

# 中信建投国家电投新能源封闭式基础设施证券投资基金

## 2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人: 中信建投基金管理有限公司

基金托管人: 中国工商银行股份有限公司

送出日期: 2024 年 08 月 30 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年8月29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	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金产品基本情况	5
2.2 基础设施项目基本情况说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 基础设施资产支持证券管理人和外部管理机构	7
2.5 信息披露方式	7
2.6 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金收益分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 其他财务指标	8
3.3 基金收益分配情况	8
3.4 报告期内基金及资产支持证券费用收取情况的说明	10
§ 4 基础设施项目运营情况	10
4.1 对报告期内基础设施项目公司运营情况的整体说明	10
4.2 基础设施项目所属行业情况	12
4.3 基础设施项目运营相关财务信息	15
4.4 基础设施项目运营相关通用指标信息	18
4.5 基础设施项目公司经营现金流	18
4.6 基础设施项目公司对外借入款项情况	19
4.7 基础设施项目投资情况	19
4.8 抵押、查封、扣押、冻结等其他权利限制的情况	20
4.9 基础设施项目相关保险的情况	20
4.10 基础设施项目未来发展展望的说明	20
4.11 其他需要说明的情况	21
§ 5 除基础设施资产支持证券之外的投资组合报告	21
5.1 报告期末基金的资产组合情况	21
5.2 报告期末按债券品种分类的债券投资组合	21
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	21
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	21
5.5 投资组合报告附注	21
5.6 报告期末其他各项资产构成	22
5.7 投资组合报告附注的其他文字描述部分	22
5.8 报告期内基金估值程序等事项的说明	22
5.9 报告期内基金资产重大减值计提情况的说明	22
§ 6 管理人报告	22
6.1 基金管理人及主要负责人员情况	22
6.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	26
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	26
6.4 管理人对报告期内基金的投资和运营分析	26
6.5 管理人对报告期内基金收益分配情况的说明	27
6.6 管理人对宏观经济及行业走势的简要展望	27
6.7 管理人对关联交易及相关利益冲突的防范措施	30
§ 7 托管人报告	31
7.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	31
7.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、收益分配等情况的说明	32
7.3 托管人对本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	32
§ 8 中期财务报告（未经审计）	32

8.1 资产负债表	32
8.2 利润表	36
8.3 现金流量表	39
8.4 所有者权益变动表	42
8.5 报表附注	47
§ 9 评估报告	80
9.1 管理人聘任评估机构及评估报告内容的合规性说明	80
9.2 评估报告摘要	80
9.3 评估机构使用评估方法的特殊情况说明	80
§ 10 基金份额持有人信息	80
10.1 基金份额持有人户数及持有人结构	80
10.2 基金前十名流通份额持有人	81
10.3 基金前十名非流通份额持有人	82
10.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	83
§ 11 基金份额变动情况	83
§ 12 重大事件揭示	84
12.1 基金份额持有人大会决议	84
12.2 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	84
12.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	84
12.4 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	84
12.5 基金投资策略的改变	84
12.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	84
12.7 为基金出具评估报告的评估机构情况	84
12.8 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	84
12.9 其他重大事件	85
§ 13 影响投资者决策的其他重要信息	86
§ 14 备查文件目录	87
14.1 备查文件目录	87
14.2 存放地点	87
14.3 查阅方式	87

## § 2 基金简介

### 2.1 基金产品基本情况

基金名称	中信建投国家电投新能源封闭式基础设施证券投资基金
基金简称	中信建投国家电投新能源REIT
场内简称	国家电投（扩位简称：中信建投国家电投新能源REIT）
基金主代码	508028
交易代码	508028
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	2023年03月20日
基金管理人	中信建投基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	800,000,000.00份
基金合同存续期	21年
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2023-03-29
投资目标	基金的主要资产投资于基础设施资产支持证券，并持有其全部份额，通过投资基础设施资产支持证券穿透取得基础设施项目完全所有权或经营权利，基金管理人主动运营管理基础设施项目，以获取基础设施项目运营过程中稳定现金流为主要目的。
投资策略	（一）资产支持证券投资策略。 1、初始投资策略； 2、扩募收购策略； 3、资产出售及处置策略； 4、融资策略； 5、运营策略。 （二）债券及货币市场工具的投资策略。
业绩比较基准	本基金暂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，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。
基金收益分配政策	1、在符合有关基金收益分配条件的前提下，每年至少收益分配一次。基金应当将90%以上合并后基金年度可供分

	<p>配金额以现金形式分配给投资者；若基金合同生效不满6个月可不进行收益分配。具体分配时间由基金管理人根据基础设施项目实际运营情况另行确定；</p> <p>2、本基金收益分配方式为现金分红；</p> <p>3、每一基金份额享有同等分配权；</p> <p>4、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。</p>
资产支持证券管理人	中信建投证券股份有限公司
外部管理机构	国家电投集团江苏海上风力发电有限公司（以下简称“江苏海风公司”）

## 2.2 基础设施项目基本情况说明

基础设施项目名称:中电投滨海北区H1#100MW海上风电工程（以下简称“滨海北H1项目”）、中电投滨海北区H2#400MW海上风电工程（以下简称“滨海北H2项目”）及配套建设的国家电投集团滨海北H1#海上风电运维驿站工程项目（以下简称“配套运维驿站项目”，与滨海北H1项目、滨海北H2项目合称为“基础设施项目”）

基础设施项目公司名称	国家电投集团滨海海上风力发电有限公司（以下简称“项目公司”）
基础设施项目类型	新能源发电
基础设施项目主要经营模式	基金管理人、项目公司作为委托方共同委托江苏海风公司担任基础设施项目的外部管理机构（或称“运营管理机构”），为基础设施项目提供运营管理服务。江苏海风公司严格依照国家法律法规和行业规范要求，对基础设施项目进行专业化管理，确保项目能够安全高效运转。
基础设施项目地理位置	江苏省盐城市滨海县滨海北部的中山河口至滨海港之间的近海海域及江苏省盐城市滨海县滨海港经济区。

## 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	中信建投基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱伟
	联系电话	010-59100208
	电子邮箱	zhuweibj@csc.com.cn
客户服务电话	4009-108-108	95588
传真	010-59100298	(010) 66105798

注册地址	北京市怀柔区桥梓镇八龙桥雅苑3号楼1室	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	北京市东城区朝阳门内大街2号凯恒中心B座17层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	100010	100140
法定代表人	黄凌	廖林

## 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
名称	中信建投证券股份有限公司	国家电投集团江苏海上风力发电有限公司（以下简称“江苏海风公司”）
注册地址	北京市朝阳区安立路66号4号楼	江苏省盐城市解放南路58号城中雅苑24幢1101室
办公地址	北京市朝阳区景辉街16号院1号楼泰康集团大厦9楼	江苏省盐城市亭湖区解放南路58号中建大厦11层
邮政编码	100026	214000
法定代表人	王常青	葛双义

## 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.cfund108.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 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01月01日-2024年06月30日)
本期收入	475,910,029.58
本期净利润	158,220,591.03

本期经营活动产生的现金流量净额	101,298,830.33
期末数据和指标	报告期末（2024年06月30日）
期末基金总资产	7,743,231,424.93
期末基金净资产	7,374,330,759.92
期末基金总资产与净资产的比例（%）	105.00

注：本表中的数据 and 指标均指合并财务报表层面的数据。

### 3.2 其他财务指标

单位：人民币元

数据和指标	报告期末（2024年06月30日）
期末基金份额净值	9.2179
期末基金份额公允价值参考净值	-

### 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	94,368,974.70	0.1180	
2023年	656,871,231.54	0.8211	

注：上表中2023年度可供分配金额数据中，未包含截至2023年12月31日（保理基准日）满足条件的国补应收账款对应的保理金额182,495,179.82元。2024年4月11日，该保理款项已到账，加上该保理流入，2023年度实现可供分配金额839,366,411.36元，单位可供分配金额1.0492元。

##### 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	313,599,984.20	0.3920	2023年第3次收益分配
2023年	525,103,999.09	0.6564	

注：（1）基金管理人分别于2023年9月、2023年12月发布了2次基金收益分配公告，分配金额合计为525,103,999.09元。2024年4月发布了2023年第3次基金收益分配公告，以2023年12月31日为收益分配基准日，分配金额为313,599,984.20元。本基金在2023年度可供分配金额839,366,411.36元（含保理流入）的基础上，最

终对外累计分配金额为838,703,983.29元，较预测值的完成率为110.78%，收益分配比例为99.92%。

(2) 根据本基金2023年年度报告，本基金对应2023年年末基金份额公允价值参考净值9.75元的现金流分派率约为10.76%。现金流分派率=报告期内可供分配金额(含国补应收账款对应的保理流入)/(期末基金份额公允价值参考净值×基金份额总额)。

(3) 基于2023年年末基金份额公允价值参考净值9.75元及存续期间资产评估报告中的全周期各年净现金流测算年度可供分配金额，并结合实际分派频率等诸多假设条件，基金管理人测算的本基金内部收益率为5.17%，以上测算系参考了存续期间资产评估报告预测的全周期各年净现金流数据，不代表后续年度的实际分配金额。因未来经营的不确定性，不代表投资者未来实际可得的收益水平。

### 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	158,220,591.03	
本期折旧和摊销	195,649,142.54	
本期利息支出	12,380,032.34	
本期所得税费用	8,579,379.98	
本期息税折旧及摊销前利润	374,829,145.89	
调增项		
1. 保理款流入	182,495,179.82	
2. 期初现金余额	140,858,748.82	
调减项		
1. 支付的利息及所得税费用	-20,959,412.32	
2. 应收和应付项目的变动	-258,343,679.47	
3. 分红支付的资金	-313,599,984.20	
4. 安全留存现金	-10,911,023.84	
本期可供分配金额	94,368,974.70	

注：(1) 以上可供分配金额测算数据中，未包含截至2024年12月31日（保理基准日）满足条件（账龄超过1.5年）可以开展保理业务的保理流入金额，本基金的保理流入金额将于年度收益分配时一并分配给投资者。截至2024年12月31日（保理基准日），账龄超过1.5年的国补应收账款金额为565,591,403.52元。结

合下半年的国补回款情况，下半年收到的国补回款将优先用于偿还2023年（保理基准日为2023年12月31日）开展保理融资的借款本金（金额为182,495,179.82元），超过的部分对应减少2024年（保理基准日为2024年12月31日）开展保理融资的金额。

（2）报告期内，本基金实现的可供分配金额为94,368,974.70元。影响上半年可供分配金额较去年同期变动的主要因素，除集中支付本基金2023年度固定管理费1、固定管理费2和托管费（金额合计为85,788,957.42元）的原因外，2023年上半年收到国补应收账款回款金额20,985,822.72元，2024年上半年未收到国补应收账款回款。同时，“4.1对报告期内基础设施项目公司运营情况的整体说明”中，报告期内经营数据的变动原因也是影响可供分配金额变动的因素。

（3）根据本基金管理人于2024年8月2日发布的《中信建投国家电投新能源封闭式基础设施证券投资基金关于2024年第一次收到国补应收账款回款情况的公告》，项目公司于2024年7月31日收到国网江苏省电力有限公司（以下简称“江苏国网”）的国补应收账款回款8,511.59万元，该回款优先用于偿还2024年4月11日（保理基准日为2023年12月31日）保理银行发放的保理融资款项（已纳入本基金2023年度第三次收益分配），该举措将减少2024年度保理融资利息费用95.86万元，提高投资者可供分配金额，增厚投资人收益水平。

### 3.3.2.2 本期调整项与往期不一致的情况说明

本期调整项不存在与往期不一致的情况。

### 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《中信建投国家电投新能源封闭式基础设施证券投资基金基金合同》，本报告期内以基金资产净值为基数计提的基金固定管理费1为7,671,593.64元（含税），其中基金管理人管理费6,143,856.18元（含税），资产支持证券管理人管理费1,527,737.46元（含税）；基金托管费为383,990.82元（含税）。根据未经审计的数据测算，本报告期内以项目公司年度净收入为基数计提的基金固定管理费2（即运营管理机构的管理费）为35,953,462.45元（含税）。以上费用截至本报告期末未支付。

上述相关费用的计算方式详见本基金招募说明书。

## § 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

项目公司持有的基础设施项目为位于江苏省盐城市的滨海北H1项目、滨海北H2项目及配套运维驿站项目，基础设施项目总发电装机规模为500MW。项目公司的主营业务收入为基础设施项目海上风电机组的发电收入。基础设施项目将海上风力资源转换成清洁电力，通过江苏国网将电力输送至终端用户，并从江苏国网取得电力销售收入。

### （1）基础设施项目经营情况

基础设施项目采取委托管理的经营模式，基金管理人、项目公司与江苏海风公司共同签署《中信建投国家电投新能源封闭式基础设施证券投资基金运营管理协议》（以下简称《运营管理协议》），委托江苏海风公司负责基础设施项目的运营管理，江苏海风公司严格依照国家法律法规和行业规范要求，对基础设施项目进行专业化管理。基金管理人按照《运营管理协议》对运营管理机构进行监督、管理和考核。

报告期内，基金管理人和运营管理机构积极制定并推进一系列的运营管理措施和方案，助力基础设施项目提质增效，基础设施项目运营稳定，整体经营状况良好，未发生安全生产事故。

报告期内，基础设施项目经营数据较去年同期相对稳定。一是，作为衡量风电机组运行稳定性的关键指标，项目风电机组全场可利用率约为99.54%，项目风电机组处于良好运行状态。二是，项目实现发电量、上网电量和不含税收入分别为67,940.18万千瓦时、66,348.46万千瓦时和47,580.66万元，同比分别下降2.53%、2.49%和7.04%，项目2024年上半年总体经营数据变动较小。

报告期内经营数据的变动原因，一方面是由于报告期内项目公司收到江苏省电力交易中心的交易结算单，结算单确认了2022年1-7月份、2023年9-12月份及2024年1-3月份的“两个细则”返还与分摊费用，不含税金额合计为-2,327.47万元，该金额在项目公司报告期结付电费时调减收入。另一方面，基础设施项目二季度平均风速为5.67m/s，风速同比下降导致的发电量波动以及报告期内运营管理机构结合风速预测情况及项目设备检修维护需要，经江苏国网批准，按照年度运营计划主动开展了为期14天的陆上和海上升压站的年度例行检修和电力设备预防性试验等工作，期间受升压站检修试验影响，风电机组停机未发电，一定程度上影响了基础设施项目报告期的发电表现。截止报告期末，项目公司2024年之前的历史“两个细则”返还与分摊费用已经确认入账完毕，风电场年度整体停电检修工作已经顺利完成。

报告期内，基础设施项目的含税上网电价保持0.85元/千瓦时（不含税金额为0.752元/千瓦时）不变，基础设施项目没有参与电力市场化交易，项目电量全额上网，没有发生限电情况。

项目公司报告期末资产总额为5,637,515,606.30元，包括货币资金、应收账款、预付账款、固定资产、无形资产、使用权资产等。项目公司上期末（2023年6月30日，下同）资产总额为5,915,300,737.06元，主要包括货币资金、应收账款、预付账款、固定资产、无形资产、使用权资产、在建工程等。资产总额较上期末减少277,785,130.76元，主要系资产计提折旧摊销所致。

项目公司报告期末负债总额为5,673,464,026.85元，包括应付账款、应交税费、其他应付款、长期借款、租赁负债。项目公司上期末负债总额为5,380,053,018.69元，主要包括应付账款、应交税费、其他应付款、租赁负债等。负债总额较上期末增加293,411,008.16元，主要系长期借款、其他应付款和应付账款增加所致。

项目公司其他信息参见“13 影响投资者决策的其他重要信息”。

## （2）项目运营优势

### 1) 风资源及发电量稳定，项目电量全额上网

海上风电项目的发电量主要受风力资源影响，基础设施项目所在地区季风气候占主导地位，风资源较好，具有海上风电开发价值。从项目历史运营情况来看，发电量整体情况是在一定范围内波动的，无明显增长或减少趋势。另外，根据《中电投江苏海上风力发电有限公司滨海北区H1#可行性研究报告》及《中电投滨海北区H2#400MW海上风电工程可行性研究报告》，项目所在区域历年风速变化总体较为平稳。在不同年度或同一年度内的不同季节中，基础设施项目的发电表现有一定的差异属正常情况，拉长时间周期来看，项目发电量整体情况是在长期稳定的范围内随风资源波动，无明显增长或减少趋势。

基础设施项目所在地江苏省经济发达，全社会用电量需求强劲。2023年江苏省全社会用电量达7,833亿千瓦时，同比增长5.86%，2024年上半年，江苏省全社会用电量3,923.06亿千瓦时，同比增长8.97%，较全国平均增速高约0.9个百分点。江苏省经济体量大，化石能源消费比重高，一次能源对外依存度相对较高，区外来电占比约为20%，是全国新能源消纳形势较好的地区之一，为项目发电量的全额上网创造了良好条件。报告期内，本项目发电量全额上网，没有发生限电情况。

### 2) 上网结算电价稳定

根据江苏省物价局出具的电价批复，明确滨海北H1项目和滨海北H2项目的含税上网电价为0.85元/千瓦时，其中燃煤机组发电基准价为0.391元/千瓦时，可再生能源电价附加补贴（国补）为0.459元/千瓦时。未来在本基金存续期内，若是江苏省燃煤机组发电基准价有所调整，则国补占比也将相应调整，但在国补到期前，含税上网电价保持0.85元/千瓦时保持不变。

### 3) 运营管理机构经验丰富

基础设施项目的运营管理机构江苏海风公司作为国家电力投资集团有限公司体系内专业运营海上风电项目的主体，曾先后获得全国“五一”劳动奖状、全国青年文明号、国家电投先进集体等荣誉。江苏海风公司拥有丰富的海上风电运营管理经验和专业的运营团队，管理人员均具有10年以上的基础设施项目运营管理经验，覆盖运营、财务及工程等领域。在基金存续期内，基础设施项目的主要运营工作仍由滨海北H1项目和滨海北H2项目原运营管理团队承担，凭借历史上对滨海北H1项目和滨海北H2项目的了解及运营经验，江苏海风公司将以丰富的行业和管理经验继续为基础设施项目提供专业的运营服务，为基础设施项目的高效稳定运营提供有力保障。

## 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

本基金的底层基础设施项目为海上风力发电项目，属于新能源发电行业。近年来，我国以风电、太阳能发电为代表的新能源电力发展迅速，目前我国新能源装机规模和新

能源发电量占比稳步提升，建造成本快速下降，电力能源结构低碳转型效果逐步显现，为我国如期实现碳达峰、碳中和目标奠定了坚实的基础。

#### （1）电力消费平稳较快增长

根据国家能源局公布的统计数据，2024年上半年我国全社会用电量46,575亿千瓦时，同比增长8.1%。从分产业用电看，第一产业用电量623亿千瓦时，同比增长8.8%；第二产业用电量30,670亿千瓦时，同比增长6.9%；第三产业用电量8,525亿千瓦时，同比增长11.7%；城乡居民生活用电量6,757亿千瓦时，同比增长9.0%。

#### （2）电力生产供应稳定增长

根据中国电力企业联合会公布的统计数据，截至2024年6月底，全国全口径发电装机容量30.7亿千瓦，同比增长14.1%；其中，非化石能源发电装机占总装机容量比重达到55.7%。

分类型看，全国并网风电装机容量为4.7亿千瓦，其中，陆上风电4.3亿千瓦、海上风电3,817万千瓦；并网太阳能发电装机容量为7.1亿千瓦。全国并网风电和太阳能发电合计装机容量在2024年6月底达到11.8亿千瓦，首次超过煤电装机规模，同比增长37.2%，占全国总装机容量比重为38.4%，比上年同期提高6.5个百分点。从分类型投资、发电装机增速及结构变化等情况看，电力行业绿色低碳转型成效显著。

2024年上半年，全国规模以上工业发电量为44,354亿千瓦时，同比增长5.2%。

#### （3）可再生能源发展取得新成效

2024年上半年，我国能源安全供应和绿色低碳协调发展，可再生能源发展取得新成效。根据国家能源局公布的数据，2024年上半年，全国可再生能源发电新增装机1.34亿千瓦，同比增长24%，占全国新增电力装机的88%。截至2024年6月底，全国可再生能源发电装机达到16.53亿千瓦，同比增长25%，约占我国发电总装机的53.8%，可再生能源装机规模不断实现新突破。

2024年上半年，全国可再生能源发电量达1.56万亿千瓦时，同比增加22%，约占全部发电量的35.1%；其中，风电太阳能发电量合计达9,007亿千瓦时，约占全部发电量的20%，同比增长23.5%，超过了同期第三产业用电量(8,525亿千瓦时)和城乡居民生活用电量(6,757亿千瓦时)，可再生能源发电量稳步迈上新台阶。

#### （4）新能源利用率保持较高水平

随着我国新能源发电装机规模不断增长，相关部门多管齐下，在扎实推进新能源基础设施建设的同时，不断完善新能源消纳和调控政策措施。

通过强化新型电力系统建设，我国新能源平均利用率继续保持较高水平，自2018年以来连续多年超过95%，但受供需关系等因素影响，不同区域的消纳水平有所分化。根据全国新能源消纳监测预警中心发布的《2024年6月全国新能源并网消纳情况》，2024年上半年全国风电利用率为96.1%，光伏发电利用率为97%，江苏省风电和光伏利用率均为99.9%，江苏省新能源消纳情况显著优于全国平均水平。

#### （5）江苏省新能源消纳有望持续保持良好发展态势

根据江苏省电力行业协会公布的统计数据，截至2024年6月底，江苏省发电装机容量18,980.36万千瓦，其中风电累计装机容量为2,298.89万千瓦，占总装机容量的12.11%，占比同比下降1.39个百分点。2024年上半年，江苏省新增发电能力1,126.17万千瓦，其中风电新增17.52万千瓦。2024年上半年，江苏省累计发电量为3,177.92亿千瓦时，同比增长8.17%。

与此同时，江苏省用能需求呈现出刚性增长的特点，根据国家能源局江苏监管办公室公布的统计数据，2024年1-6月份，江苏省全社会用电量3,923.06亿千瓦时，同比增长8.97%。2024年调度用电最高负荷12,589.60万千瓦，同比增长11.62%。江苏省经济体量大，化石能源消费比重高，一次能源对外依存度相对较高，区外来电占全社会用电量的比重近20%，形成了“能源消费大省、能源资源小省”的供需格局。

作为以外向型经济为主导的大省，江苏省用能需求将持续保持旺盛态势。江苏省正在深入推进能源革命，加快建设清洁低碳、安全高效的现代能源体系，计划到2025年，将可再生能源占全省能源消费总量的比重提升至15%以上，有利于推动新能源的发展和利用。自2018年有统计数据以来，江苏省连续多年保持风电利用率保持较高水平，展望未来，江苏省新能源的消纳形势也有望持续保持良好的发展态势。

#### 4.2.2 基础设施项目所属行业竞争情况的说明

随着我国对能源安全、生态环境等问题日益重视，加快发展包括风电在内的新能源电力已成为我国乃至全世界推动能源转型发展、应对全球气候变化的普遍共识和一致行动。从技术及经济性看，风电技术逐渐成熟，产品质量可靠，是一种安全可靠的能源主体，风电经济性日益提高。

##### （1）新能源产业是全球能源变革的关键

新能源产业的崛起，对提升我国能源安全保障水平具有深远意义。我国政府坚定推进“3060”碳减排目标，展现了推动能源绿色低碳转型的决心与智慧。我国新能源支持政策的有效实施及新能源产业的显著成就，不仅增强了我国在气候变化治理中的国际影响力，还彰显了中国作为大国的责任与担当。

##### （2）我国新能源产业发展具有坚实的基础和显著的竞争优势

在政策支持与产业界的共同努力下，我国新能源产业取得了举世瞩目的成就。风电、光伏等领域的新增与累计装机容量连续多年位居世界第一，截至2024年6月底，风电与太阳能累计装机分别突破4.67亿千瓦与7.14亿千瓦。中国已建立起技术领先、产业链完备的新能源产业体系，竞争优势日益凸显。随着“3060”碳减排目标的深入实施，非化石能源在一次能源中的占比目标提升至25%，风电、光伏等新能源产业将迎来更广阔的发展空间。

##### （3）优质资源的竞争是新能源行业竞争的核心

在新能源产业的快速发展中，资源竞争不仅是行业内部竞争的焦点，更是影响整个产业未来发展的关键因素。新能源发电作为资本密集型行业资金需求较高，特别是风电和光伏项目，高度依赖于自然资源条件，如风力资源分布、太阳辐射强度等，因此，资

源的优质水平将决定项目盈利能力，更成为行业竞争的焦点。随着补贴政策的调整，如新建新能源项目不再纳入中央财政补贴范围，项目的稀缺程度、项目所在区域的负荷情况、消纳能力和电价水平等因素将对项目竞争力产生重要影响。

(4) 电力市场化改革的不断深化，市场交易电量持续增长

当前，我国电力市场化改革的不断深化，发电行业市场竞争机制逐步成熟，多元竞争主体格局初步形成，市场在资源优化配置中的作用明显加强。根据中国电力联合会公布的数据，2024年上半年，全国各电力交易中心累计组织完成市场交易电量 28,470.3 亿千瓦时，同比增长 7.4%，占全社会用电量比重为 61.1%。其中，全国电力市场中长期电力直接交易电量合计为 22,331.4 亿千瓦时，同比增长 5.6%。电力中长期交易已在全国范围内常态化运行，交易周期覆盖多年到多日，中长期交易电量充分发挥“压舱石”作用，稳定了总体市场规模和交易价格。

根据江苏电力交易中心公示的 2024 年江苏电力市场年度交易结果，江苏省 2024 年的年度双边协商交易加权均价为 452.94 元/兆瓦时，较燃煤基准价上浮 15.84%。江苏省 2024 年的年度绿电交易成交量迎来新高，成交量达到 31.72 亿千瓦时，较 2023 年上升 78.8%，较 2022 年上升 243%，用户侧绿电购买意愿逐步提升，2024 年年度绿电成交均价 464.44 元/兆瓦时，较燃煤发电基准价溢价 18.78%。

目前本项目未参与电力市场化交易，项目发电量全额上网。根据江苏省物价局出具的电价批复，本项目的含税上网电价为 0.85 元/千瓦时（不含税金额为 0.752 元/千瓦时），在国补到期前保持不变，不受电力市场化交易的影响。

### 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 基础设施项目名称：国家电投集团滨海海上风力发电有限公司

金额单位：人民币元

序号	构成	本期（2024年01月01日-2024年06月30日）		上年同期（2023年03月20日-2023年06月30日）	
		金额	占该项目总收入比例（%）	金额	占该项目总收入比例（%）
1	发电收入	475,806,629.58	100.00	298,117,055.96	100.00
2	其他收入	-	0.00	-	0.00
3	合计	475,806,629.58	100.00	298,117,055.96	100.00

注：（1）报告期内营业收入较去年同期变动的主要原因如下：

1) 本基金基金合同生效日为 2023 年 3 月 20 日，上年同期非完整半年度数据；

2) 报告期内项目公司收到江苏省电力交易中心的交易结算单，结算单集中确认了 2022 年 1-7 月份、2023 年 9-12 月份及 2024 年 1-3 月份的“两个细则”返还与分摊费用，不含税金额合计为-23,274,655.54 元；

3) 基础设施项目二季度平均风速为 5.67m/s，风速同比下降导致的发电量波动以及运营管理机构结合风速预测情况及项目设备检修维护需要，经江苏国网批准，按照年度运营计划主动开展了为期 14 天的陆上和海上升压站的年度例行检修和电力设备预防性试验等工作，期间受升压站检修试验影响，风电机组停机未发电，一定程度上影响了基础设施项目报告期的发电表现。

(2) “两个细则”返还与分摊费用是指江苏国网依据基础设施项目所在地能源监管机构颁布的并网运行管理与辅助服务管理相关细则规定，组织实施的并网运行考核及返还、辅助服务补偿分摊，并在江苏国网向基础设施项目公司结付电费时调整的金额。其中：

1) 并网运行考核及返还：统调风力发电企业按照并网运行管理相关细则接受考核，所有统调风力发电企业被考核扣罚的金额全部返还给参与考核并完成度较好的统调风力发电企业；

2) 辅助服务补偿及辅助服务分摊：按照“谁提供、谁获利；谁受益、谁承担”的原则，确定补偿方式和分摊机制。提供辅助服务补偿的发电机组会产生额外的成本，对机组造成额外的寿命损耗，享受补偿。目前分摊辅助服务补偿资金的企业主要是提供辅助服务能力较弱的风电、光伏、核电等。

#### 4.3.1.2 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

本报告期内，基础设施项目营业收入不存在重大变化。

#### 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：国家电投集团滨海海上风力发电有限公司

金额单位：人民币元

序号	构成	本期（2024年01月01日-2024年06月30日）		上年同期（2023年03月20日-2023年06月30日）	
		金额	占该项目总成本比例（%）	金额	占该项目总成本比例（%）
1	财务费用	406,571,135.47	63.79	914,322.34	0.82
2	固定资产、使用权资产折旧/无形资产	139,249,238.78	21.85	77,966,150.24	70.06

	摊销				
3	委托运行费用	70,115,237.95	11.00	21,685,223.53	19.49
4	保险费	9,600,104.55	1.51	5,306,115.50	4.77
5	修理费	4,309,850.00	0.68	3,286,586.02	2.95
6	电力费用	1,144,800.00	0.18	733,736.56	0.66
7	税金及附加	321,489.45	0.05	153,324.52	0.14
8	材料费	-	0.00	-1,903,198.92	-1.71
9	其他成本/费用	6,055,163.91	0.95	3,146,897.29	2.83
10	合计	637,367,020.11	100.00	111,289,157.08	100.00

注：报告期内财务费用包含专项计划作为项目公司股东发放的股东借款利息支出 405,911,411.25 元，该部分利息支出扣除相关税费后将最终分配给基金份额持有人，该利息支出的发生为本基金交易结构和税务安排导致，非项目公司实际运行发生的利息支出。扣除该利息支出后本期营业总成本为 231,455,608.86 元。

#### 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：国家电投集团滨海海上风力发电有限公司

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01月01日-2024年06月30日）	上年同期（2023年03月20日-2023年06月30日）
				指标数值	指标数值
1	毛利	营业收入-营业成本	元	245,332,234.39	187,895,545.74
2	毛利率	毛利/营业收入	%	51.56	63.03
3	净利率	(净利润+计提的专项计划利息)/营业收入	%	49.57	54.42
4	息税折旧摊销前利润率	息税折旧摊销前利润/营业收入	%	80.78	89.13

#### 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

报告期内，本基金基础设施项目全场设备可利用率为99.54%，高于风力发电机组设备合同保证指标4.54个百分点。

2024年上半年，全国并网风电设备利用小时为1,134小时，滨海北H1项目和滨海北H2项目发电量口径利用小时数分别为1,207小时和1,397小时，均超过全国平均水平。其中，发电量口径利用小时数=发电量/机组并网容量。

报告期内，基础设施项目实现发电量为67,940.18万千瓦时，同比降低2.53%，完成年度预测的53.13%。上网电量为66,348.46万千瓦时，同比降低2.49%，完成年度预测的53.10%，结算电量为66,237.83万千瓦时，同比降低1.46%，完成年度预测的53.01%。

报告期内，基础设施项目结算电价为0.85元/千瓦时（不含税金额为0.752元/千瓦时），结算电费为49,824.92万元（不含税，未包含“两个细则”返还与分摊费用的调整），同比降低1.46%。结算电费中国补占比为54%，报告期内项目公司未收到国补回款。报告期内项目公司针对满足条件的国补应收账款开展了保理，保理款流入金额为18,249.52万元。

报告期内，本基金基础设施项目没有参与电力市场化交易，没有发生限电情况。

#### 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

基金存续期内，项目公司收支通过项目公司资金监管账户进行。

按照资金监管协议约定，项目公司资金监管账户开立在中国工商银行股份有限公司南京新街口支行，并接受中国工商银行股份有限公司南京新街口支行的监管。项目公司资金监管账户同时作为运营收支账户和基本户，项目公司的收支均在此账户进行归集和支付。

收入方面，项目公司的所有收入均归集至资金监管账户；支出方面，建立“三级审批”机制。项目公司日常付款事项由外部管理机构率先履行内部审批流程，完成后由项目公司和基金管理人审批，各方对付款事项的真实性、准确性和必要性进行审查。审批通过后，发起付款申请，项目公司和基金管理人复核通过后，由基金管理人发送相关付款明细至监管银行，监管银行核对无误后进行付款。任何付款流程，均需要基金管理人最终审批后方可执行。

报告期期初项目公司货币资金余额为13,384.89万元。报告期内项目公司现金流入主要为标杆电价收入26,371.61万元、国补应收账款保理流入18,249.52万元和结构性存款、协定存款以及活期存款利息（扣除手续费支出）等收入132.47万元。报告期内项目公司现金流出主要为支付专项计划股东借款利息33,835.64万元、支付本基金2023年度

固定管理费支出7,278.68万元、发电成本费用支出4,542.80万元、税费支出2,081.22万元、国补应收账款保理利息支出95.38万元。

#### 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

根据江苏国网与项目公司签署的《中长期购售电合同》，合同约定由江苏国网购买滨海北H1项目和滨海北H2项目的电能。因此，滨海北H1项目和滨海北H2项目的发电收入直接支付方为江苏国网。江苏国网以向电力用户供电并获得的销售电价收入支付购电成本。因此，穿透来看，滨海北H1项目和滨海北H2项目发电收入的终端现金流提供方为电力用户，现金流来源合理分散，不存在重要现金流提供方。

#### 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

报告期内新增保理融资款项182,495,179.82元，截至2024年6月30日保理融资余额182,495,179.82元。

2024年3月26日，项目公司与中国工商银行南京新街口支行签署《国内单保理业务合同》，将2022年3-6月已形成但尚未收到的国补应收账款债权182,495,179.82元（含税）转让给中国工商银行南京新街口支行，自中国工商银行南京新街口支行取得转让对价182,495,179.82元，项目公司收到国补后可提前还款。融资利率为以保理发放日前一日的一年期LPR为基础减少80个基点即2.65%/年，按季度支付利息，自首笔贷款实际发放日起，保理融资期限为3年。

根据本基金管理人于2024年8月2日发布的《中信建投国家电投新能源封闭式基础设施证券投资基金关于2024年第一次收到国补应收账款回款情况的公告》，项目公司于2024年7月31日收到江苏国网的国补应收账款回款85,115,922.39元，该回款优先用于偿还2024年4月11日（保理基准日为2023年12月31日）保理银行发放的保理融资款。该笔国补回款已于2024年8月2日偿还保理融资款，偿还后保理借款本金余额为97,379,257.43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

本基金上年同期无对外借入款项。

#### 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、冻结等其他权利限制的情况

报告期内，本基金基础设施项目不存在抵押、查封、扣押、冻结等其他权利限制的情况。

#### 4.9 基础设施项目相关保险的情况

报告期内，项目公司已经为基础设施项目购买了财产一切险、机器损坏险、公众责任保险、环境污染责任保险和安全生产责任保险等保险，上述保险的保险期限至2024年6月30日24时止。报告期内基础设施项目购买的上述险种均未出险，未适用理赔服务。

截至本报告披露日，项目公司已经完成财产一切险、机器损坏险、公众责任保险、环境污染责任保险和安全生产责任险的续保工作，其中公众责任保险、环境污染责任保险和安全生产责任保险由中国太平洋财产保险股份有限公司负责承保，财产一切险和机器损坏险由中国人民财产保险股份有限公司北京市分公司作为首席承保人联合中国太平洋财产保险股份有限公司太原中心支公司等9家共保人负责承保。上述保险的保险期限均为2024年7月1日0时起至2025年6月30日24时止。

#### 4.10 基础设施项目未来发展展望的说明

在推进中国式现代化和顺应全球能源低碳转型大趋势下，国家始终高度重视能源发展问题，不断增加新能源供给消纳能力，为新能源跨越式发展奠定了坚实的基础。国家战略规划的有力支撑与积极引导以及基础设施项目所在区域强劲的电力消纳能力，为本基金未来发展提供了坚实保障。

本基金基础设施项目位于江苏省盐城市，江苏省及周边区域的经济对基础设施项目存续期的稳定运营有重要影响。江苏省处在长三角、长江经济带交汇区域和对外开放前沿，作为全国第二经济大省，2023年江苏省地区生产总值达12.82万亿元，同比增长5.8%。2023年随着宏观经济回暖，江苏省用电量增速回升，2023年全社会用电量达7,833亿千瓦时，同比增长5.86%，2024年上半年，江苏省全社会用电量3,923.06亿千瓦时，同比增长8.97%。江苏省社会用电量的强劲需求与稳步增长，为本基金基础设施项目发电量的全额上网，创造了良好条件。

盐城市是中国起步最早的海上风电基地之一，风资源得天独厚，海上风电装机容量超过550万千瓦，海上风电可开发容量超3,000万千瓦。盐城市正在全力打造世界风电装备产业集群，构建了涵盖“研发设计—装备制造—资源开发—运维服务”的风电全产业链，成为全球海上风电装备综合产能最大的基地之一，目前盐城市海上风电整机产能约

占全国40%，叶片产能约占全国20%。区域规模化发展带来强大的区域供应链体系，完善的产业配套使得基础设施项目有着显著的运营成本优势，也为基础设施项目稳定运营提供了人员、技术与物资保障。

未来基金管理人和运营管理机构将持续关注宏观经济、电力市场与新能源行业政策变化，跟进绿色电力交易、绿色电力证书等政策进展情况，不断优化经营策略，力争进一步增厚基础设施项目收益。同时，基金管理人将与运营管理机构密切配合，切实履行安全管理责任，筑牢安全生产防线，保障生产经营持续稳定。

#### 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 报告期末基金的资产组合情况

单位：人民币元

序号	项目	金额
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	3,615,417.25
4	其他资产	-
5	合计	3,615,417.25

#### 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出现本期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

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，由公司分管运营领导任估值委员会主任，委员包括投资相关部门、研究部、稽控合规部、风险管理部、运营管理部的部门负责人。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策和执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据。

## 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 基金管理人及其管理基础设施基金的经验

中信建投基金管理有限公司（以下简称“中信建投基金”）于2013年9月9日在北京成立，注册资本4.5亿元，中信建投证券股份有限公司全资控股。中信建投基金主要经

营公开募集证券投资基金募集、销售、管理，特定客户资产管理以及中国证监会许可的其他业务。

截至报告期末，中信建投基金在管公募证券投资基金57个，其中包括公募基础设施证券投资基金1个。

在基础设施项目管理方面，中信建投基金设置独立的基础设施基金投资管理部门，具有5年以上基础设施项目投资管理经验的主要负责人员6名，具备5年以上基础设施项目运营经验的主要负责人员8名，同时具备健全有效的基础设施基金投资管理、项目运营、内部控制与风险管理制度和流程等。

中信建投基金以公募基金为业务本源，以专户业务为服务抓手，加强投研体系建设，注重核心投资人才的积累、培养，不断提升主动投资管理能力。同时，中信建投基金加强客户体系建设，积极拓展渠道，加大与国有大行、股份制银行、证券公司以及保险机构的合作力度。中信建投基金各项业务有序开展，为进一步发展奠定了良好的基础。

中信建投基金作为基金管理公司，秉承“忠于信，健于投”，追求以稳健的投资，回馈于客户的信任；致力于经过长期努力，打造具有影响力的品牌。

### 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历	说明
		任职日期	离任日期			
孙营	本基金的基金经理、基础设施及不动产投资部联席行政负责人	2023-03-20	-	8年	曾在中信建投证券股份有限公司主要负责全面协助北京地区各分支机构开展公司金融业务（主要侧重于债券承销、ABS方向，也涉及基础设施行业的新三板项目）及负责对公司承销债权类项目的后续管理工作。2020年8月加入中信建投基	中国籍，1989年10月生，哈尔滨商业大学管理学硕士，会计师职称，注册会计师，注册税务师。曾任大连万达集团股份有限公司会计，中信建投证券股份有限公司北京东直门南大街证券营业部公司金融业务部理财规划师，中信建投证券股份有限公司中小企业金融部和中信建投证券股份有限公司风险管

					<p>金管理有限公司后，参与中信建投基金公募REITs业务的筹备工作。2023年3月至今，担任中信建投国家电投新能源封闭式基础设施证券投资基金基金经理。</p>	<p>理部高级经理。2020年8月加入中信建投基金管理有限公司，现任本公司基础设施及不动产投资部联席行政负责人、投资管理基金经理，具有5年以上基础设施投资管理经验。</p>
刘志鹏	本基金的基金经理	2023-03-20	-	17年	<p>曾在华锐风电科技（集团）股份有限公司担任我国首个海上风电示范项目-上海东海大桥海上风电项目的项目负责人，担任公司客服中心、生产管理、采购商务、运营管理等多个部门的主要负责人并负责相关的运营管理工作。在中广核（北京）新能源科技有限公司工作期间，主要负责中广核新能源的高端运维服务、科技成果转化工作、前瞻性产业投资等工作（侧重于风电、光伏等清洁能源方向）。2022年7月加入中信建投基金管理有限公司后，参与中信建投基金公募REITs业务的筹备工作。2023年3月至今，担</p>	<p>中国籍，1981年11月生，鞍山科技大学工学学士，工程师职称。曾任北京首嘉钢结构有限公司设计员，华锐风电科技（集团）股份有限公司运营管理部部长，中广核（北京）新能源科技有限公司产品运营部高级经理。2022年7月加入中信建投基金管理有限公司，现任本公司基础设施及不动产投资部运营管理基金经理，具有5年以上基础设施运营管理经验。</p>

					任中信建投国家电投新能源封闭式基础设施证券投资基金基金经理。	
徐程龙	本基金的基金经理	2023-03-20	-	12年	曾在中国华电科工（集团）有限公司参与投资建设包括中国华电越南沿海二期2×660MW燃煤电厂项目在内的多个国际电力项目，在EDF（中国）投资有限公司作为股东方代表负责法国电力在华投资的基础设施项目项目公司的运营管理，包括江西大唐国际抚州发电有限公司、山东中华发电有限公司、河南大唐三门峡发电有限公司、法电大唐（三门峡）城市供热有限公司、法电（灵宝）生物质热电有限公司等项目公司，涵盖发电、城市照明、城市供热等多种基础设施项目类型。2022年6月加入中信建投基金管理有限公司后，参与中信建投基金公募REITs业务的筹备工作。2023年3月至今，担任中信建投国家电	中国籍，1988年3月生，清华大学工程硕士，工程师职称，会计师职称，一级建造师，注册安全工程师。曾任中国华电科工（集团）有限公司工程师、项目经理助理、商务经理，EDF（中国）投资有限公司资产管理总监。2022年6月加入中信建投基金管理有限公司，现任本公司基础设施及不动产投资部运营管理基金经理，具有5年以上基础设施运营管理经验。

					投新能源封闭式基础设施证券投资基金基金经理。	
--	--	--	--	--	------------------------	--

注：（1）基金经理任职日期、离任日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写。首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

（2）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管理起始日期起计算。

## 6.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集基础设施证券投资基金指引（试行）》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有发生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

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

## 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

本基金初始募集资金在扣除基础设施基金不可预见费用后全部用于认购专项计划资产支持证券，通过投资专项计划资产支持证券穿透取得基础设施项目完全所有权或经营权利。基金管理人通过主动投资管理和运营管理基础设施项目，确保基础设施项目的持续、稳定运营，争取为基金份额持有人提供稳定的收益，保护基金份额持有人的合法权益。

报告期内，基金资产按照法律法规、基金合同的要求进行投资，项目公司开展了结构性存款和协定存款业务，报告期内取得结构性存款、协定存款以及活期存款利息（扣除手续费支出）等利息收入132.47万元。基金管理人在充分考虑安全性、流动性的前提下，对基础设施项目运行过程中产生的闲置资金进行有效投资，最大程度保障投资者利益。

### （2）管理人对报告期内基金运营分析

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进行管理，未发生有损投资者利益的风险事件。

报告期内，基础设施项目运营正常，本基金本期实现可供分配金额详见本报告“3.3 基金收益分配情况”。本基金投资的基础设施项目运营情况详见本报告“4.1 对报告期内基础设施项目公司运营情况的整体说明”。本基金投资的基础设施项目公司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”。

## 6.5 管理人对报告期内基金收益分配情况的说明

根据相关法律法规及《基金合同》的约定，在符合有关基金分配条件的前提下，每年至少收益分配一次。基金应当将90%以上合并后基金年度可供分配金额以现金形式分配给投资者。

报告期内，本基金共进行一次收益分配。于2024年4月24日（场外）、2024年4月26日（场内）进行了2023年第三次现金红利发放，权益登记日为2024年4月22日，除息日为2024年4月22日（场外）、2024年4月23日（场内），收益分配基准日为2023年12月31日，每10份基金份额派发红利3.92元，共计派发红利313,599,984.20元。

## 6.6 管理人对宏观经济及行业走势的简要展望

### （1）宏观经济概况

国家统计局数据显示，2024年上半年国内生产总值616,836亿元，按不变价格计算，同比增长5.0%。分产业看，第一产业增加值30,660亿元，同比增长3.5%；第二产业增加值236,530亿元，增长5.8%；第三产业增加值349,646亿元，增长4.6%。

2024年上半年，全国规模以上工业增加值同比增长6.0%。分三大门类看，采矿业增加值增长2.4%，制造业增长6.5%，电力、热力、燃气及水生产和供应业增长6.0%。其中，装备制造业增加值增长7.8%，高技术制造业增加值增长8.7%。上半年，全国工业生产实现较快增长，装备制造业支撑作用明显。

2024年上半年，我国宏观政策效应持续释放、外需有所回暖、新质生产力加速发展等因素形成新支撑，国民经济运行总体平稳，稳中有进，生产稳定增长，需求持续恢复，就业物价总体稳定，居民收入继续增加，新动能加快成长，高质量发展取得新进展。综合来看，我国经济稳定运行并稳中向好，发展面临的有利条件强于不利因素，长期向好的发展态势没有改变。

### （2）行业概况及展望

#### 1) 电力生产消费持续增长，支撑经济平稳运行

根据国家统计局公布的最新统计数据，2024年1-6月份，我国规模以上工业发电量为44,354亿千瓦时，同比增长5.2%，规模以上工业水电、核电、风电、太阳能发电量合计同比增长13.4%，占规模以上工业发电量比重提升；单位GDP能耗继续下降。新技术继续赋能绿色发展，清洁能源生产较快增长，节能降碳取得积极进展，经济发展的绿色含量持续提升。

根据国家能源局公布的统计数据，2024年上半年我国全社会用电量46,575亿千瓦时，同比增长8.1%。从分产业用电看，第一产业用电量623亿千瓦时，同比增长8.8%；

第二产业用电量30,670亿千瓦时，同比增长6.9%；第三产业用电量8,525亿千瓦时，同比增长11.7%；城乡居民生活用电量6,757亿千瓦时，同比增长9.0%。

根据国家能源局江苏监管办公室公布的统计数据，2024年1-6月份，江苏省累计全社会用电量3,923.06亿千瓦时，同比增长8.97%。2024年调度用电最高负荷12,589.60万千瓦，同比增长11.62%。

### 2) 新能源装机持续增加，风电消纳形势稳定

根据国家能源局公布的最新统计数据，截至2024年6月底，全国累计发电装机容量约30.7亿千瓦，同比增长14.1%。其中，风电装机容量约4.7亿千瓦，同比增长19.9%。

根据国家能源局最新披露数据，2024年1-6月份，全国风电利用率为96.1%，光伏发电利用率为97%，其中江苏省风电利用率为99.9%，光伏发电利用率为99.9%，江苏省新能源消纳情况显著优于全国平均水平。

### 3) 绿色低碳发展政策持续利好，促进行业健康发展

2024年1月27日，国家发展改革委、国家统计局、国家能源局联合印发《关于加强绿色电力证书与节能降碳政策衔接大力促进非化石能源消费的通知》，该通知明确可再生能源、核电等非化石能源不纳入能源消耗总量和强度调控，并在“十四五”省级人民政府节能目标责任评价考核中，将非化石能源消费量从能源消费总量中扣除，以此核算能耗强度降低指标。该通知将绿证交易电量纳入节能评价考核的核心范畴，进一步推动非化石能源消费的快速增长。此外，通知还要求加快可再生能源项目建档立卡及绿证核发进度，鼓励扩大绿证交易范围。通知特别强调了绿证与碳核算和碳市场管理的衔接，以及推动绿证国际互认的举措，提高中国绿证的国际影响力和认可度。

2024年3月5日，国务院总理李强在第十四届全国人民代表大会第二次会议上发布政府工作报告。报告指出，2024年要积极稳妥推进碳达峰碳中和，大力发展绿色低碳经济。扎实开展“碳达峰十大行动”。深入推进能源革命，控制化石能源消费，加快建设新型能源体系，推进产业结构、能源结构、交通运输结构、城乡建设发展绿色转型。完善支持绿色发展的财税、金融、投资、价格政策和相关市场化机制，促进节能降碳先进技术研发应用，加快形成绿色低碳供应链。

2024年3月18日，国家能源局印发《2024年能源工作指导意见》的通知，对2024年我国能源行业的发展做出了详细的指示规划。意见指出，要把保障国家能源安全放在首位，积极有力地推进能源绿色低碳转型，要深入践行能源安全新战略，更好统筹发展和安全，处理好新能源与传统能源、全局与局部、能源开发和节约利用等关系，着力提升能源安全保障能力，着力推进能源绿色低碳转型，着力深化能源改革创新，着力提高能源国际合作水平，加快规划建设新型能源体系，为中国式现代化建设提供安全可靠的能源保障。

2024年4月10日，中国人民银行联合国家发展改革委、工业和信息化部、财政部、生态环境部、金融监管总局和中国证监会印发《关于进一步强化金融支持绿色低碳发展的指导意见》，从优化绿色金融标准体系、强化信息披露方面、促进绿色金融产品和市场发展、加强政策协调和制度保障、强化气候变化相关审慎管理和风险防范、加强国际

合作、强化组织保障等七个方面强化了金融对绿色低碳发展的支持，对未来5年乃至2035年提出了阶段性发展目标。

2024年4月16日，江苏省发改委、财政厅和生态环境厅联合印发《江苏省碳达峰碳中和试点建设方案》，方案旨在通过开展碳达峰碳中和试点建设，有效发挥城市、园区、企业等不同主体的主动性和创造性，围绕绿色低碳转型先行先试，探索行之有效的经验做法，形成一批可操作可复制可推广的发展模式和典型经验，加快发展方式绿色转型，尤其是能源低碳转型，助力江苏省如期实现碳达峰碳中和目标。

2024年5月29日，国务院印发《2024-2025年节能降碳行动方案》，方案通过分领域、分行业的节能降碳专项行动，方案力求在更高水平和更高质量上推进节能降碳工作，以实现经济效益、社会效益和生态效益的最大化，并为达成碳达峰和碳中和目标打下坚实的基础。方案明确了一系列措施，旨在通过加大非化石能源的开发力度和提升电网对可再生能源的消纳能力，促进非化石能源消费提升。方案提出了对重点用能单位的节能降碳管理，包括将可再生能源电力消纳责任权重具体分配给这些单位，并实行化石能源消费预算管理，鼓励超出预算部分通过购买绿电和绿证来抵消。同时，方案强调加强绿证交易与节能降碳政策的衔接，实现2024年底绿证核发的全覆盖，通过市场机制促进新能源电力的消费和利用。

#### 4) 规范电力市场体系建设，助力能源绿色低碳转型

2024年1月15日，财政部办公厅、国家发展改革委办公厅、国家能源局综合司联合下发《关于加强可再生能源电价附加补助资金常态化管理有关工作的通知》，通知要求，电网企业应严格按照现行政策规定审核和拨付补助资金，并依据补贴清单调整、项目核查检查等情况，及时做好已拨付补助资金的调整和收回等工作。电网企业应严格落实相关规定，做好补助资金的台账管理，全面、准确记录补助资金拨付至可再生能源发电项目的明细情况，加快推进可再生能源发电补贴项目清单审核、公布等工作，并与省级主管部门、信息中心、项目业主等做好沟通衔接，逐月统计已申报项目补贴清单审核进展情况。

2024年2月8日，国家发展改革委、国家能源局联合发布《关于建立健全电力辅助服务市场价格机制的通知》，决定从国家层面统一建立健全电力辅助服务市场价格机制，相关政策自2024年3月1日起实施。国家建立健全辅助服务价格机制，是构建新型电力系统的又一重要举措。一方面，通过推动各类经营主体公平参与辅助服务市场，明确市场交易和价格机制，有利于激励经营主体提供新型电力系统所需要的辅助服务，更好保障电力系统安全稳定运行，促进清洁能源消纳和绿色低碳转型。另一方面，统一明确辅助服务交易原则、计价规则和部分关键参数设置、辅助服务费用传导分担机制，有利于规范辅助服务交易和价格行为，预计政策实施后全国辅助服务费用总规模有所减少，经营主体或用户对辅助服务费用的承担也将更加公平合理。

2024年3月18日，国家发展改革委公布《全额保障性收购可再生能源电量监管办法》，办法是对2007年出台的《电网企业全额收购可再生能源电量监管办法》的修订完善，对促进可再生能源电量消纳，助力能源绿色低碳转型，支撑“双碳”战略目标落实具有重

大意义。办法对全额保障性收购范围进行优化，提出全额保障性收购包括保障性收购电量和市场交易电量，多方位、多主体协同促进可再生能源消纳，有利于推动可再生能源有序参与市场竞争，确保新能源由计划向市场平稳过渡，进一步发挥市场机制对新能源消纳的促进作用，保障新能源项目开发主体的合理收益。办法通过优化完善全额保障性收购监管制度，有力保障可再生能源消纳，将更好发挥可再生能源在构建新型能源体系方面的重大作用，为实现“双碳”战略目标提供更加有力的支撑和保障。

2024年4月10日，国家发展改革委印发《电力市场运行基本规则》，对加快建设全国统一电力市场体系做出顶层设计，并将于2024年7月1日起施行。该规则充分考虑新型电力系统发展的新形势，对新型经营主体进行了定义，对电力辅助服务交易、容量交易等进行了明确，是适应新型电力系统发展的实际需要，着力构建适应高比例新能源接入、传统电源提供可靠电力支撑、新型经营主体发展的电力市场体系架构。

2024年4月19日，国家能源局发布关于公开征求《绿色电力交易专章（征求意见稿）》意见的通知。该通知作为《电力中长期交易基本规则》（发改能源规〔2020〕889号）的补充，对满足电力用户购买绿色电力需求，加快建立有利于促进绿色能源生产消费的市场体系和长效机制，积极稳妥推进碳达峰碳中和具有积极作用。

2024年4月26日，国家能源局发布关于公开征求《可再生能源绿色电力证书核发和交易规则（征求意见稿）》意见的通知。该规则的实施有助于落实《国家发展改革委 财政部 国家能源局关于做好可再生能源绿色电力证书全覆盖工作 促进可再生能源电力消费的通知》，有助于规范可再生能源绿色电力证书的核发和交易，确保绿证市场的有序运行，提升绿色电力消费水平，进一步促进可再生能源电力的消费，有助于推动能源结构的持续优化和低碳转型。

2024年5月8日，国家发展改革委印发了《电力市场监管办法》，该办法自2024年6月1日起施行。该办法的出台旨在通过进一步强化对电力市场成员行为的监管，有效维护公平、公正的电力市场秩序，激发市场活力，是稳妥、有序推进全国统一电力市场体系建设的重要环节。

2024年6月4日，国家能源局发布了《关于做好新能源消纳工作 保障新能源高质量发展的通知》（国能发电力〔2024〕44号），通知针对新能源配套电网项目建设、系统调节能力提升和网源协调发展、电网资源配置平台作用发挥、新能源利用率目标优化等各方关注、亟待完善的重点方向，提出做好新能源消纳工作的举措，确保新能源在大规模发展的同时保持合理利用水平，对规划建设新型能源体系、构建新型电力系统、推动实现“双碳”战略目标具有重要意义。

## 6.7 管理人对关联交易及相关利益冲突的防范措施

### （1）固定收益投资部分关联交易的内控措施

本基金固定收益投资部分的关联交易将依照普通证券投资基金关联交易的内控措施管理。

针对普通证券投资基金的关联交易，基金管理人已经制定了完善的关联交易管理办法。在基金的运作管理过程中，对关联方和关联交易在认定、识别、审议、管理和信息披露等方面进行全流程管理。具体来说，基金管理人梳理了相关关联交易禁止清单，并及时在内部系统中进行更新维护；此外，基金管理人根据法律法规进行关联交易前的审批与合规性检查，只有合理确认相关交易符合基金管理人的关联交易政策后方可继续执行。

### （2）基础设施项目投资部分关联交易的内部控制措施

针对基础设施证券投资基金，基金管理人制定了投资管理、运营管理和风险管理的专项制度。为防范关联交易中的潜在利益冲突，有效管理关联交易风险，关联交易应根据基金管理人的章程、风险管理指引等公司制度履行基础设施基金内部审批程序。

针对于此，基金管理人根据关联方的识别标准，针对本基金投资于基础设施项目所涉及的相关主体，判断是否构成关联方；如构成关联方的，在不属于禁止或限制交易的基础上，结合关联交易的性质，严格按照法律法规、中国证监会的相关规定和内部审议程序，在审议通过的基础上执行相关交易，并严格按照规定履行信息披露和报告的义务。在本基金的运作管理过程中，涉及新增关联交易的，均应当根据关联交易的性质履行相关程序（例如，由本基金的基金份额持有人大会等在各自权限范围内审议），在严格履行适当程序后方执行相关交易，并严格按照规定履行信息披露和报告的义务。

### （3）关联交易的风险防范措施

本基金在存续期间可能存在日常运作方面的关联交易；基础设施项目亦可能存在日常经营所必要的关联交易，或者有利于业务顺利开展和正常经营的关联交易。基金管理人将积极采取相关措施，以避免利益输送、影响基础设施项目利益从而影响基金份额持有人利益的潜在风险：

1) 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、关联方回避表决制度。其中，关联交易审批程序含内部审批程序和外部审批程序。

内部审批程序系指根据法律法规、中国证监会的规定和基金管理人的内控制度所应履行的程序，例如，部分关联交易需由基金份额持有人大会以一般决议通过、部分关联交易需由基金份额持有人大会以特别决议通过，并根据相关法规予以披露。

2) 严格对市场行情、市场交易价格进行充分调查，必要时聘请专业机构提供评估、法律、审计等专业服务，以确保关联交易价格的公允性。

3) 基础设施项目日常经营过程中，基金管理人将妥善保管相关资料，并将通过不定期随机抽样查阅交易文件及银行资金流水、现场检查等方式，以核查该等关联交易的履行情况、对基础设施项目的影响等；如存在可能影响基础设施项目利益和基金份额持有人利益的情形的，应当及时采取措施避免或减少损失。

## § 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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

## 7.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、收益分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人中信建投基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

## 7.3 托管人对本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

本基金托管人依法对中信建投基金管理有限公司编制和披露的本基金2024年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 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：中信建投国家电投新能源封闭式基础设施证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	8.5.7.1	109,841,261.79	140,858,748.82
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	-	-
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	1,337,632,906.62	1,063,687,484.42

应收清算款		-	-
应收利息		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
存货	8.5.7.8	734,649.76	734,649.76
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	6,113,901,673.97	6,308,275,529.60
在建工程	8.5.7.13	-	-
使用权资产	8.5.7.14	33,609,596.84	34,445,647.52
无形资产	8.5.7.15	7,615,078.15	7,956,511.99
开发支出	8.5.7.16	-	-
商誉	8.5.7.17	-	-
长期待摊费用	8.5.7.18	-	-
递延所得税资产	8.5.7.19	4,530,824.78	4,094,141.13
其他资产	8.5.7.20	135,365,433.02	186,540,113.02
<b>资产总计</b>		<b>7,743,231,424.93</b>	<b>7,746,592,826.26</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年06月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
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	135,376,372.17	167,384,310.30
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		7,671,595.84	12,382,557.52
应付托管费		383,990.82	619,558.79

应付投资顾问费		-	-
应交税费	8.5.7.24	3,113,851.26	1,517,035.49
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	182,495,179.82	-
预计负债	8.5.7.28	-	-
租赁负债	8.5.7.29	36,106,406.47	35,258,166.76
递延收益		-	-
递延所得税负债	8.5.7.19	-	-
其他负债	8.5.7.30	3,753,268.63	3,906,109.68
<b>负债合计</b>		<b>368,900,665.01</b>	<b>221,067,738.54</b>
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	8.5.7.31	7,840,000,000.00	7,840,000,000.00
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		6,241,857.37	2,056,792.00
盈余公积	8.5.7.34	-	-
未分配利润	8.5.7.35	-471,911,097.45	-316,531,704.28
<b>所有者权益合计</b>		<b>7,374,330,759.92</b>	<b>7,525,525,087.72</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>7,743,231,424.93</b>	<b>7,746,592,826.26</b>

注：报告截止日2024年6月30日，基金份额净值9.2179元，基金份额总额800,000,000.00份。

### 8.1.2 个别资产负债表

会计主体：中信建投国家电投新能源封闭式基础设施证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
资产：			

货币资金	8.5.19.1	3,615,417.25	3,942,310.74
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	7,839,600,000.00	7,839,600,000.00
其他资产		-	-
<b>资产总计</b>		<b>7,843,215,417.25</b>	<b>7,843,542,310.74</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年06月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
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		6,143,856.18	9,912,917.68
应付托管费		383,990.82	619,558.79
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
其他负债		59,672.34	340,000.00
<b>负债合计</b>		<b>6,587,519.34</b>	<b>10,872,476.47</b>

<b>所有者权益：</b>			
实收基金		7,840,000,000.00	7,840,000,000.00
资本公积		-	-
其他综合收益		-	-
未分配利润		-3,372,102.09	-7,330,165.73
<b>所有者权益合计</b>		<b>7,836,627,897.91</b>	<b>7,832,669,834.27</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>7,843,215,417.25</b>	<b>7,843,542,310.74</b>

## 8.2 利润表

### 8.2.1 合并利润表

会计主体：中信建投国家电投新能源封闭式基础设施证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年03月20日（基 金合同生效日）至20 23年06月30日
<b>一、营业总收入</b>		<b>475,906,629.58</b>	<b>301,849,678.12</b>
1. 营业收入	8.5.7.36	475,806,629.58	298,117,055.96
2. 利息收入		-	3,732,622.16
3. 投资收益（损失以“-”号填列）	8.5.7.37	-	-
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	100,000.00	-
8. 其他业务收入	8.5.7.41	-	-
<b>二、营业总成本</b>		<b>309,110,058.57</b>	<b>190,880,269.63</b>
1. 营业成本		286,874,298.95	138,421,462.10
2. 利息支出	8.5.7.42	-	-
3. 税金及附加	8.5.7.43	1,740,208.94	5,112,720.76

4. 销售费用	8.5.7.44	-	-
5. 管理费用	8.5.7.45	59,933.88	470,376.00
6. 研发费用		-	-
7. 财务费用	8.5.7.46	12,380,032.34	715,731.42
8. 管理人报酬		7,671,593.64	45,787,794.53
9. 托管费		383,990.82	221,238.85
10. 投资顾问费		-	-
11. 信用减值损失	8.5.7.47	-	-
12. 资产减值损失	8.5.7.48	-	-
13. 其他费用	8.5.7.49	-	150,945.97
<b>三、营业利润（营业亏损以“-”号填列）</b>		166,796,571.01	110,969,408.49
加：营业外收入	8.5.7.50	3,400.00	-
减：营业外支出	8.5.7.51	-	-
<b>四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		166,799,971.01	110,969,408.49
减：所得税费用	8.5.7.52	8,579,379.98	24,601,301.27
<b>五、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		158,220,591.03	86,368,107.22
1. 持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）		158,220,591.03	86,368,107.22
2. 终止经营净利润（净亏损以“-”号填列）		-	-
<b>六、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>七、综合收益总额</b>		158,220,591.03	86,368,107.22

注：报告期内，以项目公司年度净收入为基数计提的基金固定管理费为 35,953,462.45 元，结合该费用的实际支付路径，列示在项目公司单体报表的“营业成本”中。2023 年度可比期间，该费用金额为 41,363,027.75 元，列示在基金合并报表的“管理人报酬”项目中。

### 8.2.2 个别利润表

会计主体：中信建投国家电投新能源封闭式基础设施证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年03月20日（基 金合同生效日）至20 23年06月30日
<b>一、收入</b>		324,145,828.72	3,732,622.16
1. 利息收入		9,727.12	3,732,622.16
2. 投资收益（损失以“-”号填列）		324,136,101.60	-
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		-	-
<b>二、费用</b>		6,587,780.88	3,911,998.18
1. 管理人报酬		6,143,856.18	3,539,813.36
2. 托管费		383,990.82	221,238.85
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		59,933.88	150,945.97
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		317,558,047.84	-179,376.02
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		317,558,047.84	-179,376.02
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		317,558,047.84	-179,376.02

### 8.3 现金流量表

#### 8.3.1 合并现金流量表

会计主体：中信建投国家电投新能源封闭式基础设施证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日 至2024年06月30 日	上年度可比期间 2023年03月20日 (基金合同生效 日)至2023年06 月30日
<b>一、经营活动产生的现金流量：</b>			
1. 销售商品、提供劳务收到的现金		263,716,069.24	165,694,561.00
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		9,727.12	3,732,622.16
6. 收到的税费返还		-	-
7. 收到其他与经营活动有关的现金	8.5.7.5 3.1	1,554,167.83	7,591,476.62
<b>经营活动现金流入小计</b>		265,279,964.19	177,018,659.78
8. 购买商品、接受劳务支付的现金		118,214,866.07	35,752,409.30
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		32,406,754.34	25,183,941.26
14. 支付其他与经营活动有关的现金	8.5.7.5 3.2	13,359,513.45	473,848.81
<b>经营活动现金流出小计</b>		163,981,133.86	61,410,199.37
<b>经营活动产生的现金流量净额</b>		101,298,830.33	115,608,460.41
<b>二、投资活动产生的现金流量：</b>			
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		-	-
<b>投资活动现金流入小计</b>		-	-
18. 购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		257,722.20	89,800.00
19. 取得子公司及其他营业单位支付的现金净额		-	5,889,595,031.86
20. 支付其他与投资活动有关的现金		-	-
<b>投资活动现金流出小计</b>		257,722.20	5,889,684,831.86
<b>投资活动产生的现金流量净额</b>		-257,722.20	-5,889,684,831.86
<b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>			
21. 认购/申购收到的现金		-	7,840,000,000.00
22. 取得借款收到的现金		182,495,179.82	-
23. 收到其他与筹资活动有关的现金		-	-
<b>筹资活动现金流入小计</b>		182,495,179.82	7,840,000,000.00
24. 赎回支付的现金		-	-
25. 偿还借款支付的现金		-	1,823,538,460.47
26. 偿付利息支付的现金		-	921,969.75
27. 分配支付的现金		314,553,774.98	-
28. 支付其他与筹资活动有关的现金		-	-
<b>筹资活动现金流出小计</b>		314,553,774.98	1,824,460,430.22
<b>筹资活动产生的现金流量净额</b>		-132,058,595.16	6,015,539,569.78
<b>四、汇率变动对现金及现金等价物</b>		-	-

的影响			
五、现金及现金等价物净增加额		-31,017,487.03	241,463,198.33
加：期初现金及现金等价物余额		140,858,748.82	-
六、期末现金及现金等价物余额		109,841,261.79	241,463,198.33

注：（1）经营活动产生的现金流量中“取得利息收入收到的现金”为基金托管账户中的活期存款利息收入。

（2）报告期内，经营活动产生的现金流量中“收到其他与经营活动有关的现金”较上年度可比期间变动的主要原因为2023年上半年收到了保险理赔款7,065,941.77元。

### 8.3.2 个别现金流量表

会计主体：中信建投国家电投新能源封闭式基础设施证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日 至2024年06月30 日	上年度可比期间 2023年03月20日 (基金合同生效 日)至2023年06 月30日
<b>一、经营活动产生的现金流量：</b>			
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		324,136,101.60	-
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		9,727.12	3,732,220.46
7. 收到其他与经营活动有关的现金		-	-
<b>经营活动现金流入小计</b>		<b>324,145,828.72</b>	<b>3,732,220.46</b>
8. 取得基础设施投资支付的现金		-	7,839,600,000.00
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		10,872,738.01	605.00
<b>经营活动现金流出小计</b>		10,872,738.01	7,839,600,605.00
<b>经营活动产生的现金流量净额</b>		313,273,090.71	-7,835,868,384.54
<b>二、筹资活动产生的现金流量：</b>			
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		-	-
<b>筹资活动现金流入小计</b>		-	-
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		313,599,984.20	-
19. 支付其他与筹资活动有关的现金		-	-
<b>筹资活动现金流出小计</b>		313,599,984.20	-
<b>筹资活动产生的现金流量净额</b>		-313,599,984.20	-
<b>三、汇率变动对现金及现金等价物的影响</b>		-	-
<b>四、现金及现金等价物净增加额</b>		-326,893.49	-7,835,868,384.54
加：期初现金及现金等价物余额		3,942,310.74	7,840,000,000.00
<b>五、期末现金及现金等价物余额</b>		3,615,417.25	4,131,615.46

## 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：中信建投国家电投新能源封闭式基础设施证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06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	7,840,000.00	-	-	-	2,056,792.00	-	-316,531,704.28	7,525,508.72
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	7,840,000.00	-	-	-	2,056,792.00	-	-316,531,704.28	7,525,508.72
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-	-	-	-	4,185,065.37	-	-155,379,393.17	-151,194,327.80
(一) 综合收益总额	-	-	-	-	-	-	158,220,591.03	158,220,591.03
(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	-	-	-	-	-	-	-313,599,984.20	-313,599,984.20
(四) 其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-	-	-	-	-
(五) 专项储备	-	-	-	-	4,18	-	-	4,18

					5,06			5,06
					5.37			5.37
其中：本期提取	-	-	-	-	4,80			4,80
					6,48	-	-	6,48
					4.02			4.02
本期使用	-	-	-	-	621,4			621,4
					18.65			18.65
(六) 其他	-	-	-	-	-			-
四、本期期末余额	7,84				6,24		-471,	7,37
	0,00				1,85		911,0	4,33
	0,00	-	-	-	7.37		97.45	0,75
	0.00							9.92
项目	上年度可比期间							
	2023年03月20日(基金合同生效日)至2023年06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	-	-	-	-	-	-	-	-
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	7,84							7,84
	0,00							0,00
	0,00	-	-	-	-	-	-	0,00
	0.00							0.00
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-	-	-	-	5,53		86,36	91,90
					8,62	-	8,10	6,73
					6.22		7.22	3.44
(一) 综合收益总额	-	-	-	-	-	-	86,36	86,36
							8,10	8,10
							7.22	7.22
(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	-	-	-	-	-	-	-	-
(四) 其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-	-	-	-	-
(五) 专项储备	-	-	-	-	5,53 8,62 6.22	-	-	5,53 8,62 6.22
其中：本期提取	-	-	-	-	2,69 2,88 2.14	-	-	-
本期使用	-	-	-	-	181,5 55.79	-	-	-
(六) 其他	-	-	-	-	-	-	-	-
四、本期期末余额	7,84 0,00 0,00 0.00	-	-	-	5,53 8,62 6.22	-	86,36 8,10 7.22	7,93 1,90 6,73 3.44

#### 8.4.2 个别所有者权益变动表

会计主体：中信建投国家电投新能源封闭式基础设施证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06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	7,840,00 0,000.00	-	-	-7,330,1 65.73	7,832,66 9,834.27
加：会计政策变更	-	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
二、本期期初余额	7,840,00 0,000.00	-	-	-7,330,1 65.73	7,832,66 9,834.27

三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-	-	-	3,958,06 3.64	3,958,06 3.64
(一) 综合收益总额	-	-	-	317,558, 047.84	317,558, 047.84
(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	-	-	-	-313,59 9,984.20	-313,59 9,984.20
(四) 其他综合收益结 转留存收益	-	-	-	-	-
(五) 其他	-	-	-	-	-
四、本期期末余额	7,840,00 0,000.00	-	-	-3,372,1 02.09	7,836,62 7,897.91
项目	上年度可比期间 2023年03月20日(基金合同生效日)至2023年06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	-	-	-	-	-
加: 会计政策变更	-	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
二、本期期初余额	7,840,00 0,000.00	-	-	-	7,840,00 0,000.00
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-	-	-	-179,37 6.02	-179,37 6.02
(一) 综合收益总额	-	-	-	-179,37 6.02	-179,37 6.02
(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	-	-	-	-	-

（四）其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-	-
（五）其他	-	-	-	-	-
<b>四、本期期末余额</b>	7,840,000,000.00	-	-	-179,376.02	7,839,820,623.98

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：

黄凌	张欣宇	谭保民
-----	-----	-----
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 8.5 报表附注

### 8.5.1 基金基本情况

中信建投国家电投新能源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[2023]456号《关于准予中信建投国家电投新能源封闭式基础设施证券投资基金注册的批复》核准，由中信建投基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投国家电投新能源封闭式基础设施证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型封闭式，存续期限为21年。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币7,840,000,000.00元。经向中国证监会备案，《中信建投国家电投新能源封闭式基础设施证券投资基金基金合同》于2023年3月20日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为800,000,000.00份。本基金的基金管理人为中信建投基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投国家电投新能源封闭式基础设施证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金存续期内以80%以上基金资产投资基础设施项目为投资标的的资产支持专项计划，并持有其全部份额，通过资产支持证券等特殊目的载体取得基础设施项目公司全部股权，最终取得相关基础设施项目完全经营权。本基金持有的基础设施项目为滨海北H1项目、滨海北H2项目及配套运维驿站项目（合称为“基础设施项目”）。

### 8.5.2 会计报表的编制基础

#### （一）编制基础

本基金以持续经营为基础，根据实际发生的交易和事项，按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》和各项具体会计准则、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金

信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》),参照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》及允许的基金行业实务操作,并基于以下所述重要会计政策、会计估计进行编制。

## (二) 持续经营能力评价

本财务报表以持续经营为基础列报。本基金不存在导致对报告期末起12个月内的持续经营假设产生重大疑虑的事项或情况。

本基金会计核算以权责发生制为基础,除某些金融工具外,本财务报表均以历史成本为计量基础。资产如果发生减值,则按照相关规定计提相应的减值准备。

### 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2024年6月30日的合并及基金单体财务状况以及2024年1月1日至2024年6月30日的合并及基金单体经营成果和合并及基金单体现金流量等有关信息。

### 8.5.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 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

不适用。

#### 8.5.5.2 会计估计变更的说明

不适用。

#### 8.5.5.3 差错更正的说明

无。

### 8.5.6 税项

#### 主要税种及税率

#### 1. 本基金及纳入合并范围的专项计划适用的主要税种及税率

##### (1) 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税 税试点的通知》的规定,对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税;国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税;存款利息收入不征收增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《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》的规定,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。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，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、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

## (2) 所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

### 2. 纳入合并范围的滨海海上风公司适用的主要税种及税率

税 种	计税依据	税 率
增值税	应税收入分别按6%、13%的税率计算销项税，并按扣除当期允许抵扣的进项税额后的差额计缴增值税。	6%、13%
房产税	从价计征的，按房产原值一次减除70%后余值的1.2%计缴；从租计征的，按租金收入的12%计缴	1.2%、12%
城市维护建设税	实际缴纳的流转税税额	5%
教育费附加	实际缴纳的流转税税额	3%
地方教育附加	实际缴纳的流转税税额	2%
企业所得税	应纳税所得额	25%，具体按国家的有关规定。

## 税收优惠及批文

项目公司所属风力发电企业符合财政部、国家税务局发布的《关于风力发电增值税政策的通知》（财税[2015]74号）有关规定，自2015年7月1日起享受“即征即退50%”的增值税优惠政策。

## 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06月30日	上年度末 2023年12月31日

库存现金	-	-
银行存款	109,841,261.79	140,858,748.82
其他货币资金	-	-
小计	109,841,261.79	140,858,748.82
减：减值准备	-	-
合计	109,841,261.79	140,858,748.82

#### 8.5.7.1.2 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
活期存款	109,841,261.79	140,858,748.82
定期存款	-	-
其中：存款期限1-3个月	-	-
其他存款	-	-
应计利息	-	-
小计	109,841,261.79	140,858,748.82
减：减值准备	-	-
合计	109,841,261.79	140,858,748.82

#### 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

报告期末，本基金不存在因抵押、质押或冻结等对使用有限制、有潜在回收风险的款项。

#### 8.5.7.2 交易性金融资产

无。

#### 8.5.7.3 买入返售金融资产

无。

#### 8.5.7.4 债权投资

无。

#### 8.5.7.5 其他债权投资

无。

#### 8.5.7.6 其他权益工具投资

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06月30日	上年度末 2023年12月31日
1年以内	587,977,671.28	622,558,260.72
1—2年	567,160,037.52	441,129,223.70
2—3年	194,593,484.15	12,098,286.33
小计	1,349,731,192.95	1,075,785,770.75
减：坏账准备	12,098,286.33	12,098,286.33
合计	1,337,632,906.62	1,063,687,484.42

#### 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06月30日				
	账面余额		坏账准备		账面价值
	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	12,098,286.33	0.90	12,098,286.33	100.00	-
按组合计 提预期信 用损失的 应收账款	1,337,632,906.62	99.10	-	-	1,337,632,906.62
合计	1,349,731,192.95	100.00	12,098,286.33	0.90	1,337,632,906.62
类别	上年度末 2023年12月31日				
	账面余额		坏账准备		账面价值
	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	12,098,286.33	1.12	12,098,286.33	100.00	-
按组合计提预期信用损失的应收账款	1,063,687,484.42	98.88	-	-	1,063,687,484.42
合计	1,075,785,770.75	100.00	12,098,286.33	1.12	1,063,687,484.42

### 8.5.7.7.3 单项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06月30日			
	账面余额	坏账准备	计提比例(%)	计提理由
国网江苏省电力有限公司	12,098,286.33	12,098,286.33	100.00	预计无法收回
合计	12,098,286.33	12,098,286.33	100.00	-

注：此笔应收款项是线路补贴款。根据（财建[2018]250号）规定，已纳入和尚未纳入国家可再生能源电价附加资金补助目录的可再生能源接网工程项目，不再通过可再生能源电价附加补助资金给予补贴，相关补贴纳入所在省输配电价回收，由国家发改委在核定输配电价时一并考虑。

### 8.5.7.7.4 按组合计提坏账准备的应收账款

本基金报告期末无按组合计提坏账准备的应收账款。

### 8.5.7.7.5 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
国网江苏省电力有限公司	1,348,162,558.95	99.88	12,098,286.33	1,336,064,272.62

司				
国家电投集团江苏海上风力发电有限公司	1,568,634.00	0.12	-	1,568,634.00
合计	1,349,731,192.95	100.00	12,098,286.33	1,337,632,906.62

### 8.5.7.8 存货

#### 8.5.7.8.1 存货分类

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日			上年度末 2023年12月31日		
	账面 余额	存货跌价准 备/合同履约 成本减值准 备	账面 价值	账面 余额	存货跌价准 备/合同履约 成本减值准 备	账面 价值
原材料	734,64 9.76	-	734,64 9.76	734,64 9.76	-	734,64 9.76
在产品	-	-	-	-	-	-
库存商品	-	-	-	-	-	-
周转材料	-	-	-	-	-	-
合同履约 成本	-	-	-	-	-	-
合计	734,64 9.76	-	734,64 9.76	734,64 9.76	-	734,64 9.76

注：上述原材料为备品备件。

### 8.5.7.9 合同资产

无。

### 8.5.7.10 持有待售资产

无。

### 8.5.7.11 投资性房地产

无。

### 8.5.7.12 固定资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
固定资产	6,113,901,673.97	6,308,275,529.60
固定资产清理	-	-
合计	6,113,901,673.97	6,308,275,529.60

#### 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	119,853,0 21.77	7,908,31 2,461.30	982,024.2 2	3,947,33 4.02	8,033,09 4,841.31
2. 本期增加金额	-	-	-	97,802.39	97,802.39
购置	-	-	-	97,802.39	97,802.39
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	119,853,0 21.77	7,908,31 2,461.30	982,024.2 2	4,045,13 6.41	8,033,19 2,643.70
二、累计折旧					
1. 期初余额	18,707,65 7.76	1,703,68 9,727.05	362,534.0 7	2,059,39 2.83	1,724,81 9,311.71
2. 本期增加金额	2,772,79 6.08	191,397,0 37.90	47,003.64	254,820.4 0	194,471,6 58.02
本期计提	2,279,70 1.56	135,589,2 23.20	45,426.66	261,905.1 4	138,176,2 56.56
其他原因增加	493,094.5 2	55,807,81 4.70	1,576.98	-7,084.74	56,295,40 1.46
3. 本期减少金额	-	-	-	-	-
处置或报废	-	-	-	-	-

其他原因减少	-	-	-	-	-
4. 期末余额	21,480,453.84	1,895,086,764.95	409,537.71	2,314,213.23	1,919,290,969.73
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	98,372,567.93	6,013,225,696.35	572,486.51	1,730,923.18	6,113,901,673.97
2. 期初账面价值	101,145,364.01	6,204,622,734.25	619,490.15	1,887,941.19	6,308,275,529.60

#### 8.5.7.13 在建工程

报告期末在建工程无余额。

#### 8.5.7.14 使用权资产

单位：人民币元

项目	海面滩涂	合计
一、账面原值		
1. 期初余额	39,461,951.58	39,461,951.58
2. 本期增加金额	-	-
3. 本期减少金额	-	-
4. 期末余额	39,461,951.58	39,461,951.58
二、累计折旧		
1. 期初余额	5,016,304.06	5,016,304.06
2. 本期增加金额	836,050.68	836,050.68
本期计提	836,050.68	836,050.68
3. 本期减少金额	-	-

处置	-	-
4. 期末余额	5,852,354.74	5,852,354.74
三、减值准备		
1. 期初余额	-	-
2. 本期增加金额	-	-
本期计提	-	-
3. 本期减少金额	-	-
处置	-	-
4. 期末余额	-	-
四、账面价值		
1. 期末账面价值	33,609,596.84	33,609,596.84
2. 期初账面价值	34,445,647.52	34,445,647.52

### 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	计算机软件	合计
一、账面原值						
1. 期初余额	-	4,823,530.78	-	-	5,254,228.43	10,077,759.21
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	-	4,823,530.78	-	-	5,254,228.43	10,077,759.21
二、累计摊销						
1. 期初余额	-	407,386.27	-	-	1,713,860.95	2,121,247.22
2. 本期增加金额	-	54,199.	-	-	287,23	341,43

		68			4.16	3.84
本期计提	-	31,022.52	-	-	205,909.02	236,931.54
其他原因增加	-	23,177.16	-	-	81,325.14	104,502.30
3. 本期减少金额	-	-	-	-	-	-
处置	-	-	-	-	-	-
其他原因减少	-	-	-	-	-	-
4. 期末余额	-	461,585.95	-	-	2,001,095.11	2,462,681.06
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	-	4,361,944.83	-	-	3,253,133.32	7,615,078.15
2. 期初账面价值	-	4,416,144.51	-	-	3,540,367.48	7,956,511.99

#### 8.5.7.16 开发支出

无。

#### 8.5.7.17 商誉

无。

#### 8.5.7.18 长期待摊费用

无。

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日		上年度末 2023年12月31日	
	可抵扣暂时性 差异	递延所得税 资产	可抵扣暂时性 差异	递延所得税 资产
资产减值准备	-	-	-	-
内部交易未实现利润	-	-	-	-
信用减值损失	12,098,286.33	3,024,571.58	12,098,286.33	3,024,571.58
租赁负债	37,295,404.68	9,323,851.17	36,384,720.76	9,096,180.19
其他	2,339,204.96	584,801.23	2,339,204.96	584,801.23
合计	51,732,895.97	12,933,223.98	50,822,212.05	12,705,553.00

#### 8.5.7.19.2 未经抵销的递延所得税负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日		上年度末 2023年12月31日	
	应纳税暂时性 差异	递延所得税 负债	应纳税暂时性 差异	递延所得税 负债
非同一控制企业合并资产评估增值	-	-	-	-
公允价值变动	-	-	-	-
使用权资产	33,609,596.84	8,402,399.20	34,445,647.52	8,611,411.87
合计	33,609,596.84	8,402,399.20	34,445,647.52	8,611,411.87

#### 8.5.7.19.3 以抵销后净额列示的递延所得税资产或负债

单位：人民币元

项目	递延所得税资产和负债期末互抵金额	抵销后递延所得税资产或负债期末余额	递延所得税资产和负债期初互抵金额	抵销后递延所得税资产或负债期初余额
递延所得税资产	8,402,399.20	4,530,824.78	8,611,411.87	4,094,141.13
递延所得税负债	-	-	-	-

#### 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06月30日	上年度末 2023年12月31日
预付账款	1,088,060.82	9,664,646.06
其他流动资产	134,277,372.20	176,875,466.96
合计	135,365,433.02	186,540,113.02

注：其他流动资产包含两部分，一部分是留抵进项税额91,720,610.79元，一部分是多缴企业所得税42,556,761.41元。

### 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06月30日	上年度末 2023年12月31日
1年以内	1,088,060.82	9,664,646.06
1—2年	—	—
合计	1,088,060.82	9,664,646.06

#### 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
电能易购（北京）科技有限公司	669,428.08	61.52	2024-06-26	发票已收到，暂未履行入账手续
国网江苏省电力有限公司滨海县供电分公司	333,456.74	30.65	2024-06-04	发票已收到，暂未履行入账手续
滨海县财政局	85,176.00	7.83	2024-06-28	发票已收到，暂未履行入账手续
合计	1,088,060.82	100.00		

#### 8.5.7.20.3 其他应收款

无。

### 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06月30日	上年度末 2023年12月31日
1年以内	105,288,922.55	167,384,310.30
1年以上	30,087,449.62	-
合计	135,376,372.17	167,384,310.30

### 8.5.7.23 应付职工薪酬

无。

### 8.5.7.24 应交税费

单位：人民币元

税费项目	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
增值税	2,667,963.29	1,197,599.48
消费税	-	-
企业所得税	-	-
个人所得税	-	-
城市维护建设税	186,757.44	83,831.97
教育费附加	133,398.16	59,879.98
房产税	63,789.95	63,789.95
土地使用税	9,909.97	9,909.97
土地增值税	-	-
印花税	52,032.45	102,024.14
其他	-	-
合计	3,113,851.26	1,517,035.49

### 8.5.7.25 应付利息

无。

### 8.5.7.26 合同负债

无。

### 8.5.7.27 长期借款

单位：人民币元

借款类别	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
质押借款	182,495,179.82	-
抵押借款	-	-
保证借款	-	-
信用借款	-	-
未到期应付利息	-	-
合计	182,495,179.82	-

注：2024年3月26日，项目公司与中国工商银行股份有限公司南京新街口支行（简称“保理银行”）签订《国内单保理业务合同》，依据双方签订的保理合同及《应收账款转让明细表》，将债权及其附属权利整体转让保理银行，由保理银行提供总额为人民币182,495,179.82元有追索权的保理融资。2024年4月11日，该保理款项已到账。

### 8.5.7.28 预计负债

无。

### 8.5.7.29 租赁负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
1-2年	1,249,431.98	1,188,998.21
2-3年	1,312,937.44	1,249,431.98
3-4年	1,375,181.43	1,312,937.44
4-5年	1,449,567.71	1,375,181.43
5年以上	30,719,287.91	30,131,617.70
合计	36,106,406.47	35,258,166.76

### 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06月30日	上年度末 2023年12月31日
其他应付款	2,504,598.08	2,439,555.68
其他流动负债	59,672.34	340,000.00
一年内到期的非流动负债	1,188,998.21	1,126,554.00
合计	3,753,268.63	3,906,109.68

#### 8.5.7.30.2 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06月30日	上年度末 2023年12月31日
质保金	2,302,145.86	2,373,508.61
押金及保证金	-	-
代垫往来款	41,894.56	56,138.56
其他	160,557.66	9,908.51
合计	2,504,598.08	2,439,555.68

##### 8.5.7.30.3.2 账龄超过一年的重要其他应付款

无。

#### 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	800,000,000.00	7,840,000,000.00
本期认购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	800,000,000.00	7,840,000,000.00

#### 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	-316,531,704.28	-	-316,531,704.28
本期利润	158,220,591.03	-	158,220,591.03
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	-313,599,984.20	-	-313,599,984.20
本期末	-471,911,097.45	-	-471,911,097.45

#### 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01月01日至2024年06月30日	
	国家电投集团滨海海上风力发电有限公司	合计
营业收入	-	-
发电收入	475,806,629.58	475,806,629.58
合计	475,806,629.58	475,806,629.58
营业成本	-	-
发电成本	286,874,298.95	286,874,298.95
合计	286,874,298.95	286,874,298.95

#### 8.5.7.37 投资收益

无。

#### 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

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年0 6月30日	上年度可比期间 2023年03月20日(基金合同 生效日)至2023年06月30日
星级企业奖励	100,000.00	150,000.00
合计	100,000.00	150,000.00

8.5.7.41 其他业务收入

无。

8.5.7.42 利息支出

无。

8.5.7.43 税金及附加

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30 日	上年度可比期间 2023年03月20日(基金合同生效 日)至2023年06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	827,586.36	27.89
教育费附加	591,133.13	27.89
房产税	127,579.90	59,804.24
土地使用税	19,819.94	9,909.97
土地增值税	-	-
印花税	174,089.61	5,042,950.77
合计	1,740,208.94	5,112,720.76

8.5.7.44 销售费用

无。

#### 8.5.7.45 管理费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 06月30日	上年度可比期间 2023年03月20日(基金合同 生效日)至2023年06月30日
计提评估、审计和信息披露 费用	59,672.34	-
专项计划注册登记费用	-	470,376.00
其他	261.54	-
合计	59,933.88	470,376.00

#### 8.5.7.46 财务费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年0 6月30日	上年度可比期间 2023年03月20日(基 金合同生效日)至20 23年06月30日
银行手续费	2,740.98	2,311.71
利息费用	13,821,473.89	1,235,954.56
减：利息收入	-1,444,182.53	-522,534.85
其他	-	-
合计	12,380,032.34	715,731.42

注：报告期内利息费用中包含国补应收账款保理融资产生的利息支出，金额为1,088,127.51元。

#### 8.5.7.47 信用减值损失

无。

#### 8.5.7.48 资产减值损失

无。

#### 8.5.7.49 其他费用

无。

#### 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01月01日至2024年 06月30日	上年度可比期间 2023年03月20日(基金合同 生效日)至2023年06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	-	-
合同违约金	3,400.00	-
其他	-	-
合计	3,400.00	-

#### 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

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	上年度可比期间 2023年03月20日(基金合同 生效日)至2023年06月30日
当期所得税费用	9,016,063.63	24,601,301.27
递延所得税费用	-436,683.65	-
合计	8,579,379.98	24,601,301.27

##### 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01月01日至2024年 06月30日
利润总额	166,799,971.01
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	-40,364,247.63
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	49,380,311.26
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	-436,683.65
合计	8,579,379.98

### 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01月01日至2024年06 月30日	上年度可比期间 2023年03月20日(基金合同 生效日)至2023年06月30日
保险理赔款	-	7,065,941.77
存款利息收入	1,434,455.41	522,534.85
星级企业奖励	100,000.00	-
其他	19,712.42	3,000.00
合计	1,554,167.83	7,591,476.62

#### 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01月01日至2024年 06月30日	上年度可比期间 2023年03月20日(基金合同 生效日)至2023年06月30日
2023年管理人报酬、托管费	13,002,114.11	-
专项计划注册登记费用	-	470,376.00
信披审计评估费用	340,000.00	-
手续费	17,399.34	3,472.81
合计	13,359,513.45	473,848.81

### 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01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年03月20日(基 金合同生效日)至20
----	-----------------------------------	--

		23年06月30日
1. 将净利润调节为经营活动现金流量		
净利润	158,220,591.03	86,368,107.22
加：信用减值损失	-	-
资产减值损失	-	-
固定资产折旧	194,471,658.02	105,519,672.65
投资性房地产折旧	-	-
使用权资产折旧	836,050.68	462,974.30
无形资产摊销	341,433.84	183,455.17
长期待摊费用摊销	-	-
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）	12,910,789.97	1,235,954.56
投资损失（收益以“-”号填列）	-	-
递延所得税资产减少（增加以“-”号填列）	-436,683.65	-
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）	-273,945,422.20	-133,700,693.89
经营性应付项目的增加（减少以“-”号填列）	4,715,347.27	53,027,664.05
其他	4,185,065.37	2,511,326.35
经营活动产生的现金流量净额	101,298,830.33	115,608,460.41
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	109,841,261.79	241,463,198.33
减：现金的期初余额	140,858,748.82	-
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	-31,017,487.03	241,463,198.33

#### 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01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年03月20日(基金合同 生效日)至2023年06月30日
一、现金	109,841,261.79	81,463,198.33
其中：库存现金	-	-
可随时用于支付的 银行存款	109,841,261.79	81,463,198.33
可随时用于支付的 其他货币资金	-	-
二、现金等价物	-	160,000,000.00
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	109,841,261.79	241,463,198.33
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

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	直接持股比例	间接持股比例	取得方式
中信建投-国家电投新能源发电1期资产支持专项计划	北京	北京	资产支持专项计划	100.00	-	设立
国家电投集团滨海海上风力发电有限公司	盐城	盐城	海上风力发电	-	100.00	购买

### 8.5.10 分部报告

无。

### 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

无。

#### 8.5.11.2 或有事项

无。

#### 8.5.11.3 资产负债表日后事项

无。

### 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
中信建投基金管理有限公司	基金管理人
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
中信建投证券股份有限公司	基金管理人股东、资产支持证券管理人
中信建投利信资本管理（北京）有限公司	基金管理人全资子公司
国家电投集团江苏电力有限公司	原始权益人、本基金30%以上的基金份额持有人

国家电力投资集团有限公司	本基金最终控制方
国家电投集团江苏海上风力发电有限公司	原始权益人持有人之子公司
国家电投集团协鑫滨海发电有限公司	原始权益人持有人之子公司
滨海智慧风力发电有限公司	原始权益人持有人之子公司
国家电投集团江苏电力有限公司生产监控调度培训中心	原始权益人之分公司
山东电力工程咨询院有限公司	与原始权益人受同一最终控制方控制
百瑞信托有限责任公司	与原始权益人受同一最终控制方控制
国家电投集团保险经纪有限公司	与原始权益人受同一最终控制方控制
电能易购（北京）科技有限公司	与原始权益人受同一最终控制方控制
中能融合智慧科技有限公司	与原始权益人受同一最终控制方控制
中电华创（苏州）电力技术研究有限公司	与原始权益人受同一最终控制方控制

### 8.5.13 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 8.5.13.1 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 2024年01月01 日至2024年06 月30日	上年度可比期 间 2023年03月20 日(基金合同生 效日)至2023年 06月30日
国家电投集团江苏海上风力发电有限公司	运营支出	15,175,164.18	8,042,500.00
国家电投集团保险经纪有限公司	保险费	9,600,104.55	5,875,671.56
中电华创（苏州）电力技术研究有限公司	服务费	188,679.25	-
中能融合智慧科技有限公司	服务费	160,349.67	8,129.03
国家电投集团协鑫滨海发电有限公司	服务费	41.60	-
国家电投集团江苏电力有限公司	服务费	-	446,899.06

司生产监控调度培训中心			
合计	-	25,124,339.25	14,373,199.65

#### 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

无。

#### 8.5.13.3 通过关联方交易单元进行的交易

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 2024年01月01日至2024年 06月30日	上年度可比期间 2023年03月20日(基金合同 生效日)至2023年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	43,625,056.09	45,787,794.53
其中：固定管理费	43,625,056.09	45,787,794.53
浮动管理费	-	-
支付销售机构的客户维护费	75.78	140.46

注：（1）固定管理费1按已披露的前一个估值日的基金资产净值为基数按0.2%的年费率计提。计算方法如下：

日固定管理费1=已披露的前一个估值日的基金资产净值为基数（首个估值日的基金资产净值披露之前，以基金募集资金规模为基数） $\times$ 0.2%/当年天数。

报告期内，基金管理人按照上述公式在报告中做了固定管理费1的预提，金额为7,671,593.64元。

（2）固定管理费2按项目公司年度净收入为基础按9.3%的年费率并考虑调整比率计提。

计算方法如下：

固定管理费2=项目公司年度净收入 $\times$ 9.3% $\times$ （1-调整比率）。

报告期内，基金管理人以项目公司未经审计的年度净收入为基数，结合其对应的

EBITDA完成率及调整比率，按照上述公式在报告中做了固定管理费2的预提，金额为35,953,462.45元。

#### 8.5.13.4.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 06月30日	上年度可比期间 2023年03月20日(基金合 同生效日)至2023年06月3 0日
当期发生的基金应支付的 托管费	383,990.82	221,238.85

注：基金托管费按已披露的前一个估值日的基金资产净值为基数按0.01%的年费率按日计提。计算方法如下：

日基金托管费=已披露的前一个估值日的基金资产净值为基数（首个估值日的基金资产净值披露之前，以基金募集资金规模为基数）×0.01%/当年天数。

报告期内，基金管理人按照上述公式在报告中做了托管费的预提，金额为383,990.82元。

#### 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

无。

##### 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

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日						
	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
国家电投集团江苏 电力有限公司	284,44 0,387.	35.5 6%	-	-	-	284,44 0,387.	35.5 6%

	00					00	
百瑞信托有限责任公司	7,487,425.00	0.94%	-	-	1,032,770.00	6,454,655.00	0.81%
中信建投证券股份有限公司	35,662,015.00	4.46%	28,497,204.00	-	26,435,538.00	37,723,681.00	4.72%
中信建投利信资本管理（北京）有限公司	8,000,000.00	1.00%	-	-	7,122,250.00	877,750.00	0.11%
合计	335,589,827.00	41.96%	28,497,204.00	-	34,590,558.00	329,496,473.00	41.20%
上年度可比期间 2023年03月20日（基金合同生效日）至2023年06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
国家电投集团江苏电力有限公司	272,000,000.00	34.00%	9,972,664.00	-	-	281,972,664.00	35.25%
百瑞信托有限责任公司	-	-	7,032,425.00	-	-	7,032,425.00	0.88%
中信建投证券股份有限公司	25,199,567.00	3.15%	54,445,865.00	-	46,064,831.00	33,580,601.00	4.20%
中信建投利信资本管理（北京）有限公司	8,000,000.00	1.00%	-	-	-	8,000,000.00	1.00%
合计	305,199,567.00	38.15%	71,450,954.00	-	46,064,831.00	330,585,690.00	41.32%

注：元达信资本管理（北京）有限公司于2023年7月更名为中信建投利信资本管理（北京）有限公司。

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 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年03月20日(基金合同生效日)至2023年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	109,841,261.59	1,444,182.53	241,461,225.88	4,248,835.35
合计	109,841,261.59	1,444,182.53	241,461,225.88	4,248,835.35

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

单位：人民币元

项目名称	关联方名称	本期末 2024年06月30日		上年度末 2023年12月31日	
		账面余额	坏账准备	账面余额	坏账准备
应收款项	国家电投集团江苏海上风力发电有限公司	1,568,634.00	-	1,568,634.00	-
预付款项	电能易购(北京)科技有限公司	630,000.00	-	39,428.08	-
预付款项	国家电投集团保险经纪有限公司	-	-	9,600,104.55	-
合计	-	2,198,634.00	-	11,208,166.63	-

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06月30 日	上年度末 2023年12月31 日
应付账款	国家电投集团协鑫滨海发电有限公司	-	1,216.42
应付账款	国家电投集团江苏电力有限公司生产监控调度培训中心	-	1,016,252.83
应付账款	国家电投集团江苏海上风力发电有限公司	51,136,947.89	80,427,707.44
应付账款	国家电力投资集团有限公司	-	1,218,366.40
应付账款	山东电力工程咨询院有限公司	-	678,300.00
其他应付款	国家电投集团江苏海上风力发电有限公司	67,036.49	50,724.07
其他应付款	滨海智慧风力发电有限公司	-	14,244.00
应付管理人报酬-基金管理人报酬	中信建投基金管理有限公司	6,143,856.18	9,912,917.68
应付管理人报酬-计划管理人报酬	中信建投证券股份有限公司	1,527,739.66	2,469,639.84
应付托管费	中国工商银行股份有限公司	383,990.82	619,558.79
合计	-	59,259,571.04	96,408,927.47

#### 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	2024-04-22	2024-04-23	3.9200	313,599,984.20	37.36	2023年第三次收益分配，收益分配基准日为2023年12月31日
合计	-	-	-	313,599,984.20	37.36	

注：以上收益分配数据是实际分配金额，除息日为场内除息日。

### 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。

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。本基金存放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，存放于声誉良好并拥有较高信用评级的大中型银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。

对于应收账款和其他应收款，本基金的基金管理人设定相关政策以控制信用风险敞口。本基金的基金管理人基于对客户的财务状况、信用记录及其他因素诸如目前市场状况等评估客户的信用资质并设置相应信用期。本基金的基金管理人会定期对客户信用记录进行监控，对于信用记录不良的客户，本基金的基金管理人会采用书面催款、缩短信用期或取消信用期等方式，以确保本基金的整体信用风险在可控的范围内。

### 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。

流动性风险是指本基金在履行以交付现金或其他金融资产结算的义务时遇到资金短缺的风险。

本基金采用封闭式运作，封闭期内不得申请申购、赎回本基金，故基金面临的兑付赎回资金的流动性风险较低。本基金管理人基于现金流量预测结果，在基金层面监控长短期资金需求，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。

(1) 利率风险，是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率风险可源于已确认的计息金融工具和未确认的金融工具。

本基金的利率风险主要产生于银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。浮动利率的金融负债使本公司面临现金流量利率风险，固定利率的金融负债使本公司面临公允价值利率风险。本公司根据当时的市场环境来决定固定利率及浮动利率合同的相对比例，并通过定期审阅与监察维持适当的固定和浮动利率工具组合。

于2024年6月30日，本基金未持有债券资产，因此利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### (2) 汇率风险

汇率风险，是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。汇率风险可源于以记账本位币之外的外币进行计价的金融工具。

于2024年6月30日，本基金未持有以外币计价的金融工具，因此汇率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### (3) 其他价格风险

其他价格风险，是指汇率风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险，无论这些变动是由于与单项金融工具或其发行方有关的因素而引起的，还是由于与市场内交易的所有类似金融工具有关的因素而引起的。其他价格风险可源于商品价格、股票市场指数、权益工具价格以及其他风险变量的变化。

于2024年6月30日，本基金未持有重大的以公允价值计量的金融工具，因此价格的变动对于本基金资产净值无重大影响。

### 8.5.18 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至报告期末，本基金无需要说明的其他重要事项。

### 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06月30日	上年度末 2023年12月31日
库存现金	-	-
银行存款	3,615,417.25	3,942,310.74
其他货币资金	-	-
小计	3,615,417.25	3,942,310.74
减：减值准备	-	-
合计	3,615,417.25	3,942,310.74

##### 8.5.19.1.2 银行存款

单位：人民币元

项目	本期 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
活期存款	3,615,417.25	3,942,310.74
定期存款	-	-
其中：存款期限1-3个月	-	-
其他存款	-	-
应计利息	-	-
小计	3,615,417.25	3,942,310.74
减：减值准备	-	-
合计	3,615,417.25	3,942,310.74

##### 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

	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日

	账面余额	减值准备	账面价值	账面余额	减值准备	账面价值
对子公司投资	7,839,600,000.00	-	7,839,600,000.00	7,839,600,000.00	-	7,839,600,000.00
合计	7,839,600,000.00	-	7,839,600,000.00	7,839,600,000.00	-	7,839,600,000.00

### 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
中信建投-国家电投新能源发电1期资产支持专项计划	7,839,600,000.00	-	-	7,839,600,000.00	-	-
合计	7,839,600,000.00	-	-	7,839,600,000.00	-	-

## § 9 评估报告

### 9.1 管理人聘任评估机构及评估报告内容的合规性说明

报告期内，未进行评估。

### 9.2 评估报告摘要

报告期内，未进行评估。

### 9.3 评估机构使用评估方法的特殊情况说明

报告期内，未进行评估。

## § 10 基金份额持有人信息

### 10.1 基金份额持有人户数及持有人结构

本期末 2024年06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（%）

19,078	41,933.12	790,869,028.00	98.86	9,130,972.00	1.14
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（%）
23,562	33,952.98	788,357,867.00	98.54	11,642,133.00	1.46

### 10.2 基金前十名流通份额持有人

本期末 2024年06月30日			
序号	持有人名称	持有份额（份）	占总份额比例（%）
1	中信建投证券股份有限公司	20,923,681.000	2.62
2	中国人寿资管—广发银行—国寿资产—鼎瑞绿色投资1号资产管理产品	16,000,000.000	2.00
3	中信证券股份有限公司	14,572,151.000	1.82
4	国家电投集团江苏电力有限公司	12,440,387.000	1.56
5	泰康保险集团股份有限公司—自有资金	12,000,000.000	1.50
6	长城基金管理有限公司	11,887,600.000	1.49
7	广发证券股份有限公司	10,810,559.000	1.35
8	兴瀚资管—兴业银行—兴瀚资管—兴元18号集合资产管理计划	10,000,000.000	1.25
9	中再资管—招商银行—中再资产—基建强国REITs主题资产管理产品	9,219,338.000	1.15
10	国新新格局（北京）私募证券投资基金管理有限公司—国	9,000,000.000	1.13

	新央企新发展格局私募证券投资基金		
合计		126,853,716.00	15.86
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	国家电投集团江苏电力有限公司	12,440,387.00	1.56
2	中信建投证券股份有限公司	11,662,015.00	1.46
3	国信证券股份有限公司	9,648,607.00	1.21
4	百瑞信托有限责任公司	7,487,425.00	0.94
5	中国国际金融股份有限公司	7,243,812.00	0.91
6	中信证券股份有限公司	6,743,480.00	0.84
7	华泰证券股份有限公司	3,647,165.00	0.46
8	申万宏源证券有限公司	3,594,634.00	0.45
9	中国银河证券股份有限公司	3,236,009.00	0.40
10	广发证券股份有限公司	3,178,221.00	0.40
合计		68,881,755.00	8.61

### 10.3 基金前十名非流通份额持有人

本期末 2024年06月30日			
序号	持有人名称	持有份额（份）	占总份额比例（%）
1	国家电投集团江苏电力有限公司	272,000,000.00	34.00
2	中信建投证券股份有限公司	16,800,000.00	2.10
3	英大基金—交通银行—英大基金—国英锦瑞1号集合资产管理计划	12,000,000.00	1.50
3	华金证券—东兴证券股份有限公司—华金证券东兴1号基础设施基金策略FOF单一资产管理计划	12,000,000.00	1.50
5	中信证券股份有限公司	11,200,000.00	1.40
5	中国银河证券股份有限公司	11,200,000.00	1.40

5	广发证券股份有限公司	11,200,000.00	1.40
5	中国中金财富证券有限公司	11,200,000.00	1.40
合计		357,600,000.00	44.70
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	国家电投集团江苏电力有限公司	272,000,000.00	34.00
2	中信建投证券股份有限公司	24,000,000.00	3.00
3	中信证券股份有限公司	16,000,000.00	2.00
3	中国中金财富证券有限公司	16,000,000.00	2.00
3	中国银河证券股份有限公司	16,000,000.00	2.00
3	广发证券股份有限公司	16,000,000.00	2.00
3	中国人寿资管—广发银行—国寿资产—鼎瑞绿色投资1号资产管理产品	16,000,000.00	2.00
3	光大证券资管—光大银行—光证资管诚享7号集合资产管理计划	16,000,000.00	2.00
9	英大基金—交通银行—英大基金—国英锦瑞1号集合资产管理计划	12,000,000.00	1.50
9	华金证券—东兴证券股份有限公司—华金证券东兴1号基础设施基金策略FOF单一资产管理计划	12,000,000.00	1.50
合计		416,000,000.00	52.00

#### 10.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	中信建投国家电投 新能源REIT	8,097.00	0.00

#### § 11 基金份额变动情况

单位：份

基金合同生效日（2023年03月20日）基金份额总额	800,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	800,000,000.00

本报告期基金总申购份额	-
本报告期其他份额变动情况	-
本报告期期末基金份额总额	800,000,000.00

## § 12 重大事件揭示

### 12.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 12.2 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，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 12.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 12.4 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基金份额的情况。

### 12.5 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

### 12.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为中汇会计师事务所（特殊普通合伙），本基金本报告期内不涉及改聘情况。

### 12.7 为基金出具评估报告的评估机构情况

本基金资产评估机构为北京国友大正资产评估有限公司，报告期内不存在改聘评估机构的情形。2024年为北京国友大正资产评估有限公司作为基础设施项目资产评估机构的第二年，未连续超过三年。

### 12.8 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 12.8.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2024年05月16日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局

受到的具体措施类型	责令改正
受到稽查或处罚等措施的原因	违反《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》等
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司积极进行整改，截至本报告期末已向中国证监会北京监管局提交完成整改报告。
其他	

注：报告期内基金管理人的高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 12.8.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 12.9 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	中信建投国家电投新能源封闭式基础设施证券投资基金关于2023年第三次收到国补应收账款回款情况的公告	规定网站、规定报刊	2024-01-03
2	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2023年第4季度报告提示性公告	规定报刊	2024-01-22
3	中信建投国家电投新能源封闭式基础设施证券投资基金2023年第4季度报告	规定网站	2024-01-22
4	关于中信建投国家电投新能源封闭式基础设施证券投资基金召开2023年第4季度业绩说明会的公告	规定网站、规定报刊	2024-01-22
5	中信建投国家电投新能源封闭式基础设施证券投资基金基金份额解除限售的提示性公告	规定网站、规定报刊	2024-03-15
6	中信建投国家电投新能源封闭式基础设施证券投资基金基金份额解除限售的提示性公告	规定网站、规定报刊	2024-03-22
7	中信建投国家电投新能源封闭式基础设施证券投资基金关于基金原始权益人进一步增持基金份额计划的公告	规定网站、规定报刊	2024-03-22
8	中信建投国家电投新能源封闭式基础设施证券投资基金招募说明书（更新）	规定网站	2024-03-27
9	中信建投国家电投新能源封闭式基础设施证券投资基金基金产品资料概要更新	规定网站	2024-03-27
10	中信建投国家电投新能源封闭式基础设施证券投资基金	规定网站、	2024-0

	金基金份额解除限售的公告	规定报刊	3-29
11	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2023年年度报告提示性公告	规定报刊	2024-03-29
12	中信建投国家电投新能源封闭式基础设施证券投资基金2023年年度报告	规定网站	2024-03-29
13	中信建投国家电投新能源封闭式基础设施证券投资基金2023年度审计报告	规定网站	2024-03-29
14	中信建投国家电投新能源封闭式基础设施证券投资基金2023年度评估报告	规定网站	2024-03-29
15	中信建投国家电投新能源封闭式基础设施证券投资基金关于2024年第1季度经营情况的临时公告	规定网站、规定报刊	2024-04-02
16	关于中信建投国家电投新能源封闭式基础设施证券投资基金召开2023年度业绩说明会的公告	规定网站、规定报刊	2024-04-17
17	中信建投国家电投新能源封闭式基础设施证券投资基金2023年第三次基金收益分配的公告	规定网站、规定报刊	2024-04-18
18	中信建投基金管理有限公司旗下全部基金2024年第1季度报告提示性公告	规定报刊	2024-04-22
19	中信建投国家电投新能源封闭式基础设施证券投资基金2024年第1季度报告	规定网站	2024-04-22
20	关于中信建投国家电投新能源封闭式基础设施证券投资基金召开2024年第1季度业绩说明会的公告	规定网站、规定报刊	2024-04-22
21	中信建投国家电投新能源封闭式基础设施证券投资基金基金产品资料概要更新	规定网站	2024-06-28

### § 13 影响投资者决策的其他重要信息

本基金穿透持有的基础设施项目相关信息如下：

金额单位：元

资产名称	滨海北 H1 项目、滨海北 H2 项目及配套运维驿站项目	备注
币种	人民币	
项目公司形成/购买资产时间	2015 年 7 月 2 日	
基金购买资产时间	2023 年 3 月 21 日	注（1）
项目初始成本	6,041,986,936.98	注（2）
资产组评估价值	7,162,791,460.55	注（2）
采用成本法计量的账面价值	5,290,326,048.04	注（4）
基金购买资产的投资成本	5,926,898,329.96	注（5）

--	--	--

- 注：（1）本基金购买基础设施项目的资产交割日；
- （2）基础设施项目形成（项目决算总投资）或购买资产的成本；
- （3）根据《中信建投国家电投新能源封闭式基础设施证券投资基金存续期间涉及的国家电投集团滨海海上风力发电有限公司拥有的海上风力发电资产组组合市场价值项目资产评估报告》（大正评报字（2024）第076A号），以2023年12月31日为评估基准日，资产组评估价值为7,162,791,460.55元；
- （4）项目公司采用成本法对基础设施项目进行会计计量，2023年12月31日，成本法计量的基础设施项目资产组账面价值为5,290,326,048.04元；
- （5）本基金从原始权益人处取得基础设施项目的股权转让对价款。

## § 14 备查文件目录

### 14.1 备查文件目录

- （1）中国证监会准予基金注册的文件；
- （2）《中信建投国家电投新能源封闭式基础设施证券投资基金基金合同》；
- （3）《中信建投国家电投新能源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。

### 14.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

### 14.3 查阅方式

投资者可以在营业时间免费查阅。

中信建投基金管理有限公司

2024年08月30日