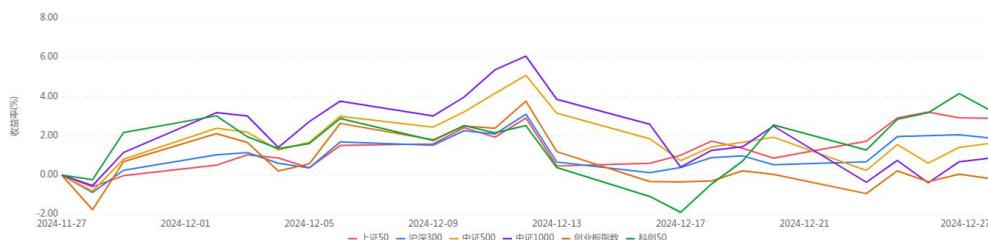


# 融智 FOF 市场周报 2024-12-27

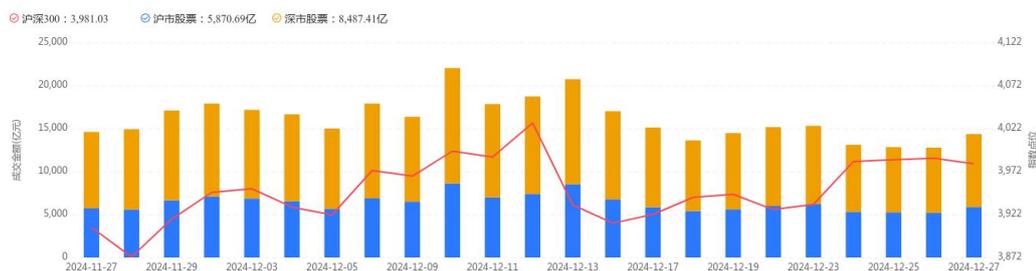
## 1. 宽基指数表现

- 上证 50：本周小幅上涨 0.73%。
- 沪深 300：本周表现较好，上涨 1.36%。
- 中证 500：本周小幅下跌-0.3%。
- 中证 1000：本周下跌-1.6%。
- 科创 50：本周小幅上涨 0.73%。
- 创业板指数：本周小幅下跌-0.22%。



## 2. 成交量

成交量方面，周五沪深两市成交量为 14,358.1 亿元，较上周有所上涨。



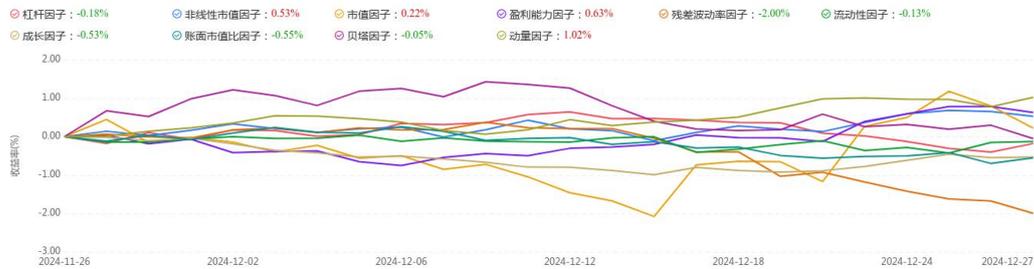
## 3. 股指期货基差变化

IF 和 IH 主力合约的基差走势保持平稳，而 IC 和 IM 主力合约的贴水水收窄。沪深 300、中证 500、中证 1000 的截面波动率（基于收益）持续下降。

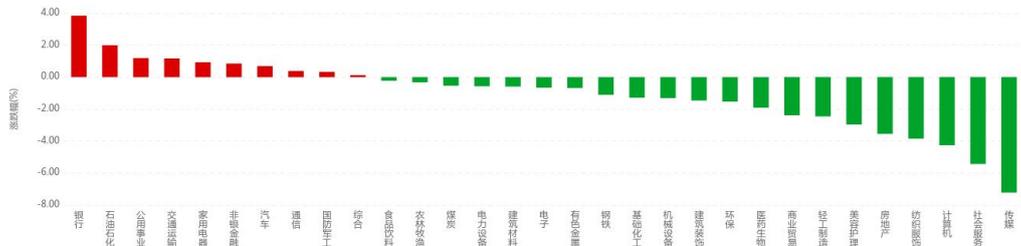


#### 4. 市场与行业风格

就市场风格而言，本周大盘价值表现良好，大盘成长、小盘价值表现平稳，小盘价值周五收跌。**beta** 因子波动或向下，表示市场环境较差；市值因子、线性市值因子相对平稳。行业方面，银行、石油石化、公用事业、交通运输、家用电器行业收涨，而大多数行业则出现了下跌，尤其是房地产、纺织服饰、计算机、社会服务、传媒跌幅居前。



#### 近一周行业表现:



#### 5. 商品期货板块

商品期货板块表现方面，南华商品指数走势平稳，贵金属、农产品表现较好。商品市场周五成交量为 12,614.4 亿元，其中农产品持仓量达到了历史高点，显示出农产品市场的活跃度较高。

