

证券期货经营机构私募资管产品备案月报 (2021年6月)

一、私募资管产品备案情况

2021年6月，证券期货经营机构当月共备案私募资管产品1241只，设立规模944.12亿元（见图1）；当月备案的集合产品备案办理时间平均为1.91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，6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，备案产品设立规模最大的为基金子公司（见表1）。证券公司私募子公司6月备案的19只私募基金中，17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（2021年6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	594	362.19	38.36%
证券公司私募子公司	19	15.29	1.62%

基金管理公司	296	122.04	12.93%
基金子公司	247	408.84	43.30%
期货公司及其资管子公司	85	35.76	3.79%
合计	1241	944.12	100.00%

从产品类型看，6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（2021年6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	450	310.11	32.85%
单一资产管理计划	791	634.00	67.15%
合计	1241	944.12	100.00%

从投资类型看，6月备案私募资管产品数量最多的与备案产品设立规模最大的均为固定收益类（见表3）。

表3 按投资类型分私募资管产品月度备案情况（2021年6月）

投资类型	产品数量（只）	设立规模（亿元）	规模占比
权益类	171	84.61	8.96%
固定收益类	575	586.82	62.15%
商品及金融衍生品类	129	113.67	12.04%
混合类	366	159.02	16.84%
合计	1241	944.12	100.00%

二、私募资管产品存续情况

截至2021年6月底，证券期货经营机构私募资管业务规模合计15.70万亿元（不含社保基金、企业年金以及证券公司大集合），较上月底减少3571.44亿元，降幅2.22%。

（证券期货经营机构存续产品规模分布情况见图2）

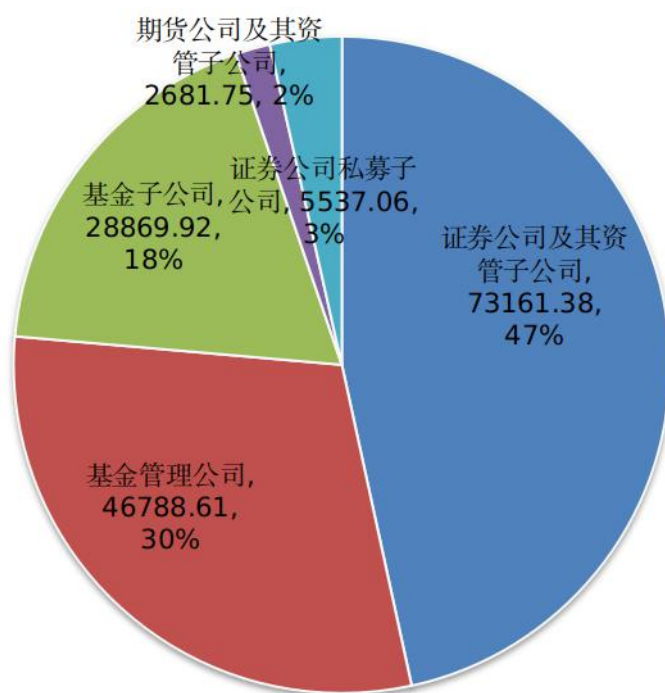


图2 证券期货经营机构存续产品规模分布情况 (单位: 亿元)

从产品类型看, 存续产品以单一资产管理计划为主, 规模占比为 66.77% (见表 4)。

表 4 按产品类型分私募资管产品存续情况 (截至 2021 年 6 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	19488	61.50%	104860.35	66.77%
集合资产管理计划	12201	38.50%	52178.36	33.23%
合计	31689	100.0%	157038.70	100.0%

从产品管理方式看 (不含证券公司私募子公司私募基金), 通道类产品规模继续下降, 主动管理类产品稳步增长。截至 2021 年 6 月底, 通道类产品规模 3.94 万亿元, 较上月底下降 8.42%; 主动管理类产品规模 11.21 万亿元, 较上月底增加 0.03%。

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 2021 年 6 月底)

投资类型	数量（只）	数量占比	规模（亿元）	规模占比
权益类	6184	19.51%	24079.43	15.33%
固定收益类	15136	47.76%	109636.18	69.81%
商品及金融衍生品	1022	3.23%	1015.68	0.65%
混合类	9347	29.50%	22307.42	14.21%
合计	31689	100.0%	157038.70	100.0%

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 2021 年 6 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 762 亿元，管理规模中位数 283 亿元；证券公司私募子公司平均管理私募基金 75 亿元，管理规模中位数 19 亿元；基金管理公司平均管理私募资管业务规模 377 亿元，管理规模中位数 110 亿元；基金子公司平均管理私募资管业务规模 380 亿元，管理规模中位数 121 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 25 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）

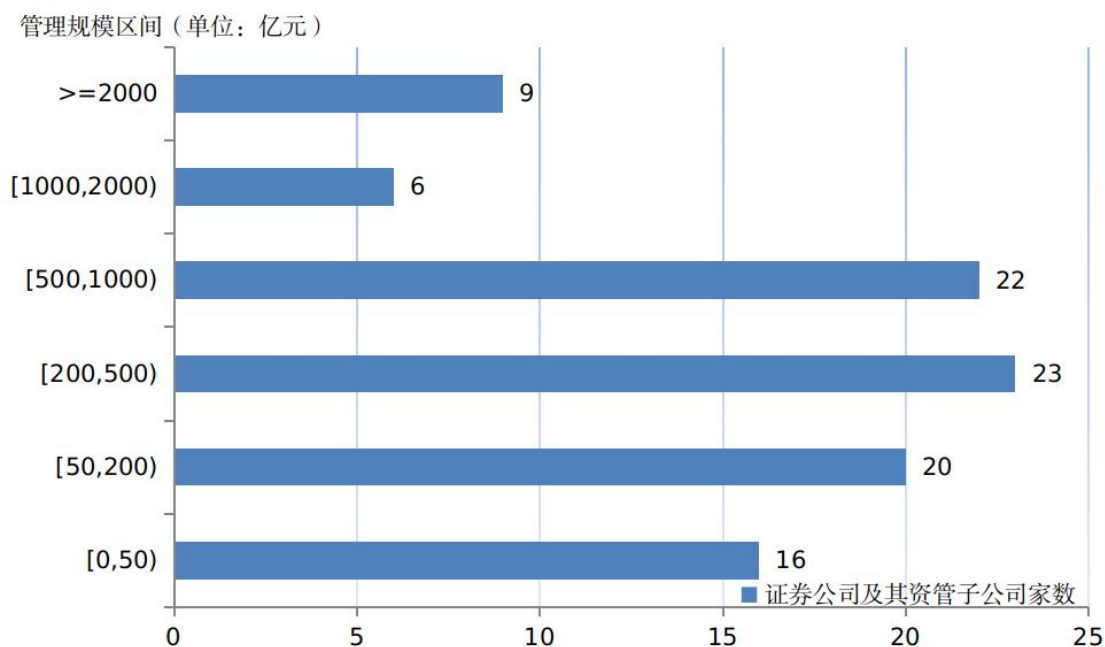


图 3 证券公司及其资管子公司私募资管业务规模分布情况

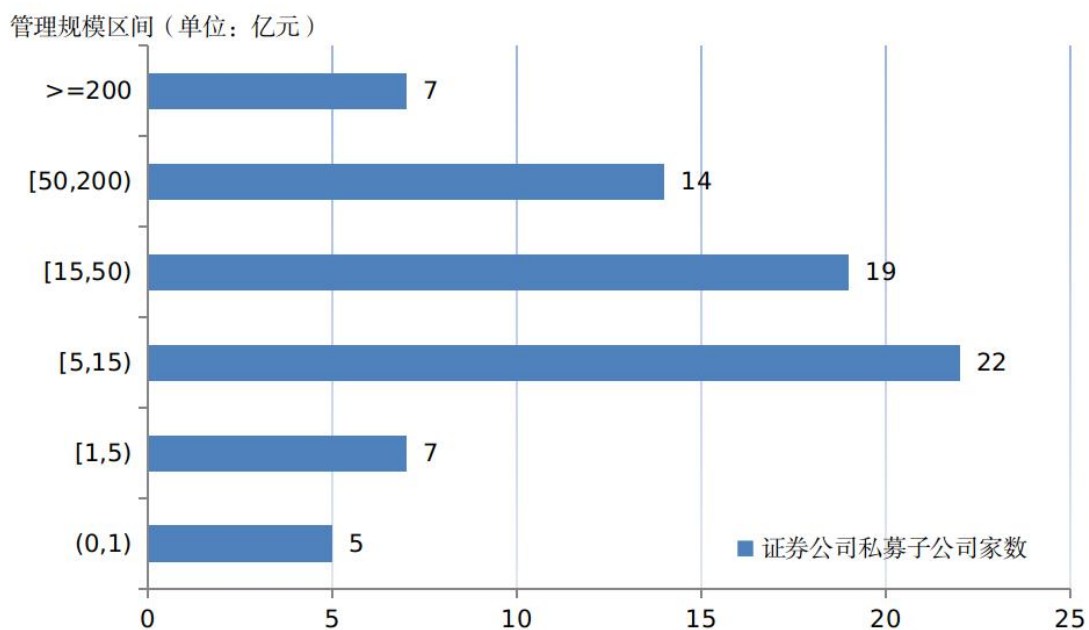


图4 证券公司私募子公司私募基金规模分布情况

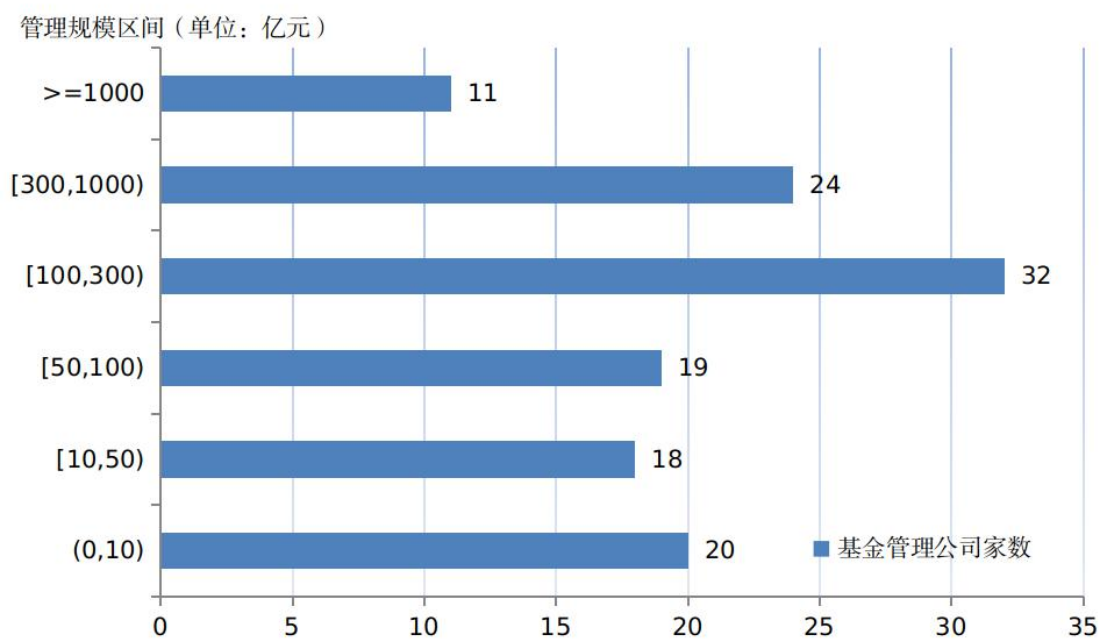


图5 基金管理公司私募资管业务规模分布情况

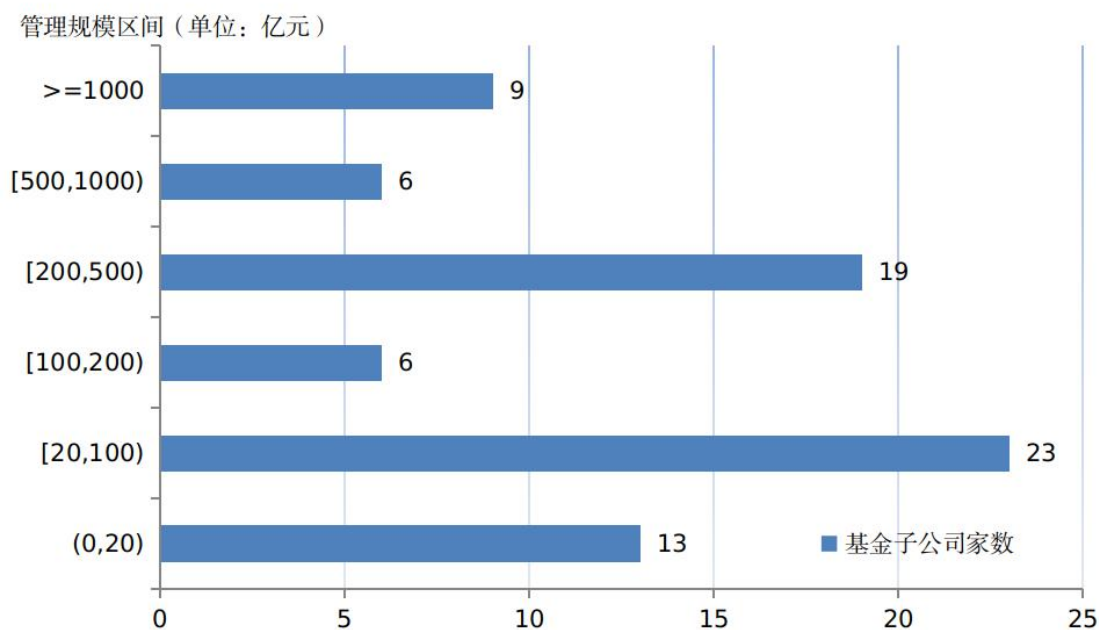


图6 基金子公司私募资管业务规模分布情况

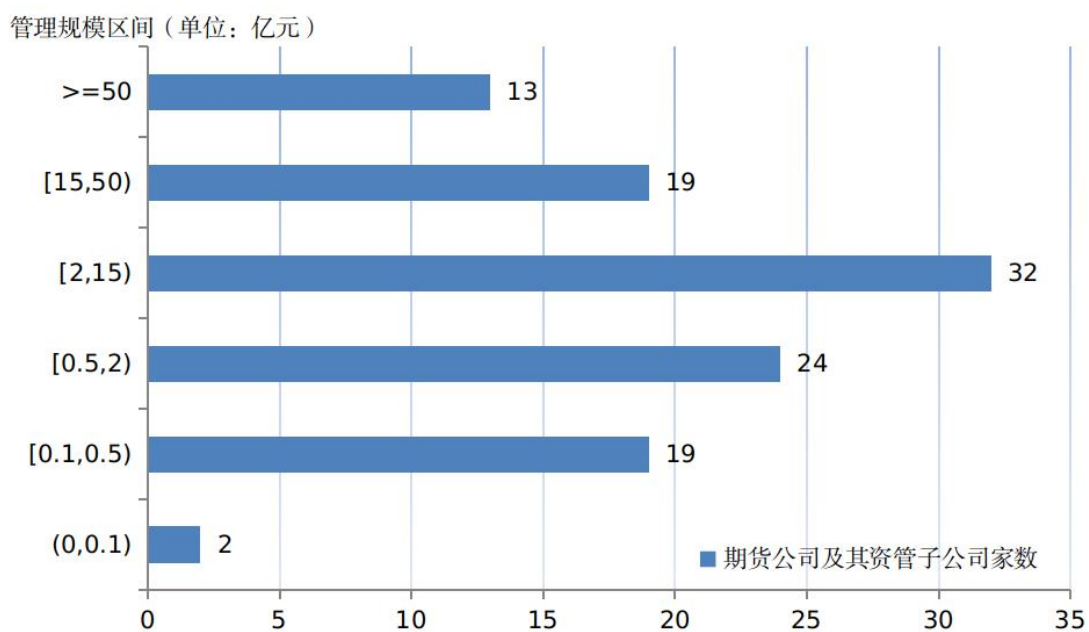


图7 期货公司及其资管子公司私募资管业务规模分布情况

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,不含证券公司管理的大集合产品,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。