

证券期货经营机构资管产品备案月报

(2019年10月)

一、资管产品备案情况¹

2019年10月，证券期货经营机构共备案534只产品，设立规模502.29亿元。其中，证券公司及子公司备案295只，设立规模251.31亿元，占比50.03%；基金公司备案121只，设立规模95.22亿元，占比18.96%；基金子公司备案81只，设立规模144.87亿元，占比28.84%；期货公司及子公司备案37只，设立规模10.88亿元，占比2.17%。

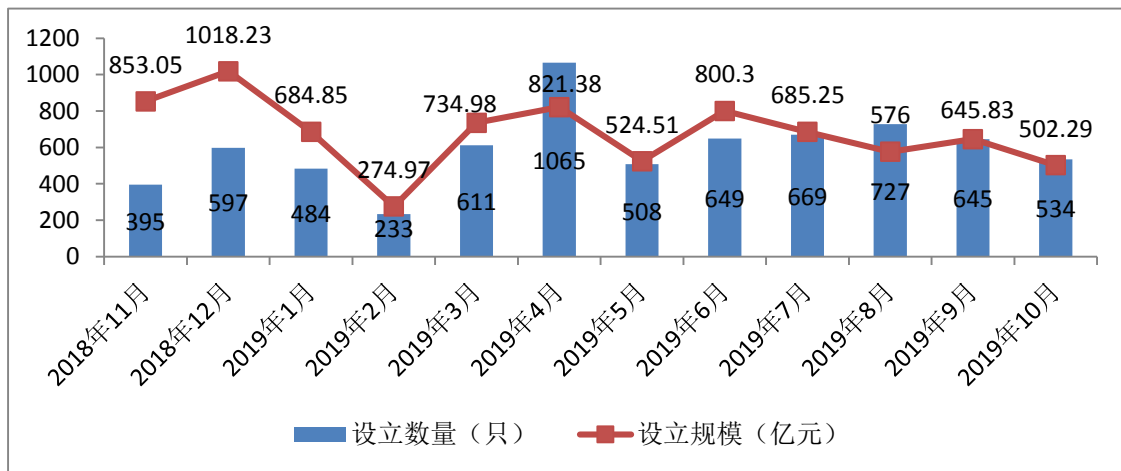


图1 证券期货经营机构资管产品月设立数量及规模趋势图

按照产品类型划分，单一产品289只，设立规模227.02亿元，占比45.2%；集合产品245只，设立规模275.28亿元，占比54.8%。

按照投资类型划分，权益类产品61只，设立规模52.32亿元；固定收益类产品283只，设立规模367.29亿元；混合类产品170只，设立规模78.13亿元；商品及金融衍生品类

¹ 由于报告中的数据采用四舍五入方式折算，可能存在分项数据之和不等于合计数据的情形。

产品 20 只，设立规模 4.55 亿元。

自 2018 年 11 月以来，证券行业在纾解民营企业融资困境方面积极发挥作用。截至 2019 年 10 月，共 64 家证券公司及私募子公司累计备案纾困计划 170 只，存续规模 1156.35 亿元，落地项目数量共计 321 个，项目规模 469.46 亿元。

10 月新设集合产品的平均备案核查时间为 2.34 个工作日。其中，证券公司资管产品平均备案核查时间为 2.33 个工作日，基金公司及子公司资管产品平均备案核查时间为 2.65 个工作日，期货公司资管产品平均备案核查时间为 1.28 个工作日。

二、资管产品存续情况

截至 2019 年 10 月底，证券期货经营机构私募资管业务管理资产规模合计 18.90 万亿元（不含社保基金、企业年金以及券商大集合），较 9 月底减少 1704 亿元，减幅 1.2%。其中，证券公司资管业务管理资产规模 10.01 万亿元，基金公司资管业务管理资产规模 4.38 万亿元，基金子公司资管业务管理资产规模 4.37 万亿元，期货公司资管业务管理资产规模 1381 亿元。

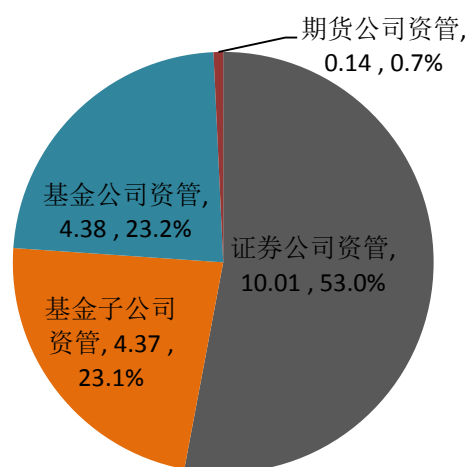


图 2 证券期货经营机构存续产品规模情况分布图（单位：万亿元）

存续资管产品中,集合产品规模2.39万亿元,占比12.6%;单一产品规模16.51万亿元,占比87.4%。从产品管理方式来看,通道类产品规模10.94万亿元,较2018年10月底累计下降28%,主动管理类产品规模7.96万亿元,自2018年10月以来增长6%。从投资类型来看,固定收益类产品数量和规模均占据四类产品最大比例,权益类、商品及金融衍生品类产品数量和规模相对较小。

表 证券期货经营机构四类资管产品数量和规模情况（截至2019年10月底）

产品类型	数量（只）	数量占比	规模（亿元）	规模占比
权益类	4856	16.9%	16053	8.5%
固定收益类	16620	57.8%	137913	73.0%
商品及金融衍生品类	385	1.3%	296	0.2%
混合类	6874	23.9%	34745	18.4%
合计	28735	100%	189006	100.0%

三、管理人资管规模分布情况²

截至2019年10月底,证券公司资管管理规模主要集中在100-2000亿元,基金公司及子公司资管管理规模主要集中在0-300亿元,期货公司资管管理规模主要集中在0-5亿元。

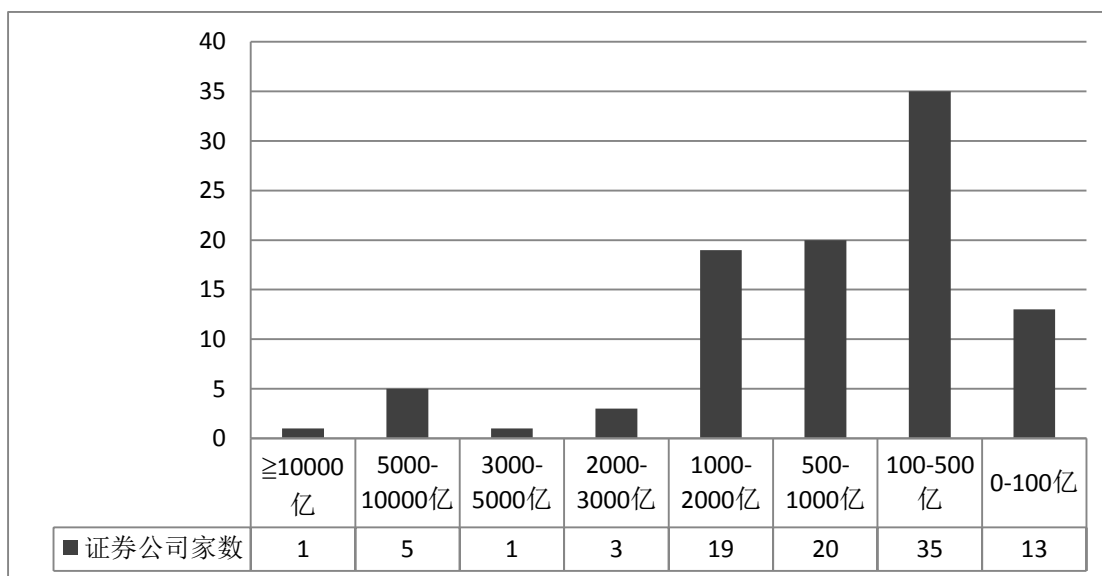


图3 证券公司资管管理规模分布情况（家数）

² 管理人分布情况统计范围为有存续资管产品的证券期货经营机构。

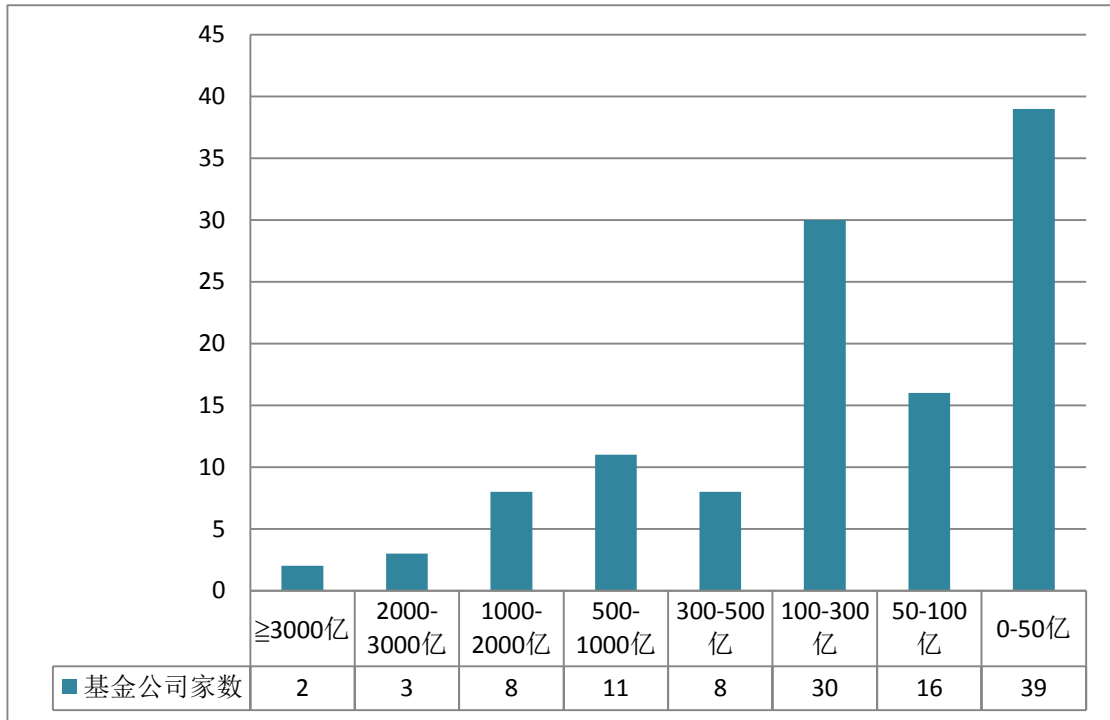


图 4 基金公司资管管理规模分布情况（家数）

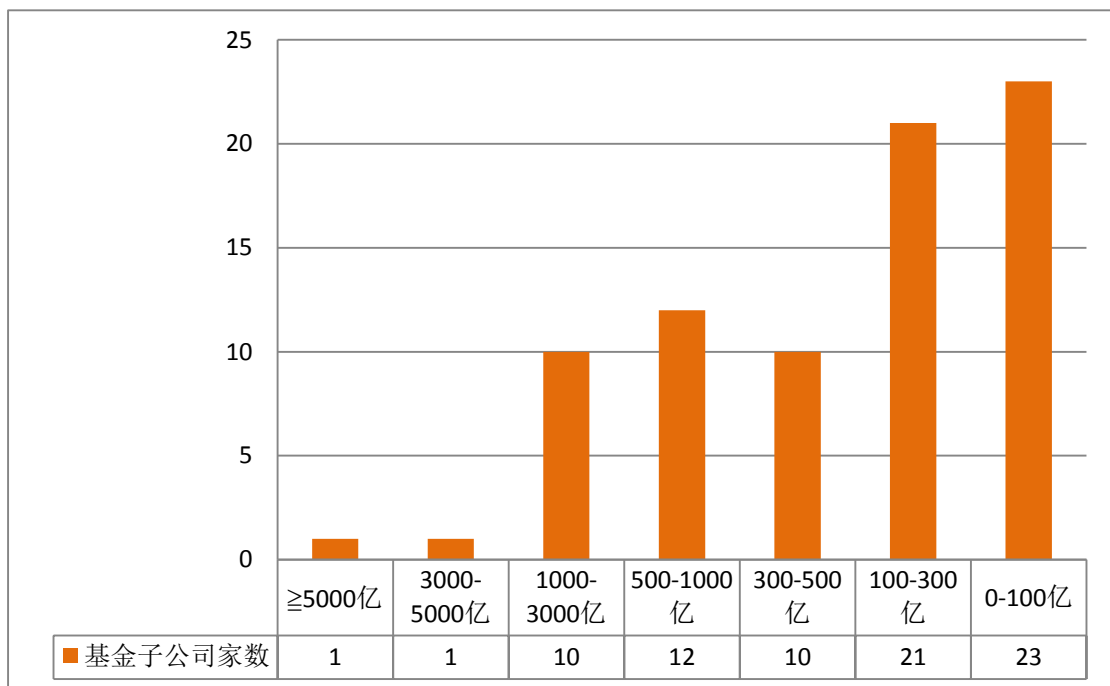


图 5 基金子公司资管管理规模分布情况（家数）

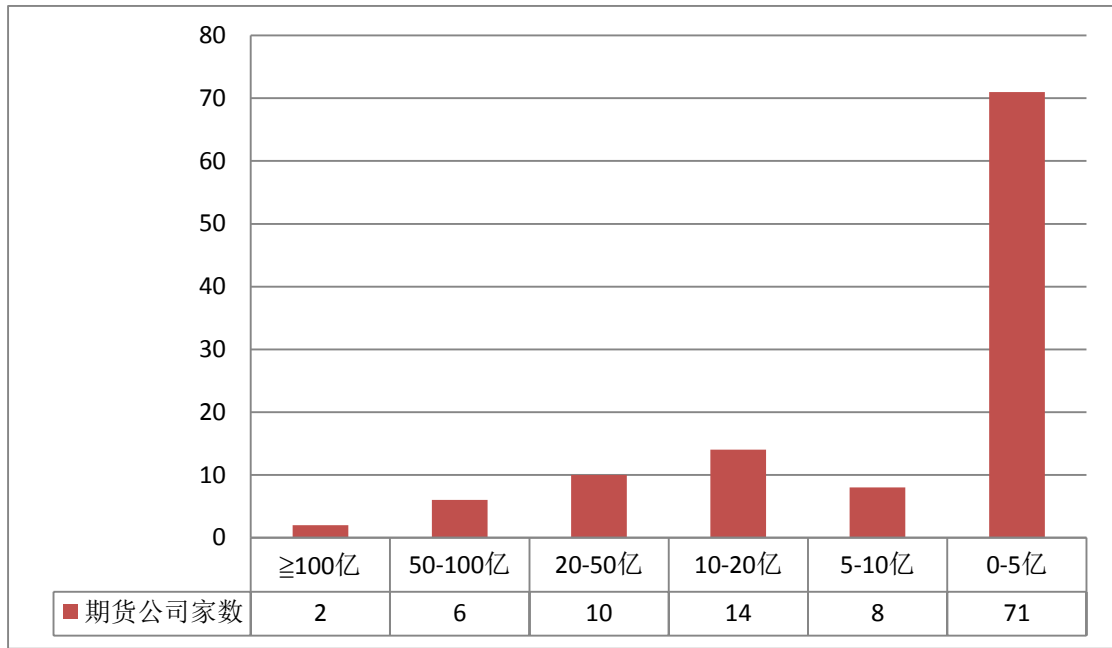


图 6 期货公司资管管理规模分布情况（家数）