

中銀香港盈荟系列

年度報告

2018年6月30日

中银香港盈荟系列

目录	页数
行政及管理	1
受托人报告书	2
独立审计报告	3-5
资产净值表	6
损益及其他全面收益表	7
归属于份额持有人的资产净值变动表	8
现金流量表	9-10
财务报表附注	11-103
投资组合（未经审计）	104-138
投资组合变动表（未经审计）	139-140
投资业绩报表（未经审计）	141-148
投资业绩记录（未经审计）	149-152

中银香港盈荟系列

行政及管理

基金管理人／RQFII持有人

中银香港资产管理有限公司
香港
德辅道中2A号
中国银行大厦5楼

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
铜锣湾
威菲路道18号
万国宝通中心12及25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

审计师

安永会计师事务所
香港
中环
添美道1号
中信大厦22楼

中银香港盈荟系列

受托人报告书

吾等特此确认，吾等认为在截至2018年6月30日止的年度内，基金管理人中银香港资产管理有限公司在所有重大方面已根据2012年6月4日签订的信托契约条文（经修订），管理中银香港盈荟系列。

谨代表

中银国际英国保诚信托有限公司（受托人）

2018年10月29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

意见

我们已审计第6至103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（前称中银香港全天候中港股票基金）、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及中银香港全天候亚太高收益基金（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2018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（前称中银香港全天候中港股票基金）、中银香港全天候在岸人民币股票基金及中银香港全天候亚洲债券基金截至2018年6月30日止年度、中银香港全天候亚洲（日本除外）股票基金自2017年4月24日（开始营运日期）至2018年6月30日、中银香港全天候中国收益基金自2017年9月8日（开始营运日期）至2018年6月30日和中银香港全天候亚太高收益基金自2018年3月23日（开始营运日期）至2018年6月30日的损益及其他全面收益表、归属于份额持有人的资产净值变动表及现金流量表及财务报告附注（包括重要会计政策摘要）。

我们认为，这些财务报表已根据香港会计师公会（“香港会计师公会”）颁布的《香港财务报告准则》真实而中肯地反映这些子基金于2018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（前称中银香港全天候中港股票基金）、中银香港全天候在岸人民币股票基金及中银香港全天候亚洲债券基金截至2018年6月30日止年度、中银香港全天候亚洲（日本除外）股票基金自2017年4月24日（开始营运日期）至2018年6月30日、中银香港全天候中国收益基金自2017年9月8日（开始营运日期）至2018年6月30日和中银香港全天候亚太高收益基金自2018年3月23日（开始营运日期）至2018年6月30日的财务表现及现金流量，并已遵照香港《公司条例》妥为编制。

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。

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。

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（续）

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》及《香港公司条例》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，除非董事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单位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，或凌驾于内部控制的上，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。
- 评价基金管理人及受托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。
- 对基金管理人及受托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。

根据信托契据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，这些财务报表已在所有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。

安永会计师事务所

注册会计师

香港

2018年10月29日

中银香港盈荟系列

资产净值表

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 (前称中银香港全天候 中港股票基金)		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	
	2018年 美元	2017年 美元	2018年 人民币	2017年 人民币	2018年 港元	2017年 港元	2018年 人民币	2017年 人民币	2018年 美元	2017年 美元	2018年 美元	2017年 美元	2018年 港元	2017年 港元	2018年 美元	2017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	5,864,330	5,041,827	2,043,386,157	3,236,014,990	312,024,078	424,290,420	259,832,233	562,974,408	45,031,755	42,701,071	6,361,945	252,923,981	25,756,551			
应收经纪人款项	201,923	401,887	33,786,846	28,812,223	44,887,153	-	2,272,108	4,162,164	22,605	2,562,488	-	22,492	-			
应收利息	1,520	4,641	92,942	-	882,736	5,155,997	-	-	-	-	28,401	886,529	36,389			
应收股利	-	-	34,837	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-			
应收认购款项	-	-	8,781,471	135,196,678	-	257,517	34	313,990	-	2,798,597	-	302,330	1,249			
其他应收款项	-	-	17,981	18,768	-	-	3,557	306	-	-	-	-	-			
现金及现金等价物	694,686	111,265	350,855,490	93,351,462	5,903,226	19,305,420	36,664,129	15,933,344	136,637	3,534,510	224,694	4,810,916	2,830,039			
存款准备金	-	-	-	-	-	-	224,000	224,000	-	-	-	-	-			
总资产	6,762,459	5,559,620	2,436,955,724	3,493,394,121	363,697,193	449,009,354	298,996,061	583,608,212	45,190,997	51,596,666	6,615,040	258,946,248	28,624,228			
负债																
以公允价值计量且其变动 计入当期损益的金融负债	-	-	8,987,109	775,633	19,412	-	-	-	18,458	284	2,668	287,700	14,821			
应付经纪人款项	202,670	398,636	23,342,771	91,152,546	10,359,688	5,110,762	4,291	684,764	22,562	6,424,326	-	525,926	116,711			
应付收益分配	-	-	24,231,692	29,563,522	-	-	-	-	99,231	118,972	-	877,672	110,435			
应付管理费	4,362	2,001	2,026,115	2,528,538	245,364	308,357	441,352	814,775	25,553	32,455	3,761	332,440	36,302			
应付受托人费用	2,500	2,500	211,197	271,261	38,155	44,991	31,525	55,993	4,681	4,096	2,500	27,704	3,025			
应付费用及其他应付款项	19,481	18,468	209,840	139,360	214,050	198,970	216,151	240,020	19,678	18,928	38,665	179,616	77,170			
应付赎回款项	673	63,701	20,758,889	15,736,323	30,294,672	1,151,043	4,593,770	4,725,602	101,089	288,477	7,932	803,336	431,795			
负债(不包括归属于份额持有人的资产净值)	229,686	485,306	79,767,613	140,167,183	41,171,341	6,814,123	5,287,089	6,521,154	291,252	6,887,538	55,526	3,034,394	790,259			
归属于份额持有人的资产净值	6,532,773	5,074,314	2,357,188,111	3,353,226,938	322,525,852	442,195,231	293,708,972	577,087,058	44,899,745	44,709,128	6,559,514	255,911,854	27,833,969			
代表： 归属于份额持有人的资产净值(按成交价) 开办费用调整	6,532,773	5,074,314	2,357,188,111	3,353,226,938	322,525,852	442,195,231	293,708,972	577,249,713	44,918,970	44,747,577	6,596,671	256,267,741	27,904,342			
	-	-	-	-	-	-	-	(162,655)	(19,225)	(38,449)	(37,157)	(355,887)	(70,373)			

载于第11至103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2018年6月30日止年／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(前称 中银香港全天候 中港股票基金)		中银香港全天候 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	
	2018年 美元	2017年 美元	2018年 人民币	2017年 人民币	2018年 港元	2017年 港元	2018年 人民币	2017年 人民币	2018年 美元	2017年 美元	2018年 ³ 港元	2017年 ³ 美元	2018年 ³ 港元	2017年 ³ 美元		
收益																
股息收入	61,163	47,701	505,970	349,527	8,769,076	10,791,263	3,507,444	4,388,749	-	-	3,564,977	115,092				
银行存款利息收入	36	84	612,085	125,595	11,188	5,039	60,441	38,845	1,349	719	9,181	273				
其他收入	-	-	460,391	74,751	-	-	-	-	1	500	-	-				
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/(净损失)	218,604	443,289	(182,835,968)	137,608,278	87,283,455	79,092,720	(13,391,416)	(4,017,432)	458,337	1,049,234	(2,122,342)	(1,480,359)				
汇兑净利得/(净损失)	(6,108)	(557)	305,853,546	2,031,800	(568,536)	(119,149)	337,605	(132,177)	603	(15,905)	(377,459)	(9,049)				
总收入/(亏损)	273,695	490,517	124,596,024	140,189,951	95,495,183	89,769,873	(9,485,926)	277,985	460,290	1,034,548	1,074,357	(1,374,043)				
费用																
管理费	33,838	23,371	33,253,131	19,713,747	3,648,562	3,777,207	7,634,870	11,088,240	442,277	401,335	3,735,782	126,969				
受托人费用	30,000	30,000	3,869,474	2,023,940	555,098	537,316	536,965	758,741	67,758	51,181	309,993	10,381				
次保管人费用	10,344	5,990	965,274	469,457	215,127	220,978	941,931	1,316,345	17,742	12,411	206,093	5,831				
审计师酬金	19,200	18,300	124,868	122,160	208,674	247,695	211,346	303,484	19,200	18,300	150,270	18,750				
佣金及事务处理费	14,151	9,508	281,295	180,805	10,313,953	2,461,563	4,620,368	5,549,289	11,920	7,681	1,442,559	39,212				
开办费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	54,510	80,000				
法律及专业服务费用	4,430	2,306	132,849	550,130	65,490	50,697	3,822	74,512	356	5,252	-	-				
其他费用	13,000	20,207	377,744	345,860	167,652	162,010	74,364	153,590	15,055	10,300	107,663	1,731				
营业费用总额	124,963	109,682	39,004,635	23,406,099	15,174,556	7,457,466	14,023,666	19,244,201	574,308	560,970	6,472,360	283,074				
归属于份额持有人的税前利润/(亏损)	148,732	380,835	85,591,389	116,783,852	80,320,627	82,312,407	(23,509,592)	(18,966,216)	(114,018)	473,578	(5,398,003)	(1,657,117)				
预扣税	(16,038)	(6,474)	-	(67,889)	(448,774)	(567,088)	(355,143)	(474,539)	-	-	(130,703)	(7,650)				
年内/期内利润/(亏损)及全面收益总额	132,694	374,361	85,591,389	116,715,963	79,871,853	81,745,319	(23,864,735)	(19,440,755)	(114,018)	473,578	(5,528,706)	(1,664,767)				

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13内。

- 自2016年8月30日(开始营运日期)至2017年6月30日止期间。
- 自2017年4月24日(开始营运日期)至2018年6月30日止期间。
- 自2017年9月8日(开始营运日期)至2018年6月30日止期间。
- 自2018年3月23日(开始营运日期)至2018年6月30日止期间。

载于第11至103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2018年6月30日止年度／期间

	附注	中银香港		中银香港		中银香港		中银香港		
		全天候香港		全天候在岸		全天候亚洲		全天候亚太		
		中银香港	中银香港	股票基金	中银香港	中银香港	中银香港	中银香港	中银香港	
		全天候环球	全天候中国	(前称中银 香港全天候 投资基金)	全天候在岸 人民币	全天候亚洲 人民币	全天候亚洲 (日本除外) 美元	全天候中国 港元	全天候亚太 美元	
		美元	人民币	港元	人民币	美元	美元	港元	美元	
于2016年7月1日或										
开始营运日期的余额 ¹		4,444,183	864,468,748	426,959,501	657,522,927	-	-	-	-	-
发行份额		3,871,531	3,158,865,164	56,936,382	199,395,607	77,553,184	-	-	-	-
赎回份额		(3,615,761)	(697,908,680)	(123,445,971)	(260,390,721)	(32,215,128)	-	-	-	-
归属于份额持有人的资产净值增加 ／(减少)		374,361	116,715,963	81,745,319	(19,440,755)	473,578	-	-	-	-
向份额持有人所作分配	13	-	(88,914,257)	-	-	(1,102,506)	-	-	-	-
于2017年6月30日及2017年7月1日										
或开始营运日期的余额 ²		5,074,314	3,353,226,938	442,195,231	577,087,058	44,709,128	-	-	-	-
发行份额		4,370,265	2,736,228,228	159,940,065	65,645,757	47,199,717	24,763,195	522,101,186	32,778,952	
赎回份额		(3,044,500)	(3,704,358,546)	(359,481,297)	(325,159,108)	(45,396,028)	(20,008,997)	(254,256,337)	(3,169,781)	
归属于份额持有人的 资产净值增加／(减少)		132,694	85,591,389	79,871,853	(23,864,735)	(114,018)	1,805,316	(5,528,706)	(1,664,767)	
向份额持有人所作分配	13	-	(113,499,898)	-	-	(1,499,054)	-	(6,404,289)	(110,435)	
于2018年6月30日的余额		6,532,773	2,357,188,111	322,525,852	293,708,972	44,899,745	6,559,514	255,911,854	27,833,969	

1 中银香港全天候亚洲债券基金的开始营运日期为2016年8月30日。

2 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及中银香港全天候亚太高收益基金的开始营运日期分别为2017年4月24日、2017年9月8日及2018年3月23日。

载于第11至103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2018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(前称中银香港 全天候中港股票基金)		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	
	2018年 美元	2017年 美元	2018年 人民币	2017年 人民币	2018年 港元	2017年 港元	2018年 人民币	2017年 人民币	2018年 美元	2017年 美元	2018年 ² 美元	2018年 ³ 港元	2018年 ⁴ 美元	2018年 ³ 港元	2018年 ⁴ 美元	
附注																
经营活动产生的现金流量																
税前利润/(亏损)	148,732	380,835	85,591,389	116,783,852	80,320,627	82,312,407	(23,509,592)	(18,966,216)	(114,018)	473,578	1,829,494	(5,398,003)	(1,657,117)			
调整:																
银行存款利息收入	(36)	(84)	(612,085)	(125,595)	(11,188)	(5,039)	(60,441)	(38,845)	(1,349)	(719)	(208)	(9,181)	(273)			
股息收入	(61,163)	(47,701)	(505,970)	(349,527)	(8,769,076)	(10,791,263)	(3,507,444)	(4,388,749)	-	-	(360,809)	(3,564,977)	(115,092)			
出售以公允价值计量且其变动计入当期损益的金 融工具的所得款项	29,820,894	8,258,561	9,626,574,282	3,199,976,406	2,113,498,928	618,384,015	1,855,332,816	1,947,532,148	209,683,099	142,647,401	28,882,192	892,730,251	4,815,882			
购买以公允价值计量且其变动计入当期损益的金 融工具	(30,424,793)	(9,327,492)	(8,608,569,941)	(5,483,684,623)	(1,913,929,719)	(636,812,159)	(1,565,582,057)	(1,870,346,684)	(211,537,272)	(184,298,954)	(33,334,404)	(1,147,488,874)	(32,037,971)			
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	6	363,495	64,458,539	4,392,290	42,635,061	(38,950,856)	24,383,198	32,504,630	1,892,461	(595,648)	(401,179)	4,026,636	1,020,778			
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	6	(582,099)	118,337,429	(142,000,568)	(129,918,516)	(40,141,864)	(10,991,782)	(28,287,198)	(2,350,798)	(453,586)	(1,505,886)	(1,904,294)	459,581			
经营资产及负债变动:																
应收经纪人款项(增加)/减少	199,964	(401,887)	(4,974,623)	(21,351,915)	(44,887,153)	662,806	1,890,056	(4,162,164)	2,539,883	(2,562,488)	-	(22,492)	-			
其他应收款项(增加)/减少	-	521	787	3,675	-	-	(3,251)	523	-	-	-	-	-			
应付经纪人款项增加/(减少)	(195,966)	398,636	(67,809,775)	80,844,672	5,248,926	5,088,593	(680,473)	(1,332,421)	(6,401,764)	6,424,326	-	525,926	116,711			
应付管理费增加/(减少)	2,361	(253)	(502,423)	1,684,915	(62,993)	(14,614)	(373,423)	(70,333)	(6,902)	32,455	3,761	332,440	36,302			
应付受托人费用增加/(减少)	-	-	(60,064)	188,734	(6,836)	1,327	(24,468)	(4,961)	585	4,096	2,500	27,704	3,025			
应计费用及其他应付款项增加/(减少)	1,013	781	70,480	24,569	15,080	56,860	(23,869)	100,637	750	18,928	38,665	179,616	75,348			
经营活动提供/(所用)的现金	(727,598)	(1,181,372)	1,212,038,025	(2,243,613,115)	144,133,141	(20,209,787)	276,849,270	52,340,367	(6,295,325)	(38,310,611)	(4,845,874)	(260,565,248)	(27,282,826)			
已收利息	36	84	577,248	125,595	11,188	5,039	60,441	38,845	1,349	719	208	9,181	273			
已收股息	64,284	51,318	413,028	461,717	13,042,337	12,903,572	3,507,444	4,388,749	-	-	332,408	2,678,448	78,702			
已付税费	(16,038)	(6,474)	-	(67,889)	(448,774)	(567,088)	(355,143)	(474,539)	-	-	(24,178)	(130,703)	(5,827)			
经营活动产生/(所用)的现金流量净额	(679,316)	(1,136,444)	1,213,028,301	(2,243,093,692)	156,737,892	(7,868,264)	280,062,012	56,293,422	(6,293,976)	(38,309,892)	(4,537,436)	(258,008,322)	(27,209,678)			

中银香港盈荟系列

现金流量表 (续)

截至2018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 (前称中银香港 全天候中港股票基金)		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	
	2018年 美元	2017年 美元	2018年 人民币	2017年 人民币	2018年 港元	2017年 港元	2018年 人民币	2017年 人民币	2018年 美元	2017年 美元	2018年 ² 美元	2017年 ¹ 美元	2018年 ³ 港元	2017年 ¹ 美元	2018年 ⁴ 美元	
筹资活动产生的现金流量*																
发行份额所得款项	4,370,265	3,871,531	2,857,101,501	3,021,127,100	160,197,582	56,722,560	65,959,713	204,487,707	49,944,081	74,714,007	24,763,195	521,152,406	32,777,703			
赎回份额支付的款项	(3,107,528)	(3,552,060)	(3,699,335,980)	(683,213,666)	(330,337,668)	(126,069,508)	(325,290,940)	(264,003,182)	(45,583,416)	(31,926,651)	(20,001,065)	(253,453,001)	(2,737,986)			
向份额持有人所作分配支付的款项	-	-	(113,289,794)	(68,516,483)	-	-	-	-	(1,464,562)	(942,954)	-	(4,880,167)	-			
筹资活动产生/(所用)的现金流量净额	1,262,737	319,471	(955,524,273)	2,269,396,951	(170,140,086)	(69,346,948)	(259,331,227)	(59,515,475)	2,896,103	41,844,402	4,762,130	262,819,238	30,039,717			
现金及现金等价物增加/(减少)净额	583,421	(816,973)	257,504,028	26,303,259	(13,402,194)	(77,215,212)	20,730,785	(3,222,053)	(3,397,873)	3,534,510	224,694	4,810,916	2,830,039			
年初/期初现金及现金等价物	111,265	928,238	93,351,462	67,048,203	19,305,420	96,520,632	15,933,344	19,155,397	3,534,510	-	-	-	-			
年末/期末现金及现金等价物	694,686	111,265	350,855,490	93,351,462	5,903,226	19,305,420	36,664,129	15,933,344	136,637	3,534,510	224,694	4,810,916	2,830,039			
现金及现金等价物余额分析： 银行现金	694,686	111,265	350,855,490	93,351,462	5,903,226	19,305,420	36,664,129	15,933,344	136,637	3,534,510	224,694	4,810,916	2,830,039			

* 股息人民币5,772,981元 (2017年：人民币4,931,287元)、53,213美元 (2017年：45,075美元) 及758,616港元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及中银香港全天候中国收益基金。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2016年8月30日 (开始营运日期) 至2017年6月30日止期间。

2 自2017年4月24日 (开始营运日期) 至2018年6月30日止期间。

3 自2017年9月8日 (开始营运日期) 至2018年6月30日止期间。

4 自2018年3月23日 (开始营运日期) 至2018年6月30日止期间。

载于第11至103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

2018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的子基金（“子基金”）。以不同货币计价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2018年6月30日，有八个（2017年：六个）已发行的子基金。

各子基金的开始营运日期及各子基金的已发行份额类别如下：

<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)
	2014年8月21日	A7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)
	2017年3月31日	X3类(港元)
	2017年6月8日	I3类(港元)
2017年5月16日	I4类(美元)	
中银香港全天候香港股票基金 (前称中银香港全天候中港股票基金)	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)
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)

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018年6月30日

1 基金及子基金（续）

<u>子基金</u>	<u>开始营运日期</u>	<u>已发行份额类别 (发行货币)</u>
中银香港全天候亚洲债券基金	2016年8月30日	A1类（美元）
	2016年8月30日	A2类（港元）
	2016年8月30日	A7类（人民币）
	2017年6月8日	I2类（港元）
	2017年6月30日	X1类（美元）
	2017年3月31日	X2类（港元）
中银香港全天候亚洲（日本除外）股票基金	2017年4月24日	A1类（美元）
	2017年4月24日	A2类（港元）
	2017年4月24日	A7类（人民币）
	2017年4月25日	X2类（港元）
中银香港全天候中国收益基金	2017年9月8日	A1类（港元）
	2017年9月8日	A2类（美元）
	2017年9月8日	A8类（人民币）
中银香港全天候亚太高收益基金	2018年3月23日	A1类（美元）
	2018年3月23日	A2类（港元）
	2018年3月23日	A4类（澳元）
	2018年3月23日	A8类（人民币）

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。

2 重要会计政策摘要 (续)

(a) 编制基础 (续)

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，财务报表内所提及净资产指归属于份额持有人的净资产。

会计政策变更及披露

子基金已采纳了于本年度的财务报表中首次生效的新订及已修订的香港财务报表准则。以下是与子基金相关的修订：

香港会计准则第7号的修订 *主动披露*

香港会计准则第7号的修订要求实体作出披露，以让财务报表使用者可评估筹资活动所产生的负债变动，包括现金流量所产生的变动及非现金变动。采纳这些修订对子基金的财务报表并无重大影响。

已颁布但尚未生效的香港财务报告准则的影响

在这些财务报表中，子基金并未应用下列已颁布但尚未生效的新修订及已修订的香港财务报告准则。以下是预期在生效时与子基金相关的准则：

香港财务报告准则第9号 *金融工具¹*

¹ 于2018年1月1日或之后开始的年度期间生效

于2014年9月，香港会计师公会颁布香港财务报告准则第9号的最终版本，这版本反映金融工具项目的所有阶段，并取代香港会计准则第39号及香港财务报告准则第9号的所有先前版本。根据香港财务报告准则第9号，只有符合下列两项条件，才会按摊余成本计量债务工具：资产乃于目标为持有资产以收取合约现金流量的业务模式中持有；及金融资产的合约条款带来纯粹支付本金及利息的现金流量的特定日期。此外，这准则规定以摊余成本或公允价值计入其他全面收益的债务工具、租赁应收款项、贷款承担及根据香港财务报告准则第9号并非以公允价值计量且其变动计入当期损益的财务担保合约的减值，应基于十二个月或全期基准按预期信贷损失模式列账。预期采纳香港财务报告准则第9号对子基金的金融资产分类及计量以及减值不会有重大影响。

2 重要会计政策摘要 (续)

(a) 编制基础 (续)

预计其他尚未生效的准则、诠释或现有准则的修订不会对子基金产生重大影响。

(b) 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

(i) 分类

子基金将其投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或负债。此类别有两个分类：持有待售的金融资产或负债；及在初始时指定以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或负债。

- 持有待售的金融资产及负债

如果金融资产或金融负债的取得主要是为了在短期内出售或购回，或者在初始确认时作为受共同管理的可识别金融工具投资组合的一部分且有相关证据证明短期盈利的近期实际模式，则金融资产或金融负债被分类为持有待售。衍生工具也被分类为持有待售。子基金并不将任何衍生工具分类为对冲关系中的对冲者。

- 在初始时指定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

在初始时指定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并未被分类为持有待售，而是作为受管理的金融工具，且其表现是根据子基金已证实的投资策略以公允价值为基础进行评估的。

(ii) 确认、终止确认及计量

正规途径买卖的投资于交易日（即子基金承诺买卖投资的日期）予以确认。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公允价值进行初始确认。衍生工具于签订衍生合约当日以公允价值进行确认，并以其公允价值进行后续重新计量。交易成本在产生时作为费用计入损益。

初始确认后，所有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均以公允价值进行计量。因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公允价值变动而产生的利得和损失，均于其产生期间的损益及其他全面收益表内进行列报。

2 重要会计政策摘要 (续)

(b) 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)

(ii) 确认、终止确认及计量 (续)

如果收取资产现金流量的权利已到期，或子基金已转让其收取资产现金流量的权利，或已承担义务来根据转手安排向第三方支付已收取的全部现金流量且无重大延误，并且符合以下任一情况，则终止确认金融资产（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））：

- 子基金已转让该资产的绝大部分风险及回报，或
- 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时，子基金终止确认金融负债。

(iii) 投资估值

公允价值是市场参与者之间于计量日期进行的有序交易中出售资产所收取或转移负债所支付的价格。在活跃市场交易的金融资产及负债（例如，公开交易的衍生工具及交易证券）的公允价值，根据报告日交易结束时的市场报价（即最后成交价）进行计算。如果最后成交价并不在买卖差价范围内，管理层将确定最能代表公允价值且在买卖差价范围内的价格。集合投资计划内的投资按该计划管理人所提供的其最后成交价进行估值。如果未能取得最后成交价，则于这些计划的投资按相关计划管理人所提供的其基金份额净值进行估值。

2 重要会计政策摘要 (续)

(b) 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)

(iv) 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

该项目包括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公允价值变动，包括债务证券的利息收入，但不包括银行存款的利息收入及股息收入。

未变现利得与损失包括期内金融资产及负债的公允价值变动，以及在以往期间未变现但在当前报告期间变现的利得与损失的转回。

采用加权平均法来计算出售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已变现利得与损失，但使用先入先出法计算期货除外。其体现了工具的初始账面金额与出售金额之间的差额或为衍生工具合约支付或收取的现金（不包括该工具的抵押保证金帐户支付或收取的款项）。

(c) 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。

(d) 费用

费用按权责发生制计入损益。

(e) 外币折算

(i) 记账本位币及列报货币

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、事件及条件的经济影响的货币为用于发行及赎回份额、绩效衡量及向份额持有人报告的货币，而且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、

2 重要会计政策摘要 (续)

(e) 外币换算 (续)

(i) 记账本位币及列报货币 (续)

中银香港全天候亚洲 (日本除外) 股票基金及中银香港全天候亚太高收益基金使用的美元 (“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 (前称中银香港全天候中港股票基金) 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列报。

(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。

(f) 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。

(g) 现金及现金等价物

现金及现金等价物包括库存现金、活期存款、初始期限为三个月或以内的其他短期高流动性投资以及银行透支 (如有)。

2 重要会计政策摘要 (续)

(h) 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净资产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。

(i) 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净资产变动表中进行列示。

(j) 开办费用

开办费用在产生时计入费用。

(k) 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

2 重要会计政策摘要 (续)

(k) 关联方 (续)

(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。

(l) 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。

(m) 向份额持有人所作收益分配

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

2 重要会计政策摘要 (续)

(n) 税费

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

(o) 结构化实体

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

子基金将所有在子基金中的投资（“被投资基金”）视为在未合并结构化实体中的投资。子基金在被投资基金中的投资旨在实现中长期资本增长，且其投资策略并不包括使用杠杆。被投资基金由相同资产管理人管理并运用多项投资策略以实现其各自的投资目标。被投资基金通过发行可由持有人选择卖出的可赎回份额来提供自身运营资金，并在各基金的净资产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）。

截至2018年6月30日及2017年6月30日，子基金并未在被投资基金中持有可赎回份额。

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。

3 重大会计估计及判断 (续)

(a) 重大会计估计及假设 (续)

投资公允价值

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

(b) 重大判断

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

截至报告期末暂停交易的投资

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。

评估作为结构性实体的被投资基金

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

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

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2018年6月30日

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。现时管理费比率如下：

子基金	管理费比率(年度)												
	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	X1类 份额	X2类 份额	X3类 份额	I2类 份额	I3类 份额	I4类 份额
中银香港全天候 环球投资基金	1.250% ³	1.250% ³	1.250% ³	不适用 ¹	1.250% ³	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 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 ²	不适用 ¹	不适用 ²	不适用 ¹	0.875%	0.875%
中银香港全天候 香港股票基金 (前称中银香港 全天候中港 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 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 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 ¹	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 ²	不适用 ²	不适用 ¹	0.700%	不适用 ¹	不适用 ¹
中银香港全天候 亚洲(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 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 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 ¹	不适用 ¹	不适用 ¹

¹ 于2017年及2018年6月30日，该等份额类别并未发行。

² X类份额毋须支付管理费。

³ 自2018年4月1日起，费率由每年0.625%回复至每年1.250%，这是于2016年4月1日临时调减生效前的费率。

管理费在各交易日计算及累计并按月到期支付。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018年6月30日

4 费用 (续)

(b) 受托人费用

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

受托人有权就各子基金收取下列受托人费用。受托人费用的现时水平列示如下：

<u>子基金</u>	<u>受托人费用比率 (年度)</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) 股票基金及中银 香港全天候亚太高收益基金	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	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。
中银香港全天候香港股票基金 (前称中银香港全天候中港 股票基金) 及中银香港全天候 中国收益基金	各类子基金资产净值首200,000,000港元的0.125%； 各类子基金资产净值下一200,000,000港元的0.10%； 各类子基金资产净值余额的0.0875%； 受最低月费20,000港元所限。

受托人费用在各交易日计算及累计并按月到期支付。

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拨备。

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

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

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

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及其他全面收益表的“预扣税”项目内。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018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(前称中银 香港全天候中港股股票基金)	
	2018年	2017年	2018年	2017年	2018年	2017年
	美元	美元	人民币	人民币	港元	港元
金融资产 – 持作 待售用途						
集合投资计划	2,998,715	2,262,028	7,034,974	20,088,803	–	40,756,000
衍生工具(附注7)	46	160	923,822	56,268,778	5,667	80,260
上市权益性证券	569,570	260,369	–	–	312,018,411	361,453,470
存托凭证	–	–	–	–	–	22,000,690
挂牌债务证券	2,295,999	2,519,270	2,035,427,361	3,159,657,409	–	–
以公允价值计量且其 变动计入当期损益的 金融资产总额	<u>5,864,330</u>	<u>5,041,827</u>	<u>2,043,386,157</u>	<u>3,236,014,990</u>	<u>312,024,078</u>	<u>424,290,420</u>
金融负债 – 持作 待售用途						
衍生工具(附注7)	–	–	8,987,109	775,633	19,412	–
以公允价值计量且其 变动计入当期损益的 金融负债总额	<u>–</u>	<u>–</u>	<u>8,987,109</u>	<u>775,633</u>	<u>19,412</u>	<u>–</u>
以公允价值计量且其 变动计入当期损益的 金融资产及负债的 净利得/(净损失)						
已变现	582,099	230,800	(118,337,429)	142,000,568	129,918,516	40,141,864
未变现	(363,495)	212,489	(64,498,539)	(4,392,290)	(42,635,061)	38,950,856
净利得/(净损失)	<u>218,604</u>	<u>443,289</u>	<u>(182,835,968)</u>	<u>137,608,278</u>	<u>87,283,455</u>	<u>79,092,720</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018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	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
	2018年	2017年	2018年	2017年	2018年	2018年	2018年
	人民币	人民币	美元	美元	美元	港元	美元
金融资产 – 持作待售用途							
集合投资计划	22,854,000	-	-	-	677,306	-	1,537,225
衍生工具(附注7)	7,204	-	-	238,823	-	-	2,550
上市权益性证券	236,971,029	562,974,408	-	-	4,377,916	156,333,266	11,146,548
存托凭证	-	-	-	-	1,306,723	4,658,495	725,398
挂牌债务证券	-	-	45,031,755	42,462,248	-	91,932,220	12,344,830
	<u> </u>	<u> </u>	<u> </u>	<u> </u>	<u> </u>	<u> </u>	<u> </u>
以公允价值计量且其变动 计入当期损益的金融 资产总额	<u>259,832,233</u>	<u>562,974,408</u>	<u>45,031,755</u>	<u>42,701,071</u>	<u>6,361,945</u>	<u>252,923,981</u>	<u>25,756,551</u>
金融负债 – 持作待售用途							
衍生工具(附注7)	-	-	18,458	284	2,668	287,700	14,821
	<u> </u>	<u> </u>	<u> </u>	<u> </u>	<u> </u>	<u> </u>	<u> </u>
以公允价值计量且其变动计 入当期损益的金融负债总额	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>18,458</u>	<u>284</u>	<u>2,668</u>	<u>287,700</u>	<u>14,821</u>
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/ (净损失)							
已变现	10,991,782	28,287,198	2,350,798	453,586	1,505,886	1,904,294	(459,581)
未变现	(24,383,198)	(32,304,630)	(1,892,461)	595,648	401,179	(4,026,636)	(1,020,778)
	<u> </u>	<u> </u>	<u> </u>	<u> </u>	<u> </u>	<u> </u>	<u> </u>
净利得/(净损失)	<u>(13,391,416)</u>	<u>(4,017,432)</u>	<u>458,337</u>	<u>1,049,234</u>	<u>1,907,065</u>	<u>(2,122,342)</u>	<u>(1,480,359)</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018年6月30日

7 衍生金融工具

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

	中银香港全天候 环球投资基金		中银香港全天候 中国高息债券基金		中银香港全天候 香港股票基金 (前称中银香港 全天候中港股票基金)		
	2018年 美元	2017年 美元	2018年 人民币	2017年 人民币	2018年 港元	2017年 港元	
金融资产							
外汇远期合约	46	160	923,822	56,268,778	5,667	80,260	
金融负债							
外汇远期合约	-	-	8,987,109	775,633	19,412	-	
	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
	2018年 人民币	2017年 人民币	2018年 美元	2017年 美元	2018年 美元	2018年 港元	2018年 美元
金融资产							
外汇远期合约	7,204	-	-	238,823	-	-	2,550
金融负债							
外汇远期合约	-	-	18,458	284	2,668	287,700	14,821

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018年6月30日

7 衍生金融工具(续)

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。

中银香港全天候环球投资基金

于报告期末，未到期外汇远期合约的详情如下：

	<u>名义金额</u>	<u>公允价值</u>	
		<u>资产</u> 美元	<u>负债</u> 美元
2018年6月30日			
购入澳元	18,519澳元	46	-
		<u> </u>	<u> </u>
2017年6月30日			
卖出欧元	164,000欧元	36	-
购入澳元	17,778澳元	124	-
		<u> </u>	<u> </u>
		160	-
		<u> </u>	<u> </u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2018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

于报告期末, 未到期外汇远期合约的详情如下:

	名义金额	公允价值	
		资产 人民币	负债 人民币
2018年6月30日			
购入美元	36,071,116美元	606,765	-
购入美元	2,395,000美元	42,682	-
购入澳元	3,245,247澳元	123,055	-
购入美元	5,490,448美元	97,847	-
卖出美元	4,512,489美元	53,473	-
卖出美元	345,829,350美元	-	8,929,890
购入美元	4,507,675美元	-	57,219
		923,822	8,987,109
		923,822	8,987,109
2017年6月30日			
卖出美元	14,400,000美元	5,930,984	-
卖出美元	31,600,000美元	12,262,028	-
卖出美元	17,200,000美元	6,984,471	-
卖出美元	6,838,776美元	1,310,575	-
卖出美元	41,366,984美元	5,789,344	-
卖出美元	44,116,375美元	6,099,126	-
卖出美元	7,631,609美元	1,120,708	-
卖出美元	9,502,966美元	1,399,320	-
卖出美元	2,157,018美元	336,701	-
卖出美元	863,446美元	130,338	-
卖出美元	5,990,917美元	343,280	-
卖出美元	7,640,262美元	418,686	-
卖出美元	8,117,029美元	416,404	-
卖出美元	241,072,077美元	12,969,677	-
卖出美元	33,182,480美元	642,109	-
购入美元	3,075,031美元	3,004	-
购入美元	5,990,743美元	-	344,480
购入美元	7,640,039美元	-	420,218
购入美元	213,149美元	-	10,935
购入澳元	4,271,500澳元	112,023	-
		56,268,778	775,633
		56,268,778	775,633

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018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(前称中银香港全天候中港股票基金)

于报告期末,未到期外汇远期合约的详情如下:

	<u>名义金额</u>	<u>公允价值</u>	
		<u>资产</u> 港元	<u>负债</u> 港元
2018年6月30日			
购入澳元	455,163澳元	5,667	—
购入人民币	人民币2,396,094元	—	19,412
		<u>5,667</u>	<u>19,412</u>
2017年6月30日			
购入人民币	人民币10,882,100元	32,762	—
购入澳元	761,100澳元	47,498	—
		<u>80,260</u>	<u>—</u>

中银香港全天候在岸人民币股票基金

于报告期末,未到期外汇远期合约的详情如下:

	<u>名义金额</u>	<u>公允价值</u>	
		<u>资产</u> 人民币	<u>负债</u> 人民币
2018年6月30日			
购入港元	2,650,172港元	<u>7,204</u>	<u>—</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018年6月30日

7 衍生金融工具 (续)

外汇远期合约 (续)

中银香港全天候亚洲债券基金

于报告期末，未到期外汇远期合约的详情如下：

	<u>名义金额</u>	<u>公允价值</u>	
		<u>资产</u> 美元	<u>负债</u> 美元
2018年6月30日			
购入人民币	人民币28,532,754元	-	18,458
		<u> </u>	<u> </u>
2017年6月30日			
购入人民币	人民币14,000,000元	114,895	-
购入人民币	人民币8,138,912元	9,361	-
购入人民币	人民币13,000,000元	114,567	-
卖出港元	11,000,000港元	-	284
		<u>238,823</u>	<u>284</u>

中银香港全天候亚洲 (日本除外) 股票基金

于报告期末，未到期外汇远期合约的详情如下：

	<u>名义金额</u>	<u>公允价值</u>	
		<u>资产</u> 美元	<u>负债</u> 美元
2018年6月30日			
购入人民币	人民币3,171,333元	-	2,668
		<u> </u>	<u> </u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018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

于报告期末，未到期外汇远期合约的详情如下：

	<u>名义金额</u>	<u>公允价值</u>	
		<u>资产</u> 港元	<u>负债</u> 港元
2018年6月30日			
购入人民币	人民币43,580,657元	-	287,700

中银香港全天候亚太高收益基金

于报告期末，未到期外汇远期合约的详情如下：

	<u>名义金额</u>	<u>公允价值</u>	
		<u>资产</u> 美元	<u>负债</u> 美元
2018年6月30日			
购入澳元	990,736澳元	2,550	-
购入人民币	人民币25,626,162元	-	14,821
		<u>2,550</u>	<u>14,821</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2018年6月30日

7 衍生金融工具(续)

金融工具的抵销

在报告期末,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

	于资产净值 表抵销的		于资产净值 表列报的 净额	于资产净值表 未抵销的金额 ²		风险净值 美元
	金融资产/ (负债) 总额 美元	金融资产/ (负债) 总额 ¹ 美元		金融工具 美元	现金抵押 美元	
2018年6月30日						
资产						
衍生工具	46	-	46	-	-	46
2017年6月30日						
资产						
衍生工具	160	-	160	-	-	160

中银香港全天候中国高息债券基金

	于资产净值 表抵销的		于资产净值 表列报的 净额	于资产净值表 未抵销的金额 ²		风险净值 人民币
	金融资产/ (负债) 总额 人民币	金融资产/ (负债) 总额 ¹ 人民币		金融工具 人民币	现金抵押 人民币	
2018年6月30日						
资产						
衍生工具	923,822	-	923,822	(923,822)	-	-
负债						
衍生工具	(8,987,109)	-	(8,987,109)	923,822	-	(8,063,287)
2017年6月30日						
资产						
衍生工具	56,268,778	-	56,268,778	(775,633)	-	55,493,145
负债						
衍生工具	(775,633)	-	(775,633)	775,633	-	-

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018年6月30日

7 衍生金融工具 (续)

金融工具的抵销 (续)

中银香港全天候香港股票基金 (前称中银香港全天候中港股票基金)

	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 表列报的 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
2018年6月30日						
资产						
衍生工具	<u>5,667</u>	<u>-</u>	<u>5,667</u>	<u>(5,667)</u>	<u>-</u>	<u>-</u>
负债						
衍生工具	<u>(19,412)</u>	<u>-</u>	<u>(19,412)</u>	<u>5,667</u>	<u>-</u>	<u>(13,745)</u>
2017年6月30日						
资产						
衍生工具	<u>80,260</u>	<u>-</u>	<u>80,260</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>80,260</u>

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 表列报的 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
2018年6月30日						
资产						
衍生工具	<u>7,204</u>	<u>-</u>	<u>7,204</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>7,204</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018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 表列报的 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	
2018年6月30日						
负债						
衍生工具	(18,458)	-	(18,458)	-	-	(18,458)
2017年6月30日						
资产						
衍生工具	238,823	-	238,823	(284)	-	238,539
负债						
衍生工具	(284)	-	(284)	284	-	-

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 表列报的 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	
2018年6月30日						
负债						
衍生工具	(2,668)	-	(2,668)	-	-	(2,668)

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018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收益基金

	于资产净值 表抵销的		于资产净值 表列报的 净额	于资产净值表 未抵销的金额 ²		风险净值
	金融资产/ (负债) 总额 港元	金融资产/ (负债) 总额 ¹ 港元		金融工具 港元	现金抵押 港元	
2018年6月30日						
负债						
衍生工具	(287,700)	-	(287,700)	-	-	(287,700)

中银香港全天候亚太高收益基金

	于资产净值 表抵销的		于资产净值 表列报的 净额	于资产净值表 未抵销的金额 ²		风险净值
	金融资产/ (负债) 总额 美元	金融资产/ (负债) 总额 ¹ 美元		金融工具 美元	现金抵押 美元	
2018年6月30日						
资产						
衍生工具	2,550	-	2,550	(2,550)	-	-
负债						
衍生工具	(14,821)	-	(14,821)	2,550	-	(12,271)

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时可予以抵销的金融工具。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018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(前称 中银香港全天候 中港股票基金)		
	2018年 美元	2017年 美元	2018年 人民币	2017年 人民币	2018年 港元	2017年 港元	
应收经纪人款项							
就已出售但尚未偿付的 证券应收的款项	<u>201,923</u>	<u>401,887</u>	<u>33,786,846</u>	<u>28,812,223</u>	<u>44,887,153</u>	<u>-</u>	
应付经纪人款项							
就已购买但尚未偿付的 证券应付的款项	<u>202,670</u>	<u>398,636</u>	<u>23,342,771</u>	<u>91,152,546</u>	<u>10,359,688</u>	<u>5,110,762</u>	
					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 在岸人民币股票基金	中银香港全天候 亚洲债券基金	2018年 人民币	2017年 人民币	2018年 美元	2017年 美元	2018年 美元
应收经纪人款项							
就已出售但尚未偿付的 证券应收的款项	<u>2,272,108</u>	<u>4,162,164</u>	<u>22,605</u>	<u>2,562,488</u>	<u>-</u>	<u>22,492</u>	<u>-</u>
应付经纪人款项							
就已购买但尚未偿付的 证券应付的款项	<u>4,291</u>	<u>684,764</u>	<u>22,562</u>	<u>6,424,326</u>	<u>-</u>	<u>525,926</u>	<u>116,711</u>

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、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(ETF)、REIT、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价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 (前称中银香港全天候中港 股票基金)	通过主要投资于香港及中国内地市场的权益性证券，实现长远资本增值。
中银香港全天候在岸 人民币股票基金	通过RQFII主要投资中国A股，实现长远资本增值。
中银香港全天候 亚洲债券基金	通过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。

9 财务风险管理 (续)

<u>子基金</u>	<u>投资目标</u>
中银香港全天候亚洲 (日本除外) 股票基金	通过主要投资于在亚洲 (日本除外) 上市或由在亚洲 (日本除外) 赚取大部分收益或进行重大业务或经济活动的公司发行的权益性证券, 以提供长期资本增值。
中银香港全天候 中国收益基金	主要通过通过对包含中国内地、香港及澳门市场的固定收益证券及权益性证券的投资组合进行积极资产配置, 以在中至长期提供收入及资本增值。
中银香港全天候 亚太高收益基金	透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。

(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, 例如波动性及关连系数。子基金内的衍生工具也可能使子基金受到市场波动的重大影响。市场风险包括经济环境、消费模式及投资者期望改变等因素, 这些因素可能会对投资价值造成重大影响。市场波动因此可导致子基金份额的资产净值出现大幅波动。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018年6月30日

9 财务风险管理 (续)

(a) 市场风险 (续)

(i) 价格风险

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

中银香港全天候环球投资基金

金融资产	2018年		2017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				
德国	—	—	344,791	6.79
香港	—	—	402,705	7.94
日本	—	—	147,486	2.91
英国	—	—	94,171	1.86
美国	2,998,715	45.90	1,272,875	25.08
	<u>2,998,715</u>	<u>45.90</u>	<u>2,262,028</u>	<u>44.58</u>
上市权益性证券				
香港	377,631	5.79	258,479	5.09
西班牙	1,556	0.02	1,890	0.04
美国	190,383	2.91	—	—
	<u>569,570</u>	<u>8.72</u>	<u>260,369</u>	<u>5.13</u>
挂牌债务证券				
澳大利亚	254,375	3.90	467,517	9.21
英属维尔京群岛	606,191	9.28	203,329	4.01
开曼群岛	401,080	6.14	604,741	11.92
法国	254,386	3.89	253,102	4.99
德国	—	—	182,032	3.59
香港	385,636	5.91	405,151	7.99
印度尼西亚	—	—	202,187	3.98
韩国	—	—	201,211	3.96
阿曼	191,627	2.93	—	—
新加坡	202,704	3.10	—	—
	<u>2,295,999</u>	<u>35.15</u>	<u>2,519,270</u>	<u>49.65</u>
	<u>5,864,284</u>	<u>89.77</u>	<u>5,041,667</u>	<u>99.36</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018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	2018年		2017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	7,034,974	0.30	20,088,803	0.60
	<u>7,034,974</u>	<u>0.30</u>	<u>20,088,803</u>	<u>0.60</u>
挂牌债务证券				
澳大利亚	73,463,198	3.11	133,589,109	3.99
巴林	6,266,984	0.27	3,675,949	0.11
百慕大	13,560,375	0.57	95,047,266	2.84
英属维尔京群岛	451,809,951	19.20	522,510,653	15.60
加拿大	–	–	8,044,964	0.24
开曼群岛	1,127,308,547	47.79	1,281,461,230	38.22
中国内地	64,657,394	2.74	98,418,308	2.94
埃及	–	–	4,975,608	0.15
法国	–	–	3,550,329	0.11
德国	–	–	9,360,159	0.28
香港	116,589,263	4.96	360,803,570	10.74
印度	–	–	59,384,880	1.77
印度尼西亚	–	–	63,732,734	1.90
日本	–	–	11,208,550	0.33
Jersey, C.I	3,394,596	0.14	24,989,822	0.75
约旦	–	–	5,339,066	0.16
韩国	12,823,470	0.54	34,884,514	1.04
毛里求斯	23,438,422	1.00	21,107,882	0.63
墨西哥	–	–	3,203,610	0.10
蒙古	19,834,027	0.84	16,678,864	0.50
荷兰	1,630,872	0.07	55,272,963	1.64
尼日利亚	–	–	7,204,135	0.21
巴基斯坦	–	–	7,143,716	0.21
菲律宾	–	–	16,529,880	0.49
葡萄牙	–	–	3,498,331	0.10
新加坡	96,511,668	4.10	215,011,050	6.40

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018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 (续)

金融资产	2018年		2017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 %
斯里兰卡	6,877,811	0.29	19,756,663	0.58
超国家	—	—	11,604,302	0.34
瑞典	—	—	4,244,867	0.13
瑞士	—	—	3,615,900	0.11
土耳其	—	—	4,208,109	0.13
英国	17,260,783	0.73	42,772,024	1.28
越南	—	—	3,590,550	0.11
赞比亚	—	—	3,237,852	0.10
	<u>2,035,427,361</u>	<u>86.35</u>	<u>3,159,657,409</u>	<u>94.23</u>
	<u>2,042,462,335</u>	<u>86.65</u>	<u>3,179,746,212</u>	<u>94.83</u>

中银香港全天候香港股票基金 (前称中银香港全天候中港股票基金)

金融资产	2018年		2017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	<u>—</u>	<u>—</u>	<u>40,756,000</u>	<u>9.21</u>
上市权益性证券				
中国内地	16,064,411	4.98	—	—
香港	<u>295,954,000</u>	<u>91.76</u>	<u>361,453,470</u>	<u>81.74</u>
	<u>312,018,411</u>	<u>96.74</u>	<u>361,453,470</u>	<u>81.74</u>
存托凭证				
美国	<u>—</u>	<u>—</u>	<u>22,000,690</u>	<u>4.98</u>
	<u>312,018,411</u>	<u>96.74</u>	<u>424,210,160</u>	<u>95.93</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018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	2018年		2017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				
中国内地	22,854,000	7.78	—	—
上市权益性证券				
中国内地	233,764,217	79.59	562,974,408	97.55
香港	3,206,812	1.09	—	—
	<u>236,971,029</u>	<u>80.68</u>	<u>562,974,408</u>	<u>97.55</u>
	<u>259,825,029</u>	<u>88.46</u>	<u>562,974,408</u>	<u>97.55</u>

中银香港全天候亚洲债券基金

金融资产	2018年		2017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	1,281,885	2.86	732,617	1.65
百慕大	197,966	0.44	716,556	1.60
英属维尔京群岛	7,468,492	16.63	6,858,688	15.34
加拿大	164,875	0.37	438,824	0.98
开曼群岛	11,378,718	25.35	9,302,449	20.81
中国内地	4,143,817	9.22	2,555,442	5.72
法国	785,939	1.75	1,089,487	2.43
香港	5,775,230	12.86	5,864,119	13.11
印度	374,426	0.84	1,687,466	3.77
印度尼西亚	2,157,814	4.81	2,360,504	5.29
Isle of Man	290,251	0.65	526,972	1.18
日本	188,628	0.42	201,397	0.45
Jersey, C.I.	—	—	210,596	0.47

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018年6月30日

9 财务风险管理 (续)

(a) 市场风险 (续)

(i) 价格风险 (续)

中银香港全天候亚洲债券基金 (续)

金融资产	2018年		2017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 %
韩国	400,673	0.89	301,817	0.68
马来西亚	492,495	1.10	335,063	0.75
墨西哥	273,423	0.61	–	–
蒙古	228,723	0.51	233,913	0.52
荷兰	187,030	0.42	420,465	0.94
阿曼	191,627	0.43	–	–
菲律宾	955,494	2.12	205,445	0.46
新加坡	2,806,200	6.23	3,067,806	6.86
斯里兰卡	444,004	0.99	473,960	1.06
超国家	–	–	797,924	1.78
瑞士	502,454	1.12	–	–
泰国	502,905	1.12	511,915	1.14
阿联酋	433,035	0.96	–	–
英国	711,055	1.59	1,069,185	2.39
美国	2,194,216	4.89	1,970,113	4.41
越南	500,380	1.11	529,525	1.18
	<u>45,031,755</u>	<u>100.29</u>	<u>42,462,248</u>	<u>94.97</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018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	2018年	
	公允价值 美元	占资产净值的 百分比 %
集合投资计划	189,944	2.90
新加坡	487,362	7.43
美国	<u>677,306</u>	<u>10.33</u>
上市权益性证券		
香港	2,910,984	44.38
印度尼西亚	67,130	1.02
韩国	1,058,442	16.14
新加坡	88,340	1.35
泰国	192,374	2.93
美国	60,646	0.92
	<u>4,377,916</u>	<u>66.74</u>
存托凭证		
印度	294,802	4.49
台湾	222,248	3.39
英国	119,211	1.82
美国	670,462	10.22
	<u>1,306,723</u>	<u>19.92</u>
	<u><u>6,361,945</u></u>	<u><u>96.99</u></u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018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	2018年	
	公允价值 港元	占资产净值的 百分比 %
上市权益性证券		
中国内地	45,919,256	17.94
香港	103,091,170	40.29
美国	7,322,840	2.86
	<u>156,333,266</u>	<u>61.09</u>
挂牌债务证券		
澳大利亚	3,518,509	1.37
英属维尔京群岛	19,630,038	7.68
加拿大	359,364	0.14
开曼群岛	40,193,466	15.71
中国内地	14,181,973	5.54
香港	4,719,933	1.84
韩国	1,571,960	0.61
马来西亚	1,472,420	0.57
阿曼	2,480,975	0.97
新加坡	3,803,582	1.49
	<u>91,932,220</u>	<u>35.92</u>
存托凭证		
美国	4,658,495	1.82
	<u>252,923,981</u>	<u>98.83</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2018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	2018年	
	公允价值 美元	占资产净值的 百分比 %
集合投资计划		
新加坡	294,951	1.06
美国	1,242,274	4.46
	<u>1,537,225</u>	<u>5.52</u>
上市权益性证券		
澳大利亚	843,892	3.03
中国内地	490,471	1.76
香港	8,779,950	31.55
新加坡	752,260	2.70
美国	279,975	1.01
	<u>11,146,548</u>	<u>40.05</u>
挂牌债务证券		
澳大利亚	795,564	2.86
英属维尔京群岛	2,319,072	8.33
开曼群岛	7,137,944	25.64
香港	399,291	1.43
毛里求斯	185,266	0.67
新加坡	1,507,693	5.42
	<u>12,344,830</u>	<u>44.35</u>
存托凭证		
英国	380,100	1.37
美国	345,298	1.24
	<u>725,398</u>	<u>2.61</u>
	<u>25,754,001</u>	<u>92.53</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2018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	2018年 占资产净值的 百分比 %	2017年 占资产净值的 百分比 %
集合投资计划		
金融	41.73	28.03
技术	4.17	13.64
其他	–	2.91
	<u>45.90</u>	<u>44.58</u>
上市权益性证券		
通讯	4.33	0.04
消费者，非周期性	0.41	–
金融	3.98	5.09
	<u>8.72</u>	<u>5.13</u>
挂牌债务证券		
基本物料	3.11	–
通讯	–	3.92
消费者，周期性	–	3.98
金融	26.08	34.23
政府	–	3.59
工业	3.03	3.93
公用事业	2.93	–
	<u>35.15</u>	<u>49.65</u>
	<u>89.77</u>	<u>99.36</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018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	2018年 占资产净值的 百分比 %	2017年 占资产净值的 百分比 %
集合投资计划		
金融	0.30	0.60
挂牌债务证券		
基本物料	5.13	4.74
通讯	1.63	1.08
消费者, 周期性	15.12	12.78
消费者, 非周期性	4.00	4.19
多元化经营	–	0.10
能源	6.01	2.25
金融	46.44	55.12
政府	0.54	2.31
工业	5.23	6.19
技术	2.11	2.40
公用事业	0.14	3.07
	86.35	94.23
	86.65	94.83

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018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 (前称中银香港全天候中港股票基金)

金融资产	2018年 占资产净值的 百分比 %	2017年 占资产净值的 百分比 %
集合投资计划		
房地产	—	1.34
其他	—	7.87
	<u>—</u>	<u>9.21</u>
上市权益性证券		
基本物料	—	3.58
通讯	10.99	—
消费者, 周期性	23.11	4.55
消费者, 非周期性	16.93	—
能源	5.32	2.56
金融	28.31	58.90
工业	5.63	4.57
技术	1.67	7.58
公用事业	4.78	—
	<u>96.74</u>	<u>81.74</u>
存托凭证		
技术	—	4.98
	<u>96.74</u>	<u>95.93</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2018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	2018年 占资产净值的 百分比 %	2017年 占资产净值的 百分比 %
集合投资计划 金融	7.78	—
上市权益性证券		
基本物料	4.40	13.15
通讯	6.91	2.55
消费者, 周期性	12.22	12.88
消费者, 非周期性	26.81	13.90
多元化经营	—	0.97
能源	—	1.75
金融	7.29	9.08
工业	19.11	36.17
技术	3.94	3.93
公用事业	—	3.17
	<u>80.68</u>	<u>97.55</u>
	<u>88.46</u>	<u>97.55</u>

中银香港全天候亚洲债券基金

金融资产	2018年 占资产净值的 百分比 %	2017年 占资产净值的 百分比 %
挂牌债务证券		
基本物料	4.68	2.44
通讯	6.40	5.28
消费者, 周期性	7.55	5.45
消费者, 非周期性	2.80	4.37
能源	5.88	10.34
金融	56.69	46.21
政府	4.09	9.31
工业	6.23	8.01
技术	0.45	1.50
公用事业	5.52	2.06
	<u>100.29</u>	<u>94.97</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018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	2018年 占资产净值 的百分比 %
集合投资计划	
金融	10.33
上市权益性证券	
通讯	10.07
消费者, 周期性	8.40
消费者, 非周期性	7.87
多元化经营	1.35
能源	1.25
金融	15.37
政府	0.91
工业	7.08
技术	10.31
公用事业	4.13
	<u>66.74</u>
存托凭证	
通讯	7.75
消费者, 周期性	0.69
能源	1.06
金融	2.23
工业	1.04
技术	7.06
公用事业	0.09
	<u>19.92</u>
	<u>96.99</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018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	2018年 占资产净值 的百分比 %
上市权益性证券	
通讯	7.00
消费者, 周期性	5.43
消费者, 非周期性	11.30
金融	26.25
工业	4.10
技术	1.34
公用事业	5.67
	<hr/>
	61.09
挂牌债务证券	
基本物料	3.56
通讯	1.82
消费者, 周期性	0.81
能源	0.74
金融	25.92
工业	0.55
公用事业	2.52
	<hr/>
	35.92
存托凭证	
通讯	1.82
	<hr/>
	98.83
	<hr/> <hr/>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2018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	2018年 占资产净值 的百分比 %
集合投资计划	
金融	5.52
上市权益性证券	
基本物料	0.51
通讯	4.51
消费者, 周期性	3.52
消费者, 非周期性	6.29
金融	21.84
工业	1.41
技术	0.58
公用事业	1.39
	40.05
挂牌债务证券	
基本物料	4.15
通讯	1.45
消费者, 周期性	6.30
消费者, 非周期性	1.44
能源	4.87
金融	22.00
工业	4.14
	44.35
存托凭证	
通讯	1.24
工业	1.37
	2.61
	92.53

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018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，从而令于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 合理可能 变动 2018年	资产净值的 估计可能 变动 2018年 美元	市场指数的 合理可能 变动 2017年	资产净值的 估计可能 变动 2017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%	± 202,984	± 5%	± 80,740

中银香港全天候香港股票基金 (前称中银香港全天候中港股票基金)

	市场指数的 合理可能 变动 2018年	资产净值的 估计可能 变动 2018年 港元	市场指数的 合理可能 变动 2017年	资产净值的 估计可能 变动 2017年 港元
恒生总回报指数	± 16%	± 55,382,706	± 10%	± 30,423,461

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2018年6月30日

9 财务风险管理 (续)

(a) 市场风险 (续)

(i) 价格风险 (续)

中银香港全天候在岸人民币股票基金

	市场指数的 合理可能 变动 2018年	资产净值的 估计可能 变动 2018年 人民币	市场指数的 合理可能 变动 2017年	资产净值的 估计可能 变动 2017年 人民币
深圳证券交易所综合总回报指数	±12%	±19,263,158	±14%	±69,675,806

中银香港全天候亚洲 (日本除外) 股票基金

	市场指数的 合理可能变动 2018年	资产净值的 估计可能变动 2018年 美元
MSCI AC亚洲除日本净总回报美元指数	±13%	±665,088

中银香港全天候中国收益基金

	市场指数的 合理可能变动 2018年	资产净值的 估计可能变动 2018年 港元
恒生低波幅总回报指数	±12%	±17,160,320

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018年6月30日

9 财务风险管理 (续)

(a) 市场风险 (续)

(i) 价格风险 (续)

中银香港全天候亚太高收益基金

	市场指数的 合理可能变动 2018年	资产净值的 估计可能变动 2018年 美元
MSCI AC亚太除日本高息净回报美元指数	± 8%	± 406,196

在报告期末，由于中银香港全天候中国高息债券基金及中银香港全天候亚洲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，因此这两个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

利率风险来自于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。子基金持有的定息债务证券使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），故子基金需承受利率风险。如果利率上升，之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，则之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，并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
2018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务证券投资。

中银香港全天候环球投资基金

	2018年 美元	2017年 美元
剩余到期日如下：		
— 少于一年	403,589	—
— 一至五年	1,515,462	1,315,632
— 超过五年	376,948	1,203,638
	<u>2,295,999</u>	<u>2,519,270</u>

中银香港全天候中国高息债券基金

	2018年 人民币	2017年 人民币
剩余到期日如下：		
— 少于一年	456,456,706	144,295,851
— 一至五年	1,312,649,378	1,764,669,280
— 超过五年	266,321,277	1,250,692,278
	<u>2,035,427,361</u>	<u>3,159,657,409</u>

中银香港全天候亚洲债券基金

	2018年 美元	2017年 美元
剩余到期日如下：		
— 少于一年	3,845,115	517,952
— 一至五年	20,648,700	19,100,008
— 超过五年	20,537,940	22,844,288
	<u>45,031,755</u>	<u>42,462,248</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2018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

2018年
港元

剩余到期日如下：

— 少于一年	14,693,584
— 一至五年	41,621,125
— 超过五年	35,617,511
	<u>91,932,220</u>

中银香港全天候亚太高收益基金

2018年
美元

剩余到期日如下：

— 少于一年	1,709,393
— 一至五年	9,840,199
— 超过五年	795,238
	<u>12,344,830</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,从而令于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。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018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)

	利率变动	对资产净值 的影响 2018年	对资产净值 的影响 2017年
中银香港全天候环球投资基金	±100基点	±73,481美元	±136,402美元
中银香港全天候中国高息债券基金	±100基点	±人民币 66,440,670元	±人民币 187,325,459元
中银香港全天候亚洲债券基金	±100基点	±1,730,903美元	±2,162,719美元
中银香港全天候中国收益基金	±100基点	±3,279,950港元	-
中银香港全天候亚太高收益基金	±100基点	±215,302美元	-

(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。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018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

	2018年 美元	2017年 美元
<i>货币性</i>		
澳元	14,239	14,266
欧元	22,033	2,560
英镑	289	3,041
港元	5,610	16,306
日圆	50	50
人民币	151	148
<i>非货币性</i>		
欧元	1,556	346,681
英镑	–	94,171
港元	377,631	661,185
日圆	–	147,486

中银香港全天候中国高息债券基金

	2018年 人民币	2017年 人民币
<i>货币性</i>		
澳元	16,431,398	22,826,587
港元	44,832,539	126,660,104
美元	240,966,693	(15,477,878)
印度卢比	–	16,137,148
<i>非货币性</i>		
美元	7,034,973	7,625,573

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018年6月30日

9 财务风险管理 (续)

(a) 市场风险 (续)

(iii) 外汇风险 (续)

中银香港全天候香港股票基金 (前称中银香港全天候中港股票基金)

	2018年 港元	2017年 港元
<i>货币性</i>		
澳元	2,917,696	4,514,913
新西兰元	59,976	2
人民币	3,413,306	12,460,570
美元	979,490	575,745
<i>非货币性</i>		
人民币	16,464,660	–
美元	–	22,000,690

中银香港全天候在岸人民币股票基金

	2018年 人民币	2017年 人民币
<i>货币性</i>		
港元	2,646,720	649,346
美元	252,328	109,834
<i>非货币性</i>		
港元	3,206,812	–

中银香港全天候亚洲债券基金

	2018年 美元	2017年 美元
<i>货币性</i>		
港元	645,900	9,806
印度卢比	–	1,236,748
人民币	4,297,518	4,899,386

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2018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

	2018年 美元
<i>货币性</i>	
港元	250,555
韩圻	1,967
人民币	482,024
新加坡元	1
<i>非货币性</i>	
港元	2,910,986
印度卢比	67,130
韩圻	1,058,442
新加坡元	189,944
泰铢	192,374

中银香港全天候中国收益基金

	2018年 港元
<i>货币性</i>	
澳元	9,049
人民币	62,083,334
美元	84,382,971
<i>非货币性</i>	
人民币	45,919,256
美元	11,981,334

中银香港全天候亚太高收益基金

	2018年 美元
<i>货币性</i>	
澳元	906,085
港元	1,773,927
人民币	3,875,616
新加坡元	94,012
<i>非货币性</i>	
澳元	843,892
港元	8,779,949
人民币	490,471
新加坡元	1,047,210

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2018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%而令于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	
		2018年	2017年
		美元 +/-	美元 +/-
<i>货币性</i>			
澳元	5%	712	713
欧元	5%	1,102	128
英镑	5%	14	152
港元	5%	281	815
日圆	5%	3	3
人民币	5%	8	7
<i>非货币性</i>			
欧元	5%	-	17,334
英镑	5%	78	4,709
港元	5%	18,882	33,059
日圆	5%	-	7,374

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018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	
		2018年	2017年
		人民币	人民币
		+/-	+/-
<i>货币性</i>			
澳元	5%	821,570	1,141,329
港元	5%	2,241,627	6,333,005
美元	5%	12,048,335	(773,894)
印度卢比	5%	–	806,857
<i>非货币性</i>			
美元	5%	351,749	381,279

中银香港全天候香港股票基金 (前称中银香港全天候中港股票基金)

	可能合理变动 +/-	对资产净值的影响	
		2018年	2017年
		港元	港元
		+/-	+/-
<i>货币性</i>			
澳元	5%	145,885	225,746
新西兰元	5%	2,999	–
人民币	5%	170,665	623,029
美元	5%	48,974	28,787
<i>非货币性</i>			
人民币	5%	823,233	–
美元	5%	–	1,100,035

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2018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	
		2018年	2017年
		人民币	人民币
		+/-	+/-
<i>货币性</i>			
港元	5%	132,336	32,467
美元	5%	12,616	5,492
<i>非货币性</i>			
港元	5%	160,341	-

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	
		2018年	2017年
		美元	美元
		+/-	+/-
<i>货币性</i>			
港元	5%	32,295	490
印度卢比	5%	-	61,837
人民币	5%	214,876	244,969

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018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
	+/-	2018年
		美元
		+/-
<i>货币性</i>		
港元	5%	12,528
韩圆	5%	98
人民币	5%	24,101
新加坡元	5%	-
<i>非货币性</i>		
港元	5%	145,549
印度卢比	5%	3,357
韩圆	5%	52,922
新加坡元	5%	9,497
泰铢	5%	9,619

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
	+/-	2018年
		港元
		+/-
<i>货币性</i>		
澳元	5%	452
人民币	5%	3,104,167
美元	5%	4,219,149
<i>非货币性</i>		
人民币	5%	2,295,963
美元	5%	599,067

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018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 2018年 美元 +/-
<i>货币性</i>		
澳元	5%	45,304
港元	5%	88,696
人民币	5%	193,781
新加坡元	5%	4,701
<i>非货币性</i>		
澳元	5%	42,195
港元	5%	438,997
人民币	5%	24,524
新加坡元	5%	52,361

(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，但财务报表附注9(d)披露的于2017年6月30日持有的暂停交易的权益性证券除外。截至2018年及2017年6月30日，除应收股息、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。

9 财务风险管理 (续)

(b) 流动风险 (续)

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2017年6月30日及2016年6月30日止的年度内，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，2017年6月30日及2016年6月30日的所有负债包括资产净值表中所列的应付分配、应付管理费、应付受托人费、应计费用及其他应付款项以及赎回份额的应付赎回款项（于一个月内到期）。这些款项为未折现的合同现金流量。由于折现的影响并不重大，所以在十二个月内到期的余额等于其帐面余额。

下表概述了在报告期末持有相关类别子基金份额的10%以上的份额持有人数目：

	2018年 份额持有人 数目	2017年 份额持有人 数目
中银香港全天候环球投资基金	3	3
中银香港全天候中国高息债券基金	9	7
中银香港全天候香港股票基金 (前称中银香港全天候中港股票基金)	4	4
中银香港全天候在岸人民币股票基金	3	2
中银香港全天候亚洲债券基金	2	3
中银香港全天候亚洲(日本除外)股票基金	2	-
中银香港全天候中国收益基金	2	-
中银香港全天候亚太高收益基金	1	-

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2018年6月30日

9 财务风险管理 (续)

(c) 信用及交易对手方风险

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。

子基金在债务证券中的投资承担信用风险，且风险概述如下。

中银香港全天候环球投资基金

评级	2018年		2017年	
	资产净值的 百分比	美元	资产净值的 百分比	美元
Aaa ²	–	–	182,032	3.59
A ¹ /A ²	457,079	7.00	1,055,009	20.79
BBB ¹ /Baa ²	1,435,330	21.97	456,430	8.99
BB ¹ /Ba ²	–	–	611,722	12.06
BBB ⁻¹	–	–	214,077	4.22
并未评级	403,590	6.18	–	–
总计	<u>2,295,999</u>	<u>35.15</u>	<u>2,519,270</u>	<u>49.65</u>

中银香港全天候中国高息债券基金

评级	2018年		2017年	
	资产净值的 百分比	人民币	资产净值的 百分比	人民币
AAA ¹ /Aaa ²	–	–	16,137,148	0.48
A ¹ /A ²	–	–	16,806,257	0.50
BBB ¹ /Baa ²	10,116,236	0.43	146,777,240	4.38
BB ¹ /Ba ²	1,226,965,033	52.05	2,371,126,636	70.71
Caa ²	–	–	21,630,878	0.65
并未评级	798,346,092	33.87	587,179,250	17.51
总计	<u>2,035,427,361</u>	<u>86.35</u>	<u>3,159,657,409</u>	<u>94.23</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018年6月30日

9 财务风险管理 (续)

(c) 信用及交易对手方风险 (续)

中银香港全天候亚洲债券基金

评级	2018年		2017年	
	美元	资产净值的 百分比 %	美元	资产净值的 百分比 %
AAA ¹ /Aaa ²	-	-	1,236,748	2.77
A ¹ /A ²	9,470,912	21.09	9,941,278	22.23
BBB ¹ /Baa ²	17,604,769	39.21	13,307,158	29.76
BB1/Ba ²	9,097,780	20.26	13,281,730	29.71
并未评级	8,858,294	19.73	4,695,334	10.50
总计	<u>45,031,755</u>	<u>100.29</u>	<u>42,462,248</u>	<u>94.97</u>

中银香港全天候中国收益基金

评级	2018年	
	港元	资产净值的 百分比 %
A ¹ /A ²	23,759,349	9.28
BBB ¹ /Baa ²	22,451,635	8.77
BB ¹ /Ba ²	21,563,788	8.43
并未评级	24,157,450	9.44
总计	<u>91,932,222</u>	<u>35.92</u>

中银香港全天候亚太高收益基金

评级	2018年	
	美元	资产净值的 百分比 %
BB ¹ /Ba ²	8,497,074	30.53
并未评级	3,847,756	13.82
总计	<u>12,344,830</u>	<u>44.35</u>

1 标准普尔

2 穆迪

9 财务风险管理 (续)

(c) 信用及交易对手方风险 (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2018年6月30日及2017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。

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，可能面临交易对手集中的风险，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2018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（2017年：A），对花旗银行香港分行的信用评级为A（2017年：A）。

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

(d) 公允价值估计

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

活跃市场指资产或负债交易以足够的频率及数量进行以持续地提供定价数据的市场。

9 财务风险管理 (续)

(d) 公允价值估计 (续)

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

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

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

公允价值等级有以下层级：

- 第一层级 — 基于实体可在计量日获取的相同资产或负债在活跃市场中的报价（未经调整）。
- 第二层级 — 基于对公允价值计量属重大的最低层级输入数据为可直接或间接观察的估值技术。
- 第三层级 — 基于对公允价值计量属重大的最低层级输入数据为不可观察的估值技术。

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

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

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

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018年6月30日

9 财务风险管理 (续)

(d) 公允价值估计 (续)

中银香港全天候环球投资基金

	第一层级 美元	第二层级 美元	第三层级 美元	总计 美元
2018年6月30日				
金融资产	2,998,715	–	–	2,998,715
集合投资计划	569,570	–	–	569,570
上市权益性证券	–	46	–	46
外汇远期合约	–	2,295,999	–	2,295,999
挂牌债务证券	<u>3,568,285</u>	<u>2,296,045</u>	<u>–</u>	<u>5,864,330</u>
金融负债				
可赎回份额 (按成交价)	<u>–</u>	<u>6,532,773</u>	<u>–</u>	<u>6,532,773</u>
2017年6月30日				
金融资产				
集合投资计划	2,262,028	–	–	2,262,028
上市权益性证券	260,369	–	–	260,369
外汇远期合约	–	160	–	160
挂牌债务证券	–	2,519,270	–	2,519,270
	<u>2,522,397</u>	<u>2,519,430</u>	<u>–</u>	<u>5,041,827</u>
金融负债				
可赎回份额 (按成交价)	<u>–</u>	<u>5,074,314</u>	<u>–</u>	<u>5,074,314</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018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
2018年6月30日				
金融资产				
集合投资计划	-	7,034,974	-	7,034,974
外汇远期合约	-	923,822	-	923,822
挂牌债务证券	-	2,035,427,361	-	2,035,427,361
	-	2,043,386,157	-	2,043,386,157
金融负债				
外汇远期合约	-	8,987,109	-	8,987,109
可赎回份额 (按成交价)	-	2,357,188,111	-	2,357,188,111
	-	2,366,175,220	-	2,366,175,220
2017年6月30日				
金融资产				
集合投资计划	-	20,088,803	-	20,088,803
外汇远期合约	-	56,268,778	-	56,268,778
挂牌债务证券	-	3,159,657,409	-	3,159,657,409
	-	3,236,014,990	-	3,236,014,990
金融负债				
外汇远期合约	-	775,633	-	775,633
可赎回份额 (按成交价)	-	3,353,226,938	-	3,353,226,938
	-	3,354,002,571	-	3,354,002,571

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018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 (前称中银香港全天候中港股票基金)

	第一层级 港元	第二层级 港元	第三层级 港元	总计 港元
2018年6月30日				
金融资产				
上市权益性证券	312,018,411	–	–	312,018,411
外汇远期合约	–	5,667	–	5,667
	<u>312,018,411</u>	<u>5,667</u>	<u>–</u>	<u>312,024,078</u>
金融负债				
外汇远期合约	–	19,412	–	19,412
可赎回份额 (按成交价)	–	322,525,852	–	322,525,852
	<u>–</u>	<u>322,545,264</u>	<u>–</u>	<u>322,545,264</u>
2017年6月30日				
金融资产				
集合投资计划	40,756,000	–	–	40,756,000
上市权益性证券	361,453,470	–	–	361,453,470
存托凭证	22,000,690	–	–	22,000,690
外汇远期合约	–	80,260	–	80,260
	<u>424,210,160</u>	<u>80,260</u>	<u>–</u>	<u>424,290,420</u>
金融负债				
可赎回份额 (按成交价)	–	442,195,231	–	442,195,231
	<u>–</u>	<u>442,195,231</u>	<u>–</u>	<u>442,195,231</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018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
2018年6月30日				
金融资产				
集合投资计划	22,854,000	–	–	22,854,000
上市权益性证券	236,971,029	–	–	236,971,029
外汇远期合约	–	7,204	–	7,204
	<u>259,825,029</u>	<u>7,204</u>	<u>–</u>	<u>259,832,233</u>
金融负债				
可赎回份额 (按成交价)	–	293,708,972	–	293,708,972
	<u>–</u>	<u>293,708,972</u>	<u>–</u>	<u>293,708,972</u>
2017年6月30日				
金融资产				
上市权益性证券	513,909,401	–	49,065,007	562,974,408
	<u>513,909,401</u>	<u>–</u>	<u>49,065,007</u>	<u>562,974,408</u>
金融负债				
可赎回份额 (按成交价)	–	577,249,713	–	577,249,713
	<u>–</u>	<u>577,249,713</u>	<u>–</u>	<u>577,249,713</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018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
2018年6月30日				
金融资产				
挂牌债务证券	—	45,031,755	—	45,031,755
金融负债				
外汇远期合约	—	18,458	—	18,458
可赎回份额 (按成交价)	—	44,918,970	—	44,918,970
	—	44,937,428	—	44,937,428
2017年6月30日				
金融资产				
挂牌债务证券	—	42,462,248	—	42,462,248
外汇远期合约	—	238,823	—	238,823
	—	42,701,071	—	42,701,071
金融负债				
外汇远期合约	—	284	—	284
可赎回份额 (按成交价)	—	44,747,577	—	44,747,577
	—	44,747,861	—	44,747,861

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018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
2018年6月30日				
金融资产				
集合投资计划	677,306	—	—	677,306
上市权益性证券	4,377,916	—	—	4,377,916
存托凭证	1,306,723	—	—	1,306,723
	<u>6,361,945</u>	<u>—</u>	<u>—</u>	<u>6,361,945</u>
金融负债				
外汇远期合约	—	2,668	—	2,668
可赎回份额 (按成交价)	—	6,596,671	—	6,596,671
	<u>—</u>	<u>6,599,339</u>	<u>—</u>	<u>6,599,339</u>

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
2018年6月30日				
金融资产				
上市权益性证券	156,333,266	—	—	156,333,266
存托凭证	4,658,495	—	—	4,658,495
挂牌债务证券	—	91,932,220	—	91,932,220
	<u>160,991,761</u>	<u>91,932,220</u>	<u>—</u>	<u>252,923,981</u>
金融负债				
外汇远期合约	—	287,700	—	287,700
可赎回份额 (按成交价)	—	256,267,741	—	256,267,741
	<u>—</u>	<u>256,555,441</u>	<u>—</u>	<u>256,555,441</u>

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018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
2018年6月30日				
金融资产				
集合投资计划	1,537,225	–	–	1,537,225
上市权益性证券	11,146,548	–	–	11,146,548
挂牌债务证券	–	12,344,830	–	12,344,830
存托凭证	725,398	–	–	725,398
外汇远期合约	–	2,550	–	2,550
	<u>13,409,171</u>	<u>12,347,380</u>	<u>–</u>	<u>25,756,551</u>
金融负债				
外汇远期合约	–	14,821	–	14,821
可赎回份额 (按成交价)	–	27,904,342	–	27,904,342
	<u>–</u>	<u>27,919,163</u>	<u>–</u>	<u>27,919,163</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、经纪人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，其一般根据可取得的市场资料得出。

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。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018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

于2018年6月30日，子基金并无持有暂停交易的权益性证券。于2017年6月30日，子基金持有10项上市权益性证券，金额为人民币49,065,007元（占其资产净值的8.50%），这些证券于相关证券交易所暂停交易，并被分类为第三层级投资。

下表列示于报告期内第三层级投资的公允价值从子基金期初余额到期末余额的对帐。公允价值等级各层级之间的转拨被视为已于报告期末发生。

	2018年 人民币	2017年 人民币
于2017年7月1日及2016年7月1日	49,065,007	76,180,894
从第三层级转入第一层级	(49,065,007)	(76,180,894)
由第一层级转至第三层级	—	49,065,007
于2018年6月30日及2017年6月30日	<u>—</u>	<u>49,065,007</u>
计入年内以公允价值计量且其变动计入当期损益的 金融资产的未变现利得／损失变动净额的 年内总损失	<u>—</u>	<u>(2,510,632)</u>

缺少报价的暂停交易上市权益性证券的公允价值由基金管理人使用经基金管理人高级管理层批准并获受托人同意的指数收益法估计。暂停交易上市权益的公允价值乃使用其于暂停交易日期的最后成交价估计，并就证券暂停交易日期至估值日期的参考基准指数的收益作出进一步调整。该估值方法包括重大不可观察输入数据，因此，子基金将暂停交易权益性证券分类为第三层级投资。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018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 (续)

下表概述确定暂停交易上市权益性证券公允价值时使用的估值技术及其重大不可观察输入数据，及不可观察输入数据可能合理变动对公允价值计量影响的敏感度分析（所有其他变量维持不变）：

	公允价值 人民币	估值技术	不可观察 输入数据	输入数据的 可能变动	公允价值 影响 人民币
2017年6月30日					
金融资产					
暂停交易的上市 权益性证券	49,065,007	指数收益法	深圳证券交易所 综合总回报指数	±5%	±2,453,250

可赎回份额的可卖回价值是根据子基金的说明书，按子基金于估值日的总资产及所有其他负债的净差额进行计算的。子基金的份额可按受托人每日计算的报价于任何营业日发行及赎回。这些份额不在证券交易所买卖。然而，该价格是可观察的，且与子基金的交易定期按该价格进行。由于子基金按报价提供其股份的每日流动性，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净资产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净资产除外）按摊销成本入账。资产净值表所披露的这些资产及负债的帐面价值是合理的且接近于公允价值。

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

9 财务风险管理 (续)

(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。

此外，根据基金说明书的规定，子基金的开办费在前三年内摊销。然而，如同财务报表附注2(j)所述，开办费在发生时计入费用。于2017年6月30日，如果与基金说明书所指的方法相比，财务报表所列开办费用的支出导致中银香港全天候在岸人民币股票基金产生差额人民币零元（2017年：人民币162,655元）、中银香港全天候亚洲债券基金产生差额19,225美元（2017年：38,449美元）、中银香港全天候亚洲（日本除外）股票基金产生差额37,157美元、中银香港全天候中国收益基金产生差额355,887港元及中银香港全天候亚太高收益基金产生差额70,373美元。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018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发行/(赎回)的相关类别份额:

中银香港全天候环球投资基金

	A1类	A2类	A3类	X2类
于2016年7月1日尚未行使的份额	222,359.4290	2,094,638.9560	1,858.3050	-
已发行份额	116,701.0000	1,254,501.0430	-	1,000,000.0000
已赎回份额	(209,682.7470)	(1,379,938.9580)	-	-
于2017年6月30日及2017年7月1日尚未行使的份额	129,377.6820	1,969,201.0410	1,858.3050	1,000,000.0000
已发行份额	108,110.6660	1,657,589.9660	197.6170	691,153.8370
已赎回份额	(95,363.7460)	(1,538,519.4120)	(197.6170)	-
于2018年6月30日尚未行使的份额	142,124.6020	2,088,271.5950	1,858.3050	1,691,153.8370
<u>于2018年6月30日</u>				
归属于份额持有人的资产净值	1,437,995美元	21,380,774港元	18,191澳元	18,490,211港元
每份额资产净值	10.12美元	10.24港元	9.79澳元	10.93港元
<u>2017年6月30日</u>				
归属于份额持有人的资产净值	1,259,184美元	19,296,650港元	17,630澳元	10,383,002港元
每份额资产净值	9.73美元	9.80港元	9.49澳元	10.38港元

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2018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)

中银香港全天候中国高息债券基金

	A1类	A2类	A3类	A4类	A8类	X1类	X3类	I2类	I3类	I4类
于2016年7月1日尚未行使的份额	33,766,167.3910	2,582,104.2360	33,496,260.4090	232,745.1590	621,666.8230	2,453,385.6720	-	-	-	-
已发行份额	177,885,187.8840	1,157,433.6760	17,697,694.4810	313,544.5780	1,001,309.5710	55,809,007.2020	17,392,420.7270	-	16,545,244.3070	622,406.6390
已赎回份额	(39,462,622.8920)	(438,796.2620)	(15,740,755.5510)	(146,104.6470)	(836,888.6380)	-	(5,171,492.6930)	-	(1,017,293.9970)	-
于2017年6月30日及 2017年7月1日尚未行使的份额	172,188,732.3830	3,300,741.6500	35,453,199.3390	400,185.0900	786,087.7560	58,262,392.8740	12,220,928.0340	-	15,527,950.3100	622,406.6390
已发行份额	108,488,176.5610	824,421.1440	40,091,431.2440	218,298.1330	188,064.7440	31,722,428.2410	1,649,990.1350	6,539,421.7850	10,520,062.2450	3,687,480.3330
已赎回份额	(164,038,447.0920)	(573,397.4450)	(25,175,309.0670)	(290,865.8330)	(401,297.6820)	(50,644,059.3430)	(13,870,918.1690)	(6,539,421.7850)	(26,048,012.5550)	(4,075,192.5520)
于2018年6月30日尚未行使的份额	116,638,461.8520	3,551,765.3490	50,369,321.5160	327,617.3900	572,854.8180	39,340,761.7720	-	-	-	234,694.4200

2018年6月30日

归属于份额持有人的资产净值

人民币	1,186,745,178元	33,659,558美元	482,816,706港元	3,277,958澳元	5,416,959美元	人民币	-	-	-	2,378,040美元
人民币10.17元	人民币10.17元	9.48美元	9.59港元	10.01澳元	9.46美元	人民币11.97元	-	-	-	10.13美元

每份额资产净值

2017年6月30日

归属于份额持有人的资产净值

人民币	1,812,804,061元	31,703,215美元	342,516,285港元	4,248,811澳元	7,746,625美元	人民币	119,905,128港元	-	150,000,000港元	5,944,770美元
人民币10.53元	人民币10.53元	9.60美元	9.66港元	10.62澳元	9.85美元	人民币11.65元	9.81港元	-	9.66港元	9.55美元

每份额资产净值

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018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)

中银香港全天候香港股票基金(前称中银香港全天候中港股票基金)

	A1类	A2类	A3类	A7类	X1类
于2016年7月1日尚未行使的份额	19,808,023.0890	1,767,280.8270	359,432.9710	1,034,187.4880	14,996,007.9840
已发行份额	2,850,900.0920	65,753.9940	4,155.8250	218,527.7380	2,579,132.4730
已赎回份额	(4,690,086.4470)	(544,737.8070)	(294,580.9370)	(298,109.4330)	(2,262,443.4380)
于2017年6月30日及 2017年7月1日尚未行使的份额	17,968,836.7340	1,288,297.0140	69,007.8590	954,605.7930	15,312,697.0190
已发行份额	10,611,676.3700	17,033.5780	145,168.9520	374,666.6070	-
已赎回份额	(15,628,730.2610)	(688,615.5240)	(179,598.8610)	(1,151,535.2950)	(5,350,244.8180)
于2018年6月30日尚未行使的份额	12,951,782.8430	616,715.0680	34,577.9500	177,737.1050	9,962,452.2010
2018年6月30日					
归属于份额持有人的资产净值	153,819,354港元	7,240,775美元	440,156澳元	人民币2,315,231元	106,595,832港元
每份额资产净值	11.88港元	11.74美元	12.73澳元	人民币13.03元	10.70港元
2017年6月30日					
归属于份额持有人的资产净值	183,684,243港元	13,085,042美元	762,499澳元	人民币10,858,637元	139,273,723港元
每份额资产净值	10.22港元	10.16美元	11.05澳元	人民币11.37元	9.10港元

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018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）

中银香港全天候在岸人民币股票基金

	A1类	A2类	A3类	A9类
于2016年6月5日尚未行使的份额	13,417,061.1690	4,386,168.8440	47,367,950.5600	-
已发行份额	3,546,184.2610	935,928.2920	17,270,740.7750	-
已赎回份额	(5,256,967.7060)	(1,908,463.8780)	(15,550,117.2700)	-
于2017年6月30日及2017年7月1日				
尚未行使的份额	11,706,277.7240	3,413,633.2580	49,088,574.0650	-
已发行份额	506,246.6510	113,385.2210	7,946,028.8770	450,518.5180
已赎回份额	(5,075,949.9240)	(1,496,748.1070)	(31,300,517.9500)	(32,633.7690)
于2018年6月30日尚未行使的份额	7,136,574.4510	2,030,270.3720	25,734,084.9920	417,884.7490
2018年6月30日				
归属于份额持有人的资产净值	人民币51,502,492元	13,716,234美元	175,985,582港元	2,793,570港元
每份额资产净值	人民币7.22元	6.76美元	6.84港元	6.69港元
2017年6月30日				
归属于份额持有人的资产净值	人民币93,503,910元	24,979,434美元	361,779,042港元	-
每份额资产净值	人民币7.99元	7.32美元	7.37港元	-

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018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)

中银香港全天候亚洲债券基金

	A1类	A2类	A7类	I2类	X1类	X2类
于2016年8月30日 (开始营运日期) 尚未行使的份额	-	-	-	-	-	-
已发行份额	3,146,648.7320	17,248,969.7930	5,439,413.5090	3,984,931.3550	151,362.2600	7,244,174.2650
已赎回份额	(1,135,394.8140)	(7,002,895.8580)	(2,009,132.7290)	-	-	(7,244,174.2650)
于2017年6月30日及 2017年7月1日 尚未行使的份额	2,011,253.9180	10,246,073.9350	3,430,280.7800	3,984,931.3550	151,362.2600	-
已发行份额	1,702,858.5680	9,103,935.3260	1,288,871.3590	-	1,478,821.1780	1,182,806.3240
已赎回份额	(2,350,814.2270)	(8,549,823.2430)	(1,855,577.7700)	(3,984,931.3550)	(151,362.2600)	(1,182,806.3240)
于2018年6月30日 尚未行使的份额	<u>1,363,298.2590</u>	<u>10,800,186.0180</u>	<u>2,863,574.3690</u>	<u>-</u>	<u>1,478,821.1780</u>	<u>-</u>
2018年6月30日 归属于份额持有人的 资产净值	12,962,307美元	103,885,606港元	人民币28,218,342元	-	14,445,364美元	-
每份额资产净值	9.51美元	9.62港元	人民币9.85元	-	9.77美元	-
2017年6月30日 归属于份额持有人的 资产净值	19,905,218美元	102,041,561港元	人民币34,822,265元	39,812,934港元	1,498,711美元	-
每份额资产净值	9.90美元	9.96港元	人民币10.15元	9.99港元	9.90美元	-

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018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)

中银香港全天候亚洲(日本除外)股票基金

	A1类	A2类	A7类	X2类
于2017年4月24日(开始营运日期) 尚未行使的份额	-	-	-	-
已发行份额	871,221.3170	8,282,547.0070	1,251,707.8380	2,521,839.2070
已赎回份额	(821,100.3850)	(7,003,714.4870)	(979,872.7020)	-
	<u>50,120.9320</u>	<u>1,278,832.5200</u>	<u>271,835.1360</u>	<u>2,521,839.2070</u>
于2018年6月30日尚未行使的份额				
2018年6月30日 归属于份额持有人的资产净值	560,934美元	14,434,886港元	人民币3,090,269元	28,979,386港元
每份额资产净值	11.19美元	11.29港元	人民币11.37元	11.49港元

中银香港全天候中国收益基金

	A1类	A2类	A8类
于2017年9月8日(开始营运日期)尚未行使的份额	-	-	-
已发行份额	29,738,167.5840	1,583,831.3220	8,082,201.0850
已赎回份额	(14,741,939.0940)	(727,193.8210)	(3,653,798.5680)
	<u>14,996,228.4900</u>	<u>856,637.5010</u>	<u>4,428,402.5170</u>
于2018年6月30日尚未行使的份额			
2018年6月30日 归属于份额持有人的资产净值	142,342,208港元	8,096,114美元	人民币42,620,979元
每份额资产净值	9.49港元	9.45美元	人民币9.62元

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018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）

中银香港全天候亚太高收益基金

	A1类	A2类	A4类	A8类
于2018年3月23日（开始营运日期） 尚未行使的份额	-	-	-	-
已发行份额	849,404,9410	14,666,232,2510	123,124,4450	2,936,677,6180
已赎回份额	(150,372,3160)	(854,272,8930)	(20,361,1850)	(309,057,6970)
	<u>699,032,6250</u>	<u>13,811,959,3580</u>	<u>102,763,2600</u>	<u>2,627,619,9210</u>
于2018年6月30日尚未行使的份额				
2018年6月30日 归属于份额持有人的资产净值	6,636,618美元	131,142,523港元	967,749澳元	人民币24,999,600元
每份额资产净值	9.49美元	9.49港元	9.42澳元	人民币9.51元

11 非金钱收益安排／佣金分成安排

在截至2018年及2017年6月30日止的年度内，基金管理人与经纪人签订了非金钱收益安排／佣金分成安排，据此，已收取用于支持作出投资决定的若干商品及服务。基金管理人已代表子基金与经纪人进行了约定金额的业务交易，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。

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软硬件及软件、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

2018年6月30日

12 与基金管理人及其关联人进行的交易

基金管理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及下文中予以披露的除外。

(a) 与基金管理人的关联人及受托人之间的银行存款往来

截至报告期末，存放于中国银行（香港）有限公司、保管人、基金管理人的关联人及受托人的银行存款如下：

	2018年	2017年
中银香港全天候环球投资基金	694,686美元	111,265美元
中银香港全天候中国高息债券基金	人民币151,784,490元	人民币93,351,462元
中银香港全天候香港股票基金（前称中银香港全天候中港股票基金）	5,903,226港元	19,305,420港元
中银香港全天候在岸人民币股票基金	人民币8,008,964元	人民币9,673,720元
中银香港全天候亚洲债券基金	125,917美元	3,534,510美元
中银香港全天候亚洲（日本除外）股票基金	224,694美元	—
中银香港全天候中国收益基金	4,810,916港元	—
中银香港全天候亚太高收益基金	2,830,039美元	—

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018年6月30日

12 与基金管理人及其关联人进行的交易（续）

(b) 在子基金中的持有量

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

基金管理人的董事持有的份额：	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
2018年6月30日				
中银香港全天候环球投资基金				
- A2类	-	50,738.5580	-	50,738.5580
中银香港全天候中国高息债券基金				
- A1类	1,462.3930	54.0700	-	1,516.4630
- A3类	-	47,617.1710	-	47,617.1710
- A8类	12,087.3670	-	-	12,087.3670
中银香港全天候香港股票基金 (前称中银香港全天候中港股票基金)				
- A1类	-	20,905.8240	(20,905.8240)	-
中银香港全天候中国收益基金				
- A2类	-	4,052.6210	(4,052.6210)	-
2017年6月30日				
中银香港全天候环球投资基金				
- A2类	-	108,274.4640	(108,274.4640)	-
中银香港全天候中国高息债券基金				
- A1类	-	1,462.3930	-	1,462.3930 ¹
- A8类	14,302.9060	32,109.5910	(34,325.1300)	12,087.3670 ¹
中银香港全天候在岸人民币股票基金				
- A3类	19,801.9800	-	-	19,801.9800 ²
中银香港全天候亚洲债券基金				
- A2类	-	30,048.8290	(30,048.8290)	-

1 这些份额由一名在截至2017年6月30日止年度委任的董事持有。

2 这些份额由一名在截至2017年6月30日止年度辞任的董事持有。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018年6月30日

12 与基金管理人及其关联人进行的交易（续）

(c) 投资由基金管理人的关连人发行的证券

于2018年6月30日，子基金并未投资由基金管理人的关联人发行的证券（2017年：无）。

(d) 与基金管理人的关连人进行的投资交易

基金管理人的关联人宝生证券及期货有限公司就子基金的证券买卖提供经纪人服务。于截至2018年6月30日及2017年6月30日止年度，交易细节如下：

中银香港全天候环球投资基金

	买卖 证券的总值 美元	支付的 佣金总额 美元	占年内子基金 交易总额的 百分比 %	平均佣金率 %
2018年6月30日				
宝生证券及期货有限公司	1,428,578	492	2.37	0.03
2017年6月30日				
宝生证券及期货有限公司	317,411	127	1.81	0.04

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018年6月30日

12 与基金管理人及其关联人进行的交易（续）

(d) 与基金管理人的关连人进行的投资交易（续）

中银香港全天候香港股票基金（前称中银香港全天候中港股票基金）

	买卖 证券的总值 港元	支付的 佣金总额 港元	占年内子基金 交易总额的 百分比 %	平均佣金率 %
2018年6月30日				
宝生证券及期货有限公司	680,726,573	988,505	16.90	0.15
2017年6月30日				
宝生证券及期货有限公司	229,251,745	91,700	18.27	0.04

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018年6月30日

12 与基金管理人及其关联人进行的交易（续）

(e) 基金管理人的关连人赚取的費用

在截至2018年及2017年6月30日止的年度内，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：

	2018年	2017年
中银香港全天候环球投资基金	6,243美元	30,234美元
中银香港全天候中国高息债券基金	人民币10,513,679元	人民币19,145,096元
中银香港全天候香港股票基金 (前称中银香港全天候中港股票基金)	1,741,345港元	589,514港元
中银香港全天候在岸人民币股票基金	人民币605,997元	人民币2,681,099元
中银香港全天候亚洲债券基金	279,880美元	692,382美元
中银香港全天候亚洲(日本除外)股票基金	292,309美元	—
中银香港全天候中国收益基金	6,895,366港元	—
中银香港全天候亚太高收益基金	811,256美元	—

(f) 投资由基金管理人管理的其他集体投资基金

在报告期末，以下子基金已投资由基金管理人管理的其他集体投资基金，详情如下：

	份额	公允价值
2018年6月30日		
中银香港全天候中国高息债券基金		
BOC (Europe) UCITS SICAV		
– BOCHK High Yield Bond Fund	10,774	人民币7,034,974元
2017年6月30日		
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	10,774	人民币7,625,573元
BOC (Europe) UCITS SICAV		
– RQFII Fixed Income Fund	130,000	人民币12,463,230元

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2018年6月30日

13 向份额持有人作出的分配

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及中银香港全天候亚太高收益基金外，基金管理人拟就任何子基金作出收益分配，而子基金赚取的任何收入将再投资于该子基金，并反映于该子基金相关类别的份额价值。

中银香港全天候中国高息债券基金

	2018年 人民币	2017年 人民币
<i>末期收益分配</i>		
<u>A1类</u>		
— 于2018年7月9日就116,666,363.8760个份额支付人民币0.13元 (2017年：于2017年7月7日就172,374,455.6160个份额支付人民币0.13元)	15,166,627	22,408,679
<u>A2类</u>		
— 于2018年7月9日就3,551,765.3490个份额支付0.13美元 (2017年：于2017年7月7日就3,300,741.6500个份额支付0.12美元)	3,063,898	2,685,761
<u>A3类</u>		
— 于2018年7月9日就50,262,772.2560个份额支付0.13港元 (2017年：于2017年7月7日就35,489,347.3730个份额支付0.12港元)	5,525,798	3,698,780
<u>A4类</u>		
— 于2018年7月9日就327,617.3900个份额支付0.13澳元 (2017年：于2017年7月7日就398,103.3490个份额支付0.14澳元)	209,277	290,582
<u>A8类</u>		
— 于2018年7月9日就572,854.8180个份额支付0.07美元 (2017年：于2017年7月7日就786,087.7560个份额支付0.09美元)	266,092	479,720
	24,231,692	29,563,522
<i>中期收益分配</i>		
<u>A1类</u>		
— 于2017年10月13日就184,430,555.6360个份额支付人民币0.11元 (2017年：于2016年10月14日就105,527,616.606个份额支付人民币0.10元)	20,287,361	10,552,762
— 于2018年1月8日就174,090,313.6180个份额支付人民币0.15元 (2017年：于2017年1月9日就105,546,493.4050个份额支付人民币0.15元)	26,113,547	15,831,974
— 于2018年4月11日就142,762,528.0140个份额支付人民币0.13元 (2017年：于2017年4月11日就93,901,867.8970个份额支付人民币0.15元)	18,559,129	14,085,280
<u>A2类</u>		
— 于2017年10月13日就3,807,037.5180个份额支付0.10美元 (2017年：于2016年10月14日就2,506,658.1530个份额支付0.09美元)	2,530,462	1,506,326
— 于2018年1月8日就3,605,297.6920个份额支付0.14美元 (2017年：于2017年1月9日就2,452,702.3340个份额支付0.14美元)	3,288,039	2,395,442
— 于2018年4月11日就3,563,722.7660个份额支付0.13美元 (2017年：于2017年4月11日就2,367,170.0150个份额支付0.14美元)	2,903,771	2,277,241

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018年6月30日

13 向份额持有人作出的分配 (续)

中银香港全天候中国高息债券基金 (续)

	2018年 人民币	2017年 人民币
<u>A3类</u>		
— 于2017年10月13日就41,536,285.8510个份额支付0.10港元 (于2016年10月14日就35,058,016.0160个份额支付0.09港元)	3,534,546	2,716,133
— 于2018年1月8日就44,667,442.0170个份额支付0.14港元 (2017年：于2017年1月9日就31,731,014.0090个份额支付0.14港元)	5,213,309	3,995,696
— 于2018年4月11日就48,369,960.6990个份额支付0.13港元 (2017年：于2017年4月11日就30,755,106.0930个份额支付0.14港元)	5,021,663	3,807,374
<u>A4类</u>		
— 于2017年10月13日就375,659.0050个份额支付0.11澳元 (于2016年10月14日就270,992.0340个份额支付0.10澳元)	215,170	138,673
— 于2018年1月8日就404,902.2740个份额支付0.15澳元 (2017年：于2017年1月9日就405,860.9800个份额支付0.16澳元)	308,962	326,531
— 于2018年4月11日就402,705.9690个份额支付0.13澳元 (2017年：于2017年4月11日就372,469.4130个份额支付0.16澳元)	251,807	312,413
<u>A8类</u>		
— 于2017年10月13日就705,468.9230个份额支付0.07美元 (于2016年10月14日就997,522.8510个份额支付0.05美元)	328,238	333,023
— 于2018年1月8日就611,219.7180个份额支付0.11美元 (2017年：于2017年1月9日就650,384.9600个份额支付0.11美元)	437,984	499,087
— 于2018年4月11日就625,006.7720个份额支付0.17美元 (2017年：于2017年4月11日就757,780.6030个份额支付0.11美元)	274,218	572,780
	<u>89,268,206</u>	<u>59,350,735</u>
收益分配总额	<u>113,499,898</u>	<u>88,914,257</u>
— 现金	107,726,917	83,982,970
— 用于再投资	<u>5,772,981</u>	<u>4,931,287</u>

于2018年6月30日应付给份额持有人的末期股息 (现金) 为人民币22,619,897元 (2017年：人民币28,161,600元)，不包括用作再投资的股息人民币1,611,795元 (2017年：人民币1,401,922元)。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018年6月30日

13 向份额持有人作出的分配 (续)

中银香港全天候亚洲债券基金

	2018年 美元	2017年 美元
<i>末期收益分配</i>		
<u>A1类</u>		
— 于2018年7月9日就1,363,991.3290个份额支付0.030美元 (2017年：于2017年7月7日就2,011,253.7930个份额支付0.029美元)	40,920	58,326
<u>A2类</u>		
— 于2018年7月9日就10,849,551.1820个份额支付0.030港元 (2017年：于2017年7月7日就10,252,970.3300个份额支付0.030港元)	41,481	39,398
<u>A7类</u>		
— 于2018年7月9日就2,863,574.3690个份额支付人民币0.042元 (2017年：于2017年7月7日就3,430,280.7140个份额支付人民币0.042元)	16,830	21,248
	<u>99,231</u>	<u>118,972</u>
<i>中期收益分配</i>		
<u>A1类</u>		
— 于2018年6月7日就1,412,848.3540个份额支付0.030美元 (2017年：于2017年6月7日就2,061,734.4830个份额支付0.029美元)	42,385	59,790
— 于2018年5月8日就1,738,536.7080个份额支付0.029美元 (2017年：于2017年5月9日就2,084,035.9260个份额支付0.027美元)	50,418	56,269
— 于2018年4月10日就2,080,629.8360个份额支付0.029美元 (2017年：于2017年4月10日就2,337,793.1030个份额支付0.029美元)	60,338	67,796
— 于2018年3月7日就2,192,671.3950个份额支付0.029美元 (2017年：于2017年3月7日就2,539,664.6430个份额支付0.028美元)	63,587	71,111
— 于2018年2月7日就2,202,190.6850个份额支付0.029美元 (2017年：于2017年2月7日就2,902,604.8280个份额支付0.029美元)	63,863	84,176
— 于2018年1月8日就2,943,937.4450个份额支付0.029美元 (2017年：于2017年1月9日就3,031,967.6920个份额支付0.026美元)	85,374	78,831
— 于2017年12月7日就3,023,250.7260个份额支付0.029美元 (2017年：于2016年12月7日就3,034,867.6670个份额支付0.030美元)	87,674	91,046
— 于2017年11月7日就2,912,442.9130个份额支付0.029美元	84,461	—
— 于2017年10月10日就3,114,305.4900个份额支付0.027美元	84,086	—
— 于2017年9月7日就2,630,833.6850个份额支付0.027美元	71,032	—
— 于2017年8月7日就1,899,385.7430个份额支付0.028美元	53,183	—

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2018年6月30日

13 向份额持有人作出的分配 (续)

中银香港全天候亚洲债券基金 (续)

	2018年 美元	2017年 美元
<u>A2类</u>		
— 于2018年6月7日就11,004,537.1020个份额支付0.030港元 (2017年：于2017年6月7日就10,543,900.6900个份额支付0.029港元)	42,087	39,238
— 于2018年5月8日就11,213,018.1370个份额支付0.029港元 (2017年：于2017年5月9日就11,461,011.1100个份额支付0.027港元)	41,432	39,783
— 于2018年4月10日就12,281,417.0700个份额支付0.029港元 (2017年：于2017年4月10日就12,058,168.6200个份额支付0.029港元)	45,380	45,000
— 于2018年3月7日就12,918,207.4490个份额支付0.029港元 (2017年：于2017年3月7日就12,485,608.2100个份额支付0.028港元)	47,868	45,037
— 于2018年2月7日就12,705,055.3620个份额支付0.029港元 (2017年：于2017年2月7日就1,3158,177.9300个份额支付0.029港元)	47,104	49,178
— 于2018年1月8日就11,865,497.7390个份额支付0.029港元 (2017年：于2017年1月9日就13,756,608.8500个份额支付0.026港元)	44,036	46,116
— 于2017年12月7日就10,655,171.9350个份额支付0.029港元 (2017年：于2016年12月7日就14,887,191.6700个份额支付0.030港元)	39,562	57,581
— 于2017年11月7日就9,945,780.6260个份额支付0.029港元	36,971	—
— 于2017年10月10日就9,550,188.0860个份额支付0.027港元	33,012	—
— 于2017年9月7日就9,523,543.3000个份额支付0.027港元	32,857	—
— 于2017年8月7日就9,312,574.2630个份额支付0.028港元	33,384	—
<u>A7类</u>		
— 于2018年6月7日就2,980,364.6890个份额支付人民币0.039元 (2017年：于2017年6月7日就3,548,320.4900个份额支付人民币0.041元)	18,134	21,559
— 于2018年5月8日就2,980,983.3350个份额支付人民币0.039元 (2017年：于2017年5月9日就3,549,424.7370个份额支付人民币0.038元)	18,429	19,551
— 于2018年4月10日就2,977,574.4020个份额支付人民币0.039元 (2017年：于2017年4月10日就3,606,328.8100个份额支付人民币0.042元)	18,527	22,043
— 于2018年3月7日就3,009,387.6240个份额支付人民币0.036元 (2017年：于2017年3月7日就3,441,229.2700个份额支付人民币0.041元)	17,127	20,594
— 于2018年2月7日就3,133,082.1610个份额支付人民币0.039元 (2017年：于2017年2月7日就3,636,331.4600个份额支付人民币0.041元)	19,397	21,704
— 于2018年1月8日就3,538,946.0530个份额支付人民币0.039元 (2017年：于2017年1月9日就4,273,247.2970个份额支付人民币0.037元)	21,187	22,664
— 于2017年12月7日就3,559,415.7990个份额支付人民币0.040元 (2017年：于2016年12月7日就4,231,017.0000个份额支付人民币0.040元)	21,514	24,467
— 于2017年11月7日就3,654,963.6680个份额支付人民币0.040元	22,048	—
— 于2017年10月10日就3,402,869.9140个份额支付人民币0.036元	18,430	—
— 于2017年9月7日就3,379,226.4740个份额支付人民币0.034元	17,414	—
— 于2017年8月7日就3,275,573.6590个份额支付人民币0.036元	17,522	—
	<u>1,399,823</u>	<u>983,534</u>
收益分配总额	<u>1,499,054</u>	<u>1,102,506</u>
— 现金	1,445,836	1,057,431
— 用于再投资	<u>53,218</u>	<u>45,075</u>

于2018年6月30日应付给份额持有人的末期股息 (现金) 为95,756美元 (2017年：114,477美元)，不包括用作再投资的股息3,475美元 (2017年：4,495美元)。

中银香港盈荟系列

财务报表附注
2018年6月30日

13 向份额持有人作出的分配 (续)

中银香港全天候中国收益基金

	2018年 港元
<i>末期收益分配</i>	
<u>A1类</u>	
— 于2018年7月9日就15,006,533.1570个份额支付0.031港元	465,203
<u>A2类</u>	
— 于2018年7月9日就856,637.5010个份额支付0.031美元	208,372
<u>A8类</u>	
— 于2018年7月9日就4,425,647.5840个份额支付人民币0.039元	204,097
	877,672
<i>中期收益分配</i>	
<u>A1类</u>	
— 于2018年6月7日就15,777,846.1850个份额支付0.031港元	489,113
— 于2018年5月8日就15,865,135.9170个份额支付0.031港元	491,819
— 于2018年4月10日就15,850,028.8300个份额支付0.032港元	507,201
— 于2018年3月7日就15,558,263.4030个份额支付0.032港元	497,865
— 于2018年2月7日就17,346,250.4550个份额支付0.033港元	572,426
— 于2018年1月8日就21,179,939.3240个份额支付0.030港元	635,398
<u>A2类</u>	
— 于2018年6月7日就903,492.2260个份额支付0.031美元	219,702
— 于2018年5月8日就910,214.1500个份额支付0.031美元	221,458
— 于2018年4月10日就934,934.0090个份额支付0.032美元	234,811
— 于2018年3月7日就659,037.9500个份额支付0.032美元	165,050
— 于2018年2月7日就742,952.5090个份额支付0.033美元	191,773
— 于2018年1月8日就973,256.0420个份额支付0.030美元	228,151
<u>A8类</u>	
— 于2018年6月7日就4,193,504.9630个份额支付人民币0.039元	200,143
— 于2018年5月8日就4,251,959.0410个份额支付人民币0.039元	206,310
— 于2018年4月10日就4,184,459.8800个份额支付人民币0.040元	209,590
— 于2018年3月7日就3,059,450.7520个份额支付人民币0.040元	151,409
— 于2018年2月7日就2,946,343.1360个份额支付人民币0.040元	146,333
— 于2018年1月8日就3,467,740.8190个份额支付人民币0.038元	158,065
	5,526,617
收益分配总额	6,404,289
— 现金	5,645,673
— 用于再投资	758,616

于2018年6月30日应付给份额持有人的末期股息 (现金) 为765,506港元, 不包括用作再投资的股息112,166港元。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018年6月30日

13 向份额持有人作出的分配(续)

中银香港全天候亚太高收益基金

	2018年 美元
<i>末期分益分配</i>	
<u>A1类</u>	
— 于2018年7月9日就699,032.6250个份额支付0.037美元	25,864
<u>A2类</u>	
— 于2018年7月9日就13,810,929.5350个份额支付0.037港元	65,124
<u>A4类</u>	
— 于2018年7月9日就102,763.2600个份额支付0.037澳元	2,816
<u>A8类</u>	
— 于2018年7月9日就2,627,619.921个份额支付人民币0.042元	16,631
	<hr/>
	110,435
	<hr/>
收益分配总额	110,435
	<hr/>
— 现金	102,816
— 用作再投资	7,619
	<hr/>

于2018年6月30日应付给份额持有人的末期股息(现金)为102,816美元, 不包括用作再投资的股息7,619美元。

14 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2018年6月30日止年度, 中银香港全天候中国高息债券基金承诺向由基金经理管理的投资基金出售金额为20,000,000美元的债券(2017年: 无)。

基金经理认为, 上述于截至2018年6月30日止年度出售债券符合中银香港全天候中国高息债券基金的最佳利益, 而有关出售是以债券于交易日期的公允价值按公平条款执行。有关出售旨在提升中银香港全天候中国高息债券基金的流动性。

15 报告期后事项

- (a) 在截至2018年6月30日止年度后, 基金的子基金中银香港全天候短期债券基金于2018年8月16日获证监会授权发行, 且已自2018年9月13日起开始发行。
- (b) 在截至2018年6月30日止年度后, 基金的子基金中银香港全天候一带一路债券基金于2018年5月25日获证监会授权发行, 且预期将于2018年12月27日开始发行。

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018年6月30日

15 报告期后事项(续)

- (c) 在截至2018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及中银香港全天候亚太高收益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2018年10月12日按每个份额人民币0.13元支付人民币13,370,287元

A2类

— 于2018年10月12日按每个份额0.12美元支付375,460美元

A3类

— 于2018年10月12日按每个份额0.12港元支付5,685,049港元

A4类

— 于2018年10月12日按每个份额0.13澳元支付42,943澳元

A8类

— 于2018年10月12日按每个份额0.11美元支付59,508美元

中银香港全天候亚洲债券基金

A1类

— 于2018年8月7日按每个份额0.028美元支付36,615美元

— 于2018年9月7日按每个份额0.029美元支付36,869美元

— 于2018年10月8日按每个份额0.028美元支付35,517美元

A2类

— 于2018年8月7日按每个份额0.028港元支付287,306港元

— 于2018年9月7日按每个份额0.029港元支付288,374港元

— 于2018年10月8日按每个份额0.028港元支付273,212港元

A7类

— 于2018年8月7日按每个份额人民币0.037元支付人民币104,069元

— 于2018年9月7日按每个份额人民币0.031元支付人民币85,999元

— 于2018年10月8日按每个份额人民币0.028元支付人民币77,547元

中银香港全天候中国收益基金

A1类

— 于2018年8月7日按每个份额0.030港元支付420,062港元

— 于2018年9月7日按每个份额0.029港元支付414,352港元

— 于2018年10月8日按每个份额0.029港元支付410,597港元

A2类

— 于2018年8月7日按每个份额0.030美元支付25,533美元

— 于2018年9月7日按每个份额0.029美元支付24,210美元

— 于2018年10月8日按每个份额0.029美元支付24,167美元

A7类

— 于2018年8月7日按每个份额人民币0.039元支付人民币175,282元

— 于2018年9月7日按每个份额人民币0.034元支付人民币152,621元

— 于2018年10月8日按每个份额人民币0.032元支付人民币142,614元

中银香港盈荟系列

财务报表附注

2018年6月30日

15 报告期后事项（续）

中银香港全天候亚太高收益基金

A1类

- 于2018年8月7日按每个份额0.036美元支付22,904美元
- 于2018年9月7日按每个份额0.036美元支付21,251美元
- 于2018年10月8日按每个份额0.035美元支付18,743美元

A2类

- 于2018年8月7日按每个份额0.036港元支付467,292港元
- 于2018年9月7日按每个份额0.036港元支付451,272港元
- 于2018年10月8日按每个份额0.035港元支付386,916港元

A4类

- 于2018年8月7日按每个份额0.036澳元支付3,689澳元
- 于2018年9月7日按每个份额0.036澳元支付3,514澳元
- 于2018年10月8日按每个份额0.035澳元支付3,418澳元

A7类

- 于2018年8月7日按每个份额人民币0.043元支付人民币117,797元
- 于2018年9月7日按每个份额人民币0.039元支付人民币101,500元
- 于2018年10月8日按每个份额人民币0.035元支付人民币90,593元

16 批准财务报表

受托人及基金管理人于2018年10月29日批准财务报表。

中银香港盈荟系列
中银香港全天候环球投资基金

投资组合 (未经审计)
2018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			
香港			
友邦保险控股有限公司	8,000	69,941	1.07%
北京同仁堂国药有限公司	13,000	26,641	0.41%
腾讯控股有限公司	5,600	281,049	4.31%
		<u>377,631</u>	<u>5.79%</u>
西班牙			
TELEFONICA SA	183	1,556	0.02%
美国			
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	1,020	190,383	2.91%
		<u>569,570</u>	<u>8.72%</u>
集合投资计划			
美国			
DEUTSCHE X-TRACKERS HARVEST CSI 300			
CHINA A-SHARES ETF	4,043	107,261	1.64%
ISHARES CORE MSCI EAFE ETF	1,479	93,724	1.43%
ISHARES CORE S&P 500 ETF	1,695	462,820	7.08%
ISHARES MSCI GERMANY ETF	5,617	168,398	2.58%
ISHARES MSCI HONG KONG ETF	8,477	205,228	3.14%
SCHWAB INTL EQUITY ETF	12,619	417,058	6.38%
VANGUARD FTSE DEVELOPED MARKETS ETF	9,500	407,550	6.24%
VANGUARD FTSE EMERGING MARKETS ETF	6,451	272,232	4.17%
VANGUARD MID-CAP VALUE ETF	1,430	157,958	2.42%
VANGUARD SMALL-CAP ETF	1,335	207,819	3.18%
VANGUARD TOTAL STOCK MARKET ETF	3,551	498,667	7.64%
		<u>2,998,715</u>	<u>45.90%</u>
定息债务证券			
英属维尔京群岛			
VERTEX CAPITAL INVESTMENT LTD 4.15%			
S/A 22APR2019	200,000	200,600	3.07%

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)
2018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
定息债务证券 (续)			
开曼群岛			
CHINA HONGQIAO GROUP LTD 6.85% S/A 22APR2019	200,000	202,990	3.11%
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD 3.75% S/A 23JAN2023	200,000	198,090	3.03%
		<u>401,080</u>	<u>6.14%</u>
香港			
VANKE REAL ESTATE HONG KONG CO LTD 3.975% S/A 09NOV2027	200,000	185,320	2.84%
阿曼			
MAZOOON ASSETS CO SAOC 5.2% S/A 08NOV2027 REGS	200,000	191,627	2.93%
		<u>978,627</u>	<u>14.98%</u>
浮息债务证券			
澳大利亚			
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 3M L+0.89% Q 10JAN2022 REGS	250,000	254,375	3.90%
英属维尔京群岛			
CICC HONG KONG FINANCE 2016 MTN LTD 3M L+1.2% Q 25APR2021	200,000	202,153	3.10%
HUARONG FINANCE 2017 CO LTD 3M L+1.65% Q 27APR2020	200,000	203,438	3.11%
		<u>405,591</u>	<u>6.21%</u>
法国			
BPCE SA 3M L+1.22% Q 22MAY2022 REGS	250,000	254,386	3.89%
香港			
VANKE REAL ESTATE HONG KONG CO LTD 3M L+1.55% Q 25MAY2023	200,000	200,316	3.07%
新加坡			
BOC AVIATION LTD 3M L+1.05% Q 02MAY2021	200,000	202,704	3.10%
		<u>1,317,372</u>	<u>20.17%</u>

中银香港盈荟系列
中银香港全天候环球投资基金

投资组合（未经审计）（续）
2018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18,519澳元及卖出13,669美元		46	0.00%
		<u>46</u>	<u>0.00%</u>
上市／挂牌投资总额		5,864,330	89.77%
其他资产净值		<u>668,443</u>	<u>10.23%</u>
于2018年6月30日的资产净值 （按成交价）		<u>6,532,773</u>	<u>100%</u>
投资总额，按成本计		<u>6,030,936</u>	

附注：于交易日对投资进行会计处理。

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）
2018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
定息债务证券			
澳大利亚			
BARMINCO FINANCE PTY LTD 6.625% S/A 15MAY2022 REGS	2,000,000	12,789,718	0.54%
SHANDONG ENERGY AUSTRALIA PTY LTD 4.55% S/A 26JUL2020	3,960,000	25,317,204	1.07%
VIRGIN AUSTRALIA HLDGS LTD 7.875% S/A 15OCT2021 REGS	1,250,000	8,437,334	0.36%
VIRGIN AUSTRALIA HLDGS LTD 8.5% S/A 15NOV2019 REGS	3,956,000	26,918,942	1.14%
		<u>73,463,198</u>	<u>3.11%</u>
巴林			
AHLI UNITED BANK BSC 6.875% S/A PERP	925,000	6,266,984	0.27%
百慕大			
CHINA OIL AND GAS GROUP LTD 5% S/A 07MAY2020	500,000	3,315,092	0.14%
GOME ELECTRICAL APPLIANCES HLDG LTD 5% S/A 10MAR2020	1,590,000	10,245,283	0.43%
		<u>13,560,375</u>	<u>0.57%</u>
英属维尔京群岛			
BAOXIN AUTO FINANCE I LTD 6.625% S/A 02APR2019	4,400,000	29,372,684	1.25%
BAOXIN AUTO FINANCE I LTD 8.75% S/A PERP	5,750,000	37,768,720	1.60%
BL CAPITAL HLDGS LTD 4.5% S/A 17AUG2018	2,600,000	17,370,139	0.74%
BLUE SKY FLIERS CO LTD 6.9% S/A 20JAN2019	5,500,000	37,031,326	1.57%
BLUE SKYVIEW CO LTD 7.125% S/A PERP	1,200,000	7,436,632	0.32%
EXCEL CAPITAL GLOBAL LTD 7% S/A PERP	400,000	2,665,894	0.11%
FORTUNE STAR BVI LTD 5.375% S/A 05DEC2020	3,500,000	23,122,341	0.98%
FRANSHION BRILLIANT LTD 5.2% S/A 08MAR2021	10,000,000	10,116,236	0.43%
HONG SENG LTD 8.5% S/A 20NOV2018	4,750,000	31,273,109	1.33%
JIANGSU NANTONG SANJIAN INTL CO LTD 7.8% S/A 26OCT2020	2,220,000	13,331,245	0.57%
KUNZHI LTD 3M L+4% Q 21MAY2021	3,750,000	25,057,081	1.06%
NEW METRO GLOBAL LTD 6.5% S/A 23APR2021	1,000,000	6,535,881	0.28%
SHNDONG IRON AND STEEL XINHENG INTL CO LTD 6.5% S/A 14JUN2021	750,000	4,639,198	0.20%
SHNDONG IRON AND STEEL XINHENG INTL CO LTD 6.9% S/A 29MAR2020	5,900,000	39,033,309	1.66%

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)
2018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
定息债务证券 (续)			
英属维尔京群岛 (续)			
STUDIO CITY FINANCE LTD 8.5%			
S/A 01DEC2020 REGS	5,250,000	35,345,471	1.50%
TOP WISE EXCELLENCE ENTERPRISE CO LTD			
6% S/A 16MAR2020	600,000	3,510,936	0.15%
TRILLION CHANCE LTD 5.25% S/A 11OCT2018	4,500,000	30,056,387	1.28%
TSINGHUA UNIC LTD 4.75% S/A 31JAN2021	5,500,000	35,493,197	1.51%
WISDOM GLORY GROUP LTD 5.25% S/A PERP	6,500,000	42,187,242	1.79%
YINGDE GASES INVESTMENT LTD 7.25%			
S/A 28FEB2020 REGS	3,000,000	20,462,923	0.87%
		<u>451,809,951</u>	<u>19.20%</u>
开曼群岛			
21VIANET GROUP INC 7% S/A 17AUG2020	5,750,000	38,365,723	1.63%
361 DEGREES INTL LTD 7.25% S/A 03JUN2021	1,600,000	10,110,247	0.43%
AGILE GROUP HLDGS LTD 10.233% S/A PERP	3,000,000	20,583,228	0.87%
AGILE GROUP HLDGS LTD 9% S/A 21MAY2020	500,000	3,475,846	0.15%
BIOSTIME INTL HLDGS LTD 7.25%			
S/A 21JUN2021 REGS	4,000,000	26,678,802	1.13%
CAR INC 6.125% S/A 04FEB2020 REGS	1,750,000	11,617,125	0.49%
CAR INC 6.5% S/A 04APR2021	23,000,000	22,859,268	0.97%
CENTRAL CHINA REAL ESTATE LTD 6.875%			
S/A 23OCT2020	2,600,000	17,077,464	0.72%
CENTRAL CHINA REAL ESTATE LTD 8%			
S/A 28JAN2020 REGS	6,670,000	45,880,482	1.94%
CHINA AOYUAN PROPERTY GROUP LTD			
6.35% S/A 11JAN2020	5,500,000	37,040,004	1.57%
CHINA AOYUAN PROPERTY GROUP LTD			
6.525% S/A 25APR2019	2,000,000	13,465,196	0.57%
CHINA AOYUAN PROPERTY GROUP LTD			
7.5% S/A 10MAY2021	1,000,000	6,495,654	0.28%
CHINA HONGQIAO GROUP LTD 6.85%			
S/A 22APR2019	3,970,000	26,737,531	1.13%
CHINA JINJIANG ENVIRONMENT HLDG CO			
LTD 6% S/A 27JUL2020	1,200,000	7,474,293	0.32%
CHINA SCE PROPERTY HLDGS LTD 10%			
S/A 02JUL2020	5,500,000	40,027,088	1.70%
CIFI HLDGS GROUP CO LTD 6.375%			
S/A 02MAY2020	1,250,000	8,329,279	0.35%

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)
2018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
定息债务证券 (续)			
开曼群岛 (续)			
CIFI HLDGS GROUP CO LTD 7.75% S/A 05JUN2020	3,800,000	25,731,502	1.09%
FANTASIA HLDGS GROUP CO LTD 7.25% S/A 13FEB2019	3,720,000	24,718,135	1.05%
FUTURE LAND DEVELOPMENT HLDGS LTD 2.25% S/A 10FEB2019	19,000,000	15,903,475	0.67%
FUTURE LAND DEVELOPMENT HLDGS LTD 5% S/A 16FEB2020	6,950,000	45,749,170	1.93%
FWD LTD 6.25% S/A PERP	3,150,000	21,021,744	0.89%
GARUDA INDONESIA GLOBAL SUKUK LTD 5.95% S/A 03JUN2020	1,500,000	9,743,707	0.41%
GOLDEN WHEEL TIANDI HLDGS CO LTD 8.25% S/A 03NOV2019	6,800,000	45,780,274	1.93%
HILONG HLDG LTD 7.25% S/A 22JUN2020	2,750,000	17,640,739	0.75%
JINGRUI HLDGS LTD 9.45% S/A 23APR2021	1,300,000	8,500,778	0.36%
KWG PROPERTY HLDGS LTD 8.975% S/A 14JAN2019 REGS	6,250,000	43,826,477	1.86%
LOGAN PROPERTY HLDGS CO LTD 5.125% S/A 02NOV2018	1,000,000	6,673,702	0.28%
LOGAN PROPERTY HLDGS CO LTD 5.375% S/A 03DEC2018	2,000,000	13,302,604	0.56%
LOGAN PROPERTY HLDGS CO LTD 6.875% S/A 24APR2021	1,000,000	6,555,243	0.28%
MAOYE INTL HLDGS LTD 7% S/A 23OCT2018	3,800,000	24,598,577	1.04%
MODERN LAND CHINA CO LTD 6.5% S/A 03JUL2018	3,000,000	20,432,006	0.87%
MODERN LAND CHINA CO LTD 6.875% S/A 20OCT2019	1,750,000	11,287,208	0.48%
MOON WISE GLOBAL LTD 9% S/A PERP	5,000,000	34,862,972	1.48%
NAGACORP LTD 9.375% S/A 21MAY2021 REGS	1,125,000	7,701,783	0.33%
POWERLONG REAL ESTATE HLDGS LTD 5.95% S/A 19JUL2020	5,200,000	33,843,304	1.44%
POWERLONG REAL ESTATE HLDGS LTD 7.625% S/A 26NOV2018	4,500,000	30,122,026	1.28%
POWERLONG REAL ESTATE HLDGS LTD CB 0% A 11FEB2019	15,000,000	12,449,231	0.53%
REDCO GROUP 6.375% S/A 27FEB2019	500,000	3,258,067	0.14%
REDCO PROPERTIES GROUP LTD 7% S/A 14NOV2018	6,500,000	43,194,182	1.83%
RONSHINE CHINA HLDGS LTD 6.95% S/A 08DEC2019	5,450,000	35,377,272	1.50%

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)

2018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
定息债务证券 (续)			
开曼群岛 (续)			
SHIMAO PROPERTY HLDGS LTD 5.75%			
S/A 15MAR2021	21,000,000	21,187,332	0.90%
SHIMAO PROPERTY HLDGS LTD 5.75%			
S/A 15MAR2021	18,000,000	18,152,640	0.77%
SHUI ON DEVELOPMENT HLDG LTD 6.875%			
S/A 02MAR2021	35,000,000	35,456,438	1.50%
SUNAC CHINA HLDGS LTD 6.875%			
S/A 08AUG2020	2,750,000	18,303,997	0.78%
SUNAC CHINA HLDGS LTD 8.75%			
S/A 05DEC2019	5,885,000	40,102,719	1.70%
TIMES CHINA HLDGS LTD 6.25% S/A 17JAN2021	1,000,000	6,496,630	0.28%
TIMES CHINA HLDGS LTD 6.25% S/A 23JAN2020	6,800,000	45,836,627	1.94%
TIMES CHINA HLDGS LTD 7.85% S/A 04JUN2021	3,000,000	19,565,046	0.83%
XINYUAN REAL ESTATE CO LTD 8.125%			
S/A 30AUG2019	311,000	2,012,400	0.09%
YANKUANG GROUP CAYMAN LTD 4.75%			
S/A 30NOV2020	5,450,000	34,927,024	1.48%
YUZHOU PROPERTIES CO LTD 6.375%			
S/A 06MAR2021	–	(1,175)	0.00%
YUZHOU PROPERTIES CO LTD 7.9%			
S/A 11MAY2021	1,000,000	6,777,461	0.29%
		<u>1,127,308,547</u>	<u>47.79%</u>
中国内地			
GANGTAI GROUP CO LTD 9.75% S/A 23SEP2019	1,000,000	6,615,104	0.28%
JAIN INTL TRADING BV 7.125% S/A 01FEB2022	1,000,000	6,493,679	0.28%
SDOE INTL FINANCE I CO LTD 5.45%			
S/A 24OCT2020	3,760,000	24,361,982	1.03%
URUMQI GAOXIN INVESTMENT AND DEVELOPMENT GROUP CO LTD 5.2%			
S/A 20DEC2020	1,240,000	7,866,215	0.33%
XINJIANG GUANGHUI INDUSTRY INVESTMENT GROUP CO LTD 7.875% S/A 30MAR2020	3,210,000	19,320,414	0.82%
		<u>64,657,394</u>	<u>2.74%</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)
2018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
定息债务证券 (续)			
香港			
BANK OF EAST ASIA LTD 5.625% S/A PERP	3,340,000	21,444,235	0.91%
CHALIECO HONG KONG CORP LTD 5.7% S/A PERP REGS	250,000	1,692,656	0.07%
HAINAN AIRLINES HONG KONG CO LTD 6.35% S/A 31OCT2018	4,914,000	32,671,850	1.39%
YANCOAL INTL RESOURCES DEVELOPMENT CO LTD 5.75% S/A PERP	5,750,000	38,087,677	1.62%
YANGO JUSTICE INTL LTD 9.5% S/A 23SEP2019	1,700,000	11,247,650	0.48%
YANLORD LAND HK CO LTD 5.875% S/A 23JAN2022	1,000,000	6,746,216	0.29%
ZOOMLION HK SPV CO LTD 6.125% S/A 20DEC2022 REGS	750,000	4,698,979	0.20%
		<u>116,589,263</u>	<u>4.96%</u>
Jersey, C.I.			
WEST CHINA CEMENT LTD 6.5% S/A 11SEP2019	500,000	3,394,596	0.14%
韩国			
KOREAN AIR LINES CO LTD 6.875% S/A 12JUN2047	2,000,000	12,823,470	0.54%
毛里求斯			
AZURE POWER ENERGY LTD 5.5% S/A 03NOV2022 REGS	2,250,000	13,830,425	0.59%
HT GLOBAL IT SOLUTIONS HLDGS LTD 7% S/A 14JUL2021 REGS	1,400,000	9,607,997	0.41%
		<u>23,438,422</u>	<u>1.00%</u>
蒙古			
MONGOLIA GOVERNMENT INTL BOND 10.875% S/A 06APR2021 REGS	750,000	5,691,525	0.24%
TRADE & DEVELOPMENT BANK OF MONGOLIA LLC 9.375% S/A 19MAY2020 REGS	2,000,000	14,142,502	0.60%
		<u>19,834,027</u>	<u>0.84%</u>
荷兰			
PB INTL BV 7.625% S/A 26JAN2022	250,000	1,630,872	0.07%

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)

2018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
定息债务证券 (续)			
新加坡			
ALAM SYNERGY PTE LTD 6.95%			
S/A 27MAR2020 REGS	1,000,000	6,157,314	0.26%
GOLDEN LEGACY PTE LTD 8.25%			
S/A 07JUN2021 REGS	2,057,000	13,601,179	0.58%
INDIKA ENERGY CAPITAL II PTE LTD 6.875%			
S/A 10APR2022 REGS	2,250,000	14,987,191	0.64%
ITNL OFFSHORE PTE LTD 7.5% S/A 18JAN2021	13,500,000	13,720,167	0.58%
MARQUEE LAND PTE LTD 9.75%			
S/A 05AUG2019 REGS	231,862	1,638,591	0.07%
MEDCO STRAITS SERVICES PTE LTD 8.5%			
S/A 17AUG2022 REGS	1,750,000	11,972,840	0.51%
OLAM INTL LTD 5.35% S/A PERP	3,000,000	19,479,822	0.83%
STATS CHIPPAK LTD 8.5% S/A 24NOV2020 REGS	2,208,000	14,954,564	0.63%
		<u>96,511,668</u>	<u>4.10%</u>
斯里兰卡			
SRI LANKA GOVERNMENT INTL BOND 6.25%			
S/A 27JUL2021 REGS	1,000,000	6,877,811	0.29%
英国			
VEDANTA RESOURCES PLC 8.25%			
S/A 07JUN2021 REGS	2,500,000	17,260,783	0.73%
		<u>2,035,427,361</u>	<u>86.35%</u>
集合投资计划			
卢森堡			
BOC (EUROPE) UCITS SICAV – BOCHK RMB			
HIGH YIELD BOND FUND-CD USD HEDGED	10,774	7,034,974	0.30%
		<u>7,034,974</u>	<u>0.30%</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）

2018年6月30日

上市／挂牌投资（续）	持股量／ 面值	公允价值 人民币	占资产净值 的百分比
外汇远期合约			
买入人民币2,288,283,642.20元及 卖出345,829,349.87美元		(8,929,890)	-0.38%
买入36,071,115.94美元及卖出人民币239,000,000元		606,765	0.03%
买入人民币30,000,000元及卖出4,512,489.44美元		53,473	0.00%
买入4,507,675.44美元及卖出人民币30,000,000元		(57,219)	0.00%
买入2,395,000美元及卖出人民币15,866,396元		42,682	0.00%
买入3,245,247澳元及卖出人民币15,841,673.23元		123,055	0.01%
买入5,490,447.85美元及卖出人民币36,373,118.92元		97,847	0.00%
		<u>(8,063,287)</u>	<u>-0.34%</u>
上市／挂牌投资总额		2,034,399,048	86.31%
其他资产净值		<u>322,789,063</u>	<u>13.69%</u>
于2018年6月30日的资产净值（按成交价）		<u>2,357,188,111</u>	<u>100.00%</u>
投资总额，按成本计		<u>2,014,112,171</u>	

附注：于交易日对投资进行会计处理。

中银香港盈荟系列

中银香港全天候香港股票基金（前称中银香港全天候中港股票基金）

投资组合（未经审计）

2018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			
中国内地			
珠海格力电器股份有限公司－A股	99,906	5,570,165	1.73%
贵州茅台酒股份有限公司－A股	5,000	4,324,694	1.34%
美的集团股份有限公司－A股	99,913	6,169,552	1.91%
		<u>16,064,411</u>	<u>4.98%</u>
香港			
友邦保险控股有限公司	450,000	30,870,000	9.57%
中国国际航空股份有限公司－H股	800,000	6,064,000	1.88%
雅居乐雅生活服务股份有限公司－H股	400,000	5,752,000	1.78%
中国海螺创业控股有限公司	400,000	11,480,000	3.56%
中国建设银行股份有限公司－H股	4,500,000	32,625,000	10.13%
中国教育集团控股有限公司	600,000	7,920,000	2.46%
中国光大国际有限公司	1,000,000	10,140,000	3.14%
中国蒙牛乳业有限公司	300,000	7,980,000	2.47%
中国石油化工股份有限公司－H股	1,000,000	7,010,000	2.17%
华润啤酒（控股）有限公司	100,000	3,810,000	1.18%
华润水泥控股有限公司	1,000,000	7,950,000	2.46%
中信证券股份有限公司－H股	200,000	3,136,000	0.97%
石药集团有限公司	500,000	11,850,000	3.67%
新奥能源控股有限公司	200,000	15,430,000	4.78%
吉利汽车控股有限公司	350,000	7,122,500	2.21%
香港交易及结算所有限公司	20,000	4,720,000	1.46%
汇丰控股有限公司	60,000	4,416,000	1.37%
华虹半导体有限公司	200,000	5,390,000	1.67%
中国龙工控股有限公司	1,500,000	5,415,000	1.68%
中国平安保险（集团）股份有限公司－H股	50,000	3,610,000	1.12%
金沙中国有限公司	100,000	4,195,000	1.30%
上海锦江国际酒店（集团）股份有限公司－H股	3,000,000	9,540,000	2.96%
申洲国际集团控股有限公司	150,000	14,527,500	4.50%
世茂房地产控股有限公司	300,000	6,180,000	1.92%
中国生物制药有限公司	600,000	7,224,000	2.24%
高鑫零售有限公司	500,000	5,130,000	1.59%
腾讯控股有限公司	90,000	35,442,000	11.00%
潍柴动力股份有限公司－H股	1,500,000	16,230,000	5.03%
信义玻璃控股有限公司	500,000	4,795,000	1.49%
		<u>295,954,000</u>	<u>91.76%</u>
		<u>312,018,411</u>	<u>96.74%</u>

中银香港盈荟系列

中银香港全天候香港股票基金（前称中银香港全天候中港股票基金）

投资组合（未经审计）（续）

2018年6月30日

上市／挂牌投资（续）	持股量／ 面值	公允价值 港元	占资产净值 的百分比
外汇远期合约			
买入人民币2,396,094元及卖出2,848,477港元		(19,412)	0.00%
买入455,163澳元及卖出2,638,079港元		5,667	0.00%
		<u>(13,745)</u>	<u>0.00%</u>
上市／挂牌投资总额		312,004,666	96.74%
其他资产净值		<u>10,521,186</u>	<u>3.26%</u>
于2018年6月30日的资产净值 （按成交价）		<u>322,525,852</u>	<u>100.00%</u>
投资总额，按成本计		<u>315,147,449</u>	

附注：于交易日对投资进行会计处理。

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)

2018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			
安琪酵母股份有限公司 - A股	90,000	3,211,200	1.09%
安徽安科生物工程股份有限公司 - A股	200,000	3,688,000	1.26%
安阳钢铁股份有限公司 - A股	800,000	3,152,000	1.07%
中航直升机股份有限公司 - A股	80,000	3,199,200	1.09%
中国银行股份有限公司 - A股	3,720,000	13,429,200	4.56%
宝鸡钛业股份有限公司 - A股	200,000	2,900,000	0.99%
北京数字政通科技股份有限公司 - A股	200,000	2,698,000	0.92%
北京光环新网科技股份有限公司 - A股	300,000	4,023,000	1.37%
北京华宇软件股份有限公司 - A股	320,000	5,657,600	1.93%
贝达药业股份有限公司 - A股	59,985	3,339,365	1.14%
光明乳业股份有限公司 - A股	250,000	2,467,500	0.84%
长春高新技术产业(集团)有限公司 - A股	17,000	3,870,900	1.32%
中表旅控股股份有限公司 - A股	160,000	3,188,800	1.09%
中国建筑工程总公司 - A股	2,800,000	15,288,000	5.20%
大连智云自动化装备股份有限公司 - A股	180,000	3,189,600	1.09%
曙光信息产业股份有限公司 - A股	70,000	3,210,900	1.09%
东方财富信息股份有限公司 - A股	990,000	13,048,200	4.43%
烽火通信科技股份有限公司 - A股	130,000	3,230,500	1.10%
河北养元智汇饮品股份有限公司 - A股	50,000	3,103,000	1.06%
河南双汇投资发展股份有限公司 - A股	120,000	3,169,200	1.08%
宏发科技股份有限公司 - A股	119,000	3,560,480	1.21%
湖北济川药业股份有限公司 - A股	70,000	3,373,300	1.15%
内蒙古伊利实业集团股份有限公司 - A股	300,000	8,370,000	2.85%
江苏鱼跃医疗设备股份有限公司 - A股	450,000	8,770,500	2.99%
健民药业集团股份有限公司 - A股	182,655	3,833,929	1.31%
中炬高新技术实业(集团)股份有限公司 - A股	120,000	3,360,000	1.14%
乐普(北京)医疗器械股份有限公司 - A股	100,000	3,668,000	1.25%

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)

2018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)			
立讯精密工业股份有限公司 - A股	140,000	3,155,600	1.07%
南都物业服务股份有限公司 - A股	21,000	705,390	0.24%
国电南瑞科技股份有限公司 - A股	687,000	10,854,600	3.70%
宁波均胜电子股份有限公司 - A股	366,920	9,426,175	3.21%
平安银行股份有限公司 - A股	800,000	7,272,000	2.48%
上海汽车集团股份有限公司 - A股	100,000	3,499,000	1.19%
三一重工股份有限公司 - A股	420,000	3,767,400	1.28%
上海飞凯光电材料股份有限公司 - A股	350,000	6,846,000	2.33%
欧菲科技股份有限公司 - A股	179,988	2,903,206	0.99%
石家庄以岭药业股份有限公司 - A股	800,000	11,184,000	3.81%
四川沱牌舍得酒业股份有限公司 - A股	90,000	3,248,100	1.11%
三诺生物传感股份有限公司 - A股	140,000	2,895,200	0.99%
通化东宝药业股份有限公司 - A股	150,000	3,595,500	1.22%
无锡威孚高科技集团股份有限公司 - A股	377,000	8,335,470	2.84%
武汉精测电子集团股份有限公司 - A股	99,995	7,959,602	2.71%
云南白药集团股份有限公司 - A股	35,000	3,743,600	1.27%
云南驰宏锌锗股份有限公司 - A股	600,000	3,270,000	1.11%
浙江海利得新材料股份有限公司 - A股	700,000	3,493,000	1.19%
紫金矿业集团股份有限公司 - A股	1,000,000	3,610,000	1.23%
		<u>233,764,217</u>	<u>79.59%</u>
香港			
石药集团有限公司	160,000	3,206,812	1.09%
中银香港盈荟系列		<u>236,971,029</u>	<u>80.68%</u>

中银香港盈荟系列
中银香港全天候在岸人民币股票基金

投资组合（未经审计）（续）
2018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			
中国内地			
华安创业板50 ETF基金	39,000,000	22,854,000	7.78%
		<u>22,854,000</u>	<u>7.78%</u>
外汇远期合约			
买入2,650,172.00港元及卖出人民币2,237,376.11元		7,204	0.00%
		<u>7,204</u>	<u>0.00%</u>
上市／挂牌投资总额		259,832,233	88.46%
其他资产净值		<u>33,876,739</u>	<u>11.54%</u>
于2018年6月30日的资产净值 （按成交价）		<u>293,708,972</u>	<u>100.00%</u>
投资总额，按成本计		<u>288,930,142</u>	

附注：于交易日对投资进行会计处理。

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)

2018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	511,155	1.14%
NEWCASTLE COAL INFRASTRUCTURE GROUP PTY LTD 4.4% S/A 29SEP2027 REGS	300,000	281,764	0.63%
SANTOS FINANCE LTD 4.125% S/A 14SEP2027	300,000	285,525	0.64%
VIRGIN AUSTRALIA HLDGS LTD 7.875% S/A 15OCT2021 REGS	200,000	203,441	0.45%
		<u>1,281,885</u>	<u>2.86%</u>
百慕大			
KUNLUN ENERGY CO LTD 3.75% S/A 13MAY2025 REGS	200,000	197,966	0.44%
英属维尔京群岛			
AMBER TREASURE VENTURES LTD 3.15% S/A 21JUL2020	500,000	497,530	1.11%
BAOXIN AUTO FINANCE I LTD 8.75% S/A PERP	250,000	247,467	0.55%
CHARMING LIGHT INVESTMENTS LTD 4.375% S/A 21DEC2027	400,000	374,866	0.83%
CHINA CINDA FINANCE 2017 I LTD 4.4% S/A 09MAR2027	500,000	486,040	1.08%
CHINA GREAT WALL INTL HLDGS III LTD 3.875% S/A 31AUG2027	300,000	278,529	0.62%
CHINA REINSURANCE FINANCE CORP LTD 3.375% S/A 09MAR2022	500,000	483,055	1.08%
CICC HONG KONG FINANCE 2016 MTN LTD 3M L+1.2% Q 25APR2021	500,000	505,382	1.13%
CITICS SECURITIES FINANCE MTN CO LTD 3.5% S/A 30OCT2019	500,000	501,720	1.12%
EASTERN CREATION II INVESTMENT HLDGS LTD 2.75% S/A 26SEP2020	500,000	492,919	1.10%
ESTATE SKY LTD 5.75% S/A PERP	300,000	278,806	0.62%
HONG SENG LTD 8.5% S/A 20NOV2018	300,000	297,654	0.66%
HORSE GALLOP FINANCE LTD 3M L+1.18% Q 28JUN2021	600,000	602,198	1.34%
HUANENG HONG KONG CAPITAL LTD 3.6% S/A PERP	500,000	460,715	1.03%
HUARONG FINANCE 2017 CO LTD 3M L+1.15% Q 07NOV2022	400,000	400,767	0.89%

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)

2018年6月30日

上市 / 挂牌投资 (续)	持股量 / 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
债务证券 (续)			
英属维尔京群岛 (续)			
HUARONG FINANCE 2017 CO LTD 3M L+1.65% Q 27APR2020	200,000	203,438	0.45%
HUARONG FINANCE 2017 CO LTD 5.5% S/A 27APR2047	200,000	200,432	0.45%
JIC ZHIXIN LTD 3.5% S/A 24NOV2027	200,000	185,791	0.41%
LSD BONDS 2017 LTD 4.6% S/A 13SEP2022	200,000	194,296	0.43%
PROVEN HONOUR CAPITAL LTD 4.125% S/A 06MAY2026	300,000	284,533	0.63%
TSINGHUA UNIC LTD 4.75% S/A 31JAN2021	300,000	291,754	0.65%
VERTEX CAPITAL INVESTMENT LTD 4.15% S/A 22APR2019	200,000	200,600	0.45%
		<u>7,468,492</u>	<u>16.63%</u>
加拿大			
BANK OF NOVA SCOTIA 4.65% S/A PERP	180,000	164,875	0.37%
开曼群岛			
21VIANET GROUP INC 7% S/A 17AUG2020	400,000	402,206	0.90%
AGILE GROUP HLDGS LTD 9% S/A 21MAY2020	200,000	209,524	0.47%
ALIBABA GROUP HLDG LTD 4.2% S/A 06DEC2047	300,000	276,974	0.62%
AZURE NOVA INTL FINANCE LTD 3.5% S/A 21MAR2022	500,000	494,781	1.10%
CDBL FUNDING 1 3.5% S/A 24OCT2027	400,000	367,314	0.82%
CDBL FUNDING 2 3% S/A 01AUG2022	500,000	485,725	1.08%
CHINA HONGQIAO GROUP LTD 6.85% S/A 22APR2019	500,000	507,474	1.13%
CHINA SCE PROPERTY HLDGS LTD 10% S/A 02JUL2020	200,000	219,349	0.49%
EHI CAR SERVICES LTD 7.5% S/A 08DEC2018 REGS	250,000	251,815	0.56%
ENN ENERGY HLDGS LTD 3.25% S/A 24JUL2022	300,000	294,004	0.65%
FUTURE LAND DEVELOPMENT HLDGS LTD 2.25% S/A 10FEB2019	6,000,000	756,838	1.68%
FWD LTD 6.25% S/A PERP	200,000	201,141	0.45%
GOLDEN EAGLE RETAIL GROUP LTD 4.625% S/A 21MAY2023 REGS	250,000	215,197	0.48%
GOLDEN WHEEL TIANDI HLDGS CO LTD 8.25% S/A 03NOV2019	250,000	253,643	0.56%

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)
2018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)			
ICD SUKUK CO LTD 5% S/A 01FEB2027	500,000	508,812	1.13%
JINGRUI HLDGS LTD 7.75% S/A 12APR2020	250,000	245,614	0.55%
JINGRUI HLDGS LTD 9.45% S/A 23APR2021	250,000	246,455	0.55%
LOGAN PROPERTY HLDGS CO LTD 5.375% S/A 03DEC2018	300,000	300,705	0.67%
MAOYE INTL HLDGS LTD 7% S/A 23OCT2018	330,000	321,924	0.72%
MOON WISE GLOBAL LTD 9% S/A PERP	200,000	210,154	0.47%
OVERSEAS CHINESE TOWN ASIA HLDGS LTD 4.3% S/A PERP	200,000	194,157	0.43%
PHOENIX GROUP HLDGS 5.375% S/A 06JUL2027	400,000	370,187	0.82%
POWERLONG REAL ESTATE HLDGS LTD 7.625% S/A 26NOV2018	300,000	302,626	0.67%
REDCO PROPERTIES GROUP LTD 7% S/A 14NOV2018	500,000	500,732	1.11%
SHIMAO PROPERTY HLDGS LTD 4.75% S/A 03JUL2022	300,000	293,303	0.65%
SHUI ON DEVELOPMENT HLDG LTD 6.4% S/A PERP	200,000	189,551	0.42%
SUNAC CHINA HLDGS LTD 6.875% S/A 08AUG2020	200,000	200,612	0.45%
SUNAC CHINA HLDGS LTD 7.35% S/A 19JUL2021	550,000	529,342	1.18%
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD 3.75% S/A 23JAN2023	650,000	643,791	1.43%
TIMES CHINA HLDGS LTD 6.25% S/A 23JAN2020	500,000	507,910	1.13%
VLL INTL INC 5.75% S/A 28NOV2024	250,000	237,755	0.53%
WYNN MACAU LTD 5.5% S/A 01OCT2027 REGS	360,000	349,369	0.78%
YANKUANG GROUP CAYMAN LTD 4.75% S/A 30NOV2020	300,000	289,734	0.65%
		<u>11,378,718</u>	<u>25.33%</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)

2018年6月30日

上市 / 挂牌投资 (续)	持股量 / 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
债务证券 (续)			
中国内地			
BANK OF CHINA LTD 5% S/A 13NOV2024 REGS	500,000	515,113	1.15%
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP 3.875% S/A 13MAY2025	500,000	499,163	1.11%
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD/SYDNEY 3M L+0.75% Q 21MAY2021	1,300,000	1,304,718	2.90%
INDUSTRIAL BANK CO LTD/HONG KONG 2% S/A 21SEP2019	500,000	493,738	1.10%
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD 4.5% A PERP	200,000	192,804	0.43%
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD/HONG KONG 3M L+0.95% Q 13JUL2022	350,000	352,329	0.78%
SHOUGANG GROUP CO LTD 3.95% S/A 04APR2019	400,000	404,747	0.90%
TAIKANG INSURANCE GROUP INC 3.5% S/A 19JAN2022	200,000	199,798	0.44%
XINJIANG GUANGHUI INDUSTRY INVESTMENT GROUP CO LTD 7.875% S/A 30MAR2020	200,000	181,407	0.40%
		<u>4,143,817</u>	<u>9.21%</u>
法国			
BPCE SA 3M L+1.22% Q 22MAY2022 REGS	250,000	254,386	0.57%
CREDIT AGRICOLE SA 8.125% Q PERP REGS	500,000	531,553	1.18%
		<u>785,939</u>	<u>1.75%</u>
香港			
AIA GROUP LTD 4.5% S/A 16MAR2046 REGS	500,000	534,823	1.19%
BANK OF EAST ASIA LTD 5.5% S/A PERP	200,000	198,268	0.44%
CGNPC INTL LTD 3.75% S/A 11DEC2027	200,000	190,629	0.42%
CHINA CITIC BANK INTL LTD 7.25% S/A PERP	600,000	621,550	1.38%
CHINA EVERBRIGHT BANK/HONG KONG 2% S/A 15SEP2019	250,000	246,925	0.55%
CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 4.125% S/A 14MAR2021	500,000	506,620	1.13%
CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 4.625% S/A 14MAR2023	210,000	213,025	0.47%
GEMDALE EVER PROSPERITY INVESTMENT LTD 4.95% S/A 26JUL2022	40,000	38,582	0.09%
ICBCIL FINANCE CO LTD 3% S/A 05APR2020	500,000	497,113	1.11%

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)
2018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)			
ICBCIL FINANCE CO LTD 3M L+0.95% Q 15MAY2021	920,000	923,228	2.06%
MCC HLDG HONG KONG CORP LTD 2.95% S/A 31MAY2020	500,000	491,995	1.10%
VANKE REAL ESTATE HONG KONG CO LTD 3.975% S/A 09NOV2027	200,000	185,320	0.41%
VANKE REAL ESTATE HONG KONG CO LTD 3M L+1.55% Q 25MAY2023	400,000	400,631	0.89%
WING LUNG BANK LTD 3.75% S/A 22NOV2027	500,000	479,666	1.07%
YANCOAL INTL RESOURCES DEVELOPMENT CO LTD 5.75% S/A PERP	200,000	199,646	0.44%
ZOOMLION HK SPV CO LTD 6.125% S/A 20DEC2022 REGS	50,000	47,209	0.11%
		<u>5,775,230</u>	<u>12.86%</u>
印度			
ADANI PORTS & SPECIAL ECONOMIC ZONE LTD 4% S/A 30JUL2027 REGS	200,000	186,598	0.42%
NEERG ENERGY LTD 6% S/A 13FEB2022 REGS	200,000	187,828	0.42%
		<u>374,426</u>	<u>0.84%</u>
印度尼西亚			
INDONESIA GOVERNMENT INTL BOND 4.75% S/A 18JUL2047 REGS	200,000	193,771	0.43%
PELABUHAN INDONESIA II 5.375% S/A 05MAY2045 REGS	600,000	554,443	1.23%
PERTAMINA PERSERO 5.625% S/A 20MAY2043 REGS	500,000	478,633	1.07%
PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA 5.25% S/A 15MAY2047 REGS	200,000	183,422	0.41%
PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA 5.25% S/A 24OCT2042 REGS	300,000	277,908	0.62%
REPUBLIC OF INDONESIA 4.625% S/A 15APR2043 REGS	500,000	469,637	1.05%
		<u>2,157,814</u>	<u>4.81%</u>
Isle of Man			
GOHL CAPITAL LTD 4.25% S/A 24JAN2027	300,000	290,251	0.65%

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）
2018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			
SUMITOMO LIFE INSURANCE CO 4% S/A 14SEP2077 REGS	200,000	188,628	0.42%
韩国			
SK TELECOM CO LTD 3.75% S/A 16APR2023 REGS	400,000	400,673	0.89%
马来西亚			
PETRONAS CAPITAL LTD 4.5% S/A 18MAR2045 REGS	300,000	304,844	0.68%
PRESS METAL LABUAN LTD 4.8% S/A 30OCT2022	200,000	187,651	0.42%
		492,495	1.10%
墨西哥			
MEXICO CITY AIRPORT TRUST 5.5% S/A 31JUL2047 REGS	300,000	273,423	0.61%
蒙古			
MONGOLIA GOVERNMENT INTL BOND 10.875% S/A 06APR2021 REGS	200,000	228,723	0.51%
荷兰			
MINEJESA CAPITAL BV 5.625% S/A 10AUG2037 REGS	200,000	187,030	0.42%
阿曼			
MAZOOON ASSETS CO SAOC 5.2% S/A 08NOV2027 REGS	200,000	191,627	0.43%
菲律宾			
BDO UNIBANK INC 2.95% S/A 06MAR2023	500,000	477,537	1.06%
UNION BANK OF THE PHILIPPINES 3.369% S/A 29NOV2022	500,000	477,957	1.06%
		955,494	2.12%
新加坡			
BOC AVIATION LTD 2.375% S/A 15SEP2021 REGS	200,000	192,859	0.43%
BOC AVIATION LTD 3M L+1.05% Q 02MAY2021	500,000	506,759	1.13%
GOLDEN LEGACY PTE LTD 8.25% S/A 07JUN2021 REGS	200,000	199,290	0.44%

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)
2018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 (续)			
MARQUEE LAND PTE LTD 9.75%			
S/A 05AUG2019 REGS	37,098	39,510	0.09%
PARKWAY PANTAI LTD 4.25% S/A PERP	500,000	477,715	1.06%
RH INTL SINGAPORE CORP PTE LTD 4.5%			
S/A 27MAR2028	250,000	257,913	0.57%
SINOCHEM INTL DEVELOPMENT PTE LTD			
3.125% S/A 25JUL2022	400,000	392,193	0.87%
STATS CHIPPAK LTD 8.5% S/A 24NOV2020 REGS	200,000	204,135	0.45%
TBLA INTL PTE LTD 7% S/A 24JAN2023	370,000	342,604	0.76%
UNITED OVERSEAS BANK LTD 2.88%			
S/A 08MAR2027	200,000	193,222	0.43%
		<u>2,806,200</u>	<u>6.23%</u>
斯里兰卡			
SRI LANKA GOVERNMENT INTL BOND 6.2%			
S/A 11MAY2027 REGS	200,000	184,882	0.41%
SRI LANKA GOVERNMENT INTL BOND 6.25%			
S/A 27JUL2021 REGS	250,000	259,122	0.58%
		<u>444,004</u>	<u>0.99%</u>
瑞士			
UBS GROUP FUNDING SWITZERLAND AG			
3M L+0.95% Q 15AUG2023 REGS	500,000	502,454	1.12%
泰国			
PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL 4.875%			
S/A PERP REGS	500,000	502,905	1.12%
阿联酋			
ABU DHABI NATIONAL ENERGY CO PJSC			
4.875% S/A 23APR2030 REGS	430,000	433,035	0.96%
英国			
HSBC HLDGS PLC 6% S/A PERP	200,000	187,760	0.42%
STANDARD CHARTERED PLC 7.75%			
S/A PERP REGS	500,000	523,295	1.16%
		<u>711,055</u>	<u>1.58%</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）
2018年6月30日

上市／挂牌投资（续）	持股量／ 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
债务证券（续）			
美国			
CNOOC FINANCE 2015 USA LLC 3.5% S/A 05MAY2025	200,000	194,259	0.43%
HYUNDAI CAPITAL AMERICA 1.75% S/A 27SEP2019 REGS	500,000	492,465	1.10%
VERIZON COMMUNICATIONS INC 3M L+1.1% Q 15MAY2025	1,500,000	1,507,492	3.36%
		<u>2,194,216</u>	<u>4.89%</u>
越南			
VIETNAM GOVERNMENT INTL BOND 4.8% S/A 19NOV2024 REGS	500,000	500,380	1.11%
		<u>45,031,755</u>	<u>100.25%</u>
外汇远期合约			
买入人民币28,532,754.24元及卖出4,313,863.24美元		(18,458)	-0.04%
		<u>(18,458)</u>	<u>-0.04%</u>
上市／挂牌投资总额		45,013,297	100.21%
其他资产净值		(94,327)	-0.21%
于2018年6月30日的资产净值 （按成交价）		<u>44,918,970</u>	<u>100.00%</u>
投资总额，按成本计		<u>46,310,369</u>	

附注：于交易日对投资进行会计处理。

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）

2018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			
香港			
中国农业银行股份有限公司－H股	62,000	28,999	0.44%
友邦保险控股有限公司	21,000	183,595	2.78%
雅居乐雅生活服务股份有限公司－H股	61,000	111,791	1.70%
安徽海螺水泥股份有限公司－H股	5,000	28,675	0.44%
安踏体育用品有限公司	12,000	63,543	0.96%
中国银行股份有限公司－H股	153,000	75,851	1.15%
中国21世纪教育集团有限公司	267,000	59,888	0.91%
中国建设银行股份有限公司－H股	130,000	120,116	1.82%
中国燃气控股有限公司	18,200	73,179	1.11%
招商银行股份有限公司－H股	6,000	22,137	0.34%
中海物业集团有限公司	230,000	76,211	1.16%
新天绿色能源股份有限公司－H股	157,000	45,220	0.69%
石药集团有限公司	38,000	114,776	1.74%
新奥能源控股有限公司	12,000	117,987	1.79%
香港电讯有限公司	122,000	155,792	2.36%
香港中华煤气有限公司	41,800	80,014	1.21%
宏华集团有限公司	690,000	64,193	0.97%
中国工商银行股份有限公司－H股	117,000	87,527	1.33%
联想集团有限公司	216,000	116,993	1.77%
龙湖集团控股有限公司	12,000	32,345	0.49%
中国龙工控股有限公司	214,000	98,455	1.49%
中国石油天然气股份有限公司－H股	48,000	36,520	0.55%
中国平安保险（集团）股份有限公司－H股	5,500	50,608	0.77%
中国邮政储蓄银行股份有限公司－H股	77,000	50,145	0.76%
金沙中国有限公司	13,600	72,709	1.10%
海丰国际控股有限公司	68,000	75,829	1.15%
高鑫零售有限公司	46,500	60,802	0.92%
新鸿基地产发展有限公司	4,000	60,357	0.91%
腾讯控股有限公司	6,900	346,294	5.25%
北京同仁堂科技发展股份有限公司－H股	57,000	90,513	1.37%
联邦制药厂有限公司	64,000	66,638	1.01%
潍柴动力股份有限公司－H股	48,000	66,189	1.00%
睿见教育国际控股有限公司	98,000	85,553	1.30%
中升控股有限公司	30,500	91,540	1.39%
		2,910,984	44.13%

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）

2018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）			
印度尼西亚			
BANK CENTRAL ASIA TBK	23,900	35,817	0.54%
UNITED TRACTORS TBK	14,200	31,313	0.48%
		<u>67,130</u>	<u>1.02%</u>
韩国			
AMOREPACIFIC CORP	179	51,776	0.79%
CELLTRION INC	340	92,551	1.40%
HOTEL SHILLA CO LTD	510	56,491	0.86%
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	3,127	43,191	0.65%
LG ELECTRONICS INC	594	44,219	0.67%
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	65	81,385	1.23%
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	7,944	332,380	5.04%
SAMSUNG SDI CO LTD	480	92,130	1.40%
SAMSUNG SDS CO LTD	321	57,725	0.87%
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	754	29,282	0.44%
SHINSEGAE CO LTD	191	68,780	1.04%
SK HYNIX INC	1,412	108,532	1.65%
		<u>1,058,442</u>	<u>16.04%</u>
新加坡			
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	1,400	88,340	1.34%
泰国			
AIRPORTS OF THAILAND PCL-F	86,900	165,714	2.51%
MINOR INTL PCL-F	27,100	26,660	0.40%
		<u>192,374</u>	<u>2.91%</u>
美国			
NVIDIA CORP	256	60,646	0.92%
		<u>4,377,916</u>	<u>66.36%</u>
存托凭证			
印度			
HDFC BANK LTD-ADR	1,395	146,503	2.22%
INFOSYS LTD-ADR	4,069	79,061	1.20%
RELIANCE INDUSTRIES LTD-GDR 144A	2,464	69,238	1.05%
		<u>294,802</u>	<u>4.47%</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）
2018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
存托凭证（续）			
台湾			
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING-ADR	6,079	222,248	3.37%
英国			
GAIL INDIA LTD-GDR	188	5,508	0.08%
HON HAI PRECISION INDUSTRY CO LTD-GDR REGS	12,581	68,315	1.04%
MAHINDRA & MAHINDRA LTD-SPONSORED GDR	3,478	45,388	0.69%
		<u>119,211</u>	<u>1.81%</u>
美国			
ALIBABA GROUP HLDG LTD-SPONSORED ADR	1,984	368,093	5.58%
BAIDU INC-ADR	578	140,454	2.13%
WNS HLDGS LTD-SPONSORED ADR	3,103	161,915	2.45%
		<u>670,462</u>	<u>10.16%</u>
		<u>1,306,723</u>	<u>19.81%</u>
集合投资计划			
新加坡			
MAPLETREE GREATER CHINA COMMERCIAL TRUST	227,000	189,944	2.88%
美国			
ISHARES INDIA 50 ETF	1,982	69,747	1.06%
ISHARES MSCI MALAYSIA ETF	5,494	171,303	2.60%
ISHARES MSCI TAIWAN ETF	6,842	246,312	3.73%
		<u>487,362</u>	<u>7.39%</u>
		<u>677,306</u>	<u>10.27%</u>
外汇远期合约			
买入人民币3,171,333元及卖出480,090.38美元		(2,668)	-0.04%
		<u>(2,668)</u>	<u>-0.04%</u>
上市／挂牌投资总额		<u>6,359,277</u>	<u>96.40%</u>
其他资产净值		237,394	3.60%
于2018年6月30日的资产净值（按成交价）		<u>6,596,671</u>	<u>100.00%</u>
投资总额，按成本计		<u>5,958,097</u>	

附注：于交易日对投资进行会计处理。

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)
2018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			
中国内地			
中国长江电力股份有限公司 – A股	511,950	9,770,704	3.81%
珠海格力电器股份有限公司 – A股	31,000	1,728,376	0.67%
江苏恒瑞医药股份有限公司 – A股	74,011	6,630,267	2.59%
贵州茅台酒股份有限公司 – A股	8,700	7,524,967	2.94%
上海国际机场股份有限公司 – A股	150,095	9,846,853	3.84%
无锡小天鹅股份有限公司 – A股	31,000	2,542,160	0.99%
云南白药集团股份有限公司 – A股	10,000	1,264,783	0.49%
漳州片仔癀药业股份有限公司 – A股	49,950	6,611,146	2.58%
		<u>45,919,256</u>	<u>17.91%</u>
香港			
中国农业银行股份有限公司 – H股	200,000	734,000	0.29%
友邦保险控股有限公司	157,600	10,811,360	4.22%
北京首都国际机场股份有限公司 – H股	80,000	661,600	0.26%
中银航空租赁有限公司	42,000	2,047,500	0.80%
中信银行股份有限公司 – H股	1,182,000	5,803,620	2.26%
中国建设银行股份有限公司 – H股	1,000,000	7,250,000	2.81%
中国燃气控股有限公司	150,000	4,732,500	1.85%
招商银行股份有限公司 – H股	228,000	6,600,600	2.58%
旭辉控股 (集团) 有限公司	600,000	2,994,000	1.17%
中信证券股份有限公司 – H股	340,500	5,339,040	2.07%
银河娱乐集团有限公司	83,000	5,042,250	1.97%
吉利汽车控股有限公司	225,000	4,578,750	1.79%
香港交易及结算所有限公司	16,700	3,941,200	1.54%
汇丰控股有限公司	61,000	4,489,600	1.75%
中国工商银行股份有限公司 – H股	780,000	4,578,600	1.79%
中国平安保险 (集团) 股份有限公司 – H股	60,000	4,332,000	1.69%
中国生物制药有限公司	45,000	541,800	0.21%
腾讯控股有限公司	45,500	17,917,900	7.00%
时代中国控股有限公司	80,000	931,200	0.36%
中国民航信息网络股份有限公司 – H股	150,000	3,427,500	1.34%
睿见教育国际控股有限公司	459,000	3,144,150	1.23%
宜昌东阳光长江药业股份有限公司 – H股	80,000	3,192,000	1.25%
		<u>103,091,170</u>	<u>40.23%</u>
美国			
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	5,000	7,322,840	2.86%
		<u>156,333,266</u>	<u>61.00%</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)
2018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			
澳大利亚			
NEWCASTLE COAL INFRASTRUCTURE GROUP PTY LTD 4.4% S/A 29SEP2027 REGS	290,000	2,137,196	0.83%
WESTPAC BANKING CORP 5% S/A PERP	200,000	1,381,313	0.54%
		<u>3,518,509</u>	<u>1.37%</u>
英属维尔京群岛			
CHINA GREAT WALL INTL HLDGS III LTD 3.875% S/A 31AUG2027	350,000	2,549,755	0.99%
CICC HONG KONG FINANCE 2016 MTN LTD 3M L+1.2% Q 25APR2021	400,000	3,172,427	1.24%
HONG SENG LTD 8.5% S/A 20NOV2018	200,000	1,557,049	0.61%
HORSE GALLOP FINANCE LTD 3M L+1.18% Q 28JUN2021	200,000	1,575,068	0.61%
HUANENG HONG KONG CAPITAL LTD 3.6% S/A PERP	550,000	3,976,551	1.55%
HUARONG FINANCE 2017 CO 4.5% S/A PERP	350,000	2,745,802	1.07%
VERTEX CAPITAL INVESTMENT LTD 4.15% S/A 22APR2019	320,000	2,518,442	0.98%
WISDOM GLORY GROUP LTD 5.25% S/A PERP	200,000	1,534,944	0.60%
		<u>19,630,038</u>	<u>7.65%</u>
加拿大			
BANK OF NOVA SCOTIA 4.65% S/A PERP	50,000	359,364	0.14%
开曼群岛			
21VIANET GROUP INC 7% S/A 17AUG2020	200,000	1,577,976	0.62%
AZURE ORBIT IV INTL FINANCE LTD 4% S/A 25JAN2028	350,000	2,639,625	1.03%
CDBL FUNDING 1 3.5% S/A 24OCT2027	350,000	2,521,892	0.98%
CENTRAL CHINA REAL ESTATE LTD 8% S/A 28JAN2020 REGS	250,000	2,033,466	0.79%
CHINA HONGQIAO GROUP LTD 6.85% S/A 22APR2019	690,000	5,495,088	2.14%
CHINA OVERSEAS GRAND OCEANS FINANCE IV CAYMAN LTD 4.875% S/A 01JUN2021	420,000	3,300,754	1.29%
CHINA SCE PROPERTY HLDGS LTD 7.45% S/A 17APR2021	200,000	1,565,481	0.61%
CIFI HLDGS GROUP CO LTD 6.875% S/A 23APR2021	200,000	1,578,165	0.62%

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)

2018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)			
开曼群岛 (续)			
FUTURE LAND DEVELOPMENT HLDGS LTD 2.25% S/A 10FEB2019	1,500,000	1,484,651	0.58%
GOLDEN WHEEL TIANDI HLDGS CO LTD 8.25% S/A 03NOV2019	200,000	1,592,188	0.62%
MAOYE INTL HLDGS LTD 7% S/A 23OCT2018	270,000	2,066,736	0.81%
REDCO PROPERTIES GROUP LTD 7% S/A 14NOV2018	200,000	1,571,618	0.61%
SUNAC CHINA HLDGS LTD 7.35% S/A 19JUL2021	400,000	3,020,753	1.18%
SUNAC CHINA HLDGS LTD 8.75% S/A 05DEC2019	250,000	2,014,476	0.79%
TIMES CHINA HLDGS LTD 7.85% S/A 04JUN2021	300,000	2,313,533	0.90%
VLL INTL INC 5.75% S/A 28NOV2024	270,000	2,014,816	0.79%
WTT INVESTMENT LTD/HONG KONG 5.5% S/A 21NOV2022 REGS	200,000	1,507,726	0.59%
YANKUANG GROUP CAYMAN LTD 4.75% S/A 30NOV2020	250,000	1,894,523	0.74%
		<u>40,193,466</u>	<u>15.69%</u>
中国内地			
CHINA CITIC BANK CORP LTD 3M L+0.9% Q 14DEC2020	250,000	1,966,354	0.77%
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP/HONG KONG 3M L+0.73% Q 08JUN2021	300,000	2,358,121	0.92%
CHINA DEVELOPMENT BK 4.2% S/A 19JAN2027	7,000,000	8,344,642	3.27%
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD 4.5% A PERP	200,000	1,512,856	0.59%
		<u>14,181,973</u>	<u>5.55%</u>
香港			
ICBCIL FINANCE CO LTD 3M L+0.95% Q 15MAY2021	300,000	2,362,239	0.92%
VANKE REAL ESTATE HONG KONG CO LTD 3M L+1.55% Q 25MAY2023	300,000	2,357,694	0.92%
		<u>4,719,933</u>	<u>1.84%</u>

中银香港盈荟系列
中银香港全天候中国收益基金

投资组合（未经审计）（续）

2018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）			
韩国			
SK TELECOM CO LTD 3.75% S/A 16APR2023 REGS	200,000	1,571,960	0.61%
马来西亚			
PRESS METAL LABUAN LTD 4.8% S/A 30OCT2022	200,000	1,472,420	0.57%
阿曼			
MAZON ASSETS CO SAOC 5.2% S/A 08NOV2027 REGS	330,000	2,480,975	0.97%
新加坡			
BOC AVIATION LTD 3.5% S/A 18SEP2027 REGS	300,000	2,385,802	0.93%
INDIKA ENERGY CAPITAL III PTE LTD 5.875% S/A 09NOV2024 REGS	200,000	1,417,780	0.55%
		3,803,582	1.48%
		91,932,220	35.87%
存托凭证			
美国			
ALIBABA GROUP HLDG LTD-SPONSORED ADR	3,200	4,658,495	1.82%
		4,658,495	1.82%
外汇远期合约			
买入人民币43,580,656.55元及卖出51,743,313.52美元		(287,700)	-0.11%
		(287,700)	-0.11%
上市／挂牌投资总额		252,636,281	98.58%
其他资产净值		3,631,460	1.42%
于2018年6月30日的资产净值（按成交价）		256,267,741	100.00%
投资总额，按成本计		256,662,917	

附注：于交易日对投资进行会计处理。

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)

2018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			
RIO TINTO LTD	2,300	142,111	0.51%
WESFARMERS LTD	19,200	701,781	2.51%
		<u>843,892</u>	<u>3.02%</u>
中国内地			
中国长江电力股份有限公司 – A股	60,000	145,938	0.52%
上海国际机场股份有限公司 – A股	41,208	344,533	1.24%
		<u>490,471</u>	<u>1.76%</u>
香港			
友邦保险控股有限公司	117,000	1,022,888	3.68%
北京首都国际机场股份有限公司 – H股	45,000	47,428	0.17%
北京同仁堂国药有限公司	90,000	184,437	0.66%
中银航空租赁有限公司	38,000	236,090	0.85%
中国信达资产管理股份有限公司 – H股	750,000	240,869	0.86%
中国建设银行股份有限公司 – H股	772,000	713,303	2.57%
中国燃气控股有限公司	60,000	241,251	0.86%
招商银行股份有限公司 – H股	116,000	427,982	1.53%
旭辉控股 (集团) 有限公司	375,000	238,479	0.85%
中信证券股份有限公司 – H股	90,000	179,849	0.64%
银河娱乐集团有限公司	35,000	270,977	0.97%
吉利汽车控股有限公司	193,000	500,542	1.79%
香港交易及结算所有限公司	13,000	390,997	1.40%
汇丰控股有限公司	18,000	168,837	0.61%
中国工商银行股份有限公司 – H股	550,000	411,452	1.47%
金界控股有限公司	230,000	209,288	0.75%
中国平安保险 (集团) 股份有限公司 – H股	68,000	625,698	2.24%
中国生物制药有限公司	60,000	92,065	0.33%
新鸿基地产发展有限公司	18,000	271,608	0.97%
腾讯控股有限公司	25,000	1,254,683	4.50%
时代中国控股有限公司	80,000	118,676	0.43%
中国民航信息网络股份有限公司 – H股	55,000	160,165	0.57%
维他奶国际集团有限公司	51,000	163,141	0.58%
睿见教育国际控股有限公司	330,000	288,087	1.03%
宜昌东阳光长江药业股份有限公司 – H股	50,000	254,250	0.91%
浙江沪杭甬高速公路股份有限公司 – H股	75,000	66,908	0.24%
		<u>8,779,950</u>	<u>31.46%</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)

2018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)			
新加坡			
DBS GROUP HLDGS LTD	27,800	542,982	1.95%
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP LTD	13,000	111,069	0.40%
UNITED OVERSEAS BANK LTD	5,000	98,209	0.35%
		<u>752,260</u>	<u>2.70%</u>
美国			
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	1,500	279,975	1.00%
		<u>11,146,548</u>	<u>39.94%</u>
债务证券			
澳大利亚			
SHANDONG ENERGY AUSTRALIA PTY LTD 4.55% S/A 26JUL2020	400,000	385,384	1.38%
VIRGIN AUSTRALIA HLDGS LTD 8.5% S/A 15NOV2019 REGS	400,000	410,180	1.47%
		<u>795,564</u>	<u>2.85%</u>
英属维尔京群岛			
BAOXIN AUTO FINANCE I LTD 6.625% S/A 02APR2019	360,000	362,165	1.30%
BAOXIN AUTO FINANCE I LTD 8.75% S/A PERP	400,000	395,948	1.42%
JIANGSU NANTONG SANJIAN INTL CO LTD 7.8% S/A 26OCT2020	400,000	361,985	1.30%
SHANDONG IRON AND STEEL XINHENG INTL CO LTD 6.9% S/A 29MAR2020	400,000	398,801	1.43%
TSINGHUA UNIC LTD 4.75% S/A 31JAN2021	400,000	389,005	1.39%
YINGDE GASES INVESTMENT LTD 7.25% S/A 28FEB2020 REGS	400,000	411,168	1.47%
		<u>2,319,072</u>	<u>8.31%</u>
开曼群岛			
21VIANET GROUP INC 7% S/A 17AUG2020	400,000	402,206	1.44%
BIOSTIME INTL HLDGS LTD 7.25% S/A 21JUN2021 REGS	400,000	402,050	1.44%
CENTRAL CHINA REAL ESTATE LTD 6.875% S/A 23OCT2020	400,000	395,934	1.42%
CENTRAL CHINA REAL ESTATE LTD 8% S/A 28JAN2020 REGS	400,000	414,644	1.49%
CFLD CAYMAN INVESTMENT LTD 6.5% S/A 21DEC2020	200,000	181,655	0.65%

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)

2018年6月30日

上市 / 挂牌投资 (续)	持股量 / 面值	公允价值 美元	占资产净值 的百分比
债务证券 (续)			
开曼群岛 (续)			
CHINA HONGQIAO GROUP LTD 6.85%			
S/A 22APR2019	340,000	345,083	1.24%
CHINA SCE PROPERTY HLDGS LTD 10%			
S/A 02JUL2020	400,000	438,697	1.57%
CHINA SCE PROPERTY HLDGS LTD 7.45%			
S/A 17APR2021	350,000	349,144	1.25%
CIFI HLDGS GROUP CO LTD 6.875%			
S/A 23APR2021	200,000	201,127	0.72%
GARUDA INDONESIA GLOBAL SUKUK LTD 5.95% S/A 03JUN2020	200,000	195,784	0.70%
GOLDEN WHEEL TIANDI HLDGS CO LTD 8.25% S/A 03NOV2019	400,000	405,829	1.45%
KWG PROPERTY HLDGS LTD 8.975%			
S/A 14JAN2019 REGS	200,000	211,349	0.76%
MAOYE INTL HLDGS LTD 7% S/A 23OCT2018	400,000	390,211	1.40%
POWERLONG REAL ESTATE HLDGS LTD 6.95% S/A 17APR2021	390,000	373,907	1.34%
REDCO PROPERTIES GROUP LTD 7%			
S/A 14NOV2018	400,000	400,586	1.44%
RONSHINE CHINA HLDGS LTD 6.95%			
S/A 08DEC2019	200,000	195,646	0.70%
SUNAC CHINA HLDGS LTD 7.35%			
S/A 19JUL2021	400,000	384,976	1.38%
SUNAC CHINA HLDGS LTD 8.75%			
S/A 05DEC2019	400,000	410,772	1.47%
TIMES CHINA HLDGS LTD 6.25% S/A 23JAN2020	400,000	406,328	1.46%
TIMES CHINA HLDGS LTD 7.85% S/A 04JUN2021	250,000	245,704	0.88%
YANKUANG GROUP CAYMAN LTD 4.75%			
S/A 30NOV2020	400,000	386,312	1.38%
		<u>7,137,944</u>	<u>25.58%</u>
香港			
YANCOAL INTL RESOURCES DEVELOPMENT CO LTD 5.75% S/A PERP	400,000	399,291	1.43%
毛里求斯			
AZURE POWER ENERGY LTD 5.5%			
S/A 03NOV2022 REGS	200,000	185,266	0.66%

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）

2018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			
ALAM SYNERGY PTE LTD 6.95% S/A 27MAR2020 REGS	400,000	371,163	1.33%
GLOBAL PRIME CAPITAL PTE LTD 7.25% S/A 26APR2021	400,000	403,920	1.44%
INDIKA ENERGY CAPITAL II PTE LTD 6.875% S/A 10APR2022 REGS	400,000	401,524	1.44%
THETA CAPITAL PTE LTD 7% S/A 11APR2022	400,000	331,086	1.19%
		<u>1,507,693</u>	<u>5.40%</u>
		<u>12,344,830</u>	<u>44.23%</u>
集合投资计划			
新加坡			
SPDR STRAITS TIMES INDEX ETF	121,000	<u>294,951</u>	<u>1.06%</u>
美国			
ISHARES MSCI AUSTRALIA ETF	22,000	497,420	1.79%
ISHARES MSCI INDIA ETF	5,000	166,450	0.60%
ISHARES MSCI INDONESIA ETF	1,200	27,564	0.10%
ISHARES MSCI MALAYSIA ETF	2,000	62,360	0.22%
ISHARES MSCI NEW ZEALAN ETF	3,500	169,225	0.61%
ISHARES MSCI SOUTH KOREA ETF	3,500	236,985	0.85%
ISHARES MSCI THAILAND ETF	1,000	82,270	0.29%
		<u>1,242,274</u>	<u>4.46%</u>
		<u>1,537,225</u>	<u>5.52%</u>
存托凭证			
英国			
HON HAI PRECISION INDUSTRY CO LTD-GDR REGS	70,000	<u>380,100</u>	<u>1.36%</u>
美国			
ALIBABA GROUP HLDG LTD-SPONSORED ADR	1,000	185,530	0.67%
WEIBO CORP-SPONSORED ADR	1,800	159,768	0.57%
		<u>345,298</u>	<u>1.24%</u>
		<u>725,398</u>	<u>2.60%</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）
2018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990,736.00澳元及卖出731,173.08美元		2,550	0.01%
买入人民币25,626,162.21元及卖出3,872,659.46美元		(14,821)	-0.05%
		<u>(12,271)</u>	<u>-0.04%</u>
上市／挂牌投资总额		25,741,730	92.25%
其他资产净值		<u>2,162,612</u>	<u>7.75%</u>
于2018年6月30日的资产净值（按成交价）		<u><u>27,904,342</u></u>	<u><u>100.00%</u></u>
投资总额，按成本计		<u><u>26,762,507</u></u>	

附注：于交易日对投资进行会计处理。

中银香港盈荟系列

投资组合变动表 (未经审计)

截至2018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 (前称中银香港全天候中港股票基金)		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
	2018年	2017年	2018年	2017年	2018年	2017年	2018年	2017年	2018年	2017年	2018年	2018年	2018年
	%	%	%	%	%	%	%	%	%	%	%	%	%
上市/挂牌投资													
权益性证券													
澳大利亚	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	3.02
中国内地	-	-	-	-	4.98	-	79.59	97.53	-	-	-	17.91	1.76
香港	5.79	5.09	-	-	91.76	81.74	1.09	-	-	-	44.13	40.23	31.46
印度尼西亚	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1.02	-	-
韩国	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	16.04	-	-
新加坡	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1.34	-	2.70
西班牙	0.02	0.04	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
泰国	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	2.91	-	-
美国	2.91	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.92	2.86	1.00
债务证券													
澳大利亚	3.90	9.21	3.11	3.99	-	-	-	-	2.86	1.65	-	1.37	2.85
巴林	-	-	0.27	0.11	-	-	-	-	-	-	-	-	-
百慕大	-	-	0.57	2.84	-	-	-	-	0.44	1.60	-	-	-
英属维尔京群岛	9.28	4.01	19.20	15.60	-	-	-	-	16.63	15.32	-	7.65	8.31
加拿大	-	-	-	0.24	-	-	-	-	0.37	0.98	-	0.14	-
开曼群岛	6.14	11.92	47.79	38.22	-	-	-	-	25.33	20.80	-	15.69	25.58
中国内地	-	-	2.74	2.94	-	-	-	-	9.21	5.71	-	5.55	-
埃及	-	-	-	0.15	-	-	-	-	-	-	-	-	-
法国	3.89	4.99	-	0.11	-	-	-	-	1.75	2.43	-	-	-
德国	-	3.59	-	0.28	-	-	-	-	-	-	-	-	-
香港	5.91	7.99	4.96	10.74	-	-	-	-	12.86	13.11	-	1.84	1.43
印度	-	-	-	1.77	-	-	-	-	0.84	3.77	-	-	-
印度尼西亚	-	3.98	-	1.90	-	-	-	-	4.81	5.28	-	-	-
Isle of Man	-	-	-	-	-	-	-	-	0.65	1.18	-	-	-
日本	-	-	-	0.33	-	-	-	-	0.42	0.45	-	-	-
Jersey, C.I.	-	-	0.14	0.75	-	-	-	-	-	0.47	-	-	-
约旦	-	-	-	0.16	-	-	-	-	-	-	-	-	-
韩国	-	3.96	0.54	1.04	-	-	-	-	0.89	0.67	-	0.61	-
马来西亚	-	-	-	-	-	-	-	-	1.10	0.75	-	0.57	-
毛里求斯	-	-	1.00	0.63	-	-	-	-	-	-	-	-	0.66
墨西哥	-	-	-	0.10	-	-	-	-	0.61	-	-	-	-
蒙古	-	-	0.84	0.50	-	-	-	-	0.51	0.52	-	-	-
荷兰	-	-	0.07	1.64	-	-	-	-	0.42	0.94	-	-	-
尼日利亚	-	-	-	0.21	-	-	-	-	-	-	-	-	-
阿曼	2.93	-	-	-	-	-	-	-	0.43	-	-	0.97	-
巴基斯坦	-	-	-	0.21	-	-	-	-	-	-	-	-	-
菲律宾	-	-	-	0.49	-	-	-	-	2.12	0.46	-	-	-
葡萄牙	-	-	-	0.10	-	-	-	-	-	-	-	-	-
新加坡	3.10	-	4.10	6.40	-	-	-	-	6.23	6.85	-	1.48	5.40
斯里兰卡	-	-	0.29	0.58	-	-	-	-	0.99	1.06	-	-	-
超国家	-	-	-	0.34	-	-	-	-	-	1.78	-	-	-
瑞典	-	-	-	0.13	-	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞士	-	-	-	0.11	-	-	-	-	1.12	-	-	-	-
泰国	-	-	-	-	-	-	-	-	1.12	1.14	-	-	-
土耳其	-	-	-	0.13	-	-	-	-	-	-	-	-	-
阿联酋	-	-	-	-	-	-	-	-	0.96	-	-	-	-
英国	-	-	0.73	1.28	-	-	-	-	1.58	2.39	-	-	-
美国	-	-	-	-	-	-	-	-	4.89	4.40	-	-	-
越南	-	-	-	0.11	-	-	-	-	1.11	1.18	-	-	-
赞比亚	-	-	-	0.10	-	-	-	-	-	-	-	-	-
集合投资计划													
中国内地	-	-	-	-	-	-	7.78	-	-	-	-	-	-
德国	-	6.79	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
香港	-	7.93	-	-	-	9.21	-	-	-	-	-	-	-

中银香港盈荟系列
投资组合变动表 (未经审计) (续)
截至2018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 (前称中银香港全天候 中港股票基金)		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
	2018年 %	2017年 %	2018年 %	2017年 %	2018年 %	2017年 %	2018年 %	2017年 %	2018年 %	2017年 %	2018年 %	2018年 %	2018年 %
上市/挂牌投资 (续)													
集合投资计划 (续)													
日本	-	2.91	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
卢森堡	-	-	0.30	0.60	-	-	-	-	-	-	-	-	-
新加坡	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	2.88	-	1.06
英国	-	1.86	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
美国	45.90	25.09	-	-	-	-	-	-	-	-	7.39	-	4.46
存托凭证													
印度	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	4.47	-	-
台湾	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	3.37	-	-
英国	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1.81	-	1.36
美国	-	-	-	-	-	4.98	-	-	-	-	10.16	1.82	1.24
外汇远期合约	-	-	-0.34	1.65	-	0.02	-	-	-0.04	0.54	-0.04	-0.11	-0.04
上市/挂牌投资 总额	89.77	99.36	86.31	96.48	96.74	95.95	88.46	97.53	100.21	95.43	96.40	98.58	92.25
其他资产净值	10.23	0.64	13.69	3.52	3.26	4.05	11.54	2.47	-0.21	4.57	3.60	1.42	7.75
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	100.00

中银香港盈荟系列

投资业绩报表 (未经审计) 资产净值

子基金	截至下列日期 止财政年度/期间	子基金的资产净值						
		A1类	A2类	A3类	A4类	A7类	A8类	A9类
中银香港全天候 环球投资基金 (附注1)	30.6.2018	1,437,995美元	21,380,774港元	18,191澳元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2017	1,259,184美元	19,296,650港元	17,630澳元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2016	2,000,988美元	18,862,236港元	16,525澳元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候 中国高息债券基金 (附注2)	30.6.2018	人民币1,186,745,178元	33,659,558美元	482,816,706港元	3,277,958澳元	不适用 ²	5,416,959美元	不适用 ²
	30.6.2017	人民币1,812,804,061元	31,703,215美元	342,516,285港元	4,248,811澳元	不适用 ²	7,746,625美元	不适用 ²
	30.6.2016	人民币346,621,572元	24,596,933美元	318,943,813港元	2,488,136澳元	不适用 ²	6,100,689美元	不适用 ²
中银香港全天候 香港股票基金 (前称中银香港全天候 中港股票基金) (附注3)	30.6.2018	153,819,354港元	56,815,463美元	2,557,483澳元	不适用 ²	人民币2,737,720元	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2017	183,684,243港元	13,085,042美元	762,499澳元	不适用 ²	人民币10,858,637元	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2016	168,414,394港元	15,021,673美元	3,247,620澳元	不适用 ²	人民币9,622,947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)	30.6.2018	人民币51,502,492元	13,716,234美元	175,985,582港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	2,793,570港元
	30.6.2017	人民币93,503,910元	24,979,434美元	361,779,042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112,269,173元	34,153,302美元	369,164,372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)	30.6.2018	12,962,307美元	103,885,606港元	不适用 ²	不适用 ²	人民币28,218,342元	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2017 ¹	19,905,218美元	102,041,561港元	不适用 ²	不适用 ²	人民币34,822,265元	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候亚洲 (日本除外) 股票基金 (附注6)	30.6.2018 ¹	560,934美元	14,434,886港元	不适用 ²	不适用 ²	人民币3,090,269元	不适用 ²	不适用 ²

中银香港盈荟系列

投资业绩报表 (未经审计) (续) 资产净值 (续)

子基金	截至下列日期 止财政年度/期间	子基金的资产净值						
		A1类	A2类	A3类	A4类	A7类	A8类	A9类
中银香港全天候中国收益基金 (附注7)	30.6.2018 ¹	142,342,208港元	8,096,114美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币42,620,979元	不适用 ²
中银香港全天候亚太高收益基金 (附注8)	30.6.2018 ¹	6,636,618美元	131,142,523港元	不适用 ²	967,749澳元	不适用 ²	人民币24,999,600元	不适用 ²

附注1： 份额于初始认购时按每份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： 份额于初始认购时按每份A1类基金人民币10元、每份A2类基金10美元、每份A3类基金10港元、每份A4类基金10.39澳元、每份A8类基金9.63美元、每份X1类基金人民币10.19元、每份X3类基金9.58港元、每份X4类基金9.83港元及每份X14类基金9.64美元向投资者发售。

附注3： 份额于初始认购时按每份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元及每份X1类基金10港元向投资者发售。

附注4： 份额于初始认购时按每份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： 份额于初始认购时按每份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： 份额于初始认购时按每份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元及每份X1类基金10港元向投资者发售。

附注7： 份额于初始认购时按每份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： 份额于初始认购时按每份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。

¹ 开始营运年份

² 这些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						
		X1类	X2类	X3类	I2类	I3类	I4类	
中银香港全天候 环球投资基金 (附注1)	30.6.2018 30.6.2017 30.6.2016	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	18,490,211港元 10,383,002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	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)	30.6.2018 30.6.2017 30.6.2016	人民币470,948,263元 人民币678,564,192元 人民币26,172,445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	119,905,128港元 150,000,000港元 不适用 ²	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	2,378,040美元 5,944,770美元 不适用 ²
中银香港全天候 香港股票基金 (前称中银香港全天候 中港股票基金) (附注3)	30.6.2018 30.6.2017 30.6.2016	106,595,832港元 139,273,723港元 112,034,219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 不适用 ² 不适用 ²	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)	30.6.2018 30.6.2017 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 不适用 ²	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 (附注5)	30.6.2018 30.6.2017 ¹	14,445,364美元 1,498,711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	39,812,934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 (日本除外) 股票基金 (附注6)	30.6.2018 ¹	不适用 ²	28,979,386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收益基金 (附注7)	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
中银香港全天候亚太高收益基金 (附注8)	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

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： 份额于初始认购时按每份额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： 份额于初始认购时按每份额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： 份额于初始认购时按每份额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元及每份额X1类基金10港元向投资者发售。
- 附注4： 份额于初始认购时按每份额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： 份额于初始认购时按每份额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： 份额于初始认购时按每份额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元及每份额X1类基金10港元向投资者发售。
- 附注7： 份额于初始认购时按每份额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： 份额于初始认购时按每份额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。

1 开始营运年份

2 这些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) 每份资产净值

子基金	截至下列日期 止财政年度 / 期间	子基金的每份资产净值						
		A1类	A2类	A3类	A4类	A7类	A8类	A9类
中银香港全天候 环球投资基金 (附注1)	30.6.2018 30.6.2017 30.6.2016	10.12美元 9.73美元 9.00美元	10.24港元 9.80港元 9.01港元	9.79澳元 9.49澳元 8.89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)	30.6.2018 30.6.2017 30.6.2016	人民币10.17元 人民币10.53元 人民币10.27元	9.48美元 9.60美元 9.53美元	9.59港元 9.66港元 9.52港元	10.01澳元 10.62澳元 10.69澳元	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	9.46美元 9.85美元 9.81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 (前称中银香港全天候 中港股票基金) (附注3)	30.6.2018 30.6.2017 30.6.2016	11.88港元 10.22港元 8.50港元	11.74美元 10.16美元 8.50美元	12.73澳元 11.05澳元 9.04澳元	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	人民币13.03元 人民币11.37元 人民币9.30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)	30.6.2018 30.6.2017 30.6.2016 ¹	人民币7.22元 人民币7.99元 人民币8.37元	6.76美元 7.32美元 7.79美元	6.84港元 7.37港元 7.79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	6.69港元 不适用 ² 不适用 ²
中银香港全天候 亚洲债券基金 (附注5)	30.6.2018 30.6.2017 ¹	9.51美元 9.90美元	9.62港元 9.96港元	不适用 ² 不适用 ²	不适用 ² 不适用 ²	人民币9.85元 人民币10.15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 (日本除外) 股票基金 (附注6)	30.6.2018 ¹	11.19美元	11.29港元	不适用 ²	不适用 ²	人民币11.37元	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候中国 收益基金 (附注7)	30.6.2018 ¹	9.49港元	9.45美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币9.62元	不适用 ²
中银香港全天候亚太高 收益基金 (附注8)	30.6.2018 ¹	9.49美元	9.49港元	不适用 ²	9.42澳元	不适用 ²	人民币9.51元	不适用 ²

中银香港盈荟系列

投资业绩报表（未经审计）（续）

每份资产净值

- 附注1： 份额于初始认购时按每份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： 份额于初始认购时按每份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X14类基金9.64美元向投资者发售。
- 附注3： 份额于初始认购时按每份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元及每份X1类基金10港元向投资者发售。
- 附注4： 份额于初始认购时按每份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： 份额于初始认购时按每份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X12类基金10.01港元向投资者发售。
- 附注6： 份额于初始认购时按每份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元及每份X1类基金10港元向投资者发售。
- 附注7： 份额于初始认购时按每份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： 份额于初始认购时按每份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。

1 开始营运年份

2 这些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)
每份资产净值

子基金	截至下列日期 止财政年度 / 期间	子基金的每份资产净值						
		X1类	X2类	X3类	I2类	I3类	I4类	
中银香港全天候 环球投资基金 (附注1)	30.6.2018 30.6.2017 30.6.2016	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	10.93港元 10.38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	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)	30.6.2018 30.6.2017 30.6.2016	人民币11.97元 人民币11.65元 人民币10.67元	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	不适用 ² 9.81港元 不适用 ²	不适用 ² 不适用 ² 不适用 ²	不适用 ² 9.66港元 不适用 ²	不适用 ² 10.13美元 9.55美元 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 (前称中银香港全天候中港股票基金) (附注3)	30.6.2018 30.6.2017 30.6.2016	10.70港元 9.10港元 7.47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 不适用 ² 不适用 ²	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)	30.6.2018 30.6.2017 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 不适用 ²	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 (附注5)	30.6.2018 30.6.2017 ¹	9.77美元 9.90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	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)	30.6.2018 ¹	不适用 ²	11.49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收益基金 (附注7)	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
中银香港全天候亚太高收益基金 (附注8)	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

中银香港盈荟系列

投资业绩报表（未经审计）（续） 每份资产净值（续）

- 附注1： 份额于初始认购时按每份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： 份额于初始认购时按每份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： 份额于初始认购时按每份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元及每份X1类基金10港元向投资者发售。
- 附注4： 份额于初始认购时按每份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： 份额于初始认购时按每份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： 份额于初始认购时按每份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元及每份X1类基金10港元向投资者发售。
- 附注7： 份额于初始认购时按每份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： 份额于初始认购时按每份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。

1 开始营运年份

2 这些类别份额于报告日期尚未发行。

中银香港盈荟系列

投资业绩记录（未经审计）

子基金	截至下列日期 止财政年度/期间	每份单位的最高发行价									每份单位的最低赎回价								
		A1类	A2类	A3类	A4类	A7类	A8类	A9类	A1类	A2类	A3类	A4类	A7类	A8类	A9类				
中银香港全天候 环球投资基金	30.6.2018	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	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	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	人民币9.20元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²					
	30.6.2015	10.66美元	10.65港元	10.58澳元	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	人民币9.16元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²					
	30.6.2014	10.67美元	10.66港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	9.66美元	9.66港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²					
30.6.2013 ¹	10.27美元	10.26港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	9.53美元	9.54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	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					
	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	人民币10.28元	人民币10.47元	9.22美元	9.21港元	10.62澳元	不适用 ²	9.82美元					
	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	人民币9.47元	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					
	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	人民币9.37元	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					
	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	人民币9.79元	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					
中银香港全天候 香港股票基金 (前称中银香港全天候 中港股票基金)	30.6.2018	14.60港元	14.49美元	15.70澳元	不适用 ²	人民币16.18元	不适用 ²	10.13港元	10.06美元	10.95澳元	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	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	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	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	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					
中银香港全天候 在岸人民币股票基金	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	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	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	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					

中银香港盈荟系列

投资业绩记录 (未经审计) (续)

子基金	截至下列日期 止财政年度/期间	每份净的最高发行价							每份净的最低赎回价						
		A1类	A2类	A3类	A4类	A7类	A8类	A9类	A1类	A2类	A3类	A4类	A7类	A8类	A9类
中银香港全天候 亚洲债券基金	30.6.2018 30.6.2017 ¹	10.08美元 10.01美元	10.15港元 10.04港元	不适用 ² 不适用 ²	不适用 ² 不适用 ²	人民币10.40元 人民币10.26元	不适用 ² 不适用 ²	不适用 ² 不适用 ²	9.51美元 9.64美元	9.62港元 9.64港元	不适用 ² 不适用 ²	不适用 ² 不适用 ²	人民币9.86元 人民币9.64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 (日本除外) 股票基金	30.6.2018 ¹	12.46美元	12.52港元	不适用 ²	不适用 ²	人民币12.60元	不适用 ²	不适用 ²	9.96美元	9.97港元	不适用 ²	不适用 ²	人民币9.97元	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候中国 收益基金	30.6.2018 ¹	10.87港元	10.87美元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	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
中银香港全天候亚太高 收益基金	30.6.2018 ¹	10.02美元	10.03港元	不适用 ²	10.00澳元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	9.47美元	9.48港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	人民币9.49元	不适用 ²

¹ 开始营运年份

² 这些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	每份净的最高发行价				每份净的最低赎回价							
		X1类	X2类	X3类	I2类	I3类	I4类	X1类	X2类	X3类	I2类	I3类	I4类
中银香港全天候 环球投资基金	30.6.2018	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	10.37港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2017	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	9.97港元	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	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
	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
30.6.2013 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	
中银香港全天候 中国高息债券基金	30.6.2018	人民币12.25元	不适用 ²	11.22港元	10.85美元	10.69港元	10.46美元	人民币11.64元	不适用 ²	9.79港元	9.70美元	9.64港元	9.55美元
	30.6.2017	人民币11.76元	不适用 ²	9.88港元	不适用 ²	9.86港元	9.65美元	人民币10.68元	不适用 ²	9.56港元	不适用 ²	9.66港元	9.55美元
	30.6.2016	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	人民币10.19元	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
	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
中银香港全天候 香港股票基金中港 股票基金 (前称中银香港全天候)	30.6.2018	13.09港元	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	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2017	9.16港元	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	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2016	10.09港元	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	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2015	10.96港元	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	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
中银香港全天候 在岸人民币股票基金	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
	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
	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

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						
		X1类	X2类	X3类	I2类	I3类	I4类	X1类	X2类	X3类	I2类	I3类	I4类
中银香港全天候 亚洲债券基金	30.6.2018	10.11美元	10.25港元	不适用 ²	10.32港元	不适用 ²	不适用 ²	9.75美元	10.11港元	不适用 ²	9.99港元	不适用 ²	不适用 ²
	30.6.2017 ¹	9.91美元	10.00港元	不适用 ²	10.04港元	不适用 ²	不适用 ²	9.91美元	9.87港元	不适用 ²	10.00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	30.6.2018 ¹	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	9.97港元	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²	不适用 ²
中银香港全天候中国 收益基金	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
中银香港全天候亚太高 收益基金	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

¹ 开始营运年份

² 这些类别份额于报告日期尚未发行。