上投摩根中国生物医药混合型证券投资基金（QDII）

2019年半年度报告摘要

（原上投摩根智慧生活灵活配置混合型证券投资基金转型）

基金管理人：上投摩根基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年八月二十四日

1 重要提示

1.1 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年8月23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，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至6月30日止。

根据基金管理人于2019年2月22日发布的《关于上投摩根智慧生活灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，基金份额持有人大会于2019年2月20日表决通过了《关于上投摩根智慧生活灵活配置混合型证券投资基金转型并修改基金合同有关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效。自基金份额持有人大会决议生效公告当日（2019年2月22日）起，《上投摩根智慧生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》失效，《上投摩根中国生物医药混合型证券投资基金（QDII）基金合同》生效。基金合同当事人将按照《上投摩根中国生物医药混合型证券投资基金（QDII）基金合同》享有权利并承担义务。基金全称由“上投摩根智慧生活灵活配置混合型证券投资基金”变更为“上投摩根中国生物医药混合型证券投资基金（QDII）”，基金代码（001984）保持不变。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

2.1.1 上投摩根中国生物医药混合型证券投资基金（QDII）

基金简称	上投摩根中国生物医药混合（QDII）
基金主代码	001984
交易代码	001984
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年2月22日
基金管理人	上投摩根基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	348,244,742.92份
基金合同存续期	不定期

2.1.2 上投摩根智慧生活灵活配置混合型证券投资基金

基金简称	上投摩根智慧生活混合
基金主代码	001984
交易代码	001984
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年4月28日
基金管理人	上投摩根基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	29,526,512.97份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

2.2.1 上投摩根中国生物医药混合型证券投资基金（QDII）

投资目标	本基金采用定量及定性研究方法，自下而上优选在中国境内、香港及美国等全球市场上市的中国生物医药类公司，通过严格的风险控制，力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用“自下而上”的策略，通过系统和深入的基本面研究和跨市场估值优势的挖掘，优选在中国境内、香港及美国等市场上市的中国生物医药类公司构建股票投资组合，并辅以严格的投资组合风险控制，以获得中长期的较高投资收益。本基金主要投资于生物医药行业相关的中国公司股票。其中“中国公司”是指满足以下三个条件之一的上市公司：1）上市公司注册地在中国（包括中国内地及香港）；2）上市公司至少50%的主营业务收入或利润来自于中国；3）上市公司的主要经营活动在中国。本基金所定义的生物医药行业由研究开发、生产和销售用于预防、诊断和治疗疾病的生物医药相关产品或服务的上市公司组成，将主要包含主营业务为生物医药行业相关的上市公司，频述生物医药行业包括化学制药、中药、生物制药、医药商业、医疗服务、医疗器械等。
业绩比较基准	申银万国医药生物行业指数收益率×45%+恒生医疗保健行业指数收益率×35%+中债总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金属于混合型基金产品，预期风险和收益水平高于债券型基金和货币市场基金。 本基金风险收益特征会定期评估并在公司网站发布，请投资者关注。

2.2.2 上投摩根智慧生活灵活配置混合型证券投资基金

投资目标	本基金将主要投资于智慧生活主题上市公司，通过严格的风险控制，力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	1.资产配置策略 本基金将综合分析和持续跟踪基本面、政策面、市场面等多方面因素，对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等影响证券市场的重要因素进行深入分析，适度调整确定基金资产在股票、债券及现金等类别资产间的分配比例，动态优化投资组合。 2.股票投资策略 本基金所界定的智慧生活是指人们生活中对于个性化、便捷性、健康、娱乐和经济的需求。由于智慧生活主题涵及多个行业，行业配置上，本基金将遵循上而下的宏观产业分析逻辑，从行业生命周期、行业景气度、行业竞争格局等多角度，对基金资产在行业间分配进行安排。个股选择上，关注企业的核心竞争力与未来的发展战略，重点投资于具有新型商业模式、具备技术优势、解决用户痛点，引领新的生活方式和消费习惯的相关行业及公司。 3.固定收益类投资策略 对于固定收益类资产的选择，本基金将以价值分析为主线，在综合研究的基础上实施积极主动的组合管理，自上而下进行组合构建，自下而上进行个券选择。
业绩比较基准	中证800指数收益率*60%+中债总指数收益率*40%
风险收益特征	本基金属于混合型基金产品，预期风险和收益水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金，属于较高风险收益水平的基金产品。 本基金风险收益特征会定期评估并在公司网站发布，请投资者关注。

2.3 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		上投摩根基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡迪	王永民
	联系电话	021-38798888	010-66594896
	电子邮箱	services@chinamore.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-889-4888	95566
传真		021-20619400	010-66594942

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	Bank of China (Hong Kong) Limited
	中文	-	中国银行(香港)有限公司
注册地址		-	香港中环花园道1号中银大厦
办公地址		-	香港中环花园道1号中银大厦
邮政编码		-	-

2.5 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.cifm.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 上投摩根中国生物医药混合型证券投资基金（QDII）

3.1.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年2月22日至2019年6月30日)
本期已实现收益	3,822,206.35
本期利润	16,921,289.46
加权平均基金份额本期利润	0.0835
本期基金份额净值增长率	5.92%
3.1.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0240
期末基金资产净值	368,853,489.92
期末基金份额净值	1.0692

3.1.2 基金净值表现

3..1.2.1 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①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	4.11%	0.64%	0.61%	1.06%	3.50%	-0.41%
过去三个月	4.42%	0.47%	-7.08%	1.20%	11.50%	-0.73%
自基金合同生效起至今	5.92%	0.53%	4.04%	1.26%	1.88%	-0.73%

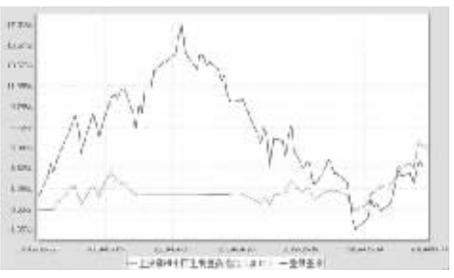
注：本基金的业绩比较基准为：申银万国医药生物行业指数收益率×45%+恒生医疗保健行业指数收益率×35%+中债总指数收益率×20%。

3.1.2.2 自基金转型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

上投摩根中国生物医药混合型证券投资基金（QDII）

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019年2月22日至2019年6月30日)



注：本基金合同生效日（转型日）为2019年2月22日，截至本报告期末，本基金合同生效（转型）未满一年，图示时间段为2019年2月22日至2019年6月30日。

本基金建仓期自2019年2月22日至2019年8月21日，本基金本报告期内仍处于建仓期。

3.2 上投摩根智慧生活灵活配置混合型证券投资基金

3.2.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.2.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日至2019年2月21日)
本期已实现收益	-709,501.22
本期利润	-141,251.97
加权平均基金份额本期利润	-0.0047
本期基金份额净值增长率	-0.68%
3.2.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年2月21日)
期末可供分配基金份额利润	-0.1295
期末基金资产净值	25,703,658.06
期末基金份额净值	0.8710

注：1.本期已实现收益指基金本期利息收入、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，期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

2.上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（例如，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.2 基金净值表现

3.2.2.1 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①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去六个月	-0.68%	0.36%	8.26%	0.65%	-9.03%	-0.30%
过去一年	-16.57%	0.87%	-1.14%	0.84%	-15.43%	0.03%
过去三年	-13.25%	1.03%	-0.36%	0.60%	-12.89%	0.43%
2016年4月28日-2019年2月21日	-12.90%	0.99%	0.03%	0.61%	-12.93%	0.38%

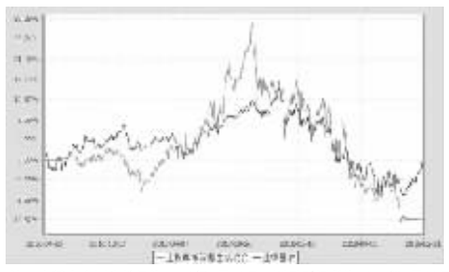
注：转型前本基金的业绩比较基准为：中证800指数收益率×60%+中债总指数收益率×40%。

3.2.2.2 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

上投摩根智慧生活灵活配置混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2016年4月28日至2019年2月21日）



注：本基金合同生效日为2016年4月28日，图示时间段为2016年4月28日至2019年2月21日。本基金建仓期自2016年4月28日至2016年10月27日。建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

上投摩根基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批准，于2004年5月12日正式成立。公司由上海国际信托投资有限公司（2007年10月8日更名为“上海国际信托有限公司”）与摩根资产管理（英国）有限公司合资设立，注册资本为2.5亿元人民币，注册地上海。截至2019年6月底，公司旗下运作的基金共有六十四只，均为开放式基金，分别是：上投摩根中国优势证券投资基金、上投摩根货币市场基金、上投摩根阿尔法混合型证券投资基金、上投摩根双息平衡混合型证券投资基金、上投摩根成长先锋混合型证券投资基金、上投摩根内需动力混合型证券投资基金、上投摩根亚太优势混合型证券投资基金、上投摩根双核平衡混合型证券投资基金、上投摩根中小盘混合型证券投资基金、上投摩根纯债债券型证券投资基金、上投摩根行业轮动混合型证券投资基金、上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金、上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金、上投摩根新兴动力混合型证券投资基金、上投摩根强化回报债券型证券投资基金、上投摩根健康品质生活混合型证券投资基金、上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金、上投摩根分红添利债券型证券投资基金、上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金、上投摩根核心优选混合型证券投资基金、上投摩根智选30混合型证券投资基金、上投摩根成长动力混合型证券投资基金、上投摩根红利回报混合型证券投资基金、上投摩根转型动力灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根双债增利债券型证券投资基金、上投摩根核心成长股票型证券投资基金、上投摩根民生需求股票型证券投资基金、上投摩根优信增利债券型证券投资基金、上投摩根纯债丰利债券型证券投资基金、上投摩根天添盈货币市场基金、上投摩根天添宝货币市场基金、上投摩根纯债添利债券型证券投资基金、上投摩根稳进回报混合型证券投资基金、上投摩根安全战略股票型证券投资基金、上投摩根卓越制造股票型证券投资基金、上投摩根整合驱动灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根动态多因子策略灵活配置证券投资基金、上投摩根智慧互联股票型证券投资基金、上投摩根科技前沿灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根新兴服务股票型证券投资基金、上投摩根医疗健康股票型证券投资基金、上投摩根文体休闲灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根中国生物医药混合型证券投资基金（QDII）、上投摩根策略精选灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根安鑫回报混合型证券投资基金、上投摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金(QDII)、上投摩根全球多元配置证券投资基金(QDII)、上投摩根安丰回报混合型证券投资基金、上投摩根安通回报混合型证券投资基金、上投摩根优选多因子股票型证券投资基金、上投摩根丰瑞债券型证券投资基金、上投摩根标普港股通低波红利指数型证券投资基金、上投摩根量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根岁岁益定期开放债券型证券投资基金、上投摩根安隆回报混合型证券投资基金、上投摩根创新商业模式灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根富时发达市场REITs指数型证券投资基金（QDII）、上投摩根香港精选港股通混合型证券投资基金、上投摩根尚睿混合型基金中基金(FOF)、上投摩根安裕回报混合型证券投资基金、上投摩根欧洲动力策略股票型证券投资基金（QDII）、上投摩根核心精选股票型证券投资基金、上投摩根动力精选混合型证券投资基金、上投摩根领先优选混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张一甫	本基金基金经理	2018-08-03	-	8年	张一甫先生，自2010年7月至2011年12月在国泰君安证券股份有限公司担任助理研究员，自2012年1月至2012年12月在瑞银证券有限责任公司担任研究员；自2013年3月至2014年1月在国泰君安证券股份有限公司担任研究员；自2014年3月起加入上投摩根基金管理有限公司，历任研究员、行业专家兼基金经理助理、基金经理。2017年1月至2019年8月担任上投摩根成长先锋混合型证券投资基金基金经理，2018年2月至2019年8月同时担任上投摩根中国生物医药混合型证券投资基金（QDII）（由上投摩根智慧生活灵活配置混合型证券投资基金转型而来）基金经理。
方钰涵	本基金基金经理	2018-08-03	-	7年	方钰涵女士，2012年12月至2014年8月在兴业证券资产管理有限公司担任研究员，自2014年9月至2015年6月在国泰基金管理有限公司担任研究员；自2015年6月起加入上投摩根基金管理有限公司，先后担任行业专家、基金经理；自2018年8月起担任上投摩根中国生物医药混合型证券投资基金（QDII）（由上投摩根智慧生活灵活配置混合型证券投资基金转型而来）基金经理，自2019年8月起同时担任上投摩根医疗健康股票型证券投资基金基金经理。

注：1.任职日期和离任日期均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3.自2019年8月16日起，张一甫先生不再担任本基金基金经理一职。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益。本基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《上投摩根中国生物医药混合型证券投资基金（QDII）》的规定。基金经理对个股和投资组合的比例遵循了投资决策委员会的授权限制，基金投资比例符合基金合同和法律法规的要求。

4.3管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司继续贯彻落实《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规和公司内部公平交易流程的各项要求，严格规范境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等活动，通过系统和人工相结合的方式进行交易执行和监控分析，以确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的环节均得到公平对待。

对于交易所市场投资活动，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在买卖同一证券时，按照时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量；对于银行间市场投资活动，本公司通过对手库控制和交易室询价机制，严格防范对手风险并检查价格公允性；对于申购投资行为，本公司遵循价格优先、比例分配的原则，根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。

报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异比较、对同向交易和反向交易的交易时机和交易价差监控分析，未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

4.3.2异常交易行为的专项说明

报告期内，通过对交易价格、交易时间、交易方向等的抽样分析，未发现存在异常交易行为。

所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形：报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的次数为一次，发生在量化投资组合与主动管理投资组合之间。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

本基金于2019年2月22日转型成中国生物医药基金(QDII)，进入建仓期。结合彼时行业估值情况，本基金采取了较为谨慎的建仓步调。5、6月份市场大幅波动之后，流动性、外围风险均有所缓解，给予了逐步买入核心股票池里的优质资产的时间窗口。随着近期权益资产价格的回升，本基金取得一定的相对收益和绝对收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期上投摩根智慧生活混合转型前份额净值增长率为：-0.68%，同期业绩比较基准收益率为：8.35%。

本报告期上投摩根中国生物医药混合（QDII）转型后份额净值增长率为：5.92%，同期业绩比较基准收益率为：4.04%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，作为目前市场上唯一一只专注于投资在A、H以及少数其他上市地点的中国生物医药公司的基金，我们仍然中长期看好行业、以及可选上市公司的增长给投资者带来的权益回报。

我们认为，中国目前的生物医药行业面临辞旧（仿制）迎新（创新）、承前（旧体制）启后（新政策）的转折期，涌现了不少的中长期的结构性投资机会，包括如下几类：

1）在细分子行业里进入全球市场、真正具备全球竞争力的公司，这背后的核心竞争力来源是我国过去二三十年来沉淀下来的工程师红利、及从低端逐渐到高端的制造能力。截止到2018年底，我国输送了500万名的出国留学生，其中有300万名已学成归国，带来在大型制药公司研发、生产、销售或审评审批机构多年的资深经验。拥有核心竞争资源的公司，通常根植于刚刚起步的、巨大且快速增长的中国本土市场，又以欧美市场的客户转移正向趋势为基础增长，前者更加强劲，例如一些龙头的全球外包服务公司，囊括临床前至生产，小分子和大分子、医疗器械公司、原料药公司，壁垒沉淀时间长，且可识别，可持续。

2）虽在只在中国本土市场经营，但是所处的本底行业稳定增长，体现为渗透率仍较低，医药消费仍在增长，消费者的用药结构或检测费用和国外还有较大差距，从国外发展的映射来看能看到较长的赛道，例如一些龙头的血液制品公司，本土医疗器械公司，医疗服务和药房零售公司。

3）在香港上市的、不能通过沪港通买入的独有公司，本基金的QDII额度发挥了优势，包括部分特色的大型制药企业、未有收入利润的创新药企业（如免疫治疗、创新疫苗等）、以及某些连锁服务业。我们看好国内自主创新的免疫治疗药品、小分子药品获批后2019年产生爆发性的销售增长带来的投资机会。而未有利润的创新药公司通常配合以更加合理的组织架构和激励机制，快速组建起一支研发、注册、临床的全球队伍，将内生研发或BD引进的临床短缺产品推向全球，我们亦看好这类企业内部组织体系变革在科创时代焕发的新生活力。

最后，我们将利用上投摩根内部严格科学的投研流程，以及母公司摩根资产在医药医疗行业的资源优势，争取为投资人创造超额回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司的基金估值和会计核算由基金会计部负责，根据相关的法律法规规定、基金合同的约定，制定了内部控制措施，对基金估值和会计核算的各个环节和整个流程进行风险控制，目的是保证基金估值和会计核算的准确性。基金会计部人员均具备基金从业资格和相关工作经历。本公司成立了估值委员会，并制订有关议事规则。估值委员会成员包括公司管理层、督察长、基金会计、风险管理等方面的负责人以及相关基金经理，所有相关成员均具有丰富的证券基金行业从业经验。公司估值委员会对估值事项发表意见，评估基金估值的公允性和合理性。基金经理是估值委员会的重要成员，参加估值委员会会议，参与估值程序和估值技术的讨论。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

无。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情况，出现该情况的时间范围为2017年07月21日至2019年04月09日。

基金管理人拟调整本基金运作方式，加大营销力度，提升基金规模，方案已报监管机关。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在上投摩根中国生物医药混合型证券投资基金（QDII）（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 上投摩根中国生物医药混合型证券投资基金（QDII）

6.1.1 资产负债表

会计主体：上投摩根中国生物医药混合型证券投资基金（QDII）

报告截止日：2019年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2019年6月30日
资 产：		
银行存款	6.4.7.1	173,437,804.94
结算备付金		989,504.56
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	217,672,321.17
其中：股票投资		217,672,321.17
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		1,897,980.86
应收利息	6.4.7.5	31,259.74
应收股利		-
应收申购款		524,516.94
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		394,553,388.23
负债和所有者权益		本期末 2019年6月30日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债		-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		6,420,140.75
应付赎回款		18,363,871.15
应付管理人报酬		468,678.49
应付托管费		76,446.40
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	337,202.66
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	43,568.86
负债合计		25,709,908.31
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	348,244,742.92
未分配利润	6.4.7.10	20,608,747.00
所有者权益合计		368,853,489.92
负债和所有者权益总计		394,553,388.23

注：报告截止日2019年06月30日，基金份额净值1.0592元，基金份额总额348,244,742.92份。

6.1.2 利润表

会计主体：上投摩根中国生物医药混合型证券投资基金（QDII）

本报告期：2019年2月22日至2019年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2019年2月22日至 2019年6月30日
一、收入		19,027,912.46
1.利息收入		344,944.85
其中：存款利息收入	6.4.7.11	325,811.27
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		19,133.59
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,889,387.71
其中：股票投资收益	6.4.7.12	4,149,680.36
基金投资收益	6.4.7.13	-
债券投资收益	6.4.7.14	9.90
资产支持证券投资收益	6.4.7.15	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.16	-
股利收益	6.4.7.17	739,697.45
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	13,099,083.11
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		545,176.44
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	149,320.34
减：二、费用		2,106,623.00
1. 管理人报酬		1,114,289.16
2. 托管费		185,714.85
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.20	779,693.42
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.21	26,925.57
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		16,921,289.46
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		16,921,289.46

6.1.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上投摩根中国生物医药混合型证券投资基金（QDII）

本报告期：2019年2月22日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年2月22日至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	25,703,614.53	-	25,703,614.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	16,921,289.46	16,921,289.46
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	322,541,128.39	3,687,457.54	326,228,585.93
其中：1.基金申购款	357,070,331.50	4,766,903.59	361,837,235.09
2.基金赎回款	-34,529,203.11	-1,079,446.05	-35,608,649.16
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	348,244,742.92	20,608,747.00	368,853,489.92

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：王大智，主管会计工作负责人：杨怡，会计机构负责人：张璐

6.1.4 报表附注

6.1.4.1 基金基本情况

上投摩根中国生物医药混合型证券投资基金(QDII)是由上投摩根智慧生活灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“原基金”)转型而来。原基金经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]2422号《关于准予上投摩根智慧生活灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由上投摩根基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《上投摩根智慧生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。原基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币222,495,387.43元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第486号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上投摩根智慧生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年4月28日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为222,556,135.92份基金份额，其中认购资金利息折合60,748.49份基金份额。

根据《关于上投摩根智慧生活灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》和《关于上投摩根智慧生活灵活配置混合型证券投资基金转型为上投摩根中国生物医药混合型证券投资基金(QDII)折算结果的公告》，上投摩根基金管理有限公司以2019年2月21日为原基金份额转换及折算基准日，折算前原基金份额总额为29,526,512.97份，折算前原基金份额净值为0.871元，折算比例为0.870528060，折算后本基金份额总额为25,703,658.05份，折算后本基金份额净值为1.0000元。

自2019年2月22日起，原基金转型为上投摩根中国生物医药混合型证券投资基金(QDII)(以下简称“本基金”)，《上投摩根智慧生活灵活配置混合型证券投资基金基金合同》失效，《上投摩根中国生物医药混合型证券投资基金(QDII)基金合同》于同一日起生效，并已报中国证监会备案。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为上投摩根基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司，境外资产托管人为中国银行(香港)有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上投摩根中国生物医药混合型证券投资基金(QDII)基金合同》的有关规定，本基金境外主要投资于在香港、美国等海外证券市场（已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区）挂牌交易的普通股、优先股、存托凭证、房地产信托凭证；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等固定收益投资工具；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品。本基金境内主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券、中小企业私募债、证券公司短期公司债)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、权证、股指期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为：股票投资为基金资产的50%-95%，其中投资于境外股票的比例为股票资产的 5%-50%，投资于生物医药行业相关的中国公司证券的比例不低于非现金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货和股票期权等合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：申银万国医药生物行业指数收益率×45%+恒生医疗保健行业指数收益率×35%+中债总指数收益率×20%

本财务报表由本基金的基金管理人上投摩根基金管理有限公司于2019年8月23日批准报出。

6.1.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号（年度报告和半年度报告）》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《上投摩根中国生物医药混合型证券投资基金(QDII)基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.1.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019年2月22日(基金合同生效日)至2019年6月30日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2019年6月30日的财务状况以及2019年2月22日(基金合同生效日)至2019年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.1.4.4 重要会计政策和会计估计

6.1.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2019年2月22日(基金合同生效日)至2019年6月30日止期间。

6.1.4.4.2记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.1.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其