

## 业绩简报

文谛 20 号 沪深 300 商品指数 RP 组合<sup>1</sup>

文谛沪深 300 指数增强 20 号 5 月份净值增长率为 1.42% 2020 年累计年度收益 5.37%，成立以来收益为 25.68%。

	文谛 20 号	沪深 300	商品指数	RP 组合 <sup>1</sup>
5 月收益	1.42 %	-1.16 %	6.08%	3.27%
年度收益	5.37% <sup>2</sup>	-3.40%	-5.90%	5.40%

## 股票：

市场先扬后抑，上证指数反弹至半年线和年线附近后开始震荡回落，全月微跌 0.27%，总体在 2800-2900 点区间震荡；创业板指数强于主板走势，中上旬持续反弹，最高摸至 2153 点，基本上将之前的涨幅回吐，全月小幅上涨 0.83%。

行业方面，家居用品、食品饮料、医疗保健、酿酒、家电等板块领涨，基本上属于大消费领域，保险、通信设备、农林牧渔等板块位居跌幅前三位。

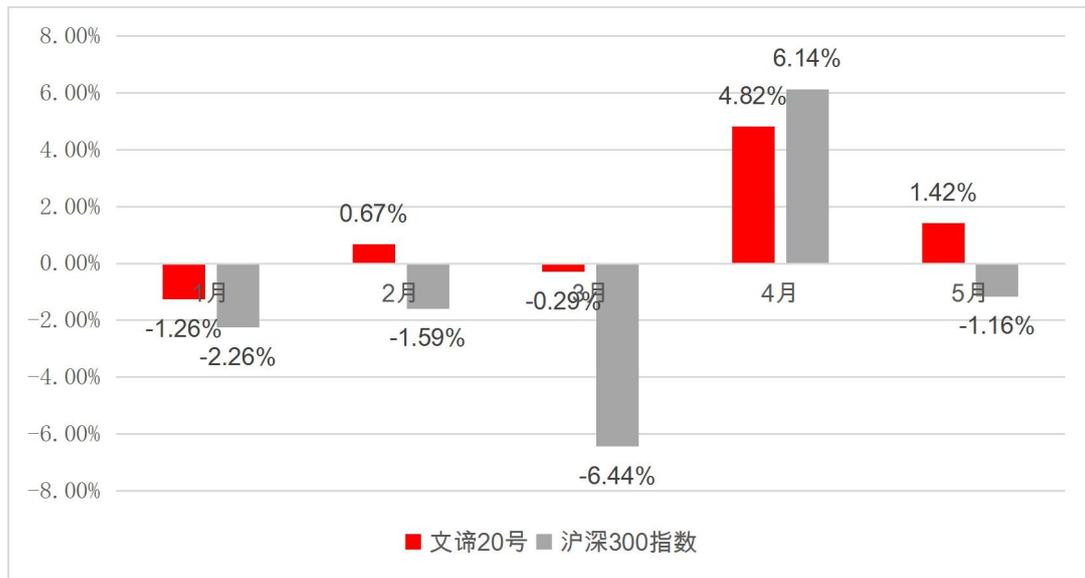
海外市场回顾：国外方面，依然有较大的不确定性。美国新冠肺炎疫情依然比较反复。

## 产品运作分析

### 1、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 5 月采取了指数增强策略。截至 5 月 29 日，本基金的单位净值是 1.2568 元，累计净值为 1.2568 元。较上月末的单位净值上涨 1.42%，同期沪深 300 指数下跌 1.16%，成立以来超额收益为 26.86%。

产品收益如下：



上图为文谛 20 号产品 2020 年月度收益

### 策略分析

指数增强策略 5 月份股票端微亏；期货端贡献正收益；

## 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。