

# 大成智惠量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

基金管理人:大成基金管理有限公司  
基金托管人:中国工商银行股份有限公司  
送出日期:2018年8月29日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年01月01日起至2018年06月30日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	大成智惠量化多策略
基金代码	004029
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年3月21日
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金资产总额	20,102,40309份
基金份额的赎回应答	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	严控风险的前提下追求绝对收益。本基金通过大类资产的配置管理，以通过多种量化方法实现对本基金资产的保值增值。
投资策略	本基金在大类资产配置方面，采用大成基金所研发的量化择时模型，通过量化方法识别市场趋势，从而调整资产配置比例；同时，本基金将通过量化选股模型，以下述详尽的选股策略，精选个股。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中证国债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，风险收益特征高于股票型基金，属于货币市场基金与债券型基金，属于风险水平中高的基金。
基金管理人和基金托管人	

项目	基金管理人	基金托管人
名称	大成基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
姓名	赵东	周明
信息披露负责人	董承杰	董承杰
联系电话	010-66105098	010-66105098
客户服务电话	4000999668	95588
传真	010-63190688	010-63190688

2.4 信息披露方式	
基金管理人半年度报告正文的管理人在互联网网址:	http://www.dcfund.com.cn
深圳证券交易所网站上披露的半年度报告摘要的管理人在互联网网址:	http://www.cninfo.com.cn

3.3 主要财务指标和基金净值表现	
金额单位:人民币元	

3.1 回购定期报告	
本期末实现收益	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
-3,406,130.05	14,200.76%
回购平均价格(元/份)	
-0.1234	13.50%
本基金赎回费(元/份)	0.1173%
3.12 新回购定期报告	报告期(2018年6月30日)
-0.0003	0.00%
回购平均价格(元/份)	29,099,896.42
本基金赎回费(元/份)	0.0009

注:1、本期已实现收益指本基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计价费用后实际收益水平将低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长 率	同期业绩比 较基准收益 率②	差额③=①-②	①-③	②-④
过去一个月	-0.60%	12.17%	-0.06%	-21.11%	0.07%
过去3个月	-0.23%	1.10%	-0.03%	-4.10%	0.03%
过去6个月	-1.17%	1.11%	-0.08%	-7.04%	0.04%
过去一年	-3.11%	0.07%	0.04%	-3.07%	0.06%
自基金合同生效以来	-0.01%	0.70%	0.36%	-0.36%	0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较	
1.00	1.00
1.05	1.05
1.10	1.10
1.15	1.15
1.20	1.20
1.25	1.25
1.30	1.30
1.35	1.35
1.40	1.40
1.45	1.45
1.50	1.50
1.55	1.55
1.60	1.60
1.65	1.65
1.70	1.70
1.75	1.75
1.80	1.80
1.85	1.85
1.90	1.90
1.95	1.95
2.00	2.00
2.05	2.05
2.10	2.10
2.15	2.15
2.20	2.20
2.25	2.25
2.30	2.30
2.35	2.35
2.40	2.40
2.45	2.45
2.50	2.50
2.55	2.55
2.60	2.60
2.65	2.65
2.70	2.70
2.75	2.75
2.80	2.80
2.85	2.85
2.90	2.90
2.95	2.95
3.00	3.00
3.05	3.05
3.10	3.10
3.15	3.15
3.20	3.20
3.25	3.25
3.30	3.30
3.35	3.35
3.40	3.40
3.45	3.45
3.50	3.50
3.55	3.55
3.60	3.60
3.65	3.65
3.70	3.70
3.75	3.75
3.80	3.80
3.85	3.85
3.90	3.90
3.95	3.95
4.00	4.00
4.05	4.05
4.10	4.10
4.15	4.15
4.20	4.20
4.25	4.25
4.30	4.30
4.35	4.35
4.40	4.40
4.45	4.45
4.50	4.50
4.55	4.55
4.60	4.60
4.65	4.65
4.70	4.70
4.75	4.75
4.80	4.80
4.85	4.85
4.90	4.90
4.95	4.95
5.00	5.00
5.05	5.05
5.10	5.10
5.15	5.15
5.20	5.20
5.25	5.25
5.30	5.30
5.35	5.35
5.40	5.40
5.45	5.45
5.50	5.50
5.55	5.55
5.60	5.60
5.65	5.65
5.70	5.70
5.75	5.75
5.80	5.80
5.85	5.85
5.90	5.90
5.95	5.95
6.00	6.00
6.05	6.05
6.10	6.10
6.15	6.15
6.20	6.20
6.25	6.25
6.30	6.30
6.35	6.35
6.40	6.40
6.45	6.45
6.50	6.50
6.55	6.55
6.60	6.60
6.65	6.65
6.70	6.70
6.75	6.75
6.80	6.80
6.85	6.85
6.90	6.90
6.95	6.95
7.00	7.00
7.05	7.05
7.10	7.10
7.15	7.15
7.20	7.20
7.25	7.25
7.30	7.30
7.35	7.35
7.40	7.40
7.45	7.45
7.50	7.50
7.55	7.55
7.60	7.60
7.65	7.65
7.70	7.70
7.75	7.75
7.80	7.80
7.85	7.85
7.90	7.90
7.95	7.95
8.00	8.00
8.05	8.05
8.10	8.10
8.15	8.15
8.20	8.20
8.25	8.25
8.30	8.30
8.35	8.35
8.40	8.40
8.45	8.45
8.50	8.50
8.55	8