

证券期货经营机构私募资管产品备案月报 (2022年4月)

一、私募资管产品备案情况

2022年4月，证券期货经营机构当月共备案私募资管产品685只，设立规模265.36亿元（见图1），4月设立规模环比减少55.62%，同比减少72.54%。当月新设产品平均备案核查时间为1.92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，4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4月备案的18只私募基金中，16只为合伙型基金，2只为契约型基金，无公司型基金备案。

表1 按机构类型分私募资管产品月度备案情况（2022年4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 | 388 | 151.61 | 57.14% |
| 证券公司私募子公司 | 18 | 24.76 | 9.33% |
| 基金管理公司 | 170 | 53.73 | 20.25% |
| 基金子公司 | 56 | 22.41 | 8.44% |

| | | | |
|-------------|-----|--------|---------|
| 期货公司及其资管子公司 | 53 | 12.85 | 4.84% |
| 合计 | 685 | 265.36 | 100.00% |

从产品类型看，4月备案的集合资管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（2022年4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 | 320 | 180.62 | 68.07% |
| 单一资产管理计划 | 365 | 84.73 | 31.93% |
| 合计 | 685 | 265.36 | 100.00% |

从投资类型看，4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（2022年4月）

| 投资类型 | 产品数量（只） | 设立规模（亿元） | 规模占比 |
|-----------|---------|----------|---------|
| 权益类 | 56 | 43.36 | 16.34% |
| 固定收益类 | 342 | 141.51 | 53.33% |
| 商品及金融衍生品类 | 48 | 23.16 | 8.73% |
| 混合类 | 239 | 57.33 | 21.60% |
| 合计 | 685 | 265.36 | 100.00% |

二、私募资管产品存续情况

截至2022年4月底，证券期货经营机构私募资管业务规模合计15.62万亿元（不含社保基金、企业年金），较上月底增加2,383.63亿元，增长1.55%。（证券期货经营机构存续产品规模分布情况见图2）

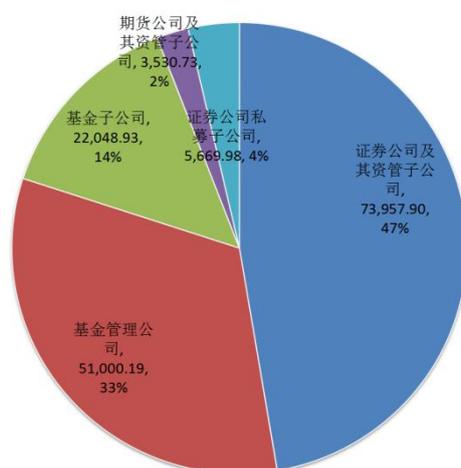


图2 证券期货经营机构存续产品规模分布情况（单位：亿元）

从产品类型看，4月存续单一资产管理计划规模占比为52.89%（见表4）。

表4 按产品类型分私募资管产品存续情况（截至2022年4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 | 18,257 | 57.79% | 82,612.22 | 52.89% |
| 集合资产管理计划 | 13,337 | 42.21% | 73,595.51 | 47.11% |
| 合计 | 31,594 | 100.00% | 156,207.73 | 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2022年4月底）

| 投资类型 | 数量（只） | 数量占比 | 规模（亿元） | 规模占比 |
|----------|--------|---------|------------|---------|
| 权益类 | 5,731 | 18.14% | 20,647.45 | 13.22% |
| 固定收益类 | 13,825 | 43.76% | 116,794.83 | 74.77% |
| 商品及金融衍生品 | 1,250 | 3.96% | 1,172.46 | 0.75% |
| 混合类 | 10,788 | 34.15% | 17,592.98 | 11.26% |
| 合计 | 31,594 | 100.00% | 156,207.73 | 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2022年4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779亿元，比上月增加14亿元，管理规模中位数229亿元；证券公司私募子公司平均管理私募基金77亿元，管理规模中位数16亿元；基金管理公司平均管理私募资管业务规模402亿元，比上月增加6亿元，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311亿元，与上月基本持平，管理规模中位数87亿元，较上月下降14亿元；期货公司及其资管子公司平均管理私募资管业务规模32亿元，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）

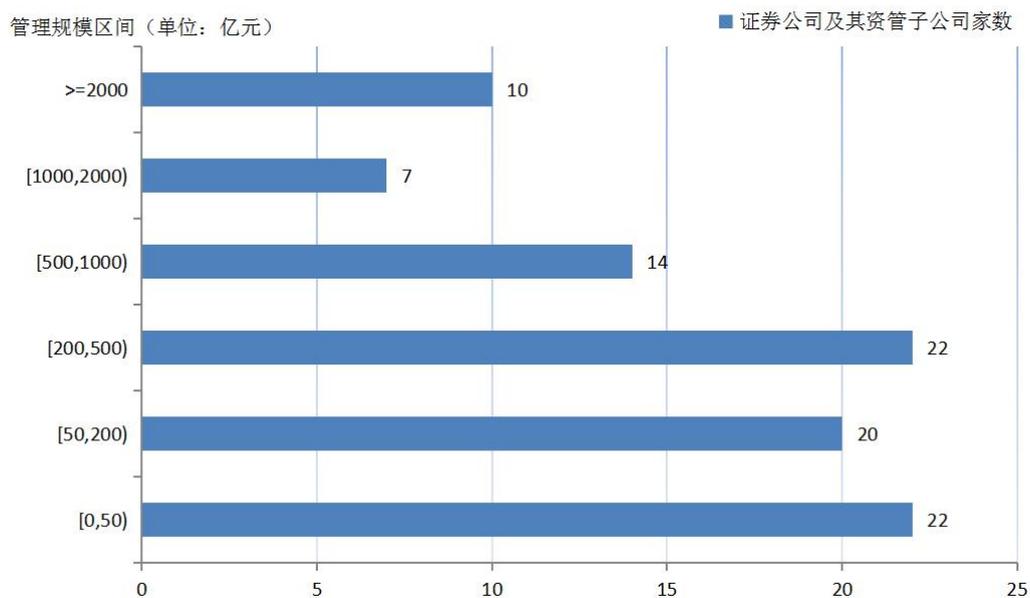


图3 证券公司及其资管子公司私募资管业务规模分布情况

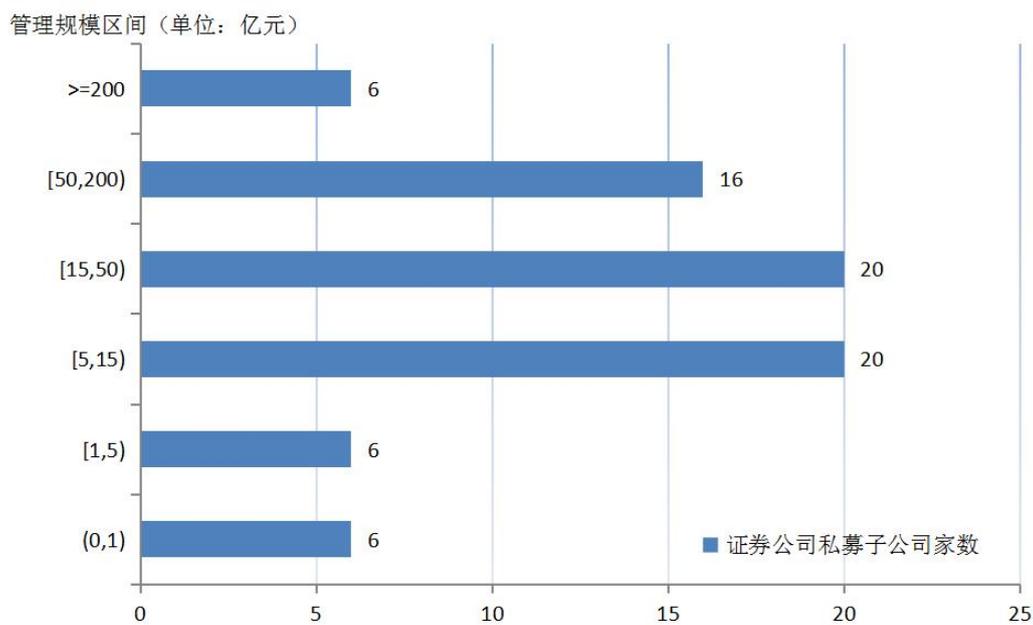


图4 证券公司私募子公司私募基金规模分布情况

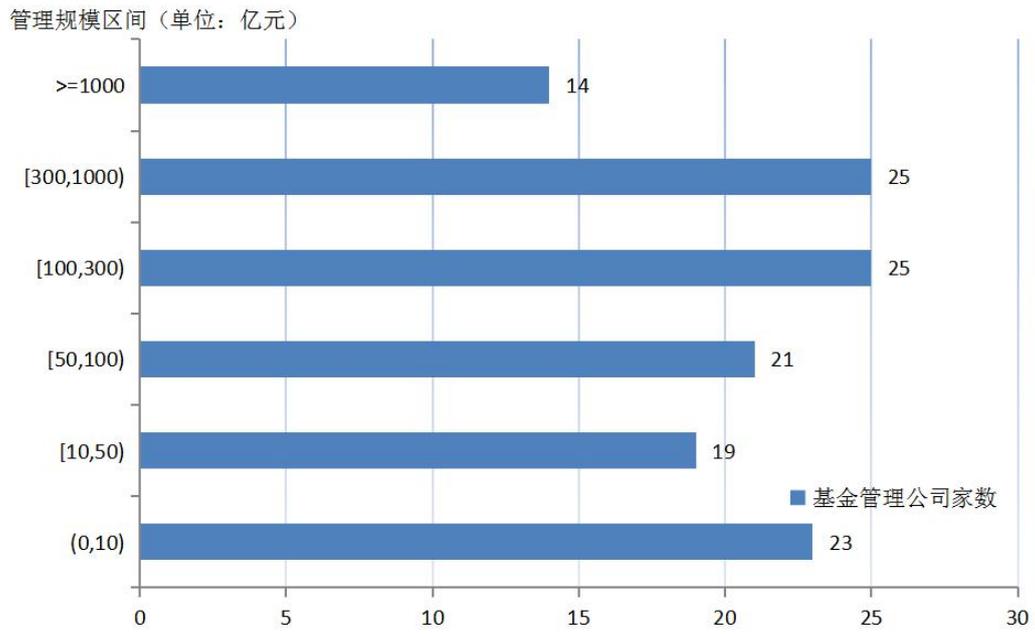


图5 基金管理公司私募资管业务规模分布情况

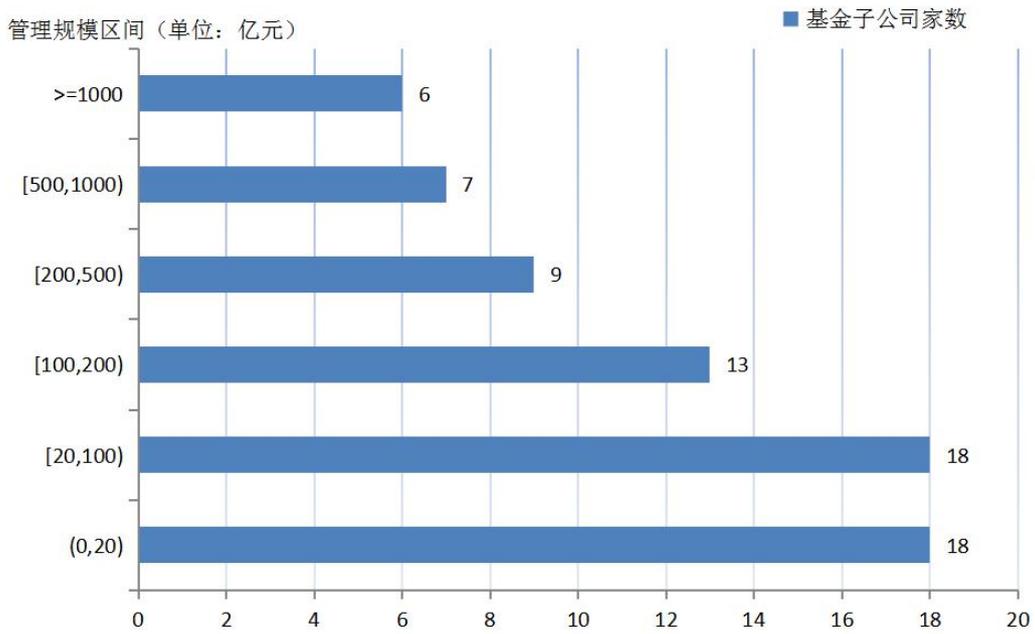


图6 基金子公司私募资管业务规模分布情况

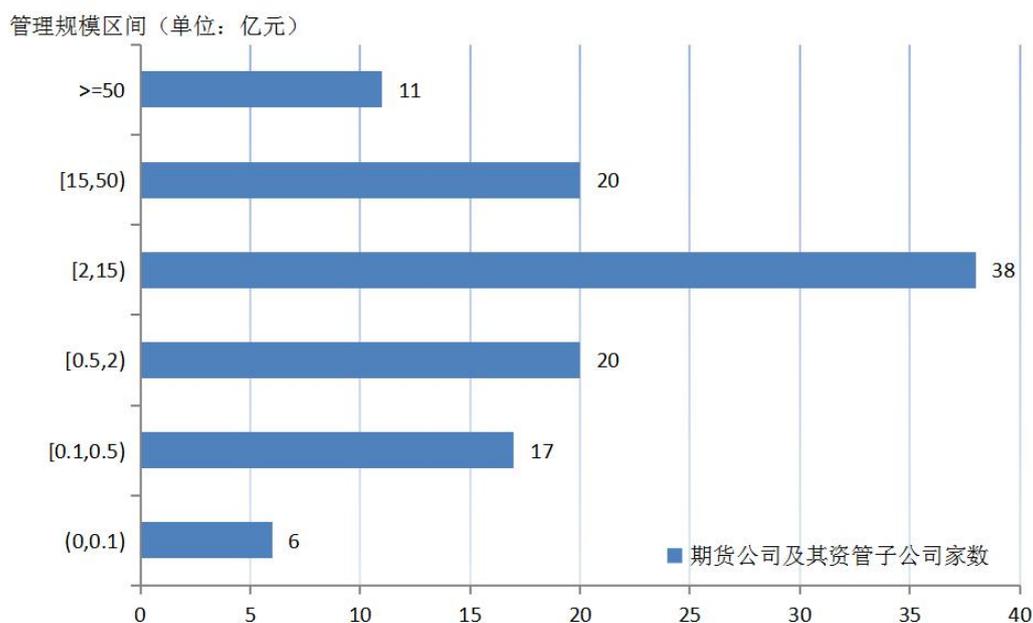


图7 期货公司及其资管子公司私募资管业务规模分布情况

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。