

证券期货经营机构私募资管产品备案月报 (2023年2月)

一、私募资管产品备案情况

2023年2月，证券期货经营机构当月共备案私募资管产品800只，设立规模375.00亿元（见图1）。当月新设产品平均备案核查时间为2.66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，2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2月备案的18只私募基金中17只为合伙型基金，1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2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 | 410 | 181.12 | 48.30% |
| 证券公司私募子公司 | 18 | 27.24 | 7.26% |
| 基金管理公司 | 238 | 98.49 | 26.26% |
| 基金子公司 | 46 | 55.77 | 14.87% |
| 期货公司及其资管子公司 | 88 | 12.38 | 3.30% |
| 合计 | 800 | 375.00 | 100.00% |

从产品类型看，2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2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 | 389 | 236.97 | 63.19% |
| 单一资产管理计划 | 411 | 138.03 | 36.81% |
| 合计 | 800 | 375.00 | 100.00% |

从投资类型看，2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2月）

| 投资类型 | 产品数量（只） | 设立规模（亿元） | 规模占比 |
|-----------|---------|----------|---------|
| 权益类 | 72 | 37.00 | 9.87% |
| 固定收益类 | 416 | 235.79 | 62.88% |
| 商品及金融衍生品类 | 63 | 42.42 | 11.31% |
| 混合类 | 249 | 59.78 | 15.94% |
| 合计 | 800 | 375.00 | 100.00% |

二、私募资管产品存续情况

截至2023年2月底，证券期货经营机构私募资管业务规模合计13.82万亿元（不含社保基金、企业年金），较上月底减少1,165.28亿元，降低0.84%。（证券期货经营机构存续产品规模分布情况见图2）

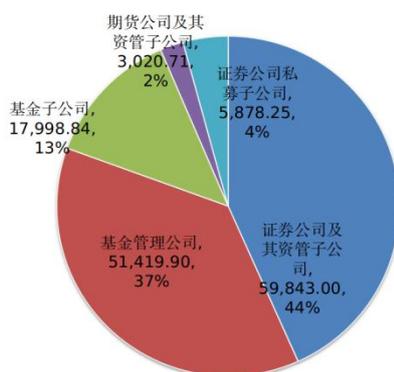


图2 证券期货经营机构存续产品规模分布情况（单位：亿元）

从产品类型看，2月存续单一资产管理计划规模占比为54.15%（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2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 | 17,623 | 54.51% | 74,818.44 | 54.15% |
| 集合资产管理计划 | 14,709 | 45.49% | 63,342.25 | 45.85% |
| 合计 | 32,332 | 100.00% | 138,160.68 | 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 | 5,722 | 17.70% | 21,371.49 | 15.47% |
| 固定收益类 | 14,020 | 43.36% | 100,502.08 | 72.74% |
| 商品及金融衍生品 | 1,409 | 4.36% | 1,095.73 | 0.79% |
| 混合类 | 11,181 | 34.58% | 15,191.39 | 11.00% |
| 合计 | 32,332 | 100.00% | 138,160.68 | 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630亿元，较上月减少10亿元，管理规模中位数225亿元；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18亿元；基金管理公司平均管理私募资管业务规模396亿元，较上月减少3亿元，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261亿元，与上月持平，管理规模中位数73亿元；期货公司及其资管子公司平均管理私募资管业务规模26亿元，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）

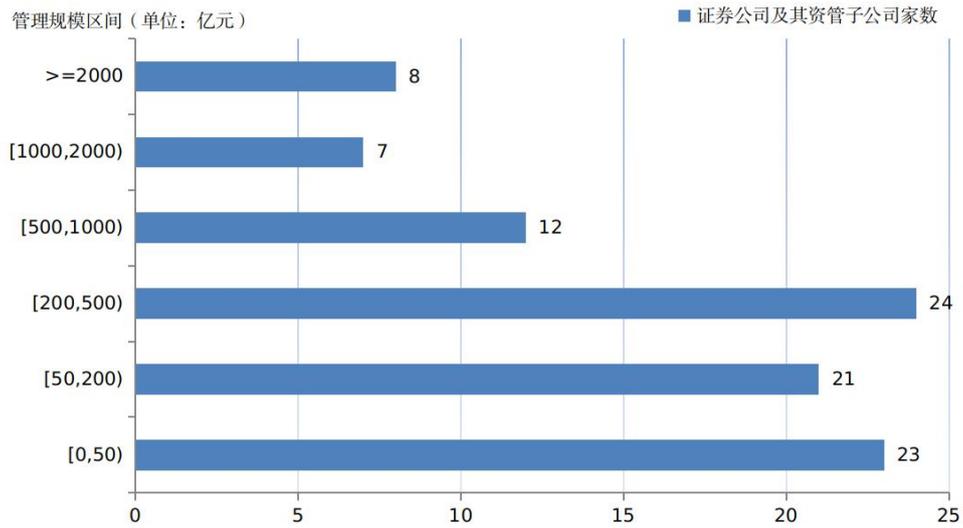


图3 证券公司及其资管子公司私募资管业务规模分布情况

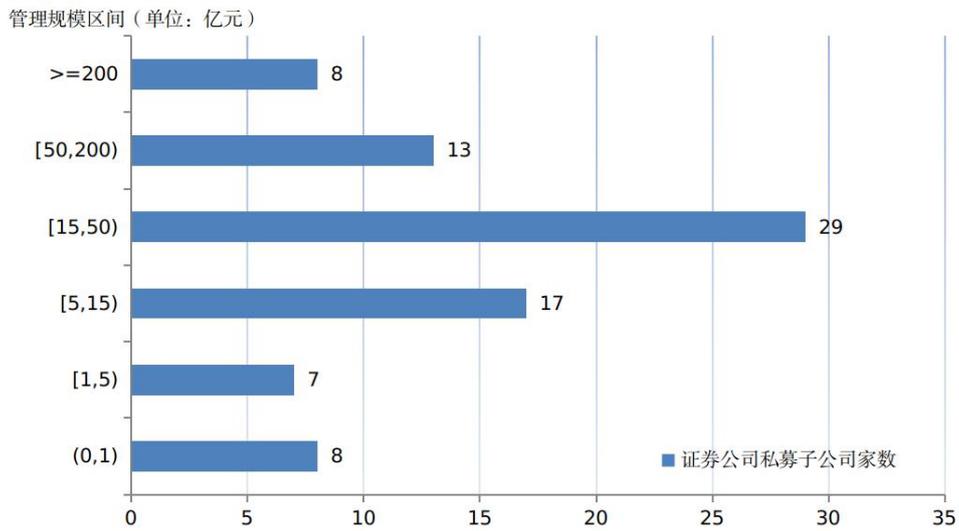


图4 证券公司私募子公司私募基金规模分布情况

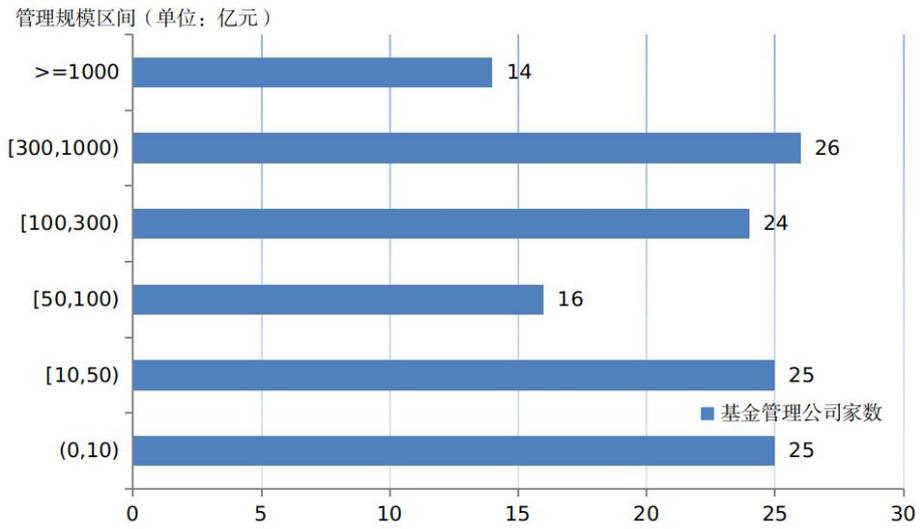


图5 基金管理公司私募资管业务规模分布情况

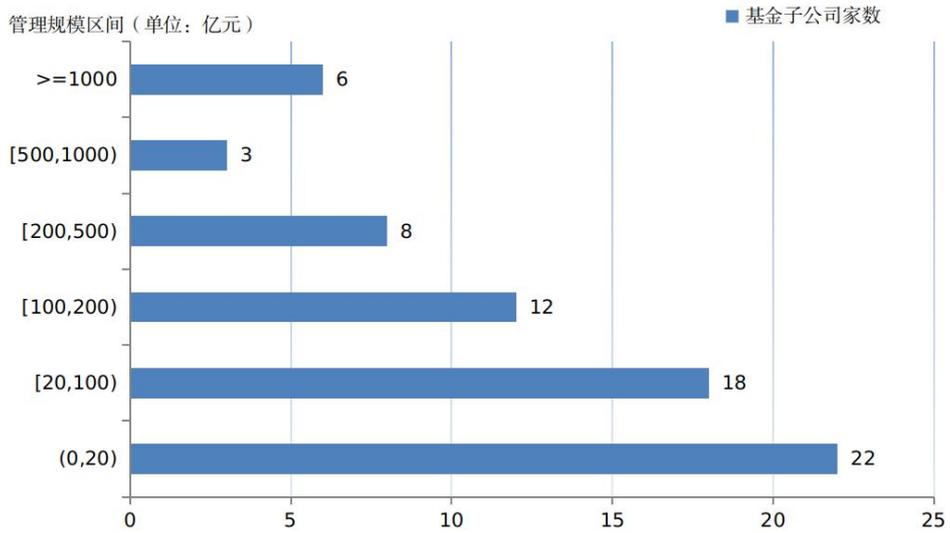


图6 基金子公司私募资管业务规模分布情况

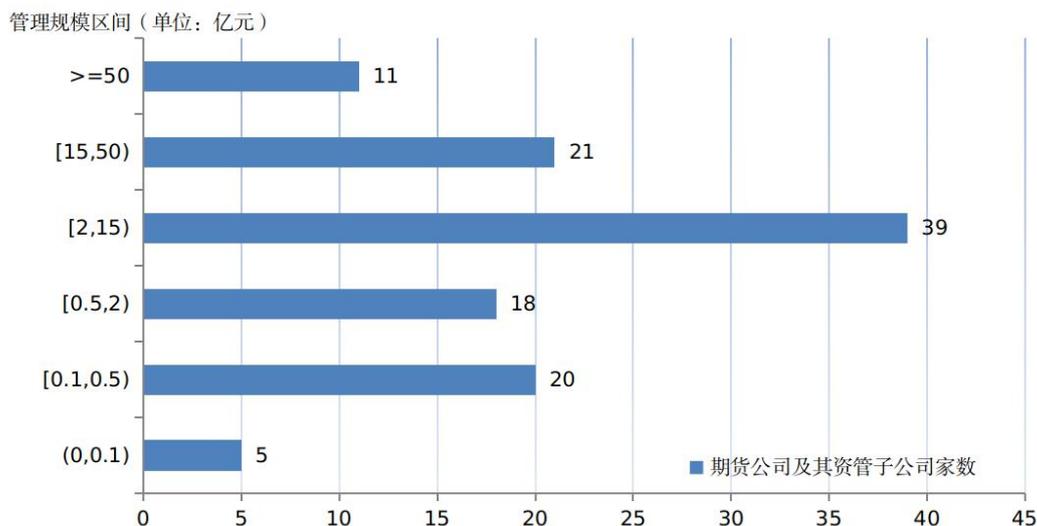


图7 期货公司及其资管子公司私募资管业务规模分布情况

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。