

证券期货经营机构私募资管产品备案月报 (2023年3月)

一、私募资管产品备案情况

2023年3月，证券期货经营机构当月共备案私募资管产品1,075只，设立规模591.86亿元（见图1）。

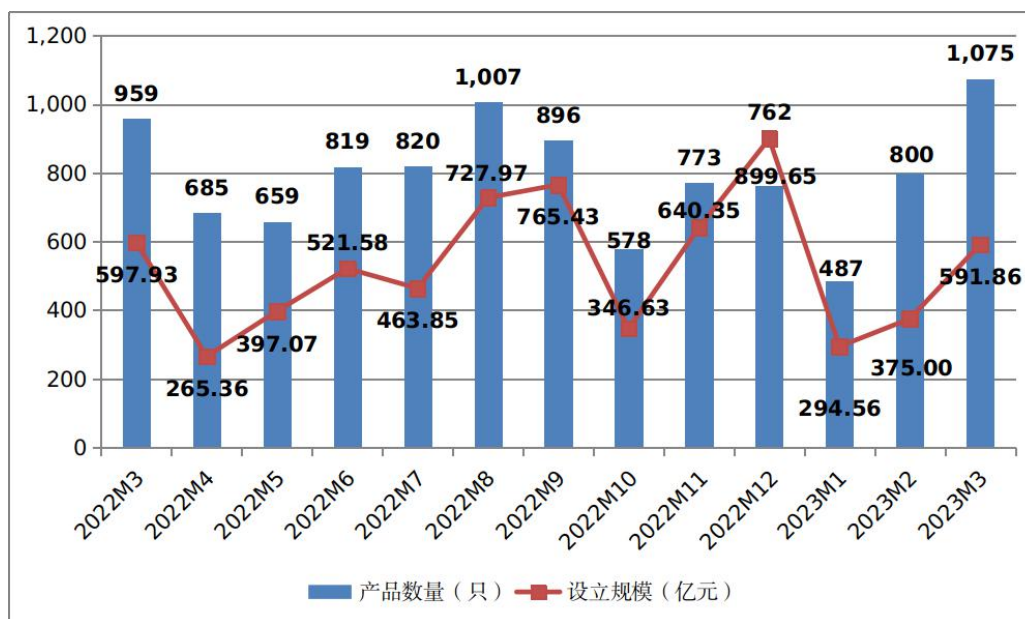


图1 证券期货经营机构资管产品月度备案数量及规模趋势

从机构类型看，3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3月备案的22只私募基金中17只为合伙型基金，5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3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	638	259.50	43.85%
证券公司私募子公司	22	32.83	5.55%
基金管理公司	268	135.14	22.83%
基金子公司	71	152.03	25.69%
期货公司及其资管子公司	76	12.36	2.09%
合计	1,075	591.86	100.00%

从产品类型看，3月备案的单一资产管理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（2023年3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	438	268.11	45.30%
单一资产管理计划	637	323.75	54.70%
合计	1,075	591.86	100.00%

从投资类型看，3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3月）

投资类型	产品数量（只）	设立规模（亿元）	规模占比
权益类	89	45.03	7.61%
固定收益类	552	443.32	74.90%
商品及金融衍生品类	85	37.80	6.39%
混合类	349	65.71	11.10%
合计	1,075	591.86	100.00%

二、私募资管产品存续情况

截至2023年3月底，证券期货经营机构私募资管业务规模合计13.56万亿元（不含社保基金、企业年金），较上月底减少2,563.80亿元，降低1.86%。（证券期货经营机构存续产品规模分布情况见图2）

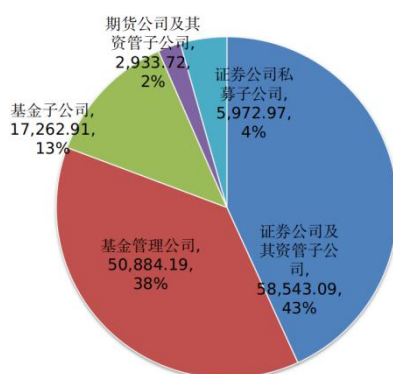


图2 证券期货经营机构存续产品规模分布情况（单位：亿元）

从产品类型看，3月存续单一资产管理计划规模占比为54.43%（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3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	17,675	54.30%	73,803.67	54.43%
集合资产管理计划	14,873	45.70%	61,793.22	45.57%
合计	32,548	100.00%	135,596.89	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3月底）

投资类型	数量（只）	数量占比	规模（亿元）	规模占比
权益类	5,707	17.53%	21,213.84	15.64%
固定收益类	14,157	43.50%	98,214.85	72.43%
商品及金融衍生品	1,429	4.39%	1,114.89	0.82%
混合类	11,255	34.58%	15,053.30	11.10%
合计	32,548	100.00%	135,596.89	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3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616亿元，较上月减少14亿元，管理规模中位数223亿元；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391亿元，较上月减少4亿元，管理规模中位数99亿元；基金子公司平均管理私募资管业务规模250亿元，管理规模中位数60亿元；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）

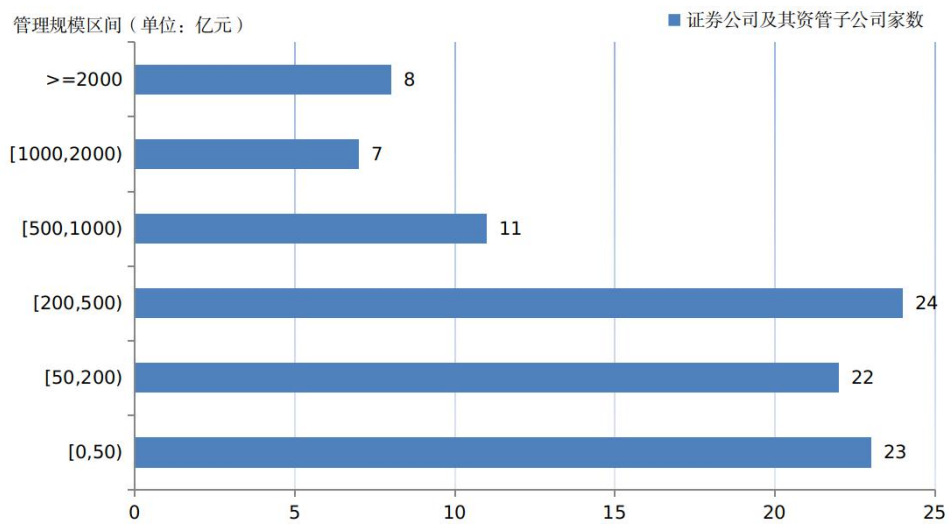


图3 证券公司及其资管子公司私募资管业务规模分布情况

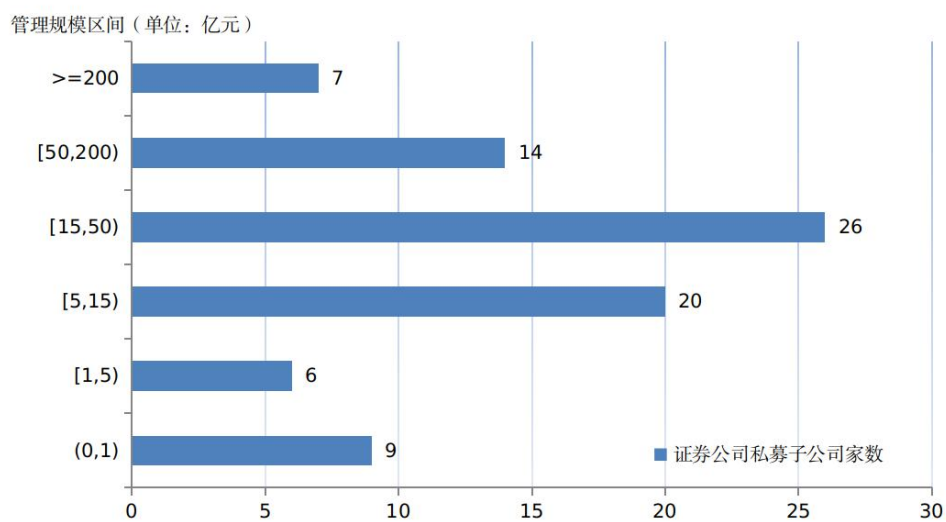


图4 证券公司私募子公司私募基金规模分布情况

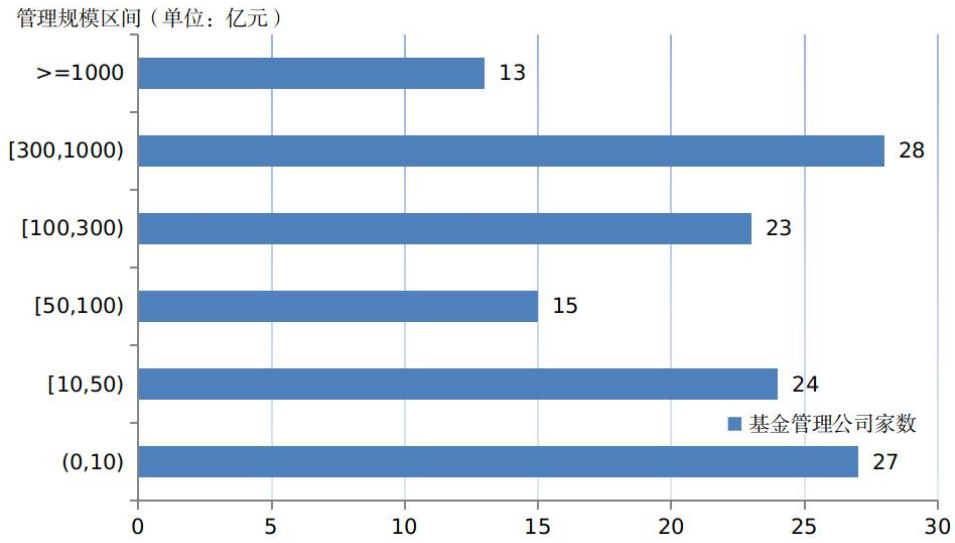


图5 基金管理公司私募资管业务规模分布情况

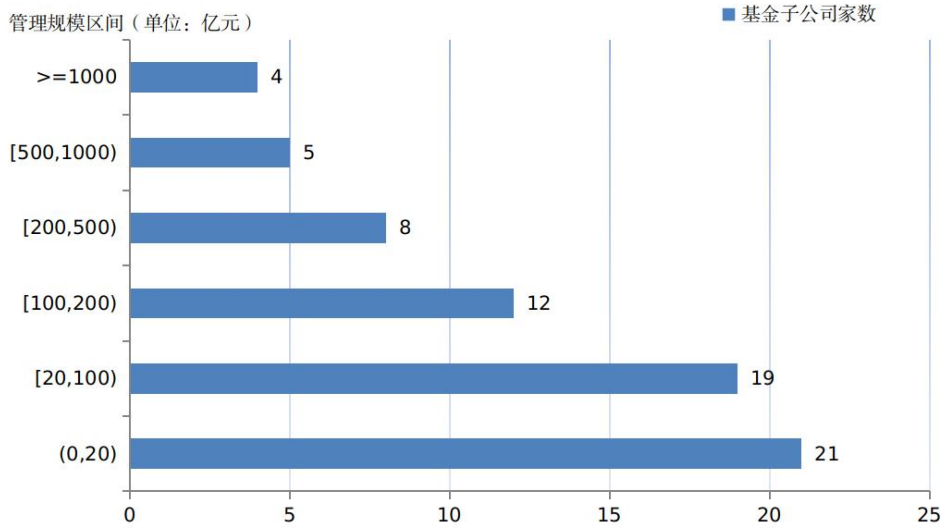


图6 基金子公司私募资管业务规模分布情况

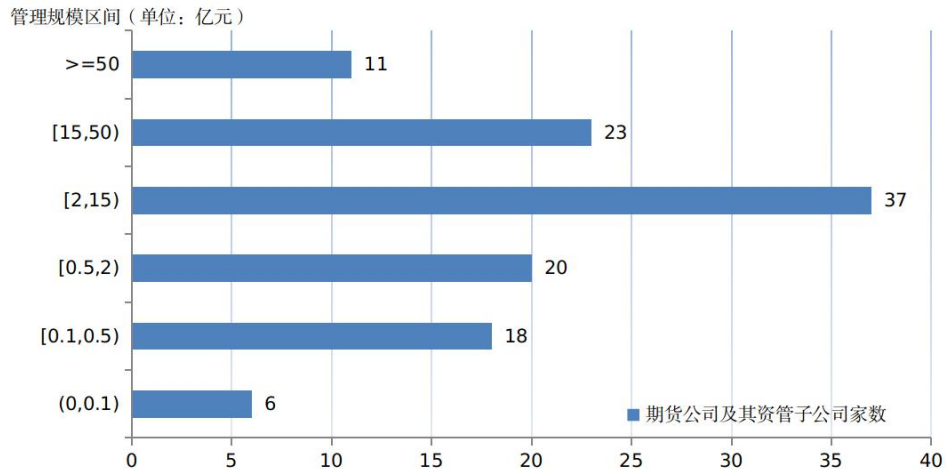


图7 期货公司及其资管子公司私募资管业务规模分布情况

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。