK million

		02kv3	02kv2	02kv1	01kv4	01kv3	01kv2	01kv1
Aktiefonder	<i>Equity funds</i>	305 584	396 062	492 915	491 399	419 510	527 449	477 396
Räntefonder	<i>Bond and money market funds</i>	83 525	77 778	75 391	72 292	72 372	63 492	63 745
Andra fonder	<i>Other funds</i>	144 884	160 550	177 944	168 209	153 106	168 617	147 708
SUMMA	TOTAL	533 993	634 390	746 250	731 900	644 988	759 558	688 849

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

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

		02kv3	02kv2	02kv1	01kv4	01kv3	Summa 01kv1-4
Hushåll	<i>Households</i>	-2 065	-468	2 349	2 128	-3 571	-3 275
Hushållens ideella organisationer	<i>Non profit institutions serving households</i>	-237	-42	472	739	374	1 716
Svenska finansiella företag	<i>Sw. Financial corporations</i>	5 792	7 724	4 579	6 781	3 558	30 309
varav unit linked	<i>of which unit linked</i>	5 784	7 114	2 606	5 058	2 353	23 855
Svenska icke finansiella företag	<i>Sw. non-financial corporations</i>	-258	1 977	1 924	1 846	74	5 597
Kommuner	<i>Local government</i>	260	-199	427	115	126	1 975
Socialförsäkring	<i>Social security funds</i>	-221	529	17 516	-256	55	16 766
varav PPM	<i>of which PPM</i>	-214	530	17 323	-248	54	16 702
Övriga svenska innehavare	<i>Other domestic owners</i>	360	-6	148	213	50	414
Utländska innehavare	<i>Foreign owners</i>	562	610	1 785	1 642	1 765	5 072
SUMMA	TOTAL	4 193	10 125	29 200	13 208	2 432	58 573

4. Fondförmögenhet fördelat på sektorer, mkr

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

	02kv3	02kv2	02kv1	01kv4	01kv3	01kv2
Hushåll <i>Households</i>	218 012	277 146	342 202	355 296	310 203	379 937
Hushållens ideella organisationer <i>Non profit institutions serving households</i>	27 205	31 341	36 714	36 410	32 978	36 572
Svenska finansiella företag <i>Sw. financial corporations</i>	165 090	188 121	211 643	204 592	180 790	207 471
varav unit linked <i>of which unit linked</i>	133 250	145 949	169 419	162 277	138 937	162 771
Svenska icke finansiella företag <i>Sw. non-financial corporations</i>	41 709	42 837	44 145	43 935	40 006	42 349
Kommuner <i>Local government</i>	6 453	6 778	8 130	7 617	7 412	7 828
Socialförsäkring <i>Social security funds</i>	51 787	63 135	76 733	59 396	52 448	63 715
varav PPM <i>of which PPM</i>	51 646	61 363	75 964	59 254	51 940	61 707
Övriga svenska innehavare <i>Other domestic owners</i>	4 574	4 998	5 428	4 198	4 107	4 608
Utländska innehavare <i>Foreign owners</i>	19 163	20 036	21 255	20 407	17 043	17 077
SUMMA TOTAL	533 993	634 390	746 250	731 852	644 988	759 558

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

5. Gross savings in funds, SEK million

	02kv3	02kv2	02kv1	01kv4	01kv3	Summa 01kv1-4
Aktiefonder <i>Equity funds</i>						
Inbetalt <i>Sales</i>	12 851	22 164	30 676	24 489	13 653	94 058
Utbetalt <i>Redemptions</i>	16 420	17 953	15 668	16 729	18 675	73 581
Nettosparande <i>Net savings</i>	-3 569	4 211	15 008	7 760	-5 022	20 477
Räntefonder <i>Bond and money market funds</i>						
Inbetalt <i>Sales</i>	11 135	13 137	11 913	16 276	14 682	58 282
Utbetalt <i>Redemptions</i>	6 955	11 115	10 824	15 856	8 312	45 523
Nettosparande <i>Net savings</i>	4 180	2 022	1 089	420	6 370	12 759
Andra fonder <i>Other funds</i>						
Inbetalt <i>Sales</i>	7 583	8 023	16 260	8 405	5 084	39 773
Utbetalt <i>Redemptions</i>	4 001	4 131	3 156	3 376	4 000	14 436
Nettosparande <i>Net savings</i>	3 582	3 892	13 103	5 028	1 084	25 337
TOTAL TOTAL						
Inbetalt <i>Sales</i>	31 568	43 324	58 849	49 169	33 419	192 112
Utbetalt <i>Redemptions</i>	27 375	33 199	29 649	35 961	30 987	133 540
Nettosparande <i>Net savings</i>	4 193	10 125	29 200	13 208	2 432	58 573

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

6. Gross savings in funds, SEK million

	02kv3	02kv2	02kv1	01kv4	01kv3	Summa 01kv1-4
Aktiefonder <i>Equity funds</i>						
Inbetalt <i>Sales</i>	4 820	7 326	8 022	10 777	6 112	35 336
Utbetalt <i>Redemptions</i>	7 074	8 048	6 718	9 456	10 170	40 818
Nettosparande <i>Net savings</i>	-2 254	-722	1 304	1 321	-4 058	-5 482
Räntefonder <i>Bond and money market funds</i>						
Inbetalt <i>Sales</i>	1 920	1 899	2 282	3 385	3 062	11 471
Utbetalt <i>Redemptions</i>	1 220	1 854	1 854	3 498	1 761	9 230
Nettosparande <i>Net savings</i>	700	45	428	-113	1 301	2 241
Andra fonder <i>Other funds</i>						
Inbetalt <i>Sales</i>	992	1 464	1 586	2 188	856	5 959
Utbetalt <i>Redemptions</i>	1 503	1 255	968	1 268	1 669	5 993
Nettosparande <i>Net savings</i>	-511	209	617	920	-813	-34
TOTAL TOTAL						
Inbetalt <i>Sales</i>	7 731	10 689	11 889	16 350	10 030	52 766
Utbetalt <i>Redemptions</i>	9 797	11 157	9 540	14 223	13 600	56 041
Nettosparande <i>Net savings</i>	-2 065	-468	2 349	2 128	-3 570	-3 275

7. Placeringar, fonder totalt, mkr

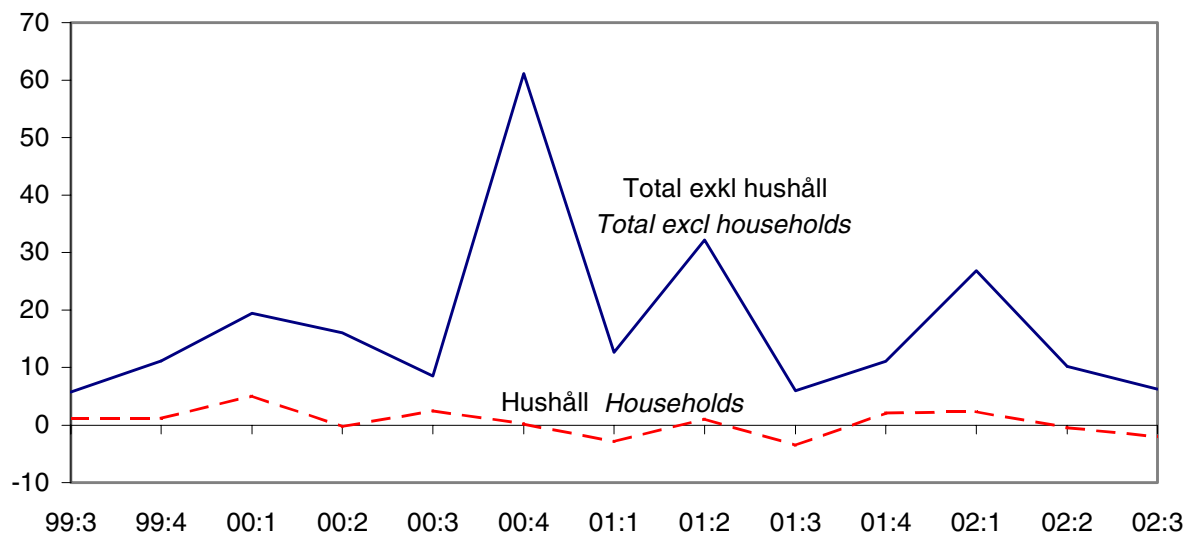
7. Fund investments at market value, total, SEK million

	02kv3	02kv2	02kv1	01kv4	01kv3	01kv2
Likvida medel <i>Liquid funds</i>	36 919	41 782	36 537	43 612	41 094	52 824
Aktier <i>Shares</i>	358 622	470 436	580 607	568 805	483 577	601 953
Noterade <i>Listed</i>	355 981	461 152	575 363	563 680	480 730	598 442
finansiella företag <i>financial corp.</i>	39 215	51 733	58 778	57 299	45 138	56 828
icke fin. företag <i>non-financial corp.</i>	125 366	166 972	213 993	211 082	173 213	213 541
utländska företag <i>foreign corp.</i>	191 399	242 446	302 592	295 299	262 379	328 073
Onoterade <i>Not listed</i>	2 641	9 284	5 243	5 124	2 847	3 511
finansiella företag <i>financial corp.</i>	7	1 731	33	3	3	1
icke fin. företag <i>non-financial corp.</i>	1 318	5 671	2 002	2 675	1 188	1 480
utländska företag <i>foreign corp.</i>	1 316	1 883	3 209	2 447	1 657	2 030
Räntebärande papper	216 285	181 835	189 856	179 263	164 272	161 718
<i>Interest bearing securities</i>						
Certifikat <i>Short term securities</i>	60 958	58 793	54 573	50 366	50 238	46 262
stat <i>central government</i>	46 591	46 789	45 916	41 682	40 442	37 024
kommun <i>local government</i>	10	27	75	27	0	0
finansinstitut <i>financial institutions</i>	10 710	7 553	2 582	3 661	3 371	3 241
övriga svenska <i>other domestic</i>	3 634	4 329	5 987	4 977	6 307	5 984
utlandet <i>rest of the world</i>	12	96	14	19	118	13
Obligationer <i>Long-term securities</i>	155 327	123 042	135 283	128 897	114 034	115 456
stat <i>central government</i>	93 102	68 345	78 781	71 834	67 091	60 714
kommun <i>local government</i>	0	11	44	26	26	25
finansinstitut <i>financial institutions</i>	47 568	40 596	42 928	43 564	34 181	42 992
övriga svenska <i>other domestic</i>	7 993	7 029	5 484	5 355	4 592	3 618
utlandet <i>rest of the world</i>	6 665	7 061	8 045	8 118	8 144	8 107
Andelar i svenska vp-fonder	989	1 036	785	3 259	2 430	2 517
<i>Dom. mutual funds</i>						
Andelar i utländska vp-fonder	693	776	529	2 047	771	803
<i>Foreign mutual funds</i>						
Derivatinstrument <i>Derivatives</i>	2 635	2 570	2 431	2 916	1 421	936
SUMMA TOTAL	616 142	698 434	810 745	799 902	693 564	820 750
därav övriga fordringar/skulder	-82 149	-64 043	-64 496	-68 050	-48 576	-61 193
<i>of which other claims/debts</i>						
Fondernas värde	533 993	634 390	746 250	731 852	644 988	759 558
<i>Market value of funds</i>						

Diagram

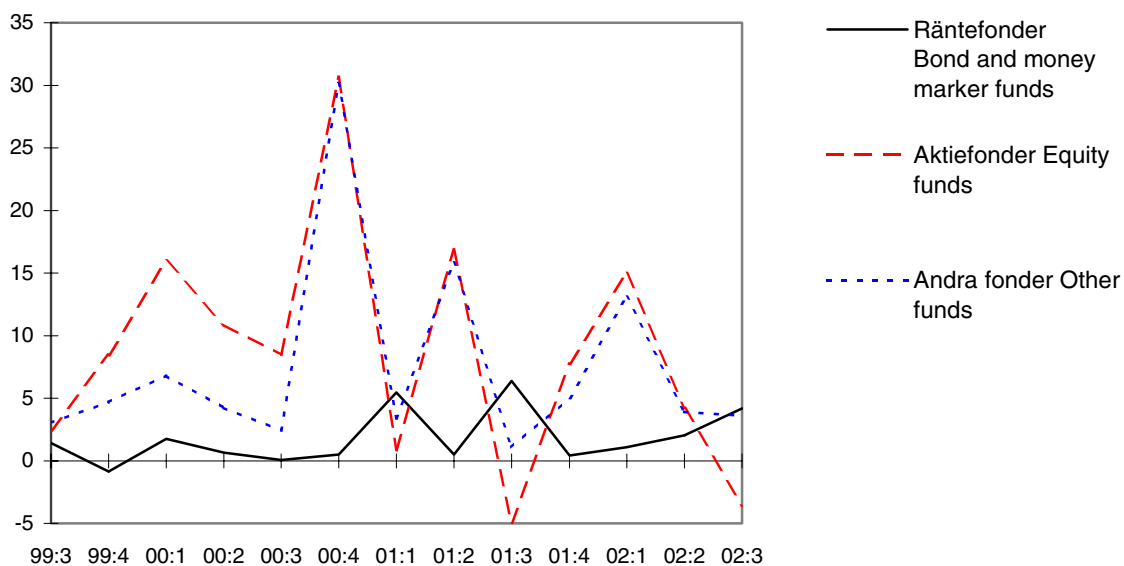
1. Nettosparande, totalt exkl. hushåll samt hushåll, mdkr

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



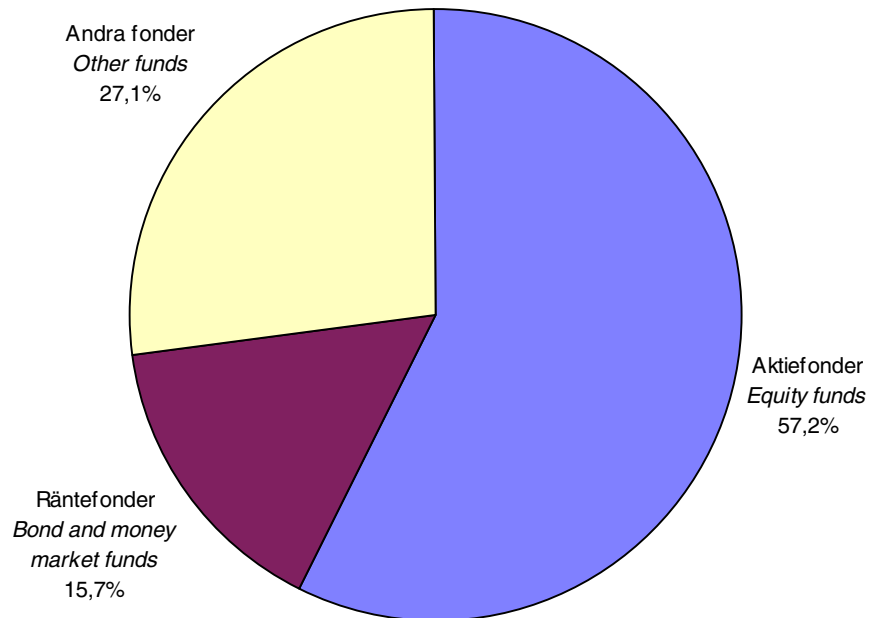
2. Nettosparande, fördelat på fondtyp, mdkr

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



3. Fondtypernas andel av det totala fondvärdet, 534,0 mdkr 3:e kvartalet 2002

3. Type of fund as a proportion of the total value of funds, 534.0 SEK billion, third 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 2002-09-30 var antalet aktiva fonder 582. 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. Under tredje kvartalet 2002 har tre fonder klassats om från andra fonder till aktiefonder på grund av ändrade placeringsregler.

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 4.2 billion in net savings for mutual funds in the third quarter 2002

The outstanding value for mutual funds registered in Sweden decreased during the third quarter 2002 from SEK 634 billion to SEK 534 billion. Since net savings included reinvested dividends amounting to SEK 4.2 billion, the average decrease in value of the funds was 16.4 percent. During the second quarter, the SX General index decreased by 26.4 percent. The total net savings for mutual funds, SEK 4.2 billion, was SEK 5.9 billion less than in the previous quarter but higher than the corresponding quarter last year when savings amounted to SEK 2.4 billion.

Households sell equity funds and invest in bond and money market funds

Net savings in mutual funds for the household sector were SEK –2.1 billion in the third quarter 2002. Last quarter the net savings amounted to SEK –0.5 billion and the corresponding quarter last year to SEK –3.6 billion. The outstanding value of funds for the household sector has decreased by SEK 267 billion from the peak in the first quarter 2000 amounting to SEK 218 billion third quarter 2002. During the third quarter the decrease was SEK 59 billion.

Net savings for unit linked funds amounted to SEK 5.8 billion during the third quarter, which is an increase compared to last quarter when it amounted to SEK 7.1 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 bond and money market funds, SEK 4.2 billion. The savings in equity funds was SEK –3.6 billion while savings in other funds was SEK 3.6 billion. The share of equity funds in the total fund value during the quarter decreased from 62.4 to 57.2 percent. The share of other funds and bond and money market funds increased to 27.1 percent and 15.7 percent respectively. The number of active mutual funds amounted to 582 at the end of the second quarter 2002, an increase with nine 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