

年度報告

中銀香港盈益系列

2021年6月30日

中银香港盈荟系列

目录	页数
行政及管理	1
受托人报告书	2
独立审计报告	3-5
资产净值表	6-7
损益及其他全面收益表	8-10
归属于份额持有人的资产净值变动表	11-16
现金流量表	17-21
财务报表附注	22-170
投资组合(未经审计)	171-241
投资组合变动表(未经审计)	242-246
投资业绩报表(未经审计)	247-260
投资业绩记录(未经审计)	261-269
因金融衍生工具所产生敞口的资料(未经审计)	270

中银香港盈荟系列

行政及管理

基金管理人／QFII持有人／RQFII持有人

中银香港资产管理有限公司
香港
德辅道中2A号
中国银行大厦5楼

基金管理人的律师

的近律师行
香港
中环遮打道18号
历山大厦5楼

受托人兼基金登记机构

中银国际英国保诚信托有限公司
香港
太古城
英皇道1111号
15楼1501-1507及1513-1516室

审计师

安永会计师事务所
香港
鲗鱼涌
英皇道979号
太古坊一座27楼

中银香港盈荟系列

受托人报告书

吾等谨此确认，吾等认为在截至2021年6月30日止的年度内，基金管理人中银香港资产管理有限公司在所有重大方面已根据2012年6月4日签订的信托契约条文（经修订），管理中银香港盈荟系列。

代表

中银国际英国保诚信托有限公司（受托人）

2021年10月27日

独立审计报告

致中银香港盈荟系列子基金的受托人及基金管理人

财务报表审计报告

意见

我们已审计第6至170页列示的关于中银香港全天候环球投资基金、中银香港全天候中国高息债券基金、中银香港全天候香港股票基金、中银香港全天候在岸人民币股票基金、中银香港全天候亚洲债券基金、中银香港全天候亚洲(日本除外)股票基金、中银香港全天候中国收益基金、中银香港全天候亚太高收益基金、中银香港全天候短期债券基金、中银香港全天候一带一路债券基金、中银香港全天候大湾区策略基金及中银香港全天候亚洲高息债券基金(中银香港盈荟系列的“子基金”)的财务报表, 这些财务报表包括这些子基金于2021年6月30日的资产净值表, 以及中银香港全天候环球投资基金、中银香港全天候中国高息债券基金、中银香港全天候香港股票基金、中银香港全天候在岸人民币股票基金、中银香港全天候亚洲债券基金、中银香港全天候亚洲(日本除外)股票基金、中银香港全天候中国收益基金、中银香港全天候亚太高收益基金、中银香港全天候短期债券基金、中银香港全天候一带一路债券基金及中银香港全天候大湾区策略基金截至2021年6月30日止年度和中银香港全天候亚洲高息债券基金自2020年6月29日(开始营运日期)至2021年6月30日的损益及其他全面收益表、归属于份额持有人的资产净值变动表及现金流量表及财务报告附注(包括重要会计政策摘要)。

我们认为, 这些财务报表已根据香港会计师公会(“香港会计师公会”)颁布的《香港财务报告准则》真实而中肯地反映这些子基金于2021年6月30日的财务状况, 以及中银香港全天候环球投资基金、中银香港全天候中国高息债券基金、中银香港全天候香港股票基金、中银香港全天候在岸人民币股票基金、中银香港全天候亚洲债券基金、中银香港全天候亚洲(日本除外)股票基金、中银香港全天候中国收益基金、中银香港全天候亚太高收益基金、中银香港全天候短期债券基金、中银香港全天候一带一路债券基金及中银香港全天候大湾区策略基金截至2021年6月30日止年度和中银香港全天候亚洲高息债券基金自2020年6月29日(开始营运日期)至2021年6月30日的财务表现及现金流量。

意见的基础

我们已根据香港会计师公会颁布的《香港审计准则》(“香港审计准则”)进行审计。我们在这些准则下承担的责任已在本报告“审计师就审计财务报表承担的责任”部分中作进一步阐述。根据香港会计师公会颁布的专业会计师道德守则(“守则”), 我们独立于子基金, 并已根据守则履行其他专业道德责任。我们相信, 我们所获得的审计凭证能充足及适当地为我们的审计意见提供基础。

独立审计报告

致中银香港盈荟系列子基金的受托人及基金管理人(续)

刊载于年度报告内的其他资料

子基金的受托人及基金管理人需对其他资料负责。其他资料包括刊载于年度报告内的资料，但不包括财务报表及我们的审计师报告。

我们对财务报表的意见并不涵盖其他资料，我们亦不对这些其他资料发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他资料，在此过程中，考虑其他资料是否与财务报表或我们在审计过程中所了解的情况存在重大抵触或者似乎存在重大错误陈述的情况。基于我们已执行的工作，如果我们认为其他资料存在重大错误陈述，我们需要报告该事实。在这方面，我们没有任何报告。

受托人及基金管理人就财务报表须承担的责任

子基金的受托人及基金管理人须负责根据香港会计师公会颁布的《香港财务报告准则》编制真实而中肯的财务报表，并对其认为为使财务报表的编制不存在由于欺诈或错误而导致的重大错误陈述所需的内部控制负责。

在编制财务报表时，子基金的受托人及基金管理人负责评估子基金持续经营的能力，并在适用情况下披露与持续经营有关的事项，以及使用持续经营为会计基础，除非受托人及基金管理人有意将子基金清盘或停止经营，或别无其他实际的替代方案。

此外，子基金的受托人及基金管理人须负责确保这些财务报表已根据日期为2012年6月4日的信托契约(经修订) (“信托契约”) 的相关披露条文及香港证券及期货事务监察委员会颁布的份额信托及互惠基金守则 (“香港证监会守则”) 附录E所列明的披露规定妥为编制。

审计师就审计财务报表承担的责任

我们的目标，是对财务报表整体是否不存在由于欺诈或错误而导致的重大错误陈述取得合理保证，并出具包括我们意见的审计师报告。我们仅向阁下整体作出报告，并不作其他用途。我们不会就本报告书的内容向任何其他人士负上或承担任何责任。

合理保证是高水平的保证，但不能保证按照《香港审计准则》进行的审计，在某一重大错误陈述存在时总能发现。错误陈述可以由欺诈或错误引起，如果合理预期它们单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依赖财务报表所作出的经济决定，则有关的错误陈述可被视作重大。此外，我们亦须评估这些子基金的财务报表是否已在各重大方面按照信托契约的相关披露条文和香港证监会守则附录E所列明的相关披露规定妥为编制。

独立审计报告

致中银香港盈荟系列子基金的受托人及基金管理人(续)

审计师就审计财务报表承担的责任(续)

在根据《香港审计准则》进行审计的过程中，我们运用了专业判断，保持了专业怀疑态度。我们亦：

- 识别和评估由于欺诈或错误而导致财务报表存在重大错误陈述的风险，设计及执行审计程序以应对这些风险，以及获取充足和适当的审计凭证，作为我们意见的基础。由于欺诈可能涉及串谋、伪造、蓄意遗漏、虚假陈述，或凌驾于内部控制之上，因此未能发现因欺诈而导致的重大错误陈述的风险高于未能发现因错误而导致的重大错误陈述的风险。
- 了解与审计相关的内部控制，以设计适当的审计程序，但目的并非对这些子基金的内部控制的有效性发表意见。
- 评价受托人及基金管理人所采用会计政策的恰当性及作出会计估计和相关披露的合理性。
- 对受托人及基金管理人采用持续经营会计基础的恰当性作出结论。根据所获取的审计凭证，确定是否存在与事项或情况有关的重大不确定性，从而可能导致对这些子基金的持续经营能力产生重大疑虑。如果我们认为存在重大不确定性，则有必要在审计师报告中提请使用者注意财务报表中的相关披露。假若有关的披露不足，则我们应当发表非无保留意见。我们的结论是基于审计师报告日期止所取得的审计凭证。然而，未来事项或情况可能导致这些子基金不能持续经营。
- 评价财务报表的整体列报方式、结构和内容，包括披露，以及财务报表是否中肯反映相关交易和事项。

我们与受托人及基金管理人就(其中包括)计划的审计范围及时间安排以及重大审计发现(包括我们在审计中识别出内部控制的任何重大缺陷)进行沟通。

根据信托契约的相关披露条文及香港证监会守则附录E的相关披露规定就有关事项作报告

我们认为，这些财务报表已在各重大方面按照信托契约的相关披露条文和香港证监会守则附录E的相关披露规定妥为编制。

注册会计师

香港

2021年10月27日

中银香港盈荟系列

资产净值表

2021年6月30日

附注	中银香港全天候 环球投资基金		中银香港全天候 中国高息债券基金		中银香港全天候 香港股票基金		中银香港全天候 在岸人民币股票基金		中银香港全天候 亚洲债券基金		中银香港全天候 亚洲(日本除外)股票基金	
	2021年 美元	2020年 美元	2021年 人民币	2020年 人民币	2021年 港元	2020年 港元	2021年 人民币	2020年 人民币	2021年 美元	2020年 美元	2021年 美元	2020年 美元
资产												
以公允价值计量且其变动计入 当期损益的金融资产												
应收经纪人款项	9,471,499	6,714,117	1,103,797,159	1,390,527,968	229,920,314	205,021,414	396,527,082	262,334,740	220,589,206	166,904,574	6,421,376	6,540,179
应收股息	994,081	-	14,261,351	-	79,042,948	-	14,917,892	706,880	5,266,885	805,304	151,382	19,317
应收利息	14,927	920	87,793	362,521	293,845	1,177,199	198,846	-	-	4,516	13,833	25,584
应收认购款项	-	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他应收款项	4,292	-	140,965	167,315	35,711	-	970,922	219,881	46,139	533,826	12,686	-
存款准备金	-	-	70,589	20,652	-	-	23,439	432	-	-	-	-
现金及现金等价物	-	-	-	-	-	-	244,804	224,000	-	-	-	-
14	395,874	769,772	17,397,597	46,286,144	50,097,933	5,083,014	16,374,917	6,816,276	986,533	6,897,825	181,237	285,294
总资产	10,880,673	7,484,810	1,135,755,454	1,437,364,600	359,390,751	211,281,627	429,257,902	270,302,209	226,888,763	175,146,045	6,780,514	6,870,374
负债												
以公允价值计量且其变动计入 当期损益的金融负债												
应付经纪人款项	380	-	12,781,044	182,003	81,356	-	-	26,814	472,185	-	3,039	-
应付收益分配	1,204,995	-	28,144,449	16,256,968	63,040,108	-	19,418,017	706,530	5,668,481	2,299,820	158,867	40,905
应付管理费	-	-	11,116,824	15,671,970	-	-	-	-	593,955	447,383	-	-
应付受托人费用	6,871	5,290	878,173	1,233,566	227,448	179,210	536,287	392,441	147,503	113,079	4,681	3,398
应付费用及其他应付款项	2,500	2,661	106,958	141,351	30,177	22,925	40,621	28,032	19,932	16,713	2,500	2,661
应付赎回款项	23,633	20,816	153,070	152,884	243,022	222,540	499,858	392,357	24,572	22,895	23,700	20,945
	-	10,197	2,978,424	2,199,944	15,099,329	19,638	1,029,702	1,959,389	1,613,197	19,691	653	8,059
负债(不包括归属于份额持有人的 资产净值)	1,238,379	38,964	56,158,942	35,838,686	78,721,440	444,313	21,524,485	3,505,563	8,539,825	2,919,581	193,440	75,968
归属于份额持有人的资产净值	9,642,294	7,445,846	1,079,596,512	1,401,525,914	280,669,311	210,837,314	407,733,417	266,796,646	218,348,938	172,226,464	6,587,074	6,794,406

载于第22至170页的附注为本财务报表的组成部分。

中银香港盈荟系列

资产净值表 (续)
2021年6月30日

附注	中银香港全天候 中国收益基金		中银香港全天候 亚太高收益基金		中银香港全天候 短期债券基金		中银香港全天候 一带一路债券基金		中银香港全天候 大湾区策略基金		中银香港 全天候 亚洲高息 债券基金	
	2021年 港元	2020年 港元	2021年 美元	2020年 美元	2021年 美元	2020年 美元	2021年 美元	2020年 美元	2021年 美元	2020年 美元	2021年 美元	2020年 美元
资产												
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	123,422,091	121,863,925	14,215,299	11,894,653	54,654,849	177,751,545	26,338,311	21,939,579	221,440,689	184,320,363	35,590,043	
应收经纪人款项	9,966,760	-	1,544,569	-	11,276,604	1,421,741	3,526,411	-	15,785,947	-	2,493,612	
应收股息	555,953	708,989	21,423	35,149	-	36,909	-	10,777	-	7,150	-	
应收利息	-	-	-	-	4,819	193,469	-	-	-	-	-	
应收认购款项	-	-	60,089	-	-	-	-	-	-	-	-	
其他应收款项	-	-	-	-	-	52,398	-	-	-	-	-	
现金及现金等价物	3,321,241	9,098,749	180,158	671,487	35,125,400	138,593,344	1,681,838	1,008,472	4,259,100	6,023,860	2,198,287	
总资产	137,266,045	131,671,663	16,021,538	12,601,289	101,061,672	318,049,406	31,546,560	22,975,537	241,787,651	191,006,808	40,675,485	
负债												
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	216,469	-	38,423	-	132,900	1,033,320	125,920	-	362,234	-	109,702	
应付经纪人款项	10,156,163	3,092,837	1,561,038	-	6,773,761	4,401,542	2,659,774	-	11,636,124	2,299,820	2,896,088	
应付收益分配	306,937	378,874	44,793	49,309	-	-	95,206	76,659	668,092	552,475	147,250	
应付管理费	130,815	168,662	15,264	16,391	18,597	62,943	23,897	19,370	170,051	141,112	31,111	
应付受托人费用	20,000	21,290	2,500	2,661	5,826	21,290	2,987	2,661	21,123	18,425	3,897	
应付费用及其他应付款项	186,819	166,195	24,991	20,785	23,776	21,254	44,707	41,379	57,895	53,837	86,520	
应付赎回款项	212,359	-	-	25,872	57,027	-	114,021	38,822	5,157,625	98,799	1,931,397	
计息银行借款	-	-	-	-	2,512,293	-	-	-	-	-	-	
负债 (不包括归属于份额持有人的资产净值)	11,229,562	3,827,858	1,687,009	115,018	9,524,180	5,540,349	3,066,512	178,891	18,073,144	3,164,468	5,205,965	
归属于份额持有人的资产净值	126,036,483	127,843,805	14,334,529	12,486,271	91,537,492	312,509,057	28,480,048	22,796,646	223,714,507	187,842,340	35,469,520	

受托人

基金管理人

载于第22至170页的附注为本财务报表的组成部分。

中银香港盈荟系列

损益及其他全面收益表 截至2021年6月30日止年度／期间

附注	中银香港全天候 环球投资基金		中银香港全天候 中国高息债券基金		中银香港全天候 香港股票基金		中银香港全天候 在岸人民币股票基金		中银香港全天候 亚洲债券基金		中银香港全天候 亚洲(日本除外)股票基金	
	2021年 美元	2020年 美元	2021年 人民币	2020年 人民币	2021年 港元	2020年 港元	2021年 人民币	2020年 人民币	2021年 美元	2020年 美元	2021年 美元	2020年 美元
收益												
股息收入	47,819	31,536	386,822	494,067	3,767,325	5,202,791	3,960,792	3,790,066	2	4,516	166,283	155,269
银行存款利息收入	9	223	3,316	65,417	2,876	7,094	16,871	19,240	857	3,481	19	75
其他收入	-	-	79,598	76,264	-	-	-	-	4,425	777	-	17,054
以公允价值计量且其变动计入当期损益的 金融资产及金融负债的净利得/(净损失)	1,403,093 (1,208)	392,763 2,717	(79,269,282) 153,710,567	52,161,874 (40,313,754)	62,226,875 227,660	(5,587,603) 68,305	74,583,691 147,157	94,928,991 (30,927)	13,817,508 (12,154)	3,642,191 (21,650)	1,843,033 (2,571)	164,168 (316)
汇兑净利得/(净损失)	1,449,713	427,239	74,911,021	12,483,868	66,224,736	(309,413)	78,708,511	98,707,370	13,810,638	3,629,315	2,006,764	336,250
总收入/(亏损)	76,950	55,823	12,437,690	15,632,183	2,516,705	2,220,620	5,502,081	4,400,156	1,755,756	1,018,363	51,029	33,009
费用												
管理费	30,000	30,000	1,450,874	1,770,370	327,335	281,482	402,577	315,471	237,963	143,791	30,000	30,000
受托人费用	11,167	5,321	230,825	379,741	157,038	93,314	274,740	272,985	53,121	38,621	11,748	6,994
次保管人费用	24,400	20,700	161,356	145,663	247,423	223,702	241,417	225,661	24,400	20,700	24,400	20,700
审计师酬金	41,143	3,405	51,300	100,640	6,097,334	865,178	2,683,371	1,245,446	15,173	10,010	63,291	16,379
佣金及交易成本	455	771	65,635	183,824	53,880	25,238	53,560	27,585	27,666	12,034	15,928	698
法律及专业服务费用	10,735	10,110	189,733	209,347	118,405	118,180	104,902	85,436	24,618	24,898	11,766	12,042
其他费用	194,850	126,130	14,587,413	18,421,768	9,518,120	3,827,714	9,262,648	6,572,740	2,138,697	1,268,417	208,162	119,822
营业费用总额	1,254,863	301,109	60,323,608	(5,937,900)	56,706,616	(4,137,127)	69,445,863	92,134,630	11,671,941	2,360,898	1,798,602	216,428
经营利润/(亏损)	-	-	(49,545,119)	(63,448,204)	56,706,616	(4,137,127)	69,445,863	92,134,630	(7,113,119)	(4,222,351)	-	-
财务费用												
向份额持有人作出的分配	1,254,863	301,109	10,778,489	(69,386,104)	56,706,616	(4,137,127)	69,445,863	92,134,630	4,558,822	(1,861,453)	1,798,602	216,428
税前利润/(亏损)	(7,355)	(6,570)	-	-	(191,919)	(291,156)	(361,580)	(384,141)	(10,776)	-	(18,125)	(20,851)
预扣税	1,247,510	294,539	10,778,489	(69,386,104)	56,514,697	(4,428,283)	69,084,283	91,750,489	4,548,046	(1,861,453)	1,780,477	195,577
归属于份额持有人的资产净值变动	1,240,155	287,969	10,771,110	(69,386,104)	56,322,777	(4,719,410)	68,722,766	91,366,348	4,537,270	(1,863,306)	1,762,312	194,726

载于第22至170页的附注为本财务报表的组成部分。

中银香港盈荟系列

损益及其他全面收益表(续)
截至2021年6月30日止年度/期间

	中银香港全天候 中国收益基金		中银香港全天候 亚太高收益基金		中银香港全天候 短期债券基金		中银香港全天候 一带一路债券基金		中银香港全天候 大湾区策略基金		中银香港 全天候 亚洲高息 债券基金	
	2021年 港元	2020年 港元	2021年 美元	2020年 美元	2021年 美元	2020年 美元	2021年 美元	2020年 美元	2021年 美元	2020年 ¹ 美元	2021年 ² 美元	
收益												
股息收入	2,590,291	3,169,744	243,670	313,064	19	36,909	16,800	18,119	4	7,150	-	
银行存款利息收入	324	2,936	83	324	527,719	1,733,290	352	928	1,076	32,987	272	
其他收入	4,322	1,507	-	48,474	18,512	6,052	558	193	3,476	32,874	2,250	
以公允价值计量且其变动计入当期损益的 金融资产及金融负债的净利得/(净损失)	7,581,717	(17,158,168)	2,363,133	(491,018)	10,522,828	5,503,319	2,694,330	1,157,971	8,595,027	6,483,333	3,218,777	
汇兑净利得/(净损失)	(28,706)	431	6,172	(906)	(1,005,304)	355,916	30,219	12,577	(42,386)	18,841	1,851	
总收入/(亏损)	10,147,948	(13,983,550)	2,613,058	(130,062)	10,063,774	7,635,486	2,742,259	1,189,788	8,557,197	6,575,185	3,223,150	
费用												
管理费	1,796,111	2,570,709	201,050	211,147	444,941	457,509	275,848	247,220	2,018,795	1,792,470	347,853	
受托人费用	240,000	242,693	30,000	30,000	184,014	150,627	34,519	32,125	251,230	211,578	43,562	
次保管人费用	136,585	206,666	18,645	15,479	34,169	22,321	19,646	20,892	52,300	52,295	17,449	
审计师酬金	189,245	161,346	24,400	20,700	24,400	20,650	24,400	19,650	24,350	20,750	23,100	
佣金及交易成本	790,286	503,009	147,601	17,733	7,455	6,921	11,757	10,591	13,758	13,610	6,833	
开办费用	-	-	-	-	-	-	-	-	-	80,000	80,000	
法律及专业服务费用	6,597	21,221	11,595	1,685	8,613	15,325	1,641	3,071	11,483	17,716	1,465	
其他费用	80,755	97,553	11,913	11,325	28,374	58,028	10,923	11,743	33,803	42,533	14,079	
营业费用总额	3,239,579	3,803,197	445,204	308,069	731,966	731,381	378,734	345,292	2,407,719	2,230,952	534,341	

中银香港盈荟系列

损益及其他全面收益表(续)
截至2021年6月30日止年度/期间

附注	中银香港全天候 中国收益基金		中银香港全天候 亚太高收益基金		中银香港全天候 短期债券基金		中银香港全天候 一带一路债券基金		中银香港全天候 大湾区策略基金		中银香港 全天候 亚洲高息 债券基金	
	2021年 港元	2020年 港元	2021年 美元	2020年 美元	2021年 美元	2020年 美元	2021年 美元	2020年 美元	2021年 美元	2020年 ¹ 美元	2021年 ² 美元	
经营利润/(亏损)	6,908,369	(17,786,747)	2,167,854	(438,131)	9,331,808	6,904,105	2,363,525	844,496	6,149,478	4,344,233	2,688,809	
财务费用	(4,147,192)	(5,947,896)	(608,724)	(650,528)	-	-	(1,087,203)	(975,539)	(7,965,629)	(6,156,176)	(1,379,689)	
向份额持有人作出的分配	2,761,177	(23,734,643)	1,559,130	(1,088,659)	9,331,808	6,904,105	1,276,322	(131,043)	(1,816,151)	(1,811,943)	1,309,120	
税前利润/(亏损)	(8,366)	(66,290)	(53,998)	(30,926)	-	-	(8,746)	(1,163)	-	-	-	
预扣税												
归属于份额持有人的资产净值变动	2,662,811	(23,800,933)	1,523,132	(1,119,585)	9,331,808	6,904,105	1,267,576	(132,206)	(1,816,151)	(1,811,943)	1,309,120	

本年度/期间应付及宣派收益分配的详情披露于本财务报表附注17内。

¹ 自2019年4月8日(开始营运日期)至2020年6月30日止期间。

² 自2020年6月29日(开始营运日期)至2021年6月30日止期间。

载于第22至170页的附注为本财务报表的组成部分。

中银香港盈荟系列

归属于份额持有人的资产净值变动表 截至2021年6月30日止年度 / 期间

	中银香港全天候 环球投资基金 份额数目	美元	中银香港全天候 中国高息债券基金 份额数目	人民币	中银香港全天候 香港股票基金 份额数目	港元	中银香港全天候 在岸人民币股票基金 份额数目	人民币	中银香港全天候 亚洲债券基金 份额数目	美元	中银香港全天候 亚洲(日本除外)股票基金 份额数目	美元
于2019年7月1日的余额	3,745,947,8200	6,425,369	149,646,253,0490	1,868,670,513	17,708,094,4930	239,227,644	32,253,421,4650	265,955,560	19,990,444,3440	52,339,720	3,421,590,6570	5,402,903
认购份额												
- A1类份额	2,286,4020	24,190	4,984,195,4830	50,764,050	4,154,835,4320	42,514,869	172,521,7220	1,622,274	6,957,317,5150	71,472,495	28,570,6020	289,459
- A2类份额	1,298,325,5750	1,759,376	456,139,2980	29,580,724	1,422,1550	118,673	77,035,0670	4,527,153	49,765,036,8120	65,522,315	505,053,0670	667,790
- A3类份额	760,7530	7,653	7,266,943,7130	59,659,745	14,397,9290	803,236	1,261,536,8020	8,627,925	-	-	-	-
- A4类份额	-	-	148,608,6020	7,073,624	-	-	-	-	-	-	-	-
- A7类份额	-	-	-	-	-	-	-	-	13,106,528,5840	19,906,341	8,896,4130	12,509
- A8类份额	-	-	1,499,934,5160	94,089,180	55,383,1760	683,937	-	-	-	-	-	-
- A9类份额	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
- I1类份额	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
- X1类份额	-	-	-	-	744,274,8090	7,800,000	777,903,0430	6,900,000	1,820,900,3220	20,000,000	97,560,9750	1,000,000
- X2类份额	-	-	-	-	93,896,7130	7,826,900	-	-	-	-	-	-
赎回份额	1,301,372,7300	1,791,219	14,355,821,6120	241,167,323	5,064,210,2140	59,747,615	3,744,465,1660	32,108,425	71,649,783,2330	176,901,151	640,081,0570	1,969,758
- A1类份额	(4,173,4600)	(45,243)	(23,586,644,5060)	(244,226,808)	(6,037,797,2110)	(61,605,839)	(3,282,438,8770)	(28,932,300)	(1,926,922,1870)	(19,652,682)	(24,059,8950)	(250,598)
- A2类份额	(736,775,8640)	(1,006,827)	(2,111,285,4860)	(138,383,205)	(65,048,7140)	(5,299,255)	(630,242,0100)	(31,641,220)	(22,904,351,2350)	(29,627,739)	(366,711,7790)	(486,894)
- A3类份额	(1,248,9260)	(13,211)	(12,560,033,2040)	(103,165,665)	(12,517,2330)	(741,817)	(7,763,642,5670)	(52,453,094)	-	-	-	-
- A4类份额	-	-	(60,754,4250)	(2,568,426)	-	-	-	-	-	-	-	-
- A7类份额	-	-	-	-	(80,727,9720)	(1,042,612)	-	-	(3,940,261,9790)	(5,872,533)	(23,210,4740)	(36,340)
- A8类份额	-	-	(243,398,3230)	(16,481,714)	-	-	(462,537,0090)	(3,285,690)	-	-	-	-
- A9类份额	-	-	-	-	-	-	(777,903,0430)	(6,705,524)	-	-	-	-
- X1类份额	-	-	(10,000,000,0000)	(134,100,000)	(1,737,323,4680)	(15,020,139)	-	-	-	-	-	-
- X2类份额	(742,198,2500)	(1,065,281)	(48,562,115,9440)	(638,925,818)	(7,933,414,5980)	(83,709,662)	(12,916,763,5060)	(123,017,828)	(28,771,535,4010)	(55,152,954)	(413,982,1480)	(773,832)
归属于份额持有人的资产净值 增加 / (减少)	-	294,539	-	(69,386,104)	-	(4,428,283)	-	91,750,489	-	(1,861,453)	-	195,577
于2020年6月30日及2020年7月1日 的余额	4,305,122,3000	7,445,846	115,439,958,7170	1,401,525,914	14,838,890,1090	210,837,314	23,081,123,1250	266,796,646	62,898,692,1760	172,226,464	3,647,689,5660	6,794,406

载于第22至170页的附注为本财务报表的组成部分。

中银香港盈荟系列

归属于份额持有人的资产净值变动表(续)
截至2021年6月30日止年度/期间

	中银香港全天候 环球投资基金		中银香港全天候 中国高息债券基金		中银香港全天候 香港股票基金		中银香港全天候 在岸人民币股票基金		中银香港全天候 亚洲债券基金		中银香港全天候 亚洲(日本除外)股票基金	
	份额数目	美元	份额数目	人民币	份额数目	港元	份额数目	人民币	份额数目	美元	份额数目	美元
认购份额												
- A1类份额	11,683,1220	139,349	3,458,451,4480	35,460,529	3,584,648,2600	45,664,960	3,101,403,0380	39,235,680	4,552,033,6260	17,090,2950	231,399	
- A2类份额	2,350,040,1160	3,597,632	311,934,1460	19,900,042	45,319,6660	4,716,210	808,755,7030	65,133,974	30,048,891,1040	975,835,6990	1,629,262	
- A3类份额	-	-	9,032,103,7780	73,454,664	20,756,8630	1,339,753	9,417,205,4120	101,194,151	-	-	-	
- A4类份额	-	-	211,838,1550	9,955,525	-	-	-	-	-	-	-	
- A7类份额	-	-	-	-	156,137,1530	2,857,828	-	-	21,045,755,0150	33,852,420	195,531	
- A8类份额	-	-	462,096,7320	28,038,995	-	-	-	-	-	-	-	
- A9类份额	-	-	-	-	-	-	7,118,738,0260	68,242,893	-	-	-	
- I1类份额	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
- I2类份额	-	-	-	-	105,542,4270	11,631,650	253,432,7620	22,650,400	-	-	-	
- X1类份额	-	-	-	-	1,850,481,1250	25,000,000	-	-	-	-	-	
- X2类份额	-	-	-	-	-	-	1,074,498,5670	12,477,626	-	-	-	
- X3类份额	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	2,361,723,2380	3,736,981	13,476,424,2590	166,809,755	5,762,885,4940	91,210,401	21,774,033,5080	308,934,724	55,646,679,7450	1,084,237,7990	2,056,192	
赎回份额												
- A1类份额	(3,633,2910)	(42,959)	(21,291,328,1570)	(218,025,984)	(2,558,841,0060)	(33,629,904)	(2,545,778,1920)	(32,970,467)	(3,183,991,9170)	(13,875,3250)	(163,698)	
- A2类份额	(1,751,428,4070)	(2,745,084)	(852,276,1810)	(53,577,449)	(117,640,6180)	(11,539,587)	(923,909,2370)	(72,244,739)	(26,180,210,1180)	(610,483,4140)	(988,237)	
- A3类份额	-	-	(12,076,970,2210)	(98,203,522)	(39,413,7100)	(2,688,336)	(8,661,000,4540)	(86,344,942)	-	-	-	
- A4类份额	-	-	(111,917,4610)	(5,309,034)	-	-	-	-	-	-	-	
- A7类份额	-	-	-	-	(70,331,2040)	(1,103,914)	-	-	(7,123,235,9850)	(11,704,136)	(300,580)	
- A8类份额	-	-	(1,024,732,6630)	(62,401,657)	-	-	-	-	-	-	-	
- A9类份额	-	-	(4,486,251,8080)	(62,000,000)	(1,596,406,1860)	(19,313,084)	(4,629,498,8680)	(45,522,088)	-	-	-	
- X1类份额	-	-	-	-	(93,896,7130)	(9,618,276)	-	-	-	(50,000,0000)	(713,500)	
- X2类份额	-	-	-	-	-	-	-	-	-	(997,008,9730)	(1,877,986)	
	(1,755,061,6980)	(2,788,043)	(39,843,476,4910)	(499,517,646)	(4,476,529,4370)	(77,893,101)	(16,760,186,7510)	(237,082,236)	(36,487,438,0200)	(78,719,211)	(4,044,001)	
归属于份额持有人的资产净值 增加/(减少)	-	1,247,510	-	10,778,489	-	56,514,697	-	69,084,283	-	4,548,046	1,780,477	
于2021年6月30日的余额	4,911,783,8400	9,642,294	89,072,906,4850	1,079,596,512	16,125,246,166	280,669,311	28,094,969,8820	407,733,417	82,057,933,9010	2,908,530,7620	6,587,074	

归属于份额持有人的资产净值
增加/(减少)

于2021年6月30日的余额

载于第22至170页的附注为本财务报表的组成部分。

中银香港盈荟系列

归属于份额持有人的资产净值变动表(续) 截至2021年6月30日止年度/期间

	中银香港全天候 中国收益基金 份额数目	港元	中银香港全天候 亚太高收益基金 份额数目	美元	中银香港全天候 短期债券基金 份额数目	美元	中银香港全天候 一带一路债券基金 份额数目	美元	中银香港全天候 大湾区策略基金 份额数目	美元	中银香港全天候 亚洲高息债券基金 份额数目	美元
于2019年7月1日或开始营运日期的余额 ¹	16,688,181,5400	207,005,040	10,876,491,0940	17,183,293	30,890,255,5230	107,901,498	14,635,391,7090	26,144,245	-	-	不适用 ²	不适用 ²
认购份额	468,302,1970	4,063,568	40,025,3450	364,279	5,100,088,2660	52,786,848	384,425,8140	3,919,305	4,845,943,8630	49,084,506	不适用 ²	不适用 ²
- A1类份额	27,935,4880	1,933,504	549,595,6040	623,228	18,091,624,7000	23,919,038	2,807,199,3910	3,687,941	92,658,609,8670	120,005,090	不适用 ²	不适用 ²
- A2类份额	-	-	-	-	46,027,9170	69,173	-	-	35,700,195,7830	44,471,015	不适用 ²	不适用 ²
- A3类份额	-	-	-	-	-	-	-	-	2,803,612,6940	4,221,338	不适用 ²	不适用 ²
- A4类份额	169,974,2480	1,698,520	43,471,3900	253,570	-	-	3,103,701,7310	4,588,705	-	-	不适用 ²	不适用 ²
- A8类份额	-	-	37,003,2800	45,766	-	-	-	-	16,679,582,6470	24,461,134	不适用 ²	不适用 ²
- A11类份额	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	不适用 ²	不适用 ²
- C1类份额	-	-	-	-	1,224,017,7290	12,738,000	-	-	-	-	不适用 ²	不适用 ²
- II类份额	-	-	-	-	10,089,709,2330	104,984,900	-	-	500,000,0000	5,000,000	不适用 ²	不适用 ²
- I6类份额	-	-	-	-	12,493,790,1260	142,874,892	-	-	-	-	不适用 ²	不适用 ²
- XI类份额	-	-	-	-	288,361,7200	3,000,000	-	-	2,027,520,0120	20,000,000	不适用 ²	不适用 ²
赎回份额	666,211,9330	7,715,592	670,095,6190	1,288,843	47,333,619,6910	340,372,851	6,295,326,9360	12,195,951	155,215,464,8660	267,243,083	不适用 ²	不适用 ²
- A1类份额	(1,716,571,8650)	(14,986,593)	(200,571,1600)	(1,824,557)	(2,621,562,9550)	(27,284,905)	(291,346,2690)	(3,009,403)	(1,760,633,9120)	(18,021,123)	不适用 ²	不适用 ²
- A2类份额	(463,835,6490)	(31,328,493)	(2,182,596,9780)	(2,553,176)	(13,052,972,1900)	(17,274,759)	(5,704,692,5410)	(7,353,396)	(35,637,016,0360)	(45,294,452)	不适用 ²	不适用 ²
- A3类份额	-	-	-	-	(18,677,4870)	(28,173)	-	-	(4,817,314,2040)	(5,959,914)	不适用 ²	不适用 ²
- A4类份额	-	-	(15,147,9340)	(88,405)	-	-	-	-	(684,256,3090)	(1,032,347)	不适用 ²	不适用 ²
- A7类份额	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	不适用 ²	不适用 ²
- A8类份额	(1,719,879,4960)	(16,760,808)	(302,581,7110)	(398,142)	-	-	(3,355,819,5720)	(5,048,545)	(5,149,091,8570)	(7,280,964)	不适用 ²	不适用 ²
- A11类份额	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	不适用 ²	不适用 ²
- C1类份额	-	-	-	-	(243,197,9590)	(2,529,287)	-	-	-	-	不适用 ²	不适用 ²
- II类份额	-	-	-	-	(7,605,138,0600)	(79,246,666)	-	-	-	-	不适用 ²	不适用 ²
- XI类份额	-	-	-	-	(933,565,2640)	(9,622,571)	-	-	-	-	不适用 ²	不适用 ²
- X2类份额	-	-	-	-	(5,044,215,7090)	(6,683,036)	-	-	-	-	不适用 ²	不适用 ²
于2020年6月30日及2020年7月1日或 开始营运日期的余额 ²	(3,900,287,0100)	(63,075,894)	(2,700,897,7830)	(4,866,280)	(29,519,329,6240)	(142,669,397)	(9,351,858,3820)	(15,411,344)	(48,048,312,3180)	(77,588,800)	不适用 ²	不适用 ²
归属于份额持有人的资产净值 增加/(减少)	-	(23,800,933)	-	(1,119,585)	-	6,904,105	-	(132,206)	-	(1,811,943)	不适用 ²	不适用 ²
于2020年6月30日及2020年7月1日或 开始营运日期的余额 ²	13,454,106,4630	127,843,805	8,845,688,9300	12,486,271	48,704,545,5900	312,509,057	11,578,860,2630	22,796,646	107,167,152,5480	187,842,340	-	-

载于第22至170页的附注为本财务报表的组成部分。

中银香港盈荟系列

归属于份额持有人的资产净值变动表(续)
截至2021年6月30日止年度/期间

	中银香港全天候 中国收益基金		中银香港全天候 亚太高收益基金		中银香港全天候 短期债券基金		中银香港全天候 一带一路债券基金		中银香港全天候 大湾区策略基金		中银香港全天候 亚洲高息债券基金	
	份额数目	港元	份额数目	美元	份额数目	美元	份额数目	美元	份额数目	美元	份额数目	美元
认购份额												
- A1类份额	926,536,1650	7,782,881	124,493,7150	1,155,205	2,776,980,7270	29,066,791	260,784,7130	2,754,890	2,017,401,5500	20,605,521	1,260,104,62	12,720,487
- A2类份额	9,024,7070	583,392	2,500,606,0040	3,046,049	20,554,448,0070	27,739,712	2,878,057,6570	3,881,985	61,036,590,0330	79,230,486	17,068,882,54	22,283,842
- A3类份额	-	-	-	-	45,382,2730	69,440	-	-	12,452,433,8950	15,659,744	-	-
- A4类份额	-	-	10,274,4630	68,338	-	-	-	-	3,296,704,6980	4,988,656	327,826,74	2,311,702
- A7类份额	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	183,423,80	2,332,824
- A8类份额	36,435,0180	380,323	663,521,0630	947,159	-	-	4,563,109,1180	7,553,569	-	-	-	-
- A9类份额	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
- A10类份额	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
- A11类份额	-	-	-	-	102,833,0980	1,075,000	-	-	14,026,605,0430	21,737,009	-	-
- C1类份额	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
- II类份额	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
- I6类份额	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
- X1类份额	2,668,213,4570	23,000,000	199,004,9750	2,000,000	3,124,596,8860	32,980,000	-	-	-	-	-	-
- X2类份额	-	-	-	-	80,940,908,1290	108,857,048	-	-	-	-	-	-
	3,640,209,3470	31,746,596	3,497,900,2200	7,216,751	107,545,149,1200	199,787,991	7,701,951,4880	14,190,444	92,829,735,2190	142,221,416	28,524,574,49	53,541,983
赎回份额												
- A1类份额	(2,955,682,4080)	(24,969,440)	(146,849,7780)	(1,382,637)	(6,259,092,1340)	(65,603,383)	(411,727,5840)	(4,354,800)	(1,563,460,5670)	(15,862,788)	(467,866,29)	(4,778,000)
- A2类份额	(105,904,6350)	(6,957,051)	(2,981,189,9280)	(3,637,339)	(19,705,700,6330)	(26,271,242)	(3,033,303,0160)	(4,082,354)	(40,532,344,2720)	(52,221,709)	(5,160,392,95)	(6,869,582)
- A3类份额	-	-	-	-	(24,684,6470)	(37,551)	-	-	(22,977,912,9720)	(28,856,663)	-	-
- A4类份额	-	-	(32,220,3370)	(235,391)	-	-	-	-	(640,548,9260)	(962,670)	(220,893,26)	(1,711,402)
- A7类份额	-	-	-	-	-	-	(810,850,1810)	(1,337,464)	-	-	(143,964,93)	(1,982,165)
- A8类份额	(436,189,2710)	(4,290,238)	(1,112,180,2590)	(1,636,258)	-	-	-	-	-	-	(1,122,317,90)	(1,791,455)
- A9类份额	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	(26,652,94)	(317,012)
- A10类份额	-	-	-	-	-	-	-	-	(4,259,206,3760)	(6,629,268)	-	-
- A11类份额	-	-	-	-	(1,083,652,8680)	(11,405,891)	-	-	-	-	-	-
- C1类份额	-	-	-	-	(2,260,390,6460)	(23,631,296)	-	-	-	-	-	-
- II类份额	-	-	-	-	(12,493,790,1260)	(155,852,672)	-	-	-	-	-	-
- I6类份额	-	-	-	-	(3,412,958,6060)	(36,420,238)	-	-	-	-	-	-
- X1类份额	-	-	-	-	(81,772,824,8410)	(110,869,091)	-	-	-	-	(1,397,949,68)	(1,931,969)
- X2类份额	(3,497,776,3140)	(36,216,729)	(4,272,440,3020)	(6,891,625)	(127,013,094,5010)	(430,091,364)	(4,255,880,7810)	(9,774,618)	(69,923,473,1130)	(104,533,098)	(8,540,037,95)	(19,381,583)

中银香港盈荟系列

归属于份额持有人的资产净值变动表(续) 截至2021年6月30日止年度 / 期间

归属于份额持有人的资产净值 增加 / (减少)	中银香港全天候 中国收益基金		中银香港全天候 亚太高收益基金		中银香港全天候 短期债券基金		中银香港全天候 一带一路债券基金		中银香港全天候 大湾区策略基金		中银香港全天候 亚洲高息债券基金	
	份额数日	港元	份额数日	美元	份额数日	美元	份额数日	美元	份额数日	美元	份额数日	美元
	-	2,662,811	-	1,523,132	-	9,331,808	-	1,267,576	-	(1,816,151)	-	1,309,120
于2021年6月30日的余额	13,596,539,4960	126,036,483	8,071,148,8480	14,334,529	29,236,600,2090	91,537,492	15,024,930,9700	28,480,048	130,073,414,6540	223,714,507	19,984,536,54	35,469,520

1 中银香港全天候大湾区策略基金的开始营运日期为2019年4月8日。

2 中银香港全天候亚洲高息债券基金的开始营运日期为2020年6月29日。

载于第22至170页的附注为本财务报表的组成部分。

中银香港盈荟系列

现金流量表 截至2021年6月30日止年度／期间

附注	中银香港全天候 环球投资基金		中银香港全天候 中国高息债券基金		中银香港全天候 香港股票基金		中银香港全天候 在岸人民币股票基金		中银香港全天候 亚洲债券基金		中银香港全天候 亚洲(日本除外)股票基金	
	2021年 美元	2020年 美元	2021年 人民币	2020年 人民币	2021年 港元	2020年 港元	2021年 人民币	2020年 人民币	2021年 美元	2020年 美元	2021年 美元	2020年 美元
经营活动产生的现金流量	1,254,863	301,109	10,778,489	(69,386,104)	56,706,616	(4,137,127)	69,445,863	92,134,630	4,558,822	(1,861,453)	1,798,602	216,428
调整：												
税前利润/(亏损)	(9)	(223)	(3,316)	(65,417)	(2,876)	(7,094)	(16,871)	(19,240)	(857)	(3,481)	(19)	(75)
银行存款利息收入	(47,819)	(31,536)	(386,822)	(494,067)	(3,767,325)	(5,202,791)	(3,960,792)	(3,790,066)	(2)	(4,516)	(166,283)	(155,269)
股息收入	-	-	49,545,119	63,448,204	-	-	-	-	7,113,119	4,222,351	-	-
向份额持有人作出收益分配	28,029,024	13,062,746	1,617,631,783	3,491,635,664	1,192,644,713	179,025,876	737,598,970	470,032,442	272,617,340	222,177,788	13,775,022	3,186,494
出售以公允价值计量且其变动计入当期损益 的金融工具的所得款项	(29,382,933)	(13,227,985)	(1,397,571,215)	(3,002,335,650)	(1,155,235,382)	(178,975,483)	(797,234,435)	(375,396,715)	(312,012,279)	(335,956,087)	(11,810,147)	(4,210,284)
购买以公允价值计量且其变动计入当期损益 的金融工具	(313,662)	(333,125)	68,985,604	59,199,398	(17,176,720)	11,863,029	68,964,877	(58,909,820)	(1,420,001)	(2,370,681)	(595,704)	(73,005)
以公允价值计量且其变动计入当期损益的 金融工具的未实现利得/损失变动净额	(1,089,431)	(59,638)	10,283,678	(111,361,272)	(45,050,155)	(6,275,426)	(143,548,568)	(36,019,171)	(12,397,507)	(1,271,510)	(1,247,329)	(91,163)
以公允价值计量且其变动计入当期损益的 金融工具的已变现(利得)/损失净额	(1,549,967)	(288,652)	359,263,320	430,640,756	28,118,871	(3,709,016)	(68,750,956)	88,032,060	(41,541,365)	(115,067,589)	1,754,142	(1,126,874)
经营资产及负债变动：	(994,081)	807,980	(14,261,351)	95,160,956	(79,042,948)	-	(14,211,012)	12,367,186	(4,461,386)	1,546,631	(132,065)	33,751
应收经纪人款项(增加)/减少	-	-	-	-	-	-	(198,846)	-	-	-	-	-
应收股息(增加)/减少	-	(1)	(49,937)	1,039	-	-	(23,007)	(58)	-	-	-	-
其他应收款项(增加)/减少	-	-	-	-	-	-	(20,804)	-	-	-	-	-
存款准备金(增加)/减少	1,204,995	(798,344)	11,887,481	(136,952,566)	63,040,108	-	18,711,487	(11,131,276)	3,368,661	(1,244,681)	117,962	(15,874)
应付经纪人款项增加/(减少)	1,581	1,208	(355,393)	(268,142)	48,238	(3,203)	143,846	24,894	34,424	89,324	1,283	1,404
应付管理费增加/(减少)	(161)	161	(34,393)	(28,288)	7,252	858	12,589	1,779	3,219	11,819	(161)	161
应付受托人费用增加/(减少)	2,817	897	186	2,706	20,482	4,384	107,501	90,952	1,677	(85)	2,755	(16,108)
应计费用及其他应付款项增加/(减少)	(1,334,816)	(276,751)	356,449,913	388,556,461	12,192,003	(3,706,977)	(64,229,202)	89,385,537	(42,594,965)	(114,664,581)	1,743,916	(1,123,540)
经营活动提供/(所用)的现金	10	223	3,316	65,417	2,876	7,094	16,871	19,240	857	3,481	19	75
已收利息	33,812	32,272	661,550	261,038	4,650,679	4,992,788	3,960,792	3,790,066	4,518	-	177,957	152,742
已收股息	(7,353)	(6,570)	-	-	(191,919)	(291,156)	(361,580)	(384,141)	(10,776)	-	(18,048)	(20,851)
已付税项	(1,308,347)	(250,826)	357,114,779	388,882,916	16,653,639	1,001,749	(60,613,119)	92,810,702	(42,600,366)	(114,661,100)	1,903,844	(991,574)
经营活动产生/(所用)的现金流量净额												

中银香港盈荟系列

现金流量表 (续) 截至2021年6月30日止年度 / 期间

附注	中银香港全天候 环球投资基金		中银香港全天候 中国高息债券基金		中银香港全天候 香港股票基金		中银香港全天候 在岸人民币股票基金		中银香港全天候 亚洲债券基金		中银香港全天候 亚洲(日本除外)股票基金	
	2021年 美元	2020年 美元	2021年 人民币	2020年 人民币	2021年 港元	2020年 港元	2021年 人民币	2020年 人民币	2021年 美元	2020年 美元	2021年 美元	2020年 美元
筹资活动产生的现金流量*												
发行份额所得的款项	3,732,689	1,791,219	158,631,861	239,301,663	91,174,690	59,747,615	308,183,683	31,888,544	120,126,675	178,342,764	2,043,506	1,969,758
赎回份额支付的款项	(2,798,240)	(1,057,411)	(498,739,166)	(643,436,812)	(62,813,410)	(83,805,172)	(238,011,923)	(121,311,370)	(77,125,705)	(55,133,263)	(4,051,407)	(765,773)
向份额持有人作出分配支付的款项	-	-	(45,896,021)	(60,469,591)	-	-	-	-	(6,311,896)	(3,510,154)	-	-
筹资活动产生 / (所用) 的现金流量净额	934,449	733,808	(386,003,326)	(464,604,740)	28,361,280	(24,057,557)	70,171,760	(89,422,826)	36,689,074	119,699,347	(2,007,901)	1,203,985
现金及现金等价物增加 / (减少) 净额	(373,898)	482,982	(28,888,547)	(75,721,824)	45,014,919	(23,055,808)	9,558,641	3,387,876	(5,911,292)	5,038,247	(104,057)	212,411
年初 / 期初现金及现金等价物	769,772	286,790	46,286,144	122,007,968	5,083,014	28,138,822	6,816,276	3,428,400	6,897,825	1,859,578	285,294	72,883
年末 / 期末现金及现金等价物	395,874	769,772	17,397,597	46,286,144	50,097,933	5,083,014	16,374,917	6,816,276	986,533	6,897,825	181,237	285,294
现金及现金等价物余额分析:												
银行现金	395,874	511,724	17,397,597	46,286,144	50,097,933	5,083,014	16,374,917	6,816,276	986,533	6,897,825	181,237	285,294
于存放时原到期日少于三个月的定期存款	-	258,048	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

载于第22至170页的附注为本财务报表的组成部分。

中银香港盈荟系列

现金流量表 (续)

截至2021年6月30日止年度 / 期间

	中银香港全天候中国收益基金		中银香港全天候亚太高收益基金		中银香港全天候短期债券基金		中银香港全天候一带一路债券基金		中银香港全天候大湾区策略基金		中银香港全天候亚洲高息债券基金	
	2021年	2020年	2021年	2020年	2021年	2020年	2021年	2020年	2021年	2020年	2021年 ²	美元
	港元	港元	美元	美元	美元	美元	美元	美元	美元	美元	美元	美元
附注												
经营活动产生的现金流量												
税前利润 / (亏损)	2,761,177	(23,734,643)	1,559,130	(1,088,659)	9,331,808	6,904,105	1,276,322	(131,043)	(1,816,151)	(1,811,943)	1,309,120	
调整：												
银行存款利息收入	(324)	(2,936)	(83)	(324)	(527,719)	(1,733,290)	(352)	(928)	(1,076)	(32,987)	(272)	
股息收入	(2,590,291)	(3,169,744)	(243,670)	(313,064)	(19)	(36,909)	(16,800)	(18,119)	(4)	(7,150)	-	
向份额持有人作出收益分配	4,147,192	5,947,896	608,724	650,528	-	-	1,087,203	975,539	7,965,629	6,156,176	1,379,689	
出售以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具的所得款项	362,468,579	718,943,718	42,462,995	19,995,930	565,861,762	206,247,053	97,859,681	92,470,765	315,321,626	373,103,474	76,790,388	
购买以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具	(356,228,559)	(651,526,546)	(42,382,085)	(16,322,717)	(433,142,658)	(314,698,652)	(99,438,163)	(86,955,803)	(343,484,211)	(550,940,504)	(109,051,952)	
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具的未变现利得 / 损失变动净额	(10,077,086)	11,328,555	(2,463,179)	1,060,350	(1,714,288)	(2,701,005)	(254,475)	266,144	545,372	(4,381,966)	(478,627)	
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具的已变现 (利得) / 损失净额	2,495,369	5,829,613	100,046	(569,332)	(8,808,540)	(2,802,314)	(2,439,855)	(1,424,115)	(9,140,399)	(2,101,367)	(2,740,150)	
经营资产及负债变动：												
应收经纪人款项 (增加) / 减少	2,976,057	63,615,913	(358,122)	3,412,712	131,000,346	(108,821,012)	(1,926,439)	5,182,440	(30,609,214)	(180,016,267)	(32,791,804)	
其他应收款项 (增加) / 减少	(9,866,760)	11,026,378	(1,544,569)	-	(9,854,863)	(1,421,741)	(3,526,411)	2,373,628	(15,785,947)	-	(2,493,612)	
应付经纪人款项增加 / (减少)	7,063,326	(13,518,085)	1,561,038	(262,875)	2,372,219	4,193,690	2,659,774	(2,337,728)	9,336,304	2,299,820	2,896,088	
应付管理费增加 / (减少)	(37,847)	(85,562)	(1,127)	(4,502)	(44,346)	40,207	4,527	(2,549)	28,939	141,112	31,111	
应付受托人费用增加 / (减少)	(1,290)	105	(161)	161	(15,464)	13,156	326	372	2,698	18,425	3,897	
应付费用及其他应付款项增加 / (减少)	20,624	(1,075)	4,206	(48,062)	2,522	1,297	3,328	(336)	3,578	53,837	86,520	

中银香港盈荟系列

现金流量表(续)
截至2021年6月30日止年度/期间

	中银香港全天候 中国收益基金		中银香港全天候 亚太高收益基金		中银香港全天候 短期债券基金		中银香港全天候 一带一路债券基金		中银香港全天候 大湾区策略基金		中银香港 全天候 亚洲高息 债券基金	
	2021年	2020年	2021年	2020年	2021年	2020年	2021年	2020年	2021年	2020年	2021年 ¹	2020年 ²
附注	港元	港元	美元	美元	美元	美元	美元	美元	美元	美元	美元	美元
经营活动提供/(所用)的现金	54,110	61,037,674	(338,735)	3,097,434	123,460,414	(105,994,403)	(2,784,894)	5,216,078	(37,023,642)	(177,503,073)	(32,267,800)	
已收利息	324	2,936	83	324	716,369	1,831,292	352	928	1,076	32,987	272	
已收股息	2,743,327	3,002,291	259,341	340,807	36,928	-	27,577	7,342	7,154	-	-	
已付税项	(98,366)	(66,290)	(37,944)	(30,926)	-	-	(8,746)	(1,163)	-	-	-	
经营活动产生/(所用)的现金流量净额	2,699,395	63,976,611	(117,255)	3,407,639	124,213,711	(104,163,112)	(2,765,711)	5,223,185	(37,015,412)	(177,470,086)	(32,267,528)	

载于第22至170页的附注为本财务报表的组成部分。

中银香港盈荟系列

现金流量表 (续)

截至2021年6月30日止年度 / 期间

附注	中银香港全天候 中国收益基金		中银香港全天候 亚太高收益基金		中银香港全天候 短期债券基金		中银香港全天候 一带一路债券基金		中银香港全天候 大湾区策略基金		中银香港 全天候 亚洲高息 债券基金	
	2021年 港元	2020年 港元	2021年 美元	2020年 美元	2021年 美元	2020年 美元	2021年 美元	2020年 美元	2021年 美元	2020年 ¹ 美元	2021年 ² 美元	
筹资活动产生的现金流*												
发行份额所得的款项	31,133,719	7,020,304	7,113,354	1,247,755	199,840,389	340,320,453	14,108,125	12,209,220	141,004,387	265,436,159	53,081,133	
赎回份额支付的款项	(36,004,370)	(63,259,145)	(6,917,497)	(4,899,416)	(430,034,337)	(143,844,825)	(9,699,419)	(16,158,444)	(99,474,272)	(77,490,001)	(17,450,186)	
向份额持有人作出分配支付的款项	(3,606,252)	(5,463,074)	(569,931)	(624,531)	-	-	(969,630)	(924,597)	(6,279,463)	(4,452,212)	(1,165,132)	
筹资活动产生 / (所用) 的现金流量净额	(8,476,903)	(61,701,915)	(374,074)	(4,276,192)	(230,193,948)	196,475,628	3,439,078	(4,873,821)	35,250,652	183,493,946	34,465,815	
现金及现金等价物增加 / (减少) 净额	(5,777,508)	2,274,696	(491,329)	(868,553)	(105,980,237)	92,312,517	673,366	349,364	(1,764,760)	6,023,860	2,198,287	
年初 / 期初现金及现金等价物	9,098,749	6,824,053	671,487	1,540,040	138,593,344	46,280,827	1,008,472	659,108	6,023,860	-	-	
年末 / 期末现金及现金等价物	3,321,241	9,098,749	180,158	671,487	32,613,107	138,593,344	1,681,838	1,008,472	4,259,100	6,023,860	2,198,287	
现金及现金等价物余额分析:												
银行现金	3,321,241	9,098,749	180,158	671,487	414,770	2,375,343	1,681,838	1,008,472	4,259,100	6,023,860	2,198,287	
于存放时原到期日少于三个月的定期存款	-	-	-	-	34,710,630	136,218,001	-	-	-	-	-	
银行透支, 无抵押	-	-	-	-	(2,512,293)	-	-	-	-	-	-	

* 股息人民币7,973,631元 (2020年: 人民币6,506,312元)、570,194美元 (2020年: 412,648美元)、604,914港元 (2020年: 700,598港元)、42,313美元 (2020年: 39,427美元)、104,741美元 (2020年: 60,959美元)、1,537,316美元 (2020年: 1,289,201美元) 及79,655美元已分别再投资给中银香港全天候中国高息债券基金、中银香港全天候亚洲债券基金、中银香港全天候中国收益基金、中银香港全天候亚太高收益基金、中银香港全天候一带一路债券基金、中银香港全天候大湾区策略基金及中银香港全天候亚洲高息债券基金。这些非现金股息再投资已于筹资活动的现金流量剔除。

¹ 自2019年4月8日 (开始营运日期) 至2020年6月30日止期间。

² 自2020年6月29日 (开始营运日期) 至2021年6月30日止期间。

载于第22至170页的附注为本财务报表的组成部分。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

1 基金及子基金

中银香港盈荟系列(“本基金”)是一种单位信托基金,由中银香港资产管理有限公司(基金管理人)与中银国际英国保诚信托有限公司(受托人)于2012年6月4日签订信托契约(经修订)(“信托契约”)进行管理。其根据香港法例成立,并受其监管。

本基金为伞子单位信托基金。基金管理人可在此伞子结构下创立不同子基金(“子基金”)。以不同货币计值的多个份额类别可在单一子基金中予以发行,而基金管理人可要求受托人创立与各子基金相关的额外份额类别。截至2021年6月30日,有十二个(2020年:十二个)已发行的子基金。

子基金各自开始营运日期及各子基金的已发行份额类别载列如下:

<u>子基金</u>	<u>开始营运日期</u>	<u>已发行份额类别(发行货币)</u>
中银香港全天候 环球投资基金	2012年9月28日	A1类(美元)
	2012年9月28日	A2类(港元)
	2014年7月29日	A3类(澳元)
	2017年3月30日	X2类(港元)
中银香港全天候 中国高息债券基金	2013年3月22日	A1类(人民币)
	2013年3月22日	A2类(美元)
	2013年3月22日	A3类(港元)
	2014年8月22日	A4类(澳元)
	2016年4月12日	A8类(美元)
	2016年3月30日	X1类(人民币)
中银香港全天候 香港股票基金	2013年7月19日	A1类(港元)
	2013年7月19日	A2类(美元)
	2014年7月24日	A3类(澳元)
	2014年7月23日	A7类(人民币)
	2014年12月9日	X1类(港元)
	2019年6月18日	I2类(美元)
2019年11月25日	X2类(美元)	
中银香港全天候 在岸人民币股票基金	2015年6月5日	A1类(人民币)
	2015年6月5日	A2类(美元)
	2015年6月5日	A3类(港元)
	2017年11月2日	A9类(港元)
	2021年2月19日	I2类(美元)
	2021年2月23日	X3类(港元)

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

1 基金及子基金(续)

<u>子基金</u>	<u>开始营运日期</u>	<u>已发行份额类别(发行货币)</u>
中银香港全天候 亚洲债券基金	2016年8月30日	A1类(美元)
	2016年8月30日	A2类(港元)
	2016年8月30日	A7类(人民币)
	2017年6月30日	X1类(美元)
中银香港全天候亚洲 (日本除外)股票基金	2017年4月24日	A1类(美元)
	2017年4月24日	A2类(港元)
	2017年4月24日	A7类(人民币)
	2017年4月25日	X2类(港元)
	2019年5月23日	X1类(美元)
	2019年10月17日	I1类(美元)
中银香港全天候 中国收益基金	2017年9月8日	A1类(港元)
	2017年9月8日	A2类(美元)
	2017年9月8日	A8类(人民币)
	2021年1月15日	X1类(港元)
中银香港全天候 亚太高收益基金	2018年3月23日	A1类(美元)
	2018年3月23日	A2类(港元)
	2018年3月23日	A4类(澳元)
	2018年3月23日	A8类(人民币)
	2021年1月15日	X1类(美元)
中银香港全天候 短期债券基金	2018年10月3日	A1类(美元)
	2018年10月3日	A2类(港元)
	2018年10月3日	A3类(人民币)
	2018年9月13日	I1类(美元)
	2018年9月13日	X1类(美元)
	2018年9月20日	X2类(港元)
	2020年1月2日	C1类(美元)
	2020年3月30日	I6类(欧元)
中银香港全天候 一带一路债券基金	2019年3月14日	A1类(美元)
	2019年3月14日	A2类(港元)
	2019年3月14日	A8类(人民币)

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

1 基金及子基金(续)

<u>子基金</u>	<u>开始营运日期</u>	<u>已发行份额类别(发行货币)</u>
中银香港全天候 大湾区策略基金	2019年4月8日	A1类(美元)
	2019年4月8日	A2类(港元)
	2019年4月8日	A3类(澳门元)
	2019年4月8日	A4类(人民币)
	2019年4月8日	I1类(美元)
	2019年4月8日	A11类(人民币)
	2020年5月5日	X1类(美元)
中银香港全天候 亚洲高息债券基金	2020年6月29日	A1类(美元)
	2020年6月29日	A2类(港元)
	2020年6月29日	A4类(澳元)
	2020年6月29日	A7类(英镑)
	2020年6月29日	A9类(人民币)
	2020年6月29日	A10类(欧元)
	2020年11月26日	X2类(港元)

所有子基金均为开放式单位信托基金，并由香港证券及期货事务监察委员会(“香港证监会”)根据证券及期货条例(“证券及期货条例”)第104(1)条予以认可，并须遵守香港证监会颁布的单位信托及互惠基金守则(“香港证监会守则”)。

2 重要会计政策摘要

用于编制这些财务报表的主要会计政策如下。

(a) 编制基础

财务报表是按照香港会计师公会颁布的香港财务报告准则(包括所有香港财务报告准则、香港会计准则及诠释)、香港公认会计原则、信托契约的相关披露条文及香港证监会守则附录E的相关披露条文而编制的。财务报表按照历史成本法编制，但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及负债则是以公允价值计量的，而除另有指明外，所有数值已四舍五入至最接近的整数。

编制符合香港财务报告准则的财务报表须使用若干主要会计估计，还需要受托人及基金管理人在应用会计政策的过程中作出判断。涉及更高级别判断或复杂的范畴，或涉及针对财务报表的重大假设及估计的范畴，在财务报表附注3内予以披露。

2 重要会计政策摘要(续)

(a) 编制基础(续)

除另有注明外，财务报表内所提及资产净值指归属于份额持有人的资产净值。

会计政策的变动及披露

子基金已就本年度的财务报表首次采纳与子基金相关的2018年财务报告概念框架及以下修订准则：

2018年财务报告概念框架(“概念框架”)

概念框架载列一套完整财务报告概念及准则设定，并为制订贯彻一致的会计政策的财务报表编制者提供指引以及协助各界了解及诠释准则。概念框架并非准则，且其载述的概念概不凌驾任何准则内的概念或规定。概念框架对子基金的财务状况及表现并无造成任何重大影响。

香港会计准则第1号及香港会计准则第8号的修订重大的定义

香港会计准则第1号及香港会计准则第8号的修订订明重大的新定义。新定义指出，若省略、错误或模糊陈述资料可以合理地预期会影响通用财务报表的主要用户根据有关财务报表所作出的决定，则资料属重大性质。这些修订澄清了重大与否取决于资料性质或程度。这些修订对子基金的财务状况及表现并无造成任何重大影响。

已颁布但尚未生效的香港财务报告准则

截至子基金的财务报表刊发日期，概无已颁布但尚未生效而基金管理人认为将明显影响子基金的准则及诠释。

2 重要会计政策摘要(续)

(b) 金融工具

(i) 分类

根据香港财务报告准则第9号，子基金于初始确认时将其金融资产及金融负债分类为下列论述的金融资产及金融负债类别。

于应用该分类时，如果出现下列情况，金融资产或金融负债被视为持作买卖：

- (a) 主要用作于不久将来出售或购回而购入或产生；或
- (b) 于初始确认时，为受共同管理的可识别金融工具组合的一部分且就此有证据证明短期盈利的近期实际模式；或
- (c) 属于衍生工具(属于金融担保合约或指定及有效对冲工具的衍生工具除外)。

金融资产

子基金按以下两个基准将其金融资产分类为其后按摊销成本计量或以公允价值计量且其变动计入当期损益：

- 该实体管理金融资产的商业模式
- 金融资产的合约现金流量特征

按摊销成本计量的金融资产

如果债务工具在目标为通过持有金融资产收取合约现金流量的业务模式下持有，而且其合约条款订明在指定日期产生的现金流量纯粹用作支付本金及未偿还本金的利息(“SPPI”)，则该债务工具按摊销成本计量。子基金将短期非融资应收款项(包括应收经纪人款项、应收股息、应收利息、应收认购款项、现金及现金等价物、其他应收款项及存款准备金)包括在此类别。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

2 重要会计政策摘要(续)

(b) 金融工具(续)

(i) 分类(续)

金融资产(续)

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

金融资产于下列情况下以公允价值计量且其变动计入当期损益：

- (a) 其合约条款并无订明于特定日期产生纯粹用作支付本金及未偿还本金的利息的现金流量；或
- (b) 其并非在目标为收取合约现金流量或同时收取合约现金流量及卖出的业务模式下持有；或
- (c) 于初始确认时，若不可撤回地指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益可消除或显著降低按不同基准计量资产或负债或确认其收益及亏损引致的计量或确认差异，则会作出有关指定。

子基金将下列项目包括在此类别：

- 持作买卖的工具。此类别包括主要为产生短期价格波动利润而购入的股本工具及债务证券。此类别亦包括资产持仓内的衍生工具合约。

金融负债

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

如果金融负债符合持作买卖的定义，则以公允价值计量且其变动计入当期损益。子基金将负债持仓内的衍生工具合约包括在此类别。

按摊销成本计量的金融负债

此类别包括所有金融负债，但以公允价值计量且其变动计入当期损益者除外。子基金将应付经纪人款项、应付收益分配、应付管理费、应付受托人费用、应计费用及其他应付款项以及应付赎回款项包括在此类别。

2 重要会计政策摘要(续)

(b) 金融工具(续)

(ii) 确认

子基金会于并仅会于成为工具合约条文的一方时确认金融资产或金融负债。

对于须按市场(常规买卖)规例或惯例通常确立的时限交收的金融资产买卖,会于交易日期(即子基金承诺购买或出售金融资产的日期)确认。

(iii) 初始计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债以公允价值于资产净值表入账。有关工具的所有交易成本直接于损益内确认。

金融资产及金融负债(以公允价值计量且其变动计入当期损益计量者除外)初始按公允价值计量,再加上任何直接应占收购或发行新增成本。

(iv) 后续计量

于初始计量后,子基金按公允价值计量被分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具。有关金融工具及债务证券利息收入成分的公允价值的后续变动于“以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及负债的收益或亏损净额”入账。银行存款所赚取利息及该等工具的股息收入部分会于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的“利息收入”及“股息收入”分别独立入账。

按摊销成本计量的金融资产使用实际利率法按摊销成本减任何减值准备列帐。收益及亏损会于贷款及应收款项被终止确认或出现减值时通过摊销程序于损益中确认。

金融负债(分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益者除外)使用实际利率法按摊销成本计量。收益及亏损会于负债被终止确认时通过摊销程序于损益中确认。

2 重要会计政策摘要(续)

(b) 金融工具(续)

(iv) 后续计量(续)

实际利率法是一种用于计算金融资产或金融负债的摊销成本及于相关期间分配利息收入或利息费用的方法。实际利率指将金融工具整个预计年期或(如适用)较短期限的估计未来现金付款或收款贴现为该金融资产或金融负债的帐面净值的利率。于计算实际利率时,子基金会考虑金融工具的所有合约条款后估计其现金流量,但不会考虑日后的信用亏损(“预期信用亏损”)。计算时会计入合约双方所支付或收取的所有费用,有关费用构成实际利率、交易成本及所有其他溢价或折让的一部分。

(v) 终止确认

金融资产(或金融资产的一部分或同类金融资产组别的一部分(如适用))于下列情况下被终止确认:

- 收取资产现金流量的权利已到期;或
- 子基金已转让其收取资产现金流量的权利,或已承担义务来根据转手安排向第三方支付已收取的全部现金流量且无重大延误,并且符合以下任一情况,(a)子基金已转让该资产的绝大部分风险及回报,或(b)子基金并未转让或保留该资产的绝大部分风险及回报,但已转让该资产的控制权。

如果子基金已转让其收取资产现金流量的权利或已签订转手安排,但并未转让或保留该资产绝大部分风险及回报,也未转让该资产的控制权,则该资产将被视为子基金持续参与的资产予以确认。在这种情况下,子基金还确认相关负债。已转让的资产及相关负债以能够反映子基金所保留的权利及责任为基础进行计量。

当负债项下的义务被解除、取消或失效时,子基金终止确认金融负债。

2 重要会计政策摘要(续)

(c) 金融资产减值

子基金就所有并非以公允价值计量且其变动计入当期损益的债务工具确认预期信用亏损准备。预期信用亏损乃基于根据合约到期收取的合约现金流量与子基金预期收取的所有现金流量的差额计量，并按原先实际利率的近似值贴现。预期现金流量将包括同为合约条款组成部分的自销售所持有抵押品所得的现金流量或其他信用提升项目。

一般方法

预期信用亏损于两个阶段获确认。就自初始确认起信用风险并无显著增加的信用风险而言，对因报告期末后12个月内可能发生的违约事件而导致的信用亏损计提预期信用亏损(12个月预期信用亏损)。就自初始确认起经已显著增加的信用风险而言，不论何时发生违约事件，均须于风险余下年期内就预期产生的信用亏损计提亏损准备(全期预期信用亏损)。

于各报告日期，子基金评估金融工具的信用风险自初始确认以来是否显著上升。于评估时，子基金会比较金融工具于报告日期发生违约的风险与金融工具于初始确认日期发生违约的风险，并考虑合理及具支持性且无须花费不必要成本或努力获取的资料，包括过往及前瞻性资料。

当内部或外来资料显示子基金不大可能于考虑子基金所持任何信用提升项目前全数收到尚未偿还的合约款项时，子基金可认为一项金融资产已属违约。当概无合理预期可收回合约现金流量时，一项金融资产即被撤销。

(d) 收入

当子基金收取款项的权利确定时，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产产生的股息收入计入损益。

银行存款的利息收入采用实际利率法按时间比例计入损益。

其他收入按权责发生制计入损益。

(e) 费用

费用按权责发生制计入损益。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

2 重要会计政策摘要(续)

(f) 外币折算

(i) 功能及列报货币

计入子基金财务报表的项目均采用子基金经营所在的主要经济环境的货币(“记账本位币”)计量。基金管理人认为最能如实反映相关交易、事件及条件的经济效应的货币为发行及赎回份额、表现衡量及向份额持有人呈报所用的货币,以及大多数费用及费用的结算均以中银香港全天候环球投资基金、中银香港全天候亚洲债券基金、中银香港全天候亚洲(日本除外)股票基金、中银香港全天候亚太高收益基金、中银香港全天候短期债券基金、中银香港全天候一带一路债券基金、中银香港全天候大湾区策略基金及中银香港全天候亚洲高息债券基金使用的美元(“美元”)、中银香港全天候中国高息债券基金及中银香港全天候在岸人民币股票基金使用的人民币(“人民币”)以及中银香港全天候香港股票基金及中银香港全天候中国收益基金使用的港元(“港元”)进行。

子基金已采纳记账本位币为列报货币,而财务报表以各自的记账本位币呈列。

(ii) 交易及余额

外币交易采用交易日的现行汇率折算为记账本位币。外币资产及负债采用年度结算日的现行汇率折算为记账本位币。

折算产生的汇兑利得与损失计入损益。

与现金及现金等价物相关的汇兑利得与损失在损益及其他全面收益表中的“汇兑净利得或净损失”内进行列报。

与以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及负债相关的汇兑利得与损失在损益及其他全面收益表中的“以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及负债的净利得或净损失”内列报。

(g) 金融工具的抵销

当存在法定可执行权利来抵销已确认的金额,并有意按净额结算或同时变现资产及结算负债时,金融资产与负债可互相抵销,并将净额在资产净值表内进行列报。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

2 重要会计政策摘要(续)

(h) 现金及现金等价物

就现金流量表而言，现金及现金等价物包括库存现金、存放于银行的活期存款，以及于存放时初始期限为三个月或以内的其他短期高流动性投资，并扣除银行透支。

(i) 可赎回份额

子基金发行可赎回份额，其可按份额持有人的选择赎回，并根据《香港会计准则第32号—金融工具：列报》(修订本)分类为金融负债。份额可按照赎回条款的规定由份额持有人随时赎回，以换取等同于子基金资产净值比例的现金。

可赎回份额的发行及赎回价格遵照持有人的选择并根据子基金在发行或赎回时的基金份额净值进行计算。子基金基金份额净值的计算方法为各类别归属于份额持有人的资产净值除以各类别尚未行使的份额总数。

如果持有人行使其权利赎回份额，则可赎回份额按照于报告日应付的赎回金额入账。

(j) 发行及赎回份额的所得款项及支付款项

子基金的资产净值须每日计算。根据最近可得的估值计算发行及赎回的价格。已发行及赎回份额的所得款项及支付款项在归属于份额持有人的资产净值变动表中进行列示。

(k) 开办费用

开办费用在产生时计入费用。

(l) 关联方

在下列情况下，一方被视为与子基金之间存在关联：

(i) 该方为符合以下条件的个人或符合以下条件的个人及其家庭的近亲：

- 可控制或共同控制子基金；
- 对子基金有重大影响力；或
- 为子基金或子基金母公司的主要管理人员的成员；

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

2 重要会计政策摘要(续)

(l) 关联方(续)

或

(ii) 该方为符合下列任何条件的实体：

- 该实体及子基金均是同一集团的成员公司；
- 一个实体是另一实体的联营公司或关联方(或是另一实体的母公司、子公司或关联方)；
- 实体与子基金均是同一第三方的关联方；
- 一个实体是第三方实体的关联方而另一实体则是该第三方实体的联营公司；
- 该实体为子基金或子基金相关实体的雇员提供雇员离职后福利计划；
- 该实体受(a)项中所识别的个人控制或共同控制；
- 在(a)(i)项中所识别的个人对该实体有重大影响力，或该个人是该实体(或是该实体的母公司)的主要管理人员的成员；及
- 该实体或该实体所属子基金的任何成员向子基金或子基金的母公司提供主要管理人员服务。

(m) 应收／应付经纪人款项

应收经纪人款项包括保证金帐户以及于报告日已签订但尚未交付的已出售证券(在正规途径交易中)应收的款项。

应付经纪人款项包括于报告日已签订但尚未交付的已购买证券(在正规途径交易中)应付的款项。

(n) 向份额持有人作出的收益分配

收益分配在基金管理人批准时确认为负债。收益分配由子基金酌情决定。向子基金份额持有人所作分配从归属于份额持有人的资产净值中扣除。在财务报表附注中披露拟进行的收益分配。

2 重要会计政策摘要(续)

(o) 税费

在一些管辖区内，股息收入、利息收入及资本利得须从收入来源中扣除预扣税。子基金在损益及其他全面收益表内将预扣税与投资收入总额分开列报。在现金流量表中，来自投资的现金流入在扣除预扣税后进行列报(如适用)。

(p) 结构化实体

结构化实体指为了使投票权或类似权利不会成为确定该实体控制方的主要因素而设立的实体，例如，当任何投票权仅与行政任务相关，且相关活动以合约安排为指导时。结构化实体通常具有以下部分或全部特征或特性：(a)受限制的活动，(b)有限且明确的目标，例如通过向投资者转移与结构化实体的资产相关的风险及回报而为投资者提供投资机会，(c)如果没有次级财务支持，则该实体缺乏足够的股本来为自身活动提供资金，以及(d)以多个合约相连工具向投资者提供资金，造成集中的信用或其他风险(层级)。

子基金将所有在子基金中的投资(“被投资基金”)视为在未合并结构化实体中的投资。子基金在被投资基金中的投资旨在实现中长期资本增长，且其投资策略并不包括使用杠杆。被投资基金由相同资产管理人管理并运用多项投资策略以实现其各自的投资目标。被投资基金通过发行可由持有人选择卖出的可赎回份额来提供自身运营资金，并在各基金的资产净值中赋予持有人一定比例的权益。子基金在被投资基金中的权益为其在该被投资基金中的投资于报告日的公允价值及本年度计入损益的相关净利得/(净损失)。

子基金于被投资基金的权益详情披露于财务报表附注12(f)。

3 重大会计估计及判断

(a) 重大会计估计及假设

基金管理人就未来作出估计及假设。按照定义，所作出的会计估计很少会与实际结果相同。基金管理人会持续评估估计，并以过往经验及其他因素作为估计的依据，包括预期在相关情况下被视为合理的未来事件。此外，子基金可不时持有并非在活跃市场报价的金融工具，例如无报价证券。相关工具的公允价值使用估值技术确定。公允价值估计基于市场情况及相关金融工具的资料作出。可造成须对资产及负债的帐面值作出大幅调整的重大风险的估计及假设概述如下。

投资公允价值

子基金持有大量非上市债务证券，其价值以经纪人报价为依据。在确定相关投资公允价值时，基金管理人来自经纪人的数据及所采用报价的数量及质量作出判断及估计。被采纳作为投资公允价值的报价具指针性参考价值，但无强制执行性，亦无法律约束力。因此，经纪人报价未必反映于报告期末证券可予买卖的实际价格。实际成交价可能有别于经纪人提供的报价。基金管理人认为，在无任何其他可靠的市场资料的情况下，这些从经纪人处取得的报价反映了对公允价值的最佳估计。

(b) 重大判断

编制财务报表时，基金管理人已作出若干判断，而其取决于未来发生的事项。基金管理人作出的判断可能与实际结果不符。对于基金作出的判断概述如下，另请参见财务报表附注5。

截至报告期末暂停交易的投资

若截至报告期末，存在暂停交易的上市投资，基金管理人已对有关投资的公允价值计量及公允价值层级作出判断。在不存在其他可靠的市场来源的情况下，基金管理人采用市场法，利用暂停交易前的最后成交价。已参考相关行业指数的回报率作出调整。若重大输入数据可观察，则未作出调整的暂停交易投资划分为第二层级。当调整成为不可观察的重大输入数据时，已作出调整的暂停交易投资划分为第三层级。

于2021年6月30日及2020年6月30日，子基金并无持有任何暂停交易的上市证券。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

3 重大会计估计及判断(续)

(b) 重大判断(续)

评估作为结构性实体的被投资基金

子基金评估其被投资基金是否应分类为结构性实体。子基金已考虑到给予这些基金的投资者投票权及其他类似权利，包括解除基金管理人或赎回持有量的权利。子基金已对这些权利是否为控制基金的主要因素或与基金管理人的合约协议是否为控制这些基金的主要因素得出结论。

子基金已得出结论，其所有基金管理人管理的被投资基金均为结构性实体(如财务报表附注2(p)所披露)。

4 费用

(a) 管理费

基金管理人有权就各子基金收取管理费，相关费用按子基金相关类别的基金份额的资产净值的某个百分比计算。管理费将从相关子基金的资产中扣除。截至2021年及2020年6月30日止年度/期间的现行管理费比率如下：

子基金	管理费比率(每年)															
	A1类 份额	A2类 份额	A3类 份额	A4类 份额	A7类 份额	A8类 份额	A9类 份额	A10类 份额	A11类 份额	C1类 份额	X1类 份额	X2类 份额	X3类 份额	I1类 份额	I2类 份额	I6类 份额
中银香港全天候环球投资基金	1.250%	1.250%	1.250%	不适用 ¹												
中银香港全天候中国高息债券基金	1.250%	1.250%	1.250%	1.250%	不适用 ¹	1.250%	不适用 ¹									
中银香港全天候香港股票基金	1.250%	1.250%	1.250%	不适用 ¹	1.250%	不适用 ¹	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ¹	不适用 ¹	0.875%	不适用 ¹				
中银香港全天候在岸人民币股票基金	1.750%	1.750%	1.750%	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ¹	1.750%	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ¹	不适用 ¹	0.875%	不适用 ¹
中银香港全天候亚洲债券基金	1.000%	1.000%	不适用 ¹	不适用 ¹	1.000%	不适用 ¹	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ¹				
中银香港全天候亚洲(日本除外) 股票基金	1.500%	1.500%	不适用 ¹	不适用 ¹	1.500%	不适用 ¹	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ¹	1.050%	不适用 ¹	不适用 ¹				
中银香港全天候中国收益基金	1.500%	1.500%	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ¹	1.500%	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ¹
中银香港全天候亚太高收益基金	1.500%	1.500%	不适用 ¹	1.500%	不适用 ¹	1.500%	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ¹
中银香港全天候短期债券基金	0.300%	0.300%	0.300%	不适用 ¹	0.300%	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ¹	0.200%	不适用 ¹	0.200%					
中银香港全天候一带一路债券基金	1.000%	1.000%	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ¹	1.000%	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ¹
中银香港全天候大湾区策略基金	1.000%	1.000%	1.000%	1.000%	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ¹	1.000%	不适用 ¹	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ¹	0.700%	不适用 ¹	不适用 ¹
中银香港全天候亚洲高息债券基金	1.250%	1.250%	不适用 ¹	1.250%	1.250%	不适用 ¹	1.250%	1.250%	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ¹

¹ 该等份额类别并无于2021年及2020年6月30日发行。

² X类份额毋须支付管理费。

管理费在每个交易日计算及累计并按月到期支付。

中银香港盈荟系列

财务报表附注 2021年6月30日

4 费用(续)

(a) 管理费(续)

诚如附注12(f)披露，基金管理人及其关联人或会收取首次认购费用及转换费用。

(b) 受托人费用

受托人有权在各子基金的首个会计期间收取成立费。成立费在子基金的首个会计期间计入开办费用。受托人在各子基金的首个会计期间收取各子基金相关开办费用2,500美元(等同于20,000港元及人民币15,000元)。

受托人有权就各子基金收取下列受托人费用。截至2020年及2019年6月30日止年度/期间的受托人费用现行水平列示如下：

<u>子基金</u>	<u>受托人费用比率(每年)</u>
中银香港全天候环球投资基金、中银香港全天候亚洲债券基金、中银香港全天候亚洲(日本除外)股票基金、中银香港全天候亚太高收益基金中银香港全天候一带一路债券基金、中银香港全天候大湾区策略基金及中银香港全天候亚洲高息债券基金	各类子基金资产净值首25,000,000美元的0.125%； 各类子基金资产净值下一25,000,000美元的0.10%； 各类子基金资产净值余额的0.0875%； 受最低月费2,500美元所限。
中银香港全天候短期债券基金	各类子基金资产净值的0.075%； 受最低月费2,500美元所限。

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2021年6月30日

4 费用(续)

(b) 受托人费用(续)

<u>子基金</u>	<u>受托人费用比率(每年)</u>
中银香港全天候 中国高息债券基金	各类子基金资产净值首人民币200,000,000元的0.125% ; 各类子基金资产净值下一人民币200,000,000元的0.10% ; 各类子基金资产净值余额的0.0875% ; 受最低月费人民币15,000元所限。
中银香港全天候 在岸人民币股票基金	各类子基金资产净值首人民币200,000,000元的0.125% ; 各类子基金资产净值下一人民币200,000,000元的0.10% ; 各类子基金资产净值余额的0.0875% ; 受最低月费人民币20,000元所限。
中银香港全天候 香港股票基金及 中银香港全天候 中国收益基金	各类子基金资产净值首200,000,000港元的0.125% ; 各类子基金资产净值下一200,000,000港元的0.10% ; 各类子基金资产净值余额的0.0875% ; 受最低月费20,000港元所限。

受托人费用在每个交易日计算及累计并按月到期支付。

诚如财务报表附注12所详述，受托人亦有权收取由受托人与基金管理人不时协定的交易费用及次保管人费用，并分别在损益表内确认为佣金及交易成本以及次保管人费用。

5 税费

香港

由于子基金已根据证券及期货条例第104条获授权为集合投资计划，因此根据香港税务条例第26A(1A)条获豁免缴纳利得税，故此并未就香港利得税作出准备。

中华人民共和国（“中国内地”）

子基金通过人民币合格境外机构投资者（“RQFII”）配额直接投资在中国内地上市的中国A股，以及投资在香港上市的中国H股。

中国有关资本利得的预扣税

据基金管理人的意向，是在并非身为中国税务居民企业及并无设立可被征收企业所得税（“企业所得税”）的营业处所或地点的情况下，来营运基金管理人及子基金的事务，尽管这并不获保证。因此，以估计为基础，子基金应毋须缴纳企业所得税，而应只须缴纳中国预扣税，但以子基金就其在中国的投资直接产生的源自中国的收入为限。

中国财政部（“财政部”）、中国国家税务总局（“国税局”）及中国证券监督管理委员会（“中证监”）联合颁布《财税[2014]79号—关于合格境外机构投资者（“QFII”）和RQFII取得中国境内的股票等权益性投资资产转让所得暂免征收企业所得税问题的通知》（“79号文”）。根据79号文，自2014年11月17日起，QFII及RQFII从出售权益性投资变现的资本利得暂免征收中国内地预扣税。

由于获79号文的暂免征收，子基金自2014年11月17日起暂缓为透过RQFII配额直接投资中国A股的资本利得作出预扣税准备。

5 税费(续)

中华人民共和国(“中国内地”)(续)

中国有关资本利得的预扣税(续)

财政部、国税局及中证监亦已联合发出有关沪港通税务处理的通知(《财税[2014]81号—关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》)(“81号文”),列明香港及境外投资者(包括子基金)通过沪港通买卖中国A股的利得暂获豁免企业所得税、个人所得税及营业税。另外,财政部、国税局及中证监已联合发出有关深港通税务处理的通知(《财税[2016]127号—关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》)(“127号文”),列明香港及境外投资者(包括子基金)通过深港通买卖中国A股的利得暂获豁免企业所得税及个人所得税。

鉴于子基金于2014年11月17日之后开始通过股票市场交易互联互通机制投资中国A股,根据81号文及127号文,子基金投资中国A股所得的资本利得暂获豁免中国内地预扣税,因此概无就子基金通过股票市场交易互联互通机制投资中国A股所得的已变现及未变现资本利得总额计提中国内地预扣税准备。

中国利息/股息预扣税

子基金就投资中国A股及H股所得股息收入须缴纳预扣税。该等投资收入的预扣税计入子基金的损益表的“预扣税”项目内。

于2018年11月22日,财政部及国税局联合颁布《关于境外机构投资境内债券市场企业所得税及增值税(“增值税”)政策的通知》(财税[2018]108号)(“108号文”)。根据108号文,自2018年11月7日起至2021年11月6日止,对境外机构投资境内债券市场取得的债券利息收入暂免征收预扣税及增值税。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

6 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及负债

	中银香港全天候 环球投资基金		中银香港全天候 中国高息债券基金		中银香港全天候 香港股票基金	
	2021年	2020年	2021年	2020年	2021年	2020年
	美元	美元	人民币	人民币	港元	港元
以公允价值计量且其变动 计入当期损益的金融资产						
集合投资计划	1,581,808	2,355,778	18,231,882	7,413,405	-	10,917,248
衍生工具(附注7)	-	6	2,224,146	1,062,878	-	137,966
上市权益性证券	4,816,037	321,656	-	-	229,920,314	193,966,200
存托凭证	120,160	129,420	-	-	-	-
挂牌债务证券	2,953,494	3,907,257	1,083,341,131	1,382,051,685	-	-
以公允价值计量且其 变动计入当期损益的 金融资产总额	<u>9,471,499</u>	<u>6,714,117</u>	<u>1,103,797,159</u>	<u>1,390,527,968</u>	<u>229,920,314</u>	<u>205,021,414</u>
以公允价值计量且其 变动计入当期损益的 金融负债						
衍生工具(附注7)	380	-	12,781,044	182,003	81,356	-
以公允价值计量且其 变动计入当期损益的 金融负债总额	<u>380</u>	<u>-</u>	<u>12,781,044</u>	<u>182,003</u>	<u>81,356</u>	<u>-</u>
以公允价值计量且其 变动计入当期损益的 金融资产及金融负债 的净利得/(净损失)						
已变现	1,089,431	59,638	(10,283,678)	111,361,272	45,050,155	6,275,426
未变现	313,662	333,125	(68,985,604)	(59,199,398)	17,176,720	(11,863,029)
净利得/(净损失)	<u>1,403,093</u>	<u>392,763</u>	<u>(79,269,282)</u>	<u>52,161,874</u>	<u>62,226,875</u>	<u>(5,587,603)</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2021年6月30日

6 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及负债(续)

	中银香港全天候 在岸人民币股票基金		中银香港全天候 亚洲债券基金		中银香港全天候 亚洲(日本除外)股票基金	
	2021年 人民币	2020年 人民币	2021年 美元	2020年 美元	2021年 美元	2020年 美元
以公允价值计量且其变动 计入当期损益的金融资产						
集合投资计划	-	-	2,602,774	4,209,006	608,055	1,084,153
衍生工具(附注7)	379,684	-	-	13,397	-	437
上市权益性证券	396,147,398	262,334,740	-	-	5,019,680	4,339,110
存托凭证	-	-	-	-	793,641	1,116,479
挂牌债务证券	-	-	217,986,432	162,682,171	-	-
以公允价值计量且其 变动计入当期损益的 金融资产总额	<u>396,527,082</u>	<u>262,334,740</u>	<u>220,589,206</u>	<u>166,904,574</u>	<u>6,421,376</u>	<u>6,540,179</u>
以公允价值计量且其 变动计入当期损益的 金融负债						
衍生工具(附注7)	-	26,814	472,185	-	3,039	-
以公允价值计量且其 变动计入当期损益的 金融负债总额	<u>-</u>	<u>26,814</u>	<u>472,185</u>	<u>-</u>	<u>3,039</u>	<u>-</u>
以公允价值计量且其 变动计入当期损益的 金融资产及金融负债 的净得/(净损失)						
已变现	143,548,568	36,019,171	12,397,507	1,271,510	1,247,329	91,163
未变现	(68,964,877)	58,909,820	1,420,001	2,370,681	595,704	73,005
净得/(净损失)	<u>74,583,691</u>	<u>94,928,991</u>	<u>13,817,508</u>	<u>3,642,191</u>	<u>1,843,033</u>	<u>164,168</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

6 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及负债(续)

	中银香港全天候 中国收益基金		中银香港全天候 亚太高收益基金		中银香港全天候 短期债券基金	
	2021年	2020年	2021年	2020年	2021年	2020年
	港元	港元	美元	美元	美元	美元
以公允价值计量且其变动 计入当期损益的金融资产						
集合投资计划	5,801,439	8,203,511	2,106,624	864,601	-	9,683,425
衍生工具(附注7)	-	31,896	-	1,897	37,928	339,245
上市权益性证券	92,051,647	51,142,797	8,878,280	4,955,430	-	-
存托凭证	2,321,299	-	573,604	429,466	-	-
挂牌债务证券	23,247,706	62,485,721	2,656,791	5,643,259	54,616,921	167,728,875
以公允价值计量且其 变动计入当期损益的 金融资产总额	<u>123,422,091</u>	<u>121,863,925</u>	<u>14,215,299</u>	<u>11,894,653</u>	<u>54,654,849</u>	<u>177,751,545</u>
以公允价值计量且其变动 计入当期损益的金融负债						
衍生工具(附注7)	216,469	-	38,423	-	132,900	1,033,320
以公允价值计量且其 变动计入当期损益的 金融负债总额	<u>216,469</u>	<u>-</u>	<u>38,423</u>	<u>-</u>	<u>132,900</u>	<u>1,033,320</u>
以公允价值计量且其 变动计入当期损益的 金融资产及金融负债 的净利得/(净损失)						
已变现	(2,495,369)	(5,829,613)	(100,046)	569,332	8,808,540	2,802,314
未变现	10,077,086	(11,328,555)	2,463,179	(1,060,350)	1,714,288	2,701,005
净利得/(净损失)	<u>7,581,717</u>	<u>(17,158,168)</u>	<u>2,363,133</u>	<u>(491,018)</u>	<u>10,522,828</u>	<u>5,503,319</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2021年6月30日

6 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及负债(续)

	中银香港全天候 一带一路债券基金		中银香港全天候 大湾区策略基金		中银香港 全天候 亚洲高息 债券基金
	2021年 美元	2020年 美元	2021年 美元	2020年 美元	2021年 美元
以公允价值计量且其变动计入 当期损益的金融资产					
集合投资计划	1,111,436	927,464	2,696,850	1,874,857	407,663
衍生工具(附注7)	-	3,412	-	12,292	-
上市权益性证券	1,961,015	1,179,978	-	-	-
存托凭证	-	-	-	-	-
挂牌债务证券	23,265,860	19,828,725	218,743,839	182,433,214	35,182,380
以公允价值计量且其变动计入 当期损益的金融资产总额	26,338,311	21,939,579	221,440,689	184,320,363	35,590,043
以公允价值计量且其变动计入 当期损益的金融负债					
衍生工具(附注7)	125,920	-	362,234	-	109,702
以公允价值计量且其变动计入 当期损益的金融负债总额	125,920	-	362,234	-	109,702
以公允价值计量且其变动计入 当期损益的金融资产及 金融负债的净利得/(净损失)					
已变现	2,439,855	1,424,115	9,140,399	2,101,367	2,740,150
未变现	254,475	(266,144)	(545,372)	4,381,966	478,627
净利得	2,694,330	1,157,971	8,595,027	6,483,333	3,218,777

中银香港盈荟系列

财务报表附注 2021年6月30日

7 衍生金融工具

子基金可根据基金说明书所述的各自投资策略投资于衍生金融工具以作投资或对冲用途。截至报告期末，子基金持有下列衍生工具：

	中银香港全天候 环球投资基金		中银香港全天候 中国高息债券基金		中银香港全天候 香港股票基金	
	2021年 美元	2020年 美元	2021年 人民币	2020年 人民币	2021年 港元	2020年 港元
金融资产						
外汇远期合约	-	6	2,224,146	1,062,878	-	137,966
金融负债						
外汇远期合约	380	-	12,781,044	182,003	81,356	-
	中银香港全天候 在岸人民币股票基金		中银香港全天候 亚洲债券基金		中银香港全天候 亚洲(日本除外)股票基金	
	2021年 人民币	2020年 人民币	2021年 美元	2020年 美元	2021年 美元	2020年 美元
金融资产						
外汇远期合约	379,684	-	-	13,397	-	437
金融负债						
外汇远期合约	-	26,814	472,185	-	3,039	-
	中银香港全天候 中国收益基金		中银香港全天候 亚太高收益基金		中银香港全天候 短期债券基金	
	2021年 港元	2020年 港元	2021年 美元	2020年 美元	2021年 美元	2020年 美元
金融资产						
外汇远期合约	-	31,896	-	1,897	37,928	339,245
金融负债						
外汇远期合约	216,469	-	38,423	-	132,900	1,033,320

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2021年6月30日

7 衍生金融工具(续)

	<u>中银香港全天候 一带一路债券基金</u>		<u>中银香港全天候 大湾区策略基金</u>		<u>中银香港 全天候 亚洲高息 债券基金</u>
	2021年 美元	2020年 美元	2021年 美元	2020年 美元	2021年 美元
金融资产					
外汇远期合约	<u>-</u>	<u>3,412</u>	<u>-</u>	<u>12,292</u>	<u>-</u>
金融负债					
外汇远期合约	<u>125,920</u>	<u>-</u>	<u>362,234</u>	<u>-</u>	<u>109,702</u>

外汇远期合约

外汇远期合约为于场外交易市场设定的指定日期按指定费率买卖外币的合约责任。

于报告期末，未到期外汇远期合约的详情如下：

中银香港全天候环球投资基金

于报告期末，未到期外汇远期合约的详情如下：

	<u>名义金额</u>	<u>公允价值</u>	
		<u>资产</u>	<u>负债</u>
		美元	美元
2021年6月30日			
购入澳元	16,604澳元	<u>-</u>	<u>380</u>
2020年6月30日			
购入澳元	13,149澳元	<u>6</u>	<u>-</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

7 衍生金融工具(续)

外汇远期合约(续)

中银香港全天候中国高息债券基金

	名义金额	公允价值	
		资产 人民币	负债 人民币
2021年6月30日			
购入美元	23,749,102美元	1,624,590	-
购入美元	6,248,145美元	590,490	-
购入美元	1,000,000美元	5,906	-
购入美元	1,500,000美元	3,160	-
卖出美元	1,200,000美元	-	2,290
购入澳元	4,699,232澳元	-	627,268
卖出美元	174,569,412美元	-	12,151,486
		<u>2,224,146</u>	<u>12,781,044</u>
2020年6月30日			
卖出美元	194,547,606美元	1,062,878	-
购入澳元	3,630,232澳元	-	14,973
购入美元	30,569,601美元	-	167,030
		<u>1,062,878</u>	<u>182,003</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

7 衍生金融工具(续)

外汇远期合约(续)

中银香港全天候香港股票基金

	<u>名义金额</u>	<u>公允价值</u>	
		<u>资产</u> 港元	<u>负债</u> 港元
2021年6月30日			
购入人民币	人民币3,220,651元	–	38,837
购入澳元	252,917澳元	–	42,519
		<u>–</u>	<u>81,356</u>

2020年6月30日

购入澳元	296,871澳元	136,735	–
购入人民币	人民币1,800,686元	1,231	–
		<u>137,966</u>	<u>–</u>

中银香港全天候在岸人民币股票基金

	<u>名义金额</u>	<u>公允价值</u>	
		<u>资产</u> 人民币	<u>负债</u> 人民币
2021年6月30日			
购入港元	52,454,688港元	<u>379,684</u>	<u>–</u>
2020年6月30日			
购入港元	9,665,253港元	<u>–</u>	<u>26,814</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2021年6月30日

7 衍生金融工具(续)

外汇远期合约(续)

中银香港全天候亚洲债券基金

	<u>名义金额</u>	<u>公允价值</u>	
		<u>资产</u> 美元	<u>负债</u> 美元
2021年6月30日			
购入人民币	人民币283,224,737元	—	472,185
		<u> </u>	<u> </u>
2020年6月30日			
购入人民币	人民币123,039,871元	13,397	—
		<u> </u>	<u> </u>

中银香港全天候亚洲(日本除外)股票基金

	<u>名义金额</u>	<u>公允价值</u>	
		<u>资产</u> 美元	<u>负债</u> 美元
2021年6月30日			
购入人民币	人民币1,693,039元	—	3,039
		<u> </u>	<u> </u>
2020年6月30日			
购入人民币	人民币1,799,227元	437	—
		<u> </u>	<u> </u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2021年6月30日

7 衍生金融工具(续)

外汇远期合约(续)

中银香港全天候中国收益基金

	<u>名义金额</u>	<u>公允价值</u>	
		<u>资产</u> 港元	<u>负债</u> 港元
2021年6月30日			
购入人民币	人民币517,982元	-	982
购入人民币	人民币17,110,539元	-	215,487
		-	216,469
2020年6月30日			
购入人民币	人民币19,985,447元	31,896	-

中银香港全天候亚太高收益基金

	<u>名义金额</u>	<u>公允价值</u>	
		<u>资产</u> 美元	<u>负债</u> 美元
2021年6月30日			
购入人民币	人民币10,293,246元	-	18,476
购入澳元	871,982澳元	-	19,947
		-	38,423
2020年6月30日			
购入澳元	946,021澳元	420	-
购入人民币	人民币13,570,603元	1,477	-
		1,897	-

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

7 衍生金融工具(续)

外汇远期合约(续)

中银香港全天候短期债券基金

	名义金额	公允价值	
		资产 美元	负债 美元
2021年6月30日			
卖出欧元	5,130,000欧元	30,973	—
卖出人民币	人民币20,000,000元	6,955	—
卖出人民币	人民币10,000,000元	—	758
卖出人民币	人民币15,000,000元	—	7,937
卖出人民币	人民币15,000,000元	—	45,522
购入欧元	5,130,000欧元	—	78,683
		37,928	132,900
		37,928	132,900
2020年6月30日			
购入欧元	60,000,000欧元	195,185	—
卖出人民币	人民币32,000,000元	105,001	—
卖出人民币	人民币5,800,000元	12,900	—
卖出欧元	1,328,000欧元	12,330	—
购入人民币	人民币16,400,000元	7,718	—
卖出人民币	人民币25,000,000元	4,773	—
购入人民币	人民币8,300,000元	1,338	—
卖出欧元	5,165,000欧元	—	6,340
卖出欧元	1,900,000欧元	—	21,800
购入人民币	人民币5,724,000元	—	24,434
购入欧元	70,000,000欧元	—	980,746
		339,245	1,033,320
		339,245	1,033,320

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2021年6月30日

7 衍生金融工具(续)

外汇远期合约(续)

中银香港全天候一带一路债券基金

	<u>名义金额</u>	<u>公允价值</u>	
		<u>资产</u> 美元	<u>负债</u> 美元
2021年6月30日			
购入人民币	人民币75,526,883元	-	125,920
2020年6月30日			
购入人民币	人民币31,336,883元	3,412	-

中银香港全天候大湾区策略基金

	<u>名义金额</u>	<u>公允价值</u>	
		<u>资产</u> 美元	<u>负债</u> 美元
2021年6月30日			
购入人民币	人民币217,267,818元	-	362,234
2020年6月30日			
购入人民币	人民币112,889,994元	12,292	-

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

7 衍生金融工具(续)

外汇远期合约(续)

中银香港全天候亚洲高息债券基金

	名义金额	公允价值	
		资产 美元	负债 美元
2021年6月30日			
购入澳元	62,000澳元	-	788
购入人民币	人民币2,700,000元	-	5,537
购入英镑	400,294英镑	-	14,394
购入欧元	352,255欧元	-	14,643
购入澳元	2,219,881澳元	-	29,382
购入人民币	人民币28,566,713元	-	44,958
		-	109,702
		-	109,702

金融工具的抵销

于报告期末，受可抵销、可强制执行主净额结算安排及类似协议限制的金融资产及负债如下：

中银香港全天候环球投资基金

	金融资产/ (负债)总额 美元	于资产 净值表抵销 的金融资产 /(负债) 总额 ¹ 美元	于资产 净值表 呈列的净额 美元	于资产净值表 未抵销的金额 ²		
				金融工具 美元	现金抵押 美元	风险净值 美元
2021年6月30日						
负债						
衍生工具	(380)	-	(380)	-	-	(380)
	(380)	-	(380)	-	-	(380)
2020年6月30日						
资产						
衍生工具	6	-	6	-	-	6
	6	-	6	-	-	6

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2021年6月30日

7 衍生金融工具(续)

金融工具的抵销(续)

中银香港全天候中国高息债券基金

	金融资产/ (负债)总额 人民币	于资产 净值表抵销 的金融资产 /(负债) 总额 ¹ 人民币	于资产 净值表 呈列的净额 人民币	于资产净值表 未抵销的金额 ²		风险净值 人民币
				金融工具 人民币	现金抵押 人民币	
2021年6月30日						
资产						
衍生工具	2,224,146	-	2,224,146	(2,224,146)	-	-
负债						
衍生工具	(12,781,044)	-	(12,781,044)	2,224,146	-	(10,556,898)
2020年6月30日						
资产						
衍生工具	1,062,878	-	1,062,878	(182,003)	-	880,875
负债						
衍生工具	(182,003)	-	(182,003)	182,003	-	-

中银香港全天候香港股票基金

	金融资产/ (负债)总额 港元	于资产 净值表抵销 的金融资产 /(负债) 总额 ¹ 港元	于资产 净值表 呈列的净额 港元	于资产净值表 未抵销的金额 ²		风险净值 港元
				金融工具 港元	现金抵押 港元	
2021年6月30日						
负债						
衍生工具	(81,356)	-	(81,356)	-	-	(81,356)
2020年6月30日						
资产						
衍生工具	137,966	-	137,966	-	-	137,966

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

7 衍生金融工具(续)

金融工具的抵销(续)

中银香港全天候在岸人民币股票基金

	金融资产/ (负债)总额 人民币	于资产 净值表抵销 的金融资产 /(负债) 总额 ¹ 人民币	于资产 净值表 呈列的净额 人民币	于资产净值表 未抵销的金额 ²		风险净值 人民币
				金融工具 人民币	现金抵押 人民币	

2021年6月30日

资产

衍生工具	379,684	-	379,684	-	-	379,684
------	---------	---	---------	---	---	---------

2020年6月30日

负债

衍生工具	(26,814)	-	(26,814)	-	-	(26,814)
------	----------	---	----------	---	---	----------

中银香港全天候亚洲债券基金

	金融资产/ (负债)总额 美元	于资产 净值表抵销 的金融资产 /(负债) 总额 ¹ 美元	于资产 净值表 呈列的净额 美元	于资产净值表 未抵销的金额 ²		风险净值 美元
				金融工具 美元	现金抵押 美元	

2021年6月30日

负债

衍生工具	(472,185)	-	(472,185)	-	-	(472,185)
------	-----------	---	-----------	---	---	-----------

2020年6月30日

资产

衍生工具	13,397	-	13,397	-	-	13,397
------	--------	---	--------	---	---	--------

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

7 衍生金融工具(续)

金融工具的抵销(续)

中银香港全天候亚洲(日本除外)股票基金

	金融资产/ (负债)总额 美元	于资产 净值表抵销 的金融资产 /(负债) 总额 ¹ 美元	于资产 净值表 呈列的净额 美元	于资产净值表 未抵销的金额 ²		风险净值 美元
				金融工具 美元	现金抵押 美元	
2021年6月30日						
负债						
衍生工具	(3,039)	-	(3,039)	-	-	(3,039)
2020年6月30日						
资产						
衍生工具	437	-	437	-	-	437

中银香港全天候中国收益基金

	金融资产/ (负债)总额 港元	于资产 净值表抵销 的金融资产 /(负债) 总额 ¹ 港元	于资产 净值表 呈列的净额 港元	于资产净值表 未抵销的金额 ²		风险净值 港元
				金融工具 港元	现金抵押 港元	
2021年6月30日						
负债						
衍生工具	(216,469)	-	(216,469)	-	-	(216,469)
2020年6月30日						
资产						
衍生工具	31,896	-	31,896	-	-	31,896

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

7 衍生金融工具(续)

金融工具的抵销(续)

中银香港全天候亚太高收益基金

	金融资产/ (负债)总额 美元	于资产 净值表抵销 的金融资产 /(负债) 总额 ¹ 美元	于资产 净值表 呈列的净额 美元	于资产净值表 未抵销的金额 ²		风险净值 美元
				金融工具 美元	现金抵押 美元	
2021年6月30日						
负债						
衍生工具	(38,423)	-	(38,423)	-	-	(38,423)
2020年6月30日						
资产						
衍生工具	1,897	-	1,897	-	-	1,897

中银香港全天候短期债券基金

	金融资产/ (负债)总额 美元	于资产 净值表抵销 的金融资产 /(负债) 总额 ¹ 美元	于资产 净值表 呈列的净额 美元	于资产净值表 未抵销的金额 ²		风险净值 美元
				金融工具 美元	现金抵押 美元	
2021年6月30日						
资产						
衍生工具	37,928	-	37,928	(37,928)	-	-
负债						
衍生工具	(132,900)	-	(132,900)	37,928	-	(94,972)
2020年6月30日						
资产						
衍生工具	339,245	-	339,245	(339,245)	-	-
负债						
衍生工具	(1,033,320)	-	(1,033,320)	339,245	-	(694,075)

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2021年6月30日

7 衍生金融工具(续)

金融工具的抵销(续)

中银香港全天候一带一路债券基金

	金融资产/ (负债)总额 美元	于资产 净值表抵销 的金融资产 /(负债) 总额 ¹ 美元	于资产 净值表 呈列的净额 美元	于资产净值表 未抵销的金额 ²		风险净值 美元
				金融工具 美元	现金抵押 美元	
2021年6月30日						
负债						
衍生工具	(125,920)	-	(125,920)	-	-	(125,920)

2020年6月30日

资产						
衍生工具	3,412	-	3,412	-	-	3,412

中银香港全天候大湾区策略基金

	金融资产/ (负债)总额 美元	于资产 净值表抵销 的金融资产 /(负债) 总额 ¹ 美元	于资产 净值表 呈列的净额 美元	于资产净值表 未抵销的金额 ²		风险净值 美元
				金融工具 美元	现金抵押 美元	
2021年6月30日						
负债						
衍生工具	(362,234)	-	(362,234)	-	-	(362,234)

2020年6月30日

资产						
衍生工具	12,292	-	12,292	-	-	12,292

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

7 衍生金融工具(续)

金融工具的抵销(续)

中银香港全天候亚洲高息债券基金

	金融资产/ (负债)总额 美元	于资产 净值表抵销 的金融资产 /(负债) 总额 ¹ 美元	于资产 净值表 呈列的净额 美元	于资产净值表 未抵销的金额 ² 金融工具 美元	现金抵押 美元	风险净值 美元
2021年6月30日						
负债						
衍生工具	(109,702)	-	(109,702)	-	-	(109,702)

¹ 包括受可强制执行主净额结算协议限制并可根据《香港会计准则第32号》予以抵销的金融工具。

² 包括受可强制执行主净额结算协议限制且不可根据《香港会计准则第32号》予以抵销但当发生违约者可予以抵销的金融工具。

8 应收/应付经纪人余额

	中银香港全天候 环球投资基金		中银香港全天候 中国高息债券基金		中银香港全天候 香港股票基金	
	2021年 美元	2020年 美元	2021年 人民币	2020年 人民币	2021年 港元	2020年 港元
应收经纪人款项						
就已出售但尚未偿付的 证券应收的款项	994,081	-	14,261,351	-	79,042,948	-
应付经纪人款项						
就已购买但尚未偿付的 证券应付的款项	1,204,995	-	28,144,449	16,256,968	63,040,108	-

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

8 应收／应付经纪人余额(续)

	中银香港全天候 在岸人民币股票基金		中银香港全天候 亚洲债券基金		中银香港全天候 亚洲(日本除外)股票基金	
	2021年 人民币	2020年 人民币	2021年 美元	2020年 美元	2021年 美元	2020年 美元
应收经纪人款项						
就已出售但尚未偿付的 证券应收的款项	<u>14,917,892</u>	<u>706,880</u>	<u>5,266,885</u>	<u>805,304</u>	<u>151,382</u>	<u>19,317</u>
应付经纪人款项						
就已购买但尚未偿付的 证券应付的款项	<u>19,418,017</u>	<u>706,530</u>	<u>5,668,481</u>	<u>2,299,820</u>	<u>158,867</u>	<u>40,905</u>
	中银香港全天候 中国收益基金		中银香港全天候 亚太高收益基金		中银香港全天候 短期债券基金	
	2021年 港元	2020年 港元	2021年 美元	2020年 美元	2021年 美元	2020年 美元
应收经纪人款项						
就已出售但尚未偿付的 证券应收的款项	<u>9,966,760</u>	<u>-</u>	<u>1,544,569</u>	<u>-</u>	<u>11,276,604</u>	<u>1,421,741</u>
应付经纪人款项						
就已购买但尚未偿付的 证券应付的款项	<u>10,156,163</u>	<u>3,092,837</u>	<u>1,561,038</u>	<u>-</u>	<u>6,773,761</u>	<u>4,401,542</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

8 应收／应付经纪人余额(续)

	中银香港全天候 一带一路债券基金		中银香港全天候 大湾区策略基金		中银香港 全天候 亚洲高息 债券基金
	2021年 美元	2020年 美元	2021年 美元	2020年 美元	2021年 美元
应收经纪人款项					
就已出售但尚未偿付的证券应收 的款项	3,526,411	-	15,785,947	-	2,493,612
应付经纪人款项					
就已购买但尚未偿付的证券应付 的款项	2,659,774	-	11,636,124	2,299,820	2,896,088

9 财务风险管理

本基金的业务面临多种财务风险：市场风险（包括价格风险、利率风险以及外汇风险）、流动风险及信用及交易对手风险。

子基金的投资受正常市场波动及投资证券时的其他固有风险的限制，且概不保证会有任何升值。投资价值及其收入会有波动，故可赎回份额的价值可跌可升。

子基金的投资目标列示如下：

<u>子基金</u>	<u>投资目标</u>
中银香港全天候 环球投资基金	通过主要投资于一个由股票、债券、交易所买卖基金(ETFs)、REITs、RQFII基金及其他资产组成的受管理投资组合，提供长远资本增值。
中银香港全天候 中国高息债券基金	通过主要投资于以人民币或其他货币计值的固定收益及债务证券，提供长期资本增值及人民币收益。子基金也可能投资于人民币存款。
中银香港全天候 香港股票基金	通过主要投资于香港市场的权益性证券，达致长远资本增值。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

<u>子基金</u>	<u>投资目标</u>
中银香港全天候 在岸人民币股票基金	通过RQFII主要投资于中国A股，达致长远资本增值。
中银香港全天候 亚洲债券基金	通过主要投资于由亚太区政府、政府机构、跨国实体、主要收入或主要业务或经济活动源自亚太区的银行或公司所发行的任何固定收益证券、或以亚太区货币计值的任何固定收益证券，以在中至长期提供收入及资本增值。
中银香港全天候 亚洲(日本除外)股票基金	通过主要投资于在亚洲(日本除外)上市或由在亚洲(日本除外)赚取大部分收益或进行重大业务或经济活动的公司发行的权益性证券，以提供长期资本增值。
中银香港全天候 中国收益基金	主要通过通过对包含中国内地、香港及澳门市场的固定收益证券及权益性证券的投资组合进行积极资产配置，以在中至长期实现长远资本增值。
中银香港全天候 亚太高收益基金	通过对包含相比其他同类证券提供较高收益的亚太区固定收益证券及权益性证券的投资组合进行积极资产配置，以在中至长期提供收入及资本增值。
中银香港全天候 短期债券基金	通过从一个由短存续期固定收益证券组成的受管理投资组合中提供收入及资本增值。
中银香港全天候 一带一路债券基金	通过主要投资于由一带一路沿线国家/地区(定义详见于基金相关附录及产品资料概要)的政府、政府机构、跨国实体或在一带一路沿线国家/地区注册成立或赚取大部分收益或有重大业务或经济活动的银行或公司所发行，或以有关一带一路沿线国家/地区的当地货币计值的固定收益证券，以在中至长期提供收入及资本增值。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

子基金

投资目标

中银香港全天候
大湾区策略基金

通过主要投资于由香港特别行政区和澳门特别行政区以及中国内地广东省的相关城市(“大湾区”)的政府、政府机构、跨国实体或在大湾区注册成立或赚取收益或有业务或经济活动的银行或公司所发行,或以大湾区货币(包括人民币、港元或澳门元)计值的固定收益证券以及存放于上述银行或金融机构的存款,以在中至长期提供收入及资本增值。

中银香港全天候
亚洲高息债券基金

通过主要投资于由政府、政府机构、跨国实体、在亚洲注册成立或其收入或业务或经济活动源自亚洲的银行或公司所发行的、或以任何亚洲货币计值的高息固定收益券,以及在上述银行及金融机构存款,以提供长远的资本增值及收入。

(a) 市场风险

市场风险指因为市场价格及息率变动等未知因素而导致损失的风险,其中包括可观测变数,例如利率、信用差额、汇率,以及其他只能间接观测的变量,例如波动性及关联系数。子基金内的衍生工具也可能使子基金受到市场波动的重大影响。市场风险包括经济环境、消费模式及投资者期望改变等因素,这些因素可能会对投资价值造成重大影响。市场波动因此可导致子基金份额的资产净值出现大幅波动。

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(a) 市场风险(续)

(i) 价格风险

子基金通过多元化投资组合以及投资于基础雄厚的证券来管理其市场价格风险。在报告期末，按地理位置划分的子基金的投资组合如下：

中银香港全天候环球投资基金

金融资产	2021年		2020年	
	公允价值 美元	占资产净值 的百分比 %	公允价值 美元	占资产净值 的百分比 %
集合投资计划				
香港	190,968	1.98	1,059,329	14.23
日本	80,718	0.84	—	—
美国	1,310,122	13.58	1,296,449	17.42
	<u>1,581,808</u>	<u>16.40</u>	<u>2,355,778</u>	<u>31.65</u>
上市权益性证券				
香港	3,724,240	38.62	321,656	4.32
美国	1,091,797	11.32	—	—
	<u>4,816,037</u>	<u>49.94</u>	<u>321,656</u>	<u>4.32</u>
挂牌债务证券				
澳大利亚	—	—	239,854	3.22
英属维尔京群岛	616,489	6.40	842,126	11.32
开曼群岛	610,238	6.33	1,232,447	16.54
中国内地	210,145	2.18	—	—
法国	223,087	2.31	387,443	5.20
德国	208,348	2.16	—	—
香港	200,434	2.08	—	—
印度	—	—	201,114	2.70
印度尼西亚	247,653	2.57	202,613	2.72
荷兰	223,028	2.31	201,130	2.70
瑞典	214,223	2.22	196,185	2.63
英国	—	—	404,345	5.43
美国	199,849	2.07	—	—
	<u>2,953,494</u>	<u>30.63</u>	<u>3,907,257</u>	<u>52.46</u>
存托凭证				
美国	—	—	129,420	1.74
台湾	120,160	1.25	—	—
	<u>9,471,499</u>	<u>98.22</u>	<u>6,714,111</u>	<u>90.17</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(a) 市场风险(续)

(i) 价格风险(续)

中银香港全天候中国高息债券基金

金融资产	2021年		2020年	
	公允价值 人民币	占资产净值 的百分比 %	公允价值 人民币	占资产净值 的百分比 %
集合投资计划				
卢森堡	6,672,282	0.62	7,413,405	0.53
香港	11,559,600	1.07	–	–
	<u>18,231,882</u>	<u>1.69</u>	<u>7,413,405</u>	<u>0.53</u>
挂牌债务证券				
澳大利亚	7,188,154	0.67	7,183,567	0.51
百慕大	34,261,580	3.18	12,251,451	0.88
英属维尔京群岛	160,590,690	14.88	244,529,299	17.47
开曼群岛	678,345,484	62.84	983,049,311	70.12
中国内地	46,611,355	4.31	–	–
香港	63,823,043	5.91	52,350,667	3.74
印度	8,414,590	0.78	13,489,221	0.95
印度尼西亚	4,489,510	0.42	6,229,413	0.44
马来西亚	–	–	3,403,118	0.24
毛里求斯	–	–	8,548,719	0.61
巴基斯坦	2,704,350	0.25	–	–
菲律宾	16,407,514	1.52	1,415,551	0.10
新加坡	40,211,490	3.72	45,335,844	3.24
斯里兰卡	8,151,263	0.76	4,265,524	0.30
英国	1,342,051	0.12	–	–
美国	10,800,057	1.00	–	–
	<u>1,083,341,131</u>	<u>100.36</u>	<u>1,382,051,685</u>	<u>98.60</u>
	<u>1,101,573,013</u>	<u>102.05</u>	<u>1,389,465,090</u>	<u>99.13</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(a) 市场风险(续)

(i) 价格风险(续)

中银香港全天候香港股票基金

金融资产	2021年		2020年	
	公允价值 港元	占资产净值 的百分比 %	公允价值 港元	占资产净值 的百分比 %
集合投资计划 香港	—	—	10,917,248	5.18
上市权益性证券				
香港	196,894,200	70.15	193,966,200	92.01
中国内地	33,026,114	11.77	—	—
	<u>229,920,314</u>	<u>81.92</u>	<u>193,966,200</u>	<u>92.01</u>
	<u>229,920,314</u>	<u>81.92</u>	<u>204,883,448</u>	<u>97.19</u>

中银香港全天候在岸人民币股票基金

金融资产	2021年		2020年	
	公允价值 人民币	占资产净值 的百分比 %	公允价值 人民币	占资产净值 的百分比 %
上市权益性证券				
中国内地	292,763,355	71.81	262,334,740	98.33
香港	103,384,043	25.35	—	—
	<u>396,147,398</u>	<u>97.16</u>	<u>262,334,740</u>	<u>98.33</u>

中银香港全天候亚洲债券基金

金融资产	2021年		2020年	
	公允价值 美元	占资产净值 的百分比 %	公允价值 美元	占资产净值 的百分比 %
集合投资计划				
澳大利亚	—	—	1,184,120	0.69
香港	2,602,774	1.20	3,024,886	1.76
	<u>2,602,774</u>	<u>1.20</u>	<u>4,209,006</u>	<u>2.45</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(a) 市场风险(续)

(i) 价格风险(续)

金融资产	2021年		2020年	
	公允价值 美元	占资产净值 的百分比 %	公允价值 美元	占资产净值 的百分比 %
挂牌债务证券				
澳大利亚	3,545,701	1.62	3,657,837	2.12
百慕大	3,806,942	1.74	1,779,016	1.04
英属维尔京群岛	36,268,612	16.62	30,559,667	17.74
加拿大	185,851	0.09	172,405	0.10
开曼群岛	69,205,099	31.68	61,721,909	35.85
中国内地	10,418,166	4.77	5,013,876	2.91
法国	568,873	0.26	1,558,588	0.91
香港	23,189,687	10.62	11,328,710	6.57
印度	13,140,911	6.02	5,835,594	3.39
印度尼西亚	7,629,110	3.49	10,326,600	6.00
Isle of Man	–	–	308,392	0.18
日本	3,097,604	1.42	3,010,042	1.74
韩国	3,109,691	1.42	2,099,253	1.22
澳门	523,722	0.24	514,437	0.30
马来西亚	6,087,869	2.79	1,392,364	0.81
毛里求斯	–	–	468,917	0.27
蒙古	196,278	0.09	213,765	0.12
荷兰	4,373,230	2.00	2,684,846	1.56
阿曼	–	–	190,471	0.11
巴基斯坦	522,713	0.24	–	–
菲律宾	8,071,456	3.71	3,350,786	1.94
沙特阿拉伯	1,592,571	0.73	–	–
新加坡	8,907,066	4.09	6,641,901	3.86
西班牙	–	–	584,673	0.34
斯里兰卡	1,008,336	0.46	1,180,612	0.68
瑞典	642,668	0.29	588,554	0.34
瑞士	534,725	0.24	–	–
泰国	4,446,444	2.04	2,803,869	1.62
阿联酋	–	–	521,495	0.30
英国	3,937,097	1.39	2,115,412	1.23
美国	3,391,111	1.55	1,838,000	1.07
乌兹别克斯坦	260,411	0.12	–	–
越南	224,488	0.10	220,180	0.13
	<u>217,986,432</u>	<u>99.83</u>	<u>162,682,171</u>	<u>94.45</u>
	<u>220,589,206</u>	<u>101.03</u>	<u>166,891,177</u>	<u>96.90</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(a) 市场风险(续)

(i) 价格风险(续)

中银香港全天候亚洲(日本除外)股票基金

金融资产	2021年		2020年	
	公允价值 美元	占资产净值 的百分比 %	公允价值 美元	占资产净值 的百分比 %
集合投资计划				
香港	165,000	2.50	153,461	2.26
新加坡	65,775	1.00	63,687	0.94
美国	377,280	5.73	867,005	12.76
	<u>608,055</u>	<u>9.23</u>	<u>1,084,153</u>	<u>15.96</u>
上市权益性证券				
香港	3,772,939	57.28	2,725,958	40.12
韩国	1,246,741	18.93	1,423,671	20.95
新加坡	–	–	189,481	2.79
	<u>5,019,680</u>	<u>76.21</u>	<u>4,339,110</u>	<u>63.86</u>
存托凭证				
台湾	540,720	8.21	340,620	5.01
英国	–	–	72,875	1.07
美国	252,921	3.84	702,984	10.35
	<u>793,641</u>	<u>12.05</u>	<u>1,116,479</u>	<u>16.43</u>
	<u><u>6,421,376</u></u>	<u><u>97.49</u></u>	<u><u>6,539,742</u></u>	<u><u>96.25</u></u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(a) 市场风险(续)

(i) 价格风险(续)

中银香港全天候中国收益基金

金融资产	2021年		2020年	
	公允价值 港元	占资产净值 的百分比 %	公允价值 港元	占资产净值 的百分比 %
集合投资计划				
澳大利亚	–	–	2,294,381	1.79
香港	5,801,439	4.61	5,909,130	4.63
	<u>5,801,439</u>	<u>4.61</u>	<u>8,203,511</u>	<u>6.42</u>
上市权益性证券				
中国内地	1,728,937	1.37	1,122,770	0.88
香港	90,322,710	71.65	50,020,027	39.15
	<u>92,051,647</u>	<u>73.02</u>	<u>51,142,797</u>	<u>40.03</u>
存托凭证				
美国	2,321,299	1.84	–	–
挂牌债务证券				
百慕大	1,579,687	1.25	–	–
英属维尔京群岛	5,649,158	4.49	27,063,717	21.18
加拿大	400,942	0.32	371,173	0.29
开曼群岛	9,408,045	7.46	18,281,946	14.30
中国内地	–	–	1,547,614	1.21
法国	–	–	1,391,184	1.09
香港	1,556,654	1.24	3,521,260	2.75
印度	–	–	1,499,866	1.17
印度尼西亚	1,621,583	1.29	1,516,065	1.19
日本	–	–	1,616,339	1.26
马来西亚	–	–	1,463,408	1.14
荷兰	–	–	1,471,190	1.15
新加坡	–	–	2,741,959	2.14
斯里兰卡	1,478,357	1.17	–	–
英国	1,553,280	1.23	–	–
	<u>23,247,706</u>	<u>18.45</u>	<u>62,485,721</u>	<u>48.87</u>
	<u>123,422,091</u>	<u>97.92</u>	<u>121,832,029</u>	<u>95.32</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(a) 市场风险(续)

(i) 价格风险(续)

中银香港全天候亚太高收益基金

金融资产	2021年		2020年	
	公允价值 美元	占资产净值 的百分比 %	公允价值 美元	占资产净值 的百分比 %
集合投资计划				
香港	203,832	1.42	–	–
新加坡	211,093	1.47	441,365	3.53
美国	1,691,699	11.82	423,236	3.39
	<u>2,106,624</u>	<u>14.71</u>	<u>864,601</u>	<u>6.92</u>
上市权益性证券				
澳大利亚	1,724,361	12.03	871,720	6.98
中国内地	1,507,945	10.52	659,820	5.28
香港	5,645,974	39.37	2,695,014	21.60
新加坡	–	–	594,139	4.76
美国	–	–	134,737	1.08
	<u>8,878,280</u>	<u>61.92</u>	<u>4,955,430</u>	<u>39.70</u>
挂牌债务证券				
百慕大	203,613	1.42	–	–
英属维尔京群岛	77,864	0.54	857,113	6.86
开曼群岛	2,175,314	15.18	2,926,820	23.44
法国	–	–	179,496	1.44
香港	–	–	207,794	1.66
印度	–	–	193,519	1.55
印度尼西亚	–	–	303,920	2.43
马来西亚	–	–	160,476	1.29
荷兰	–	–	189,819	1.52
新加坡	–	–	427,915	3.43
英国	200,000	1.40	196,387	1.57
	<u>2,656,791</u>	<u>18.54</u>	<u>5,643,259</u>	<u>45.19</u>
存托凭证				
台湾	–	–	170,310	1.36
美国	137,300	0.96	–	–
英国	436,304	3.04	259,156	2.08
	<u>573,604</u>	<u>4.00</u>	<u>429,466</u>	<u>3.44</u>
	<u>14,215,299</u>	<u>99.17</u>	<u>11,892,756</u>	<u>95.25</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(a) 市场风险(续)

(i) 价格风险(续)

中银香港全天候短期债券基金

金融资产	2021年		2020年	
	公允价值 美元	占资产净值 的百分比 %	公允价值 美元	占资产净值 的百分比 %
集合投资计划				
澳大利亚	—	—	9,683,425	3.10
挂牌债券证券				
百慕大	1,473,290	0.47		
英属维尔京群岛	13,212,040	14.43	95,114,574	30.45
开曼群岛	9,057,218	9.90	12,583,870	4.03
中国内地	9,912,868	10.84	20,100,134	6.43
香港	10,449,518	11.41	37,515,716	12.00
韩国	—	—	941,291	0.30
美国	11,985,277	13.09	—	—
	<u>54,616,921</u>	<u>59.67</u>	<u>167,728,875</u>	<u>53.68</u>
	<u>54,616,921</u>	<u>59.67</u>	<u>177,412,300</u>	<u>56.78</u>

中银香港全天候一带一路债券基金

金融资产	2021年		2020年	
	公允价值 美元	占资产净值 的百分比 %	公允价值 美元	占资产净值 的百分比 %
集合投资计划				
澳大利亚	—	—	296,030	1.30
香港	1,111,436	3.90	631,434	2.77
	<u>1,111,436</u>	<u>3.90</u>	<u>927,464</u>	<u>4.07</u>
上市权益性证券				
中国内地	811,563	2.85	501,958	2.20
香港	1,149,452	4.04	513,842	2.25
美国	—	—	164,178	0.72
	<u>1,961,015</u>	<u>6.89</u>	<u>1,179,978</u>	<u>5.17</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(a) 市场风险(续)

(i) 价格风险(续)

金融资产	2021年		2020年	
	公允价值 美元	占资产净值 的百分比 %	公允价值 美元	占资产净值 的百分比 %
挂牌债务证券				
澳大利亚	216,072	0.76	—	—
百慕大	508,819	1.78	—	—
英属维尔京群岛	4,349,208	15.25	6,250,263	27.42
开曼群岛	8,204,750	28.81	7,005,702	30.73
中国内地	1,901,393	6.68	628,320	2.76
法国	—	—	179,496	0.79
香港	2,564,880	9.00	931,785	4.09
印度	1,506,133	5.28	786,797	3.45
印度尼西亚	—	—	1,731,706	7.60
日本	397,585	1.40	208,546	0.91
韩国	992,425	3.48	—	—
卢森堡	—	—	—	—
马来西亚	591,807	2.08	160,476	0.70
蒙古	196,278	0.69	—	—
荷兰	506,064	1.78	189,819	0.83
菲律宾	—	—	203,279	0.89
新加坡	—	—	754,118	3.31
斯里兰卡	—	—	281,292	1.23
泰国	—	—	205,070	0.90
阿联酋	203,009	0.71	—	—
英国	720,888	2.53	312,056	1.37
美国	406,549	1.43	—	—
	<u>23,265,860</u>	<u>81.69</u>	<u>19,828,725</u>	<u>86.98</u>
	<u>26,338,311</u>	<u>89.63</u>	<u>21,936,167</u>	<u>96.22</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(a) 市场风险(续)

(i) 价格风险(续)

中银香港全天候大湾区策略基金

金融资产	2021年		2020年	
	公允价值 美元	占资产净值 的百分比 %	公允价值 美元	占资产净值 的百分比 %
集合投资计划				
香港	2,696,850	1.21	1,874,857	1.00
挂牌债务证券				
澳大利亚	4,733,968	2.11	2,407,162	1.29
百慕大	3,586,428	1.61	3,100,925	1.66
英属维尔京群岛	58,089,777	25.93	42,334,661	22.54
开曼群岛	78,842,639	35.25	80,088,671	42.63
中国内地	16,937,044	7.57	15,316,340	8.15
法国	–	–	1,054,945	0.56
德国	662,937	0.30	590,193	0.31
香港	26,816,949	11.99	15,413,060	8.21
印度	3,416,550	1.53	2,764,394	1.48
印度尼西亚	4,990,200	2.21	1,832,112	0.98
日本	525,936	0.24	521,366	0.28
韩国	–	–	1,843,042	0.98
卢森堡	1,078,189	0.48	1,079,499	0.57
澳门	523,722	0.23	514,437	0.27
马来西亚	4,775,361	2.14	–	–
蒙古	196,278	0.09	–	–
荷兰	997,308	0.45	1,954,742	1.04
菲律宾	2,125,344	0.95	2,186,185	1.16
新加坡	5,329,196	2.38	4,356,478	2.32
西班牙	219,405	0.10	194,891	0.10
斯里兰卡	–	–	351,615	0.19
瑞典	642,668	0.29	588,554	0.31
泰国	3,169,879	1.42	2,463,012	1.31
英国	1,084,061	0.49	304,400	0.16
美国	–	–	1,172,530	0.62
	<u>218,743,839</u>	<u>97.76</u>	<u>182,433,214</u>	<u>97.12</u>
	<u>221,440,689</u>	<u>98.97</u>	<u>184,308,071</u>	<u>98.12</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(a) 市场风险(续)

(i) 价格风险(续)

中银香港全天候亚洲高息债券基金

金融资产	2021年	
	公允价值 美元	占资产净值 的百分比 %
集合投资计划		
香港	407,663	1.15
挂牌债务证券		
百慕大	814,025	2.29
英属维尔京群岛	5,324,586	15.01
开曼群岛	18,943,057	53.41
中国内地	1,497,998	4.22
香港	2,141,747	6.04
印度	949,783	2.68
印度尼西亚	527,413	1.49
蒙古	236,640	0.67
荷兰	915,173	2.58
巴基斯坦	591,296	1.67
菲律宾	698,201	1.97
新加坡	1,327,647	3.74
斯里兰卡	834,814	2.35
英国	380,000	1.07
	35,182,380	99.19
	35,590,043	100.34

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(a) 市场风险(续)

(i) 价格风险(续)

下表分析了在报告期末按行业分布划分的子基金在投资方面的价格风险集中情况，不包括外汇远期合约。

中银香港全天候环球投资基金

金融资产	2021年 占资产净值 的百分比 %	2020年 占资产净值 的百分比 %
集合投资计划		
金融	16.40	14.23
其他	—	17.42
	<u>16.40</u>	<u>31.65</u>
存托凭证		
通讯	—	1.74
技术	1.25	—
	<u>1.25</u>	<u>1.74</u>
上市权益性证券		
基本物料	3.84	—
通讯	15.15	4.32
消费者，周期性	3.79	—
消费者，非周期性	9.07	—
能源	3.67	—
金融	10.81	—
技术	3.61	—
	<u>49.94</u>	<u>4.32</u>
挂牌债务证券		
基本物料	4.75	2.73
消费者，周期性	2.14	2.71
消费者，非周期性	2.18	2.70
能源	—	2.72
金融	19.48	38.90
政府	2.08	—
工业	—	2.70
	<u>30.63</u>	<u>52.46</u>
	<u>98.22</u>	<u>90.17</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(a) 市场风险(续)

(i) 价格风险(续)

中银香港全天候中国高息债券基金

金融资产	2021年 占资产净值 的百分比 %	2020年 占资产净值 的百分比 %
集合投资计划		
金融	1.07	0.53
其他	0.62	—
	<u>1.69</u>	<u>0.53</u>
挂牌债务证券		
基本物料	2.87	2.12
通讯	—	1.43
消费者, 周期性	4.00	2.88
消费者, 非周期性	0.38	0.97
能源	4.91	6.09
金融	81.05	82.25
政府	1.02	0.30
工业	1.00	0.81
技术	0.92	0.77
公用事业	4.21	0.98
	<u>100.36</u>	<u>98.60</u>
	<u>102.05</u>	<u>99.13</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(a) 市场风险(续)

(i) 价格风险(续)

中银香港全天候香港股票基金

金融资产	2021年 占资产净值 的百分比 %	2020年 占资产净值 的百分比 %
集合投资计划 金融	—	5.18
上市权益性证券		
通讯	20.09	21.83
消费者, 周期性	8.83	6.54
消费者, 非周期性	14.66	9.46
能源	2.39	2.45
金融	19.24	43.54
工业	10.34	6.90
技术	5.42	1.29
公用事业	0.95	—
	<u>81.92</u>	<u>92.01</u>
	<u>81.92</u>	<u>97.19</u>

中银香港全天候在岸人民币股票基金

金融资产	2021年 占资产净值 的百分比 %	2020年 占资产净值 的百分比 %
上市权益性证券		
基本物料	22.63	2.72
通讯	6.17	8.72
消费者, 周期性	13.50	11.20
消费者, 非周期性	16.45	38.01
多元化经营	0.42	—
能源	—	1.16
金融	4.73	—
工业	20.46	25.86
技术	12.80	10.66
	<u>97.16</u>	<u>98.33</u>
	<u>97.16</u>	<u>98.33</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(a) 市场风险(续)

(i) 价格风险(续)

中银香港全天候亚洲债券基金

金融资产	2021年 占资产净值 的百分比 %	2020年 占资产净值 的百分比 %
集合投资计划		
金融	1.20	2.45
挂牌债务证券		
基本物料	3.43	5.80
通讯	3.84	2.45
消费者, 周期性	4.57	1.61
消费者, 非周期性	2.31	2.22
多元化经营	0.25	0.32
能源	5.06	5.44
金融	63.02	64.22
政府	6.54	2.99
工业	1.94	4.37
技术	1.3	—
公用事业	7.57	5.03
	99.83	94.45
	101.03	96.90

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(a) 市场风险(续)

(i) 价格风险(续)

中银香港全天候亚洲(日本除外)股票基金

金融资产	2021年 占资产净值 的百分比 %	2020年 占资产净值 的百分比 %
集合投资计划		
金融	9.23	15.96
上市权益性证券		
通讯	34.80	18.69
消费者, 周期性	7.75	3.00
消费者, 非周期性	4.31	3.43
多元化经营	–	0.33
能源	2.59	1.22
金融	12.08	20.56
工业	2.14	4.16
技术	11.23	11.65
公用事业	1.31	0.82
	<u>76.21</u>	<u>63.86</u>
存托凭证		
通讯	3.84	8.97
消费者, 非周期性	–	0.55
工业	–	1.08
技术	8.21	5.83
	<u>12.05</u>	<u>16.43</u>
	<u>97.49</u>	<u>96.25</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(a) 市场风险(续)

(i) 价格风险(续)

中银香港全天候中国收益基金

金融资产	2021年 占资产净值 的百分比 %	2020年 占资产净值 的百分比 %
集合投资计划		
金融	4.61	6.42
上市权益性证券		
基本物料	—	0.71
通讯	31.98	4.93
消费者, 周期性	4.29	0.48
消费者, 非周期性	3.82	2.39
多元化经营	—	1.94
能源	3.85	0.45
金融	24.59	22.84
工业	1.95	3.11
技术	0.63	—
公用事业	1.91	3.18
	<u>73.02</u>	<u>40.03</u>
存托凭证		
通讯	1.84	—
	<u>1.84</u>	<u>—</u>
挂牌债务证券		
基本物料	1.26	3.00
通讯	—	1.51
消费者, 周期性	—	1.22
金融	13.53	34.92
政府	1.18	—
工业	1.23	6.08
公用事业	1.25	2.14
	<u>18.45</u>	<u>48.87</u>
	<u>97.92</u>	<u>95.32</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(a) 市场风险(续)

(i) 价格风险(续)

中银香港全天候亚太高收益基金

金融资产	2021年 占资产净值 的百分比 %	2020年 占资产净值 的百分比 %
集合投资计划		
金融	14.71	6.92
上市权益性证券		
基本物料	5.69	3.43
通讯	1.21	2.89
消费者, 周期性	17.42	3.07
消费者, 非周期性	13.49	4.63
能源	6.98	1.38
金融	10.27	21.74
工业	3.30	1.37
技术	1.96	—
公用事业	1.60	1.19
	<u>61.92</u>	<u>39.70</u>
挂牌债务证券		
基本物料	1.42	—
消费者, 非周期性	—	2.94
能源	1.27	5.86
金融	13.91	36.39
工业	1.94	—
	<u>18.54</u>	<u>45.19</u>
存托凭证		
通讯	0.96	—
技术	3.04	3.44
	<u>4.00</u>	<u>3.44</u>
	<u>99.17</u>	<u>95.25</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(a) 市场风险(续)

(i) 价格风险(续)

中银香港全天候短期债券基金

金融资产	2021年 占资产净值 的百分比 %	2020年 占资产净值 的百分比 %
集合投资计划		
金融	—	3.10
挂牌债务证券		
基本物料	5.70	5.29
消费者, 周期性	0.22	8.37
消费者, 非周期性	—	0.32
多元化经营	—	0.26
金融	34.14	33.99
政府	13.09	—
工业	3.79	5.13
公用事业	2.73	0.32
	<u>59.67</u>	<u>53.68</u>
	<u>59.67</u>	<u>56.78</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(a) 市场风险(续)

(i) 价格风险(续)

中银香港全天候一带一路债券基金

金融资产	2021年 占资产净值 的百分比 %	2020年 占资产净值 的百分比 %
集合投资计划		
金融	2.85	4.07
其他	1.05	—
	<u>3.90</u>	<u>4.07</u>
上市权益性证券		
通讯	2.76	0.59
消费者, 非周期性	3.62	2.78
金融	0.51	1.08
技术	—	0.72
	<u>6.89</u>	<u>5.17</u>
挂牌债务证券		
基本物料	1.40	6.08
通讯	7.71	2.08
消费者, 周期性	0.71	0.89
消费者, 非周期性	—	3.37
多元化经营	—	1.20
能源	1.15	1.47
金融	50.48	49.07
政府	3.21	3.42
工业	8.18	9.93
技术	3.47	—
公用事业	5.38	9.47
	<u>81.69</u>	<u>86.98</u>
	<u>89.63</u>	<u>96.22</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(a) 市场风险(续)

(i) 价格风险(续)

中银香港全天候大湾区策略基金

金融资产	2021年 占资产净值 的百分比 %	2020年 占资产净值 的百分比 %
集合投资计划		
金融	1.21	1.00
挂牌债务证券		
基本物料	5.65	4.67
通讯	2.01	3.63
消费者, 周期性	3.80	0.99
消费者, 非周期性	1.69	1.22
多元化经营	0.24	0.29
能源	2.73	2.98
金融	68.32	68.50
政府	0.85	0.79
工业	6.59	8.01
技术	—	0.54
公用事业	5.88	5.50
	<u>97.76</u>	<u>97.12</u>
	<u>98.97</u>	<u>98.12</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(a) 市场风险(续)

(i) 价格风险(续)

中银香港全天候亚洲高息债券基金

金融资产	2021年 占资产净值 的百分比 %
集合投资计划	
金融	1.15
挂牌债务证券	
基本物料	2.99
通讯	0.86
消费者, 周期性	4.20
消费者, 非周期性	3.54
多元化经营	0.91
能源	4.41
金融	73.49
政府	4.02
工业	1.07
公用事业	3.70
	99.19
	100.34

中银香港盈荟系列

财务报表附注 2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(a) 市场风险(续)

(i) 价格风险(续)

下表列示了因市场指数的合理可能变动会对集合投资计划的相关投资的公允价值、存托凭证及上市权益性证券产生影响，从而令子基金的资产净值出现变动，并且所有其他变量保持不变。基金管理人已运用其对市场指数的合理可能变动的看法，估计本敏感度分析的变动。然而，这并非对这些市场未来变化的预测。以下变动是按绝对值列示的，且影响可为正数或负数。市场指数的可能变动会视基金管理人对市场波动及其他相关因素的现时看法而每年作出修订。

中银香港全天候环球投资基金

	市场指数的 合理可能变动 2021年	资产净值的 估计可能变动 2021年 美元	市场指数的 合理可能变动 2020年	资产净值的 估计可能变动 2020年 美元
摩根士丹利资本国际世界每日 总回报净额全球美元指数	±8%	±299,234	±13%	±376,865

中银香港全天候香港股票基金

	市场指数的 合理可能变动 2021年	资产净值的 估计可能变动 2021年 港元	市场指数的 合理可能变动 2020年	资产净值的 估计可能变动 2020年 港元
恒生总回报指数	±13%	±22,263,612	±20%	±33,347,499

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(a) 市场风险(续)

(i) 价格风险(续)

中银香港全天候在岸人民币股票基金

	市场指数的 合理可能变动 2021年	资产净值的 估计可能变动 2021年 人民币	市场指数的 合理可能变动 2020年	资产净值的 估计可能变动 2020年 人民币
深圳证券交易所综 合总回报指数	±17%	±58,446,338	±11%	±35,984,873

中银香港全天候亚洲(日本除外)股票基金

	市场指数的 合理可能变动 2021年	资产净值的 估计可能变动 2021年 美元	市场指数的 合理可能变动 2020年	资产净值的 估计可能变动 2020年 美元
MSCI AC远东除日本 净总回报美元指数	±13%	±749,747	±20%	±1,143,457

中银香港全天候中国收益基金

	市场指数的 合理可能变动 2021年	资产净值的 估计可能变动 2021年 港元	市场指数的 合理可能变动 2020年	资产净值的 估计可能变动 2020年 港元
恒生低波幅总回报指数	±7%	±5,478,041	±11%	±6,886,050

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(a) 市场风险(续)

(i) 价格风险(续)

中银香港全天候亚太高收益基金

	市场指数的 合理可能变动 2021年	资产净值的 估计可能变动 2021年 美元	市场指数的 合理可能变动 2020年	资产净值的 估计可能变动 2020年 美元
MSCI AC亚太除日本高息 净回报美元指数	±9%	±667,449	±17%	±929,758

在报告期末，由于中银香港全天候中国高息债券基金、中银香港全天候亚洲债券基金、中银香港全天候短期债券基金、中银香港全天候一带一路债券基金、中银香港全天候大湾区策略基金及中银香港全天候亚洲高息债券基金的大部分投资为债务证券，故基金管理人认为这些子基金的股本价格风险微乎其微，因此这些子基金均不会面临任何股本价格风险。投资于债务证券所面临的市场价格风险是由利率变动所引起的，其风险在财务报表附注9(a)(ii)的利率风险中予以披露。

(ii) 利率风险

利率风险来自市场利率当前水平的波动对计息资产及负债的公允价值以及其未来现金流量的影响。子基金持有定息债务证券令子基金承受公允价值利率风险。

子基金投资于债务证券(其价值受到利率变动大幅推动)，并承受利率风险。当利率上升，以前收购的债务证券价值普遍会下降，因为已收购的新债务证券将支付较高利息。反之，如果利率下降，则以前收购的债务证券价值普遍会上升。基金管理人将定期评估经济状况，监控利率走向变动及采取相应适当措施以控制利率风险的影响。在利率上升的环境下，子基金将会收购期限较短的债务证券以将其对投资组合所产生的负面影响减至最小。

中银香港盈荟系列

财务报表附注 2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(a) 市场风险(续)

(ii) 利率风险(续)

下表概述了在报告期末以公允价值计量并按到期日分类的子基金债券证券投资。

中银香港全天候环球投资基金

	2021年 美元	2020年 美元
剩余到期日如下：		
— 少于一年	598,035	—
— 一至五年	612,340	1,031,064
— 超过五年	1,743,119	2,876,193
	<u>2,953,494</u>	<u>3,907,257</u>

中银香港全天候中国高息债券基金

	2021年 人民币	2020年 人民币
剩余到期日如下：		
— 少于一年	107,830,938	256,501,947
— 一至五年	787,550,173	938,123,587
— 超过五年	187,960,020	187,426,151
	<u>1,083,341,131</u>	<u>1,382,051,685</u>

中银香港全天候亚洲债券基金

	2021年 美元	2020年 美元
剩余到期日如下：		
— 少于一年	18,161,334	9,641,851
— 一至五年	89,554,150	66,621,120
— 超过五年	110,270,948	86,419,200
	<u>217,986,432</u>	<u>162,682,171</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(a) 市场风险(续)

(ii) 利率风险(续)

中银香港全天候中国收益基金

	2021年 港元	2020年 港元
剩余到期日如下：		
— 少于一年	7,509,058	5,893,845
— 一至五年	13,784,426	25,756,958
— 超过五年	1,954,222	30,834,918
	<u>23,247,706</u>	<u>62,485,721</u>

中银香港全天候亚太高收益基金

	2021年 美元	2020年 美元
剩余到期日如下：		
— 少于一年	866,371	832,330
— 一至五年	1,391,312	3,280,376
— 超过五年	399,108	1,530,553
	<u>2,656,791</u>	<u>5,643,259</u>

中银香港全天候短期债券基金

	2021年 美元	2020年 美元
剩余到期日如下：		
— 少于一年	21,802,093	75,936,914
— 一至五年	32,814,828	58,742,528
— 超过五年	—	33,049,433
	<u>54,616,921</u>	<u>167,728,875</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(a) 市场风险(续)

(ii) 利率风险(续)

中银香港全天候一带一路债券基金

	2021年 美元	2020年 美元
剩余到期日如下：		
— 少于一年	—	914,094
— 一至五年	13,162,545	8,187,340
— 超过五年	10,103,315	10,727,291
	<u>23,265,860</u>	<u>19,828,725</u>

中银香港全天候大湾区策略基金

	2021年 美元	2020年 美元
剩余到期日如下：		
— 少于一年	21,788,943	15,677,649
— 一至五年	106,858,751	87,600,796
— 超过五年	90,096,145	79,154,769
	<u>218,743,839</u>	<u>182,433,214</u>

中银香港全天候亚洲高息债券基金

	2021年 美元
剩余到期日如下：	
— 少于一年	5,390,533
— 一至五年	23,178,254
— 超过五年	6,613,593
	<u>35,182,380</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(a) 市场风险(续)

(ii) 利率风险(续)

下表列示了因利率合理变动100基点(“基点”)会对相关固定债务证券投资的公允价值产生影响,从而令子基金的资产净值出现的变动,并且所有其他变量保持不变。基金管理人已运用其对利率的合理可能变动的看法,估计本敏感度分析的变动。然而,这并非对这些市场未来变化的预测。以下变动是按绝对值列示的,且影响可为正数或负数。利率的可能变动会视基金管理人对市场波动及其他相关因素的现时看法而每年作出修订。

	利率变动	对资产净值的影响 2021年	对资产净值的影响 2020年
中银香港全天候 环球投资基金	±100基点	±255,905美元	±489,873美元
中银香港全天候 中国高息债券基金	±100基点	±人民币34,612,003元	±人民币42,068,847元
中银香港全天候 亚洲债券基金	±100基点	±16,888,826美元	±13,222,205美元
中银香港全天候 中国收益基金	±100基点	±555,725港元	±7,442,879港元
中银香港全天候 亚太高收益基金	±100基点	±56,728美元	±292,399美元
中银香港全天候 短期债券基金	±100基点	±802,054美元	±8,685,390美元
中银香港全天候 一带一路债券基金	±100基点	±1,339,029美元	±1,836,403美元
中银香港全天候 大湾区策略基金	±100基点	±15,944,131美元	±13,917,233美元
中银香港全天候 亚洲高息债券基金	±100基点	±1,257,550美元	-

中银香港盈荟系列

财务报表附注 2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(a) 市场风险(续)

(iii) 外汇风险

外汇风险指金融工具的价值将会因外汇汇率变动而产生波动的风险。

子基金可能以其记账本位币以外的货币进行投资，并可能因汇率波动而受到影响，可能导致投资价值减少。所投资本的汇回可能会受到适用于海外投资者的规例变更的限制，其也可能对子基金的业绩产生不利影响。同时，如果投资者希望以相关子基金的记账本位币以外的货币收取赎回所得款项，则其须将所得款项兑换(无论是通过基金管理人，还是以其他方式)为相关其他货币。由此，投资者将须承受外汇风险及货币兑换成本。子基金拟避免投资于需汇回资本的境外国家。

下表概述了在报告期末承受外汇风险的子基金的资产及负债：

中银香港全天候环球投资基金

	2021年 美元	2020年 美元
<i>货币性</i>		
澳元	154	10,230
欧元	1	1
英镑	302	271
港元	23,153	363,182
日圆	6,963	51
新西兰元	61	56
人民币	339	1
新加坡元	31	30
<i>非货币性</i>		
港元	3,821,133	827,985
日圆	80,718	—
人民币	94,076	—

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(a) 市场风险(续)

(iii) 外汇风险(续)

中银香港全天候中国高息债券基金

	2021年 人民币	2020年 人民币
<i>货币性</i>		
澳元	19,334,871	18,467,847
港元	(2,008,388)	(1,484,105)
美元	1,081,457,223	215,679,610
<i>非货币性</i>		
美元	6,672,282	7,413,405

中银香港全天候香港股票基金

	2021年 港元	2020年 港元
<i>货币性</i>		
澳元	252	1,731,159
新西兰元	2	2
人民币	12,961,701	2,196,565
美元	98,774	(213,546)
<i>非货币性</i>		
人民币	33,026,114	—

中银香港全天候在岸人民币股票基金

	2021年 人民币	2020年 人民币
<i>货币性</i>		
港元	7,263,615	9,488,778
美元	2,957,261	315,840
<i>非货币性</i>		
港元	103,384,043	—

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(a) 市场风险(续)

(iii) 外汇风险(续)

中银香港全天候亚洲债券基金

	2021年 美元	2020年 美元
<i>货币性</i>		
港元	(1,572,748)	582,694
印度卢比	739,119	710,498
人民币	43,882,257	17,819,314
<i>非货币性</i>		
人民币	2,602,774	—

中银香港全天候亚洲(日本除外)股票基金

	2021年 美元	2020年 美元
<i>货币性</i>		
港元	93,938	196,060
韩元	1,992	(40,868)
人民币	281,369	257,646
新加坡元	25,292	54,540
<i>非货币性</i>		
港元	3,937,938	2,879,419
韩元	1,246,742	1,423,670
新加坡元	65,775	253,168

中银香港全天候中国收益基金

	2021年 港元	2020年 港元
<i>货币性</i>		
澳元	9,068	8,316
人民币	25,360,546	22,225,657
美元	21,500,292	67,437,886
<i>非货币性</i>		
人民币	3,311,976	1,122,770
美元	2,321,299	2,294,381

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(a) 市场风险(续)

(iii) 外汇风险(续)

中银香港全天候亚太高收益基金

	2021年 美元	2020年 美元
<i>货币性</i>		
澳元	692,527	783,866
港元	203,423	126,055
新西兰元	551	508
人民币	1,614,907	1,973,413
新加坡元	17,388	82,636
<i>非货币性</i>		
澳元	1,724,361	871,719
港元	5,645,975	2,695,017
人民币	1,711,776	659,820
新加坡元	211,093	1,035,504

中银香港全天候短期债券基金

	2021年 美元	2020年 美元
<i>货币性</i>		
港元	3,695	2,093
欧元	100,027	146,984,395
人民币	9,900,642	(4,058,056)
新加坡元	128,172	-
<i>非货币性</i>		
人民币	-	4,749,592

中银香港全天候一带一路债券基金

	2021年 美元	2020年 美元
<i>货币性</i>		
欧元	2,696	2,558
港元	(32,539)	6,116
印度卢比	-	498,860
人民币	12,279,643	4,482,530
<i>非货币性</i>		
港元	1,962,980	1,145,278
人民币	1,109,471	501,957

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(a) 市场风险(续)

(iii) 外汇风险(续)

中银香港全天候大湾区策略基金

	2021年 美元	2020年 美元
<i>货币性</i>		
港元	2,858,463	280,875
澳门元	(3,064,908)	336,112
人民币	134,566	16,432,590
<i>非货币性</i>		
人民币	2,696,851	—

中银香港全天候亚洲高息债券基金

	2021年 美元
<i>货币性</i>	
澳元	6,249
欧元	5,137
英镑	66,922
港元	424,356
人民币	59,868
<i>非货币性</i>	
人民币	407,663

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(a) 市场风险(续)

(iii) 外汇风险(续)

下表列示了因主要汇率合理可能变动5%而令子基金的资产净值出现的变动，且所有其他变数保持不变。基金管理人已运用其对汇率的合理可能变动的看法，估计本敏感度分析的变动。然而，这并非对这些市场未来变化的预测。以下变动按绝对值列示，且影响可为正数或负数。利率的可能变动会视基金管理人对市场波动及其他相关因素的现时看法而每年作出修订。

中银香港全天候环球投资基金

	可能合理变动 +/-	对资产净值的影响	
		2021年 美元 +/-	2020年 美元 +/-
<i>货币性</i>			
澳元	5%	8	512
欧元	5%	-	-
英镑	5%	15	14
港元	5%	1,158	18,159
日圆	5%	348	3
新西兰元	5%	3	3
人民币	5%	17	-
新加坡元	5%	2	2
<i>非货币性</i>			
港元	5%	191,057	41,399
日圆	5%	4,036	-
人民币	5%	4,704	-

中银香港全天候中国高息债券基金

	可能合理变动 +/-	对资产净值的影响	
		2021年 人民币 +/-	2020年 人民币 +/-
<i>货币性</i>			
澳元	5%	966,744	923,392
港元	5%	(100,419)	74,205
美元	5%	54,072,861	10,783,981
<i>非货币性</i>			
美元	5%	333,614	370,670

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(a) 市场风险(续)

(iii) 外汇风险(续)

中银香港全天候香港股票基金

	可能合理变动 +/-	对资产净值的影响	
		2021年 港元 +/-	2020年 港元 +/-
货币性			
澳元	5%	13	86,558
人民币	5%	648,085	109,828
美元	5%	4,939	10,677
非货币性			
美元	5%	1,651,306	-

中银香港全天候在岸人民币股票基金

	可能合理变动 +/-	对资产净值的影响	
		2021年 人民币 +/-	2020年 人民币 +/-
货币性			
港元	5%	363,181	474,439
美元	5%	147,863	15,792
非货币性			
港元	5%	5,169,202	-

中银香港全天候亚洲债券基金

	可能合理变动 +/-	对资产净值的影响	
		2021年 美元 +/-	2020年 美元 +/-
货币性			
港元	5%	(78,637)	29,135
印度卢比	5%	36,956	35,525
人民币	5%	2,194,113	890,966
非货币性			
人民币	5%	130,139	-

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(a) 市场风险(续)

(iii) 外汇风险(续)

中银香港全天候亚洲(日本除外)股票基金

	可能合理变动 +/-	对资产净值的影响	
		2021年 美元 +/-	2020年 美元 +/-
<i>货币性</i>			
港元	5%	4,697	9,803
韩元	5%	100	(2,043)
人民币	5%	14,068	12,882
新加坡元	5%	1,265	2,727
<i>非货币性</i>			
港元	5%	196,897	143,971
韩元	5%	62,337	71,184
新加坡元	5%	3,289	12,658

中银香港全天候中国收益基金

	可能合理变动 +/-	对资产净值的影响	
		2021年 港元 +/-	2020年 港元 +/-
<i>货币性</i>			
澳元	5%	453	416
人民币	5%	1,268,027	1,111,283
美元	5%	1,075,015	3,371,894
<i>非货币性</i>			
人民币	5%	165,599	56,138
美元	5%	116,065	114,719

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(a) 市场风险(续)

(iii) 外汇风险(续)

中银香港全天候亚太高收益基金

	可能合理变动 +/-	对资产净值的影响	
		2021年 美元 +/-	2020年 美元 +/-
<i>货币性</i>			
澳元	5%	34,626	39,193
港元	5%	10,171	6,303
新西兰元	5%	28	25
人民币	5%	80,745	98,671
新加坡元	5%	869	4,132
<i>非货币性</i>			
澳元	5%	86,218	43,586
港元	5%	282,299	134,751
人民币	5%	85,589	32,991
新加坡元	5%	10,555	51,775

中银香港全天候短期债券基金

	可能合理变动 +/-	对资产净值的影响	
		2021年 美元 +/-	2020年 美元 +/-
<i>货币性</i>			
港元	5%	185	105
欧元	5%	5,001	7,349,220
人民币	5%	495,032	(202,903)
新加坡元	5%	6,409	-
<i>非货币性</i>			
人民币	5%	-	237,480

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(a) 市场风险(续)

(iii) 外汇风险(续)

中银香港全天候一带一路债券基金

	可能合理变动 +/-	对资产净值的影响	
		2021年 美元 +/-	2020年 美元 +/-
<i>货币性</i>			
欧元	5%	135	128
港元	5%	(1,627)	306
印度卢比	5%	-	24,943
人民币	5%	613,982	224,127
<i>非货币性</i>			
港元	5%	98,149	57,264
人民币	5%	55,474	25,098

中银香港全天候大湾区策略基金

	可能合理变动 +/-	对资产净值的影响	
		2021年 美元 +/-	2020年 美元 +/-
<i>货币性</i>			
港元	5%	142,923	14,044
澳门元	5%	(153,245)	16,806
人民币	5%	6,728	821,630
<i>非货币性</i>			
人民币	5%	134,843	-

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(a) 市场风险(续)

(iii) 外汇风险(续)

中银香港全天候亚洲高息债券基金

	可能合理变动	对资产净值的影响
	+/-	2021年 美元 +/-
货币性		
澳元	5%	312
欧元	5%	257
英镑	5%	3,346
港元	5%	21,218
人民币	5%	2,993
非货币性		
人民币	5%	20,383

(b) 流动风险

流动风险指子基金可能无法产生充足现金资源以在到期时充分履行其义务或仅可按极为不利的条款履行其义务的风险。

子基金须由其投资者每日赎回份额。相关投资须可随时出售以在合理时间内满足赎回的付款要求。

子基金将大部分资产投资于现金、权益性证券及债务证券。这些证券由政府、等效公共机构、非政府机构或其他实体发行或担保，相对较易套现。此外，子基金也可投资于在香港或其他国家上市的权益性证券，而相关投资也易于出售以套现。截至2021年及2020年6月30日，除应收利息、应收股息、其他应收款项及存款准备金外，子基金的资产可于7日内变现。

根据子基金的政策，基金管理人每日监控子基金的流动状况。在取得受托人批准的情况下，基金管理人可将于任何交易日赎回的任何子基金份额的数目限制在已发行相关子基金份额总数的10%以内。在此情况下，相关限制将按比例适用，以使有意于该交易日赎回该子基金份额的相关子基金的所有份额持有人将赎回相同比例的相关份额，而未赎回的份额将于下个交易日结转以供赎回(但须受相同的限制)。如果赎回要求照此结转，则基金管理人将通知相关份额持有人。截至2021年及2020年6月30日止的年度/期间内，基金管理人并未限制任何赎回。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(b) 流动风险(续)

基于报告期末至合约到期日之间的剩余期间，2021年及2020年6月30日的所有负债包括资产净值表中所列的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、应付经纪人款项、应付分配、应付管理费、应付受托人费、计息贷款及应计费用及其他应付款项以及赎回份额的应付赎回款项(于一个月内到期)。这些款项为未折现的合同现金流量。由于折现的影响并不重大，所以在十二个月内到期的余额等于其帐面余额。

下表概述了在报告期末持有相关类别子基金份额的10%以上的份额持有人数目：

	2021年 份额持有人 数目	2020年 份额持有人 数目
中银香港全天候环球投资基金	4	5
中银香港全天候中国高息债券基金	14	13
中银香港全天候香港股票基金	6	12
中银香港全天候在岸人民币股票基金	6	8
中银香港全天候亚洲债券基金	4	6
中银香港全天候亚洲(日本除外)股票基金	6	10
中银香港全天候中国收益基金	4	5
中银香港全天候亚太高收益基金	6	4
中银香港全天候短期债券基金	12	18
中银香港全天候一带一路债券基金	3	3
中银香港全天候大湾区策略基金	13	16
中银香港全天候亚洲高息债券基金	7	-

(c) 信用及交易对手风险

子基金承担信用风险，该风险指交易对手未来无法支付全部到期款项的风险。如果子基金投资的任何债务证券的发行人拖欠付款，则子基金的业绩将受到不利影响。

子基金投资于多元化组合债务证券，其基于基础研究分析进行选择，以降低此信用风险。通过主要交易具有高信用评级的发行人所发行的证券，子基金限制其自身承担的信用风险。子基金投资于具有标准普尔或穆迪评级的投资级别的债务证券。信用评级由基金管理人定期审核。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(c) 信用及交易对手风险(续)

受香港财务报告准则第9号减值要求规限的金融资产

子基金受香港财务报告准则第9号项下的预期信用亏损模式规限的金融资产为应收经纪人款项、应收股息、应收利息、应收认购款项、其他应收款项、存款准备金以及现金及现金等价物。于2021年及2020年6月30日，概无就应收经纪人款项、应收股息、应收利息、应收认购款项、现金及现金等价物、其他应收款项及存款准备金作出亏损准备。有关资产被视作并无任何集中信用风险。期内并无资产被视作减值，亦无金额被撤销。

于2021年及2020年6月30日，应收经纪人款项、应收股息、应收利息、应收认购款项、现金及现金等价物、其他应收款项及存款准备金(全部均为并无融资成分的相对短期的应收款项)受到香港财务报告准则第9号的预期信用亏损模式的影响，子基金已采纳一般方法。由于自初始确认以来信用风险并无显著增加，因此所示的亏损准备乃按相等于12个月预期信用亏损的金额计量。

在计算亏损准备时，所使用的准备矩阵以应收款项预计年期的过往观察所得亏损率为基础，并就前瞻性估计作出调整。

不受香港财务报告准则第9号减值要求规限的金融资产

子基金承担股本及债务证券的信用风险。此类金融资产不受香港财务报告准则第9号减值要求规限，因为其以公允价值计量且其变动计入当期损益。根据香港财务报告准则第9号，有关资产的帐面值均相当于各报告日期子基金就不受香港财务报告准则第9号减值要求规限的金融工具所承担的最大信用风险值。

子基金在债务证券中的投资承担信用风险，而风险概述如下。

中银香港全天候环球投资基金

评级	2021年		2020年	
	美元	占资产净值的百分比	美元	占资产净值的百分比
AAA ¹ /Aaa ²	199,849	2.07	—	—
A ¹ /A ²	205,896	2.14	201,752	2.71
BBB ¹ /Baa ²	866,001	8.98	1,258,354	16.90
BB ¹ /Ba ²	1,072,828	11.12	1,613,769	21.67
并未评级	608,920	6.32	833,382	11.18
	<u>2,953,494</u>	<u>30.63</u>	<u>3,907,257</u>	<u>52.46</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(c) 信用及交易对手风险(续)

中银香港全天候中国高息债券基金

评级	2021年		2020年	
	人民币	占资产净值的百分比 %	人民币	占资产净值的百分比 %
BBB ¹ /Baa ²	186,062,812	17.24	–	–
BB ¹ /Ba ²	358,101,497	33.18	982,458,218	70.10
并未评级	539,176,822	49.94	399,593,467	28.50
总计	<u>1,083,341,131</u>	<u>100.36</u>	<u>1,382,051,685</u>	<u>98.60</u>

中银香港全天候亚洲债券基金

评级	2021年		2020年	
	美元	占资产净值的百分比 %	美元	占资产净值的百分比 %
AAA ¹ /Aaa ²	833,425	0.38	1,155,854	0.67
A ¹ /A ²	37,862,264	17.34	22,307,481	12.95
BBB ¹ /Baa ²	50,931,473	23.33	60,234,053	34.97
BB ¹ /Ba ²	57,369,876	26.27	45,733,160	26.55
并未评级	70,989,394	32.51	33,251,623	19.31
总计	<u>217,986,432</u>	<u>99.83</u>	<u>162,682,171</u>	<u>94.45</u>

中银香港全天候中国收益基金

评级	2021年		2020年	
	港元	占资产净值的百分比 %	港元	占资产净值的百分比 %
A ¹ /A ²	–	–	7,512,305	5.88
BBB ¹ /Baa ²	1,957,596	1.55	19,692,393	15.40
BB ¹ /Ba ²	10,602,851	8.42	14,546,870	11.37
并未评级	10,687,259	8.48	20,734,153	16.22
总计	<u>23,247,706</u>	<u>18.45</u>	<u>62,485,721</u>	<u>48.87</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(c) 信用及交易对手风险(续)

中银香港全天候亚太高收益基金

评级	2021年		2020年	
	美元	占资产净值的百分比 %	美元	占资产净值的百分比 %
BBB ¹ /Baa ²	–	–	303,920	2.43
BB ¹ /Ba ²	1,415,069	9.87	3,619,451	28.99
并未评级	1,241,722	8.67	1,719,888	13.77
总计	<u>2,656,791</u>	<u>18.54</u>	<u>5,643,259</u>	<u>45.19</u>

中银香港全天候短期债券基金

评级	2021年		2020年	
	美元	占资产净值的百分比 %	美元	占资产净值的百分比 %
AAA ¹ /Aaa ²	11,985,278	13.08	389,253	0.12
A ¹ /A ²	9,675,135	10.58	29,046,152	9.30
BBB ¹ /Baa ²	18,200,344	19.89	71,221,076	22.80
并未评级	14,756,164	16.12	67,072,394	21.46
总计	<u>54,616,921</u>	<u>59.67</u>	<u>167,728,875</u>	<u>53.68</u>

中银香港全天候一带一路债券基金

评级	2021年		2020年	
	美元	占资产净值的百分比 %	美元	占资产净值的百分比 %
AAA ¹ /Aaa ²	1,003,832	3.52	–	–
A ¹ /A ²	3,354,530	11.78	2,996,945	13.15
BBB ¹ /Baa ²	5,296,145	18.60	6,794,492	29.80
BB ¹ /Ba ²	6,214,824	21.82	5,424,187	23.79
并未评级	7,396,529	25.97	4,613,101	20.24
总计	<u>23,265,860</u>	<u>81.69</u>	<u>19,828,725</u>	<u>86.98</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(c) 信用及交易对手风险(续)

中银香港全天候大湾区策略基金

评级	2021年		2020年	
	美元	占资产净值的百分比	美元	占资产净值的百分比
AAA ¹ /Aaa ²	–	–	1,071,297	0.58
A ¹ /A ²	6,118,076	2.74	35,138,622	18.72
BBB ¹ /Baa ²	196,278	0.07	60,405,613	32.14
BB ¹ /Ba ²	12,439,723	5.54	50,465,326	26.85
并未评级	199,989,762	89.41	35,352,356	18.83
总计	<u>218,743,839</u>	<u>97.76</u>	<u>182,433,214</u>	<u>97.12</u>

中银香港全天候亚洲高息债券基金

评级	2021年	
	美元	占资产净值的百分比
BBB ¹ /Baa ²	1,154,662	3.27
BB ¹ /Ba ²	22,336,548	62.97
并未评级	11,691,170	32.95
总计	<u>35,182,380</u>	<u>99.19</u>

¹ 标准普尔

² 穆迪

对于未评级的债务工具，基金管理人采纳研究信用审核程序，该程序依赖于定性及定量因素的共同作用。其定性评估专注于管理优势、市场状况、竞争环境及财务灵活性等因素。其定量评估专注于历史经营成果、各项信用比率的计算及预期未来前景。信用审核程序的目标是识别可提供相关价值的证券，包括主要评级机构的预期评级工作。

其信用研究工作针对所有未评级持有制定了内部级别。分析员将确定一个级别(其可能与穆迪或标准普尔所制定的级别有所不同)。之后，其将确定级别的趋势，可能将上升、稳定或下降。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(c) 信用及交易对手风险(续)

基金管理人已依据发行人的性质及相关发行人的违约率历史信息评估了债务证券的信用质量。

截至2021年及2020年6月30日，基金管理人认为，未评级债务证券的信用质量及信用度与子基金所持有的其他债务证券相类似。

所有上市证券的交易均于交割时通过经审批的经纪人结算/支付。由于出售的证券只会在经纪人收到付款后方进行交割，故违约风险极低。在购买证券时，只会在经纪人收到证券后方会付款。如果任何一方未能履行其义务，则交易将失败。

可能面临交易对手集中风险的子基金的资产主要包括存放在中国银行(香港)有限公司及花旗银行香港分行(“保管人”)的银行存款及投资，而应收经纪人款项在此应为应收保管人款项。子基金持有的外汇合约的交易对手亦为保管人。截至2021年6月30日，标准普尔对中国银行(香港)有限公司的信用评级为A(2020年：A)，对花旗银行香港分行的信用评级为A(2020年：A)。

截至报告期末，信用风险的最高风险为资产净值表所列的资产帐面金额。不存在资产减值或逾期但未减值的情况。

(d) 公允价值估计

在活跃市场买卖的金融资产及负债(如买卖证券)的公允价值按报告期末交易时间结束时的市场报价计算。

活跃市场指资产或负债交易以足够的频率及数量进行以持续地提供定价数据的市场。

当报价可实时和定期地从证券交易所、交易商、经纪人、业内集团、定价服务或监管代理机构获得，且这些价格代表了按公平交易基准进行的实际和常规市场交易时，该金融工具被视为在活跃市场获得报价。

9 财务风险管理(续)

(d) 公允价值估计(续)

不在活跃市场中买卖的金融资产的公允价值则利用估值技术确定。子基金使用各种方法，并根据每个期间结算日的市场状况作出假设。所使用的估值技术是这些市场参与者通用的估值技术，尽量多地使用市场输入数据，而尽量少地依赖特定实体的输入数据。

假设帐面价值减去应收款项及应付款项的减值准备金后的差额接近于公允价值。为了披露金融负债的公允价值，可按照子基金可获得的类似金融工具的现行市场利率来折算未来合同现金流量，从而估算该公允价值。

公允价值等级有以下层级：

第一层级 — 基于实体可在计量日获取的相同资产或负债在活跃市场中的报价(未经调整)。

第二层级 — 基于对公允价值计量属重大的最低层级输入数据为可直接或间接观察的估值技术。

第三层级 — 基于对公允价值计量属重大的最低层级输入数据为不可观察的估值技术。

将公允价值的计量全部归类于公允价值等级中的层级，其确定依据为对于整体公允价值的计量有重要性的最低层级输入数据。因此，输入数据的重要性是以整体公允价值的计量来评估的。如果公允价值计量使用可观察数据，但相关输入数据需要根据不可观察数据作出重大调整，则计量应为第三层级。评估一个特定数据对于整体公允价值计量的重要性，需要考虑资产或负债本身的因素再作判断。

要确定构成可观察的因素，子基金需要作出重大判断。子基金认为可观察的输入数据是即时可供、定期分配或更新、可靠及可核实、并非专有，并由活跃于相关市场的独立来源提供的市场输入数据。

下表分析了报告期末在公允价值等级内按公允价值计量的子基金的金融资产及负债(按类别划分)。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(d) 公允价值估计(续)

中银香港全天候环球投资基金

	第一层级 美元	第二层级 美元	第三层级 美元	总计 美元
2021年6月30日				
金融资产				
集合投资计划	1,581,808	—	—	1,581,808
上市权益性证券	4,816,037	—	—	4,816,037
挂牌债务证券	—	2,953,494	—	2,953,494
存托凭证	120,160	—	—	120,160
	<u>6,518,005</u>	<u>2,953,494</u>	<u>—</u>	<u>9,471,499</u>
金融负债				
外汇远期合约	—	380	—	380
可赎回份额(按成交价)	—	9,642,294	—	9,642,294
	<u>—</u>	<u>9,642,674</u>	<u>—</u>	<u>9,642,674</u>
2020年6月30日				
集合投资计划	2,355,778	—	—	2,355,778
上市权益性证券	321,656	—	—	321,656
外汇远期合约	—	6	—	6
挂牌债务证券	—	3,907,257	—	3,907,257
存托凭证	129,420	—	—	129,420
	<u>2,806,854</u>	<u>3,907,257</u>	<u>—</u>	<u>6,714,117</u>
金融负债				
可赎回份额(按成交价)	—	7,445,846	—	7,445,846
	<u>—</u>	<u>7,445,846</u>	<u>—</u>	<u>7,445,846</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(d) 公允价值估计(续)

中银香港全天候中国高息债券基金

	第一层级 人民币	第二层级 人民币	第三层级 人民币	总计 人民币
2021年6月30日				
金融资产				
集合投资计划	11,559,600	6,672,282	–	18,231,882
外汇远期合约	–	2,224,146	–	2,224,146
挂牌债务证券	–	1,083,341,131	–	1,083,341,131
	<u>11,559,600</u>	<u>1,092,237,559</u>	<u>–</u>	<u>1,103,797,159</u>
金融负债				
外汇远期合约	–	12,781,044	–	12,781,044
可赎回份额(按成交价)	–	1,079,596,512	–	1,079,596,512
	<u>–</u>	<u>1,092,377,556</u>	<u>–</u>	<u>1,092,377,556</u>
2020年6月30日				
金融资产				
集合投资计划	–	7,413,405	–	7,413,405
外汇远期合约	–	1,062,878	–	1,062,878
挂牌债务证券	–	1,382,051,685	–	1,382,051,685
	<u>–</u>	<u>1,390,527,968</u>	<u>–</u>	<u>1,390,527,968</u>
金融负债				
外汇远期合约	–	182,003	–	182,003
可赎回份额(按成交价)	–	1,401,525,914	–	1,401,525,914
	<u>–</u>	<u>1,401,707,917</u>	<u>–</u>	<u>1,401,707,917</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(d) 公允价值估计(续)

中银香港全天候香港股票基金

	第一层级 港元	第二层级 港元	第三层级 港元	总计 港元
2021年6月30日				
金融资产				
上市权益性证券	229,920,314	—	—	229,920,314
	<u>229,920,314</u>	<u>—</u>	<u>—</u>	<u>229,920,314</u>
金融负债				
外汇远期合约	—	81,356	—	81,356
可赎回份额(按成交价)	—	280,669,311	—	280,669,311
	<u>—</u>	<u>280,750,667</u>	<u>—</u>	<u>280,750,667</u>
2020年6月30日				
金融资产				
上市权益性证券	193,966,200	—	—	193,966,200
集合投资计划	—	10,917,248	—	10,917,248
外汇远期合约	—	137,966	—	137,966
	<u>193,966,200</u>	<u>11,055,214</u>	<u>—</u>	<u>205,021,414</u>
金融负债				
可赎回份额(按成交价)	—	210,837,314	—	210,837,314
	<u>—</u>	<u>210,837,314</u>	<u>—</u>	<u>210,837,314</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(d) 公允价值估计(续)

中银香港全天候在岸人民币股票基金

	第一层级 人民币	第二层级 人民币	第三层级 人民币	总计 人民币
2021年6月30日				
金融资产				
上市权益性证券	396,147,398	–	–	396,147,398
外汇远期合约	–	379,684	–	379,684
	<u>396,147,398</u>	<u>379,684</u>	<u>–</u>	<u>396,527,082</u>
金融负债				
可赎回份额(按成交价)	–	407,733,417	–	407,733,417
	<u>–</u>	<u>407,733,417</u>	<u>–</u>	<u>407,733,417</u>
2020年6月30日				
金融资产				
上市权益性证券	<u>262,334,740</u>	<u>–</u>	<u>–</u>	<u>262,334,740</u>
金融负债				
外汇远期合约	–	26,814	–	26,814
可赎回份额(按成交价)	–	266,796,646	–	266,796,646
	<u>–</u>	<u>266,823,460</u>	<u>–</u>	<u>266,823,460</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(d) 公允价值估计(续)

中银香港全天候亚洲债券基金

	第一层级 美元	第二层级 美元	第三层级 美元	总计 美元
2021年6月30日				
金融资产				
集合投资计划	2,602,774	–	–	2,602,774
挂牌债务证券	–	217,986,432	–	217,986,432
	<u>2,602,774</u>	<u>217,986,432</u>	<u>–</u>	<u>220,589,206</u>
金融负债				
外汇远期合约	–	472,185	–	472,185
可赎回份额(按成交价)	–	218,348,938	–	218,348,938
	<u>–</u>	<u>218,821,123</u>	<u>–</u>	<u>218,821,123</u>
2020年6月30日				
金融资产				
挂牌债务证券	–	162,682,171	–	162,682,171
集合投资计划	–	4,209,006	–	4,209,006
外汇远期合约	–	13,397	–	13,397
	<u>–</u>	<u>166,904,574</u>	<u>–</u>	<u>166,904,574</u>
金融负债				
可赎回份额(按成交价)	–	172,226,464	–	172,226,464
	<u>–</u>	<u>172,226,464</u>	<u>–</u>	<u>172,226,464</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(d) 公允价值估计(续)

中银香港全天候亚洲(日本除外)股票基金

	第一层级 美元	第二层级 美元	第三层级 美元	总计 美元
2021年6月30日				
金融资产				
集合投资计划	608,055	—	—	608,055
上市权益性证券	5,019,680	—	—	5,019,680
存托凭证	793,641	—	—	793,641
	<u>6,421,376</u>	<u>—</u>	<u>—</u>	<u>6,421,376</u>
金融负债				
外汇远期合约	—	3,039	—	3,039
可赎回份额(按成交价)	—	6,587,074	—	6,587,074
	<u>—</u>	<u>6,590,113</u>	<u>—</u>	<u>6,590,113</u>
2020年6月30日				
金融资产				
集合投资计划	1,084,153	—	—	1,084,153
上市权益性证券	4,339,110	—	—	4,339,110
存托凭证	1,116,479	—	—	1,116,479
外汇远期合约	—	437	—	437
	<u>6,539,742</u>	<u>437</u>	<u>—</u>	<u>6,540,179</u>
金融负债				
可赎回份额(按成交价)	—	6,794,406	—	6,794,406
	<u>—</u>	<u>6,794,406</u>	<u>—</u>	<u>6,794,406</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(d) 公允价值估计(续)

中银香港全天候中国收益基金

	第一层级 港元	第二层级 港元	第三层级 港元	总计 港元
2021年6月30日				
金融资产				
集合投资计划	5,801,439	—	—	5,801,439
上市权益性证券	92,051,647	—	—	92,051,647
存托凭证	2,321,299	—	—	2,321,299
挂牌债务证券	—	23,247,706	—	23,247,706
	<u>100,174,385</u>	<u>23,247,706</u>	<u>—</u>	<u>123,422,091</u>
金融负债				
外汇远期合约	—	216,469	—	216,469
可赎回份额(按成交价)	—	126,036,483	—	126,036,483
	<u>—</u>	<u>126,252,952</u>	<u>—</u>	<u>126,252,952</u>
2020年6月30日				
金融资产				
集合投资计划	5,909,130	2,294,381	—	8,203,511
上市权益性证券	51,142,797	—	—	51,142,797
外汇远期合约	—	31,896	—	31,896
挂牌债务证券	—	62,485,721	—	62,485,721
	<u>57,051,927</u>	<u>64,811,998</u>	<u>—</u>	<u>121,863,925</u>
金融负债				
可赎回份额(按成交价)	—	127,843,805	—	127,843,805
	<u>—</u>	<u>127,843,805</u>	<u>—</u>	<u>127,843,805</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(d) 公允价值估计(续)

中银香港全天候亚太高收益基金

	第一层级 美元	第二层级 美元	第三层级 美元	总计 美元
2021年6月30日				
金融资产				
集合投资计划	2,106,624	—	—	2,106,624
存托凭证	573,604	—	—	573,604
上市权益性证券	8,878,280	—	—	8,878,280
挂牌债务证券	—	2,656,791	—	2,656,791
	<u>11,558,508</u>	<u>2,656,791</u>	<u>—</u>	<u>14,215,299</u>
金融负债				
外汇远期合约	—	38,423	—	38,423
可赎回份额(按成交价)	—	14,334,529	—	14,334,529
	<u>—</u>	<u>14,372,952</u>	<u>—</u>	<u>14,372,952</u>
2020年6月30日				
金融资产				
集合投资计划	864,601	—	—	864,601
上市权益性证券	4,955,430	—	—	4,955,430
挂牌债务证券	—	5,643,259	—	5,643,259
存托凭证	429,466	—	—	429,466
外汇远期合约	—	1,897	—	1,897
	<u>6,249,497</u>	<u>5,645,156</u>	<u>—</u>	<u>11,894,653</u>
金融负债				
可赎回份额(按成交价)	—	12,486,271	—	12,486,271
	<u>—</u>	<u>12,486,271</u>	<u>—</u>	<u>12,486,271</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(d) 公允价值估计(续)

中银香港全天候短期债券基金

	第一层级 美元	第二层级 美元	第三层级 美元	总计 美元
2021年6月30日				
金融资产				
挂牌债务证券	–	54,616,921	–	54,616,921
外汇远期合约	–	37,928	–	37,928
	–	54,654,849	–	54,654,849
金融负债				
外汇远期合约	–	132,900	–	132,900
可赎回份额(按成交价)	–	91,537,492	–	91,537,492
	–	91,670,392	–	91,670,392
2020年6月30日				
金融资产				
集合投资计划	–	9,683,425	–	9,683,425
挂牌债务证券	–	167,728,875	–	167,728,875
外汇远期合约	–	339,245	–	339,245
	–	177,751,545	–	177,751,545
金融负债				
外汇远期合约	–	1,033,320	–	1,033,320
可赎回份额(按成交价)	–	312,537,629	–	312,537,629
	–	313,570,949	–	313,570,949

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(d) 公允价值估计(续)

中银香港全天候一带一路债券基金

	第一层级 美元	第二层级 美元	第三层级 美元	总计 美元
2021年6月30日				
金融资产				
上市权益性证券	1,961,015	–	–	1,961,015
集合投资计划	297,908	813,528	–	1,111,436
挂牌债务证券	–	23,265,860	–	23,265,860
	<u>2,258,923</u>	<u>24,079,388</u>	<u>–</u>	<u>26,338,311</u>
金融负债				
外汇远期合约	–	125,920	–	125,920
可赎回份额(按成交价)	–	28,480,048	–	28,480,048
	<u>–</u>	<u>28,605,968</u>	<u>–</u>	<u>28,605,968</u>
	第一层级 美元	第二层级 美元	第三层级 美元	总计 美元
2020年6月30日				
金融资产				
上市权益性证券	1,179,978	–	–	1,179,978
集合投资计划	–	927,464	–	927,464
挂牌债务证券	–	19,828,725	–	19,828,725
外汇远期合约	–	3,412	–	3,412
	<u>1,179,978</u>	<u>20,759,601</u>	<u>–</u>	<u>21,939,579</u>
金融负债				
可赎回份额(按成交价)	–	22,831,409	–	22,831,409
	<u>–</u>	<u>22,831,409</u>	<u>–</u>	<u>22,831,409</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(d) 公允价值估计(续)

中银香港全天候大湾区策略基金

	第一层级 美元	第二层级 美元	第三层级 美元	总计 美元
2021年6月30日				
金融资产				
集合投资计划	2,696,850	–	–	2,696,850
挂牌债务证券	–	218,743,839	–	218,743,839
	<u>2,696,850</u>	<u>218,743,839</u>	<u>–</u>	<u>221,440,689</u>
金融负债				
外汇远期合约	–	362,234	–	362,234
可赎回份额(按成交价)	–	223,739,254	–	223,739,254
	<u>–</u>	<u>224,101,488</u>	<u>–</u>	<u>224,101,488</u>
	第一层级 美元	第二层级 美元	第三层级 美元	总计 美元
2020年6月30日				
金融资产				
集合投资计划	–	1,874,857	–	1,874,857
挂牌债务证券	–	182,433,214	–	182,433,214
外汇远期合约	–	12,292	–	12,292
	<u>–</u>	<u>184,320,363</u>	<u>–</u>	<u>184,320,363</u>
金融负债				
可赎回份额(按成交价)	–	187,891,834	–	187,891,834
	<u>–</u>	<u>187,891,834</u>	<u>–</u>	<u>187,891,834</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

9 财务风险管理(续)

(d) 公允价值估计(续)

中银香港全天候亚洲高息债券基金

	第一层级 美元	第二层级 美元	第三层级 美元	总计 美元
2021年6月30日				
金融资产				
集合投资计划	–	407,663	–	407,663
挂牌债务证券	–	35,182,380	–	35,182,380
	–	35,590,043	–	35,590,043
金融负债				
外汇远期合约	–	109,702	–	109,702
可赎回份额(按成交价)	–	35,522,803	–	35,522,803
	–	35,632,505	–	35,632,505

价值基于活跃市场报价的投资包括上市存托凭证、上市集合投资计划及上市权益性证券。子基金并未调整这些工具的报价，因此分类为第一层级。

在不被视为活跃的市场内交易但根据市场报价、交易商报价或由可观察输入数据支持的其他定价来源估值的金融工具分类为第二层级。这些工具包括挂牌债务证券、外汇远期合约及不公开买卖的投资基金。由于第二层级投资包括不在活跃市场买卖及/或须受转让限制的状况，估值可能予以调整以反映非流动性及/或不可转让性，其一般根据可取得市场资料得出。

分类为第三层级的投资因为不常交易，因此有重大不可观察输入数据。由于这些证券并无可观察价格，因此子基金利用估值方法获得其公允价值。

可赎回份额的可卖回价值是根据子基金的说明书，按子基金于估值日的总资产及所有其他负债的净差额进行计算的。子基金的份额可按受托人每日计算的报价于任何营业日发行及赎回。这些份额不在证券交易所买卖。然而，该价格是可观察的，且与子基金的交易定期按该价格进行。由于子基金按报价提供其股份的流动性，故基金管理人认为市场参与者也将按此价格进行交易，原因是买家或卖家预期不会接受有别于该报价的价格。因此，基金管理人得出结论，于报告日，在未作出调整的情况下，对可赎回份额公允价值的最适当估算为其报价，而可赎回份额分类为第二层级。该价格是采用归属于份额持有人的资产净值除以已发行份额数目计算得出的。

9 财务风险管理 (续)

(d) 公允价值估计 (续)

子基金的资产及负债 (但以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及负债以及归属份额持有人的资产净值除外) 按摊销成本入账。资产净值表所披露的这些资产及负债的帐面价值是合理的且接近于公允价值。

现金及现金等价物包括库存现金、银行存款及活跃市场中的其他短期投资。应收股息、应收利息、应收认购 / 申购款项及应收经纪人款项指为结算交易及其他义务而结欠子基金的合约金额。应付分配、应付赎回款项、应付经纪人款项、应付费用、计息银行借款、应计费用及其他应付款项指子基金为结算交易及费用而结欠的合约金额和义务。

(e) 资本风险管理

子基金的资本指归属于份额持有人的资产净值。归属于份额持有人的资产净值的金额可能每日大幅改变, 原因为子基金须按份额持有人的选择每日认购 / 申购及赎回。

子基金管理资本的目标是保障其持续经营能力, 旨在为份额持有人提供回报及为其他利益关联方提供收益, 并维持雄厚的资本基础以支持子基金的投资活动。

为维持或调整资本架构, 子基金的政策旨在执行下列事项:

- 监控相关流动资产的每日认购 / 申购及赎回水平; 及
- 根据基金信托契约赎回及发行份额。

受托人及基金管理人基于归属于份额持有人的资产净值监控资本。

10 归属于份额持有人的资产净值及已发行份额数目

子基金的资本指子基金的可赎回份额，并在资产净值表中列为归属于份额持有人的资产净值。年内认购／申购及赎回的份额在归属于份额持有人的资产净值变动报表中予以列示。为实现投资目标，子基金致力于根据财务报表附注9所概述的投资政策投资其资本，同时维持足够的流动资金以满足赎回要求。相关流动资金通过持有流动投资增加。

根据基金说明书的规定，为发行和赎回及其他收费而确定基金份额净值时，投资是按估值日的最后成交价入账。归属于份额持有人的资产净值为资产净值表中的一项负债，且假设份额持有人行使权利赎回在子基金中的份额，将该负债按于期间结算日应付的赎回金额入账。

子基金管理其赎回份额义务的目标及政策载于附注9(e)资本风险管理及附注9(b)流动资金风险中。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

10 归属于份额持有人的资产净值及已发行份额数目(续)

下表概述了各子基金的已发行份额数目及相关类别的归属于份额持有人的每份额资产净值：

于2021年6月30日

	中银香港全天候 环球投资基金		中银香港全天候 中国高息债券基金		中银香港全天候 香港股票基金		中银香港全天候 在岸人民币股票基金		中银香港全天候 亚洲债券基金		中银香港全天候 亚洲(日本除外)股票基金	
	已发行 份额数目	每份 资产净值	已发行 份额数目	每份 资产净值	已发行 份额数目	每份 资产净值	已发行 份额数目	每份 资产净值	已发行 份额数目	每份 资产净值	已发行 份额数目	每份 资产净值
-A1类份额	140,355,1410	12.36美元	34,035,054,3040	人民币10.05元	11,933,549,7060	13.37港元	3,598,836,3130	人民币13.71元	7,397,785,5600	10.05美元	38,144,2570	12.97美元
-A2类份额	3,079,291,3850	12.38港元	659,201,3530	9.56美元	222,056,1090	13.36美元	996,897,9260	13.17美元	44,913,587,6440	10.06港元	1,288,163,2310	12.94港元
-A3类份额	983,4770	16.98澳元	34,451,769,7120	9.58港元	19,343,5580	13.22澳元	18,097,520,2160	13.19港元	-	-	-	-
-A4类份额	-	-	485,614,8720	9.33澳元	-	-	-	-	-	-	-	-
-A7类份额	-	-	-	-	216,309,9860	人民币14.83元	-	-	26,167,586,9540	人民币10.71元	131,058,1250	人民币13.22元
-A8类份额	-	-	2,732,601,0620	9.07美元	-	-	-	-	-	-	-	-
-A9类份额	-	-	-	-	-	-	4,073,784,0980	12.12港元	-	-	-	-
-I1类份额	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	97,560,9750	13.07美元
-I2类份额	-	-	-	-	500,409,1590	13.44美元	253,432,7620	13.21美元	-	-	-	-
-X1类份额	-	-	16,708,665,1820	人民币14.34元	3,233,577,6480	12.51港元	-	-	3,548,973,7430	11.97美元	-	-
-X2类份额	1,691,153,8370	13.72港元	-	-	-	-	-	-	-	-	1,353,604,1740	13.79港元
-X3类份额	-	-	-	-	-	-	1,074,498,5670	13.28港元	-	-	-	-

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

10 归属于份额持有人的资产净值及已发行份额数目(续)

于2021年6月30日(续)

	中银香港全天候 中国收益基金		中银香港全天候 亚太高收益基金		中银香港全天候 短期债券基金		中银香港全天候 一带一路债券基金		中银香港全天候 大湾区策略基金		中银香港全天候 亚洲高息债券基金	
	已发行 份额数目	每份 资产净值	已发行 份额数目	每份 资产净值	已发行 份额数目	每份 资产净值	已发行 份额数目	每份 资产净值	已发行 份额数目	每份 资产净值	已发行 份额数目	每份 资产净值
-A1类份额	8,632,530,8210	8.07港元	237,666,0200	9.54美元	2,297,864,6740	10.35美元	663,295,2930	10.52美元	3,519,250,9340	9.67美元	792,238,3330	10.08美元
-A2类份额	213,156,2870	8.12美元	6,468,987,3670	9.44港元	19,056,987,2470	10.26港元	7,505,137,9460	10.41港元	77,525,839,5920	9.75港元	11,908,489,5930	10.10港元
-A3类份额	-	-	-	-	100,568,1040	人民币9.71元	-	-	20,407,402,5020	9.74澳门元	-	-
-A4类份额	-	-	95,555,2230	8.91澳元	-	-	-	-	4,775,512,1570	人民币9.47元	106,933,4750	10.06澳元
-A7类份额	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	39,458,8680	10.03英镑
-A8类份额	2,082,637,9310	人民币8.33元	1,069,935,2630	人民币9.71元	-	-	6,856,497,7310	人民币10.79元	-	-	-	-
-A9类份额	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	2,945,757,3970	人民币10.25元
-A10类份额	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	34,498,7120	10.07欧元
-A11类份额	-	-	-	-	-	-	-	-	21,297,889,4570	人民币10.09元	-	-
-I1类份额	-	-	-	-	3,420,196,6280	10.39美元	-	-	500,000,0000	10.74美元	-	-
-X1类份额	2,668,213,4570	8.27港元	1,99,004,9750	9.83美元	117,509,9630	10.42美元	-	-	2,027,520,0120	10.45美元	-	-
-X2类份额	-	-	-	-	4,243,443,5930	10.35港元	-	-	-	-	4,157,160,1640	10.74港元

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

10 归属于份额持有人的资产净值及已发行份额数目(续)

于2020年6月30日

	中银香港全天候 环球投资基金		中银香港全天候 中国高息债券基金		中银香港全天候 香港股票基金		中银香港全天候 在岸人民币股票基金		中银香港全天候 亚洲债券基金		中银香港全天候 亚洲(日本除外)股票基金	
	已发行 份额数目	每份 资产净值	已发行 份额数目	每份 资产净值	已发行 份额数目	每份 资产净值	已发行 份额数目	每份 资产净值	已发行 份额数目	每份 资产净值	已发行 份额数目	每份 资产净值
-A1类份额	132,305,3100	10.76美元	51,867,931,0130	人民币9.96元	10,907,742,4520	10.48港元	3,043,211,4670	人民币10.61元	6,029,743,85	10.04美元	34,929,2870	10.40美元
-A2类份额	2,480,679,6760	10.76港元	1,199,543,3880	8.68美元	294,377,0610	10.49美元	1,112,051,4600	9.32美元	41,044,906,66	10.03港元	922,810,9460	10.44港元
-A3类份额	983,4770	15.02澳元	37,496,636,1550	8.68港元	38,000,4050	10.63澳元	17,341,315,2580	9.32港元	-	-	-	-
-A4类份额	-	-	385,694,1780	9.41澳元	-	-	-	-	-	-	-	-
-A7类份额	-	-	-	-	130,504,0370	人民币11.38元	-	-	12,245,067,92	人民币10.48元	191,775,2110	人民币10.51元
-A8类份额	-	-	3,295,236,9930	9.20美元	-	-	-	-	-	-	-	-
-A9类份额	-	-	-	-	-	-	1,584,544,9400	9.56港元	-	-	-	-
-I1类份额	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	97,560,9750	10.51美元
-I2类份额	-	-	-	-	394,866,7320	10.52美元	-	-	-	-	-	-
-X1类份额	-	-	21,194,916,9900	人民币13.34元	2,979,502,7090	9.69港元	-	-	3,548,973,74	11.38美元	50,000,0000	11.06美元
-X2类份额	1,691,153,8370	11.78港元	-	-	93,896,7130	10.57美元	-	-	-	-	2,350,613,1470	10.95港元

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

10 归属于份额持有人的资产净值及已发行份额数目(续)

于2020年6月30日(续)

	中银香港全天候 中国收益基金		中银香港全天候 亚太高收益基金		中银香港全天候 短期债券基金		中银香港全天候 一带一路债券基金		中银香港全天候 大湾区策略基金	
	已发行 份额数目	每份 资产净值	已发行 份额数目	每份 资产净值	已发行 份额数目	每份 资产净值	已发行 份额数目	每份 资产净值	已发行 份额数目	每份 资产净值
-A1类份额	10,661,677,0640	8.07港元	260,022,0830	8.69美元	5,779,976,0810	10.45美元	8,423,816,640	10.23美元	3,089,630,7710	10.08美元
-A2类份额	310,037,2150	8.13美元	6,949,571,2910	8.58港元	18,208,239,8730	10.34港元	7,660,383,3050	10.10港元	57,021,593,8310	9.93港元
-A3类份额	-	-	-	-	79,870,4780	人民币10.71元	-	-	30,882,881,5790	9.93澳门元
-A4类份额	-	-	117,501,0970	8.24澳元	-	-	-	-	2,119,356,3850	人民币10.57元
-A8类份额	2,482,392,1840	人民币8.18元	1,518,594,4590	人民币8.68元	-	-	3,104,238,7940	人民币10.28元	-	-
-A11类份额	-	-	-	-	-	-	-	-	11,530,490,7900	人民币10.09元
-C1类份额	-	-	-	-	980,819,7700	10.45美元	-	-	-	-
-II类份额	-	-	-	-	5,680,587,2740	10.48美元	-	-	500,000,0000	10.50美元
-I6类份额	-	-	-	-	12,493,790,1260	10.46欧元	-	-	-	-
-X1类份额	-	-	-	-	405,871,6830	10.49美元	-	-	2,027,520,0120	10.13美元
-X2类份额	-	-	-	-	5,075,390,3050	10.39港元	-	-	-	-

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

11 非金钱收益安排／佣金分成安排

在截至2021年及2020年6月30日止的年度内，基金管理人与经纪人签订了非金钱收益安排／佣金分成安排，据此，已收取用于支持作出投资决定的若干商品及服务。基金管理人已代表子基金与经纪人进行了约定金额的交易，并根据香港证监会颁布的守则及指引，基于这些商品及服务的对价支付这些交易的佣金。交易详情如下：

	2021年		2020年	
	执行的交易金额	已支付佣金	执行的交易金额	已支付佣金
中银香港全天候环球投资基金	9,996,400美元	10,762美元	650,041美元	457美元
中银香港全天候香港股票基金	1,258,520,039港元	1,322,577港元	254,296,401港元	268,265港元
中银香港全天候在岸人民币 股票基金	人民币272,743,043元	人民币293,517元	-	-
中银香港全天候亚洲(日本除外) 股票基金	9,203,355美元	9,519美元	-	-
中银香港全天候中国收益基金	83,192,318港元	86,272港元	57,331,213港元	60,390港元
中银香港全天候亚太高收益基金	31,196,668美元	33,609美元	60,867美元	66美元
中银香港全天候一带一路债券 基金	549,045美元	9美元	513,429美元	181美元

这些商品及服务必须可证实对子基金有利，并可包括研究及咨询服务、经济及政治分析、含估值及业绩评估的组合分析、市场分析及数据与报价服务、上述商品及服务附带的计算机硬件及软件、结算与托管服务以及相关投资的刊物。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

12 与基金管理人、受托人及其关联人进行的交易

基金管理人及受托人的关联人为香港证监会守则所定义的人士。子基金与基金管理人、受托人及其关联人于年内签订的所有交易均在正常业务过程中按一般商业条款执行。据基金管理人所知，子基金与这些关联人并未进行任何其他交易，但在财务报表附注4、附注18及下文中予以披露的除外。

(a) 与基金管理人的关联人、受托人及其关联人的银行存款往来

截至报告期末，存放于基金管理人的关联人及受托人的银行存款如下：

	2021年	2020年
中银香港全天候环球投资基金	395,874美元	769,772美元
中银香港全天候中国高息债券基金	人民币17,397,597元	人民币46,286,144元
中银香港全天候香港股票基金	50,097,933港元	5,083,014港元
中银香港全天候在岸人民币股票基金	人民币15,959,442元	人民币3,155,972元
中银香港全天候亚洲债券基金	966,623美元	6,877,778美元
中银香港全天候亚洲(日本除外)股票基金	181,237美元	285,294美元
中银香港全天候中国收益基金	3,321,241港元	9,098,749港元
中银香港全天候亚太高收益基金	180,158美元	671,487美元
中银香港全天候短期债券基金	414,770美元	2,375,343美元
中银香港全天候一带一路债券基金	1,681,838美元	1,008,472美元
中银香港全天候大湾区策略基金	4,259,100美元	6,023,860美元
中银香港全天候亚洲高息债券基金	2,198,287美元	-

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

12 与基金管理人、受托人及其关联人进行的交易(续)

(b) 从与基金管理人的关联人及受托人的银行存款赚取的利息收入

在报告期内，按一般商业利率从在基金管理人的关联人及受托人存放的银行存款赚取的利息收入如下：

	2021年	2020年
中银香港全天候环球投资基金	5美元	212美元
中银香港全天候中国高息债券基金	人民币3,316元	人民币65,417元
中银香港全天候香港股票基金	2,875港元	7,954港元
中银香港全天候在岸人民币股票基金	人民币3,845元	人民币6,223元
中银香港全天候亚洲债券基金	857美元	2,833美元
中银香港全天候亚洲(日本除外)股票基金	19美元	75美元
中银香港全天候中国收益基金	324港元	2,936港元
中银香港全天候亚太高收益基金	83美元	324美元
中银香港全天候短期债券基金	590美元	2,546美元
中银香港全天候一带一路债券基金	352美元	928美元
中银香港全天候大湾区策略基金	1,076美元	32,987美元
中银香港全天候亚洲高息债券基金	213美元	-

(c) 从投资于基金管理人的关联人及受托人发行的定息银行存款证赚取的利息收入

在报告期内，按一般商业利率从基金管理人的关联人及受托人发行的定息银行存证证赚取的利息收入如下：

	2021年	2020年
中银香港全天候环球投资基金	4美元	-
中银香港全天候短期债券基金	180,823美元	225,384美元
中银香港全天候大湾区策略基金	-	23,664美元

(d) 就基金管理人的关联人及受托人的计息贷款支付的利息开支

在报告期内，按一般商业利率就基金管理人的关联人及受托人的计息贷款支付的利息开支如下：

	2021年	2020年
中银香港全天候短期债券基金	1,189美元	-

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

12 与基金管理人、受托人及其关联人进行的交易(续)

(e) 基金管理人的关联人及受托人的银行收费

在报告期内，基金管理人的关联人及受托人的银行收费如下：

	2021年	2020年
中银香港全天候环球投资基金	174美元	296美元
中银香港全天候中国高息债券基金	人民币7,847元	人民币9,918元
中银香港全天候香港股票基金	2,301港元	2,584港元
中银香港全天候在岸人民币股票基金	人民币301元	人民币957元
中银香港全天候亚洲债券基金	1,037美元	4,029美元
中银香港全天候亚洲(日本除外)股票基金	280美元	136美元
中银香港全天候中国收益基金	5,871港元	13,959港元
中银香港全天候亚太高收益基金	407美元	178美元
中银香港全天候短期债券基金	2,809美元	8,437美元
中银香港全天候一带一路债券基金	217美元	1,603美元
中银香港全天候大湾区策略基金	784美元	5,278美元
中银香港全天候亚洲高息债券基金	26美元	-

(f) 在子基金中的持有量

子基金允许基金管理人、其关联人及基金管理人管理的其他基金认购/申购及赎回子基金的份额。基金管理人及其关联人在报告期末在子基金中的持有量如下：

基金管理人及其关联人持有的份额 ¹ :	于年初/期初 尚未行使的份额	于年内/期内 发行的份额	于年内/期内 赎回的份额	于年末/期末 尚未行使的份额
2021年6月30日				
中银香港全天候环球投资基金				
- A1类	123,439.8850	11,302.2410	(3,463.2910)	131,278.8350
- A2类	2,475,604.1470	2,579,137.7140	(1,993,048.3330)	3,061,693.5280
- A3类	281.8980	-	-	281.8990
- X2类	1,691,153.8370	-	-	1,691,153.8370
中银香港全天候中国高息债券基金				
- A1类	43,616,808.7370	3,394,586.2190	(15,431,978.3710)	31,579,416.5850
- A2类	1,127,112.4410	257,352.3380	(814,515.3920)	569,949.3870
- A3类	35,120,523.6880	8,626,777.3620	(11,151,365.2690)	32,595,935.7810
- A4类	363,861.0110	211,218.8390	(111,917.4610)	463,162.3890
- A8类	3,293,959.4570	462,096.7320	(1,024,732.6630)	2,731,323.5260
- X1类	21,194,916.9900	-	(4,486,251.8080)	16,708,665.1800

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

12 与基金管理人、受托人及其关联人进行的交易(续)

(f) 在子基金中的持有量(续)

基金管理人及其关联人持有的份额 ¹ : (续)	于年初/期初 尚未行使的份额	于年内/期内 发行的份额	于年内/期内 赎回的份额	于年末/期末 尚未行使的份额
2021年6月30日				
中银香港全天候香港股票基金				
- A1类	8,599,956.0040	3,120,598.2010	(2,459,760.2630)	9,260,793.9420
- A2类	289,033.3190	34,787.6440	(113,100.4740)	210,720.4890
- A3类	38,000.4050	19,575.2040	(39,413.7100)	18,161.8990
- A7类	114,444.8050	153,540.0110	(54,885.9490)	213,098.8670
- X1类	2,979,502.7090	1,850,481.1250	(1,596,406.1860)	3,233,577.6480
- X2类	93,896.7130	-	(93,896.7130)	-
中银香港全天候在岸人民币股票基金				
- A1类	2,716,864.8330	2,790,191.3450	(2,171,051.0670)	3,336,005.1110
- A2类	959,834.0270	499,671.1130	(807,057.7920)	652,447.3480
- A3类	14,318,782.6490	7,400,007.9930	(7,494,846.4520)	14,223,944.1900
- A9类	1,584,544.9400	7,451,488.5480	(4,976,710.9560)	4,059,322.5320
- X3类	-	1,074,498.5670	-	1,074,498.5670
中银香港全天候亚洲债券基金				
- A1类	5,978,965.3630	4,513,568.6610	(3,163,212.6990)	7,329,321.3250
- A2类	39,807,102.3940	29,631,431.4970	(25,435,866.7460)	44,002,667.1450
- A7类	10,921,308.2710	20,634,737.2790	(6,006,713.3510)	25,549,332.1990
- X1类	3,548,973.7430	-	-	3,548,973.7430
中银香港全天候亚洲(日本除外)股票基金				
- A1类	34,929.2870	20,128.9770	(16,914.0070)	38,144.2570
- A2类	922,810.9460	975,835.6990	(610,483.4140)	1,288,163.2310
- A7类	191,775.2110	98,888.2650	(159,605.3510)	131,058.1250
- X1类	50,000.0000	-	(50,000.0000)	-
- X2类	2,350,613.1470	-	(997,008.9730)	1,353,604.1740
中银香港全天候中国收益基金				
- A1类	10,661,677.0640	926,536.1650	(2,955,682.4080)	8,632,530.8210
- A2类	310,037.2150	9,024.7070	(105,905.6350)	213,156.2870
- A8类	2,470,337.0090	36,435.0180	(436,189.2710)	2,070,582.7560
- X1类	-	2,668,213.4570	-	2,668,213.4570

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

12 与基金管理人、受托人及其关联人进行的交易(续)

(f) 在子基金中的持有量(续)

基金管理人及其关联人持有的份额 ¹ :(续)	于年初/期初 尚未行使的份额	于年内/期内 发行的份额	于年内/期内 赎回的份额	于年末/期末 尚未行使的份额
2021年6月30日				
中银香港全天候亚太高收益基金				
- A1类	260,022.0830	101,810.4500	(146,849.7780)	214,982.7550
- A2类	6,949,571.2910	2,500,606.0040	(2,981,189.9280)	6,468,987.3670
- A4类	117,501.0970	10,274.4630	(32,220.3370)	95,555.2230
- A8类	1,518,594.4590	661,548.7700	(1,112,180.2590)	1,067,962.9700
- X1类	-	199,004.9750	-	199,004.9750
中银香港全天候短期债券基金				
- A1类	5,779,880.6100	2,763,163.6210	(6,245,179.5570)	2,297,864.6740
- A2类	17,753,352.7290	19,670,855.7390	(18,383,845.3330)	19,040,363.1350
- A3类	79,870.4780	45,382.2730	(24,684.6470)	100,568.1040
- X1类	405,871.6830	755,629.4390	(1,043,991.1590)	117,509.9630
- X2类	5,075,390.3050	70,378,641.4200	(71,210,558.1320)	4,243,473.5930
中银香港全天候一带一路债券基金				
- A1类	814,238.1640	283,609.7740	(434,552.6450)	663,295.2930
- A2类	7,646,589.1150	2,860,991.7980	(3,029,236.2920)	7,478,344.6210
- A8类	3,104,238.7940	4,572,456.2400	(820,197.3030)	6,856,497.7310
中银香港全天候大湾区策略基金				
- A1类	3,027,008.5500	2,086,644.0320	(1,663,023.1270)	3,450,629.4550
- A2类	56,423,903.1110	57,143,848.9890	(40,056,119.3650)	73,511,632.7350
- A3类	30,882,881.5790	12,679,315.4580	(23,154,794.5350)	20,407,402.5020
- A4类	2,077,961.3370	2,960,908.6850	(622,353.1440)	4,416,516.8780
- A11类	11,477,519.4740	13,600,436.0650	(4,347,820.7990)	20,730,134.7400
- X1类	2,027,520.0120	-	-	2,027,520.0120
中银香港全天候亚洲高息债券基金				
- A1类	-	1,260,104.6180	(467,866.2850)	792,238.3330
- A2类	-	16,721,898.5130	(4,860,855.4350)	11,861,043.0780
- A4类	-	327,826.7310	(220,893.2560)	106,933.4750
- A7类	-	183,423.7980	(143,964.9300)	39,458.8680
- A9类	-	4,068,075.2930	(1,122,317.8960)	2,945,757.3970
- A10类	-	61,151.6480	(26,652.9360)	34,498.7120
- X2类	-	5,555,109.8370	(1,397,949.6730)	4,157,160.1640

¹ 不包括基金管理人的董事及其关联人

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

12 与基金管理人、受托人及其关联人进行的交易(续)

(f) 在子基金中的持有量(续)

基金管理人及其关联人持有的份额:	于年初/期初尚未行使的份额	于年内/期内发行的份额	于年内/期内赎回的份额	于年末/期末尚未行使的份额
2020年6月30日				
中银香港全天候环球投资基金				
- A1类	125,326.9430	2,286.4020	(4,173.4600)	123,439.8850
- A2类	1,915,766.3680	1,299,124.0150	(739,286.2360)	2,475,604.1470
- A3类	1,471.6500	59.1750	(1,248.9260)	281.8980
- X2类	1,691,153.8370	-	-	1,691,153.8370
中银香港全天候中国高息债券基金				
- A1类	62,090,910.0410	4,751,046.6990	(23,225,148.0030)	43,616,808.7370
- A2类	1,359,698.6100	451,799.4840	(684,385.6530)	1,127,112.4410
- A3类	40,157,173.1570	8,846,363.1000	(13,883,012.5690)	35,120,523.6880
- A4类	276,006.8340	148,608.6020	(60,754.4250)	363,861.0110
- A8类	2,037,423.2640	1,499,934.5160	(243,398.3230)	3,293,959.4570
- X1类	31,194,916.9900	-	(10,000,000.0000)	21,194,916.9900
中银香港全天候香港股票基金				
- A1类	10,007,937.9170	4,140,716.5300	(5,548,698.4430)	8,599,956.0040
- A2类	352,659.8780	1,422.1550	(65,048.7140)	289,033.3190
- A3类	36,119.7090	14,397.9290	(12,517.2330)	38,000.4050
- A7类	139,789.6010	54,493.8330	(79,838.6290)	114,444.8050
- X1类	3,972,551.3680	744,274.8090	(1,737,323.4680)	2,979,502.7090
- X2类	-	93,896.7130	-	93,896.7130
中银香港全天候在岸人民币股票基金				
- A1类	5,623,181.5770	40,205.8990	(2,946,522.6430)	2,716,864.8330
- A2类	1,398,727.9740	60,273.0240	(499,166.9710)	959,834.0270
- A3类	18,693,973.9440	1,195,270.8920	(5,570,462.1870)	14,318,782.6490
- A9类	591,613.4170	1,455,468.5320	(462,537.0090)	1,584,544.9400
- X1类	-	777,903.0430	(777,903.0430)	-
中银香港全天候亚洲债券基金				
- A1类	987,038.3050	6,790,791.9690	(1,798,864.9110)	5,978,965.3630
- A2类	13,974,291.1360	47,553,937.4950	(21,721,126.2370)	39,807,102.3940
- A7类	2,758,676.0390	11,655,686.6560	(3,493,054.4240)	10,921,308.2710
- X1类	1,728,073.4210	1,820,900.3220	-	3,548,973.7430
中银香港全天候亚洲(日本除外)股票基金				
- A1类	30,418.5800	28,570.6020	(24,059.8950)	34,929.2870
- A2类	784,469.6580	505,053.0670	(366,711.7790)	922,810.9460
- A7类	206,089.2720	8,896.4130	(23,210.4740)	191,775.2110
- X1类	50,000.0000	-	-	50,000.0000
- X2类	2,350,613.1470	-	-	2,350,613.1470

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

12 与基金管理人、受托人及其关联人进行的交易(续)

(f) 在子基金中的持有量(续)

基金管理人及其关联人持有的份额 ¹ (续):	于年初/期初 尚未行使的份额	于年内/期内 发行的份额	于年内/期内 赎回的份额	于年末/期末 尚未行使的份额
2020年6月30日				
中银香港全天候中国收益基金				
- A1类	11,909,946.7320	468,302.1970	(1,716,571.8650)	10,661,677.0640
- A2类	745,937.3760	27,935.4880	(463,835.6490)	310,037.2150
- A8类	4,032,297.4320	157,919.0730	(1,719,879.4960)	2,470,337.0090
中银香港全天候亚太高收益基金				
- A1类	420,567.8980	40,025.3450	(200,571.1600)	260,022.0830
- A2类	8,582,572.6650	861,621.2840	(2,494,622.6580)	6,949,571.2910
- A4类	89,177.6410	43,471.3900	(15,147.9340)	117,501.0970
- A8类	1,784,172.8900	37,003.2800	(302,581.7110)	1,518,594.4590
中银香港全天候短期债券基金				
- A1类	3,278,820.8800	5,096,006.2530	(2,594,946.5230)	5,779,880.6100
- A2类	12,451,466.8010	17,053,248.1810	(11,751,362.2530)	17,753,352.7290
- A3类	52,520.0480	46,027.9170	(18,677.4870)	79,870.4780
- X1类	1,051,075.2270	288,361.7200	(933,565.2640)	405,871.6830
- X2类	10,119,606.0140	-	(5,044,215.7090)	5,075,390.3050
中银香港全天候一带一路债券基金				
- A1类	721,158.6190	384,328.7390	(291,249.1940)	814,238.1640
- A2类	10,547,384.3300	2,790,366.0930	(5,691,161.3080)	7,646,589.1150
- A8类	3,356,356.6350	3,105,688.4580	(3,357,806.2990)	3,104,238.7940
中银香港全天候大湾区策略基金				
- A1类	-	4,792,061.0590	(1,765,052.5090)	3,027,008.5500
- A2类	-	93,602,177.6410	(37,178,274.5300)	56,423,903.1110
- A3类	-	35,840,417.7790	(4,957,536.2000)	30,882,881.5790
- A4类	-	2,761,551.3000	(683,589.9630)	2,077,961.3370
- A11类	-	17,117,901.1820	(5,640,381.7080)	11,477,519.4740
- X1类	-	2,027,520.0120	-	2,027,520.0120

¹ 不包括基金管理人的董事及其关联人

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

12 与基金管理人、受托人及其关联人进行的交易(续)

(f) 在子基金中的持有量(续)

在报告期内，基金管理人及其关联人于子基金的认购及赎回金额如下：

	于截至2021年 6月30日止年度/ 期间发行的金额	于截至2021年 6月30日止年度/ 期间赎回的金额	于截至2020年 6月30日止年度/ 期间发行的金额	于截至2020年 6月30日止年度/ 期间赎回的金额
中银香港全天候环球投资基金	美元	美元	美元	美元
- A1类	135,022	(41,001)	24,191	(45,243)
- A2类	3,578,305	(2,745,084)	1,756,863	(1,006,612)
- A3类	-	-	613	(13,165)
中银香港全天候中国高息债券基金	人民币	人民币	人民币	人民币
- A1类	33,741,151	(156,469,633)	48,396,212	(240,411,562)
- A2类	16,479,612	(51,185,077)	29,270,466	(44,070,480)
- A3类	68,830,761	(89,435,893)	58,567,999	(100,204,076)
- A4类	9,927,677	(5,309,034)	7,087,360	(2,582,921)
- A8类	28,038,995	(62,401,656)	93,655,413	(16,492,364)
- X1类	-	(62,000,000)	-	(134,100,000)
中银香港全天候香港股票基金	港元	港元	港元	港元
- A1类	38,296,412	(31,251,232)	41,471,401	(55,965,584)
- A2类	3,644,015	(11,053,003)	118,673	(5,299,996)
- A3类	1,255,336	(2,688,336)	803,285	(741,151)
- A7类	2,810,958	(893,480)	673,240	(1,031,411)
- X1类	25,000,000	(19,313,084)	7,800,000	(15,020,139)
- X2类	-	(9,618,276)	7,826,900	-
中银香港全天候在岸人民币股票基金	人民币	人民币	人民币	人民币
- A1类	34,986,797	(27,916,451)	406,557	(25,816,849)
- A2类	39,538,740	(63,276,551)	3,554,173	(24,641,472)
- A3类	76,723,269	(72,063,932)	8,009,971	(36,665,752)
- A9类	68,026,494	(45,436,837)	10,358,019	(3,270,585)
- X1类	-	-	6,900,000	(6,705,524)
- X3类	12,477,626	-	-	-
中银香港全天候亚洲债券基金	美元	美元	美元	美元
- A1类	46,319,970	(32,346,560)	69,767,361	(18,341,647)
- A2类	38,266,193	(33,193,821)	62,298,062	(27,590,785)
- A7类	33,156,238	(9,907,996)	17,743,650	(5,201,096)
- X1类	-	-	20,000,000	-
中银香港全天候亚洲(日本除外) 股票基金	美元	美元	美元	美元
- A1类	231,399	(163,698)	289,459	(250,598)
- A2类	1,629,262	(988,237)	667,570	(486,883)
- A7类	195,531	(300,580)	12,510	(36,347)
- X1类	-	(713,500)	-	-
- X2类	-	(1,877,986)	-	-

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

12 与基金管理人、受托人及其关联人进行的交易(续)

(f) 在子基金中的持有量(续)

	于截至2021年 6月30日止年度/ 期间发行的金额	于截至2021年 6月30日止年度/ 期间赎回的金额	于截至2020年 6月30日止年度/ 期间发行的金额	于截至2020年 6月30日止年度/ 期间赎回的金额
中银香港全天候中国收益基金	港元	港元	港元	港元
- A1类	7,782,881	(24,969,440)	4,063,568	(14,986,593)
- A2类	583,392	(6,957,051)	1,953,979	(31,329,746)
- A8类	380,323	(4,290,238)	1,584,482	(16,762,410)
- X1类	23,000,000	-	-	-
中银香港全天候亚太高收益基金	美元	美元	美元	美元
- A1类	939,941	(1,382,638)	364,279	(1,824,557)
- A2类	23,620,321	(28,203,467)	625,297	(2,554,334)
- A4类	88,388	(301,896)	253,932	(88,232)
- A8类	6,265,680	(10,681,698)	45,683	(397,918)
- X1类	2,000,000	-	-	-
中银香港全天候短期债券基金	美元	美元	美元	美元
- A1类	28,921,233	(65,456,579)	52,744,848	(27,009,374)
- A2类	26,443,047	(24,381,487)	22,352,707	(15,353,227)
- A3类	69,440	(37,551)	69,200	(28,173)
- X1类	8,000,000	(11,120,436)	3,000,000	(9,622,571)
- X2类	94,625,456	(96,591,640)	-	(6,686,053)
中银香港全天候一带一路债券基金	美元	美元	美元	美元
- A1类	2,754,890	(4,354,800)	3,918,298	(3,008,371)
- A2类	3,859,010	(4,076,926)	3,665,895	(7,335,413)
- A8类	7,553,569	(1,337,464)	4,593,414	(5,051,365)
中银香港全天候大湾区策略基金	美元	美元	美元	美元
- A1类	19,525,460	(15,088,299)	21,314,230	(17,606,186)
- A2类	73,617,264	(51,012,400)	73,212,589	(44,296,487)
- A3类	15,659,744	(28,856,663)	12,125,715	(5,845,947)
- A4类	4,481,072	(935,513)	2,099,542	(895,500)
- A11类	20,894,805	(6,565,609)	16,785,717	(7,239,432)
- X1类	-	-	20,000,000	-
中银香港全天候亚洲高息债券基金	美元	美元	美元	美元
- A1类	12,720,487	(4,778,000)	-	-
- A2类	22,283,842	(6,869,582)	-	-
- A4类	2,311,702	(1,711,402)	-	-
- A7类	2,332,824	(1,982,165)	-	-
- A9类	5,973,595	(1,791,454)	-	-
- A10类	694,227	(317,012)	-	-
- X2类	7,225,307	(1,931,969)	-	-

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

12 与基金管理人、受托人及其关联人进行的交易(续)

(f) 在子基金中的持有量(续)

基金管理人的董事持有的份额：	于年初／期初／ 董事委任日期 尚未行使的份额	于年内／期内 发行的份额	于年内／期内 赎回的份额	于年末／期末／ 董事辞任日期 尚未行使的份额
2021年6月30日				
中银香港全天候环球投资基金				
– A2类	3,308.7640	–	(3,308.7640)	–
中银香港全天候亚洲债券基金				
– A1类	1,146.3000	18,638.9200	(19,785.2200)	–
– A2类	5,255.5500	20,211.4870	(25,467.0370)	–
中银香港全天候香港股票基金				
– A1类	17,161.0000	12,872.0820	–	30,033.0820
中银香港全天候在岸人民币 股票基金				
– A3类	–	44,768.9170	–	44,768.9170
– A9类	–	326,661.3760	–	326,661.3760
中银香港全天候短期债券基金				
– A1类	22,512.3100	956.4500	5,868.7600	17,600.0000
– A2类	398,860.0520	4,835.6200	213,221.3400	190,475.0520
– A3类	34,758.9680	–	–	34,758.9680
中银香港全天候大湾区策略基金				
– A1类	784.4400	–	784.4400	–
中银香港全天候亚洲高息债券基金				
– A1类	–	1,542.8140	–	1,542.8140

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

12 与基金管理人、受托人及其关联人进行的交易(续)

(f) 在子基金中的持有量(续)

基金管理人的董事持有的份额：	于年初／期初／ 董事委任日期 尚未行使的份额	于年内／期内 发行的份额	于年内／期内 赎回的份额	于年末／期末／ 董事辞任日期 尚未行使的份额
2020年6月30日				
中银香港全天候环球投资基金				
- A2类	-	3,308.7640	-	3,308.7640
中银香港全天候中国高息债券基金				
- A1类	1,617.2920	-	-	1,617.2920 ²
- A3类	8.2830	72,108.6250	(72,116.9080)	-
- A8类	-	7,083.1160	(7,083.1160)	-
中银香港全天候亚洲债券基金				
- A1类	-	1,146.3000	-	1,146.3000
- A2类	-	5,255.5500	-	5,255.5500
中银香港全天候香港股票基金				
- A1类	17,161.00001	-	-	17,161.0000
中银香港全天候短期债券基金				
- A1类	25,647.7100	11,024.6000	(14,160.0000)	22,512.3100
- A2类	388,304.05201	69,805.9000	(59,250.0000)	398,860.0520
- A3类	34,758.96801	-	-	34,758.9680
中银香港全天候大湾区策略基金				
- A1类	-	784.4400	-	784.4400

¹ 这些份额由截至2020年6月30日止年度内获委任的董事持有。

² 这些份额由截至2020年6月30日止年度内辞任的董事持有。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

12 与基金管理人、受托人及其关联人进行的交易(续)

(f) 在子基金中的持有量(续)

由基金管理人管理的某些其他基金投资于某些子基金。于2021年6月30日及2020年6月30日上述其他基金所投资的股份数目及交易数量如下：

	于2021年 6月30日 收盘时的持股	购买 港元	出售 港元	于2021年 6月30日的 市值 港元	期内收益 分配 港元
中银香港全天候香港股票基金					
中银香港全天候一带一路债券基金	505,051	-	-	813,528	-
中银香港全天候环球投资基金	-	-	(556,522)	-	-
		美元	美元	美元	美元
中银香港全天候亚洲(日本除外) 股票基金					
中银香港全天候环球投资基金	-	-	(713,500)	-	-
中银香港全天候香港股票基金	-	-	(14,568,899)	-	-
		美元	美元	美元	美元
中银香港全天候短期债券基金					
中银香港全天候亚洲债券基金	-	-	(3,064,478)	-	-
	于2020年 6月30日 收盘时的持股	购买 港元	出售 港元	于2020年 6月30日的 市值 港元	期内收益 分配 港元
中银香港全天候香港股票基金					
中银香港全天候一带一路债券基金	505,051	-	-	631,435	-
中银香港全天候环球投资基金	404,984	-	-	506,329	-

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

12 与基金管理人、受托人及其关联人进行的交易(续)

(f) 在子基金中的持有量(续)

	于2020年 6月30日 收盘时的持股	购买 美元	出售 美元	于2020年 6月30日的 市值 美元	期内收益 分配 美元
中银香港全天候亚洲(日本除外) 股票基金					
中银香港全天候环球投资基金	50,000	-	-	553,000	-
中银香港全天候香港股票基金	997,009	-	-	10,917,248	-
		美元	美元	美元	美元
中银香港全天候短期债券基金					
中银香港全天候亚洲债券基金	288,362	3,000,000	-	3,024,886	-
中银香港全天候大湾区策略基金	-	-	(9,622,571)	-	-

(g) 投资于由基金管理人的关联人及受托人及基金管理人管理的其他集合投资计划发行的证券

某些子基金投资于由基金管理人的关联人及受托人发行的上市权益性证券及挂牌债务证券。某些子基金也持有由基金管理人管理的被投资基金的投资。该等被投资基金于报告期内并无收取表现费。

于2021年6月30日及2020年6月30日上述子基金投资的股份数目及金额如下：

	于2021年 6月30日 收盘时的 持股	于2020年 7月1日 的市值 美元	购买 美元	出售 美元	投资净利得 /(净损失) 美元	于2021年 6月30日 的市值 美元	于2021年 6月30日 占资产净值 的百分比 %
中银香港全天候环球投资基金							
中银香港盈荟系列－中银香港							
全天候香港股票基金－X1	-	506,329	-	(556,522)	50,193	-	-
中银香港盈荟系列－中银香港							
全天候(日本除外)股票基金－X1	-	553,000	-	(713,500)	-	-	-
BOC AVIATION LTD 2.625%							
S/A 17SEP2030 REGS	-	-	197,059	(198,354)	-	-	-

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

12 与基金管理人、受托人及其关联人进行的交易(续)

(g) 投资于由基金管理人的关联人及受托人及基金管理人管理的其他集合投资计划发行的证券(续)

	于2021年 6月30日 收盘时的 持股	于2020年 7月1日 的市值 人民币	购买 人民币	出售 人民币	投资净利得 /(净损失) 人民币	于2021年 6月30日 的市值 人民币	于2021年 6月30日 占资产净值 的百分比 %
中银香港全天候中国高息债券基金							
BOC (EUROPE) UCITS SICAV – BOCHK RMB HIGH YIELD BOND FUND-CD USD HEDGED	10,774	7,413,405	-	-	(741,123)	6,672,282	0.62%
BANK OF CHINA/HONG KONG 2.8% S/A 14JAN2023	-	-	5,600,000	(5,628,000)	628,000	-	-
		港元	港元	港元	港元	港元	
中银香港全天候香港股票基金							
中银香港(控股)有限公司	-	2,958,000	-	(2,610,000)	(348,000)	-	-
中银香港盈荟系列-中银香港 全天候(日本除外)股票基金-X2	-	10,917,248	-	(14,568,899)	3,651,651	-	-
		美元	美元	美元	美元	美元	
中银香港全天候亚洲债券基金							
BCHINA2411%5 BANK OF CHINA LTD 5% S/A 13NOV2024 REGS	2,500,000	557,135	2,277,449	-	(44,009)	2,790,575	1.28%
BOCAVI2109%2.375 BOC AVIATION LTD 2.375% S/A 15SEP2021 REGS	200,000	200,476	-	-	(180)	200,296	0.09%
BOCAVI2312%2.75 BOC AVIATION LTD 2.75% S/A 02DEC2023	-	1,512,870	-	(1,532,013)	19,143	-	-
BOCAVI2504%3.25 BOC AVIATION LTD 3.25% S/A 29APR2025 REGS	2,600,000	2,049,020	633,719	-	54,775	2,737,514	1.25%
		港元	港元	港元	港元	港元	
中银香港全天候中国收益基金							
中国银行股份有限公司-H股	-	1,191,050	-	(1,101,908)	(89,142)	-	-
中银香港(控股)有限公司	-	369,750	-	(338,951)	(30,800)	-	-
BOC AVIATION LTD 2.75% S/A 02DEC2023	-	2,741,959	-	(2,831,900)	89,941	-	-
BANK OF CHINA/HONG KONG 2.8% S/A 14JAN2023	-	-	1,676,890	(1,686,240)	9,350	-	-
		美元	美元	美元	美元	美元	
中银香港全天候亚太高收益基金							
HK.2588中银航空租赁有限公司	-	-	248,959	(254,264)	5,304	-	-
HK.2388中银香港(控股)有限公司	-	95,413	-	(83,323)	(12,091)	-	-

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

12 与基金管理人、受托人及其关联人进行的交易(续)

(g) 投资于由基金管理人的关联人及受托人及基金管理人管理的其他集合投资计划发行的证券(续)

	于2021年 6月30日 收盘时 的持股	于2020年 7月1日 的市值 美元	购买 美元	出售 美元	投资净利得 /(净损失) 美元	于2021年 6月30日 的市值 美元	于2021年 6月30日 占资产净值 的百分比 %
中银香港全天候短期债券基金							
BANK OF CHINA/HONG KONG							
2.8% S/A 14JAN2023	-	-	1,269,724	1,277,731	(2,547,456)	-	-
BOC AVIATION LTD 2.75% S/A							
02DEC2023	-	-	3,095,988	3,134,907	(6,230,894)	-	-
		美元	美元	美元	美元	美元	
中银香港全天候一带一路债券基金							
BCHINA2301%2.8 BANK OF							
CHINA/HONG KONG 2.8%							
S/A 14JAN2023	-	-	216,270	(217,937)	1,668	-	-
BOCAVI2312%2.75 BOC AVIATION							
LTD 2.75% S/A 02DEC2023	-	505,398	-	(521,060)	15,663	-	-
HK.BOCHKX1 中银香港盈荟系列 -							
中银香港全天候香港股票基金 -X1	505,051	631,435	-	-	182,092	813,528	2.85%
		美元	美元	美元	美元	美元	
中银香港全天候大湾区策略基金							
BANK OF CHINA LTD/HONG							
KONG 3.625% S/A 17APR2029							
	1,810,000	729,172	-	-	1,079,145	1,808,317	0.80%
BOC AVIATION LTD 3.25% S/A							
29APR2025 REGS	3,000,000	1,768,892	1,057,119	-	349,451	3,175,462	1.41%
BOC AVIATION LTD 2.75% S/A							
02DEC2023	750,000	2,060,214	2,250,000	(1,038,782)	(2,493,634)	777,799	0.35%
BOC AVIATION LTD 2.625% S/A							
17SEP2030 REGS	-	-	3,322,741	(3,279,132)	(43,609)	-	-

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

12 与基金管理人、受托人及其关联人进行的交易(续)

(g) 投资于由基金管理人的关联人及受托人及基金管理人管理的其他集合投资计划发行的证券(续)

	于2020年 6月30日 收盘时 的持股	于2019年 7月1日 的市值 美元	购买 美元	出售 美元	投资净利得 /(净损失) 美元	于2020年 6月30日 的市值 美元	于2020年 6月30日 占资产净值 的百分比 %
中银香港全天候环球投资基金							
中银香港盈荟系列 - 中银香港							
全天候香港股票基金 - X1	404,984	499,315	-	-	7,013	506,329	6.80%
中银香港盈荟系列 - 中银香港							
全天候(日本除外)股票基金 - X1	50,000	536,000	-	-	17,000	553,000	7.43%
		人民币	人民币	人民币	人民币	人民币	
中银香港全天候中国高息债券基金							
BOC (EUROPE) UCITS SICAV -							
BOCHK RMB HIGH YIELD							
BOND FUND-CD USD HEDGED	10,774	7,618,565	-	-	(205,160)	7,413,405	0.53%
BANK OF CHINA LTD 3.6% A							
PERP	-	-	21,087,600	(20,694,823)	(392,777)	-	-
BOC AVIATION LTD 2.75% S/A							
02DEC2023	-	-	6,271,129	(6,316,997)	45,868	-	-
		港元	港元	港元	港元	港元	
中银香港全天候香港股票基金							
中银香港(控股)有限公司							
中国银行股份有限公司 - H股	120,000	3,075,000	567,250	-	(684,250)	2,958,000	1.40%
中银香港盈荟系列 - 中银香港							
全天候亚洲(日本除外)股票基金 - X2	-	4,950,000	-	(4,521,150)	(428,850)	-	-
	997,009	10,667,996	-	-	249,252	10,917,248	5.18%
		美元	美元	美元	美元	美元	
中银香港全天候亚洲债券基金							
BCHINA2411%5 BANK OF CHINA							
LTD 5% S/A 13NOV2024 REGS	500,000	538,385	-	-	18,750	557,135	0.32%
BOCAVI2109%2.375 BOC AVIATION							
LTD 2.375% S/A 15SEP2021 REGS	200,000	197,988	-	-	2,488	200,476	0.12%
BOCAVI2312%2.75 BOC AVIATION							
LTD 2.75% S/A 02DEC2023	1,500,000	-	1,745,660	(249,778)	16,988	1,512,870	0.88%
BOCAVI2504%3.25 BOC AVIATION							
LTD 3.25% S/A 29APR2025 REGS	2,000,000	-	2,011,147	-	37,873	2,049,020	1.19%

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

12 与基金管理人、受托人及其关联人进行的交易(续)

(g) 投资于由基金管理人的关联人及受托人及基金管理人管理的其他集合投资计划发行的证券(续)

	于2020年 6月30日 收盘时 的持股	于2019年 7月1日 的市值 美元	购买 美元	出售 美元	投资净利得 /(净损失) 美元	于2020年 6月30日 的市值 美元	于2020年 6月30日 占资产净值 的百分比 %
中银香港全天候(日本除外)股票基金							
中银香港(控股)有限公司	-	49,211	8,602	46,603	(104,416)	-	-
中国银行股份有限公司-H股	-	42,250	8,105	44,844	(95,199)	-	-
		港元	港元	港元	港元	港元	
中银香港全天候中国收益基金							
中国银行股份有限公司-H股	415,000	2,640,000	-	(1,141,791)	(307,159)	1,191,050	0.93%
BANK OF CHINA LTD 3.6% A PERP	-	-	7,793,800	(7,747,959)	(45,841)	-	-
中银香港(控股)有限公司	15,000	2,152,500	-	(1,571,760)	(210,990)	369,750	0.29%
BOC AVIATION LTD 2.75% S/A 02DEC2023	350,000	-	2,706,646	-	35,313	2,741,959	2.14%
		美元	美元	美元	美元	美元	
中银香港全天候亚太高收益基金							
HK.2588中银航空租赁有限公司	-	251,962	46,235	(337,942)	39,745	-	-
HK.2388中银香港(控股)有限公司	30,000	137,792	-	(17,304)	(25,075)	95,413	0.76%
		美元	美元	美元	美元	美元	
中银香港全天候短期债券基金							
BANK OF CHINA LTD/HONG KONG 3M L+0.77% Q 14FEB2020							
	-	5,605,656	-	5,600,000	(11,205,656)	-	-
BANK OF CHINA LTD/ LUXEMBOURG 3M L+1% Q 12JUL2019							
	-	450,077	-	450,000	(900,077)	-	-

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

12 与基金管理人、受托人及其关联人进行的交易(续)

(g) 投资于由基金管理人的关联人及受托人及基金管理人管理的其他集合投资计划发行的证券(续)

	于2020年 6月30日 收盘时 的持股	于2019年 7月1日 的市值 美元	购买 美元	出售 美元	投资净利得 /(净损失) 美元	于2020年 6月30日 的市值 美元	于2020年 6月30日 占资产净值 的百分比 %
中银香港全天候一带一路债券基金							
BCHINA2904%3.625 BANK OF CHINA LTD/HONG KONG 3.625% S/A 17APR2029	-	206,772	-	(218,257)	11,485	-	-
BCHINAPERP%3.6 BANK OF CHINA LTD 3.6% A PERP	-	-	1,000,000	(968,480)	(31,520)	-	-
BOCAVI2312%2.75 BOC AVIATION LTD 2.75% S/A 02DEC2023	500,000	-	877,818	(379,662)	7,242	505,398	2.21%
HK.BOCHKX1 中银香港盈荟系列 - 中银香港全天候香港股票基金 - X1	505,051	622,689	-	-	8,746	631,435	2.76%
		美元	美元	美元	美元	美元	
中银香港全天候大湾区策略基金							
中银香港盈荟系列 - 中银香港 全天候短期债券基金 - X1	-	-	15,500,000	(15,624,971)	124,971	-	-
中银香港盈荟系列 - 中银香港 全天候香港股票基金 - X1	-	-	1,274,925	(1,057,702)	(217,223)	-	-
BANK OF CHINA LTD/MACAU 1.7% A 04NOV2019 FXCD	-	-	1,977,135	(1,982,161)	5,025	-	-
BANK OF CHINA LTD 3.6% A PERP	-	-	5,000,000	(4,776,250)	(223,750)	-	-
BANK OF CHINA LTD/HONG KONG 3.625% S/A 17APR2029	-	-	637,286	-	91,886	729,172	0.39%
BOC AVIATION LTD 3.25% S/A 29APR2025 REGS	-	-	2,011,147	-	49,067	2,060,214	1.09%
BOC AVIATION LTD 2.75% S/A 02DEC2023	-	-	1,745,660	-	23,232	1,768,892	0.94%

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

12 与基金管理人、受托人及其关联人进行的交易(续)

(h) 与基金管理人的关联人进行的投资交易

基金管理人的关联人宝生证券及期货有限公司就子基金的证券买卖提供经纪人服务。于截至2021年6月30日及2020年6月30日止年度，交易细节如下：

中银香港全天候香港股票基金

	买卖证券 的总值 港元	支付的 佣金总额 港元	占年内 子基金交易 总额的 百分比 %	平均 佣金率 %
2021年6月30日				
宝生证券及期货有限公司	—	—	—	—
2020年6月30日				
宝生证券及期货有限公司	74,218,121	118,644	20.71	0.16

(i) 基金管理人的关联人赚取的費用

在截至2021年及2020年6月30日止年度，基金管理人的关联人从子基金的投资者处收取的首次认购／申购费用及转换费用如下：

	2021年	2020年
中银香港全天候环球投资基金	26,536美元	6,614美元
中银香港全天候中国高息债券基金	人民币1,051,578元	人民币933,156元
中银香港全天候香港股票基金	366,713港元	217,504港元
中银香港全天候在岸人民币股票基金	人民币1,938,185元	人民币115,788元
中银香港全天候亚洲债券基金	1,285,648美元	1,789,334美元
中银香港全天候亚洲(日本除外)股票基金	9,900美元	7,978美元
中银香港全天候中国收益基金	42,840港元	66,216港元
中银香港全天候亚太高收益基金	54,621美元	11,121美元
中银香港全天候短期债券基金	32,576美元	77,810美元
中银香港全天候一带一路债券基金	187,202美元	161,899美元
中银香港全天候大湾区策略基金	962,364美元	723,071美元
中银香港全天候亚洲高息债券基金	480,791美元	—

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

12 与基金管理人、受托人及其关联人进行的交易(续)

(j) 投资于由基金管理人的关联人及受托人及基金管理人管理的其他集合投资计划发行的权益性证券赚取的股息收入

在报告期内，投资于由基金管理人的关联人及受托人及基金管理人管理的其他集合投资计划发行的权益性证券赚取的股息收入如下：

	2021年	2020年
中银香港全天候中国高息债券基金	人民币386,822元	人民币494,067元
中银香港全天候香港股票基金	172,680港元	65,400港元
中银香港全天候亚洲(日本除外)股票基金	-	871美元
中银香港全天候中国收益基金	101,748港元	34,164港元
中银香港全天候亚太高收益基金	5,570美元	7,342美元

(k) 投资于由基金管理人的关联人及受托人发行的债务证券赚取的利息收入

在报告期内，投资于由基金管理人的关联人及受托人发行的债务证券赚取的利息收入如下：

	2021年	2020年
中银香港全天候亚洲债券基金	188,588美元	29,750美元
中银香港全天候中国收益基金	37,306港元	-
中银香港全天候短期债券基金	-	131,788美元
中银香港全天候一带一路债券基金	6,875美元	3,625美元
中银香港全天候大湾区策略基金	180,031美元	40,371美元

(l) 受托人收取的股息手续费

在报告期内，由受托人收取并于损益表内确认为其他费用的股息手续费如下：

	2021年	2020年
中银香港全天候中国高息债券基金	人民币14,200元	人民币13,450元
中银香港全天候亚洲债券基金	2,664美元	2,672美元
中银香港全天候中国收益基金	11,820港元	11,340港元
中银香港全天候亚太高收益基金	904美元	936美元
中银香港全天候一带一路债券基金	755美元	602美元
中银香港全天候大湾区策略基金	2,584美元	1,808美元
中银香港全天候亚洲高息债券基金	1,144美元	-

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

13 开办费用

根据基金说明书的规定，子基金的开办费用于前三年内摊销。然而，如同香港财务报告准则所规定，开办费用在发生时计入费用。在资产净值表内列报的归属于份额持有人的资产净值与就处理份额认购及赎回而厘定的归属于份额持有人的资产净值的对帐提供如下：

中银香港全天候短期债券基金

	2021年 美元	2020年 美元
归属于份额持有人的资产净值(按成交价)	91,537,492	312,537,629
开办费用的调整	—	(28,572)
归属于份额持有人的资产净值	<u>91,537,492</u>	<u>312,509,057</u>

中银香港全天候一带一路债券基金

	2021年 美元	2020年 美元
归属于份额持有人的资产净值(按成交价)	28,480,048	22,831,409
开办费用的调整	—	(34,763)
归属于份额持有人的资产净值	<u>28,480,048</u>	<u>22,796,646</u>

中银香港全天候大湾区策略基金

	2021年 美元	2020年 美元
归属于份额持有人的资产净值(按成交价)	223,739,254	187,891,834
开办费用的调整	(24,747)	(49,494)
归属于份额持有人的资产净值	<u>223,714,507</u>	<u>187,842,340</u>

中银香港全天候亚洲高息债券基金

	2021年 美元
归属于份额持有人的资产净值(按成交价)	35,522,803
开办费用的调整	(53,283)
归属于份额持有人的资产净值	<u>35,469,520</u>

于2021年6月30日，子基金的余下摊销期如下：

	余下年期
中银香港全天候大湾区策略基金	1.00
中银香港全天候亚洲高息债券基金	2.00

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2021年6月30日

14 现金及现金等价物

中银香港全天候环球投资基金

	2021年 美元	2020年 美元
银行现金	395,874	511,724
定期存款	–	258,048
	<u>395,874</u>	<u>769,772</u>

中银香港全天候中国高息债券基金

	2021年 人民币	2020年 人民币
银行现金	<u>17,397,597</u>	<u>46,286,144</u>

中银香港全天候香港股票基金

	2021年 港元	2020年 港元
银行现金	<u>50,097,933</u>	<u>5,083,014</u>

中银香港全天候在岸人民币股票基金

	2021年 人民币	2020年 人民币
银行现金	<u>16,374,917</u>	<u>6,816,276</u>

中银香港全天候亚洲债券基金

	2021年 美元	2020年 美元
银行现金	<u>986,533</u>	<u>6,897,825</u>

中银香港全天候亚洲(日本除外)股票基金

	2021年 美元	2020年 美元
银行现金	<u>181,237</u>	<u>285,294</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2021年6月30日

14 现金及现金等价物(续)

中银香港全天候中国收益基金

	2021年 港元	2020年 港元
银行现金	3,321,241	9,098,749

中银香港全天候亚太高收益基金

	2021年 美元	2020年 美元
银行现金	180,158	671,487

中银香港全天候短期债券基金

	2021年 美元	2020年 美元
银行现金	414,770	2,375,343
定期存款	34,710,630	136,218,001
	<u>35,125,400</u>	<u>138,593,344</u>

中银香港全天候一带一路债券基金

	2021年 美元	2020年 美元
银行现金	1,681,838	1,008,472

中银香港全天候大湾区策略基金

	2021年 美元	2020年 美元
银行现金	4,259,100	6,023,860

中银香港全天候亚洲高息债券基金

	2021年 美元
银行现金	<u>2,198,287</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

14 现金及现金等价物(续)

银行现金为由子基金的托管人持有并存入附带浮动利息的帐户的银行结存。

短期定期存款乃视乎子基金的即时现金需求，就一天至三个月不等的期间叙造，并按各自的短期定期存款利率赚取利息。银行结存存放于近期并无违约记录的具信誉银行。

15 计息银行借款

中银香港全天候短期债券基金

	2021年 美元	2020年 美元
银行透支，无抵押	<u>2,512,293</u>	<u>-</u>

银行透支以美元计值。未偿还余额已于2021年7月7日结清。

16 佣金及交易成本

经纪人佣金是关于透过经纪进行的根据交易价值以平均市场收费率计算的经纪人佣金。交易成本是关于在交易所进行的每项交易的交易费用及交易征费，包括受托人与基金管理人不时协定的由受托人收取的交易手续费。

17 向份额持有人作出的收益分配

除中银香港全天候中国高息债券基金、中银香港全天候亚洲债券基金、中银香港全天候中国收益基金、中银香港全天候亚太高收益基金、中银香港全天候一带一路债券基金、中银香港全天候大湾区策略基金及中银香港全天候亚洲高息债券基金外，基金管理人拟就任何子基金作出收益分配，而子基金赚取的任何收入将再投资于该子基金，并反映于该子基金相关类别的份额价值。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

17 向份额持有人作出的收益分配(续)

中银香港全天候中国高息债券基金

人民币

于2019年6月30日的未分配收入	-
年内归属于份额持有人的资产净值减少	(69,386,104)
加：财务费用－向份额持有人作出的收益分配	63,448,204
减：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的净利得	(52,161,874)
收益分配前的未分配收入	(58,099,774)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额人民币0.14元、A2类：每个份额0.12美元、A3类：每个份额0.12港元、A4类：每个份额0.13澳元、A8类：每个份额0.13美元)于2019年10月14日分配	(17,941,587)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额人民币0.14元、A2类：每个份额0.13美元、A3类：每个份额0.13港元、A4类：每个份额0.14澳元、A8类：每个份额0.13美元)于2020年1月8日分配	(16,352,074)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额人民币0.12元、A2类：每个份额0.11美元、A3类：每个份额0.11港元、A4类：每个份额0.12澳元、A8类：每个份额0.11美元)于2020年4月7日分配	(13,482,573)
2020年末期收益分配(A1类：每个份额人民币0.14元、A2类：每个份额0.12美元、A3类：每个份额0.12港元、A4类：每个份额0.13澳元、A8类：每个份额0.13美元)于2020年7月8日分配	(15,671,970)
年内收益分配总额	
－以现金	(56,941,892)
－用作再投资	(6,506,312)
从资本转拨	121,547,978
于2020年6月30日未分配收入	-

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

17 向份额持有人作出的收益分配(续)

中银香港全天候中国高息债券基金(续)

人民币

于2020年6月30日未分配收入	-
年内归属于份额持有人的资产净值增加	10,778,489
加：财务费用－向份额持有人作出的收益分配	49,545,119
加：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的亏损净额	79,269,282
收益分配前的未分配收入	<u>139,592,890</u>
2021年中期收益分配(A1类：每个份额人民币0.13元、A2类：每个份额0.12美元、A3类：每个份额0.12港元、A4类：每个份额0.13澳元、A8类：每个份额0.12美元)于2020年10月15日分配	(13,975,980)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额人民币0.13元、A2类：每个份额0.13美元、A3类：每个份额0.13港元、A4类：每个份额0.08澳元、A8类：每个份额0.12美元)于2020年1月8日分配	(13,223,659)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额人民币0.13元、A2类：每个份额0.12美元、A3类：每个份额0.12港元、A4类：每个份额0.11澳元、A8类：每个份额0.12美元)于2021年4月12日分配	(11,228,656)
2021年末期收益分配(A1类：每个份额人民币0.13元、A2类：每个份额0.13美元、A3类：每个份额0.13港元、A4类：每个份额0.12澳元、A8类：每个份额0.12美元)于2021年7月8日分配	<u>(11,116,824)</u>
年内收益分配总额	
－以现金	(41,571,488)
－用作再投资	(7,973,631)
从资本转拨	<u>(90,047,771)</u>
于2021年6月30日未分配收入	<u><u>-</u></u>

于2021年6月30日应付给份额持有人的末期股息(现金)为人民币9,207,153元(2020年：人民币13,531,686元)，不包括用作再投资的股息人民币1,909,671元(2020年：人民币2,140,284元)。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

17 向份额持有人作出的收益分配(续)

中银香港全天候亚洲债券基金

美元

于2019年6月30日的未分配收入	-
年内归属于份额持有人的资产净值减少	(1,861,453)
加：财务费用 - 向份额持有人作出的收益分配	4,222,351
减：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的净利得	(3,642,191)
收益分配前的未分配收入	<u>(1,281,293)</u>
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.034港元、A7类：每个份额人民币0.035元)于2019年8月7日分配	(447,383)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.035港元、A7类：每个份额人民币0.036元)于2019年9月6日分配	(419,395)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.035港元、A7类：每个份额人民币0.036元)于2019年10月9日分配	(422,784)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.035港元、A7类：每个份额人民币0.036元)于2019年11月7日分配	(398,532)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.035美元、A2类：每个份额0.035港元、A7类：每个份额人民币0.036元)于2019年12月6日分配	(461,644)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.035美元、A2类：每个份额0.035港元、A7类：每个份额人民币0.036元)于2020年1月8日分配	(437,823)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.035美元、A2类：每个份额0.035港元、A7类：每个份额人民币0.036元)于2020年2月7日分配	(395,140)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.035美元、A2类：每个份额0.035港元、A7类：每个份额人民币0.036元)于2020年3月6日分配	(334,336)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.031美元、A2类：每个份额0.031港元、A7类：每个份额人民币0.032元)于2020年4月7日分配	(274,029)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.033美元、A2类：每个份额0.033港元、A7类：每个份额人民币0.034元)于2020年5月8日分配	(239,456)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.033美元、A2类：每个份额0.033港元、A7类：每个份额人民币0.034元)于2020年6月5日分配	(218,031)
2020年末期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.034港元、A7类：每个份额人民币0.036元)于2020年7月8日分配	<u>(173,798)</u>
年内收益分配总额	
- 以现金	(3,809,703)
- 用作再投资	(412,648)
从资本转拨	<u>5,503,644</u>
于2020年6月30日未分配收入	<u><u>-</u></u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

17 向份额持有人作出的收益分配(续)

中银香港全天候亚洲债券基金(续)

	美元
于2020年6月30日未分配收入	-
年内归属于份额持有人的资产净值增加	4,548,046
加：财务费用－向份额持有人作出的收益分配	7,113,119
减：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的净利得	<u>(13,817,508)</u>
收益分配前的未分配收入	(2,156,343)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.034港元、A8类：每个份额人民币0.036元)于2020年8月7日分配	(487,541)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.034港元、A8类：每个份额人民币0.036元)于2020年9月7日分配	(527,816)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.034港元、A8类：每个份额人民币0.036元)于2020年10月9日分配	(541,713)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.034港元、A8类：每个份额人民币0.036元)于2020年11月6日分配	(563,811)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.034港元、A8类：每个份额人民币0.036元)于2020年12月7日分配	(602,214)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.035美元、A2类：每个份额0.035港元、A8类：每个份额人民币0.037元)于2021年1月8日分配	(625,014)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.034港元、A8类：每个份额人民币0.036元)于2021年2月5日分配	(631,364)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.034港元、A8类：每个份额人民币0.036元)于2021年3月5日分配	(654,531)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.034港元、A8类：每个份额人民币0.036元)于2021年4月12日分配	(643,260)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.034港元、A8类：每个份额人民币0.036元)于2021年5月7日分配	(632,802)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.034港元、A8类：每个份额人民币0.036元)于2021年6月7日分配	(609,096)
2021年末期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.034港元、A8类：每个份额人民币0.036元)于2021年7月8日分配	<u>(593,955)</u>
年内收益分配总额	
－以现金	(6,440,501)
－用作再投资	(672,618)
从资本转拨	<u>9,269,462</u>
于2021年6月30日未分配收入	<u>-</u>

于2021年6月30日应付给份额持有人的末期股息(现金)为534,165美元(2020年：405,557美元)，不包括用作再投资的股息59,790美元(2020年：41,825美元)。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

17 向份额持有人作出的收益分配(续)

中银香港全天候中国收益基金

	港元
于2019年6月30日的未分配收入	-
年内归属于份额持有人的资产净值减少	(23,800,933)
加：财务费用－向份额持有人作出的收益分配	5,947,896
加：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的亏损净额	17,158,168
	<hr/>
收益分配前的未分配收入	(694,869)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.027港元、A2类：每个份额0.027美元、A8类：每个份额人民币0.028元)于2019年8月7日分配	(595,943)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.026港元、A2类：每个份额0.026美元、A8类：每个份额人民币0.027元)于2019年9月6日分配	(565,470)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.026港元、A2类：每个份额0.026美元、A8类：每个份额人民币0.026元)于2019年10月9日分配	(559,627)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.026港元、A2类：每个份额0.026美元、A8类：每个份额人民币0.027元)于2019年11月7日分配	(565,176)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.026港元、A2类：每个份额0.026美元、A8类：每个份额人民币0.026元)于2019年12月6日分配	(559,884)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.026港元、A2类：每个份额0.026美元、A8类：每个份额人民币0.026元)于2020年1月8日分配	(557,376)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.026港元、A2类：每个份额0.026美元、A8类：每个份额人民币0.027元)于2020年2月7日分配	(534,071)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.026港元、A2类：每个份额0.026美元、A8类：每个份额人民币0.027元)于2020年3月6日分配	(524,459)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.023港元、A2类：每个份额0.023美元、A8类：每个份额人民币0.023元)于2020年4月7日分配	(365,971)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.023港元、A2类：每个份额0.024美元、A8类：每个份额人民币0.023元)于2020年5月8日分配	(371,904)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.023港元、A2类：每个份额0.024美元、A8类：每个份额人民币0.023元)于2020年6月5日分配	(369,141)
2020年末期收益分配(A1类：每个份额0.024港元、A2类：每个份额0.024美元、A8类：每个份额人民币0.024元)于2020年7月8日分配	(378,874)
	<hr/>
年内收益分配总额	
－以现金	(5,247,298)
－用作再投资	(700,598)
从资本转拨	6,642,765
	<hr/>
于2020年6月30日未分配收入	-
	<hr/> <hr/>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

17 向份额持有人作出的收益分配(续)

中银香港全天候中国收益基金(续)

	港元
于2020年6月30日未分配收入	—
年内归属于份额持有人的资产净值增加	2,662,811
加：财务费用－向份额持有人作出的收益分配	4,147,192
减：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的净利得	<u>(7,581,717)</u>
收益分配前的未分配收入	(771,714)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.024港元、A2类：每个份额0.024美元、A8类：每个份额人民币0.024元)于2020年8月7日分配	(375,688)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.024港元、A2类：每个份额0.024美元、A8类：每个份额人民币0.024元)于2020年9月7日分配	(374,116)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.024港元、A2类：每个份额0.024美元、A8类：每个份额人民币0.024元)于2020年10月9日分配	(363,723)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.024港元、A2类：每个份额0.024美元、A8类：每个份额人民币0.024元)于2020年11月6日分配	(362,611)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.024港元、A2类：每个份额0.024美元、A8类：每个份额人民币0.024元)于2020年12月7日分配	(359,517)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.025港元、A2类：每个份额0.025美元、A8类：每个份额人民币0.025元)于2021年1月8日分配	(367,454)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.025港元、A2类：每个份额0.025美元、A8类：每个份额人民币0.025元)于2021年2月5日分配	(347,236)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.025港元、A2类：每个份额0.025美元、A8类：每个份额人民币0.025元)于2021年3月5日分配	(331,668)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.024港元、A2类：每个份额0.025美元、A8类：每个份额人民币0.025元)于2021年4月12日分配	(320,689)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.024港元、A2类：每个份额0.025美元、A8类：每个份额人民币0.025元)于2021年5月7日分配	(318,611)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.024港元、A2类：每个份额0.025美元、A8类：每个份额人民币0.025元)于2021年6月7日分配	(318,942)
2021年末期收益分配(A1类：每个份额0.024港元、A2类：每个份额0.024美元、A8类：每个份额人民币0.024元)于2021年7月8日分配	<u>(306,937)</u>
年内收益分配总额	
－以现金	(3,542,278)
－用作再投资	(604,914)
从资本转拨	<u>4,918,906</u>
于2021年6月30日未分配收入	<u>—</u>

于2021年6月30日应付给份额持有人的末期股息(现金)为261,545港元(2020年：325,519港元)，不包括用作再投资的股息45,392港元(2020年：53,355美元)。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

17 向份额持有人作出的收益分配(续)

中银香港全天候亚太高收益基金

	美元
于2019年6月30日的未分配收入	-
年内归属于份额持有人的资产净值减少	(1,119,585)
加：财务费用一向份额持有人作出的收益分配	650,528
加：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的亏损净额	491,018
	<hr/>
收益分配前的未分配收入	21,961
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.035美元、A2类：每个份额0.035港元、A4类：每个份额0.034澳元、A8类：每个份额人民币0.035元)于2019年8月7日分配	(61,883)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.034港元、A4类：每个份额0.033澳元、A8类：每个份额人民币0.033元)于2019年9月6日分配	(57,341)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.034港元、A4类：每个份额0.033澳元、A8类：每个份额人民币0.034元)于2019年10月9日分配	(58,167)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.037美元、A2类：每个份额0.037港元、A4类：每个份额0.036澳元、A8类：每个份额人民币0.037元)于2019年11月7日分配	(61,448)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.038美元、A2类：每个份额0.038港元、A4类：每个份额0.037澳元、A8类：每个份额人民币0.038元)于2019年12月6日分配	(61,885)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.038美元、A2类：每个份额0.038港元、A4类：每个份额0.037澳元、A8类：每个份额人民币0.038元)于2020年1月8日分配	(61,936)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.036美元、A2类：每个份额0.036港元、A4类：每个份额0.035澳元、A8类：每个份额人民币0.036元)于2020年2月7日分配	(52,319)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.036美元、A2类：每个份额0.036港元、A4类：每个份额0.035澳元、A8类：每个份额人民币0.036元)于2020年3月6日分配	(52,686)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.031美元、A2类：每个份额0.040港元、A4类：每个份额0.029澳元、A8类：每个份额人民币0.030元)于2020年4月7日分配	(43,394)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.032美元、A2类：每个份额0.031港元、A4类：每个份额0.030澳元、A8类：每个份额人民币0.032元)于2020年5月8日分配	(45,115)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.032美元、A2类：每个份额0.031港元、A4类：每个份额0.030澳元、A8类：每个份额人民币0.032元)于2020年6月5日分配	(45,045)
2020年末期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.034港元、A4类：每个份额0.032澳元、A8类：每个份额人民币0.034元)于2020年7月8日分配	(49,309)
	<hr/>
年内收益分配总额	
- 以现金	(611,101)
- 用作再投资	(39,427)
从资本转拨	628,567
于2020年6月30日未分配收入	<hr/> <hr/>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

17 向份额持有人作出的收益分配(续)

中银香港全天候亚太高收益基金(续)

	美元
于2020年6月30日未分配收入	-
年内归属于份额持有人的资产净值增加	1,523,132
加：财务费用 - 向份额持有人作出的收益分配	608,724
减：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的净利得	(2,363,133)
	<hr/>
收益分配前的未分配收入	(231,277)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.034港元、A4类：每个份额0.032澳元、A8类：每个份额人民币0.034元)于2020年8月7日分配	(50,076)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.034港元、A4类：每个份额0.032澳元、A8类：每个份额人民币0.034元)于2020年9月7日分配	(51,306)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.035美元、A2类：每个份额0.035港元、A4类：每个份额0.033澳元、A8类：每个份额人民币0.035元)于2020年10月9日分配	(51,924)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.035美元、A2类：每个份额0.035港元、A4类：每个份额0.033澳元、A8类：每个份额人民币0.035元)于2020年11月6日分配	(52,332)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.035美元、A2类：每个份额0.035港元、A4类：每个份额0.033澳元、A8类：每个份额人民币0.035元)于2020年12月7日分配	(51,827)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.037美元、A2类：每个份额0.037港元、A4类：每个份额0.035澳元、A8类：每个份额人民币0.037元)于2021年1月8日分配	(55,299)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.037美元、A2类：每个份额0.037港元、A4类：每个份额0.035澳元、A8类：每个份额人民币0.037元)于2021年2月5日分配	(56,944)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.037美元、A2类：每个份额0.037港元、A4类：每个份额0.035澳元、A8类：每个份额人民币0.037元)于2021年3月5日分配	(50,821)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.036美元、A2类：每个份额0.036港元、A4类：每个份额0.034澳元、A8类：每个份额人民币0.037元)于2021年4月12日分配	(49,459)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.036美元、A2类：每个份额0.036港元、A4类：每个份额0.034澳元、A8类：每个份额人民币0.037元)于2021年5月7日分配	(48,398)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.034港元、A4类：每个份额0.032澳元、A8类：每个份额人民币0.035元)于2021年6月7日分配	(45,545)
2021年末期收益分配(A1类：每个份额0.035美元、A2类：每个份额0.034港元、A4类：每个份额0.033澳元、A8类：每个份额人民币0.035元)于2021年7月8日分配	(44,793)
	<hr/>
年内收益分配总额	
- 以现金	(566,424)
- 用作再投资	(42,300)
从资本转拨	840,001
	<hr/>
于2021年6月30日未分配收入	-
	<hr/> <hr/>

于2021年6月30日应付给份额持有人的末期股息(现金)为42,635美元(2020年：46,142美元)，不包括用作再投资的股息2,158美元(2020年：3,166美元)。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

17 向份额持有人作出的收益分配(续)

中银香港全天候一带一路债券基金

	美元
于2019年6月30日的未分配收入	-
年内归属于份额持有人的资产净值减少	(132,206)
加：财务费用 - 向份额持有人作出的收益分配	975,539
减：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的净利得	(1,157,971)
	<hr/>
收益分配前的未分配收入	(314,638)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.034港元、A8类：每个份额人民币0.034元)于2019年8月7日分配	(89,065)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.034港元、A8类：每个份额人民币0.034元)于2019年9月6日分配	(89,176)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.034港元、A8类：每个份额人民币0.034元)于2019年10月9日分配	(85,532)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.034港元、A8类：每个份额人民币0.034元)于2019年11月7日分配	(82,752)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.035美元、A2类：每个份额0.035港元、A8类：每个份额人民币0.035元)于2019年12月6日分配	(93,776)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.035美元、A2类：每个份额0.035港元、A8类：每个份额人民币0.035元)于2020年1月8日分配	(92,936)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.035美元、A2类：每个份额0.035港元、A8类：每个份额人民币0.035元)于2020年2月7日分配	(83,344)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.035美元、A2类：每个份额0.035港元、A8类：每个份额人民币0.035元)于2020年3月6日分配	(81,362)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.032美元、A2类：每个份额0.031港元、A8类：每个份额人民币0.032元)于2020年4月7日分配	(64,635)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.033美元、A2类：每个份额0.032港元、A8类：每个份额人民币0.033元)于2020年5月8日分配	(67,013)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.033美元、A2类：每个份额0.032港元、A8类：每个份额人民币0.033元)于2020年6月5日分配	(69,290)
2020年末期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.034港元、A8类：每个份额人民币0.035元)于2020年7月8日分配	(76,659)
	<hr/>
年内收益分配总额	
- 以现金	(914,50)
- 用作再投资	(60,959)
从资本转拨	(1,290,177)
	<hr/>
于2020年6月30日未分配收入	-
	<hr/> <hr/>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

17 向份额持有人作出的收益分配(续)

中银香港全天候一带一路债券基金(续)

	美元
于2020年6月30日未分配收入	-
年内归属于份额持有人的资产净值增加	1,267,576
加：财务费用－向份额持有人作出的收益分配	1,087,203
减：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的净利得	<u>(2,694,330)</u>
收益分配前的未分配收入	(339,551)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.034港元、A8类：每个份额人民币0.035元)于2020年8月7日分配	(76,622)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.034港元、A8类：每个份额人民币0.035元)于2020年9月7日分配	(81,781)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.033港元、A8类：每个份额人民币0.034元)于2020年10月9日分配	(81,934)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.033港元、A8类：每个份额人民币0.034元)于2020年11月6日分配	(82,049)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.033港元、A8类：每个份额人民币0.034元)于2020年12月7日分配	(85,532)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.035美元、A2类：每个份额0.034港元、A8类：每个份额人民币0.035元)于2021年1月8日分配	(87,678)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.035美元、A2类：每个份额0.034港元、A8类：每个份额人民币0.035元)于2021年2月5日分配	(96,244)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.035美元、A2类：每个份额0.034港元、A8类：每个份额人民币0.035元)于2021年3月5日分配	(107,009)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.035美元、A2类：每个份额0.034港元、A8类：每个份额人民币0.035元)于2021年4月12日分配	(98,861)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.035美元、A2类：每个份额0.034港元、A8类：每个份额人民币0.035元)于2021年5月7日分配	(97,412)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.035美元、A2类：每个份额0.034港元、A8类：每个份额人民币0.035元)于2021年6月7日分配	(96,877)
2021年末期收益分配(A1类：每个份额0.035美元、A2类：每个份额0.035港元、A8类：每个份额人民币0.036元)于2021年7月8日分配	<u>(95,206)</u>
年内收益分配总额	
－以现金	(982,463)
－用作再投资	(104,741)
从资本转拨	<u>1,426,754</u>
于2021年6月30日未分配收入	<u>-</u>

于2021年6月30日应付给份额持有人的末期股息(现金)为84,312美元(2020年：71,478美元)，不包括用作再投资的股息10,894美元(2020年：5,181美元)。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

17 向份额持有人作出的收益分配(续)

中银香港全天候大湾区策略基金

	美元
于2019年6月30日的未分配收入	-
年内归属于份额持有人的资产净值减少	(1,811,943)
加：财务费用－向份额持有人作出的收益分配	6,156,176
减：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的净利得	(6,483,333)
	<hr/>
收益分配前的未分配收入	(2,139,100)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.034港元、A3类：每个份额0.034澳门元、A4类：每个份额人民币0.035元、A11类：每个份额人民币0.034元)于2019年8月7日分配	(410,106)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.034港元、A3类：每个份额0.034澳门元、A4类：每个份额人民币0.036元、A11类：每个份额人民币0.034元)于2019年9月6日分配	(430,430)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.034港元、A3类：每个份额0.034澳门元、A4类：每个份额人民币0.036元、A11类：每个份额人民币0.034元)于2019年10月9日分配	(453,348)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.034港元、A3类：每个份额0.034澳门元、A4类：每个份额人民币0.036元、A11类：每个份额人民币0.035元)于2019年11月7日分配	(509,957)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.035美元、A2类：每个份额0.035港元、A3类：每个份额0.035澳门元、A4类：每个份额人民币0.037元、A11类：每个份额人民币0.035元)于2019年12月6日分配	(554,706)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.035美元、A2类：每个份额0.035港元、A3类：每个份额0.035澳门元、A4类：每个份额人民币0.037元、A11类：每个份额人民币0.035元)于2020年1月8日分配	(565,204)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.035美元、A2类：每个份额0.035港元、A3类：每个份额0.035澳门元、A4类：每个份额人民币0.037元、A11类：每个份额人民币0.035元)于2020年2月7日分配	(579,919)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.035美元、A2类：每个份额0.035港元、A3类：每个份额0.035澳门元、A4类：每个份额人民币0.037元、A11类：每个份额人民币0.035元)于2020年3月6日分配	(623,269)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.032美元、A2类：每个份额0.032港元、A3类：每个份额0.032澳门元、A4类：每个份额人民币0.034元、A11类：每个份额人民币0.032元)于2020年4月7日分配	(480,463)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.033美元、A2类：每个份额0.032港元、A3类：每个份额0.032澳门元、A4类：每个份额人民币0.035元、A11类：每个份额人民币0.033元)于2020年5月8日分配	(491,423)
2020年中期收益分配(A1类：每个份额0.033美元、A2类：每个份额0.032港元、A3类：每个份额0.032澳门元、A4类：每个份额人民币0.035元、A11类：每个份额人民币0.033元)于2020年6月5日分配	(504,876)
2020年末期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.034港元、A3类：每个份额0.034澳门元、A4类：每个份额人民币0.036元、A11类：每个份额人民币0.034元)于2020年7月8日分配	(552,475)
	<hr/>
年内收益分配总额	
－以现金	(4,866,975)
－用作再投资	(1,289,201)
从资本转拨	8,295,276
	<hr/>
于2020年6月30日未分配收入	-
	<hr/> <hr/>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

17 向份额持有人作出的收益分配(续)

中银香港全天候大湾区策略基金(续)

	美元
于2020年6月30日未分配收入	-
年内归属于份额持有人的资产净值增加	(1,816,151)
加：财务费用一向份额持有人作出的收益分配	7,965,629
减：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的净利得	(8,595,027)
	<hr/>
收益分配前的未分配收入	(2,445,549)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.034港元、A3类：每个份额0.034澳门元、A4类：每个份额人民币0.033元、A11类：每个份额人民币0.034元)于2020年8月7日分配	(579,559)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.034港元、A3类：每个份额0.034澳门元、A4类：每个份额人民币0.036元、A11类：每个份额人民币0.034元)于2020年9月7日分配	(621,930)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.033港元、A3类：每个份额0.033澳门元、A4类：每个份额人民币0.034元、A11类：每个份额人民币0.034元)于2020年10月9日分配	(559,881)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.033港元、A3类：每个份额0.033澳门元、A4类：每个份额人民币0.034元、A11类：每个份额人民币0.034元)于2020年11月6日分配	(599,700)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.033港元、A3类：每个份额0.033澳门元、A4类：每个份额人民币0.034元、A11类：每个份额人民币0.034元)于2020年12月7日分配	(676,221)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.034港元、A3类：每个份额0.034澳门元、A4类：每个份额人民币0.033元、A11类：每个份额人民币0.034元)于2021年1月8日分配	(714,171)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.033港元、A3类：每个份额0.033澳门元、A4类：每个份额人民币0.033元、A11类：每个份额人民币0.034元)于2021年2月5日分配	(704,913)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.033港元、A3类：每个份额0.033澳门元、A4类：每个份额人民币0.033元、A11类：每个份额人民币0.034元)于2021年3月5日分配	(736,565)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.033港元、A3类：每个份额0.033澳门元、A4类：每个份额人民币0.033元、A11类：每个份额人民币0.034元)于2021年4月12日分配	(719,046)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.033港元、A3类：每个份额0.033澳门元、A4类：每个份额人民币0.033元、A11类：每个份额人民币0.034元)于2021年5月7日分配	(692,007)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.034美元、A2类：每个份额0.033港元、A3类：每个份额0.033澳门元、A4类：每个份额人民币0.033元、A11类：每个份额人民币0.034元)于2021年6月7日分配	(693,544)
2021年末期收益分配(A1类：每个份额0.033美元、A2类：每个份额0.033港元、A3类：每个份额0.033澳门元、A4类：每个份额人民币0.032元、A11类：每个份额人民币0.034元)于2021年7月8日分配	(668,092)
	<hr/>
年内收益分配总额	
- 以现金	(6,428,313)
- 用作再投资	(1,537,316)
从资本转拨	10,411,178
于2021年6月30日未分配收入	<hr/> <hr/>

于2021年6月30日应付给份额持有人的末期股息(现金)为563,613美元(2020年：414,763美元)，不包括用作再投资的股息104,479美元(2020年：137,712美元)。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

17 向份额持有人作出的收益分配(续)

中银香港全天候亚洲高息债券基金

	美元
于2020年6月30日未分配收入	-
年内归属于份额持有人的资产净值增加	1,309,120
加：财务费用－向份额持有人作出的收益分配	1,379,689
减：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的净利得	<u>(3,328,479)</u>
收益分配前的未分配收入	(639,670)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.049美元、A2类：每个份额0.049港元、A4类：每个份额0.049澳元、A7类：每个份额0.049英镑、A9类：每个份额人民币0.049元、A10类：每个份额0.040欧元)于2020年10月9日分配	(142,030)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.049美元、A2类：每个份额0.049港元、A4类：每个份额0.049澳元、A7类：每个份额0.049英镑、A9类：每个份额人民币0.049元、A10类：每个份额0.040欧元)于2020年11月6日分配	(139,624)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.049美元、A2类：每个份额0.049港元、A4类：每个份额0.049澳元、A7类：每个份额0.049英镑、A9类：每个份额人民币0.049元、A10类：每个份额0.040欧元)于2020年12月7日分配	(135,405)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.050美元、A2类：每个份额0.050港元、A4类：每个份额0.050澳元、A7类：每个份额0.050英镑、A9类：每个份额人民币0.050元、A10类：每个份额0.041欧元)于2021年1月8日分配	(128,215)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.051美元、A2类：每个份额0.051港元、A4类：每个份额0.051澳元、A7类：每个份额0.051英镑、A9类：每个份额人民币0.051元、A10类：每个份额0.042欧元)于2021年2月5日分配	(131,456)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.051美元、A2类：每个份额0.051港元、A4类：每个份额0.051澳元、A7类：每个份额0.033英镑、A9类：每个份额人民币0.051元、A10类：每个份额0.042欧元)于2021年3月5日分配	(128,992)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.051美元、A2类：每个份额0.051港元、A4类：每个份额0.050澳元、A7类：每个份额0.050英镑、A9类：每个份额人民币0.051元、A10类：每个份额0.041欧元)于2021年4月12日分配	(123,082)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.051美元、A2类：每个份额0.051港元、A4类：每个份额0.050澳元、A7类：每个份额0.050英镑、A9类：每个份额人民币0.051元、A10类：每个份额0.041欧元)于2021年5月7日分配	(148,702)
2021年中期收益分配(A1类：每个份额0.051美元、A2类：每个份额0.051港元、A4类：每个份额0.050澳元、A7类：每个份额0.050英镑、A9类：每个份额人民币0.051元、A10类：每个份额0.041欧元)于2021年6月7日分配	(154,933)
2021年末期收益分配(A1类：每个份额0.050美元、A2类：每个份额0.050港元、A4类：每个份额0.050澳元、A7类：每个份额0.050英镑、A9类：每个份额人民币0.051元、A10类：每个份额0.041欧元)于2021年7月8日分配	<u>(147,250)</u>
年内收益分配总额	
－以现金	(1,302,901)
－用作再投资	(76,788)
从资本转拨	2,019,359
于2021年6月30日未分配收入	<u><u>-</u></u>

于2021年6月30日应付给份额持有人的末期股息(现金)为137,769美元，不包括用作再投资的股息9,481美元。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

18 与基金管理人管理的另一个集体投资基金进行的交叉交易

于截至2021年6月30日止年度，并无与基金管理人管理的另一个集体投资基金进行的交叉交易。

于截至2020年6月30日止年度，中银香港全天候中国高息债券基金、中国香港全天候短期债券基金及中国香港全天候大湾区策略基金承诺向由基金管理人管理的投资基金出售金额为9,200,000美元、人民币25,000,000元及1,200,000美元。

基金管理人认为，上述于截至2021年及2020年6月30日止年度出售债券符合中银香港全天候中国高息债券基金、中银香港全天候短期债券基金、中银香港全天候大湾区策略基金及中银香港全天候亚洲高息债券基金的最佳利益，而有关出售是以债券于交易日期的公允价值按公平条款执行。有关出售旨在提升中银香港全天候中国高息债券基金、中银香港全天候短期债券基金、中银香港全天候大湾区策略基金及中银香港全天候亚洲高息债券基金的流动性。

19 报告期后事项

- (a) 于2021年7月29日推出新基金中银香港全天候ESG多元资产基金，作为中银香港盈荟系列的子基金。
- (b) 在截至2021年6月30日止年度后，中银香港全天候中国高息债券基金、中银香港全天候亚洲债券基金、中银香港全天候中国收益基金、中银香港全天候亚太高收益基金、中银香港全天候一带一路债券基金、中银香港全天候大湾区策略基金及中银香港全天候亚洲高息债券基金作出以下中期收益分配：

中银香港全天候中国高息债券基金

A1类

— 于2021年10月15日按每个份额人民币0.12元支付人民币3,786,049元

A2类

— 于2021年10月15日按每个份额0.12美元支付89,900美元

A3类

— 于2021年10月15日按每个份额0.12港元支付4,252,599港元

A4类

— 于2021年10月15日按每个份额0.11澳元支付53,505澳元

A8类

— 于2021年10月15日按每个份额0.11美元支付301,390美元

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

19 报告期后事项(续)

中银香港全天候亚洲债券基金

A1类

- 于2021年8月6日按每个份额0.034美元支付227,618美元
- 于2021年9月7日按每个份额0.034美元支付182,961美元
- 于2021年10月8日按每个份额0.033美元支付165,777美元

A2类

- 于2021年8月6日按每个份额0.034港元支付1,452,925港元
- 于2021年9月7日按每个份额0.034港元支付1,431,468港元
- 于2021年10月8日按每个份额0.033港元支付1,322,598港元

A7类

- 于2021年8月6日按每个份额人民币0.036元支付人民币942,645元
- 于2021年9月7日按每个份额人民币0.036元支付人民币867,118元
- 于2021年10月8日按每个份额人民币0.035元支付人民币833,846元

中银香港全天候中国收益基金

A1类

- 于2021年8月6日按每个份额0.024港元支付206,976港元
- 于2021年9月7日按每个份额0.024港元支付207,603港元
- 于2021年10月8日按每个份额0.023港元支付198,157港元

A2类

- 于2021年8月6日按每个份额0.024美元支付5,118美元
- 于2021年9月7日按每个份额0.024美元支付4,361美元
- 于2021年10月8日按每个份额0.023美元支付4,181美元

A7类

- 于2021年8月6日按每个份额人民币0.024元支付人民币49,462元
- 于2021年9月7日按每个份额人民币0.024元支付人民币49,469元
- 于2021年10月8日按每个份额人民币0.024元支付人民币49,532元

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

19 报告期后事项(续)

中银香港全天候亚太高收益基金

A1类

- 于2021年8月6日按每个份额0.035美元支付8,370美元
- 于2021年9月7日按每个份额0.035美元支付8,157美元
- 于2021年10月8日按每个份额0.033美元支付6,690美元

A2类

- 于2021年8月6日按每个份额0.034港元支付221,677港元
- 于2021年9月7日按每个份额0.034港元支付210,550港元
- 于2021年10月8日按每个份额0.033港元支付196,408港元

A4类

- 于2021年8月6日按每个份额0.033澳元支付3,154澳元
- 于2021年9月7日按每个份额0.033澳元支付3,191澳元
- 于2021年10月8日按每个份额0.031澳元支付3,025澳元

A8类

- 于2021年8月6日按每个份额人民币0.035元支付人民币38,825元
- 于2021年9月7日按每个份额人民币0.035元支付人民币38,816元
- 于2021年10月8日按每个份额人民币0.034元支付人民币36,633元

中银香港全天候一带一路债券基金

A1类

- 于2021年8月6日按每个份额0.035美元支付22,836美元
- 于2021年9月7日按每个份额0.035美元支付22,497美元
- 于2021年10月8日按每个份额0.034美元支付20,863美元

A2类

- 于2021年8月6日按每个份额0.035港元支付260,009港元
- 于2021年9月7日按每个份额0.035港元支付258,951港元
- 于2021年10月8日按每个份额0.033港元支付246,338港元

A8类

- 于2021年8月6日按每个份额人民币0.036元支付人民币250,226元
- 于2021年9月7日按每个份额人民币0.036元支付人民币197,044元
- 于2021年10月8日按每个份额人民币0.035元支付人民币191,787元

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2021年6月30日

19 报告期后事项(续)

中银香港全天候大湾区策略基金

A1类

- 于2021年8月6日按每个份额0.033美元支付116,665美元
- 于2021年9月7日按每个份额0.033美元支付111,909美元
- 于2021年10月8日按每个份额0.032美元支付107,674美元

A2类

- 于2021年8月6日按每个份额0.033港元支付2,568,370港元
- 于2021年9月7日按每个份额0.033港元支付2,522,243港元
- 于2021年10月8日按每个份额0.032港元支付2,402,202港元

A3类

- 于2021年8月6日按每个份额0.033澳门元支付681,219澳门元
- 于2021年9月7日按每个份额0.033澳门元支付654,885澳门元
- 于2021年10月8日按每个份额0.032澳门元支付607,087澳门元

A4类

- 于2021年8月6日按每个份额人民币0.032元支付人民币145,868元
- 于2021年9月7日按每个份额人民币0.032元支付人民币144,398元
- 于2021年10月8日按每个份额人民币0.031元支付人民币138,608元

A11类

- 于2021年8月6日按每个份额人民币0.034元支付人民币717,562元
- 于2021年9月7日按每个份额人民币0.034元支付人民币712,891元
- 于2021年10月8日按每个份额人民币0.033元支付人民币672,334元

中银香港全天候亚洲高息债券基金

A1类

- 于2021年8月6日按每个份额0.050美元支付36,451美元
- 于2021年9月7日按每个份额0.050美元支付36,457美元
- 于2021年10月8日按每个份额0.045美元支付31,902美元

A2类

- 于2021年8月6日按每个份额0.050港元支付610,144港元
- 于2021年9月7日按每个份额0.050港元支付610,967港元
- 于2021年10月8日按每个份额0.045港元支付584,628港元

A4类

- 于2021年8月6日按每个份额0.050澳元支付5,845澳元
- 于2021年9月7日按每个份额0.050澳元支付5,846澳元
- 于2021年10月8日按每个份额0.045澳元支付4,326澳元

A7类

- 于2021年8月6日按每个份额0.050英镑支付1,974英镑
- 于2021年9月7日按每个份额0.050英镑支付1,995英镑
- 于2021年10月8日按每个份额0.045英镑支付1,533英镑

A9类

- 于2021年8月6日按每个份额人民币0.051元支付人民币149,946元
- 于2021年9月7日按每个份额人民币0.051元支付人民币151,004元
- 于2021年10月8日按每个份额人民币0.046元支付人民币124,559元

A10类

- 于2021年8月6日按每个份额人民币0.041元支付人民币1,448元
- 于2021年9月7日按每个份额人民币0.041元支付人民币1,448元
- 于2021年10月8日按每个份额人民币0.040元支付人民币1,400元

20 批准财务报表

受托人及基金管理人于2021年10月27日批准财务报表。

中银香港盈荟系列
中银香港全天候环球投资基金

投资组合(未经审计)
2021年6月30日

上市/挂牌投资	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
集合投资计划			
香港			
领展房地产投资信托基金	10,000	96,892	1.00%
PREMIA中国国库及政策性银行债券长久期ETF—人民币	6,000	94,076	0.98%
		<u>190,968</u>	<u>1.98%</u>
日本			
日经225交易所买卖基金	300	80,718	0.84%
美国			
INVESCO QQQ TRUST SERIES 1	1,200	425,316	4.41%
SPDR DOW JONES INDUSTRIAL AVERAGE ETF TRUST	1,200	413,940	4.29%
SPDR S&P 500 ETF TRUST	1,100	470,866	4.88%
		<u>1,310,122</u>	<u>13.58%</u>
		<u>1,581,808</u>	<u>16.40%</u>
存托凭证			
台湾			
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO-ADR	1,000	120,160	1.25%
		<u>120,160</u>	<u>1.25%</u>
权益性证券			
香港			
友邦保险控股有限公司	10,000	124,253	1.29%
康方生物科技(开曼)有限公司	10,000	80,668	0.84%
阿里巴巴集团控股有限公司	5,000	141,636	1.47%
中国铝业股份有限公司—H股	150,000	89,424	0.93%
安踏体育用品有限公司	6,000	141,224	1.46%
康希诺生物股份有限公司—H股	3,000	159,379	1.65%
中国建设银行股份有限公司—H股	200,000	157,344	1.63%
中国移动有限公司	30,000	187,539	1.94%
中国有色矿业有限公司	100,000	49,573	0.51%

中银香港盈荟系列
中银香港全天候环球投资基金

投资组合(未经审计)(续)
2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
权益性证券(续)			
香港(续)			
中国太平保险控股有限公司	100,000	166,358	1.73%
旭辉控股有限公司	100,000	78,028	0.81%
中国海洋石油有限公司	200,000	227,390	2.36%
碧桂园服务控股有限公司	10,000	108,029	1.12%
江西赣锋锂业股份有限公司-H股	10,000	149,361	1.55%
海尔智家股份有限公司-H股	40,000	139,575	1.45%
恒基兆业地产有限公司	20,000	94,767	0.98%
香港交易及结算所有限公司	3,000	178,770	1.85%
江西铜业股份有限公司-H股	40,000	81,891	0.85%
美团点评-B类	7,000	288,782	2.99%
沛嘉医疗有限公司	40,000	186,186	1.93%
中国邮政储蓄银行股份有限公司-H股	200,000	134,683	1.40%
金沙中国有限公司	20,000	84,209	0.87%
腾讯控股有限公司	4,000	300,783	3.12%
阜博集团有限公司	20,000	90,389	0.94%
药明生物技术有限公司	15,500	283,999	2.95%
		<u>3,724,240</u>	<u>38.62%</u>
美国			
ALPHABET INC-CL C	50	125,316	1.30%
AMAZON.COM INC	40	137,606	1.43%
APPLE INC	894	122,442	1.27%
EXXON MOBIL CORP	2,000	126,160	1.31%
FACEBOOK INC-CL A	300	104,313	1.08%
JOHNSON & JOHNSON	1,000	164,740	1.71%
MICROSOFT CORP	500	135,450	1.40%
WALT DISNEY CO	1,000	175,770	1.82%
		<u>1,091,797</u>	<u>11.32%</u>
		<u>4,816,037</u>	<u>49.94%</u>

中银香港盈荟系列
中银香港全天候环球投资基金

投资组合(未经审计)(续)

2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
债务证券			
英属维尔京群岛			
CHINALCO CAPITAL HLDGS LTD 4.1% S/A PERP	200,000	210,740	2.19%
HUARONG FINANCE 2017 CO LTD 3M L+1.175% Q 03JUL2021	200,000	199,853	2.07%
SUNNY EXPRESS ENTERPRISES CORP 3.35% S/A PERP	200,000	205,896	2.14%
		<u>616,489</u>	<u>6.40%</u>
开曼群岛			
KAISA GROUP HLDGS LTD 9.75% S/A 28SEP2023	200,000	202,262	2.10%
POWERLONG REAL ESTATE HLDGS LTD 7.125% S/A 08NOV2022	200,000	210,230	2.18%
ZHONGLIANG HLDGS GROUP CO LTD 7.5% S/A 31JAN2022	200,000	197,746	2.05%
		<u>610,238</u>	<u>6.33%</u>
中国内地			
SHENZHEN EXPRESSWAY CO LTD 1.75% S/A 08JUL2026	210,000	210,145	2.18%
法国			
BNP PARIBAS SA 6.625% S/A PERP REGS	200,000	223,087	2.31%
德国			
ALLIANZ SE 3.5% A PERP	200,000	208,348	2.16%
香港			
HUARONG LEASING MANAGEMENT HONG KONG CO LTD 2.5% S/A 21JUL2021	200,000	200,434	2.08%
印度尼西亚			
INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM TBK 6.53% S/A 15NOV2028 REGS	200,000	247,653	2.57%

中银香港盈荟系列
中银香港全天候环球投资基金

投资组合(未经审计)(续)
2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
债务证券(续)			
荷兰			
ING GROEP NV 5.75% S/A PERP	200,000	223,028	2.31%
瑞典			
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB 5.125% S/A PERP	200,000	214,223	2.22%
美国			
US TREASURY N/B 0.875% S/A 30JUN2026	200,000	199,849	2.07%
		2,953,494	30.63%
外汇远期合约			
买入16,604澳元及卖出12,831美元 (交易对手: 中国银行(香港)有限公司)	-	(380)	0.00%
		(380)	0.00%
上市/挂牌投资总额		9,471,119	98.22%
其他资产净值		171,175	1.78%
于2021年6月30日的资产净值(按成交价)		9,642,294	100.00%
投资总额, 按成本计		8,679,761	

附注: 投资按交易日基准列帐。

中银香港盈荟系列
中银香港全天候中国高息债券基金

投资组合(未经审计)
2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 人民币	占资产净值 的百分比
集合投资计划			
香港			
PREMIA 中国国库及政策性银行债券长久期ETF—人民币	114,000	11,559,600	1.07%
		<u>11,559,600</u>	<u>1.07%</u>
债务证券			
百慕大			
CHINA OIL AND GAS GROUP LTD 4.7% S/A 30JUN2026	1,750,000	11,509,828	1.07%
CHINA OIL AND GAS GROUP LTD 5.5% S/A 25JAN2023	1,700,000	11,559,092	1.07%
HOPSON DEVELOPMENT HLDGS LTD 7.5% S/A 27JUN2022	1,700,000	11,192,660	1.04%
		<u>34,261,580</u>	<u>3.18%</u>
英属维尔京群岛			
EASY TACTIC LTD 11.75% S/A 02AUG2023	1,500,000	10,031,073	0.93%
EASY TACTIC LTD 12.375% S/A 18NOV2022	1,000,000	6,673,797	0.62%
HAIMEN ZHONGNAN INVESTMENT DEVELOPMENT INTL CO LTD 11.5% S/A 07APR2024	3,500,000	21,863,530	2.03%
HAIMEN ZHONGNAN INVESTMENT DEVELOPMENT INTL CO LTD 9% S/A 03AUG2021	1,100,000	7,357,956	0.68%
HONG SENG LTD 9.875% S/A 27AUG2022	1,550,000	10,488,857	0.97%
HUARONG FINANCE 2017 CO LTD 3M L+1.175% Q 03JUL2021	800,000	5,169,882	0.48%
HUARONG FINANCE II CO LTD 2.875% S/A PERP	1,700,000	9,053,893	0.84%
LS FINANCE 2017 LTD 4.8% S/A 18JUN2026	200,000	1,303,966	0.12%
NWD FINANCE BVI LTD 4.125% S/A PERP	550,000	3,605,550	0.33%
NWD FINANCE BVI LTD 4.8% S/A PERP	60,000	390,724	0.04%
RADIANCE CAPITAL INVESTMENTS LTD 11.75% S/A 31OCT2021	1,000,000	6,721,967	0.62%
RKPF OVERSEAS 2019 A LTD 6.7% S/A 30SEP2024	2,150,000	15,014,606	1.39%
TONGFANG AQUA LTD 6.8% S/A 10JAN2022	1,500,000	9,879,530	0.92%
WANDA PROPERTIES OVERSEAS LTD 6.875% S/A 23JUL2023	1,500,000	9,911,771	0.92%
WANDA PROPERTIES OVERSEAS LTD 6.95% S/A 05DEC2022	3,300,000	21,550,991	2.00%
		<u>139,018,093</u>	<u>12.89%</u>

中银香港盈荟系列
中银香港全天候中国高息债券基金

投资组合(未经审计)(续)

2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 人民币	占资产净值 的百分比
债务证券(续)			
开曼群岛			
AGILE GROUP HLDGS LTD 7.75% S/A PERP	600,000	3,961,862	0.37%
AGILE GROUP HLDGS LTD 7.875% S/A PERP	2,900,000	19,797,931	1.83%
AGILE GROUP HLDGS LTD 8.375% S/A PERP	2,500,000	16,985,535	1.57%
CENTRAL CHINA REAL ESTATE LTD 6.875% S/A 08AUG2022	1,660,000	10,840,904	1.00%
CENTRAL CHINA REAL ESTATE LTD 7.25% S/A 13AUG2024	2,000,000	11,528,274	1.07%
CENTRAL CHINA REAL ESTATE LTD 7.65% S/A 27AUG2023	1,000,000	6,295,916	0.58%
CENTRAL CHINA REAL ESTATE LTD 7.9% S/A 07NOV2023	2,000,000	12,340,003	1.14%
CHINA AOYUAN GROUP LTD 5.88% S/A 01MAR2027	1,000,000	5,477,957	0.51%
CHINA AOYUAN GROUP LTD 6.2% S/A 24MAR2026	1,000,000	5,743,273	0.53%
CHINA AOYUAN GROUP LTD 6.35% S/A 08FEB2024	1,500,000	9,436,439	0.87%
CHINA AOYUAN GROUP LTD 7.95% S/A 19FEB2023	2,320,000	15,341,555	1.42%
CHINA HONGQIAO GROUP LTD 6.25% S/A 08JUN2024	1,570,000	10,379,696	0.96%
CHINA HONGQIAO GROUP LTD 7.125% S/A 22JUL2022	1,500,000	10,272,685	0.95%
CHINA SCE GROUP HLDGS LTD 5.95% S/A 29SEP2024	1,200,000	7,913,989	0.73%
CHINA SCE GROUP HLDGS LTD 7% S/A 02MAY2025	1,500,000	9,964,820	0.92%
CHINA SCE GROUP HLDGS LTD 7.25% S/A 19APR2023	3,000,000	20,282,757	1.88%
CHINA SCE GROUP HLDGS LTD 7.375% S/A 09APR2024	500,000	3,408,707	0.32%
CIFI HLDGS GROUP CO LTD 4.45% S/A 17AUG2026	800,000	5,190,695	0.48%
CIFI HLDGS GROUP CO LTD 6.45% S/A 07NOV2024	500,000	3,459,785	0.32%
DEXIN CHINA HLDGS CO LTD 11.875% S/A 23APR2022	200,000	1,358,735	0.13%

中银香港盈荟系列
中银香港全天候中国高息债券基金

投资组合(未经审计)(续)

2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 人民币	占资产净值 的百分比
债务证券(续)			
开曼群岛(续)			
DEXIN CHINA HLDGS CO LTD 9.95% S/A 03DEC2022	1,780,000	11,131,202	1.03%
EHI CAR SERVICES LTD 7.75% S/A 14NOV2024	630,000	4,262,945	0.39%
FANTASIA HLDGS GROUP CO LTD 10.875% S/A 09JAN2023	1,000,000	6,127,760	0.57%
FANTASIA HLDGS GROUP CO LTD 6.95% S/A 17DEC2021	510,000	3,197,360	0.30%
GREENTOWN CHINA HLDGS LTD 4.7% S/A 29APR2025	1,950,000	12,812,044	1.19%
HONGHUA GROUP LTD 6.375% S/A 01AUG2022	2,333,000	15,135,610	1.40%
KAISA GROUP HLDGS LTD 10.875% S/A 23JUL2023	1,950,000	13,250,078	1.23%
KAISA GROUP HLDGS LTD 11.95% S/A 12NOV2023	1,000,000	6,730,927	0.62%
KAISA GROUP HLDGS LTD 11.95% S/A 22OCT2022 REGS	1,000,000	6,821,395	0.63%
KAISA GROUP HLDGS LTD 9.375% S/A 30JUN2024	1,500,000	9,154,896	0.85%
KAISA GROUP HLDGS LTD 9.75% S/A 28SEP2023	2,010,000	13,145,856	1.22%
KWG GROUP HLDGS LTD 5.875% S/A 10NOV2024	1,250,000	8,225,932	0.76%
KWG GROUP HLDGS LTD 7.4% S/A 05MAR2024	500,000	3,456,162	0.32%
LOGAN GROUP CO LTD 4.7% S/A 06JUL2026	1,520,000	9,786,150	0.91%
MGM CHINA HLDGS LTD 4.75% S/A 01FEB2027 REGS	1,150,000	7,713,656	0.71%
MGM CHINA HLDGS LTD 5.875% S/A 15MAY2026 REGS	200,000	1,368,732	0.13%
POWERLONG REAL ESTATE HLDGS LTD 6.25% S/A 10AUG2024	380,000	2,610,991	0.24%
POWERLONG REAL ESTATE HLDGS LTD 7.125% S/A 08NOV2022	2,200,000	14,955,357	1.39%
REDCO PROPERTIES GROUP LTD 8.5% S/A 19AUG2021	540,000	3,606,676	0.33%
REDSUN PROPERTIES GROUP LTD 7.3% S/A 13JAN2025	2,400,000	14,963,317	1.39%
REDSUN PROPERTIES GROUP LTD 7.3% S/A 21MAY2024	1,700,000	10,508,914	0.97%

中银香港盈荟系列
中银香港全天候中国高息债券基金

投资组合(未经审计)(续)

2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 人民币	占资产净值 的百分比
债务证券(续)			
开曼群岛(续)			
RONSHINE CHINA HLDGS LTD 10.5% S/A 01MAR2022	2,500,000	16,947,682	1.57%
RONSHINE CHINA HLDGS LTD 6.75% S/A 05AUG2024	420,000	2,573,976	0.24%
RONSHINE CHINA HLDGS LTD 7.1% S/A 25JAN2025	2,150,000	12,932,728	1.20%
RONSHINE CHINA HLDGS LTD 8.1% S/A 09JUN2023	2,250,000	14,220,231	1.32%
RONSHINE CHINA HLDGS LTD 8.75% S/A 25OCT2022	1,000,000	6,593,025	0.61%
RONSHINE CHINA HLDGS LTD 8.95% S/A 22JAN2023	500,000	3,335,695	0.31%
SINIC HLDGS GROUP CO LTD 8.5% S/A 24JAN2022	1,670,000	10,314,306	0.96%
SUNAC CHINA HLDGS LTD 5.95% S/A 26APR2024	4,000,000	26,190,411	2.42%
SUNAC CHINA HLDGS LTD 6.5% S/A 10JAN2025	3,000,000	19,710,266	1.83%
SUNAC CHINA HLDGS LTD 6.65% S/A 03AUG2024	600,000	4,001,126	0.37%
TIMES CHINA HLDGS LTD 5.55% S/A 04JUN2024	1,460,000	9,508,744	0.88%
TIMES CHINA HLDGS LTD 6.2% S/A 22MAR2026	2,500,000	16,192,325	1.50%
TIMES CHINA HLDGS LTD 6.75% S/A 16JUL2023	3,000,000	20,543,988	1.90%
WYNN MACAU LTD 4.875% S/A 01OCT2024 REGS	1,000,000	6,643,248	0.62%
YUZHOU GROUP HLDGS CO LTD 7.85% S/A 12AUG2026	2,000,000	10,650,534	0.99%
YUZHOU PROPERTIES CO LTD 7.7% S/A 20FEB2025	2,100,000	12,038,111	1.12%
YUZHOU GROUP HLDGS CO LTD 7.85% S/A 12AUG2026	2,000,000	10,650,534	0.99%
YUZHOU PROPERTIES CO LTD 7.7% S/A 20FEB2025	2,100,000	12,038,111	1.12%
YUZHOU PROPERTIES CO LTD 8.3% S/A 27MAY2025	4,000,000	22,248,089	2.06%
YUZHOU PROPERTIES CO LTD 8.375% S/A 30OCT2024	500,000	2,940,238	0.27%
YUZHOU PROPERTIES CO LTD 8.5% S/A 26FEB2024	700,000	4,277,235	0.40%
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD 10.25% S/A PERP	2,500,000	17,174,785	1.59%

中银香港盈荟系列
中银香港全天候中国高息债券基金

投资组合(未经审计)(续)
2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 人民币	占资产净值 的百分比
债务证券(续)			
开曼群岛(续)			
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD 5.95% S/A 18NOV2021	490,000	3,198,275	0.30%
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD 7.1% S/A 10SEP2024	630,000	3,943,659	0.37%
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD 7.875% S/A 14APR2024	200,000	1,318,039	0.12%
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD 8.35% S/A 10MAR2024	400,000	2,703,651	0.25%
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD 8.7% S/A 03AUG2022	3,500,000	24,031,344	2.22%
ZHONGLIANG HLDGS GROUP CO LTD 7.5% S/A 31JAN2022	3,040,000	19,438,416	1.80%
ZHONGLIANG HLDGS GROUP CO LTD 9.5% S/A 29JUL2022	1,880,000	12,255,062	1.14%
		<u>674,872,667</u>	<u>62.52%</u>
中国内地			
DALIAN DETA HLDG CO LTD 5.95% S/A 29JUL2022	1,000,000	5,881,389	0.54%
GUANGZHOU FINELAND REAL ESTATE DEVELOPMENT CO LTD 13.6% S/A 27JUL2023	2,880,000	19,906,996	1.84%
JINKE PROPERTIES GROUP CO LTD 6.85% S/A 28MAY2024	3,400,000	20,822,970	1.93%
		<u>46,611,355</u>	<u>4.31%</u>
香港			
CATHAY PACIFIC MTN FINANCING HK LTD 4.875 S/A 17AUG2026	1,710,000	11,322,363	1.05%
HUARONG LEASING MANAGEMENT HONG KONG CO LTD 2.5% S/ A 21JUL2021	200,000	1,296,230	0.12%
YANGO JUSTICE INTL LTD 7.5% S/A 15APR2024	4,420,000	28,592,395	2.64%
YANLORD LAND HK CO LTD 5.125% S/A 20MAY2026	1,360,000	9,037,713	0.84%
YANLORD LAND HK CO LTD 6.8% S/A 27FEB2024	1,950,000	13,574,342	1.26%
		<u>63,823,043</u>	<u>5.91%</u>

中银香港盈荟系列
中银香港全天候中国高息债券基金

投资组合(未经审计)(续)

2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 人民币	占资产净值 的百分比
债务证券(续)			
印度尼西亚			
BAYAN RESOURCES TBK 6.125% S/A 24JAN2023 REGS	650,000	4,489,510	0.42%
印度			
INDIA INFOLINE FINANCE LTD 5.875% S/A 20APR2023	400,000	2,570,069	0.24%
MANAPPURAM FINANCE LTD 5.9% S/A 13JAN2023	850,000	5,844,521	0.54%
		8,414,590	0.78%
巴基斯坦			
PAKISTAN GOVERNMENT INTL BOND 7.875% S/A 31MAR2036 REGS	400,000	2,704,350	0.25%
菲律宾			
SMC GLOBAL POWER HLDGS CORP 6.5% S/A PERP	200,000	1,346,912	0.12%
SMC GLOBAL POWER HLDGS CORP 7% S/A PERP	2,170,000	15,060,602	1.40%
		16,407,514	1.52%

中银香港盈荟系列
中银香港全天候中国高息债券基金

投资组合(未经审计)(续)

2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 人民币	占资产净值 的百分比
债务证券(续)			
新加坡			
INDIKA ENERGY CAPITAL III PTE LTD 5.875% S/A 09NOV2024 REGS	2,500,000	16,550,216	1.53%
LMIRT CAPITAL PTE LTD 7.25% S/A 16JUN2024	500,000	3,387,747	0.31%
MEDCO BELL PTE LTD 6.375% S/A 30JAN2027 REGS	300,000	2,058,225	0.19%
MEDCO OAK TREE PTE LTD 7.375% S/A 14MAY2026 REGS	600,000	4,281,085	0.40%
MEDCO PLATINUM ROAD PTE LTD 6.75% S/A 30JAN2025 REGS	1,500,000	10,457,907	0.97%
THETA CAPITAL PTE LTD 8.125% S/A 22JAN2025	500,000	3,476,310	0.32%
		<u>40,211,490</u>	<u>3.72%</u>
斯里兰卡			
SRI LANKA GOVERNMENT INTL BOND 6.25% S/A 27JUL2021 REGS	1,250,000	8,151,263	0.76%
英国			
HSBC HLDGS PLC 4.6% S/A PERP	200,000	1,342,051	0.12%
WEST CHINA CEMENT LTD 4.95% S/A 08JUL2026	1,670,000	10,800,057	1.00%
		<u>12,142,108</u>	<u>1.12%</u>
		<u>1,051,107,563</u>	<u>97.38%</u>

中银香港盈荟系列
中银香港全天候中国高息债券基金

投资组合(未经审计)(续)

2021年6月30日

非上市/非挂牌投资	持股量/ 面值	公允价值 人民币	占资产净值 的百分比
集合投资计划			
卢森堡			
BOC (EUROPE) UCITS SICAV – BOCHK RMB HIGH YIELD BOND FUND-CD USD HEDGED			
	10,774	6,672,282	0.62%
债务证券			
澳大利亚			
MACQUARIE BANK LTD/LONDON 6.125% S/A PERP REGS			
	1,000,000	7,188,154	0.67%
英属维尔京群岛			
SHANDONG IRON AND STEEL XINHENG INTL CO LTD 6.85% S/A 25SEP2022			
	500,000	3,362,914	0.31%
STUDIO CITY FINANCE LTD 5% S/A 15JAN2029 REGS			
	1,700,000	11,365,389	1.05%
YINGDE GASES INVESTMENT LTD 6.25% S/A 19JAN2023 REGS			
	1,000,000	6,844,294	0.63%
		21,572,597	1.99%
开曼群岛			
MELCO RESORTS FINANCE LTD 5.625% S/A 17JUL2027 REGS			
	500,000	3,472,817	0.32%
外汇远期合约			
买入人民币1,121,922,699.33元及卖出174,569,412.36美元 (交易对手: 中国银行(香港)有限公司)			
	-	(12,151,486)	(1.13%)
买入人民币7,793,400.00元及卖出1,200,000.00美元 (交易对手: 中国银行(香港)有限公司)			
	-	(2,290)	0.00%
买入4,669,232.00澳元及卖出人民币23,374,175.39元 (交易对手: 中国银行(香港)有限公司)			
	-	(627,268)	(0.06%)
买入6,248,145.08美元及卖出人民币40,000,000.00元 (交易对手: 中国银行(香港)有限公司)			
	-	590,490	0.05%

中银香港盈荟系列
中银香港全天候中国高息债券基金

投资组合(未经审计)(续)

2021年6月30日

非上市/非挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 人民币	占资产净值 的百分比
外汇远期合约(续)			
买入23,749,101.99美元及卖出人民币152,659,227.59元 (交易对手:中国银行(香港)有限公司)	-	1,624,590	0.15%
买入1,500,000.00美元及卖出人民币9,741,450.00元 (交易对手:中国银行(香港)有限公司)	-	3,160	0.00%
买入1,000,000.00美元及卖出人民币6,490,500.00元 (交易对手:中国银行(香港)有限公司)	-	5,906	0.00%
		<u>(10,556,898)</u>	<u>(0.99%)</u>
投资总额		1,091,016,115	101.06%
其他资产净值		<u>(11,419,603)</u>	<u>(1.06%)</u>
于2021年6月30日的资产净值(按成交价)		<u>1,079,596,512</u>	<u>100.00%</u>
投资总额,按成本计		<u>1,128,298,591</u>	

中银香港盈荟系列
中银香港全天候香港股票基金

投资组合(未经审计)
2021年6月30日

上市/挂牌投资	持股量/ 面值	公允价值 港元	占资产净值 的百分比
权益性证券			
香港			
瑞声科技控股有限公司	300,000	17,430,000	6.21%
友邦保险控股有限公司	200,000	19,300,000	6.88%
安踏体育用品有限公司	20,000	3,656,000	1.30%
比亚迪股份有限公司－H股	20,000	4,644,000	1.65%
中国建设银行股份有限公司－H股	3,000,000	18,330,000	6.53%
龙源电力集团股份有限公司－H股	200,000	2,676,000	0.95%
内蒙古蒙牛乳业股份有限公司	200,000	9,390,000	3.35%
中国移动有限公司	400,000	19,420,000	6.92%
中软国际有限公司	200,000	2,832,000	1.01%
碧桂园服务控股有限公司	50,000	4,195,000	1.49%
香港交易及结算所有限公司	15,000	6,942,000	2.47%
华虹半导体有限公司	100,000	4,290,000	1.53%
京东健康股份有限公司	60,000	6,678,000	2.38%
快手科技	20,000	3,896,000	1.39%
微创医疗科学有限公司	80,000	5,572,000	1.99%
中国邮政储蓄银行股份有限公司－H股	1,000,000	5,230,000	1.86%
中芯国际集成电路制造有限公司	150,000	3,585,000	1.28%
申洲国际集团控股有限公司	50,000	9,805,000	3.49%
舜宇光学科技有限公司	20,000	4,908,000	1.75%
腾讯控股有限公司	40,000	23,360,000	8.32%
无锡药明康德新药开发股份有限公司－H股	24,000	4,351,200	1.55%
信义光能控股有限公司	400,000	6,704,000	2.39%
中兴通讯股份有限公司－H股	400,000	9,700,000	3.46%
		<u>196,894,200</u>	<u>70.15%</u>
中国内地			
爱尔眼科医院集团股份有限公司－A股	129,658	11,052,117	3.94%
北京兆易创新科技股份有限公司－A股	20,000	4,513,017	1.61%
歌尔股份有限公司－A股	50,000	2,566,343	0.91%
江苏恒立液压股份有限公司－A股	40,000	4,127,285	1.47%
漳州片仔癀药业股份有限公司－A股	20,000	10,767,352	3.84%
		<u>33,026,114</u>	<u>11.77%</u>
		<u>229,920,314</u>	<u>81.92%</u>

中银香港盈荟系列
中银香港全天候香港股票基金

投资组合(未经审计)(续)

2021年6月30日

上市／挂牌投资(续)	持股量／ 面值	公允价值 港元	占资产净值 的百分比
外汇远期合约			
买入人民币3,220,651元及卖出3,886,564港元 (交易对手：中国银行(香港)有限公司)	-	(38,837)	(0.01%)
买入252,917澳元及卖出1,515,352港元 (交易对手：中国银行(香港)有限公司)	-	(42,519)	(0.02%)
		<u>(81,356)</u>	<u>(0.03%)</u>
上市／挂牌投资总额		229,838,958	81.89%
其他资产净值		<u>50,830,353</u>	<u>18.11%</u>
于2021年6月30日的资产净值(按成交价)		<u>280,669,311</u>	<u>100.00%</u>
投资总额，按成本计		<u>213,166,874</u>	

附注：投资按交易日基准列帐。

中银香港盈荟系列
中银香港全天候在岸人民币股票基金

投资组合(未经审计)
2021年6月30日

上市/挂牌投资	持股量/ 面值	公允价值 人民币	占资产净值 的百分比
权益性证券			
中国内地			
深圳光峰科技股份有限公司-A股	245,000	10,260,600	2.52%
北京东方雨虹防水技术股份有限公司-A股	55,000	3,042,600	0.75%
深圳市华测检测技术有限公司-A股	145,000	4,622,600	1.13%
长春高新技术产业(集团)股份有限公司-A股	22,000	8,514,000	2.09%
成都市极米科技有限公司-A股	8,500	7,072,000	1.73%
中国巨石股份有限公司-A股	1,263,000	19,589,130	4.79%
深圳市雷赛智能控制股份有限公司-A股	362,500	10,392,875	2.55%
重庆太极实业股份有限公司-A股	380,000	7,892,600	1.94%
重庆智飞生物制品股份有限公司-A股	29,000	5,415,170	1.33%
广联达软件股份有限公司-A股	250,000	17,050,000	4.18%
广东新宝电器股份有限公司-A股	186,000	4,882,500	1.20%
河南神火煤电股份有限公司-A股	500,000	4,725,000	1.16%
宏发科技股份有限公司-A股	160,000	10,032,000	2.46%
华域汽车系统股份有限公司-A股	200,000	5,254,000	1.29%
人福医药集团股份有限公司-A股	60,000	1,696,200	0.42%
恒生电子股份有限公司-A股	90,000	8,392,500	2.06%
内蒙古伊利实业集团股份有限公司-A股	292,000	10,754,360	2.64%
江苏雅克科技股份有限公司-A股	148,000	11,988,000	2.94%
中炬高新技术实业(集团)股份有限公司-A股	130,000	5,462,600	1.34%
贵州茅台酒股份有限公司-A股	2,000	4,113,400	1.01%
龙佰集团股份有限公司-A股	400,000	13,832,000	3.39%
立讯精密工业股份有限公司-A股	100,000	4,600,000	1.13%
芒果超媒股份有限公司-A股	130,000	8,918,000	2.19%
美的集团股份有限公司-A股	200,000	14,274,000	3.50%
深信服科技股份有限公司-A股	21,500	5,578,820	1.37%
三一重工股份有限公司-A股	230,000	6,686,100	1.64%
山东华鲁恒升化工股份有限公司-A股	155,000	4,797,250	1.18%
山东玲珑轮胎股份有限公司-A股	100,000	4,374,000	1.07%
深圳市朗科智能电气股份有限公司-A股	230,000	3,514,400	0.86%

中银香港盈荟系列
中银香港全天候在岸人民币股票基金

投资组合(未经审计)(续)
2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 人民币	占资产净值 的百分比
权益性证券(续)			
中国内地(续)			
深圳迈瑞生物医疗电子股份有限公司 - A股	15,000	7,200,750	1.77%
贵研铂业股份有限公司 - A股	169,000	4,157,400	1.02%
苏州天华超净科技股份有限公司 - A股	130,000	6,243,900	1.53%
通威股份有限公司 - A股	140,000	6,057,800	1.49%
万华化学集团股份有限公司 - A股	120,000	13,058,400	3.20%
烟台中宠食品有限公司 - A股	200,000	8,200,000	2.01%
永兴特种材料科技股份有限公司 - A股	60,000	3,563,400	0.87%
浙江三花智能控制股份有限公司 - A股	250,000	5,995,000	1.47%
珠海市博杰电子有限公司 - A股	120,000	10,560,000	2.59%
		<u>292,763,355</u>	<u>71.81%</u>
香港			
中国宏桥集团有限公司	330,000	2,890,810	0.71%
中国移动有限公司	75,000	3,032,078	0.74%
中国有色矿业有限公司	2,000,000	6,411,808	1.57%
江西赣锋锂业股份有限公司 - H股	180,000	17,386,826	4.26%
香港交易及结算所有限公司	50,000	19,268,734	4.73%
金蝶国际软件集团有限公司	680,000	14,920,362	3.66%
美团点评 - B类	10,000	2,667,979	0.65%
腾讯控股有限公司	40,000	19,451,928	4.77%
杭州启明医疗器械有限公司 - H股	80,000	4,313,398	1.06%
紫金矿业集团股份有限公司 - H股	1,500,000	13,040,120	3.20%
		<u>103,384,043</u>	<u>25.35%</u>
		<u>396,147,398</u>	<u>97.16%</u>

中银香港盈荟系列
中银香港全天候在岸人民币股票基金

投资组合(未经审计)(续)

2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 人民币	占资产净值 的百分比
外汇远期合约			
买入52,454,688港元及卖出人民币43,505,735元 (交易对手: 中国银行(香港)有限公司)		379,684	0.09%
上市/挂牌投资总额		396,527,082	97.25%
其他资产净值		11,206,335	2.75%
于2021年6月30日的资产净值(按成交价)		407,733,417	100.00%
投资总额, 按成本计		389,811,554	

附注: 投资按交易日基准列帐。

中银香港盈荟系列
中银香港全天候亚洲债券基金

投资组合(未经审计)
2021年6月30日

上市/挂牌投资	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
集合投资计划			
香港			
PREMIA 中国国库及政策性银行债券长久期ETF—人民币	166,000	2,602,774	1.19%
		<u>2,602,774</u>	<u>1.19%</u>
债务证券			
澳大利亚			
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD/UK 6.75% S/A PERP REGS	500,000	591,355	0.27%
NEWCASTLE COAL INFRASTRUCTURE GROUP PTY LTD 4.4% S/A 29SEP2027 REGS	300,000	315,319	0.14%
SANTOS FINANCE LTD 4.125% S/A 14SEP2027	300,000	327,510	0.15%
SANTOS FINANCE LTD 5.25% S/A 13MAR2029	1,000,000	1,155,230	0.53%
WESTPAC BANKING CORP 4.11% S/A 24JUL2034	500,000	556,952	0.26%
WESTPAC BANKING CORP 4.421% S/A 24JUL2039	500,000	599,335	0.27%
		<u>3,545,701</u>	<u>1.62%</u>
百慕大			
CHINA OIL AND GAS GROUP LTD 4.7% S/A 30JUN2026	1,200,000	1,220,401	0.56%
CHINA OIL AND GAS GROUP LTD 5.5% S/A 25JAN2023	500,000	525,697	0.24%
HAITONG INTL SECURITIES GROUP LTD 3.375% S/A 19JUL2024	500,000	533,749	0.24%
HOPSON DEVELOPMENT HLDGS LTD 7.5% S/A 27JUN2022	1,500,000	1,527,095	0.70%
		<u>3,806,942</u>	<u>1.74%</u>
英属维尔京群岛			
BLUESTAR FINANCE HLDGS LTD 3.375% S/A 16JUL2024	500,000	530,459	0.24%
CASTLE PEAK POWER FINANCE CO LTD 2.125% S/A 03MAR2031	250,000	248,589	0.11%
CHAMPION SINCERITY HLDGS LTD 8.125% S/A PERP	380,000	404,063	0.19%

中银香港盈荟系列
中银香港全天候亚洲债券基金

投资组合(未经审计)(续)
2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
债务证券(续)			
英属维尔京群岛(续)			
CHINA CINDA FINANCE 2017 I LTD 4.4% S/A 09MAR2027	500,000	532,164	0.24%
CHINA CINDA FINANCE 2017 I LTD 4.75% S/A 21FEB2029	1,250,000	1,372,391	0.63%
CHINA GREAT WALL INTL HLDGS III LTD 3.875% S/A 31AUG2027	300,000	311,103	0.14%
CHINA GREAT WALL INTL HLDGS IV LTD 3.95% S/A PERP	500,000	500,679	0.23%
CHINA HUANENG GROUP HONG KONG TREASURY MANAGEMENT HLDG LTD 2.85% S/A PERP	500,000	510,301	0.23%
CHINA HUANENG GROUP HONG KONG TREASURY MANAGEMENT HLDGS LTD 3.08% S/A PERP	500,000	512,376	0.23%
CHINALCO CAPITAL HLDGS LTD 4.1% S/A PERP	1,000,000	1,053,698	0.48%
CHOUZHOU INTL INVESTMENT LTD 3.15% S/A 11AUG2023	1,000,000	1,026,530	0.47%
CHOUZHOU INTL INVESTMENT LTD 4% S/A 18FEB2025	300,000	309,194	0.14%
CICC HONG KONG FINANCE 2016 MTN LTD 1.625% S/A 26JAN2024	500,000	505,938	0.23%
CLP POWER HK FINANCE LTD 3.55% S/A PERP	500,000	529,109	0.24%
CMHI FINANCE BVI CO LTD 3.5% S/A PERP	330,000	340,722	0.16%
ELECT GLOBAL INVESTMENTS LTD 4.85% S/A PERP	500,000	529,768	0.24%
FPC RESOURCES LTD 4.375% S/A 11SEP2027	340,000	370,756	0.17%
HAIMEN ZHONGNAN INVESTMENT DEVELOPMENT INTL CO LTD 11.5% S/A 07APR2024	1,000,000	965,923	0.44%
HONGKONG ELECTRIC FINANCE LTD 2.25% S/A 09JUN2030	500,000	501,763	0.23%
HUANENG HONG KONG CAPITAL LTD 3.6% S/A PERP	500,000	512,620	0.23%
HUARONG FINANCE 2017 CO LTD 3M L+1.15% Q 07NOV2022	400,000	307,739	0.14%
HUARONG FINANCE 2017 CO LTD 3M L+1.175% Q 03JUL2021	1,500,000	1,498,899	0.69%

中银香港盈荟系列
中银香港全天候亚洲债券基金

投资组合(未经审计)(续)
2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
债务证券(续)			
英属维尔京群岛(续)			
HUARONG FINANCE 2017 CO LTD 5.5% S/A 27APR2047	200,000	137,316	0.06%
HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 3.375% S/A 24FEB2030	500,000	351,908	0.16%
JIC ZHIXIN LTD 1.5% S/A 27AUG2025	500,000	498,088	0.23%
JIC ZHIXIN LTD 2.125% S/A 27AUG2030	580,000	562,669	0.26%
JMH CO LTD 2.5% S/A 09APR2031	1,000,000	1,018,794	0.47%
JOY TREASURE ASSETS HLDGS INC 1.875% S/A 17NOV2025	1,680,000	1,615,222	0.74%
LEVC FINANCE LTD 1.375% S/A 25MAR2024	500,000	502,358	0.23%
LS FINANCE 2017 LTD 4.8% S/A 18JUN2026	200,000	201,631	0.09%
MINMETALS BOUNTEOUS FINANCE BVI LTD 3.375% S/A PERP	610,000	633,779	0.30%
NWD FINANCE BVI LTD 4.125% S/A PERP	970,000	983,266	0.45%
NWD MTN LTD 4.125% S/A 18JUL2029	300,000	318,806	0.15%
PROVEN HONOUR CAPITAL LTD 4.125% S/A 06MAY2026	300,000	319,447	0.15%
SHANDONG IRON AND STEEL XINHENG INTL CO LTD 6.85% S/A 25SEP2022	250,000	260,002	0.12%
SHANGHAI PORT GROUP BVI DEVELOPMENT 2 CO LTD 2.375% S/A 13JUL2030	500,000	506,997	0.23%
SHANGHAI PORT GROUP BVI DEVELOPMENT CO LTD 2.85% S/A 11SEP2029	1,000,000	1,047,768	0.49%
SINO-OCEAN LAND TREASURE IV LTD 3M L+2.3% Q 31JUL2021	400,000	401,876	0.18%
SINO-OCEAN LAND TREASURE IV LTD 5.25% S/A 30APR2022	370,000	382,412	0.18%
SPIC MTN CO LTD 1.625% S/A 27JUL2025	500,000	501,371	0.23%
STANDARD CHARTERED PLC 6% S/A PERP	500,000	563,327	0.26%
STUDIO CITY FINANCE LTD 6% S/A 15JUL2025 REGS	500,000	540,413	0.25%
SUNNY EXPRESS ENTERPRISES CORP 3.35% S/A PERP	200,000	205,896	0.09%
TAIHU PEARL ORIENTAL CO LTD 3.15% S/A 30JUL2023	530,000	542,181	0.25%
TALENT YIELD INTL LTD 2% S/A 06MAY2026	750,000	761,269	0.35%
TALENT YIELD INTL LTD 3.125% S/A 06MAY2031	990,000	1,035,396	0.47%

中银香港盈荟系列
中银香港全天候亚洲债券基金

投资组合(未经审计)(续)
2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
债务证券(续)			
英属维尔京群岛(续)			
TCL TECHNOLOGY INVESTMENTS LTD 1.875% S/A 14JUL2025	4,060,000	4,046,147	1.86%
TSMC GLOBAL LTD 2.25% S/A 23APR2031 REGS	2,800,000	2,830,688	1.30%
WANDA PROPERTIES OVERSEAS LTD 6.95% S/A 05DEC2022	250,000	252,455	0.12%
WHARF REIC FINANCE BVI LTD 2.875% S/A 07MAY2030	1,500,000	1,537,324	0.70%
XIANJIN INDUSTRY INVESTMENT CO LTD 2.95% S/A 24SEP2023	330,000	335,022	0.15%
		<u>36,268,612</u>	<u>16.62%</u>
加拿大			
BANK OF NOVA SCOTIA 4.65% S/A PERP	180,000	<u>185,851</u>	<u>0.09%</u>
开曼群岛			
AGILE GROUP HLDGS LTD 7.75% S/A PERP	600,000	612,618	0.28%
AGILE GROUP HLDGS LTD 7.875% S/A PERP	200,000	211,126	0.10%
AGILE GROUP HLDGS LTD 8.375% S/A PERP	200,000	210,116	0.10%
ALIBABA GROUP HLDG LTD 3.25% S/A 09FEB2061	1,000,000	985,079	0.45%
ALIBABA GROUP HLDG LTD 4.2% S/A 06DEC2047	300,000	347,057	0.16%
AYC FINANCE LTD 4.85% S/A PERP	1,000,000	1,045,458	0.48%
CDBL FUNDING 1 3.5% S/A 24OCT2027	400,000	425,202	0.19%
CENTRAL CHINA REAL ESTATE LTD 6.75% S/A 08NOV2021	750,000	756,546	0.35%
CENTRAL CHINA REAL ESTATE LTD 7.65% S/A 27AUG2023	1,000,000	973,530	0.45%
CENTRAL CHINA REAL ESTATE LTD 7.9% S/A 07NOV2023	700,000	667,842	0.31%
CHINA AOYUAN GROUP LTD 5.98% S/A 18AUG2025	970,000	885,991	0.41%
CHINA AOYUAN GROUP LTD 6.35% S/A 08FEB2024	500,000	486,382	0.22%
CHINA AOYUAN GROUP LTD 7.95% S/A 19FEB2023	800,000	818,016	0.37%
CHINA AOYUAN GROUP LTD 8.5% S/A 23JAN2022	1,500,000	1,565,783	0.72%

中银香港盈荟系列
中银香港全天候亚洲债券基金

投资组合(未经审计)(续)

2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
债务证券(续)			
开曼群岛(续)			
CHINA HONGQIAO GROUP LTD 7.125% S/A 22JUL2022	250,000	264,742	0.12%
CHINA OVERSEAS FINANCE CAYMAN VIII LTD 2.75% S/A 02MAR2030	500,000	502,440	0.23%
CHINA OVERSEAS FINANCE CAYMAN VIII LTD 3.125% S/A 02MAR2035	500,000	495,980	0.23%
CHINA RESOURCES LAND LTD 3.75% S/A PERP	2,500,000	2,609,154	1.19%
CHINA SCE GROUP HLDGS LTD 7% S/A 02MAY2025	750,000	770,424	0.35%
CIFI HLDGS GROUP CO LTD 5.25% S/A 13MAY2026	440,000	456,254	0.21%
CIFI HLDGS GROUP CO LTD 6.55% S/A 28MAR2024	1,250,000	1,336,951	0.61%
CK HUTCHISON INTL 19 II LTD 3.375% S/A 06SEP2049 REGS	500,000	541,806	0.25%
COUNTRY GARDEN HLDGS CO LTD 5.125% S/A 14JAN2027	700,000	764,802	0.35%
COUNTRY GARDEN HLDGS CO LTD 5.4% S/A 27MAY2025	1,000,000	1,078,690	0.49%
COUNTRY GARDEN HLDGS CO LTD 5.625% S/A 14JAN2030	800,000	890,827	0.41%
COUNTRY GARDEN HLDGS CO LTD 7.25% S/A 08APR2026	500,000	563,203	0.26%
DEXIN CHINA HLDGS CO LTD 11.875% S/A 23APR2022	320,000	336,159	0.15%
DEXIN CHINA HLDGS CO LTD 9.95% S/A 03DEC2022	1,160,000	1,121,684	0.51%
EHI CAR SERVICES LTD 7.75% S/A 14NOV2024	210,000	219,725	0.10%
FOXCONN FAR EAST LTD 2.5% S/A 28OCT2030	500,000	503,498	0.23%
FUFENG GROUP LTD 5.875% S/A 28AUG2021	1,000,000	1,026,203	0.47%
FWD LTD 6.25% S/A PERP	200,000	207,945	0.10%
ICD SUKUK CO LTD 5% S/A 01FEB2027	500,000	566,657	0.26%
JD.COM INC 3.375% S/A 14JAN2030	1,080,000	1,170,468	0.54%
KAISA GROUP HLDGS LTD 10.875% S/A 23JUL2023	450,000	472,810	0.22%
KAISA GROUP HLDGS LTD 11.95% S/A 12NOV2023	1,430,000	1,488,337	0.68%
KAISA GROUP HLDGS LTD 11.95% S/A 22OCT2022 REGS	1,400,000	1,476,698	0.68%

中银香港盈荟系列
中银香港全天候亚洲债券基金

投资组合(未经审计)(续)

2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
债务证券(续)			
开曼群岛(续)			
KAISA GROUP HLDGS LTD 6.5% S/A 07DEC2021	400,000	403,069	0.18%
KAISA GROUP HLDGS LTD 9.75% S/A 28SEP2023	1,190,000	1,203,456	0.55%
KWG GROUP HLDGS LTD 5.95% S/A 10AUG2025	500,000	510,422	0.23%
KWG GROUP HLDGS LTD 7.875% S/A 01SEP2023	1,500,000	1,574,565	0.72%
LOGAN GROUP CO LTD 4.7% S/A 06JUL2026	1,350,000	1,343,979	0.62%
LOGAN GROUP CO LTD 5.25% S/A 19OCT2025	560,000	582,249	0.27%
LOGAN GROUP CO LTD 5.75% S/A 14JAN2025	1,050,000	1,121,278	0.51%
LOGAN GROUP CO LTD 7.5% S/A 25AUG2022	300,000	314,910	0.14%
MEITUAN DIANPING 3.05% S/A 28OCT2030 REGS	400,000	396,299	0.18%
MGM CHINA HLDGS LTD 5.875% S/A 15MAY2026 REGS	200,000	211,645	0.10%
PHOENIX GROUP HLDGS 5.375% S/A 06JUL2027	400,000	466,855	0.21%
POWERLONG REAL ESTATE HLDGS LTD 6.25% S/A 10AUG2024	1,370,000	1,455,569	0.67%
POWERLONG REAL ESTATE HLDGS LTD 6.95% S/A 23JUL2023	1,050,000	1,117,140	0.51%
REDCO PROPERTIES GROUP LTD 8% S/A 13APR2022	500,000	507,216	0.23%
REDCO PROPERTIES GROUP LTD 8.5% S/A 19AUG2021	730,000	753,923	0.35%
REDSUN PROPERTIES GROUP LTD 7.3% S/A 13JAN2025	650,000	626,643	0.29%
REDSUN PROPERTIES GROUP LTD 7.3% S/A 21MAY2024	1,000,000	955,871	0.44%
RONSHINE CHINA HLDGS LTD 11.25% S/A 22AUG2021	250,000	262,188	0.12%
RONSHINE CHINA HLDGS LTD 6.75% S/A 05AUG2024	560,000	530,681	0.24%
RONSHINE CHINA HLDGS LTD 8.1% S/A 09JUN2023	250,000	244,318	0.11%
RONSHINE CHINA HLDGS LTD 8.75% S/A 25OCT2022	2,750,000	2,803,547	1.28%
RONSHINE CHINA HLDGS LTD 8.95% S/A 22JAN2023	550,000	567,374	0.26%
SHIMAO GROUP HLDGS LTD 4.6% S/A 13JUL2030	500,000	518,128	0.24%
SHIMAO PROPERTY HLDGS LTD 5.6% S/A 15JUL2026	1,500,000	1,617,738	0.74%

中银香港盈荟系列
中银香港全天候亚洲债券基金

投资组合(未经审计)(续)

2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
债务证券(续)			
开曼群岛(续)			
SHIMAO PROPERTY HLDGS LTD 6.125% S/A 21FEB2024	1,000,000	1,055,338	0.48%
SHUI ON DEVELOPMENT HLDG LTD 6.4% S/A PERP	200,000	203,441	0.09%
SIB SUKUK CO III LTD 2.85% S/A 23JUN2025	510,000	530,009	0.24%
SINIC HLDGS GROUP CO LTD 10.5% S/A 18JUN2022	500,000	446,626	0.20%
SINIC HLDGS GROUP CO LTD 8.5% S/A 24JAN2022	1,770,000	1,690,391	0.77%
SUNAC CHINA HLDGS LTD 5.95% S/A 26APR2024	2,700,000	2,733,610	1.25%
SUNAC CHINA HLDGS LTD 6.5% S/A 09JUL2023	500,000	526,943	0.24%
SUNAC CHINA HLDGS LTD 6.65% S/A 03AUG2024	300,000	309,345	0.14%
SUNAC CHINA HLDGS LTD 7.25% S/A 14JUN2022	500,000	514,762	0.24%
SUNAC CHINA HLDGS LTD 7.5% S/A 01FEB2024	300,000	317,061	0.15%
SUNAC CHINA HLDGS LTD 8.35% S/A 19APR2023	1,000,000	1,052,970	0.48%
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD 3.75% S/A 23JAN2023	450,000	473,161	0.22%
TENCENT HLDGS LTD 2.39% S/A 03JUN2030 REGS	1,000,000	997,949	0.46%
TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP 2% S/A 03SEP2030	740,000	718,122	0.33%
TIMES CHINA HLDGS LTD 6.6% S/A 02MAR2023	500,000	511,587	0.23%
VLL INTL INC 5.75% S/A 28NOV2024	250,000	257,458	0.12%
WEIBO CORP 3.5% S/A 05JUL2024	600,000	642,943	0.29%
YUZHOU PROPERTIES CO LTD 6% S/A 25OCT2023	600,000	533,592	0.24%
YUZHOU PROPERTIES CO LTD 7.7% S/A 20FEB2025	900,000	797,760	0.37%
YUZHOU PROPERTIES CO LTD 8.375% S/A 30OCT2024	1,000,000	909,291	0.42%
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD 5.95% S/A 18NOV2021	580,000	585,380	0.27%
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD 7.1% S/A 10SEP2024	550,000	532,368	0.24%

中银香港盈荟系列
中银香港全天候亚洲债券基金

投资组合(未经审计)(续)
2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
债务证券(续)			
开曼群岛(续)			
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD 7.875% S/A 14APR2024	200,000	203,807	0.09%
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD 9.8% S/A 20AUG2021	250,000	260,708	0.12%
ZHONGLIANG HLDGS GROUP CO LTD 7.5% S/A 31JAN2022	2,730,000	2,699,233	1.23%
ZHONGLIANG HLDGS GROUP CO LTD 9.5% S/A 29JUL2022	750,000	755,978	0.35%
		<u>69,205,099</u>	<u>31.68%</u>
中国内地			
BANK OF CHINA LTD 5% S/A 13NOV2024 REGS	2,500,000	2,807,242	1.29%
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP 2.45% S/A 24JUN2030	1,000,000	1,022,166	0.47%
GUANGZHOU FINELAND REAL ESTATE DEVELOPMENT CO LTD 13.6% S/A 27JUL2023	1,920,000	2,052,130	0.94%
JIANGXI RAILWAY INVESTMENT GROUP CORP 4.85% S/A 21FEB2022	200,000	208,207	0.10%
JINKE PROPERTIES GROUP CO LTD 6.85% S/A 28MAY2024	2,500,000	2,367,523	1.08%
KUNMING RAIL TRANSIT GROUP CO LTD 3.5% S/A 12DEC2022	500,000	502,474	0.23%
SHOUGANG GROUP CO LTD 4% S/A 23MAY2024	700,000	743,696	0.34%
TAIKANG INSURANCE GROUP INC 3.5% S/A 19JAN2022	200,000	205,194	0.09%
XIAN MUNICIPAL INFRASTRUCTURE CONSTRUCTION INVESTMENT GROUP CO LTD 4% S/A 24JUN2022	500,000	509,534	0.23%
		<u>10,418,166</u>	<u>4.77%</u>
法国			
BNP PARIBAS SA 6.625% S/A PERP REGS	510,000	568,873	0.26%

中银香港盈荟系列
中银香港全天候亚洲债券基金

投资组合(未经审计)(续)
2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
债务证券(续)			
香港			
AIA GROUP LTD 3.2% S/A 16SEP2040 REGS	1,380,000	1,439,069	0.66%
AIA GROUP LTD 4.5% S/A 16MAR2046 REGS	500,000	637,728	0.29%
AIRPORT AUTHORITY HONG KONG 2.1% S/A PERP	1,280,000	1,290,869	0.59%
AIRPORT AUTHORITY HONG KONG 2.4% S/A PERP	2,750,000	2,754,574	1.26%
AIRPORT AUTHORITY HONG KONG 2.625% S/A 04FEB2051 REGS	500,000	506,744	0.23%
BANK OF EAST ASIA LTD 4% S/A 29MAY2030	940,000	991,630	0.45%
BLOSSOM JOY LTD 3.1% S/A PERP	1,000,000	1,026,978	0.47%
CHINA CITIC BANK INTL LTD 4.625% S/A 28FEB2029	400,000	429,737	0.20%
CHONG HING BANK LTD 5.5% S/A PERP	500,000	535,521	0.25%
CHONG HING BANK LTD 5.7% S/A PERP	930,000	999,911	0.46%
CITIC LTD 2.85% S/A 25FEB2030	650,000	668,093	0.31%
CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 4.625% S/A 14MAR2023	210,000	223,714	0.10%
CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 5.125% S/A 14MAR2028	1,000,000	1,160,543	0.53%
GUOTAI JUNAN INTL HLDGS LTD 2% S/A 03MAR2026	750,000	753,027	0.34%
HUASING INTL HLDGS CO LTD 5% S/A 20MAR2023	1,000,000	1,042,178	0.48%
HUATONG INTL INVESTMENT HLDGS CO LTD 2.98% S/A 04MAR2024	1,000,000	990,185	0.45%
NANYANG COMMERCIAL BANK LTD 3.8% S/A 20NOV2029	1,670,000	1,729,281	0.79%
SHANGRAO INVESTMENT HLDGS INTL CO LTD 4.3% S/A 16JAN2023	360,000	373,931	0.17%
VANKE REAL ESTATE HONG KONG CO LTD 3.975% S/A 09NOV2027	200,000	215,814	0.10%
WING LUNG BANK LTD 3.75% S/A 22NOV2027	500,000	513,341	0.24%
YANGO JUSTICE INTL LTD 7.5% S/A 15APR2024	2,690,000	2,690,735	1.23%
YANGO JUSTICE INTL LTD 7.5% S/A 17FEB2025	820,000	748,190	0.34%
YANLORD LAND HK CO LTD 5.125% S/A 20MAY2026	800,000	822,053	0.38%
YANLORD LAND HK CO LTD 6.8% S/A 27FEB2024	600,000	645,841	0.30%
		23,189,687	10.62%

中银香港盈荟系列
中银香港全天候亚洲债券基金

投资组合(未经审计)(续)

2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
债务证券(续)			
印度			
ADANI ELECTRICITY MUMBAI LTD 3.949% S/A 12FEB2030 REGS	1,500,000	1,528,106	0.70%
ADANI PORTS & SPECIAL ECONOMIC ZONE LTD 4% S/A 30JUL2027 REGS	200,000	210,880	0.10%
ADANI PORTS & SPECIAL ECONOMIC ZONE LTD 4.2% S/A 04AUG2027 REGS	400,000	424,964	0.19%
ADANI TRANSMISSION LTD 4% S/A 03AUG2026 REGS	1,500,000	1,600,987	0.73%
ALAM SUTERA REALTY TBK 6% S/A 02MAY2024	1,500,000	1,326,260	0.61%
BHARAT PETROLEUM CORP LTD 4% S/A 08MAY2025	1,000,000	1,065,719	0.49%
EXPORT-IMPORT BANK OF INDIA 3.25% S/A 15JAN2030 REGS	1,400,000	1,446,825	0.66%
INDIA INFOLINE FINANCE LTD 5.875% S/A 20APR2023	400,000	397,407	0.19%
JSW HYDRO ENERGY LTD 4.125% S/A 18MAY2031 REGS	1,450,000	1,480,025	0.68%
MUTHOOT FINANCE LTD 4.4% S/A 02SEP2023 REGS	1,000,000	1,045,914	0.48%
REC LTD 2.25% S/A 01SEP2026	1,000,000	988,470	0.45%
REC LTD 4.75% S/A 19MAY2023 REGS	500,000	529,736	0.24%
RELIANCE INDUSTRIES LTD 3.667% S/A 30NOV2027 REGS	1,000,000	1,095,618	0.50%
		<u>13,140,911</u>	<u>6.02%</u>
印度尼西亚			
ADARO INDONESIA 4.25% S/A 31OCT2024 REGS	400,000	416,657	0.19%
BANK MANDIRI PERSERO TBK 3.75% S/A 11APR2024	500,000	536,697	0.25%
BANK RAKYAT INDONESIA PERSERO TBK 3.95% S/A 28MAR2024	200,000	216,089	0.10%
BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO TBK 4.2% S/A 23JAN2025	310,000	323,632	0.15%
BAYAN RESOURCES TBK 6.125% S/A 24JAN2023 REGS	250,000	267,003	0.12%
INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM PERSERO 4.75% S/A 15MAY2025 REGS	350,000	387,719	0.18%

中银香港盈荟系列
中银香港全天候亚洲债券基金

投资组合(未经审计)(续)

2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
债务证券(续)			
印度尼西亚(续)			
INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM TBK 5.23% S/A 15NOV2021 REGS	400,000	409,897	0.19%
INDONESIA GOVERNMENT INTL BOND 3.05% S/A 12MAR2051	500,000	504,439	0.22%
INDONESIA GOVERNMENT INTL BOND 4.2% S/A 15OCT2050	200,000	229,963	0.11%
INDONESIA GOVERNMENT INTL BOND 4.75% S/A 18JUL2047 REGS	200,000	243,165	0.11%
INDONESIA GOVERNMENT INTL BOND 5.35% S/A 11FEB2049	1,000,000	1,323,046	0.61%
PELABUHAN INDONESIA II 5.375% S/A 05MAY2045 REGS	600,000	725,401	0.33%
PERTAMINA PERSERO 3.65% S/A 30JUL2029 REGS	400,000	434,924	0.19%
PERUSAHAAN PENERBIT SBSN INDONESIA III 3.8% S/A 23JUN2050 REGS	1,200,000	1,259,501	0.58%
REPUBLIC OF INDONESIA 4.625% S/A 15APR2043 REGS	300,000	350,977	0.16%
		<u>7,629,110</u>	<u>3.49%</u>
日本			
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 3.751% S/A 18JUL2039	500,000	577,462	0.26%
NIPPON LIFE INSURANCE CO 3.4% S/A 23JAN2050 REGS	500,000	525,936	0.24%
NOMURA HLDGS INC 1.851% S/A 16JUL2025	500,000	515,232	0.24%
NTT FINANCE CORP 1.162% S/A 03APR2026 REGS	620,000	620,768	0.28%
SUMITOMO LIFE INSURANCE CO 4% S/A 14SEP2077 REGS	200,000	219,050	0.11%
SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC 2.75% S/A 15JAN2030	600,000	639,156	0.29%
		<u>3,097,604</u>	<u>1.42%</u>

中银香港盈荟系列
中银香港全天候亚洲债券基金

投资组合(未经审计)(续)

2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
债务证券(续)			
韩国			
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD 2.125% S/A 30JUL2023	1,180,000	1,214,106	0.56%
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD 2.625% S/A 30JUL2025	400,000	415,932	0.19%
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD 3.34% S/A 05FEB2030 REGS	500,000	529,693	0.24%
SK TELECOM CO LTD 3.75% S/A 16APR2023 REGS	400,000	424,805	0.19%
WOORI BANK 4.25% S/A PERP REGS	500,000	525,155	0.24%
		<u>3,109,691</u>	<u>1.42%</u>
澳门			
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA MACAU LTD 2.875% S/A 12SEP2029	500,000	523,722	0.24%
马来西亚			
GENM CAPITAL LABUAN LTD 3.882% S/A 19APR2031 REGS	910,000	916,574	0.42%
PETRONAS CAPITAL LTD 3.404% S/A 28APR2061 REGS	930,000	961,580	0.44%
PETRONAS CAPITAL LTD 4.5% S/A 18MAR2045 REGS	300,000	373,859	0.17%
PETRONAS CAPITAL LTD 4.55% S/A 21APR2050 REGS	200,000	249,243	0.12%
RHB BANK BHD 1.658% S/A 29JUN2026	3,010,000	3,019,217	1.38%
TNB GLOBAL VENTURES CAPITAL BHD 4.851% S/A 01NOV2028	480,000	567,396	0.26%
		<u>6,087,869</u>	<u>2.79%</u>
蒙古			
MONGOLIA GOVERNMENT INTL BOND 3.5% S/A 07JUL2027 REGS	200,000	196,278	0.09%

中银香港盈荟系列
中银香港全天候亚洲债券基金

投资组合(未经审计)(续)
2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
债务证券(续)			
荷兰			
ING GROEP NV 4.875% S/A PERP	900,000	947,856	0.43%
ING GROEP NV 6.75% S/A PERP	590,000	660,601	0.31%
MINEJESA CAPITAL BV 5.625% S/A 10AUG2037 REGS	500,000	554,381	0.25%
MONG DUONG FINANCE HLDGS BV 5.125% S/A 07MAY2029 REGS	1,700,000	1,720,617	0.79%
SABIC CAPITAL I BV 2.15% S/A 14SEP2030	500,000	489,775	0.22%
		<u>4,373,230</u>	<u>2.00%</u>
巴基斯坦			
PAKISTAN GOVERNMENT INTL BOND 7.875% S/A 31MAR2036 REGS	500,000	522,713	0.24%
菲律宾			
BDO UNIBANK INC 2.125% S/A 13JAN2026	400,000	415,919	0.19%
BDO UNIBANK INC 2.95% S/A 06MAR2023	500,000	522,085	0.24%
DEVELOPMENT BANK OF THE PHILIPPINES 2.375% S/A 11MAR2031	1,120,000	1,109,513	0.51%
INTL CONTAINER TERMINAL SERVICES INC 4.75% S/A 17JUN2030	340,000	381,782	0.17%
PHILIPPINE GOVERNMENT INTL BOND 1.648% S/A 10JUN2031	340,000	329,263	0.15%
PHILIPPINE GOVERNMENT INTL BOND 2.65% S/A 10DEC2045	1,060,000	984,015	0.45%
PLDT INC 2.5% S/A 23JAN2031	240,000	241,743	0.11%
PLDT INC 3.45% S/A 23JUN2050	1,000,000	1,007,437	0.46%
RIZAL COMMERCIAL BANKING CORP 3% S/A 11SEP2024	800,000	844,829	0.39%
SMC GLOBAL POWER HLDGS CORP 5.95% S/A PERP	500,000	515,263	0.24%
SMC GLOBAL POWER HLDGS CORP 6.5% S/A PERP	430,000	447,783	0.22%
SMC GLOBAL POWER HLDGS CORP 7% S/A PERP	700,000	751,227	0.34%
UNION BANK OF THE PHILIPPINES 3.369% S/A 29NOV2022	500,000	520,597	0.24%
		<u>8,071,456</u>	<u>3.71%</u>

中银香港盈荟系列
中银香港全天候亚洲债券基金

投资组合(未经审计)(续)

2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
债务证券(续)			
沙特阿拉伯			
SAUDI ARABIAN OIL CO 1.625% S/A 24NOV2025 REGS	600,000	606,978	0.28%
SAUDI ARABIAN OIL CO 2.25% S/A 24NOV2030 REGS	1,000,000	985,593	0.45%
		<u>1,592,571</u>	<u>0.73%</u>
新加坡			
BOC AVIATION LTD 2.375% S/A 15SEP2021 REGS	200,000	201,695	0.09%
BOC AVIATION LTD 3.25% S/A 29APR2025 REGS	2,600,000	2,752,067	1.26%
INDIKA ENERGY CAPITAL III PTE LTD 5.875% S/A 09NOV2024 REGS	250,000	255,914	0.12%
INDIKA ENERGY CAPITAL IV PTE LTD 8.25% S/A 22OCT2025 REGS	1,000,000	1,078,403	0.49%
MEDCO BELL PTE LTD 6.375% S/A 30JAN2027 REGS	250,000	265,217	0.12%
MEDCO OAK TREE PTE LTD 7.375% S/A 14MAY2026 REGS	200,000	220,660	0.11%
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP LTD 1.832% S/A 10SEP2030 REGS	590,000	593,055	0.27%
PARKWAY PANTAI LTD 4.25% S/A PERP	500,000	517,240	0.24%
SINGTEL GROUP TREASURY PTE LTD 2.375% S/A 28AUG2029	500,000	520,902	0.24%
SINOCHEM INTL DEVELOPMENT PTE LTD 3.125% S/A 25JUL2022	200,000	205,856	0.09%
THETA CAPITAL PTE LTD 6.75% S/A 31OCT2026	500,000	498,104	0.23%
THETA CAPITAL PTE LTD 8.125% S/A 22JAN2025	250,000	268,769	0.12%
TML HLDGS PTE LTD 5.5% S/A 03JUN2024	1,000,000	1,045,988	0.48%
UNITED OVERSEAS BANK LTD 2.88% S/A 08MAR2027	200,000	204,136	0.09%
UNITED OVERSEAS BANK LTD 3.75% S/A 15APR2029 REGS	260,000	279,060	0.13%
		<u>8,907,066</u>	<u>4.08%</u>

中银香港盈荟系列
中银香港全天候亚洲债券基金

投资组合(未经审计)(续)

2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
债务证券(续)			
斯里兰卡			
SRI LANKA GOVERNMENT INTL BOND 6.25% S/A 27JUL2021 REGS	1,000,000	1,008,336	0.46%
瑞典			
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB 5.125% S/A PERP	600,000	642,668	0.29%
瑞士			
JULIUS BAER GROUP LTD 4.875% S/A PERP	500,000	534,725	0.24%
泰国			
BANGKOK BANK PCL/HONG KONG 3.733% S/A 25SEP2034 REGS	500,000	524,157	0.24%
KASIKORNBANK PCL/HOKG KONG 3.343% S/A 02OCT2031	500,000	515,997	0.24%
KASIKORNBANK PCL/HOKG KONG 5.275% S/A PERP	720,000	773,707	0.35%
KRUNG THAI BANK PCL/CAYMAN ISLANDS 4.4% S/A PERP	670,000	688,112	0.32%
PTTEP TREASURY CENTER CO LTD 2.587% S/A 10JUN2027 REGS	690,000	717,510	0.33%
TMB BANK PCL/CAYMAN ISLANDS 4.9% S/A PERP	1,200,000	1,226,961	0.56%
		4,446,444	2.04%
英国			
HSBC HLDGS PLC 2.357% S/A 18AUG2031	600,000	606,149	0.28%
HSBC HLDGS PLC 4.6% S/A PERP	200,000	207,520	0.10%
HSBC HLDGS PLC 6% S/A PERP	200,000	223,772	0.10%
PHOENIX GROUP HLDGS PLC 5.625% S/A PERP	310,000	334,061	0.15%
STANDARD CHARTERED PLC 3.516% S/A 12FEB2030	500,000	532,178	0.24%
STANDARD CHARTERED PLC 4.305% S/A 21MAY2030 REGS	500,000	576,592	0.26%
STANDARD CHARTERED PLC 7.75% S/A PERP REGS	500,000	556,825	0.26%
WEST CHINA CEMENT LTD 4.95% S/A 08JUL2026	900,000	900,000	0.41%
		3,937,097	1.80%

中银香港盈荟系列
中银香港全天候亚洲债券基金

投资组合(未经审计)(续)
2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
债务证券(续)			
美国			
CNOOC FINANCE 2015 USA LLC 4.375% S/A 02MAY2028	500,000	568,650	0.26%
HYUNDAI CAPITAL AMERICA 3.5% S/A 02NOV2026 REGS	1,000,000	1,089,036	0.50%
US TREASURY N/B 1.625% S/A 15MAY2031	820,000	833,425	0.38%
		<u>3,391,111</u>	<u>1.14%</u>
乌兹别克斯坦			
REP OF UZBEKISTAN 3.7% S/A 25NOV2030 REGS	260,000	260,411	0.12%
越南			
VIETNAM GOVERNMENT INTL BOND 4.8% S/A 19NOV2024 REGS	200,000	224,488	0.10%
		<u>217,986,432</u>	<u>99.83%</u>
外汇远期合约			
买入人民币283,224,737.24元及卖出44,069,324.89美元 (交易对手: 中国银行(香港)有限公司)		<u>(472,185)</u>	<u>(0.22%)</u>
上市/挂牌投资总额		220,117,021	100.81%
其他资产净值		<u>(1,768,083)</u>	<u>(0.81%)</u>
于2021年6月30日的资产净值(按成交价)		<u>218,348,938</u>	<u>100.00%</u>
投资总额, 按成本计		<u>214,689,542</u>	

附注: 投资按交易日基准列帐。

中银香港盈荟系列
中银香港全天候亚洲(日本除外)股票基金

投资组合(未经审计)

2021年6月30日

上市/挂牌投资	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
集合投资计划			
香港			
ISHARES安硕富时中国A50 ETF	30,000	77,797	1.18%
领展房地产投资信托基金	9,000	87,203	1.32%
		<u>165,000</u>	<u>2.50%</u>
新加坡			
ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	30,000	65,775	1.00%
美国			
ISHARES MSCI INDONESIA ETF	6,000	121,680	1.85%
ISHARES MSCI MALAYSIA ETF	5,000	127,700	1.94%
ISHARES MSCI TAIWAN ETF	2,000	127,900	1.94%
		<u>377,280</u>	<u>5.73%</u>
		<u>608,055</u>	<u>9.23%</u>
权益性证券			
香港			
友邦保险控股有限公司	21,000	260,932	3.96%
阿里巴巴集团控股有限公司	16,000	453,234	6.88%
百度集团-SW	8,000	205,398	3.12%
中国建设银行股份有限公司-H股	100,000	78,672	1.19%
龙源电力集团股份有限公司-H股	50,000	86,140	1.31%
中国海洋石油有限公司	150,000	170,542	2.59%
海尔智家股份有限公司-H股	30,000	104,682	1.59%
香港宽频有限公司	100,000	121,034	1.84%
香港电讯信托与香港电讯有限公司	50,000	68,114	1.03%
香港交易及结算所有限公司	2,500	148,975	2.26%
和记电讯香港控股有限公司	800,000	157,602	2.39%
合景悠活集团控股有限公司	125,000	160,306	2.43%
利福国际集团有限公司	350,000	268,593	4.08%
美团点评-B类	12,000	495,056	7.52%
中国平安保险(集团)股份有限公司-H股	15,000	146,883	2.23%
腾讯控股有限公司	7,000	526,370	7.99%
药明生物技术有限公司	8,000	146,580	2.23%
小米集团-B类股份	50,000	173,826	2.64%
		<u>3,772,939</u>	<u>57.28%</u>

中银香港盈荟系列
中银香港全天候亚洲(日本除外)股票基金

投资组合(未经审计)(续)

2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
权益性证券(续)			
韩国			
AMOREPACIFIC CORP	230	51,254	0.78%
CELLTRION INC	361	85,714	1.30%
HOTEL SHILLA CO LTD	1,600	137,243	2.08%
NAVER CORP	150	55,379	0.84%
NCSOFT CORP	50	36,256	0.55%
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	900	140,869	2.14%
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	8,000	570,904	8.67%
SK HYNIX INC	1,500	169,122	2.57%
		<u>1,246,741</u>	<u>18.93%</u>
		<u>5,019,680</u>	<u>76.21%</u>
存托凭证			
台湾			
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO-ADR	4,500	540,720	8.21%
美国			
BAIDU INC-ADR	500	101,950	1.55%
PINDUODUO INC-SPONSORED ADR	540	68,591	1.04%
SEA LTD-ADR	300	82,380	1.25%
		<u>252,921</u>	<u>3.84%</u>
		<u>793,641</u>	<u>12.05%</u>
外汇远期合约			
买入人民币1,693,039.00元及卖出263,516.22美元		(3,039)	(0.05%)
上市/挂牌投资总额		6,418,337	97.44%
其他资产净值		168,737	2.56%
于2021年6月30日的资产净值(按成交价)		<u>6,587,074</u>	<u>100.00%</u>
投资总额,按成本计		<u>5,515,400</u>	

附注:投资按交易日基准列帐。

中银香港盈荟系列
中银香港全天候中国收益基金

投资组合(未经审计)
2021年6月30日

上市/挂牌投资	持股量/ 面值	公允价值 港元	占资产净值 的百分比
集合投资计划			
香港			
ISHARES安硕富时中国A50 ETF	60,000	1,208,400	0.96%
领展房地产投资信托基金	40,000	3,010,000	2.39%
PREMIA中国国库及政策性银行债券长久期ETF—人民币	13,000	1,583,039	1.26%
		<u>5,801,439</u>	<u>4.61%</u>
债务证券			
百慕大			
CHINA OIL AND GAS GROUP LTD 4.7% S/A 30JUN2026	200,000	1,579,687	1.25%
英属维尔京群岛			
RADIANCE CAPITAL INVESTMENTS LTD 10.5% S/A 16JAN2022	200,000	1,658,429	1.32%
WANDA PROPERTIES OVERSEAS LTD 6.875% S/A 23JUL2023	200,000	1,587,085	1.26%
		<u>3,245,514</u>	<u>2.58%</u>
开曼群岛			
CHINA EVERGRANDE GROUP 8.75% S/A 28JUN2025	250,000	1,296,482	1.03%
CHINA HONGQIAO GROUP LTD 6.25% S/A 08JUN2024	200,000	1,587,907	1.26%
CIFI HLDGS GROUP CO LTD 6.7% S/A 23APR2022	1,000,000	1,239,922	0.98%
COUNTRY GARDEN HLDGS CO LTD 6.15% S/A 17SEP2025	50,000	433,744	0.34%
REDCO PROPERTIES GROUP LTD 8% S/A 13APR2022	200,000	1,575,696	1.25%
RONSHINE CHINA HLDGS LTD 8.1% S/A 09JUN2023	250,000	1,897,467	1.51%
YUZHOU PROPERTIES CO LTD 7.7% S/A 20FEB2025	200,000	1,376,827	1.09%
		<u>9,408,045</u>	<u>7.46%</u>

中银香港盈荟系列
中银香港全天候中国收益基金

投资组合(未经审计)(续)
2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 港元	占资产净值 的百分比
债务证券(续)			
香港			
HUARONG LEASING MANAGEMENT HONG KONG CO LTD 2.5% S/A 21JUL2021	200,000	1,556,654	1.24%
印度尼西亚			
BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO TBK 4.2% S/A 23JAN2025	200,000	1,621,583	1.29%
斯里兰卡			
SRI LANKA GOVERNMENT INTL BOND 5.75% S/A 18JAN2022 REGS	200,000	1,478,357	1.17%
英国			
WEST CHINA CEMENT LTD 4.95% S/A 08JUL2026	200,000	1,553,280	1.23%
		20,442,824	16.22%
权益性证券			
中国内地			
贵州茅台酒股份有限公司-A股	700	1,728,937	1.37%
香港			
友邦保险控股有限公司	65,000	6,272,500	4.98%
阿里巴巴集团控股有限公司	30,000	6,600,000	5.24%
百度集团-SW	25,000	4,985,000	3.96%
龙源电力集团股份有限公司-H股	180,000	2,408,400	1.91%
招商银行股份有限公司-H股	20,000	1,325,000	1.05%
华润置地有限公司	10,000	314,500	0.25%
旭辉控股有限公司	100,000	606,000	0.48%
中国中信股份有限公司	100,000	837,000	0.66%
中国海洋石油有限公司	550,000	4,856,500	3.85%
银河娱乐集团有限公司	25,000	1,553,750	1.23%
海尔智家股份有限公司-H股	60,000	1,626,000	1.29%
香港电讯信托与香港电讯有限公司	300,000	3,174,000	2.52%

中银香港盈荟系列
中银香港全天候中国收益基金

投资组合(未经审计)(续)
2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 港元	占资产净值 的百分比
权益性证券(续)			
香港(续)			
香港交易及结算所有限公司	7,500	3,471,000	2.75%
汇丰控股有限公司	120,000	5,382,000	4.27%
和记电讯香港控股有限公司	1,500,000	2,295,000	1.82%
中国工商银行股份有限公司-H股	650,000	2,964,000	2.35%
信达生物制药(B)	10,000	905,500	0.72%
京东集团股份有限公司	3,500	1,068,900	0.85%
金蝶国际软件集团有限公司	30,000	790,500	0.63%
合景悠活集团控股有限公司	148,000	1,474,080	1.17%
利福国际集团有限公司	373,000	2,223,080	1.76%
龙湖集团控股有限公司	10,000	435,000	0.35%
美团点评-B类	30,000	9,612,000	7.62%
中国平安保险(集团)股份有限公司-H股	80,000	6,084,000	4.83%
中国生物制药有限公司	100,000	762,000	0.60%
信和置业有限公司	150,000	1,836,000	1.46%
舜宇光学科技有限公司	10,000	2,454,000	1.95%
腾讯控股有限公司	16,000	9,344,000	7.40%
药明生物技术有限公司	10,000	1,423,000	1.13%
小米集团-B类股份	120,000	3,240,000	2.57%
		<u>90,322,710</u>	<u>71.65%</u>
		<u>92,051,647</u>	<u>73.02%</u>
存托凭证			
美国			
PINDUODUO INC-SPONSORED ADR	1,500	1,479,732	1.17%
TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP-ADR	7,000	841,567	0.67%
		<u>2,321,299</u>	<u>1.84%</u>

中银香港盈荟系列
中银香港全天候中国收益基金

投资组合(未经审计)(续)

2021年6月30日

非上市 / 非挂牌投资	持股量 / 面值	公允价值 港元	占资产净值 的百分比
债务证券			
加拿大			
BANK OF NOVA SCOTIA 4.65% S/A PERP	50,000	400,942	0.32%
英属维尔京群岛			
HENDERSON LAND MTN LTD 3.3% A 13MAY2023	2,000,000	2,403,644	1.91%
外汇远期合约			
买入人民币17,110,539元及卖出20,657,553.74港元 (交易对手：中国银行(香港)有限公司)		(215,487)	(0.17%)
买入人民币517,982元及卖出619,781.36港元 (交易对手：中国银行(香港)有限公司)		(982)	(0.00%)
		<u>(216,469)</u>	<u>(0.17%)</u>
投资总额		123,205,622	97.75%
其他资产净值		2,830,861	2.25%
于2021年6月30日的资产净值(按成交价)		<u>126,036,483</u>	<u>100.00%</u>
投资总额，按成本计		<u>124,715,890</u>	

附注：投资按交易日基准列帐。

中银香港盈荟系列
中银香港全天候亚太高收益基金

投资组合(未经审计)
2021年6月30日

上市/挂牌投资	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
集合投资计划			
香港			
PREMIA 中国国库及政策性银行债券长久期ETF—人民币	13,000	203,832	1.42%
新加坡			
ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	96,280	211,093	1.47%
美国			
ISHARES MSCI AUSTRALIA ETF	15,000	389,700	2.72%
ISHARES MSCI SOUTH KOREA ETF	5,600	521,808	3.64%
ISHARES MSCI TAIWAN ETF	12,200	780,191	5.46%
		1,691,699	11.82%
		2,106,624	14.71%
权益性证券			
澳大利亚			
BHP GROUP LTD	10,000	364,129	2.54%
FORTESCUE METALS GROUP LTD	7,000	122,486	0.85%
RIO TINTO LTD	3,468	329,259	2.30%
WESFARMERS LTD	10,000	443,073	3.09%
WHITEHAVEN COAL LTD	320,000	465,414	3.25%
		1,724,361	12.03%
中国内地			
北京君正集成电路股份有限公司—A股	18,000	280,893	1.96%
贵州茅台酒股份有限公司—A股	1,100	349,828	2.44%
宜宾五粮液股份有限公司—A股	5,500	253,343	1.77%
漳州片仔癀药业股份有限公司—A股	9,000	623,881	4.35%
		1,507,945	10.52%

中银香港盈荟系列
中银香港全天候亚太高收益基金

投资组合(未经审计)(续)
2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
权益性证券(续)			
香港			
瑞声科技控股有限公司	10,000	74,809	0.52%
友邦保险控股有限公司	49,000	608,841	4.25%
安踏体育用品有限公司	32,000	753,193	5.25%
比亚迪股份有限公司—H股	26,000	777,349	5.42%
中国建设银行股份有限公司—H股	150,000	118,008	0.82%
龙源电力集团股份有限公司—H股	70,000	120,596	0.84%
招商银行股份有限公司—H股	45,000	383,865	2.68%
华润电力控股有限公司	80,000	109,188	0.76%
银河娱乐集团有限公司	15,000	120,036	0.84%
汇丰控股有限公司	14,000	80,848	0.56%
李宁有限公司	33,000	402,812	2.81%
龙湖集团控股有限公司	50,000	280,053	1.95%
中国石油天然气股份有限公司—H股	1,100,000	535,383	3.73%
荣昌生物制药(烟台)股份有限公司—H股	14,000	213,432	1.49%
赛晶电力电子集团有限公司	300,000	115,498	0.81%
舜宇光学科技有限公司	4,000	126,391	0.88%
创科实业有限公司	9,000	157,138	1.10%
药明生物技术有限公司	27,000	494,708	3.45%
小米集团—B类股份	50,000	173,826	1.21%
		<u>5,645,974</u>	<u>39.37%</u>
		<u>8,878,280</u>	<u>61.92%</u>
债务证券			
百慕大			
HOPSON DEVELOPMENT HLDGS LTD 7.5% S/A 27JUN2022	200,000	<u>203,613</u>	<u>1.42%</u>
英属维尔京群岛			
TUSPARK FORWARD LTD 7.95% S/A 15AUG2021	200,000	<u>77,864</u>	<u>0.54%</u>

中银香港盈荟系列
中银香港全天候亚太高收益基金

投资组合(未经审计)(续)

2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
债务证券(续)			
开曼群岛			
CHINA AOYUAN GROUP LTD 7.95% S/A 21JUN2024	200,000	194,882	1.36%
CHINA HONGQIAO GROUP LTD 6.25% S/A 08JUN2024	200,000	204,459	1.43%
HILONG HLDG LTD 9.75% S/A 18NOV2024 REGS	200,000	180,469	1.26%
KAISA GROUP HLDGS LTD 9.75% S/A 28SEP2023	200,000	202,262	1.41%
LOGAN GROUP CO LTD 4.7% S/A 06JUL2026	200,000	199,108	1.39%
REDCO PROPERTIES GROUP LTD 8% S/A 13APR2022	200,000	202,886	1.42%
REDSUN PROPERTIES GROUP LTD 7.3% S/A 21MAY2024	200,000	191,174	1.33%
SINIC HLDGS GROUP CO LTD 8.5% S/A 24JAN2022	400,000	382,009	2.66%
YUZHOU PROPERTIES CO LTD 8.375% S/A 30OCT2024	200,000	181,857	1.27%
YUZHOU PROPERTIES CO LTD 8.5% S/A 26FEB2024	250,000	236,208	1.65%
		<u>2,175,314</u>	<u>15.18%</u>
英国			
WEST CHINA CEMENT LTD 4.95% S/A 08JUL2026	200,000	200,000	1.40%
		<u>2,656,791</u>	<u>18.54%</u>
存托凭证			
英国			
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD PREFERENCE SHARE-GDR REGS	268	436,304	3.04%
美国			
SEA LTD-ADR	500	137,300	0.96%
		<u>573,604</u>	<u>4.00%</u>

中银香港盈荟系列
中银香港全天候亚太高收益基金

投资组合(未经审计)(续)

2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
外汇远期合约			
买入871,982.00澳元及卖出673,867.69美元 (交易对手: 中国银行(香港)有限公司)		(19,947)	(0.14%)
买入人民币10,293,246.00元及卖出1,602,111.50美元 (交易对手: 中国银行(香港)有限公司)		(18,476)	(0.13%)
		<u>(38,423)</u>	<u>(0.27%)</u>
上市/挂牌投资总额		14,176,876	98.90%
其他资产净值		<u>157,653</u>	<u>1.10%</u>
于2021年6月30日的资产净值(按成交价)		<u>14,334,529</u>	<u>100.00%</u>
投资总额, 按成本计		<u>11,955,643</u>	

附注: 投资按交易日基准列帐。

中银香港盈荟系列
中银香港全天候短期债券基金

投资组合 (未经审计)
2021年6月30日

上市 / 挂牌投资	持股量 / 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
债务证券			
英属维尔京群岛			
AMBER TREASURE VENTURES LTD 3.5% S/A 08MAY2022	200,000	200,953	0.22%
CDBI TREASURE I LTD 2.25% S/A 02AUG2021	774,000	781,796	0.85%
CHANG DEVELOPMENT INTL LTD 5.7% S/A 08NOV2021	1,800,000	1,831,647	2.00%
CHINA CINDA 2020 I MANAGEMENT LTD 1.25% S/A 20JAN2024	1,000,000	971,780	1.06%
HUARONG FINANCE 2017 CO LTD 3M L+1.175% Q 03JUL2021	2,550,000	2,548,128	2.78%
INDUSTRIAL INVESTMENT OVERSEAS LTD 3.7% S/A 24AUG2021	1,000,000	1,015,920	1.11%
TAIHU PEARL ORIENTAL CO LTD 3.15% S/A 30JUL2023	1,600,000	1,636,772	1.79%
VERTEX CAPITAL INVESTMENT LTD 4.75% S/A 03APR2024	500,000	535,866	0.59%
ZHONGYUAN SINCERE INVESTMENT CO LTD 4.25% S/A 28JUN2024	700,000	729,116	0.80%
		<u>10,251,978</u>	<u>11.20%</u>
开曼群岛			
CK PROPERTY FINANCE MTN LTD 0.75% S/A 30JUN2024	2,770,000	<u>2,753,549</u>	<u>3.01%</u>
中国内地			
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD/HONG KONG 0.7% S/A 17JUN2024	2,210,000	2,204,856	2.41%
香港			
BOCOM LEASING MANAGEMENT HONG KONG CO LTD 3M L+1.075% Q 10DEC2024	2,000,000	1,986,044	2.17%
CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 3.5% S/A 19JUL2022	4,450,000	4,617,098	5.04%
HUARONG LEASING MANAGEMENT HONG KONG CO LTD 2.5% S/A 21JUL2021	2,850,000	2,856,191	3.12%
HUATONG INTL INVESTMENT HLDGS CO LTD 2.98% S/A 04MAR2024	1,000,000	990,185	1.08%
		<u>10,449,518</u>	<u>11.41%</u>
美国			
US TREASURY N/B 0.125% S/A 31MAY2023	5,000,000	<u>4,989,885</u>	<u>5.45%</u>

中银香港盈荟系列
中银香港全天候短期债券基金

投资组合(未经审计)(续)

2021年6月30日

非上市/非挂牌投资	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
债务证券(续)			
英属维尔京群岛			
BLUESTAR FINANCE HLDGS LTD 3.375% S/A 16JUL2024	560,000	594,115	0.65%
VIGOROUS CHAMPION INTL LTD 3.3% A 07DEC2021	15,000,000	2,365,947	2.58%
		<u>2,960,061</u>	<u>3.23%</u>
开曼群岛			
SUNRISE CAYMAN LTD 5.25% S/A 11MAR2024	6,000,000	6,303,669	6.89%
中国内地			
AGRICULTURAL BANK OF CHINA/LONDON 0.8% S/A 18MAY2024	2,000,000	2,001,571	2.19%
CHINA HUARONG FINANCIAL LEASING CO LTD 4.5% A 29AUG2021 CDC RMB	20,000,000	3,206,117	3.50%
STATE DEVELOPMENT & INVESTMENT CORP LTD 4.9% A 05NOV2024 SHCH	15,000,000	2,500,324	2.73%
		<u>7,708,012</u>	<u>8.42%</u>
美国			
UNITED STATES OF AMERICA TREASURY BILL 0% A 16JUN2022	7,000,000	6,995,392	7.64%
外汇远期合约			
买入5,130,000.00欧元及卖出6,163,182美元 (交易对手: 中国银行(香港)有限公司)		(78,682)	(0.09%)
买入2,271,842.63美元及卖出人民币15,000,000元 (交易对手: 中国银行(香港)有限公司)		(45,522)	(0.05%)
买入1,542,543.35美元及卖出人民币10,000,000元 (交易对手: 中国银行(香港)有限公司)		(758)	0.00%
买入6,115,473.00美元及卖出5,130,000欧元 (交易对手: 中国银行(香港)有限公司)		30,973	0.03%

中银香港盈荟系列
中银香港全天候短期债券基金

投资组合(未经审计)(续)

2021年6月30日

非上市/非挂牌投资	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
外汇远期合约(续)			
买入3,096,119.01美元及卖出人民币20,000,000元 (交易对手:中国银行(香港)有限公司)		6,955	0.01%
买入2,308,935.58美元及卖出人民币15,000,000元 (交易对手:中国银行(香港)有限公司)		(7,937)	(0.01%)
		<u>(94,972)</u>	<u>(0.10%)</u>
上市/挂牌投资总额		54,521,949	59.57%
其他资产净值		<u>37,015,543</u>	<u>40.43%</u>
于2021年6月30日的资产净值(按成交价)		<u>91,537,492</u>	<u>100.00%</u>
投资总额,按成本计		<u>53,760,281</u>	

附注:投资按交易日基准列帐。

中银香港盈荟系列
中银香港全天候一带一路债券基金

投资组合(未经审计)
2021年6月30日

上市/挂牌投资	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
集合投资计划			
香港			
PREMIA中国国库及政策性银行债券长久期ETF-人民币	19,000	297,908	1.05%
权益性证券			
中国内地			
内蒙古伊利实业集团股份有限公司-A股	12,500	71,187	0.25%
江苏恒瑞医药股份有限公司-A股	15,120	158,913	0.56%
贵州茅台酒股份有限公司-A股	800	254,420	0.89%
宜宾五粮液股份有限公司-A股	7,100	327,043	1.15%
		811,563	2.85%
香港			
中国飞鹤有限公司	27,000	58,266	0.20%
中信证券股份有限公司-H股	57,500	144,224	0.51%
石药集团有限公司	111,360	161,167	0.57%
腾讯控股有限公司	10,450	785,795	2.76%
		1,149,452	4.04%
		1,961,015	6.89%
债务证券			
英属维尔京群岛			
CHANG DEVELOPMENT INTL LTD 5.7% S/A 08NOV2021	200,000	203,516	0.71%
CLP POWER HK FINANCE LTD 3.55% S/A PERP	230,000	243,390	0.85%
EASY TACTIC LTD 12.375% S/A 18NOV2022	300,000	309,588	1.09%

中银香港盈荟系列
中银香港全天候一带一路债券基金

投资组合(未经审计)(续)

2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
债务证券(续)			
英属维尔京群岛(续)			
HAIMEN ZHONGNAN INVESTMENT DEVELOPMENT INTL CO LTD 10.875% S/A 18JUN2022	200,000	191,797	0.67%
HUARONG FINANCE 2017 CO LTD 3M L+1.175% Q 03JUL2021	300,000	299,780	1.05%
JIANGNING JINGKAI OVERSEAS INVESTMENT CO LTD A 3.15% 26OCT2021	200,000	205,028	0.72%
LS FINANCE 2017 LTD 4.8% S/A 18JUN2026	200,000	201,631	0.71%
MEGA WISDOM GLOBAL LTD 5.4% S/A 03NOV2021	200,000	199,964	0.70%
NWD FINANCE BVI LTD 4.125% S/A PERP	200,000	202,735	0.71%
RADIANCE CAPITAL INVESTMENTS LTD 10.5% S/A 16JAN2022	200,000	213,539	0.75%
RONGXINGDA DEVELOPMENT BVI LTD 9% S/A 15JUL2021	400,000	411,316	1.44%
TSMC GLOBAL LTD 2.25% S/A 23APR2031 REGS	390,000	394,274	1.38%
WANDA PROPERTIES OVERSEAS LTD 6.875% S/A 23JUL2023	200,000	204,353	0.72%
YONGDA INVESTMENT LTD 2.25% S/A 16JUN2025	200,000	201,694	0.71%
ZHAOBING INVESTMENT BVI LTD 5.875% S/A 18SEP2022	359,000	345,806	1.21%
ZHONGYUAN SINCERE INVESTMENT CO LTD 4.25% S/A 28JUN2024	500,000	520,797	1.83%
		<u>4,349,208</u>	<u>15.25%</u>
百慕大			
CHINA OIL AND GAS GROUP LTD 4.7% S/A 30JUN2026	200,000	203,400	0.71%
HOPSON DEVELOPMENT HLDGS LTD 7.5% S/A 27JUN2022	300,000	305,419	1.07%
		<u>508,819</u>	<u>1.78%</u>

中银香港盈荟系列
中银香港全天候一带一路债券基金

投资组合(未经审计)(续)
2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
债务证券(续)			
开曼群岛			
21VIANET GROUP INC 7.875% S/A 15OCT2021	500,000	510,833	1.79%
AAC TECHNOLOGIES HLDGS INC 2.625% S/A 02JUN2026	200,000	202,837	0.71%
AGILE GROUP HLDGS LTD 7.875% S/A PERP	200,000	211,126	0.74%
ALIBABA GROUP HLDG LTD 3.25% S/A 09FEB2061	600,000	591,048	2.08%
CENTRAL CHINA REAL ESTATE LTD 6.75% S/A 08NOV2021	250,000	252,182	0.89%
CENTRAL CHINA REAL ESTATE LTD 6.875% S/A 08AUG2022	200,000	201,966	0.71%
CHINA SCE GROUP HLDGS LTD 7.25% S/A 19APR2023	250,000	261,375	0.92%
CIFI HLDGS GROUP CO LTD 6.7% S/A 23APR2022	3,000,000	478,956	1.68%
DAFA PROPERTIES GROUP LTD 9.95% S/A 18JAN2022	300,000	301,076	1.06%
DEXIN CHINA HLDGS CO LTD 11.875% S/A 23APR2022	300,000	315,149	1.11%
KAISA GROUP HLDGS LTD 10.875% S/A 23JUL2023	200,000	210,138	0.74%
KAISA GROUP HLDGS LTD 11.95% S/A 22OCT2022 REGS	200,000	210,957	0.74%
MEITUAN DIANPING 3.05% S/A 28OCT2030 REGS	500,000	495,374	1.74%
REDCO PROPERTIES GROUP LTD 8% S/A 13APR2022	370,000	375,340	1.32%
REDCO PROPERTIES GROUP LTD 8.5% S/A 19AUG2021	200,000	206,554	0.73%
REDSUN PROPERTIES GROUP LTD 9.95% S/A 11APR2022	422,000	437,268	1.54%
RONSHINE CHINA HLDGS LTD 10.5% S/A 01MAR2022	250,000	262,060	0.92%
RONSHINE CHINA HLDGS LTD 8.95% S/A 22JAN2023	200,000	206,318	0.72%
SINIC HLDGS GROUP CO LTD 8.5% S/A 24JAN2022	200,000	191,005	0.67%
SINIC HLDGS GROUP CO LTD 9.5% S/A 18OCT2021	200,000	198,318	0.70%
SUNAC CHINA HLDGS LTD 7.25% S/A 14JUN2022	300,000	308,857	1.08%

中银香港盈荟系列
中银香港全天候一带一路债券基金

投资组合(未经审计)(续)
2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
债务证券(续)			
开曼群岛(续)			
SUNAC CHINA HLDGS LTD 7.95% S/A 11OCT2023	200,000	210,115	0.74%
TENCENT HLDGS LTD 2.39% S/A 03JUN2030 REGS	600,000	598,769	2.10%
YUZHOU PROPERTIES CO LTD 8.5% S/A 04FEB2023	500,000	490,394	1.72%
ZHONGLIANG HLDGS GROUP CO LTD 8.5% S/A 19MAY2022	500,000	476,735	1.67%
		<u>8,204,750</u>	<u>28.82%</u>
中国内地			
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP 2.45% S/A 24JUN2030	200,000	204,433	0.72%
DALIAN DETA HLDG CO LTD 5.95% S/A 29JUL2022	300,000	272,830	0.96%
GUANGZHOU FINELAND REAL ESTATE DEVELOPMENT CO LTD 13.6% S/A 27JUL2023	400,000	427,527	1.50%
JINKE PROPERTIES GROUP CO LTD 6.85% S/A 28MAY2024	500,000	473,505	1.66%
KUNMING RAIL TRANSIT GROUP CO LTD 3.5% S/A 12DEC2022	316,000	317,563	1.12%
ZHENGZHOU URBAN CONSTRUCTION INVESTMENT GROUP CO LTD 3.8% S/A 16JAN2025	200,000	205,535	0.72%
		<u>1,901,393</u>	<u>6.68%</u>
香港			
BANK OF EAST ASIA LTD 5.625% S/A PERP	400,000	412,732	1.45%
CITIC LTD 2.85% S/A 25FEB2030	400,000	411,134	1.44%
HUARONG LEASING MANAGEMENT HONG KONG CO LTD 2.5% S/ A 21JUL2021	200,000	200,434	0.70%
HUASING INTL HLDGS CO LTD 5% S/A 20MAR2023	500,000	521,089	1.83%
NANYANG COMMERCIAL BANK LTD 3.8% S/A 20NOV2029	250,000	258,874	0.91%
SHANGRAO INVESTMENT HLDGS INTL CO LTD 4.3% S/A 16JAN2023	240,000	249,288	0.88%
YANGO JUSTICE INTL LTD 10.25% S/A 18MAR2022	240,000	248,591	0.87%
YANGO JUSTICE INTL LTD 5.3% S/A 11JAN2022	260,000	262,738	0.92%
		<u>2,564,880</u>	<u>9.00%</u>

中银香港盈荟系列
中银香港全天候一带一路债券基金

投资组合(未经审计)(续)
2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
债务证券(续)			
印度			
ADANI ELECTRICITY MUMBAI LTD 3.949% S/A 12FEB2030 REGS	300,000	305,621	1.07%
ALAM SUTERA REALTY TBK 6% S/A 02MAY2024	300,000	265,252	0.93%
EXPORT-IMPORT BANK OF INDIA 3.25% S/A 15JAN2030 REGS	300,000	310,034	1.09%
REC LTD 2.25% S/A 01SEP2026	300,000	296,541	1.04%
RELIANCE INDUSTRIES LTD 3.667% S/A 30NOV2027 REGS	300,000	328,685	1.15%
		<u>1,506,133</u>	<u>5.28%</u>
日本			
NIPPON LIFE INSURANCE CO 2.75% S/A 21JAN2051 REGS	400,000	397,585	1.40%
韩国			
LG CHEM LTD 2.375% S/A 07JUL2031 REGS	400,000	399,524	1.40%
SK HYNIX INC 2.375% S/A 19JAN2031 REGS	600,000	592,901	2.08%
		<u>992,425</u>	<u>3.48%</u>
马来西亚			
RHB BANK BHD 1.658% S/A 29JUN2026	590,000	591,807	2.08%
蒙古			
MONGOLIA GOVERNMENT INTL BOND 3.5% S/A 07JUL2027 REGS	200,000	196,278	0.69%
荷兰			
MONG DUONG FINANCE HLDGS BV 5.125% S/A 07MAY2029 REGS	500,000	506,064	1.78%
阿联酋			
MDGH GMTN RSC LTD 2.5% S/A 03JUN2031	200,000	203,009	0.71%

中银香港盈荟系列
中银香港全天候一带一路债券基金

投资组合(未经审计)(续)

2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
债务证券(续)			
英国			
NATWEST GROUP PLC 3.754% S/A 01NOV2029	300,000	320,888	1.13%
美国			
WEST CHINA CEMENT LTD 4.95% S/A 08JUL2026	400,000	400,000	1.40%
US TREASURY N/B 1.625% S/A 15MAY2031	400,000	406,549	1.43%
		<u>806,549</u>	<u>2.83%</u>
		<u>23,265,860</u>	<u>81.91%</u>
非上市/非挂牌投资			
集合投资计划			
香港			
中银香港盈荟系列－中银香港全天候香港股票基金－X1	505,051	<u>813,528</u>	<u>2.86%</u>
债务证券			
澳大利亚			
SCENTRE GROUP TRUST 2 4.75% S/A 24SEP2080 REGS	200,000	<u>216,072</u>	<u>0.76%</u>
外汇远期合约			
买入人民币75,526,883.27元及卖出11,751,864美元 (交易对手：中国银行(香港)有限公司)		<u>(125,920)</u>	<u>(0.44%)</u>
投资总额		<u>26,212,391</u>	<u>92.03%</u>
其他资产净值		<u>2,267,657</u>	<u>7.97%</u>
于2021年6月30日的资产净值(按成交价)		<u><u>28,480,048</u></u>	<u><u>100.00%</u></u>
投资总额，按成本计		<u><u>25,517,380</u></u>	

附注：投资按交易日基准列帐。

中银香港盈荟系列
中银香港全天候大湾区策略基金

投资组合(未经审计)
2021年6月30日

上市/挂牌投资	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
集合投资计划			
香港			
PREMIA 中国国库及政策性银行债券长久期ETF—人民币	172,000	2,696,850	1.21%
		<u>2,696,850</u>	<u>1.21%</u>
债务证券			
澳大利亚			
MACQUARIE BANK LTD 3.624% S/A 03JUN2030 REGS	230,000	243,751	0.11%
MACQUARIE GROUP LTD 2.691% S/A 23JUN2032 REGS	3,940,000	3,950,038	1.76%
SCENTRE GROUP TRUST 2 4.75% S/A 24SEP2080 REGS	500,000	540,179	0.24%
		<u>4,733,968</u>	<u>2.11%</u>
百慕大			
CHINA OIL AND GAS GROUP LTD 4.7% S/A 30JUN2026	1,200,000	1,220,401	0.55%
HAITONG INTL SECURITIES GROUP LTD 3.125% S/A 18MAY2025	1,500,000	1,565,404	0.70%
HAITONG INTL SECURITIES GROUP LTD 3.375% S/A 19JUL2024	750,000	800,623	0.36%
		<u>3,586,428</u>	<u>1.61%</u>
英属维尔京群岛			
AMBER TREASURE VENTURES LTD 2.9% S/A 11JUN2022	630,000	631,733	0.28%
BLUESTAR FINANCE HLDGS LTD 3.1% S/A PERP	510,000	510,612	0.23%
BLUESTAR FINANCE HLDGS LTD 3.375% S/A 16JUL2024	500,000	530,459	0.24%
BLUESTAR FINANCE HLDGS LTD 3.875% S/A PERP	500,000	509,117	0.23%
BLUESTAR FINANCE HLDGS LTD 6.25% S/A PERP	1,000,000	1,025,515	0.46%
BOCOM INTL BLOSSOM LTD 1.75% S/A 28JUN2026	1,200,000	1,198,267	0.54%

中银香港盈荟系列
中银香港全天候大湾区策略基金

投资组合(未经审计)(续)

2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
债务证券(续)			
英属维尔京群岛(续)			
CHINA GREAT WALL INTL HLDGS V LTD 2.375% S/A 18AUG2030	2,000,000	1,814,189	0.81%
CHINA HUADIAN OVERSEAS DEVELOPMENT MANAGEMENT CO LTD 4% S/A PERP	2,000,000	2,098,611	0.94%
CHINA HUANENG GROUP HONG KONG TREASURY MANAGEMENT HLDG LTD 2.85% S/A PERP	360,000	367,417	0.16%
CHINA HUANENG GROUP HONG KONG TREASURY MANAGEMENT HLDGS LTD 3.08% S/A PERP	2,740,000	2,807,821	1.25%
CHINALCO CAPITAL HLDGS LTD 2.125% S/A 03JUN2026	1,000,000	997,703	0.45%
CHINALCO CAPITAL HLDGS LTD 4.1% S/A PERP	1,000,000	1,053,698	0.47%
CHOUZHOU INTL INVESTMENT LTD 3.15% S/A 11AUG2023	910,000	934,142	0.42%
CICC HONG KONG FINANCE 2016 MTN LTD 3M L+1.175% Q 03MAY2022	3,450,000	3,455,850	1.53%
CMHI FINANCE BVI CO LTD 3.875% S/A PERP	200,000	209,103	0.09%
CNOOC FINANCE 2013 LTD 2.875% S/A 30SEP2029	2,000,000	2,085,335	0.93%
CONTEMPORARY RUIDING DEVELOPMENT LTD 1.875% S/A 17SEP2025	500,000	504,327	0.23%
EASTERN CREATION II INVESTMENT HLDGS LTD 1% S/A 10SEP2023	290,000	290,346	0.13%
ELECT GLOBAL INVESTMENTS LTD 4.85% S/A PERP	500,000	529,768	0.24%
FRANSHION BRILLIANT LTD 4.25% S/A 23JUL2029	1,000,000	1,016,403	0.45%
HAIMEN ZHONGNAN INVESTMENT DEVELOPMENT INTL CO LTD 12% S/A 08JUN2022	500,000	486,107	0.22%
HUARONG FINANCE 2017 CO LTD 4% S/A PERP	2,000,000	1,277,800	0.57%
HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 3.375% S/A 24FEB2030	500,000	351,908	0.16%
HUARONG FINANCE II CO LTD 2.875% S/A PERP	1,000,000	823,525	0.37%

中银香港盈荟系列
中银香港全天候大湾区策略基金

投资组合(未经审计)(续)
2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
债务证券(续)			
英属维尔京群岛(续)			
HUARONG FINANCE II CO LTD 4.625% S/A 03JUN2026	500,000	356,304	0.16%
HUARONG FINANCE II CO LTD 4.875% S/A 22NOV2026	2,000,000	1,427,923	0.64%
INVENTIVE GLOBAL INVESTMENTS LTD 1.65% S/A 03SEP2025	3,200,000	3,189,402	1.42%
JIC ZHIXIN LTD 2.125% S/A 27AUG2030	870,000	844,004	0.38%
JMH CO LTD 2.5% S/A 09APR2031	600,000	611,242	0.27%
JOY TREASURE ASSETS HLDGS INC 1.875% S/A 17NOV2025	2,680,000	2,576,664	1.15%
LEVC FINANCE LTD 1.375% S/A 25MAR2024	1,270,000	1,275,990	0.57%
LS FINANCE 2017 LTD 4.8% S/A 18JUN2026	200,000	201,631	0.09%
NWD FINANCE BVI LTD 4.125% S/A PERP	1,970,000	1,996,942	0.89%
NWD MTN LTD 4.125% S/A 18JUL2029	1,000,000	1,062,687	0.47%
PROVEN HONOUR CAPITAL LTD 4.125% S/A 06MAY2026	500,000	532,411	0.24%
RADIANCE CAPITAL INVESTMENTS LTD 11.75% S/A 31OCT2021	1,000,000	1,039,410	0.46%
RADIANCE CAPITAL INVESTMENTS LTD 8.8% S/A 17SEP2023	1,000,000	1,035,562	0.46%
RONGSHI INTL FINANCE LTD 3.25% S/A 21MAY2024	1,100,000	1,166,573	0.52%
SHANDONG IRON AND STEEL XINHENG INTL CO LTD 6.85% S/A 25SEP2022	1,000,000	1,040,007	0.46%
SHANGHAI PORT GROUP BVI DEVELOPMENT 2 CO LTD 2.375% S/A 13JUL2030	200,000	202,799	0.09%
SHANGHAI PORT GROUP BVI DEVELOPMENT CO LTD 2.85% S/A 11SEP2029	500,000	523,884	0.23%
SIHC INTL CAPITAL LTD 4.35% S/A 26SEP2023	500,000	534,255	0.24%
STUDIO CITY FINANCE LTD 5% S/A 15JAN2029	1,750,000	1,809,333	0.81%
SUNNY EXPRESS ENTERPRISES CORP 3.35% S/A PERP	200,000	205,896	0.09%
TAIHU PEARL ORIENTAL CO LTD 3.15% S/A 30JUL2023	1,070,000	1,094,591	0.49%
TALENT YIELD INTL LTD 3.125% S/A 06MAY2031	990,000	1,035,396	0.46%
TOWNGAS FINANCE LTD 4.75% S/A PERP	1,000,000	1,083,140	0.48%

中银香港盈荟系列
中银香港全天候大湾区策略基金

投资组合(未经审计)(续)

2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
债务证券(续)			
英属维尔京群岛(续)			
UHI CAPITAL LTD 3% S/A 12JUN2024	500,000	520,817	0.23%
VERTEX CAPITAL INVESTMENT LTD 4.75% S/A 03APR2024	960,000	1,028,862	0.46%
VIGOROUS CHAMPION INTL LTD 2.75% S/A 02JUN2025	3,150,000	3,233,900	1.44%
WANDA PROPERTIES OVERSEAS LTD 6.95% S/A 05DEC2022	900,000	908,838	0.41%
WHARF REIC FINANCE BVI LTD 2.875% S/A 07MAY2030	1,500,000	1,537,324	0.69%
YONGDA INVESTMENT LTD 2.25% S/A 16JUN2025	500,000	504,234	0.23%
		<u>58,089,777</u>	<u>25.93%</u>
开曼群岛			
AAC TECHNOLOGIES HLDGS INC 2.625% S/A 02JUN2026	470,000	476,667	0.21%
AAC TECHNOLOGIES HLDGS INC 3% S/A 27NOV2024	1,800,000	1,860,648	0.83%
AGILE GROUP HLDGS LTD 7.75% S/A PERP	600,000	612,618	0.27%
AGILE GROUP HLDGS LTD 7.875% S/A PERP	200,000	211,126	0.09%
AGILE GROUP HLDGS LTD 8.375% S/A PERP	1,300,000	1,365,756	0.61%
CCBL CAYMAN 1 CORP LTD 1.99% S/A 21JUL2025	400,000	404,614	0.18%
CCBL CAYMAN 1 CORP LTD 3.5% S/A 16MAY2024	2,700,000	2,874,947	1.28%
CENTRAL CHINA REAL ESTATE LTD 6.875% S/A 08AUG2022	1,130,000	1,141,107	0.51%
CENTRAL CHINA REAL ESTATE LTD 7.65% S/A 27AUG2023	1,000,000	973,530	0.44%
CHINA AOYUAN GROUP LTD 5.98% S/A 18AUG2025	1,630,000	1,488,830	0.67%
CHINA AOYUAN GROUP LTD 6.35% S/A 08FEB2024	1,000,000	972,764	0.43%
CHINA AOYUAN GROUP LTD 7.95% S/A 19FEB2023	500,000	511,260	0.23%
CHINA AOYUAN GROUP LTD 8.5% S/A 23JAN2022	900,000	939,470	0.42%

中银香港盈荟系列
中银香港全天候大湾区策略基金

投资组合(未经审计)(续)
2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
债务证券(续)			
开曼群岛(续)			
CHINA HONGQIAO GROUP LTD 6.25% S/A 08JUN2024	1,790,000	1,829,905	0.82%
CHINA MENGNIU DAIRY CO LTD 1.875% S/A 17JUN2025	500,000	503,620	0.23%
CHINA OVERSEAS FINANCE CAYMAN VIII LTD 2.75% S/A 02MAR2030	860,000	864,197	0.39%
CHINA OVERSEAS FINANCE CAYMAN VIII LTD 3.125% S/A 02MAR2035	500,000	495,980	0.22%
CHINA OVERSEAS FINANCE CAYMAN VIII LTD 3.45% S/A 15JUL2029	1,000,000	1,066,388	0.48%
CHINA OVERSEAS GRAND OCEANS FINANCE IV CAYMAN LTD 2.45% S/A 09FEB2026	2,800,000	2,829,299	1.26%
CHINA RESOURCES LAND LTD 3.75% S/A PERP	1,540,000	1,607,239	0.72%
CHINA RESOURCES LAND LTD 4.125% S/A 26FEB2029	1,000,000	1,107,743	0.50%
CHINA SCE GROUP HLDGS LTD 5.95% S/A 29SEP2024	1,000,000	1,019,776	0.46%
CHINA SCE GROUP HLDGS LTD 7.25% S/A 19APR2023	500,000	522,750	0.23%
CHINA STATE CONSTRUCTION FINANCE CAYMAN I LTD 3.4% S/A PERP	1,000,000	1,013,732	0.45%
CHINA STATE CONSTRUCTION FINANCE CAYMAN III LTD 4% S/A PERP	2,000,000	2,075,642	0.93%
CK HUTCHISON INTL 19 II LTD 3.375% S/A 06SEP2049 REGS	500,000	541,806	0.24%
COUNTRY GARDEN HLDGS CO LTD 3.125% S/A 22OCT2025	500,000	505,880	0.23%
COUNTRY GARDEN HLDGS CO LTD 5.125% S/A 14JAN2027	500,000	546,287	0.24%
COUNTRY GARDEN HLDGS CO LTD 5.4% S/A 27MAY2025	1,000,000	1,078,690	0.48%
COUNTRY GARDEN HLDGS CO LTD 6.15% S/A 17SEP2025	1,100,000	1,228,674	0.55%
COUNTRY GARDEN HLDGS CO LTD 6.5% S/A 08APR2024	1,000,000	1,077,566	0.48%
DEXIN CHINA HLDGS CO LTD 11.875% S/A 23APR2022	250,000	262,625	0.12%

中银香港盈荟系列
中银香港全天候大湾区策略基金

投资组合(未经审计)(续)
2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
债务证券(续)			
开曼群岛(续)			
DEXIN CHINA HLDGS CO LTD 12.875% S/A 06AUG2021	1,500,000	1,595,501	0.71%
DUBAI DOF SUKUK LTD 2.763% S/A 09SEP2030	430,000	441,036	0.20%
FANTASIA HLDGS GROUP CO LTD 6.95% S/A 17DEC2021	1,350,000	1,308,717	0.58%
FOXCONN FAR EAST LTD 2.5% S/A 28OCT2030	930,000	936,505	0.42%
HONGKONG LAND FINANCE CAYMAN ISLAND CO LTD 2.875% S/A 27MAY2030	800,000	839,724	0.38%
JD.COM INC 3.375% S/A 14JAN2030	650,000	704,448	0.31%
KAISA GROUP HLDGS LTD 10.875% S/A 23JUL2023	450,000	472,810	0.21%
KAISA GROUP HLDGS LTD 11.95% S/A 12NOV2023	710,000	738,965	0.33%
KAISA GROUP HLDGS LTD 9.375% S/A 30JUN2024	1,000,000	943,740	0.42%
KAISA GROUP HLDGS LTD 9.75% S/A 28SEP2023	500,000	505,654	0.23%
LOGAN GROUP CO LTD 4.7% S/A 06JUL2026	1,800,000	1,791,972	0.80%
LOGAN GROUP CO LTD 4.85% S/A 14DEC2026	810,000	816,051	0.36%
LOGAN GROUP CO LTD 5.25% S/A 19OCT2025	910,000	946,154	0.42%
LOGAN GROUP CO LTD 5.75% S/A 14JAN2025	400,000	427,153	0.19%
MEITUAN DIANPING 2.125% S/A 28OCT2025 REGS	1,590,000	1,584,036	0.71%
MEITUAN DIANPING 3.05% S/A 28OCT2030 REGS	660,000	653,893	0.29%
POWERLONG REAL ESTATE HLDGS LTD 6.25% S/A 10AUG2024	2,370,000	2,518,028	1.13%
REDSUN PROPERTIES GROUP LTD 7.3% S/A 13JAN2025	1,200,000	1,156,880	0.52%
REDSUN PROPERTIES GROUP LTD 7.3% S/A 21MAY2024	1,000,000	955,871	0.43%
REDSUN PROPERTIES GROUP LTD 9.95% S/A 11APR2022	500,000	518,091	0.23%
RONSHINE CHINA HLDGS LTD 11.25% S/A 22AUG2021	1,550,000	1,625,566	0.73%
SHIMAO PROPERTY HLDGS LTD 5.6% S/A 15JUL2026	1,000,000	1,078,492	0.48%
SINIC HLDGS GROUP CO LTD 10.5% S/A 18JUN2022	1,000,000	893,252	0.40%

中银香港盈荟系列
中银香港全天候大湾区策略基金

投资组合(未经审计)(续)

2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
债务证券(续)			
开曼群岛(续)			
SINIC HLDGS GROUP CO LTD 8.5% S/A 24JAN2022	500,000	477,512	0.21%
SINIC HLDGS GROUP CO LTD 9.5% S/A 18OCT2021	1,800,000	1,784,862	0.80%
SUN HUNG KAI PROPERTIES CAPITAL MARKET LTD 2.875% S/A 21JAN2030	500,000	528,529	0.24%
SUNAC CHINA HLDGS LTD 5.95% S/A 26APR2024	2,000,000	2,024,896	0.91%
SUNAC CHINA HLDGS LTD 6.5% S/A 09JUL2023	500,000	526,943	0.24%
SUNAC CHINA HLDGS LTD 6.65% S/A 03AUG2024	1,300,000	1,340,494	0.60%
SUNAC CHINA HLDGS LTD 7.25% S/A 14JUN2022	750,000	772,143	0.35%
SUNRISE CAYMAN LTD 5.25% S/A 11MAR2024	2,000,000	2,101,223	0.94%
TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP 2% S/A 03SEP2030	500,000	485,218	0.22%
TIMES CHINA HLDGS LTD 5.55% S/A 04JUN2024	280,000	281,980	0.13%
TIMES CHINA HLDGS LTD 6.75% S/A 16JUL2023	1,000,000	1,058,898	0.47%
WEIBO CORP 3.5% S/A 05JUL2024	500,000	535,737	0.24%
YUZHOU PROPERTIES CO LTD 7.375% S/A 13JAN2026	500,000	412,543	0.18%
YUZHOU PROPERTIES CO LTD 7.7% S/A 20FEB2025	1,300,000	1,152,319	0.52%
YUZHOU PROPERTIES CO LTD 8.3% S/A 27MAY2025	750,000	645,037	0.29%
YUZHOU PROPERTIES CO LTD 8.5% S/A 04FEB2023	500,000	490,394	0.22%
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD 10.25% S/A PERP	700,000	743,601	0.33%
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD 7.1% S/A 10SEP2024	2,130,000	2,061,716	0.92%
ZHONGLIANG HLDGS GROUP CO LTD 7.5% S/A 31JAN2022	4,000,000	3,954,919	1.76%
		<u>78,842,639</u>	<u>35.25%</u>

中银香港盈荟系列
中银香港全天候大湾区策略基金

投资组合(未经审计)(续)
2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
债务证券(续)			
中国内地			
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD/HONG KONG 1.25% S/A 17JUN2026	1,920,000	1,908,741	0.85%
BANK OF CHINA LTD/HONG KONG 3.625% S/A 17APR2029	640,000	700,506	0.31%
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP 2.45% S/A 24JUN2030	500,000	511,083	0.23%
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP/HONG KONG 3M L+0.66% Q 22OCT2022	2,870,000	2,880,678	1.29%
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD/HONG KONG 0.839% S/A 15JUN2024	1,250,000	1,249,141	0.56%
CHINA MINMETALS CORP 3.75% S/A PERP	2,000,000	2,052,740	0.92%
GUANGZHOU FINELAND REAL ESTATE DEVELOPMENT CO LTD 13.6% S/A 27JUL2023	1,420,000	1,517,721	0.68%
GUOREN PROPERTY & CASUALTY INSURANCE CO LTD 3.35% S/A 01JUN2026	1,060,000	1,079,336	0.48%
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD/ LUXEMBOURG 3M L+0.72% Q 11JUN2022	1,000,000	1,002,339	0.45%
JINKE PROPERTIES GROUP CO LTD 6.85% S/A 28MAY2024	2,500,000	2,367,523	1.06%
SHENZHEN EXPRESSWAY CO LTD 1.75% S/A 08JUL2026	400,000	400,276	0.18%
SHOUGANG GROUP CO LTD 4% S/A 23MAY2024	1,000,000	1,062,422	0.47%
WUHAN METRO GROUP CO LTD 5.98% S/A PERP	200,000	204,538	0.09%
		<u>16,937,044</u>	<u>7.57%</u>
德国			
COMMERZBANK AG 7% A PERP	600,000	662,937	0.30%
		<u>662,937</u>	<u>0.30%</u>
香港			
AIA GROUP LTD 3.2% S/A 16SEP2040 REGS	1,380,000	1,439,069	0.64%
AIRPORT AUTHORITY HONG KONG 2.4% S/A PERP	750,000	751,181	0.34%
BANK OF COMMUNICATIONS HONG KONG LTD 2.304% S/A 08JUL2031	1,810,000	1,808,317	0.81%
BANK OF EAST ASIA LTD 5.825% S/A PERP	250,000	272,904	0.12%
BOCOM LEASING MANAGEMENT HONG KONG CO LTD 3M L+0.83% Q 02MAR2023	1,160,000	1,153,509	0.52%
CHONG HING BANK LTD 5.7% S/A PERP	560,000	602,097	0.27%

中银香港盈荟系列
中银香港全天候大湾区策略基金

投资组合(未经审计)(续)

2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
债务证券(续)			
香港(续)			
CITIC LTD 2.85% S/A 25FEB2030	650,000	668,093	0.30%
CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 3.875% S/A 19JUN2029	1,000,000	1,061,242	0.47%
CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 5.125% S/A 14MAR2028	1,000,000	1,160,543	0.52%
CRCC CHENGAN LTD 3.97% S/A PERP	2,000,000	2,068,262	0.92%
GLP CHINA HLDGS LTD 2.95% S/A 29MAR2026	880,000	899,412	0.40%
GUOTAI JUNAN INTL HLDGS LTD 2% S/A 03MAR2026	2,250,000	2,259,080	1.01%
HUATONG INTL INVESTMENT HLDGS CO LTD 2.98% S/A 04MAR2024	1,000,000	990,185	0.44%
LEADER GOAL INTL LTD 4.25% S/A PERP	1,000,000	1,042,015	0.47%
NANYANG COMMERCIAL BANK LTD 3.8% S/A 20NOV2029	1,500,000	1,553,247	0.69%
SHANGRAO INVESTMENT HLDGS INTL CO LTD 4.3% S/A 16JAN2023	360,000	373,931	0.17%
VANKE REAL ESTATE HONG KONG CO LTD 3.5% S/A 12NOV2029	2,000,000	2,084,168	0.93%
YAN GANG LTD 1.9% S/A 23MAR2026	500,000	503,296	0.22%
YANGO JUSTICE INTL LTD 5.3% S/A 11JAN2022	1,030,000	1,040,846	0.47%
YANGO JUSTICE INTL LTD 7.5% S/A 15APR2024	2,500,000	2,500,683	1.12%
YANGO JUSTICE INTL LTD 7.5% S/A 17FEB2025	1,000,000	912,427	0.41%
YANGO JUSTICE INTL LTD 7.875% S/A 04SEP2024	1,000,000	934,886	0.42%
ZHEJIANG SEAPORT INTL CO LTD 1.98% S/A 17MAR2026	730,000	737,556	0.33%
		<u>26,816,949</u>	<u>11.99%</u>
印度			
ADANI ELECTRICITY MUMBAI LTD 3.949% S/A 12FEB2030 REGS	690,000	702,929	0.31%
ADANI PORTS & SPECIAL ECONOMIC ZONE LTD 4.375% S/A 03JUL2029 REGS	600,000	639,265	0.29%
ADANI TRANSMISSION LTD 4% S/A 03AUG2026 REGS	500,000	533,662	0.24%
EXPORT-IMPORT BANK OF INDIA 3.25% S/A 15JAN2030 REGS	500,000	516,723	0.23%
REC LTD 2.25% S/A 01SEP2026	500,000	494,235	0.22%
REC LTD 4.75% S/A 19MAY2023 REGS	500,000	529,736	0.24%
		<u>3,416,550</u>	<u>1.53%</u>

中银香港盈荟系列
中银香港全天候大湾区策略基金

投资组合(未经审计)(续)

2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
债务证券(续)			
印度尼西亚			
BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO TBK 4.2% S/A 23JAN2025	310,000	323,632	0.14%
BUKIT MAKMUR MANDIRI UTAMA 7.75% S/A 10FEB2026 REGS	1,000,000	1,055,954	0.47%
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK 3.398% S/A 09JUN2031	560,000	568,896	0.25%
INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM PERSERO 4.75% S/A 15MAY2025 REGS	350,000	387,719	0.17%
INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM PERSERO 5.45% S/A 15MAY2030 REGS	350,000	410,828	0.18%
PERTAMINA PERSERO 1.4% S/A 09FEB2026 REGS	1,500,000	1,481,538	0.66%
PERTAMINA PERSERO 4.7% S/A 30JUL2049 REGS	500,000	552,847	0.25%
PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA 3.375% S/A 05FEB2030 REGS	200,000	208,786	0.09%
		<u>4,990,200</u>	<u>2.21%</u>
日本			
NIPPON LIFE INSURANCE CO 3.4% S/A 23JAN2050 REGS	500,000	<u>525,936</u>	<u>0.24%</u>
卢森堡			
SPIC LUXEMBOURG LATIN AMERICA RENEWABLE ENERGY INVESTMENT CO SARL 4.65% S/A 30OCT2023	1,000,000	<u>1,078,189</u>	<u>0.48%</u>
澳门			
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA MACAU LTD 2.875% S/A 12SEP2029	500,000	<u>523,722</u>	<u>0.23%</u>
马来西亚			
GENM CAPITAL LABUAN LTD 3.882% S/A 19APR2031 REGS	2,000,000	2,014,448	0.90%
PETRONAS CAPITAL LTD 3.404% S/A 28APR2061 REGS	730,000	754,789	0.34%
RHB BANK BHD 1.658% S/A 29JUN2026	2,000,000	2,006,124	0.90%
		<u>4,775,361</u>	<u>2.14%</u>

中银香港盈荟系列
中银香港全天候大湾区策略基金

投资组合(未经审计)(续)

2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
债务证券(续)			
蒙古			
MONGOLIA GOVERNMENT INTL BOND 3.5% S/A 07JUL2027 REGS	200,000	196,278	0.09%
荷兰			
JABABEKA INTL BV 6.5% S/A 05OCT2023 REGS	1,000,000	997,308	0.45%
菲律宾			
RIZAL COMMERCIAL BANKING CORP 3% S/A 11SEP2024	600,000	633,622	0.28%
SMC GLOBAL POWER HLDGS CORP 7% S/A PERP	1,390,000	1,491,722	0.67%
		2,125,344	0.95%
新加坡			
BOC AVIATION LTD 2.75% S/A 02DEC2023	750,000	777,723	0.35%
BOC AVIATION LTD 3.25% S/A 29APR2025 REGS	3,000,000	3,175,462	1.42%
THETA CAPITAL PTE LTD 6.75% S/A 31OCT2026	500,000	498,104	0.22%
TML HLDGS PTE LTD 4.35% S/A 09JUN2026	870,000	877,907	0.39%
		5,329,196	2.38%
西班牙			
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 6.5% Q PERP	200,000	219,405	0.10%
瑞典			
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB 5.125% S/A PERP	600,000	642,668	0.29%
泰国			
KASIKORNBANK PCL/HOKG KONG 5.275% S/A PERP	500,000	537,296	0.24%
KRUNG THAI BANK PCL/CAYMAN ISLANDS 4.4% S/A PERP	670,000	688,112	0.31%
PTTEP TREASURY CENTER CO LTD 2.587% S/A 10JUN2027 REGS	690,000	717,510	0.32%
TMB BANK PCL/CAYMAN ISLANDS 4.9% S/A PERP	1,200,000	1,226,961	0.55%
		3,169,879	1.42%

中银香港盈荟系列
中银香港全天候大湾区策略基金

投资组合(未经审计)(续)

2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
债务证券(续)			
英国			
PHOENIX GROUP HLDGS PLC 5.625% S/A PERP	310,000	334,061	0.15%
WEST CHINA CEMENT LTD 4.95% S/A 08JUL2026	750,000	750,000	0.34%
		<u>1,084,061</u>	<u>0.49%</u>
		<u>218,743,839</u>	<u>97.76%</u>
外汇远期合约			
买入人民币217,267,818.42元及卖出人民币33,806,532元 (交易对手: 中国银行(香港)有限公司)		(362,234)	(0.16%)
		<u>(362,234)</u>	<u>(0.16%)</u>
上市/挂牌投资总额		221,828,455	99.15%
其他资产净值		<u>1,910,799</u>	<u>0.85%</u>
于2021年6月30日的资产净值(按成交价)		<u><u>223,739,254</u></u>	<u><u>100.00%</u></u>
投资总额, 按成本计		<u><u>234,063,676</u></u>	

附注: 投资按交易日基准列帐。

中银香港盈荟系列
中银香港全天候亚洲高息债券基金

投资组合(未经审计)
2021年6月30日

上市/挂牌投资	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
集合投资计划			
香港			
PREMIA 中国国库及政策性银行债券长久期ETF—人民币	26,000	407,663	1.15%
		<u>407,663</u>	<u>1.15%</u>
债务证券			
百慕大			
CHINA OIL AND GAS GROUP LTD 4.7% S/A 30JUN2026	400,000	406,800	1.15%
HOPSON DEVELOPMENT HLDGS LTD 7.5% S/A 27JUN2022	400,000	407,225	1.15%
		<u>814,025</u>	<u>2.30%</u>
英属维尔京群岛			
EASY TACTIC LTD 12.375% S/A 18NOV2022	250,000	257,990	0.73%
HAIMEN ZHONGNAN INVESTMENT DEVELOPMENT INTL CO LTD 10.875% S/A 18JUN2022	700,000	671,291	1.89%
HAIMEN ZHONGNAN INVESTMENT DEVELOPMENT INTL CO LTD 11.5% S/A 07APR2024	350,000	338,073	0.95%
HAIMEN ZHONGNAN INVESTMENT DEVELOPMENT INTL CO LTD 9% S/A 03AUG2021	300,000	310,296	0.87%
HONG SENG LTD 9.875% S/A 27AUG2022	230,000	240,666	0.68%
HUARONG FINANCE 2017 CO LTD 3M L+1.175% Q 03JUL2021	200,000	199,853	0.56%
HUARONG FINANCE II CO LTD 2.875% S/A PERP	400,000	329,410	0.93%
LS FINANCE 2017 LTD 4.8% S/A 18JUN2026	200,000	201,631	0.57%
MEGA WISDOM GLOBAL LTD 5.4% S/A 03NOV2021	500,000	499,910	1.41%
NWD FINANCE BVI LTD 4.125% S/A PERP	200,000	202,735	0.57%
RONGXINGDA DEVELOPMENT BVI LTD 8.95% S/A 28JAN2022	250,000	227,714	0.64%
STUDIO CITY FINANCE LTD 5% S/A 15JAN2029 REGS	400,000	413,510	1.16%
WANDA PROPERTIES OVERSEAS LTD 6.875% S/A 23JUL2023	550,000	561,970	1.58%
WANDA PROPERTIES OVERSEAS LTD 6.95% S/A 05DEC2022	250,000	252,455	0.71%
WANDA PROPERTIES OVERSEAS LTD 7.25% S/A 28APR2022	200,000	203,457	0.57%
		<u>4,910,961</u>	<u>13.82%</u>

中银香港盈荟系列
中银香港全天候亚洲高息债券基金

投资组合(未经审计)(续)

2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
债务证券(续)			
开曼群岛			
21VIANET GROUP INC 7.875% S/A 15OCT2021	300,000	306,500	0.86%
AGILE GROUP HLDGS LTD 6.875% S/A PERP	500,000	518,495	1.46%
AGILE GROUP HLDGS LTD 7.875% S/A PERP	300,000	316,689	0.89%
CENTRAL CHINA REAL ESTATE LTD 7.25% S/A 13AUG2024	500,000	445,651	1.25%
CENTRAL CHINA REAL ESTATE LTD 7.25% S/A 24APR2023	600,000	579,260	1.63%
CENTRAL CHINA REAL ESTATE LTD 7.65% S/A 27AUG2023	350,000	340,736	0.96%
CHINA AOYUAN GROUP LTD 6.35% S/A 08FEB2024	600,000	583,658	1.64%
CHINA EVERGRANDE GROUP 8.75% S/A 28JUN2025	500,000	333,870	0.94%
CHINA HONGQIAO GROUP LTD 6.25% S/A 08JUN2024	520,000	531,592	1.50%
CHINA HONGQIAO GROUP LTD 7.125% S/A 22JUL2022	500,000	529,484	1.49%
CHINA SCE GROUP HLDGS LTD 5.95% S/A 29SEP2024	200,000	203,955	0.57%
CHINA SCE GROUP HLDGS LTD 7% S/A 02MAY2025	250,000	256,808	0.72%
CIFI HLDGS GROUP CO LTD 4.45% S/A 17AUG2026	400,000	401,316	1.13%
DEXIN CHINA HLDGS CO LTD 9.95% S/A 03DEC2022	420,000	406,127	1.14%
EHI CAR SERVICES LTD 7.75% S/A 14NOV2024	210,000	219,725	0.62%
FANTASIA HLDGS GROUP CO LTD 10.875% S/A 09JAN2023	200,000	189,506	0.53%
FANTASIA HLDGS GROUP CO LTD 6.95% S/A 17DEC2021	200,000	193,884	0.55%
GREENTOWN CHINA HLDGS LTD 4.7% S/A 29APR2025	300,000	304,786	0.86%
KAISA GROUP HLDGS LTD 10.875% S/A 23JUL2023	700,000	735,482	2.07%
KAISA GROUP HLDGS LTD 11.95% S/A 12NOV2023	350,000	364,278	1.03%
KAISA GROUP HLDGS LTD 9.75% S/A 28SEP2023	840,000	849,498	2.39%
KWG GROUP HLDGS LTD 5.875% S/A 10NOV2024	500,000	508,786	1.43%
KWG GROUP HLDGS LTD 7.4% S/A 05MAR2024	500,000	534,422	1.50%
LOGAN GROUP CO LTD 4.7% S/A 06JUL2026	360,000	358,394	1.01%

中银香港盈荟系列
中银香港全天候亚洲高息债券基金

投资组合(未经审计)(续)

2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
债务证券(续)			
开曼群岛(续)			
MGM CHINA HLDGS LTD 4.75% S/A 01FEB2027 REGS	270,000	280,038	0.79%
MODERN LAND CHINA CO LTD 11.5% S/A 13NOV2022	200,000	203,717	0.57%
POWERLONG REAL ESTATE HLDGS LTD 6.25% S/A 10AUG2024	300,000	318,738	0.90%
REDCO PROPERTIES GROUP LTD 8.5% S/A 19AUG2021	360,000	371,797	1.05%
REDSUN PROPERTIES GROUP LTD 7.3% S/A 13JAN2025	350,000	337,423	0.95%
REDSUN PROPERTIES GROUP LTD 7.3% S/A 21MAY2024	400,000	382,349	1.08%
RONSHINE CHINA HLDGS LTD 7.1% S/A 25JAN2025	350,000	325,544	0.92%
RONSHINE CHINA HLDGS LTD 8.1% S/A 09JUN2023	500,000	488,635	1.38%
RONSHINE CHINA HLDGS LTD 8.95% S/A 22JAN2023	400,000	412,636	1.16%
SINIC HLDGS GROUP CO LTD 8.5% S/A 24JAN2022	510,000	487,062	1.37%
SUNAC CHINA HLDGS LTD 5.95% S/A 26APR2024	500,000	506,224	1.43%
SUNAC CHINA HLDGS LTD 6.65% S/A 03AUG2024	500,000	515,575	1.45%
SUNAC CHINA HLDGS LTD 7.5% S/A 01FEB2024	300,000	317,061	0.89%
TIMES CHINA HLDGS LTD 5.55% S/A 04JUN2024	400,000	402,829	1.13%
TIMES CHINA HLDGS LTD 6.2% S/A 22MAR2026	500,000	500,760	1.41%
YUZHOU PROPERTIES CO LTD 6% S/A 25OCT2023	300,000	266,796	0.75%
YUZHOU PROPERTIES CO LTD 7.7% S/A 20FEB2025	300,000	265,920	0.75%
YUZHOU PROPERTIES CO LTD 8.3% S/A 27MAY2025	700,000	602,034	1.69%
YUZHOU PROPERTIES CO LTD 8.375% S/A 30OCT2024	350,000	318,252	0.90%
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD 5.95% S/A 18NOV2021	200,000	201,855	0.57%
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD 7.1% S/A 10SEP2024	200,000	193,588	0.54%
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD 8.7% S/A 03AUG2022	400,000	424,679	1.20%
ZHONGLIANG HLDGS GROUP CO LTD 7.5% S/A 31JAN2022	510,000	504,252	1.42%
ZHONGLIANG HLDGS GROUP CO LTD 9.5% S/A 29JUL2022	300,000	302,391	0.85%
		<u>18,943,057</u>	<u>53.32%</u>

中银香港盈荟系列
中银香港全天候亚洲高息债券基金

投资组合(未经审计)(续)

2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
债务证券(续)			
中国内地			
DALIAN DETA HLDG CO LTD 5.95% S/A 29JUL2022	250,000	227,358	0.64%
GUANGZHOU FINELAND REAL ESTATE DEVELOPMENT CO LTD 13.6% S/A 27JUL2023	480,000	513,033	1.44%
JINKE PROPERTIES GROUP CO LTD 6.85% S/A 28MAY2024	800,000	757,607	2.13%
		<u>1,497,998</u>	<u>4.21%</u>
香港			
CATHAY PACIFIC MTN FINANCING HK LTD 4.875% S/A 17AUG2026	380,000	389,059	1.10%
HUARONG LEASING MANAGEMENT HONG KONG CO LTD 2.5% S/A 21JUL2021	200,000	200,435	0.56%
YANGO JUSTICE INTL LTD 7.5% S/A 15APR2024	730,000	730,200	2.05%
YANLORD LAND HK CO LTD 5.125% S/A 20MAY2026	800,000	822,053	2.31%
		<u>2,141,747</u>	<u>6.02%</u>
印度			
ADANI PORTS & SPECIAL ECONOMIC ZONE LTD 4.2% S/A 04AUG2027 REGS	400,000	424,964	1.20%
MANAPPURAM FINANCE LTD 5.9% S/A 13JAN2023	250,000	265,803	0.75%
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD 5.95% S/A 24OCT2022 REGS	250,000	259,016	0.73%
		<u>949,783</u>	<u>2.68%</u>
印度尼西亚			
ADARO INDONESIA 4.25% S/A 31OCT2024 REGS	250,000	260,410	0.73%
BAYAN RESOURCES TBK 6.125% S/A 24JAN2023 REGS	250,000	267,003	0.75%
		<u>527,413</u>	<u>1.48%</u>

中银香港盈荟系列
中银香港全天候亚洲高息债券基金

投资组合(未经审计)(续)
2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
债务证券(续)			
蒙古			
MONGOLIAN MINING CORP/ENERGY RESOURCES LLC 9.25% S/A 15APR2024 REGS	250,000	236,640	0.67%
荷兰			
MONG DUONG FINANCE HLDGS BV 5.125% S/A 07MAY2029 REGS	300,000	303,638	0.85%
ROYAL CAPITAL BV 5% S/A PERP	570,000	611,535	1.72%
		915,173	2.57%
巴基斯坦			
PAKISTAN GOVERNMENT INTL BOND 6.875% S/A 05DEC2027 REGS	300,000	313,592	0.88%
PAKISTAN GOVERNMENT INTL BOND 8.25% S/A 15APR2024 REGS	250,000	277,704	0.78%
		591,296	1.66%
菲律宾			
SAN MIGUEL CORP 5.5% S/A PERP	300,000	322,588	0.91%
SMC GLOBAL POWER HLDGS CORP 7% S/A PERP	350,000	375,613	1.06%
		698,201	1.97%
新加坡			
INDIKA ENERGY CAPITAL III PTE LTD 5.875% S/A 09NOV2024 REGS	250,000	255,914	0.72%
LMIRT CAPITAL PTE LTD 7.25% S/A 16JUN2024	250,000	261,922	0.74%
MEDCO BELL PTE LTD 6.375% S/A 30JAN2027 REGS	250,000	265,217	0.75%
MEDCO OAK TREE PTE LTD 7.375% S/A 14MAY2026 REGS	250,000	275,825	0.78%
THETA CAPITAL PTE LTD 8.125% S/A 22JAN2025	250,000	268,769	0.76%
		1,327,647	3.75%

中银香港盈荟系列
中银香港全天候亚洲高息债券基金

投资组合(未经审计)(续)

2021年6月30日

上市/挂牌投资(续)	持股量/ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
债务证券(续)			
斯里兰卡			
SRI LANKA GOVERNMENT INTL BOND 5.75% S/A 18APR2023 REGS	300,000	229,812	0.65%
SRI LANKA GOVERNMENT INTL BOND 6.25% S/A 27JUL2021 REGS	600,000	605,002	1.70%
		<u>834,814</u>	<u>2.35%</u>
英国			
WEST CHINA CEMENT LTD 4.95% S/A 08JUL2026	380,000	<u>380,000</u>	<u>1.07%</u>
非上市/非挂牌投资			
债券证券			
英属维尔京群岛			
EASY TACTIC LTD 11.75% S/A 02AUG2023	400,000	<u>413,625</u>	<u>1.17%</u>
外汇远期合约			
买入2,219,881.00澳元及卖出1,728,643美元 (交易对手: 中国银行(香港)有限公司)		(29,382)	(0.08%)
买入62,000.00澳元及卖出47,281美元 (交易对手: 中国银行(香港)有限公司)		(788)	0.00%
买入400,294.00英镑及卖出566,876美元 (交易对手: 中国银行(香港)有限公司)		(14,394)	(0.04%)
买入人民币28,566,712.98元及卖出4,444,935美元 (交易对手: 中国银行(香港)有限公司)		(44,958)	(0.13%)
买入人民币2,700,000.00元及卖出421,151美元 (交易对手: 中国银行(香港)有限公司)		(5,537)	(0.02%)
买入352,255.00欧元及卖出432,569美元 (交易对手: 中国银行(香港)有限公司)		(14,643)	(0.04%)
		<u>(109,702)</u>	<u>(0.31%)</u>
投资总额		35,480,341	99.88%
其他资产净值		<u>42,462</u>	<u>0.12%</u>
于2021年6月30日的资产净值(按成交价)		<u>35,522,803</u>	<u>100.00%</u>
投资总额, 按成本计		<u>35,006,790</u>	

中银香港盈荟系列

投资组合变动表(未经审计) 截至2021年6月30日止年度

	中银香港全天候 环球投资基金		中银香港全天候 中国高息债券基金		中银香港全天候 香港股票基金		中银香港全天候 在岸人民币股票基金		中银香港全天候 亚洲债券基金		中银香港全天候 亚洲(日本除外)股票基金	
	2021年 %	2020年 %	2021年 %	2020年 %	2021年 %	2020年 %	2021年 %	2020年 %	2021年 %	2020年 %	2021年 %	2020年 %
权益性证券												
澳大利亚	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
英属维尔京群岛	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
开曼群岛	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中国内地	-	-	-	-	11.77	-	71.81	98.33	-	-	-	-
法国	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
香港	38.62	4.32	-	-	70.15	92.01	25.35	-	-	-	57.28	40.12
印度	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
印度尼西亚	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
韩国	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	18.93	20.95
卢森堡	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
马来西亚	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
蒙古	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
荷兰	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
新西兰	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
菲律宾	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
新加坡	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	2.79
斯里兰卡	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西班牙	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
泰国	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
英国	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
美国	11.32	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
债务证券												
澳大利亚	-	3.22	0.67	0.51	-	-	-	-	1.62	2.12	-	-
巴林	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
百慕大	-	-	3.18	0.88	-	-	-	-	1.74	1.04	-	-
英属维尔京群岛	6.40	11.32	14.88	17.47	-	-	-	-	16.62	17.74	-	-
加拿大	-	-	-	-	-	-	-	-	0.09	0.1	-	-
开曼群岛	6.33	16.54	62.84	70.12	-	-	-	-	31.68	35.85	-	-
中国内地	2.18	-	4.31	-	-	-	-	-	4.77	2.91	-	-
埃及	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
法国	2.31	5.2	-	-	-	-	-	-	0.26	0.91	-	-
德国	2.16	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
香港	2.08	-	5.91	3.74	-	-	-	-	10.62	6.57	-	-
印度	-	2.7	0.78	0.95	-	-	-	-	6.02	3.39	-	-
印度尼西亚	2.57	2.72	0.42	0.44	-	-	-	-	3.49	6.00	-	-
Isle of Man	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.18	-	-
日本	-	-	-	-	-	-	-	-	1.42	1.74	-	-
约旦	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
韩国	-	-	-	-	-	-	-	-	1.42	1.22	-	-
澳门	-	-	-	-	-	-	-	-	0.24	0.3	-	-
马来西亚	-	-	-	0.24	-	-	-	-	2.79	0.81	-	-
毛里求斯	-	-	-	0.61	-	-	-	-	-	0.27	-	-
墨西哥	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
蒙古	-	-	-	-	-	-	-	-	0.09	0.12	-	-
荷兰	2.31	2.7	-	-	-	-	-	-	2.00	1.56	-	-
尼日利亚	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
阿曼	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.11	-	-
巴基斯坦	-	-	0.25	-	-	-	-	-	0.24	-	-	-

中银香港盈荟系列

投资组合变动表(未经审计)(续) 截至2021年6月30日止年度

	中银香港全天候 环球投资基金		中银香港全天候 中国高息债券基金		中银香港全天候 香港股票基金		中银香港全天候 在岸人民币股票基金		中银香港全天候 亚洲债券基金		中银香港全天候 亚洲(日本除外)股票基金	
	2021年 %	2020年 %	2021年 %	2020年 %	2021年 %	2020年 %	2021年 %	2020年 %	2021年 %	2020年 %	2021年 %	2020年 %
债务证券(续)												
菲律宾	-	-	1.52	0.10	-	-	-	-	3.71	1.94	-	-
葡萄牙	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
沙特阿拉伯	-	-	-	-	-	-	-	-	0.73	-	-	-
新加坡	-	-	3.72	3.24	-	-	-	-	4.09	3.86	-	-
西班牙	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.34	-	-
斯里兰卡	-	-	0.76	0.30	-	-	-	-	0.46	0.68	-	-
超国家	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞典	2.22	2.63	-	-	-	-	-	-	0.29	0.34	-	-
瑞士	-	-	-	-	-	-	-	-	0.24	-	-	-
泰国	-	-	-	-	-	-	-	-	2.04	1.62	-	-
土耳其	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
阿联酋	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.3	-	-
英国	-	5.43	0.12	-	-	-	-	-	1.80	1.23	-	-
美国	2.07	-	1.00	-	-	-	-	-	1.14	1.07	-	-
乌兹别克斯坦	-	-	-	-	-	-	-	-	0.12	-	-	-
越南	-	-	-	-	-	-	-	-	0.10	0.13	-	-
赞比亚	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
集合投资计划												
澳大利亚	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.69	-	-
中国内地	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
香港	1.98	14.23	1.07	-	-	5.18	-	-	1.20	1.76	2.50	2.26
日本	0.84	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
卢森堡	-	-	0.62	0.53	-	-	-	-	-	-	-	-
新加坡	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1.00	0.94
英国	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
美国	13.58	17.42	-	-	-	-	-	-	-	-	5.73	12.76
存托凭证												
印度	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
台湾	1.25	-	-	-	-	-	-	-	-	-	8.21	5.01
英国	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1.07
美国	-	1.74	-	-	-	-	-	-	-	-	3.84	10.35
外汇远期合约												
投资总额	98.22	90.17	101.06	99.20	81.89	97.26	97.25	98.32	100.81	96.91	97.44	96.26
其他资产净值	1.78	9.83	(1.06)	0.80	18.11	2.74	2.75	1.68	(0.81)	3.09	2.56	3.74
于6月30日的资产 净值	100.00	100.00	100.00	100.00	100.00	100.00	100.00	100.00	100.00	100.00	100.00	100.00

中银香港盈荟系列

投资组合变动表(未经审计)(续) 截至2021年6月30日止年度

	中银香港全天候 中国收益基金		中银香港全天候 亚太高收益基金		中银香港全天候 短期债券基金		中银香港全天候 一带一路债券基金		中银香港全天候 大湾区策略基金		中银香港 全天候 亚洲高息 债券基金
	2021年	2020年	2021年	2020年	2021年	2020年	2021年	2020年	2021年	2020年	2021年
	%	%	%	%	%	%	%	%	%	%	%
权益性证券											
澳大利亚	-	-	12.03	6.98	-	-	-	-	-	-	-
英属维尔京群岛	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
开曼群岛	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中国内地	1.37	0.88	10.52	5.28	-	-	2.85	2.20	-	-	-
法国	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
香港	71.65	39.15	39.37	21.60	-	-	4.04	2.25	-	-	-
印度	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
印度尼西亚	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
韩国	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
卢森堡	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
马来西亚	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
蒙古	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
荷兰	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
新西兰	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
菲律宾	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
新加坡	-	-	-	4.76	-	-	-	-	-	-	-
斯里兰卡	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西班牙	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
泰国	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
英国	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
美国	-	-	-	1.08	-	-	-	0.72	-	-	-
债务证券											
澳大利亚	-	-	-	-	-	-	0.76	-	2.11	1.28	-
巴林	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
百慕大	1.25	-	1.42	-	-	0.47	1.78	-	2.31	1.65	2.30
英属维尔京群岛	4.49	21.18	0.54	6.86	14.43	36.43	15.25	27.34	25.23	22.55	14.99
加拿大	0.32	0.29	-	-	-	-	-	-	-	-	-
开曼群岛	7.46	14.3	15.18	23.44	9.89	4.03	29.81	30.68	35.25	42.62	53.32
中国内地	-	1.21	-	-	10.83	6.43	6.68	2.75	7.57	8.17	4.21
埃及	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
法国	-	1.09	-	1.44	-	-	-	0.79	-	0.56	-
德国	-	-	-	-	-	-	-	-	0.30	0.31	-
香港	1.24	2.75	-	1.66	11.41	12.00	9.00	4.08	11.99	8.20	6.02
印度	-	1.17	-	1.55	-	-	5.28	3.45	1.53	1.47	2.68
印度尼西亚	1.29	1.19	-	2.43	-	-	-	7.59	2.21	0.98	1.48
Isle of Man	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
日本	-	1.26	-	-	-	-	1.40	0.91	0.24	0.28	-
Jersey, C.I.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

中银香港盈荟系列

投资组合变动表(未经审计)(续)
截至2021年6月30日止年度

	中银香港全天候 中国收益基金		中银香港全天候 亚太高收益基金		中银香港全天候 短期债券基金		中银香港全天候 一带一路债券基金		中银香港全天候 大湾区策略基金		中银香港 全天候 亚洲高息 债券基金
	2021年	2020年	2021年	2020年	2021年	2020年	2021年	2020年	2021年	2020年	2021年
	%	%	%	%	%	%	%	%	%	%	%
债务证券(续)											
约旦	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
韩国	-	-	-	-	-	0.30	3.48	-	-	0.97	-
卢森堡	-	-	-	-	-	-	-	-	0.48	0.57	-
澳门	-	-	-	-	-	-	-	-	0.23	0.27	-
马来西亚	-	1.14	-	1.29	-	-	2.08	0.70	2.14	-	-
毛里求斯	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
墨西哥	-	-	-	-	-	-	0.69	-	-	-	-
蒙古	-	-	-	-	-	-	-	-	0.09	-	0.67
荷兰	-	1.15	-	1.52	-	-	1.78	0.83	0.45	1.04	2.57
尼日利亚	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
阿曼	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
巴基斯坦	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1.66
菲律宾	-	-	-	-	-	-	-	0.89	0.95	1.16	1.97
葡萄牙	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
新加坡	-	2.14	-	3.43	-	-	-	3.30	2.38	2.32	3.75
西班牙	-	-	-	-	-	-	-	-	0.10	0.10	-
斯里兰卡	1.17	-	-	-	-	-	-	1.23	-	0.19	2.35
超国家	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞典	-	-	-	-	-	-	-	-	0.29	0.31	-
瑞士	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
泰国	-	-	-	-	-	-	-	0.90	1.42	1.31	-
土耳其	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
阿联酋	-	-	-	-	-	-	0.71	-	-	-	-
英国	1.23	-	-	1.57	-	-	1.13	1.37	0.15	0.16	1.07
美国	-	-	1.40	-	13.09	-	2.83	-	0.34	0.62	-
越南	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
赞比亚	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
集合投资计划											
澳大利亚	-	1.79	-	-	-	3.1	-	1.30	-	-	-
中国内地	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
香港	4.61	4.63	1.42	-	-	-	3.91	2.77	1.21	1.00	-
日本	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1.15
卢森堡	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
新加坡	-	-	1.47	3.53	-	-	-	-	-	-	-
英国	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
美国	-	-	11.82	3.39	-	-	-	-	-	-	-

中银香港盈荟系列

投资组合变动表(未经审计)(续) 截至2021年6月30日止年度

	中银香港全天候 中国收益基金		中银香港全天候 亚太高收益基金		中银香港全天候 短期债券基金		中银香港全天候 一带一路债券基金		中银香港全天候 大湾区策略基金		中银香港 全天候 亚洲高息 债券基金
	2021年	2020年	2021年	2020年	2021年	2020年	2021年	2020年	2021年	2020年	2021年
	%	%	%	%	%	%	%	%	%	%	%
上市/挂牌投资(续)											
存托凭证											
印度	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
台湾	-	-	-	1.36	-	-	-	-	-	-	-
英国	-	-	3.04	2.08	-	-	-	-	-	-	-
美国	1.84	-	0.96	-	-	-	-	-	-	-	-
外汇远期合约	(0.17)	-	(0.27)	0.01	(0.10)	(0.22)	(0.44)	0.01	(0.16)	0.01	(0.31)
投资总额	97.75	95.32	98.90	95.26	59.56	56.54	93.02	96.06	98.81	98.10	99.88
其他资产净值	2.25	4.68	1.10	4.74	40.44	43.46	6.98	3.94	1.19	1.90	0.12
于6月30日的资产净值	100.00	100.00	100.00	100.00	100.00	100.00	100.00	100.00	100.00	100.00	100.00

中银香港盈荟系列

投资业绩报表 (未经审计) 资产净值

子基金	截至下列日期止 财政年度/期间	子基金的资产净值							
		A1类	A2类	A3类	A4类	A7类	A8类	A9类	
中银香港全天候环球 投资基金 (附注1)	30.6.2021	1,734,422美元	38,112,186港元	16,700澳元	不适用 ²				
	30.6.2020	1,423,661美元	26,680,657港元	14,770澳元	不适用 ²				
	30.6.2019	1,392,896美元	20,065,591港元	22,215澳元	不适用 ²				
中银香港全天候中国高息 债券基金 (附注2)	30.6.2021	人民币341,960,026元	6,303,183美元	330,154,244港元	4,528,564澳元	不适用 ²	24,794,166美元	不适用 ²	
	30.6.2020	人民币516,358,454元	10,412,769美元	325,497,232港元	3,628,973澳元	不适用 ²	30,319,880美元	不适用 ²	
	30.6.2019	人民币749,491,449元	27,281,406美元	411,980,793港元	3,075,618澳元	不适用 ²	20,180,277美元	不适用 ²	
中银香港全天候香港 股票基金 (附注3)	30.6.2021	159,604,432港元	2,966,326美元	255,640澳元	不适用 ²	人民币3,207,918元	不适用 ²	不适用 ²	
	30.6.2020	114,365,311港元	3,089,116美元	403,847澳元	不适用 ²	人民币1,485,686元	不适用 ²	不适用 ²	
	30.6.2019	135,034,601港元	3,753,605美元	407,774澳元	不适用 ²	人民币1,799,054元	不适用 ²	不适用 ²	
中银香港全天候在岸人民币 股票基金 (附注4)	30.6.2021	人民币49,343,070元	13,129,086美元	238,796,770港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	49,359,708港元	
	30.6.2020	人民币32,282,907元	10,366,902美元	161,637,339港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	15,143,730港元	
	30.6.2019	人民币45,363,988元	11,102,966美元	160,208,274港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	3,930,736港元	
中银香港全天候亚洲 债券基金 (附注5)	30.6.2021	74,342,844美元	58,186,478港元	不适用 ²	不适用 ²	人民币43,342,407元	不适用 ²	不适用 ²	
	30.6.2020	60,555,558美元	411,870,824港元	不适用 ²	不适用 ²	人民币128,285,425元	不适用 ²	不适用 ²	
	30.6.2019	10,146,107美元	145,019,651港元	不适用 ²	不适用 ²	人民币32,415,695元	不适用 ²	不适用 ²	
中银香港全天候亚洲 (日本除外)股票基金 (附注6)	30.6.2021	494,633美元	16,675,168港元	不适用 ²	不适用 ²	人民币1,732,333元	不适用 ²	不适用 ²	
	30.6.2020	366,039美元	9,633,985港元	不适用 ²	不适用 ²	人民币2,014,675元	不适用 ²	不适用 ²	
	30.6.2019	312,536美元	8,091,932港元	不适用 ²	不适用 ²	人民币2,142,627元	不适用 ²	不适用 ²	
中银香港全天候中国 收益基金 (附注7)	30.6.2021	69,694,335港元	1,730,480美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币17,344,342元	不适用 ²	
	30.6.2020	86,042,096港元	2,521,461美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币20,301,311元	不适用 ²	
	30.6.2019	110,184,519港元	6,902,070美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币37,887,635元	不适用 ²	
中银香港全天候亚太高收益 基金 (附注8)	30.6.2021	2,268,233美元	61,087,622港元	不适用 ²	851,725澳元	不适用 ²	人民币10,385,676元	不适用 ²	
	30.6.2020	2,259,278美元	59,649,871港元	不适用 ²	967,947澳元	不适用 ²	人民币13,174,939元	不适用 ²	
	30.6.2019	3,939,946美元	80,038,845港元	不适用 ²	812,044澳元	不适用 ²	人民币16,661,242元	不适用 ²	

中银香港盈荟系列

投资业绩报表 (未经审计) (续) 资产净值 (续)

子基金	截至下列日期止 财政年度/期间	子基金的资产净值						
		A1类	A2类	A3类	A4类	A7类	A8类	A9类
中银香港全天候短期债券基金(附注9)	30.6.2021 30.6.2020 30.6.2019 ¹	23,785,664美元 60,396,889美元 33,819,070美元	195,940,889港元 187,802,225港元 134,461,551港元	人民币976,487元 人民币855,756元 人民币535,937元	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²			
中银香港全天候一带一路债券基金(附注10)	30.6.2021 30.6.2020 30.6.2019 ¹	6,975,955美元 8,332,069美元 7,398,875美元	78,123,191港元 77,395,052港元 107,776,611港元	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	人民币74,015,750元 人民币31,905,215元 人民币34,452,168元	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²
中银香港全天候大湾区策略基金(附注11)	30.6.2021 30.6.2020 ¹	34,832,772美元 31,011,089美元	755,697,590港元 566,204,325港元	198,742,257澳门元 306,539,191澳门元	人民币45,207,584元 人民币22,407,872元	不适用 ² 不适用 ²	不适用 ² 不适用 ²	不适用 ² 不适用 ²
中银香港全天候亚洲高息债券基金(附注12)	30.6.2021 ¹	7,981,974美元	119,189,072港元	不适用 ²	1,076,199澳门元	395,651英镑	人民币30,282,114元	

附注1： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10美元、每份额A2类基金10港元、每份额A3类基金10.5澳元、每份额A7类基金人民币10.44元及每份额X2类基金10港元向投资者发售。

附注2： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金人民币10元、每份额A2类基金10美元、每份额A3类基金10港元、每份额A4类基金10.39澳元、每份额A8类基金9.63美元、每份额X1类基金人民币10.19元、每份额X3类基金9.58港元、每份额I3类基金9.83港元及每份额I4类基金9.64美元向投资者发售。

附注3： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10港元、每份额A2类基金10美元、每份额A3类基金12.63澳元、每份额A7类基金人民币12.65元、每份额X1类基金10港元及每份额X2类基金10.65美元向投资者发售。

附注4： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金人民币10元、每份额A2类基金10美元、每份额A3类基金10港元及每份额A9类基金8港元向投资者发售。

附注5： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10美元、每份额A2类基金10港元、每份额A7类基金人民币10元、每份额X1类基金9.91美元及每份额I2类基金10.01港元向投资者发售。

附注6： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10美元、每份额A2类基金10港元、每份额A7类基金人民币10元、每份额X1类基金10港元、每份额X2类基金10港元及每份额I1类基金10.25美元向投资者发售。

附注7： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10港元、每份额A2类基金10美元及每份额A8类基金人民币10元向投资者发售。

附注8： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10美元、每份额A2类基金10港元、每份额A4类基金10澳元及每份额A8类基金人民币10元向投资者发售。

附注9： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10美元、每份额A2类基金10港元、每份额A3类基金人民币10元、每份额C1类基金10.40美元、每份额X1类基金10美元、每份额X2类基金10港元、每份额I1类基金10.4欧元向投资者发售。

附注10： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10美元、每份额A2类基金10港元及每份额A8类基金人民币10元向投资者发售。

附注11： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10美元、每份额A2类基金9.94港元、每份额A3类基金9.93澳门元、每份额A4类基金人民币10元、每份额A11类基金人民币10元、每份额X1类基金9.78美元及每份额I1类基金10美元向投资者发售。

附注12： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10美元、每份额A2类基金10港元、每份额A4类基金10澳元、每份额A7类基金人民币10元、每份额A9类基金人民币10元、每份额A10类基金10欧元及每份额X2类基金10港元向投资者发售。

¹ 开始营运年份

² 该等类别份额于报告日期尚未发行。

中银香港盈荟系列

投资业绩报表 (未经审计) (续) 资产净值 (续)

子基金	截至下列日期止 财政年度 / 期间	子基金的资产净值						
		A10类	A11类	CI类	XI类	X2类	X3类	II类
中银香港全天候环球 投资基金 (附注1)	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	23,206,275港元	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2020	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	19,915,413港元	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2019	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	19,119,744港元	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候中国 高息债券基金 (附注2)	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币239,650,366元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2020	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币282,694,034元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2019	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币416,316,451元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候香港 股票基金 (附注3)	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	40,451,805港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2020	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	28,857,160港元	992,945美元	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2019	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	38,259,702港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候在岸 人民币股票基金 (附注4)	30.6.2021	不适用 ²	14,264,525港元	不适用 ²				
	30.6.2020	不适用 ²						
	30.6.2019	不适用 ²						
中银香港全天候亚洲 债券基金 (附注5)	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	42,477,207美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2020	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	40,381,593美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2019	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	18,906,933美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候亚洲 (日本除外) 股票基金 (附注6)	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	18,659,842港元	不适用 ²	1,274,844美元
	30.6.2020	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	553,128美元	25,744,023港元	不适用 ²	1,025,620美元
	30.6.2019	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	534,235美元	25,057,889港元	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候中国 收益基金 (附注7)	30.6.2021	不适用 ²	22,073,569港元	不适用 ²				
	30.6.2020	不适用 ²						
	30.6.2019	不适用 ²						
中银香港全天候亚太 高收益基金 (附注8)	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	1,956,204美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2020	不适用 ²						
	30.6.2019	不适用 ²						
中银香港全天候短期债券 基金 (附注9)	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	1,224,696美元	43,902,350港元	不适用 ²	35,551,003美元
	30.6.2020	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	4,257,540美元	52,742,660港元	不适用 ²	59,549,616美元
	30.6.2019	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	10,775,752美元	103,576,674港元	不适用 ²	32,810,068美元

中银香港盈荟系列

投资业绩报表 (未经审计) (续) 资产净值 (续)

子基金	截至下列日期止 财政年度/期间	子基金的资产净值						
		A10类	A11类	C1类	X1类	X2类	X3类	II类
中银香港全天候一带一路 债券基金 (附注10)	30.6.2021 30.6.2020 30.6.2019	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²						
中银香港全天候大湾区 策略基金 (附注11)	30.6.2021 30.6.2020	不适用 ² 不适用 ²	人民币214,999,147元 人民币116,397,180元	不适用 ² 不适用 ²	21,145,993美元 20,539,271美元	不适用 ² 不适用 ²	不适用 ² 不适用 ²	5,368,226美元 5,250,829美元
中银香港全天候亚洲高息债券 基金 (附注12)	30.6.2021	347,372欧元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	44,634,712港元	不适用 ²	不适用 ²

附注1： 份额乃于初步认购时按每份A1类基金10美元、每份A2类基金10港元、每份A3类基金10.5澳元、每份A7类基金人民币10.44元及每份X2类基金10港元向投资者发售。

附注2： 份额乃于初步认购时按每份A1类基金人民币10元、每份A2类基金10美元、每份A3类基金10港元、每份A4类基金10.39澳元、每份A8类基金9.63美元、每份X1类基金人民币10.19元、每份X3类基金9.58港元、每份X4类基金9.83港元及每份X14类基金9.64美元向投资者发售。

附注3： 份额乃于初步认购时按每份A1类基金10港元、每份A2类基金10美元、每份A3类基金12.63澳元、每份A7类基金人民币12.65元、每份X1类基金10港元及每份X2类基金10.65美元向投资者发售。

附注4： 份额乃于初步认购时按每份A1类基金人民币10元、每份A2类基金10美元、每份A3类基金10港元及每份A9类基金8港元向投资者发售。

附注5： 份额乃于初步认购时按每份A1类基金10美元、每份A2类基金10港元、每份A7类基金人民币10元、每份X1类基金9.91美元及每份X2类基金10.01港元向投资者发售。

附注6： 份额乃于初步认购时按每份A1类基金10美元、每份A2类基金10港元、每份A7类基金人民币10元、每份X1类基金10港元、每份X2类基金10港元及每份X3类基金10.25美元向投资者发售。

附注7： 份额乃于初步认购时按每份A1类基金10港元、每份A2类基金10美元及每份A8类基金人民币10元向投资者发售。

附注8： 份额乃于初步认购时按每份A1类基金10美元、每份A2类基金10港元、每份A4类基金10澳元及每份A8类基金人民币10元向投资者发售。

附注9： 份额乃于初步认购时按每份A1类基金10美元、每份A2类基金10港元、每份A3类基金10港元、每份A7类基金人民币10元、每份X1类基金10.40美元、每份X2类基金10美元、每份X3类基金10港元、每份X4类基金10.4欧元向投资者发售。

附注10： 份额乃于初步认购时按每份A1类基金10美元、每份A2类基金10港元及每份A8类基金人民币10元向投资者发售。

附注11： 份额乃于初步认购时按每份A1类基金10美元、每份A2类基金9.94港元、每份A3类基金9.93澳门元、每份A4类基金人民币10元、每份A11类基金人民币10元、每份X1类基金9.78美元及每份X11类基金10美元向投资者发售。

附注12： 份额乃于初步认购时按每份A1类基金10美元、每份A2类基金10港元、每份A4类基金10澳元、每份A7类基金10英镑、每份A9类基金人民币10元、每份A10类基金10欧元及每份X2类基金10港元向投资者发售。

¹ 开始营运年份

² 该等类别份额于报告日期尚未发行。

中银香港盈荟系列

投资业绩报表(未经审计)(续) 资产净值(续)

子基金	截至下列日期止 财政年度/期间	子基金的资产净值		
		I2类	I4类	I6类
中银香港全天候环球 投资基金(附注1)	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2020	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2019	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候中国 高息债券基金(附注2)	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2020	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2019	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候香港 股票基金(附注3)	30.6.2021	6,725,706美元	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2020	4,153,447美元	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2019	4,139,598美元	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候在岸 人民币股票基金(附注4)	30.6.2021	3,348,724美元	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2020	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2019	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候亚洲 债券基金(附注5)	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2020	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2019	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候亚洲(日本除外) 股票基金(附注6)	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2020	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2019	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候中国 收益基金(附注7)	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	
	30.6.2020	不适用 ²	不适用 ²	
	30.6.2019	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候亚太 高收益基金(附注8)	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2020	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2019	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候短期债券 基金(附注9)	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2020	不适用 ²	不适用 ²	130,636,536欧元
	30.6.2019 ¹	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候一带一路 债券基金(附注10)	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2020	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2019 ¹	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候大湾区 策略基金(附注11)	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2020 ¹	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候亚洲高息债券基金(附注12)	30.6.2021 ¹	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²

中银香港盈荟系列

投资业绩报表(未经审计)(续)

资产净值(续)

附注1： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10美元、每份额A2类基金10港元、每份额A3类基金10.5澳元、每份额A7类基金人民币10.44元及每份额X2类基金10港元向投资者发售。

附注2： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金人民币10元、每份额A2类基金10美元、每份额A3类基金10港元、每份额A4类基金10.39澳元、每份额A8类基金9.63美元、每份额X1类基金人民币10.19元、每份额X3类基金9.58港元、每份额I3类基金9.83港元及每份额I4类基金9.64美元向投资者发售。

附注3： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10港元、每份额A2类基金10美元、每份额A3类基金12.63澳元、每份额A7类基金人民币12.65元、每份额X1类基金10港元及每份额X2类基金10.65美元向投资者发售。

附注4： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金人民币10元、每份额A2类基金10美元、每份额A3类基金10港元及每份额A9类基金8港元向投资者发售。

附注5： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10美元、每份额A2类基金10港元、每份额A7类基金人民币10元、每份额X1类基金9.91美元及每份额I2类基金10.01港元向投资者发售。

附注6： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10美元、每份额A2类基金10港元、每份额A7类基金人民币10元、每份额X1类基金10港元、每份额X2类基金10港元及每份额I1类基金10.25美元向投资者发售。

附注7： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10港元、每份额A2类基金10美元及每份额A8类基金人民币10元向投资者发售。

附注8： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10美元、每份额A2类基金10港元、每份额A4类基金10澳元及每份额A8类基金人民币10元向投资者发售。

附注9： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10美元、每份额A2类基金10港元、每份额A3类基金人民币10元、每份额C1类基金10.40美元、每份额X1类基金10美元、每份额X2类基金10港元、每份额I1类基金10美元及每份额I6类基金10.4欧元向投资者发售。

附注10： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10美元、每份额A2类基金10港元及每份额A8类基金人民币10元向投资者发售。

附注11： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10美元、每份额A2类基金9.94港元、每份额A3类基金9.93澳门元、每份额A4类基金人民币10元、每份额A11类基金人民币10元、每份额X1类基金9.78美元及每份额I1类基金10美元向投资者发售。

附注12： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10美元、每份额A2类基金10港元、每份额A4类基金10澳元、每份额A7类基金10英镑、每份额A9类基金人民币10元、每份额A10类基金10欧元及每份额X2类基金10港元向投资者发售。

1 开始营运年份

2 该等类别份额于报告日期尚未发行。

中银香港盈荟系列

投资业绩报表 (未经审计) (续) 资产净值 (续)

子基金	截至下列日期止 财政年度/期间	子基金的每份资产净值							
		A1类	A2类	A3类	A4类	A7类	A8类	A9类	
中银香港全天候环球 投资基金 (附注1)	30.6.2021	12.36美元	12.38港元	16.98澳元	不适用 ²				
	30.6.2020	10.76美元	10.76港元	15.02澳元	不适用 ²				
	30.6.2019	10.38美元	10.46港元	15.10澳元	不适用 ²				
中银香港全天候中国高息 债券基金 (附注2)	30.6.2021	人民币10.05元	9.56美元	9.58港元	9.33澳元	不适用 ²	9.07美元	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2020	人民币9.96元	8.68美元	8.68港元	9.41澳元	不适用 ²	9.20美元	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2019	人民币10.04元	9.56美元	9.63港元	10.33澳元	不适用 ²	9.90美元	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候香港 股票基金 (附注3)	30.6.2021	13.37港元	13.36美元	13.22澳元	不适用 ²	人民币14.83元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2020	10.48港元	10.49美元	10.63澳元	不适用 ²	人民币11.38元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2019	10.56港元	10.48美元	11.29澳元	不适用 ²	人民币11.54元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候在岸人民币 股票基金 (附注4)	30.6.2021	人民币13.71元	13.17美元	13.19港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	12.12港元	不适用 ²
	30.6.2020	人民币10.61元	9.32美元	9.32港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	9.56港元	不适用 ²
	30.6.2019	人民币7.37元	6.67美元	6.72港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	6.64港元	不适用 ²
中银香港全天候亚洲 债券基金 (附注5)	30.6.2021	10.05美元	10.06港元	不适用 ²	不适用 ²	人民币10.71元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2020	10.04美元	10.03港元	不适用 ²	不适用 ²	人民币10.48元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2019	10.15美元	10.22港元	不适用 ²	不适用 ²	人民币10.53元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候亚洲 (日本除外) 股票基金 (附注6)	30.6.2021	12.97美元	12.94港元	不适用 ²	不适用 ²	人民币13.22元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2020	10.48美元	10.44港元	不适用 ²	不适用 ²	人民币10.51元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2019	10.27美元	10.32港元	不适用 ²	不适用 ²	人民币10.40元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²

中银香港盈荟系列

投资业绩报表 (未经审计) (续) 资产净值 (续)

子基金	截至下列日期止 财政年度/期间	子基金的每份资产净值						
		A1类	A2类	A3类	A4类	A7类	A8类	A9类
中银香港全天候中国 收益基金 (附注7)	30.6.2021	8.07港元	8.12美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币8.33元	不适用 ²
	30.6.2020	8.07港元	8.13美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币8.18元	不适用 ²
	30.6.2019	9.25港元	9.25美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币9.39元	不适用 ²
中银香港全天候亚太高收益 基金 (附注8)	30.6.2021	9.54美元	9.44港元	不适用 ²	8.91澳元	不适用 ²	人民币9.71元	不适用 ²
	30.6.2020	8.69美元	8.58港元	不适用 ²	8.24澳元	不适用 ²	人民币8.68元	不适用 ²
	30.6.2019	9.37美元	9.33港元	不适用 ²	9.11澳元	不适用 ²	人民币9.34元	不适用 ²
中银香港全天候短期债券 基金 (附注9)	30.6.2021	10.35美元	10.26港元	人民币9.71元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2020	10.45美元	10.34港元	人民币10.71元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2019 ¹	10.25美元	10.24港元	人民币10.27元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候一带一路 债券基金 (附注10)	30.6.2021	10.52美元	10.41港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币10.79元	不适用 ²
	30.6.2020	10.23美元	10.10港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币10.28元	不适用 ²
	30.6.2019 ¹	10.26美元	10.21港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币10.26元	不适用 ²
中银香港全天候大湾区 策略基金 (附注11)	30.6.2021	9.67美元	9.75港元	9.74澳门元	人民币9.47元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2020	10.05美元	9.93港元	9.93澳门元	人民币10.57元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候亚洲高息债券 基金 (附注12)	30.6.2021	10.08美元	10.10港元	不适用 ²	10.06澳元	10.03英镑	不适用 ²	人民币10.28元

中银香港盈荟系列

投资业绩报表 (未经审计) (续) 资产净值 (续)

附注1： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10美元、每份额A2类基金10港元、每份额A3类基金10.5澳元、每份额A7类基金人民币10.44元及每份额X2类基金10港元向投资者发售。

附注2： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金人民币10元、每份额A2类基金10美元、每份额A3类基金10港元、每份额A4类基金10.39澳元、每份额A8类基金9.63美元、每份额X1类基金人民币10.19元、每份额X3类基金9.58港元、每份额X4类基金9.83港元及每份额X14类基金9.64美元向投资者发售。

附注3： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10港元、每份额A2类基金10美元、每份额A3类基金12.63澳元、每份额A7类基金人民币12.65元、每份额X1类基金10港元及每份额X2类基金10.65美元向投资者发售。

附注4： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金人民币10元、每份额A2类基金10美元、每份额A3类基金10港元及每份额A9类基金8港元向投资者发售。

附注5： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10美元、每份额A2类基金10港元、每份额A7类基金人民币10元、每份额X1类基金9.91美元及每份额X2类基金10.01港元向投资者发售。

附注6： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10美元、每份额A2类基金10港元、每份额A7类基金人民币10元、每份额X1类基金10港元、每份额X2类基金10港元及每份额X11类基金10.25美元向投资者发售。

附注7： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10港元、每份额A2类基金10美元及每份额A8类基金人民币10元向投资者发售。

附注8： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10美元、每份额A2类基金10港元、每份额A4类基金10澳元及每份额A8类基金人民币10元向投资者发售。

附注9： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10美元、每份额A2类基金10港元、每份额A3类基金人民币10元、每份额C1类基金10.40美元、每份额X1类基金10美元、每份额X2类基金10港元、每份额X11类基金10美元及每份额X16类基金10.4欧元向投资者发售。

附注10： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10美元、每份额A2类基金10港元及每份额A8类基金人民币10元向投资者发售。

附注11： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10美元、每份额A2类基金9.94港元、每份额A3类基金9.93澳门元、每份额A4类基金人民币10元、每份额A11类基金人民币10元、每份额X1类基金9.78美元及每份额X11类基金10美元向投资者发售。

附注12： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10美元、每份额A2类基金10港元、每份额A4类基金10澳元、每份额A7类基金10英镑、每份额A9类基金人民币10元、每份额A10类基金10欧元及每份额X2类基金10港元向投资者发售。

1 开始营运年份

2 该等类别份额于报告日期尚未发行。

中银香港盈荟系列

投资业绩报表 (未经审计) (续) 资产净值 (续)

子基金	截至下列日期止 财政年度/期间	子基金的资产净值						
		A10类	A11类	C1类	X1类	X2类	X3类	II类
中银香港全天候环球 投资基金 (附注1)	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	13.72港元	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2020	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	11.78港元	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2019	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	11.31港元	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候中国 高息债券基金 (附注2)	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币14.34元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2020	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币13.34元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2019	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币13.34元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候香港 股票基金 (附注3)	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	12.51港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2020	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	9.69港元	10.57美元	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2019	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	9.63港元	不适用	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候在岸 人民币股票基金 (附注4)	30.6.2021	不适用 ²	13.28港元	不适用 ²				
	30.6.2020	不适用 ²	不适用	不适用 ²				
	30.6.2019	不适用 ²	不适用	不适用 ²				
中银香港全天候亚洲 债券基金 (附注5)	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	11.97美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2020	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	11.38美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2019	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	10.94美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候亚洲 (日本除外) 股票基金 (附注6)	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	13.79港元	不适用 ²	13.07美元
	30.6.2020	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	11.06美元	10.95港元	不适用 ²	10.51美元
	30.6.2019	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	10.68美元	10.66港元	不适用 ²	不适用 ²

中银香港盈荟系列

投资业绩报表 (未经审计) (续) 资产净值 (续)

子基金	截至下列日期止 财政年度/期间	子基金的资产净值						
		A10类	A11类	C1类	X1类	X2类	X3类	I1类
中银香港全天候中国 收益基金 (附注7)	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	8.27	不适用 ²	22,073,569港元	不适用 ²
	30.6.2020	不适用 ²						
	30.6.2019	不适用 ²						
中银香港全天候亚太 高收益基金 (附注8)	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	9.83美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2020	不适用 ²						
	30.6.2019	不适用 ²						
中银香港全天候短期债券 基金 (附注9)	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	10.42美元	10.35港元	不适用 ²	10.39美元
	30.6.2020	不适用 ²	不适用 ²	10.45美元	10.49美元	10.39港元	不适用 ²	10.48美元
	30.6.2019 ¹	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	10.00美元	9.96港元	不适用 ²	10.00美元
中银香港全天候一带一路 债券基金 (附注10)	30.6.2021	不适用 ²						
	30.6.2020	不适用 ²						
	30.6.2019 ¹	不适用 ²						
中银香港全天候大湾区 策略基金 (附注11)	30.6.2021	不适用 ²	人民币10.09元	不适用 ²	10.43美元	不适用 ²	不适用 ²	10.74美元
	30.6.2020 ¹	不适用 ²	人民币10.09元	不适用 ²	10.13美元	不适用 ²	不适用 ²	10.50美元
中银香港全天候亚洲高息债券 基金 (附注12)	30.6.2021	10.07欧元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	10.74港元	不适用 ²	不适用 ²

中银香港盈荟系列

投资业绩报表 (未经审计) (续) 资产净值 (续)

附注1： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10美元、每份额A2类基金10港元、每份额A3类基金10.5澳元、每份额A7类基金人民币10.44元及每份额X2类基金10港元向投资者发售。

附注2： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金人民币10元、每份额A2类基金10美元、每份额A3类基金10港元、每份额A4类基金10.39澳元、每份额A8类基金9.63美元、每份额X1类基金人民币10.19元、每份额X3类基金9.58港元、每份额X4类基金9.83港元及每份额X14类基金9.64美元向投资者发售。

附注3： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10港元、每份额A2类基金10美元、每份额A3类基金12.63澳元、每份额A7类基金人民币12.65元、每份额X1类基金10港元及每份额X2类基金10.65美元向投资者发售。

附注4： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金人民币10元、每份额A2类基金10美元、每份额A3类基金10港元及每份额A9类基金8港元向投资者发售。

附注5： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10美元、每份额A2类基金10港元、每份额A7类基金人民币10元、每份额X1类基金9.91美元及每份额X2类基金10.01港元向投资者发售。

附注6： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10美元、每份额A2类基金10港元、每份额A7类基金人民币10元、每份额X1类基金10港元、每份额X2类基金10港元及每份额X11类基金10.25美元向投资者发售。

附注7： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10港元、每份额A2类基金10美元及每份额A8类基金人民币10元向投资者发售。

附注8： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10美元、每份额A2类基金10港元、每份额A4类基金10澳元及每份额A8类基金人民币10元向投资者发售。

附注9： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10美元、每份额A2类基金10港元、每份额A3类基金人民币10元、每份额C1类基金10.40美元、每份额X1类基金10美元、每份额X2类基金10港元、每份额X11类基金10美元及每份额X16类基金10.4欧元向投资者发售。

附注10： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10美元、每份额A2类基金10港元及每份额A8类基金人民币10元向投资者发售。

附注11： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10美元、每份额A2类基金9.94港元、每份额A3类基金9.93澳门元、每份额A4类基金人民币10元、每份额A11类基金人民币10元、每份额X1类基金9.78美元及每份额X11类基金10美元向投资者发售。

附注12： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10美元、每份额A2类基金10港元、每份额A4类基金10澳元、每份额A7类基金10英镑、每份额A9类基金人民币10元、每份额A10类基金10欧元及每份额X2类基金10港元向投资者发售。

1 开始营运年份

2 该等类别份额于报告日期尚未发行。

中银香港盈荟系列

投资业绩报表(未经审计)(续) 资产净值(续)

子基金	截至下列日期止 财政年度/期间	子基金的资产净值		
		I2类	I4类	I6类
中银香港全天候环球 投资基金(附注1)	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2020	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2019	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候中国 高息债券基金(附注2)	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2020	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2019	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候香港 股票基金(附注3)	30.6.2021	13.44美元	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2020	10.52美元	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2019	10.48美元	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候在岸 人民币股票基金(附注4)	30.6.2021	13.21美元	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2020	不适用	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2019	不适用	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候亚洲 债券基金(附注5)	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2020	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2019	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候亚洲(日本除外) 股票基金(附注6)	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2020	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2019	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候中国 收益基金(附注7)	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	
	30.6.2020	不适用 ²	不适用 ²	
	30.6.2019	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候亚太 高收益基金(附注8)	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2020	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2019	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候短期债券 基金(附注9)	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2020	不适用 ²	不适用 ²	10.46欧元
	30.6.2019 ¹	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候一带一路 债券基金(附注10)	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2020	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2019 ¹	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候大湾区 策略基金(附注11)	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2020 ¹	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候亚洲高息债券基金(附注12)	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²

中银香港盈荟系列

投资业绩报表(未经审计)(续)

资产净值(续)

附注1： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10美元、每份额A2类基金10港元、每份额A3类基金10.5澳元、每份额A7类基金人民币10.44元及每份额X2类基金10港元向投资者发售。

附注2： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金人民币10元、每份额A2类基金10美元、每份额A3类基金10港元、每份额A4类基金10.39澳元、每份额A8类基金9.63美元、每份额X1类基金人民币10.19元、每份额X3类基金9.58港元、每份额I3类基金9.83港元及每份额I4类基金9.64美元向投资者发售。

附注3： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10港元、每份额A2类基金10美元、每份额A3类基金12.63澳元、每份额A7类基金人民币12.65元、每份额X1类基金10港元及每份额X2类基金10.65美元向投资者发售。

附注4： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金人民币10元、每份额A2类基金10美元、每份额A3类基金10港元及每份额A9类基金8港元向投资者发售。

附注5： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10美元、每份额A2类基金10港元、每份额A7类基金人民币10元、每份额X1类基金9.91美元及每份额I2类基金10.01港元向投资者发售。

附注6： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10美元、每份额A2类基金10港元、每份额A7类基金人民币10元、每份额X1类基金10港元、每份额X2类基金10港元及每份额I1类基金10.25美元向投资者发售。

附注7： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10港元、每份额A2类基金10美元及每份额A8类基金人民币10元向投资者发售。

附注8： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10美元、每份额A2类基金10港元、每份额A4类基金10澳元及每份额A8类基金人民币10元向投资者发售。

附注9： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10美元、每份额A2类基金10港元、每份额A3类基金人民币10元、每份额C1类基金10.40美元、每份额X1类基金10美元、每份额X2类基金10港元、每份额I1类基金10美元及每份额I6类基金10.4欧元向投资者发售。

附注10： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10美元、每份额A2类基金10港元及每份额A8类基金人民币10元向投资者发售。

附注11： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10美元、每份额A2类基金9.94港元、每份额A3类基金9.93澳门元、每份额A4类基金人民币10元、每份额A11类基金人民币10元、每份额X1类基金9.78美元及每份额I1类基金10美元向投资者发售。

附注12： 份额乃于初步认购时按每份额A1类基金10美元、每份额A2类基金10港元、每份额A4类基金10澳元、每份额A7类基金10英镑、每份额A9类基金人民币10元、每份额A10类基金10欧元及每份额X2类基金10港元向投资者发售。

1 开始营运年份

2 该等类别份额于报告日期尚未发行。

中银香港盈荟系列

投资业绩记录 (未经审计)

子基金	截至下列日期止 财政年度/期间	每份单位的最高发行价					每份单位的最低赎回价									
		A1类	A2类	A3类	A4类	A7类	A8类	A9类	A1类	A2类	A3类	A4类	A7类	A8类	A9类	
中银香港全天候 环球投资基金	30.6.2021	12.96美元	12.96港元	17.95澳元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	10.90美元	10.89港元	15.20澳元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	
	30.6.2020	11.22美元	11.24港元	16.12澳元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	8.88美元	8.88港元	12.46澳元	不适用 ²					
	30.6.2019	10.38美元	10.46港元	15.10澳元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	9.46美元	9.55港元	9.23澳元	不适用 ²					
	30.6.2018	10.99美元	11.08港元	10.68澳元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	9.71美元	9.79港元	9.47澳元	不适用 ²					
	30.6.2017	9.80美元	9.85港元	9.58澳元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	8.98美元	8.98港元	8.85澳元	不适用 ²					
	30.6.2016	9.35美元	9.35港元	9.71澳元	不适用 ²	人民币9.61元	不适用 ²	8.16美元	8.21港元	8.05澳元	人民币9.20元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	
中银香港全天候 中国高息债券 基金	30.6.2015	10.66美元	10.65港元	10.58澳元	不适用 ²	人民币10.44元	不适用 ²	9.08美元	9.08港元	7.88澳元	不适用 ²	人民币9.16元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	
	30.6.2014	10.67美元	10.66港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	9.66美元	9.66港元	不适用 ²						
	30.6.2021	人民币10.46元	9.98美元	10.00港元	9.77澳元	不适用 ²	9.55美元	8.70美元	8.70港元	9.33澳元	9.33澳元	不适用 ²	9.07美元	9.07美元	不适用 ²	
	30.6.2020	人民币10.77元	9.64美元	9.68港元	10.37澳元	不适用 ²	9.98美元	7.57美元	7.57港元	8.27澳元	8.27澳元	不适用 ²	8.10美元	8.10美元	不适用 ²	
	30.6.2019	人民币10.76元	9.88美元	10.00港元	10.48澳元	不适用 ²	10.00美元	8.96美元	9.06港元	9.88澳元	9.88澳元	不适用 ²	9.35美元	9.35美元	不适用 ²	
	30.6.2018	人民币10.83元	10.54美元	10.65港元	10.87澳元	不适用 ²	10.08美元	9.48美元	9.58港元	10.00澳元	10.00澳元	不适用 ²	9.46美元	9.46美元	不适用 ²	
中银香港全天候 香港股票基金	30.6.2017	人民币10.77元	9.81美元	9.86港元	10.96澳元	不适用 ²	10.09美元	9.22美元	9.21港元	10.62澳元	10.62澳元	不适用 ²	9.82美元	9.82美元	不适用 ²	
	30.6.2016	人民币10.41元	9.88美元	9.86港元	10.84澳元	不适用 ²	9.91美元	9.05美元	9.03港元	10.05澳元	10.05澳元	不适用 ²	9.58美元	9.58美元	不适用 ²	
	30.6.2015	人民币10.43元	10.53美元	10.52港元	10.65澳元	不适用 ²	不适用 ²	9.32美元	9.31港元	9.83澳元	9.83澳元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	
	30.6.2014	人民币10.38元	10.62美元	10.61港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	9.89美元	9.89港元	9.89港元	不适用 ²					
	30.6.2021	15.16港元	15.17美元	15.03澳元	不适用 ²	人民币16.70元	不适用 ²	10.85港元	10.86美元	10.98澳元	10.98澳元	不适用 ²	人民币11.78元	10.86美元	10.86美元	不适用 ²
	30.6.2020	11.64港元	11.62美元	12.25澳元	不适用 ²	人民币12.68元	不适用 ²	8.95港元	8.94美元	9.19澳元	9.19澳元	不适用 ²	人民币9.77元	8.94美元	8.94美元	不适用 ²
30.6.2019	11.77港元	11.63美元	12.62澳元	不适用 ²	人民币12.93元	不适用 ²	9.56港元	9.47美元	10.24澳元	10.24澳元	不适用 ²	人民币10.47元	9.47美元	9.47美元	不适用 ²	
30.6.2018	14.60港元	14.49美元	15.70澳元	不适用 ²	人民币16.18元	不适用 ²	10.13港元	10.06美元	10.95澳元	10.95澳元	不适用 ²	人民币11.28元	10.06美元	10.06美元	不适用 ²	
30.6.2017	10.29港元	10.23美元	11.12澳元	不适用 ²	人民币11.45元	不适用 ²	8.39港元	8.39美元	8.92澳元	8.92澳元	不适用 ²	人民币9.19元	8.39美元	8.39美元	不适用 ²	
30.6.2016	11.62港元	11.63美元	12.22澳元	不适用 ²	人民币12.31元	不适用 ²	7.00港元	6.97美元	7.40澳元	7.40澳元	不适用 ²	人民币7.59元	6.97美元	6.97美元	不适用 ²	
30.6.2015	12.75港元	12.77美元	13.26澳元	不适用 ²	人民币13.36元	不适用 ²	11.00港元	10.99美元	11.52澳元	11.52澳元	不适用 ²	人民币11.54元	10.99美元	10.99美元	不适用 ²	
30.6.2014	12.40港元	12.41美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	9.99港元	9.99美元	9.99港元	9.99港元	不适用 ²	不适用 ²	9.99美元	9.99美元	不适用 ²	

中银香港盈荟系列

投资业绩记录 (未经审计) (续)

子基金	截至下列日期止 财政年度/期间	每份单位的最高发行价							每份单位的最低赎回价						
		A1类	A2类	A3类	A4类	A7类	A8类	A9类	A1类	A2类	A3类	A4类	A7类	A8类	A9类
中银香港全天候在岸 人民币股票基金	30.6.2021	人民币15.90元	15.36美元	15.36港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	14.20港元	人民币10.77元	9.46美元	9.46港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	9.70港元
	30.6.2020	人民币10.61元	9.32美元	9.32港元	不适用 ²	不适用 ²	9.36港元	9.36港元	人民币7.28元	6.37美元	6.44港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	6.56港元
	30.6.2019	人民币8.06元	7.45美元	7.55港元	不适用 ²	不适用 ²	7.27港元	7.27港元	人民币5.76元	5.20美元	5.26港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	5.23港元
	30.6.2018	人民币8.94元	8.46美元	8.54港元	不适用 ²	不适用 ²	8.24港元	8.24港元	人民币6.99元	6.54美元	6.62港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	6.47港元
	30.6.2017	人民币9.54元	8.57美元	8.58港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币7.43元	6.79美元	6.83港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2016 ¹	人民币10.63元	10.62美元	10.62港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币5.11元	4.96美元	4.96港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候亚洲 债券基金	30.6.2021	10.40美元	10.39港元	不适用 ²	不适用 ²	人民币10.95元	不适用 ²	不适用 ²	10.03美元	10.04港元	不适用 ²	不适用 ²	人民币10.50元	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2020	10.52美元	10.57港元	不适用 ²	不适用 ²	人民币10.96元	不适用 ²	不适用 ²	9.12美元	9.12港元	不适用 ²	不适用 ²	人民币9.50元	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2019	10.17美元	10.25港元	不适用 ²	不适用 ²	人民币10.54元	不适用 ²	不适用 ²	9.44美元	9.52港元	不适用 ²	不适用 ²	人民币9.80元	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2018	10.08美元	10.15港元	不适用 ²	不适用 ²	人民币10.40元	不适用 ²	不适用 ²	9.51美元	9.62港元	不适用 ²	不适用 ²	人民币9.86元	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2017 ¹	10.01美元	10.04港元	不适用 ²	不适用 ²	人民币10.26元	不适用 ²	不适用 ²	9.64美元	9.64港元	不适用 ²	不适用 ²	人民币9.64元	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候亚洲 (日本除外) 股票基金	30.6.2021	15.08美元	15.03港元	不适用 ²	不适用 ²	人民币15.31元	不适用 ²	不适用 ²	10.81美元	10.77港元	不适用 ²	不适用 ²	人民币10.84元	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2020	11.52美元	11.51港元	不适用 ²	不适用 ²	人民币11.62元	不适用 ²	不适用 ²	8.32美元	8.29港元	不适用 ²	不适用 ²	人民币8.36元	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2019	11.32美元	11.42港元	不适用 ²	不适用 ²	人民币11.51元	不适用 ²	不适用 ²	9.15美元	9.21港元	不适用 ²	不适用 ²	人民币9.29元	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2018 ¹	12.46美元	12.52港元	不适用 ²	不适用 ²	人民币12.60元	不适用 ²	不适用 ²	9.96美元	9.97港元	不适用 ²	不适用 ²	人民币9.97元	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候中国 收益基金	30.6.2021	8.94港元	9.00美元	不适用 ²	不适用 ²	人民币9.17元	不适用 ²	不适用 ²	7.94港元	7.98美元	不适用 ²	不适用 ²	人民币8.18元	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2020	9.34港元	9.36美元	不适用 ²	不适用 ²	人民币9.50元	不适用 ²	不适用 ²	7.40港元	7.46美元	不适用 ²	不适用 ²	人民币7.51元	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2019	9.55港元	9.51美元	不适用 ²	不适用 ²	人民币9.69元	不适用 ²	不适用 ²	8.49港元	8.45美元	不适用 ²	不适用 ²	人民币8.62元	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2018 ¹	10.87港元	10.87美元	不适用 ²	不适用 ²	人民币10.99元	不适用 ²	不适用 ²	9.39港元	9.35美元	不适用 ²	不适用 ²	人民币9.52元	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候亚太 高收益基金	30.6.2021	10.55美元	10.42港元	不适用 ²	9.92澳元	人民币10.66元	不适用 ²	不适用 ²	8.83美元	8.72港元	不适用 ²	8.37澳元	人民币8.82元	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2020	9.62美元	9.52港元	不适用 ²	9.26澳元	人民币9.60元	不适用 ²	不适用 ²	7.27美元	7.18港元	不适用 ²	6.89澳元	人民币7.25元	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2019	9.63美元	9.63港元	不适用 ²	9.54澳元	人民币9.65元	不适用 ²	不适用 ²	8.60美元	8.58港元	不适用 ²	8.51澳元	人民币8.63元	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2018 ¹	10.02美元	10.03港元	不适用 ²	10.00澳元	人民币10.02元	不适用 ²	不适用 ²	9.47美元	9.48港元	不适用 ²	9.40澳元	人民币9.49元	不适用 ²	不适用 ²

中银香港盈荟系列

投资业绩记录 (未经审计) (续)

子基金	截至下列日期止 财政年度/期间	每份净的最高发行价					每份净的最低赎回价							
		A1类	A2类	A3类	A4类	A7类	A8类	A9类	A1类	A2类	A3类	A4类	A7类	A8类
中银香港全天候短期 债券基金	30.6.2021	10.63美元	10.55港元	人民币10.72元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	10.26美元	10.17港元	人民币9.52元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2020	10.49美元	10.40港元	人民币10.87元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	10.25美元	10.18港元	人民币10.22元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2019 ¹	10.24美元	10.21港元	人民币10.20元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	10.00美元	10.00港元	人民币9.80元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候 一带一路债券基金	30.6.2021	10.79美元	10.66港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币10.97元	10.27美元	10.14港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币10.32元	不适用 ²
	30.6.2020	10.64美元	10.54港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币10.67元	9.26美元	9.15港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币9.29元	不适用 ²
	30.6.2019 ¹	10.28美元	10.23港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币10.28元	10.00美元	10.00港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币10.00元	不适用 ²
中银香港全天候大湾区 策略基金	30.6.2021	10.30美元	10.18港元	10.17澳门元	人民币10.66元	不适用 ²	不适用 ²	9.84美元	9.74港元	9.74澳门元	人民币9.35元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2020 ¹	10.47美元	10.39港元	10.39澳门元	人民币10.97元	不适用 ²	不适用 ²	9.33美元	9.22港元	9.22澳门元	人民币9.86元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候亚洲 高息债券基金	30.6.2021 ¹	10.46美元	10.46港元	不适用 ²	10.40澳门元	10.42英镑	不适用 ²	10.00美元	10.00港元	不适用 ²	9.95澳门元	9.99英镑	不适用 ²	人民币9.98元

¹ 开始营运年份

² 该等类别份额于报告日期尚未发行。

中银香港盈荟系列

投资业绩记录 (未经审计) (续)

子基金	截至下列日期止 财政年度/期间	每份额的最高发行价					每份额的最低赎回价							
		A10类	A11类	C1类	X1类	X2类	X3类	A10类	A11类	C1类	X1类	X2类	X3类	I1类
中银香港全天候环球 投资基金	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	14.30港元	不适用 ²							
	30.6.2020	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	12.25港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	11.93港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2019	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	11.31港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	10.27港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2018	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	11.78港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	10.37港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2017	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	10.43港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	9.97港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2016	不适用 ²												
	30.6.2015	不适用 ²												
	30.6.2014	不适用 ²												
中银香港全天候中国 高息债券基金	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币14.52元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币13.37元	不适用 ²				
	30.6.2020	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币13.99元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币11.36元	不适用 ²				
	30.6.2019	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币13.33元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币11.85元	不适用 ²				
	30.6.2018	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币12.25元	不适用 ²	11.22港元	不适用 ²	人民币11.64元	不适用 ²	不适用 ²	9.79港元	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2017	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币11.76元	不适用 ²	9.88港元	不适用 ²	人民币10.68元	不适用 ²	不适用 ²	9.56港元	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2016	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币10.67元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币10.19元	不适用 ²				
	30.6.2015	不适用 ²												
	30.6.2014	不适用 ²												
中银香港全天候香港 股票基金	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	14.11港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	10.02港元	不适用 ²	10.94美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2020	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	10.69港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	8.24港元	不适用 ²	8.98美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2019	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	10.61港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	8.66港元	不适用 ²				
	30.6.2018	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	13.09港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	9.01港元	不适用 ²				
	30.6.2017	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	9.16港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	7.38港元	不适用 ²				
	30.6.2016	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	10.09港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	6.12港元	不适用 ²				
	30.6.2015	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	10.96港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	9.52港元	不适用 ²				
	30.6.2014	不适用 ²												

中银香港盈荟系列

投资业绩记录 (未经审计) (续)

子基金	截至下列日期止 财政年度/期间	每份额的最高发行价					每份额的最低赎回价							
		A10类	A11类	C1类	X1类	X2类	X3类	A10类	A11类	C1类	X1类	X2类	X3类	I1类
中银香港全天候在岸 人民币股票基金	30.6.2021	不适用 ²												
	30.6.2020	不适用 ²	13.96港元	不适用 ²	11.89港元	不适用 ²								
	30.6.2019	不适用 ²												
	30.6.2018	不适用 ²												
	30.6.2017	不适用 ²												
30.6.2016 ¹	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候亚洲 债券基金	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	12.07美元	不适用 ²	12.07美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²				
	30.6.2020	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	11.70美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	10.17美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2019	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	10.94美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	9.75美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2018	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	10.11美元	不适用 ²	10.25港元	不适用 ²	不适用 ²	9.75美元	10.11港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2017 ¹	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	9.91美元	10.00港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	9.91美元	9.87港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候亚洲 (日本除外) 股票基金	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	16.07美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	15.91港元	不适用 ²	11.30港元	不适用 ²	不适用 ²	10.85美元
	30.6.2020	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	12.08美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	11.99港元	不适用 ²	8.66港元	不适用 ²	不适用 ²	8.33美元
	30.6.2019	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	10.76美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	11.64港元	不适用 ²	9.45港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2018 ¹	不适用 ²	12.67港元	不适用 ²	9.97港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²						
中银香港全天候中国 收益基金	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	8.97港元	不适用 ²	8.97港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²				
	30.6.2020	不适用 ²												
	30.6.2019	不适用 ²												
	30.6.2018 ¹	不适用 ²												
中银香港全天候亚太 高收益基金	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	10.60美元	不适用 ²	9.17美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²				
	30.6.2020	不适用 ²												
	30.6.2019	不适用 ²												
	30.6.2018 ¹	不适用 ²												

中银香港盈荟系列

投资业绩记录 (未经审计) (续)

子基金	截至下列日期止 财政年度/期间	每份单位的最高发行价						每份单位的最低赎回价						
		A10类	A11类	C1类	X1类	X2类	X3类	I1类	A10类	A11类	C1类	X1类	X2类	X3类
中银香港全天候短期 债券基金	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	10.54美元	10.70美元	10.63港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	10.45美元	10.33美元	10.25港元	不适用 ²	10.30美元
	30.6.2020	不适用 ²	不适用 ²	10.49美元	10.52美元	10.45港元	不适用 ²	不适用 ²	10.37美元	10.26美元	10.21港元	不适用 ²	不适用 ²	10.27美元
	30.6.2019 ¹	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	10.25美元	10.24港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	10.00美元	9.96港元	不适用 ²	不适用 ²	10.00美元
中银香港全天候 一带一路债券基金	30.6.2021	不适用 ²												
	30.6.2020	不适用 ²												
	30.6.2019 ¹	不适用 ²												
中银香港全天候大湾区 策略基金	30.6.2021	不适用 ²	人民币10.44元	不适用 ²	10.62美元	不适用 ²	10.97美元	不适用 ²	人民币10.06元	不适用 ²	10.14美元	不适用 ²	不适用 ²	10.51美元
	30.6.2020 ¹	不适用 ²	人民币10.52元	不适用 ²	10.13美元	不适用 ²	10.79美元	不适用 ²	人民币9.34元	不适用 ²	9.78美元	不适用 ²	不适用 ²	9.61美元
中银香港全天候亚洲 高息债券基金	30.6.2021 ¹	10.43欧元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	10.83港元	不适用 ²	10.00欧元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	10.00港元	不适用 ²	不适用 ²

1 开始营运年份

2 该等类别份额于报告日期尚未发行。

中银香港盈荟系列

投资业绩记录(未经审计)(续)

子基金	截至下列日期 止财政年度 / 期间	每份额的最高发行价				每份额的最低赎回价			
		I2类	I3类	I4类	I6类	I2类	I3类	I4类	I6类
中银香港全天候环球 投资基金	30.6.2021	不适用 ²							
	30.6.2020	不适用 ²							
	30.6.2019	不适用 ²							
	30.6.2018	不适用 ²							
	30.6.2017	不适用 ²							
	30.6.2016	不适用 ²							
	30.6.2015	不适用 ²							
	30.6.2014	不适用 ²							
中银香港全天候中国 高息债券基金	30.6.2021	不适用 ²							
	30.6.2020	不适用 ²							
	30.6.2019	不适用 ²	不适用 ²	10.49美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	10.02美元	不适用 ²
	30.6.2018	10.85美元	10.69港元	10.46美元	不适用 ²	9.70美元	9.64港元	9.55美元	不适用 ²
	30.6.2017	不适用 ²	9.86港元	9.65美元	不适用 ²	不适用 ²	9.66港元	9.55美元	不适用 ²
	30.6.2016	不适用 ²							
	30.6.2015	不适用 ²							
	30.6.2014 ¹	不适用 ²							
中银香港全天候香港 股票基金	30.6.2021	15.24美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	10.88美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2020	11.63美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	8.95美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2019	10.51美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	10.13美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2018	不适用 ²							
	30.6.2017	不适用 ²							
	30.6.2016	不适用 ²							
	30.6.2015	不适用 ²							
	30.6.2014 ¹	不适用 ²							

中银香港盈荟系列

投资业绩记录 (未经审计) (续)

子基金	截至下列日期 止财政年度 / 期间	每份额的最高发行价				每份额的最低赎回价			
		I2类	I3类	I4类	I6类	I2类	I3类	I4类	I6类
中银香港全天候在岸 人民币股票基金	30.6.2021	14.90美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	11.86美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2020	不适用 ²							
	30.6.2019	不适用 ²							
	30.6.2018	不适用 ²							
	30.6.2017	不适用 ²							
30.6.2016 ¹	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	
中银香港全天候亚洲 债券基金	30.6.2021	不适用 ²							
	30.6.2020	不适用 ²							
	30.6.2019	不适用 ²							
	30.6.2018	10.32港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	9.99港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2017 ¹	10.04港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	10.00港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候亚洲 (日本除外) 股票基金	30.6.2021	不适用 ²							
	30.6.2020	不适用 ²							
	30.6.2019	不适用 ²							
	30.6.2018 ¹	不适用 ²							
中银香港全天候中国 收益基金	30.6.2021	不适用 ²							
	30.6.2020	不适用 ²							
	30.6.2019	不适用 ²							
	30.6.2018 ¹	不适用 ²							
中银香港全天候亚太 高收益基金	30.6.2021	不适用 ²							
	30.6.2020	不适用 ²							
	30.6.2019	不适用 ²							
	30.6.2018 ¹	不适用 ²							

中银香港盈荟系列

投资业绩记录(未经审计)(续)

子基金	截至下列日期 止财政年度/ 期间	每份的最高发行价			每份的最低赎回价				
		I2类	I3类	I4类	I6类	I2类	I3类	I4类	I6类
中银香港全天候短期债券基金	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	10.51欧元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	10.46欧元
	30.6.2020	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	10.46欧元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	10.40欧元
	30.6.2019 ¹	不适用 ²							
中银香港全天候一带一路债券基金	30.6.2021	不适用 ²							
	30.6.2020	不适用 ²							
	30.6.2019 ¹	不适用 ²							
中银香港全天候大湾区策略基金	30.6.2021	不适用 ²							
	30.6.2020 ¹	不适用 ²							
中银香港全天候亚洲高息债券基金	30.6.2021	不适用 ²							
	30.6.2020 ¹	不适用 ²							

¹ 开始营运年份

² 该等类别份额于报告日期尚未发行。

中银香港盈荟系列

因金融衍生工具所产生敞口的资料(未经审计)

子基金	截至下列日期止 财政年度/期间	敞口总值			敞口净值		
		最高	最低	平均风险值	最高	最低	平均风险值
中银香港全天候环球 投资基金	30.6.2021	0.14%	0.11%	0.13%	0.14%	0.11%	0.13%
	30.6.2020	7.97%	0.12%	1.55%	0.64%	0.03%	0.18%
中银香港全天候中国 高息债券基金	30.6.2021	237.22%	112.61%	126.21%	2.30%	1.19%	1.89%
	30.6.2020	310.78%	101.45%	123.65%	10.25%	0.75%	1.04%
中银香港全天候香港 股票基金	30.6.2021	237.22%	112.61%	126.21%	2.30%	1.19%	1.89%
	30.6.2020	310.78%	101.45%	123.65%	10.25%	0.75%	1.04%
中银香港全天候在岸 人民币股票基金	30.6.2021	2.14%	0.00%	1.45%	1.38%	0.00%	0.08%
	30.6.2020	0.52%	0.00%	0.34%	0.28%	0.00%	0.03%
中银香港全天候亚洲 债券基金	30.6.2021	26.43%	0.00%	18.76%	24.64%	0.00%	17.75%
	30.6.2020	13.73%	8.53%	11.47%	13.69%	8.27%	11.21%
中银香港全天候亚洲 (日本除外)股票基金	30.6.2021	0.97%	0.37%	0.57%	0.00%	0.00%	0.00%
	30.6.2020	0.70%	0.00%	0.37%	0.00%	0.00%	0.00%
中银香港全天候中国 收益基金	30.6.2021	22.01%	10.49%	17.65%	18.31%	10.48%	16.71%
	30.6.2020	62.57%	14.99%	21.51%	21.75%	14.91%	19.39%
中银香港全天候亚太 高收益基金	30.6.2021	22.21%	15.12%	19.27%	12.74%	0.00%	5.77%
	30.6.2020	21.11%	15.35%	18.84%	13.30%	9.12%	10.92%
中银香港全天候短期 债券基金	30.6.2021	0.63%	0.04%	0.22%	0.00%	0.00%	0.00%
	30.6.2020	0.70%	0.00%	0.17%	0.00%	0.00%	0.00%
中银香港全天候一带一路 债券基金	30.6.2021	34.15%	17.00%	24.53%	29.14%	13.30%	19.75%
	30.6.2020	24.59%	15.88%	18.70%	31.02%	13.68%	17.42%
中银香港全天候大湾区 策略基金 ¹	30.6.2021	16.08%	8.28%	12.68%	15.87%	7.85%	12.12%
	30.6.2020 ¹	1.42%	0.00%	0.82%	0.00%	0.00%	0.00%
中银香港全天候亚洲高息 债券基金	30.6.2021 ¹	237.22%	112.61%	126.21%	2.30%	1.19%	1.89%

¹ 开始营运年份