

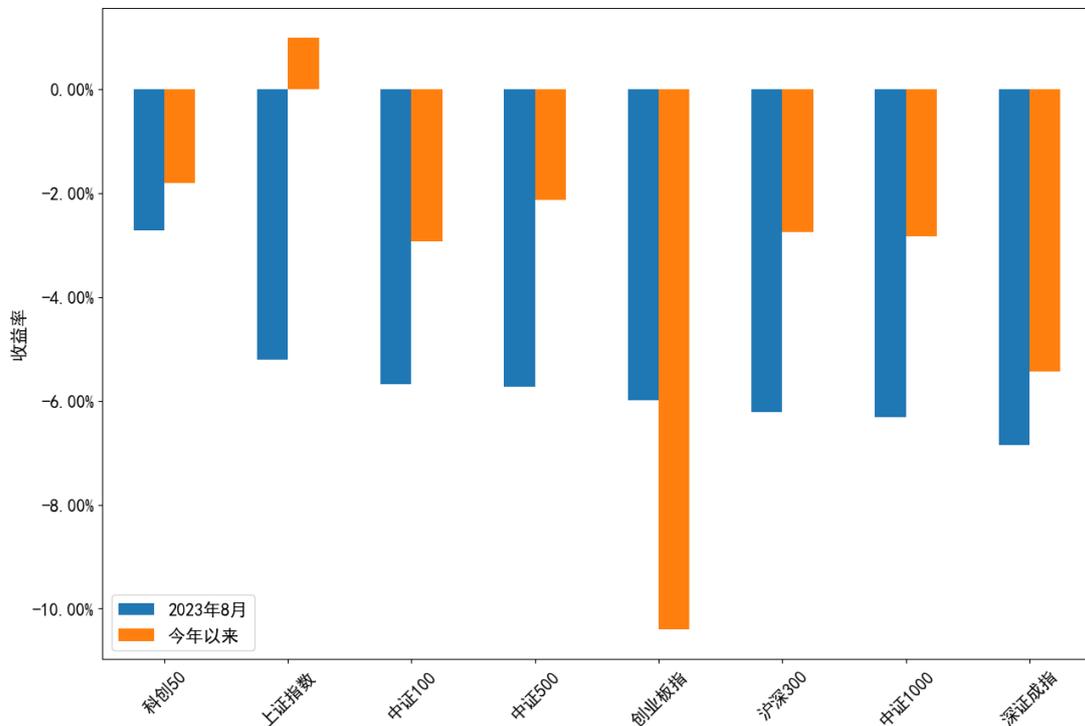
## 《东方基金 | 量化观市 2023-8》

2023年8月，市场出现回调，主要指数均录得负收益，科创50表现相对较好，深证成指表现最差；行业方面，传媒相对跌幅较小，消费者服务表现疲软；市场风格方面价值延续强势，中盘价值继续占优，中盘成长回调；从市场情绪来看，市场交易日成交额有所减少，为8237.73亿，两融余额继续呈现下降的趋势，北向资金月度为净流出状态，其中净流入较大的行业为计算机，净流出较大的行业为食品饮料。

### 市场表现回顾

2023年8月主要市场指数中，科创50表现最好，收益率为-2.72%；深证成指表现最差，收益率为-6.85%。

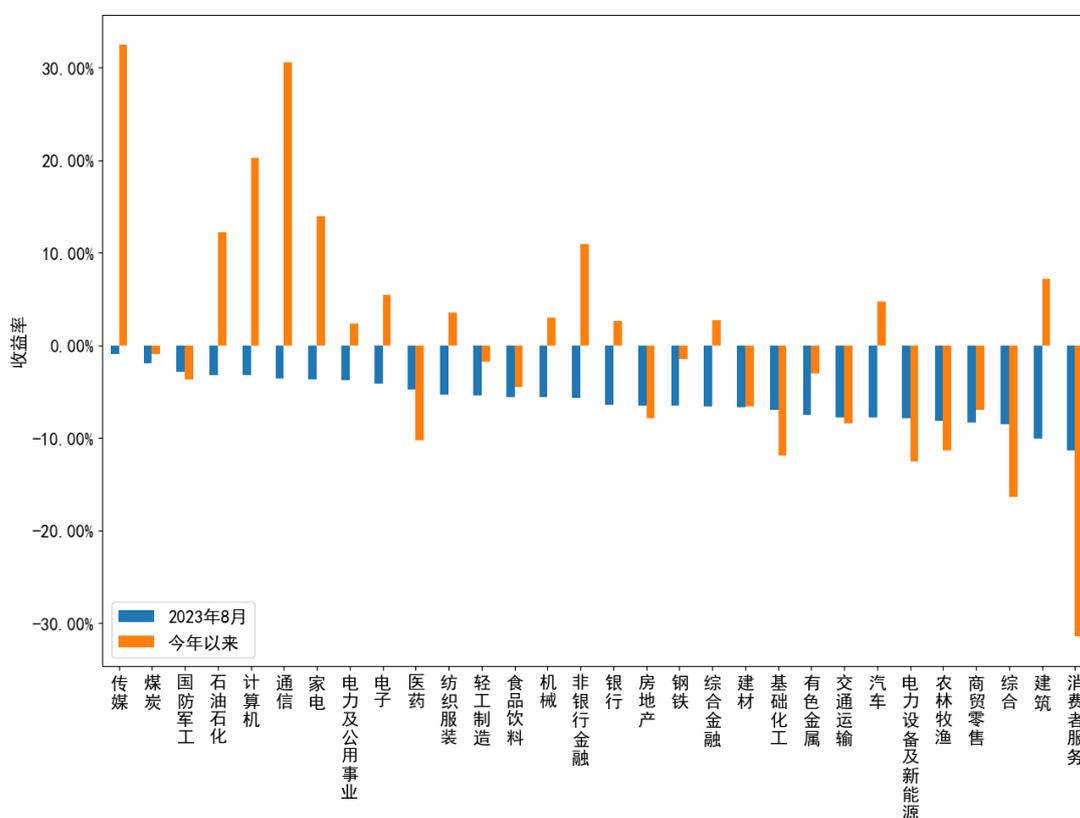
今年以来，上证指数表现最好，收益率为0.99%；创业板指表现最差，收益率为-10.41%。



(数据来源：wind，东方基金量化投资部，月度数据统计区间：20230101-20230831)

2023年8月中信一级行业中,收益率靠前的5个行业为传媒,煤炭,国防军工,石油石化,计算机,收益率分别为-0.96%, -1.93%, -2.81%, -3.17%, -3.21%;收益率靠后的5个行业为消费者服务,建筑,综合,商贸零售,农林牧渔。

今年以来中信一级行业中,共14个行业上涨,16个行业下跌,其中收益率靠前的5个行业为传媒,通信,计算机,家电,石油石化,收益率分别为32.49%, 30.57%, 20.26%, 13.99%, 12.27%;收益率靠后的5个行业为消费者服务,综合,电力设备及新能源,基础化工,农林牧渔。

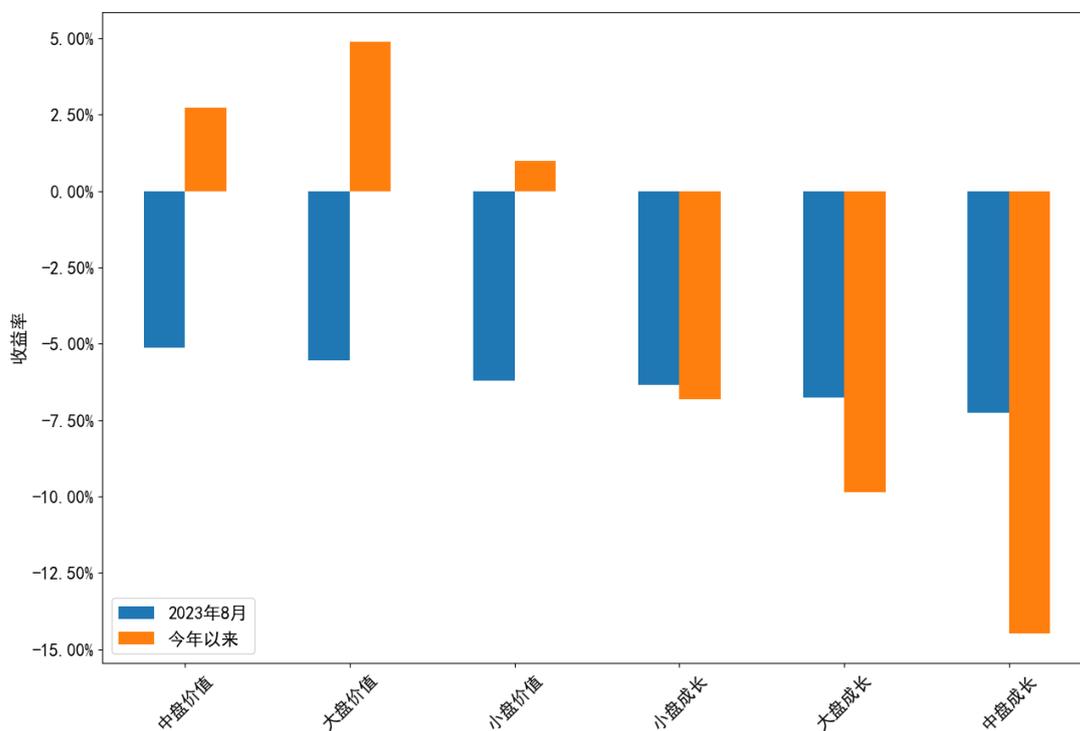


(数据来源: wind, 东方基金量化投资部, 月度数据统计区间: 20230101-20230831)

### 市场风格回顾

2023年8月巨潮风格指数中,中盘价值表现最好,收益率为-5.14%,而中盘成长表现最差,收益率为-7.26%;今年以来,大盘价值表现最好,收益率为4.90%,中盘成长表现最差,

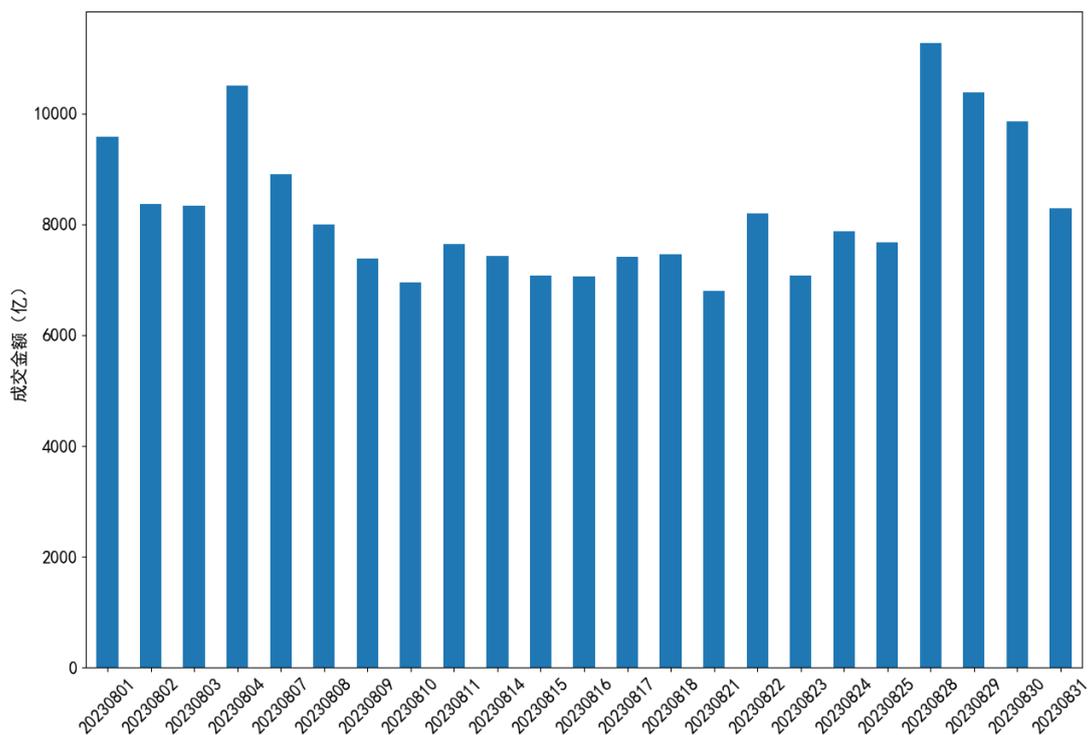
收益率为-14.48%。



(数据来源: wind, 东方基金量化投资部, 月度数据统计区间: 20230101-20230831)

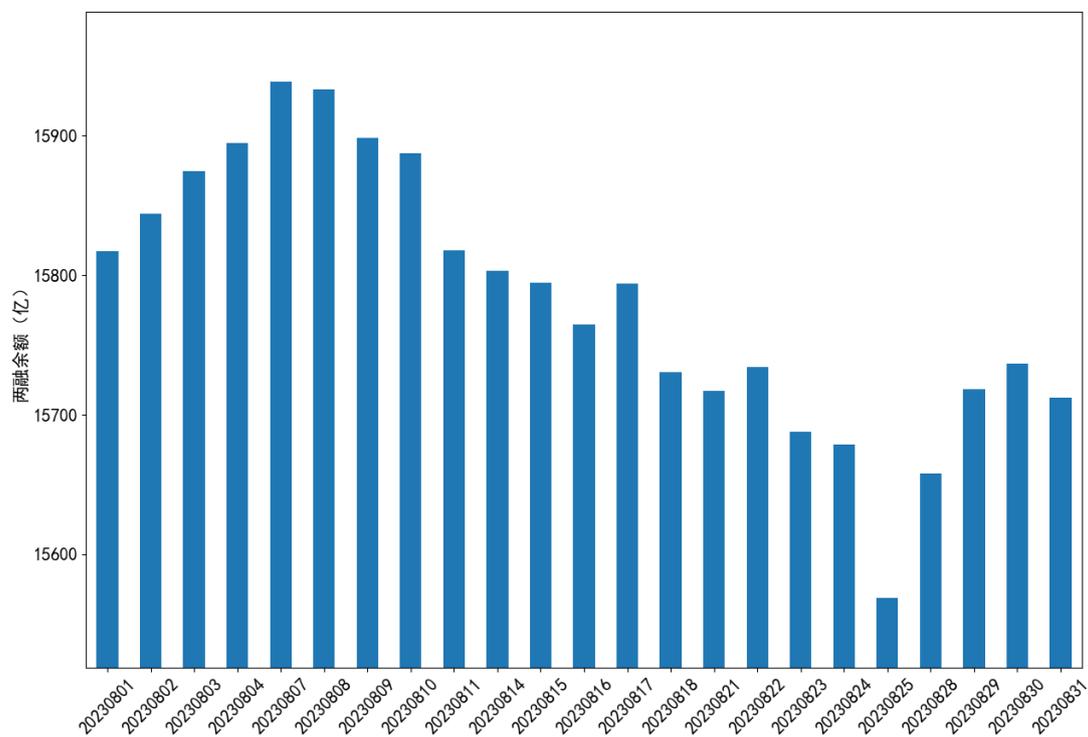
### 市场情绪回顾

2023年8月23个交易日中, 日均成交额为8237.73亿。其中单日最大成交额为8月28日的11278.24亿, 单日最小成交额为8月21日的6789.45亿。



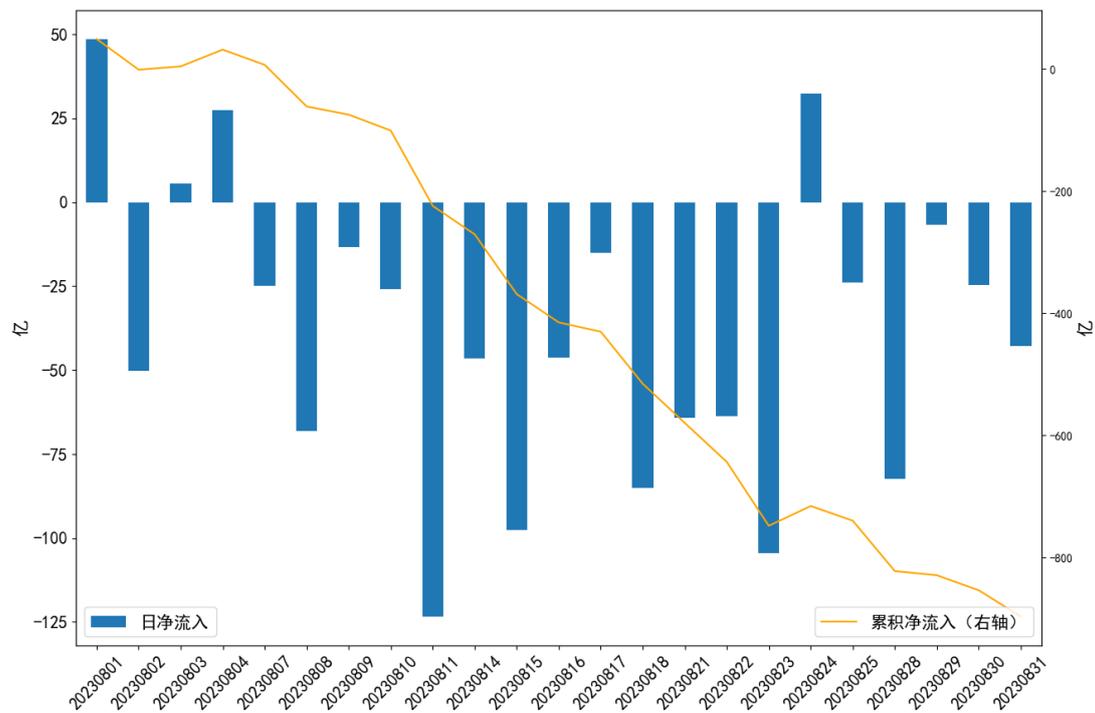
(数据来源: wind, 东方基金量化投资部, 数据统计区间: 20230801-20230831)

2023年8月两融余额总体呈现下降趋势, 月末相比月初减少了104.97亿。



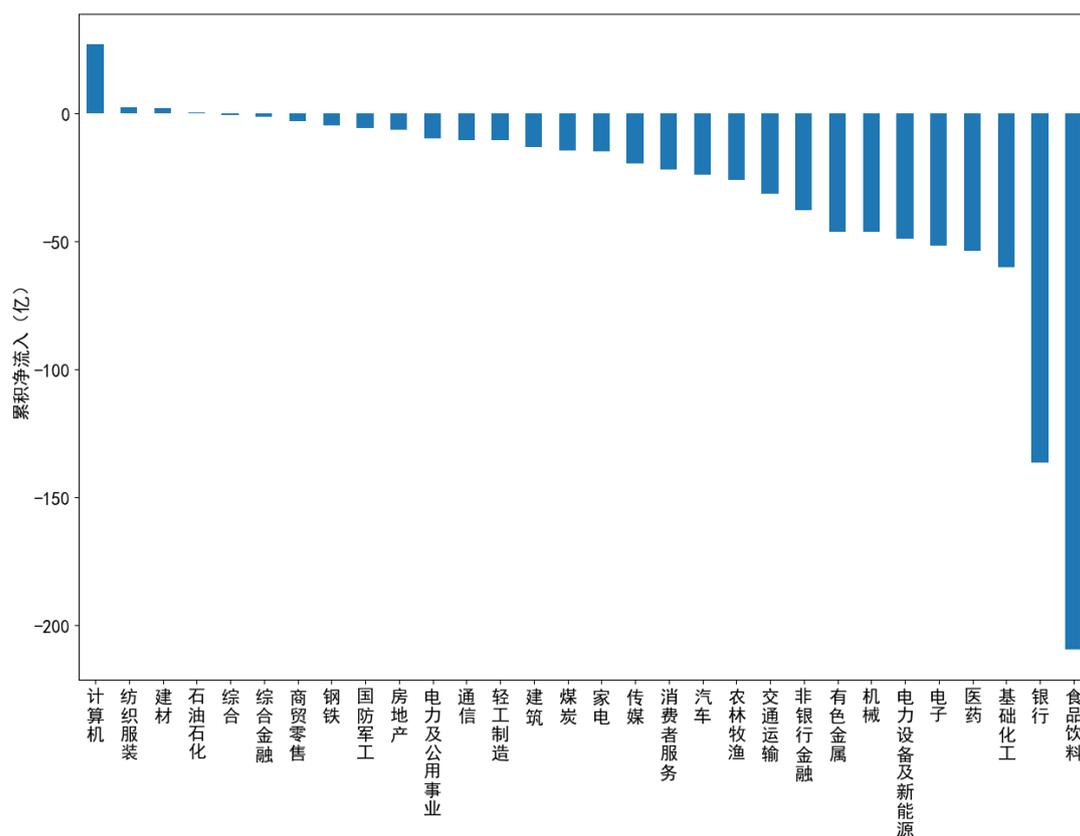
(数据来源: wind, 东方基金量化投资部, 数据统计区间: 20230801-20230831)

2023年8月23个交易日中，北向资金共4天为净流入，19天为净流出。其中单日最大净流入为8月1日的48.54亿，单日最大净流出为8月11日的123.38亿。



(数据来源: wind, 东方基金量化投资部, 数据统计区间: 20230801-20230831)

分行业来看, 30个中信一级行业中, 上月共4个行业净流入, 26个行业净流出。其中计算机净流入最多, 净流入27.13亿; 食品饮料净流出最多, 净流出209.49亿。



(数据来源: wind, 东方基金量化投资部, 数据统计区间: 20230801-20230831)

### 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。