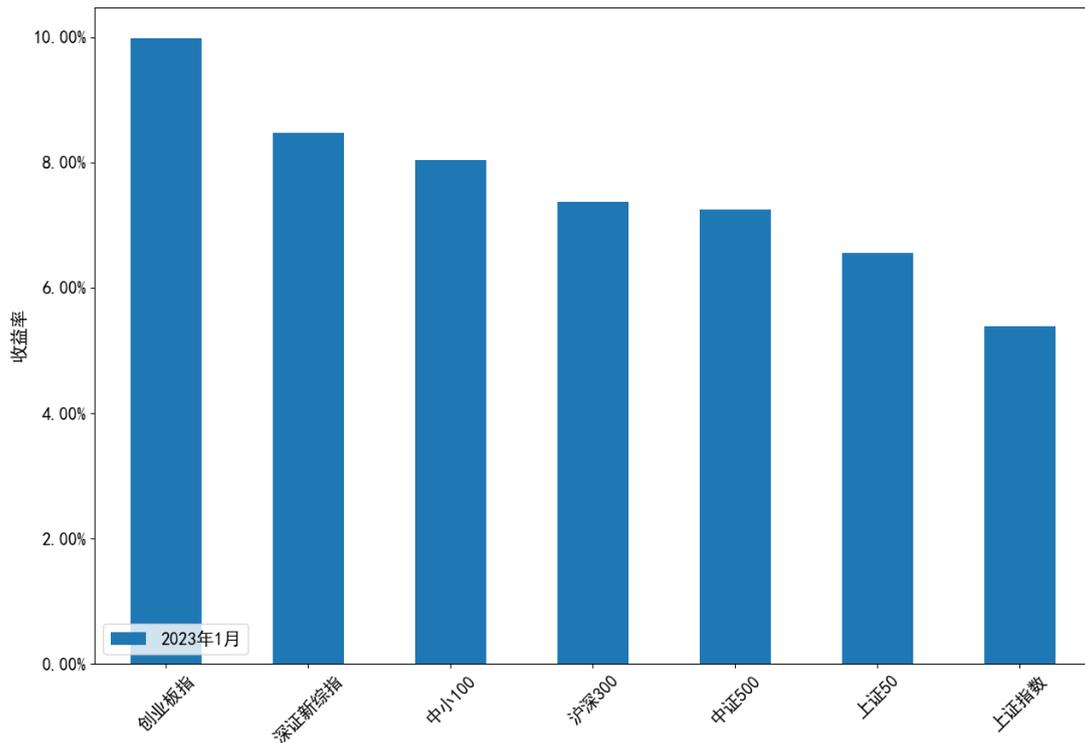


《 东方基金 | 量化观市 2023/1 》

2023年1月，市场上行，主要指数均录得正收益；行业方面，有色金属与计算机领涨，消费者服务回调；市场风格方面则是大盘成长风格继续占优；从市场情绪来看，市场交易日均成交额变化不大，为7872.76亿，两融余额总体呈现小幅下降的趋势，北向资金月度为大幅净流入状态，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交通运输。

市场表现回顾

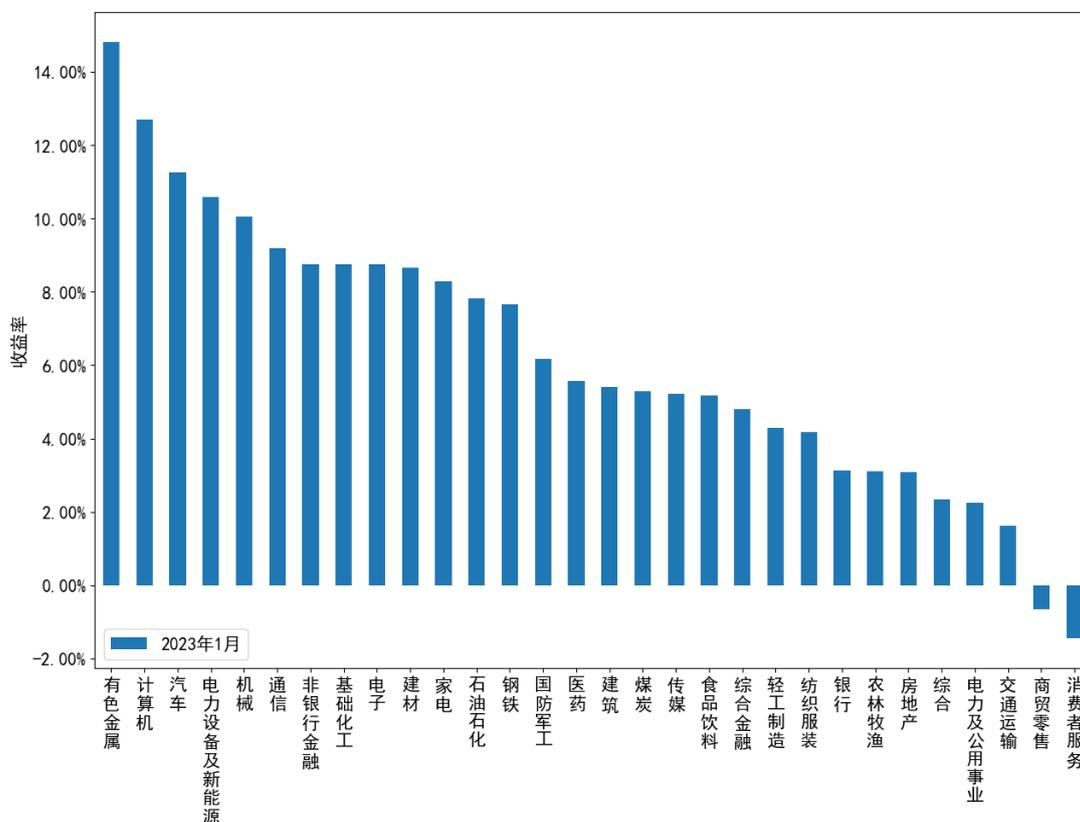
2023年1月主要市场指数中，创业板指表现最好，收益率为9.97%；上证指数表现最差，收益率为5.39%。



(数据来源: wind, 东方基金量化投资部, 月度数据统计区间: 20230101-20230131)

2023年1月中信一级行业中，共28个行业上涨，2个行业下跌，其中收益率靠前的5个行业为有色金属，计算机，汽车，电力设备及新能源，机械，收益率分别为14.81%，12.70%，

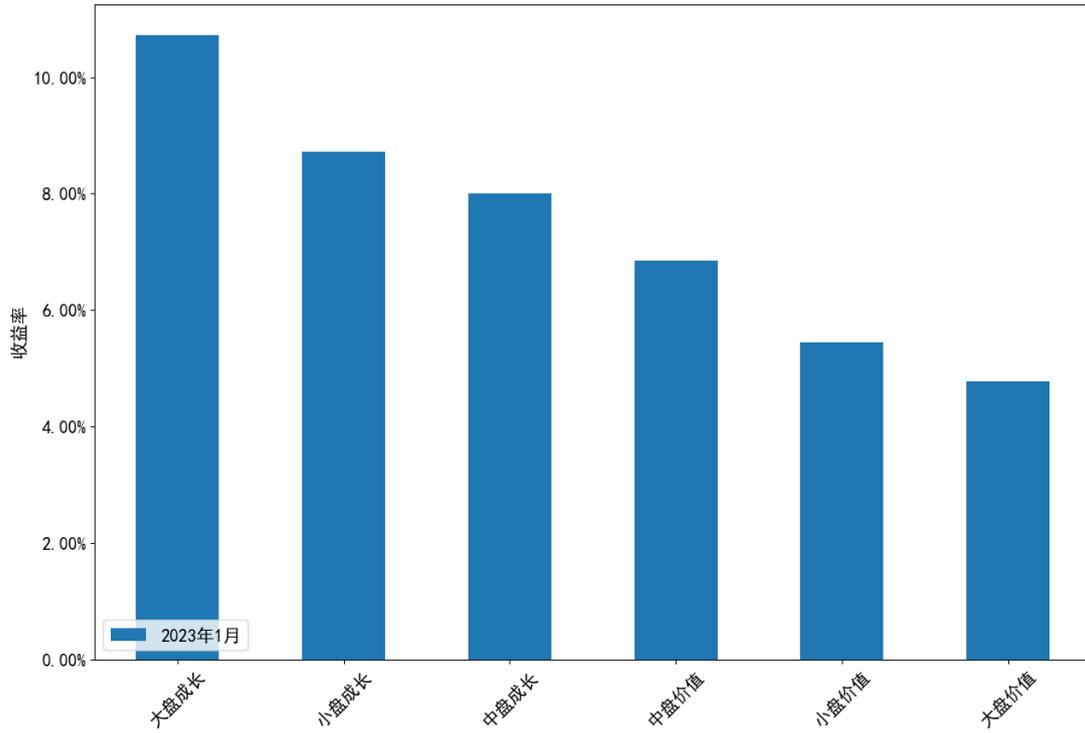
11.27%, 10.58%, 10.05%; 收益率靠后的 5 个行业为消费者服务, 商贸零售, 交通运输, 电力及公用事业, 综合, 收益率分别为-1.45%, -0.66%, 1.62%, 2.24%, 2.34%。



(数据来源: wind, 东方基金量化投资部, 月度数据统计区间: 20230101-20230131)

市场风格回顾

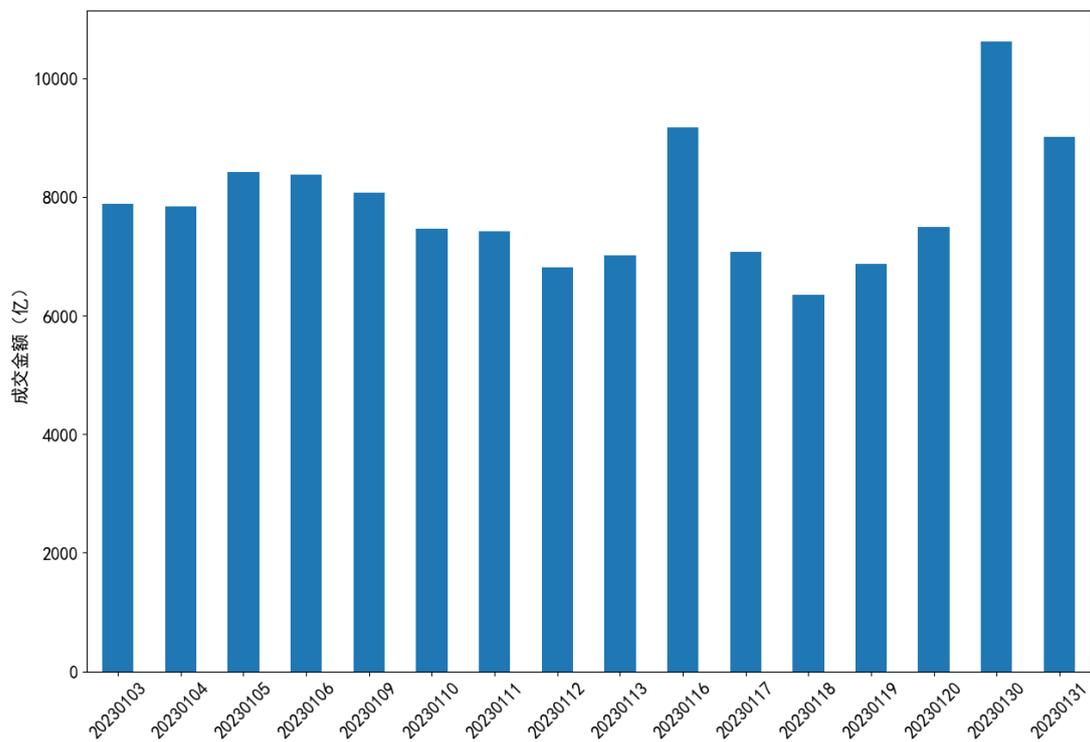
2023 年 1 月巨潮风格指数中, 大盘成长表现最好, 收益率为 10.72%, 而大盘价值表现最差, 收益率为 4.78%。



(数据来源: wind, 东方基金量化投资部, 月度数据统计区间: 20230101-20230131)

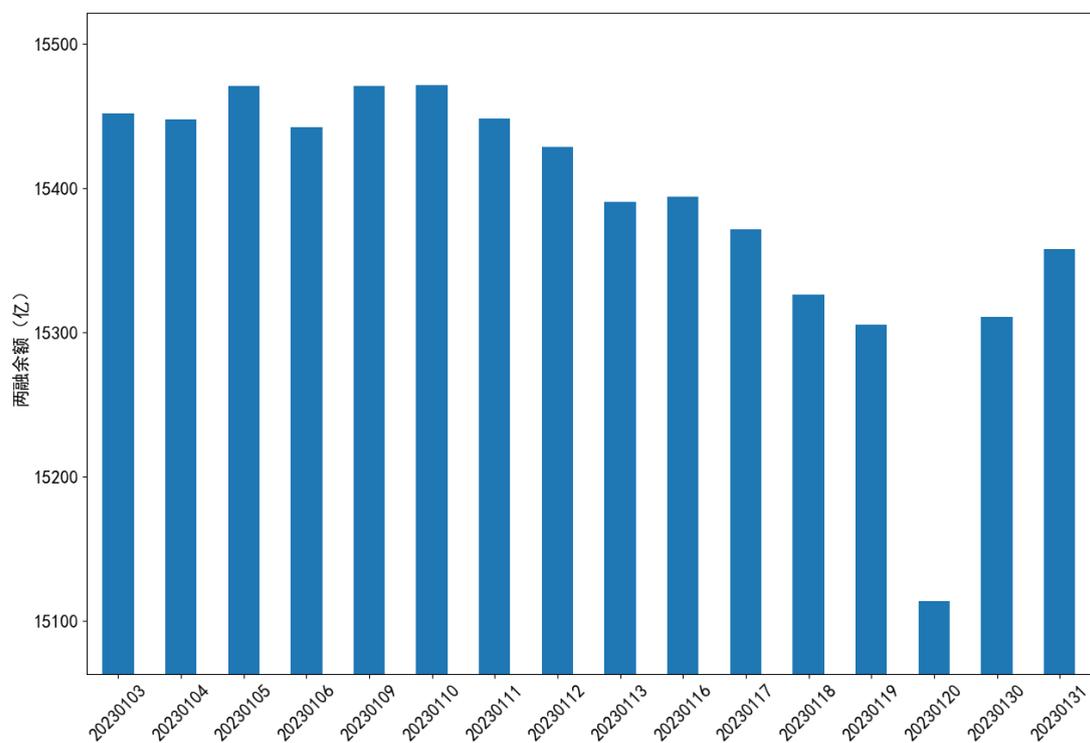
市场情绪回顾

2023年1月16个交易日中, 日均成交额为7872.76亿。其中单日最大成交额为1月30日的10625.44亿, 单日最小成交额为1月18日的6360.81亿。



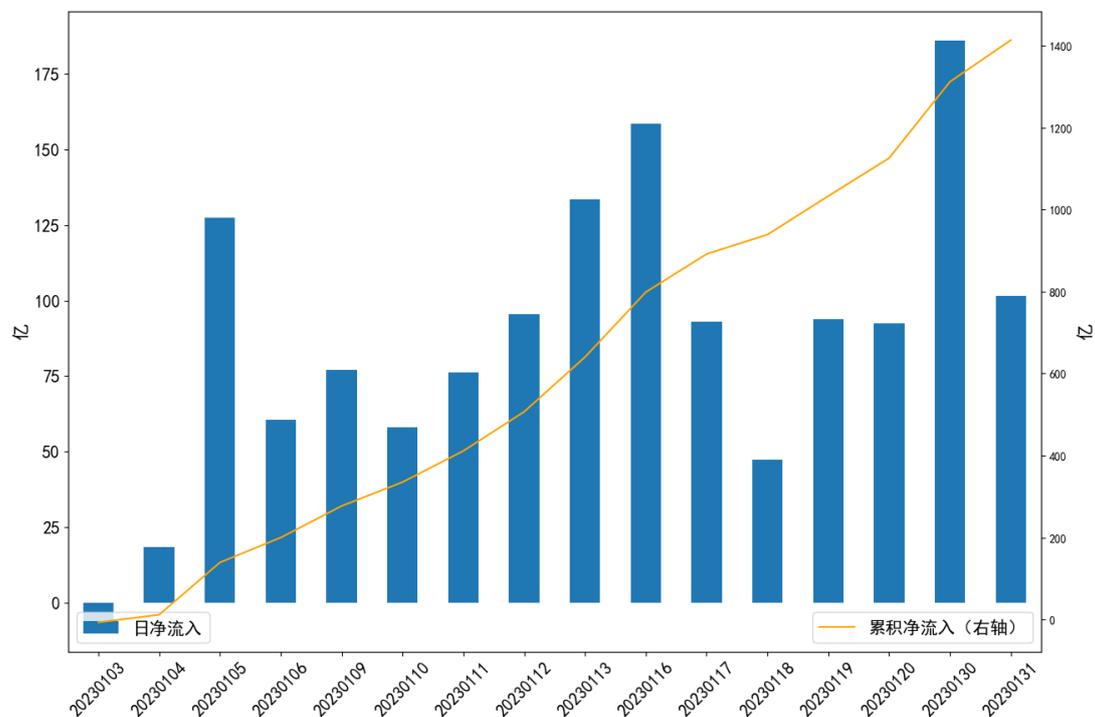
(数据来源: wind, 东方基金量化投资部, 数据统计区间: 20230101-20230131)

2023年1月两融余额总体呈现小幅下降趋势, 月末相比月初减少了93.84亿。



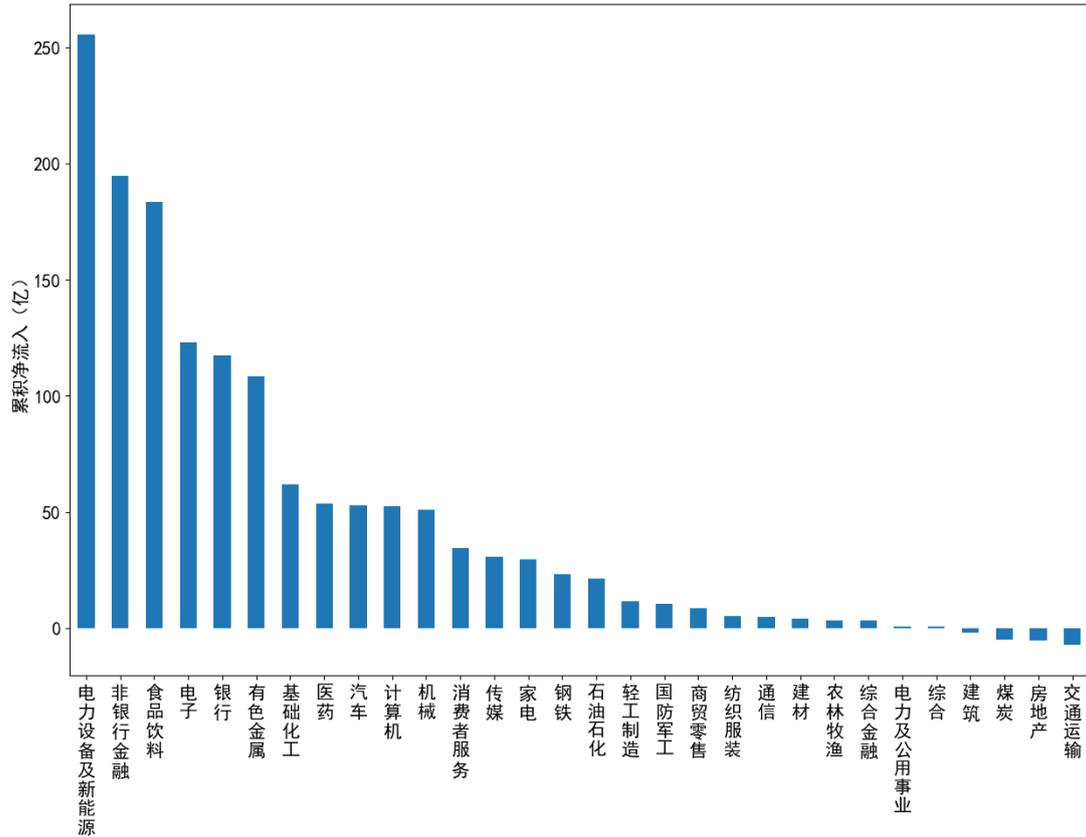
(数据来源: wind, 东方基金量化投资部, 数据统计区间: 20230101-20230131)

2023年1月16个交易日中，北向资金共15天为净流入，1天为净流出。其中单日最大净流入为1月30日的186.14亿，单日最大净流出为1月3日的6.45亿。



(数据来源: wind, 东方基金量化投资部, 数据统计区间: 20230101-20230131)

分行业来看，30个中信一级行业中，上月共26个行业净流入，4个行业净流出。其中电力设备及新能源净流入最多，净流入255.50亿；交通运输净流出最多，净流出7.27亿。



(数据来源: wind, 东方基金量化投资部, 数据统计区间: 20230101-20230131)

市场有风险基金投资需谨慎

东方基金管理股份有限公司(下称“东方基金”)是经中国证券监督管理委员会批准依法设立的公募基金管理人,具备公募基金管理人资格。

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。