

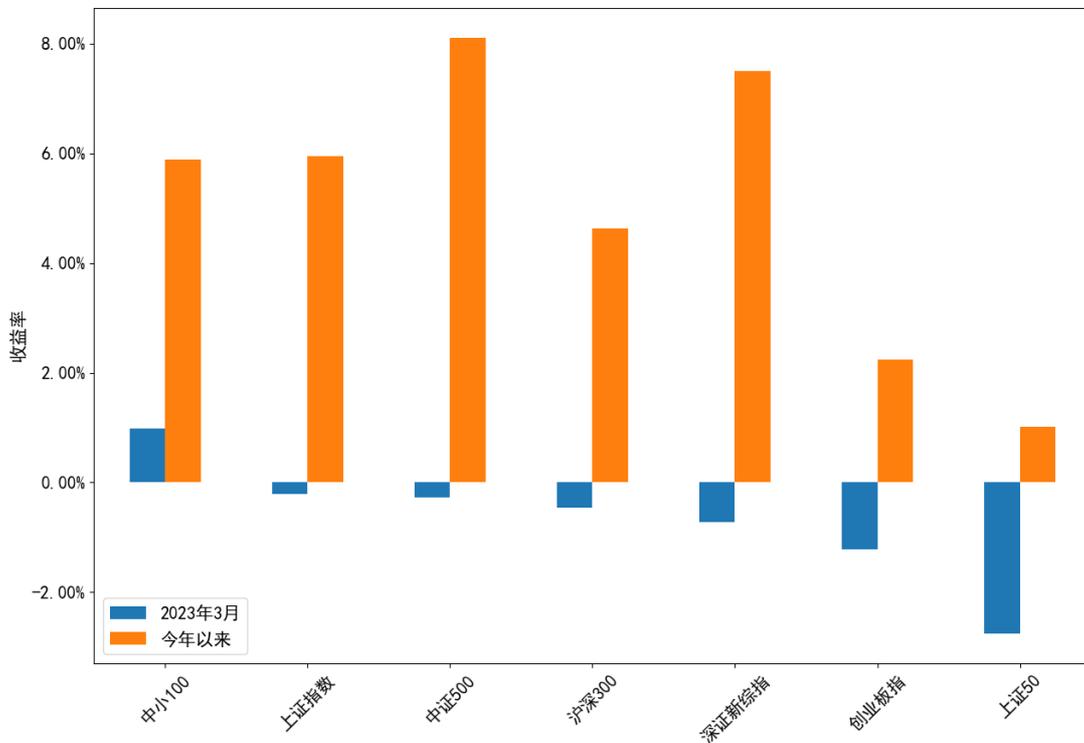
《 东方基金 | 量化观市 2023/3/31 》

2023年3月，市场震荡，主要指数表现继续分化，，中小100录得正收益，上证50回调较多；行业方面，传媒与计算机领涨，钢铁与综合表现相对较差；市场风格方面则是大盘价值风格占优，中盘成长回调较多；从市场情绪来看，市场交易日均成交额继续提升，为9276.38亿，两融余额总体呈现提升的趋势，北向资金月度为净流入状态，其中净流入较大的行业为电子，净流出较大的行业为银行。

市场表现回顾

2023年3月主要市场指数中，中小100表现最好，收益率为0.99%；上证50表现最差，收益率为-2.75%。

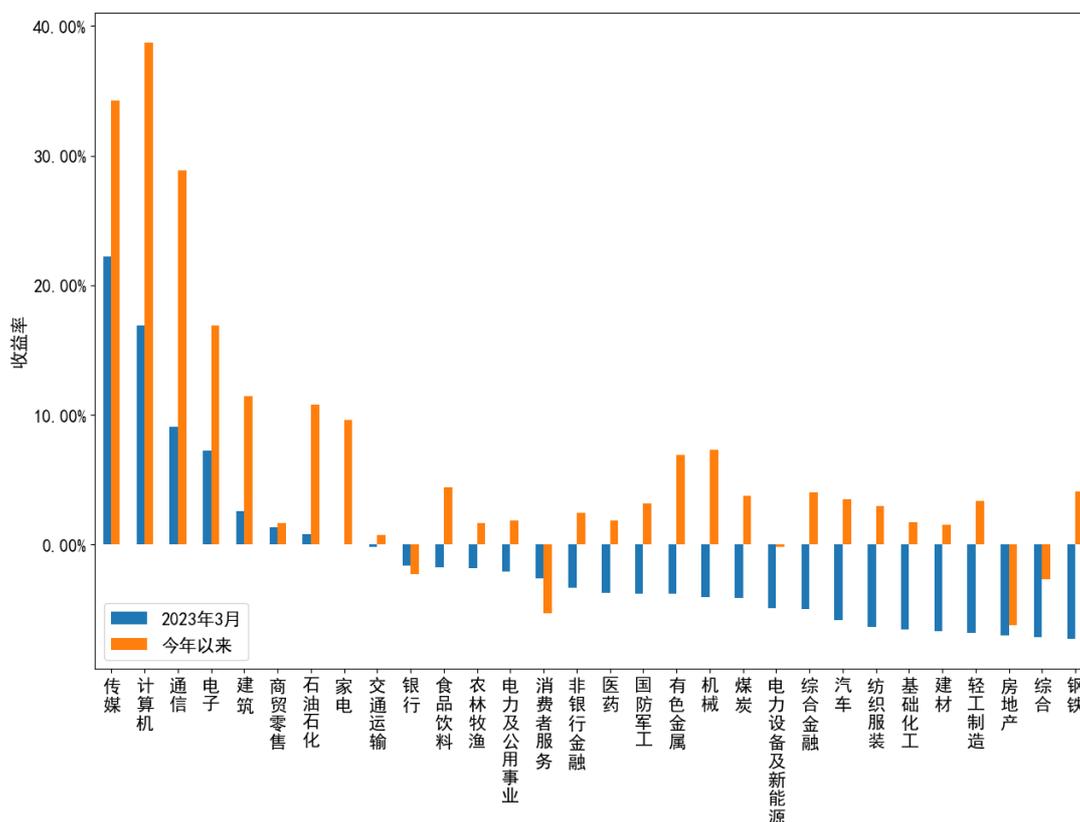
今年以来，中证500表现最好，收益率为8.11%；上证50表现最差，收益率为1.01%。



(数据来源：wind，东方基金量化投资部，月度数据统计区间：20230101-20230331)

2023年3月中信一级行业中，共8个行业上涨，22个行业下跌，其中收益率靠前的5个行业为传媒，计算机，通信，电子，建筑，收益率分别为22.20%，16.88%，9.11%，7.27%，2.61%；收益率靠后的5个行业为钢铁，综合，房地产，轻工制造，建材，收益率分别为-7.26%，-7.13%，-6.99%，-6.82%，-6.65%。

今年以来中信一级行业中，共25个行业上涨，5个行业下跌，其中收益率靠前的5个行业为计算机，传媒，通信，电子，建筑，收益率分别为38.70%，34.23%，28.88%，16.89%，11.46%；收益率靠后的5个行业为房地产，消费者服务，综合，银行，电力设备及新能源，收益率分别为-6.21%，-5.29%，-2.65%，-2.25%，-0.18%。

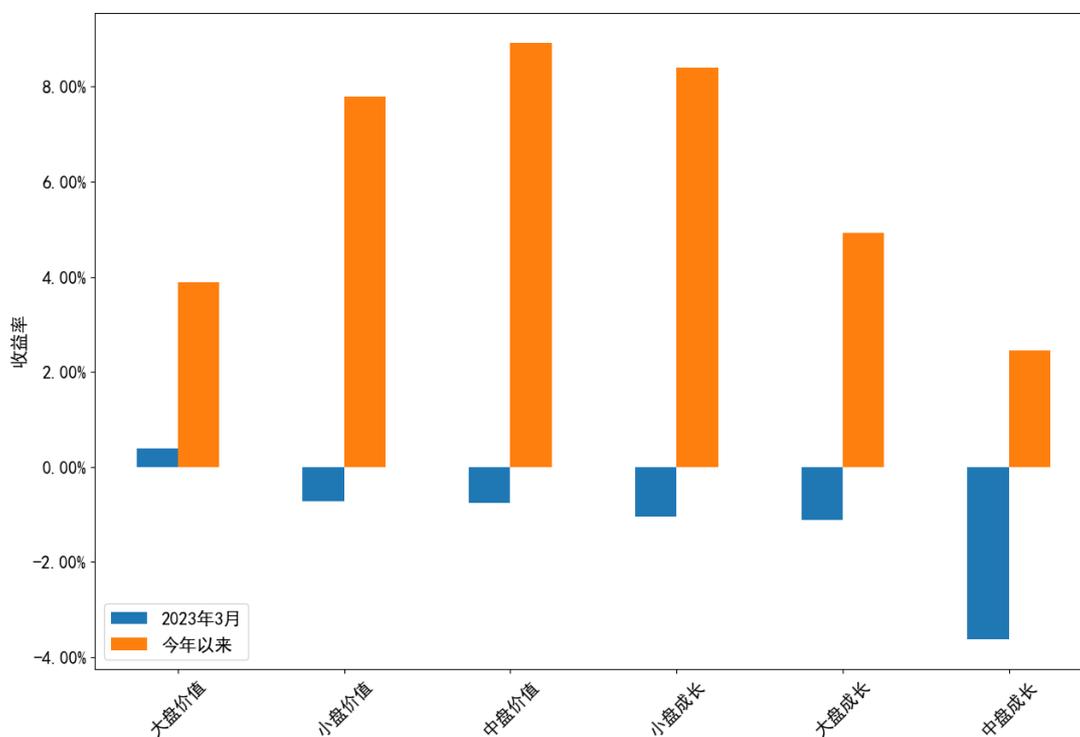


(数据来源：wind，东方基金量化投资部，月度数据统计区间：20230101-20230331)

市场风格回顾

2023年3月巨潮风格指数中，大盘价值表现最好，收益率为0.39%，而中盘成长表现最差，

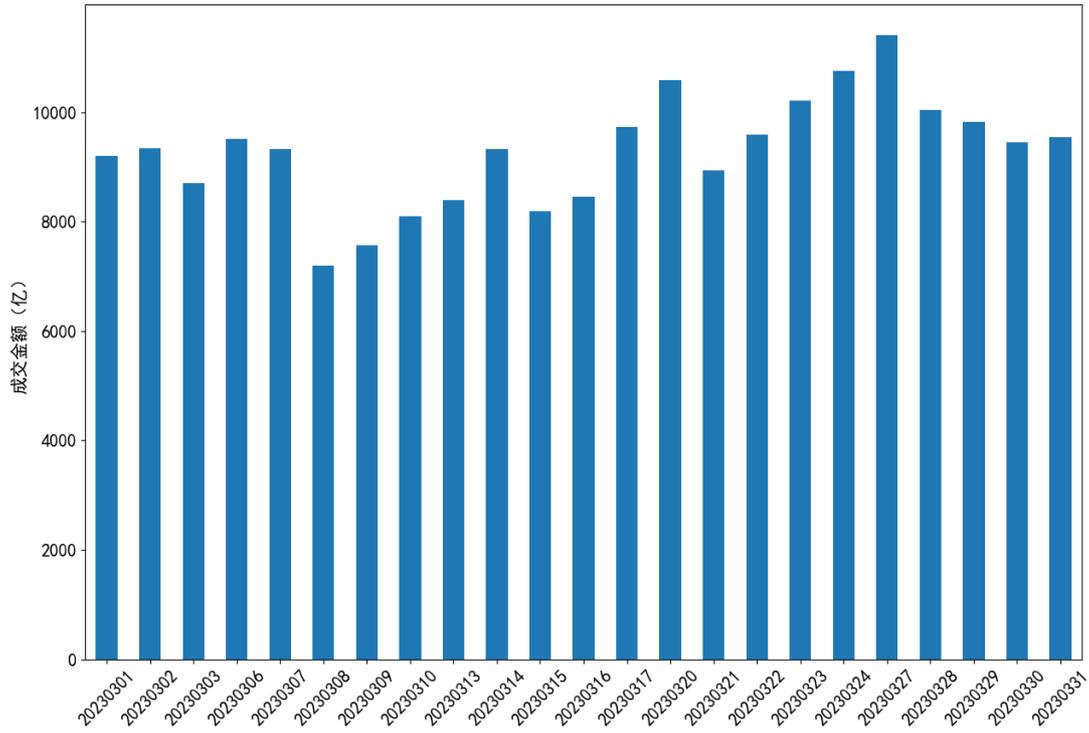
收益率为-3.62%；今年以来，中盘价值表现最好，收益率为 8.93%，中盘成长表现最差，收益率为 2.44%。



(数据来源：wind，东方基金量化投资部，月度数据统计区间：20230101-20230331)

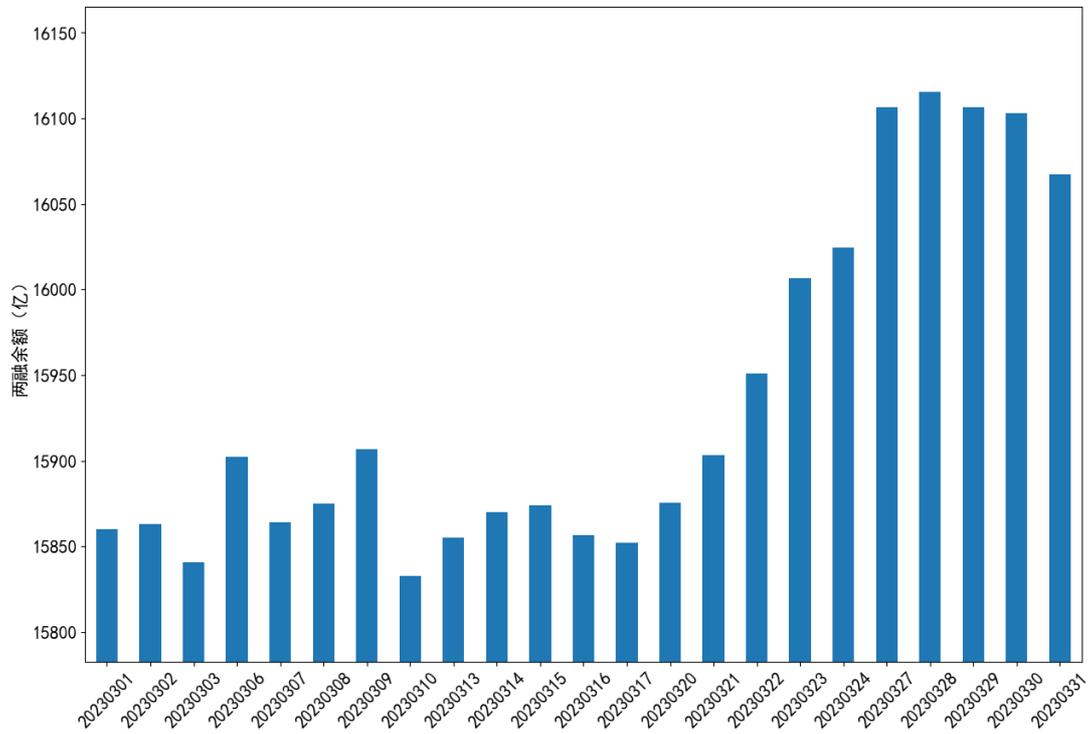
市场情绪回顾

2023年3月23个交易日中，日均成交额为9276.38亿。其中单日最大成交额为3月27日的11406.49亿，单日最小成交额为3月8日的7188.34亿。



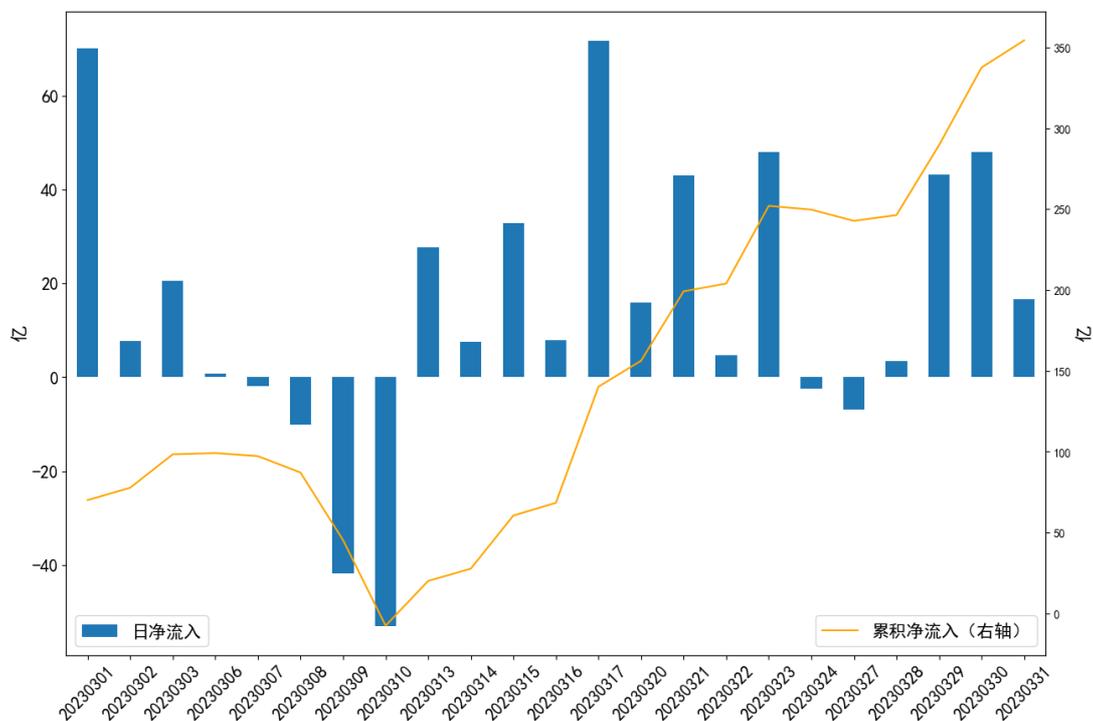
(数据来源：wind，东方基金量化投资部，数据统计区间：20230101-20230331)

2023年3月两融余额总体呈现上升趋势，月末相比月初增加了206.85亿。



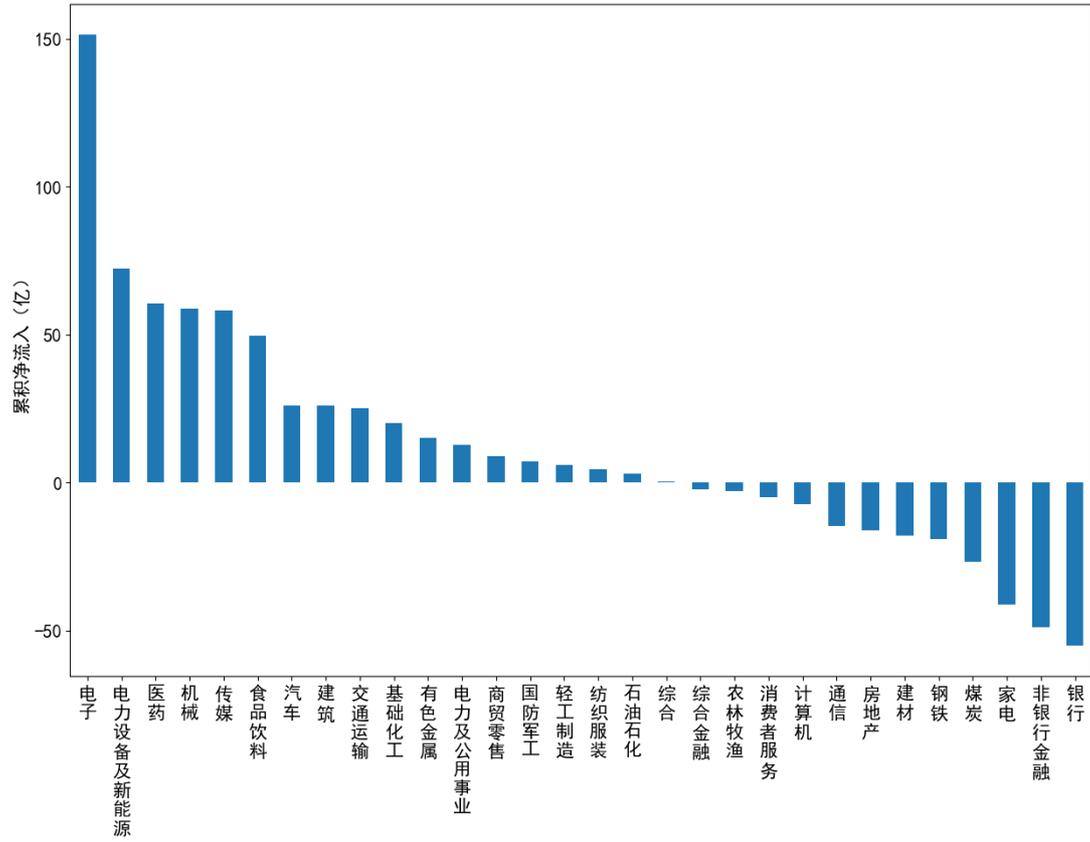
(数据来源：wind，东方基金量化投资部，数据统计区间：20230101-20230331)

2023年3月23个交易日中，北向资金共17天为净流入，6天为净流出。其中单日最大净流入为3月17日的71.83亿，单日最大净流出为3月10日的52.96亿。



(数据来源：wind，东方基金量化投资部，数据统计区间：20230101-20230331)

分行业来看，30个中信一级行业中，上月共18个行业净流入，12个行业净流出。其中电子净流入最多，净流入151.34亿；银行净流出最多，净流出55.09亿。



(数据来源：wind，东方基金量化投资部，数据统计区间：20230101-20230331)

市场有风险 基金投资需谨慎