

证券期货经营机构私募资管产品备案月报 (2024年2月)

一、私募资管产品备案情况

2024年2月，证券期货经营机构共备案私募资管产品497只，环比减少38.11%，同比减少37.88%；设立规模234.82亿元，环比减少55.43%，同比减少37.38%（见图1）。

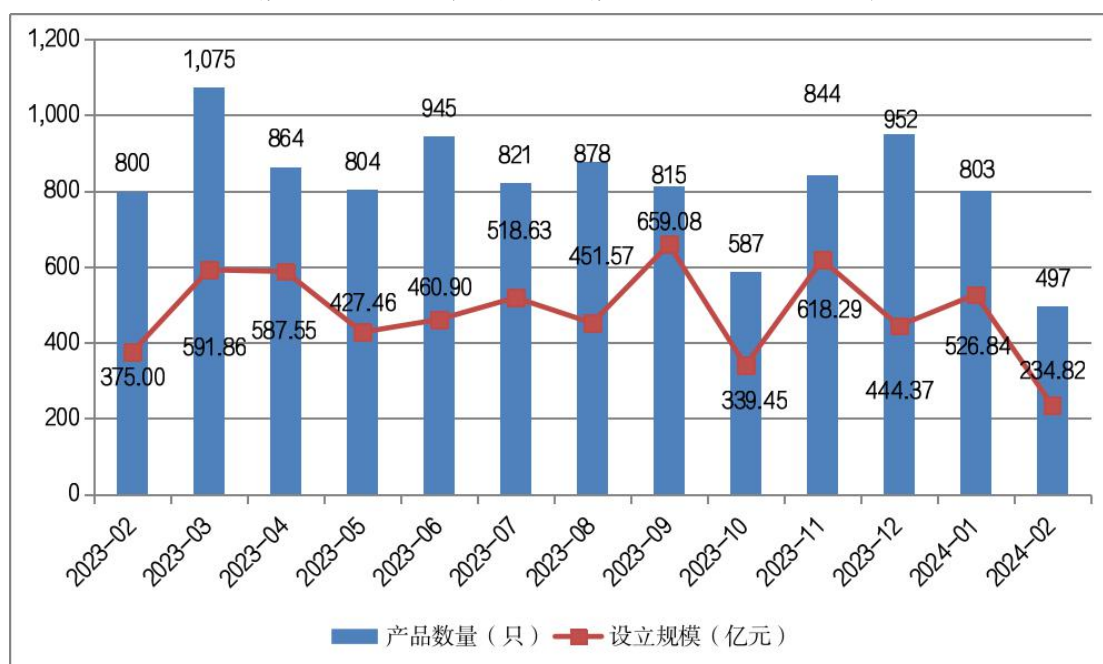


图1 证券期货经营机构资管产品月度备案数量及规模趋势

2月备案的497只产品中，60.97%是证券公司及其子公司产品，31.59%是基金公司及其子公司产品（见表1）。

表1 按机构类型分私募资管产品月度备案情况（2024年2月）

机构类型	备案数量 (只)	设立规模 (亿元)	规模占比
证券公司及其资管子公司	292	164.29	69.97%
证券公司私募子公司	11	10.36	4.41%
基金管理公司	138	40.76	17.36%
基金子公司	19	3.26	1.39%
基金管理公司私募子公司	0	0	0.00%
期货公司及其资管子公司	37	16.14	6.87%
合计	497	234.82	100.00%

从产品类型看，2月备案的集合产品平均单只设立规模低于1月单只设立规模的33%，单一产品单只设立规模低于1月的9%，均略低于2023年全年平均水平（见表2）。

表2 按产品类型分私募资管产品月度备案情况（2024年2月）

产品类型	备案数量（只）	设立规模（亿元）	规模占比
集合资产管理计划	218	153.02	65.16%
单一资产管理计划	279	81.80	34.84%
合计	497	234.82	100.00%

从投资类型看，2月备案产品以固定收益类与混合类产品为主（见表3）。

表3 按投资类型分私募资管产品月度备案情况（2024年2月）

投资类型	备案数量（只）	设立规模（亿元）	规模占比
权益类	43	14.43	6.15%
固定收益类	293	166.85	71.05%
期货和衍生品类	20	15.24	6.49%
混合类	141	38.30	16.31%
合计	497	234.82	100.00%

二、私募资管产品存续情况

截至2024年2月底，证券期货经营机构私募资管业务规模合计12.27万亿元（不含社保基金、企业年金），较上月底减少1,352亿元，下降1.1%。（证券期货经营机构存续产品规模分布情况见图2）

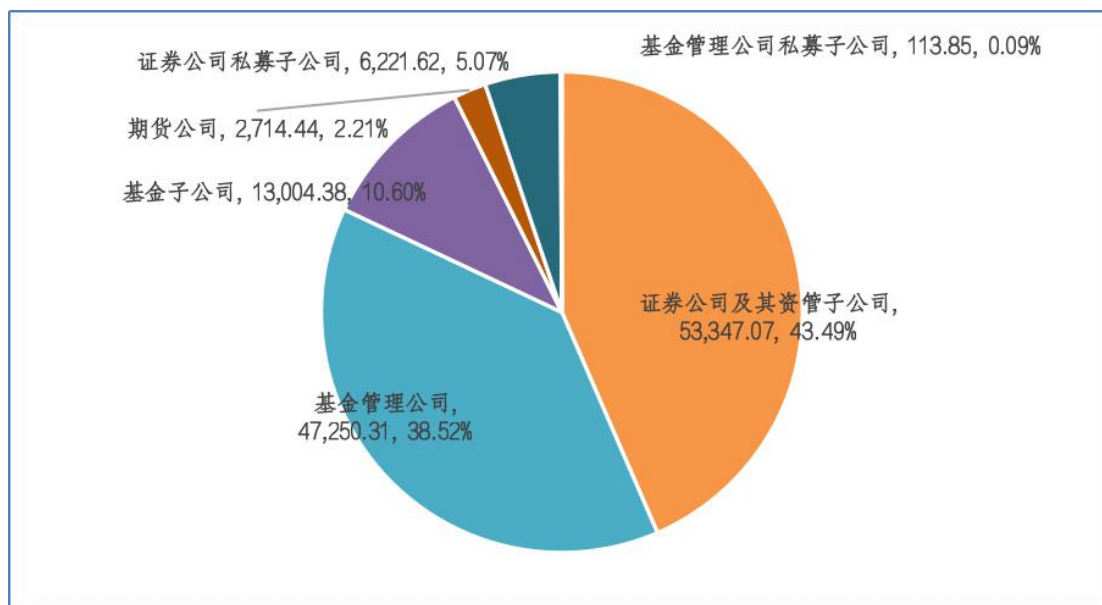


图2 证券期货经营机构存续产品规模分布情况 (单位: 亿元)

从产品类型看, 存续单一资产管理计划数量与规模均高于集合资产管理计划 (见表4)。

表4 按产品类型分私募资管产品存续情况 (截至2024年2月底)

产品类型	数量 (只)	数量占比	规模 (亿元)	规模占比
集合资产管理计划	16,433	48.62%	58,128.14	47.39%
单一资产管理计划	17,367	51.38%	64,523.53	52.61%
合计	33,800	100.00%	122,651.67	100.00%

从投资类型看, 固定收益类产品数量和规模均占据四类产品最大比例, 混合类产品数量位居第二, 权益类产品规模位居第二, 期货和衍生品类产品数量和规模均较小 (见表5)。

表5 按投资类型分私募资管产品存续情况 (截至2024年2月底)

投资类型	数量 (只)	数量占比	规模 (亿元)	规模占比
权益类	5,557	16.44%	18,878.07	15.39%
固定收益类	15,151	44.83%	90,404.08	73.71%
期货和衍生品类	1,425	4.22%	872.95	0.71%
混合类	11,667	34.52%	12,496.58	10.19%
合计	33,800	100.00%	122,651.67	100.00%

三、证券期货经营机构管理私募资管业务规模分布情况

截至2024年2月底, 证券公司及其资管子公司平均管理私募资管业务规模556亿元, 管理规模中位数230亿元;

证券公司私募子公司平均管理私募基金 85 亿元，管理规模中位数为 24 亿元；基金管理公司平均管理私募资管业务规模 363 亿元，管理规模中位数 94 亿元；基金子公司平均管理私募资管业务规模 194 亿元，管理规模中位数 50 亿元；期货公司及其资管子公司平均管理私募资管业务规模 24 亿元，管理规模中位数 3 亿元。（证券期货经营机构管理私募资管业务规模分布情况见图 3 至 7）

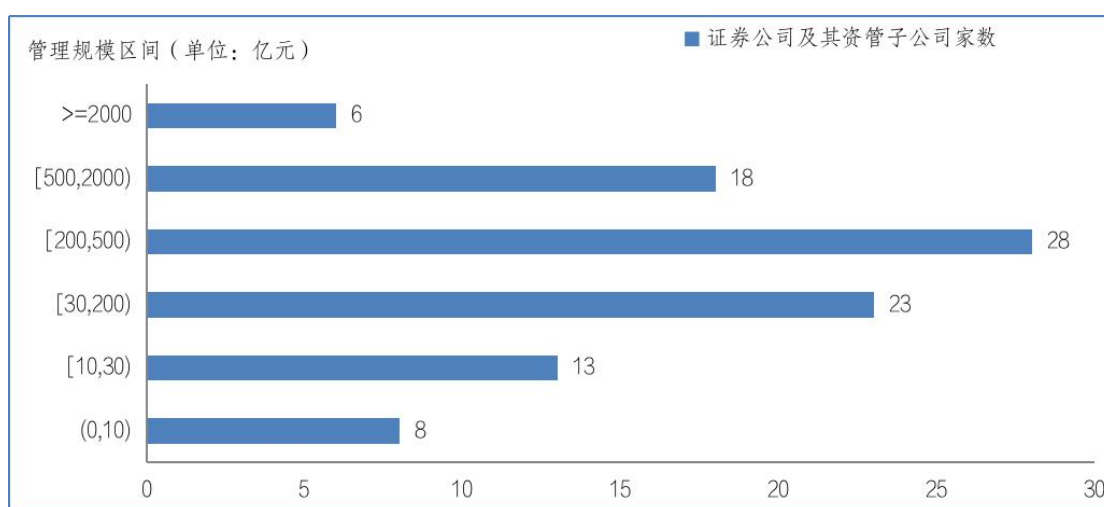


图 3 证券公司及其资管子公司私募资管业务规模分布情况

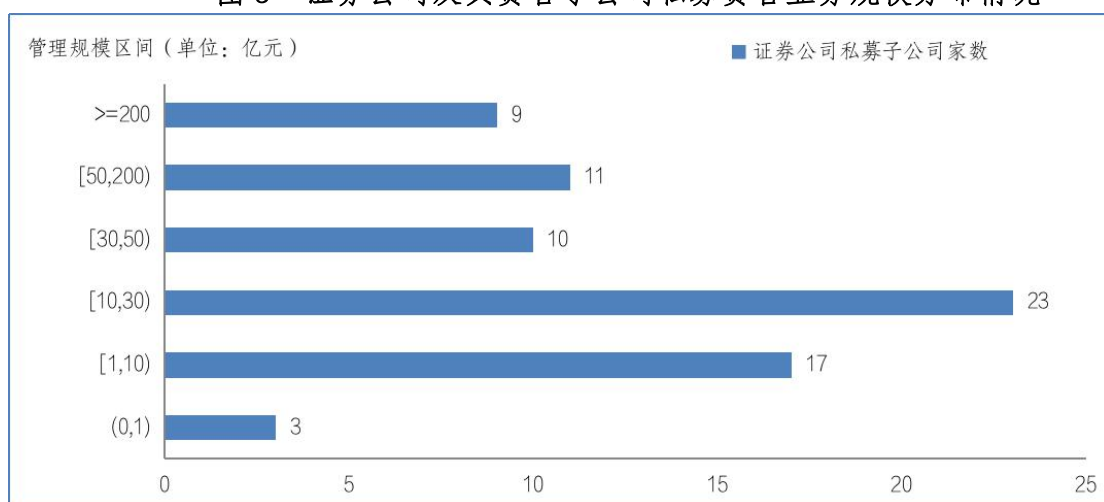


图 4 证券公司私募子公司私募基金规模分布情况

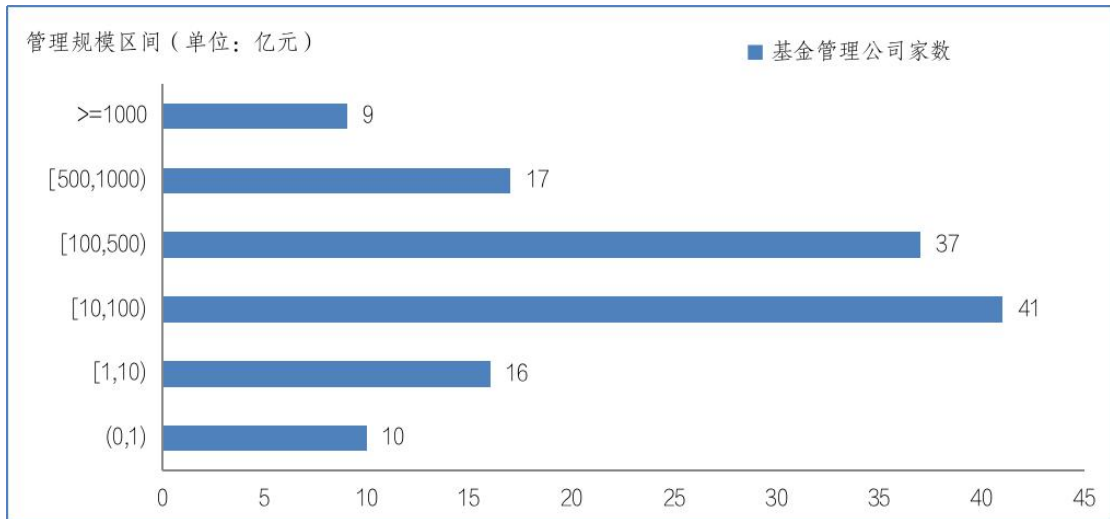


图5 基金管理公司私募资管业务规模分布情况

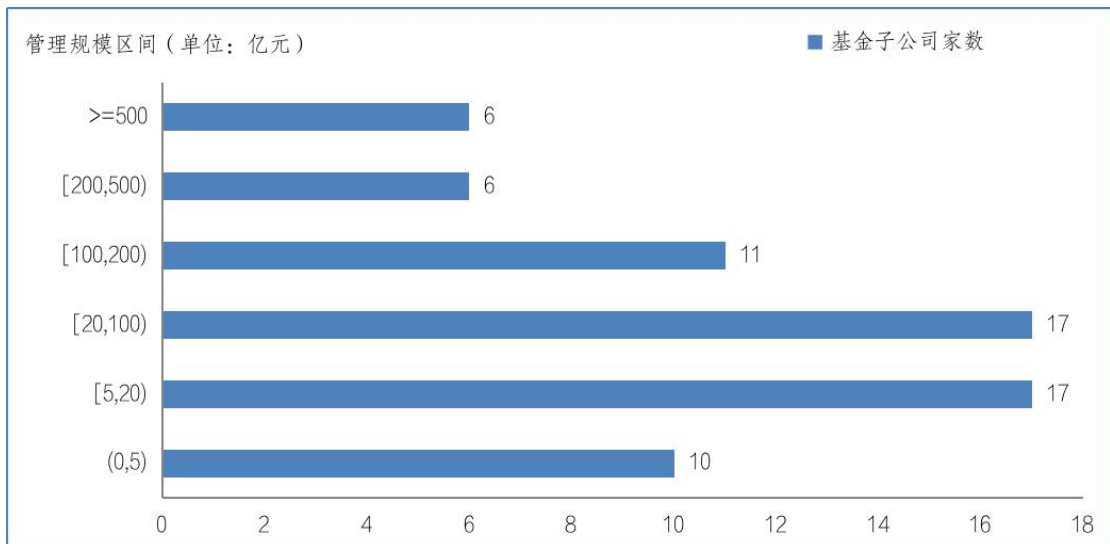


图6 基金子公司私募资管业务规模分布情况

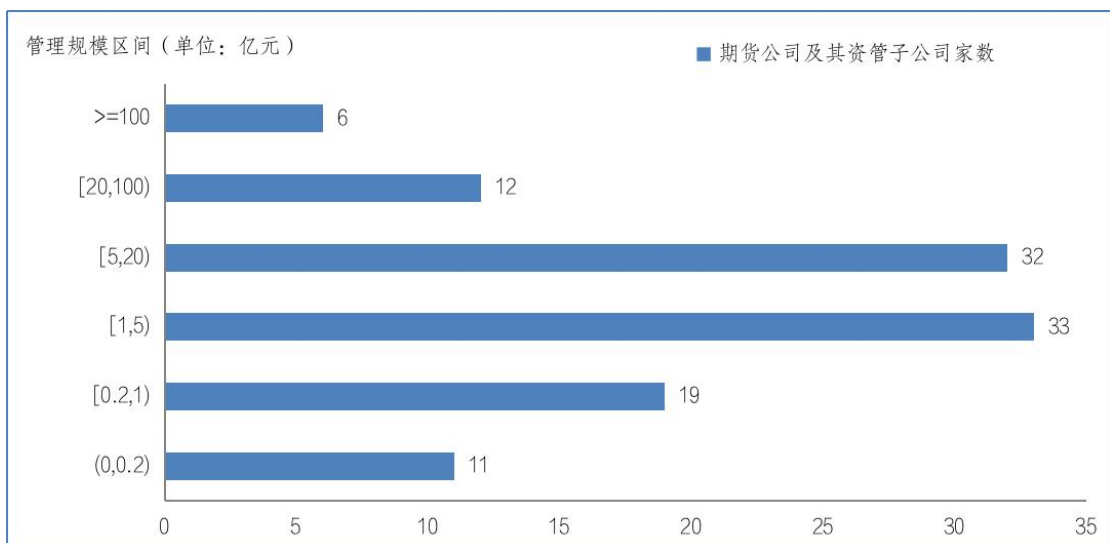


图7 期货公司及其资管子公司私募资管业务规模分布情况

注：

[1] 本文统计数据含证券公司私募子公司私募基金和基金管理公司私募子公司数据，不含基金管理公司、证券公司管理的社保基金、基本养老金、企（职）业年金等，不含证券公司及基金子公司管理的企业资产证券化产品。

[2] 设立规模指产品备案时的初始规模或募集规模，证券公司私募子公司和基金管理公司私募子公司设立规模指备案时的实缴规模。

[3] 存续规模指当月末正在运作产品的资产净值，证券公司私募子公司和基金管理公司私募子公司私募基金存续规模指当月末实缴规模。由于统计时点后存在行业机构重报、更新数据等情况，环比中上月末存续规模可能会有调整。

[4] 本文规模分布情况统计范围为：截至统计时点有正在运作产品的管理人。

[5] 由于四舍五入原因，本文可能存在分项数据之和不等于合计数据的情形。