

# 证券期货经营机构私募资管产品备案月报 (2023年11月)

## 一、私募资管产品备案情况

2023年11月，证券期货经营机构当月共备案私募资管产品844只，设立规模618.29亿元（见图1）。

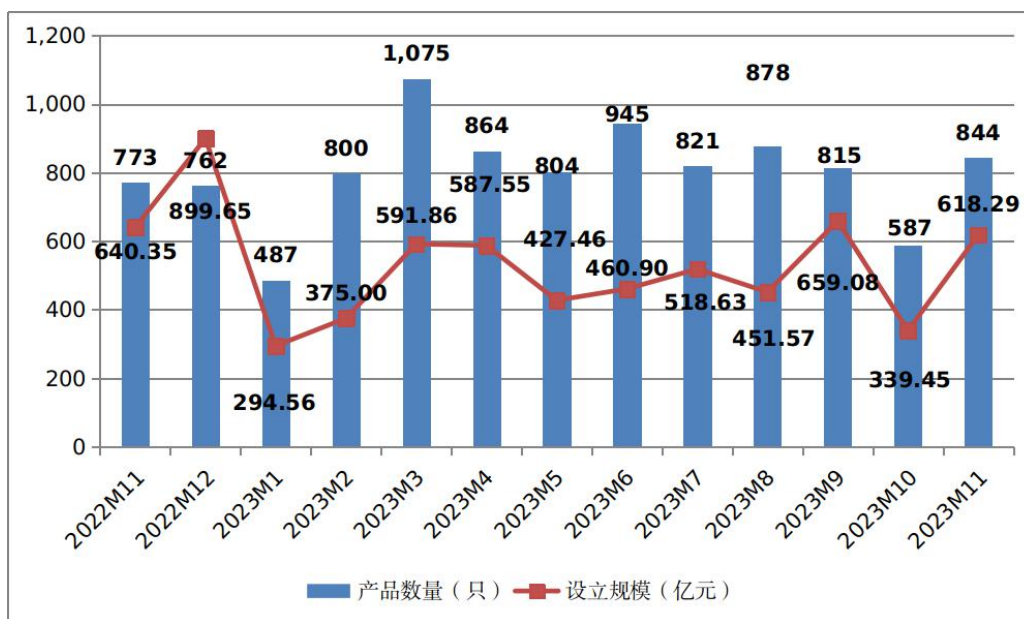


图1 证券期货经营机构资管产品月度备案数量及规模趋势

从机构类型看，11月备案私募资管产品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11月备案的21只私募基金中17只为合伙型，3只为契约型，1只为公司型。

表1 按机构类型分私募资管产品月度备案情况（2023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	526	310.95	50.29%
证券公司私募子公司	21	22.60	3.66%
基金管理公司	161	251.81	40.73%
基金子公司	59	22.77	3.68%
基金管理公司私募子公司	1	0.17	0.03%
期货公司及其资管子公司	76	9.98	1.61%
合计	844	618.29	100.00%

从产品类型看，11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	451	444.02	71.81%
单一资产管理计划	393	174.27	28.19%
合计	844	618.29	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（2023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	79	38.20	6.18%
固定收益类	497	518.04	83.79%
期货和衍生品类	43	8.95	1.45%
混合类	225	53.10	8.59%
合计	844	618.29	100.00%

## 二、私募资管产品存续情况

截至2023年11月底，证券期货经营机构私募资管业务规模合计12.69万亿元（不含社保基金、企业年金），较上月底减少605.76亿元，降低0.5%。（证券期货经营机构存续产品规模分布情况见图2）

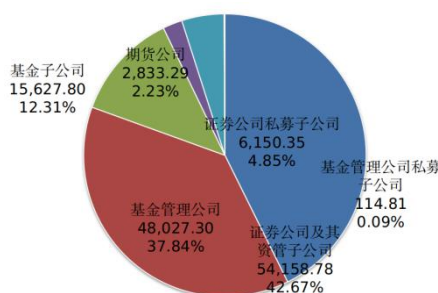


图2 证券期货经营机构存续产品规模分布情况（单位：亿元）

从产品类型看，11月存续单一资产管理计划规模占比为52.93%（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	17,420	51.90%	67,176.41	52.93%
集合资产管理计划	16,146	48.10%	59,735.92	47.07%
<b>合计</b>	<b>33,566</b>	<b>100.00%</b>	<b>126,912.33</b>	<b>100.00%</b>

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，期货和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	5,601	16.69%	18,991.25	14.96%
固定收益类	14,807	44.11%	93,618.44	73.77%
期货和衍生品类	1,495	4.45%	962.40	0.76%
混合类	11,663	34.75%	13,340.24	10.51%
<b>合计</b>	<b>33,566</b>	<b>100.00%</b>	<b>126,912.33</b>	<b>100.00%</b>

### 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564亿元，管理规模中位数206亿元；证券公司私募子公司平均管理私募基金83亿元；基金管理公司平均管理私募资管业务规模372亿元，管理规模中位数111亿元；基金子公司平均管理私募资管业务规模233亿元，管理规模中位数69亿元；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）

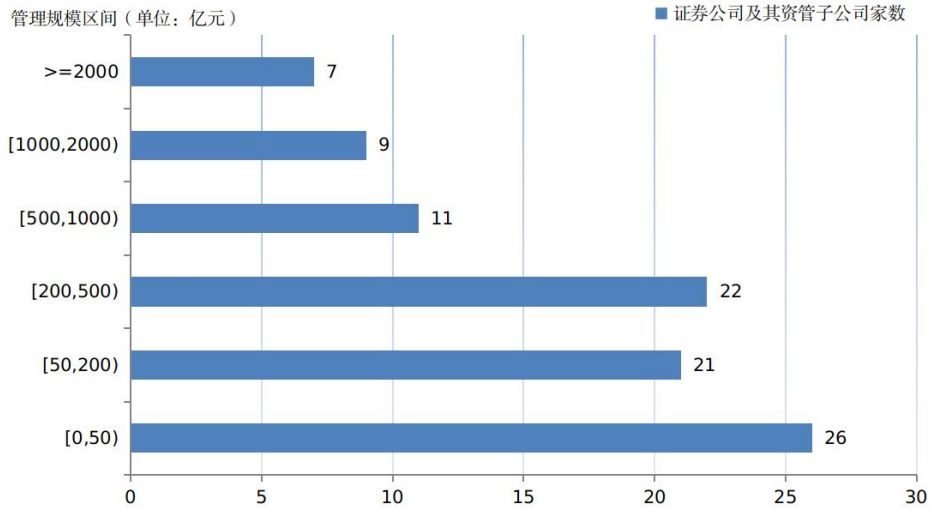


图3 证券公司及其资管子公司私募资管业务规模分布情况

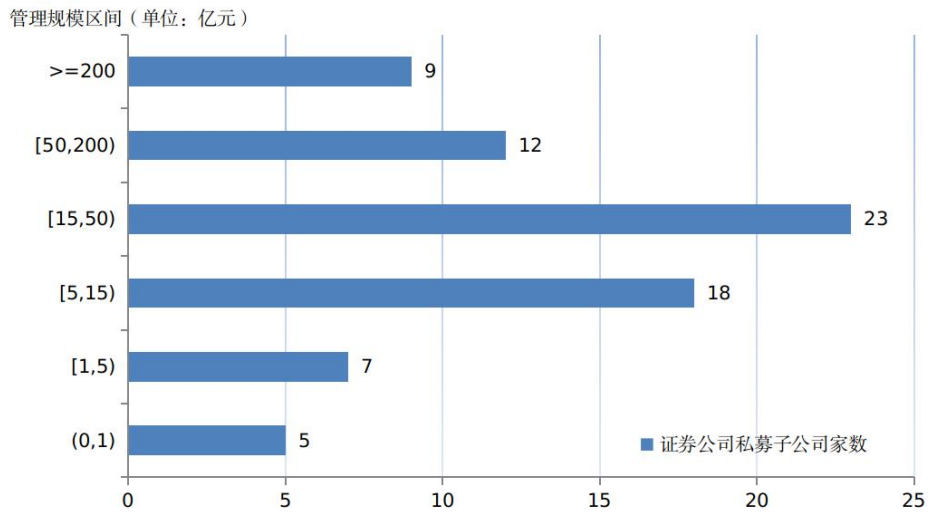


图4 证券公司私募子公司私募基金规模分布情况

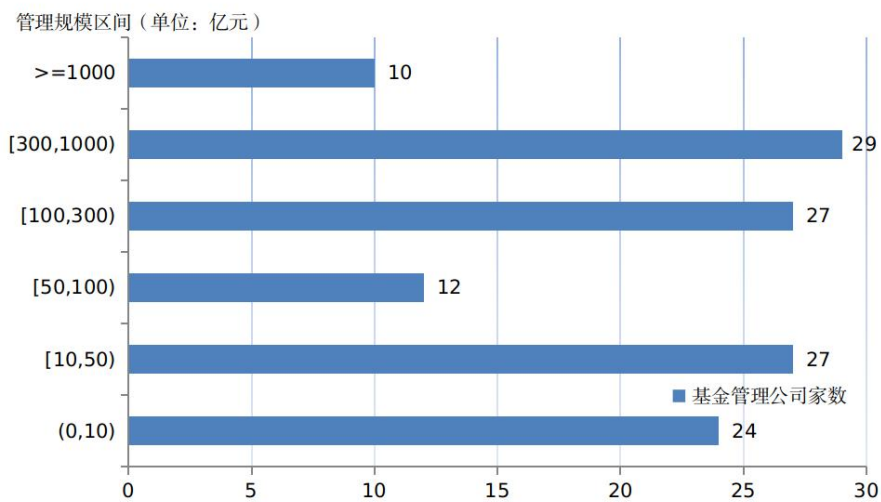


图5 基金管理公司私募资管业务规模分布情况

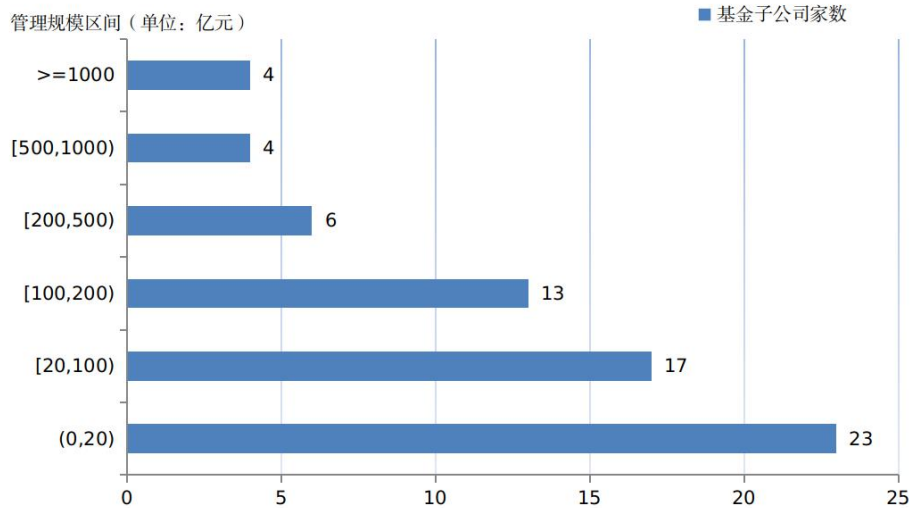


图6 基金子公司私募资管业务规模分布情况

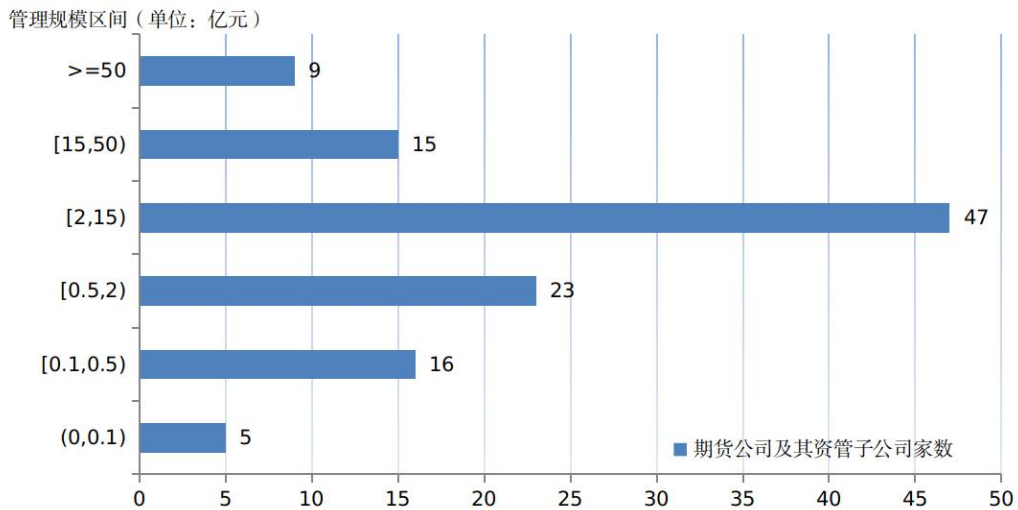


图7 期货公司及其资管子公司私募资管业务规模分布情况

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。