

期货经营机构资管业务月报

(2024 年 1 月)

中国期货业协会

2024 年 2 月 28 日

目 录

一、资管业务整体概况	1
(一) 本月产品备案情况	1
(二) 存续产品运作情况	1
二、资管计划资金来源情况	2
三、资管计划资金投向情况	2
四、聘请服务机构情况	3
五、资管业务收入情况	3
六、投资顾问业务开展情况	4
七、附表	4
(一) 各类型数量规模分布	4
(二) 产品规模排名情况 (前 10)	5

一、资管业务整体概况

(一) 本月产品备案情况

截至统计期末，本月共有 35 家公司成立了 70 只资产管理计划，新成立资管计划净资产规模 19.54 亿元；其中有 65 只通过基金业协会备案，净资产规模 9.81 亿元。本月新成立产品情况如下：

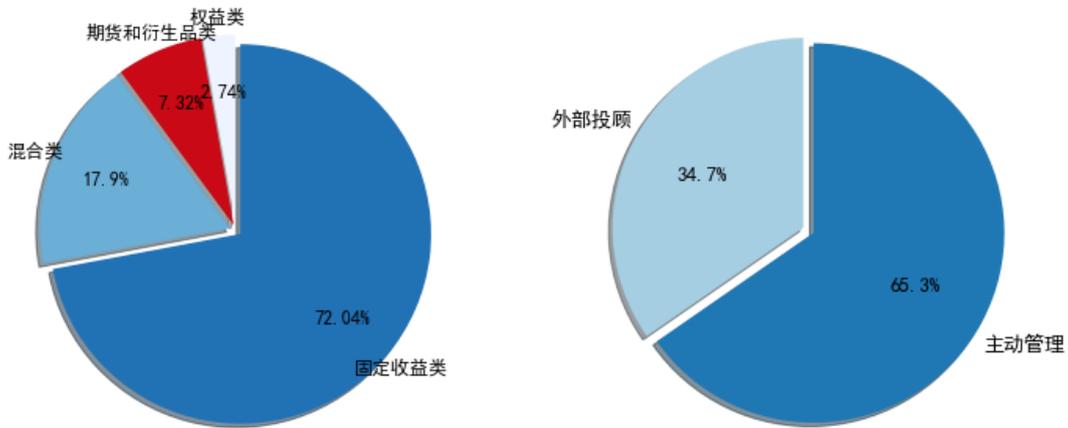
分类维度	产品数量	净资产规模_亿元
固定收益类	12	2.6
期货和衍生品类	15	10.79
权益类	2	0.2
混合类	41	5.95
主动管理	69	19.44
外部投顾	1	0.1
单一	31	4.97
集合	39	14.56

(二) 存续产品运作情况

截至报告期末，期货经营机构完成备案正常运作的资产管理计划共 2074 只，较上月环比下降 1.66%；净资产规模 2730.83 亿元，较上月环比下降 0.46%。

从产品类别来看，规模最高的是固定收益类产品（602 只，规模 1967.21 亿元）；其他依次是混合类产品（746 只，规模 488.78 亿元），期货和衍生品类产品（605 只，规模 200.01 亿元），权益类产品（121 只，规模 74.82 亿元）。管理方式上主动管理为主，共 1628 只，规模 1783.73 亿元。

资产管理计划规模占比分布



二、资管计划资金来源情况

截至报告期末，期货经营机构正常运作的资产管理计划主要资金来源为银行，合计规模 1346.81 亿元，占比 49.32%；其次为自然人，规模 472.84 亿元，占比 17.31%；第三是信托公司，规模 381.11 亿元，占比 10.19%。

客户性质	规模_亿元	规模占比
银行	1346.81	49.32%
自然人	472.84	17.31%
信托公司	381.11	13.96%
一般法人	278.22	10.19%
私募基金	105.14	3.85%
证券公司	69.59	2.55%
期货公司	63.81	2.34%
基金公司	4.38	0.16%
QFII	1.07	0.04%
保险公司	0.33	0.01%
其他	7.52	0.28%

三、资管计划资金投向情况

截至报告期末，期货资管投向债权类资产的规模为 2251.17 亿元，占比 72.75%；投向股权类资产的规模为 199.55 亿元，占比 6.45%；投向期货和衍生品类资产的规模为 46.54

亿元，占比 1.5%。

配置方向	规模（亿元）	投向占比
债权资产	2251.17	72.75%
股权资产	199.55	6.45%
期货和衍生品	46.54	1.50%
公募基金	137.72	4.45%
私募资管产品	191.83	6.20%
各类现金备付金	244.95	7.92%
应收股利等其他资产	22.61	0.73%

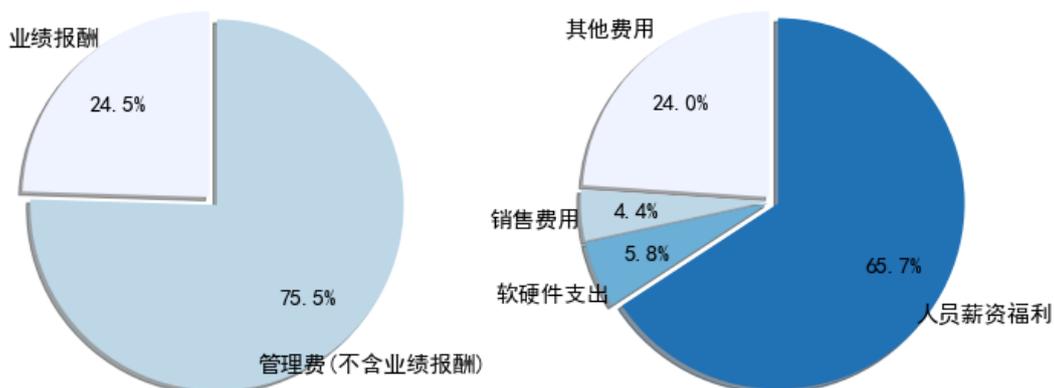
四、聘请服务机构情况

截至报告期末，存续产品中共有 446 只产品聘请了 156 家投资顾问。存续产品中共有 1214 只产品采用了 132 家期货经营机构以外的销售机构。存续资管计划的托管机构以证券公司为主，共 1336 只产品聘请证券公司作为托管机构，其余则选择银行作为托管机构，共 732 只产品。

五、资管业务收入情况

截至报告期末，本月期货经营机构资产管理业务总收入 6972.51 万元(其中业绩报酬 1758.78 万元),总支出 5972.11 万元，净收入 1000.4 万元。分布情况见下图：

期货经营机构资管业务 收入支出分布情况



六、投资顾问业务开展情况

截至统计期末，本月共有 49 家期货经营机构为 295 只资产管理产品提供投资顾问服务，涉及产品管理人 71 个。账户总规模 1446.4 亿元，其中期货及衍生品投资规模 2.98 亿元。

业务收入方面截至统计期末，各期货经营机构本月投资顾问业务收入 685.58 万元，本年度累计收入 685.58 万元。

投顾产品管理人类型	管理人数量	产品数量	产品规模_亿元	期货和衍生品投资规模_亿元	产品规模占比
基金公司及其资管子公司	11	52	1257.72	1.73	86.96%
信托公司	12	155	95.22	0.3	6.58%
私募基金管理人	43	82	55.32	0.72	3.82%
其他	3	3	37.19	0	2.57%
期货公司及其资管子公司	1	1	0.65	0.24	0.04%
证券公司及其资管子公司	2	2	0.29	0	0.02%

七、附表

(一) 各类型数量规模分布

分类维度	产品数量	净资产规模_亿元
固定收益类	602	1967.21
期货和衍生品类	605	200.01
权益类	121	74.82
混合类	746	488.78
主动管理	1628	1783.73
外部投顾	446	947.1
单一	514	458.88
集合	1560	2271.95

(二) 产品规模排名情况 (前 10)

机构名称	资管计划数量	产品规模_亿元	规模占比	规模累计占比
行业中位数	9	3.71	-	-
中信期货有限公司	244	759.02	27.79%	27.79%
中信建投期货有限公司	42	259.81	9.51%	37.30%
弘业期货股份有限公司	27	250.67	9.18%	46.48%
海通期货股份有限公司	154	240.7	8.81%	55.29%
光大期货有限公司	55	158.91	5.82%	61.11%
国泰君安期货有限公司	80	118.16	4.33%	65.44%
兴业期货有限公司	49	112.47	4.12%	69.56%
中粮期货有限公司	39	81.78	2.99%	72.55%
上海东证期货有限公司	36	55.24	2.02%	74.57%
建信期货有限责任公司	71	52.33	1.92%	76.49%