

证券期货经营机构私募资管产品备案月报 (2022年11月)

一、私募资管产品备案情况

2022年11月，证券期货经营机构当月共备案私募资管产品773只，设立规模640.35亿元（见图1）。当月新设产品平均备案核查时间为2.22个工作日。

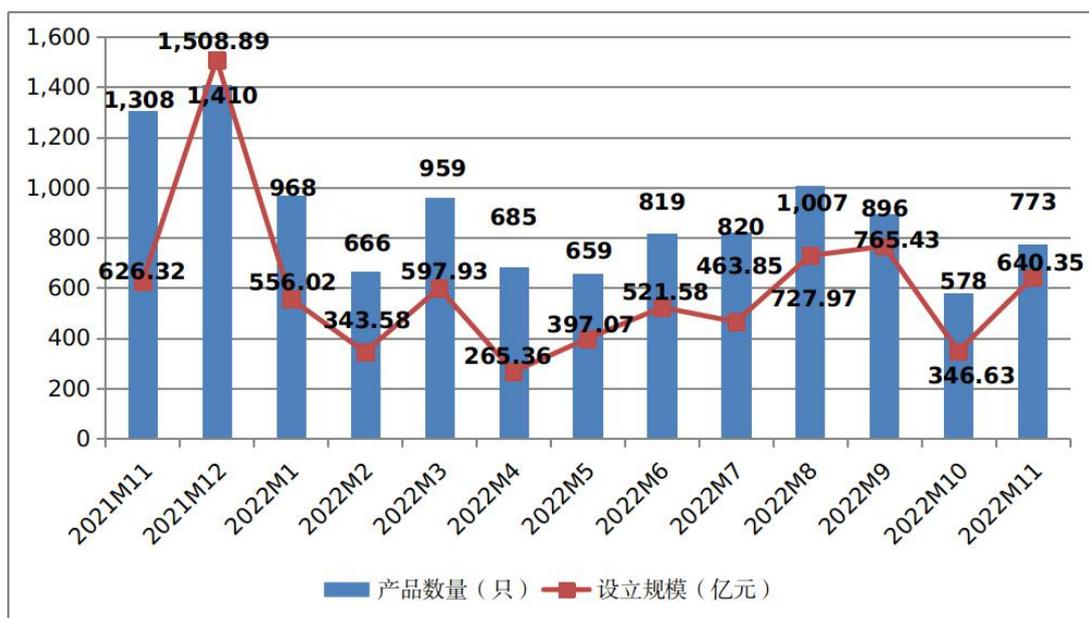


图1 证券期货经营机构资管产品月度备案数量及规模趋势

从机构类型看，11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11月备案的14只私募基金中13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（2022年11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	384	162.87	25.44%
证券公司私募子公司	14	36.51	5.70%
基金管理公司	229	322.50	50.36%
基金子公司	55	102.44	16.00%
期货公司及其资管子公司	91	16.03	2.50%
合计	773	640.35	100.00%

从产品类型看，11月备案的单一资管计划设立规模占比高于集合资管计划（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11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	396	191.47	29.90%
单一资产管理计划	377	448.88	70.10%
合计	773	640.35	100.00%

从投资类型看，11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11月）

投资类型	产品数量（只）	设立规模（亿元）	规模占比
权益类	62	75.01	11.71%
固定收益类	419	487.17	76.08%
商品及金融衍生品类	61	18.46	2.88%
混合类	231	59.71	9.32%
合计	773	640.35	100.00%

二、私募资管产品存续情况

截至2022年11月底，证券期货经营机构私募资管业务规模合计15.34万亿元（不含社保基金、企业年金），较上月底减少7,278.56亿元，降低4.53%。（证券期货经营机构存续产品规模分布情况见图2）

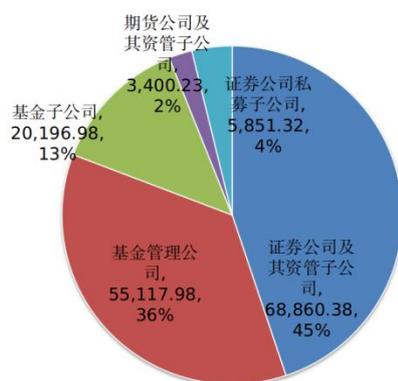


图2 证券期货经营机构存续产品规模分布情况（单位：亿元）

从产品类型看，11月存续单一资产管理计划规模占比为50.04%（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11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	17,809	55.15%	76,778.83	50.04%
集合资产管理计划	14,482	44.85%	76,648.07	49.96%
合计	32,291	100.00%	153,426.90	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11月底）

投资类型	数量（只）	数量占比	规模（亿元）	规模占比
权益类	5,753	17.82%	21,220.52	13.83%
固定收益类	13,878	42.98%	114,651.30	74.73%
商品及金融衍生品	1,423	4.41%	1,197.68	0.78%
混合类	11,237	34.80%	16,357.40	10.66%
合计	32,291	100.00%	153,426.90	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11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725亿元，较上月减少60亿元，管理规模中位数245亿元；证券公司私募子公司平均管理私募基金73亿元，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434亿元，较上月减少5亿元，管理规模中位数107亿元；基金子公司平均管理私募资管业务规模289亿元，较上月减少10亿元，管理规模中位数75亿元；期货公司及其资管子公司平均管理私募资管业务规模30亿元，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）

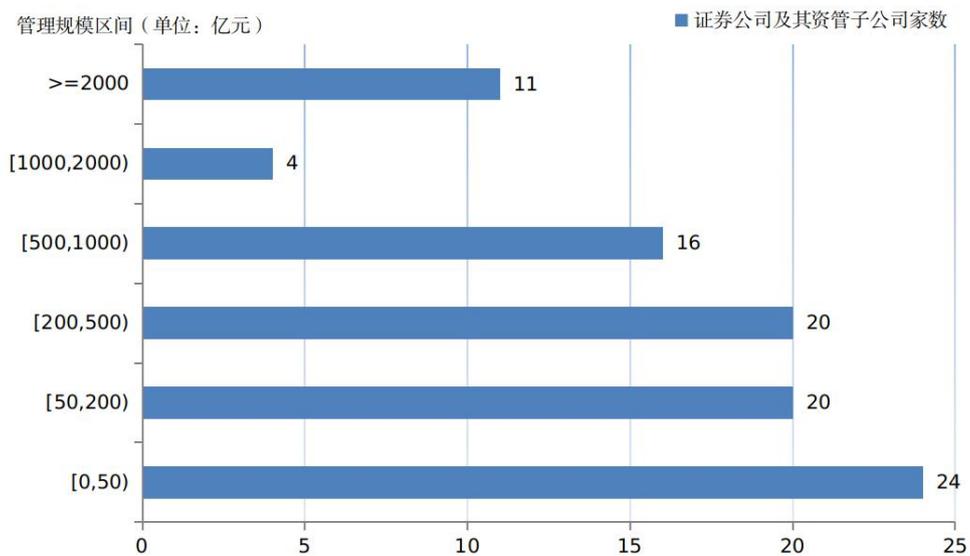


图 3 证券公司及其资管子公司私募资管业务规模分布情况

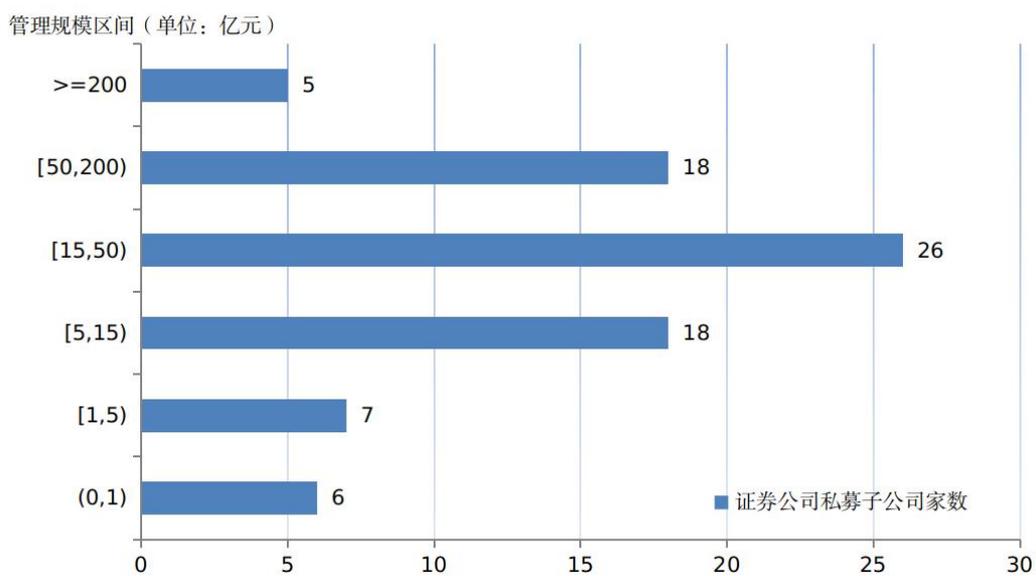


图 4 证券公司私募子公司私募基金规模分布情况

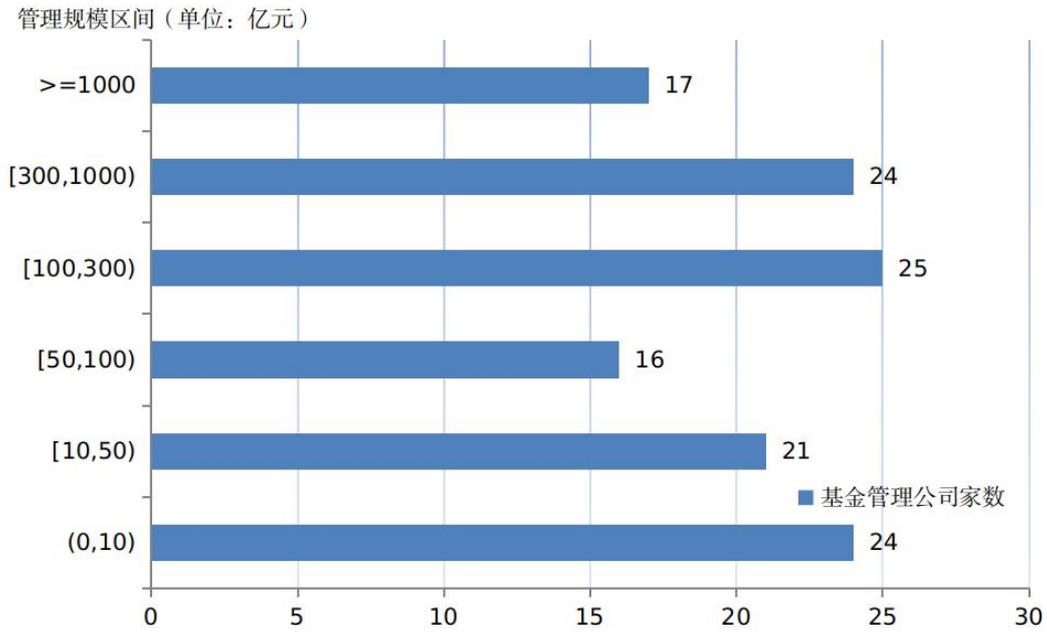


图5 基金管理公司私募资管业务规模分布情况

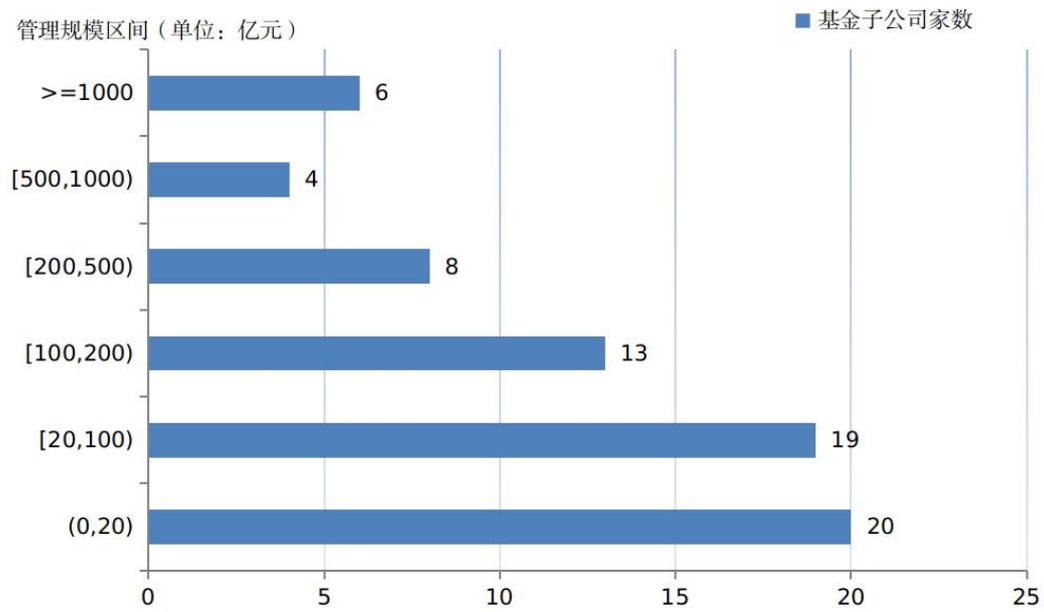


图6 基金子公司私募资管业务规模分布情况

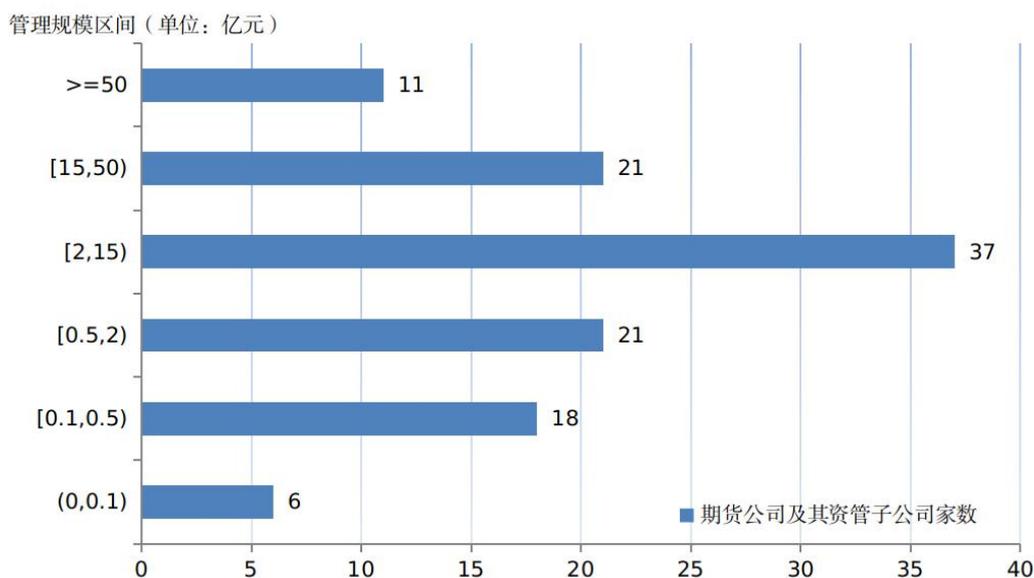


图7 期货公司及其资管子公司私募资管业务规模分布情况

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2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。