



业绩简报

文谛 20 号 沪深 300 商品指数 RP 组合 1

文谛沪深 300 指数增强 20 号 2 月份净值增长率为 0.67%，2020 年累计年度收益 -0.60%，成立以来收益为 18.56%。

	文谛 20 号	沪深 300	商品指数	RP 组合 1
2 月收益	0.67%	-1.59%	-7.62%	-0.29%
年度收益	-0.60%	-3.8%	-12.7%	-1.1%

股票：

全月来看，A 股结构性机会仍存，部分行业和主题表现亮眼。

- 1)为防控疫情，多地政府发出延时开工通知，并鼓励企业人员在家办公，使得云办公概念股走强，从而推动计算机、通信等行业的上涨；
- 2)随着国内复工进度陆续加快、区域交通恢复正常，猪肉消费得以提振，同时生猪出栏调运将更为顺畅，农林牧渔行业走强；
- 3)国家政策提出了要加大 5G 的建设力度，强调了 5G 发展的重要性，5G 概念相关个股表现优异；
- 4)国内新冠肺炎疫情得到有效控制，各地陆续复工，推升赶工需求，利好建材行业，全月表现靠前。

海外市场回顾：受新冠肺炎海外扩散的影响，海外各主要市场受到重创 2020 年 2 月，受新冠肺炎海外扩散的影响，海外各主要市场受到重创。美国方面，非农数据好于预期，美股上旬表现良好。

报告期内基金的投资情况及业绩表现

文谛沪深 300 指数增强 20 号在 2 月录得正收益。截至 2 月 28 日，本基金的单位净值是 1.1856 元，累计净值为 1.1856 元。较上月末的单位净值微涨 0.67%，同期沪深 300 指数下跌 1.59%，超额收益为 17.87%。

截止 2 月 28 日，本基金持有的国债期货、锌、阴极铜、精对苯二甲酸 (PTA)、天然橡胶 等获得不错的正收益；铁矿石、平板玻璃、聚乙烯等出现亏损。

策略分析

指数增强策略 2 月份股票端贡献约-0.19%收益；股指期货端贡献约 0.82%收益；

产品信息

管理关联方		条款和费率	
产品管理人	上海文谛资产管理有限公司	最低认购额度	1,000,000 元 (人民币)
证券主经纪商	华泰证券股份有限公司	封闭期	6 个月
期货主经纪商	华泰期货股份有限公司	申购\赎回费率	1.0%
基金托管人	华泰证券股份有限公司	管理费率	0.5%
		业绩报酬	分段收取
		开放期	封闭期过后每季度

免责声明

过往业绩不预示未来表现。报告中所有内容皆为上海文谛资产管理有限公司(后简称公司)尽最大勤勉责任提供的信息，但公司不对其准确性、完整性和适当性作任何担保。该报告仅用于一般性演示或讨论，不构成对产品的购买建议，且未经允许不得向任何机构或个人转载或发布。公司拥有对报告内容的最终解释权。