

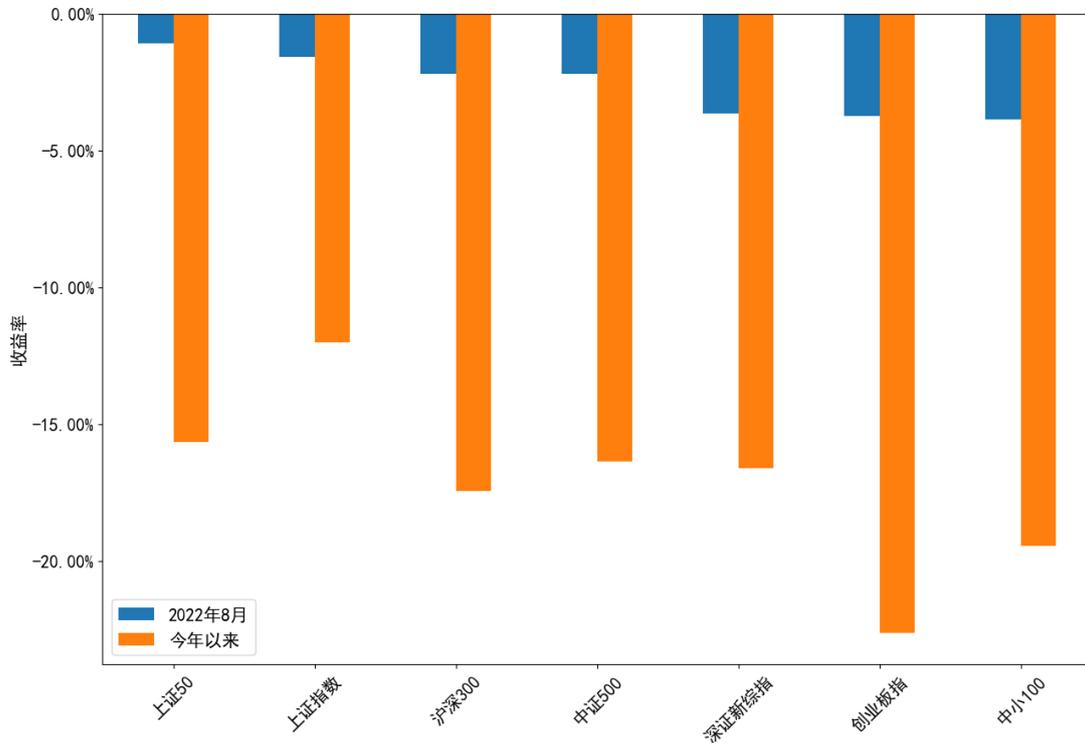
《 东方基金 | 量化观市 2022/8 》

2022年8月，市场继续震荡回调，主要宽基指数均录得负收益；行业方面，煤炭与石油石化表现相对最好；市场风格方面亦有所切换，中盘价值风格占优；从市场情绪来看，市场交易日成交额变化不大，为10056.38亿，两融余额呈先上升后下降的趋势，北向资金日净流入有所波动，月度总体为净流入状态，其中净流入较大的行业为电力设备及新能源，净流出较大的行业为家电。

市场表现回顾

2022年8月主要市场指数中，上证50表现最好，收益率为-1.09%；中小100表现最差，收益率为-3.86%。

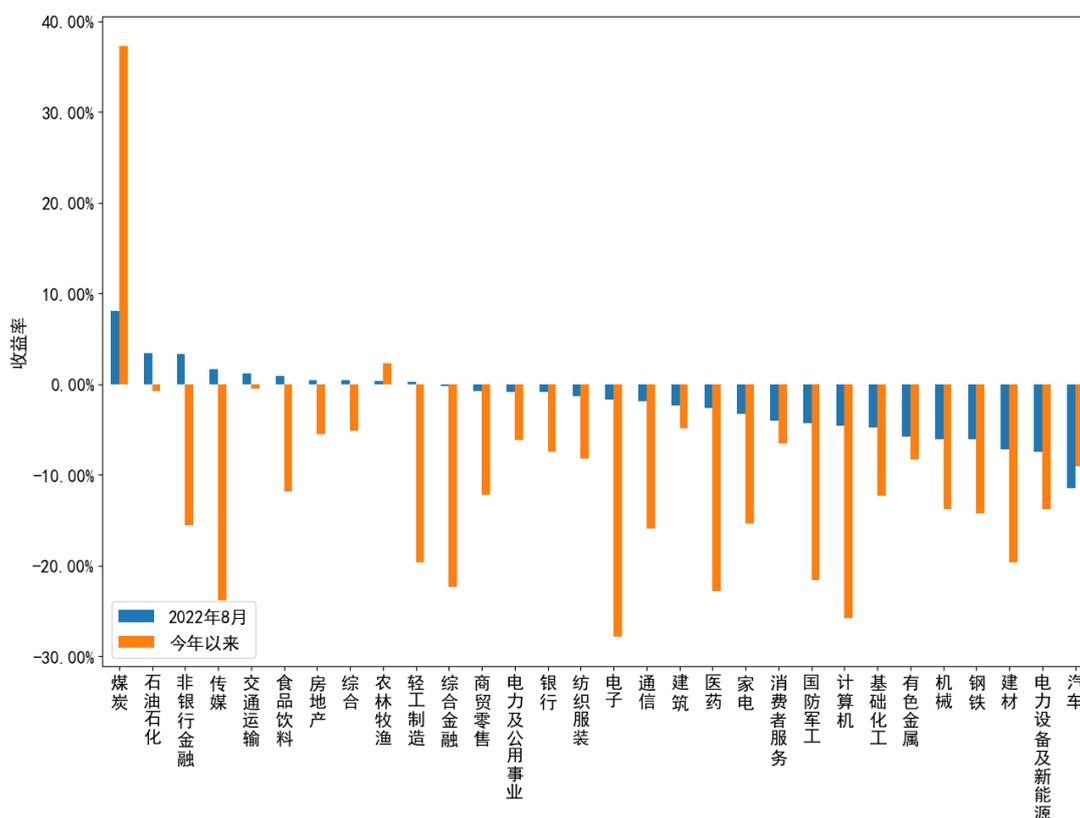
今年以来，上证指数表现最好，收益率为-12.02%；创业板指表现最差，收益率为-22.64%。



(数据来源: wind, 东方基金量化投资部, 年度数据统计区间: 20220101-20220831, 月度数据统计区间: 20220801-20220831)

2022年8月中信一级行业中，共10个行业上涨，20个行业下跌，其中收益率靠前的5个行业为煤炭，石油石化，非银行金融，传媒，交通运输，收益率分别为8.04%，3.41%，3.34%，1.62%，1.20%；收益率靠后的5个行业为汽车，电力设备及新能源，建材，钢铁，机械，收益率分别为-11.51%，-7.45%，-7.18%，-6.09%，-6.06%。

今年以来中信一级行业中，共2个行业上涨，28个行业下跌，其中收益率靠前的5个行业为煤炭，农林牧渔，交通运输，石油石化，建筑，收益率分别为37.26%，2.25%，-0.48%，-0.76%，-4.89%；收益率靠后的5个行业为电子，计算机，传媒，医药，综合金融，收益率分别为-27.86%，-25.83%，-23.86%，-22.85%，-22.38%。

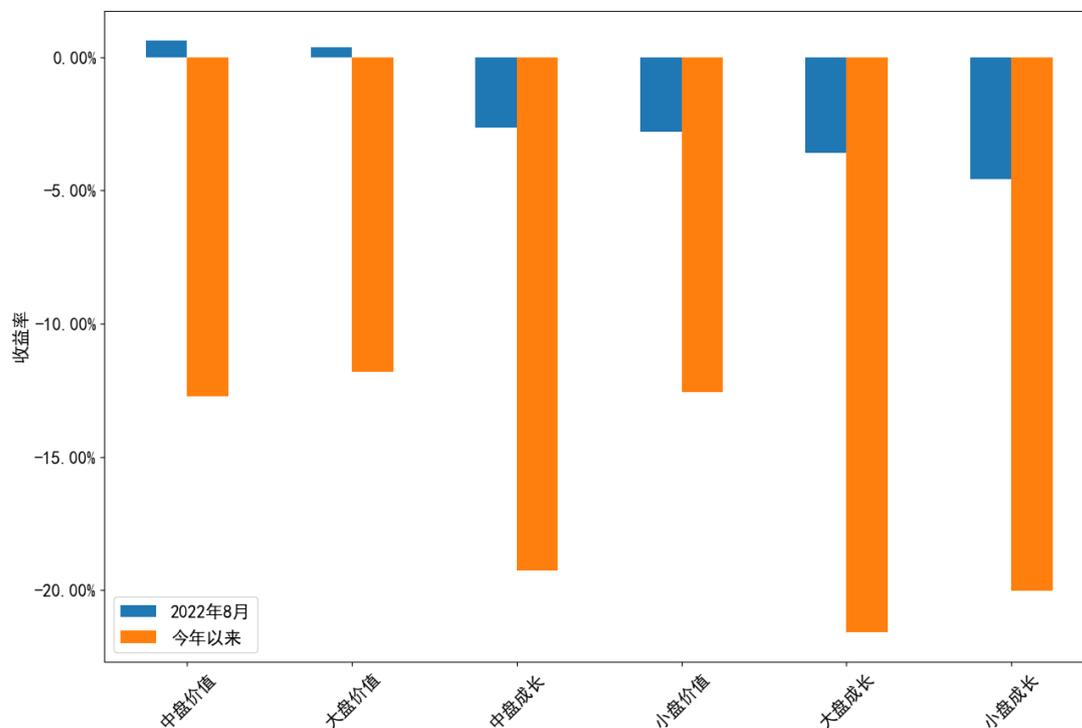


(数据来源: wind, 东方基金量化投资部, 年度数据统计区间: 20220101-20220831, 月度数据统计区间: 20220801-20220831)

市场风格回顾

2022年8月巨潮风格指数中,中盘价值表现最好,收益率为0.64%,而小盘成长表现最差,

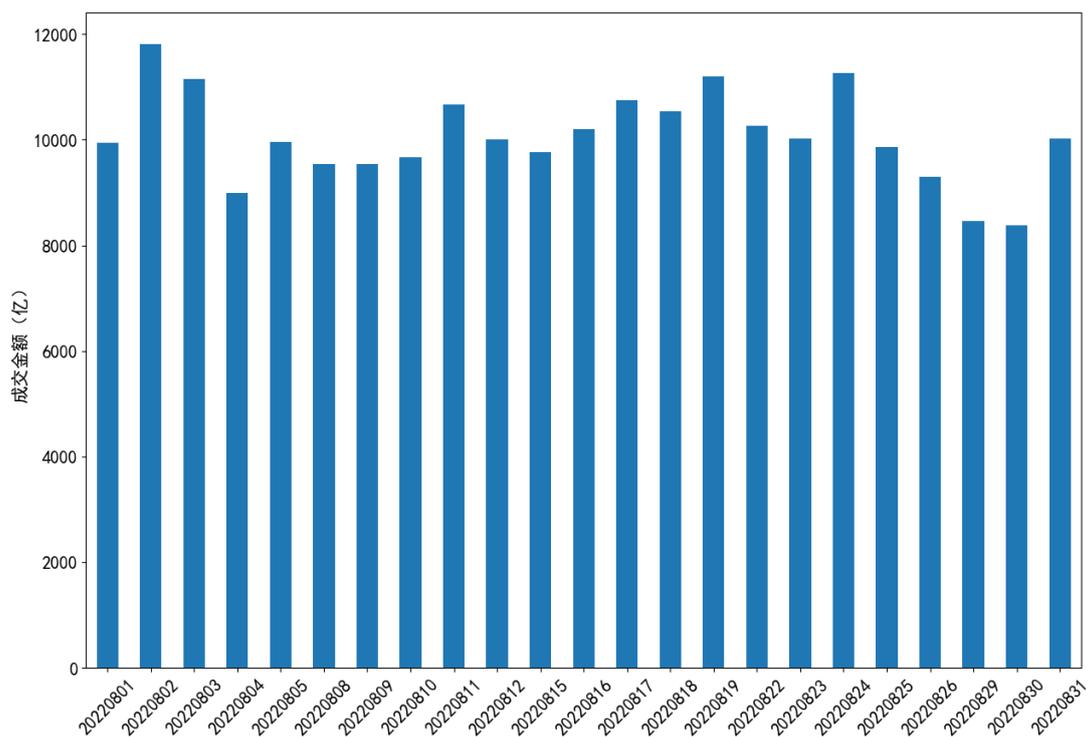
收益率为-4.57%；今年以来，大盘价值表现最好，收益率为-11.82%，大盘成长表现最差，收益率为-21.56%。



(数据来源: wind, 东方基金量化投资部, 年度数据统计区间: 20220101-20220831, 月度数据统计区间: 20220801-20220831)

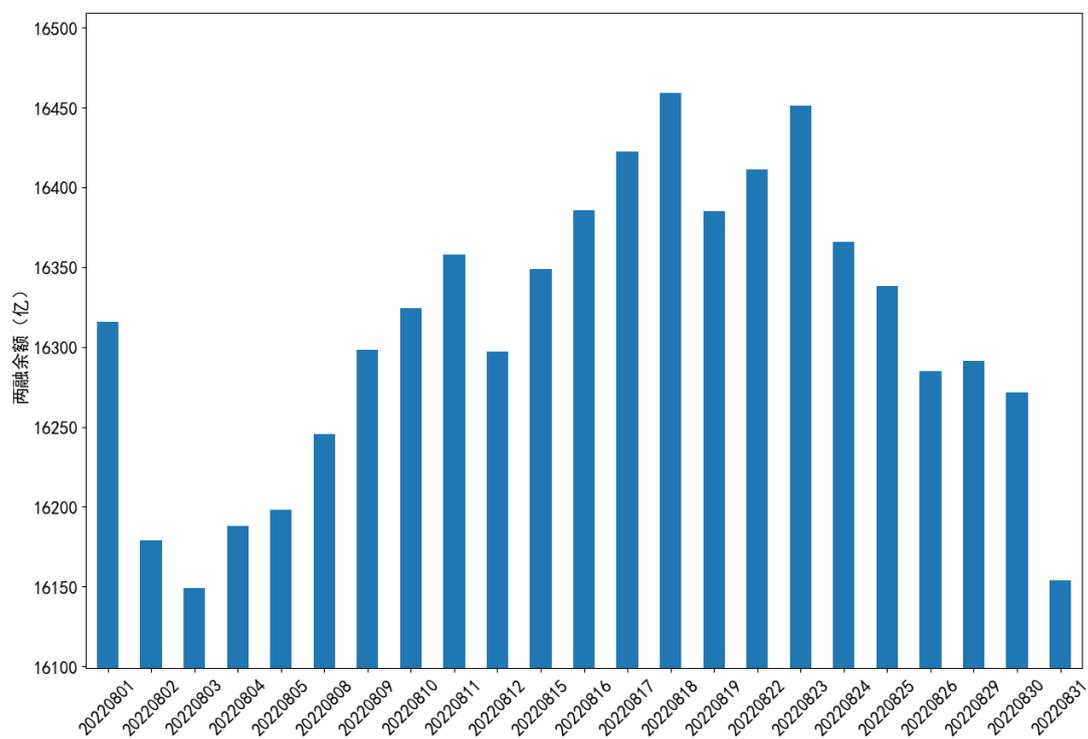
市场情绪回顾

2022年8月23个交易日中，日均成交额为10056.38亿。其中单日最大成交额为8月2日的11811.34亿，单日最小成交额为8月30日的8385.59亿。



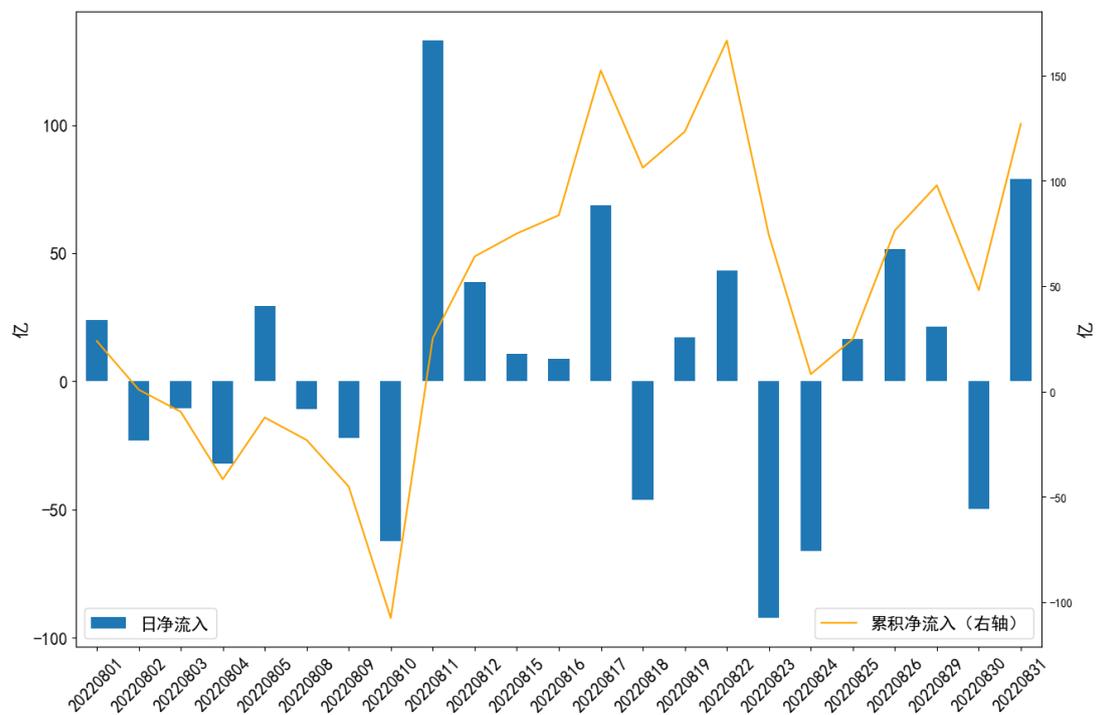
(数据来源: wind, 东方基金量化投资部, 数据统计区间: 20220801-20220831)

2022年8月两融余额总体呈现先上升后下降趋势, 月末相比月初减少了161.96亿。



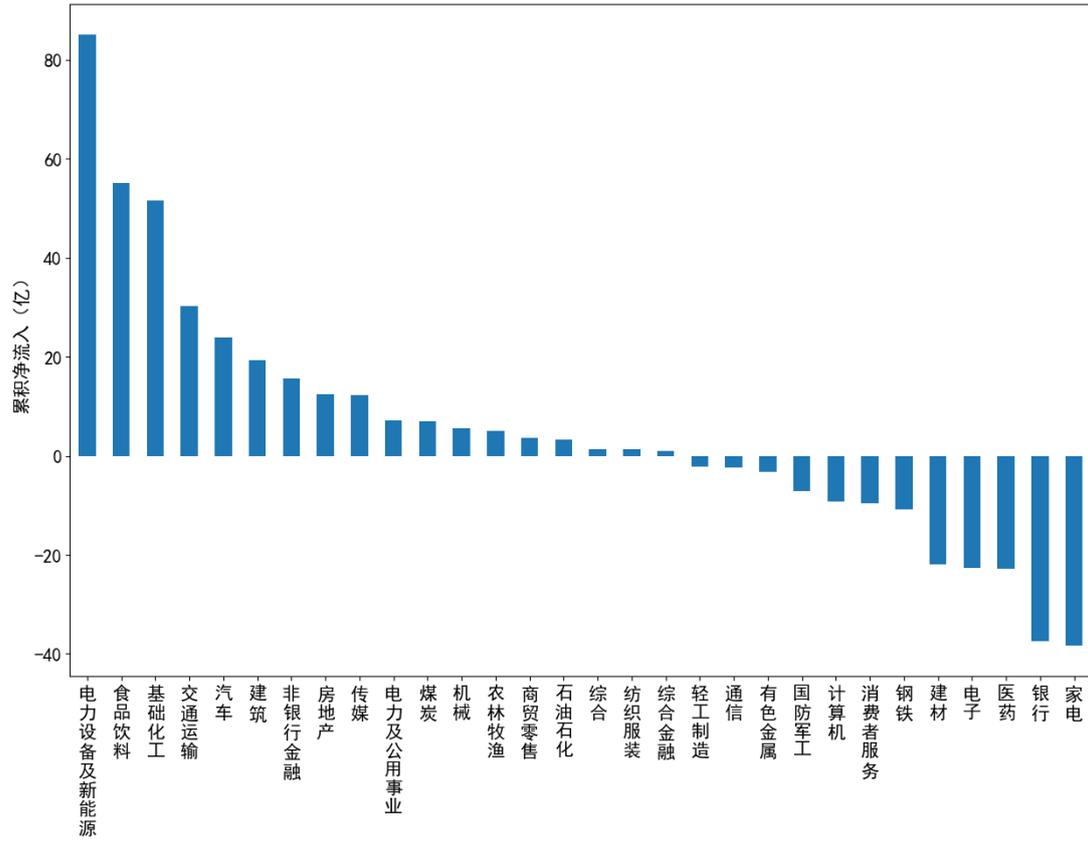
(数据来源: wind, 东方基金量化投资部, 数据统计区间: 20220801-20220831)

2022年8月23个交易日中，北向资金共13天为净流入，10天为净流出。其中单日最大净流入为8月11日的132.95亿，单日最大净流出为8月23日的92.28亿。



(数据来源: wind, 东方基金量化投资部, 数据统计区间: 20220801-20220831)

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。其中电力设备及新能源净流入最多，净流入85.09亿；家电净流出最多，净流出38.35亿。



(数据来源: wind, 东方基金量化投资部, 数据统计区间: 20220801-20220831)

市场有风险基金投资需谨慎