

Värdepappersfonderna 1:a kvartalet 2003

Mutual funds – first quarter 2003

I korta drag

30 miljarder nettosparades i fonder 1:a kvartalet

Det sammanlagda värdet för fonder registrerade i Sverige ökade marginellt under första kvartalet 2003 från 565 till 567 miljarder kronor. Då nettoköpen av fondandelar, inkl utdelningar, var 30 miljarder innebär detta att den genomsnittliga värdeminskningen var 5,0 procent. Under första kvartalet sjönk Affärsvärldens generalindex med 7,6 procent. Nettoköpen av fondandelar som totalt uppgick till 30 miljarder var 19 miljarder högre än föregående kvartal vilket beror på de stora insättningarna i premiepensionssystemet under första kvartalet.

Negativt hushållssparande i fonder

Hushållen nettosålde fondandelar för 1,1 miljarder under första kvartalet vilket är en minskning jämfört med kvartalet innan då hushållen nettoköpte fondandelar för 1,7 miljarder. Av de totala nettoförsäljningarna på 1,1 miljarder stod aktiefonder för 1,6 miljarder, andra fonder än aktie- och räntefonder för 0,4 miljarder medan 0,9 miljarder sparades i räntefonder. Hushållens fondförmögenhet minskade med 14 miljarder under kvartalet och uppgick vid utgången av mars 2003 till 216 miljarder.

Nettosparandet i livförsäkringsanknutna fonder, s. k. unit-linked uppgick till 4,6 miljarder, vilket är en uppgång jämfört med fjärde kvartalet 2002 då det uppgick till 2,6 miljarder. Fondförmögenheten i unit-linked fonder minskade från 139 till 131 miljarder.

Räntefondernas andel ökar

Största delen av det totala fonsparandet under första kvartalet gick till andra fonder än aktie- och räntefonder, 13 miljarder, 9,5 miljarder sparades i aktiefonder medan sparandet i räntefonder uppgick till 7,6 miljarder. Aktiefondernas andel av den totala fondförmögenheten minskade från 58,6 till 56,1 procent. Räntefondernas andel ökade 1,3 procentenheter till 16,2 procent medan andra fonder ökade något till 27,6 procent. Antalet aktiva fonder uppgick till 574 vid slutet av första kvartalet, en ökning med två fonder under 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 0302. Utgivet den 15 maj 2003.
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, 566,8 mdkr 1:a kvartalet 2003	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
In English	11
Summary	11
List of tables	11

Tabeller

1. Antal aktiva fonder

1. Number of funds

		03kv1	02kv4	02kv3	02kv2	02kv1	01kv4	01kv3
Aktiefonder	<i>Equity funds</i>	349	345	356	352	350	349	338
Räntefonder	<i>Bond and money market funds</i>	90	93	93	93	93	92	92
Andra fonder	<i>Other funds</i>	135	134	133	128	127	118	111
SUMMA	TOTAL	574	572	582	573	570	559	541

2. Fondförmögenhet, mkr

2. Market value of funds, SEK million

		03kv1	02kv4	02kv3	02kv2	02kv1	01kv4	01kv3
Aktiefonder	<i>Equity funds</i>	318 080	331 278	305 584	396 062	492 915	491 399	419 510
Räntefonder	<i>Bond and money market funds</i>	92 022	84 239	83 525	77 778	75 391	72 292	72 372
Andra fonder	<i>Other funds</i>	156 658	149 584	144 884	160 550	177 944	168 209	153 106
SUMMA	TOTAL	566 760	565 102	533 993	634 390	746 250	731 900	644 988

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

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

		03kv1	02kv4	02kv3	02kv2	02kv1	Summa 02kv1-4	Summa 01kv1-4
Hushåll	<i>Households</i>	-1 092	1 679	-2 065	-468	2 349	1 495	-3 275
Hushållens ideella organisationer	<i>Non profit institutions serving households</i>	-152	-328	-237	-42	472	-135	1 716
Svenska finansiella företag	<i>Sw. financial corporations</i>	8 886	3 920	5 792	7 724	4 579	22 015	30 309
varav unit linked	<i>of which unit linked</i>	4 615	2 587	5 784	7 114	2 606	18 090	23 855
Svenska icke finansiella företag	<i>Sw. Non-financial corporations</i>	1 748	2 163	-258	1 977	1 924	5 806	5 597
Kommuner	<i>Local government</i>	149	328	260	-199	427	816	1 975
Socialförsäkring	<i>Social security funds</i>	19 109	1 564	-221	529	17 516	19 389	16 766
varav PPM	<i>of which PPM</i>	18 937	435	-214	530	17 323	18 074	16 702
Övriga svenska innehavare	<i>Other domestic owners</i>	480	1 327	360	-6	148	1 829	414
Utländska innehavare	<i>Foreign owners</i>	961	299	562	610	1 785	3 255	5 072
SUMMA	TOTAL	30 090	10 953	4 193	10 125	29 200	54 471	58 573

4. Fondförmögenhet fördelat på sektorer, mkr

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

	03kv1	02kv4	02kv3	02kv2	02kv1	01kv4
Hushåll <i>Households</i>	216 319	230 772	218 012	277 146	342 202	355 296
Hushållens ideella organisationer <i>Non profit institutions serving households</i>	27 062	28 003	27 205	31 341	36 714	36 410
Svenska finansiella företag <i>Sw. financial corporations</i>	178 156	174 370	165 090	188 121	211 643	204 592
varav unit linked <i>of which unit linked</i>	131 455	138 887	133 250	145 949	169 419	162 277
Svenska icke finansiella företag <i>Sw. non-financial corporations</i>	41 264	43 698	41 709	42 837	44 145	43 935
Kommuner <i>Local government</i>	6 989	6 890	6 453	6 778	8 130	7 617
Socialförsäkring <i>Social security funds</i>	70 449	55 827	51 787	63 135	76 733	59 396
varav PPM <i>of which PPM</i>	69 425	54 675	51 646	61 363	75 964	59 254
Övriga svenska innehavare <i>Other domestic owners</i>	6 048	5 528	4 574	4 998	5 428	4 198
Utländska innehavare <i>Foreign owners</i>	20 473	20 012	19 163	20 036	21 255	20 407
SUMMA TOTAL	566 760	565 102	533 993	634 390	746 250	731 852

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

5. Gross savings in funds, SEK million

	03kv1	02kv4	02kv3	02kv2	02kv1	Summa 02kv1-4	Summa 01kv1-4
Aktiefonder <i>Equity funds</i>							
Inbetalt <i>Sales</i>	24 305	27 422	12 851	22 164	30 676	93 113	94 058
Utbetalt <i>Redemptions</i>	14 805	18 983	16 420	17 953	15 668	69 024	73 581
Nettosparande <i>Net saving</i>	9 500	8 439	-3 569	4 211	15 008	24 089	20 477
Räntefonder <i>Bond and money market funds</i>							
Inbetalt <i>Sales</i>	16 327	15 859	11 135	13 137	11 913	52 044	58 282
Utbetalt <i>Redemptions</i>	8 699	15 701	6 955	11 115	10 824	44 594	45 523
Nettosparande <i>Net saving</i>	7 628	158	4 180	2 022	1 089	7 450	12 759
Andra fonder <i>Other funds</i>							
Inbetalt <i>Sales</i>	17 976	5 962	7 583	8 023	16 260	37 828	39 773
Utbetalt <i>Redemptions</i>	5 015	3 606	4 001	4 131	3 156	14 895	14 436
Nettosparande <i>Net saving</i>	12 962	2 356	3 582	3 892	13 103	22 933	25 337
TOTAL TOTAL							
Inbetalt <i>Sales</i>	58 608	49 244	31 568	43 324	58 849	182 985	192 112
Utbetalt <i>Redemptions</i>	28 519	38 290	27 375	33 199	29 649	128 513	133 540
Nettosparande <i>Net saving</i>	30 089	10 953	4 193	10 125	29 200	54 472	58 573

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

6. Gross savings in funds, SEK million

	03kv1	02kv4	02kv3	02kv2	02kv1	Summa 02kv1-4	Summa 01kv1-4
Aktiefonder <i>Equity funds</i>							
Inbetalt <i>Sales</i>	4 205	11 614	4 820	7 326	8 022	31 781	35 336
Utbetalt <i>Redemptions</i>	5 805	10 244	7 074	8 048	6 718	32 084	40 818
Nettosparande <i>Net saving</i>	-1 600	1 370	-2 254	-722	1 304	-302	-5 482
Räntefonder <i>Bond and money market funds</i>							
Inbetalt <i>Sales</i>	2 531	3 345	1 920	1 899	2 282	9 445	11 471
Utbetalt <i>Redemptions</i>	1 611	3 121	1 220	1 854	1 854	8 049	9 230
Nettosparande <i>Net saving</i>	919	223	700	45	428	1 396	2 241
Andra fonder <i>Other funds</i>							
Inbetalt <i>Sales</i>	1 043	1 491	992	1 464	1 586	5 533	5 959
Utbetalt <i>Redemptions</i>	1 455	1 406	1 503	1 255	968	5 132	5 993
Nettosparande <i>Net saving</i>	-412	86	-511	209	617	401	-34
TOTAL <i>TOTAL</i>							
Inbetalt <i>Sales</i>	7 779	16 450	7 731	10 689	11 889	46 760	52 766
Utbetalt <i>Redemptions</i>	8 871	14 771	9 797	11 157	9 540	45 265	56 041
Nettosparande <i>Net saving</i>	-1 092	1 679	-2 065	-468	2 349	1 495	-3 275

7. Placeringar, fonder totalt, mkr

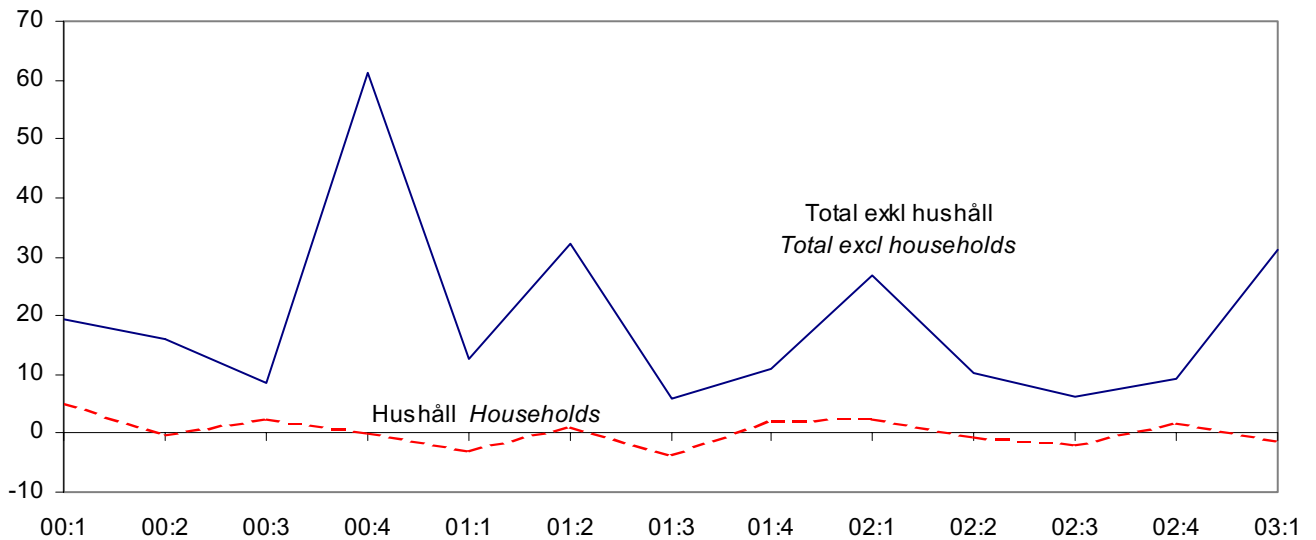
7. Fund investments at market value, total, SEK million

	03kv1	02kv4	02kv3	02kv2	02kv1	01kv4
Likvida medel <i>Liquid funds</i>	40 265	39 535	36 919	41 782	36 537	43 612
Aktier <i>Shares</i>	376 633	387 145	358 622	470 436	580 607	568 805
Noterade <i>Quoted</i>	375 032	383 190	355 981	461 152	575 363	563 680
finansiella företag <i>financial corp.</i>	43 111	43 108	39 215	51 733	58 778	57 299
icke fin. företag <i>non-financial corp.</i>	135 854	141 802	125 366	166 972	213 993	211 082
utländska företag <i>foreign corp.</i>	196 067	198 279	191 399	242 446	302 592	295 299
Onoterade <i>Unquoted</i>	1 601	3 956	2 641	9 284	5 243	5 124
finansiella företag <i>financial corp.</i>	2	123	7	1 731	33	3
icke fin. företag <i>non-financial corp.</i>	1 123	1 322	1 318	5 671	2 002	2 675
utländska företag <i>foreign corp.</i>	476	2 510	1 316	1 883	3 209	2 447
Räntebärande papper <i>Interest bearing securities</i>	229 638	201 947	216 285	181 835	189 856	179 263
Certifikat <i>Short term securities</i>	58 730	56 490	60 958	58 793	54 573	50 366
stat <i>central government</i>	47 205	42 343	46 591	46 789	45 916	41 682
kommun <i>local government</i>	11	1	10	27	75	27
finansinstitut <i>financial institutions</i>	8 024	10 340	10 710	7 553	2 582	3 661
övriga svenska <i>other domestic</i>	3 465	3 696	3 634	4 329	5 987	4 977
utlandet <i>rest of the world</i>	26	110	12	96	14	19
Obligationer <i>Long term securities</i>	170 908	145 457	155 327	123 042	135 283	128 897
stat <i>central government</i>	101 638	78 154	93 102	68 345	78 781	71 834
kommun <i>local government</i>	0	0	0	11	44	26
finansinstitut <i>financial institutions</i>	52 420	50 711	47 568	40 596	42 928	43 564
övriga svenska <i>other domestic</i>	9 154	7 969	7 993	7 029	5 484	5 355
utlandet <i>rest of the world</i>	7 696	8 623	6 665	7 061	8 045	8 118
Andelar i svenska vp-fonder <i>Dom. mutual funds</i>	1 338	1 733	989	1 036	785	3 259
Andelar i utländska vp-fonder <i>Foreign mutual funds</i>	1 347	1 278	693	776	529	2 047
Derivatinstrument <i>Derivatives</i>	1 030	1 050	2 635	2 570	2 431	2 916
SUMMA TOTAL	650 250	632 687	616 142	698 434	810 745	799 902
därav övriga fordringar/skulder <i>of which other demands/debts</i>	-83 490	-67 586	-82 149	-64 043	-64 496	-68 050
Fondernas värde <i>Market value of funds</i>	566 760	565 102	533 993	634 390	746 250	731 852

Diagram

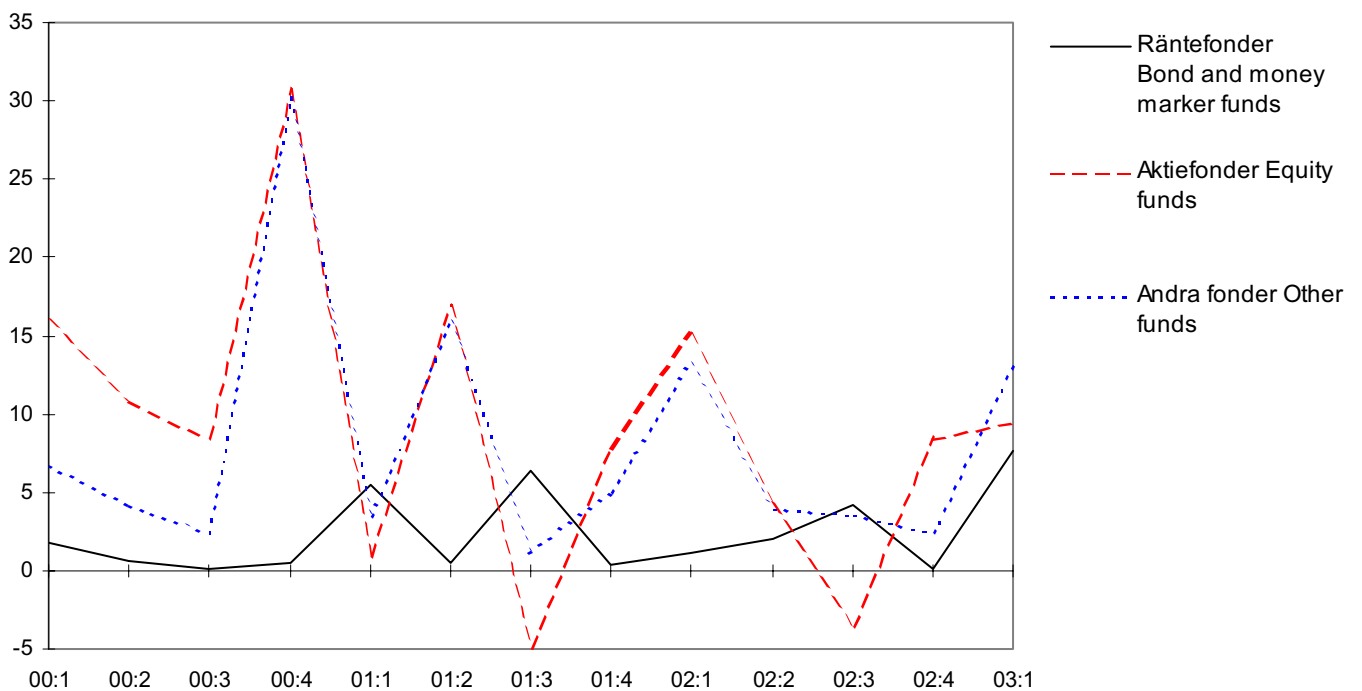
1. Nettosparande, totalt exkl. hushåll samt hushåll, mdkr

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



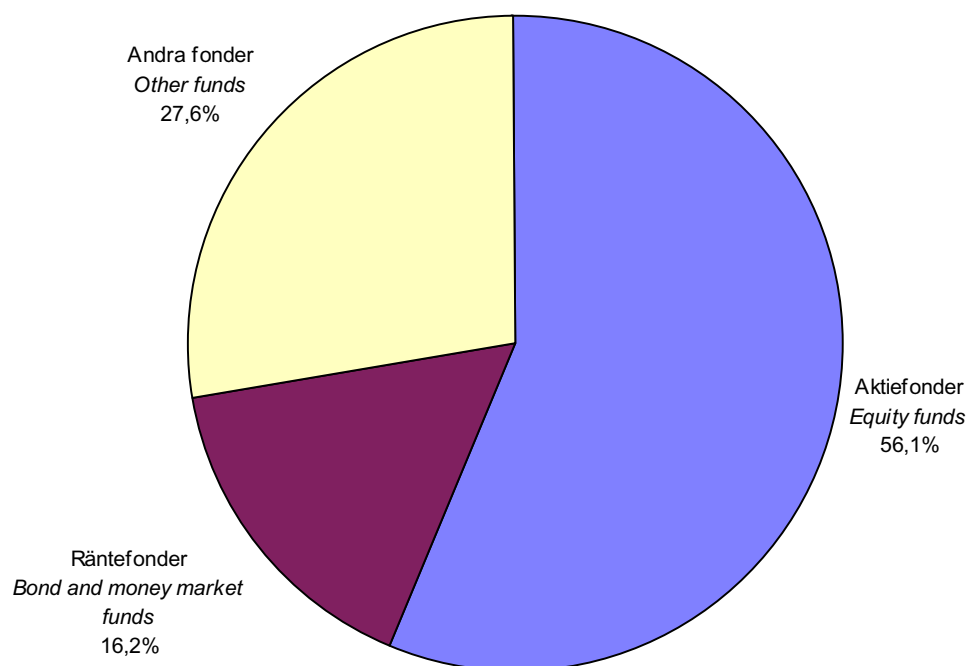
2. Nettosparande, fördelat på fondtyp, mdkr

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



3. Fondtypernas andel av det totala fondvärdet, 566,8 mdkr 1:a kvartalet 2003

3. Type of fund as a proportion of the total value of funds, 566.8 SEK billion, first quarter 2003



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 2003-03-31 var antalet aktiva fonder 574. 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. I denna publicering saknas sex fonder som ännu inte hade rapporterat. För dessa har förmögenhetsvärden för tredje kvartalet använts och fondsparandet har antagits vara noll.

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 elektroniskt 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 balanspos-

ter. 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 30 billion in net savings for mutual funds in the first quarter 2003

The outstanding value for mutual funds registered in Sweden increased during the first quarter 2003 from SEK 565 billion to SEK 567 billion. Since net savings included reinvested dividends amounting to SEK 30 billion, the average decrease in value of the funds was 5.0 percent. During the first quarter, the SX General index decreased by 7.6 percent. The total net savings for mutual funds, SEK 30 billion, was SEK 19 billion higher than in the previous quarter, which is due to large savings in the Premium Pension System this quarter.

Households invest in bond and money market funds

Net savings in mutual funds for the household sector were SEK -1.1 billion in the first quarter 2002. Last quarter the net savings amounted to SEK 1.7. Of the total saving of SEK -1.1 billion the major part went to bond and money market funds SEK 0.9 billion. Saving in equity funds and other funds were negative SEK 1.6 billion and SEK 0.4 billion respectively. The outstanding value of funds for the household sector has decreased by SEK 14 billion during the quarter amounting to SEK 216 billion first quarter 2002.

Net savings for unit linked funds amounted to SEK 4.6 billion during the first 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 from SEK 139 billion to SEK 131 billion.

Increasing share in Equity funds

The dominant amount of net savings in mutual funds during the second quarter was in other funds, SEK 13.0 billion. The savings in equity funds was SEK 9.5 billion while savings in bond and money market funds was SEK 7.6 billion. The share of equity funds in the total fund value during the quarter decreased from 58.6 to 56.1 percent. The share of other funds and bond and money market funds increased to 27.6 percent and 16.2 percent respectively. The number of active mutual funds amounted to 574 at the end of the first quarter 2003, an increase with two funds compared to last quarter.

List of tables

1. Number of 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