

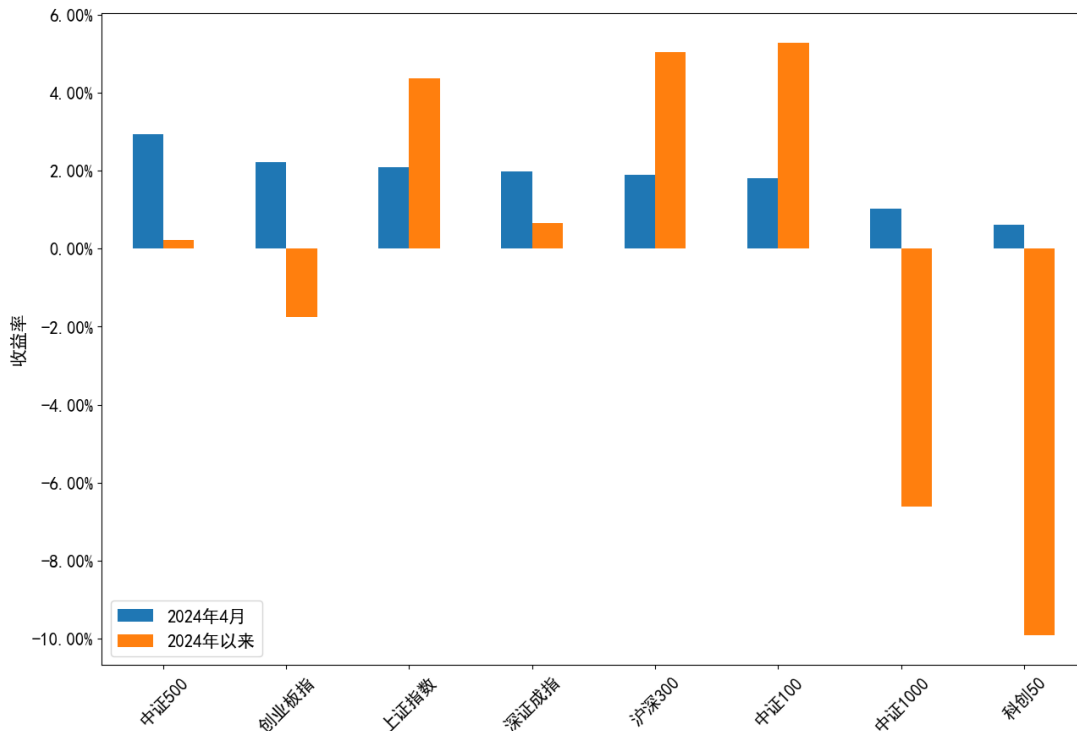
## 《东方基金 | 量化观市 2024/4》

2024年4月，市场总体呈现为上中旬震荡，月底强势上行，主要指数均录得正收益，中证500相对表现最好，而上月表现不佳的科创50依旧表现低迷；行业方面，家电、银行表现最好，综合与传媒表现不佳；市场风格方面上总体是价值优于成长，小盘优于大盘；从市场情绪来看，市场交易成交额与市场表现较为一致，先下降后上升，日均成交额为9162.95亿，两融余额有所下降，北向资金月度总体继续呈现净流入的状态，其中净流入较大的行业为有色金属，净流出较大的行业为传媒。

### 市场表现回顾

2024年4月主要市场指数中，中证500表现最好，收益率为2.93%；科创50表现最差，收益率为0.62%。

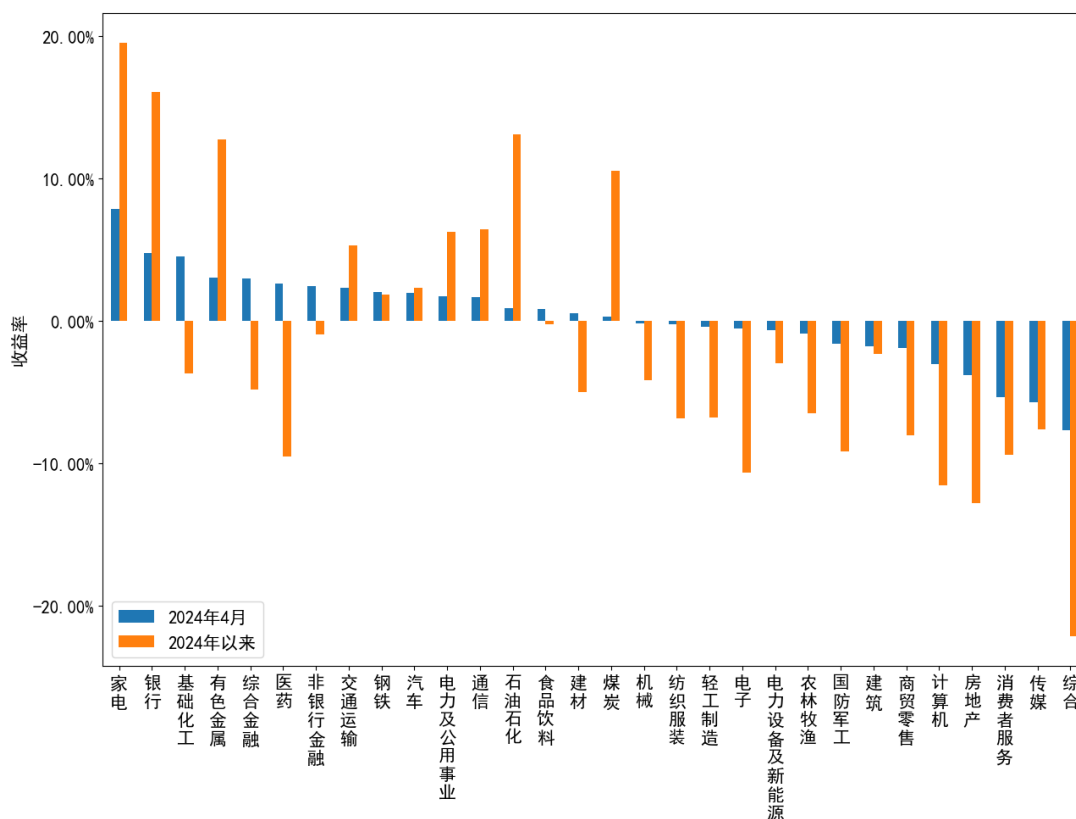
2024年以来，中证100表现最好，收益率为5.28%；科创50表现最差，收益率为-9.92%。



(数据来源: wind, 东方基金量化投资部, 月度数据统计区间: 20240101-20240430)

2024年4月中信一级行业中，共16个行业上涨，14个行业下跌，其中收益率靠前的5个行业为家电，银行，基础化工，有色金属，综合金融，收益率分别为7.90%，4.80%，4.57%，3.03%，3.02%；收益率靠后的5个行业为综合，传媒，消费者服务，房地产，计算机，收益率分别为-7.65%，-5.70%，-5.32%，-3.80%，-3.03%。

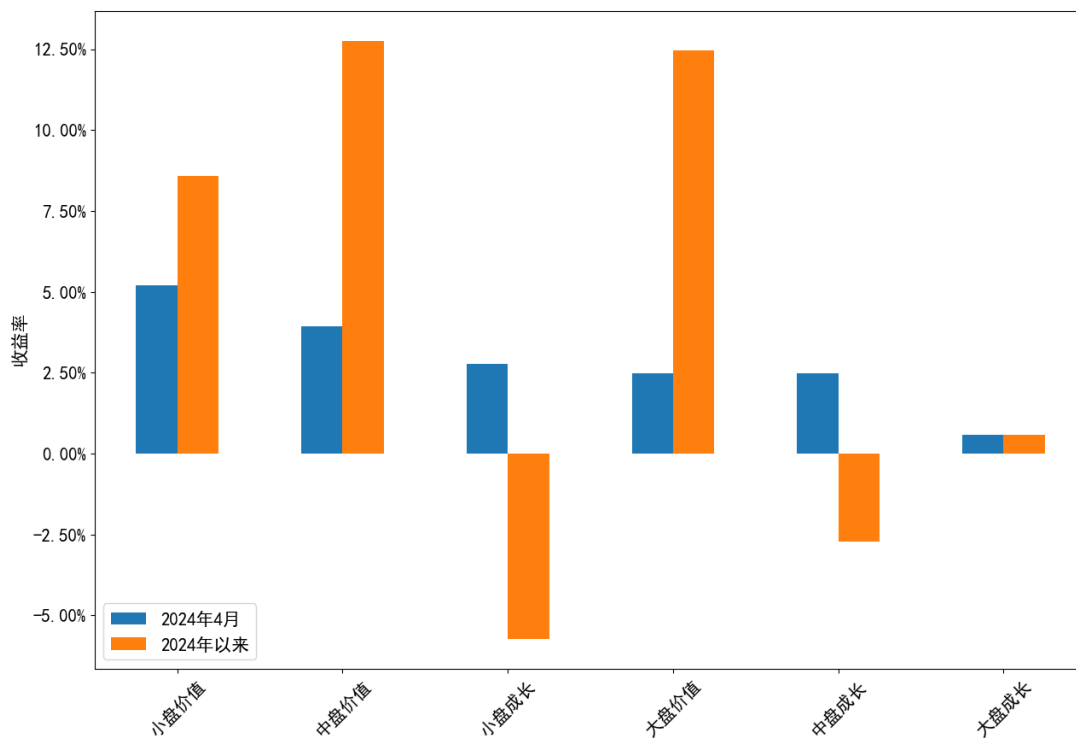
2024年以来中信一级行业中，共10个行业上涨，20个行业下跌，其中收益率靠前的5个行业为家电，银行，石油石化，有色金属，煤炭，收益率分别为19.55%，16.10%，13.11%，12.78%，10.56%；收益率靠后的5个行业为综合，房地产，计算机，电子，医药，收益率分别为-22.14%，-12.78%，-11.55%，-10.63%，-9.51%。



(数据来源: wind, 东方基金量化投资部, 月度数据统计区间: 20240101-20240430)

## 市场风格回顾

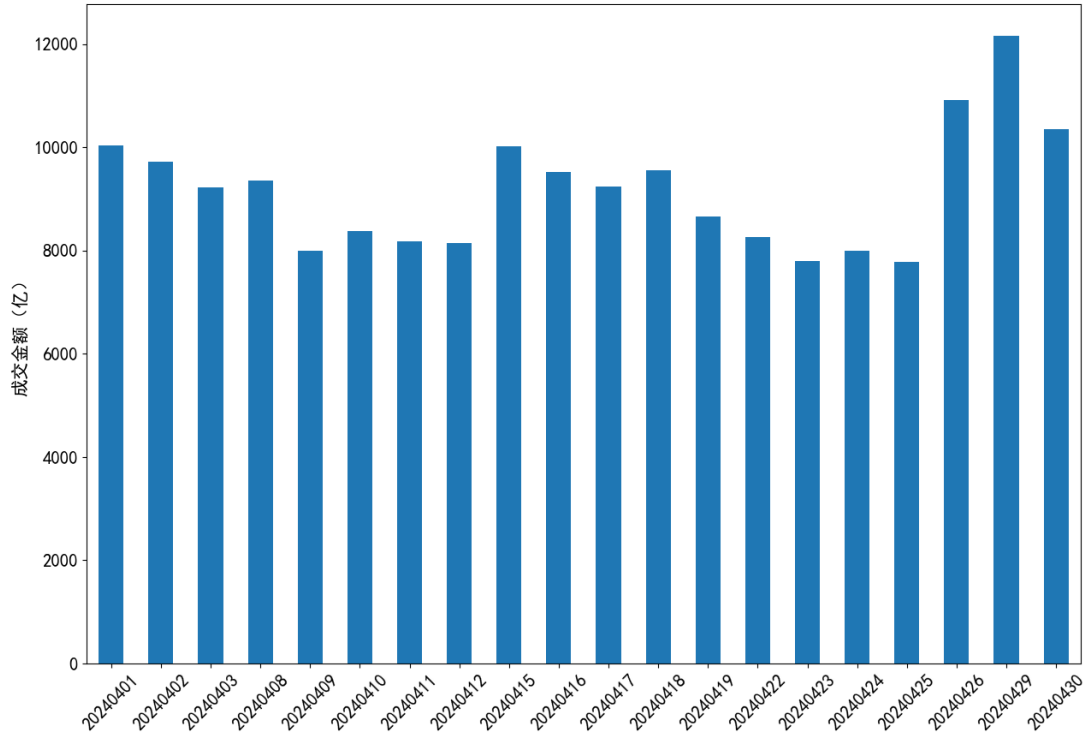
2024年4月巨潮风格指数中,小盘价值表现最好,收益率为5.20%,而大盘成长表现最差,收益率为0.59%;2024年以来,中盘价值表现最好,收益率为12.76%,小盘成长表现最差,收益率为-5.72%。



(数据来源: wind, 东方基金量化投资部, 月度数据统计区间: 20240101-20240430)

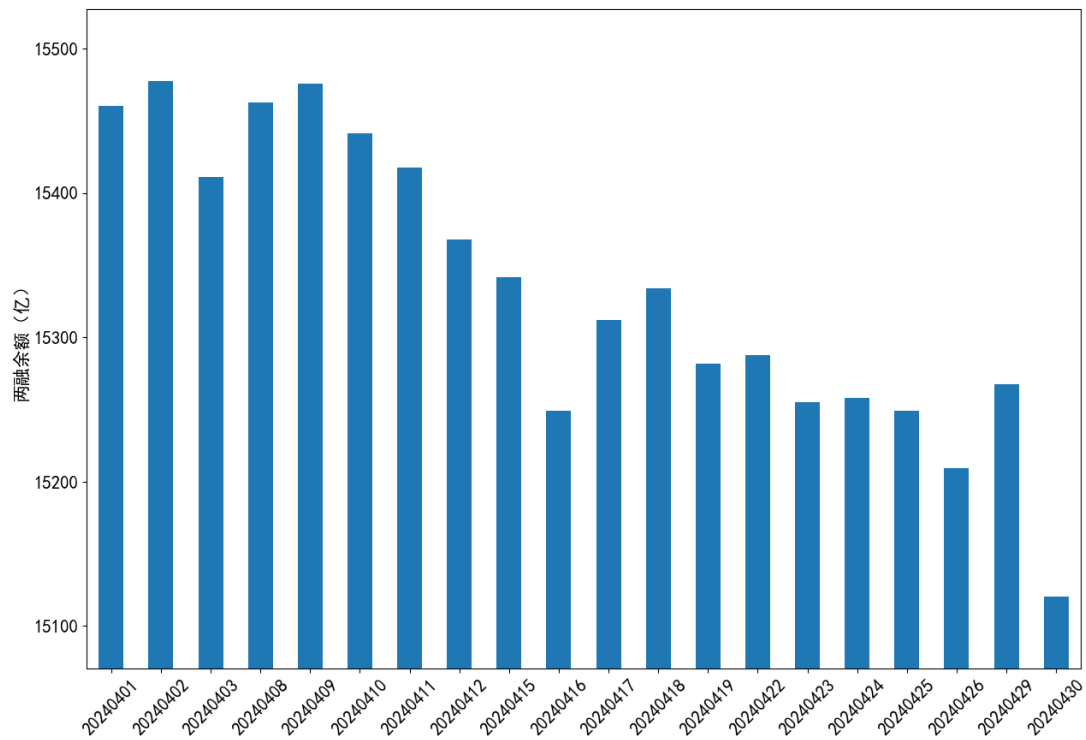
## 市场情绪回顾

2024年4月20个交易日中,日均成交额为9162.95亿。其中单日最大成交额为4月29日的12166.65亿,单日最小成交额为4月25日的7778.93亿。



(数据来源: wind, 东方基金量化投资部, 数据统计区间: 20240401-20240430)

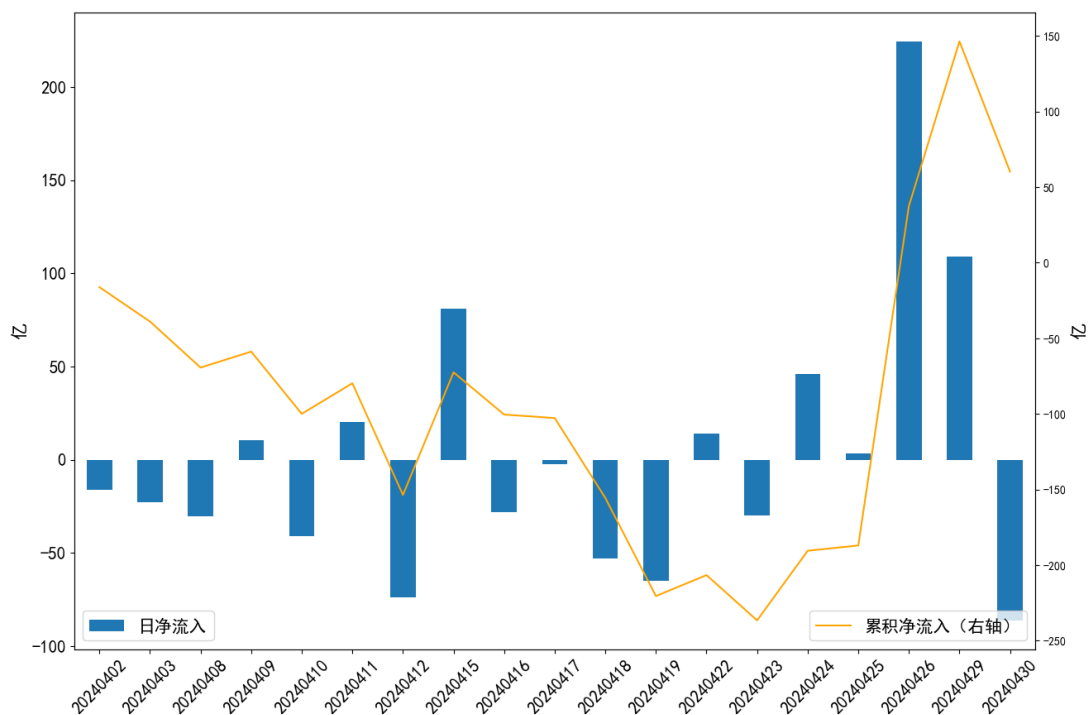
2024年4月两融余额总体呈现下降趋势, 月末相比月初减少了339.97亿。



(数据来源: wind, 东方基金量化投资部, 数据统计区间: 20240401-20240430)

---

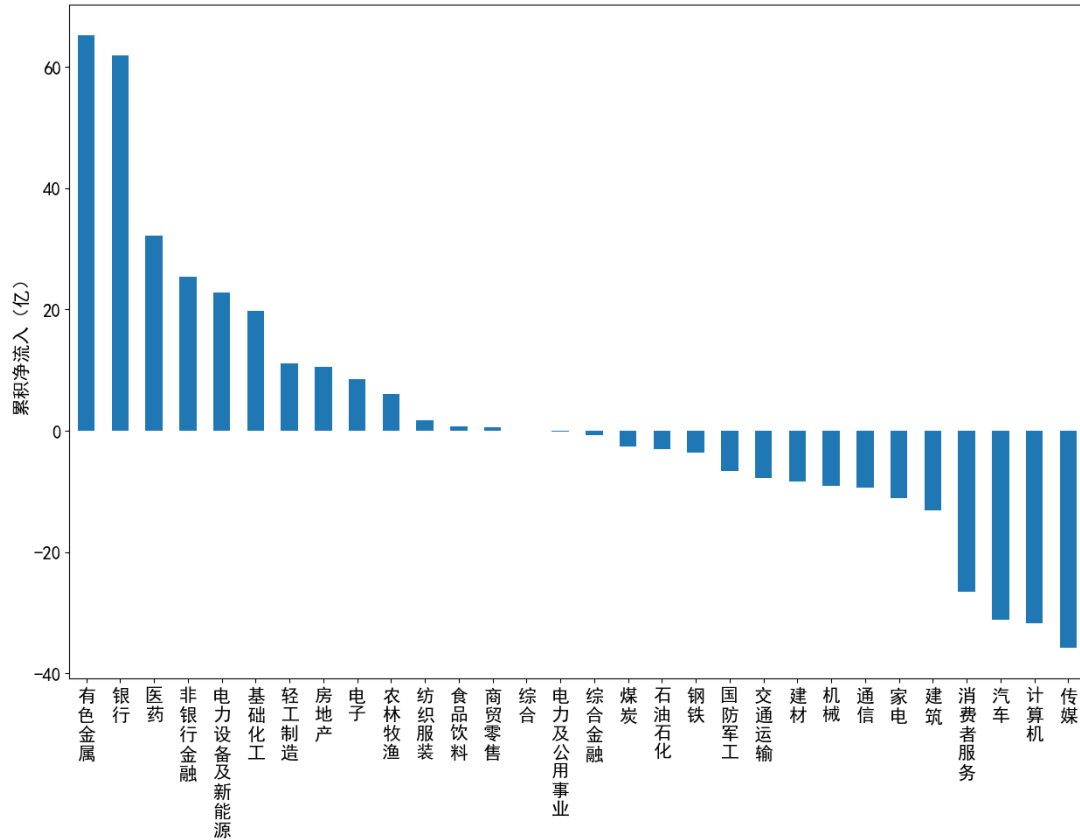
2024年4月19个交易日中，北向资金共8天为净流入，11天为净流出。其中单日最大净流入为4月26日的224.49亿，单日最大净流出为4月30日的86.17亿。



(数据来源: wind, 东方基金量化投资部, 数据统计区间: 20240401-20240430)

分行业来看，30个中信一级行业中，上月共14个行业净流入，16个行业净流出。其中有色金属净流入最多，净流入65.20亿；传媒净流出最多，净流出35.77亿。

---



(数据来源: wind, 东方基金量化投资部, 数据统计区间: 20240401-20240430)

### 市场有风险 基金投资需谨慎

本报告并非基金宣传推介材料, 仅供投资者参考, 不构成任何投资建议或承诺。

本报告是基于投资者被认为有能力独立评估投资风险、独立行使投资决策并独立承担相应风险。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则, 在做出投资决策后, 基金运作状况与基金净值变化引致的投资风险, 由投资人自行承担。

本报告所载资料来源均为已公开资料, 东方基金对这些资料的准确性和完整性不做任何保证, 且东方基金不对因使用本报告的内容而引致的损失承担任何责任, 除非法律法规有明确规定。

东方基金可发出其它与本报告所载信息不一致及有不同结论的报告。本报告反映研究人员、基金经理的不同观点、见解及分析方法, 并不代表东方基金或其附属机构的立场。报告所载资料、意见及推测仅反映研究人员、基金经理于发出本报告当日的判断, 可随时更改且不予通告。

本报告版权归东方基金所有, 未经东方基金事先书面许可, 任何机构或个人不得以任何形式翻版、复制、刊发、转载和引用, 否则由此造成的一切不良后果及法律责任由私自翻版、复制、刊登、转载和引用者承担。