

证券期货经营机构私募资管产品备案月报 (2023年1月)

一、私募资管产品备案情况

2023年1月，证券期货经营机构当月共备案私募资管产品487只，设立规模294.56亿元（见图1）。当月新设产品平均备案核查时间为2.4个工作日。

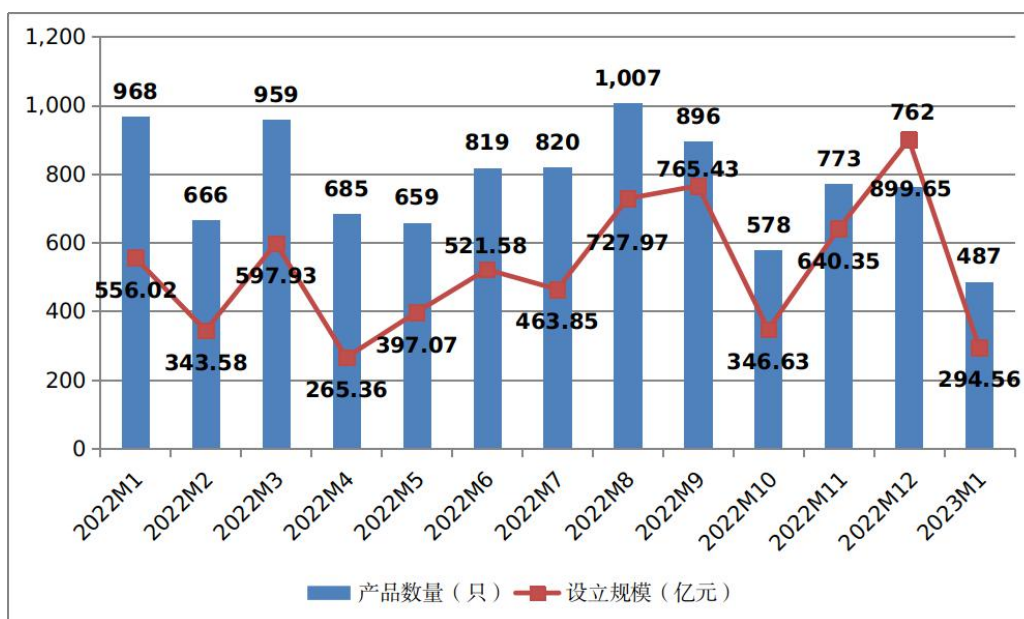


图1 证券期货经营机构资管产品月度备案数量及规模趋势

从机构类型看，1月备案私募资管产品数量最多、设立规模最大的为证券公司及其资管子公司（见表1）。证券公司私募子公司1月备案的14只私募基金中12只为合伙型基金，2只为契约型基金。

表1 按机构类型分私募资管产品月度备案情况（2023年1月）

机构类型	产品数量 (只)	设立规模 (亿元)	规模占比
证券公司及其资管子公司	241	157.76	53.56%
证券公司私募子公司	14	46.27	15.71%
基金管理公司	137	64.40	21.86%
基金子公司	33	17.01	5.78%
期货公司及其资管子公司	62	9.12	3.10%
合计	487	294.56	100.00%

从产品类型看，1月备案的集合资产管理计划设立规模占比高于单一资管计划（见表2）。

表2 按产品类型分私募资管产品月度备案情况（2023年1月）

产品类型	产品数量（只）	设立规模（亿元）	规模占比
集合资产管理计划	230	178.62	60.64%
单一资产管理计划	257	115.93	39.36%
合计	487	294.56	100.00%

从投资类型看，1月备案私募资管产品数量最多、设立规模最大的为固定收益类（见表3）。

表3 按投资类型分私募资管产品月度备案情况（2023年1月）

投资类型	产品数量（只）	设立规模（亿元）	规模占比
权益类	51	67.05	22.76%
固定收益类	248	155.56	52.81%
商品及金融衍生品类	38	16.77	5.69%
混合类	150	55.17	18.73%
合计	487	294.56	100.00%

二、私募资管产品存续情况

截至2023年1月底，证券期货经营机构私募资管业务规模合计13.93万亿元（不含社保基金、企业年金），较上月底减少3,754.94亿元，下降2.62%。（证券期货经营机构存续产品规模分布情况见图2）

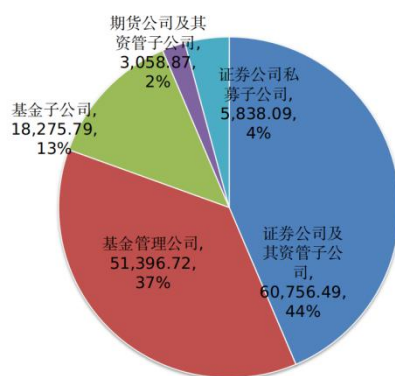


图2 证券期货经营机构存续产品规模分布情况（单位：亿元）

从产品类型看，1月存续单一资产管理计划规模占比为53.78%（见表4）。

表4 按产品类型分私募资管产品存续情况（截至2023年1月底）

产品类型	数量（只）	数量占比	规模（亿元）	规模占比
单一资产管理计划	17,463	54.61%	74,922.64	53.78%
集合资产管理计划	14,515	45.39%	64,403.33	46.22%
合计	31,978	100.00%	139,325.96	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，商品及金融衍生品类产品数量和规模相对较小（见表5）。

表5 按投资类型分私募资管产品存续情况（截至2023年1月底）

投资类型	数量（只）	数量占比	规模（亿元）	规模占比
权益类	5,669	17.73%	21,563.67	15.48%
固定收益类	13,827	43.24%	101,264.65	72.68%
商品及金融衍生品	1,391	4.35%	1,117.94	0.80%
混合类	11,091	34.68%	15,379.71	11.04%
合计	31,978	100.00%	139,325.96	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2023年1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640亿元，较上月减少22亿元，管理规模中位数223亿元；证券公司私募子公司平均管理私募基金72亿元，管理规模中位数17亿元；基金管理公司平均管理私募资管业务规模398亿元，较上月减少11亿元，管理规模中位数100亿元；基金子公司平均管理私募资管业务规模261亿元，较上月减少13亿元，管理规模中位数70亿元；期货公司及其资管子公司平均管理私募资管业务规模27亿元，管理规模中位数4亿元。（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至图7）

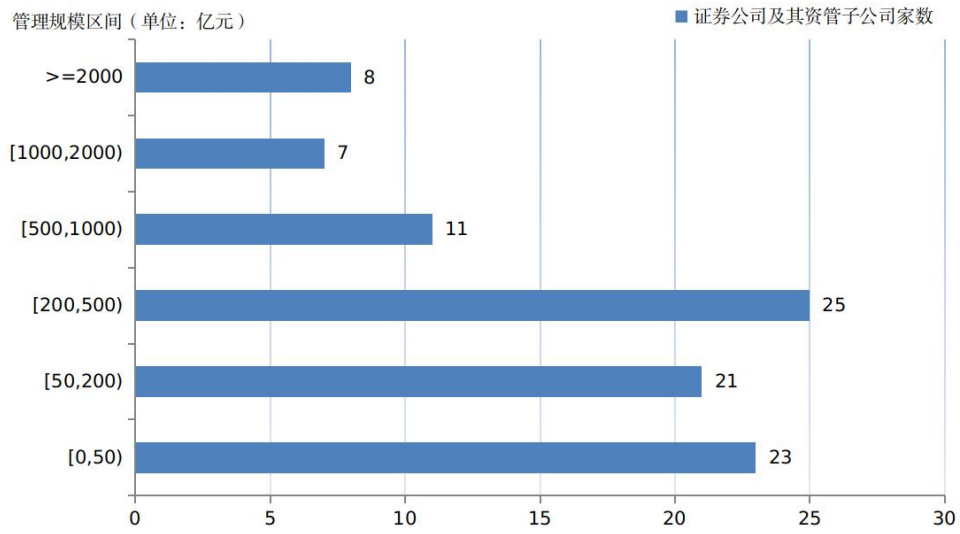


图3 证券公司及其资管子公司私募资管业务规模分布情况

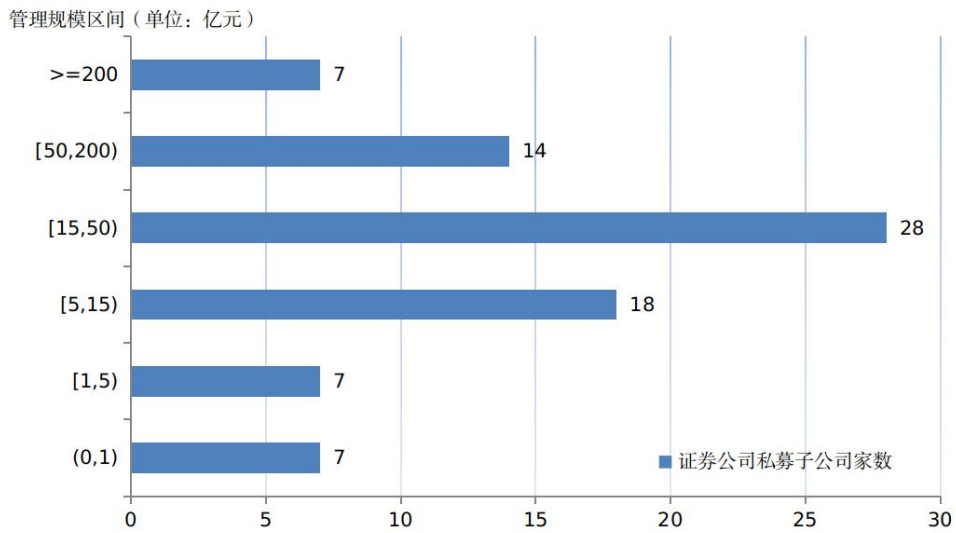


图4 证券公司私募子公司私募基金规模分布情况

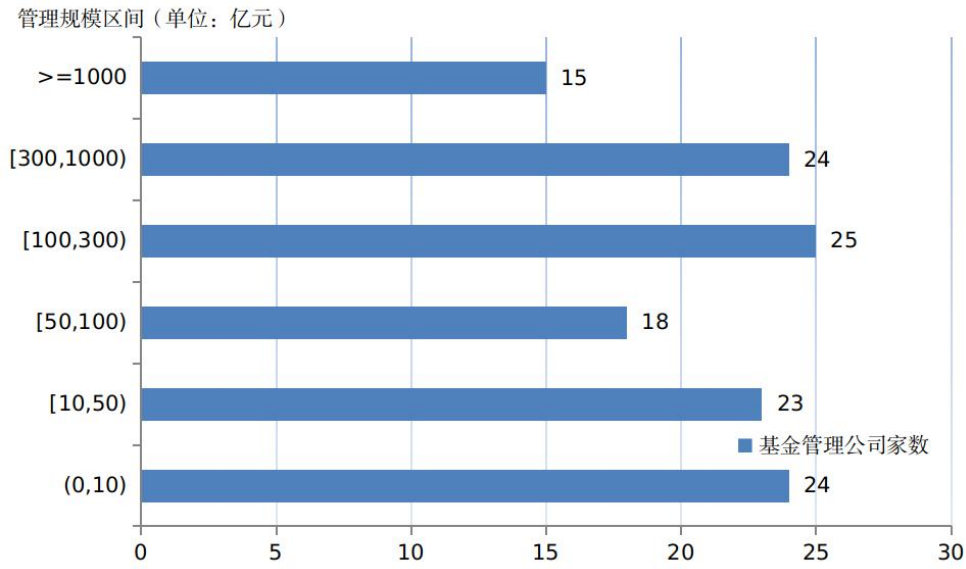


图5 基金管理公司私募资管业务规模分布情况

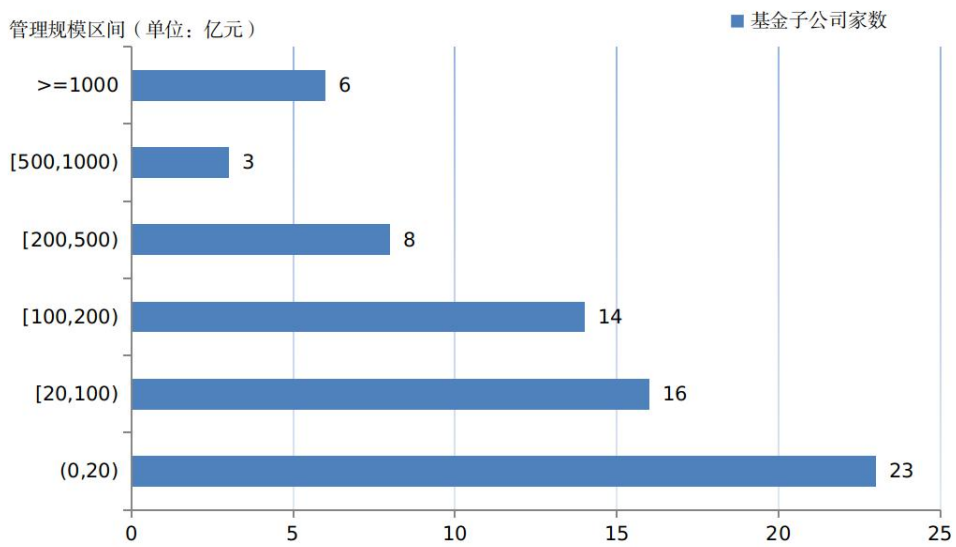


图6 基金子公司私募资管业务规模分布情况

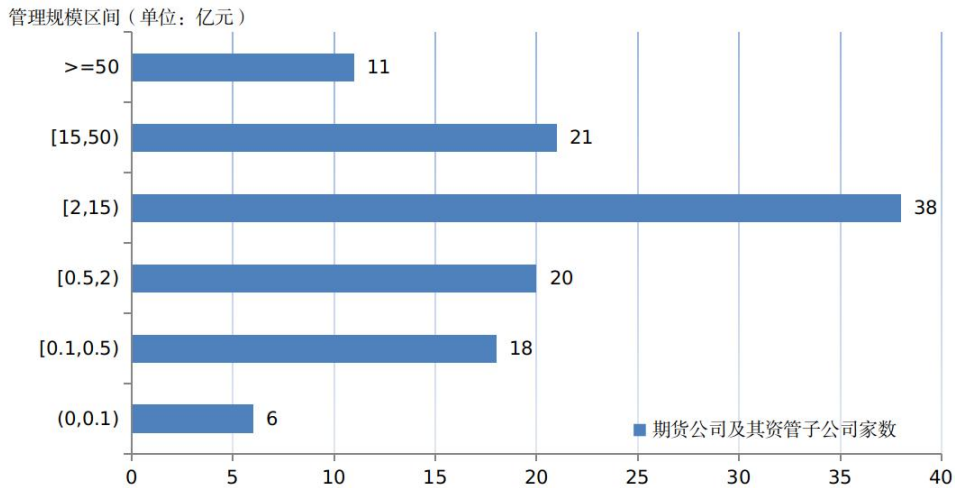


图 7 期货公司及其资管子公司私募资管业务规模分布情况

注：

[1] 本文统计数据口径：含证券公司私募子公司私募基金数据，不含基金管理公司管理的社保基金与企业年金，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私募基金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、修改数据等情况，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：截至当月末有正在运作产品的证券期货经营机构。

[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。

[6] 本月 1 只新备案的基金股权子公司产品暂归入基金子公司进行统计；产品类型集合产品、投资类型为权益类产品。