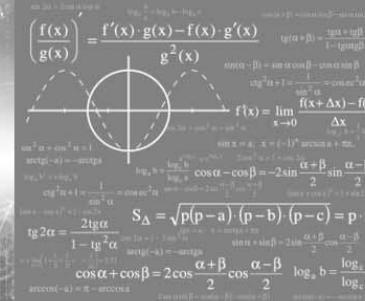
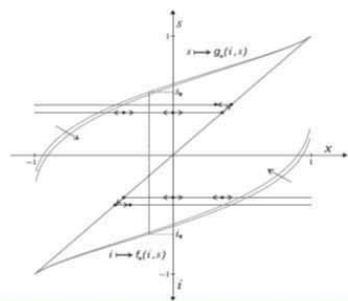




业绩简报

优选三号 沪深 300 商品指数 RP 组合 1

文谛量化套利六号 2 月净值增长率为 7.11% ,

2 月收益 7.11% -1.59% -7.62% -0.29%

2020 年累计年度收益为 11.26% , 成立以来

今年收益 11.26% -3.8% -12.7% -1.1%

收益为 12.3%。

期货市场

疫情在全球蔓延，原油价格大跌，导致整个化工板块全面大幅下行。

黑色系方面，澳洲巴西铁矿发运总量 2047.6 万吨，环比上期增加 531.3 万吨。发货量开始恢复，打压铁矿盘面，本周领跌黑色板块，铁矿跌幅达到 8.73%。钢材库存也是继续累库，螺纹钢和热卷也开启下跌模式。

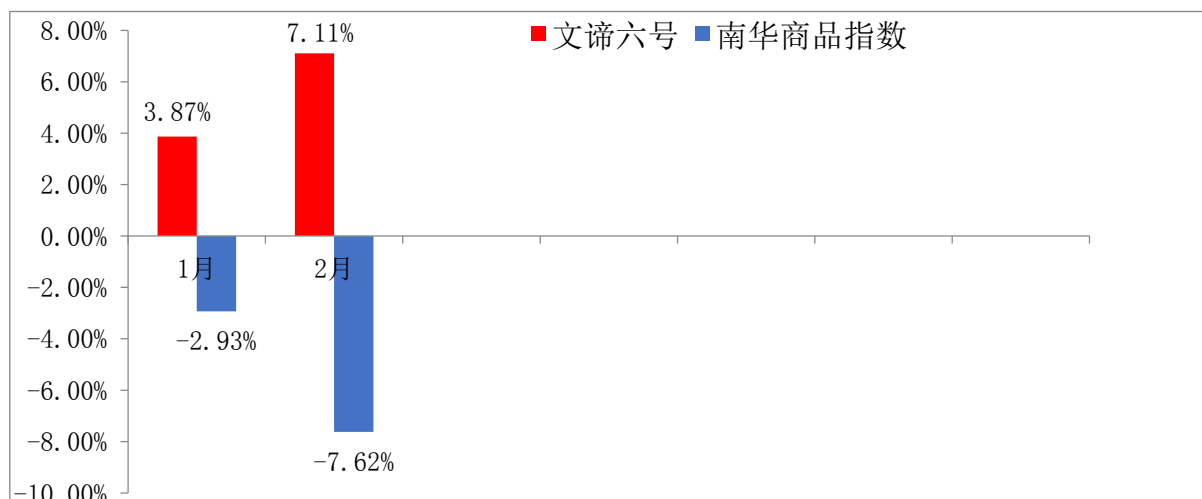
农产品方面，三大油脂再次大跌，预计马来西亚 2 月棕榈油出口料维持低迷局面，因新冠肺炎疫情或令中国棕榈油需求下降，且印度对马来西亚精炼棕榈油进口限制措施。国内各类学校开学时间延后，餐饮需求大幅下滑，在供应不断增加及需求减弱结构下，鸡蛋价反弹受阻。

贵金属方面，交易所交易产品持有的黄金达到 3000 吨以上的历史新高。由于股票市场急剧下跌，黄金被用来满足作为流动性资产的追加保证金要求时，黄金可能会遭受进一步的获利了结。

报告期内基金的投资情况及业绩表现

文谛量化套利六号在 2 月获得了 7.11% 收益。截至 2 月 28 日，本基金的单位净值是 1.123 元，累计净值为 1.123 元。较上月末的单位净值微涨 7.11%，同期沪深 300 指数下跌 1.59%，南华商品指数下跌 7.62%。

截止 2 月 28 日，本基金持有的棕榈油、硅铁、锰硅、棉花等获得不错的正收益；



上图为 2020 年文谛六号月度收益

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	兴业证券股份有限公司	封闭期	6 个月
期货主经纪商	兴证期货有限公司	申购\赎回费率	1%
基金托管人	兴业证券股份有限公司	管理费率	1.5%
		业绩报酬	10% (净值高水标法)
		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。