

华夏中国交建高速公路封闭式基础设施证券

投资基金

2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年八月三十日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、收益分配情况、财务会计报告和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金产品基本情况.....	4
2.2 基础设施项目基本情况说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 基础设施资产支持证券管理人和外部管理机构.....	5
2.5 信息披露方式.....	5
2.6 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金收益分配情况.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 其他财务指标.....	6
3.3 基金收益分配情况.....	6
3.4 报告期内基金及资产支持证券费用收取情况的说明.....	8
§4 基础设施项目运营情况.....	8
4.1 对报告期内基础设施项目公司运营情况的整体说明.....	8
4.2 基础设施项目所属行业情况.....	8
4.3 基础设施项目运营相关财务信息.....	9
4.4 基础设施项目运营相关通用指标信息.....	11
4.5 基础设施项目公司经营现金流.....	11
4.6 基础设施项目公司对外借入款项情况.....	11
4.7 基础设施项目投资情况.....	12
4.8 抵押、查封、扣押、冻结等其他权利限制的情况.....	12
4.9 基础设施项目相关保险的情况.....	12
4.10 基础设施项目未来发展展望的说明.....	13
4.11 其他需要说明的情况.....	14
§5 除基础设施资产支持证券之外的投资组合报告.....	14
5.1 报告期末基金资产组合情况.....	14
5.2 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....	14
5.3 报告期末按公允价值大小排序的前五名债券投资明细.....	14
5.4 报告期末按公允价值大小排序的前十名资产支持证券投资明细.....	14
5.5 投资组合报告附注.....	14
5.6 报告期末其他各项资产构成.....	14
5.7 投资组合报告附注的其他文字描述部分.....	14
5.8 报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
5.9 报告期内基金资产重大减值计提情况的说明.....	15
§6 管理人报告.....	15
6.1 基金管理人及主要负责人员情况.....	15
6.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	17
6.3 管理人对报告期内公平交易制度及执行情况的专项说明.....	17
6.4 管理人对报告期内基金的投资和运营分析.....	17
6.5 管理人对报告期内基金收益分配情况的说明.....	18

6.6	管理人对宏观经济及行业走势的简要展望	18
6.7	管理人对关联交易及相关利益冲突的防范措施	19
§7	托管人报告	20
7.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	20
7.2	托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、收益分配等情况的说明	20
7.3	托管人对中期报告中财务信息等内容的真实性、准确性和完整性发表意见	20
§8	中期财务报告（未经审计）	21
8.1	资产负债表	21
8.2	利润表	24
8.3	现金流量表	26
8.4	所有者权益变动表	28
8.5	报表附注	31
§9	基金份额持有人信息	61
9.1	基金份额持有人户数及持有人结构	61
9.2	基金前十名流通份额持有人	61
9.3	基金前十名非流通份额持有人	62
9.4	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
§10	基金份额变动情况	63
§11	重大事件揭示	63
11.1	基金份额持有人大会决议	63
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	63
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
11.4	报告期内原始权益人或其同一控制下的关联方卖出战略配售取得的基金份额	63
11.5	基金投资策略的改变	63
11.6	为基金进行审计的会计师事务所情况	63
11.7	为基金出具评估报告的评估机构情况	63
11.8	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	63
11.9	其他重大事件	64
§12	影响投资者决策的其他重要信息	64
§13	备查文件目录	64
13.1	备查文件目录	64
13.2	存放地点	65
13.3	查阅方式	65

§2 基金简介

2.1 基金产品基本情况

基金名称	华夏中国交建高速公路封闭式基础设施证券投资基金
基金简称	华夏中国交建高速 REIT
场内简称	中交 REIT（扩位简称：华夏中国交建 REIT）
基金主代码	508018
交易代码	508018
基金运作方式	契约型封闭式。本基金存续期限为 40 年，本基金在此期间内封闭运作并在符合规定的情形下在上交所上市交易。存续期届满后，经基金份额持有人大会决议通过，本基金可延长存续期。
基金合同生效日	2022 年 4 月 13 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,000,000,000.00 份
基金合同存续期	40 年
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2022 年 4 月 28 日
投资目标	本基金主要投资于基础设施资产支持证券全部份额，并取得基础设施项目经营权利。通过主动的投资管理和运营管理，力争为基金份额持有人提供稳定的收益分配。
投资策略	本基金的投资策略包括资产支持证券投资策略与固定收益投资策略。其中，资产支持证券投资策略包括初始投资策略、扩募收购策略、资产出售及处置策略、融资策略、运营策略、权属到期后的安排等。
业绩比较基准	本基金不设置业绩比较基准。
风险收益特征	本基金在存续期内主要投资于基础设施资产支持证券全部份额，以获取基础设施运营收益并承担标的资产价格波动，因此与股票型基金和债券型基金有不同的风险收益特征。一般市场情况下，本基金预期风险和收益高于债券型基金和货币型基金，低于股票型基金。
基金收益分配政策	本基金的收益分配政策为：(1)每一基金份额享有同等分配权；(2)本基金收益以现金形式分配；(3)本基金应当将不低于合并后年度可供分配金额的 90% 以现金形式分配给投资者。本基金的收益分配在符合分配条件的情况下每年不得少于 1 次。
资产支持证券管理人	中信证券股份有限公司
外部管理机构	中交投资有限公司
其他外部管理机构	中交投资（湖北）运营管理有限公司

2.2 基础设施项目基本情况说明

基础设施项目名称：武汉至深圳高速公路嘉鱼至通城段项目

基础设施项目公司名称	湖北中交嘉通高速公路发展有限公司
------------	------------------

基础设施项目类型	收费公路
基础设施项目主要经营模式	基础设施项目公司的主营业务为高速公路（嘉通高速项目）的投资运营，嘉通高速项目为采用 BOT 模式（Build-Operate-Transfer，即建设-运营-移交模式）的特许经营项目，由基础设施项目公司负责投资建设和运营。基础设施项目公司负责武汉至深圳高速公路嘉鱼至通城段项目的投资运营，根据《特许权协议》，在特许经营期限内享有运营、管理项目的权利，收取车辆通行费的权利，项目沿线规定区域内的服务设施经营权、项目沿线规定区域内的广告经营权、广告经营权及服务设施经营权对外承包经营权。
基础设施项目地理位置	武汉至深圳高速公路嘉鱼至通城段项目为南北走向，起于湖北省咸宁市嘉鱼县新街镇三畝村，对接武汉至深圳高速公路嘉鱼北段，止于湖北省咸宁市通城县大坪乡达凤村，对接通城至界上高速公路。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华夏基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李彬	任航
	联系电话	400-818-6666	010-66060069
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-818-6666	95599
传真		010-63136700	010-68121816
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号院	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址		北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		100033	100031
法定代表人		张佑君	谷澍

2.4 基础设施资产支持证券管理人和外部管理机构

项目	基础设施资产支持证券管理人	外部管理机构	外部管理机构 2
名称	中信证券股份有限公司	中交投资有限公司	中交投资（湖北）运营管理有限公司
注册地址	广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座	北京市西城区德胜门外大街121号C座3层302号	武汉经济技术开发区军山街徐家堡1号
办公地址	北京市朝阳区亮马桥路48号	北京市朝阳区小营北路53号院	武汉经济技术开发区军山街徐家堡1号
邮政编码	100026	100020	430058
法定代表人	张佑君	蔡奉祥	胡艳莉

注：外部管理机构：中交投资有限公司为运营管理统筹机构；

外部管理机构 2：中交投资（湖北）运营管理有限公司为运营管理实施机构。

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
----------------	---------

登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和/或基金托管人的住所/办公地址

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标和基金收益分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

期间数据和指标	报告期（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日）
本期收入	202,595,767.71
本期净利润	27,608,334.21
本期经营活动产生的现金流量净额	152,654,160.00
期末数据和指标	报告期末（2024 年 6 月 30 日）
期末基金总资产	10,388,907,604.42
期末基金净资产	8,938,281,344.25
期末基金总资产与净资产的比例（%）	116.23

注：①本表中的“本期收入”、“本期净利润”、“本期经营活动产生的现金流量净额”均指合并报表层面的数据。

②本期收入指基金合并利润表中的本期营业收入、利息收入、投资收益、公允价值变动收益、汇兑收益、资产处置收益、其他收益、其他业务收入以及营业外收入的总和。

3.2 其他财务指标

单位：人民币元

数据和指标	2024 年
期末基金份额净值	8.9383
期末基金份额公允价值参考净值	-

注：本期末为 2024 年 6 月 30 日。

3.3 基金收益分配情况

3.3.1 本报告期及近三年的收益分配情况

3.3.1.1 本报告期及近三年的可供分配金额

单位：人民币元

期间	可供分配金额	单位可供分配金额	备注
本期	132,851,864.49	0.1329	-
2023 年	320,358,076.61	0.3204	-
2022 年	250,597,919.87	0.2506	为 2022 年 4 月 13 日（基金合同生效日）到 2022 年 12 月 31 日可供分配金额。

3.3.1.2 本报告期及近三年的实际分配金额

单位：人民币元

期间	实际分配金额	单位实际分配金额	备注
本期	149,630,160.66	0.1496	-
2023 年	315,499,605.25	0.3155	-
2022 年	177,819,650.42	0.1778	-

注：本基金合同于 2022 年 4 月 13 日生效，合同生效年度期间自 2022 年 4 月 13 日至 2022 年 12 月 31 日。

3.3.2 本期可供分配金额

3.3.2.1 本期可供分配金额计算过程

单位：人民币元

项目	金额	备注
本期合并净利润	27,608,334.21	-
本期折旧和摊销	94,873,644.27	-
本期利息支出	29,285,314.20	-
本期所得税费用	-	-
本期税息折旧及摊销前利润	151,767,292.68	-
调增项		
1.应收和应付项目的变动	1,779,250.41	-
调减项		
1.支付的利息及所得税费用	-13,049,681.67	-
2.偿还借款支付的本金	-1,841,666.67	-
3.当期购买基础设施项目等资本性支出	-412,694.69	-
4.未来合理相关支出预留，包括重大资本性支出（如固定资产正常更新、大修、改造等）、未来合理期间内的债务利息、运营费用等	-5,390,635.57	-
本期可供分配金额	132,851,864.49	-

注：未来合理相关支出预留，包括重大资本性支出（如固定资产正常更新、大修、改造等）、未来合理期间内的债务利息、运营费用等，包括本期基金管理人的管理费、专项计划基金管理人的管理费、托管费、外部管理机构的管理费、待缴纳的增值税、未来合理期间内的债务利息、预留资本性支出、交割前项目公司应付款项及已清分尚未收到的通行费收入等变动的净额。

此外，上述可供分配金额并不代表最终实际分配的金额。由于收入和费用并非在一年内平均发生，所以投资者不能按照本期占全年的时长比例来简单判断本基金全年的可供分配金额。

3.3.2.2 本期调整项与往期不一致的情况说明

无。

3.4 报告期内基金及资产支持证券费用收取情况的说明

依据本基金基金合同、招募说明书、资产支持专项计划标准条款、运营管理服务协议等相关法律文件，本报告期内计提基金管理人管理费 3,604,317.08 元，资产支持证券管理人管理费 901,080.18 元，基金托管人托管费 450,539.18 元，以基础设施资产净收入为基数计提的运营管理机构运营管理费为 8,273,147.94 元。本报告期本期净利润及可供分配金额均已根据测算扣减上述以基础设施资产净收入为基数计提的运营管理机构运营管理费。

§4 基础设施项目运营情况

4.1 对报告期内基础设施项目公司运营情况的整体说明

报告期内，本基金由基金管理人、资产支持证券管理人和项目公司共同委托中交投资有限公司和中交投资（湖北）运营管理有限公司作为基础设施项目的运营管理机构，其中，中交投资有限公司担任运营管理统筹机构，负责统筹、协调和安排项目的运营管理工作，中交投资（湖北）运营管理有限公司担任运营管理实施机构，负责基础设施项目的运营管理的实施工作。基金管理人按照《华夏中国交建高速公路封闭式基础设施证券投资基金运营管理服务协议》对运营管理机构进行监督和考核。

2024 年上半年度，嘉通高速实现通行费收入（不含税）19,886.4 万元，日均通行费收入（不含税）109.3 万元，较 2023 年上半年同期日均同比下降 11.1%；实现自然车流量 417.3 万辆，日均自然车流量 2.29 万辆，较 2023 年上半年同期日均同比下降 10.8%。

报告期内，湖北省内多地频发冰冻雨雪、暴雨等恶劣天气，对嘉通高速的车流量产生不利影响，其中，嘉通高速客车日均自然车流量完成 1.33 万辆，较 2023 年同期日均同比下降 16.5%，随着暑期及旅游旺季的临近和恶劣天气影响逐步好转，6 月呈现恢复性上涨趋势；嘉通高速受宏观经济、货运需求不足、持续恶劣天气及周边路网变化影响，货车日均自然车流量完成 0.96 万辆，较 2023 年同期日均同比下降 1.4%。

4.2 基础设施项目所属行业情况

4.2.1 基础设施项目所属行业整体情况的说明

本基础设施项目属于高速公路行业，是交通运输的重要板块之一。目前，我国综合立体交通网总里程已突破 600 万公里，其中，京津冀、长三角、粤港澳、成渝双城经济圈之间的 6 条交通主通道，西部陆海走廊等 7 条走廊，沿边通道等 8 条通道所构成的“6 轴 7 廊 8 通道”，主骨架已基本形成，覆盖了全国超过 80% 的县（市、区），服务了全国 90% 左右的经济和人口。

2023 年，我国国家高速公路里程 12.23 万公里、增加 0.24 万公里。根据《加快建设交通强国五年行动计划（2023—2027 年）》，到 2027 年，国家高速公路里程达到约 13 万公里，普通国道里程约 27 万公里。我国交通运输行业正从高速发展逐步转向高质量发展。我国将加快“6 轴 7 廊 8 通道”主骨架建设，打造示范大通道，深入实施国家综合货运枢纽补链强链，推进国家公路联通提质工程，打造“四个一流”，构建安全、便捷、高效、绿色、经济的现代化综合交通运输体系。

从交通运输量的角度来看，根据初步统计，2023 年全年完成营业性货运量 547.5 亿吨，同比增长 8.1%，比 2019 年增长 16.9%；完成跨区域人员流动量 612.5 亿人次，同比增长 30.9%，比 2019 年增长 0.8%。

4.2.2 基础设施项目所属行业竞争情况的说明

高速公路的实际经营表现会受沿途地域经济能力及区域路网的影响，且可能与部分功能、路线相近的高速公路、国省干线形成竞争。高速公路作为交通运输行业的大类基础设施，就运输功能的实现方面，和铁路、水运、航空等客、货运输方式存在一定的替代效应。就本项目而言，湖北省内新增的南北向客、货运输方式，可能造成一定的市场竞争风险。

本基础设施项目周边现有高速公路路网成型较早，已具备一定的稳定性，所属区域的相同走向交通量在京港澳高速、武监高速、孝洪高速、咸通高速等各条高速公路之间的分配情况已趋于平衡和稳定。

本基础设施项目在本基金招募说明书中披露说明，从主要功能定位来说，京港澳高速为本基础设施项目的主要竞品。本基础设施项目所属的武深高速在金水枢纽互通和赤壁西枢纽互通路段，相对于京港澳高速具有路程更短、通行耗时更少、货车综合通行成本更低及行车体验更好的优势。2024 年上半年嘉通高速的经营业绩完成情况，相较京港澳高速竞争路段保持了较明显的比较优势。

本基础设施项目影响区内主要铁路通道为京九铁路武咸城际和武广高铁。5 月 2 日，武广高铁发布公告称，自 2024 年 6 月 15 日起，武广高铁对京广高铁武广段上运行的时速 300 公里及以上动车组列车公布票价进行上调，武广高铁全程票价涨幅在 20% 左右。武广高铁票价上涨可能会有利于武深高速客运增长。

4.3 基础设施项目运营相关财务信息

4.3.1 基础设施项目公司的营业收入分析

4.3.1.1 基础设施项目公司名称：湖北中交嘉通高速公路发展有限公司

金额单位：人民币元

序号	构成	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年同期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
		金额 (元)	占该项目总收入比例 (%)	金额 (元)	占该项目总收入比例 (%)
1	通行费收入	198,864,299.29	99.07	222,565,745.41	99.23
2	其他收入	1,867,884.22	0.93	1,718,442.74	0.77
3	合计	200,732,183.51	100.00	224,284,188.15	100.00

注：本报告期其他收入主要为租赁收入。

4.3.1.2 管理人对基础设施项目公司营业收入重大变化情况的分析

无。

4.3.2 基础设施项目公司的营业成本及主要费用分析

4.3.2.1 基础设施项目公司名称：湖北中交嘉通高速公路发展有限公司

金额单位：人民币元

序号	构成	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年同期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
		金额 (元)	占该项目总成本比例 (%)	金额 (元)	占该项目总成本比例 (%)
1	营业成本	113,736,161.76	32.32	104,364,191.33	33.03
2	财务费用	229,201,158.88	65.12	200,294,313.81	63.39
3	管理费用	8,273,147.94	2.35	10,505,317.15	3.32
4	税金及附加	733,628.74	0.21	810,732.97	0.26
5	其他成本/费用	-	-	-	-
6	合计	351,944,097.32	100.00	315,974,555.26	100.00

注：本报告期财务费用主要包含外部银行借款利息费用以及股东借款利息费用。

4.3.2.2 管理人对基础设施项目公司营业成本及主要费用重大变化情况的分析

无。

4.3.3 基础设施项目公司的财务业绩衡量指标分析

4.3.3.1 基础设施项目公司名称：湖北中交嘉通高速公路发展有限公司

序号	指标名称	指标含义说明及计算公式	指标单位	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年同期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
				指标数值	指标数值
1	毛利率	(营业收入-营业成本-管理人报酬)/营业收入×100%	%	39.22	48.78
2	净利率	净利润/营业收入×100%	%	28.16	38.37
3	息税折旧摊销前利润率	(利润总额+利息费用+折旧摊销)/营业收入×100%	%	78.43	84.60

注：净利率的计算过程中，净利润调整为“财务报表净利润+拟支付给专项计划的股东借款利息”。

4.3.3.2 管理人对基础设施项目公司财务业绩衡量指标重大变化情况的分析

无。

4.4 基础设施项目运营相关通用指标信息

2024 年上半年，嘉通高速收费站出入口车流量合计为 155.73 万辆，其中入口合计 81.32 万辆，出口合计 74.41 万辆；嘉通高速收费站出口免费车流量共计 19.60 万辆，其中节假日免费车流量 18.56 万辆，绿通车免费车流量 0.36 万辆，军警车及其他免费车流量 0.67 万辆。

4.5 基础设施项目公司经营现金流

4.5.1 经营活动现金流归集、管理、使用及变化情况

1. 收入归集和支出管理

项目公司开立了运营收支账户和基本户，两个账户均受到托管人中国农业银行股份有限公司的监管。运营收支账户用于接收运营收支账户开户行发放的银行贷款、接收基础设施项目收入及其他合法收入；基本户用于接收专项计划发放的股东借款、专项计划支付的增资款、项目公司运营收支账户所划转的基础设施项目收入及其他合法收入及基金管理人认可的其他款项，并根据《基本户资金监管协议》的约定对外支付人民币资金。

2. 现金归集和使用情况

本报告期初项目公司货币资金余额 92,259,779.89 元。本报告期内，项目公司收入归集总金额为 301,161,706.57 元，其中收到通行费收入 209,407,892.82 元，收到其他收入 4,395,492.86 元，赎回货币基金 87,358,320.89 元；对外支出总金额为 298,896,033.77 元，其中支付银行借款利息及股东借款利息 170,726,156.74 元，偿还银行借款本金 1,841,666.67 元，申购货币基金 70,000,000.00 元，支付运营支出以及偿还交割前应付款项合计 56,328,210.36 元。截至本报告期末，项目公司货币资金余额为 94,525,452.69 元；货币基金账户余额为 32,971,979.71 元，本报告期收益 892,383.09 元。

上年同期项目公司收入归集总金额为 234,457,368.00 元，对外支出总金额为 246,316,758.55 元。

4.5.2 对报告期内单一客户经营性现金流占比较高情况的说明

无。

4.5.3 对报告期内发生的影响未来项目正常现金流的重大情况与拟采取的相应措施的说明

无。

4.6 基础设施项目公司对外借入款项情况

4.6.1 报告期内对外借入款项基本情况

截至本报告期末，项目公司存续的外部借款为中国工商银行股份有限公司北京和平里支行于 2022 年 4 月 15 日发放的固定资产借款，借款总额为人民币 1,300,000,000.00 元，借款期限为 20 年。根据实际签署的《固定资产借款合同》，上述借款的计划还款时间为 2023 年至 2041 年每年的 12 月 21 日，经贷款人同意可提前还款。借款利率为每笔借款提款日前一工作日全国银行间同业拆借中心公布的五年期以上贷款市场报价利率（LPR），浮动点数为减 65 个基点，以 12 个月为一期，一期一调整，分段计息。

上述借款资金全部用于偿还发行前基础设施项目公司签署的《武深高速公路嘉通段项目人民币资金银团贷款合同》（合同编号：WSGS-YTDKHT-2014-01）的借款本金及利息。

项目公司已经将嘉通高速的相关收益出质给贷款人，并办理相关的质押担保登记。本期归还对外借入款项 1,841,666.67 元，截至本报告期末，借款余额为人民币 1,295,558,333.33 元。

4.6.2 本期对外借入款项情况与上年同期的变化情况分析

本期期初项目公司对外借入款项余额 1,297,400,000.00 元，本期归还对外借入款项 1,841,666.67 元，本期期末对外借入款项余额 1,295,558,333.33 元。

上年同期期初项目公司对外借入款项余额 1,300,000,000.00 元，上年同期归还对外借入款项 917,222.22 元，上年同期期末对外借入款项余额 1,299,082,777.78 元。

4.6.3 对基础设施项目报告期内对外借入款项不符合借款要求情况的说明

无。

4.7 基础设施项目投资情况

4.7.1 报告期内购入或出售基础设施项目情况

无。

4.7.2 购入或出售基础设施项目变化情况及对基金运作、收益等方面的影响分析

无。

4.8 抵押、查封、扣押、冻结等他项权利限制的情况

项目公司依据外部借款协议约定，已将嘉通高速的相关收益出质给贷款人中国工商银行股份有限公司北京和平里支行，并办理了质押担保登记。

4.9 基础设施项目相关保险的情况

本基金基础设施项目公司于 2024 年 5 月 17 日为基础设施项目投保了足额的财产一切险、营业中断险、机械损坏险、公众责任险和安全生产责任险等，本次保险的期限为 2024 年 5 月 17 日 0 时至 2025 年 5 月 16 日 24 时，由中国平安财产保险股份有限公司湖北分公司、中

国太平洋财产保险股份有限公司黑龙江分公司共同承保。

4.10 基础设施项目未来发展展望的说明

高速公路经营业绩情况与 GDP 增速、居民收入水平、消费结构升级、路网路况、收费路段运营等情况密切相关。回顾 2024 年上半年，外部环境更趋复杂严峻和不确定，从短期来看，我国二季度经济增速相较一季度有所回落，但经济稳定运行、长期向好的基本面没有改变。无论从经济发展的短周期还是长周期看，都有强有力的支撑。我国交通运输经济运行持续恢复、整体好转，人员流动大幅增加，货运量、港口货物吞吐量、交通固定资产投资同比均实现较快增长，为推动经济回升向好提供了有力保障。国民经济持续稳定的发展是公路车流量增长的原动力，嘉通高速作为一条位于湖北省的以货车通行费收入为主的高速公路，其未来经营业绩与沿途及辐射区域的宏观经济情况密切相关。

嘉通高速位于湖北省的东南部，处于武汉城市圈，是连通南北的交通大通道中的重要一段，湖北省经济发展情况及跨省经济活动对本基础设施项目有重要影响。2024 年上半年，湖北省围绕推动高质量发展，积极扩大有效投资，持续推动大规模设备更新，加快推进重大项目建设，进一步激发投资活力，全省固定资产投资运行稳中有进。固定资产投资同比增长 5.9%，增速比一季度加快 0.1 个百分点，分别高于全国和中部地区平均水平 2.0 个和 1.9 个百分点。

2024 年上半年，湖北省物流业景气指数从 3 月份的 59.6%，逐月降低至 6 月份的 42.6%，二季度月度数据相较 2023 年分别有不同程度的下降。2024 年 6 月份，湖北省物流需求规模增势减弱，业务总量和新订单指数回落。分物流企业类型来看，运输型、仓储型和 5A 级物流企业景气指数回升，主要是由于节日促销活动带动了相关商品销量，因此物流业务量有所上升；分不同行业来看，交通运输、仓储、装卸搬运、包装、货代、工业（制造业）物流业景气指数降低；其中，运输业中的公路、铁路以及配送业物流景气指数下降；从服务对象来看，受端午节以及 6.18 电商促销活动影响，快消品、农产品、大宗商品、电子设备及电器等商品物流需求增加，但汽车、建材、危化品、医药等进入生产或销售淡季，物流需求随之减少。根据湖北省现代物流发展促进会对后期走势的预测，湖北省 6 月物流业务活动预期指数为 44.81%，回落 3.73 个百分点。随着高温多雨天气来临，纺织品、汽车、建材、农产品、医药等相关物流业务进入淡季，预计后期物流需求增长势头将持续放缓。

从路网结构上看，本基础设施项目周边路网稳定，不存在新增的分流路段，当前修建的赤壁长江公路大桥东延线、通城—修水高速公路（通修高速公路），建成后将对本项目交通量有一定的诱增影响。京港澳高速湖北南段作为本项目的重要竞争路段，嘉通高速具有较为

明显的比较优势，且两条高速间的车流量分配已基本稳定；京港澳高速湖北北段作为嘉通高速的重要引流路，其“4 车道改 8 车道”长期来看有利于嘉通高速未来交通量的增长。

本基础设施项目运营过程中可能遇到的政策风险、运营风险、市场风险、经营业绩波动风险和不可抗力等可能造成投资者收益的波动。

4.11 其他需要说明的情况

无。

§5 除基础设施资产支持证券之外的投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

单位：人民币元

序号	项目	金额（元）
1	固定收益投资	-
	其中：债券	-
	资产支持证券	-
2	买入返售金融资产	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-
3	货币资金和结算备付金合计	4,044,847.95
4	其他资产	-
5	合计	4,044,847.95

5.2 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.3 报告期末按公允价值大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.4 报告期末按公允价值大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末除基础设施资产支持证券之外未持有资产支持证券。

5.5 投资组合报告附注

报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.6 报告期末其他各项资产构成

本基金本报告期末无其他资产。

5.7 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

5.8 报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格根据《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的资产进行估值。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查基金资产净值。

本基金管理人设有估值委员会，由主管基金运营的公司领导或其授权人任主席并确定委员人选，由督察长、投资风控工作负责人、证券研究工作负责人、合规工作负责人及基金会计工作负责人组成。估值委员会负责公司基金估值政策、程序及方法的制定和修订，负责定期审议公司估值政策、程序及方法的科学合理性，保证基金估值的公平、合理。基金经理原则上不参与估值委员会的工作，其估值建议经估值委员会成员评估后审慎采用。估值委员会的相关人员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。本基金参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

5.9 报告期内基金资产重大减值计提情况的说明

无。

§6 管理人报告

6.1 基金管理人及主要负责人员情况

6.1.1 管理人及其管理基础设施基金的经验

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州、青岛、武汉及沈阳设有分公司，在香港、深圳、上海、北京设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、首批个人养老金基金管理人、境内首批中日互通 ETF 基金管理人、首批商品期货 ETF 基金管理人、首批公募 MOM 基金管理人、首批纳入互联互通 ETF 基金管理人、首批北交所主题基金管理人以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人、公募 REITs 管理人，国内首家承诺“碳中和”具体目标和路径的公募基金公司，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金

管理公司之一。

华夏基金拥有多年丰富的基础设施与不动产领域投资研究和投后管理经验，并已设置独立的基础设施基金业务主办部门，即基础设施与不动产业务部。截至本报告发布日，基础设施与不动产业务部已配备不少于 3 名具有 5 年以上基础设施项目运营或基础设施投资管理经验的主要负责人员，其中至少 2 名具备 5 年以上基础设施项目运营经验，覆盖交通基础设施、园区基础设施、保障性租赁住房、消费基础设施、仓储物流基础设施、能源及市政基础设施等领域。

6.1.2 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任职期限		基础设施项目运营或投资管理年限	基础设施项目运营或投资管理经验	说明
		任职日期	离任日期			
王越	本基金的基金经理	2022-04-13	-	10 年	自 2014 年开始从事基础设施相关的运营管理工作，2017 年开始同时参与投资管理工作，曾参与静兴高速、芜湖市轨道交通 1 号线 2 号线项目，广西壮族自治区崇左市环城北路工程等，主要涵盖高速公路、轨道交通、产业园区、综合管廊等基础设施类型。	硕士，具有 5 年以上基础设施投资和运营管理经验。曾就职于中铁资本有限公司、中铁工程设计咨询集团有限公司。2020 年 9 月加入华夏基金管理有限公司。
王昱昊	本基金的基金经理	2023-06-29	-	8 年	自 2014 年开始从事基础设施相关的投资运营管理工作。曾参与山东永锋转炉余热利用项目，天津大无缝余热利用项目，收购乍嘉苏高速股权项目，京津塘高速改扩建项目，平临高速法拍项目。主要涵盖节能环保、高速公路等基础设施类型。	硕士，具有 5 年以上基础设施投资和运营管理经验。曾任中冶建筑研究总院有限公司项目经理、招商局公路网络科技控股股份有限公司投资经理等。2023 年 5 月加入华夏基金管理有限公司。曾任基础设施与不动产业务部研究员。
莫一帆	本基金的基金经理	2022-04-13	-	11 年	自 2013 年开始从事基础设施与不动产相关的投资和运营管理工作，曾参与深圳市产业园区并购项目、境内仓储物流资产包并购项目、境外高速公路并购项目等，涵盖产业园	学士，具有 5 年以上基础设施投资和运营管理经验。曾任职于招商局资本管理（国际）有限公司、普洛斯投资（上海）有限公司、燕鹏（上海）股权投资基

	理				区、仓储物流、高速公路、数据中心、租赁住房等基础设施类型。	金管理合伙企业（有限合伙）。2021 年 6 月加入华夏基金管理有限公司。
--	---	--	--	--	-------------------------------	---------------------------------------

注：①上述“任职日期”和“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理的，其“任职日期”为基金合同生效日。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

③基础设施项目运营或投资管理年限自基金经理基础设施项目运营或投资起始日期起计算。

6.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》等法律法规和基金合同，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

6.3 管理人对报告期内公平交易制度及执行情况的专项说明

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

6.4 管理人对报告期内基金的投资和运营分析

1.管理人对报告期内基金投资分析

本报告期内，项目公司监管账户开展了协定存款业务和货币基金投资业务。

本基金投资的基础设施项目本期财务情况详见本报告“4.3 基础设施项目运营相关财务信息”；本基金本期预计实现可供分配金额详见本报告“3.3 基金收益分配情况”。

2.管理人对报告期内基金运营分析

(1) 基金运营情况

本报告期内，本基金运营正常，管理人秉承投资者优先的原则审慎开展业务管理，未发生有损投资人利益的风险事件。

(2) 项目公司运营情况

本报告期内，基金管理人和运营管理机构持续关注运营效率，按需调整经营策略，多方协同，致力于提升资产经营业绩、保障畅通运营，为投资人创造良好收益。

1) 全力开展营销宣传工作。为促进嘉通高速车流量恢复，基金管理人和运管机构开展了如下工作：

基金管理人和运管机构在 2024 年上半年开展了多重营销活动，如“寒假研学季”“启航 2024”“畅享武深高速·乐游武功山水”“畅行武深高速、关爱卡友一路”“高速+文旅研学”“战国策”等主题活动。加强对周边国道、工业园、物流园和景区等地区开展引车上路活动。

加强线上宣传营销，一方面进行传统广告宣传，开展 FM94.8、FM92.7、百度地图、楼宇广告等宣传；另一方面通过新媒体，在抖音、快手、小红书等平台上开立账号，发布宣传视频、提供司乘导航直播等，增强广大司乘的认同感，引流车辆上路，进一步提升项目效益。

持续开展“抢收引流”OD 调查活动，获取通行路段 OD 流量数据，有效提升车辆来源分析的效率，为营销工作提供精准价值信息。

2) 做好保通保畅工作，稳定运营高速公路资产。报告期内，湖北省内遭遇多次冰冻雨雪、暴雨等恶劣天气，基金管理人和运营管理机构即时响应、及时处理，保障道路安全畅通。发挥“一路多方”联防联控优势，同时，嘉通高速建立健全恶劣天气预警预报协同联动机制，对全线高边坡路基、重点桥隧和桥涵、排水设施等重点位置进行灾害风险专项巡（检）查。

3) 嘉通高速收费站无人化改造项目正常进展中，本项目 5 个收费站均已完成改造并进入试运营阶段，该系统可以提高收费站通行效率、降低人员成本，初步预计全周期可降低运营管理成本约 1.4 亿元。

6.5 管理人对报告期内基金收益分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金的基金合同等规定，本基金本报告期实施利润分配 2 次，符合相关法规及基金合同的规定。

6.6 管理人对宏观经济及行业走势的简要展望

1. 宏观经济

2024 年上半年，中国经济回升向好，结构分化特征明显。全球经济恢复超乎预期，国际贸易持续复苏，为中国出口带来一定增长。与此同时，国内宏观政策持续发力，效果逐渐显现，新质生产力加快培育，经济增长内生动力逐渐增强，新旧动能转换加速。

(1) 工业生产持续回升向好，制造业走势平稳。2024 年上半年，规模以上工业增加值同比增长 6.0%。6 月制造业 PMI 为 49.5%，连续两个月保持稳定；其中生产分项环比下降 0.2%至 50.6%。

(2) 物流业景气指数环比下降，物流业增势放缓。2024 年 6 月，物流业景气指数环比回落 0.2%至 51.6%，仍维持在 50%以上区间。新订单指数保持扩张，但新增物流需求增势趋稳。

(3) 消费和投资稳步恢复，外贸韧性继续显现。2024 年上半年，社会消费品零售总额同比上升 3.7%，市场销售继续扩大；全国固定资产投资同比增长 3.9%，基建投资延续高增长；我国进出口总值 21.2 万亿元人民币，同比上涨 6.1%。

2024 年上半年经济运行平稳，需求保持稳定增长，带动供给端延续向好态势，恢复基础有望进一步巩固。展望未来经济走势，在市场内生动力企稳以及稳增长政策发力的情况下，供给侧活力进一步释放，有效需求可能走出底部区间，经济总体将持续向潜在增速中枢回归。

2.高速公路行业

2024 年上半年，湖北省交通投资增长势头强劲，全省完成高速公路建设投资 531.0 亿元，同比增长 25.9%。

客运方面，2024 年上半年，湖北省累计实现公路客运量 0.9 亿人，累计同比下降 3.0%；累计实现公路旅客周转量 62.0 亿人公里，累计同比上涨 7.2%，呈现出出行人次和出行里程之间的不同走势。货运方面，2024 年上半年，湖北省累计实现公路货运量 8.6 亿吨，累计同比上涨 7.9%；累计实现公路货物周转量 1,169.5 亿吨公里，累计同比上涨 3.5%，货运量上涨速度显著快于货物周转量上涨速度。

总的来看，2024 年上半年宏观经济平稳发展，工业及进出口贸易超预期，高速行业保持稳定运行。展望下半年，随着外部环境的潜在变化、政策持续聚焦新动能，预计工业景气将延续较快复苏，服务消费仍有韧性，出口趋势性回温，宏观经济增速将持续保持合理增速，若经济持续修复，将利好交通运输行业。

6.7 管理人对关联交易及相关利益冲突的防范措施

针对本基金与基金管理人管理的其他基金，本基金管理人制定了《华夏基金管理有限公司异常交易监控与报告管理办法》《华夏基金管理有限公司公平交易制度》和《华夏基金管理有限公司投资组合参与关联交易管理制度》《华夏基金管理有限公司公开募集基础设施证券投资基金投资管理制度》《华夏基金管理有限公司公开募集基础设施证券投资基金投资风险管理制度》《华夏基金管理有限公司公开募集基础设施证券投资基金项目运营管理制度》《华夏基金管理有限公司公开募集基础设施证券投资基金公平交易制度（试行）》等，从而建立了本基金管理人管理的产品的投资、管理以及风险管控等方面的规则，从投资决策的内部控制、管控利益输送、防范利益冲突和其他内部控制角度，有效防范本基金层面的利益冲

突和关联交易风险，保障基金管理人管理的不同基金之间的公平性。

针对基础设施基金的关联交易事项，基金管理人建立了关联交易审批和检查机制，并严格按照法律法规和中国证监会的有关规定履行关联交易审批程序。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。完善的关联交易决策及审查机制，保障了日常运营管理过程中关联交易的合理性和公允性，充分防范利益冲突。

如原始权益人/运营管理机构为其他同类型基础设施项目提供运营管理服务或持有同类型基础设施项目，运营管理机构在人员、设备配备、管理模式和水平、资源分配、市场地位等方面可能与本基金存在利益冲突。针对上述潜在的利益冲突，本基金采取了以下防范措施：

(1) 基金管理人与运营管理机构签署了《运营管理服务协议》，协议中包含了关于防范利益冲突的相关条款；(2) 原始权益人/运营管理机构已出具了避免同业竞争或利益冲突的承诺函，以保障本基金的利益。

§7 托管人报告

7.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—华夏基金管理有限公司 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

7.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、收益分配等情况的说明

本托管人认为，华夏基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

7.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实性、准确性和完整性发表意见

本托管人认为，华夏基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§8 中期财务报告（未经审计）

8.1 资产负债表

8.1.1 合并资产负债表

会计主体：华夏中国交建高速公路封闭式基础设施证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	8.5.7.1	98,684,329.76	93,604,885.50
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
衍生金融资产		-	-
交易性金融资产	8.5.7.2	32,971,979.71	49,437,917.51
买入返售金融资产	8.5.7.3	-	-
债权投资	8.5.7.4	-	-
其他债权投资	8.5.7.5	-	-
其他权益工具投资	8.5.7.6	-	-
应收票据		-	-
应收账款	8.5.7.7	10,234,052.54	15,758,699.00
应收清算款		-	-
应收利息		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
存货	8.5.7.8	-	-
合同资产	8.5.7.9	-	-
持有待售资产	8.5.7.10	-	-
长期股权投资		-	-
投资性房地产	8.5.7.11	-	-
固定资产	8.5.7.12	450,619.70	53,772.60
在建工程	8.5.7.13	-	-
使用权资产	8.5.7.14	-	-
无形资产	8.5.7.15	10,242,617,615.55	10,337,243,469.99
开发支出	8.5.7.16	-	-
商誉	8.5.7.17	-	-
长期待摊费用	8.5.7.18	2,087,480.16	2,319,422.40
递延所得税资产	8.5.7.19	-	-
其他资产	8.5.7.20	1,861,527.00	886,712.85
资产总计		10,388,907,604.42	10,499,304,879.85

负债和所有者权益		本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款	8.5.7.21	-	-
衍生金融负债		-	-
交易性金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付票据		-	-
应付账款	8.5.7.22	32,412,743.51	33,243,743.51
应付职工薪酬	8.5.7.23	-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		15,088,934.76	23,473,845.44
应付托管费		681,577.86	231,038.68
应付投资顾问费		-	-
应交税费	8.5.7.24	9,199,514.74	7,941,937.57
应付利息	8.5.7.25	-	-
应付利润		-	-
合同负债	8.5.7.26	-	-
持有待售负债		-	-
长期借款	8.5.7.27	1,290,900,000.00	1,290,900,000.00
预计负债	8.5.7.28	66,117,799.66	55,695,543.75
租赁负债	8.5.7.29	-	-
递延收益		-	-
递延所得税负债	8.5.7.19	-	-
其他负债	8.5.7.30	36,225,689.64	27,515,600.20
负债合计		1,450,626,260.17	1,439,001,709.15
所有者权益：			
实收基金	8.5.7.31	9,398,997,794.02	9,398,997,794.02
其他权益工具		-	-
资本公积	8.5.7.32	-	-
其他综合收益	8.5.7.33	-	-
专项储备		-	-
盈余公积	8.5.7.34	-	-
未分配利润	8.5.7.35	-460,716,449.77	-338,694,623.32
所有者权益合计		8,938,281,344.25	9,060,303,170.70
负债和所有者权益总计		10,388,907,604.42	10,499,304,879.85

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 8.9383 元，基金份额总额 1,000,000,000.00 份。

8.1.2 个别资产负债表

会计主体：华夏中国交建高速公路封闭式基础设施证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	8.5.19.1	4,044,847.95	1,288,865.04
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
衍生金融资产		-	-
交易性金融资产		-	-
债权投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收清算款		-	-
应收利息		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
长期股权投资	8.5.19.2	9,398,900,000.00	9,398,900,000.00
其他资产		-	-
资产总计		9,402,944,847.95	9,400,188,865.04
负债和所有者权益		本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
衍生金融负债		-	-
交易性金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		6,815,786.82	2,310,389.56
应付托管费		681,577.86	231,038.68
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
其他负债		74,092.20	149,000.00
负债合计		7,571,456.88	2,690,428.24
所有者权益：			
实收基金		9,398,997,794.02	9,398,997,794.02
资本公积		-	-
其他综合收益		-	-

未分配利润		-3,624,402.95	-1,499,357.22
所有者权益合计		9,395,373,391.07	9,397,498,436.80
负债和所有者权益总计		9,402,944,847.95	9,400,188,865.04

8.2 利润表

8.2.1 合并利润表

会计主体：华夏中国交建高速公路封闭式基础设施证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		202,254,309.71	225,841,267.38
1.营业收入	8.5.7.36	200,732,183.51	224,284,188.15
2.利息收入		629,743.11	1,171,677.42
3.投资收益（损失以“-”号填列）	8.5.7.37	892,383.09	385,401.81
4.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	8.5.7.38	-	-
5.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
6.资产处置收益（损失以“-”号填列）	8.5.7.39	-	-
7.其他收益	8.5.7.40	-	-
8.其他业务收入	8.5.7.41	-	-
二、营业总成本		174,987,433.50	168,688,155.52
1.营业成本	8.5.7.36	130,982,194.79	122,493,334.26
2.利息支出	8.5.7.42	29,285,314.20	29,014,103.47
3.税金及附加	8.5.7.43	1,455,215.86	1,430,390.16
4.销售费用	8.5.7.44	-	-
5.管理费用	8.5.7.45	-	-
6.研发费用		-	-
7.财务费用	8.5.7.46	8,023.54	9,056.60
8.管理人报酬		12,778,545.20	15,104,728.06
9.托管费		450,539.18	459,940.91
10.投资顾问费		-	-
11.信用减值损失	8.5.7.47	-54,113.98	88,131.02
12.资产减值损失	8.5.7.48	-	-
13.其他费用	8.5.7.49	81,714.71	88,471.04
三、营业利润（营业亏损以“-”号填列）		27,266,876.21	57,153,111.86
加：营业外收入	8.5.7.50	341,458.00	161,333.19
减：营业外支出	8.5.7.51	-	-
四、利润总额（亏损总额以“-”号		27,608,334.21	57,314,445.05

填列)			
减：所得税费用	8.5.7.52	-	-
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		27,608,334.21	57,314,445.05
1.持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）		27,608,334.21	57,314,445.05
2.终止经营净利润（净亏损以“-”号填列）		-	-
六、其他综合收益的税后净额		-	-
七、综合收益总额		27,608,334.21	57,314,445.05

8.2.2 个别利润表

会计主体：华夏中国交建高速公路封闭式基础设施证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、收入		152,536,387.18	174,086,921.40
1.利息收入		86,229.18	301,260.40
2.投资收益（损失以“-”号填列）		152,450,158.00	173,785,661.00
其中：以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他业务收入		-	-
二、费用		5,031,272.25	5,134,998.61
1.管理人报酬		4,505,397.26	4,599,410.91
2.托管费		450,539.18	459,940.91
3.投资顾问费		-	-
4.利息支出		-	-
5.信用减值损失		-	-
6.资产减值损失		-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用		75,335.81	75,646.79
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		147,505,114.93	168,951,922.79
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		147,505,114.93	168,951,922.79
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		147,505,114.93	168,951,922.79

8.3 现金流量表

8.3.1 合并现金流量表

会计主体：华夏中国交建高速公路封闭式基础设施证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、经营活动产生的现金流量：			
1.销售商品、提供劳务收到的现金		212,819,888.32	223,438,463.59
2.处置证券投资收到的现金净额		-	-
3.买入返售金融资产净减少额		-	-
4.卖出回购金融资产款净增加额		-	-
5.取得利息收入收到的现金		628,576.05	1,168,483.19
6.收到的税费返还		-	-
7.收到其他与经营活动有关的现金	8.5.7.53.1	452,311.25	164,953.00
经营活动现金流入小计		213,900,775.62	224,771,899.78
8.购买商品、接受劳务支付的现金		48,631,577.38	39,945,060.41
9.取得证券投资支付的现金净额		-	-
10.买入返售金融资产净增加额		-	-
11.卖出回购金融资产款净减少额		-	-
12.支付给职工以及为职工支付的现金		-	-
13.支付的各项税费		12,260,246.13	13,291,153.21
14.支付其他与经营活动有关的现金	8.5.7.53.2	354,792.11	396,474.25
经营活动现金流出小计		61,246,615.62	53,632,687.87
经营活动产生的现金流量净额		152,654,160.00	171,139,211.91
二、投资活动产生的现金流量：			
15.处置固定资产、无形资产和其他长期资产收到的现金净额		-	-
16.处置子公司及其他营业单位收到的现金净额		-	-
17.收到其他与投资活动有关的现金	8.5.7.53.3	87,358,320.89	10,000,000.00
投资活动现金流入小计		87,358,320.89	10,000,000.00
18.购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		412,694.69	-
19.取得子公司及其他营业单位支付的现金净额		-	-
20.支付其他与投资活动有关的现金	8.5.7.53.4	70,000,000.00	-
投资活动现金流出小计		70,412,694.69	-
投资活动产生的现金流量净额		16,945,626.20	10,000,000.00
三、筹资活动产生的现金流量：			

21.认购/申购收到的现金		-	-
22.取得借款收到的现金		-	-
23.收到其他与筹资活动有关的现金	8.5.7.53.5	-	-
筹资活动现金流入小计		-	-
24.赎回支付的现金		-	-
25.偿还借款支付的现金		1,841,666.67	917,222.22
26.偿付利息支付的现金		13,049,681.67	18,187,007.99
27.分配支付的现金		149,630,160.66	166,149,738.75
28.支付其他与筹资活动有关的现金	8.5.7.53.6	-	-
筹资活动现金流出小计		164,521,509.00	185,253,968.96
筹资活动产生的现金流量净额		-164,521,509.00	-185,253,968.96
四、汇率变动对现金及现金等价物的影响		-	-
五、现金及现金等价物净增加额		5,078,277.20	-4,114,757.05
加：期初现金及现金等价物余额		93,604,255.63	95,383,571.58
六、期末现金及现金等价物余额		98,682,532.83	91,268,814.53

8.3.2 个别现金流量表

会计主体：华夏中国交建高速公路封闭式基础设施证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日 至 2023 年 6 月 30 日
一、经营活动产生的现金流量：			
1.收回基础设施投资收到的现金		-	-
2.取得基础设施投资收益收到的现金		152,450,158.00	173,785,661.00
3.处置证券投资收到的现金净额		-	-
4.买入返售金融资产净减少额		-	-
5.卖出回购金融资产款净增加额		-	-
6.取得利息收入收到的现金		85,062.12	298,066.17
7.收到其他与经营活动有关的现金		-	-
经营活动现金流入小计		152,535,220.12	174,083,727.17
8.取得基础设施投资支付的现金		-	-
9.取得证券投资支付的现金净额		-	-
10.买入返售金融资产净增加额		-	-
11.卖出回购金融资产款净减少额		-	-
12.支付的各项税费		-	-
13.支付其他与经营活动有关的现金		150,243.61	120,263.03
经营活动现金流出小计		150,243.61	120,263.03
经营活动产生的现金流量净额		152,384,976.51	173,963,464.14

二、筹资活动产生的现金流量：			
14. 认购/申购收到的现金		-	-
15. 收到其他与筹资活动有关的现金		-	-
筹资活动现金流入小计		-	-
16. 赎回支付的现金		-	-
17. 偿付利息支付的现金		-	-
18. 分配支付的现金		149,630,160.66	166,149,738.75
19. 支付其他与筹资活动有关的现金		-	-
筹资活动现金流出小计		149,630,160.66	166,149,738.75
筹资活动产生的现金流量净额		-149,630,160.66	-166,149,738.75
三、汇率变动对现金及现金等价物的影响			
		-	-
四、现金及现金等价物净增加额			
		2,754,815.85	7,813,725.39
加：期初现金及现金等价物余额		1,288,235.17	6,266,498.50
五、期末现金及现金等价物余额			
		4,043,051.02	14,080,223.89

8.4 所有者权益变动表

8.4.1 合并所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华夏中国交建高速公路封闭式基础设施证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日							
	实收 基金	其他 权益 工具	资本 公积	其他 综合 收益	专项 储备	盈余 公积	未分配 利润	所有者权益 合计
一、上期期末余额	9,398,997,794.02	-	-	-	-	-	-338,694,623.32	9,060,303,170.70
加：会计政策变更	-	-	-	-	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-	-	-	-	-
同一控制下企业合并	-	-	-	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-	-	-	-
二、本期期初余额	9,398,997,794.02	-	-	-	-	-	-338,694,623.32	9,060,303,170.70
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-	-	-	-	-	-	-122,021,826.45	-122,021,826.45
(一) 综合收益总额	-	-	-	-	-	-	27,608,334.21	27,608,334.21
(二) 产品持有人申购和赎回	-	-	-	-	-	-	-	-
其中：产品申购	-	-	-	-	-	-	-	-
产品赎回	-	-	-	-	-	-	-	-
(三) 利润分配	-	-	-	-	-	-	-149,630,160.66	-149,630,160.66
(四) 其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-	-	-	-	-

(五) 专项储备	-	-	-	-	-	-	-	-
其中：本期提取	-	-	-	-	-	-	-	-
本期使用	-	-	-	-	-	-	-	-
(六) 其他	-	-	-	-	-	-	-	-
四、本期期末余额	9,398,997,794.02	-	-	-	-	-	-460,716,449.77	8,938,281,344.25
项目	上年度可比期间							
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日							
	实收 基金	其他 权益 工具	资本 公积	其他 综合 收益	专项 储备	盈余 公积	未分配 利润	所有者权益 合计
一、上期期末余额	9,398,997,794.02	-	-	-	-	-	-123,944,119.47	9,275,053,674.55
加：会计政策变更	-	-	-	-	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-	-	-	-	-
同一控制下企业 合并	-	-	-	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-	-	-	-
二、本期期初余额	9,398,997,794.02	-	-	-	-	-	-123,944,119.47	9,275,053,674.55
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-	-	-	-	-	-	-108,835,293.70	-108,835,293.70
(一) 综合收益总额	-	-	-	-	-	-	57,314,445.05	57,314,445.05
(二) 产品持有人申 购和赎回	-	-	-	-	-	-	-	-
其中：产品申购	-	-	-	-	-	-	-	-
产品赎回	-	-	-	-	-	-	-	-
(三) 利润分配	-	-	-	-	-	-	-166,149,738.75	-166,149,738.75
(四) 其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-	-	-	-	-
(五) 专项储备	-	-	-	-	-	-	-	-
其中：本期提取	-	-	-	-	-	-	-	-
本期使用	-	-	-	-	-	-	-	-
(六) 其他	-	-	-	-	-	-	-	-
四、本期期末余额	9,398,997,794.02	-	-	-	-	-	-232,779,413.17	9,166,218,380.85

8.4.2 个别所有者权益变动表

会计主体：华夏中国交建高速公路封闭式基础设施证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期				
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日				
	实收 基金	资本 公积	其他 综合 收益	未分配 利润	所有者权益 合计
一、上期期末余额	9,398,997,794.02	-	-	-1,499,357.22	9,397,498,436.80

加：会计政策变更	-	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
二、本期期初余额	9,398,997,794.02	-	-	-1,499,357.22	9,397,498,436.80
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-	-	-	-2,125,045.73	-2,125,045.73
(一) 综合收益总额	-	-	-	147,505,114.93	147,505,114.93
(二) 产品持有人申 购和赎回	-	-	-	-	-
其中：产品申购	-	-	-	-	-
产品赎回	-	-	-	-	-
(三) 利润分配	-	-	-	-149,630,160.66	-149,630,160.66
(四) 其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-	-
(五) 其他	-	-	-	-	-
四、本期期末余额	9,398,997,794.02	-	-	-3,624,402.95	9,395,373,391.07
项目	上年度可比期间				
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日				
	实收 基金	资本 公积	其他 综合收益	未分配 利润	所有者权益 合计
一、上期期末余额	9,398,997,794.02	-	-	-1,415,293.02	9,397,582,501.00
加：会计政策变更	-	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
二、本期期初余额	9,398,997,794.02	-	-	-1,415,293.02	9,397,582,501.00
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-	-	-	2,802,184.04	2,802,184.04
(一) 综合收益总额	-	-	-	168,951,922.79	168,951,922.79
(二) 产品持有人申 购和赎回	-	-	-	-	-
其中：产品申购	-	-	-	-	-
产品赎回	-	-	-	-	-
(三) 利润分配	-	-	-	-166,149,738.75	-166,149,738.75
(四) 其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-	-
(五) 其他	-	-	-	-	-
四、本期期末余额	9,398,997,794.02	-	-	1,386,891.02	9,400,384,685.04

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 8.1 至 8.5，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：张佑君 主管会计工作负责人：朱威 会计机构负责人：朱威

8.5 报表附注

8.5.1 基金基本情况

华夏中国交建高速公路封闭式基础设施证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2022]600 号文《关于准予华夏中国交建高速公路封闭式基础设施证券投资基金注册的批复》，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《华夏中国交建高速公路封闭式基础设施证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为契约型封闭式，存续期限为 40 年，本基金自 2022 年 4 月 7 日至 2022 年 4 月 8 日共募集 9,398,997,794.02 元（不含认购资金利息），业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明验字（2022）第 60739337_A29 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏中国交建高速公路封闭式基础设施证券投资基金基金合同》于 2022 年 4 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,000,000,000.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和本基金基金合同的有关规定，本基金存续期内以 80%以上基金资产投资于收费公路类基础设施资产支持专项计划，并将优先投资于以中国交通建设股份有限公司或其关联方拥有或推荐的优质收费公路基础设施项目为投资标的的资产支持专项计划，并持有资产支持专项计划的全部资产支持证券份额，从而取得基础设施项目经营权利。本基金的其余基金资产应当依法投资于利率债（国债、政策性金融债、央行票据、地方政府债）、AAA 级信用债（企业债、公司债、金融债、中期票据、短期融资券、超短期融资债券、公开发行的次级债、可分离交易可转债的纯债部分）或货币市场工具（债券回购、银行存款、同业存单等）。

本基金不投资于股票等权益类资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于基础设施资产支持证券的资产比例不低于基金资产的 80%。但因基础设施项目出售、按照扩募方案实施扩募收购时收到扩募资金但尚未完成基础设施项目购入、资产支持证券或基础设施资产公允价值减少、资产支持证券收益分配及中国证监会认可的其他因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的不属于违反投资比例限制；因除上述原因以外的其他原因导致不满足上述比例限制的，基金管理人应在 60 个工作日内调整。

8.5.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 8.5.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

8.5.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则及其他有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金本报告期末的合并及个别财务状况以及本报告期间的合并及个别经营成果和现金流量等有关信息。

8.5.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

8.5.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

8.5.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

8.5.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

8.5.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

8.5.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55 号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

企业所得税税率为 25%，税基为应纳税所得额；

增值税税率为 13%、5% 及 3%，税基为应纳税增值额（一般计税方式：应纳税额按应纳税销售额乘以适用税率扣除当期允许抵扣的进项税后的余额计算；简易计税方式：应纳税额按应纳税销售额乘以征收率计算）；

城市维护建设税税率为 7%，税基为缴纳的增值税税额；

教育费附加税率为 3%，税基为缴纳的增值税税额；

地方教育费附加税率为 2%，税基为缴纳的增值税税额；

（1）资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

根据财政部和国家税务总局《财政部国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》（财税[2016]36 号）规定，项目公司作为公路经营企业中的一般纳税人收取试点前开工的高速公路的车辆通行费，可以选择适用简易计税方法，减按 3% 的征收率计算应纳税额。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

（2）本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

（3）资产支持专项计划及本基金以契约形式的形式存在，其并非企业所得税纳税主体，其从项目公司取得的利息收入或投资收益及分红无需缴纳企业所得税。项目公司按《中华人民共和国企业所得税法》计算及缴纳企业所得税，所得税率为 25%。

8.5.7 合并财务报表重要项目的说明

8.5.7.1 货币资金

8.5.7.1.1 货币资金情况

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
库存现金	-
银行存款	98,684,329.76
其他货币资金	-

小计	98,684,329.76
减：减值准备	-
合计	98,684,329.76

8.5.7.1.2 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	98,682,532.83
定期存款	-
其中：存款期限 1—3 个月	-
其他存款	-
应计利息	1,796.93
小计	98,684,329.76
减：减值准备	-
合计	98,684,329.76

8.5.7.1.3 因抵押、质押或冻结等对使用有限制、有潜在回收风险的款项说明

无。

8.5.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

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小计			
项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
债券	-	-	-
其中：交易所市场	-	-	-
银行间市场	-	-	-
货币基金投资	32,971,979.71	32,971,979.71	-
资产支持证券	-	-	-
其他	-	-	-
小计	32,971,979.71	32,971,979.71	-
指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产小计			
项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
债券	-	-	-
其中：交易所市场	-	-	-
银行间市场	-	-	-
资产支持证券	-	-	-
其他	-	-	-

小计	-	-	-
合计	32,971,979.71	32,971,979.71	-

8.5.7.3 买入返售金融资产

8.5.7.3.1 买入返售金融资产情况

无。

8.5.7.3.2 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

8.5.7.4 债权投资

8.5.7.4.1 债权投资情况

无。

8.5.7.4.2 债权投资减值准备计提情况

无。

8.5.7.5 其他债权投资

8.5.7.5.1 其他债权投资情况

无。

8.5.7.5.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

8.5.7.6 其他权益工具投资

8.5.7.6.1 其他权益工具投资情况

无。

8.5.7.6.2 报告期内其他权益工具投资情况

无。

8.5.7.7 应收账款

8.5.7.7.1 按账龄披露应收账款

单位：人民币元

账龄	本期末 2024年6月30日
1年以内	10,334,295.20
1—2年	-
小计	10,334,295.20
减：坏账准备	100,242.66
合计	10,234,052.54

8.5.7.7.2 按坏账准备计提方法分类披露

金额单位：人民币元

类别	本期末 2024 年 6 月 30 日				账面价值
	账面余额		坏账准备		
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)	
单项计提预期信用损失的应收账款	-	-	-	-	-
按组合计提预期信用损失的应收账款	10,334,295.20	100.00	100,242.66	0.97	10,234,052.54
合计	10,334,295.20	100.00	100,242.66	0.97	10,234,052.54

8.5.7.7.3 单项计提坏账准备的应收账款

无。

8.5.7.7.4 按组合计提坏账准备的应收账款

金额单位：人民币元

债务人名称	本期末 2024 年 6 月 30 日		
	账面余额	坏账准备	计提比例 (%)
湖北省高速公路联网收费中心	10,334,295.20	100,242.66	0.97
合计	10,334,295.20	100,242.66	0.97

8.5.7.7.5 本期坏账准备的变动情况

单位：人民币元

类别	上年度末 2023 年 12 月 31 日	本期变动金额				本期末 2024 年 6 月 30 日
		计提	转回或收回	核销	其他变动	
单项计提预期信用损失的应收账款	-	-	-	-	-	-
按组合计提预期信用损失的应收账款	154,356.64	-	54,113.98	-	-	100,242.66
合计	154,356.64	-	54,113.98	-	-	100,242.66

本期坏账准备发生重要转回或收回的应收账款情况

债务人名称	转回或收回金额	转回或收回方式	备注
湖北省高速公路联网收费中心	44,403.35	已收回款项	-
中国石化销售股份有限公司湖北咸宁石油分公司	9,710.63	已收回款项	-
合计	54,113.98	-	-

8.5.7.7.6 本期实际核销的应收账款情况

无。

8.5.7.7.7 按债务人归集的报告期末余额前五名的应收账款

金额单位：人民币元

债务人名称	账面余额	占应收账款期末余额的比例 (%)	已计提坏账准备	账面价值
湖北省高速公路联网收费中心	10,334,295.20	100.00	100,242.66	10,234,052.54
合计	10,334,295.20	100.00	100,242.66	10,234,052.54

8.5.7.8 存货

8.5.7.8.1 存货分类

无。

8.5.7.8.2 存货跌价准备及合同履约成本减值准备

无。

8.5.7.8.3 报告期末存货余额含借款费用资本化金额的说明

无。

8.5.7.8.4 报告期内合同履约成本摊销金额的说明

无。

8.5.7.9 合同资产

8.5.7.9.1 合同资产情况

无。

8.5.7.9.2 报告期内合同资产账面价值发生重大变动的金额和原因

无。

8.5.7.9.3 报告期内合同资产计提减值准备情况

无。

按预期信用损失一般模型计提减值准备的注释或说明

无。

8.5.7.10 持有待售资产

无。

8.5.7.11 投资性房地产

8.5.7.11.1 采用成本计量模式的投资性房地产

无。

8.5.7.11.2 采用公允价值计量模式的投资性房地产

无。

8.5.7.11.3 投资性房地产主要项目情况

无。

8.5.7.12 固定资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
固定资产	450,619.70
固定资产清理	-
合计	450,619.70

8.5.7.12.1 固定资产情况

单位：人民币元

项目	房屋及建筑物	机器设备	运输工具	电子设备	合计
一、账面原值					
1. 期初余额	-	-	542,889.26	566,208.00	1,109,097.26
2. 本期增加金额	-	-	412,694.69	-	412,694.69
购置	-	-	412,694.69	-	412,694.69
在建工程转入	-	-	-	-	-
其他原因增加	-	-	-	-	-
3. 本期减少金额	-	-	-	-	-
处置或报废	-	-	-	-	-
其他原因减少	-	-	-	-	-
4. 期末余额	-	-	955,583.95	566,208.00	1,521,791.95
二、累计折旧					
1. 期初余额	-	-	542,889.26	512,435.40	1,055,324.66
2. 本期增加金额	-	-	6,878.25	8,969.34	15,847.59
本期计提	-	-	6,878.25	8,969.34	15,847.59
其他原因增加	-	-	-	-	-
3. 本期减少金额	-	-	-	-	-
处置或报废	-	-	-	-	-
其他原因减少	-	-	-	-	-
4. 期末余额	-	-	549,767.51	521,404.74	1,071,172.25
三、减值准备					
1. 期初余额	-	-	-	-	-
2. 本期增加金额	-	-	-	-	-
本期计提	-	-	-	-	-
其他原因增加	-	-	-	-	-
3. 本期减少金额	-	-	-	-	-

处置或报废	-	-	-	-	-
其他原因减少	-	-	-	-	-
4. 期末余额	-	-	-	-	-
四、账面价值					
1. 期末账面价值	-	-	405,816.44	44,803.26	450,619.70
2. 期初账面价值	-	-	0.00	53,772.60	53,772.60

8.5.7.12.2 固定资产的其他说明

无。

8.5.7.12.3 固定资产清理

无。

8.5.7.13 在建工程

无。

8.5.7.13.1 在建工程情况

无。

8.5.7.13.2 报告期内重要在建工程项目变动情况

无。

8.5.7.13.3 报告期内在建工程计提减值准备情况

无。

8.5.7.13.4 工程物资情况

无。

8.5.7.14 使用权资产

无。

8.5.7.15 无形资产

8.5.7.15.1 无形资产情况

单位：人民币元

项目	特许经营权	土地使用权	专利权	非专有技术	合计
一、账面原值					
1. 期初余额	11,282,264,122.23	-	-	-	11,282,264,122.23
2. 本期增加金额	-	-	-	-	-
购置	-	-	-	-	-
内部研发	-	-	-	-	-
其他原因增加	-	-	-	-	-
3. 本期减少金额	-	-	-	-	-
处置	-	-	-	-	-
其他原因减少	-	-	-	-	-

4. 期末余额	11,282,264,122.23	-	-	-	11,282,264,122.23
二、累计摊销					
1. 期初余额	945,020,652.24	-	-	-	945,020,652.24
2. 本期增加金额	94,625,854.44	-	-	-	94,625,854.44
本期计提	94,625,854.44	-	-	-	94,625,854.44
其他原因增加	-	-	-	-	-
3. 本期减少金额	-	-	-	-	-
处置	-	-	-	-	-
其他原因减少	-	-	-	-	-
4. 期末余额	1,039,646,506.68	-	-	-	1,039,646,506.68
三、减值准备					
1. 期初余额	-	-	-	-	-
2. 本期增加金额	-	-	-	-	-
本期计提	-	-	-	-	-
其他原因增加	-	-	-	-	-
3. 本期减少金额	-	-	-	-	-
处置	-	-	-	-	-
其他原因减少	-	-	-	-	-
4. 期末余额	-	-	-	-	-
四、账面价值					
1. 期末账面价值	10,242,617,615.55	-	-	-	10,242,617,615.55
2. 期初账面价值	10,337,243,469.99	-	-	-	10,337,243,469.99

8.5.7.15.2 无形资产的其他说明

无。

8.5.7.16 开发支出

无。

8.5.7.17 商誉

8.5.7.17.1 商誉账面原值

无。

8.5.7.17.2 商誉减值准备

无。

8.5.7.17.3 商誉减值测试过程、关键参数及商誉减值损失的确认方法

无。

8.5.7.18 长期待摊费用

单位：人民币元

项目	期初余额	本期增加金额	本期摊销金额	本期其他减少金额	期末余额
专项工程支出	2,319,422.40	-	231,942.24	-	2,087,480.16

合计	2,319,422.40	-	231,942.24	-	2,087,480.16
----	--------------	---	------------	---	--------------

8.5.7.19 递延所得税资产和递延所得税负债

8.5.7.19.1 未经抵销的递延所得税资产

无。

8.5.7.19.2 未经抵销的递延所得税负债

无。

8.5.7.19.3 以抵销后净额列示的递延所得税资产或负债

无。

8.5.7.19.4 未确认递延所得税资产的可抵扣暂时性差异明细

无。

8.5.7.19.5 未确认递延所得税资产的可抵扣亏损将于以下年度到期

无。

8.5.7.20 其他资产

8.5.7.20.1 其他资产情况

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
预付款项	1,811,527.00
其他应收款	50,000.00
合计	1,861,527.00

8.5.7.20.2 预付账款

8.5.7.20.2.1 按账龄列示

单位：人民币元

账龄	本期末 2024年6月30日
1年以内	1,811,527.00
1—2年	-
合计	1,811,527.00

8.5.7.20.2.2 按预付对象归集的报告期末余额前五名的预付款情况

金额单位：人民币元

预付对象	期末余额	占预付账款总额的比例 (%)	预付款时间	未结算原因
中国平安财产保险股份有限公司湖北分公司	1,664,027.00	91.86	2024-05-16	未满足扣回条件

国网湖北省电力有限公司	147,500.00	8.14	2024-06-11	未满足扣回条件
合计	1,811,527.00	100.00		

8.5.7.20.3 其他应收款

8.5.7.20.3.1 按账龄列示

单位：人民币元

账龄	本期末 2024年6月30日
1年以内	50,000.00
1-2年	-
小计	50,000.00
减：坏账准备	-
合计	50,000.00

8.5.7.20.3.2 按款项性质分类情况

单位：人民币元

款项性质	本期末 2024年6月30日
备用金	50,000.00
小计	50,000.00
减：坏账准备	-
合计	50,000.00

8.5.7.20.3.3 其他应收款坏账准备计提情况

无。

本期发生坏账准备显著变动的其他应收款情况说明：

无。

本期计算坏账准备计提金额与评估金融工具信用风险是否显著增加的依据：

无。

本期坏账准备发生重要转回或收回的其他应收款情况

无。

8.5.7.20.3.4 报告期内实际核销的其他应收款情况

其中，重要的其他应收款核销情况：

无。

8.5.7.20.3.5 按债务人归集的报告期末余额前五名的其他应收款

金额单位：人民币元

债务人名称	账面余额	占其他应收款期末余额的比例 (%)	已计提坏账准备	账面价值
个人 1	16,000.00	32.00	-	16,000.00
个人 2	9,000.00	18.00	-	9,000.00
个人 3	8,000.00	16.00	-	8,000.00
个人 4	6,000.00	12.00	-	6,000.00
个人 5	6,000.00	12.00	-	6,000.00
合计	45,000.00	90.00	-	45,000.00

8.5.7.21 短期借款

无。

8.5.7.22 应付账款

8.5.7.22.1 应付账款情况

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付工程款及运营支出	32,412,743.51
合计	32,412,743.51

8.5.7.22.2 账龄超过一年的重要应付账款

单位：人民币元

单位名称	期末余额	未偿还或结转原因
北京水规院京华工程管理有限公司	997,754.15	应付工程保留金未到付款期
北京中交公路桥梁工程监理有限公司	684,960.00	应付工程保留金未到付款期
北京兴通工程咨询有限公司	463,305.00	应付工程保留金未到付款期
中交基础设施养护集团有限公司	414,928.00	应付工程保留金未到付款期
重庆中字工程咨询监理有限责任公司	350,309.30	应付工程保留金未到付款期
合计	2,911,256.45	—

8.5.7.23 应付职工薪酬

8.5.7.23.1 应付职工薪酬情况

无。

8.5.7.23.2 短期薪酬

无。

8.5.7.23.3 设定提存计划

无。

8.5.7.24 应交税费

单位：人民币元

税费项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
增值税	8,207,122.57
消费税	-
企业所得税	-
个人所得税	-
城市维护建设税	574,498.58
教育费附加	410,356.12
房产税	-
土地使用税	-
土地增值税	-
印花税	7,537.47
其他	-
合计	9,199,514.74

8.5.7.25 应付利息

无。

8.5.7.26 合同负债

8.5.7.26.1 合同负债情况

无。

8.5.7.26.2 报告期内合同负债账面价值发生重大变动的金额和原因

无。

8.5.7.27 长期借款

单位：人民币元

借款类别	本期末 2024 年 6 月 30 日
质押借款	1,290,900,000.00
抵押借款	-
保证借款	-
信用借款	-
未到期应付利息	-
合计	1,290,900,000.00

注：截至本报告期末，借款总额为 1,295,558,333.33 元，其中将于未来一年内偿还的金额为 4,658,333.33 元，已列示于一年内到期的非流动负债，详见报表附注 8.5.7.30.1。

8.5.7.28 预计负债

单位：人民币元

项目	期初余额	本期增加金额	本期减少金额	期末余额	形成原因及经济利益流出不确定性的说明

未决诉讼	-	-	-	-	-
大修基金	55,695,543.75	10,422,255.91	-	66,117,799.66	大修费用计提为大修基金的储备款项
其他	-	-	-	-	-
合计	55,695,543.75	10,422,255.91	-	66,117,799.66	—

8.5.7.29 租赁负债

无。

8.5.7.30 其他负债

8.5.7.30.1 其他负债情况

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
预收款项	459,562.85
其他应付款	19,403,976.04
一年内到期的非流动负债	16,288,058.55
其他流动负债	74,092.20
合计	36,225,689.64

8.5.7.30.2 预收款项

8.5.7.30.2.1 预收款项情况

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
预收租赁款	459,562.85
合计	459,562.85

8.5.7.30.2.2 账龄超过一年的重要预收款项

无。

8.5.7.30.3 其他应付款

8.5.7.30.3.1 按款项性质列示的其他应付款

单位：人民币元

款项性质	本期末 2024 年 6 月 30 日
押金及保证金	450,160.37
保险理赔款	15,231,231.60
其他	3,722,584.07
合计	19,403,976.04

8.5.7.30.3.2 账龄超过一年的重要其他应付款

单位：人民币元

债权人名称	期末余额	未偿还或结转的原因
湖北兴达路桥公司等保险赔付款	15,231,231.60	未到付款时点
合计	15,231,231.60	—

8.5.7.31 实收基金

金额单位：人民币元

项目	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,000,000,000.00	9,398,997,794.02
本期认购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,000,000,000.00	9,398,997,794.02

8.5.7.32 资本公积

无。

8.5.7.33 其他综合收益

无。

8.5.7.34 盈余公积

无。

8.5.7.35 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	合计
上年度末	-338,694,623.32	-	-338,694,623.32
本期利润	27,608,334.21	-	27,608,334.21
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金认购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-149,630,160.66	-	-149,630,160.66
本期末	-460,716,449.77	-	-460,716,449.77

8.5.7.36 营业收入和营业成本

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	武汉至深圳高速公路嘉鱼至通城段项目	合计
营业收入	-	-
通行费收入	198,864,299.29	198,864,299.29
其他	1,867,884.22	1,867,884.22
合计	200,732,183.51	200,732,183.51
营业成本	-	-
折旧与摊销	94,873,644.27	94,873,644.27

运营服务费	21,837,550.63	21,837,550.63
其他	14,270,999.89	14,270,999.89
合计	130,982,194.79	130,982,194.79

8.5.7.37 投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
货币基金收益	892,383.09
合计	892,383.09

8.5.7.38 公允价值变动收益

无。

8.5.7.39 资产处置收益

无。

8.5.7.40 其他收益

无。

8.5.7.41 其他业务收入

无。

8.5.7.42 利息支出

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
短期借款利息支出	-
长期借款利息支出	29,285,314.20
卖出回购金融资产利息支出	-
其他	-
合计	29,285,314.20

8.5.7.43 税金及附加

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
增值税	-
消费税	-
企业所得税	-
个人所得税	-
城市维护建设税	844,382.50
教育费附加	603,130.37

房产税	-
土地使用税	-
土地增值税	-
印花税	7,702.99
其他	-
合计	1,455,215.86

8.5.7.44 销售费用

无。

8.5.7.45 管理费用

无。

8.5.7.46 财务费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
银行手续费	8,023.54
其他	-
合计	8,023.54

8.5.7.47 信用减值损失

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
债权投资减值损失	-
应收账款坏账损失	-54,113.98
其他应收款坏账损失	-
其他	-
合计	-54,113.98

8.5.7.48 资产减值损失

无。

8.5.7.49 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
信息披露费	59,672.34
审计费	14,419.86
其他	7,622.51
合计	81,714.71

8.5.7.50 营业外收入

8.5.7.50.1 营业外收入情况

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
非流动资产报废利得合计	-
其中：固定资产报废利得	-
无形资产报废利得	-
政府补助	-
保险赔款收入	341,458.00
其他	-
合计	341,458.00

8.5.7.50.2 计入当期损益的政府补助

无。

8.5.7.51 营业外支出

无。

8.5.7.52 所得税费用

8.5.7.52.1 所得税费用情况

无。

8.5.7.52.2 会计利润与所得税费用调整过程

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
利润总额	27,608,334.21
按法定/适用税率计算的所得税费用	-
子公司适用不同税率的影响	-37,480,989.69
调整以前期间所得税的影响	-
非应税收入的影响	-
不可抵扣的成本、费用和损失的影响	-
使用前期未确认递延所得税资产的可抵扣亏损的影响	-
本期未确认递延所得税资产的可抵扣暂时性差异或可抵扣亏损的影响	37,480,989.69
合计	-

8.5.7.53 现金流量表附注

8.5.7.53.1 收到其他与经营活动有关的现金

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日

保险赔款收入	341,458.00
其他	110,853.25
合计	452,311.25

8.5.7.53.2 支付其他与经营活动有关的现金

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费	58,000.00
信息披露费	120,000.00
银行手续费	8,023.54
其他	168,768.57
合计	354,792.11

8.5.7.53.3 收到其他与投资活动有关的现金

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
赎回货币基金	87,358,320.89
合计	87,358,320.89

8.5.7.53.4 支付其他与投资活动有关的现金

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
申购货币基金	70,000,000.00
合计	70,000,000.00

8.5.7.53.5 收到其他与筹资活动有关的现金

无。

8.5.7.53.6 支付其他与筹资活动有关的现金

无。

8.5.7.54 现金流量表补充资料

8.5.7.54.1 现金流量表补充资料

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1. 将净利润调节为经营活动现金流量	
净利润	27,608,334.21
加：信用减值损失	-54,113.98
资产减值损失	-

固定资产折旧	15,847.59
投资性房地产折旧	-
使用权资产折旧	-
无形资产摊销	94,625,854.44
长期待摊费用摊销	231,942.24
处置固定资产、无形资产和其他长期资产的损失（收益以“-”号填列）	-
固定资产报废损失（收益以“-”号填列）	-
公允价值变动损失（收益以“-”号填列）	-
财务费用（收益以“-”号填列）	29,285,314.20
投资损失（收益以“-”号填列）	-892,383.09
递延所得税资产减少（增加以“-”号填列）	-
递延所得税负债增加（减少以“-”号填列）	-
存货的减少（增加以“-”号填列）	-
经营性应收项目的减少（增加以“-”号填列）	4,602,779.23
经营性应付项目的增加（减少以“-”号填列）	-2,769,414.84
其他	-
经营活动产生的现金流量净额	152,654,160.00
2. 不涉及现金收支的重大投资和筹资活动	
债务转为资本	-
融资租入固定资产	-
3. 现金及现金等价物净变动情况	
现金的期末余额	98,682,532.83
减：现金的期初余额	93,604,255.63
加：现金等价物的期末余额	-
减：现金等价物的期初余额	-
现金及现金等价物净增加额	5,078,277.20

8.5.7.54.2 报告期内支付的取得子公司的现金净额

无。

8.5.7.54.3 现金和现金等价物的构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
一、现金	98,682,532.83
其中：库存现金	-
可随时用于支付的银行存款	98,682,532.83
可随时用于支付的其他货币资金	-
二、现金等价物	-
其中：3 个月内到期的债券投资	-
三、期末现金及现金等价物余额	98,682,532.83
其中：基金或集团内子公司使用受限制的现金及现金等价物	-

8.5.7.55 所有者权益变动表项目注释

无。

8.5.8 合并范围的变更

8.5.8.1 非同一控制下企业合并

8.5.8.1.1 报告期内发生的非同一控制下企业合并

无。

8.5.8.1.2 合并成本及商誉

8.5.8.1.2.1 合并成本及商誉情况

无。

8.5.8.1.2.2 合并成本公允价值的确定方法、或有对价及其变动的说明

无。

8.5.8.1.2.3 大额商誉形成的主要原因

无。

8.5.8.1.3 被购买方于购买日可辨认资产、负债

8.5.8.1.3.1 被购买方于购买日可辨认资产、负债的情况

无。

8.5.8.1.3.2 可辨认资产、负债公允价值的确定方法

无。

8.5.8.1.3.3 企业合并中承担的被购买方的或有负债

无。

8.5.8.2 同一控制下企业合并

8.5.8.2.1 报告期内发生的同一控制下企业合并

无。

8.5.8.2.2 合并成本

无。

8.5.8.2.3 或有对价及其变动的说明

无。

8.5.8.2.4 合并日被合并方资产、负债的账面价值

无。

8.5.8.2.5 企业合并中承担的被合并方的或有负债的说明

无。

8.5.8.3 反向购买

无。

8.5.8.4 其他

无。

8.5.9 集团的构成

子公司名称	主要经营地	注册地	业务性质	持股比例（%）		取得方式
				直接	间接	
中信证券-中交投资高速公路 1 号资产支持专项计划	北京	北京	资产支持计划	100.00	-	认购
湖北中交嘉通高速公路发展有限公司	咸宁市	咸宁市	高速公路运营	-	100.00	收购

8.5.10 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

8.5.11 承诺事项、或有事项、资产负债表日后事项的说明

8.5.11.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无承诺事项。

8.5.11.2 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

8.5.11.3 资产负债表日后事项

根据本基金管理人于 2024 年 8 月 15 日发布的分红公告，本基金向 2024 年 8 月 19 日在本基金登记结算机构登记在册的基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.6085 元。

8.5.12 关联方关系

8.5.12.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

8.5.12.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司（“华夏基金”）	基金管理人
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、资产支持证券托管人
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东、资产支持证券管理人
中交投资有限公司（“中交投资”）	外部管理机构、原始权益人、持有本基金 10% 以上基金份额的份额持有人
中交投资(湖北)运营管理有限公司（“中交投资湖北运营”）	外部管理机构
中交第二航务工程局有限公司（“中交二航局”）	原始权益人
中交第二公路勘察设计研究院有限公司（“中交二公院”）	原始权益人
中交资本控股有限公司（“中交资本”）	原始权益人之一致行动人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

8.5.13 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

8.5.13.1 关联采购与销售情况

8.5.13.1.1 采购商品、接受劳务情况

单位：人民币元

关联方名称	关联交易内容	本期	上年度可比期间
		2024年1月1日至2024年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日
中交投资湖北运营	运营服务费	21,837,550.63	19,980,610.03
合计	—	21,837,550.63	19,980,610.03

8.5.13.1.2 出售商品、提供劳务情况

无。

8.5.13.2 关联租赁情况

8.5.13.2.1 作为出租方

无。

8.5.13.2.2 作为承租方

无。

8.5.13.3 通过关联方交易单元进行的交易

8.5.13.3.1 债券交易

无。

8.5.13.3.2 债券回购交易

无。

8.5.13.3.3 基金交易

无。

8.5.13.3.4 应支付关联方的佣金

无。

8.5.13.4 关联方报酬

8.5.13.4.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	12,778,545.20	15,104,728.06
其中：固定管理费	4,505,397.26	4,599,410.91
浮动管理费	8,273,147.94	10,505,317.15
支付销售机构的客户维护费	803.57	859.45

注：①固定管理费包括基金管理人管理费和资产支持证券管理人管理费，以 0.1% 的总年费率按日计提，计算方法如下：

每日应计提的固定管理费=已披露的前一个估值日的基金资产净值（首个估值日及首个估值日之前，以基金募集资金规模为基数）×0.1%/当年天数。

②浮动管理费是运营管理机构运营管理费，以 6% 的年费率按年计提，计算方法如下：

每年度应计提的浮动管理费=基础设施资产净收入（首次计提时不满一年的，为项目公司股权交割日起至当年度最后一日期间的基础设施资产净收入）×6%。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

8.5.13.4.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	450,539.18	459,940.91

注：基金托管费以 0.01% 的年费率按日计提，计算方法如下：

每日应计提的基金托管费=已披露的前一个估值日的基金资产净值（首个估值日及首个估值日之前，以基金募集资金规模为基数）×0.01%/当年天数。

8.5.13.5 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

8.5.13.6 各关联方投资本基金的情况

8.5.13.6.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日
期初持有的基金份额	5,064,268.00	-
期间申购/买入总份额	-	2,178,365.00
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	5,064,268.00	2,178,365.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.51%	0.22%

8.5.13.6.2 报告期内除基金管理人外其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

本期							
2024年1月1日至2024年6月30日							
关联方名称	期初持有		期间申购/买入份额	期间因拆分变动份额	减：期间赎回/卖出份额	期末持有	
	份额	比例				份额	比例
中交投资	127,692,680.00	12.77%	1,239,327.00	-	-	128,932,007.00	12.89%
中交二航局	64,135,118.00	6.41%	679,804.00	-	-	64,814,922.00	6.48%
中交二公院	20,000,000.00	2.00%	-	-	-	20,000,000.00	2.00%
中交资本	12,269,419.00	1.23%	-	-	-	12,269,419.00	1.23%
中信证券	23,509,239.00	2.35%	40,667,777.00	-	40,427,302.00	23,749,714.00	2.37%
合计	247,606,456.00	24.76%	42,586,908.00	-	40,427,302.00	249,766,062.00	24.98%
上年度可比期间							
2023年1月1日至2023年6月30日							
关联方名称	期初持有		期间申购/买入份额	期间因拆分变动份额	减：期间赎回/卖出份额	期末持有	
	份额	比例				份额	比例
中交投资	120,000,000.00	12.00%	-	-	-	120,000,000.00	12.00%
中交二航局	60,000,000.00	6.00%	-	-	-	60,000,000.00	6.00%
中交二公院	20,000,000.00	2.00%	-	-	-	20,000,000.00	2.00%
中交资本	1,731,078.00	0.17%	10,538,341.00	-	-	12,269,419.00	1.23%
中信证券	24,141,342.00	2.41%	2,613,175.00	-	2,672,678.00	24,081,839.00	2.41%
合计	225,872,420.00	22.59%	13,151,516.00	-	2,672,678.00	236,351,258.00	23.64%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的相关费用符合基金招募说明书、交易所、登记结算机构的有关规定。

8.5.13.7 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行活期存款	15,242,024.02	237,158.40	40,700,082.56	710,871.57
合计	15,242,024.02	237,158.40	40,700,082.56	710,871.57

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

8.5.13.8 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

8.5.13.9 其他关联交易事项的说明

无。

8.5.14 关联方应收应付款项

8.5.14.1 应收项目

无。

8.5.14.2 应付项目

单位：人民币元

项目名称	关联方名称	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
应付管理人报酬	中交投资湖北运营	8,273,147.94	21,163,455.88
应付管理人报酬	华夏基金	5,452,628.36	1,848,311.28
应付管理人报酬	中信证券	1,363,158.46	462,078.28
应付托管费	中国农业银行	681,577.86	231,038.68
合计	—	15,770,512.62	23,704,884.12

8.5.15 期末基金持有的流通受限证券

8.5.15.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

8.5.15.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

8.5.15.2.1 银行间市场债券正回购

无。

8.5.15.2.2 交易所市场债券正回购

无。

8.5.16 收益分配情况

8.5.16.1 收益分配基本情况

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额分红数	本期收益分配合计	本期收益分配占可供分配金额比例 (%)	备注
1	2024-04-26	2024-04-26	0.7763	77,630,149.40	99.99	本次分红的场内除息日为 2024 年 4 月 29 日, 场外除息日为 2024 年 4 月 26 日。本基金截止本次收益分配基准日的可供分配金额 77,636,740.81 元, 包含前期未分配的可供分配金额 385.17 元, 以及 2023 年 10 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日的可供分配金额 77,636,355.64 元。
2	2024-06-03	2024-06-03	0.7200	72,000,011.26	99.99	本次分红的场内除息日为 2024 年 6 月 4 日, 场外除息日为 2024 年 6 月 3 日。本基金截止本次收益分配基准日的可供分配金额 72,010,017.87 元, 包含前期未分配的可供分配金额 6,591.41 元, 以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 3 月 31 日的可供分配金额 72,003,426.46 元。
合计				149,630,160.66	-	-

注: 根据本基金管理人于 2024 年 8 月 15 日发布的分红公告, 本基金向 2024 年 8 月 19 日在本基金登记结算机构登记在册的基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.6085 元。

8.5.16.2 可供分配金额计算过程

参见 3.3.2.1。

8.5.17 金融工具风险及管理

8.5.17.1 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任, 或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息, 导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人对信用风险按组合分类进行管理。信用风险主要产生于银行存款、应收账款及其他应收款等。于资产负债表日, 本基金金融资产的账面价值已代表其最大信用风险敞口。

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行; 本基金存放定期存款前, 均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险, 因而与银行存款相关的信用风险不

重大。

8.5.17.2 流动性风险

本基金管理人负责基于项目公司运营的现金流量预测，持续监控短期和长期的资金需求，以确保维持充裕的现金储备。本基金持有充足的使用未受限的货币资金，以满足日常营运以及偿付有关到期债务的资金需求。

8.5.17.3 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，主要包括利率风险，外汇风险和其他价格风险。

本基金所投资的基础设施项目现金流受到经济环境，运营管理等因素影响，具有一定波动性。同时，本基金在二级市场交易的过程中，交易价格受到基础设施经营情况、所在行业情况、市场情绪、供求关系等多因素作用，存在基金份额交易价格相对于基金份额净值折溢价的现象，因此具有市场风险。

8.5.18 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

公允价值

(1) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(2) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2024 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产属于第一层次。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(3) 非持续的以公允价值计量的金融工具

截至 2024 年 6 月 30 日止，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(4) 不以公允价值计量的金融工具

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债。于 2024 年 6 月 30 日，其账面价值与公允价值不存在重大差异。

8.5.19 个别财务报表重要项目的说明

8.5.19.1 货币资金

8.5.19.1.1 货币资金情况

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
库存现金	-
银行存款	4,044,847.95
其他货币资金	-
小计	4,044,847.95
减：减值准备	-
合计	4,044,847.95

8.5.19.1.2 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	4,043,051.02
定期存款	-
其中：存款期限 1—3 个月	-
其他存款	-
应计利息	1,796.93
小计	4,044,847.95
减：减值准备	-
合计	4,044,847.95

8.5.19.1.3 因抵押、质押或冻结等对使用有限制、有潜在回收风险的款项说明

无。

8.5.19.2 长期股权投资

8.5.19.2.1 长期股权投资情况

单位：人民币元

项目名称	本期末 2024 年 6 月 30 日		
	账面余额	减值准备	账面价值
对子公司投资	9,398,900,000.00	-	9,398,900,000.00

合计	9,398,900,000.00	-	9,398,900,000.00
----	------------------	---	------------------

8.5.19.2.2 对子公司投资

单位：人民币元

被投资单位	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额	本期计提减值准备	减值准备余额
中信证券-中交投资高速公路 1 号资产支持专项计划	9,398,900,000.00	-	-9,398,900,000.00		-	-
合计	9,398,900,000.00	-	-9,398,900,000.00		-	-

9 基金份额持有人信息

9.1 基金份额持有人户数及持有人结构

本期末 2024 年 6 月 30 日					
持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额 (份)	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额(份)	占总份额 比例 (%)	持有份额(份)	占总份额比例 (%)
181,779	5,501.19	888,359,062.00	88.84	111,640,938.00	11.16
上年度末 2023 年 12 月 31 日					
持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额 (份)	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额(份)	占总份额 比例 (%)	持有份额(份)	占总份额比例 (%)
199,120	5,022.10	887,432,818.00	88.74	112,567,182.00	11.26

9.2 基金前十名流通份额持有人

本期末 2024 年 6 月 30 日			
序号	持有人名称	持有份额(份)	占总份额 比例 (%)
1	华金证券—横琴人寿保险有限公司—华金证券横琴人寿基础设施策略 2 号 FOF 单一资产管理计划	43,000,000.00	4.30
2	工银安盛人寿保险有限公司	40,000,000.00	4.00
3	东兴证券股份有限公司	26,500,000.00	2.65
4	中信证券股份有限公司	23,749,714.00	2.37
5	国新投资有限公司	23,000,000.00	2.30
5	国新新格局(北京)私募证券投资基金管理有限公司—国新央企新发展格局私募证券投资基金	23,000,000.00	2.30
7	中保投资有限责任公司—中国保险投资基金(有限合伙)	22,000,000.00	2.20

7	华宝信托有限责任公司—华宝信托—宝富投资 1 号集合资金信托计划	22,000,000.00	2.20
7	江苏省国际信托有限责任公司—江苏信托—禾享添利 1 号集合资金信托计划	22,000,000.00	2.20
10	英大泰和人寿保险股份有限公司—分红	20,949,902.00	2.09
合计		266,199,616.00	26.62
上年度末 2023 年 12 月 31 日			
序号	持有人名称	持有份额（份）	占总份额比例（%）
1	华金证券—横琴人寿保险有限公司—华金证券横琴人寿基础设施策略 2 号 FOF 单一资产管理计划	43,000,000.00	4.30
2	工银安盛人寿保险有限公司	40,000,000.00	4.00
3	东兴证券股份有限公司	26,500,000.00	2.65
4	中信证券股份有限公司	23,509,239.00	2.35
5	国新投资有限公司	23,000,000.00	2.30
5	国新新格局（北京）私募证券投资基金管理有限公司—国新央企新发展格局私募证券投资基金	23,000,000.00	2.30
7	华宝信托有限责任公司—华宝信托—宝富投资 1 号集合资金信托计划	22,000,000.00	2.20
7	江苏省国际信托有限责任公司—江苏信托—禾享添利 1 号集合资金信托计划	22,000,000.00	2.20
7	中保投资有限责任公司—中国保险投资基金（有限合伙）	22,000,000.00	2.20
10	英大泰和人寿保险股份有限公司—分红	20,949,902.00	2.09
合计		265,959,141.00	26.60

9.3 基金前十名非流通份额持有人

本期末 2024 年 6 月 30 日			
序号	持有人名称	持有份额（份）	占总份额比例（%）
1	中交投资有限公司	120,000,000.00	12.00
2	中交第二航务工程局有限公司	60,000,000.00	6.00
3	中交第二公路勘察设计研究院有限公司	20,000,000.00	2.00
合计		200,000,000.00	20.00
上年度末 2023 年 12 月 31 日			
序号	持有人名称	持有份额（份）	占总份额比例（%）
1	中交投资有限公司	120,000,000.00	12.00
2	中交第二航务工程局有限公司	60,000,000.00	6.00
3	中交第二公路勘察设计研究院有限公司	20,000,000.00	2.00
合计		200,000,000.00	20.00

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,743.00	0.00%

§10 基金份额变动情况

单位：份

基金合同生效日（2022年4月13日）基金份额总额	1,000,000,000.00
报告期期初基金份额总额	1,000,000,000.00
报告期期间基金总申购份额	-
报告期期间其他份额变动情况	-
报告期期末基金份额总额	1,000,000,000.00

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 报告期内原始权益人或其同一控制下的关联方卖出战略配售取得的基金份额

本基金报告期内，无原始权益人或其同一控制下的关联方卖出战略配售取得份额的情况。

11.5 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

11.7 为基金出具评估报告的评估机构情况

本报告期内本基金所聘用的评估机构未发生改变。

11.8 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.8.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

11.8.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金托管人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏中国交建高速公路封闭式基础设施证券投资基金关于二〇二三年十二月主要运营数据暨二〇二三年第四季度经营情况的临时公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-01-06
2	华夏中国交建高速公路封闭式基础设施证券投资基金关于二〇二三年度投资者开放日暨走进原始权益人活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-01-08
3	华夏中国交建高速公路封闭式基础设施证券投资基金交易情况的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-02-20
4	华夏中国交建高速公路封闭式基础设施证券投资基金关于二〇二四年一月主要运营数据的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-02-24
5	华夏中国交建高速公路封闭式基础设施证券投资基金关于二〇二四年二月主要运营数据的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-03-20
6	华夏基金管理有限公司旗下华夏中国交建高速公路封闭式基础设施证券投资基金 2023 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-03-30
7	华夏中国交建高速公路封闭式基础设施证券投资基金 2023 年度评估报告	中国证监会指定报刊及网站	2024-03-30
8	华夏中国交建高速公路封闭式基础设施证券投资基金 2023 年审计报告	中国证监会指定报刊及网站	2024-03-30
9	关于华夏中国交建高速公路封闭式基础设施证券投资基金召开 2023 年年度业绩说明会的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-04-10
10	华夏中国交建高速公路封闭式基础设施证券投资基金关于二〇二四年三月主要运营数据的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-04-20
11	华夏基金管理有限公司关于华夏中国交建高速公路封闭式基础设施证券投资基金收益分配的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-04-24
12	华夏中国交建高速公路封闭式基础设施证券投资基金关于二〇二四年四月主要运营数据的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-05-20
13	华夏基金管理有限公司关于华夏中国交建高速公路封闭式基础设施证券投资基金收益分配的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-05-30
14	华夏中国交建高速公路封闭式基础设施证券投资基金关于基金原始权益人增持期间届满暨增持计划实施情况的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-06-07
15	华夏中国交建高速公路封闭式基础设施证券投资基金关于二〇二四年五月主要运营数据的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-06-20

§12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；

- 2、《华夏中国交建高速公路封闭式基础设施证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏中国交建高速公路封闭式基础设施证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司

二〇二四年八月三十日