

证券期货经营机构私募资管产品备案月报 (2022年9月)

一、私募资管产品备案情况

2022年9月，证券期货经营机构当月共备案私募资管产品896只，设立规模765.43亿元（见图1），9月设立规模环比增长5.15%，同比降低20.32%。当月新设产品平均备案核查时间为2.01个工作日。

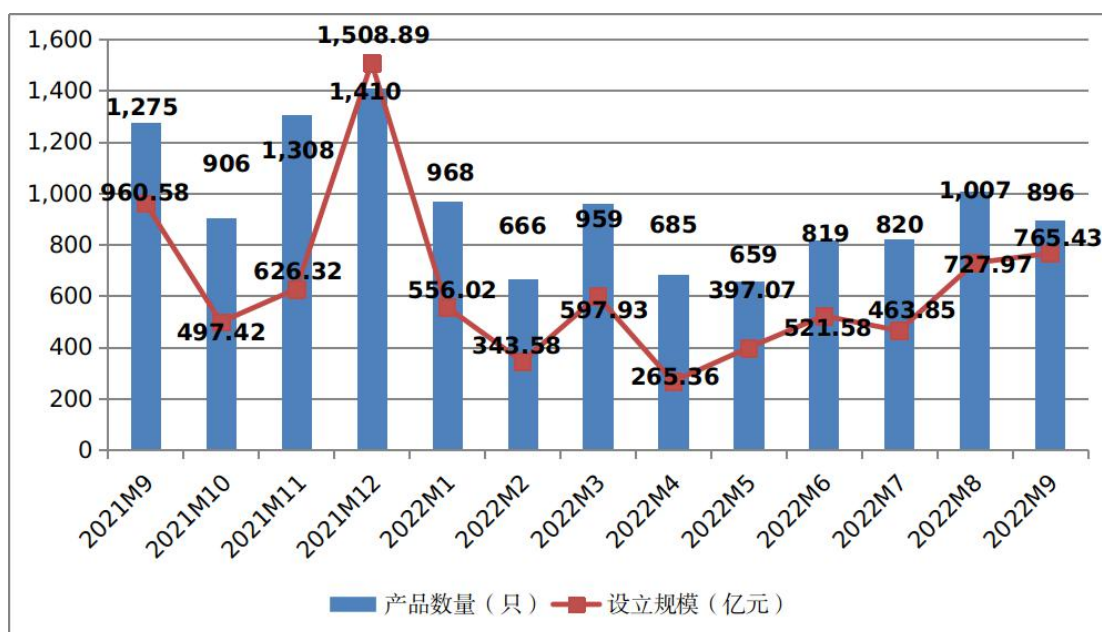


图1 证券期货经营机构资管产品月度备案数量及规模趋势

从机构类型看，9月备案私募资管产品数量最多的为证券公司及其资管子公司，设立规模最大的为基金管理公司（见表1）。证券公司私募子公司9月备案的27只私募基金21只为合伙型基金，6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（2022年9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	428	296.42	38.73%
证券公司私募子公司	27	25.63	3.35%
基金管理公司	279	403.97	52.78%

基金子公司	59	21.01	2.75%
期货公司及其资管子公司	103	18.40	2.40%
合计	896	765.43	100.00%

从产品类型看，9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9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	449	403.02	52.65%
单一资产管理计划	447	362.41	47.35%
合计	896	765.43	100.00%

从投资类型看，9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9月）

投资类型	产品数量（只）	设立规模（亿元）	规模占比
权益类	105	100.15	13.08%
固定收益类	394	469.36	61.32%
商品及金融衍生品类	68	25.89	3.38%
混合类	329	170.02	22.21%
合计	896	765.43	100.00%

二、私募资管产品存续情况

截至2022年9月底，证券期货经营机构私募资管业务规模合计15.84万亿元（不含社保基金、企业年金），较上月底减少2,180.37亿元，减少1.36%。（证券期货经营机构存续产品规模分布情况见图2）

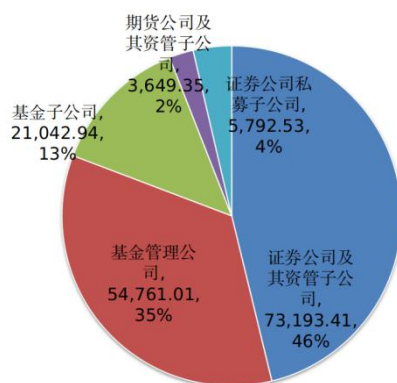


图2 证券期货经营机构存续产品规模分布情况（单位：亿元）

从产品类型看，9月存续单一资产管理计划规模占比为49.02%（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9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	17,938	55.78%	77,670.24	49.02%
集合资产管理计划	14,223	44.22%	80,769.00	50.98%
合计	32,161	100.00%	158,439.24	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9月底）

投资类型	数量（只）	数量占比	规模（亿元）	规模占比
权益类	5,791	18.01%	20,960.15	13.23%
固定收益类	13,785	42.86%	119,186.12	75.23%
商品及金融衍生品类	1,372	4.27%	1,195.56	0.75%
混合类	11,213	34.87%	17,097.40	10.79%
合计	32,161	100.00%	158,439.24	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9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770亿元，较上月减少12亿元，管理规模中位数238亿元；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431亿元，较上月减少5亿元，管理规模中位数116亿元；基金子公司平均管理私募资管业务规模301亿元，较上月减少5亿元，管理规模中位数80亿元；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）

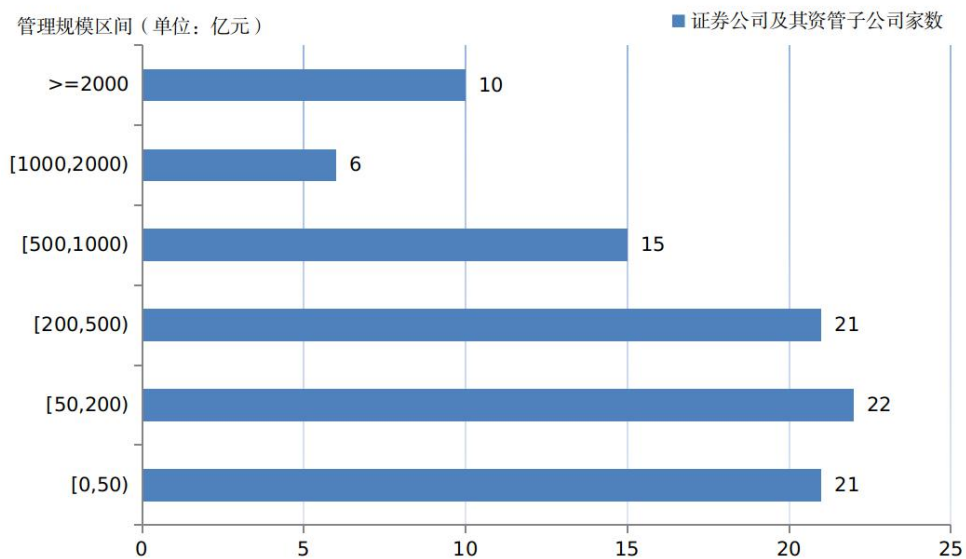


图3 证券公司及其资管子公司私募资管业务规模分布情况

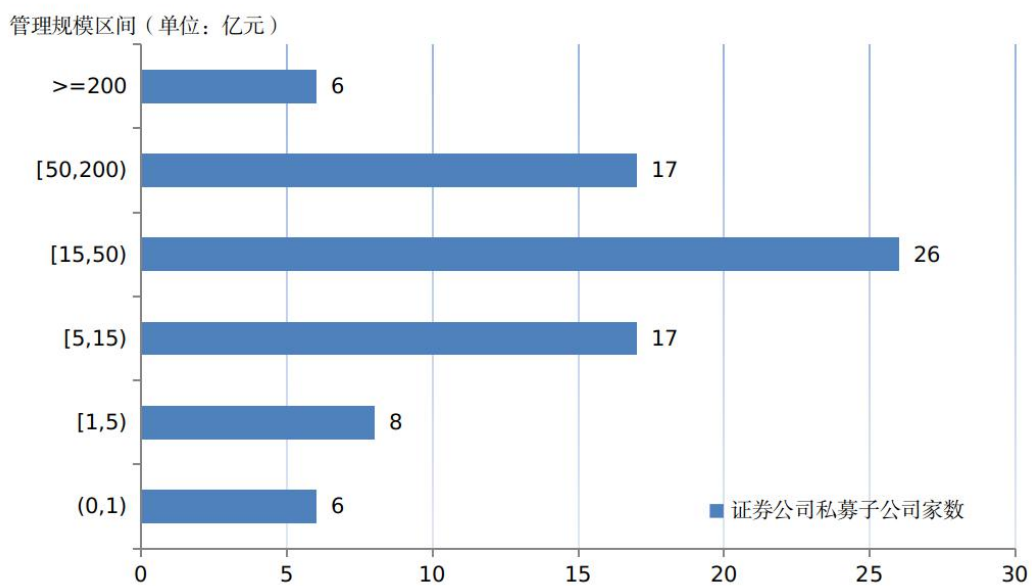


图4 证券公司私募子公司私募基金规模分布情况

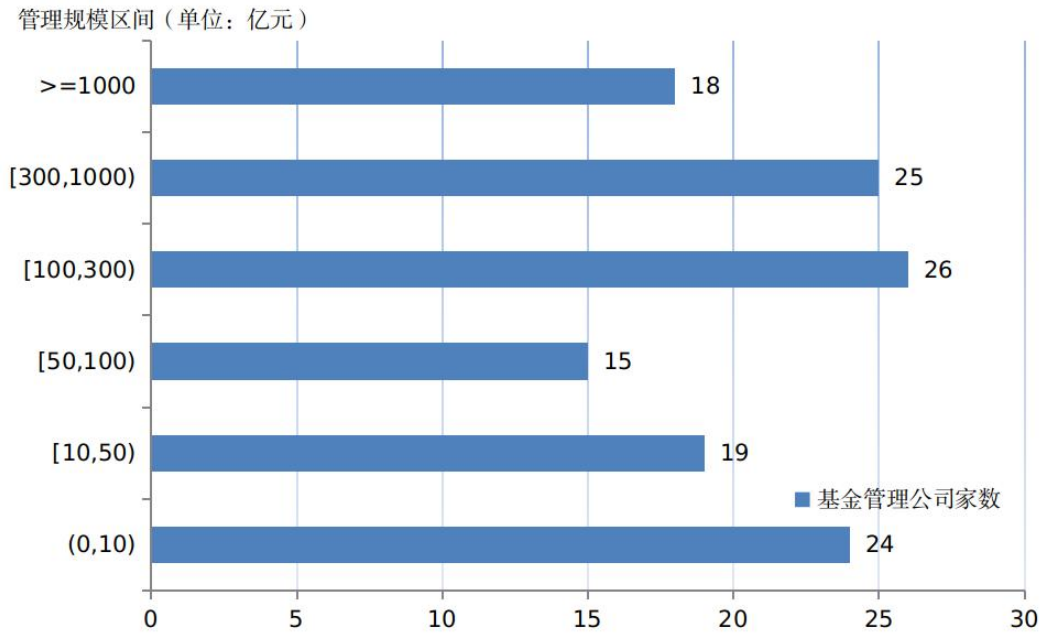


图5 基金管理公司私募资管业务规模分布情况

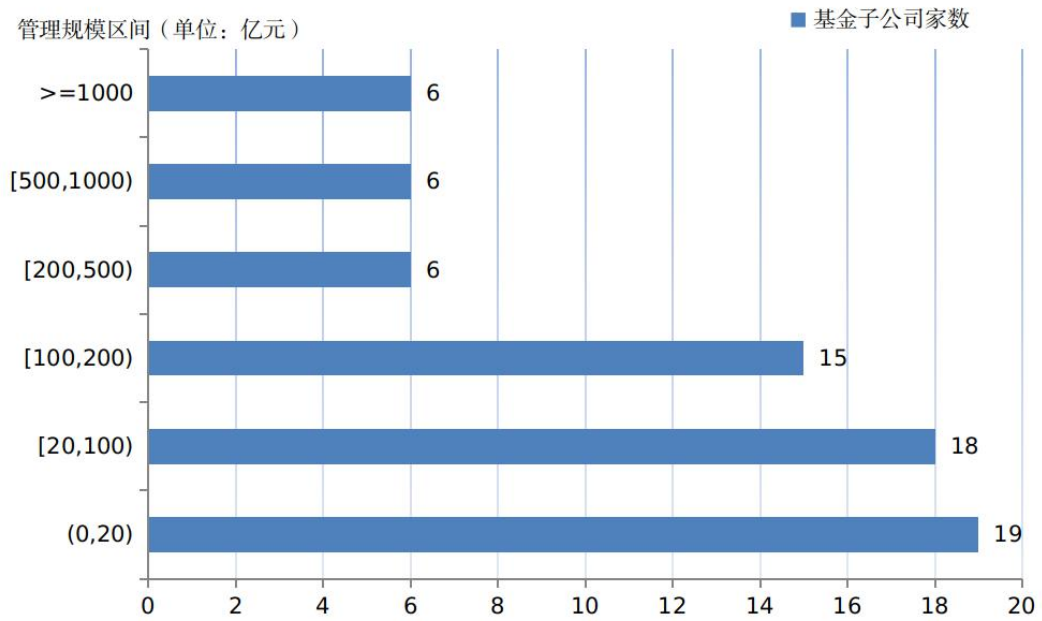


图6 基金子公司私募资管业务规模分布情况

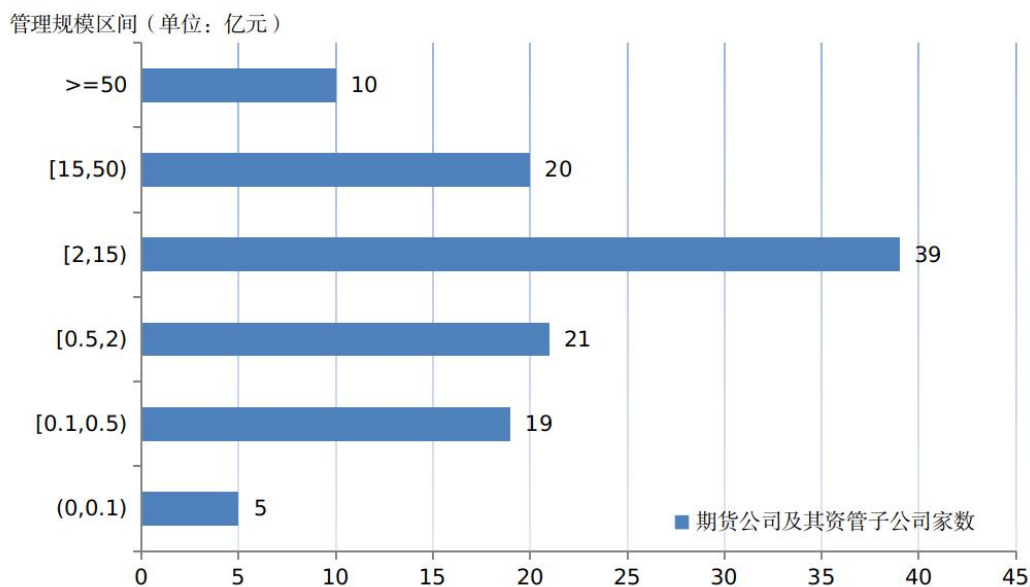


图 7 期货公司及其资管子公司私募资管业务规模分布情况

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 3 只新备案的基金公司私募投资基金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。