

证券期货经营机构私募资管产品备案月报 (2023年5月)

一、私募资管产品备案情况

2023年5月，证券期货经营机构当月共备案私募资管产品804只，设立规模427.46亿元（见图1）。

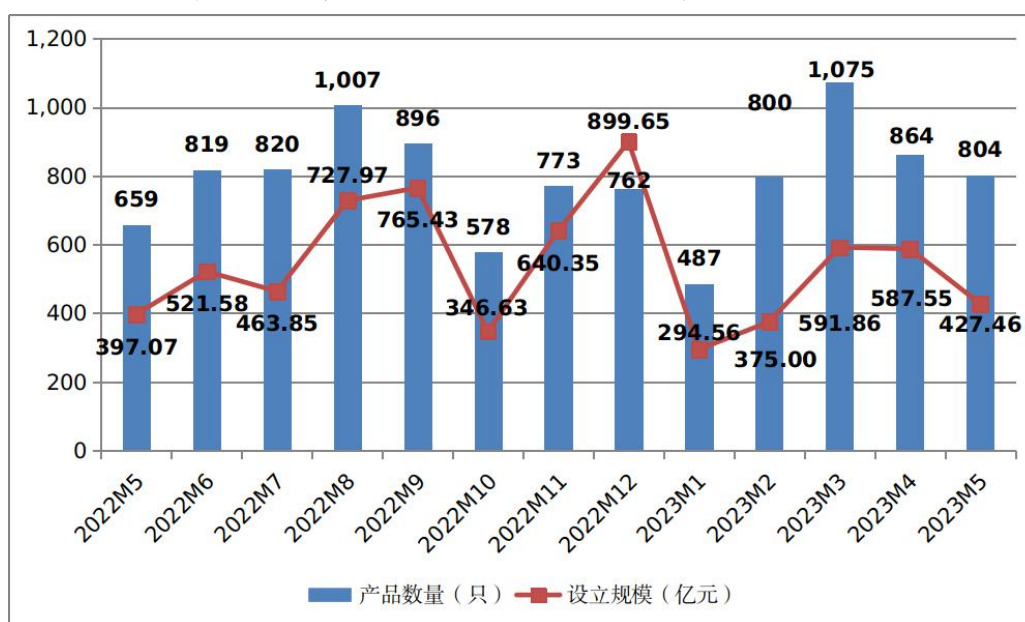


图1 证券期货经营机构资管产品月度备案数量及规模趋势

从机构类型看，5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5月备案的24只私募基金均为合伙型基金。

表1 按机构类型分私募资管产品月度备案情况（2023年5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	467	247.23	57.84%
证券公司私募子公司	24	13.60	3.18%
基金管理公司	216	120.02	28.08%
基金子公司	35	36.67	8.58%
期货公司及其资管子公司	62	9.94	2.33%
合计	804	427.46	100.00%

从产品类型看，5月备案的集合资产管理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（2023年5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	368	261.60	61.20%
单一资产管理计划	436	165.86	38.80%
合计	804	427.46	100.00%

从投资类型看，5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5月）

投资类型	产品数量（只）	设立规模（亿元）	规模占比
权益类	82	24.56	5.75%
固定收益类	354	293.03	68.55%
商品及金融衍生品类	59	27.45	6.42%
混合类	309	82.42	19.28%
合计	804	427.46	100.00%

二、私募资管产品存续情况

截至2023年5月底，证券期货经营机构私募资管业务规模合计13.46万亿元（不含社保基金、企业年金），较上月底减少3,150.92亿元，降低2.29%。（证券期货经营机构存续产品规模分布情况见图2）

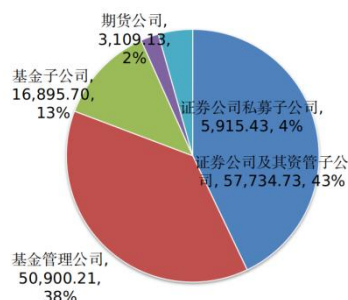


图2 证券期货经营机构存续产品规模分布情况（单位：亿元）

从产品类型看，5月存续单一资产管理计划规模占比为53.83%（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5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	17,624	53.72%	72,434.27	53.83%
集合资产管理计划	15,182	46.28%	62,120.93	46.17%
合计	32,806	100.00%	134,555.20	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5月底）

投资类型	数量（只）	数量占比	规模（亿元）	规模占比
权益类	5,685	17.33%	20,161.04	14.98%
固定收益类	14,255	43.45%	99,025.25	73.59%
商品及金融衍生品	1,471	4.48%	1,090.08	0.81%
混合类	11,395	34.73%	14,278.83	10.61%
合计	32,806	100.00%	134,555.20	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5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608亿元，较上月减少16亿元，管理规模中位数230亿元；证券公司私募子公司平均管理私募基金79亿元，管理规模中位数20亿元；基金管理公司平均管理私募资管业务规模392亿元，较上月减少8亿元，管理规模中位数97亿元；基金子公司平均管理私募资管业务规模246亿元，管理规模中位数63亿元；期货公司及其资管子公司平均管理私募资管业务规模27亿元，管理规模中位数5亿元。（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）

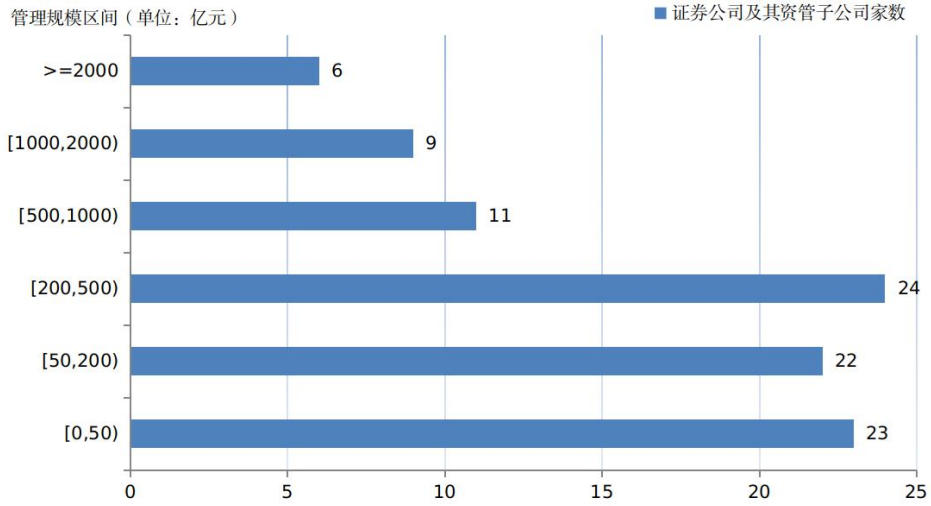


图3 证券公司及其资管子公司私募资管业务规模分布情况

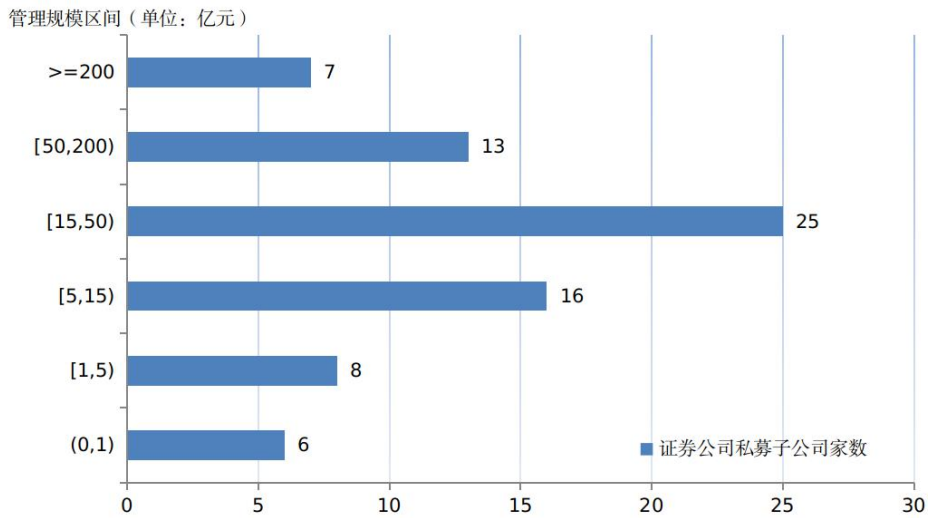


图4 证券公司私募子公司私募基金规模分布情况

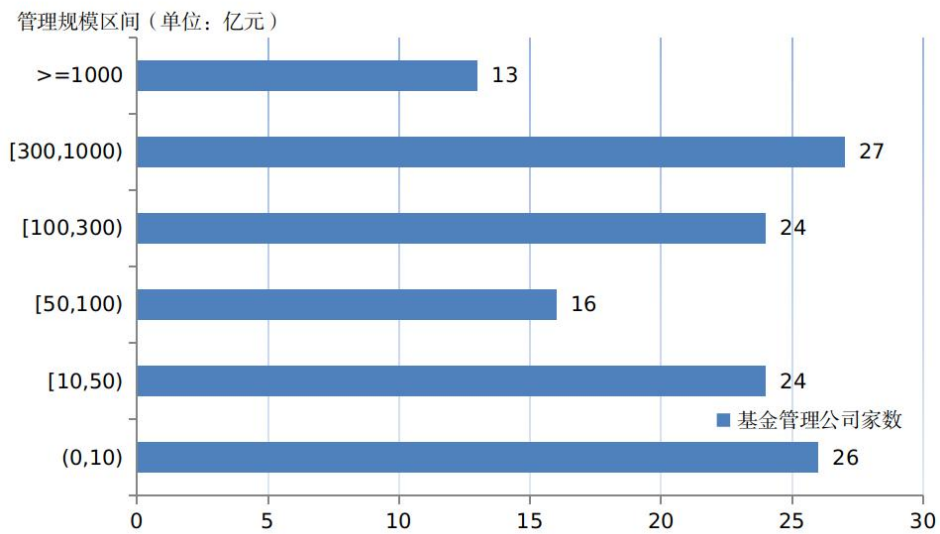


图5 基金管理公司私募资管业务规模分布情况

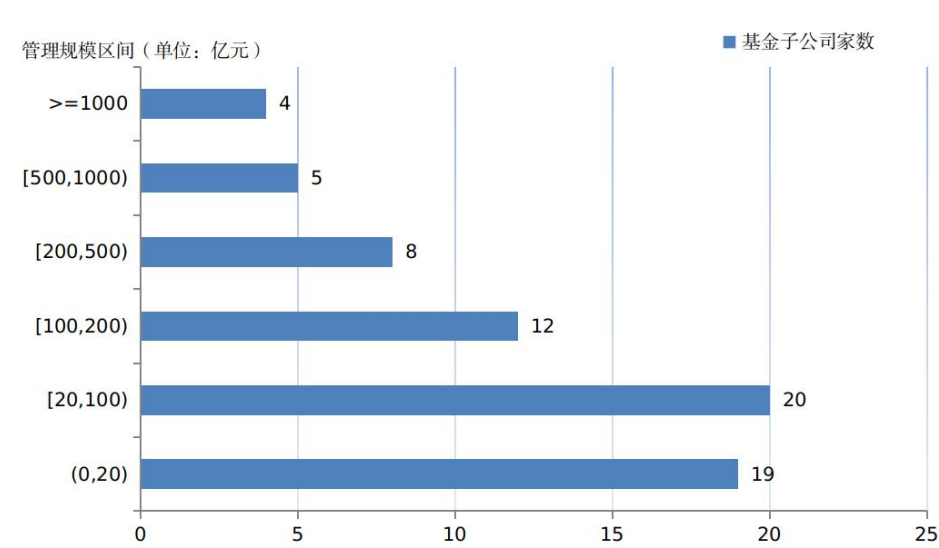


图6 基金子公司私募资管业务规模分布情况

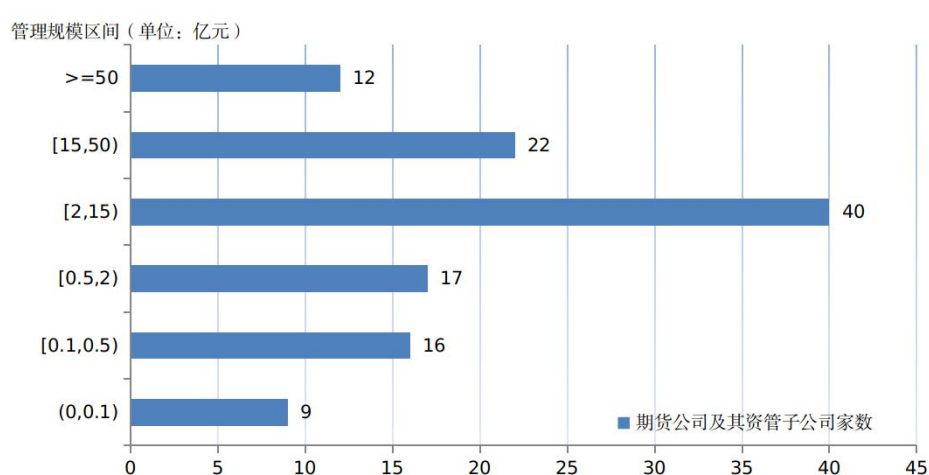


图7 期货公司及其资管子公司私募资管业务规模分布情况

注:

[1] 本文统计数据口径: 含证券公司私募子公司私募基金和基金管理公司私募投资基金管理子公司数据, 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和基金管理公司私募投资基金管理子公司产品规模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和基金管理公司私募投资基金管理子公司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]基金管理公司私募投资基金管理子公司产品暂纳入基金子公司统计。