

## Värdepappersstatistik (SVDB)

2016

FM9998

*I denna beskrivning redovisas först administrativa 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

<b>A</b>	<b>Allmänna uppgifter</b> .....	<b>2</b>
A.1	Ämnesområde .....	2
A.2	Statistikområde .....	2
A.3	SOS-klassificering .....	2
A.4	Statistikansvarig .....	2
A.5	Statistikproducent .....	2
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 .....	4
A.11	Statistikanvändning .....	4
A.12	Uppläggning och genomförande .....	4
A.13	Internationell rapportering .....	4
A.14	Planerade förändringar i kommande undersökningar .....	4
<b>B</b>	<b>Kvalitetsdeklaration</b> .....	<b>4</b>
B.0	Inledning .....	4
B.1	Innehåll .....	4
1.1	Statistiska målstorheter .....	4
1.1.1	Objekt och population .....	5
1.1.2	Variabler .....	5
1.1.3	Statistiska mått .....	5
1.1.4	Redovisningsgrupper .....	5
1.1.5	Referenstider .....	5
1.2.	Fullständighet .....	6
B.2	Tillförlitlighet .....	6
2.1	Tillförlitlighet totalt .....	6
2.2	Osäkerhetskällor .....	6
2.2.1	Urval .....	6
2.2.2	Ramtäckning .....	6
2.2.3	Mätning .....	6
2.2.4	Svarsbortfall .....	7
2.2.5	Bearbetning .....	7
2.2.6	Modellantaganden .....	7

2.3	Redovisning av osäkerhetsmått.....	7
B.3	<i>Aktualitet</i> .....	7
3.1	Frekvens .....	7
3.2	Framställningstid.....	7
3.3	Punktlighet .....	7
B.4	<i>Jämförbarhet och sam användbarhet</i> .....	7
4.1	Jämförbarhet över tiden.....	7
4.2	Jämförbarhet mellan grupper .....	8
4.3	Sam användbarhet med annan statistik .....	8
B.5	<i>Tillgänglighet och förståelighet</i> .....	8
5.1	Spridningsformer.....	8
5.2	Presentation .....	8
5.3	Dokumentation.....	8
5.4	Tillgång till primärmaterial .....	8
5.5	Upplysningstjänster.....	9

## **A Allmänna uppgifter**

### **A.1 Ämnesområde**

*Ämnesområde:* Finansmarknad

### **A.2 Statistikområde**

*Statistikområde:* Övrigt

### **A.3 SOS-klassificering**

*Tillhör (SOS)* Nej

### **A.4 Statistikansvarig**

*Myndighet/organisation:* Sveriges riksbank  
*Postadress:* 103 37 Stockholm  
*Besöksadress:*  
*Kontaktperson:* Jyry Hokkanen  
*Telefon:* 08-787 00 00  
*Telefax:* 08-24 53 48  
*E-post:* fornamn.efternamn@riksbank.se

### **A.5 Statistikproducent**

*Myndighet/organisation:* Statistiska centralbyrån  
*Postadress:* Box 24 300 104 51 Stockholm  
*Besöksadress:*  
*Kontaktperson:* Jon Smedsaas  
*Telefon:* 08-50694708  
*Telefax:* 08- 66 777 88  
*E-post:* fornamn.efternamn@scb.se

## A.6 Uppgiftsskyldighet

Uppgiftslämnarplikt föreligger med stöd av lagen om Sveriges riksbank (1988:1385) 6 kap. 9 §. Mer information finns också i Riksbankens författningssamling (RBFS 2012:1).

Uppgifter som samlas in från emittenter regleras av Riksbankslagen varvid vite kan utdömas vid sen eller oriktig rapportering.

## A.7 Sekretess och regler för behandling av personuppgifter

SCB:s eventuella åtaganden beträffande affärssekretess, konfidentialitet eller liknande begränsas av reglerna om offentlighet och sekretess i 2 kap. tryckfrihetsförordningen (TF) och 24 kap. 8 § offentlighets- och sekretesslagen (2009:400). Regler om affärssekretess finns i 19 kap. 1-3 §§ samt 31 kap. 12-15 §§ och 18-19 §§ offentlighets- och sekretesslagen (2009:400).

Uppgifter som levereras till Riksbanken omfattas av offentlighets och sekretesslagen (2009:400). Sekretess gäller för samtliga uppgifter i 20 år.

Publicerade uppgifter genomgår röjandekontroll.

## A.8 Gallringsföreskrifter

Riksbanken är arkivansvarig myndighet enligt arkivlagen för de handlingar och statistiska uppgifter som upprättas och samlas in av SCB för Riksbankens räkning. SCB förbereder för arkivering och överlämnar till Riksbanken grunddata och andra register, inklusive gamla versioner, samt standardiserade leveransvariabler/leveranser som ska arkiveras. Registren och leveransvariablerna bevaras digitalt och konverteras av SCB till det format som Riksarkivet fastställt som arkivformat. Inkomna statistiska rapporter, i digital eller pappersform, med primäruppgifter gallras av SCB enligt Riksbankens gallringsbeslut. Publikationer, rapporter och dokumentation av statistiken bevaras digitalt och arkiveras av Riksbanken enligt gällande informationshanteringsplan. Riksbanken diarieför vissa handlingar rörande finansmarknadsstatistiken.

Varje institut som lämnar uppgifter elektroniskt måste spara en undertecknad kopia av rapporten i läsbar form i minst två år efter utgången av den rapportperiod som uppgiften avser. Även kopior av rättelser och andra ändringar av lämnade uppgifter som institutet gör skall undertecknas och sparas i minst två år. Detta i enlighet med Riksbankens föreskrifter och allmänna råd RBFS 2010:1.

*Följande handlingar får gallras med den gallringsfrist SCB bestämmer:*

Inkomna statistiska rapporter, i digital eller pappersform, med primäruppgifter tillhörande värdepappersstatistiken får gallras under förutsättning att innehållet har förts över till SCB:s databas för Värdepappersstatistik och att nödvändig kontroll har skett

## A.9 EU-reglering

För Riksbankens åtagande att delta i kvalitetsarbetet med ECB:s värdepappersdatabas gäller Guideline of the European Central Bank of 26 september 2012 on the data quality management framework for the Centralised Securities Database (2012/689/EU). SCB har åtagit sig att genomföra detta arbete för Riksbankens räkning.

## **A.10 Syfte och historik**

För Riksbankens arbete inom penningpolitik och finansiell stabilitet är det viktigt att Riksbanken kan följa utvecklingen på kreditmarknaderna. Under finanskrisen hösten 2008 framkom stora brister i den statistik över värdepappersmarknader som Riksbanken förfogade över. För att kunna följa utvecklingen på kreditmarknaderna krävs statistik som visar hur t.ex. bankers och företags marknadsfinansiering utvecklas och på vilka villkor den sker. Detta gäller särskilt i orostider när det råder tveksamheter om hur väl marknaderna fungerar. Offentligt tillgänglig statistik är också till fördel för marknadens aktörer.

Den första undersökningen skedde april 2013 med mars 2013 som referensperiod.

## **A.11 Statistikanvändning**

Värdepappersstatistik används för analys av finansmarknaderna på kort och lång sikt.

Användare är Riksbanken och annan SCB-statistik såsom Nationalräkenskaper, Finansmarknadsstatistik och Betalningsbalansen.

## **A.12 Uppläggning och genomförande**

På uppdrag av Riksbanken samlar SCB in, bearbetar och publicerar månadsvis värdepappersstatistik. Upplägget är en undersökning av alla svenska institutioner som emitterar räntebärande värdepapper. Källorna till statistiken är direktinsamling från emittenter och registerdata från Euroclear, Europeiska centralbanken och företagsdatabasen.

## **A.13 Internationell rapportering**

Värdepappersstatistiken rapporteras månatligen till Europeiska Centralbanken, ECB.

## **A.14 Planerade förändringar i kommande undersökningar**

Inga förändringar är planerade.

# **B Kvalitetsdeklaration**

## **B.0 Inledning**

### **B.1 Innehåll**

#### **1.1 Statistiska målstorheter**

Ett antal statistiska storheter, i huvudsak totaler i SEK, skattas som avser att på olika sätt beskriva emissioner av värdepapper gjorda av svenska företag i Sverige eller utomlands.

### 1.1.1 Objekt och population

Populationen består av alla, av svenska företag oavsett sektor och bransch, vid en given tidpunkt levande emitterade värdepapper.

### 1.1.2 Variabler

Till varje emitterat värdepapper kopplas ett antal egenskaper (eller variabler) där några kan betraktas som bakgrundsvariabler. Följande variabler samlas in:

<i>Variabler</i>	
Denomineringsvaluta	Organisationsnummer
Emissionsdatum	Pris
Emissionspris	Prisdatum
Emissionsprogrammets volym	Rating
Emittentens hemvist	Referensdatum
Emittentnamn	Reposition
ESA95 Sektor	Räntebas
Fast kupongränta	SecurityType
Förfalldatum	Senaste förändringsdatum
Förfallopris	Senaste kupongdatum
Förfallovaluta	Senaste kupongfrekvens
Första räntedag	Senaste kupongränta
ISIN-kod	Säkerhetstyp
Kupongreferensränta	Underliggande säkerhet
Kupongreferensräntepåslag	Utestående belopp
Kupongtyp	Utestående belopp Emittent
Kupongvaluta	Utestående belopp Euroclear
Kvoteringsbas	VP-info
MFI-kod	Värdepapperssort
Månatligt genomsnittspris	Värdepapperstyp
Nace sektor	Värderingsprincip

### 1.1.3 Statistiska mått

De statistiska mått som redovisas är summor, i SEK.

### 1.1.4 Redovisningsgrupper

De statistiska målstorheterna skattas uppdelade på institutionell sektor, förfallotid, värdepapperstyp, valuta samt värdering.

### 1.1.5 Referenstider

Uppgifterna avser levande värdepapper vid referenstidpunkten som är den sista dagen i varje kalendermånad.

## **1.2. Fullständighet**

Fullständigheten kan överlag anses vara bra.

## **B.2 Tillförlitlighet**

### **2.1 Tillförlitlighet totalt**

Den totala tillförlitligheten bedöms som god. Undersökningen är en totalundersökning med full ramtäckning. Uppgifterna i undersökning har flera källor vilket gör att mätfel upptäcks vid samgranskning av uppgifterna. I direktinsamlingen av uppgifter från emittenter har inga bortfall förekommit. Däremot har inga studier över antalet bearbetningsfel genomförts.

### **2.2 Osäkerhetskällor**

#### *2.2.1 Urval*

Undersökningen undersöker alla levande emitterade värdepapper, dvs. den är en totalundersökning, därför finns inget osäkerhet pga. urval. Dock finns det en avgränsning i direktinsamlingen av uppgifter om emitterade värdepapper utomlands av svenska företag. Avgränsningen bedöms inte påverka kvaliteten i slutresultatet nämnvärt då uppgifter om dessa värdepapper hämtas från andra källor.

#### *2.2.2 Ramtäckning*

Merparten av alla värdepapper som emitteras på svensk marknad registreras hos Euroclear och erhåller en internationell identifikator, en så kallad ISIN-kod. Uppgifter om värdepappret bokförs i samband med det hos Euroclear och framtida förändringar i värdepappret samlas också in. Informationen om värdepappret är därmed god och aktuell. Detta förfarande finns i hela Europa. Eftersom undersökningen hämtar uppgifter från både Euroclear och den europeiska centrala värdepappersdatabasen (CSDB) som Europeiska Centralbanken ansvarar för så bedöms sannolikheten som väldigt liten att något värdepapper med ISIN-kod skulle missas i insamlingen. Ett fåtal större emittenter ger ut värdepapper utan ISIN-kod. Information om dessa värdepapper samlas enbart in via direktinsamling från emittenterna själva via xml-fil.

#### *2.2.3 Mätning*

Den totala mättillförlitligheten bedöms som god. Detta på grund av att undersökningen baseras på uppgifter som till viss del finns tillgängliga via olika källor, vilket underlättar kvalitetskontroller. Dessutom finns det möjligheter att stämna av inrapporterade uppgifter mot offentliga uppgifter som prospekt och annan offentlig dokumentation.

Det är tänkbart att fel uppstår i samband med inmatning av uppgifter i någon av de datakällor som finns. Är dessa fel små riskerar de att undgå den granskning som görs. Större fel ska normalt fångas upp och korrigeras efter kontakt med uppgiftslämnaren.

Ingen studie har genomförts för att försöka mäta mätfelet.

#### 2.2.4 Svarsbortfall

Uppgifterna från emittenter samlas in med stöd av Riksbankslagen vilket bland annat innebär att vite kan tilldelas rapportörer som är sena med rapporteringen. Inget bortfall förekommer.

#### 2.2.5 Bearbetning

Någon särskild studie av bearbetningsfel har ännu inte genomförts.

När handläggare som arbetar med undersökningen gör korrigeringar av insamlade uppgifter kan det inträffa att ett felaktigt värde matas in på grund av den så kallade mänskliga faktorn. En annan bearbetningsrisk uppstår då värdepappret ska kopplas ihop med ett företag för att på så sätt erhålla en sektorkod. Om värdepappret kopplas ihop med fel företag kan det få ett annat företags sektorkod och på så sätt felaktigt påverka de målstorheter som redovisas uppdelade på sektor.

Värdepappersstatistiken är en snabbstatistik med kort tid mellan referenstidpunkt och publicering och kommer därför att vara föremål för revideringar.

På grund av sekretessregler är resultaten inte uppdelade så detaljerat som en del användare kan tänkas önska, vilket troligtvis kan försvåra tolkningar av resultaten.

#### 2.2.6 Modellantaganden

Inga modellantaganden görs förutom de ovan angivna.

### 2.3 Redovisning av osäkerhetsmått

Inga osäkerhetsmått redovisas. Ett mått på urvalsosäkerhet är heller inte aktuellt att redovisa då undersökningen inte är urvalsbaserad.

## B.3 Aktualitet

### 3.1 Frekvens

Undersökning genomförs och redovisas månatligen. Varje månad samlas uppgifter in avseende ställningsvärden och transaktioner med månad som referensperiod.

### 3.2 Framställningstid

Insamlingen av uppgifter via direktinsamling avslutas fyra bankdagar efter referensmånadens utgång. Efter tolv bankdagar publiceras resultaten från undersökningen på [www.scb.se](http://www.scb.se).

### 3.3 Punktlighet

Resultaten publiceras enligt SCB:s publiceringskalender.

## B.4 Jämförbarhet och sammanvändbarhet

### 4.1 Jämförbarhet över tiden

Undersökningen är ny från mars 2013. Inga förändringar har skett sedan start som påverkar jämförbarheten över tiden. Historiska uppgifter från 1996 vad gäller volymer av emitterade värdepapper finns dock tillgängligt via bland annat

Finansräkenskaperna. Uppgifterna i Finansräkenskaperna samlas in aggregerat från uppgiftslämnare och är därmed behäftade med andra eventuella insamlingsfel än Värdepapperstatistiken. Det kan också skilja i värdering av de emitterade värdepapperna i de olika insamlingarna.

#### **4.2 Jämförbarhet mellan grupper**

Uppgifter om emissioner av räntebärande värdepapper finns tillgängligt i andra europeiska länder. Insamlingsmetoder och användning av de insamlade uppgifterna kan skilja sig något men slutprodukten ska trots det vara jämförbar.

Europeiska Centralbanken, ECB, publicerar uppgifter om emitterade värdepapper för de länder som deltar i eurosamarbetet.

#### **4.3 Samanvändbarhet med annan statistik**

Uppgifterna går att jämföra med bland annat Finansmarknadsstatistik och Balansstatistiken, BAST för att bland annat jämföra företagens upplåning. Det finns dock vissa metodskillnader som bör beaktas vid jämförelser. Finansmarknadsstatistikens uppgifter är uppdelade på svensk respektive utländsk marknadsplats medan Värdepappersstatistiken är uppdelad på svensk respektive utländsk valuta.

### **B.5 Tillgänglighet och förståelighet**

#### **5.1 Spridningsformer**

Statistiken publiceras den 12:e bankdagen varje månad kl. 09.30 på SCB:s webbplats [www.scb.se](http://www.scb.se).

På webbplatsen publiceras statistiknyheter som innehåller analyser av statistiken. Det finns även möjlighet att göra egna uttag från Statistikdatabasen.

#### **5.2 Presentation**

I dagsläget är presentationen av resultaten inte särskilt omfattande i termer av antal tabeller och diagram. På sikt kan detta komma att utökas om önskemål om det förs fram av användare.

#### **5.3 Dokumentation**

Framtagandet och designen av Värdepappersstatistiken finns dokumenterad i SCBDOK och dess kvalitet finns sammanfattad i detta dokument, Beskrivning av statistiken (BaS). En mer detaljerad innehållsbeskrivning finns i det som kallas för MetaPlus. Samtliga dokumentationer finns tillgängliga på SCB:s webbplats.

#### **5.4 Tillgång till primärmaterial**

SCB utför på beställning specialbearbetningar av primärmaterial. Forskare med flera kan efter prövning få tillgång till avidentifierat material för egen bearbetning.



## **5.5      Upplysningstjänster**

Frågor kan skickas via e-post direkt till oss som arbetar med Värdepappersstatistiken: [SVDB@scb.se](mailto:SVDB@scb.se). Det går också bra att vända sig till SCB:s centrala Statistiks-service 08 / 506 940 00.