

年度報告

中銀香港盈泰系列

2022年6月30日



中銀香港資產管理有限公司
BOCHK ASSET MANAGEMENT LIMITED

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	6-8
损益及其他全面收益表	9-11
归属于份额持有人的资产净值变动表	12-19
现金流量表	20-25
财务报表附注	26-185
关于中银香港全天候ESG多元资产基金如何实现其ESG重点的 额外信息披露 (未经审计)	186-188
关于中银香港全天候ESG多元资产基金如何实现其ESG重点的 定期评估及报告 (未经审计)	189
投资组合 (未经审计)	190-251
投资组合变动表 (未经审计)	252-258
投资业绩报表 (未经审计)	259-271
投资业绩记录 (未经审计)	272-280
因金融衍生工具所产生敞口的资料 (未经审计)	281

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
花园道1号
中银大厦40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2022年6月30日止年度内，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

2022年10月28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185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、中银香港全天候亚洲高息债券基金及中银香港全天候ESG多元资产基金（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2022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、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截至2022年6月30日止年度和中银香港全天候ESG多元资产基金自2021年7月29日（开始营运日期）至2022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（包括重要会计政策概要）。

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2022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、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截至2022年6月30日止年度和中银香港全天候ESG多元资产基金自2021年7月29日（开始营运日期）至2022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

2022年10月28日

中银香港盈荟系列

资产净值表

2022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	
	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年
	美元	美元	人民币	人民币	港元	港元	人民币	人民币	美元	美元	美元	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	7,854,406	9,471,499	496,066,440	1,103,797,159	157,901,943	229,920,314	291,618,528	396,527,082	99,770,683	220,589,206	3,665,188	6,421,376
应收股息	198,900	994,081	2,810	14,261,351	1,906,500	79,042,948	3,288,083	14,917,892	963,541	5,266,885	187,892	151,382
应收利息	3,251	14,927	-	87,793	702,243	293,845	735,863	198,846	-	-	5,449	13,833
应收认购款项	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他应收款项	-	4,292	94,633	140,965	5,318	35,711	4,254	970,922	-	46,139	-	12,686
存款准备金	-	-	123,699	70,589	-	-	598	23,439	-	-	-	-
现金及现金等价物	-	-	-	-	-	-	264,604	244,804	-	-	-	-
14	527,153	395,874	39,639,349	17,397,597	20,826,212	50,097,933	12,351,414	16,374,917	6,501,904	986,533	68,336	181,237
总资产	8,583,710	10,880,673	535,926,931	1,135,755,454	181,342,216	359,390,751	308,263,344	429,257,902	107,236,128	226,888,763	3,926,865	6,780,514
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	81	380	1,558,151	12,781,044	29,025	81,356	386,374	-	62,766	472,185	-	3,039
应付收益分配	199,522	1,204,995	5,198,506	28,144,449	1,409,561	63,040,108	3,257,877	19,418,017	963,910	5,668,481	141,799	158,867
应付管理费	-	-	5,500,281	11,116,824	-	-	-	-	271,853	593,955	-	-
应付受托人费用	6,322	6,871	449,679	878,173	153,383	227,448	397,837	536,287	67,149	147,503	2,239	4,681
应付费用及其他应付款项	2,500	2,500	56,600	106,958	20,000	30,177	29,995	40,621	10,825	19,932	2,500	2,500
应付赎回款项	24,573	23,633	161,868	153,070	260,368	243,022	559,666	499,858	23,761	24,572	24,649	23,700
244,013	-	-	4,277,112	2,978,424	538,007	15,099,329	2,293,849	1,029,702	343,779	1,613,197	4,075	653
负债(不包括归属于份额持有人的资产净值)	477,011	1,238,379	17,202,197	56,158,942	2,410,344	78,721,440	6,925,598	21,524,485	1,744,043	8,539,825	175,262	193,440
归属于份额持有人的资产净值	8,106,699	9,642,294	518,724,734	1,079,596,512	178,931,872	280,669,311	301,337,746	407,733,417	105,492,085	218,348,938	3,751,603	6,587,074

载于第26至185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)

2022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	
	2022年 港元	2021年 港元	2022年 美元	2021年 美元	2022年 美元	2021年 美元	2022年 美元	2021年 美元	2022年 美元	2021年 美元	2022年 美元	2021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	62,437,940	123,422,091	7,516,652	14,215,299	26,771,928	54,654,849	15,762,093	26,338,311	120,560,632	221,440,689	15,849,462	35,590,043
应收股息	846,000	9,966,760	208,916	1,544,569	593,652	11,276,604	821,508	3,526,411	963,541	15,783,947	-	2,493,612
应收利息	376,385	555,953	22,252	21,423	-	-	-	-	37,024	-	-	-
应收认购款项	-	-	-	-	6,533	4,819	-	-	-	-	-	-
其他应收款项	-	-	-	60,089	2,546	-	-	-	1,255	301,915	-	393,543
现金及现金等价物	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
总资产	2,454,012	3,321,241	1,275,074	180,158	23,029,082	35,123,400	351,489	1,681,838	8,120,496	4,259,100	816,186	2,198,287
	66,114,337	137,266,045	9,022,894	16,021,538	50,403,741	101,061,672	16,935,090	31,546,560	129,682,948	241,787,651	16,665,648	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												
应付经纪人款项	-	216,469	3,781	38,423	-	132,900	16,684	125,920	58,780	362,234	12,963	109,702
应付收益分配	2,435	10,156,163	128,036	1,561,038	593,308	6,773,761	645,600	2,659,774	1,846,732	11,636,124	194,131	2,896,088
应付管理费	148,701	306,937	26,139	44,793	-	-	53,442	95,206	400,145	668,092	63,851	147,250
应付受托人费用	67,454	130,815	8,871	15,264	7,439	18,597	13,392	23,897	98,361	170,051	14,764	31,111
应付费用及其他应付款项	20,000	20,000	2,500	2,500	3,105	5,826	2,500	2,987	12,452	21,123	2,500	3,897
应付赎回款项	192,096	186,819	24,994	24,991	24,398	23,776	44,859	44,707	24,835	57,895	87,223	86,520
计息银行借款	28,719	212,359	-	-	-	57,027	-	114,021	104,970	5,157,625	9,057	1,931,397
	-	-	-	-	-	2,512,293	-	-	-	-	-	-
负债 (不包括归属于份额持有人的资产净值)	459,405	11,229,562	194,321	1,687,009	628,250	9,524,180	776,477	3,066,512	2,546,275	18,073,144	384,489	5,205,965
归属于份额持有人的资产净值	65,654,932	126,036,483	8,828,573	14,334,529	49,775,491	91,537,492	16,158,613	28,480,048	127,136,673	223,714,507	16,281,159	35,469,520

载于第26至185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)
2022年6月30日

	附注	中银香港全天候 ESG多元资产基金 2022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	6,7	26,064,558
应收股息	8	198,900
应收利息		49,588
应收认购款项		—
其他应收款项		—
现金及现金等价物	14	2,042,808
总资产		28,355,854
负债		
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债	6,7	35,138
应付经纪人款项	8	398,898
应付收益分配	17	71,430
应付管理费	4(a)	31,643
应付受托人费用	4(b)	3,028
应计费用及其他应付款项		24,750
应付赎回款项		—
负债 (不包括归属于份额持有人的资产净值)		564,887
归属于份额持有人的资产净值		27,790,967
受托人		基金管理人

载于第26至185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2022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	
		2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年
		美元	美元	人民币	人民币	港元	港元	人民币	人民币	美元	美元	美元	美元
收益													
股息收入		131,004	47,819	467,976	386,822	4,981,284	3,767,325	3,289,490	3,960,792	60,664	2	139,687	166,283
银行存款利息收入		19	9	1,731	3,316	8,781	2,876	28,213	16,871	127	857	26	19
其他收入		16	-	51,014	79,598	-	-	-	-	14,256	4,425	-	-
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)	6	(2,354,486)	1,403,093	(383,253,606)	(79,269,282)	(67,198,590)	62,226,875	(53,002,935)	74,583,691	(32,427,736)	13,817,508	(2,181,592)	1,843,033
汇兑净利得/(净损失)		(5,739)	(1,208)	(2,776,530)	153,710,567	(343,067)	227,660	(140,610)	147,157	(19,220)	(12,154)	(5,192)	(2,571)
总收入/(亏损)		(2,229,186)	1,449,713	(385,509,415)	74,911,021	(62,551,592)	66,224,736	(49,544,623)	78,708,511	(32,371,909)	13,810,638	(2,047,071)	2,006,764
费用													
管理费	4(a)	80,027	76,950	7,475,548	12,437,690	2,223,323	2,516,705	5,670,369	5,502,081	1,186,841	1,755,756	42,840	51,029
受托人费用	4(b)	30,000	30,000	934,112	1,450,874	292,547	327,335	426,826	402,577	175,692	237,963	30,000	30,000
次保管人费用		17,408	11,167	168,174	230,825	288,545	157,038	342,081	274,740	36,162	53,121	9,953	11,748
审计师酬金		23,400	24,400	151,079	161,356	255,983	247,423	151,240	241,417	22,500	24,400	23,400	24,400
佣金及交易成本	16	35,152	41,143	20,160	51,300	14,076,899	6,097,334	3,963,587	2,683,371	7,711	15,173	112,191	63,291
法律及专业服务费用		253	455	19,241	65,635	6,383	53,880	9,272	53,560	3,968	27,666	143	15,928
其他费用		13,641	10,735	230,725	189,733	153,970	118,405	147,492	104,902	34,974	24,618	13,095	11,766
营业费用总额		199,881	194,850	8,999,039	14,587,413	17,297,650	9,518,120	10,710,867	9,262,648	1,467,848	2,138,697	231,622	208,162
经营利润/(亏损)		(2,429,067)	1,254,863	(394,508,454)	60,323,608	(79,849,242)	56,706,616	(60,255,490)	69,445,863	(33,839,757)	11,671,941	(2,278,693)	1,798,602
财务费用													
向份额持有人作出收益分配		-	-	(29,092,094)	(49,545,119)	-	-	-	-	(4,637,706)	(7,113,119)	-	-
税前利润/(亏损)		(2,429,067)	1,254,863	(423,600,548)	10,778,489	(79,849,242)	56,706,616	(60,255,490)	69,445,863	(38,477,463)	4,558,822	(2,278,693)	1,798,602
预扣税	5	(19,829)	(7,353)	-	-	(255,905)	(191,919)	(272,441)	(361,580)	-	(10,776)	(13,267)	(18,125)
归属于份额持有人的资产净值变动		(2,448,896)	1,247,510	(423,600,548)	10,778,489	(80,105,147)	56,514,697	(60,527,931)	69,084,283	(38,477,463)	4,548,046	(2,291,960)	1,780,477

载于第26至185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2022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	
	2022年 港元	2021年 港元	2022年 美元	2021年 美元	2022年 美元	2021年 美元	2022年 美元	2021年 美元	2022年 美元	2021年 美元	2022年 美元	2021年 美元
收益												
股息收入	1,207,944	2,590,291	281,771	243,670	-	19	20,555	16,800	186,669	4	9,502	-
银行存款利息收入	694	324	201	83	126,317	527,719	66	352	185	1,076	72	272
其他收入	-	4,322	11,125	-	240	18,512	1,024	558	37,702	3,476	41	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)	(27,152,987)	7,581,717	(3,251,800)	2,363,133	363,216	10,522,828	(4,329,998)	2,694,330	(33,147,452)	8,595,027	(12,440,365)	3,218,777
汇兑净利得/(净损失)	(46,658)	(28,706)	(12,652)	6,172	(5,595)	(1,003,304)	754	30,219	(9,326)	(42,386)	17,728	1,851
总收入/(亏损)	(25,991,007)	10,147,948	(2,971,355)	2,613,058	484,178	10,063,774	(4,307,599)	2,742,259	(32,932,222)	8,557,197	(12,413,022)	3,223,150
费用												
管理费	1,133,183	1,796,111	137,423	201,050	117,270	444,941	215,396	275,848	1,577,160	2,018,795	262,887	347,853
受托人费用	240,000	240,000	30,000	30,000	42,119	184,014	30,872	34,519	196,078	251,230	34,138	43,562
次保管人费用	145,830	136,585	27,977	18,645	10,917	34,169	15,818	19,646	41,232	52,300	10,304	17,449
审计师酬金	182,625	189,245	23,400	24,400	23,400	24,400	23,400	24,400	23,400	24,350	23,960	23,100
佣金及交易成本	959,227	790,286	245,311	147,601	2,954	7,455	17,362	11,757	35,877	13,758	2,184	6,833
开办费用	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	80,000
法律及专业服务费用	2,300	6,597	273	11,595	1,159	8,613	585	1,641	4,567	11,483	653	1,465
其他费用	122,023	80,755	15,551	11,913	23,288	28,374	14,178	10,923	44,896	35,803	19,736	14,079
营业费用总额	2,785,188	3,239,579	479,935	445,204	221,107	731,966	317,611	378,734	1,923,210	2,407,719	353,862	534,341
经营利润/(亏损)	(28,776,195)	6,908,369	(3,451,290)	2,167,854	263,071	9,331,808	(4,625,210)	2,363,525	(34,855,432)	6,149,478	(12,766,884)	2,688,809
财务费用												
向份额持有人作出收益分配	(2,540,328)	(4,147,192)	(401,024)	(608,724)	-	-	(857,397)	(1,087,203)	(6,257,388)	(7,965,629)	(1,244,590)	(1,379,689)
税前利润/(亏损)	(31,316,523)	2,761,177	(3,852,314)	1,559,130	263,071	9,331,808	(5,482,607)	1,276,322	(41,112,820)	(1,816,151)	(14,011,474)	1,309,120
预扣税	(55,256)	(98,366)	(57,846)	(35,998)	-	-	(896)	(8,746)	(7,042)	-	-	-
归属于份额持有人的资产净值变动	(31,371,779)	2,662,811	(3,910,160)	1,523,132	263,071	9,331,808	(5,483,503)	1,267,576	(41,119,862)	(1,816,151)	(14,011,474)	1,309,120

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26至185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2022年6月30日止年度／期间

	附注	中银香港全天候 ESG多元资产基金 2022年 ² 美元
收益		
股息收入		255,716
银行存款利息收入		110
其他收入		10
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)	6	(7,696,831)
汇兑净利得／(净损失)		32,343
总收入／(亏损)		(7,408,652)
费用		
管理费	4(a)	427,737
受托人费用	4(b)	42,049
次保管人费用		21,063
审计师酬金		24,000
佣金及交易成本	16	106,456
开办费用		62,223
法律及专业服务费用		—
其他费用		7,997
营业费用总额		691,525
经营利润／(亏损)		(8,100,177)
财务费用		
向份额持有人作出收益分配		(831,359)
税前利润／(亏损)		(8,931,536)
预扣税	5	(44,448)
归属于份额持有人的资产净值变动		(8,975,984)

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。

² 自2021年7月29日(开始营运日期)至2022年6月30日止期间。

载于第26至185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2022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
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	46,711,270	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	39,729,949	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	91,311.8050	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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
– X3类份额	-	-	-	-	-	-	1,074,498.5670	12,477,626	-	-	-	-
	2,361,773.2380	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	120,293,639	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)	(32,559,234)	(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)	(34,455,841)	(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)	(152,028.8910)	(300,580)
– A8类份额	-	-	(1,024,732.6630)	(62,401,657)	-	-	-	-	-	-	-	-
– A9类份额	-	-	-	-	-	-	(4,629,498.8680)	(45,522,088)	-	-	-	-
– X1类份额	-	-	(4,486,251.8080)	(62,000,000)	(1,596,406.1860)	(19,313,084)	-	-	-	-	(50,000.0000)	(713,500)
– X2类份额	-	-	-	-	(93,896.7130)	(9,618,276)	-	-	-	-	(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)	(1,823,396.6030)	(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日及

2021年7月1日的余额	4,911,783.8400	9,642,294	89,072,906.4850	1,079,596,512	16,125,246.1660	280,669,311	28,094,969.8820	407,733,417	82,057,933.9010	218,348,938	2,908,530.7620	6,587,074
--------------	----------------	-----------	-----------------	---------------	-----------------	-------------	-----------------	-------------	-----------------	-------------	----------------	-----------

载于第26至185页的附注为本财务报表的组成部分。

归属于份额持有人的资产净值变动表(续)

载于第26至185页的附注为本财务报表的组成部分。

归属于份额持有人的资产净值变动表(续)

– 14 –

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2022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	港元	份额数	美元	份额数	美元	份额数	美元	份额数	美元	份额数	美元
于2021年6月30日及 2021年7月1日的余额	-	2,662,811	-	1,523,132	-	9,331,808	-	1,267,576	-	(1,816,151)	-	1,309,120
	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	19,984,536,5520	35,469,520

载于第26至185页的附注为本财务报表的组成部分。

归属于份额持有人的资产净值变动表(续)

载于第26至185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2022年6月30日止年度／期间

	中银香港全天候 ESG多元资产基金	美元
	份额数目	
于2021年7月29日 (开始营运日期) 的余额		
认购份额		
– A1类份额	733,047.6200	7,307,962
– A2类份额	11,067,645.0730	14,191,225
– A3类份额	–	–
– A4类份额	399,373.8500	2,944,112
– A7类份额	99,290.2410	1,369,265
– A8类份额	–	–
– A9类份额	4,517,167.8030	6,886,294
– A10类份额	43,321.4290	512,701
– I1类份额	499,998.0000	4,999,980
– I2类份额	–	–
– X1类份额	–	–
– X2类份额	3,880,000.0000	4,992,408
– X3类份额	–	–
	21,239,844.0160	43,203,947
赎回份额		
– A1类份额	(33,603.6320)	(289,350)
– A2类份额	(1,622,844.2410)	(1,832,483)
– A3类份额	–	–
– A4类份额	(82,509.7420)	(493,543)
– A7类份额	(7,623.7210)	(86,660)
– A8类份额	–	–
– A9类份额	(760,070.9610)	(1,048,608)
– A10类份额	(702.1620)	(5,760)
– X1类份额	–	–
– X2类份额	(2,466,472.4630)	(2,680,592)
	(4,973,826.9220)	(6,436,996)
归属于份额持有人的资产净值增加／(减少)	–	(8,975,984)
于2022年6月30日的余额	16,266,017.0940	27,790,967

1 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26至185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2022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	
	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年
已发行份额数目												
- A1类份额	130,664,8880	140,355,1410	27,668,476,4600	34,035,054,3040	13,018,692,6680	11,933,549,7060	2,744,744,5820	3,598,836,3130	3,690,716,2070	7,397,785,5600	37,708,1180	38,144,2570
- A2类份额	3,784,545,8340	3,079,291,3850	772,651,3220	659,201,3530	228,682,0350	222,056,1090	814,706,4060	996,897,9260	30,735,223,3710	44,913,587,6440	1,256,578,4480	1,288,163,2310
- A3类份额	983,4770	983,4770	32,061,579,2160	34,451,769,7120	52,969,3980	19,343,5580	15,957,728,1240	18,097,520,2160	-	-	-	-
- A4类份额	-	-	431,106,1500	485,614,8720	-	-	-	-	-	-	-	-
- A7类份额	-	-	-	-	371,332,5610	216,309,9860	-	-	17,707,387,1330	26,167,586,9540	95,317,7390	131,058,1250
- A8类份额	-	-	1,854,554,5420	2,732,601,0620	-	-	-	-	-	-	-	-
- A9类份额	-	-	-	-	-	-	4,421,443,3980	4,073,784,0980	-	-	-	-
- I1类份额	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	97,560,9750
- I2类份额	-	-	-	-	105,542,4270	500,409,1590	253,432,7620	253,432,7620	-	-	-	-
- X1类份额	-	-	12,378,103,3610	16,708,665,1820	1,219,772,4190	3,233,577,6480	-	-	2,670,707,1540	3,548,973,7430	-	-
- X2类份额	1,691,153,8370	1,691,153,8370	-	-	151,515,1510	-	-	-	-	-	1,775,172,8010	1,353,604,1740
- X3类份额	-	-	-	-	-	-	491,034,9970	1,074,498,5670	-	-	-	-
	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	
	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年
已发行份额数目												
- A1类份额	6,668,894,6280	8,632,530,8210	171,025,6240	237,666,0200	963,097,6850	2,297,864,6740	529,531,4360	663,295,2930	2,621,867,3210	3,539,250,9340	580,572,1090	792,238,3330
- A2类份额	158,287,3640	213,156,2870	5,487,311,8560	6,468,987,3670	14,628,045,4000	19,056,987,2470	5,786,079,0300	7,505,137,9460	57,859,545,0280	77,525,839,5920	8,674,501,6100	11,908,489,5930
- A3类份额	-	-	-	-	145,306,8330	100,568,1040	-	-	17,567,953,9160	20,407,402,5020	-	-
- A4类份额	-	-	94,382,5800	95,555,2230	-	-	-	-	3,868,103,3240	4,775,512,1570	90,547,5340	106,933,4750
- A7类份额	-	-	-	-	-	-	4,599,251,3280	6,856,497,7310	-	-	35,664,6110	39,458,8680
- A8类份额	1,110,268,7350	2,082,637,9310	1,022,067,7670	1,069,935,2630	-	-	-	-	-	-	-	-
- A9类份额	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	2,288,391,6630	2,945,757,3970
- A10类份额	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	33,814,1210	34,498,7120
- A11类份额	-	-	-	-	-	-	-	-	17,013,271,3340	21,297,889,4570	-	-
- C1类份额	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
- I1类份额	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
- I6类份额	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
- X1类份额	1,814,728,3930	2,668,213,4570	132,095,0000	199,004,9750	1,169,678,3860	1,175,509,9630	-	-	1,022,423,6910	2,027,520,0120	-	-
- X2类份额	-	-	761,035,0070	-	5,942,583,9170	4,243,473,5930	-	-	-	-	4,157,160,1640	4,157,160,1640

载于第26至185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2022年6月30日止年度／期间

	中银香港全天候 ESG多元资产基金
	2022年
已发行份额数目	
- A1类份额	699,443,9880
- A2类份额	9,444,800.8320
- A4类份额	316,864.1080
- A7类份额	91,666.5200
- A9类份额	3,757,096.8420
- A10类份额	42,619.2670
- I1类份额	499,998.0000
- X2类份额	1,413,527.5370

载于第26至185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2022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	
	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年
	美元	美元	人民币	人民币	港元	港元	人民币	人民币	美元	美元	美元	美元
经营活动产生的现金流量												
税前利润/(亏损)	(2,429,067)	1,254,863	(423,600,548)	10,778,489	(79,849,242)	56,706,616	(60,255,490)	69,445,863	(38,477,463)	4,558,822	(2,278,693)	1,798,602
调整：												
银行存款利息收入	(19)	(9)	(1,731)	(3,316)	(8,781)	(2,876)	(28,213)	(16,871)	(127)	(857)	(26)	(19)
股息收入	(131,004)	(47,819)	(467,976)	(386,822)	(4,981,284)	(3,767,325)	(3,289,490)	(3,960,792)	(60,664)	(2)	(139,687)	(166,283)
向份额持有人作出收益分配	-	-	29,092,094	49,545,119	-	-	-	-	4,637,706	7,113,119	-	-
出售以公允价值计量的金融工具所得款项												
当期损益的金融工具	28,064,405	28,029,024	849,712,007	1,617,631,783	2,446,530,864	1,192,644,713	1,186,722,528	737,598,970	164,366,659	272,617,340	23,480,507	13,775,022
购买以公允价值计量的金融工具	(28,802,097)	(29,382,933)	(636,457,787)	(1,397,571,215)	(2,441,763,414)	(1,155,235,382)	(1,134,430,535)	(797,234,435)	(76,375,542)	(312,012,279)	(22,908,950)	(11,810,147)
以公允价值计量的未实现利得/损失变动净额	6	2,013,598	(313,662)	101,366,618	68,985,604	(17,176,720)	21,047,639	68,964,877	16,192,556	(1,420,001)	1,115,241	(595,704)
以公允价值计量的已变动计入当期损益的金融工具	6	340,888	(1,089,431)	281,886,988	10,283,678	(45,050,155)	31,955,296	(143,548,568)	16,235,180	(12,397,507)	1,066,351	(1,247,329)
金融工具的已变现(利得)/损失净额									86,518,305	(41,541,365)	334,743	1,754,142
经营活动及负债变动：												
应收经纪人款项(增加)/减少	795,181	(994,081)	14,258,541	(14,261,351)	77,136,448	(79,042,948)	11,629,809	(14,211,012)	4,293,595	(4,461,581)	(36,510)	(132,065)
应收股息(增加)/减少	-	-	-	(49,937)	-	-	-	-	-	-	-	-
其他应收款项(增加)/减少	-	-	(53,110)	-	-	-	22,841	(23,007)	-	-	-	-
存款准备金(增加)/减少	-	-	-	-	-	-	(19,800)	(20,804)	-	-	-	-
应付经纪人款项增加/(减少)	(1,005,473)	1,204,995	(22,945,943)	11,887,481	(61,630,547)	63,040,108	(16,160,140)	18,711,487	(4,704,571)	3,368,661	(17,068)	117,962
应付管理费增加/(减少)	(549)	1,581	(428,494)	(355,393)	(74,065)	48,238	(138,450)	143,846	(80,354)	34,424	(2,442)	1,283
应付受托人费用增加/(减少)	(161)	(50,358)	(34,393)	(10,177)	7,252	(10,626)	12,589	(9,107)	3,219	949	(161)	-
应计费用及其他应付款项增加/(减少)	940	2,817	8,798	186	17,346	20,482	59,808	107,501	(811)	1,677	-	2,755
经营活动提供/(所用)的现金	(1,153,197)	(1,334,816)	192,319,099	356,449,913	2,565,738	12,192,003	37,105,177	(64,030,356)	86,017,057	(42,594,965)	279,672	1,743,916
已收利息	19	10	1,731	3,316	8,781	2,876	28,213	16,871	127	857	26	19
已收股息	142,680	33,812	555,769	661,550	4,572,886	4,650,679	2,752,473	3,761,946	60,664	4,518	148,071	177,957
已付税项	(19,829)	(7,353)	-	-	(255,905)	(191,919)	(272,441)	(361,580)	-	(10,776)	(13,267)	(18,048)
经营活动产生/(所用)的现金流量净额	(1,030,327)	(1,308,347)	192,876,599	357,114,779	6,891,500	16,653,639	39,613,422	(60,613,119)	86,077,848	(42,600,366)	414,502	1,903,844

载于第26至185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2022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	
	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年
	美元	美元	人民币	人民币	港元	港元	人民币	人民币	美元	美元	美元	美元
筹资活动产生的现金流量*												
发行份额所得的款项	2,308,175	3,732,689	89,260,576	158,631,861	66,908,506	91,174,690	81,065,267	308,183,683	4,350,515	120,126,675	1,186,769	2,043,506
赎回份额支付的款项	(1,146,569)	(2,798,240)	(231,866,675)	(498,739,166)	(103,071,727)	(62,813,410)	(124,702,192)	(238,011,923)	(80,378,409)	(77,125,705)	(1,714,172)	(4,051,407)
向份额持有人作出分配支付的款项	17	-	(28,028,748)	(45,896,021)	-	-	-	-	(4,534,583)	(6,311,896)	-	-
筹资活动产生 / (所用) 的现金流量净额	1,161,606	934,449	(170,634,847)	(386,003,326)	(36,163,221)	28,361,280	(43,636,925)	70,171,760	(80,562,477)	36,689,074	(527,403)	(2,007,901)
现金及现金等价物增加 / (减少) 净额	131,279	(373,898)	22,241,752	(28,888,547)	(29,271,721)	45,014,919	(4,023,503)	9,558,641	5,515,371	(5,911,292)	(112,901)	(104,057)
年初 / 期初现金及现金等价物	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
年末 / 期末现金及现金等价物	527,153	395,874	39,639,349	17,397,597	20,826,212	50,097,933	12,351,414	16,374,917	6,501,904	986,533	68,336	181,237
现金及现金等价物余额分析：												
银行现金	14	527,153	395,874	17,397,597	20,826,212	50,097,933	12,351,414	16,374,917	6,501,904	986,533	68,336	181,237
于存放时原到期日少于三个月的定期存款	14	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
		527,153	395,874	17,397,597	20,826,212	50,097,933	12,351,414	16,374,917	6,501,904	986,533	68,336	181,237

载于第26至185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2022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	
	2022年 港元	2021年 港元	2022年 美元	2021年 美元	2022年 美元	2021年 美元	2022年 美元	2021年 美元	2022年 美元	2021年 美元	2022年 美元	2021年 ¹ 美元
经营活动产生的现金流量												
税前利润／(亏损)	(31,316,523)	2,761,177	(3,852,314)	1,559,130	263,071	9,331,808	(5,482,607)	1,276,322	(41,112,820)	(1,816,151)	(14,011,474)	1,309,120
调整：												
银行存款利息收入	(694)	(324)	(201)	(83)	(126,317)	(527,719)	(66)	(352)	(185)	(1,076)	(72)	(272)
股息收入	(1,207,944)	(2,590,291)	(281,771)	(243,670)	-	(19)	(20,555)	(16,800)	(186,669)	(4)	(9,502)	-
向份额持有人作出收益分配	2,540,328	4,147,192	401,024	608,724	-	-	857,397	1,087,203	6,257,388	7,965,629	1,244,590	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	344,762,299	362,468,579	60,918,621	42,462,995	126,687,089	565,861,762	57,110,715	97,859,681	161,907,417	315,321,626	26,643,881	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	(311,147,604)	(356,228,559)	(57,506,416)	(42,382,085)	(98,573,852)	(433,142,658)	(50,973,733)	(99,438,163)	(94,478,264)	(343,484,211)	(19,440,404)	(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	4,056,602	(10,077,086)	2,731,156	(2,463,179)	646,272	(1,714,288)	1,697,108	(254,475)	12,549,331	545,372	5,443,153	(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	23,096,385	2,495,369	520,644	100,046	(1,009,488)	(8,808,540)	2,632,890	(2,439,855)	20,598,121	(9,140,399)	6,997,212	(2,740,150)
	<u>30,782,849</u>	<u>2,976,057</u>	<u>2,930,743</u>	<u>(358,122)</u>	<u>27,886,775</u>	<u>131,000,346</u>	<u>5,821,149</u>	<u>(1,926,439)</u>	<u>65,534,319</u>	<u>(30,609,214)</u>	<u>6,867,384</u>	<u>(32,791,804)</u>
经营资产及负债变动：												
应收经纪人款项(增加)／减少	9,120,760	(9,966,760)	1,335,653	(1,544,569)	10,682,952	(9,854,863)	2,704,903	(3,526,411)	14,822,406	(15,785,947)	2,493,612	(2,493,612)
其他应收款项(增加)／减少	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付经纪人款项增加／(减少)	(10,153,728)	7,063,326	(1,433,002)	1,561,038	(6,180,453)	2,372,219	(2,014,174)	2,659,774	(9,789,392)	9,336,304	(2,701,957)	2,896,088
应付管理费增加／(减少)	(63,361)	(37,847)	(6,393)	(1,127)	(11,158)	(44,346)	(10,505)	4,527	(71,690)	28,939	(16,347)	31,111
应付受托人费用增加／(减少)	-	(1,290)	-	(161)	(2,721)	(15,464)	(487)	326	(8,671)	2,698	(1,397)	3,897
应计费用及其他应付款项增加／(减少)	5,277	20,624	3	4,206	622	2,522	155	3,328	(33,062)	3,578	703	86,520
经营活动提供／(所用)的现金	<u>29,691,797</u>	<u>54,110</u>	<u>2,827,004</u>	<u>(338,735)</u>	<u>32,376,017</u>	<u>123,460,414</u>	<u>6,501,041</u>	<u>(2,784,895)</u>	<u>70,453,910</u>	<u>(37,023,642)</u>	<u>6,641,998</u>	<u>(32,267,800)</u>
已收利息	694	324	201	83	124,603	716,369	66	352	185	1,076	72	272
已收股息	1,387,512	2,743,327	280,942	259,341	-	36,928	20,555	27,577	149,645	7,154	9,502	-
已付税项	(55,256)	(98,366)	(57,846)	(37,944)	-	-	(896)	(8,746)	(7,042)	-	-	-
经营活动产生／(所用)的现金流量净额	<u>31,024,747</u>	<u>2,699,395</u>	<u>3,050,301</u>	<u>(117,255)</u>	<u>32,500,620</u>	<u>124,213,711</u>	<u>6,520,766</u>	<u>(2,765,712)</u>	<u>70,596,698</u>	<u>(37,015,412)</u>	<u>6,651,572</u>	<u>(32,267,528)</u>

载于第26至185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2022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	
	2022年 港元	2021年 港元	2022年 美元	2021年 美元	2022年 美元	2021年 美元	2022年 美元	2021年 美元	2022年 美元	2021年 美元	2022年 美元	2021年 ¹ 美元
筹资活动产生的现金流量*												
发行份额所得的款项	4,100,874	31,133,719	1,694,314	7,113,354	21,109,090	199,840,389	603,486	14,108,125	6,833,716	141,004,387	3,038,286	53,081,133
赎回份额支付的款项	(33,716,675)	(36,004,370)	(3,250,435)	(6,917,497)	(63,193,735)	(430,034,337)	(7,637,554)	(9,699,419)	(67,986,977)	(99,474,272)	(9,806,372)	(17,450,186)
向份额持有人作出分配支付的款项	(2,276,175)	(3,606,252)	(399,264)	(569,931)	-	-	(817,047)	(969,630)	(5,582,041)	(6,279,463)	(1,265,587)	(1,165,132)
	(31,891,976)	(8,476,903)	(1,955,385)	(374,074)	(42,084,645)	(230,193,948)	(7,851,115)	3,439,078	(66,735,302)	35,250,652	(8,033,673)	34,465,815
筹资活动产生／(所用)的现金流量净额												
现金及现金等价物增加／(减少) 净额	(867,229)	(5,777,508)	1,094,916	(491,329)	(9,584,025)	(105,980,237)	(1,330,349)	673,366	3,861,396	(1,764,760)	(1,382,101)	2,198,287
年初／期初现金及现金等价物	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	-
	(2,454,012)	3,321,241	1,275,074	180,158	23,029,082	32,613,107	351,489	1,681,838	8,120,496	4,259,100	816,186	2,198,287
年末／期末现金及现金等价物												
现金及现金等价物余额分析：												
银行现金	2,454,012	3,321,241	1,275,074	180,158	2,984,793	414,770	351,489	1,681,838	8,120,496	4,259,100	816,186	2,198,287
于存放时原到期日少于三个月的定期存款	-	-	-	-	20,044,289	34,710,630	-	-	-	-	-	-
银行透支，无抵押	-	-	-	-	-	(2,512,293)	-	-	-	-	-	-
	2,454,012	3,321,241	1,275,074	180,158	23,029,082	32,613,107	351,489	1,681,838	8,120,496	4,259,100	816,186	2,198,287

载于第26至185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2022年6月30日止年度 / 期间

		中银香港全天候 ESG多元资产基金	
	附注	2022年 ² 美元	
经营活动产生的现金流量		(8,931,536)	
税前利润 / (亏损)		(110)	
调整：		(255,716)	
银行存款利息收入		831,359	
股息收入		89,478,530	
向份额持有人作出收益分配		(123,204,781)	
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		2,636,218	6
购买以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具		5,060,613	6
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		(34,385,423)	
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		(198,900)	
经营资产及负债变动：		—	
应收经纪人款项 (增加) / 减少		398,898	
其他应收款项 (增加) / 减少		31,643	
应付经纪人款项增加 / (减少)		3,028	
应付管理费增加 / (减少)		24,750	
应付受托人费用增加 / (减少)		(34,126,004)	
应计费用及其他应付款项增加 / (减少)		110	
经营活动提供 / (所用) 的现金		206,128	
已收利息		(44,448)	
已收股息			
已付税项			
经营活动产生 / (所用) 的现金流量净额		(33,964,214)	

载于第26至185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2022年6月30日止年度／期间

	附注	中银香港全天候 ESG多元资产基金 2022年 ² 美元
筹资活动产生的现金流量*		
发行份额所得的款项		43,088,696
赎回份额支付的款项		(6,436,996)
向份额持有人作出分配支付的款项	17	(644,678)
筹资活动产生／(所用)的现金流量净额		36,007,022
现金及现金等价物增加／(减少) 净额		2,042,808
年初／期初现金及现金等价物		—
年末／期末现金及现金等价物		2,042,808
现金及现金等价物余额分析：		
银行现金	14	2,042,808
于存放时原到期日少于三个月的定期存款	14	—
银行透支，无抵押	15	—
		2,042,808

* 股息人民币5,983,436元(2021年：人民币7,973,631元)、392,063美元(2021年：570,194美元)、403,220港元(2021年：604,914港元)、19,717美元(2021年：42,300美元)、76,235美元(2021年：104,741美元)、892,689美元(2021年：1,537,316美元)、56,254美元(2021年：79,655美元)及125,953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、中银香港全天候亚洲高息债券基金及中银香港全天候ESG多元资产基金。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2020年6月29日(开始营运日期)至2021年6月30日止期间。

² 自2021年7月29日(开始营运日期)至2022年6月30日止期间。

载于第26至185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

2022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2022年6月30日,有十三个(2021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)

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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(日本除外) 股票基金	2017年4月24日 2017年4月24日 2017年4月24日 2017年4月25日 2019年5月23日 2019年10月17日	A1类(美元) A2类(港元) A7类(人民币) X2类(港元) X1类(美元) I1类(美元)
中银香港全天候 中国收益基金	2017年9月8日 2017年9月8日 2017年9月8日 2021年1月15日	A1类(港元) A2类(美元) A8类(人民币) X1类(港元)
中银香港全天候 亚太高收益基金	2018年3月23日 2018年3月23日 2018年3月23日 2018年3月23日 2021年1月15日 2022年3月17日	A1类(美元) A2类(港元) A4类(澳元) A8类(人民币) X1类(美元) X2类(美元)
中银香港全天候 短期债券基金	2018年10月3日 2018年10月3日 2018年10月3日 2018年9月13日 2018年9月13日 2018年9月20日 2020年1月2日 2020年3月30日	A1类(美元) A2类(港元) A3类(人民币) I1类(美元) X1类(美元) X2类(港元) C1类(美元) 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 2019年3月14日 2019年3月14日	A1类(美元) A2类(港元) A8类(人民币)
中银香港全天候 大湾区策略基金	2019年4月8日 2019年4月8日 2019年4月8日 2019年4月8日 2019年4月8日 2019年4月8日 2020年5月5日	A1类(美元) A2类(港元) A3类(澳门元) A4类(人民币) I1类(美元) A11类(人民币) X1类(美元)

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022年6月30日

1 基金及子基金(续)

子基金	开始营运日期	已发行份额类别 (发行货币)
中银香港全天候	2020年6月29日	A1类(美元)
亚洲高息债券基金	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)
中银香港全天候	2021年7月29日	A1类(美元)
ESG多元资产基金	2021年7月29日	A2类(港元)
	2021年7月29日	A4类(澳元)
	2021年7月29日	A7类(英镑)
	2021年7月29日	A9类(人民币)
	2021年7月29日	A10类(欧元)
	2021年7月30日	I1类(美元)
	2021年7月29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。

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。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022年6月30日

2 重要会计政策摘要(续)

(a) 编制基础(续)

与子基金相关并于本年度或期间生效的准则及现有准则的修订。

截至子基金的财务报表刊发日期，会计政策及披露并无出现基金管理人认为会明显影响子基金的变动。

与子基金相关并于本年度或期间生效而未有提早采纳的新准则、修订及诠释

子基金并无在本财务报表内应用已颁布但尚未就截至2022年6月30日止会计年度或期间生效的任何新订或经订香港财务报告准则。在这些香港财务报告准则中，基金管理人认为以下准则生效时预期会与子基金的财务报表相关：

香港会计准则第1号及香港财务报告准则实务公告第2号(修订本)
香港会计准则第8号(修订本)

会计政策的披露¹

会计估计的定义¹

¹ 于2023年1月1日或之后开始的年度期间生效

香港会计准则第1号(修订本)会计政策披露要求实体披露其重大会计政策信息(而非其重大会计政策)。如果会计政策信息与实体财务报表所载的其他信息一并考虑时，可能合理预期影响一般用途财务报表的主要使用者基于这些财务报表作出的决定，则有关信息属重大。香港财务报告准则实务公告第2号(修订本)就如何将重要性概念应用于会计政策披露提供非强制性指引。香港会计准则第1号(修订本)于2023年1月1日或之后开始的年度期间生效，并允许提早应用。由于香港财务报告准则实务公告第2号(修订本)所提供的指引为非强制性，因此这些修订的生效日期并非必要。基金管理人目前正在评估这些修订对子基金会计政策披露的影响。

香港会计准则第8号(修订本)澄清会计估计变更与会计政策变更之间的区别。会计估计定义为财务报表中受计量不确定性影响的货币金额。这些修订亦澄清实体如何使用计量技术及输入数据作出会计估计。这些修订于2023年1月1日或之后开始的年度报告期间生效，并适用于该期间开始时或之后发生的会计政策变动及会计估计变动。允许提早应用。这些修订预期不会对子基金的财务报表产生任何重大影响。

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) 属衍生工具(属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业务模式
- 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、其他应收款项、存款准备金及现金及现金等价物)包括在此类别。

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、计息银行借款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“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届满;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

开支按应计基准于损益内确认。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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,以及大多数费用及开支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、中银香港全天候亚洲高息债券基金及中银香港全天候ESG多元资产基金使用的美元(“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。

2 重要会计政策摘要(续)

(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。

(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。

2 重要会计政策摘要(续)

(I) 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；

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。

2 重要会计政策摘要(续)

(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。

(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及现金流量表内将预扣税与投资收入总额分开列报。

(p) 结构性实体

结构性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。结构性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性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)。

子基金将所有在其他基金中的投资(“被投资基金”)视为在未合并结构性实体中的投资。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(g)。

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，基金管理人会对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2022年6月30日及2021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

2022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的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2022年及2021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	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ¹	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	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ²	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ¹	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 ¹	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ²	不适用 ¹	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 ¹	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 ¹	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ²	不适用 ¹	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 ¹	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ²	不适用 ¹	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 ¹	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 ¹	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ¹

中银香港盈荟系列

财务报表附注 2022年6月30日

4 费用(续)

(a) 管理费(续)

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
中银香港全天候短期债券基金	0.300%	0.300%	0.300%	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ¹	0.300%	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ¹	0.200%	不适用 ¹	不适用 ¹
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 ¹	不适用 ¹	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 ¹	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 ¹	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ESG多元资产基金	1.500%	1.500%	不适用 ¹	1.500%	1.500%	不适用 ¹	1.500%	1.500%	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ¹	不适用 ²	不适用 ¹	1.050%	不适用 ¹	不适用 ¹

1 该等份额类别并无于2022年及2021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。

诚如附注12(h)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)。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022年6月30日

4 费用(续)

(b) 受托人费用(续)

受托人有权就各子基金收取下列受托人费用。截至2022年及2021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%；

中银香港盈荟系列

财务报表附注 2022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>
	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。
中银香港全天候 ESG多元资产基金	各类子基金资产净值的0.125%； 受最低月费2,500美元所限。

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”)、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。

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)

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。

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。根据财税[2021]34号(“34号通知”),该暂免已延长至2025年12月31日。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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	
	2022年 美元	2021年 美元	2022年 人民币	2021年 人民币	2022年 港元	2021年 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	1,167,634	1,581,808	15,985,894	18,231,882	-	-
衍生工具(附注7)	-	-	142,023	2,224,146	33,220	-
上市权益性证券	3,204,759	4,816,037	-	-	157,868,723	229,920,314
存托凭证	396,618	120,160	-	-	-	-
挂牌债务证券	3,085,395	2,953,494	479,938,523	1,083,341,131	-	-
以公允价值计量且其 变动计入当期损益的 金融资产总额	7,854,406	9,471,499	496,066,440	1,103,797,159	157,901,943	229,920,314
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)	81	380	1,558,151	12,781,044	29,025	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	81	380	1,558,151	12,781,044	29,025	81,356
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	(340,800)	1,089,431	(281,886,988)	(10,283,678)	(60,879,192)	45,050,155
未变现	(2,013,598)	313,662	(101,366,618)	(68,985,604)	(6,319,398)	17,176,720
净利得/(净损失)	(2,354,486)	1,403,093	(383,253,606)	(79,269,282)	(67,198,590)	62,226,875

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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	
	2022年 人民币	2021年 人民币	2022年 美元	2021年 美元	2022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	-	-	2,658,143	2,602,774	-	608,055
衍生工具(附注7)	-	379,684	-	-	1,211	-
上市权益性证券	291,618,528	396,147,398	-	-	3,429,967	5,019,680
存托凭证	-	-	-	-	234,010	793,641
挂牌债务证券	-	-	97,112,540	217,986,432	-	-
以公允价值计量且其 变动计入当期损益的 金融资产总额	291,618,528	396,527,082	99,770,683	220,589,206	3,665,188	6,421,376
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)	386,374	-	62,766	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	386,374	-	62,766	472,185	-	3,039
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	(31,955,296)	143,548,568	(16,235,180)	12,397,507	(1,066,351)	1,247,329
未变现	(21,047,639)	(68,964,877)	(16,192,556)	1,420,001	(1,115,241)	595,704
净利得/(净损失)	(53,002,935)	74,583,691	(32,427,736)	13,817,508	(2,181,592)	1,843,033

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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	
	2022年 港元	2021年 港元	2022年 美元	2021年 美元	2022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	1,633,555	5,801,439	282,603	2,106,624	-	-
衍生工具(附注7)	63,724	-	10,348	-	20,958	37,928
上市权益性证券	37,223,419	92,051,647	6,041,552	8,878,280	-	-
存托凭证	-	2,321,299	-	573,604	-	-
挂牌债务证券	23,517,242	23,247,706	1,182,149	2,656,791	26,750,970	54,616,921
以公允价值计量且其 变动计入当期损益的 金融资产总额	62,437,940	123,422,091	7,516,652	14,215,299	26,771,928	54,654,849
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	3,781	38,423	-	132,900
以公允价值计量且其 变动计入当期损益的 金融负债总额	-	216,469	3,781	38,423	-	132,900
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	(23,096,385)	(2,495,369)	(520,644)	(100,046)	(646,272)	8,808,540
未变现	(4,056,602)	10,077,086	(2,731,156)	2,463,179	1,009,488	1,714,288
净利得/(净损失)	(27,152,987)	7,581,717	(3,251,800)	2,363,133	363,216	10,522,828

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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	
	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年
	美元	美元	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	304,245	1,111,436	2,998,890	2,696,850	416,336	407,663
衍生工具(附注7)	-	-	-	-	-	-
上市权益性证券	1,401,379	1,961,015	9,570,420	-	-	-
存托凭证	-	-	-	-	-	-
挂牌债务证券	14,056,469	23,265,860	107,991,322	218,743,839	15,433,126	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	15,762,093	26,338,311	120,560,632	221,440,689	15,849,462	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)	16,684	125,920	58,780	362,234	12,963	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	16,684	125,920	58,780	362,234	12,963	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	(2,632,890)	2,439,855	(20,598,121)	9,140,399	(6,997,212)	2,740,150
未变现	(1,697,108)	254,475	(12,549,331)	(545,372)	(5,443,153)	478,627
净利得/(净损失)	(4,329,998)	2,694,330	(33,147,452)	8,595,027	(12,440,365)	3,218,777

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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 ESG多元资产基金 2022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	
上市权益性证券	11,643,250
存托凭证	408,750
挂牌债务证券	14,012,558
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产总额	26,064,558
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)	35,138
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债总额	35,138
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	(5,060,613)
未变现	(2,636,218)
净利得	(7,696,831)

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	
	2022年 美元	2021年 美元	2022年 人民币	2021年 人民币	2022年 港元	2021年 港元
金融资产						
外汇远期合约	—	—	142,023	2,224,146	33,220	—
金融负债						
外汇远期合约	81	380	1,558,151	12,781,044	29,025	81,356

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2022年6月30日

7 衍生金融工具(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	
	2022年 人民币	2021年 人民币	2022年 美元	2021年 美元	2022年 美元	2021年 美元
金融资产						
外汇远期合约	-	379,684	-	-	1,211	-
金融负债						
外汇远期合约	386,374	-	62,766	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	
	2022年 港元	2021年 港元	2022年 美元	2021年 美元	2022年 美元	2021年 美元
金融资产						
外汇远期合约	63,724	-	10,348	-	20,958	37,928
金融负债						
外汇远期合约	-	216,469	3,781	38,423	-	132,900
	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	
	2022年 美元	2021年 美元	2022年 美元	2021年 美元	2022年 美元	2021年 美元
金融资产						
外汇远期合约	-	-	-	-	-	-
金融负债						
外汇远期合约	16,684	125,920	58,780	362,234	12,963	109,702

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2022年6月30日

7 衍生金融工具(续)

	中银香港全天候 ESG多元资产基金 2022年 美元
金融资产	
外汇远期合约	—
金融负债	
外汇远期合约	35,138
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

	名义金额	公允价值 资产 美元	负债 美元
2022年6月30日			
购入澳元	13,274澳元	—	81
2021年6月30日			
购入澳元	16,604澳元	—	380

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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
2022年6月30日			
购入美元	9,649,717美元	142,023	—
购入澳元	2,344,041澳元	—	50,591
卖出美元	79,271,281美元	—	1,507,560
		<u>142,023</u>	<u>1,558,151</u>
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>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2022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

	名义金额	公允价值	
		资产 港元	负债 港元
2022年6月30日			
购入人民币	人民币3,506,535元	33,190	—
购入人民币	人民币212,718元	30	—
购入人民币	人民币220,000元	—	360
购入澳元	28,000澳元	—	378
购入人民币	人民币176,309元	—	409
购入澳元	16,890澳元	—	2,542
购入澳元	21,660澳元	—	4,364
购入澳元	435,710澳元	—	20,972
		<u>33,220</u>	<u>29,025</u>
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>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2022年6月30日

7 衍生金融工具(续)

外汇远期合约(续)

中银香港全天候在岸人民币股票基金

	名义金额	公允价值 资产 人民币	负债 人民币
2022年6月30日			
购入港元	9,665,253港元	—	386,374
2021年6月30日			
购入港元	52,454,688港元	379,684	—

中银香港全天候亚洲债券基金

	名义金额	公允价值 资产 美元	负债 美元
2022年6月30日			
购入人民币	人民币150,010,720元	—	62,766
2021年6月30日			
购入人民币	人民币283,224,737元	—	472,185

中银香港全天候亚洲(日本除外)股票基金

	名义金额	公允价值 资产 美元	负债 美元
2022年6月30日			
购入人民币	人民币821,929元	1,211	—
2021年6月30日			
购入人民币	人民币1,693,039元	—	3,039

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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

	名义金额	公允价值	
		资产	负债
		港元	港元
2022年6月30日			
购入人民币	人民币6,240,180元	63,682	—
购入人民币	人民币287,907元	42	—
		<u>63,724</u>	<u>—</u>
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
		<u>—</u>	<u>216,469</u>

中银香港全天候亚太高收益基金

	名义金额	公允价值	
		资产	负债
		美元	美元
2022年6月30日			
购入人民币	人民币7,022,389元	10,348	—
购入澳元	577,256澳元	—	3,781
		<u>10,348</u>	<u>3,781</u>
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
		<u>—</u>	<u>38,423</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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
2022年6月30日			
卖出人民币	人民币4,000,000元	20,958	—
		<u>20,958</u>	<u>—</u>
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
		<u>37,928</u>	<u>132,900</u>

中银香港全天候一带一路债券基金

	名义金额	公允价值 资产 美元	负债 美元
2022年6月30日			
购入人民币	人民币39,236,883元	—	16,684
		<u>—</u>	<u>16,684</u>
2021年6月30日			
购入人民币	人民币75,526,883元	—	125,920
		<u>—</u>	<u>125,920</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022年6月30日

7 衍生金融工具(续)

外汇远期合约(续)

中银香港全天候大湾区策略基金

		公允价值	
	名义金额	资产	负债
		美元	美元
2022年6月30日			
购入人民币	人民币128,237,818元	—	58,780
2021年6月30日			
购入人民币	人民币217,267,818元	—	362,234

中银香港全天候亚洲高息债券基金

		公允价值	
	名义金额	资产	负债
		美元	美元
2022年6月30日			
购入欧元	206,255欧元	—	2,235
购入英镑	215,601英镑	—	2,267
购入澳元	548,881澳元	—	2,463
购入人民币	人民币14,366,713元	—	5,998
		—	12,963
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

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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ESG多元资产基金

	名义金额	公允价值	
		资产	负债
		美元	美元
2022年6月30日			
购入欧元	330,000欧元	—	3,576
购入英镑	722,427英镑	—	7,596
购入澳元	2,449,209澳元	—	11,256
购入人民币	人民币29,890,255元	—	12,710
		—	35,138

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
2022年6月30日						
负债						
衍生工具	(81)	—	(81)	—	—	(81)
2021年6月30日						
负债						
衍生工具	(380)	—	(380)	—	—	(380)

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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 金融工具 人民币	现金抵押 人民币	风险净值 人民币
2022年6月30日						
资产						
衍生工具	142,023	—	142,023	(142,023)	—	—
负债						
衍生工具	(1,558,151)	—	(1,558,151)	142,023	—	(1,416,128)
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)

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 金融工具 港元	现金抵押 港元	风险净值 港元
2022年6月30日						
资产						
衍生工具	33,220	—	33,220	(29,025)	—	4,195
负债						
衍生工具	(29,025)	—	(29,025)	29,025	—	—
2021年6月30日						
负债						
衍生工具	(81,356)	—	(81,356)	—	—	(81,356)

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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 金融工具 人民币	现金抵押 人民币	风险净值 人民币
2022年6月30日						
负债						
衍生工具	(386,374)	—	(386,374)	—	—	(386,374)
2021年6月30日						
资产						
衍生工具	379,684	—	379,684	—	—	379,684

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 金融工具 美元	现金抵押 美元	风险净值 美元
2022年6月30日						
负债						
衍生工具	(62,766)	—	(62,766)	—	—	(62,766)
2021年6月30日						
负债						
衍生工具	(472,185)	—	(472,185)	—	—	(472,185)

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2022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 金融工具 美元	现金抵押 美元	风险净值 美元
2022年6月30日						
资产						
衍生工具	1,211	—	1,211	—	—	1,211

2021年6月30日						
负债						
衍生工具	(3,039)	—	(3,039)	—	—	(3,039)

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 金融工具 港元	现金抵押 港元	风险净值 港元
2022年6月30日						
资产						
衍生工具	63,724	—	63,724	—	—	63,724

2021年6月30日						
负债						
衍生工具	(216,469)	—	(216,469)	—	—	(216,469)

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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	
2022年6月30日						
资产						
衍生工具	10,348	—	10,348	(3,781)	—	6,567
	<u>10,348</u>	<u>—</u>	<u>10,348</u>	<u>(3,781)</u>	<u>—</u>	<u>6,567</u>
负债						
衍生工具	(3,781)	—	(3,781)	3,781	—	—
	<u>(3,781)</u>	<u>—</u>	<u>(3,781)</u>	<u>3,781</u>	<u>—</u>	<u>—</u>
2021年6月30日						
负债						
衍生工具	(38,423)	—	(38,423)	—	—	(38,423)
	<u>(38,423)</u>	<u>—</u>	<u>(38,423)</u>	<u>—</u>	<u>—</u>	<u>(38,423)</u>

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	
2022年6月30日						
资产						
衍生工具	20,958	—	20,958	—	—	20,958
	<u>20,958</u>	<u>—</u>	<u>20,958</u>	<u>—</u>	<u>—</u>	<u>20,958</u>
2021年6月30日						
资产						
衍生工具	37,928	—	37,928	(37,928)	—	—
	<u>37,928</u>	<u>—</u>	<u>37,928</u>	<u>(37,928)</u>	<u>—</u>	<u>—</u>
负债						
衍生工具	(132,900)	—	(132,900)	37,928	—	(94,972)
	<u>(132,900)</u>	<u>—</u>	<u>(132,900)</u>	<u>37,928</u>	<u>—</u>	<u>(94,972)</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2022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 金融工具 美元	现金抵押 美元	风险净值 美元
2022年6月30日						
负债						
衍生工具	(16,684)	—	(16,684)	—	—	(16,684)

2021年6月30日						
负债						
衍生工具	(125,920)	—	(125,920)	—	—	(125,920)

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 金融工具 美元	现金抵押 美元	风险净值 美元
2022年6月30日						
负债						
衍生工具	(58,780)	—	(58,780)	—	—	(58,780)

2021年6月30日						
负债						
衍生工具	(362,234)	—	(362,234)	—	—	(362,234)

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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
2022年6月30日						
负债						
衍生工具	(12,963)	—	(12,963)	—	—	(12,963)

2021年6月30日

负债						
衍生工具	(109,702)	—	(109,702)	—	—	(109,702)

中银香港全天候ESG多元资产基金

	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
2022年6月30日						
负债						
衍生工具	(35,138)	—	(35,138)	—	—	(35,138)

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。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022年6月30日

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	
	2022年 美元	2021年 美元	2022年 人民币	2021年 人民币	2022年 港元	2021年 港元
应收经纪人款项						
就已出售但未偿付的						
证券应收的款项	198,900	994,081	2,810	14,261,351	1,906,500	79,042,948
应付经纪人款项						
就已购买但未偿付的						
证券应付的款项	199,522	1,204,995	5,198,506	28,144,449	1,409,561	63,040,108
	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	
	2022年 人民币	2021年 人民币	2022年 美元	2021年 美元	2022年 美元	2021年 美元
应收经纪人款项						
就已出售但未偿付的						
证券应收的款项	3,288,083	14,917,892	963,541	5,266,885	187,892	151,382
应付经纪人款项						
就已购买但未偿付的						
证券应付的款项	3,257,877	19,418,017	963,910	5,668,481	141,799	158,867
	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	
	2022年 港元	2021年 港元	2022年 美元	2021年 美元	2022年 美元	2021年 美元
应收经纪人款项						
就已出售但未偿付的						
证券应收的款项	846,000	9,966,760	208,916	1,544,569	593,652	11,276,604
应付经纪人款项						
就已购买但未偿付的						
证券应付的款项	2,435	10,156,163	128,036	1,561,038	593,308	6,773,761

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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	
	2022年 美元	2021年 美元	2022年 美元	2021年 美元	2022年 美元	2021年 美元
应收经纪人款项						
就已出售但未偿付的						
证券应收的款项	821,508	3,526,411	963,541	15,785,947	–	2,493,612
应付经纪人款项						
就已购买但未偿付的						
证券应付的款项	645,600	2,659,774	1,846,732	11,636,124	194,131	2,896,088
					中银香港全天候 ESG多元资产基金	
					2022年	
					美元	
应收经纪人款项						
就已出售但未偿付的证券应收的款项						198,900
应付经纪人款项						
就已购买但未偿付的证券应付的款项						398,898

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。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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(定义详见子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。

中银香港全天候ESG多元
资产基金

透过对符合以环境、社会及管治为重的投资原则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，以在中至长期提供收入及资本增值。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022年6月30日

9 财务风险管理(续)

(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。

(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	2022年		2021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	96,078	1.19	190,968	1.98
日本	—	—	80,718	0.84
美国	1,071,556	13.22	1,310,122	13.58
	<u>1,167,634</u>	<u>14.41</u>	<u>1,581,808</u>	<u>16.40</u>
上市权益性证券				
澳大利亚	85,183	1.05	—	—
法国	406,646	5.02	—	—
香港	287,314	3.55	3,724,240	38.62
日本	129,756	1.60	—	—
美国	2,295,860	28.32	1,091,797	11.32
	<u>3,204,759</u>	<u>39.54</u>	<u>4,816,037</u>	<u>49.94</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2022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	2022年		2021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	279,269	3.44	—	—
英属维尔京群岛	901,259	11.12	616,489	6.40
开曼群岛	181,408	2.24	610,238	6.33
中国内地	195,122	2.40	210,145	2.18
法国	168,016	2.07	223,087	2.31
德国	166,962	2.06	208,348	2.16
香港	—	—	200,434	2.08
印度	160,976	1.98	—	—
印度尼西亚	204,963	2.53	247,653	2.57
毛里求斯	189,323	2.34	—	—
新西兰	246,363	3.04	—	—
荷兰	204,487	2.52	223,028	2.31
瑞典	—	—	214,223	2.22
英国	187,247	2.31	—	—
美国	—	—	199,849	2.07
	<u>3,085,395</u>	<u>38.05</u>	<u>2,953,494</u>	<u>30.63</u>
存托凭证				
美国	355,743	4.39	—	—
台湾	40,875	0.50	120,160	1.25
	<u>396,618</u>	<u>4.89</u>	<u>120,160</u>	<u>1.25</u>
	<u>7,854,406</u>	<u>96.89</u>	<u>9,471,499</u>	<u>98.22</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2022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	2022年		2021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	3,765,094	0.73	6,672,282	0.62
香港	12,220,800	2.36	11,559,600	1.07
	<u>15,985,894</u>	<u>3.09</u>	<u>18,231,882</u>	<u>1.69</u>
挂牌债务证券				
澳大利亚	6,233,045	1.20	7,188,154	0.67
百慕大	10,364,519	2.00	34,261,580	3.18
英属维尔京群岛	74,384,185	14.32	160,590,690	14.88
开曼群岛	113,351,841	21.86	678,345,484	62.84
中国内地	91,228,475	17.58	46,611,355	4.31
香港	66,432,009	12.81	63,823,043	5.91
印度	18,182,656	3.51	8,414,590	0.78
印度尼西亚	—	—	4,489,510	0.42
Jersey, C.I.	9,268,848	1.79	—	—
毛里求斯	15,283,707	2.95	—	—
荷兰	3,833,082	0.74	—	—
巴基斯坦	1,674,122	0.32	2,704,350	0.25
菲律宾	15,789,495	3.05	16,407,514	1.52
新加坡	23,958,907	4.62	40,211,490	3.72
斯里兰卡	—	—	8,151,263	0.76
泰国	2,487,743	0.48	—	—
英国	7,476,880	1.44	1,342,051	0.12
美国	19,989,009	3.84	10,800,057	1.00
	<u>479,938,523</u>	<u>92.51</u>	<u>1,083,341,131</u>	<u>100.36</u>
	<u>495,924,417</u>	<u>95.60</u>	<u>1,101,573,013</u>	<u>102.05</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2022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	2022年		2021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 %
上市权益性证券				
香港	130,597,000	72.99	196,894,200	70.15
中国内地	27,271,723	15.24	33,026,114	11.77
	<u>157,868,723</u>	<u>88.23</u>	<u>229,920,314</u>	<u>81.92</u>
	<u>157,868,723</u>	<u>88.23</u>	<u>229,920,314</u>	<u>81.92</u>

中银香港全天候在岸人民币股票基金

金融资产	2022年		2021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	246,870,332	81.93	292,763,355	71.81
香港	44,748,196	14.85	103,384,043	25.35
	<u>291,618,528</u>	<u>96.78</u>	<u>396,147,398</u>	<u>97.16</u>
	<u>291,618,528</u>	<u>96.78</u>	<u>396,147,398</u>	<u>97.16</u>

中银香港全天候亚洲债券基金

金融资产	2022年		2021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	2,658,143	2.52	2,602,774	1.20
	<u>2,658,143</u>	<u>2.52</u>	<u>2,602,774</u>	<u>1.20</u>
	<u>2,658,143</u>	<u>2.52</u>	<u>2,602,774</u>	<u>1.20</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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	2022年		2021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	3,969,169	3.75	3,545,701	1.62
百慕大	145,463	0.14	3,806,942	1.74
英属维尔京群岛	23,399,882	22.17	36,268,612	16.62
加拿大	—	—	185,851	0.09
开曼群岛	8,536,318	8.08	69,205,099	31.68
中国内地	6,769,420	6.41	10,418,166	4.77
法国	660,629	0.63	568,873	0.26
香港	10,686,548	10.12	23,189,687	10.62
印度	9,516,395	9.03	13,140,911	6.02
印度尼西亚	5,907,771	5.60	7,629,110	3.49
日本	3,530,255	3.35	3,097,604	1.42
Jersey, C.I.	746,152	0.71	—	—
韩国	2,062,732	1.95	3,109,691	1.42
澳门	491,642	0.47	523,722	0.24
马来西亚	493,524	0.47	6,087,869	2.79
毛里求斯	1,657,219	1.57	—	—
蒙古	—	—	196,278	0.09
荷兰	2,136,715	2.03	4,373,230	2.00
新西兰	2,355,740	2.24	—	—
巴基斯坦	312,588	0.30	522,713	0.24
菲律宾	2,896,308	2.75	8,071,456	3.71
沙特阿拉伯	—	—	1,592,571	0.73
新加坡	6,748,299	6.40	8,907,066	4.09
斯里兰卡	—	—	1,008,336	0.46
瑞典	550,934	0.52	642,668	0.29
瑞士	461,275	0.44	534,725	0.24
泰国	2,273,549	2.16	4,446,444	2.04
英国	290,233	0.28	3,937,097	1.39
美国	513,780	0.49	3,391,111	1.55
乌兹别克斯坦	—	—	260,411	0.12
越南	—	—	224,488	0.10
	97,112,540	92.06	217,986,432	99.83
	99,770,683	94.58	220,589,206	101.03

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2022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	2022年		2021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
新加坡	—	—	65,775	1.00
美国	—	—	377,280	5.73
	<u>—</u>	<u>—</u>	<u>608,055</u>	<u>9.23</u>
上市权益性证券				
中国内地	421,832	11.25	—	—
香港	1,495,650	39.86	3,772,939	57.28
韩国	176,974	4.72	1,246,741	18.93
新加坡	686,401	18.29	—	—
美国	649,110	17.31	—	—
	<u>3,429,967</u>	<u>91.43</u>	<u>5,019,680</u>	<u>76.21</u>
存托凭证				
台湾	234,010	6.24	540,720	8.21
美国	—	—	252,921	3.84
	<u>234,010</u>	<u>6.24</u>	<u>793,641</u>	<u>12.05</u>
	<u>3,663,977</u>	<u>97.67</u>	<u>6,421,376</u>	<u>97.49</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2022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	2022年		2021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	1,633,555	2.49	5,801,439	4.61
	<u>1,633,555</u>	<u>2.49</u>	<u>5,801,439</u>	<u>4.61</u>
上市权益性证券				
中国内地	3,555,819	5.42	1,728,937	1.37
香港	33,667,600	51.27	90,322,710	71.65
	<u>37,223,419</u>	<u>56.69</u>	<u>92,051,647</u>	<u>73.02</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	6,741,980	10.27	5,649,158	4.49
加拿大	—	—	400,942	0.32
开曼群岛	2,324,628	3.54	9,408,045	7.46
中国内地	4,582,635	6.98	—	—
香港	4,675,076	7.11	1,556,654	1.24
印度	2,543,131	3.87	—	—
印度尼西亚	—	—	1,621,583	1.29
毛里求斯	1,462,279	2.23	—	—
斯里兰卡	—	—	1,478,357	1.17
瑞士	1,187,513	1.81	—	—
英国	—	—	1,553,280	1.23
	<u>23,517,242</u>	<u>35.81</u>	<u>23,247,706</u>	<u>18.45</u>
	<u>62,374,216</u>	<u>94.99</u>	<u>123,422,091</u>	<u>97.92</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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	2022年		2021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	208,168	2.36	203,832	1.42
新加坡	74,435	0.84	211,093	1.47
美国	—	—	1,691,699	11.82
	<u>282,603</u>	<u>3.20</u>	<u>2,106,624</u>	<u>14.71</u>
上市权益性证券				
澳大利亚	414,062	4.68	1,724,361	12.03
中国内地	1,224,231	13.87	1,507,945	10.52
香港	4,403,259	49.88	5,645,974	39.37
	<u>6,041,552</u>	<u>68.43</u>	<u>8,878,280</u>	<u>61.92</u>
挂牌债务证券				
百慕大	—	—	203,613	1.42
英属维尔京群岛	352,162	3.99	77,864	0.54
开曼群岛	316,858	3.59	2,175,314	15.18
印度	160,975	1.82	—	—
Jersey, C.I.	165,812	1.88	—	—
毛里求斯	186,342	2.11	—	—
英国	—	—	200,000	1.40
	<u>1,182,149</u>	<u>13.39</u>	<u>2,656,791</u>	<u>18.54</u>
存托凭证				
美国	—	—	137,300	0.96
英国	—	—	436,304	3.04
	<u>—</u>	<u>—</u>	<u>573,604</u>	<u>4.00</u>
	<u>7,506,304</u>	<u>85.02</u>	<u>14,215,299</u>	<u>99.17</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2022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	2022年		2021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	1,198,429	2.41	—	—
英属维尔京群岛	6,468,049	12.99	13,212,040	14.43
加拿大	601,847	1.21	—	—
开曼群岛	2,454,988	4.93	9,057,218	9.90
中国内地	—	—	9,912,868	10.84
香港	8,853,321	17.79	10,449,518	11.41
日本	1,124,546	2.26	—	—
韩国	6,049,790	12.16	—	—
美国	—	—	11,985,277	13.09
	<u>26,750,970</u>	<u>53.75</u>	<u>54,616,921</u>	<u>59.67</u>
	<u>26,750,970</u>	<u>53.75</u>	<u>54,616,921</u>	<u>59.67</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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	2022年		2021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	304,245	1.88	1,111,436	3.90
	<u>304,245</u>	<u>1.88</u>	<u>1,111,436</u>	<u>3.90</u>
上市权益性证券				
中国内地	487,932	3.02	811,563	2.85
香港	913,447	5.65	1,149,452	4.04
	<u>1,401,379</u>	<u>8.67</u>	<u>1,961,015</u>	<u>6.89</u>
挂牌债务证券				
澳大利亚	682,834	4.23	216,072	0.76
百慕大	—	—	508,819	1.78
英属维尔京群岛	3,403,920	21.06	4,349,208	15.25
开曼群岛	1,798,238	11.13	8,204,750	28.81
中国内地	2,005,741	12.41	1,901,393	6.68
法国	330,315	2.05	—	—
香港	613,161	3.79	2,564,880	9.00
印度	706,777	4.37	1,506,133	5.28
印度尼西亚	1,218,432	7.54	—	—
日本	733,167	4.54	397,585	1.40
韩国	—	—	992,425	3.48
马来西亚	—	—	591,807	2.08
毛里求斯	342,857	2.12	—	—
蒙古	—	—	196,278	0.69
荷兰	245,384	1.52	506,064	1.78
新西兰	719,893	4.46	—	—
新加坡	731,870	4.53	—	—
瑞士	151,328	0.94	—	—
泰国	372,552	2.31	—	—
阿联酋	—	—	203,009	0.71
英国	—	—	720,888	2.53
美国	—	—	406,549	1.43
	<u>14,056,469</u>	<u>87.00</u>	<u>23,265,860</u>	<u>81.69</u>
	<u>15,762,093</u>	<u>97.55</u>	<u>26,338,311</u>	<u>89.63</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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	2022年		2021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	2,998,890	2.36	2,696,850	1.21
	<u>2,998,890</u>	<u>2.36</u>	<u>2,696,850</u>	<u>1.21</u>
上市权益性证券				
香港	9,570,420	7.53	—	—
	<u>9,570,420</u>	<u>7.53</u>	<u>—</u>	<u>—</u>
挂牌债务证券				
澳大利亚	1,951,333	1.54	4,733,968	2.11
百慕大	707,744	0.56	3,586,428	1.61
英属维尔京群岛	34,568,705	27.19	58,089,777	25.93
加拿大	1,072,585	0.84	—	—
开曼群岛	27,900,974	21.93	78,842,639	35.25
中国内地	10,630,702	8.35	16,937,044	7.57
德国	592,914	0.47	662,937	0.30
香港	16,141,075	12.69	26,816,949	11.99
印度	2,631,123	2.08	3,416,550	1.53
印度尼西亚	1,675,472	1.33	4,990,200	2.21
日本	—	—	525,936	0.24
卢森堡	1,018,179	0.80	1,078,189	0.48
澳门	—	—	523,722	0.23
马来西亚	—	—	4,775,361	2.14
毛里求斯	489,259	0.39	—	—
蒙古	—	—	196,278	0.09
荷兰	408,974	0.32	997,308	0.45
新西兰	1,064,286	0.84	—	—
菲律宾	1,383,038	1.09	2,125,344	0.95
新加坡	2,730,050	2.14	5,329,196	2.38
西班牙	184,619	0.15	219,405	0.10
瑞典	550,934	0.43	642,668	0.29
泰国	—	—	3,169,879	1.42
英国	290,233	0.23	1,084,061	0.49
美国	1,999,123	1.57	—	—
	<u>107,991,322</u>	<u>84.94</u>	<u>218,743,839</u>	<u>97.76</u>
	<u>120,560,632</u>	<u>94.83</u>	<u>221,440,689</u>	<u>98.97</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2022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	2022年		2021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	416,336	2.56	407,663	1.15
	416,336	2.56	407,663	1.15
挂牌债务证券				
百慕大	353,872	2.17	814,025	2.29
英属维尔京群岛	2,075,363	12.73	5,324,586	15.01
开曼群岛	3,569,416	21.93	18,943,057	53.41
中国内地	798,403	4.90	1,497,998	4.22
香港	1,690,207	10.39	2,141,747	6.04
印度	1,522,262	9.34	949,783	2.68
印度尼西亚	238,960	1.47	527,413	1.49
Jersey	315,042	1.94	—	—
毛里求斯	869,214	5.33	—	—
蒙古	—	—	236,640	0.67
荷兰	811,102	4.98	915,173	2.58
巴基斯坦	405,577	2.49	591,296	1.67
菲律宾	648,932	3.99	698,201	1.97
新加坡	910,877	5.60	1,327,647	3.74
斯里兰卡	—	—	834,814	2.35
泰国	185,802	1.14	—	—
美国	797,610	4.91	—	—
英国	240,487	1.48	380,000	1.07
	15,433,126	94.79	35,182,380	99.19
	15,849,462	97.35	35,590,043	100.34

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2022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ESG多元资产基金

	2022年	占资产净值 的百分比
金融资产	公允价值 美元	%
上市权益性证券		
香港	2,867,420	10.33
美国	8,775,830	31.57
	<u>11,643,250</u>	<u>41.90</u>
挂牌债务证券		
澳大利亚	1,347,768	4.85
英属维尔京群岛	343,755	1.23
开曼群岛	2,329,221	8.39
中国内地	2,967,538	10.67
法国	670,344	2.41
德国	148,228	0.53
香港	1,076,254	3.88
印度	1,030,759	3.71
日本	528,048	1.90
韩国	409,448	1.47
毛里求斯	1,579,915	3.69
新加坡	501,356	1.81
泰国	879,104	3.16
美国	200,820	0.72
	<u>14,012,558</u>	<u>50.42</u>
存托凭证		
台湾	408,750	1.47
	<u>26,064,558</u>	<u>93.79</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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	2022年 占资产净值 的百分比 %	2021年 占资产净值 的百分比 %
集合投资计划		
金融	14.41	16.40
	<u>14.41</u>	<u>16.40</u>
存托凭证		
通讯	0.42	—
基本物料	2.26	—
消费者，周期性	1.71	—
技术	0.50	1.25
	<u>4.89</u>	<u>1.25</u>
上市权益性证券		
基本物料	2.68	3.84
通讯	4.60	15.15
消费者，周期性	13.19	3.79
消费者，非周期性	2.39	9.07
能源	0.71	3.67
金融	4.49	10.81
技术	11.48	3.61
	<u>39.54</u>	<u>49.94</u>
挂牌债务证券		
基本物料	5.01	4.75
通讯	2.24	—
消费者，周期性	2.48	2.14
消费者，非周期性	2.10	2.18
能源	2.34	—
金融	21.36	19.48
政府	—	2.08
公用事业	2.52	—
	<u>38.05</u>	<u>30.63</u>
	<u>96.89</u>	<u>98.22</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2022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	2022年 占资产净值 的百分比 %	2021年 占资产净值 的百分比 %
集合投资计划		
金融	—	1.07
其他	3.09	0.62
	<u>3.09</u>	<u>1.69</u>
挂牌债务证券		
基本物料	8.37	2.87
通讯	0.60	—
消费者, 周期性	6.73	4.00
消费者, 非周期性	3.60	0.38
多元化经营	2.47	—
能源	7.36	4.91
金融	39.16	81.05
政府	9.08	1.02
工业	4.95	1.00
技术	—	0.92
公用事业	10.19	4.21
	<u>92.51</u>	<u>100.36</u>
	<u>95.60</u>	<u>102.05</u>

中银香港全天候香港股票基金

金融资产	2022年 占资产净值 的百分比 %	2021年 占资产净值 的百分比 %
上市权益性证券		
基本物料	0.97	—
通讯	24.13	20.09
消费者, 周期性	5.41	8.83
消费者, 非周期性	8.64	14.66
能源	11.60	2.39
金融	31.31	19.24
工业	2.75	10.34
技术	3.42	5.42
公用事业	—	0.95
	<u>88.23</u>	<u>81.92</u>
	<u>88.23</u>	<u>81.92</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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

金融资产	2022年 占资产净值 的百分比 %	2021年 占资产净值 的百分比 %
上市权益性证券		
基本物料	3.00	22.63
通讯	11.31	6.17
消费者, 周期性	17.78	13.50
消费者, 非周期性	21.17	16.45
多元化经营	—	0.42
能源	10.76	—
金融	17.06	4.73
工业	11.36	20.46
技术	2.35	12.80
公用事业	1.99	—
	96.78	97.16

中银香港全天候亚洲债券基金

金融资产	2022年 占资产净值 的百分比 %	2021年 占资产净值 的百分比 %
集合投资计划		
金融	2.52	1.20
挂牌债务证券		
基本物料	7.56	3.43
通讯	4.03	3.84
消费者, 周期性	4.90	4.57
消费者, 非周期性	3.51	2.31
多元化经营	0.55	0.25
能源	6.54	5.06
金融	43.88	63.02
政府	5.50	6.54
工业	5.00	1.94
技术	—	1.30
公用事业	10.59	7.57
	92.06	99.83
	94.58	101.03

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2022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

	2022年 占资产净值 的百分比 %	2021年 占资产净值 的百分比 %
金融资产		
集合投资计划		
金融	—	9.23
上市权益性证券		
通讯	18.91	34.80
消费者, 周期性	12.27	7.75
消费者, 非周期性	18.99	4.31
能源	—	2.59
金融	21.07	12.08
工业	6.11	2.14
技术	11.54	11.23
公用事业	2.54	1.31
	91.43	76.21
存托凭证		
通讯	6.24	3.84
技术	—	8.21
	6.24	12.05
	97.67	97.49

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2022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	2022年 占资产净值 的百分比 %	2021年 占资产净值 的百分比 %
集合投资计划		
金融	2.49	4.61
上市权益性证券		
通讯	12.93	31.98
消费者, 周期性	2.87	4.29
消费者, 非周期性	4.33	3.82
能源	—	3.85
金融	31.79	24.59
工业	4.77	1.95
技术	—	0.63
公用事业	—	1.91
	56.69	73.02
存托凭证		
通讯	—	1.84
挂牌债务证券		
基本物料	1.94	1.26
通讯	2.32	—
消费者, 非周期性	1.93	—
能源	2.23	—
金融	22.55	13.53
政府	—	1.18
工业	2.41	1.23
公用事业	2.43	1.25
	35.81	18.45
	94.99	97.92

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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	2022年 占资产净值 的百分比 %	2021年 占资产净值 的百分比 %
集合投资计划		
金融	0.85	14.71
基金	2.36	—
	<u>3.20</u>	<u>14.71</u>
上市权益性证券		
基本物料	2.80	5.69
通讯	8.08	1.21
消费者, 周期性	11.30	17.42
消费者, 非周期性	5.43	13.49
能源	1.89	6.98
金融	34.76	10.27
工业	1.94	3.30
技术	—	1.96
公用事业	2.23	1.60
	<u>68.43</u>	<u>61.92</u>
挂牌债务证券		
基本物料	2.10	1.42
消费者, 非周期性	1.82	—
能源	2.12	1.27
金融	3.13	13.91
工业	4.22	1.94
	<u>13.39</u>	<u>18.54</u>
存托凭证		
通讯	—	0.96
技术	—	3.04
	<u>—</u>	<u>4.00</u>
	85.02	99.17

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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	2022年 占资产净值 的百分比 %	2021年 占资产净值 的百分比 %
挂牌债务证券		
基本物料	1.04	5.70
通讯	4.06	—
消费者, 周期性	2.02	0.22
能源	1.22	—
金融	26.75	34.14
政府	—	13.09
工业	3.26	3.79
公用事业	15.40	2.73
	<u>53.75</u>	<u>59.67</u>
	53.75	59.67

中银香港全天候一带一路债券基金

金融资产	2022年 占资产净值 的百分比 %	2021年 占资产净值 的百分比 %
集合投资计划		
金融	—	2.85
其他	1.88	1.05
	<u>1.88</u>	<u>3.90</u>
上市权益性证券		
通讯	0.35	2.76
消费者, 周期性	3.15	—
消费者, 非周期性	1.51	3.62
金融	3.66	0.51
	<u>8.67</u>	<u>6.89</u>
挂牌债务证券		
基本物料	9.08	1.40
通讯	8.14	7.71
消费者, 周期性	2.31	0.71
消费者, 非周期性	1.00	—
能源	5.10	1.15
金融	38.99	50.48
政府	7.56	3.21
工业	5.41	8.18
技术	2.11	3.47
公用事业	7.30	5.38
	<u>87.00</u>	<u>81.69</u>
	97.55	89.63

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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	2022年 占资产净值 的百分比 %	2021年 占资产净值 的百分比 %
集合投资计划		
金融	0.19	1.21
其他	2.17	—
	<u>2.36</u>	<u>1.21</u>
上市权益性证券		
通讯	1.93	—
消费者, 周期性	0.71	—
消费者, 非周期性	0.47	—
能源	0.19	—
金融	2.75	—
工业	0.59	—
技术	0.59	—
公用事业	0.30	—
	<u>7.53</u>	<u>—</u>
挂牌债务证券		
基本物料	6.77	5.65
通讯	4.14	2.01
消费者, 周期性	2.29	3.80
消费者, 非周期性	3.78	1.69
多元化经营	1.03	0.24
能源	3.88	2.73
金融	40.81	68.32
政府	1.57	0.85
工业	10.37	6.59
公用事业	10.30	5.88
	<u>84.94</u>	<u>97.76</u>
	<u>94.83</u>	<u>98.97</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2022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	2022年 占资产净值 的百分比 %	2021年 占资产净值 的百分比 %
集合投资计划		
金融	2.56	1.15
挂牌债务证券		
基本物料	7.63	2.99
通讯	1.06	0.86
消费者, 周期性	7.08	4.20
消费者, 非周期性	10.04	3.54
多元化经营	1.85	0.91
能源	8.50	4.41
金融	36.50	73.49
政府	7.39	4.02
工业	3.96	1.07
公用事业	10.78	3.70
	94.79	99.19
	97.35	100.34

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2022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ESG多元资产基金

金融资产	2022年 占资产净值 的百分比 %
上市权益性证券	
通讯	5.69
消费者，周期性	5.00
消费者，非周期性	8.67
金融	1.92
工业	8.40
技术	12.22
	41.90
挂牌债务证券	
基本物料	2.13
通讯	8.27
消费者，周期性	2.92
消费者，非周期性	0.58
能源	4.97
金融	28.60
技术	0.61
公用事业	2.34
	50.42
存托凭证	
技术	1.47
	93.79

中银香港盈荟系列

财务报表附注 2022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可能合理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可能合理变动的看法，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 可能合理变动 2022年	资产净值的 估计可能变动 2022年 美元	市场指数的 可能合理变动 2021年	资产净值的 估计可能变动 2021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%	± 332,947	±8%	± 299,234

中银香港全天候香港股票基金

	市场指数的 可能合理变动 2022年	资产净值的 估计可能变动 2022年 港元	市场指数的 可能合理变动 2021年	资产净值的 估计可能变动 2021年 港元
恒生总回报指数	±15%	± 11,929,240	±13%	± 22,263,612

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2022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 可能合理变动 2022年	资产净值的 估计可能变动 2022年 人民币	市场指数的 可能合理变动 2021年	资产净值的 估计可能变动 2021年 人民币
深圳证券交易所 综合总回报指 数	±20%	± 35,259,840	±17%	± 58,446,338

中银香港全天候亚洲(日本除外)股票基金

	市场指数的 可能合理变动 2022年	资产净值的 估计可能变动 2022年 美元	市场指数的 可能合理变动 2021年	资产净值的 估计可能变动 2021年 美元
MSCI AC远东除 日本净总回报 美元指数	±11%	± 301,084	±13%	± 749,747

中银香港全天候中国收益基金

	市场指数的 可能合理变动 2022年	资产净值的 估计可能变动 2022年 港元	市场指数的 可能合理变动 2021年	资产净值的 估计可能变动 2021年 港元
恒生低波幅总回 报指数	±7%	± 3,042,121	±7%	± 5,478,041

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2022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 可能合理变动 2022年	资产净值的 估计可能变动 2022年 美元	市场指数的 可能合理变动 2021年	资产净值的 估计可能变动 2021年 美元
MSCI AC亚太除 日本高息净回 报美元指数	±8%	± 390,205	±9%	± 667,449

中银香港全天候ESG多元资产基金

	市场指数的 可能合理变动 2022年	资产净值的 估计可能变动 2022年 美元
MSCI环球ESG领导者净总回报指数	±10%	± 581,411

9 财务风险管理(续)

(a) 市场风险(续)

(i) 价格风险(续)

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
2022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

	2022年 美元	2021年 美元
剩余到期日如下：		
— 少于一年	—	598,035
— 一至五年	911,900	612,340
— 超过五年	2,173,495	1,743,119
	<u>3,085,395</u>	<u>2,953,494</u>

中银香港全天候中国高息债券基金

	2022年 人民币	2021年 人民币
剩余到期日如下：		
— 少于一年	108,921,130	107,830,938
— 一至五年	232,214,686	787,550,173
— 超过五年	138,802,707	187,960,020
	<u>479,938,523</u>	<u>1,083,341,131</u>

中银香港全天候亚洲债券基金

	2022年 美元	2021年 美元
剩余到期日如下：		
— 少于一年	4,639,900	18,161,334
— 一至五年	41,711,403	89,554,150
— 超过五年	50,761,237	110,270,948
	<u>97,112,540</u>	<u>217,986,432</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2022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

	2022年 港元	2021年 港元
剩余到期日如下：		
— 少于一年	5,532,165	7,509,058
— 一至五年	12,364,724	13,784,426
— 超过五年	5,620,353	1,954,222
	<u>23,517,242</u>	<u>23,247,706</u>

中银香港全天候亚太高收益基金

	2022年 美元	2021年 美元
剩余到期日如下：		
— 少于一年	17,350	866,371
— 一至五年	857,707	1,391,312
— 超过五年	307,092	399,108
	<u>1,182,149</u>	<u>2,656,791</u>

中银香港全天候短期债券基金

	2022年 美元	2021年 美元
剩余到期日如下：		
— 少于一年	18,065,385	21,802,093
— 一至五年	4,523,612	32,814,828
— 超过五年	4,161,973	—
	<u>26,750,970</u>	<u>54,616,921</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2022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

	2022年 美元	2021年 美元
剩余到期日如下：		
— 少于一年	1,253,188	—
— 一至五年	7,406,372	13,162,545
— 超过五年	5,396,909	10,103,315
	<u>14,056,469</u>	<u>23,265,860</u>

中银香港全天候大湾区策略基金

	2022年 美元	2021年 美元
剩余到期日如下：		
— 少于一年	10,929,260	21,788,943
— 一至五年	47,128,730	106,858,751
— 超过五年	49,933,332	90,096,145
	<u>107,991,322</u>	<u>218,743,839</u>

中银香港全天候亚洲高息债券基金

	2022年 美元	2021年 美元
剩余到期日如下：		
— 少于一年	3,260,882	5,390,533
— 一至五年	8,082,797	23,178,254
— 超过五年	4,089,447	6,613,593
	<u>15,433,126</u>	<u>35,182,380</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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ESG多元资产基金

2022年
美元

剩余到期日如下：

— 少于一年	602,693
— 一至五年	10,966,007
— 超过五年	2,443,858
	<u>14,012,558</u>

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可能合理变动的看法，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 2022年	对资产净值 的影响 2021年
中银香港全天候环球投资基金	±100基点	±328,444美元	±255,905美元
中银香港全天候中国高息债券基金	±100基点	±人民币28,517,913元	±人民币34,612,003元
中银香港全天候亚洲债券基金	±100基点	±8,117,397美元	±16,888,826美元
中银香港全天候中国收益基金	±100基点	±1,946,102港元	±555,725港元
中银香港全天候亚太高收益基金	±100基点	±49,009美元	±56,728美元
中银香港全天候短期债券基金	±100基点	±398,261美元	±802,054美元
中银香港全天候一带一路债券基金	±100基点	±850,750美元	±1,339,029美元
中银香港全天候大湾区策略基金	±100基点	±9,087,960美元	±15,944,131美元
中银香港全天候亚洲高息债券基金	±100基点	±532,509美元	±1,257,550美元
中银香港全天候ESG多元资产基金	±100基点	±528,460美元	—

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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

	2022年 美元	2021年 美元
<i>货币性</i>		
澳元	2	154
欧元	3,747	1
英镑	266	302
港元	55,853	23,153
日圆	3,767	6,963
新西兰元	54	61
人民币	78	339
新加坡元	30	31
<i>非货币性</i>		
澳元	85,183	—
欧元	406,646	—
港元	287,314	3,821,133
日圆	129,756	80,718
人民币	96,077	94,076

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2022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

	2022年 人民币	2021年 人民币
货币性		
澳元	(85,742)	19,334,871
欧元	65,173	—
港元	(2,005,364)	(2,008,388)
美元	508,172,402	1,081,457,223
非货币性		
美元	3,765,094	6,672,282

中银香港全天候香港股票基金

	2022年 港元	2021年 港元
货币性		
澳元	1,254,096	252
新西兰元	2	2
人民币	3,981,820	12,961,701
美元	306,545	98,774
非货币性		
人民币	130,597,000	33,026,114

中银香港全天候在岸人民币股票基金

	2022年 人民币	2021年 人民币
货币性		
港元	1,747,146	7,263,615
美元	116,906	2,957,261
非货币性		
港元	44,748,197	103,384,043

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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

	2022年 美元	2021年 美元
货币性		
欧元	29	—
港元	21,496	(1,572,748)
印度卢比	—	739,119
人民币	(59,070)	43,882,257
非货币性		
人民币	2,658,142	2,602,774

中银香港全天候亚洲(日本除外)股票基金

	2022年 美元	2021年 美元
货币性		
港元	77,813	93,938
韩元	—	1,992
人民币	18,103	281,369
新加坡元	4,803	25,292
非货币性		
港元	1,495,650	3,937,938
韩元	176,974	1,246,742
人民币	421,833	—
新加坡元	686,401	65,775

中银香港全天候中国收益基金

	2022年 港元	2021年 港元
货币性		
澳元	8,447	9,068
欧元	57,787	—
人民币	4,371,861	25,360,546
美元	20,959,625	21,500,292
非货币性		
人民币	5,189,374	3,311,976
美元	117,913	2,321,299

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2022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

	2022年 美元	2021年 美元
<i>货币性</i>		
澳元	360,299	692,527
欧元	826	—
港元	539,784	203,423
新西兰元	493	551
人民币	208,608	1,614,907
新加坡元	14,532	17,388
<i>非货币性</i>		
澳元	414,063	1,724,361
港元	4,403,260	5,645,975
人民币	1,432,399	1,711,776
新加坡元	74,435	211,093

中银香港全天候短期债券基金

	2022年 美元	2021年 美元
<i>货币性</i>		
港元	50,859	3,695
欧元	672	100,027
人民币	778,170	9,900,642
新加坡元	327	128,172

中银香港全天候一带一路债券基金

	2022年 美元	2021年 美元
<i>货币性</i>		
欧元	6,785	2,696
港元	178,057	(32,539)
人民币	105,191	12,279,643
<i>非货币性</i>		
港元	913,448	1,962,980
人民币	792,177	1,109,471

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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

	2022年 美元	2021年 美元
货币性		
港元	1,127,273	2,858,463
澳门元	(54,633)	(3,064,908)
人民币	(26,497)	134,566
欧元	20	—
非货币性		
人民币	2,754,220	2,696,851
港元	9,815,092	—

中银香港全天候亚洲高息债券基金

	2022年 美元	2021年 美元
货币性		
澳元	26,067	6,249
欧元	10,360	5,137
英镑	2,809	66,922
港元	687	424,356
人民币	(2,368)	59,868
非货币性		
人民币	416,336	407,663

中银香港全天候ESG多元资产基金

	2022年 美元
货币性	
澳元	528,489
欧元	113,745
英镑	226,136
港元	10,598,479
人民币	1,192,909
非货币性	
港元	2,867,419

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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可能合理变动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可能合理变动的看法，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	
			2022年	2021年
			美元	美元
		+/-	+/-	+/-
货币性				
澳元	5%	—	8	
欧元	5%	187	—	
英镑	5%	13	15	
港元	5%	2,793	1,158	
日圆	5%	188	348	
新西兰元	5%	3	3	
人民币	5%	4	17	
新加坡元	5%	2	2	
非货币性				
澳元	5%	4,259	—	
欧元	5%	20,332	—	
港元	5%	14,366	191,057	
日圆	5%	6,488	4,036	
人民币	5%	4,804	4,704	

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2022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

	可能合理变动 +/-	对资产净值的影响	
		2022年 人民币	2021年 人民币
		+/-	+/-
货币性			
澳元	5%	(4,287)	966,744
欧元	5%	3,259	-
港元	5%	(100,268)	(100,419)
美元	5%	25,408,620	54,072,861
非货币性			
美元	5%	188,255	333,614

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	
		2022年 港元	2021年 港元
		+/-	+/-
货币性			
澳元	5%	62,705	13
人民币	5%	194,591	648,085
美元	5%	15,327	4,939
非货币性			
人民币	5%	1,363,586	1,651,306

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2022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)

中银香港全天候在岸人民币股票基金

	可能合理变动 +/-	对资产净值的影响	
		2022年 人民币	2021年 人民币
		+/-	+/-
货币性			
港元	5%	87,357	363,181
美元	5%	5,845	147,863
非货币性			
港元	5%	2,237,410	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	
		2022年 美元	2021年 美元
		+/-	+/-
货币性			
欧元	5%	1	-
港元	5%	1,075	(78,637)
印度卢比	5%	-	36,956
人民币	5%	2,953	2,194,113
非货币性			
人民币	5%	132,907	130,139

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2022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	
		2022年	2021年
		美元	美元
	+/-	+/-	+/-
货币性			
港元	5%	3,891	4,697
韩元	5%	—	100
人民币	5%	905	14,068
新加坡元	5%	240	1,265
非货币性			
港元	5%	74,782	196,897
韩元	5%	8,849	62,337
人民币	5%	21,092	—
新加坡元	5%	34,320	3,289

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	
			2022年	2021年
			港元	港元
		+ / -	+ / -	+ / -
货币性				
澳元	5%	422	453	
欧元	5%	2,889	-	
人民币	5%	218,593	1,268,027	
美元	5%	1,047,981	1,075,015	
非货币性				
人民币	5%	259,469	165,599	
美元	5%	5,896	116,065	

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2022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	
			2022年	2021年
			美元	美元
		+/-	+/-	+/-
货币性				
澳元	5%	18,015	34,626	
欧元	5%	41	-	
港元	5%	26,989	10,171	
新西兰元	5%	25	28	
人民币	5%	10,430	80,745	
新加坡元	5%	727	869	
非货币性				
澳元	5%	20,703	86,218	
港元	5%	220,163	282,299	
人民币	5%	71,620	85,589	
新加坡元	5%	3,722	10,555	

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	
		2022年	2021年
		美元	美元
	+ / -	+ / -	+ / -
货币性			
港元	5%	2,543	185
欧元	5%	34	5,001
人民币	5%	7,942	495,032
新加坡元	5%	16	6,409

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2022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	
		2022年	2021年
		美元	美元
	+/-	+/-	+/-
货币性			
欧元	5%	339	135
港元	5%	8,903	(1,627)
人民币	5%	5,260	613,982
非货币性			
港元	5%	45,672	98,149
人民币	5%	39,609	55,474

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	
		2022年	2021年
		美元	美元
	+/-	+/-	+/-
货币性			
港元	5%	56,364	142,923
澳门元	5%	2,732	(153,245)
人民币	5%	1,325	6,728
欧元	5%	1	-
非货币性			
人民币	5%	137,711	134,843
港元	5%	490,755	-

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2022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	
		2022年 美元	2021年 美元
		+/-	+/-
货币性			
澳元	5%	1,303	312
欧元	5%	518	257
英镑	5%	140	3,346
港元	5%	34	21,218
人民币	5%	(118)	2,993
非货币性			
人民币	5%	20,817	20,383

中银香港全天候ESG多元资产基金

	可能合理变动 +/-	对资产净值的影响	
		2022年 美元	2021年 美元
		+/-	+/-
货币性			
澳元	5%	26,424	
欧元	5%	5,687	
英镑	5%	11,307	
港元	5%	529,924	
人民币	5%	59,645	
非货币性			
港元	5%	143,371	

9 财务风险管理(续)

(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2022年及2021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2022年及2021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。

基于报告期末至合约到期日之间的剩余期间，2022年及2021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、计息银行借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。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022年6月30日

9 财务风险管理(续)

(b) 流动风险(续)

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：

	2022年 份额持有人 数目	2021年 份额持有人 数目
中银香港全天候环球投资基金	6	4
中银香港全天候中国高息债券基金	13	14
中银香港全天候香港股票基金	10	6
中银香港全天候在岸人民币股票基金	10	6
中银香港全天候亚洲债券基金	9	4
中银香港全天候亚洲(日本除外)股票基金	6	6
中银香港全天候中国收益基金	6	4
中银香港全天候亚太高收益基金	7	6
中银香港全天候短期债券基金	12	12
中银香港全天候一带一路债券基金	4	3
中银香港全天候大湾区策略基金	12	13
中银香港全天候亚洲高息债券基金	9	7
中银香港全天候ESG多元资产基金	12	—

(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。

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2022年及2021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。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022年6月30日

9 财务风险管理(续)

(c) 信用及交易对手风险(续)

于2022年及2021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	2022年		2021年	
	美元	占资产净值的百分比	美元	占资产净值的百分比
AAA1/Aaa2	201,340	2.48	199,849	2.07
A1/A2	572,261	7.06	205,896	2.14
BBB1/Baa2	1,126,747	13.90	866,001	8.98
BB1/Ba2	615,575	7.59	1,072,828	11.12
并未评级	569,472	7.02	608,920	6.32
	<u>3,085,395</u>	<u>38.05</u>	<u>2,953,494</u>	<u>30.63</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2022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	2022年		2021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 %
AAA ¹ /Aaa ²	19,989,009	3.84	—	—
A ¹ /A ²	29,941,228	5.77	—	—
BBB ¹ /Baa ²	62,089,393	11.97	186,062,812	17.24
BB ¹ /Ba ²	274,436,095	52.91	358,101,497	33.18
并未评级	93,482,798	18.02	539,176,822	49.94
总计	479,938,523	92.51	1,083,341,131	100.36

中银香港全天候亚洲债券基金

评级	2022年		2021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	5,340,250	5.06	833,425	0.38
A ¹ /A ²	27,638,452	26.20	37,862,264	17.34
BBB ¹ /Baa ²	38,943,281	36.92	50,931,473	23.33
BB ¹ /Ba ²	13,891,864	13.17	57,369,876	26.27
并未评级	11,298,693	10.71	70,989,394	32.51
总计	97,112,540	92.06	217,986,432	99.83

中银香港全天候中国收益基金

评级	2022年		2021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	1,282,524	1.96	—	—
BBB ¹ /Baa ²	4,702,822	7.16	1,957,596	1.55
BB ¹ /Ba ²	5,501,355	8.38	10,602,851	8.42
并未评级	12,030,541	18.32	10,687,259	8.48
总计	23,517,242	35.82	23,247,706	18.45

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2022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	2022年		2021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	—	—	—	—
BB ¹ /Ba ²	938,203	10.63	1,415,069	9.87
并未评级	243,946	2.76	1,241,722	8.67
总计	<u>1,182,149</u>	<u>13.39</u>	<u>2,656,791</u>	<u>18.54</u>

中银香港全天候短期债券基金

评级	2022年		2021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	5,228,218	10.51	11,985,278	13.08
A ¹ /A ²	14,422,213	28.97	9,675,135	10.58
BBB ¹ /Baa ²	6,775,894	13.61	18,200,344	19.89
并未评级	324,645	0.65	14,756,164	16.12
总计	<u>26,750,970</u>	<u>53.74</u>	<u>54,616,921</u>	<u>59.67</u>

中银香港全天候一带一路债券基金

评级	2022年		2021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	1,224,762	7.59	1,003,832	3.52
A ¹ /A ²	4,378,119	27.09	3,354,530	11.78
BBB ¹ /Baa ²	5,359,174	33.17	5,296,145	18.60
BB ¹ /Ba ²	1,776,210	10.99	6,214,824	21.82
并未评级	1,318,204	8.16	7,396,529	25.97
总计	<u>14,056,469</u>	<u>87.00</u>	<u>23,265,860</u>	<u>81.69</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2022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	2022年		2021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	1,991,773	1.58	—	—
A ¹ /A ²	33,324,411	26.22	6,118,076	2.74
BBB ¹ /Baa ²	50,901,967	40.02	196,278	0.07
BB ¹ /Ba ²	7,673,380	6.02	12,439,723	5.54
并未评级	14,099,791	11.10	199,989,762	89.41
总计	<u>107,991,322</u>	<u>84.94</u>	<u>218,743,839</u>	<u>97.76</u>

中银香港全天候亚洲高息债券基金

评级	2022年		2021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	797,610	4.91	—	—
A ¹ /A ²	168,207	1.03	—	—
BBB ¹ /Baa ²	714,029	4.39	1,154,662	3.27
BB ¹ /Ba ²	10,071,178	61.86	22,336,548	62.97
并未评级	3,682,102	22.60	11,691,170	32.95
总计	<u>15,433,126</u>	<u>94.79</u>	<u>35,182,380</u>	<u>99.19</u>

中银香港全天候ESG多元资产基金

评级	2022年	
	美元	占资产净值的百分比 %
AAA ¹ /Aaa ²	2,630,191	9.47
A ¹ /A ²	5,856,984	21.08
BBB ¹ /Baa ²	3,627,252	13.05
BB ¹ /Ba ²	1,613,572	5.81
并未评级	284,559	1.01
总计	<u>14,012,558</u>	<u>50.42</u>

¹ 标准普尔

² 穆迪

9 财务风险管理(续)

(c) 信用及交易对手风险(续)

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。

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2022年及2021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2022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(2021年：A)，对花旗银行香港分行的信用评级为A(2021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账面金额。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处获得，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。

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2022年6月30日

9 财务风险管理(续)

(d) 公允价值估计(续)

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
2022年6月30日				
金融资产				
集合投资计划	1,167,634	—	—	1,167,634
上市权益性证券	3,204,759	—	—	3,204,759
挂牌债务证券	—	3,085,395	—	3,085,395
存托凭证	396,618	—	—	396,618
	<u>4,769,011</u>	<u>3,085,395</u>	<u>—</u>	<u>7,854,406</u>
金融负债				
外汇远期合约	—	81	—	81
可赎回份额(按成交价)	—	8,106,699	—	8,106,699
	<u>—</u>	<u>8,106,780</u>	<u>—</u>	<u>8,106,780</u>
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>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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
2022年6月30日				
金融资产				
集合投资计划	12,220,800	3,765,094	—	15,985,894
外汇远期合约	—	142,023	—	142,023
挂牌债务证券	—	479,938,523	—	479,938,523
	<u>12,220,800</u>	<u>483,845,640</u>	<u>—</u>	<u>496,066,440</u>
金融负债				
外汇远期合约	—	1,558,151	—	1,558,151
可赎回份额(按成交价)	—	518,724,734	—	518,724,734
	<u>—</u>	<u>520,282,885</u>	<u>—</u>	<u>520,282,885</u>
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>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2022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
2022年6月30日				
金融资产				
上市权益性证券	157,868,723	–	–	157,868,723
外汇远期合约	–	33,220	–	33,220
	<u>157,868,723</u>	<u>33,220</u>	<u>–</u>	<u>157,901,943</u>
金融负债				
外汇远期合约	–	29,025	–	29,025
可赎回份额(按成交价)	–	178,931,872	–	178,931,872
	<u>–</u>	<u>178,960,897</u>	<u>–</u>	<u>178,960,897</u>
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>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2022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
2022年6月30日				
金融资产				
上市权益性证券	291,618,528	—	—	291,618,528
	<u>291,618,528</u>	<u>—</u>	<u>—</u>	<u>291,618,528</u>
金融负债				
外汇远期合约	—	386,374	—	386,374
可赎回份额(按成交价)	—	301,337,746	—	301,337,746
	<u>—</u>	<u>301,724,120</u>	<u>—</u>	<u>301,724,120</u>
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>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2022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
2022年6月30日				
金融资产				
集合投资计划	2,658,143	—	—	2,658,143
挂牌债务证券	—	97,112,540	—	97,112,540
	<u>2,658,143</u>	<u>97,112,540</u>	<u>—</u>	<u>99,770,683</u>
金融负债				
外汇远期合约	—	62,766	—	62,766
可赎回份额(按成交价)	—	105,492,085	—	105,492,085
	<u>—</u>	<u>105,554,851</u>	<u>—</u>	<u>105,554,851</u>
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>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2022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
2022年6月30日				
金融资产				
上市权益性证券	3,429,967	—	—	3,429,967
存托凭证	234,010	—	—	234,010
外汇远期合约	—	1,211	—	1,211
	<u>3,663,977</u>	<u>1,211</u>	<u>—</u>	<u>3,665,188</u>
金融负债				
可赎回份额(按成交价)	—	3,751,603	—	3,751,603
	<u>—</u>	<u>3,751,603</u>	<u>—</u>	<u>3,751,603</u>
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>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2022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
2022年6月30日				
金融资产				
集合投资计划	1,633,555	—	—	1,633,555
上市权益性证券	37,223,419	—	—	37,223,419
外汇远期合约	—	63,724	—	63,724
挂牌债务证券	—	23,517,242	—	23,517,242
	<u>38,856,974</u>	<u>23,580,966</u>	<u>—</u>	<u>62,437,940</u>
金融负债				
可赎回份额(按成交价)	—	65,654,932	—	65,654,932
	<u>—</u>	<u>65,654,932</u>	<u>—</u>	<u>65,654,932</u>
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>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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
2022年6月30日				
金融资产				
集合投资计划	282,603	—	—	282,603
外汇远期合约	—	10,348	—	10,348
上市权益性证券	6,041,552	—	—	6,041,552
挂牌债务证券	—	1,182,149	—	1,182,149
	<u>6,324,155</u>	<u>1,192,497</u>	<u>—</u>	<u>7,516,652</u>
金融负债				
外汇远期合约	—	3,781	—	3,781
可赎回份额(按成交价)	—	8,828,573	—	8,828,573
	<u>—</u>	<u>8,832,354</u>	<u>—</u>	<u>8,832,354</u>
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>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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
2022年6月30日				
金融资产				
挂牌债务证券	–	26,750,970	–	26,750,970
外汇远期合约	–	20,958	–	20,958
	<u>–</u>	<u>26,771,928</u>	<u>–</u>	<u>26,771,928</u>
金融负债				
可赎回份额(按成交价)	–	49,775,491	–	49,775,491
	<u>–</u>	<u>49,775,491</u>	<u>–</u>	<u>49,775,491</u>
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
	<u>–</u>	<u>54,654,849</u>	<u>–</u>	<u>54,654,849</u>
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
	<u>–</u>	<u>91,670,392</u>	<u>–</u>	<u>91,670,392</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2022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
2022年6月30日				
金融资产				
上市权益性证券	1,401,379	—	—	1,401,379
集合投资计划	304,245	—	—	304,245
挂牌债务证券	—	14,056,469	—	14,056,469
	<u>1,705,624</u>	<u>14,056,469</u>	<u>—</u>	<u>15,762,093</u>
金融负债				
外汇远期合约	—	16,684	—	16,684
可赎回份额(按成交价)	—	16,158,613	—	16,158,613
	<u>—</u>	<u>16,175,297</u>	<u>—</u>	<u>16,175,297</u>
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>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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
2022年6月30日				
金融资产				
集合投资计划	2,998,890	—	—	2,998,890
上市权益性证券	9,570,420	—	—	9,570,420
挂牌债务证券	—	107,991,322	—	107,991,322
	<u>12,569,310</u>	<u>107,991,322</u>	<u>—</u>	<u>120,560,632</u>
金融负债				
外汇远期合约	—	58,780	—	58,780
可赎回份额(按成交价)	—	127,136,673	—	127,136,673
	<u>—</u>	<u>127,195,453</u>	<u>—</u>	<u>127,195,453</u>
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>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2022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
2022年6月30日				
金融资产				
集合投资计划	—	416,336	—	416,336
挂牌债务证券	—	15,433,126	—	15,433,126
	<u>—</u>	<u>15,433,126</u>	<u>—</u>	<u>15,433,126</u>
	<u>—</u>	<u>15,849,462</u>	<u>—</u>	<u>15,849,462</u>
金融负债				
外汇远期合约	—	12,963	—	12,963
可赎回份额(按成交价)	—	16,307,801	—	16,307,801
	<u>—</u>	<u>16,307,801</u>	<u>—</u>	<u>16,307,801</u>
	<u>—</u>	<u>16,320,764</u>	<u>—</u>	<u>16,320,764</u>
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
	<u>—</u>	<u>35,182,380</u>	<u>—</u>	<u>35,182,380</u>
	<u>—</u>	<u>35,590,043</u>	<u>—</u>	<u>35,590,043</u>
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
	<u>—</u>	<u>35,522,803</u>	<u>—</u>	<u>35,522,803</u>
	<u>—</u>	<u>35,632,505</u>	<u>—</u>	<u>35,632,505</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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ESG多元资产基金

	第一层级 美元	第二层级 美元	第三层级 美元	总计 美元
2022年6月30日				
金融资产				
存托凭证	408,750	—	—	408,750
上市权益性证券	11,643,250	—	—	11,643,250
挂牌债务证券	—	14,012,558	—	14,012,558
	<u>12,052,000</u>	<u>14,012,558</u>	<u>—</u>	<u>26,064,558</u>
金融负债				
外汇远期合约	—	35,138	—	35,138
可赎回份额(按成交价)	—	27,822,532	—	27,822,532
	<u>—</u>	<u>27,857,670</u>	<u>—</u>	<u>27,857,670</u>

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。

于截至2022年及2021年6月30日止年度，第一层级与第二层级之间并无转拨，亦无转入或转出第三层级。

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

9 财务风险管理(续)

(d) 公允价值估计(续)

按该价格进行。由于子基金按报价提供其股份的日常流动性，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。

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、应计费用、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

2022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资产净值：

于2022年6月30日

	中银香港全天候			中银香港全天候			中银香港全天候			中银香港全天候			中银香港全天候		
	环球投资基金			中国高息债券基金			香港股票基金			在岸人民币股票基金			亚洲债券基金		
	已发行 份额数目	每份 资产净值	每份 资产净值	已发行 份额数目	每份 资产净值	每份 资产净值	已发行 份额数目	每份 资产净值	每份 资产净值	已发行 份额数目	每份 资产净值	每份 资产净值	已发行 份额数目	每份 资产净值	每份 资产净值
- A1类份额	130,664,8880美元	9.38美元	人民币5.80元	人民币27,668,476,4600元	人民币5.80元	13,018,692,6680港元	9.52港元	人民币2,744,744,5790元	人民币11.65元	3,690,716,2070美元	7.59美元	37,708,1180美元	8.14美元		
- A2类份额	3,784,545,8340港元	9.49港元	5.33美元	772,651,3220美元	5.33美元	228,682,0350美元	9.41美元	814,706,4100美元	10.81美元	30,735,223,3710港元	7.68港元	1,256,578,4480港元	8.21港元		
- A3类份额	983,4770澳元	12.64澳元	5.40港元	32,061,579,2160港元	5.40港元	52,969,3980澳元	9.24澳元	15,957,728,1280港元	10.94港元	-	-	-	-	-	-
- A4类份额	-	-	5.24澳元	431,106,1500澳元	5.24澳元	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
- A7类份额	-	-	-	-	-	人民币371,332,5610元	人民币	-	-	人民币	人民币8.31元	人民币95,317,7390元	人民币8.47元		
- A8类份额	-	-	8.84美元	1,854,554,5420美元	8.84美元	-	-	-	-	17,707,387,1330元	-	-	-	-	-
- A9类份额	-	-	-	-	-	-	-	4,421,443,4000港元	10.12港元	-	-	-	-	-	-
- I1类份额	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
- I2类份额	-	-	-	-	-	105,542,4270美元	9.50美元	253,432,7620美元	10.94美元	-	-	-	-	-	-
- X1类份额	-	-	人民币5.08元	人民币12,378,103,3610元	人民币5.08元	1,219,772,4190港元	9.01港元	-	-	2,670,707,1540美元	9.51美元	-	-	-	-
- X2类份额	1,691,153,8370港元	10.65港元	-	-	-	151,515,1510美元	10.06美元	-	-	-	-	1,775,172,8010港元	8.88港元	-	-
- X3类份额	-	-	-	-	-	-	-	491,035,0000港元	11.20港元	-	-	-	-	-	-

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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2022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	每份 资产净值	已发行 份额数目	每份 资产净值	每份 资产净值	已发行 份额数目	每份 资产净值	每份 资产净值	已发行 份额数目	每份 资产净值	每份 资产净值	已发行 份额数目	每份 资产净值	每份 资产净值	已发行 份额数目	每份 资产净值	每份 资产净值
- A1类份额	6,668,895,6280港元	5.83港元	6.63美元	171,025,6240美元	6.63美元	10.37美元	963,097,6850美元	8.12美元	8.12美元	529,531,4360美元	8.12美元	8.12美元	2,621,867,3210美元	7.68美元	7.68美元	580,572,1090美元	5.79美元	5.79美元
- A2类份额	158,287,3640美元	5.82美元	6.63港元	5,487,311,8560港元	6.63港元	10.39港元	14,628,045,4000港元	8.12港元	8.12港元	5,786,079,0300港元	8.12港元	8.12港元	57,859,545,0280港元	7.68港元	7.68港元	8,674,501,6070港元	5.87港元	5.87港元
- A3类份额	-	-	-	-	-	人民币145,306,8330元	人民币145,306,8330元	-	-	-	-	-	17,567,953,9160澳门元	7.68澳门元	7.68澳门元	-	-	-
- A4类份额	-	-	6.09澳元	94,382,5800澳元	6.09澳元	-	-	-	-	-	-	-	人民币3,868,103,3240元	人民币7.65元	人民币7.65元	90,547,5340澳元	5.79澳元	5.79澳元
- A7类份额	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	35,664,6110英镑	5.76英镑	5.76英镑
- A8类份额	人民币1,110,268,7350元	人民币6.16元	人民币6.89元	人民币1,022,067,7670元	人民币6.89元	-	-	人民币4,599,251,3280元	人民币8.54元	-	-	-	-	-	-	人民币2,288,391,6630元	人民币6.02元	人民币6.02元
- A9类份额	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	33,814,1210欧元	5.80欧元	5.80欧元
- A10类份额	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
- A11类份额	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	人民币17,013,271,3340元	人民币8.08元	人民币8.08元	-	-	-
- II类份额	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
- X1类份额	1,814,728,3930港元	6.29港元	7.25美元	132,095,0000美元	7.25美元	10.47美元	1,169,678,3860美元	10.47美元	10.47美元	-	-	-	1,022,423,6910美元	8.56美元	8.56美元	-	-	-
- X2类份额	-	-	6.75美元	761,035,0070美元	6.75美元	10.51港元	5,942,583,9170港元	10.51港元	10.51港元	-	-	-	-	-	-	4,157,160,1640港元	6.71港元	6.71港元

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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2022年6月30日(续)

	中银香港全天候ESG多元资产基金	
	已发行 份额数目	每份额 资产净值
– A1类份额	699,443.9880美元	7.80美元
– A2类份额	9,444,800.8320港元	7.88港元
– A3类份额	–	–
– A4类份额	316,864.1080澳元	7.72澳元
– A7类份额	91,666.5200英镑	7.75英镑
– A8类份额	–	–
– A9类份额	人民币3,757,096.8420元	人民币7.91元
– A10类份额	42,619.2670欧元	7.75欧元
– I1类份额	499,998.0000美元	8.07美元
– I2类份额	–	–
– X1类份额	–	–
– X2类份额	1,413,527.5370港元	8.22港元
– X3类份额	–	–

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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

	中银香港全天候		中银香港全天候		中银香港全天候		中银香港全天候		中银香港全天候		中银香港全天候	
	环球投资基金		中国高息债券基金		香港股票基金		在岸人民币股票基金		亚洲债券基金		亚洲(日本除外)股票基金	
	已发行	每份 资产净值	已发行	每份 资产净值	已发行	每份 资产净值	已发行	每份 资产净值	已发行	每份 资产净值	已发行	每份 资产净值
	份额数目		份额数目		份额数目		份额数目		份额数目		份额数目	
- A1类份额	140,355,141.0美元	12.36美元	人民币34,035,054,304.0元	人民币10.05元	11,933,549,706.0港元	13.37港元	人民币3,598,836,313.0元	人民币13.71元	7,397,785,560.0美元	10.05美元	38,144,257.0美元	12.97美元
- A2类份额	3,079,291,385.0港元	12.36港元	659,201,353.0美元	9.56美元	222,056,109.0美元	13.36美元	996,897,926.0美元	13.17美元	44,913,587,644.0港元	10.06港元	1,288,163,231.0港元	12.94港元
- A3类份额	983,477.0港元	16.98港元	34,451,769.7120港元	9.58港元	19,343,558.0港元	13.22港元	18,097,520.2160港元	13.19港元	-	-	-	-
- A4类份额	-	-	485,614.8720港元	9.33港元	-	-	-	-	-	-	-	-
- A7类份额	-	-	-	-	人民币216,309,986.0元	人民币14.83元	-	-	人民币26,167,586,954.0元	人民币10.71元	人民币131,058,125.0元	人民币13.22元
- A8类份额	-	-	2,732,601.0620美元	9.07美元	-	-	-	-	-	-	-	-
- A9类份额	-	-	-	-	-	-	4,073,784,098.0港元	12.12港元	-	-	-	-
- I1类份额	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	97,560,975.0美元	13.07美元
- I2类份额	-	-	-	-	500,409,159.0美元	13.44美元	253,432,762.0美元	13.21美元	-	-	-	-
- X1类份额	-	-	人民币16,708,665,182.0元	人民币14.34元	3,233,577,648.0港元	12.51港元	-	-	3,548,973,743.0美元	11.97美元	-	-
- X2类份额	1,691,153,837.0港元	13.72港元	-	-	-	-	-	-	-	-	1,353,604,174.0港元	13.79港元
- X3类份额	-	-	-	-	-	-	1,074,498,567.0港元	13.28港元	-	-	-	-

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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				中银香港全天候				中银香港全天候				中银香港全天候				中银香港全天候			
	中国收益基金		亚太高收益基金		短期债券基金		一带一路债券基金		大湾区策略基金		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	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港元	8.07港元	237,666,0200美元	9.54美元	2,297,864,6740美元	10.35美元	663,295,2930美元	10.52美元	3,539,250,9340美元	9.67美元	792,238,3330美元	10.08美元								
- A2类份额	213,156,2870美元	8.12美元	6,468,987,3670港元	9.44港元	19,056,987,2470港元	10.26港元	7,505,137,9460港元	10.41港元	77,525,839,5920港元	9.75港元	11,908,489,5930港元	10.10港元								
- A3类份额	-	-	-	-	人民币100,568,1040元	人民币9.71元	-	-	20,407,402,5020澳门元	9.74澳门元	-	-								
- A4类份额	-	-	95,555,2230澳门元	8.91澳门元	-	-	-	-	人民币	人民币9.47元	106,933,4750澳门元	10.06澳门元								
- A7类份额	-	-	-	-	-	-	-	-	4,775,512,1570元	-	-	-								
- A8类份额	人民币8.33元	人民币9.71元	人民币	人民币9.71元	-	-	人民币	人民币10.79元	-	-	39,458,8680英镑	10.03英镑								
	2,082,637,9310元		1,069,935,2630元				6,856,497,7310元													
- A9类份额	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	人民币2,945,757,3970元	人民币10.28元								
- A10类份额	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	34,498,7120欧元	10.07欧元								
- A11类份额	-	-	-	-	-	-	-	-	人民币	人民币10.09元	-	-								
									21,297,889,4570元											
- I1类份额	-	-	-	-	3,420,196,6280美元	10.39美元	-	-	500,000,0000美元	10.74美元	-	-								
- X1类份额	2,668,213,4570港元	8.27港元	199,004,9750美元	9.83美元	117,509,9630美元	10.42美元	-	-	2,027,520,0120美元	10.43美元	-	-								
- X2类份额	-	-	-	-	4,243,473,5930港元	10.35港元	-	-	-	-	4,157,160,1640港元	10.74港元								

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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：

	2022年		2021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	1,789,400美元	2,371美元	9,996,400美元	10,762美元
中银香港全天候香港股票基金	2,149,489,258港元	2,430,892港元	1,258,520,039港元	1,322,577港元
中银香港全天候在岸人民币股票基金	人民币255,814,755元	人民币324,158元	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	4,087,612美元	5,632美元	9,203,355美元	9,519美元
中银香港全天候中国收益基金	69,757,028港元	88,280港元	83,192,318港元	86,272港元
中银香港全天候亚太高收益基金	28,194,247美元	32,945美元	31,196,668美元	33,609美元
中银香港全天候一带一路债券基金	2,929,272美元	3,549美元	84,963美元	9美元
中银香港全天候大湾区策略基金	2,224,092美元	3,058美元	-	-
中银香港全天候ESG多元资产基金	9,727,813美元	13,394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

2022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：

	2022年	2021年
中银香港全天候环球投资基金	527,153美元	395,874美元
中银香港全天候中国高息债券基金	人民币39,639,349元	人民币17,397,597元
中银香港全天候香港股票基金	20,826,212港元	50,097,933港元
中银香港全天候在岸人民币股票基金	人民币5,905,712元	人民币15,959,442元
中银香港全天候亚洲债券基金	6,501,904美元	966,623美元
中银香港全天候亚洲(日本除外)股票基金	68,336美元	181,237美元
中银香港全天候中国收益基金	2,454,012港元	3,321,241港元
中银香港全天候亚太高收益基金	1,275,074美元	180,158美元
中银香港全天候短期债券基金	2,984,793美元	414,770美元
中银香港全天候一带一路债券基金	351,489美元	1,681,838美元
中银香港全天候大湾区策略基金	8,120,496美元	4,259,100美元
中银香港全天候亚洲高息债券基金	816,186美元	2,198,287美元
中银香港全天候ESG多元资产基金	2,042,808美元	—

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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：

	2022年	2021年
中银香港全天候环球投资基金	19美元	5美元
中银香港全天候中国高息债券基金	人民币1,731元	人民币3,316元
中银香港全天候香港股票基金	8,781港元	2,875港元
中银香港全天候在岸人民币股票基金	人民币2,710元	人民币3,845元
中银香港全天候亚洲债券基金	127美元	857美元
中银香港全天候亚洲(日本除外)股票基金	26美元	19美元
中银香港全天候中国收益基金	694港元	324港元
中银香港全天候亚太高收益基金	201美元	83美元
中银香港全天候短期债券基金	399美元	590美元
中银香港全天候一带一路债券基金	66美元	352美元
中银香港全天候大湾区策略基金	185美元	1,076美元
中银香港全天候亚洲高息债券基金	72美元	213美元
中银香港全天候ESG多元资产基金	110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款证赚取的利息收入如下：

	2022年	2021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	5,969美元	180,823美元

(d) 就基金管理人的关联人及受托人就银行透支支付的利息开支

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银行透支支付的利息开支如下：

	2022年	2021年
中银香港全天候短期债券基金	1,359美元	1,189美元

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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：

	2022年	2021年
中银香港全天候环球投资基金	154美元	174美元
中银香港全天候中国高息债券基金	人民币6,170元	人民币7,847元
中银香港全天候香港股票基金	1,236港元	2,301港元
中银香港全天候在岸人民币股票基金	人民币1,131元	人民币301元
中银香港全天候亚洲债券基金	925美元	1,037美元
中银香港全天候亚洲(日本除外)股票基金	136美元	280美元
中银香港全天候中国收益基金	5,622港元	5,871港元
中银香港全天候亚太高收益基金	306美元	407美元
中银香港全天候短期债券基金	974美元	2,809美元
中银香港全天候一带一路债券基金	376美元	217美元
中银香港全天候大湾区策略基金	1,159美元	784美元
中银香港全天候亚洲高息债券基金	610美元	26美元
中银香港全天候ESG多元资产基金	256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：

	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
基金管理人及其关联人持有的份额¹：				
2022年6月30日				
中银香港全天候环球投资基金				
- A1类	131,278.8350	1,115.8240	(10,595.1960)	121,799.4630
- A2类	3,061,693.5280	1,561,875.1930	(901,544.5270)	3,722,024.1940
- A3类	281.8990	—	—	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	31,579,416.5850	1,234,482.6190	(7,989,101.2910)	24,824,797.9130
- A2类	569,949.3870	196,279.1280	(159,202.7800)	607,025.7350
- A3类	32,595,935.7810	4,483,404.5580	(7,095,729.5300)	29,983,610.8090
- A4类	463,162.3890	21,087.9820	(74,977.3880)	409,272.9830
- A8类	2,731,323.5260	558,409.0250	(1,459,231.6390)	1,830,500.9120
- X1类	16,708,665.1820	—	(4,330,561.8210)	12,378,103.3610

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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
2022年6月30日				
中银香港全天候香港股票基金				
- A1类	9,260,793.9420	3,565,495.2020	(2,168,203.0250)	10,658,086.1190
- A2类	210,720.4890	11,762.4070	(5,136.4810)	217,346.4150
- A3类	18,161.8990	33,625.8400	-	51,787.7390
- A7类	213,098.8670	244,974.4330	(89,951.8580)	368,121.4420
- X1类	3,233,577.6480	638,686.1310	(2,652,491.3600)	1,219,772.4190
- X2类	-	151,515.1510	-	151,515.1510
中银香港全天候在岸人民币股票基金				
- A1类	3,336,005.1110	421,659.7270	(1,344,317.5390)	2,413,347.2990
- A2类	652,447.3480	57,761.7060	(114,565.4350)	595,643.6190
- A3类	14,223,944.1900	2,425,063.7050	(4,156,041.2230)	12,492,966.6720
- A9类	4,059,322.5320	1,812,063.7280	(1,464,404.4280)	4,406,981.8320
- X3类	1,074,498.5670	551,977.9200	(1,135,441.4900)	491,034.9970
中银香港全天候亚洲债券基金				
- A1类	7,329,321.3250	144,199.0490	(3,854,263.2260)	3,619,257.1480
- A2类	44,002,667.1450	1,900,428.6870	(15,862,332.4920)	30,040,763.3400
- A7类	25,549,332.1990	343,148.8610	(8,622,441.4630)	17,270,039.5970
- X1类	3,548,973.7430	-	(878,266.5890)	2,670,707.1540
中银香港全天候亚洲(日本除外)股票基金				
- A1类	38,144.2570	2,291.4560	(2,727.5950)	37,708.1180
- A2类	1,288,163.2310	428,283.1430	(459,867.9260)	1,256,578.4480
- A7类	131,058.1250	1,603.8190	(37,344.2050)	95,317.7390
- X2类	1,353,604.1740	421,568.6270	-	1,775,172.8010
中银香港全天候中国收益基金				
- A1类	8,632,530.8210	634,877.6980	(2,598,512.8910)	6,668,895.6280
- A2类	213,156.2870	1,159.8180	(56,028.7410)	158,287.3640
- A8类	2,070,582.7560	12,704.8700	(985,074.0660)	1,098,213.5600
- X1类	2,668,213.4570	-	(853,485.0640)	1,814,728.3930
中银香港全天候亚太高收益基金				
- A1类	214,982.7550	7,742.5710	(51,699.7020)	171,025.6240
- A2类	6,468,987.3670	762,184.7250	(1,743,860.2360)	5,487,311.8560
- A4类	95,555.2230	2,134.6140	(3,307.2570)	94,382.5800
- A8类	1,067,962.9700	106,912.2250	(152,807.4280)	1,022,067.7670
- X1类	199,004.9750	-	(66,909.9750)	132,095.0000
- X2类	-	761,035.0070	-	761,035.0070

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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
2022年6月30日				
中银香港全天候短期债券基金				
- A1类	2,297,864.6740	12,505.4740	(1,347,272.4630)	963,097.6850
- A2类	19,040,363.1350	2,512,440.0820	(6,929,776.2490)	14,623,026.9680
- A3类	100,568.1040	75,208.3820	(30,469.6530)	145,306.8330
- X1类	117,509.9630	1,052,168.4230	-	1,169,678.3860
- X2类	4,243,473.5930	1,820,551.1470	(121,440.8230)	5,942,583.9170
中银香港全天候一带一路债券基金				
- A1类	663,295.2930	2,690.0460	(136,453.9030)	529,531.436
- A2类	7,478,344.6210	296,469.9770	(2,029,914.3590)	5,744,900.239
- A8类	6,856,497.7310	162,787.8900	(2,420,034.2930)	4,599,251.328
中银香港全天候大湾区策略基金				
- A1类	3,450,629.4550	76,750.7230	(971,203.8380)	2,556,176.3400
- A2类	73,511,632.7350	3,228,452.6890	(20,698,969.9250)	56,041,115.4990
- A3类	20,407,402.5020	1,563,512.0830	(4,402,960.6690)	17,567,953.9160
- A4类	4,416,516.8780	66,592.4020	(704,299.2210)	3,778,810.0590
- A11类	20,730,134.7400	406,615.3470	(4,305,227.3490)	16,831,522.7380
- X1类	2,027,520.0120	-	(1,005,096.3210)	1,022,423.6910
中银香港全天候亚洲高息债券基金				
- A1类	792,238.3330	12,643.6700	(224,309.8940)	580,572.1090
- A2类	11,861,043.0780	1,904,529.9150	(5,141,906.0930)	8,623,666.9000
- A4类	106,933.4750	10,332.6910	(26,718.6320)	90,547.5340
- A7类	39,458.8680	3,097.8740	(6,892.1310)	35,664.6110
- A9类	2,945,757.3970	96,834.6140	(754,200.3480)	2,288,391.6630
- A10类	34,498.7120	1,567.6650	(2,252.2560)	33,814.1210
- X2类	4,157,160.1640	-	-	4,157,160.1640
中银香港全天候ESG多元资产基金				
- A1类	-	722,107.3000	(33,603.6320)	688,503.6680
- A2类	-	10,768,441.8860	(1,323,641.0540)	9,444,800.8320
- A4类	-	399,373.8500	(82,509.7420)	316,864.1080
- A7类	-	99,290.2410	(7,623.7210)	91,666.5200
- A9类	-	4,517,167.8030	(760,070.9610)	3,757,096.8420
- A10类	-	43,321.4290	(702.1620)	42,619.2670
- X2类	-	3,880,000.0000	(2,466,472.4630)	1,413,527.5370

¹ 不包括基金管理人的董事。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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 :	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

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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 :	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。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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2022年 6月30日止年度／ 期间发行的金额	于截至2022年 6月30日止年度／ 期间赎回的金额	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
中银香港全天候环球投资基金	美元	美元	美元	美元
– A1类	13,080	(115,690)	135,022	(41,001)
– A2类	2,223,777	(1,271,066)	3,578,305	(2,745,084)
– A3类	–	–	–	–
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	10,179,632	(65,400,831)	33,741,151	(156,469,633)
– A2类	10,798,798	(7,122,677)	16,479,612	(51,185,077)
– A3类	29,483,716	(42,320,497)	68,830,761	(89,435,893)
– A4类	688,670	(2,166,069)	9,927,677	(5,309,034)
– A8类	24,433,613	(59,963,178)	28,038,995	(62,401,656)
– X1类	–	(45,300,000)	–	(62,000,000)
中银香港全天候香港股票基金	港元	港元	港元	港元
– A1类	37,247,865	(25,029,181)	38,296,412	(31,251,232)
– A2类	1,045,834	(487,009)	3,644,015	(11,053,003)
– A3类	1,792,309	–	1,255,336	(2,688,336)
– A7类	3,559,437	(1,302,418)	2,810,958	(893,480)
– X1类	7,000,000	(23,437,600)	25,000,000	(19,313,084)
– X2类	15,546,200	–	–	(9,618,276)
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	5,063,953	(15,104,933)	34,986,797	(27,916,451)
– A2类	5,066,963	(8,814,488)	39,538,740	(63,276,551)
– A3类	24,583,517	(41,543,877)	76,723,269	(72,063,932)
– A9类	16,964,469	(13,365,245)	68,026,494	(45,436,837)
– X3类	4,881,606	(10,864,910)	12,477,626	–

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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2022年 6月30日止年度／ 期间发行的金额	于截至2022年 6月30日止年度／ 期间赎回的金额	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
中银香港全天候亚洲债券基金	美元	美元	美元	美元
– A1类	1,431,146	(36,701,482)	46,319,970	(32,346,560)
– A2类	2,280,251	(18,591,646)	38,266,193	(33,193,821)
– A7类	549,583	(13,311,317)	33,156,238	(9,907,996)
– X1类	–	(9,605,128)	–	–
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	28,286	(30,473)	231,399	(163,698)
– A2类	593,873	(573,246)	1,629,262	(988,237)
– A7类	2,565	(65,095)	195,531	(300,580)
– X1类	–	–	–	(713,500)
– X2类	549,359	–	–	(1,877,986)
中银香港全天候中国收益基金	港元	港元	港元	港元
– A1类	4,346,642	(16,304,651)	7,782,881	(24,969,440)
– A2类	59,608	(2,935,656)	583,392	(6,957,051)
– A8类	109,237	(8,284,944)	380,323	(4,290,238)
– X1类	–	(6,000,000)	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	71,207	(428,985)	939,941	(1,382,638)
– A2类	781,331	(1,831,269)	23,620,321	(28,203,467)
– A4类	13,766	(17,046)	88,388	(301,896)
– A8类	149,317	(200,020)	6,265,680	(10,681,698)
– X1类	–	(550,000)	2,000,000	–
– X2类	639,018	–	–	–
中银香港全天候短期债券基金	美元	美元	美元	美元
– A1类	129,811	(13,989,568)	28,921,233	(65,456,579)
– A2类	3,325,217	(9,176,282)	26,443,047	(24,381,487)
– A3类	113,243	(45,857)	69,440	(37,551)
– X1类	11,000,000	–	8,000,000	(11,120,436)
– X2类	2,435,960	(162,350)	94,625,456	(96,591,640)

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2022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2022年 6月30日止年度/ 期间发行的金额	于截至2022年 6月30日止年度/ 期间赎回的金额	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
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	25,995	(1,298,500)	2,754,890	(4,354,800)
– A2类	376,660	(2,381,522)	3,859,010	(4,076,926)
– A8类	265,975	(3,843,471)	7,553,569	(1,337,464)
中银香港全天候大湾区策略基金	美元	美元	美元	美元
– A1类	719,504	(8,528,505)	19,525,460	(15,088,299)
– A2类	3,935,666	(23,381,257)	73,617,264	(51,012,400)
– A3类	1,826,701	(5,043,447)	15,659,744	(28,856,663)
– A4类	95,310	(960,138)	4,481,072	(935,513)
– A11类	598,688	(6,251,260)	20,894,805	(6,565,609)
– X1类	–	(9,605,128)	–	–
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	103,298	(1,789,070)	12,720,487	(4,778,000)
– A2类	2,336,909	(4,833,574)	22,283,842	(6,869,582)
– A4类	75,578	(180,190)	2,311,702	(1,711,402)
– A7类	36,140	(91,146)	2,332,824	(1,982,165)
– A9类	136,106	(971,280)	5,973,595	(1,791,454)
– A10类	15,930	(18,772)	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
2022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2022年 6月30日止年度／ 期间发行的金额 美元	于截至2022年 6月30日止年度／ 期间赎回的金额 美元
中银香港全天候ESG多元资产基金		
– A1类	7,208,952	(289,350)
– A2类	13,806,214	(1,442,029)
– A4类	2,944,112	(493,543)
– A7类	1,369,265	(86,660)
– A9类	6,886,294	(1,048,608)
– A10类	512,701	(5,760)
– X2类	4,992,408	(2,680,592)
	于年初／期初／ 董事委任日期 尚未行使的份额	于年末／期末／ 董事辞任日期 尚未行使的份额
基金管理人的董事持有的份额：	于年内／期内 发行的份额	于年内／期内 赎回的份额
2022年6月30日		
中银香港全天候香港股票基金		
– A1类	30,033.0820	–
		–
中银香港全天候在岸人民币股票基金		
– A3类	44,768.9170	–
– A9类	326,661.3760	–
		–
中银香港全天候短期债券基金		
– A1类	17,600.0000	–
– A2类	190,474.3320	–
– A2类	34,758.9680	–
		–
中银香港全天候亚洲高息债券基金		
– A1类	1,542.8140	–
		–

¹ 这些份额由截至2022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

2022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)	190,474.3320
– 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

2022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2022年6月30日及2021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2022年 6月30日 收盘时的持股	购买 港元	出售 港元	于2022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	-	-	(523,735)	-	-
	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)	-	-

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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

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2022年6月30日及2021年6月30日上述子基金投资的股份数目及金额如下：

	于2022年 6月30日 收盘时的持股	于2021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2022年 6月30日 的市值 美元	于2022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							
BANK OF CHINA HONG KONG LTD 5.9% S/A PERP REGS	-	-	331,228	(325,349)	(5,879)	-	-
		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	6,672,282	-	-	(2,907,188)	3,765,094	0.73%
		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	-	-	33,126,840	(34,405,585)	1,278,745	-	-
中国银行股份有限公司－H股	-	-	12,180,000	(12,040,000)	(140,000)	-	-
		人民币	人民币	人民币	人民币	人民币	
中银香港全天候在岸人民币股票基金							
中银航空租赁有限公司	120,000	-	6,065,013	-	686,489	6,751,502	2.24%

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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2022年 6月30日 收盘时的持股	于2021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2022年 6月30日 的市值 美元	于2022年 6月30日 占资产净值 的百分比%
中银香港全天候亚洲债券基金							
BANK OF CHINA HONG KONG LTD 2.8% S/ A 09JUL2023	-	-	1,390,670	(1,390,207)	(463)	-	-
BANK OF CHINA HONG KONG LTD 1.33% S/A 17FEB2024	1,000,000	-	128,294	-	(4,163)	124,131	0.12%
BANK OF CHINA/MACAU S+0.78% Q 28APR2025	1,710,000	-	1,710,000	-	3,277	1,713,277	1.62%
BANK OF CHINA LTD 5% S/A 13NOV2024 REGS	400,000	2,790,575	-	(2,177,853)	(200,067)	412,655	0.39%
BOC AVIATION LTD 2.375% S/A 15SEP2021 REGS	-	200,296	-	(200,000)	(296)	-	-
BOC AVIATION LTD 3.25% S/A 29APR2025 REGS	2,000,000	2,737,514	-	(624,410)	(149,470)	1,963,634	1.86%
		美元	美元	美元	美元	美元	
中银香港全天候亚太高收益基金							
中银香港(控股)有限公司	150,000	-	919,493	(337,391)	10,458	592,561	6.71%
中国银行股份有限公司-H股	400,000	-	430,308	(270,222)	(540)	159,545	1.81%
中银航空租赁有限公司	-	-	187,491	(189,702)	2,211	-	-
		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 3% S/A 14FEB2022	-	-	1,217,760	(1,200,000)	(17,760)	-	-

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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2022年 6月30日 收盘时的持股	于2021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2022年 6月30日 的市值 美元	于2022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							
BANK OF CHINA LTD 3.6% A PERP	-	-	422,080	(421,380)	(700)	-	-
BANK OF CHINA/MACAU S+0.78% Q 28APR2025	430,000	-	430,000	-	824	430,824	2.67%
中银香港盈荟系列 - 中银香港全天候香港股票基金 - X1							
	-	813,528	-	(523,735)	(289,793)	-	-
		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 HONG KONG LTD 2.8% S/A 09JUL2023	-	-	1,390,670	(1,390,207)	(463)	-	-
BOC AVIATION LTD 2.75% S/A 02DEC2023	-	777,799	-	(779,596)	1,797	-	-
BANK OF CHINA HONG KONG LTD 1.33% S/A 17FEB2024	4,000,000	-	513,176	-	(16,652)	496,524	0.39%
中银香港(控股)有限公司	100,000	-	376,748	-	18,292	395,040	0.31%
中银航空租赁有限公司	50,000	-	385,313	-	34,895	420,208	0.33%
BOC AVIATION LTD 3.25% S/A 29APR2025 REGS	2,000,000	3,175,462	-	(997,869)	(213,958)	1,963,634	1.54%
BANK OF CHINA LTD/HONG KONG 3.625% S/A 17APR2029	-	700,506	-	(629,069)	(71,437)	-	-
		美元	美元	美元	美元	美元	
中银香港全天候ESG多元资产基金							
BANK OF CHINA LTD 3.6% A PERP	-	-	633,120	(632,070)	(1,050)	-	-
BANK OF CHINA/MACAU S+0.78% Q 28APR2025	430,000	-	430,000	-	824	430,824	1.55%

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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 亚洲(日本除外)股票基金－X1	–	553,000	–	(713,500)	(160,500)	–	–
BOC AVIATION LTD 2.625% S/A 17SEP2030 REGS	–	–	197,059	(198,354)	(1,295)	–	–
		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	7,413,405	–	–	(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 亚洲(日本除外)股票基金－X2	–	10,917,248	–	(14,568,899)	3,651,651	–	–

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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)	(30,799)	-	-
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)	5,305	-	-
HK.2388中银香港(控股)有限公司	-	95,413	-	(83,323)	(12,090)	-	-
		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/HONG KONG 2.8% S/A 14JAN2023	-	-	1,269,724	(1,277,731)	(8,007)	-	-
BOC AVIATION LTD 2.75% S/A 02DEC2023	-	-	3,095,988	(3,134,907)	(38,919)	-	-

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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.BCHKX1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	813,527	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	640,000	729,172	-	-	(28,666)	700,506	0.31%
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)	(2,493,709)	777,723	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

2022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) 基金管理人的关联人赚取的費用

在截至2022年及2021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：

	2022年	2021年
中银香港全天候环球投资基金	2,217美元	26,536美元
中银香港全天候中国高息债券基金	人民币553,608元	人民币1,051,578元
中银香港全天候香港股票基金	170,953港元	366,713港元
中银香港全天候在岸人民币股票基金	人民币577,554元	人民币1,938,185元
中银香港全天候亚洲债券基金	41,489美元	1,285,648美元
中银香港全天候亚洲(日本除外)股票基金	647美元	9,900美元
中银香港全天候中国收益基金	2,972港元	42,840港元
中银香港全天候亚太高收益基金	—	54,621美元
中银香港全天候短期债券基金	10,233美元	32,576美元
中银香港全天候一带一路债券基金	9,424美元	187,202美元
中银香港全天候大湾区策略基金	49,400美元	962,364美元
中银香港全天候亚洲高息债券基金	11,915美元	480,791美元
中银香港全天候ESG多元资产基金	423,670美元	—

(i) 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：

	2022年	2021年
中银香港全天候中国高息债券基金	人民币201,216元	人民币386,822元
中银香港全天候香港股票基金	—	172,680港元
中银香港全天候中国收益基金	—	101,748港元
中银香港全天候亚太高收益基金	—	5,570美元
中银香港全天候大湾区策略基金	8,665美元	—

(j) 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：

	2022年	2021年
中银香港全天候环球投资基金	8,850美元	—
中银香港全天候亚洲债券基金	202,125美元	188,588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	18,000美元	—
中银香港全天候一带一路债券基金	—	6,875美元
中银香港全天候大湾区策略基金	104,450美元	180,031美元

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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)

(k) 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：

	2022年	2021年
中银香港全天候中国高息债券基金	人民币14,400元	人民币14,200元
中银香港全天候亚洲债券基金	2,784美元	2,664美元
中银香港全天候中国收益基金	11,580港元	11,820港元
中银香港全天候亚太高收益基金	904美元	904美元
中银香港全天候一带一路债券基金	1,024美元	755美元
中银香港全天候大湾区策略基金	2,888美元	2,584美元
中银香港全天候亚洲高息债券基金	2,016美元	1,144美元
中银香港全天候ESG多元资产基金	1,184美元	—

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：

中银香港全天候大湾区策略基金	2022年 美元	2021年 美元
归属于份额持有人的资产净值(按成交价)	127,136,673	223,739,254
开办费用的调整	—	(24,747)
归属于份额持有人的资产净值	<u>127,136,673</u>	<u>223,714,507</u>
中银香港全天候亚洲高息债券基金		
	2022年 美元	2021年 美元
归属于份额持有人的资产净值(按成交价)	16,307,801	35,522,803
开办费用的调整	(26,642)	(53,283)
归属于份额持有人的资产净值	<u>16,281,159</u>	<u>35,469,520</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2022年6月30日

13 开办费用(续)

中银香港全天候ESG多元资产基金

	2022年 美元
归属于份额持有人的资产净值(按成交价)	27,822,532
开办费用的调整	(31,565)
归属于份额持有人的资产净值	<u>27,790,967</u>

于2022年6月30日，子基金的余下摊销期如下：

	余下年期
中银香港全天候亚洲高息债券基金	1.00
中银香港全天候ESG多元资产基金	2.00

14 现金及现金等价物

中银香港全天候环球投资基金

	2022年 美元	2021年 美元
银行现金	<u>527,153</u>	<u>395,874</u>

中银香港全天候中国高息债券基金

	2022年 人民币	2021年 人民币
银行现金	<u>39,639,349</u>	<u>17,397,597</u>

中银香港全天候香港股票基金

	2022年 港元	2021年 港元
银行现金	<u>20,826,212</u>	<u>50,097,933</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2022年6月30日

14 现金及现金等价物(续)

中银香港全天候在岸人民币股票基金

	2022年 人民币	2021年 人民币
银行现金	<u>12,351,414</u>	<u>16,374,917</u>

中银香港全天候亚洲债券基金

	2022年 美元	2021年 美元
银行现金	<u>6,501,904</u>	<u>986,533</u>

中银香港全天候亚洲(日本除外)股票基金

	2022年 美元	2021年 美元
银行现金	<u>68,336</u>	<u>181,237</u>

中银香港全天候中国收益基金

	2022年 港元	2021年 港元
银行现金	<u>2,454,012</u>	<u>3,321,241</u>

中银香港全天候亚太高收益基金

	2022年 美元	2021年 美元
银行现金	<u>1,275,074</u>	<u>180,158</u>

中银香港全天候短期债券基金

	2022年 美元	2021年 美元
银行现金	2,984,793	414,770
定期存款	<u>20,044,289</u>	<u>34,710,630</u>
	<u>23,029,082</u>	<u>35,125,400</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2022年6月30日

14 现金及现金等价物(续)

中银香港全天候一带一路债券基金

	2022年 美元	2021年 美元
银行现金	351,489	1,681,838

中银香港全天候大湾区策略基金

	2022年 美元	2021年 美元
银行现金	8,120,496	4,259,100

中银香港全天候亚洲高息债券基金

	2022年 美元	2021年 美元
银行现金	816,186	2,198,287

中银香港全天候ESG多元资产基金

	2022年 美元
银行现金	2,042,808

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。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022年6月30日

15 计息银行借款

中银香港全天候短期债券基金

	2022年 美元	2021年 美元
银行透支，无抵押	—	2,512,293

银行透支以美元计值并于要求时偿还。于2021年6月30日的未偿还余额已于2021年7月7日全数偿还。

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、中银香港全天候亚洲高息债券基金及中银香港全天候亚洲ESG多元资产基金外，基金管理人拟就任何子基金作出分益分配，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。

中银香港全天候中国高息债券基金

	人民币
于2020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净损失	79,269,282
收益分配前的未分配收入	139,592,890
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	(11,116,824)

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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
於2020年6月30日未分配收入	—
年内收益分配总额	
— 以现金	(41,571,488)
— 用作再投资	(7,973,631)
转拨至资本	(90,047,771)
于2021年6月30日未分配收入	—
	人民币
于2021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减少	(423,600,548)
加：财务费用 — 向份额持有人作出的收益分配	29,092,094
加：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的净损失	383,253,606
收益分配前的未分配收入	(11,254,848)
2022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0.12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0.11美元)于2021年10月15日分配	(10,086,510)
2022年中期收益分配(A1类：每个份额人民币0.10元、A2类：每个份额0.10美元、A3类：每个份额0.10港元、A4类：每个份额0.09澳元、A8类：每个份额0.09美元)于2022年1月10日分配	(7,658,926)
2022年中期收益分配(A1类：每个份额人民币0.08元、A2类：每个份额0.08美元、A3类：每个份额0.08港元、A4类：每个份额0.07澳元、A8类：每个份额0.07美元)于2022年4月11日分配	(5,846,377)
2022年末期收益分配(A1类：每个份额人民币0.08元、A2类：每个份额0.07美元、A3类：每个份额0.07港元、A4类：每个份额0.07澳元、A8类：每个份额0.07美元)于2022年7月8日分配	(5,500,281)
年内收益分配总额	
— 以现金	23,108,658
— 用作再投资	5,983,436
从资本转拨	40,346,942
于2022年6月30日未分配收入	—

于2022年6月30日应付给份额持有人的末期股息(现金)为人民币4,287,063元(2021年：人民币9,207,153元)，不包括用作再投资的股息人民币1,213,218元(2021年：人民币1,909,671元)。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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	(13,817,508)
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	(593,955)
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	9,269,462
于2021年6月30日未分配收入	—

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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2021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减少	(38,477,463)
加：财务费用－向份额持有人作出的收益分配	4,637,706
加：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的净损失	32,427,737
收益分配前的未分配收入	(1,412,020)
2022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8月6日分配	(560,412)
2022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9月7日分配	(501,370)
2022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、A8类：每个份额人民币0.035元)于2021年10月8日分配	(464,840)
2022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、A8类：每个份额人民币0.033元)于2021年11月5日分配	(428,210)
2022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、A8类：每个份额人民币0.033元)于2021年12月7日分配	(419,444)
2022年中期收益分配(A1类：每个份额0.030美元、A2类：每个份额0.030港元、A8类：每个份额人民币0.033元)于2022年1月7日分配	(396,865)
2022年中期收益分配(A1类：每个份额0.029美元、A2类：每个份额0.030港元、A8类：每个份额人民币0.032元)于2022年2月10日分配	(353,564)
2022年中期收益分配(A1类：每个份额0.029美元、A2类：每个份额0.030港元、A8类：每个份额人民币0.032元)于2022年3月7日分配	(347,708)
2022年中期收益分配(A1类：每个份额0.027美元、A2类：每个份额0.027港元、A8类：每个份额人民币0.029元)于2022年4月8日分配	(308,084)
2022年中期收益分配(A1类：每个份额0.027美元、A2类：每个份额0.027港元、A8类：每个份额人民币0.029元)于2022年5月10日分配	(298,033)
2022年中期收益分配(A1类：每个份额0.027美元、A2类：每个份额0.027港元、A8类：每个份额人民币0.029元)于2022年6月8日分配	(287,323)
2022年末期收益分配(A1类：每个份额0.026美元、A2类：每个份额0.026港元、A8类：每个份额人民币0.028元)于2022年7月8日分配	(271,853)
年内收益分配总额	
－以现金	(4,245,643)
－用作再投资	(392,063)
从资本转拨	(6,049,726)
于2022年6月30日未分配收入	—

于2022年6月30日应付给份额持有人的末期股息(现金)为245,223美元(2021年：534,165美元)，不包括用作再投资的股息26,630美元(2021年：59,790美元)。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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	(7,581,717)
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	(306,937)
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	4,918,906
于2022年6月30日未分配收入	—

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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2021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减少	(31,371,779)
加：财务费用－向份额持有人作出的收益分配	2,540,328
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损失	27,433,180
收益分配前的未分配收入	(1,398,271)
2022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2021年8月6日分配	(306,228)
2022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2021年9月7日分配	(301,137)
2022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0.024元)于2021年10月8日分配	(290,455)
2022年中期收益分配(A1类：每个份额0.021港元、A2类：每个份额0.021美元、A8类：每个份额人民币0.021元)于2021年11月5日分配	(261,533)
2022年中期收益分配(A1类：每个份额0.019港元、A2类：每个份额0.019美元、A8类：每个份额人民币0.020元)于2021年12月7日分配	(214,020)
2022年中期收益分配(A1类：每个份额0.017港元、A2类：每个份额0.017美元、A8类：每个份额人民币0.018元)于2022年1月7日分配	(186,385)
2022年中期收益分配(A1类：每个份额0.017港元、A2类：每个份额0.017美元、A8类：每个份额人民币0.018元)于2022年2月10日分配	(180,368)
2022年中期收益分配(A1类：每个份额0.017港元、A2类：每个份额0.017美元、A8类：每个份额人民币0.018元)于2022年3月7日分配	(180,367)
2022年中期收益分配(A1类：每个份额0.016港元、A2类：每个份额0.016美元、A8类：每个份额人民币0.017元)于2022年4月8日分配	(169,827)
2022年中期收益分配(A1类：每个份额0.015港元、A2类：每个份额0.015美元、A8类：每个份额人民币0.016元)于2022年5月10日分配	(158,774)
2022年中期收益分配(A1类：每个份额0.015港元、A2类：每个份额0.015美元、A8类：每个份额人民币0.016元)于2022年6月8日分配	(142,533)
2022年末期收益分配(A1类：每个份额0.016港元、A2类：每个份额0.016美元、A8类：每个份额人民币0.017元)于2022年7月8日分配	(148,701)
年内收益分配总额	
－以现金	(2,137,441)
－用作再投资	(402,887)
从资本转拨	3,938,599
于2022年6月30日未分配收入	—

于2022年6月30日应付给份额持有人的末期股息(现金)为122,811港元(2021年：261,545港元)，不包括用作再投资的股息25,890港元(2021年：45,392港元)。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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)
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)
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
于2021年6月30日未分配收入	-

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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2021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	(3,910,160)
加：财务费用－向份额持有人作出的收益分配	401,024
加：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的净损失	3,251,800
收益分配前的未分配收入	(257,336)
2022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2021年8月6日分配	(45,217)
2022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2021年9月7日分配	(43,576)
2022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2021年10月8日分配	(39,774)
2022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2021年11月5日分配	(39,917)
2022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2021年12月7日分配	(34,400)
2022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2022年1月7日分配	(31,029)
2022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2022年2月10日分配	(29,912)
2022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2022年3月7日分配	(30,046)
2022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2022年4月8日分配	(27,317)
2022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2022年5月10日分配	(26,844)
2022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2022年6月8日分配	(26,853)
2022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2022年7月8日分配	(26,139)
年内收益分配总额	
－以现金	(381,389)
－用作再投资	(19,635)
从资本转拨	658,360
于2022年6月30日未分配收入	—

于2022年6月30日应付给份额持有人的末期股息(现金)为24,760美元(2021年：42,635美元)，不包括用作再投资的股息1,379美元(2021年：2,158美元)。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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	(2,694,330)
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	(95,206)
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	1,426,754
于2022年6月30日未分配收入	—

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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2021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减少	(5,483,503)
加：财务费用－向份额持有人作出的收益分配	857,397
加：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的净损失	4,329,998
收益分配前的未分配收入	(296,108)
2022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0.036元)于2021年8月6日分配	(95,007)
2022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0.036元)于2021年9月7日分配	(86,323)
2022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0.035元)于2021年10月8日分配	(82,216)
2022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0.035元)于2021年11月5日分配	(80,198)
2022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、A8类：每个份额人民币0.033元)于2021年12月7日分配	(76,226)
2022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、A8类：每个份额人民币0.033元)于2022年1月7日分配	(72,708)
2022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、A8类：每个份额人民币0.032元)于2022年2月10日分配	(68,719)
2022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、A8类：每个份额人民币0.032元)于2022年3月7日分配	(67,870)
2022年中期收益分配(A1类：每个份额0.028美元、A2类：每个份额0.028港元、A8类：每个份额人民币0.030元)于2022年4月8日分配	(60,537)
2022年中期收益分配(A1类：每个份额0.028美元、A2类：每个份额0.028港元、A8类：每个份额人民币0.030元)于2022年5月10日分配	(57,713)
2022年中期收益分配(A1类：每个份额0.028美元、A2类：每个份额0.028港元、A8类：每个份额人民币0.030元)于2022年6月8日分配	(56,438)
2022年末期收益分配(A1类：每个份额0.027美元、A2类：每个份额0.027港元、A8类：每个份额人民币0.028元)于2022年7月8日分配	(53,442)
年内收益分配总额	
－以现金	(781,751)
－用作再投资	(75,646)
从资本转拨	1,153,505
于2022年6月30日未分配收入	—

于2022年6月30日应付给份额持有人的末期股息(现金)为49,016美元(2021年：84,312美元)，不包括用作再投资的股息4,426美元(2021年：10,894美元)。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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－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)

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)

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

-

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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2021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减少	(41,119,862)
加：财务费用－向份额持有人作出的收益分配	6,257,388
加：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的净损失	33,147,452
收益分配前的未分配收入	(1,715,022)
2022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、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8月6日分配	(665,874)
2022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、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9月7日分配	(650,796)
2022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0.031元、A11类：每个份额人民币0.033元)于2021年10月8日分配	(617,611)
2022年中期收益分配(A1类：每个份额0.030美元、A2类：每个份额0.030港元、A3类：每个份额0.030澳门元、A4类：每个份额人民币0.029元、A11类：每个份额人民币0.031元)于2021年11月5日分配	(565,615)
2022年中期收益分配(A1类：每个份额0.030美元、A2类：每个份额0.030港元、A3类：每个份额0.030澳门元、A4类：每个份额人民币0.028元、A11类：每个份额人民币0.031元)于2021年12月7日分配	(553,411)
2022年中期收益分配(A1类：每个份额0.030美元、A2类：每个份额0.030港元、A3类：每个份额0.030澳门元、A4类：每个份额人民币0.028元、A11类：每个份额人民币0.031元)于2022年1月7日分配	(549,352)
2022年中期收益分配(A1类：每个份额0.029美元、A2类：每个份额0.029港元、A3类：每个份额0.029澳门元、A4类：每个份额人民币0.027元、A11类：每个份额人民币0.030元)于2022年2月10日分配	(489,429)
2022年中期收益分配(A1类：每个份额0.029美元、A2类：每个份额0.029港元、A3类：每个份额0.029澳门元、A4类：每个份额人民币0.027元、A11类：每个份额人民币0.030元)于2022年3月7日分配	(483,844)
2022年中期收益分配(A1类：每个份额0.027美元、A2类：每个份额0.027港元、A3类：每个份额0.027澳门元、A4类：每个份额人民币0.025元、A11类：每个份额人民币0.028元)于2022年4月8日分配	(436,771)
2022年中期收益分配(A1类：每个份额0.027美元、A2类：每个份额0.027港元、A3类：每个份额0.027澳门元、A4类：每个份额人民币0.025元、A11类：每个份额人民币0.028元)于2022年5月10日分配	(425,453)
2022年中期收益分配(A1类：每个份额0.027美元、A2类：每个份额0.027港元、A3类：每个份额0.027澳门元、A4类：每个份额人民币0.025元、A11类：每个份额人民币0.028元)于2022年6月8日分配	(419,088)
2022年末期收益分配(A1类：每个份额0.026美元、A2类：每个份额0.026港元、A3类：每个份额0.026澳门元、A4类：每个份额人民币0.026元、A11类：每个份额人民币0.027元)于2022年7月8日分配	(400,145)
年内收益分配总额	
－以现金	(5,364,901)
－用作再投资	(892,487)
从资本转拨	7,972,410
于2022年6月30日未分配收入	-

于2022年6月30日应付给份额持有人的末期股息(现金)为346,469美元(2021年：563,613美元)，不包括用作再投资的股息53,676美元(2021年：104,479美元)。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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

(3,328,479)

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0.051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	(147,250)

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

—

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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(续)

美元

于2021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减少	(14,011,474)
加：财务费用－向份额持有人作出的收益分配	1,244,590
加：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的净损失	12,538,712
收益分配前的未分配收入	(228,172)
2022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0.051元、A10类：每个份额0.041欧元)于2021年8月6日分配	(146,913)
2022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0.051元、A10类：每个份额0.041欧元)于2021年9月7日分配	(147,137)
2022年中期收益分配(A1类：每个份额0.045美元、A2类：每个份额0.045港元、A4类：每个份额0.045澳元、A7类：每个份额0.045英镑、A9类：每个份额人民币0.046元、A10类：每个份额0.040欧元)于2021年10月8日分配	(133,095)
2022年中期收益分配(A1类：每个份额0.041美元、A2类：每个份额0.041港元、A4类：每个份额0.040澳元、A7类：每个份额0.041英镑、A9类：每个份额人民币0.052元、A10类：每个份额0.036欧元)于2021年11月5日分配	(119,930)
2022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、A7类：每个份额0.038英镑、A9类：每个份额人民币0.045元、A10类：每个份额0.034欧元)于2021年12月7日分配	(103,591)
2022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、A7类：每个份额0.036英镑、A9类：每个份额人民币0.045元、A10类：每个份额0.031欧元)于2022年1月7日分配	(101,025)
2022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、A7类：每个份额0.036英镑、A9类：每个份额人民币0.043元、A10类：每个份额0.031欧元)于2022年2月10日分配	(95,794)

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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(续)

美元

2022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、A7类:每个份额0.036英镑、A9类:每个份额人民币0.043元、A10类:每个份额0.031欧元)于2022年3月7日分配	(96,107)
2022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、A4类:每个份额0.029澳元、A7类:每个份额0.033英镑、A9类:每个份额人民币0.039元、A10类:每个份额0.025欧元)于2022年4月8日分配	(79,816)
2022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、A4类:每个份额0.030澳元、A7类:每个份额0.033英镑、A9类:每个份额人民币0.040元、A10类:每个份额0.026欧元)于2022年5月10日分配	(80,674)
2022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、A4类:每个份额0.028澳元、A7类:每个份额0.031英镑、A9类:每个份额人民币0.037元、A10类:每个份额0.023欧元)于2022年6月8日分配	(76,657)
2022年末期收益分配(A1类:每个份额0.029美元、A2类:每个份额0.029港元、A4类:每个份额0.028澳元、A7类:每个份额0.028英镑、A9类:每个份额人民币0.03元、A10类:每个份额0.020欧元)于2022年7月8日分配	(63,851)
年内收益分配总额	
— 以现金	(1,188,370)
— 用作再投资	(56,220)
从资本转拨	1,472,762
于2022年6月30日未分配收入	—

于2022年6月30日应付给份额持有人的末期股息(现金)为60,551美元(2021年:137,769美元),不包括用作再投资的股息3,300美元(2021年:9,481美元)。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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ESG多元资产基金

美元

于2021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减少	(8,975,984)
加：财务费用－向份额持有人作出的收益分配	831,359
加：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的净损失	7,696,831
收益分配前的未分配收入	(447,794)
2022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、A4类：每个份额0.031澳元、A7类：每个份额0.032英镑、A9类：每个份额人民币0.042元、A10类：每个份额0.026欧元)于2021年11月5日分配	(105,608)
2022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、A4类：每个份额0.031澳元、A7类：每个份额0.032英镑、A9类：每个份额人民币0.042元、A10类：每个份额0.026欧元)于2021年12月7日分配	(103,593)
2022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、A4类：每个份额0.029澳元、A7类：每个份额0.029英镑、A9类：每个份额人民币0.039元、A10类：每个份额0.023欧元)于2022年1月7日分配	(102,306)
2022年中期收益分配(A1类：每个份额0.030美元、A2类：每个份额0.030港元、A4类：每个份额0.029澳元、A7类：每个份额0.030英镑、A9类：每个份额人民币0.037元、A10类：每个份额0.023欧元)于2022年2月10日分配	(99,017)
2022年中期收益分配(A1类：每个份额0.030美元、A2类：每个份额0.030港元、A4类：每个份额0.029澳元、A7类：每个份额0.030英镑、A9类：每个份额人民币0.037元、A10类：每个份额0.023欧元)于2022年3月7日分配	(97,459)
2022年中期收益分配(A1类：每个份额0.028美元、A2类：每个份额0.028港元、A4类：每个份额0.025澳元、A7类：每个份额0.029英镑、A9类：每个份额人民币0.040元、A10类：每个份额0.020欧元)于2022年4月8日分配	(92,600)
2022年中期收益分配(A1类：每个份额0.027美元、A2类：每个份额0.027港元、A4类：每个份额0.024澳元、A7类：每个份额0.028英镑、A9类：每个份额人民币0.035元、A10类：每个份额0.019欧元)于2022年5月10日分配	(83,915)
2022年中期收益分配(A1类：每个份额0.025美元、A2类：每个份额0.025港元、A4类：每个份额0.022澳元、A7类：每个份额0.026英镑、A9类：每个份额人民币0.032元、A10类：每个份额0.015欧元)于2022年6月8日分配	(75,431)
2022年末期收益分配(A1类：每个份额0.025美元、A2类：每个份额0.025港元、A4类：每个份额0.023澳元、A7类：每个份额0.023英镑、A9类：每个份额人民币0.028元、A10类：每个份额0.012欧元)于2022年7月8日分配	(71,430)
年内收益分配总额	
－以现金	(705,254)
－用作再投资	(126,105)
从资本转拨	1,279,153
于2022年6月30日未分配收入	-

于2022年6月30日应付给份额持有人的末期股息(现金)为60,576美元，不包括用作再投资的股息10,854美元。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022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2022年及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。

19 报告期后事项

- (a) 预期将于2022年10月31日推出新基金中银香港全天候中国新动力股票基金，作为中银香港盈荟系列的子基金。
- (b) 于截至2022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、中银香港全天候亚洲高息债券基金及中银香港全天候ESG多元资产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2022年10月14日按每个份额人民币0.04元支付人民币982,699元

A2类

— 于2022年10月14日按每个份额0.03美元支付20,687美元

A3类

— 于2022年10月14日按每个份额0.03港元支付942,482港元

A4类

— 于2022年10月14日按每个份额0.03澳元支付12,961澳元

A8类

— 于2022年10月14日按每个份额0.03美元支付53,426美元

中银香港全天候亚洲债券基金

A1类

— 于2022年8月5日按每个份额0.025美元支付80,001美元

— 于2022年9月7日按每个份额0.025美元支付78,920美元

— 于2022年10月10日按每个份额0.025美元支付78,471美元

A2类

— 于2022年8月5日按每个份额0.026港元支付767,014港元

— 于2022年9月7日按每个份额0.026港元支付724,623港元

— 于2022年10月10日按每个份额0.025港元支付663,623港元

A7类

— 于2022年8月5日按每个份额人民币0.028元支付人民币419,416元

— 于2022年9月7日按每个份额人民币0.028元支付人民币415,407元

— 于2022年10月10日按每个份额人民币0.027元支付人民币345,119元

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022年6月30日

19 报告期后事项(续)

中银香港全天候中国收益基金

A1类

- 于2022年8月5日按每个份额0.015港元支付100,089港元
- 于2022年9月7日按每个份额0.015港元支付100,428港元
- 于2022年10月10日按每个份额0.015港元支付100,397港元

A2类

- 于2022年8月5日按每个份额0.015美元支付2,375美元
- 于2022年9月7日按每个份额0.015美元支付2,398美元
- 于2022年10月10日按每个份额0.015美元支付2,398美元

A8类

- 于2022年8月5日按每个份额人民币0.016元支付人民币17,764元
- 于2022年9月7日按每个份额人民币0.016元支付人民币17,769元
- 于2022年10月10日按每个份额人民币0.016元支付人民币17,774元

中银香港全天候亚太高收益基金

A1类

- 于2022年8月5日按每个份额0.023美元支付3,844美元
- 于2022年9月7日按每个份额0.023美元支付3,617美元
- 于2022年10月10日按每个份额0.022美元支付3,461美元

A2类

- 于2022年8月5日按每个份额0.023港元支付126,594港元
- 于2022年9月7日按每个份额0.023港元支付116,674港元
- 于2022年10月10日按每个份额0.022港元支付112,120港元

A4类

- 于2022年8月5日按每个份额0.021澳元支付1,982澳元
- 于2022年9月7日按每个份额0.021澳元支付1,982澳元
- 于2022年10月10日按每个份额0.020澳元支付1,888澳元

A8类

- 于2022年8月5日按每个份额人民币0.024元支付人民币24,169元
- 于2022年9月7日按每个份额人民币0.024元支付人民币22,964元
- 于2022年10月10日按每个份额人民币0.023元支付人民币21,317元

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022年6月30日

19 报告期后事项(续)

中银香港全天候一带一路债券基金

A1类

- 于2022年8月5日按每个份额0.027美元支付13,922美元
- 于2022年9月7日按每个份额0.027美元支付13,924美元
- 于2022年10月10日按每个份额0.025美元支付12,519美元

A2类

- 于2022年8月5日按每个份额0.027港元支付153,909港元
- 于2022年9月7日按每个份额0.027港元支付146,547港元
- 于2022年10月10日按每个份额0.025港元支付134,405港元

A8类

- 于2022年8月5日按每个份额人民币0.028元支付人民币132,301元
- 于2022年9月7日按每个份额人民币0.028元支付人民币131,579元
- 于2022年10月10日按每个份额人民币0.027元支付人民币123,580元

中银香港全天候大湾区策略基金

A1类

- 于2022年8月5日按每个份额0.025美元支付65,002美元
- 于2022年9月7日按每个份额0.025美元支付64,161美元
- 于2022年10月10日按每个份额0.025美元支付61,803美元

A2类

- 于2022年8月5日按每个份额0.025港元支付1,372,168港元
- 于2022年9月7日按每个份额0.025港元支付1,337,973港元
- 于2022年10月10日按每个份额0.025港元支付1,320,366港元

A3类

- 于2022年8月5日按每个份额0.025澳门元支付436,235澳门元
- 于2022年9月7日按每个份额0.025澳门元支付432,554澳门元
- 于2022年10月10日按每个份额0.025澳门元支付429,558澳门元

A4类

- 于2022年8月5日按每个份额人民币0.025元支付人民币96,015元
- 于2022年9月7日按每个份额人民币0.025元支付人民币95,297元
- 于2022年10月10日按每个份额人民币0.026元支付人民币98,023元

A11类

- 于2022年8月5日按每个份额人民币0.027元支付人民币385,176元
- 于2022年9月7日按每个份额人民币0.026元支付人民币370,679元
- 于2022年10月10日按每个份额人民币0.026元支付人民币311,037元

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022年6月30日

19 报告期后事项(续)

中银香港全天候亚洲高息债券基金

A1类

- 于2022年8月5日按每个份额0.027美元支付15,241美元
- 于2022年9月7日按每个份额0.027美元支付13,943美元
- 于2022年10月10日按每个份额0.026美元支付13,376美元

A2类

- 于2022年8月5日按每个份额0.027港元支付218,547港元
- 于2022年9月7日按每个份额0.028港元支付223,353港元
- 于2022年10月10日按每个份额0.027港元支付214,811港元

A4类

- 于2022年8月5日按每个份额0.025澳元支付2,266澳元
- 于2022年9月7日按每个份额0.025澳元支付2,267澳元
- 于2022年10月10日按每个份额0.024澳元支付2,176澳元

A7类

- 于2022年8月5日按每个份额0.024英镑支付856英镑
- 于2022年9月7日按每个份额0.024英镑支付835英镑
- 于2022年10月10日按每个份额0.023英镑支付800英镑

A9类

- 于2022年8月5日按每个份额人民币0.026元支付人民币57,482元
- 于2022年9月7日按每个份额人民币0.024元支付人民币52,126元
- 于2022年10月10日按每个份额人民币0.023元支付人民币47,858元

A10类

- 于2022年8月5日按每个份额0.016欧元支付516欧元
- 于2022年9月7日按每个份额0.016欧元支付516欧元
- 于2022年10月10日按每个份额0.015欧元支付484欧元

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2022年6月30日

19 报告期后事项(续)

中银香港全天候ESG多元资产基金

A1类

- 于2022年8月5日按每个份额0.025美元支付17,109美元
- 于2022年9月7日按每个份额0.025美元支付16,063美元
- 于2022年10月10日按每个份额0.024美元支付15,370美元

A2类

- 于2022年8月5日按每个份额0.025港元支付227,582港元
- 于2022年9月7日按每个份额0.026港元支付229,464港元
- 于2022年10月10日按每个份额0.025港元支付215,067港元

A4类

- 于2022年8月5日按每个份额0.022澳元支付6,974澳元
- 于2022年9月7日按每个份额0.022澳元支付6,146澳元
- 于2022年10月10日按每个份额0.021澳元支付5,869澳元

A7类

- 于2022年8月5日按每个份额0.020英镑支付1,835英镑
- 于2022年9月7日按每个份额0.021英镑支付1,545英镑
- 于2022年10月10日按每个份额0.020英镑支付1,472英镑

A9类

- 于2022年8月5日按每个份额人民币0.023元支付人民币85,994元
- 于2022年9月7日按每个份额人民币0.022元支付人民币74,438元
- 于2022年10月10日按每个份额人民币0.021元支付人民币69,218元

A10类

- 于2022年8月5日按每个份额0.008欧元支付341欧元
- 于2022年9月7日按每个份额0.009欧元支付384欧元
- 于2022年10月10日按每个份额0.009欧元支付384欧元

20 批准财务报表

受托人及基金管理人于2022年10月28日批准财务报表。

中银香港盈荟系列
中银香港全天候ESG多元资产基金

关于中银香港全天候ESG多元资产基金如何实现其ESG重点的额外信息披露(未经审计)
2022年6月30日

子基金的投资目标是通过符合环境、社会及治理原则(“ESG”)的集中投资,对固定收益证券及股本证券投资组合进行积极资产配置,从而提供中长期的收益及资本增值。ESG重点可根据基金管理人采用的合资格ESG投资选择方法进行计量,该方法基本上整合了子基金投资顾问Amundi Hong Kong Limited理念(“投资顾问理念”)与基金管理人的内部专有ESG评级方法(“ESG评级方法”)。

投资顾问理念是负面筛选与同类最佳ESG评级方法的结合,将潜在投资分为A(最高)至G(最低)级别。评级为D级或以上的公司将被归类为合资格投资,并将列入合资格的ESG投资范围内,而评级为F级或以下的公司将不合格并被剔除。(a)与投资顾问关于有争议行业(包括煤炭及烟草)的ESG政策相抵触及/或(b)不遵守国际公约、国际公认框架或国家法规的公司将被评为F级或以下,因此被负面筛选。评级为E级的公司将纳入ESG评级方法以进一步评估其资格。

除了E级公司,ESG评级方法亦专门用于评估发展中市场的公司,这些市场的ESG发展通常落后于发达市场,而由于数据不足,这些市场无法通过投资顾问理念进行评估。ESG评级方法(包括定量评级及定性调整)是一种动态评级方法,用于在公司的每项环境、社会及治理层面为各个评级因素编配分数,以评估其ESG表现。合共对20个因素进行评分及加权,以得出ESG分数,然后将分数转换为从A到K的评分等级。必要时,将根据基金管理人的深入研究及分析结果对个别公司的评级因素进行定性调整,以得出最终ESG评级。根据ESG评级方法所考虑的前50%投资最终将被归类为合资格并列入合资格的ESG投资范围。

此外,符合国际资本市场协会的绿色债券原则、社会债券原则及/或可持续发展债券指引的任何绿色、社会及/或可持续发展债券亦将被列入合资格的ESG投资范围,而不论上述各个评级模式下发行人的ESG评级如何。

因此,一个合资格的ESG投资范围得以形成,其中包含与子基金的ESG重点相称的所有潜在投资。因此,ESG重点可依循上述方法计量。为监控子基金的ESG重点,基金管理人属下的基金经理将于筛选及评分程序后进行每月检查及投资组合监控,以确定是否通过将其最新可用资产净值的至少70%投资于合资格ESG投资项目以实现其投资目标。内部数据跟踪系统也已设立,在遵循上述ESG筛选标准后,跟踪投资组合内每项持股的最新评估结果。

中银香港盈荟系列
中银香港全天候ESG多元资产基金

关于中银香港全天候ESG多元资产基金如何实现其ESG重点的额外信息披露(未经审计)(续)
2022年6月30日

子基金的受托人将每天对投资组合进行定期监控，以检查及监察在遵循上述ESG筛选标准后其投资目标的实现情况。任何情况下，若发现未有达成投资目标，受托人将及时向基金管理人属下的基金经理反馈，并作出必要的投资组合调整。为确保达到投资目标，会妥善执行相关内部评估流程及专有ESG评分系统并记录在案，而投资团队及基金管理人将每月对合格投资范围及其相关评估和评分摘要文件进行例行检查。

为更好地了解子基金投资组合内与ESG相关的风险状况及敞口，基金管理人定期进行尽职调查。每年均会对每家相关被投资公司进行定性分析。定性分析报告包括被投资公司的一般信息及财务表现分析，以及ESG表现和相关风险评估。评估被投资方ESG表现时，也会参照独立第三方及ESG的研究。

融入Amundi理念：投资顾问通过定期参与，并对6项ESG主题(其中大部分与可持续发展目标(SDG)相关)进行表决，以影响被投资公司的活动或行为。

为了更好地开展管理工作，Amundi制定了参与政策及表决政策。其中经已制定积极参与政策，以促进最佳实践的广泛实行、推动将可持续发展更有效地融入被投资方的治理和营运中、启发被投资方积极求变以管理有关影响、支持被投资方本身朝着更可持续及低碳的业务模式转型。一套严格表决政策也已获采纳，突显一个负责任及多元化的董事会的必要性，以应对环境及社会挑战，并确保董事会及企业有合适定位，和准备好应对向可持续发展及低碳的经济模式的转型。

投资顾问理念的数据平台汇集了来自不同外部数据提供商的原始ESG数据，以构建其专有的ESG工具并每月进行质量检查，而基金管理人在使用ESG评级方法进行其ESG评级时亦从各种数据渠道获取数据，其中包括：

1. 彭博、路孚特、摩根大通ESG (JESG)全球固定收益指数
2. 公司的公开信息，包括年报、ESG报告等。
3. 基金管理人通过与公司进行的会面／电话会议、与行业专家的会议进行的内部分析

原始数据经过清理、重复筛选及错误检查，以确保数据质量，以便融入ESG评级方法中来进行标准化及评分。

中银香港盈荟系列

中银香港全天候ESG多元资产基金

关于中银香港全天候ESG多元资产基金如何实现其ESG重点的额外信息披露(未经审计)(续) 2022年6月30日

诚如上文章节所述，基金管理人使用投资顾问理念作为存取ESG数据的核心模式。ESG评级方法的理念乃由基金管理人独家开发，其中利用第三方来源的数据，并从亚洲的角度补充来自发展中国家的不充分的ESG数据。将根据第三方信息来源，对被投资方的环境、社会及治理层面的合共20个评级因素进行评估及评分。在每个评级因素下，基金管理人属下的基金经理将数据汇集起来，并为每项潜在投资编配具有各自加权因子的因子分数。

中银香港盈荟系列
中银香港全天候ESG多元资产基金

关于中银香港全天候ESG多元资产基金如何实现其ESG重点的定期评估及报告（未经审计）
2022年6月30日

截至2022年6月30日，投资组合中83.8%的相关投资（以资产净值计）与子基金的ESG重点相称。截至2022年6月30日，投资范围的18.6%因子基金的ESG相关筛选而被剔除。为实现子基金的ESG重点，基金管理人已根据合格的ESG投资筛选及选择流程构建了投资组合并进行每月审查及监控，详情请参阅有关子基金于评估期内如何实现其ESG重点的额外信息披露。子基金的投资顾问亦在必要及适当的情况下，遵循“有关子基金如何实现其ESG重点的额外信息披露”一节所详述的完善参与政策及表决政策来进行参与活动。

与子基金的ESG重点相称的相关投资的实际比例乃基于来自合资格ESG投资范围的相关投资（而非来自该投资范围）总价值的实际数据。

因子基金的ESG相关筛选而被剔除的投资范围的实际比例亦以实际数据为依据，但对数据覆盖范围有所限制。虽然合格的ESG投资筛选及选择主要基于投资顾问理念，但由于少数潜在投资不包括在投资顾问理念中，因此这些投资被视为直接通过ESG评级方法进行投资，并按有关子基金如何实现其ESG重点的额外信息披露所述，基于摘取自其他外部数据提供商的补充ESG数据另外进行评估。然而，由于没有清晰的初始投资范围及明确界定范围来摘取这些少量潜在投资，因此无法量化ESG评级方法所剔除的投资范围的实际比例。由于此限制，并考虑到合资格ESG投资筛选及选择主要建基于投资顾问理念，因子基金的ESG相关筛选而被剔除的投资范围的实际比例仅根据投资顾问理念的初始投资范围，以及从该初始投资范围中剔除的实际投资数量计算。由于这次是进行定期评估的第一年，所以没有对当前评估期与上一个评估期进行比较。

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)

2022年6月30日

非上市／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			
澳大利亚			
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA S+0.97% Q 14MAR2027 REGS	100,000	99,683	1.23%
WESTPAC BANKING CORP/NEW ZEALAND 5% S/A PERP	200,000	179,586	2.21%
		<u>279,269</u>	<u>3.44%</u>
印度			
JSW INFRASTRUCTURE LTD 4.95% S/A 21JAN2029 REGS	200,000	160,976	1.98%
新西兰			
BANK OF NEW ZEALAND S+0.81% Q 27JAN2027 REGS	250,000	246,363	3.04%
		<u>507,022</u>	<u>6.25%</u>
上市／挂牌投资			
债务证券			
开曼群岛			
MEITUAN DIANPING 2.125% S/A 28OCT2025 REGS	200,000	181,408	2.24%
中国内地			
SHENZHEN EXPRESSWAY CO LTD 1.75% S/A 08JUL2026	10,000	9,232	0.11%
GUOREN PROPERTY & CASUALTY INSURANCE CO LTD 3.35% S/A 01JUN2026	200,000	185,890	2.29%
		<u>195,122</u>	<u>2.40%</u>
法国			
AXA SA 4.5% S/A PERP	200,000	168,016	2.07%
德国			
ALLIANZ SE 3.5% A PERP	200,000	166,962	2.06%
印度尼西亚			
INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM TBK 6.53% S/A 15NOV2028 REGS	200,000	204,963	2.53%

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)

2022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)			
毛里求斯			
GREENKO WIND PROJECTS MAURITIUS LTD 5.5% S/A 06APR2025 REGS	200,000	189,323	2.34%
荷兰			
MONG DUONG FINANCE HLDGS BV 5.125% S/A 07MAY2029 REGS	250,000	204,487	2.52%
英国			
PHOENIX GROUP HLDGS PLC 5.625% S/A PERP	200,000	187,247	2.31%
英属维尔京群岛			
CHINALCO CAPITAL HLDGS LTD 4.1% S/A PERP	200,000	201,340	2.48%
SUNNY EXPRESS ENTERPRISES CORP 3.35% S/A PERP	200,000	201,196	2.48%
HUARONG FINANCE 2017 CO LTD 4% S/A PERP	300,000	299,580	3.70%
NWD FINANCE BVI LTD 6.15% S/A PERP	200,000	199,143	2.46%
		901,259	11.12%
		2,578,373	31.80%
存托凭证			
美国			
ALIBABA GROUP HLDG LTD-SPONSORED ADR	299	33,990	0.42%
TOYOTA MOTOR COPR-ADR	900	138,753	1.71%
RIO TINTO PLC-SPONSORED ADR	3,000	183,000	2.26%
		355,743	4.39%
台湾			
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO-ADR	500	40,875	0.50%
		396,618	4.89%

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)
2022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
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	6,000	96,078	1.19%
美国			
ISHARES DJ SELECT DIVIDEND INDEX FD	500	58,835	0.73%
SPDR EURO STOXX 50 ETF	3,000	104,370	1.29%
CONSUMER STAPLES SELECT SECTOR SPDR FUND	4,500	324,810	4.01%
HEALTH CARE SELECT SECTOR SPDR FUND	1,400	179,536	2.21%
ISHARES INDIA 50 ETF	2,000	82,060	1.01%
KRANESHARES CSI CHINA INTERNET FUND	8,000	262,080	3.23%
SPDR PORTFOLIO S&P 500 HIGH DIVDIEND ETF	1,500	59,865	0.74%
		1,071,556	13.22%
		1,167,634	14.41%
权益性证券			
澳大利亚			
RIO TINTO LTD	1,200	85,183	1.05%
法国			
LVMH MOET HENNESSAY LOUIS VUITTON SE	300	182,939	2.26%
HERMES INTL	200	223,707	2.76%
		406,646	5.02%
香港			
阿里巴巴集团控股有限公司	6,000	85,558	1.06%
腾讯控股有限公司	1,600	72,259	0.89%
药明生物技术有限公司	4,000	36,599	0.45%
碧桂园控股有限公司	150,000	92,898	1.15%
		287,314	3.55%
日本			
NINTENDO CO LTD	300	129,756	1.60%

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)
2022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)			
美国			
APPLE INC	1,500	205,080	2.53%
AMAZON.COM INC	800	84,968	1.05%
ALPHABET INC-CL C	60	131,247	1.62%
MICROSOFT CORP	700	179,781	2.22%
ARCH RESOURCES INC	400	57,236	0.71%
COSTCO WHOLESALE CORP	500	239,640	2.96%
CROWDSTRIKE HLDGS INC-CL A	700	117,992	1.46%
NVIDIA CORP	1,283	194,490	2.40%
TESLA INC	270	181,823	2.24%
BLACKSTONE INC	1,500	136,845	1.69%
KROGER CO	1,500	70,995	0.88%
MP MATERIALS CORP	1,500	48,120	0.59%
ARCHER DANIELS MIDLAND CO	1,100	85,360	1.05%
ADVANCED MICRO DEVICES INC	1,500	114,705	1.41%
CAMECO CORP	4,000	84,080	1.04%
HILTON WORLDWIDE HLDGS INC	1,000	111,440	1.37%
SERVICENOW INC	250	118,880	1.46%
WELLS FARGO & CO	3,400	133,178	1.64%
		<u>2,295,860</u>	<u>28.32%</u>
		3,204,759	39.54%
外汇远期合约			
买入13,274.00澳元及卖出9,265.25美元 (交易对手：中国银行(香港)有限公司)		(81)	0.00%
		<u>(81)</u>	<u>0.00%</u>
投资总额		7,854,325	96.89%
其他资产净值		<u>252,374</u>	<u>3.11%</u>
于2022年6月30日的资产净值 (按成交价)		<u>8,106,699</u>	<u>100.00%</u>
投资总额，按成本计		<u>9,076,578</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)

2022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
债务证券			
百慕大			
CHINA OIL AND GAS GROUP LTD 4.7% S/A 30JUN2026	1,750,000	10,364,519	2.00%
英属维尔京群岛			
BLUESTAR FINANCE HLDGS LTD 3.875% S/A PERP	1,000,000	6,684,247	1.29%
ELECT GLOBAL INVESTMENTS LTD 4.85% S/A PERP	800,000	4,504,314	0.87%
HAIMEN ZHONGNAN INVESTMENT DEVELOPMENT INTL CO LTD 11.5% S/A 07APR2024	1,560,000	3,013,320	0.58%
HKT CAPITAL NO 6 LTD 3% S/A 18JAN2032	540,000	3,126,228	0.60%
NWD FINANCE BVI LTD 4.8% S/A PERP	60,000	307,774	0.06%
NWD FINANCE BVI LTD 6.15% S/A PERP	430,000	2,866,336	0.55%
NWD FINANCE BVI LTD 6.25% S/A PERP	1,200,000	7,425,396	1.43%
PEAK RE BVI HLDG LTD 5.35% S/A PERP	1,000,000	5,458,057	1.05%
TUSPARK FORWARD LTD 6.95% S/A 13MAY2024 (EXTENDED FROM 18JUN2022)	1,700,000	4,689,952	0.90%
TUSPARK FORWARD LTD 7.95% S/A 13MAY2024 (EXTENDED FROM 15AUG2021)	1,799,000	4,952,355	0.95%
WANDA PROPERTIES OVERSEAS LTD 6.875% S/A 23JUL2023	1,500,000	8,311,215	1.60%
WANDA PROPERTIES OVERSEAS LTD 6.95% S/A 05DEC2022	1,300,000	7,874,364	1.52%
ZHAOBING INVESTMENT BVI LTD 5.875% S/A 18SEP2022	1,000,000	6,759,799	1.30%
		65,973,357	12.70%
开曼群岛			
BRIGHT SCHOLAR EDUCATION HLDGS LTD 7.45% S/A 31JUL2022	1,600,000	10,462,627	2.02%
CHINA HONGQIAO GROUP LTD 6.25% S/A 08JUN2024	1,570,000	9,811,499	1.89%
CHINA HONGQIAO GROUP LTD 7.125% S/A 22JUL2022	1,500,000	10,375,279	2.00%
CHINA SCE GROUP HLDGS LTD 7.25% S/A 19APR2023	2,000,000	5,949,893	1.15%
CHINA SCE GROUP HLDGS LTD 7.375% S/A 09APR2024	500,000	1,230,731	0.24%
CIFI HLDGS GROUP CO LTD 4.45% S/A 17AUG2026	800,000	3,156,069	0.61%
CIFI HLDGS GROUP CO LTD 6% S/A 16JUL2025	600,000	2,499,268	0.48%
CIFI HLDGS GROUP CO LTD 6.45% S/A 07NOV2024	500,000	2,167,594	0.42%
CIFI HLDGS GROUP CO LTD 6.55% S/A 28MAR2024	600,000	2,772,331	0.53%
EH CAR SERVICES LTD 7.75% S/A 14NOV2024	630,000	2,808,659	0.54%
GOLDEN EAGLE RETAIL GROUP LTD 4.625% S/A 21MAY2023 REGS	800,000	5,202,469	1.00%
GREENTOWN CHINA HLDGS LTD 4.7% S/A 29APR2025	2,250,000	12,176,122	2.35%

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)

2022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)			
HONGHUA GROUP LTD 6.375% S/A 01AUG2022	1,583,000	10,498,597	2.02%
MGM CHINA HLDGS LTD 4.75% S/A 01FEB2027 REGS	1,150,000	5,629,753	1.09%
MGM CHINA HLDGS LTD 5.875% S/A 15MAY2026 REGS	200,000	1,032,825	0.20%
POWERLONG REAL ESTATE HLDGS LTD 6.25% S/A 10AUG2024	380,000	496,780	0.10%
POWERLONG REAL ESTATE HLDGS LTD 7.125% S/A 08NOV2022	2,200,000	3,271,404	0.63%
REDSUN PROPERTIES GROUP LTD 7.3% S/A 13JAN2025	2,400,000	2,806,376	0.54%
SUNAC CHINA HLDGS LTD 8.35% S/A 19APR2023	3,000,000	3,062,579	0.59%
WYNN MACAU LTD 4.875% S/A 01OCT2024 REGS	1,000,000	5,030,640	0.97%
YUZHOU GROUP HLDGS CO LTD 7.85% S/A 12AUG2026	2,000,000	976,474	0.19%
YUZHOU GROUP HLDGS CO LTD 9.95% S/A 08JUN2023	1,200,000	673,691	0.13%
YUZHOU PROPERTIES CO LTD 7.7% S/A 20FEB2025	2,100,000	1,096,997	0.21%
YUZHOU PROPERTIES CO LTD 8.5% S/A 26FEB2024	700,000	385,207	0.07%
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD 7.1% S/A 10SEP2024	630,000	302,064	0.06%
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD 7.875% S/A 14APR2024	200,000	96,429	0.02%
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD 8.35% S/A 10MAR2024	400,000	186,565	0.04%
		<u>104,158,922</u>	<u>20.09%</u>
中国内地			
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP 2.85% S/A 21JAN2032	2,000,000	12,692,917	2.45%
CHINA GOVERNMENT INTL BOND 0.75% S/A 26OCT2024 REGS	4,000,000	25,436,915	4.89%
CITY DEVELOPMENT CO OF LAN ZHOU 4.15% S/A 15NOV2022	1,000,000	6,104,088	1.18%
DALIAN DETA HLDG CO LTD 5.95% S/A 29JUL2022	1,000,000	6,816,390	1.31%
GUANGZHOU FINELAND REAL ESTATE DEVELOPMENT CO LTD 13.6% S/A 27JUL2023	2,880,000	10,395,396	2.00%
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD 3.2% S/A PERP	2,000,000	12,808,005	2.47%
JINKE PROPERTIES GROUP CO LTD 6.85% S/A 28MAY2024	1,800,000	3,093,779	0.60%
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD 4.5% A PERP	2,000,000	13,880,985	2.68%
		<u>91,228,475</u>	<u>17.58%</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)

2022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)			
香港			
BANK OF COMMUNICATIONS (HONG KONG) LTD 3.725% S/A PERP	1,000,000	6,675,853	1.29%
CATHAY PACIFIC MTN FINANCING HK LTD 4.875 S/A 17AUG2026	1,710,000	10,659,654	2.05%
CHIYU BANKING CORP LTD 5.25% S/A PERP	1,000,000	6,689,624	1.29%
CITIC LTD 2.875% S/A 17FEB2027	2,000,000	12,813,349	2.47%
CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 3.35% S/A PERP	1,000,000	6,671,922	1.29%
GEMDALE EVER PROSPERITY INVESTMENT LTD 4.95% S/A 12AUG2024	900,000	4,401,621	0.85%
YANLORD LAND HK CO LTD 5.125% S/A 20MAY2026	1,360,000	6,991,163	1.35%
YANLORD LAND HK CO LTD 6.8% S/A 27FEB2024	1,950,000	11,528,823	2.22%
		<u>66,432,009</u>	<u>12.81%</u>
印度			
ADANI GREEN ENERGY LTD 4.375% S/A 08SEP2024 REGS	710,000	4,342,125	0.84%
INDIA INFOLINE FINANCE LTD 5.875% S/A 20APR2023	400,000	2,657,105	0.51%
MANAPPURAM FINANCE LTD 5.9% S/A 13JAN2023	850,000	5,795,076	1.12%
		<u>12,794,306</u>	<u>2.47%</u>
Jersey, C.I.			
WEST CHINA CEMENT LTD 4.95% S/A 08JUL2026	1,670,000	9,268,848	1.79%
毛里求斯			
AZURE POWER ENERGY LTD 3.575% S/A 19AUG2026 REGS	220,000	1,193,244	0.23%
GREENKO POWER II LTD 4.3% S/A 13DEC2028 REGS	1,000,000	5,239,038	1.01%
GREENKO WIND PROJECTS MAURITIUS LTD 5.5% S/A 06APR2025 REGS	520,000	3,295,352	0.64%
INDIA CLEAN ENERGY HLDGS 4.5% S/A 18APR2027 REGS	1,100,000	5,556,073	1.07%
		<u>15,283,707</u>	<u>2.95%</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)

2022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)			
荷兰			
MONG DUONG FINANCE HLDGS BV 5.125%			
S/A 07MAY2029 REGS	700,000	3,833,082	0.74%
巴基斯坦			
PAKISTAN GOVERNMENT INTL BOND 7.875%			
S/A 31MAR2036 REGS	400,000	1,674,122	0.32%
菲律宾			
SMC GLOBAL POWER HLDGS CORP 6.5% S/A PERP	200,000	1,334,979	0.26%
SMC GLOBAL POWER HLDGS CORP 7% S/A PERP	2,170,000	14,454,516	2.79%
		15,789,495	3.05%
新加坡			
INDIKA ENERGY CAPITAL III PTE LTD 5.875%			
S/A 09NOV2024 REGS	1,000,000	6,581,301	1.27%
LMIRT CAPITAL PTE LTD 7.25% S/A 16JUN2024	500,000	2,957,295	0.57%
MEDCO BELL PTE LTD 6.375% S/A 30JAN2027 REGS	300,000	1,761,047	0.34%
MEDCO PLATINUM ROAD PTE LTD 6.75%			
S/A 30JAN2025 REGS	1,500,000	9,646,375	1.86%
THETA CAPITAL PTE LTD 8.125% S/A 22JAN2025	500,000	3,012,889	0.58%
		23,958,907	4.62%
泰国			
BANGKOK BANK PLC/HONG KONG 5% S/A PERP REGS	400,000	2,487,743	0.48%
英国			
HSBC HLDGS PLC 4.6% S/A PERP	200,000	1,037,032	0.20%
VEDANTA RESOURCES FINANCE II PLC 13.875%			
S/A 21JAN2024 REGS	1,000,000	6,439,848	1.24%
		7,476,880	1.44%

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)

2022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	12,220,800	2.36%
		442,945,172	85.40%

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)

2022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
债务证券			
澳大利亚			
MACQUARIE BANK LTD/LONDON 6.125% S/A PERP REGS	1,000,000	6,233,045	1.20%
英属维尔京群岛			
SHANDONG IRON AND STEEL XINHENG INTL CO LTD 6.85% S/A 25SEP2022	500,000	3,428,762	0.66%
STUDIO CITY FINANCE LTD 5% S/A 15JAN2029 REGS	1,400,000	4,982,066	0.96%
		8,410,828	1.62%
开曼群岛			
MELCO RESORTS FINANCE LTD 5.625% S/A 17JUL2027 REGS	500,000	2,347,077	0.45%
SUNRISE CAYMAN LTD 5.25% S/A 11MAR2024	1,000,000	6,845,842	1.32%
		9,192,919	1.77%
印度			
JSW INFRASTRUCTURE LTD 4.95% S/A 21JAN2029 REGS	1,000,000	5,388,350	1.04%
美国			
UNITED STATES OF AMERICA TREASURY BILL 0% A 06OCT2022	3,000,000	19,989,009	3.84%
集合投资计划			
卢森堡			
BOC (EUROPE) UCITS SICAV – BOCHK RMB HIGH YIELD BOND FUND-CD USD HEDGED	10,774	3,765,094	0.73%
		52,979,245	10.20%

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)

2022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
远期外汇合约			
买入人民币529,389,469.78元及卖出79,271,281.15美元 (交易对手：中国银行(香港)有限公司)	–	(1,507,560)	(0.29%)
买入2,344,041.00澳元及卖出人民币10,904,009.92元 (交易对手：中国银行(香港)有限公司)	–	(50,590)	(0.01%)
买入9,649,717.24美元及卖出人民币64,484,235.44元 (交易对手：中国银行(香港)有限公司)	–	142,022	0.03%
		<u>(1,416,128)</u>	<u>(0.27%)</u>
非上市及上市／挂牌投资总额		494,508,289	95.33%
其他资产净值		<u>24,216,445</u>	<u>4.67%</u>
于2021年6月30日的资产净值(按成交价)		<u>518,724,734</u>	<u>100.00%</u>
投资总额，按成本计		<u>633,160,193</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)
2022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			
友邦保险控股有限公司	100,000	8,505,000	4.75%
阿里巴巴集团控股有限公司	100,000	11,190,000	6.25%
百度集团	10,000	1,485,000	0.83%
比亚迪电子	50,000	1,237,500	0.69%
中国建设银行	1,000,000	5,270,000	2.95%
招商银行	120,000	6,300,000	3.52%
中国移动有限公司	80,000	3,920,000	2.19%
中国海外发展有限公司	150,000	3,720,000	2.08%
华润啤酒(控股)有限公司	60,000	3,510,000	1.96%
华润置地有限公司	100,000	3,660,000	2.05%
碧桂园服务控股有限公司	100,000	3,495,000	1.95%
江西赣锋锂业股份有限公司	20,000	1,727,000	0.97%
协鑫科技控股有限公司	500,000	1,895,000	1.06%
香港交易及结算所有限公司	10,000	3,860,000	2.16%
汇丰控股有限公司	200,000	10,330,000	5.77%
海吉亚医疗控股有限公司	50,000	2,607,500	1.46%
中国工商银行	1,000,000	4,660,000	2.60%
信达生物制药	150,000	5,235,000	2.93%
京东集团股份有限公司	10,000	2,528,000	1.41%
九毛九国际控股有限公司	200,000	4,170,000	2.33%
李宁有限公司	50,000	3,635,000	2.03%
力劲科技	160,000	2,400,000	1.34%
美团	60,000	11,652,000	6.52%
微创医疗科学	80,000	1,820,000	1.02%
中国邮政储蓄银行股份有限公司	1,000,000	6,230,000	3.48%
金沙中国有限公司	100,000	1,872,000	1.05%
舜宇光学科技(集团)有限公司	10,000	1,279,000	0.71%
腾讯控股有限公司	35,000	12,404,000	6.93%
		<u>130,597,000</u>	<u>72.99%</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)
2022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)			
中国内地			
爱尔眼科医院集团股份有限公司	1	52	0.00%
隆基绿能科技股份有限公司	50,000	3,905,130	2.18%
山西杏花村汾酒厂股份有限公司	6,000	2,284,351	1.28%
阳光电源股份有限公司	40,000	4,606,681	2.57%
苏州迈为科技股份有限公司	18,000	10,357,649	5.79%
中科创达软件股份有限公司	40,000	6,117,860	3.42%
		27,271,723	15.24%
		157,868,723	88.23%

外汇远期合约

买入人民币3,506,535元及卖出4,067,906港元 (交易对手：中国银行(香港)有限公司)	—	33,189	0.01%
买入人民币176,309元及卖出206,693港元 (交易对手：中国银行(香港)有限公司)	—	(408)	0.00%
买入人民币212,718元及卖出248,851港元 (交易对手：中国银行(香港)有限公司)	—	31	0.00%
买入人民币220,000元及卖出257,762港元 (交易对手：中国银行(香港)有限公司)	—	(360)	0.00%
买入435.710澳元及卖出2,382,811港元 (交易对手：中国银行(香港)有限公司)	—	(20,973)	(0.01%)
买入21,660澳元及卖出121,729港元 (交易对手：中国银行(香港)有限公司)	—	(4,364)	0.00%
买入16,890澳元及卖出94,060港元 (交易对手：中国银行(香港)有限公司)	—	(2,542)	0.00%
买入28,000澳元及卖出152,096港元 (交易对手：中国银行(香港)有限公司)	—	(378)	0.00%
		4,195	0.00%

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)
2022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
上市／挂牌投资总额		157,872,918	88.23%
其他资产净值		<u>21,058,954</u>	<u>11.77%</u>
于2022年6月30日的资产净值(按成交价)		<u>178,931,872</u>	<u>100.00%</u>
投资总额，按成本计		<u>147,520,232</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）
2022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			
中国国际航空股份有限公司－A股	300,000	3,483,000	1.16%
中航重机股份有限公司－A股	140,000	4,505,200	1.50%
宝山钢铁股份有限公司－A股	1,500,000	9,030,000	3.00%
北京北摩高科摩擦材料股份有限公司－A股	45,500	2,665,390	0.88%
比亚迪股份有限公司－A股	40,000	13,339,600	4.43%
招商银行股份有限公司－A股	280,000	11,816,000	3.91%
中国中铁股份有限公司－A股	500,000	3,070,000	1.02%
中国南方航空股份有限公司－A股	500,000	3,655,000	1.21%
中国旅游集团中免股份有限公司－A股	60,000	13,975,800	4.64%
万科企业股份有限公司－A股	68,000	1,394,000	0.46%
中国长江电力股份有限公司－A股	260,000	6,011,200	1.99%
中信证券股份有限公司－A股	500,000	10,830,000	3.59%
宁德时代新能源科技股份有限公司－A股	12,000	6,408,000	2.13%
东方财富信息股份有限公司－A股	540,000	13,716,000	4.55%
分众传媒信息技术股份有限公司－A股	700,000	4,711,000	1.56%
歌尔股份有限公司－A股	200,000	6,720,000	2.23%
杭州士兰微电子股份有限公司－A股	30,000	1,560,000	0.52%
内蒙古伊利实业集团股份有限公司－A股	345,000	13,437,750	4.46%
江苏恒瑞医药股份有限公司－A股	99,952	3,707,220	1.23%
江苏新泉汽车饰件股份有限公司－A股	195,000	5,655,000	1.88%
贵州茅台酒股份有限公司－A股	8,000	16,360,000	5.43%
隆基绿能科技股份有限公司－A股	336,000	22,387,680	7.43%
芒果超媒股份有限公司－A股	100,000	3,336,000	1.11%
中国平安保险股份有限公司－A股	180,000	8,404,200	2.79%
保利发展控股集团股份有限公司－A股	700,000	12,222,000	4.06%
重庆博腾制药科技股份有限公司－A股	30,000	2,339,700	0.78%
中国电力建设集团有限公司－A股	1,500,000	11,805,000	3.92%

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)

2022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)			
深圳迈瑞医疗国际有限公司－A股	20,000	6,264,000	2.08%
阳光电源股份有限公司－A股	63,000	6,189,750	2.05%
宜宾五粮液股份有限公司－A股	30,000	6,057,900	2.01%
无锡药明康德新药开发股份有限公司－A股	44,998	4,679,342	1.55%
漳州片仔癀药业股份有限公司－A股	20,000	7,134,600	2.37%
		<u>246,870,332</u>	<u>81.93%</u>
香港			
中银航空租赁有限公司	120,000	6,751,502	2.24%
华润啤酒(控股)有限公司	76,000	3,792,921	1.26%
中国神华能源股份有限公司－H股	200,000	3,838,989	1.27%
李宁有限公司	60,000	3,721,260	1.23%
美团－B类股份	58,000	9,609,075	3.19%
网易	45,000	5,531,984	1.84%
舜宇光学科技(集团)有限公司	50,000	5,455,630	1.81%
腾讯控股有限公司	20,000	6,046,835	2.01%
		<u>44,748,196</u>	<u>14.85%</u>
		<u>291,618,528</u>	<u>96.78%</u>
外汇远期合约			
买入9,665,253港元及卖出人民币8,882,367.51元		(386,374)	(0.13%)
		<u>(386,374)</u>	<u>(0.13%)</u>
上市／挂牌投资总额		291,232,154	96.65%
其他资产净值		<u>10,105,592</u>	<u>3.35%</u>
于2022年6月30日的资产净值			
(按成交价)		<u>301,337,746</u>	<u>100.00%</u>
投资总额, 按成本计		<u>305,564,265</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)
2022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			
澳大利亚			
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD/ UK 6.75% S/A PERP REGS	500,000	496,820	0.47%
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA S+0.97% Q 14MAR2027 REGS	1,000,000	996,833	0.94%
MACQUARIE BANK LTD S+1.31% Q 21MAR2025 REGS	470,000	472,302	0.45%
NEWCASTLE COAL INFRASTRUCTURE GROUP PTY LTD 4.4% S/A 29SEP2027 REGS	300,000	268,480	0.25%
SANTOS FINANCE LTD 4.125% S/A 14SEP2027	300,000	286,632	0.27%
WESTPAC BANKING CORP 3M S+1% Q 26AUG2025	1,450,000	1,448,103	1.37%
		<u>3,969,170</u>	<u>3.75%</u>
百慕大			
CHINA OIL AND GAS GROUP LTD 5.5% S/A 25JAN2023	500,000	<u>145,463</u>	<u>0.14%</u>
英属维尔京群岛			
BLUESTAR FINANCE HLDGS LTD 3.375% S/A 16JUL2024	500,000	501,424	0.48%
CHINA CINDA FINANCE 2017 I LTD 4.4% S/A 09MAR2027	500,000	499,214	0.47%
CHINA CINDA FINANCE 2017 I LTD 4.75% S/A 21FEB2029	1,250,000	1,221,291	1.16%
CHINA HUANENG GROUP HONG KONG TREASURY MANAGEMENT HLDG LTD 2.85% S/A PERP	500,000	492,856	0.47%
CHINA HUANENG GROUP HONG KONG TREASURY MANAGEMENT HLDGS LTD 3.08% S/A PERP	500,000	479,936	0.45%
CHINALCO CAPITAL HLDGS LTD 4.1% S/A PERP	1,000,000	1,006,698	0.95%
CHOUZHOU INTL INVESTMENT LTD 3.15% S/A 11AUG2023	1,000,000	1,003,420	0.95%
CLP POWER HK FINANCE LTD 3.55% S/A PERP	500,000	483,664	0.46%
CMHI FINANCE BVI CO LTD 3.5% S/A PERP	330,000	330,337	0.31%

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)

2022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)			
CNPC HK OVERSEAS CAP 5.95% S/A 28APR2041 REGS	2,000,000	2,228,065	2.11%
HKT CAPITAL NO 6 LTD 3% S/A 18JAN2032	1,360,000	1,176,092	1.11%
HONGKONG ELECTRIC FINANCE LTD 2.25% S/A 09JUN2030	500,000	427,518	0.41%
HUANENG HONG KONG CAPITAL LTD 3.6% S/A PERP	500,000	503,105	0.48%
HUARONG FINANCE 2017 CO LTD 3M L+1.15% Q 07NOV2022	400,000	398,842	0.38%
HUARONG FINANCE 2017 CO LTD 5.5% S/A 27APR2047	200,000	161,150	0.15%
HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 3.375% S/A 24FEB2030	500,000	385,858	0.37%
HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 3M L+1.125% Q 24FEB2023	250,000	246,599	0.23%
JIC ZHIXIN LTD 1.5% S/A 27AUG2025	500,000	468,698	0.44%
JIC ZHIXIN LTD 2.125% S/A 27AUG2030	80,000	68,735	0.07%
LEVC FINANCE LTD 1.375% S/A 25MAR2024	500,000	481,728	0.46%
MINMETALS BOUNTEOUS FINANCE BVI LTD 3.375% S/A PERP	610,000	604,274	0.57%
NWD FINANCE BVI LTD 4.125% S/A PERP	970,000	829,133	0.79%
NWD MTN LTD 4.125% S/A 18JUL2029	300,000	271,316	0.26%
PEAK RE BVI HLDG LTD 5.35% S/A PERP	500,000	407,646	0.39%
PROVEN HONOUR CAPITAL LTD 4.125% S/A 06MAY2026	300,000	293,767	0.28%
SHANDONG IRON AND STEEL XINHENG INTL CO LTD 6.85% S/A 25SEP2022	250,000	256,084	0.24%
SHANGHAI PORT GROUP BVI DEVELOPMENT 2 CO LTD 2.375% S/A 13JUL2030	500,000	442,557	0.42%
SINOCHEM OFFSHORE CAPITAL CO LTD 2.375% S/A 23SEP2031	940,000	768,145	0.73%
STANDARD CHARTERED PLC 6% S/A PERP	500,000	488,397	0.46%
STUDIO CITY FINANCE LTD 6% S/A 15JUL2025 REGS	500,000	341,143	0.32%
SUNNY EXPRESS ENTERPRISES CORP 3.35% S/A PERP	200,000	201,196	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)
2022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)			
TAIHU PEARL ORIENTAL CO LTD 3.15% S/A 30JUL2023	530,000	533,436	0.51%
TALENT YIELD INTL LTD 3.125% S/A 06MAY2031	990,000	890,252	0.84%
TCL TECHNOLOGY INVESTMENTS LTD 1.875% S/A 14JUL2025	4,060,000	3,791,341	3.59%
TUSPARK FORWARD LTD 6.95% S/A 13MAY2024 (EXTENDED FROM 18JUN2022)	500,000	206,046	0.20%
WHARF REIC FINANCE BVI LTD 2.875% S/A 07MAY2030	200,000	180,293	0.17%
XIANJIN INDUSTRY INVESTMENT CO LTD 2.95% S/A 24SEP2023	330,000	329,627	0.30%
		<u>23,399,883</u>	<u>22.17%</u>
开曼群岛			
AAC TECHNOLOGIES HLDGS INC 3% S/A 27NOV2024	500,000	469,777	0.45%
CDBL FUNDING 1 3.5% S/A 24OCT2027	400,000	385,002	0.36%
CHINA HONGQIAO GROUP LTD 7.125% S/A 22JUL2022	250,000	258,300	0.24%
CHINA OVERSEAS FINANCE CAYMAN VIII LTD 2.75% S/A 02MAR2030	500,000	431,010	0.41%
CHINA OVERSEAS FINANCE CAYMAN VIII LTD 3.125% S/A 02MAR2035	500,000	400,330	0.38%
CHINA RESOURCES LAND LTD 3.75% S/A PERP	2,700,000	2,648,003	2.51%
FOXCONN FAR EAST LTD 2.5% S/A 28OCT2030	500,000	428,998	0.41%
ICD SUKUK CO LTD 5% S/A 01FEB2027	500,000	515,002	0.49%
MEITUAN DIANPING 2.125% S/A 28OCT2025 REGS	1,500,000	1,360,558	1.29%
MGM CHINA HLDGS LTD 5.875% S/A 15MAY2026 REGS	200,000	154,277	0.15%
PHOENIX GROUP HLDGS 5.375% S/A 06JUL2027	400,000	396,483	0.38%
POWERLONG REAL ESTATE HLDGS LTD 6.95% S/A 23JUL2023	1,050,000	219,432	0.21%
REDSUN PROPERTIES GROUP LTD 7.3% S/A 13JAN2025	650,000	113,533	0.11%

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)
2022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)			
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD 3.75% S/A 23JAN2023	450,000	457,825	0.43%
VLL INTL INC 5.75% S/A 28NOV2024	250,000	243,995	0.22%
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD 7.1% S/A 10SEP2024	550,000	39,391	0.03%
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD 7.875% S/A 14APR2024	200,000	14,403	0.01%
		<u>8,536,319</u>	<u>8.08%</u>
中国内地			
BANK OF CHINA LTD 5% S/A 13NOV2024 REGS	400,000	412,655	0.39%
BANK OF CHINA/MACAU S+0.78% Q 28APR2025	1,710,000	1,713,277	1.62%
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP/MACAU S+0.5% Q 21DEC2024	1,690,000	1,682,455	1.59%
GUANGZHOU FINELAND REAL ESTATE DEVELOPMENT CO LTD 13.6% S/A 27JUL2023	790,000	425,943	0.40%
JINKE PROPERTIES GROUP CO LTD 6.85% S/A 28MAY2024	1,500,000	385,109	0.37%
KUNMING RAIL TRANSIT GROUP CO LTD 3.5% S/A 12DEC2022	500,000	499,469	0.47%
SHOUGANG GROUP CO LTD 4% S/A 23MAY2024	700,000	701,982	0.67%
YIBIN EMERGING INDUSTRY INVESTMENT GROUP CO LTD 2.2% S/A 17JUL2024	1,000,000	948,530	0.90%
		<u>6,769,420</u>	<u>6.41%</u>
法国			
SOCIETE GENERALE SA S+1.05% Q 21JAN2026 REGS	680,000	660,629	0.63%
香港			
AIA GROUP LTD 3.2% S/A 16SEP2040 REGS	1,380,000	1,122,883	1.06%
AIRPORT AUTHORITY HONG KONG 2.1% S/A PERP	1,280,000	1,165,365	1.10%
AIRPORT AUTHORITY HONG KONG 2.4% S/A PERP	1,000,000	863,813	0.82%

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)
2022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)			
BANK OF CHINA HONG KONG LTD 1.33% S/A 17FEB2024	1,000,000	124,131	0.12%
BANK OF EAST ASIA LTD 4% S/A 29MAY2030	940,000	917,596	0.87%
BLOSSOM JOY LTD 3.1% S/A PERP	1,000,000	961,418	0.91%
CHONG HING BANK LTD 5.5% S/A PERP	500,000	507,271	0.48%
CITIC LTD 2.85% S/A 25FEB2030	650,000	579,862	0.55%
CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 5.125% S/A 14MAR2028	2,500,000	2,561,007	2.43%
DAH SING BANK LTD 3% S/A 02NOV2031	380,000	355,257	0.34%
NANYANG COMMERCIAL BANK LTD 3.8% S/A 20NOV2029	670,000	658,052	0.62%
SHANGRAO INVESTMENT HLDGS INTL CO LTD 4.3% S/A 16JAN2023	360,000	368,002	0.35%
WING LUNG BANK LTD 3.75% S/A 22NOV2027	500,000	501,891	0.47%
		<u>10,686,548</u>	<u>10.12%</u>
印度			
ADANI ELECTRICITY MUMBAI LTD 3.949% S/A 12FEB2030 REGS	1,500,000	1,250,756	1.19%
ADANI GREEN ENERGY LTD 4.375% S/A 08SEP2024 REGS	1,250,000	1,141,903	1.08%
ADANI PORTS & SPECIAL ECONOMIC ZONE LTD 3.828% S/A 02FEB2032 REGS	900,000	740,406	0.70%
ADANI PORTS & SPECIAL ECONOMIC ZONE LTD 4% S/A 30JUL2027 REGS	200,000	187,688	0.18%
ADANI PORTS & SPECIAL ECONOMIC ZONE LTD 4.2% S/A 04AUG2027 REGS	400,000	378,016	0.36%
ADANI TRANSMISSION LTD 4% S/A 03AUG2026 REGS	1,500,000	1,442,752	1.37%
ALAM SUTERA REALTY TBK 6% S/A 02MAY2024	500,000	334,806	0.32%
EXPORT-IMPORT BANK OF INDIA 3.25% S/A 15JAN2030 REGS	1,400,000	1,237,161	1.17%
HDFC BANK LTD 3.7% S/A PERP	1,000,000	848,110	0.80%
INDIA INFOLINE FINANCE LTD 5.875% S/A 20APR2023	400,000	396,903	0.38%

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)
2022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(续)			
JSW INFRASTRUCTURE LTD 4.95% S/A 21JAN2029 REGS	200,000	160,976	0.15%
JSW STEEL LTD 3.95% S/A 05APR2027 REGS	540,000	440,373	0.42%
REC LTD 2.25% S/A 01SEP2026	500,000	451,420	0.43%
REC LTD 4.75% S/A 19MAY2023 REGS	500,000	505,125	0.48%
		<u>9,516,395</u>	<u>9.03%</u>
印度尼西亚			
ADARO INDONESIA 4.25% S/A 31OCT2024 REGS	400,000	382,337	0.36%
BANK MANDIRI PERSERO TBK 3.75% S/A 11APR2024	500,000	500,127	0.47%
BANK RAKYAT INDONESIA PERSERO TBK 3.95% S/A 28MAR2024	200,000	201,263	0.19%
BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO TBK 4.2% S/A 23JAN2025	310,000	299,424	0.28%
INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM PERSERO 4.75% S/A 15MAY2025 REGS	350,000	350,304	0.33%
INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM TBK 6.53% S/A 15NOV2028 REGS	1,000,000	1,024,814	0.97%
INDONESIA GOVERNMENT INTL BOND 4.2% S/A 15OCT2050	200,000	174,323	0.17%
INDONESIA GOVERNMENT INTL BOND 4.75% S/A 18JUL2047 REGS	200,000	188,617	0.18%
PELABUHAN INDONESIA II 5.375% S/A 05MAY2045 REGS	600,000	565,495	0.54%
PERTAMINA PERSERO 3.65% S/A 30JUL2029 REGS	400,000	372,904	0.35%
PERUSAHAAN PENERBIT SBSN INDONESIA III 3.8% S/A 23JUN2050 REGS	1,200,000	969,593	0.92%
PERUSAHAAN PENERBIT SBSN INDONESIA III 4.4% S/A 01MAR2028 REGS	600,000	603,544	0.57%
REPUBLIC OF INDONESIA 4.625% S/A 15APR2043 REGS	300,000	275,026	0.27%
		<u>5,907,771</u>	<u>5.60%</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)

2022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)			
日本			
MIZUHO FINANCIAL GROUP INC S+0.96% Q 22MAY2026	1,090,000	1,065,875	1.01%
NOMURA HLDGS INC 1.851% S/A 16JUL2025	500,000	463,707	0.44%
NTT FINANCE CORP 1.162% S/A 03APR2026 REGS	620,000	559,761	0.53%
SUMITOMO LIFE INSURANCE CO 4% S/A 14SEP2077 REGS	200,000	190,664	0.18%
SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC S+0.88% Q 14JAN2027	1,280,000	1,250,248	1.19%
		<u>3,530,255</u>	<u>3.35%</u>
Jersey, C.I.			
WEST CHINA CEMENT LTD 4.95% S/A 08JUL2026	900,000	<u>746,152</u>	<u>0.71%</u>
韩国			
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD 2.125% S/A 30JUL2023	1,180,000	1,168,947	1.11%
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD 3.34% S/A 05FEB2030 REGS	500,000	489,728	0.46%
SK TELECOM CO LTD 3.75% S/A 16APR2023 REGS	400,000	404,057	0.38%
		<u>2,062,732</u>	<u>1.95%</u>
澳门			
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA MACAU LTD 2.875% S/A 12SEP2029	500,000	<u>491,642</u>	<u>0.47%</u>
马来西亚			
TNB GLOBAL VENTURES CAPITAL BHD 4.851% S/A 01NOV2028	480,000	<u>493,524</u>	<u>0.47%</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)
2022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)			
毛里求斯			
AZURE POWER ENERGY LTD 3.575% S/A 19AUG2026 REGS	630,000	510,414	0.48%
GREENKO POWER II LTD 4.3% S/A 13DEC2028 REGS	280,000	219,121	0.21%
GREENKO WIND PROJECTS MAURITIUS LTD 5.5% S/A 06APR2025 REGS	980,000	927,684	0.88%
		<u>1,657,219</u>	<u>1.57%</u>
荷兰			
ING GROEP NV 4.875% S/A PERP	400,000	329,774	0.31%
MINEJESA CAPITAL BV 5.625% S/A 10AUG2037 REGS	500,000	416,431	0.39%
MONG DUONG FINANCE HLDGS BV 5.125% S/A 07MAY2029 REGS	1,700,000	1,390,510	1.33%
		<u>2,136,715</u>	<u>2.03%</u>
新西兰			
ANZ NEW ZEALAND INTL LTD/LONDON 3M S+0.6% Q 18FEB2025 REGS	200,000	197,604	0.19%
BANK OF NEW ZEALAND S+0.81% Q 27JAN2027 REGS	2,190,000	2,158,136	2.05%
		<u>2,355,740</u>	<u>2.24%</u>
巴基斯坦			
PAKISTAN GOVERNMENT INTL BOND 7.875% S/A 31MAR2036 REGS	500,000	312,588	0.30%
菲律宾			
RIZAL COMMERCIAL BANKING CORP 3% S/A 11SEP2024	800,000	787,909	0.75%
SMC GLOBAL POWER HLDGS CORP 5.95% S/A PERP	500,000	482,593	0.46%
SMC GLOBAL POWER HLDGS CORP 6.5% S/A PERP	430,000	428,734	0.41%
SMC GLOBAL POWER HLDGS CORP 7% S/A PERP	700,000	696,494	0.66%
UNION BANK OF THE PHILIPPINES 3.369% S/A 29NOV2022	500,000	500,578	0.47%
		<u>2,896,308</u>	<u>2.75%</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)

2022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)			
新加坡			
BOC AVIATION LTD 3.25% S/A 29APR2025 REGS	2,000,000	1,963,634	1.86%
INDIKA ENERGY CAPITAL III PTE LTD 5.875% S/A 09NOV2024 REGS	250,000	245,769	0.23%
INDIKA ENERGY CAPITAL IV PTE LTD 8.25% S/A 22OCT2025 REGS	1,000,000	990,523	0.94%
MEDCO BELL PTE LTD 6.375% S/A 30JAN2027 REGS	250,000	219,212	0.21%
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP LTD 1.832% S/A 10SEP2030 REGS	590,000	546,746	0.52%
PARKWAY PANTAI LTD 4.25% S/A PERP	500,000	506,610	0.48%
SINGTEL GROUP TREASURY PTE LTD 2.375% S/A 28AUG2029	500,000	454,037	0.43%
SINOCHEM INTL DEVELOPMENT PTE LTD 3.125% S/A 25JUL2022	200,000	202,652	0.19%
THETA CAPITAL PTE LTD 6.75% S/A 31OCT2026	500,000	391,929	0.37%
THETA CAPITAL PTE LTD 8.125% S/A 22JAN2025	250,000	225,024	0.21%
UNITED OVERSEAS BANK LTD 3.75% S/A 15APR2029 REGS	260,000	260,155	0.25%
UNITED OVERSEAS BANK LTD S+0.7% Q 07APR2025 REGS	740,000	742,007	0.71%
		<u>6,748,298</u>	<u>6.40%</u>
瑞典			
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB 5.125% S/A PERP	600,000	<u>550,934</u>	<u>0.52%</u>
瑞士			
JULIUS BAER GROUP LTD 4.875% S/A PERP	500,000	<u>461,275</u>	<u>0.44%</u>
泰国			
KASIKORNBANK PCL/HOKG KONG 3.343% S/A 02OCT2031	500,000	455,261	0.43%
KASIKORNBANK PCL/HOKG KONG 5.275% S/A PERP	720,000	671,258	0.64%
KRUNG THAI BANK PCL/CAYMAN ISLANDS 4.4% S/A PERP	670,000	593,897	0.56%
TMB BANK PCL/CAYMAN ISLANDS 4.9% S/A PERP	600,000	553,132	0.53%
		<u>2,273,548</u>	<u>2.16%</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)
2022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	290,233	0.28%
美国			
CNOOC FINANCE 2015 USA LLC 4.375% S/A 02MAY2028	500,000	513,780	0.49%
		97,112,541	92.06%
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	2,658,142	2.52%
外汇远期合约			
买入人民币150,010,720.24元及卖出22,462,747.48美元		(62,766)	(0.06%)
		(62,766)	(0.06%)
上市／挂牌投资总额		99,707,917	94.52%
其他资产净值		5,784,168	5.48%
于2022年6月30日的资产净值(按成交价)		<u>105,492,085</u>	<u>100.00%</u>
投资总额, 按成本计		<u>110,447,875</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)
2022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
权益性证券			
中国内地			
博瑞生物医药技术(苏州)有限公司－A股	100,000	360,738	9.62%
贵州茅台酒股份有限公司－A股	200	61,094	1.63%
		<u>421,832</u>	<u>11.25%</u>
香港			
哔哩哔哩股份有限公司－Z类股份	10,000	256,139	6.83%
中国电力国际发展有限公司	150,000	95,192	2.54%
中粮家佳康食品有限公司	600,000	290,546	7.74%
京东健康股份有限公司	15,750	123,535	3.29%
力劲科技集团有限公司	120,000	229,378	6.11%
美团－B类股份	6,000	148,484	3.96%
中国人民财产保险股份有限公司－H股	100,000	103,985	2.77%
腾讯控股有限公司	5,500	248,391	6.62%
		<u>1,495,650</u>	<u>39.86%</u>
韩国			
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	4,000	<u>176,974</u>	<u>4.72%</u>
新加坡			
DBS GROUP HLDGS LTD	11,000	235,030	6.26%
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP LTD	20,000	163,991	4.37%
SINGAPORE EXCHANGE LTD	20,000	136,203	3.63%
UNITED OVERSEAS BANK LTD	8,000	151,177	4.03%
		<u>686,401</u>	<u>18.29%</u>
美国			
SHOPIFY INC-CL A	10,000	312,400	8.33%
TESLA INC	500	336,710	8.98%
		<u>649,110</u>	<u>17.31%</u>
		<u>3,429,967</u>	<u>91.43%</u>
存托凭证			
美国			
SEA LTD-ADR	3,500	<u>234,010</u>	<u>6.24%</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)

2022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			
买入人民币821,929.00元及卖出121,506.25美元 (交易对手：中国银行(香港)有限公司)		<u>1,211</u>	<u>0.03%</u>
上市／挂牌投资总额		3,665,188	97.70%
其他资产净值		<u>86,415</u>	<u>2.30%</u>
于2022年6月30日的资产净值(按成交价)		<u>3,751,603</u>	<u>100.00%</u>
投资总额，按成本计		<u>3,877,493</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)

2022年6月30日

非上市／挂牌投资	持股量／ 面值	公允价值 港元	占资产净值 的百分比
债务证券			
英属维尔京群岛			
HENDERSON LAND MTN LTD 3.3% A 13MAY2023	2,000,000	<u>2,349,409</u>	<u>3.57%</u>
中国内地			
YIBIN EMERGING INDUSTRY INVESTMENT GROUP CO LTD 2.2% S/A 17JUL2024	200,000	<u>1,488,678</u>	<u>2.27%</u>
印度			
JSW INFRASTRUCTURE LTD 4.95% S/A 21JAN2029 REGS	200,000	<u>1,263,227</u>	<u>1.92%</u>
非上市债务证券总值		<u>5,101,314</u>	<u>7.76%</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)

2022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
债务证券			
开曼群岛			
OVERSEAS CHINESE TOWN ASIA HLDGS LTD 4.5% S/A PERP	200,000	1,593,316	2.43%
POWERLONG REAL ESTATE HLDGS LTD 6.95% S/A 23JUL2023	300,000	491,985	0.75%
SUNAC CHINA HLDGS LTD 8.35% S/A 19APR2023	200,000	239,327	0.36%
		<u>2,324,628</u>	<u>3.54%</u>
中国内地			
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD 4.4% A PERP	200,000	1,495,945	2.28%
DALIAN DETA HLDG CO LTD 5.95% S/A 29JUL2022	200,000	1,598,012	2.43%
		<u>3,093,957</u>	<u>4.71%</u>
香港			
CHINA PING AN INSURANCE OVERSEAS HLDGS LTD 2.85% S/A 12AUG2031	300,000	1,930,563	2.95%
CHIYU BANKING CORP LTD 5.25% S/A PERP	350,000	2,744,513	4.17%
		<u>4,675,076</u>	<u>7.12%</u>
印度			
JSW STEEL LTD 3.95% S/A 05APR2027 REGS	200,000	<u>1,279,904</u>	<u>1.95%</u>
毛里求斯			
AZURE POWER ENERGY LTD 3.575% S/A 19AUG2026 REGS	230,000	<u>1,462,279</u>	<u>2.23%</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)
2022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)			
瑞士			
JULIUS BAER GROUP LTD 3.625% S/A PERP	200,000	1,187,513	1.81%
英属维尔京群岛			
PROVEN GLORY CAPITAL LTD 4% S/A 21FEB2027	200,000	1,525,302	2.33%
SINOCHEM OFFSHORE CAPITAL CO LTD 2.375% S/A 23SEP2031	200,000	1,282,524	1.95%
ZHAOBING INVESTMENT BVI LTD 5.875% S/A 18SEP2022	200,000	1,584,745	2.41%
		4,392,571	6.69%
上市债务证券总值		18,415,928	28.05%
互惠基金／单位信托			
香港			
PREMIA中国国库及政策性银行债券长久期ETF－ 人民币	13,000	1,633,555	2.49%
互惠基金／单位信托总值		1,633,555	2.49%
权益性证券			
中国内地			
宁德时代新能源科技股份有限公司－A股	3,000	1,877,838	2.86%
贵州茅台酒股份有限公司－A股	700	1,677,981	2.56%
		3,555,819	5.42%

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)
2022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			
友邦保险控股有限公司	30,000	2,551,500	3.88%
阿里巴巴集团控股有限公司	20,000	2,238,000	3.40%
交通银行股份有限公司－H股	400,000	2,168,000	3.30%
中国建设银行股份有限公司－H股	400,000	2,108,000	3.21%
招商银行股份有限公司－H股	30,000	1,575,000	2.40%
中国移动有限公司	40,000	1,960,000	2.99%
中国建筑材料集团有限公司－H股	200,000	1,676,000	2.55%
中国海外宏洋集团有限公司	300,000	1,251,000	1.91%
中国海外发展有限公司	50,000	1,240,000	1.89%
中国中铁股份有限公司－H股	300,000	1,455,000	2.22%
恒生银行有限公司	10,000	1,385,000	2.11%
汇丰控股有限公司	30,000	1,549,500	2.36%
中国工商银行股份有限公司－H股	400,000	1,864,000	2.84%
美团－B类股份	13,000	2,524,600	3.84%
中国人民保险集团股份有限公司－H股	500,000	1,200,000	1.83%
中国平安保险股份有限公司－H股	40,000	2,134,000	3.25%
中国复星医药(集团)股份有限公司－H股	40,000	1,162,000	1.77%
新鸿基地产发展有限公司	20,000	1,854,000	2.82%
腾讯控股有限公司	5,000	1,772,000	2.70%
		<u>33,667,600</u>	<u>51.27%</u>
权益性证券总值		<u>37,223,419</u>	<u>56.69%</u>
外汇远期合约			
买入人民币6,420,180.00元及卖出7,448,004.64港元 (交易对手：中国银行(香港)有限公司)		63,682	0.10%
买入人民币287,907.00元及卖出336,812.12港元 (交易对手：中国银行(香港)有限公司)		42	0.01%
		<u>63,724</u>	<u>0.11%</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)

2022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
非上市及上市／挂牌投资总额		62,437,940	95.10%
其他资产净值		<u>3,216,992</u>	<u>4.90%</u>
于2022年6月30日的资产净值(按成交价)		<u><u>65,654,932</u></u>	<u><u>100.00%</u></u>
投资总额，按成本计		<u><u>67,938,841</u></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)

2022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
权益性证券			
澳大利亚			
BHP GROUP LTD	4,000.00	114,048	1.29%
RIO TINTO LTD	1,870.00	132,744	1.50%
WHITEHAVEN COAL LTD	50,000.00	167,270	1.89%
		<u>414,062</u>	<u>4.68%</u>
中国内地			
北京东方雨虹防水技术股份有限公司－A股	10,000	76,883	0.87%
中国旅游集团中免股份有限公司－A股	15,000	521,906	5.91%
中国长江电力股份有限公司－A股	35,000	120,874	1.37%
东方财富信息股份有限公司－A股	30,000	113,823	1.29%
江苏恒瑞医药股份有限公司－A股	42,960	238,011	2.70%
贵州茅台酒股份有限公司－A股	500	152,735	1.73%
		<u>1,224,231</u>	<u>13.87%</u>
香港			
中国农业银行股份有限公司－H股	200,000	75,440	0.85%
阿里巴巴集团控股有限公司	16,000	228,155	2.58%
中国银行股份有限公司－H股	400,000	159,545	1.81%
交通银行股份有限公司－H股	1,000,000	690,682	7.84%
中银香港(控股)有限公司	150,000	592,561	6.71%
比亚迪股份有限公司－H股	3,000	120,041	1.36%
比亚迪电子(国际)有限公司	30,000	94,619	1.07%
中国电力国际发展有限公司	120,000	76,154	0.86%
吉利汽车控股有限公司	50,000	113,670	1.29%
长城汽车股份有限公司－H股	40,000	82,270	0.93%
香港交易及结算所有限公司	11,500	565,672	6.41%
信达生物制药(B)	20,000	88,948	1.01%
九毛九国际控股有限公司	60,000	159,418	1.81%
美团－B类股份	15,000	371,210	4.20%
中国人民财产保险股份有限公司－H股	260,000	270,361	3.06%
中国邮政储蓄银行股份有限公司－H股	900,000	714,513	8.09%
		<u>4,403,259</u>	<u>49.88%</u>
		<u>6,041,552</u>	<u>68.43%</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)

2022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			
开曼群岛			
CHINA HONGQIAO GROUP LTD 6.25% S/A 08JUN2024	200,000	186,698	2.11%
CHINA SCE GROUP HLDGS LTD 7% S/A 02MAY2025	300,000	92,260	1.05%
YUZHOU PROPERTIES CO LTD 8.5% S/A 04FEB2023	200,000	17,350	0.20%
YUZHOU PROPERTIES CO LTD 8.5% S/A 26FEB2024	250,000	20,550	0.23%
		<u>316,858</u>	<u>3.59%</u>
印度			
JSW INFRASTRUCTURE LTD 4.95% S/A 21JAN2029 REGS	200,000	<u>160,975</u>	<u>1.82%</u>
Jersey, C.I.			
WEST CHINA CEMENT LTD 4.95% S/A 08JUL2026	200,000	<u>165,812</u>	<u>1.88%</u>
毛里求斯			
AZURE POWER ENERGY LTD 3.575% S/A 19AUG2026 REGS	230,000	<u>186,342</u>	<u>2.11%</u>
英属维尔京群岛			
RKP OVERSEAS FINANCE 2016 A LTD 7.95% S/A PERP	300,000	146,116	1.66%
TUSPARK FORWARD LTD 6.95% S/A 13MAY2024 (EXTENDED FROM 18JUN2022)	500,000	<u>206,046</u>	<u>2.33%</u>
		<u>352,162</u>	<u>3.99%</u>
		<u>1,182,149</u>	<u>13.39%</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)

2022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
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	208,168	2.36%
新加坡			
ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	36,280	74,435	0.84%
		282,603	3.20%
外汇远期合约			
买入577,256.00澳元及卖出402,924.69美元 (交易对手：中国银行(香港)有限公司)		(3,781)	(0.04%)
买入人民币7,022,389.00元及卖出1,038,123.88美元 (交易对手：中国银行(香港)有限公司)		10,347	0.12%
		6,566	0.08%
上市／挂牌投资总额		7,512,871	85.10%
其他资产净值		1,315,703	14.90%
于2022年6月30日的资产净值(按成交价)		<u>8,828,573</u>	<u>100.00%</u>
投资总额，按成本计		<u>8,023,056</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)
2022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			
澳大利亚			
WESTPAC BANKING CORP 3M S+1% Q 26AUG2025	1,200,000	1,198,429	2.41%
英属维尔京群岛			
CITIC SECURITIES FINANCE MTN CO LTD 2.75% S/A 24OCT2022	4,000,000	4,012,072	8.05%
CNRC CAPITALE LTD 3.9% S/A PERP	500,000	511,946	1.03%
COSL FINANCE BVI LTD 3.25% S/A 06SEP2022 REGS	600,000	606,355	1.22%
EASTERN CREATION II INVESTMENT HLDGS LTD 2.8% S/A 15JUL2022	1,000,000	1,013,031	2.04%
XINGSHENG BVI CO LTD 3.375% S/A 25JUL2022	320,000	324,645	0.65%
		6,468,049	12.99%
加拿大			
BK OF NOVA SCOTIA 3.42% A 22APR2023	4,000,000	601,846	1.21%
开曼群岛			
CSCEC FINANCE CAYMAN II LTD 2.9% S/A 05JUL2022	600,000	608,483	1.22%
ENN ENERGY HLDGS LTD 3.25% S/A 24JUL2022	1,620,000	1,642,929	3.30%
SUN HUNG KAI PROPERTIES CAPITAL MARKET LTD 3.625% S/A 16JAN2023	200,000	203,577	0.41%
		2,454,988	4.93%
香港			
BOCOM LEASING MANAGEMENT HONG KONG CO LTD 3M L+1.075% Q 10DEC2024	2,000,000	1,993,203	4.00%
CGNPC INTL LTD 3.125% S/A 11DEC2022	3,000,000	3,002,658	6.03%
CHINA LIFE INSURANCE OVERSEAS CO LTD/HONG KONG 3.35% S/A 27JUL2027	3,200,000	3,248,514	6.53%
CHINA TAIPING NEW HORIZON LTD 6% S/A 18OCT2023	200,000	207,433	0.42%
WING LUNG BANK LTD 3.75% S/A 22NOV2027	400,000	401,513	0.81%
		8,853,321	17.79%
日本			
MIZUHO FINANCIAL GROUP INC S+0.96% Q 22MAY2026	1,150,000	1,124,547	2.26%

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)
2022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			
KOREA HYDRO & NUCLEAR POWER CO LTD 3% S/A 19SEP2022 REGS	3,000,000	3,025,590	6.08%
KOREAN AIR LINES CO LTD 2% S/A 04SEP2022	1,000,000	1,004,200	2.02%
KT CORP 2.625% S/A 07AUG2022	2,000,000	2,020,000	4.06%
		6,049,790	12.16%
		26,750,971	53.75%
远期外汇合约			
买入619,338.86美元及卖出人民币4,000,000.00元 (交易对手：中国银行(香港)有限公司)	—	20,958	0.04%
	—	20,958	0.04%
上市／挂牌投资总额		26,771,928	53.79%
其他资产净值		23,003,563	46.21%
于2022年6月30日的资产净值(按成交价)		49,775,491	100.00%
投资总额，按成本计		26,662,353	

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)

2022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	304,245	1.88%
		304,245	1.88%
权益性证券			
中国内地			
中国旅游集团中免股份有限公司－A股	7,000	243,556	1.51%
贵州茅台酒股份有限公司－A股	800	244,376	1.51%
		487,932	3.02%
香港			
阿里巴巴集团控股有限公司	4,000	57,039	0.36%
招商银行股份有限公司－H股	10,000	66,902	0.41%
香港交易及结算所有限公司	5,000	245,944	1.52%
九毛九国际控股有限公司	100,000	265,696	1.64%
中国邮政储蓄银行股份有限公司－H股	350,000	277,866	1.72%
		913,447	5.65%
		1,401,379	8.67%
债务证券			
英属维尔京群岛			
BLUESTAR FINANCE HLDGS LTD 3.875% S/A PERP	400,000	399,380	2.47%
CLP POWER HK FINANCE LTD 3.55% S/A PERP	230,000	222,486	1.38%
HKT CAPITAL NO 6 LTD 3% S/A 18JAN2032	200,000	172,955	1.07%
HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 3M L+1.125% Q 24FEB2023	250,000	246,599	1.53%
NWD MTN LTD 4.125% S/A 18JUL2029	300,000	271,316	1.68%
PEAK RE BVI HLDG LTD 5.35% S/A PERP	300,000	244,588	1.51%
PROVEN GLORY CAPITAL LTD 4% S/A 21FEB2027	276,000	268,235	1.66%
RH INTL FINANCE LTD 6.5% S/A PERP	400,000	306,901	1.90%
STATE GRID OVERSEAS INVESTMENT 2016 LTD 1.625% S/A 05AUG2030	400,000	336,900	2.08%
TSMC GLOBAL LTD 2.25% S/A 23APR2031 REGS	400,000	341,600	2.11%
YONGDA INVESTMENT LTD 2.25% S/A 16JUN2025	200,000	189,064	1.17%
ZHAOBING INVESTMENT BVI LTD 5.875% S/A 18SEP2022	400,000	403,896	2.50%
		3,403,920	21.07%

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)

2022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			
AAC TECHNOLOGIES HLDGS INC 3% S/A 27NOV2024	300,000	281,866	1.74%
BAIDU INC 3.5% S/A 28NOV2022	600,000	602,693	3.73%
MEITUAN DIANPING 2.125% S/A 28OCT2025 REGS	300,000	272,112	1.68%
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD 6.63% S/A 07JAN2026	400,000	28,012	0.17%
		<u>1,184,683</u>	<u>7.33%</u>
中国内地			
BANK OF CHINA/MACAU S+0.78% Q 28APR2025	430,000	430,824	2.67%
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP/MACAU S+0.5% Q 21DEC2024	850,000	846,205	5.24%
CHINA GOVERNMENT INTL BOND 0.75% S/A 26OCT2024 REGS	300,000	284,971	1.76%
GUANGZHOU FINELAND REAL ESTATE DEVELOPMENT CO LTD 13.6% S/A 27JUL2023	200,000	107,834	0.67%
JINKE PROPERTIES GROUP CO LTD 6.85% S/A 28MAY2024	200,000	51,348	0.32%
		<u>1,721,182</u>	<u>10.65%</u>
香港			
AIRPORT AUTHORITY HONG KONG 1.625% S/A 04FEB2031 REGS	400,000	333,062	2.06%
CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 3.875% S/A 19JUN2029	300,000	280,099	1.73%
		<u>613,161</u>	<u>3.79%</u>
印度			
ADANI GREEN ENERGY LTD 4.375% S/A 08SEP2024 REGS	410,000	374,545	2.32%
JSW STEEL LTD 3.95% S/A 05APR2027 REGS	210,000	171,256	1.06%
		<u>545,801</u>	<u>3.38%</u>
印度尼西亚			
INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM TBK 6.53% S/A 15NOV2028 REGS	600,000	614,888	3.81%
PERUSAHAAN PENERBIT SBSN INDONESIA III 4.4% S/A 01MAR2028 REGS	600,000	603,544	3.74%
		<u>1,218,432</u>	<u>7.54%</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)

2022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)			
日本			
MIZUHO FINANCIAL GROUP INC S+0.96% Q 22MAY2026	540,000	528,048	3.27%
SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC S+0.88% Q 14JAN2027	210,000	205,119	1.27%
		733,167	4.54%
毛里求斯			
AZURE POWER ENERGY LTD 3.575% S/A 19AUG2026 REGS	230,000	186,342	1.15%
GREENKO POWER II LTD 4.3% S/A 13DEC2028 REGS	200,000	156,515	0.97%
		342,857	2.12%
荷兰			
MONG DUONG FINANCE HLDGS BV 5.125% S/A 07MAY2029 REGS	300,000	245,384	1.52%
新西兰			
ANZ NEW ZEALAND INTL LTD/LONDON 3M S+0.6% Q 18FEB2025 REGS	200,000	197,604	1.22%
新加坡			
INDIKA ENERGY CAPITAL IV PTE LTD 8.25% S/A 22OCT2025 REGS	300,000	297,156	1.84%
MEDCO OAK TREE PTE LTD 7.375% S/A 14MAY2026 REGS	200,000	184,036	1.14%
		481,192	2.98%
瑞士			
JULIUS BAER GROUP LTD 3.625% S/A PERP	200,000	151,328	0.94%
泰国			
MINOR INTL PCL 2.7% S/A PERP	400,000	372,552	2.31%
		11,211,263	69.39%

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)

2022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			
澳大利亚			
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA S+0.97% Q 14MAR2027 REGS	100,000	99,683	0.62%
MACQUARIE BANK LTD S+1.31% Q 21MAR2025 REGS	200,000	200,979	1.24%
SCENTRE GROUP TRUST 2 4.75% S/A 24SEP2080 REGS	200,000	182,434	1.13%
WESTPAC BANKING CORP 3M S+1% Q 26AUG2025	200,000	199,738	1.24%
		<u>682,834</u>	<u>4.23%</u>
开曼群岛			
SUNRISE CAYMAN LTD 5.25% S/A 11MAR2024	600,000	<u>613,555</u>	<u>3.80%</u>
中国内地			
YIBIN EMERGING INDUSTRY INVESTMENT GROUP CO LTD 2.2% S/A 17JUL2024	300,000	<u>284,559</u>	<u>1.76%</u>
法国			
SOCIETE GENERALE SA S+1.05% Q 21JAN2026 REGS	340,000	<u>330,315</u>	<u>2.04%</u>
印度			
JSW INFRASTRUCTURE LTD 4.95% S/A 21JAN2029 REGS	200,000	<u>160,976</u>	<u>1.00%</u>
新西兰			
BANK OF NEW ZEALAND S+0.81% Q 27JAN2027 REGS	530,000	<u>522,289</u>	<u>3.23%</u>
新加坡			
UNITED OVERSEAS BANK LTD S+0.7% Q 07APR2025 REGS	250,000	<u>250,678</u>	<u>1.55%</u>
		<u>2,845,206</u>	<u>17.61%</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)

2022年6月30日

非上市／非挂牌投资(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			
买入人民币39,236,883.23元及卖出5,875,368.10美元		(16,684)	(0.10%)
		(16,684)	(0.10%)
投资总额		15,745,409	97.45%
其他资产净值		413,204	2.55%
于2022年6月30日的资产净值(按成交价)		<u>16,158,613</u>	<u>100.00%</u>
投资总额，按成本计		<u>16,747,507</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）

2022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			
澳大利亚			
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA S+0.97% Q 14MAR2027 REGS	1,500,000	1,495,249	1.18%
SCENTRE GROUP TRUST 2 4.75% S/A 24SEP2080 REGS	500,000	456,084	0.36%
		<u>1,951,333</u>	<u>1.54%</u>
百慕大			
CHINA OIL AND GAS GROUP LTD 4.7% S/A 30JUN2026	800,000	<u>707,744</u>	<u>0.56%</u>
英属维尔京群岛			
BLUESTAR FINANCE HLDGS LTD 3.1% S/A PERP	510,000	501,704	0.39%
BLUESTAR FINANCE HLDGS LTD 3.875% S/A PERP	500,000	499,227	0.39%
CHINA CINDA 2020 I MANAGEMENT LTD 2.5% S/A 20JAN2028	1,000,000	891,228	0.70%
CHINA HUADIAN OVERSEAS DEVELOPMENT MANAGEMENT CO LTD 4% S/A PERP	2,000,000	1,997,891	1.57%
CHINA HUANENG GROUP HONG KONG TREASURY MANAGEMENT HLDGS LTD 3.08% S/A PERP	2,940,000	2,822,024	2.22%
CHINALCO CAPITAL HLDGS LTD 4.1% S/A PERP	1,000,000	1,006,698	0.79%
CHOUZHOU INTL INVESTMENT LTD 3.15% S/A 11AUG2023	910,000	913,112	0.72%
CMHI FINANCE BVI CO LTD 3.875% S/A PERP	200,000	198,787	0.16%
CNOOC FINANCE 2013 LTD 2.875% S/A 30SEP2029	500,000	467,589	0.37%
CNPC HK OVERSEAS CAP 5.95% S/A 28APR2041 REGS	1,380,000	1,537,365	1.21%
CONTEMPORARY RUIDING DEVELOPMENT LTD 1.875% S/A 17SEP2025	500,000	465,498	0.37%
EASTERN CREATION II INVESTMENT HLDGS LTD 1% S/A 10SEP2023	290,000	283,087	0.22%
FRANSHION BRILLIANT LTD 4.25% S/A 23JUL2029	1,000,000	804,233	0.63%
HUARONG FINANCE 2017 CO LTD 4% S/A PERP	2,000,000	1,997,200	1.57%

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）

2022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 2019 CO LTD 3.375% S/A 24FEB2030	500,000	385,858	0.30%
INVENTIVE GLOBAL INVESTMENTS LTD 1.65% S/A 03SEP2025	2,500,000	2,342,996	1.84%
JIC ZHIXIN LTD 2.125% S/A 27AUG2030	870,000	747,495	0.59%
JOY TREASURE ASSETS HLDGS INC 1.875% S/A 17NOV2025	1,000,000	921,992	0.73%
LEVC FINANCE LTD 1.375% S/A 25MAR2024	500,000	481,728	0.38%
NWD FINANCE BVI LTD 4.125% S/A PERP	1,970,000	1,683,909	1.32%
PROVEN HONOUR CAPITAL LTD 4.125% S/A 06MAY2026	500,000	489,611	0.39%
RONGSHI INTL FINANCE LTD 3.25% S/A 21MAY2024	1,100,000	1,098,164	0.86%
SF HLDG INVESTMENT 2021 LTD 3.125% S/A 17NOV2031	500,000	426,790	0.34%
SHANDONG IRON AND STEEL XINHENG INTL CO LTD 6.85% S/A 25SEP2022	1,000,000	1,024,337	0.81%
SHANGHAI PORT GROUP BVI DEVELOPMENT 2 CO LTD 2.375% S/ A 13JUL2030	200,000	177,023	0.14%
SHANGHAI PORT GROUP BVI DEVELOPMENT CO LTD 2.85% S/A 11SEP2029	500,000	461,969	0.36%
SIHC INTL CAPITAL LTD 4.35% S/A 26SEP2023	500,000	508,385	0.40%
SINOCHAM OFFSHORE CAPITAL CO LTD 2.375% S/A 23SEP2031	940,000	768,145	0.60%
SINOPEC GROUP OVERSEAS DEVELOPMENT 2016 LTD 4.1% S/A 03MAY2046 REGS	500,000	451,989	0.36%
SINOPEC GROUP OVERSEAS DEVELOPMENT 2018 LTD 2.3% S/A 08JAN2031 REGS	500,000	443,826	0.35%
STUDIO CITY FINANCE LTD 5% S/A 15JAN2029 REGS	1,250,000	664,457	0.52%
SUNNY EXPRESS ENTERPRISES CORP 3.35% S/A PERP	200,000	201,196	0.16%
TAIHU PEARL ORIENTAL CO LTD 3.15% S/A 30JUL2023	1,070,000	1,076,936	0.85%
TALENT YIELD INTL LTD 3.125% S/A 06MAY2031	990,000	890,252	0.70%
UHI CAPITAL LTD 3% S/A 12JUN2024	500,000	491,267	0.39%
VERTEX CAPITAL INVESTMENT LTD 4.75% S/A 03APR2024	960,000	980,065	0.77%
VIGOROUS CHAMPION INTL LTD 2.75% S/A 02JUN2025	3,150,000	2,992,013	2.35%
YONGDA INVESTMENT LTD 2.25% S/A 16JUN2025	500,000	472,659	0.37%
		<u>34,568,705</u>	<u>27.19%</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)

2022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)			
加拿大			
CNOOC PETROLEUM NORTH AMERICA ULC 5.875% S/A 10MAR2035	1,000,000	1,072,585	0.84%
开曼群岛			
AAC TECHNOLOGIES HLDGS INC 3% S/A 27NOV2024	1,800,000	1,691,196	1.33%
ALIBABA GROUP HLDG LTD 2.125% S/A 09FEB2031	1,000,000	837,302	0.66%
BAIDU INC 4.875% S/A 14NOV2028	500,000	509,627	0.40%
CCBL CAYMAN 1 CORP LTD 3.5% S/A 16MAY2024	2,700,000	2,692,319	2.12%
CHINA HONGQIAO GROUP LTD 6.25% S/A 08JUN2024	1,000,000	933,493	0.73%
CHINA MODERN DAIRY HLDGS LTD 2.125% S/A 14JUL2026	2,190,000	1,936,305	1.52%
CHINA OVERSEAS FINANCE CAYMAN VIII LTD 2.75% S/A 02MAR2030	860,000	741,337	0.58%
CHINA OVERSEAS FINANCE CAYMAN VIII LTD 3.125% S/A 02MAR2035	500,000	400,330	0.31%
CHINA OVERSEAS FINANCE CAYMAN VIII LTD 3.45% S/A 15JUL2029	1,000,000	924,908	0.73%
CHINA OVERSEAS GRAND OCEANS FINANCE IV CAYMAN LTD 2.45% S/A 09FEB2026	2,800,000	2,547,311	2.00%
CHINA RESOURCES LAND LTD 3.75% S/A PERP	1,540,000	1,510,342	1.19%
CHINA RESOURCES LAND LTD 4.125% S/A 26FEB2029	1,000,000	969,803	0.76%
CHINA STATE CONSTRUCTION FINANCE CAYMAN I LTD 3.4% S/A PERP	1,000,000	954,452	0.75%
CHINA STATE CONSTRUCTION FINANCE CAYMAN III LTD 4% S/A PERP	2,000,000	1,981,902	1.56%
ENN ENERGY HLDGS LTD 4.625% S/A 17MAY2027 REGS	2,200,000	2,236,592	1.76%
JD.COM INC 3.375% S/A 14JAN2030	650,000	606,064	0.48%
MEITUAN DIANPING 2.125% S/A 28OCT2025 REGS	1,000,000	907,039	0.71%
PCGI INTERMEDIATE HLDGS III LTD 4.5% S/A 23AUG2026	500,000	485,265	0.38%
POWERLONG REAL ESTATE HLDGS LTD 6.25% S/A 10AUG2024	2,370,000	462,812	0.36%
SUN HUNG KAI PROPERTIES CAPITAL MARKET LTD 2.875% S/A 21JAN2030	500,000	456,654	0.36%

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)

2022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)			
SUNRISE CAYMAN LTD 5.25% S/A 11MAR2024	2,000,000	2,045,183	1.61%
TENCENT HLDGS LTD 3.975% S/A 11APR2029 REGS	2,000,000	1,918,187	1.51%
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD 7.1% S/A 10SEP2024	2,130,000	152,551	0.12%
		<u>27,900,974</u>	<u>21.93%</u>
中国内地			
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD 4.4% A PERP	500,000	476,579	0.37%
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP 2.85% S/A 21JAN2032	1,000,000	947,997	0.75%
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP/HONG KONG 3M L+0.66% Q 22OCT2022	2,870,000	2,881,259	2.27%
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD/HONG KONG 0.839% S/A 15JUN2024	1,250,000	1,188,566	0.93%
CHINA MINMETALS CORP 3.75% S/A PERP	2,000,000	2,011,040	1.58%
GUANGZHOU FINELAND REAL ESTATE DEVELOPMENT CO LTD 13.6% S/A 27JUL2023	710,000	382,809	0.30%
GUOREN PROPERTY & CASUALTY INSURANCE CO LTD 3.35% S/A 01JUN2026	1,060,000	985,219	0.77%
JINKE PROPERTIES GROUP CO LTD 6.85% S/A 28MAY2024	1,500,000	385,109	0.30%
SHENZHEN EXPRESSWAY CO LTD 1.75% S/A 08JUL2026	400,000	369,292	0.29%
SHOUGANG GROUP CO LTD 4% S/A 23MAY2024	1,000,000	1,002,832	0.79%
		<u>10,630,702</u>	<u>8.35%</u>
德国			
ALLIANZ SE 3.2% A PERP	800,000	592,914	0.47%
香港			
BANK OF CHINA HONG KONG LTD 1.33% S/A 17FEB2024	4,000,000	496,524	0.39%
BOCOM LEASING MANAGEMENT HONG KONG CO LTD 3M L+0.83% Q 02MAR2023	1,160,000	1,159,275	0.91%
CHINA PING AN INSURANCE OVERSEAS HLDGS LTD 2.85% S/A 12AUG2031	500,000	410,027	0.32%
CHONG HING BANK LTD 5.7% S/A PERP	560,000	573,257	0.45%
CITIC LTD 2.85% S/A 25FEB2030	650,000	579,862	0.46%
CITIC LTD 3.5% S/A 17FEB2032	800,000	733,278	0.58%

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)

2022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)			
CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 3.875% S/A 19JUN2029	1,000,000	933,662	0.73%
CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 5.125% S/A 14MAR2028	1,000,000	1,024,403	0.81%
CRCC CHENGAN LTD 3.97% S/A PERP	2,000,000	1,988,682	1.56%
GLP CHINA HLDGS LTD 2.95% S/A 29MAR2026	880,000	799,373	0.63%
LEADER GOAL INTL LTD 4.25% S/A PERP	1,000,000	1,021,565	0.80%
NANYANG COMMERCIAL BANK LTD 3.8% S/A 20NOV2029	1,500,000	1,473,252	1.16%
PINGAN REAL ESTATE CAPITAL LTD 3.45% S/A 29JUL2026	500,000	443,048	0.35%
SHANGRAO INVESTMENT HLDGS INTL CO LTD 4.3% S/A 16JAN2023	360,000	368,002	0.29%
VANKE REAL ESTATE HONG KONG CO LTD 3M L+1.55% Q 25MAY2023	3,000,000	2,992,139	2.35%
YAN GANG LTD 1.9% S/A 23MAR2026	500,000	463,256	0.36%
ZHEJIANG SEAPORT INTL CO LTD 1.98% S/A 17MAR2026	730,000	681,470	0.54%
		<u>16,141,075</u>	<u>12.69%</u>
印度			
ADANI GREEN ENERGY LTD 4.375% S/A 08SEP2024 REGS	1,250,000	1,141,903	0.90%
ADANI PORTS & SPECIAL ECONOMIC ZONE LTD 4.375% S/A 03JUL2029 REGS	600,000	543,721	0.43%
JSW STEEL LTD 3.95% S/A 05APR2027 REGS	540,000	440,373	0.35%
REC LTD 4.75% S/A 19MAY2023 REGS	500,000	505,126	0.40%
		<u>2,631,123</u>	<u>2.08%</u>
印度尼西亚			
BUKIT MAKMUR MANDIRI UTAMA 7.75% S/A 10FEB2026 REGS	1,000,000	886,304	0.70%
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK 3.398% S/A 09JUN2031	560,000	438,864	0.35%
INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM PERSERO 4.75% S/A 15MAY2025 REGS	350,000	350,304	0.28%
		<u>1,675,472</u>	<u>1.33%</u>
卢森堡			
SPIC LUXEMBOURG LATIN AMERICA RENEWABLE ENERGY INVESTMENT CO SARL 4.65% S/A 30OCT2023	1,000,000	1,018,179	0.80%

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)

2022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)			
毛里求斯			
AZURE POWER ENERGY LTD 3.575% S/A 19AUG2026 REGS	230,000	186,342	0.15%
GREENKO WIND PROJECTS MAURITIUS LTD 5.5% S/A 06APR2025 REGS	320,000	302,917	0.24%
		<u>489,259</u>	<u>0.39%</u>
荷兰			
MONG DUONG FINANCE HLDGS BV 5.125% S/A 07MAY2029 REGS	500,000	<u>408,974</u>	<u>0.32%</u>
新西兰			
BANK OF NEW ZEALAND S+0.81% Q 27JAN2027 REGS	1,080,000	<u>1,064,286</u>	<u>0.84%</u>
菲律宾			
SMC GLOBAL POWER HLDGS CORP 7% S/A PERP	1,390,000	<u>1,383,038</u>	<u>1.09%</u>
新加坡			
BOC AVIATION LTD 3.25% S/A 29APR2025 REGS	2,000,000	1,963,634	1.54%
TML HLDGS PTE LTD 4.35% S/A 09JUN2026	870,000	766,416	0.60%
		<u>2,730,050</u>	<u>2.14%</u>
西班牙			
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 6.5% Q PERP	200,000	<u>184,619</u>	<u>0.15%</u>
瑞典			
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB 5.125% S/A PERP	600,000	<u>550,934</u>	<u>0.43%</u>
英国			
PHOENIX GROUP HLDGS PLC 5.625% S/A PERP	310,000	<u>290,233</u>	<u>0.23%</u>
美国			
UNITED STATES OF AMERICA TREASURY BILL 0% A 07JUL2022	2,000,000	1,999,123	1.57%
		<u>107,991,322</u>	<u>84.94%</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)

2022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			
香港			
友邦保险控股有限公司	50,000	541,906	0.43%
阿里巴巴集团控股有限公司	30,000	427,790	0.34%
安徽海螺水泥股份有限公司－H股	60,000	259,962	0.20%
中银航空租赁有限公司	50,000	420,208	0.33%
中银香港(控股)有限公司	100,000	395,040	0.31%
龙源电力集团股份有限公司－H股	200,000	386,375	0.30%
招商银行股份有限公司－H股	66,000	441,553	0.35%
中国移动有限公司	75,000	468,314	0.37%
中国中铁股份有限公司－H股	300,000	185,414	0.15%
华润啤酒(控股)有限公司	60,000	447,288	0.35%
华润置地有限公司	60,000	279,841	0.22%
旭辉控股有限公司	280,800	140,985	0.11%
碧桂园服务控股有限公司	30,000	133,613	0.11%
香港交易及结算所有限公司	8,000	393,511	0.31%
华泰证券股份有限公司－H股	100,000	148,331	0.12%
金蝶国际软件集团有限公司	150,000	351,713	0.28%
李宁有限公司	48,000	444,688	0.35%
龙湖集团控股有限公司	50,000	236,068	0.19%
美团－B类股份	30,000	742,421	0.57%
网易	22,000	403,986	0.32%
中国石油天然气股份有限公司－H股	500,000	238,299	0.19%
申洲国际集团控股有限公司	20,000	242,249	0.19%
新鸿基地产发展有限公司	30,000	354,389	0.28%
舜宇光学科技(集团)有限公司	18,800	306,414	0.24%
腾讯控股有限公司	18,000	812,917	0.63%
药明生物技术有限公司	17,000	155,544	0.12%
中升集团控股有限公司	30,000	211,601	0.17%
		<u>9,570,420</u>	<u>7.53%</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)

2022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
集合投资计划			
香港			
领展房地产投资信托基金	30,000	244,670	0.19%
PREMIA中国国库及政策性银行债券长久期ETF－人民币	172,000	2,754,220	2.17%
		<u>2,998,890</u>	<u>2.36%</u>
外汇远期合约			
买入人民币128,237,818.49元及卖出20,699,862.01美元 (交易对手：中国银行(香港)有限公司)	—	(58,780)	(0.05%)
		<u>(58,780)</u>	<u>(0.05%)</u>
上市／挂牌投资总额		120,501,852	94.78%
其他资产净值		<u>6,634,821</u>	<u>5.22%</u>
于2022年6月30日的资产净值 (按成交价)		<u>127,136,673</u>	<u>100.00%</u>
投资总额，按成本计		<u><u>131,462,514</u></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)

2022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			
百慕大			
CHINA OIL AND GAS GROUP LTD 4.7% S/A 30JUN2026	400,000	353,872	2.17%
英属维尔京群岛			
ELECT GLOBAL INVESTMENTS LTD 4.85% S/A PERP	200,000	168,207	1.03%
HKT CAPITAL NO 6 LTD 3% S/A 18JAN2032	200,000	172,955	1.06%
NWD FINANCE BVI LTD 5.875% S/A PERP	200,000	203,514	1.25%
NWD FINANCE BVI LTD 6.15% S/A PERP	200,000	199,143	1.22%
NWD FINANCE BVI LTD 6.25% S/A PERP	300,000	277,291	1.70%
PEAK RE BVI HLDG LTD 5.35% S/A PERP	200,000	163,059	1.00%
TUSPARK FORWARD LTD 6.95% S/A 13MAY2024 (EXTENDED FROM 18JUN2022)	800,000	329,674	2.02%
WANDA PROPERTIES OVERSEAS LTD 6.875% S/A 23JUL2023	550,000	455,209	2.80%
		1,969,050	12.08%
开曼群岛			
BRIGHT SCHOLAR EDUCATION HLDGS LTD 7.45% S/A 31JUL2022	400,000	390,711	2.40%
CHINA HONGQIAO GROUP LTD 6.25% S/A 08JUN2024	520,000	485,416	2.98%
CHINA HONGQIAO GROUP LTD 7.125% S/A 22JUL2022	500,000	516,599	3.18%
CHINA SCE GROUP HLDGS LTD 5.95% S/A 29SEP2024	200,000	66,435	0.41%
CHINA SCE GROUP HLDGS LTD 7% S/A 02MAY2025	300,000	92,260	0.57%
CIFI HLDGS GROUP CO LTD 4.45% S/A 17AUG2026	400,000	235,718	1.45%
CIFI HLDGS GROUP CO LTD 6% S/A 16JUL2025	200,000	124,442	0.76%
EH CAR SERVICES LTD 7.75% S/A 14NOV2024	210,000	139,847	0.86%
GOLDEN EAGLE RETAIL GROUP LTD 4.625% S/A 21MAY2023 REGS	200,000	194,280	1.19%
GREENTOWN CHINA HLDGS LTD 4.7% S/A 29APR2025	500,000	404,177	2.48%

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)

2022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	197,438	1.21%
POWERLONG REAL ESTATE HLDGS LTD 6.25% S/A 10AUG2024	300,000	58,584	0.36%
POWERLONG REAL ESTATE HLDGS LTD 6.95% S/A 23JUL2023	200,000	41,797	0.26%
REDSUN PROPERTIES GROUP LTD 7.3% S/A 13JAN2025	350,000	61,133	0.38%
SUNAC CHINA HLDGS LTD 8.35% S/A 19APR2023	600,000	91,494	0.56%
WYNN MACAU LTD 4.875% S/A 01OCT2024 REGS	400,000	300,579	1.85%
YUZHOU GROUP HLDGS CO LTD 9.95% S/A 08JUN2023	300,000	25,158	0.15%
YUZHOU PROPERTIES CO LTD 7.7% S/A 20FEB2025	300,000	23,409	0.14%
YUZHOU PROPERTIES CO LTD 8.3% S/A 27MAY2025	700,000	51,737	0.32%
YUZHOU PROPERTIES CO LTD 8.375% S/A 30OCT2024	350,000	27,853	0.17%
YUZHOU PROPERTIES CO LTD 8.5% S/A 04FEB2023	300,000	26,025	0.16%
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD 7.1% S/A 10SEP2024	200,000	14,324	0.09%
		<u>3,569,416</u>	<u>21.93%</u>
中国内地			
CITY DEVELOPMENT CO OF LAN ZHOU 4.15% S/A 15NOV2022	200,000	182,359	1.12%
DALIAN DETA HLDG CO LTD 5.95% S/A 29JUL2022	250,000	254,548	1.56%
GUANGZHOU FINELAND REAL ESTATE DEVELOPMENT CO LTD 13.6% S/A 27JUL2023	480,000	258,801	1.59%
JINKE PROPERTIES GROUP CO LTD 6.85% S/A 28MAY2024	400,000	102,696	0.63%
		<u>798,403</u>	<u>4.90%</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)
2022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			
BANK OF COMMUNICATIONS (HONG KONG) LTD 3.725% S/A PERP	300,000	299,160	1.84%
CATHAY PACIFIC MTN FINANCING HK LTD 4.875 S/A 17AUG2026	380,000	353,839	2.17%
GEMDALE EVER PROSPERITY INVESTMENT LTD 4.95% S/A 12AUG2024	200,000	146,109	0.90%
HONG KONG RED STAR MACALLINE UNIVERSAL HOME FURNISHINGS LTD 3.375% S/A 21SEP2022	350,000	276,806	1.70%
YANLORD LAND HK CO LTD 5.125% S/A 20MAY2026	800,000	614,293	3.78%
		<u>1,690,207</u>	<u>10.39%</u>
印度			
ADANI GREEN ENERGY LTD 4.375% S/A 08SEP2024 REGS	200,000	182,705	1.12%
ADANI PORTS & SPECIAL ECONOMIC ZONE LTD 4.2% S/A 04AUG2027 REGS	400,000	378,016	2.32%
MANAPPURAM FINANCE LTD 5.9% S/A 13JAN2023	250,000	254,598	1.56%
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD 5.1% S/A 16JUL2023 REGS	300,000	295,274	1.81%
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD 5.95% S/A 24OCT2022 REGS	250,000	250,693	1.54%
		<u>1,361,286</u>	<u>8.35%</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)

2022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			
ADARO INDONESIA 4.25% S/A 31OCT2024 REGS	250,000	238,960	1.47%
JERSEY, C.I.			
WEST CHINA CEMENT LTD 4.95% S/A 08JUL2026	380,000	315,042	1.94%
毛里求斯			
AZURE POWER ENERGY LTD 3.575% S/A 19AUG2026 REGS	220,000	178,239	1.09%
GREENKO POWER II LTD 4.3% S/A 13DEC2028 REGS	400,000	313,031	1.92%
GREENKO WIND PROJECTS MAURITIUS LTD 5.5% S/A 06APR2025 REGS	200,000	189,323	1.16%
INDIA CLEAN ENERGY HLDGS 4.5% S/A 18APR2027 REGS	250,000	188,621	1.16%
		869,214	5.33%
荷兰			
MONG DUONG FINANCE HLDGS BV 5.125% S/A 07MAY2029 REGS	300,000	245,384	1.51%
ROYAL CAPITAL BV 5% S/A PERP	570,000	565,718	3.47%
		811,102	4.98%
巴基斯坦			
PAKISTAN GOVERNMENT INTL BOND 6.875% S/A 05DEC2027 REGS	300,000	205,463	1.26%
PAKISTAN GOVERNMENT INTL BOND 8.25% S/A 15APR2024 REGS	250,000	200,114	1.23%
		405,577	2.49%
菲律宾			
SAN MIGUEL CORP 5.5% S/A PERP	300,000	300,685	1.85%
SMC GLOBAL POWER HLDGS CORP 7% S/A PERP	350,000	348,247	2.14%
		648,932	3.99%
新加坡			
INDIKA ENERGY CAPITAL III PTE LTD 5.875% S/A 09NOV2024 REGS	250,000	245,769	1.51%
LMIRT CAPITAL PTE LTD 7.25% S/A 16JUN2024	250,000	220,872	1.36%
MEDCO BELL PTE LTD 6.375% S/A 30JAN2027 REGS	250,000	219,212	1.35%
THETA CAPITAL PTE LTD 8.125% S/A 22JAN2025	250,000	225,024	1.38%
		910,877	5.60%

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)
2022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)			
泰国			
BANGKOK BANK PLC/HONG KONG 5% S/A PERP REGS	200,000	185,802	1.14%
英国			
VEDANTA RESOURCES FINANCE II PLC 13.875% S/A 21JAN2024 REGS	250,000	240,487	1.48%
		14,368,227	88.24%
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	416,336	2.56%
上市／挂牌投资总额		14,784,563	90.81%
非上市投资			
债务证券			
印度			
JSW INFRASTRUCTURE LTD 4.95% S/A 21JAN2029 REGS	200,000	160,976	0.99%
英属维尔京群岛			
STUDIO CITY FINANCE LTD 5% S/A 15JAN2029 REGS	200,000	106,313	0.65%
美国			
UNITED STATES OF AMERICA TREASURY BILL 0% A 08SEP2022	800,000	797,610	4.91%
非上市／非挂牌投资总额		1,064,899	6.55%

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)

2022年6月30日

非上市投资(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548,881.00澳元及卖出381,999.22美元 (交易对手：中国银行(香港)有限公司)		(2,463)	(0.02%)
买入215,601.00英镑及卖出264,941.29美元 (交易对手：中国银行(香港)有限公司)		(2,267)	(0.01%)
买入人民币14,366,712.99元及卖出2,151,285.23美元 (交易对手：中国银行(香港)有限公司)		(5,998)	(0.04%)
买入206,255.00欧元及卖出218,877.81美元 (交易对手：中国银行(香港)有限公司)		(2,235)	(0.01%)
		(12,963)	(0.08%)
投资总额		15,836,499	97.11%
其他资产净值		471,302	2.89%
于2022年6月30日的资产净值(按成交价)		16,307,801	100.00%
投资总额，按成本计		20,806,171	

中银香港盈荟系列
中银香港全天候ESG多元资产基金

投资组合(未经审计)

2022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			
澳大利亚			
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA S+0.97% Q 14MAR2027 REGS	250,000	249,208	0.90%
WESTPAC BANKING CORP 3M S+1% Q 26AUG2025	1,100,000	1,098,560	3.95%
		<u>1,347,768</u>	<u>4.85%</u>
中国内地			
YIBIN EMERGING INDUSTRY INVESTMENT GROUP CO LTD 2.2% S/A 17JUL2024	300,000	<u>284,559</u>	<u>1.02%</u>
法国			
SOCIETE GENERALE SA S+1.05% Q 21JAN2026 REGS	690,000	<u>670,344</u>	<u>2.41%</u>
印度			
JSW INFRASTRUCTURE LTD 4.95% S/A 21JAN2029 REGS	200,000	<u>160,976</u>	<u>0.58%</u>
新西兰			
BANK OF NEW ZEALAND S+0.81% Q 27JAN2027 REGS	1,080,000	<u>1,064,286</u>	<u>3.83%</u>
新加坡			
UNITED OVERSEAS BANK LTD S+0.7% Q 07APR2025 REGS	500,000	<u>501,356</u>	<u>1.81%</u>
		<u>4,029,289</u>	<u>14.50%</u>
上市／挂牌投资			
债务证券			
英属维尔京群岛			
HKT CAPITAL NO 6 LTD 3% S/A 18JAN2032	200,000	172,955	0.62%
TSMC GLOBAL LTD 2.25% S/A 23APR2031 REGS	200,000	<u>170,800</u>	<u>0.61%</u>
		<u>343,755</u>	<u>1.23%</u>

中银香港盈荟系列
中银香港全天候ESG多元资产基金

投资组合(未经审计)(续)
2022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			
MEITUAN DIANPING 2.125% S/A 28OCT2025 REGS	600,000	544,223	1.96%
BAIDU INC 3.5% S/A 28NOV2022	600,000	602,693	2.17%
BAIDU INC 2.375% S/A 23AUG2031	600,000	504,687	1.82%
TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP 2% S/A 03SEP2030	600,000	474,291	1.71%
ENN ENERGY HLDGS LTD 4.625% S/A 17MAY2027 REGS	200,000	203,327	0.73%
		<u>2,329,221</u>	<u>8.39%</u>
中国内地			
BANK OF CHINA/MACAU S+0.78% Q 28APR2025	430,000	430,824	1.55%
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP/MACAU S+0.5% Q 21DEC2024	1,690,000	1,682,455	6.05%
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD/ SINGAPORE 1% S/A 28OCT2024	600,000	569,700	2.05%
		<u>2,682,979</u>	<u>9.65%</u>
德国			
ALLIANZ SE 3.2% A PERP	200,000	148,228	0.53%
香港			
GLP CHINA HLDGS LTD 4.974% S/A 26FEB2024	800,000	810,425	2.92%
PINGAN REAL ESTATE CAPITAL LTD 3.45% S/A 29JUL2026	300,000	265,829	0.96%
		<u>1,076,254</u>	<u>3.88%</u>
印度			
JSW STEEL LTD 3.95% S/A 05APR2027 REGS	210,000	171,256	0.62%
RELIANCE INDUSTRIES LTD 3.625% S/A 12JAN2052 REGS	250,000	189,159	0.68%
		<u>360,415</u>	<u>1.30%</u>
日本			
MIZUHO FINANCIAL GROUP INC S+0.96% Q 22MAY2026	540,000	528,048	1.90%

中银香港盈荟系列
中银香港全天候ESG多元资产基金

投资组合(未经审计)(续)

2022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			
KODIT GLOBAL 2022 THE 1ST SECURITIZATION SPECIALTY CO LTD 3.619% S/A 27MAY2025	200,000	198,638	0.71%
KOREA ELECTRIC POWER CORP 4% S/A 14JUN2027 REGS	210,000	210,810	0.76%
		409,448	1.47%
毛里求斯			
GREENKO WIND PROJECTS MAURITIUS LTD 5.5% S/ A 06APR2025 REGS	320,000	302,917	1.09%
AZURE POWER ENERGY LTD 3.575% S/A 19AUG2026 REGS	600,000	486,109	1.75%
CLEAN RENEWABLE POWER MAURITIUS PTE LTD 4.25% S/A 25MAR2027 REGS	300,000	235,971	0.85%
		1,024,997	3.69%
泰国			
KASIKORNBANK PCL/HOKG KONG 4% S/A PERP GC TREASURY CENTER CO LTD 2.98% S/A 18MAR2031 REGS	300,000	256,343	0.92%
	500,000	421,358	1.52%
THAIOIL TREASURY CENTER CO LTD 2.5% S/A 18JUN2030 REGS	250,000	201,403	0.72%
		879,104	3.16%
美国			
HANWHA ENERGY USA HLDGS CORP 4.125% S/A 05JUL2025 REGS (FUNGED)	200,000	200,820	0.72%
		9,983,269	35.92%
存托凭证			
台湾			
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO- ADR	5,000	408,750	1.47%
		408,750	1.47%

中银香港盈荟系列
中银香港全天候ESG多元资产基金

投资组合(未经审计)(续)
2022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			
香港			
中国移动有限公司	100,000	624,419	2.25%
友邦保险控股有限公司	30,000	325,144	1.17%
恒生银行有限公司	20,000	352,988	1.27%
中国电信集团有限公司－H股	1,000,000	340,244	1.23%
中国建筑材料集团有限公司－H股	500,000	533,942	1.92%
交通银行股份有限公司－H股	1,000,000	690,683	2.49%
		<u>2,867,420</u>	<u>10.33%</u>
美国			
WALT DISNEY CO	3,000	283,200	1.02%
APPLE INC	4,271	583,931	2.10%
AMAZON.COM INC	4,480	475,821	1.71%
ALPHABET INC-CL C	300	656,235	2.36%
MICROSOFT CORP	2,500	642,075	2.31%
COSTCO WHOLESALE CORP	1,500	718,920	2.59%
NVIDIA CORP	2,000	303,180	1.09%
TESLA INC	500	336,710	1.21%
VISA INC – A	3,000	590,670	2.13%
HOME DEPOT INC	1,910	523,856	1.88%
COCA-COLA CO	5,000	314,550	1.13%
PROCTER & GAMBLE CO	5,655	813,132	2.93%
VERIZON COMMUNICATIONS INC	20,000	1,015,000	3.65%
SALESFORCE INC	2,000	330,080	1.19%
JPMORGAN CHASE & CO	4,000	450,440	1.62%
PFIZER INC	5,000	262,150	0.94%
ASML HLDG NV-NY REG	1,000	475,880	1.71%
		<u>8,775,830</u>	<u>31.57%</u>
		<u>11,643,250</u>	<u>41.90%</u>

中银香港盈荟系列
中银香港全天候ESG多元资产基金

投资组合(未经审计)(续)

2022年6月30日

	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2,449,209.00澳元及卖出1,704,551.50美元 (交易对手：中国银行(香港)有限公司)		(11,256)	(0.04%)
买入722,427.00英镑及卖出887,754.42美元 (交易对手：中国银行(香港)有限公司)		(7,596)	(0.03%)
买入人民币29,890,255.00元及卖出4,475,795.12美元 (交易对手：中国银行(香港)有限公司)		(12,710)	(0.05%)
买入330,000.00欧元及卖出350,196.00美元 (交易对手：中国银行(香港)有限公司)		(3,576)	(0.01%)
		<u>(35,138)</u>	<u>(0.13%)</u>
投资总额		26,029,420	93.66%
其他资产净值		<u>1,793,112</u>	<u>6.34%</u>
于2022年6月30日的资产净值 (按成交价)		<u>27,822,532</u>	<u>100.00%</u>
投资总额，按成本计		<u>28,665,638</u>	

中银香港盈荟系列

投资组合变动表(未经审计)

截至2022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	
	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年
	%	%	%	%	%	%	%	%	%	%	%	%
权益性证券												
澳大利亚	1.05	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
英属维尔京群岛	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
开曼群岛	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中国内地	-	-	-	-	15.24	11.77	81.93	71.81	-	-	11.25	-
法国	5.02	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
香港	3.55	38.62	-	-	72.99	70.15	14.85	25.35	-	-	39.86	57.28
印度	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
印度尼西亚	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
日本	1.60	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
韩国	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	4.72	18.93
卢森堡	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
马来西亚	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
蒙古	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
荷兰	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
新西兰	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
菲律宾	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
新加坡	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	18.29	-
斯里兰卡	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西班牙	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
泰国	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
英国	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
美国	28.32	11.32	-	-	-	-	-	-	-	-	17.31	-

中银香港盈荟系列

投资组合变动表(未经审计)(续)

截至2022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	
	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年
	%	%	%	%	%	%	%	%	%	%	%	%
债务证券												
澳大利亚	-	-	-	0.67	-	-	-	-	3.75	1.62	-	-
巴林	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
百慕大	-	-	2.00	3.18	-	-	-	-	0.14	1.74	-	-
英属维尔京群岛	11.12	6.40	12.70	14.88	-	-	-	-	22.17	16.62	-	-
加拿大	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.09	-	-
开曼群岛	2.24	6.33	20.09	62.84	-	-	-	-	8.08	31.68	-	-
中国内地	2.40	2.18	17.58	4.31	-	-	-	-	6.41	4.77	-	-
埃及	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
法国	2.07	2.31	-	-	-	-	-	-	0.63	0.26	-	-
德国	2.06	2.16	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
香港	-	2.08	12.81	5.91	-	-	-	-	10.12	10.62	-	-
印度	-	-	2.47	0.78	-	-	-	-	9.03	6.02	-	-
印度尼西亚	2.53	2.57	-	0.42	-	-	-	-	5.60	3.49	-	-
Isle of Man	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
日本	-	-	-	-	-	-	-	-	3.35	1.42	-	-
约旦	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Jersey, C.I.	-	-	1.79	-	-	-	-	-	0.71	-	-	-
韩国	-	-	-	-	-	-	-	-	1.95	1.42	-	-
澳门	-	-	-	-	-	-	-	-	0.47	0.24	-	-
马来西亚	-	-	-	-	-	-	-	-	0.47	2.79	-	-
毛里求斯	2.34	-	2.95	-	-	-	-	-	1.57	-	-	-
墨西哥	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
蒙古	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.09	-	-
荷兰	-	2.31	0.74	-	-	-	-	-	2.03	2.00	-	-
新西兰	2.52	-	-	-	-	-	-	-	2.24	-	-	-
尼日利亚	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
阿曼	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
巴基斯坦	-	-	0.32	0.25	-	-	-	-	0.30	0.24	-	-
菲律宾	-	-	3.05	1.52	-	-	-	-	2.75	3.71	-	-
葡萄牙	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
沙特阿拉伯	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.73	-	-
新加坡	-	-	4.62	3.72	-	-	-	-	6.40	4.09	-	-
西班牙	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
斯里兰卡	-	-	-	0.76	-	-	-	-	-	0.46	-	-
超国家	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞典	-	2.22	-	-	-	-	-	-	0.52	0.29	-	-
瑞士	-	-	-	-	-	-	-	-	0.44	0.24	-	-
泰国	-	-	0.48	-	-	-	-	-	2.16	2.04	-	-
土耳其	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
阿联酋	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
英国	2.31	-	1.44	0.12	-	-	-	-	0.28	1.80	-	-
美国	-	2.07	-	1.00	-	-	-	-	0.49	1.14	-	-
乌兹别克斯坦	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.12	-	-

中银香港盈荟系列

投资组合变动表(未经审计)(续)

截至2022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	
	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年
	%	%	%	%	%	%	%	%	%	%	%	%
债务证券(续)												
越南	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.10	-	-
赞比亚	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
集合投资计划												
澳大利亚	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中国内地	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
香港	1.19	1.98	2.36	1.07	-	-	-	-	2.52	1.20	-	2.50
日本	-	0.84	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
卢森堡	-	-	-	0.62	-	-	-	-	-	-	-	-
新加坡	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1.00
英国	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
美国	13.22	13.58	-	-	-	-	-	-	-	-	-	5.73
存托凭证												
印度	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
台湾	0.50	1.25	-	-	-	-	-	-	-	-	-	8.21
英国	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
美国	4.39	-	-	-	-	-	-	-	-	-	6.24	3.84
非上市/非挂牌投资												
债务证券												
澳大利亚	3.44	-	1.20	-	-	-	-	-	-	-	-	-
英属维尔京群岛	-	-	1.62	-	-	-	-	-	-	-	-	-
开曼群岛	-	-	1.77	-	-	-	-	-	-	-	-	-
印度	1.98	-	1.04	-	-	-	-	-	-	-	-	-
新西兰	3.04	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
美国	-	-	3.84	-	-	-	-	-	-	-	-	-
集合投资计划												
卢森堡	-	-	0.73	-	-	-	-	-	-	-	-	-
外汇远期合约												
投资总额	96.89	98.22	95.33	101.06	88.23	81.89	96.65	97.25	94.52	100.81	97.70	97.44
其他资产净值	3.11	1.78	4.67	(1.06)	11.77	18.11	3.35	2.75	5.48	(0.81)	2.30	2.56
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2022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	
	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年
	%	%	%	%	%	%	%	%	%	%	%	%
权益性证券												
澳大利亚	-	-	4.68	12.03	-	-	-	-	-	-	-	-
英属维尔京群岛	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
开曼群岛	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中国内地	5.42	1.37	13.87	10.52	-	-	3.02	2.85	-	-	-	-
法国	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
香港	51.27	71.65	49.88	39.37	-	-	5.65	4.04	7.53	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
斯里兰卡	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
西班牙	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
泰国	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
英国	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
美国	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

中银香港盈荟系列

投资组合变动表(未经审计)(续)

截至2022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	
	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年
	%	%	%	%	%	%	%	%	%	%	%	%
债务证券												
澳大利亚	-	-	-	-	2.41	-	-	0.76	1.54	2.11	-	-
巴林	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
百慕大	-	1.25	-	1.42	-	-	-	1.78	0.56	2.31	2.17	2.30
英属维尔京群岛	6.69	4.49	3.99	0.54	12.99	14.43	21.07	15.25	27.19	25.23	12.73	14.99
加拿大	-	0.32	-	-	1.21	-	-	-	0.84	-	-	-
开曼群岛	3.54	7.46	3.59	15.18	4.93	9.89	7.33	29.81	21.93	35.25	21.93	53.32
中国内地	4.71	-	-	-	-	10.83	10.65	6.68	8.35	7.57	4.90	4.21
埃及	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
法国	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
德国	-	-	-	-	-	-	-	-	0.47	0.30	-	-
香港	7.12	1.24	-	-	17.79	11.41	3.79	9.00	12.69	11.99	10.39	6.02
印度	1.95	-	-	-	-	-	3.38	5.28	2.08	1.53	9.34	2.68
印度尼西亚	-	1.29	1.82	-	-	-	7.54	-	1.33	2.21	1.37	1.48
Isle of Man	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
日本	-	-	-	-	2.26	-	4.54	1.40	-	0.24	-	-
Jersey, C.I.	-	-	1.88	-	-	-	-	-	-	-	1.94	-
约旦	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
韩国	-	-	-	-	12.16	-	-	3.48	-	-	-	-
卢森堡	-	-	-	-	-	-	-	-	0.80	0.48	-	-
澳门	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.23	-	-
马来西亚	-	-	-	-	-	-	-	2.08	-	2.14	-	-
毛里求斯	2.23	-	2.11	-	-	-	2.12	-	0.39	-	5.33	-
墨西哥	-	-	-	-	-	-	-	0.69	-	-	-	-
蒙古	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.09	-	0.67
荷兰	-	-	-	-	-	-	1.52	1.78	0.32	0.45	4.98	2.57
新西兰	-	-	-	-	-	-	1.22	-	0.84	-	-	-
尼日利亚	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
阿曼	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
巴基斯坦	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	2.49	1.66
菲律宾	-	-	-	-	-	-	-	-	1.09	0.95	3.99	1.97
葡萄牙	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
新加坡	-	-	-	-	-	-	2.98	-	2.14	2.38	5.60	3.75
西班牙	-	-	-	-	-	-	-	-	0.15	0.10	-	-
斯里兰卡	-	1.17	-	-	-	-	-	-	-	-	-	2.35
超国家	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞典	-	-	-	-	-	-	-	-	0.43	0.29	-	-
瑞士	1.81	-	-	-	-	-	0.94	-	-	-	-	-
泰国	-	-	-	-	-	-	2.31	-	-	1.42	1.14	-
土耳其	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
阿联酋	-	-	-	-	-	-	-	0.71	-	-	-	-
英国	-	1.23	-	-	-	-	-	1.13	0.23	0.15	1.48	1.07
美国	-	-	-	1.40	-	13.09	-	2.83	1.57	0.34	4.91	-

中银香港盈荟系列

投资组合变动表(未经审计)(续)

截至2022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	
	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年	2022年	2021年
	%	%	%	%	%	%	%	%	%	%	%	%
债务证券(续)												
越南	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
赞比亚	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
集合投资计划	-	-										
澳大利亚	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中国内地	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
香港	2.49	4.61	2.36	1.42	-	-	1.88	3.91	2.36	1.21	2.56	1.15
日本	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
卢森堡	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
新加坡	-	-	0.84	1.47	-	-	-	-	-	-	-	-
英国	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
美国	-	-	-	11.82	-	-	-	-	-	-	-	-
存托凭证	-											
印度	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
台湾	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
英国	-	-	-	3.04	-	-	-	-	-	-	-	-
美国	-	1.84	-	0.96	-	-	-	-	-	-	-	-
非上市/非挂牌投资												
债务证券												
澳大利亚	-	-	-	-	-	-	4.23	-	-	-	-	-
英属维尔京群岛	13.57	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
开曼群岛	-	-	-	-	-	-	3.80	-	-	-	-	-
中国内地	2.27	-	-	-	-	-	1.76	-	-	-	-	-
法国	-	-	-	-	-	-	2.04	-	-	-	-	-
印度	1.92	-	-	-	-	-	1.00	-	-	-	-	-
新西兰	-	-	-	-	-	-	3.23	-	-	-	-	-
新加坡	-	-	-	-	-	-	1.55	-	-	-	-	-
外汇远期合约	0.11	(0.17)	0.08	(0.27)	0.04	(0.10)	(0.10)	(0.44)	(0.05)	(0.16)	(0.08)	(0.31)
投资总额	95.10	97.75	85.10	98.90	53.79	59.56	97.44	93.02	94.78	98.81	97.27	99.88
其他资产净值	4.90	2.25	14.90	1.10	46.21	40.44	2.56	6.98	5.22	1.19	2.73	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	100.00

中银香港盈荟系列

投资组合变动表(未经审计)(续)
截至2022年6月30日止年度

	中银香港 全天候ESG 多元资产基金 2022年 %
权益性证券	
香港	10.33
美国	31.57
债务证券	
英属维尔京群岛	1.23
开曼群岛	8.39
中国内地	9.65
德国	0.53
香港	3.88
印度	1.30
日本	1.90
韩国	1.47
毛里求斯	3.69
泰国	3.16
美国	0.72
存托凭证	
台湾	1.47
非上市／非挂牌投资	
债务证券	
澳大利亚	4.85
中国内地	1.02
法国	2.41
印度	0.58
新西兰	3.83
新加坡	1.81
外汇远期合约	(0.13)
投资总额	93.66
其他资产净值	6.34
于6月30日的资产净值	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	A1类	A2类	A3类	子基金的资产净值 A4类	A7类	A8类	A9类
中银香港全天候环球 投资基金 (附注1)	30.6.2022 30.6.2021 30.6.2020	1,225,297美元 1,734,422美元 1,423,661美元	35,915,627港元 38,112,186港元 26,680,657港元	12,433 澳元 16,700 澳元 14,770 澳元	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²
中银香港全天候中国高息 债券基金 (附注2)	30.6.2022 30.6.2021 30.6.2020	人民币160,528,936元 人民币341,960,026元 人民币516,358,454元	4,117,578美元 6,303,183美元 10,412,769美元	173,236,664港元 330,154,244港元 325,497,232港元	2,257,323 澳元 4,528,564 澳元 3,628,973 澳元	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	9,425,687美元 24,794,166美元 30,319,880美元	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)	30.6.2022 30.6.2021 30.6.2020	123,904,466港元 159,604,432港元 114,365,311港元	2,151,453美元 2,966,326美元 3,089,116美元	489,331 澳元 255,640 澳元 403,847 澳元	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	人民币3,983,842元 人民币3,207,918元 人民币1,485,686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
中银香港全天候在岸人民币 股票基金 (附注4)	30.6.2022 30.6.2021 30.6.2020	人民币31,976,290元 人民币49,343,070元 人民币32,282,907元	8,808,209美元 13,129,086美元 10,366,902美元	176,162,133港元 238,796,770港元 161,637,339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	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	45,848,824港元 49,359,708港元 15,143,730港元
中银香港全天候亚洲 债券基金 (附注5)	30.6.2022 30.6.2021 30.6.2020	28,024,746美元 74,342,844美元 60,555,558美元	236,106,756港元 58,186,478港元 411,870,824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147,109,179元 人民币43,342,407元 人民币128,285,425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 (日本除外) 股票基金 (附注6)	30.6.2022 30.6.2021 30.6.2020	307,070美元 494,633美元 366,039美元	10,321,383港元 16,675,168港元 9,633,985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807,527元 人民币1,732,333元 人民币2,014,675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	A1类	A2类	A3类	子基金的资产净值 A4类	A7类	A8类	A9类
中银香港全天候中国 收益基金 (附注7)	30.6.2022 30.6.2021 30.6.2020	38,992,465港元 69,694,335港元 86,042,096港元	921,064美元 1,730,480美元 2,521,461美元	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	人民币6,835,790元 人民币17,344,342元 人民币20,301,311元	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)	30.6.2022 30.6.2021 30.6.2020	1,133,568美元 2,268,233美元 2,259,278美元	36,360,613港元 61,087,622港元 59,649,871港元	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	574,706澳元 851,725澳元 967,947澳元	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	人民币7,043,997元 人民币10,385,676元 人民币13,174,939元	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)	30.6.2022 30.6.2021 30.6.2020	9,989,053美元 23,785,664美元 60,396,889美元	151,928,069港元 195,940,889港元 187,802,225港元	人民币1,463,430元 人民币976,487元 人民币855,756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	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²
中银香港全天候一带一路 债券基金 (附注10)	30.6.2022 30.6.2021 30.6.2020	4,301,030美元 6,975,955美元 8,332,069美元	46,999,125港元 78,123,191港元 77,395,052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	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	人民币39,286,414元 人民币74,015,750元 人民币31,905,215元	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)	30.6.2022 30.6.2021 30.6.2020 ¹	20,124,583美元 34,832,772美元 31,011,089美元	444,733,310港元 755,697,590港元 566,204,325港元	134,838,402澳门元 198,742,257澳门元 306,539,191澳门元	人民币29,577,938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	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)	30.6.2022 30.6.2021 ¹	3,368,868美元 7,981,974美元	50,989,596港元 119,189,072港元	不适用 ² 不适用 ²	524,711澳元 1,076,199澳元	205,733英镑 395,651英镑	人民币13,807,839元 人民币30,282,114元	人民币13,807,839元 人民币30,282,114元
中银香港全天候ESG多元资产 基金 (附注13)	30.6.2022 ¹	5,461,636美元	74,484,306港元	不适用 ²	2,448,295澳元	711,131英镑	不适用 ²	人民币29,750,483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、每份额A8类基金人民币10元、每份额X1类基金10美元及每份额X2类基金10港元向投资者发售。
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10港元、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。
附注13：	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A10类基金10欧元、每份额X11类基金10美元及每份额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	A10类	A11类	CI类	子基金的资产净值 X1类	X2类	X3类	II类
中银香港全天候环球 投资基金 (附注1)	30.6.2022 30.6.2021 30.6.2020	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	18,017,360港元 23,206,275港元 19,915,413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
中银香港全天候中国高息 债券基金 (附注2)	30.6.2022 30.6.2021 30.6.2020	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	人民币109,404,487元 人民币239,650,366元 人民币282,694,034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	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)	30.6.2022 30.6.2021 30.6.2020	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	10,995,287港元 40,451,805港元 28,857,160港元	1,523,559.96美元 不适用 ² 992,945美元	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²
中银香港全天候在岸人民币 股票基金 (附注4)	30.6.2022 30.6.2021 30.6.2020	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 不适用 ²	5,501,893港元 14,264,525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 (附注5)	30.6.2022 30.6.2021 30.6.2020	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	25,405,392美元 42,477,207美元 40,381,593美元	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	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)	30.6.2022 30.6.2021 30.6.2020	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 ² 553,128美元	15,762,336港元 18,659,842港元 25,744,023港元	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	不适用 ² 1,274,844美元 1,025,620美元
中银香港全天候中国 收益基金 (附注7)	30.6.2022 30.6.2021 30.6.2020	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	11,421,801港元 22,073,569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 不适用 ²	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)	30.6.2022 30.6.2021 30.6.2020	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	957,207美元 1,956,204美元 不适用 ²	5,138,807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 不适用 ² 不适用 ²
中银香港全天候短期债券 基金 (附注9)	30.6.2022 30.6.2021 30.6.2020	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	不适用 ² 不适用 ² 10,249,420美元	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	12,251,412美元 1,224,696美元 4,257,540美元	62,432,130港元 43,902,350港元 52,742,660港元	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	不适用 ² 35,551,003美元 59,549,616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	A10类	A11类	C1类	子基金的资产净值 X1类	X2类	X3类	I1类
中银香港全天候一带一路 债券基金 (附注10)	30.6.2022 30.6.2021 30.6.2020	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 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
中银香港全天候大湾区 策略基金 (附注11)	30.6.2022 30.6.2021 30.6.2020	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	人民币137,427,884元 人民币214,999,147元 人民币116,397,180元	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	8,746,850美元 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 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)	30.6.2022 30.6.2021	196,542欧元 347,372欧元	不适用 ² 不适用 ²	不适用 ² 不适用 ²	不适用 ² 不适用 ²	27,931,973港元 44,634,712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ESG多元资产 基金 (附注13)	30.6.2022	330,774欧元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	11,638,618港元	不适用 ²	4,032,559美元
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9.64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、每份A8类基金人民币10元及每份X1类基金8.62港元向投资者发售。							
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、每份A8类基金人民币10元、每份X1类基金10美元及每份X2类基金10港元向投资者发售。							
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类基金人民币10元、每份C1类基金10.40美元、每份X1类基金10美元、每份X2类基金10港元及每份X3类基金10港元、每份X4类基金10.40美元及每份X5类基金10.40美元向投资者发售。							
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10港元、每份A3类基金人民币9.93澳门元、每份A4类基金人民币10元、每份A5类基金人民币10元、每份A6类基金人民币9.78美元及每份X1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A3类基金10港元、每份A4类基金10港元、每份A5类基金人民币10元、每份A6类基金人民币10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。							
附注13：	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A4类基金10港元、每份A5类基金10欧元、每份A6类基金10欧元、每份A7类基金10欧元、每份A8类基金10欧元、每份A9类基金10欧元、每份A10类基金10欧元、每份A11类基金10欧元及每份X1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)	30.6.2022	不适用 ²	不适用 ²	不适用 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
中银香港全天候中国高息 债券基金(附注2)	30.6.2022	不适用 ²	不适用 ²	不适用 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
中银香港全天候香港 股票基金(附注3)	30.6.2022	1,002,795美元	不适用 ²	不适用 ²
	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
中银香港全天候在岸人民币 股票基金(附注4)	30.6.2022	2,772,853美元	不适用 ²	不适用 ²
	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
中银香港全天候亚洲 债券基金(附注5)	30.6.2022	不适用 ²	不适用 ²	不适用 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
中银香港全天候亚洲 (日本除外)股票基金(附注6)	30.6.2022	不适用 ²	不适用 ²	不适用 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
中银香港全天候中国 收益基金(附注7)	30.6.2022	不适用 ²	不适用 ²	不适用 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
中银香港全天候亚太高收益 基金(附注8)	30.6.2022	不适用 ²	不适用 ²	不适用 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
中银香港全天候短期债券 基金(附注9)	30.6.2022	不适用 ²	不适用 ²	不适用 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	130,636,536欧元
中银香港全天候一带一路 债券基金(附注10)	30.6.2022	不适用 ²	不适用 ²	不适用 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
中银香港全天候大湾区 策略基金(附注11)	30.6.2022			
	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
中银香港全天候亚洲 高息债券基金(附注12)	30.6.2022 30.6.2021 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
中银香港全天候ESG多元资产 基金(附注13)	30.6.2022 ¹	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²

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。

附注13： 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A10类基金10欧元、每份额I1类基金10美元及每份额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	A1类	A2类	A3类	子基金的每份资产净值 A4类	A7类	A8类	A9类
中银香港全天候环球 投资基金 (附注1)	30.6.2022 30.6.2021 30.6.2020	9.38美元 12.36美元 10.76美元	9.49港元 12.38港元 10.76港元	12.64澳元 16.98澳元 15.02澳元	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²
中银香港全天候中国高息 债券基金 (附注2)	30.6.2022 30.6.2021 30.6.2020	人民币5.80元 人民币10.05元 人民币9.96元	5.33美元 9.56美元 8.68美元	5.40港元 9.58港元 8.68港元	5.24澳元 9.33澳元 9.41澳元	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	8.84美元 9.07美元 9.20美元	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)	30.6.2022 30.6.2021 30.6.2020	9.52港元 13.37港元 10.48港元	9.41美元 13.36美元 10.49美元	9.24澳元 13.22澳元 10.63澳元	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	人民币10.73元 人民币14.83元 人民币11.38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
中银香港全天候在岸人民币 股票基金 (附注4)	30.6.2022 30.6.2021 30.6.2020	人民币11.65元 人民币13.71元 人民币10.61元	10.81美元 13.17美元 9.32美元	10.94港元 13.19港元 9.32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	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	10.12港元 12.12港元 9.56港元
中银香港全天候亚洲 债券基金 (附注5)	30.6.2022 30.6.2021 30.6.2020	7.59美元 10.05美元 10.04美元	7.68港元 10.06港元 10.03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8.31元 人民币10.71元 人民币10.48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 (日本除外) 股票基金 (附注6)	30.6.2022 30.6.2021 30.6.2020	8.14美元 12.97美元 10.48美元	8.21港元 12.94港元 10.44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8.47元 人民币13.22元 人民币10.51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
中银香港全天候中国 收益基金 (附注7)	30.6.2021 30.6.2020 30.6.2019	8.07港元 8.07港元 9.25港元	8.12美元 8.13美元 9.25美元	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8.33元 人民币8.18元 人民币9.39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
中银香港全天候亚太高收益 基金 (附注8)	30.6.2022 30.6.2021 30.6.2020	6.63美元 9.54美元 8.69美元	6.63港元 9.44港元 8.58港元	6.09澳元 8.91澳元 8.24澳元	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	人民币6.89元 人民币9.71元 人民币8.68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
中银香港全天候短期债券 基金 (附注9)	30.6.2022 30.6.2021 30.6.2020	10.37美元 10.35美元 10.45美元	10.39港元 10.26港元 10.34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10.07元 人民币9.71元 人民币10.71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	A1类	A2类	A3类	子基金的每份资产净值 A4类	A7类	A8类	A9类
中银香港全天候一带一路 债券基金 (附注10)	30.6.2022 30.6.2021 30.6.2020	8.12美元 10.52美元 10.23美元	8.12港元 10.41港元 10.10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	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	人民币8.54元 人民币10.79元 人民币10.28元	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)	30.6.2022 30.6.2021 30.6.2020	7.68美元 9.67美元 10.05美元	7.68港元 9.75港元 9.93港元	7.68澳门元 9.74澳门元 9.93澳门元	人民币7.65元 人民币9.47元 人民币10.57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	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)	30.6.2022 30.6.2021	5.69美元 10.08美元	5.87港元 10.10港元	不适用 ² 不适用 ²	5.79澳门元 10.06澳门元	5.79英镑 10.03英镑	不适用 ² 不适用 ²	人民币6.02元 人民币10.28元
中银香港全天候ESG多元 资产基金 (附注13)	30.6.2022	7.80美元	7.88港元	不适用 ²	7.72澳门元	7.75英镑	不适用 ²	人民币7.91元
附注1： 份额乃于初步认购时按每份资产A1类基金10美元、每份资产A2类基金10港元、每份资产A3类基金10.5澳门元、每份资产A7类基金人民币10.44元及每份资产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资产A1类基金人民币10元、每份资产A2类基金10港元、每份资产A3类基金10港元、每份资产A4类基金10.39澳门元、每份资产A8类基金9.63美元、每份资产X1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资产A1类基金10港元、每份资产A2类基金10港元、每份资产A3类基金12.63澳门元、每份资产A7类基金人民币12.65元、每份资产X1类基金10港元及每份资产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资产A1类基金人民币10元、每份资产A2类基金10港元、每份资产A3类基金10港元及每份资产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资产A1类基金10美元、每份资产A2类基金10港元、每份资产A7类基金人民币10元、每份资产X1类基金9.91美元及每份资产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资产A1类基金10美元、每份资产A2类基金10港元、每份资产A7类基金人民币10元、每份资产X1类基金10港元及每份资产X2类基金10港元向投资者发售。								
附注7： 份额乃于初步认购时按每份资产A1类基金10港元、每份资产A2类基金10港元、每份资产A3类基金10港元及每份资产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资产A1类基金10美元、每份资产A2类基金10港元、每份资产A4类基金10港元及每份资产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资产A1类基金10美元、每份资产A2类基金10港元、每份资产A3类基金10港元、每份资产A4类基金10.40美元、每份资产X1类基金10美元、每份资产X2类基金10港元、每份资产X6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资产A1类基金10美元、每份资产A2类基金10港元、每份资产A3类基金10港元及每份资产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资产A1类基金10美元、每份资产A2类基金10港元、每份资产A3类基金9.94港元、每份资产A4类基金人民币10元、每份资产A7类基金人民币10元、每份资产A9类基金人民币10元、每份资产X1类基金10港元、每份资产X2类基金10港元及每份资产X6类基金10.4欧元向投资者发售。								
附注12： 份额乃于初步认购时按每份资产A1类基金10美元、每份资产A2类基金10港元、每份资产A3类基金10港元、每份资产A4类基金10港元、每份资产A7类基金人民币10元、每份资产A9类基金人民币10元、每份资产X1类基金10港元、每份资产X2类基金10港元及每份资产X6类基金10.4欧元向投资者发售。								
附注13： 份额乃于初步认购时按每份资产A1类基金10港元、每份资产A2类基金10港元、每份资产A3类基金10港元、每份资产A4类基金10港元、每份资产A7类基金人民币10元、每份资产A9类基金人民币10元、每份资产X1类基金10港元、每份资产X2类基金10港元及每份资产X6类基金10.4欧元向投资者发售。								

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	A10类	A11类	C1类	子基金的资产净值 X1类	X2类	X3类	11类
中银香港全天候环球 投资基金 (附注1)	30.6.2022 30.6.2021 30.6.2020	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	10.65港元 13.72港元 11.78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
中银香港全天候中国高息 债券基金 (附注2)	30.6.2022 30.6.2021 30.6.2020	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	人民币5.08元 人民币14.34元 人民币13.34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	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)	30.6.2022 30.6.2021 30.6.2020	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	9.01港元 12.51港元 9.69港元	10.06美元 不适用 ² 10.57美元	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²
中银香港全天候在岸人民币 股票基金 (附注4)	30.6.2022 30.6.2021 30.6.2020	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 不适用 ²	11.20港元 13.28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 (附注5)	30.6.2022 30.6.2021 30.6.2020	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	9.51美元 11.97美元 11.38美元	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	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)	30.6.2022 30.6.2021 30.6.2020	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 11.06美元	8.88港元 13.79港元 10.95港元	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	不适用 ² 13.07美元 10.51美元
中银香港全天候中国 收益基金 (附注7)	30.6.2022 30.6.2021 30.6.2020	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	8.27 不适用 ²	不适用 ² 不适用 ²	22,073,569港元 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)	30.6.2022 30.6.2021 30.6.2020	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	7.25美元 9.83美元 不适用 ²	6.75美元 不适用 ² 不适用 ²	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²
中银香港全天候短期债券 基金 (附注9)	30.6.2022 30.6.2021 30.6.2020	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 10.45美元	10.47美元 10.42美元 10.49美元	10.51港元 10.35港元 10.39港元	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	不适用 ² 10.39美元 10.48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	A10类	A11类	C1类	子基金的资产净值 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)	30.6.2022 30.6.2021 30.6.2020	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 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
中银香港全天候大湾区 策略基金 (附注11)	30.6.2022 30.6.2021 30.6.2020 ¹	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	人民币8.08元 人民币10.09元 人民币10.09元	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	8.56美元 10.43美元 10.13美元	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	不适用 ² 10.74美元 10.50美元
中银香港全天候亚洲高息 债券基金 (附注12)	30.6.2022 30.6.2021 ¹	5.80欧元 10.07欧元	不适用 ² 不适用 ²	不适用 ² 不适用 ²	不适用 ² 不适用 ²	6.71港元 10.74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ESG多元资产 基金 (附注13)	30.6.2022 ¹	7.75欧元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	8.22港元	不适用 ²	8.07美元
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9.64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A4类基金10.40美元、每份X1类基金10美元、每份X2类基金10港元、每份X3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A7类基金人民币10元、每份X1类基金9.78美元及每份X2类基金10.4欧元向投资者发售。							
附注12：	份额乃于初步认购时按每份A1类基金10港元、每份A2类基金10港元、每份A4类基金10港元、每份A7类基金10英镑、每份A9类基金人民币10元、每份X1类基金10欧元及每份X2类基金10港元向投资者发售。							
附注13：	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港元、每份A7类基金10欧元、每份X1类基金10美元及每份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)	30.6.2022	不适用 ²	不适用 ²	不适用 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
中银香港全天候中国高息 债券基金(附注2)	30.6.2022	不适用 ²	不适用 ²	不适用 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
中银香港全天候香港 股票基金(附注3)	30.6.2022	9.50美元	不适用 ²	不适用 ²
	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
中银香港全天候在岸人民币 股票基金(附注4)	30.6.2022	10.94美元	不适用 ²	不适用 ²
	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
中银香港全天候亚洲 债券基金(附注5)	30.6.2022	不适用 ²	不适用 ²	不适用 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
中银香港全天候亚洲 (日本除外)股票基金(附注6)	30.6.2022	不适用 ²	不适用 ²	不适用 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
中银香港全天候中国 收益基金(附注7)	30.6.2022			
	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
中银香港全天候亚太高收益 基金(附注8)	30.6.2022	不适用 ²	不适用 ²	不适用 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
中银香港全天候短期债券 基金(附注9)	30.6.2022	不适用 ²	不适用 ²	不适用 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	10.46欧元
中银香港全天候一带一路 债券基金(附注10)	30.6.2022	不适用 ²	不适用 ²	不适用 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

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
中银香港全天候大湾区 策略基金(附注11)	30.6.2022			
	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)	30.6.2022	不适用 ²		
	30.6.2021 ¹	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候ESG多元 资产基金(附注13)	30.6.2022 ¹	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
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。				
附注13： 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A10类基金10欧元、每份额I1类基金10美元及每份额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	每份额的最高发行价					每份额的最低赎回价								
		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	30.6.2022	12.31美元	12.33港元	16.92澳元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	9.30美元	9.41港元	12.53澳元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	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	不适用 ²	8.88美元	8.88港元	12.46澳元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	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	不适用 ²	9.46美元	9.55港元	9.23澳元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	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	不适用 ²	9.71美元	9.79港元	9.47澳元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	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	不适用 ²	8.98美元	8.98港元	8.85澳元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	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	不适用 ²	8.16美元	8.21港元	8.05澳元	不适用 ²	人民币9.20元	不适用 ²	不适用 ²
	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	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
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	不适用 ²	9.66美元	9.66港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	
中银香港全天候中国 高息债券基金	30.6.2022	人民币10.14元	9.64美元	9.66港元	9.40澳元	不适用 ²	9.15美元	不适用 ²	人民币5.80元	5.33美元	5.40港元	5.24澳元	不适用 ²	5.08美元	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	不适用 ²	人民币9.98元	8.70美元	8.70港元	9.33澳元	不适用 ²	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	不适用 ²	人民币8.74元	7.57美元	7.57港元	8.27澳元	不适用 ²	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	不适用 ²	人民币10.07元	8.96美元	9.06港元	9.88澳元	不适用 ²	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	不适用 ²	人民币10.17元	9.48美元	9.58港元	10.00澳元	不适用 ²	9.46美元	不适用 ²
	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	不适用 ²	人民币10.28元	9.22美元	9.21港元	10.62澳元	不适用 ²	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	不适用 ²	人民币9.47元	9.05美元	9.03港元	10.05澳元	不适用 ²	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	不适用 ²	人民币9.37元	9.32美元	9.31港元	9.83澳元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
30.6.2014 ¹	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	不适用 ²	人民币9.79元	9.89美元	9.89港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	
中银香港全天候香港 股票基金	30.6.2022	13.14港元	13.13美元	12.99澳元	不适用 ²	人民币14.58元	不适用 ²	不适用 ²	8.39港元	8.29美元	8.16澳元	不适用 ²	人民币9.44元	不适用 ²	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	不适用 ²	10.85港元	10.86美元	10.98澳元	不适用 ²	人民币11.78元	不适用 ²	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	不适用 ²	8.95港元	8.94美元	9.19澳元	不适用 ²	人民币9.77元	不适用 ²	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	不适用 ²	9.56港元	9.47美元	10.24澳元	不适用 ²	人民币10.47元	不适用 ²	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	不适用 ²	10.13港元	10.06美元	10.95澳元	不适用 ²	人民币11.28元	不适用 ²	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	不适用 ²	8.39港元	8.39美元	8.92澳元	不适用 ²	人民币9.19元	不适用 ²	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	不适用 ²	7.00港元	6.97美元	7.40澳元	不适用 ²	人民币7.59元	不适用 ²	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	不适用 ²	11.00港元	10.99美元	11.52澳元	不适用 ²	人民币11.54元	不适用 ²	不适用 ²
30.6.2014 ¹	12.40港元	12.41美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	9.99港元	9.99美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	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	30.6.2022	人民币14.76元	14.23美元	14.28港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	12.97港元	人民币9.87元	9.33美元	9.44港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	8.62港元
	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	不适用 ²	9.56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	不适用 ²	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	不适用 ²	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	30.6.2022	10.12美元	10.13港元	不适用 ²	不适用 ²	人民币10.79元	不适用 ²	不适用 ²	7.59美元	7.68港元	不适用 ²	不适用 ²	人民币8.31元	不适用 ²	不适用 ²
	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	30.6.2022	12.77美元	12.74港元	不适用 ²	不适用 ²	人民币13.01元	不适用 ²	不适用 ²	7.88美元	7.95港元	不适用 ²	不适用 ²	人民币8.17元	不适用 ²	不适用 ²
	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
	30.6.2017 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	30.6.2022	7.96港元	8.00美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币8.21元	不适用 ²	5.47港元	5.82美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	6.16港元	不适用 ²
	30.6.2021	8.94港元	9.00美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币9.17元	不适用 ²	7.94港元	7.98美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币8.18元	不适用 ²
	30.6.2020	9.34港元	9.36美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币9.50元	不适用 ²	7.40港元	7.46美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币7.51元	不适用 ²
	30.6.2019	9.55港元	9.51美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币9.69元	不适用 ²	8.49港元	8.45美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币8.62元	不适用 ²
	30.6.2018 ¹	10.87港元	10.87美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币10.99元	不适用 ²	9.39港元	9.35美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币9.52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 亚太高收益基金	30.6.2022	9.71美元	9.62港元	不适用 ²	9.03澳元	不适用 ²	人民币9.92元	不适用 ²	6.20美元	6.18港元	不适用 ²	5.74澳元	不适用 ²	人民币6.41元	不适用 ²
	30.6.2021	10.55美元	10.42港元	不适用 ²	9.92澳元	不适用 ²	人民币10.66元	不适用 ²	8.83美元	8.72港元	不适用 ²	8.37澳元	不适用 ²	人民币8.82元	不适用 ²
	30.6.2020	9.62美元	9.52港元	不适用 ²	9.26澳元	不适用 ²	人民币9.60元	不适用 ²	7.27美元	7.18港元	不适用 ²	6.89澳元	不适用 ²	人民币7.25元	不适用 ²
	30.6.2019	9.63美元	9.63港元	不适用 ²	9.54澳元	不适用 ²	人民币9.65元	不适用 ²	8.60美元	8.58港元	不适用 ²	8.51澳元	不适用 ²	人民币8.63元	不适用 ²
	30.6.2018 ¹	10.02美元	10.03港元	不适用 ²	10.00澳元	不适用 ²	人民币10.02元	不适用 ²	9.47美元	9.48港元	不适用 ²	9.40澳元	不适用 ²	人民币9.49元	不适用 ²
中银香港全天候 短期债券基金	30.6.2022	10.40美元	10.40港元	人民币10.25元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	10.35美元	10.26港元	人民币9.50元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	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	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	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	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
	30.6.2022	10.51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	8.11美元	8.11港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币8.53元	不适用 ²
中银香港全天候大湾区 策略基金	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	不适用 ²	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	不适用 ²	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	不适用 ²	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
	30.6.2022	9.93美元	9.84港元	9.83澳门元	人民币9.59元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	7.66美元	7.67港元	7.66澳门元	人民币7.50元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	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	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
中银香港全天候亚洲 高息债券基金	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	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
	30.6.2022	10.08美元	10.11港元	不适用 ²	10.08澳元	10.03英镑	不适用 ²	人民币10.30元	5.80美元	5.88港元	不适用 ²	5.79澳元	5.77英镑	不适用 ²	人民币6.03元
	30.6.2021 ¹	10.46美元	10.46港元	不适用 ²	10.40澳元	10.42英镑	不适用 ²	人民币10.54元	10.00美元	10.00港元	不适用 ²	9.95澳元	9.99英镑	不适用 ²	人民币9.98元
中银香港全天候ESG 多元资产基金	30.6.2022	10.16美元	10.16港元	不适用 ²	10.16澳元	10.18英镑	不适用 ²	人民币10.13元	7.75美元	7.83港元	不适用 ²	7.99澳元	8.15英镑	不适用 ²	人民币7.67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	I1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	30.6.2022	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	13.68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	10.56港元	不适用 ²	不适用 ²
	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	不适用 ²	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
	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	不适用 ²	不适用 ²	9.69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	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
	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	不适用 ²	不适用 ²	10.37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	不适用 ²	10.43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	9.97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	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
	30.6.2015	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
	30.6.2014	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
中银香港全天候中国 高息债券基金	30.6.2022	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币14.48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8.76元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	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	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币13.37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13.99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11.36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13.33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11.85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	人民币12.25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11.64元	不适用 ²	9.79港元	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	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币10.68元	不适用 ²	9.56港元	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	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币10.19元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2015	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
	30.6.2014 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
中银香港全天候香港 股票基金	30.6.2022	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	12.30港元	13.20美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	7.93港元	8.85美元	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	14.11港元	15.41美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	10.02港元	10.94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	10.69港元	11.65美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	8.24港元	8.98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	10.61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	8.66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	13.09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	9.01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	9.16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	7.38港元	不适用 ²	不适用 ²	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	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	6.12港元	不适用 ²	不适用 ²	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	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	9.52港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2014 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	I1类
中银香港全天候在岸 人民币股票基金	30.6.2022	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	14.42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	9.64港元	不适用 ²
	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	13.96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	11.89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	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
	30.6.2019	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
	30.6.2018	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
	30.6.2017	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
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	30.6.2022	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	12.05美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	9.51美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	12.07美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	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	不适用 ²	不适用 ²	10.17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	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
	30.6.2018	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	10.11美元	10.25港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	9.75美元	10.11港元	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	不适用 ²	不适用 ²	9.91美元	9.87港元	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	30.6.2022	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	13.57港元	不适用 ²	12.86美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	8.57港元	不适用 ²	10.09美元
	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	16.07美元	15.91港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	11.41美元	11.30港元	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	11.99港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	8.74美元	8.66港元	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	11.64港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	9.97美元	9.45港元	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2018 ¹	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	12.67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	9.97港元	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候中国 收益基金	30.6.2022	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	8.15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	6.29港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	8.97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	8.07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	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
	30.6.2019	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
	30.6.2018 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	每份净值的最高发行价					每份净值的最低赎回价								
		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	I1类
中银香港全天候亚太 高收益基金	30.6.2022	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	10.10美元	7.24港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	6.65美元	6.49港元	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	10.60美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	9.17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	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
	30.6.2019	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
	30.6.2018 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
中银香港全天候短期 债券基金	30.6.2022	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	10.48美元	10.51港元	不适用 ²	10.43美元	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
	30.6.2021	不适用 ²	不适用 ²	10.54美元	10.70美元	10.63港元	不适用 ²	10.68美元	不适用 ²	10.45美元	10.33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	10.52美元	不适用 ²	10.37美元	10.26美元	10.26美元	10.21港元	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	10.27美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	10.00美元	9.96港元	不适用 ²	10.00美元
中银香港全天候 一带一路债券基金	30.6.2022	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
	30.6.2021	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
	30.6.2020	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
	30.6.2019 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
中银香港全天候大湾区 策略基金	30.6.2022	不适用 ²	人民币10.19元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	10.52美元	10.83美元	不适用 ²	人民币8.06元	不适用 ²	8.51美元	不适用 ²	不适用 ²	10.61美元
	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	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	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	30.6.2022	10.07欧元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	10.75港元	不适用 ²	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
	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	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
中银香港全天候ESG 多元资产基金	30.6.2022 ¹	10.14欧元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	10.12港元	不适用 ²	10.18美元	7.70欧元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	7.70港元	不适用 ²	7.86美元

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			
		12类	13类	14类	12类	13类	14类	16类
中银香港全天候环球 投资基金	30.6.2022	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
	30.6.2021	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
	30.6.2020	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
	30.6.2019	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
	30.6.2018	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
	30.6.2017	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
	30.6.2016	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
	30.6.2015	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
30.6.2014	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	
中银香港全天候中国高息 债券基金	30.6.2022	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
	30.6.2021	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
	30.6.2020	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
	30.6.2019	不适用 ²	不适用 ²	10.49美元	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	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	9.66港元	9.55美元	不适用 ²
	30.6.2016	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
	30.6.2015	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
30.6.2014 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	
中银香港全天候香港 股票基金	30.6.2022	13.21美元	不适用 ²	不适用 ²	8.37美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2021	15.24美元	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	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	10.13美元	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	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	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2016	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
	30.6.2015	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
30.6.2014 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	

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	30.6.2022	14.30美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	9.42美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	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	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
	30.6.2019	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
	30.6.2018	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
	30.6.2017	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	30.6.2016 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
	30.6.2022	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
	30.6.2021	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
	30.6.2020	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
	30.6.2019	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
	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
中银香港全天候亚洲 (日本除外) 股票基金	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
	30.6.2022	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
	30.6.2021	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
	30.6.2020	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
	30.6.2019	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
	30.6.2018 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
中银香港全天候中国 收益基金	30.6.2022	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
	30.6.2021	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
	30.6.2020	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
	30.6.2019	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
	30.6.2018 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
中银香港全天候亚太高收益基金	30.6.2022	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
	30.6.2021	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
	30.6.2020	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
	30.6.2019	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
	30.6.2018 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
中银香港全天候短期债券基金	30.6.2022	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
	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	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
中银香港全天候一带一路债券基金	30.6.2022	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
	30.6.2021	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
	30.6.2020	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
	30.6.2019 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
中银香港全天候大湾区策略基金	30.6.2022	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
	30.6.2021	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
	30.6.2020 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高息债券基金	30.6.2022	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
	30.6.2021 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ESG多元资产基金	30.6.2022 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

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	最高	风险总值 最低	平均风险值	最高	风险净值 最低	平均风险值
中银香港全天候环球 投资基金	30.6.2022	0.13%	0.10%	0.12%	0.13%	0.00%	0.08%
	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	30.6.2022	286.33%	98.24%	133.66%	15.06%	1.78%	2.58%
	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	30.6.2022	4.37%	1.92%	2.76%	3.16%	0.46%	0.90%
	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	30.6.2022	13.32%	0.00%	10.76%	0.00%	0.00%	0.00%
	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	30.6.2022	1.51%	1.12%	1.33%	0.00%	0.00%	0.00%
	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	30.6.2022	4.30%	2.93%	3.44%	4.00%	0.00%	2.07%
	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	30.6.2022	18.72%	10.90%	14.12%	11.46%	0.00%	5.83%
	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	30.6.2022	22.55%	15.13%	17.75%	8.65%	0.00%	2.66%
	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	30.6.2022	30.45%	0.00%	6.23%	5.32%	0.00%	0.28%
	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	30.6.2022	63.43%	29.05%	33.20%	53.89%	22.56%	28.04%
	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	30.6.2022	17.91%	14.61%	16.11%	16.06%	12.89%	14.33%
	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	30.6.2022	19.63%	16.18%	17.53%	16.98%	12.74%	15.05%
	30.6.2021 ¹	237.22%	112.61%	126.21%	2.30%	1.19%	1.89%
中银香港全天候ESG多元 资产基金	30.6.2022 ¹	44.46%	0.00%	37.96%	60.12%	0.00%	37.23%

¹ 开始营运年份