
中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证 券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：中金基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 28 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 8 月 27 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。

运营管理机构已对中期报告中的相关披露事项进行确认，不存在异议，确保相关披露内容的真实性、准确性和完整性。

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

不动产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不动产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 2026 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	不动产基金简介	5
2.1	不动产基金产品基本情况	5
2.2	不动产项目基本情况说明	6
2.3	不动产基金扩募情况	6
2.4	基金管理人和运营管理机构	6
2.5	基金托管人、资产支持证券管理人、资产支持证券托管人	6
2.6	会计师事务所、资产评估机构、律师事务所、财务顾问（如有）等专业机构	7
2.7	信息披露方式	7
§3	主要财务指标和不动产基金运作情况	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	其他财务指标	7
3.3	不动产基金收益分配情况	7
3.4	报告期内不动产基金费用收取情况的说明	9
3.5	报告期内进行不动产项目重大改造或者扩建的情况	9
3.6	报告期内完成不动产基金购入、出售不动产项目交割审计的情况	9
3.7	报告期内发生的关联交易	9
3.8	报告期内与不动产项目相关的资产减值计提情况	9
3.9	报告期内其他不动产基金资产减值计提情况	10
3.10	报告期内不动产基金业务参与者作出承诺及承诺履行相关情况	10
§4	不动产项目基本情况	10
4.1	报告期内不动产项目的运营情况	10
4.2	不动产项目所属行业情况	12
4.3	不动产项目运营相关财务信息	17
4.4	项目公司经营现金流	18
4.5	项目公司对外借入款项情况	20
4.6	不动产项目投资情况	20
4.7	抵押、查封、扣押、冻结等他项权利限制的情况	20
4.8	不动产项目相关保险的情况	20
4.9	重要不动产项目生产经营状态、外部环境已经或者预计发生重大变化分析	20
4.10	其他需要说明的情况	21
§5	除不动产资产支持证券之外的投资组合报告	21
5.1	报告期末不动产基金的资产组合情况	21
5.2	投资组合报告附注	21
5.3	报告期内不动产基金估值程序等事项的说明	21
§6	回收资金使用情况	22
6.1	原始权益人回收资金使用有关情况说明	22

§7	管理人报告	22
7.1	基金管理人及主要负责人员情况	22
7.2	管理人在报告期内对不动产基金的投资运作决策和主动管理情况	23
7.3	管理人在报告期内对不动产基金的运营管理职责的落实情况	26
7.4	管理人在报告期内的信息披露工作开展情况	26
§8	运营管理机构报告	27
8.1	报告期内运营管理机构管理职责履行情况	27
8.2	报告期内运营管理机构配合信息披露工作开展情况	29
§9	其他业务参与者履职报告	29
9.1	托管人报告	29
9.2	资产支持证券管理人报告	30
9.3	原始权益人报告	31
§10	中期财务报告（未经审计）	31
10.1	资产负债表	31
10.2	利润表	34
10.3	现金流量表	36
10.4	所有者权益变动表	39
10.5	报表附注	43
§11	评估报告	72
§12	基金份额持有人信息	72
12.1	基金份额持有人户数及持有人结构	72
12.2	不动产基金前十名流通份额持有人	72
12.3	不动产基金前十名非流通份额持有人	73
12.4	期末基金管理人的从业人员持有本不动产基金的情况	73
§13	不动产基金份额变动情况	74
§14	重大事件揭示	74
14.1	基金份额持有人大会决议	74
14.2	基金管理人、基金托管人的专门不动产基金托管部门的重大人事变动	74
14.3	不动产基金投资策略的改变	74
14.4	为不动产基金进行审计的会计师事务所情况	74
14.5	为不动产基金出具评估报告的评估机构情况	74
14.6	报告期内信息披露义务人、运营管理机构及其高级管理人员，原始权益人、资产支持证券管理人、资产支持证券托管人、项目公司和专业机构等业务参与者涉及对不动产项目运营有重大影响的稽查、处罚、诉讼或者仲裁等情况	75
14.7	其他重大事件	75
§15	影响投资者决策的其他重要信息	76
§16	备查文件目录	76
16.1	备查文件目录	76
16.2	存放地点	77
16.3	查阅方式	77

§2 不动产基金简介

2.1 不动产基金产品基本情况

基金名称	中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金
基金简称	中金安徽交控 REIT
场内简称	安徽交控（扩位简称：中金安徽交控 REIT）
基金代码	508009
交易代码	508009
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	2022 年 11 月 11 日
基金管理人	中金基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,000,000,000.00 份
基金合同存续期	17 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 11 月 22 日
投资目标	本基金主要资产投资于不动产资产支持证券并持有其全部份额，通过不动产资产支持证券、项目公司等载体穿透取得不动产项目完全所有权或经营权利。本基金通过主动的投资管理和运营管理，提升不动产项目的运营收益水平，力争为基金份额持有人提供稳定的收益分配及长期可持续的收益分配增长。
投资策略	（一）不动产项目投资策略。1、初始基金资产投资策略。2、运营管理策略。3、资产收购策略。4、维修改造策略。5、出售及处置策略。6、对外借款策略。 （二）债券及货币市场工具的投资策略。
风险收益特征	本基金为公开募集不动产投资信托基金（REITs）（或简称不动产基金），在基金合同存续期内通过资产支持证券和项目公司等载体穿透取得不动产项目完全所有权或经营权利，通过积极运营管理以获取不动产项目车辆通行费等稳定现金流。一般市场情况下，本基金预期风险收益低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。
基金收益分配政策	（一）在符合有关基金分红条件的前提下，本基金应当将 90%以上合并后基金年度可供分配金额分配给投资者，每年不得少于 1 次，若基金合同生效不满 6 个月可不进行收益分配； （二）本基金收益分配方式为现金分红； （三）每一基金份额享有同等分配权； （四）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。 在不违背法律法规及基金合同的规定、且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人经与基金托管人协商一致，可在中国证监会允许的条件下调整基金收益的分配原则，不需召开基金份额持有人大会。
资产支持证券管理人	中国国际金融股份有限公司
运营管理机构	安徽省交通控股集团有限公司

2.2 不动产项目基本情况说明

不动产项目名称：沿江高速公路芜湖（张韩）至安庆（大渡口）段

项目公司名称	安徽省沿江高速公路有限公司
不动产项目业态	交通设施
不动产项目主要经营模式	沿江高速公路芜湖（张韩）至安庆（大渡口）段项目的运营管理，通过为过往车辆提供通行服务并按照政府收费标准收取车辆通行费的方式获取经营收益。
不动产项目地理位置	起于芜湖市（张韩），终于池州大渡口镇。沿江高速公路可分为三个路段，分别为沿江高速公路东段、沿江高速公路中段、沿江高速公路西段。其中，沿江高速公路东段起于芜湖市（张韩），终于铜陵市（朱村）；沿江高速公路中段起于铜陵（朱村），经天门镇、上水桥、大通镇、梅龙镇、观前镇、九华河、马衙镇，终于池州（毛竹园）；沿江高速公路西段起于池州（毛竹园），经双桥、殷家汇、牛头山，终于池州大渡口镇。

2.3 不动产基金扩募情况

无。

2.4 基金管理人和运营管理机构

项目		基金管理人	运营管理机构
名称		中金基金管理有限公司	安徽省交通控股集团有限公司
信息披露事务负责人	姓名	李耀光	左敦礼
	职务	副总经理	总经济师
	联系方式	xxpl@ciccfund.com	ahjkzjzx@163.com
注册地址		北京市朝阳区建国门外大街1号国贸写字楼2座26层05室	安徽省合肥市包河区西藏路1666号
办公地址		北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦B座43层	安徽省合肥市包河区西藏路1666号
邮政编码		100004	230092
法定代表人		李金泽	孙革新

2.5 基金托管人、资产支持证券管理人、资产支持证券托管人

项目	基金托管人	资产支持证券管理人	资产支持证券托管人
名称	招商银行股份有限公司	中国国际金融股份有限公司	招商银行股份有限公司
注册地址	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦	北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦	北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	518040	100004	518040
法定代表人	缪建民	陈亮	缪建民

2.6 会计师事务所、资产评估机构、律师事务所、财务顾问（如有）等专业机构

项目	名称	办公地址
会计师事务所	无	无
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
评估机构	无	无

2.7 信息披露方式

本不动产基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载不动产基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.ciccfund.com/
不动产基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§3 主要财务指标和不动产基金运作情况

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（2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
本期收入	411,769,225.18
本期净利润	-23,203,037.46
本期经营活动产生的现金流量净额	303,191,012.32
本期现金流分派率(%)	4.46
年化现金流分派率(%)	9.00
期末数据和指标	2026 年 6 月 30 日
期末不动产基金总资产	8,243,645,992.10
期末不动产基金净资产	6,914,460,895.57
期末不动产基金总资产与净资产的比例（%）	119.22

注：1、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；

2、本期现金流分派率=报告期可供分配金额/报告期末市值。年化现金流分派率=截至报告期末本年累计可供分配金额/报告期末市值/年初（基金成立当年为基金合同生效日）至报告期末实际天数*本年总天数。

3.2 其他财务指标

单位：人民币元

数据和指标	2026 年 6 月 30 日
期末不动产基金份额净值	6.9145
期末不动产基金份额公允价值参考净值	-

3.3 不动产基金收益分配情况

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	257,656,734.18	0.2577	-
2025年	636,495,559.07	0.6365	-
2024年	600,346,171.69	0.6003	-
2023年	780,445,986.54	0.7804	-

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	321,000,011.99	0.3210	-
2025年	623,000,071.15	0.6230	-
2024年	667,000,080.43	0.6670	-
2023年	1,088,600,062.65	1.0886	-

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	-23,203,037.46	-
本期折旧和摊销	353,193,896.21	-
本期利息支出	14,131,072.23	-
本期所得税费用	2,017,983.48	-
本期息税折旧及摊销前利润	346,139,914.46	-
调增项		-
1-其他可能的调整项，如不动产基金发行份额募集的资金、处置不动产项目资产取得的现金、金融资产相关调整、期初现金余额等	5,495,529.28	-
调减项		-
1-应收和应付项目的变动	-44,079,653.85	-
2-支付的利息及所得税费用	-16,149,055.71	-
3-偿还借款本金支付的现金	-9,750,000.00	-
4-其他资本性支出	-	-
5-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	-24,000,000.00	-
本期可供分配金额	257,656,734.18	-

注： 设置未来合理相关支出预留调整项的原因及其使用情况详见 3.3.2.3。

3.3.2.2 可供分配金额较上年同期变化超过10%的情况说明

本期可供分配金额为 257,656,734.18 元，较去年同期 316,334,875.48 元下降超 10%。主要原因为：（1）本期营业收入较去年同期减少约 4,372.45 万元；（2）年末结算的运营成本支付时点差异，导致本期经营性现金流出较去年同期多约 1,051.98 万元，该部分成本均在预算范围内。

3.3.2.3 设置未来合理支出相关预留调整项的原因，上年同期未来合理支出相关预留调整项的前期设置金额与实际使用金额差异超过10%的原因及合理性

未来合理支出相关预留为项目公司未来一个月的资金预算，主要系结合本基金每月稳定的现金流入特征，特预留项目公司未来一个月的资金预算作为日常支出储备，专项用于覆盖成本费用、税费缴纳等日常运营开支，确保资金调度与经营需求精准匹配，保障运营活动平稳有序开展。上年未来合理支出相关预留调整项的前期设置金额与实际使用金额差异未超 10%。

3.4 报告期内不动产基金费用收取情况的说明

3.4.1 报告期内基金管理人、基金托管人、资产支持证券管理人、资产支持证券托管人、运营管理机构的费用收取情况及依据

根据本基金基金合同、招募说明书和托管协议等相关法律文件，本报告期内基金管理人的管理费计提金额 2,753,618.16 元，资产支持证券管理人的管理费计提金额 485,932.75 元，基金托管人和资产支持证券托管人的托管费计提金额 359,951.08 元。运营管理机构的固定管理费用计提金额 0 元，未产生浮动管理费用。

费用收取依据参见本基金招募说明书及其更新“第四部分 治理机制与运营管理安排”之“四、运营管理安排”之“（三）运营管理费用”及“第五部分 不动产基金”之“六、基金运作”之“（二）基金合同及托管协议相关情况”之“9、基金的费用与税收”。

3.5 报告期内进行不动产项目重大改造或者扩建的情况

无。

3.6 报告期内完成不动产基金购入、出售不动产项目交割审计的情况

无。

3.7 报告期内发生的关联交易

报告期内发生的关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立，具体关联交易详见“10.5.12 关联方关系”及“10.5.13 本报告期及上年度可比期间的关联方交易”。

3.8 报告期内与不动产项目相关的资产减值计提情况

无。

3.9 报告期内其他不动产基金资产减值计提情况

无。

3.10 报告期内不动产基金业务参与人作出承诺及承诺履行相关情况

报告期内，本基金业务参与人未新增不动产基金相关承诺，不存在前期承诺事项无法按期履行或者履行承诺可能不利于维护不动产基金利益或者变更承诺的情形。

§4 不动产项目基本情况

4.1 报告期内不动产项目的运营情况

4.1.1 对报告期内重要不动产项目运营情况的说明

重要不动产项目指单独或者合计运营收入或者现金流占上年度全部不动产项目合计运营收入、现金流 10%以上的项目，或者其他对不动产项目运营、基金份额持有人权益产生重大影响的项目。本基金重要不动产项目为沿江高速公路（截至本报告披露日，本基金仅有此唯一不动产项目）。沿江高速公路分为东、中、西三段，收费经营到期时间分别为 2037 年 6 月 27 日、2038 年 6 月 27 日、2036 年 12 月 23 日。报告期内本不动产项目运营平稳，未发生安全生产责任事故，未出现重大未决诉讼或仲裁。其他基本情况参见“2.2 不动产项目基本情况说明”。

本不动产基金竞争性项目的基本情况详见招募说明书（及其更新）和往期报告，报告期内本不动产项目未新增竞争性道路。G4231 南京至九江高速公路（原 S22 天长至天柱山高速公路，北沿江高速）无为至安庆段（以下简称“宁九高速”）于 2025 年 12 月 26 日正式通车运营。宁九高速路线全长约 119.2 公里，线路起自无为市襄安镇北侧，止于怀宁县凉亭乡南侧，与合安高速相交，顺接正在建设的 S22 天天高速安庆至潜山段。全线采用双向四车道标准建设，设计时速 120 公里。宁九高速作为沿江高速的平行路段，其建成通车可能对沿江高速的车流量及通行费收入造成一定影响，基金管理人及运营管理机构将持续关注相关情况。

4.1.2 报告期以及上年同期不动产项目整体运营指标

序号	指标名称	指标含义说明及计算方式	指标单位	本期（2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）	上年同期（2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日）	同比（%）
1	日均自然车流量	断面自然车流量（含免费车流量）/自然天数	辆	20,632.78	22,694.06	-9.08
2	日均客车流量	客车断面自然车流量/自然天数	辆	13,940.43	15,265.00	-8.68

序号	指标名称	指标含义说明及计算方式	指标单位	本期（2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）	上年同期（2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日）	同比（%）
3	日均货车流量	货车断面自然车流量/自然天数	辆	5,789.07	6,321.26	-8.42
4	客车通行费收入	含税收入	万元	17,881.40	19,908.29	-10.18
5	货车通行费收入	含税收入	万元	24,472.95	26,623.61	-8.08
6	通行费收入	含税收入	万元	42,354.35	46,531.90	-8.98

注：1、断面自然车流量指每个区段两个收费站之间自然车流量按区段公里数加权平均后得出全程的日均车流量；

2、因联网运营公司无法提供精确的客货车型分别对应的通行费收入数据，客货车通行费收入为运营管理机构估算值。

4.1.3 报告期及上年同期重要不动产项目运营指标

本不动产基金重要不动产项目为沿江高速项目，无其他不动产项目，不动产项目运营指标参见“4.1.2 报告期以及上年同期不动产项目整体运营指标”。

4.1.4 其他运营情况说明

无。

4.1.5 可能对基金份额持有人权益产生重大不利影响的经营风险、行业风险、周期性风险

（1）经营风险

不动产项目的经营风险包括运营成本相关风险、维修和改造的相关风险、其他运营相关的风险等。

（2）行业风险

高速公路行业风险包括宏观经济环境变化可能导致的行业风险、周边区域交通网络和城市规划等发生变化的风险、相关政策法规发生变化的风险、土地使用政策风险、房屋产权风险等。

（3）周期性风险

证券市场受宏观经济运行的影响，而经济运行具有周期性的特点，而周期性的经济运行表现将对证券市场的收益水平产生影响，从而对收益产生影响。

随着通车营运时间的增加，为维持道路通行技术状况，需要定期对道路养护设施进行大中修。大中修期间，可能会对交通流量产生一定影响，同时增加运营成本，影响项目的盈利水平。

其他相关风险参见本基金招募说明书更新“第一部分 招募说明书概要及风险因素”之“二、风险因素”及往期公告。

4.2 不动产项目所属行业情况

4.2.1 不动产项目所属行业基本情况、发展阶段、周期性特点和竞争格局

（1）基本情况

不动产项目所属行业为交通运输业-道路运输业。高速公路行业作为交通运输行业的重要组成部分，是国民经济循环的动脉，是服务构建新发展格局的重要支撑。截至 2025 年底，全国高速公路通车里程达到 19.94 万公里，建成了全球最大的高速公路网。目前，我国持续推动基础设施建设，深化交通运输改革以及推动高速公路智能化发展，预计高速公路行业将继续保持稳步发展。

（2）行业发展阶段

交通运输部于 2026 年 6 月 22 日发布《2025 年交通运输行业发展统计公报》，交通运输行业紧紧围绕加快建设交通强国，奋发作为、攻坚克难，全年各项目标任务圆满完成，为经济社会平稳健康发展提供了有力的交通运输保障。

公路运输方面，2025 年全年完成营业性货运量 432.88 亿吨，比上年增长 3.4%，完成货物周转量 79,511 亿吨公里、增长 3.5%。2025 年全年完成公路人员流动量 612.26 亿人次，比上年增长 3.3%。

（3）行业周期性特点

高速公路行业具有一定的弱周期性。一方面，高速公路特许经营收费期限一般长达 25-30 年，在行业政策较为稳定的情况下，高速公路行业经营稳定性较好；另一方面，在特许经营收费期限内，高速公路项目通常可以获取较为稳定的车辆通行费收入，现金流较为充裕，具有一定的抗风险能力。

（4）行业竞争格局

随着高铁、航空、水运等各种交通运输方式的发展，将会提供丰富而多样的出行、运输选择，可替代的交通运输方式将带来竞争，对高速公路的交通量造成一定分流影响。

4.2.2 可比区域内的可比不动产项目情况

（1）G318 国道池州至殷汇段公路（以下简称“国道 G318”）：根据池州市政府披露信息，国道 G318 池殷段公路改建工程于 2022 年四季度开始免费试通行，11 月交工验收，改建后采用双向四车道一级公路标准，设计时速 80 公里，路线全长 30.843 公里。起点位于池州市贵池区马衙街道大路村，最终接池州市贵池区殷汇镇西侧现状 318 国道与沪渝高速殷汇出口连接线 T 型交叉口处。由于国道 G318 为新竣工路段，路况良好且处于免费试通行阶段。国道 G318 主要影响沿江高速“殷汇-上水桥枢纽”段，对沿江高速的交通量造成一定分流影响。

(2) 上海至武汉高速公路无为至岳西段（以下简称“无岳高速”）：无岳高速于 2023 年 10 月底开通，开通初期由于宁芜高速和宣广高速正在改扩建施工，通行条件较差，无岳高速分流了沿江高速上“马鞍山、南京往来安庆、湖北”方向的交通量，以及“上海、苏州往来湖北、江西”方向的交通量，随着宁芜高速和宣广高速改扩建完成，该分流交通量会有所减少。

(3) 国道 G236：国道 G236 殷汇至查桥段改扩建，里程为 48.65 公里。目前国道 G236 为双向 2 车道的二级公路，改扩建以后为双向 4 车道的一级公路。由于改扩建工程需要，从 2023 年 11 月 30 日至 2026 年 11 月 28 日，禁止重中型货车（黄牌货车）在施工路段通行。国道 G236 禁止通行会使部分货车被迫选择沪渝高速，途经沿江高速大渡桥至殷家汇段。

(4) 宁九高速：G4231 南京至九江高速公路（原 S22 天长至天柱山高速公路，北沿江高速）无为至安庆段（以下简称“宁九高速”）于 2025 年 12 月 26 日正式通车运营。宁九高速全长约 119.2 公里，采用双向四车道高速公路标准建设，设计时速 120 公里。路线起于芜湖市无为市襄安镇襄安北枢纽（接铜商高速公路铜陵公铁长江大桥北岸接线），途经无为市、铜陵市郊区、枞阳县、安庆市宜秀区，终至安庆市怀宁县凉亭乡凉亭枢纽（与 G50 沪渝高速合安段相交，顺接正在建设的 S22 天天高速安庆至潜山段）。全线设有牛埠、陈瑶湖、项铺、枞阳、巨石山 5 处匝道收费站，牛埠 1 处养护工区，以及竹丝湖、白云岩 2 处服务区，桥隧比达 41.6%，包含特大桥 10 座、大桥 17 座、中小桥 12 座，长隧道 3 座、短隧道 1 座。随着宁九高速的开通，部分南京、马鞍山往来安庆、池州、湖北的交通会选择马巢高速、巢无高速和北沿江高速，部分池州至安庆的交通也会选择从池州过江，选择走宁九高速。

(5) 宁国至枞阳高速池州段（以下简称“宁枞高速”）、黄山至东至高速（以下简称“黄东高速”）：宁枞高速长约 46.225 公里，黄东高速长约 106 公里，均约 2028 年底开通。随着宁枞高速开通，从宣城可以经过“宣东高速和宁国至枞阳高速池州段”组成的路径，其里程与“铜南宣高速和沿江高速”组成的路径接近，但是新路的沿途经过的山区较多，预计桥隧叠加费较高。

随着黄东高速开通，部分芜湖、溧阳往来江西、湖北的交通会选择走“宣城-池州-黄山-东至”高速；部分池州往来江西、湖北的交通也会转移到“池州-黄山-东至”高速，从而避开沿江高速九华山至大渡口桥段。

(6) 宣东高速泾县至青阳段（以下简称“宣东高速泾青段”）线路起自泾县黄村镇九义村附近，接芜湖至黄山高速公路及宣城至泾县高速公路，往西经黄村镇、丁家桥镇、桃花潭镇，止于泾县与青阳县交界竹溪村附近，接规划宁国至枞阳高速公路池州段，全长 39.24 公里。采用双向四车道标

准，设计车速 100 公里/小时，截至 2026 年 6 月 30 日暂未通车。根据车流量预测机构分析，宣东高速泾青段建成以后将形成一条与项目道路平行的竞争路线，浙江和上海方向的车辆可以在宣城选择宣城至泾县高速公路和宣东高速泾县至青阳段，然后通过京台高速到达上水桥枢纽，然后再选择过铜陵长江三桥或者继续沿项目道路往西，从线路里程看，“宣城至泾县高速公路+宣东高速泾县至青阳段+京台高速”的里程比“铜南宣高速 + 沿江高速”的里程要远 20 公里左右，竞争优势不明显。

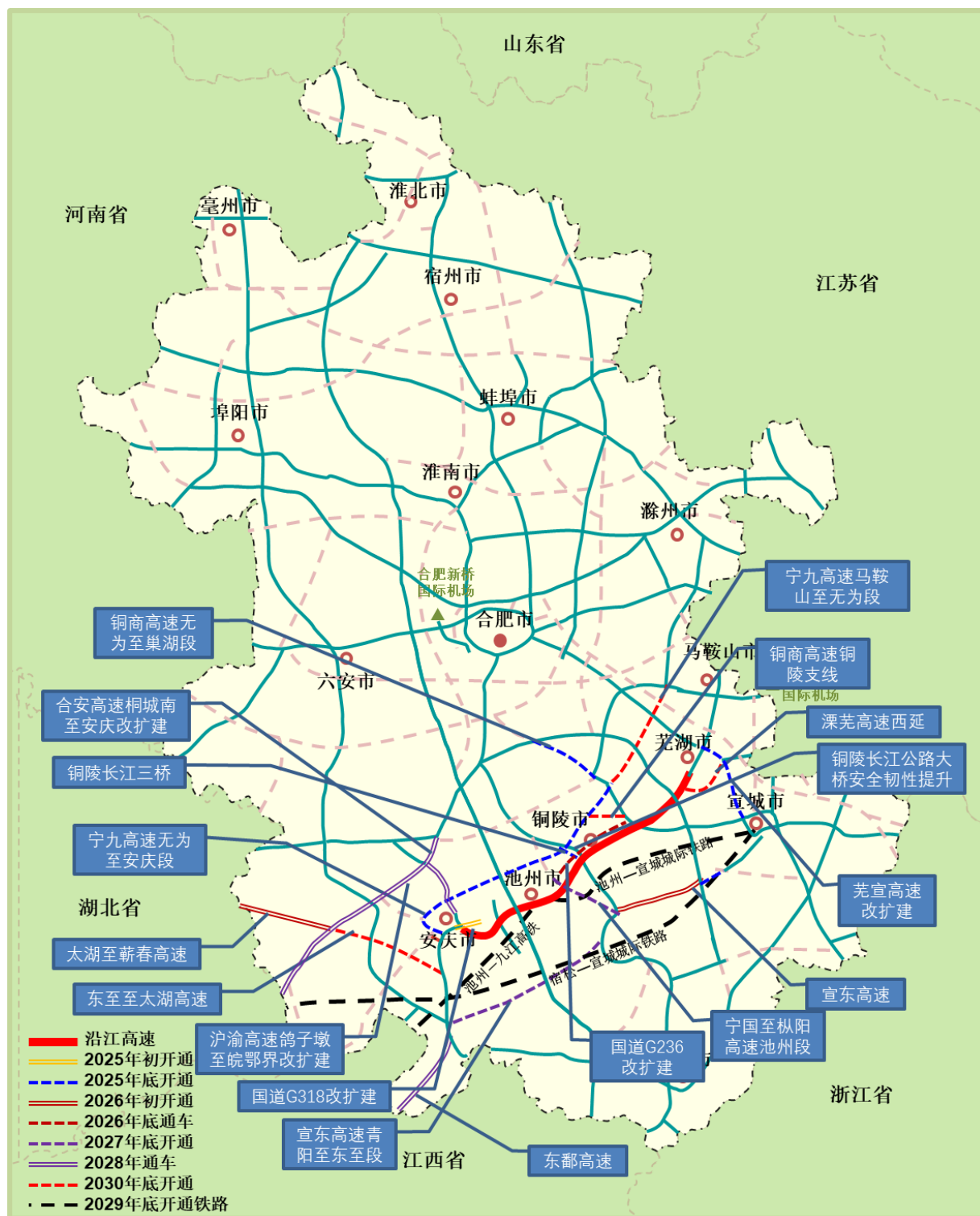
（7）G50 沪渝高速鸽子墩至皖鄂省界段（以下简称“高界高速”）改扩建工程路线起自怀宁县金拱镇既有鸽子墩枢纽互通南侧，接同步实施改扩建的 G4212 合安高速桐城南枢纽至凉亭枢纽段（以下简称“合安高速桐凉段”），沿既有高速公路改扩建，经怀宁县、潜山市、太湖县、宿松县，止于宿松县佐坝乡西侧皖鄂省界，顺接 G50 沪渝高速公路湖北段。全长 109.768 公里，按照“四改八”的标准改扩建，设计速度采用 120 公里/小时，预计工期 3 年。2026 年 3 月 5 日，高界高速改扩建工程小池镇段正式进入施工建设阶段。根据车流量预测机构分析，高界高速改扩建施工会对过往车辆的通行条件造成一定干扰，进而使部分车辆改变出行路径。路径转变有两个方向，其一是转移到沪武高速往来湖北，其可能对项目道路造成负面影响；其二是转移到安庆至东至高速和彭湖高速经九江往来湖北，其对项目道路将造成正面影响。

（8）东至至太湖高速公路：随着 2030 年底东至至太湖高速公路的开通，原本从池州公路大桥（池宣高速的一部分）过江，然后走北沿江高速和高界高速的车辆将有所回流到沿江高速。这些车主要来往于浙江、宣城、芜湖、马鞍山、江苏、铜陵和安庆、湖北之间。

沿江高速周边路网区位示意图如下，具体情况详见《车流量预测报告 2026》¹、本基金招募说明书及其更新。

图 1 沿江高速周边路网变化

¹ 指施伟拔咨询（深圳）有限公司 2026 年 3 月 21 日出具的《安徽省沿江高速公路交通量及通行费收入预测评估报告》，详见《中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金 2025 年度评估报告》附件，下同。



图片来源：《安徽省沿江高速公路交通量及通行费收入预测评估报告》（施伟拔咨询（深圳）有限公司，2026 年 3 月 21 日）

4.2.3 新公布的法律法规、行业政策、区域政策、税收政策对所属行业、区域的重大影响

交通运输部组织制定的交通运输行业标准《收费公路联网收费客户服务规范》（标准编号：JT/T

1560—2025）发布，自 2026 年 1 月 1 日起实施。该标准的发布实施，旨在系统规范和科学指导全国收费公路联网收费客户服务工作，全面提升全网客户服务标准化、规范化水平。对于构建完善全国高速公路联网收费客户服务体系，推动“一张网运行、一体化服务”，具有重要的指导意义。

交通运输部 2026 年 5 月发布《交通运输部 2026 年立法工作计划》，聚焦持续完善现代化综合交通运输体系，加强重点领域、新兴领域、涉外领域立法，为加快建设国家综合立体交通网，着力推进一体化融合、安全化提升、数智化升级、绿色化转型提供有力法治保障；坚持有效衔接、立足实际，法律、行政法规以列入全国人大常委会立法规划、计划以及国务院立法计划为主，规章重点满足行业管理实际需要，与法律、行政法规整体协调衔接。同时，为了保证《立法计划》有效实施，对法规起草、审核工作提出明确要求。其中，《收费公路管理条例（修订）》纳入年内完成部内工作或者公布的立法项目。

安徽省交通运输厅、安徽省发展改革委、安徽省财政厅 2026 年 3 月 31 日发布《关于优化调整部分高速公路差异化收费政策有关事项的通知》，继续实施安徽省 6 项差异化收费政策，对“ETC 套装货车支付差异化收费”“9 座（不含 9 座）以上 ETC 套装客车差异化收费”2 项差异化收费政策实施路段进行调整，将德上高速祁门至皖赣界段、五蒙高速、亳蒙高速板桥集枢纽至立德枢纽段列入差异化收费政策实施路段，将宁洛高速明光枢纽至皖豫省界段移出实施路段。调整后的差异化收费政策自 2026 年 4 月 1 日起施行。调整后的政策执行期暂定 3 年，期满前将综合评估实施效果和路网流量变化，根据评估结果优化调整差异化收费政策路段。后续如有新的规定，从其规定。

4.2.4 不动产项目所属行业的其他整体情况和竞争情况

（1）宏观经济及交通运输行业主要指标情况

2026 年上半年，我国国民经济运行在合理区间，新质生产力培育壮大，高质量发展向新向优。根据国家统计局数据，2026 年上半年国内生产总值 695,704 亿元，按不变价格计算，同比增长 4.7%；全国居民消费价格（CPI）同比上涨 1.0%；全国规模以上工业增加值同比增长 5.4%。

根据安徽省统计局数据，2026 年上半年安徽省地区生产总值 27,370 亿元，按不变价格计算，同比增长 5.6%，全省规模以上工业增加值同比增长 12.4%。根据池州市统计局数据，2026 年上半年池州市地区生产总值 655.3 亿元，按不变价格计算，同比增长 5.7%。根据芜湖市统计局数据，2026 年上半年芜湖市实现生产总值 2,781.55 亿元，按不变价格计算，同比增长 6.0%，规上工业增加值同比增长 10.5%。2026 年上半年，安徽省经济运行总体平稳，生产形势较好，工业增长较快。

根据交通运输部数据，2026 年 1—6 月，全国完成公路货运量约 212.19 亿吨，同比增长 3.2%；公路客运量约 56.42 亿人次，同比下降 2.1%。其中，安徽省完成公路货运量约 13.58 亿吨，同比增长 3.1%；公路客运量约 2.20 亿人次，同比下降 6.0%。

（2）竞争情况

不动产项目可比竞争性道路在建成通车后将给不动产资产的业绩带来一定压力。本基金招募说明书及更新、车流量预测报告已对竞争性道路的影响进行了考虑，具体竞争情况详见“4.2.2 可比区域内的可比不动产项目情况”及往期公告。

4.3 不动产项目运营相关财务信息

4.3.1 项目公司整体财务情况

序号	科目名称	报告期末金额（元）	上年末金额（元）	变动比例（%）
1	总资产	8,206,479,663.69	8,640,901,113.18	-5.03
2	总负债	9,285,732,511.79	9,404,714,117.85	-1.27
序号	科目名称	报告期金额（元）	上年同期金额（元）	变动比例（%）
1	营业收入	411,110,520.47	453,895,426.90	-9.43
2	营业成本/费用	724,682,439.08	786,466,236.32	-7.86
3	EBITDA	359,579,876.01	394,550,240.02	-8.86

4.3.2 重要不动产项目公司的主要资产负债科目分析

项目公司名称：安徽省沿江高速公路有限公司

序号	构成	报告期末金额（元）	上年末金额（元）	较上年末变动（%）
主要资产科目				
1	无形资产	7,912,592,872.77	8,264,072,267.49	-4.25
主要负债科目				
1	长期借款	1,173,900,000.00	1,189,500,000.00	-1.31
2	其他负债	7,252,000,000.00	7,252,000,000.00	-

4.3.3 重要不动产项目公司的营业收入分析

项目公司名称：安徽省沿江高速公路有限公司

金额单位：人民币元

序号	构成	本期（2026年1月1日至2026年6月30日）		上年同期（2025年1月1日至2025年6月30日）		金额同比变化（%）
		金额	占该项目总收入比例（%）	金额	占该项目总收入比例（%）	
1	通行费收入	409,302,467.66	99.56	453,342,922.93	99.88	-9.71
2	其他收入	1,808,052.81	0.44	552,503.97	0.12	227.25
3	营业收入合计	411,110,520.47	100.00	453,895,426.90	100.00	-9.43

注：其他收入包含路损赔付收入、涉路工程补偿收入等；其他收入同比增长 227.25%的主要原因为本期涉路工程补偿收入金额较去年增长明显，该部分收入不具长期性。

4.3.4 重要不动产项目公司的营业成本及主要费用分析

项目公司名称：安徽省沿江高速公路有限公司

金额单位：人民币元

序号	构成	本期（2026年1月1日至2026年6月30日）		上年同期（2025年1月1日至2025年6月30日）		金额同比变化（%）
		金额	占该项目总成本比例（%）	金额	占该项目总成本比例（%）	
1	折旧摊销	353,193,896.21	48.73	352,413,084.13	44.81	0.22
2	养护成本	2,998,084.26	0.41	10,604,383.25	1.35	-71.73
3	运营服务成本	42,867,445.92	5.92	41,089,754.00	5.23	4.33
4	其他营业成本	3,623,906.82	0.50	3,649,649.16	0.46	-0.71
5	税金及附加	1,925,166.79	0.27	2,076,288.51	0.26	-7.28
6	财务费用	319,563,439.08	44.10	373,443,504.71	47.48	-14.43
7	管理人报酬	-	-	2,723,372.56	0.35	-100.00
8	其他成本/费用	510,500.00	0.07	466,200.00	0.06	9.50
9	营业成本/费用合计	724,682,439.08	100.00	786,466,236.32	100.00	-7.86

注：1、本报告期项目公司财务费用主要包含外部银行借款利息费用 14,131,072.23 元及股东借款利息 305,676,767.52 元等；

2、养护成本同比下降 71.73%的主要原因为去年国检专项养护工程结算金额较大；

3、根据运营管理协议，运营管理机构收取固定管理费的费率为 0，因此管理人报酬为 0，较去年同期下降 100%。

4.3.5 重要不动产项目公司的财务业绩衡量指标分析

项目公司名称：安徽省沿江高速公路有限公司

序号	指标名称	指标含义说明及计算公式	指标单位	本期（2026年1月1日至2026年6月30日）	上年同期（2025年1月1日至2025年6月30日）
				指标数值	指标数值
1	毛利率	毛利润额/营业收入×100%	%	2.05	10.17
2	息税折旧摊销前利润率	不动产项目息税折旧摊销前净利润/营业收入×100%	%	87.47	86.93

注：上表所述不动产项目息税折旧摊销前净利润为不动产项目财务业绩指标，“3.3.2.1 本期可供分配金额计算过程”中“本期息税折旧及摊销前利润”为基金层面财务指标，两者计算口径存在差异。

4.4 项目公司经营现金流

4.4.1 经营活动现金流归集、管理、使用以及变化情况

自权利义务转移日（2022 年 11 月 14 日，下同）起，基金管理人全面接管不动产项目公司所有银行账户及资金，确保所有账户及资金统一纳入基金管理人和基金托管人的监管范围。项目公司开立了监督账户和缴费账户，用于收取项目公司收入及外部借款、缴纳项目公司相关支出、支付分红/股利、偿还关联方借款及外部借款等，两个账户均受到托管人招商银行股份有限公司的监管。

不动产项目公司本期收入归集总金额 425,516,897.48 元，对外支出总金额 94,611,643.05 元。去

年同期收入归集总金额 444,379,207.38 元，对外支出总金额 79,514,465.75 元。

4.4.2 来源于单一客户及其关联方的现金流占比超过 10%的情况说明

无。

4.4.3 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说明

根据铜陵市人民政府公告，自 2026 年 2 月 1 日起至 2028 年 7 月 31 日，对铜陵长江大桥（一桥）实施封闭施工，计划工期 30 个月。除公交车（38 路、62 路、64 路、T1 路）、三轮及以下机动车、非机动车及行人外，其他车辆禁止通行。铜陵长江三桥于 2025 年 11 月 6 日通车，其主力车型（一类客货车、六轴货车等）收费标准较安庆长江大桥提高 25%，铜陵长江大桥（一桥）封闭施工，可能造成部分往来湖北与浙江、上海之间的车辆通过安庆长江大桥过桥。

由于道路维修整治工程施工需要，铜陵市义安区东盛大道实施同侧半幅封闭施工，半幅双向通行²，期间禁止大型货车通行，封闭时间为 2026 年 3 月 5 日—2026 年 12 月 31 日。由于铜陵长江大桥封闭改造和铜陵市义安区东盛大道道路维修整治工程施工，部分车辆选择从沿江高速绕行，对沿江高速铜陵东站通行费收入有一定提升作用。基金管理人与运营管理机构将持续跟踪工程进展。

针对上述路网变化，基金管理人与运营管理机构将努力做好运营管理工作，保障资产平稳运营。本报告期运营管理机构采取的措施详见“8.1.3 报告期内运营管理机构采取的运营管理措施以及效果”。

图 2 沿江高速周边路网情况



² 公告内容详见：

<https://www.ahjlyaq.gov.cn/home/?searchWord=%E5%85%B3%E4%BA%8E%E4%B9%89%E5%AE%89%E5%8C%BA%E4%B8%9C%E7%9B%9B%E5%A4%A7%E9%81%93%E9%81%93%E8%B7%AF%E7%BB%B4%E4%BF%AE%E6%96%BD%E5%B7%A5%E7%9A%84%E5%85%AC%E5%91%8A&siteid=1678706659544797184>

4.5 项目公司对外借入款项情况

4.5.1 报告期内对外借入款项基本情况

报告期内，项目公司无新增外部借款。

项目公司存续质押借款已在本基金招募说明书中披露，借款银行为招商银行股份有限公司合肥分行，借款金额 1,300,000,000.00 元，借款期限为 2022 年 11 月 30 日至 2029 年 11 月 29 日，借款利率以 5 年期以上贷款市场报价利率（LPR）为基准利率下浮 120 个基点（BPs）。项目公司已将沿江高速公路芜湖（张韩）至安庆（大渡口）段公路收费权质押给借款银行。报告期内计提利息 14,131,072.23 元，期末借款本金余额 1,212,250,000.00 元。

4.5.2 本期对外借入款项情况与上年同期的变化情况分析

本基金对外借入款项与上年同期无变化。具体借入款项情况见“4.5.1 报告期内对外借入款项基本情况”。

4.5.3 对不动产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。

4.6 不动产项目投资情况

4.6.1 报告期内购入或出售不动产项目情况

无。

4.6.2 购入或出售不动产项目情况以及对不动产基金运作、收益等方面的影响分析

无。

4.7 抵押、查封、扣押、冻结等他项权利限制的情况

本报告期内，不存在抵押、查封、扣押、冻结等他项权利限制的情况。

4.8 不动产项目相关保险的情况

不动产项目已按照《公开募集基础设施证券投资基金指引（试行）》要求，购买不动产资产的财产一切险、机损险、现金险、公众责任险、董监事及高级管理人员责任保险，上述保险为不动产项目主要财产安全以及发生其他意外事故时提供有效保障。保险处于有效期内，保险公司履约正常。

4.9 重要不动产项目生产经营状况、外部环境已经或者预计发生重大变化分析

无。

4.10 其他需要说明的情况

无。

§5 除不动产资产支持证券之外的投资组合报告

5.1 报告期末不动产基金的资产组合情况

单位：人民币元

序号	项目	金额	占不动产资产支持证券之外的投资组合的比例（%）
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	36,067,403.46	100.00
4	其他资产	-	-
5	合计	36,067,403.46	100.00

5.2 投资组合报告附注

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

5.3 报告期内不动产基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金主要资产投资于不动产资产支持证券，无其他投资品种。本基金管理人根据有关法律法规和基金合同的规定开展基金估值工作，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。基金管理人建立并执行基金估值相关管理制度，设置估值委员会研究、指导基金估值业务。估值委员会由相关高级管理人员、基金运营部、投研部门、风险管理部、监察稽核部等相关人员组成。各估值委员会委员和基金会计均具有相关工作经历和专业胜任能力。基金经理参与估值委员会会议讨论，但不参与基金估值决策，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

86 回收资金使用情况

6.1 原始权益人回收资金使用有关情况说明

原始权益人净回收资金已使用完毕。经原始权益人确认，其对净回收资金的使用符合基金合同约定、公开承诺以及有关法律法规的规定。

87 管理人报告

7.1 基金管理人及主要负责人员情况

7.1.1 基金管理人及其管理不动产基金的经验

中金基金管理有限公司（以下简称“中金基金”）成立于 2014 年 2 月，由中国国际金融股份有限公司作为全资股东，是首家通过发起设立方式由单一股东持股的基金公司，注册资本 10 亿元。中金基金经营范围为基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务，注册地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 26 层 05 室。

中金基金设立专门部门负责不动产基金（或称“公募 REITs”）的研究、投资及运营管理等工作，建立并执行公募 REITs 尽职调查、投资管理、运营管理及风险控制等各项制度流程，持续加强专业人员配备，保障基金规范设立及运作，保护基金份额持有人合法权益。

截至报告期末，中金基金共管理 12 只不动产基金。

7.1.2 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任职期限		不动产项目运营或投资管理年限	不动产项目运营或投资管理经验	说明
		任职日期	离任日期			
吴亚琼	本基金的基金经理	2022 年 11 月 11 日	-	10 年	曾参与台州市域铁路 S1 线 PPP 项目、天津地铁 7 号线 PPP 项目及唐山港货运铁路 PPP 项目等的运营管理工作，项目类型覆盖轨道交通、铁路等不动产领域。	吴亚琼女士，CPA，管理学硕士。历任中车建设工程有限公司物资部采购主管、城轨运营部高级主管；神州高铁技术股份有限公司 PPP 事业部项目经理；北京明树数据科技有限公司常务副总经理助理；现任中金基金管理有限公司创新投资部基金经理。
郑霜	本基金的基金	2022 年 11 月 11 日	-	9.5 年	曾负责贵阳市清镇市产业新城、成都市明宸冠寓等产业园及租赁住房	郑霜女士，管理学学士。历任华夏幸福（深圳）运营管理有限公司财务经理；成都

姓名	职务	任职期限		不动产项目运营或投资管理年限	不动产项目运营或投资管理经验	说明
		任 职 日期	离 任 日期			
	经理	日			项目的园区运营、预算管理、税务管理与财务分析等工作，项目类型覆盖产业园、租赁住房等不动产领域。	辰煦置业有限公司项目财务岗位；现任中金基金管理有限公司创新投资部基金经理。
郭茂乾	本基金的基金经理	2025 年 3 月 3 日	-	8 年	曾参与望东长江大桥北岸连接线项目财务管理相关工作，参与或负责北京望京万象汇、北京首开万象汇、石家庄万象城等购物中心项目投资及运营管理相关工作，项目类型覆盖高速公路、消费等不动产领域。	郭茂乾先生，理学硕士，历任中交三公局第二工程有限公司财务会计；润欣商业投资（深圳）有限公司北京咨询分公司招商专员、营运管理主管、营运管理高级主管；现任中金基金管理有限公司创新投资部基金经理。

注：1、不动产项目运营或投资管理年限为参与不动产相关行业运营或投资管理工作经验年限总和。

2、本基金无基金经理助理。

3、本基金于 2026 年 8 月 15 日披露了《中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金基金经理变更公告》，基金经理郑霜于 2026 年 8 月 13 日因个人原因离任，新任基金经理为马牧野。本次变更基金经理不影响基金管理人履行职责，对本基金份额持有人利益无重大影响。

7.1.3 报告期末兼任私募资产管理计划投资经理的不动产基金经理同时管理的产品情况

本报告期内，本基金不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情形。

7.2 管理人在报告期内对不动产基金的投资运作决策和主动管理情况

7.2.1 管理人对报告期内本不动产基金运作合规守信情况的说明

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）》等法律法规、规章、规范性文件，中国证监会、上海证券交易所有关规定，以及本基金基金合同、招募说明书及其更新等相关法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，履行不动产项目运营管理职责，在控制风险的前提下，谋求基金份额持有人利益最大化。报告期内，本基金运作整体合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

7.2.2 管理人对报告期内公平交易制度及执行情况的专项说明

本基金管理人根据《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》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011 年修订）的规定，制定了《中金基金管理有限公司公平交易管理办法》，对投资决策的内部控制、交易执行的内部控制、公平交易实施效

果评估、信息披露与报告制度等多方面进行了规定，公平对待不同投资组合，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。为保证各投资组合在投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会，公司建立了科学合理的投资运作体系和规范的投资流程，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合，严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，规范投资、研究和交易等各相关流程，通过系统控制和人工监控等方式在各环节严格控制，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。

本报告期内，本基金运作符合法律法规和公司公平交易制度的规定。

7.2.3 管理人对报告期内不动产基金的投资和运营分析

本基金按基金合同约定完成初始基金资产投资后，在本报告期内未新增投资。截至本报告期末，本基金通过持有“中金-安徽交控高速公路基础设施资产支持专项计划资产支持证券”全部份额，穿透取得项目公司持有的不动产资产的完全所有权或经营权利。

基金成立之日起，基金管理人主动履行不动产项目运营管理职责，同时，基金管理人委托安徽交控集团作为运营管理机构，负责不动产项目的部分运营管理职责。基金管理人、项目公司和安徽交控集团根据签订的《运营管理服务协议》，执行协议中运营管理职责的分工。基金管理人开展了对运营管理机构履职情况的检查工作，检查内容包括其从事不动产项目运营管理活动而保存的记录、合同等，总体履职情况良好。

报告期内基金投资的不动产项目运营情况详见“4.1 报告期内不动产项目的运营情况”。

7.2.4 管理人对报告期内不动产基金收益分配情况的说明

本基金本报告期进行了 2 次收益分配，实际分配金额为 321,000,011.99 元。

2026 年第一次收益分配基于 2025 年第 3 季度可供分配金额，合计人民币 195,835,110.77 元，实际分配人民币 160,000,000.00 元，约占前述可供分配金额的 81.70%。

2026 年第二次收益分配基于 2025 年扣除前期已分配金额后尚未分配的可供分配金额，合计人民币 161,495,541.27 元，实际分配人民币 161,000,011.99 元，约占前述可供分配金额的 99.69%。

7.2.5 管理人对关联交易采取的内部控制措施及相关利益冲突的防范措施

由中金基金作为基金管理人的中金山高集团高速公路封闭式基础设施证券投资基金（以下简称“中金山东高速 REIT”）已于 2023 年 10 月 27 日上市，中金山东高速 REIT 是主要投资于高速公路类不动产项目的不动产基金，因此，基金管理人目前管理与本基金具有同类型不动产资产的不动产基

金。

综合考量中金山东高速 REIT 和本基金项下不动产资产处在距离较远的不同区域，分别聘请了运营管理机构，且 2 只不动产基金的投资及扩募资产范围重叠可能性较低等因素，同时结合高速公路项目的运营管理特点，基金管理人认为现阶段同时管理 2 只高速公路 REITs 不存在利益冲突。

为有效防范不动产基金关联交易及潜在利益冲突风险，基金管理人建立了相应的风险防范机制并严格按照法规和制度开展相关工作，防范措施主要包括：

1) 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，基金管理人制定不动产基金关联交易管理制度，规范关联方管理、关联交易决策及信息披露等工作。根据基金管理人章程及关联交易管理制度规定，不动产基金开展关联交易需提交 REITs 投资决策委员会审批，并根据法规及基金合同约定提请基金管理人董事会、基金份额持有人大会审批（如需）。必要时，基金管理人可就关联交易的公允性等征求会计师事务所等中介机构的独立意见。基金管理人董事会至少每半年对关联交易事项进行审查。

2) 基金管理人通过召开 REITs 投资决策委员会会议，预防和评估不同不动产基金之间同业竞争和潜在利益冲突情况，制定公平对待所有不动产项目的相关措施；对可能发生的同业竞争和可能存在的利益冲突，由 REITs 投资决策委员会召开会议讨论和决定处理方式。

本基金报告期内开展的关联交易，符合基金合同约定的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，执行了市场公平合理价格。

7.2.6 管理人内部关于本不动产基金的监察稽核情况

报告期内，基金管理人持续加强不动产基金的监察稽核工作，为业务开展提供全流程法律合规支持，防范法律合规风险。

制度体系方面，在投资管理、运营管理、风险控制、尽职调查等不动产基金基础制度的基础上，持续根据相关法律法规政策要求，结合业务实际需求，完善不动产基金制度流程，就业务开展的重要环节细化明确合规管理要求。申报与发售方面，严格审查项目申报、发售各项文件，协助开展战略配售、网下询价及公众发售工作，加强投资者教育及宣传推介材料的合规审查，强化销售行为管理。存续期运作方面，就交割、上市及运营管理各项工作及时提供法律合规咨询意见，规范审查信息披露材料，有针对性地开展合规培训，适时发布合规指引或提示，促进合规展业。

报告期内，本基金整体运作合法合规，内部控制和风险防范措施不断完善。本基金管理人将不断提高监察稽核工作的规范性和有效性，努力防范和控制重大合规风险，维护基金份额持有人合法权益。

7.3 管理人在报告期内对不动产基金的运营管理职责的落实情况

7.3.1 管理人在报告期内主动采取的运营管理措施

报告期内，基金管理人根据有关法律法规、基金合同和运营管理服务协议等基金法律文件的要求，主动履行不动产项目运营管理职责，主要包括：建立并执行项目公司印章与证照的管理和使用机制、账户与现金流的管理机制；对不动产项目的年度预算、重大资本性支出、关联交易及项目所涉及的重要合同等进行审批；协同运营管理机构制定并落实不动产项目运营策略等。报告期内，基金管理人加强与运营管理机构的沟通，定期开展不动产项目经营情况的总结回顾，保障不动产项目平稳运营。

7.3.2 管理人在报告期内的重大事项决策情况

报告期内，基金管理人专业、审慎开展本基金相关重大事项的决策，根据基金合同、招募说明书等基金法律文件及基金管理人相关内部管理制度的要求，按照事项内容相应分级履行基金经理与基金运营团队决策、基金运营咨询委员会讨论及公司 REITs 投资决策委员会决策流程。报告期内，未发生需提请基金份额持有人大会决策的事项。

7.3.3 管理人在报告期内对运营管理机构的检查和考核情况

根据有关法律法规、基金合同、招募说明书和运营管理服务协议等基金法律文件的要求，基金管理人开展了对运营管理机构履职情况的检查工作，检查内容包括但不限于其从事不动产项目运营管理活动而保存的记录、合同等，报告期内运营管理机构总体履职情况良好。

根据招募说明书及运营管理服务协议的约定，并结合运营管理机构报告期内的履职表现，报告期内，运营管理机构未发生考核政策约定的违规事项，运营管理机构本报告期运营管理费用的收取及运营业绩奖励情况详见“3.4 报告期内不动产基金费用收取情况的说明”及“10.5.13.4.1 基金管理费”。

7.3.4 管理人在报告期内其他对运营管理机构的监督情况

无。

7.4 管理人在报告期内的信息披露工作开展情况

7.4.1 报告期内信息披露事务负责人的履职情况

基金管理人信息披露事务负责人根据适用法律法规、自律规则及基金管理人内部制度统筹组织和协调本基金信息披露各项事务，履行信息披露管理职责，不存在不能履职或无法履职的情况。

信息披露事务负责人高度重视不动产基金的信息披露工作。组织协调信息披露事务方面，统筹公司有关部门制定不动产基金相关信息披露管理办法，重视并督促开展有关信息披露培训，组织细

化完善不动产基金信息披露工作流程，协调督促相关部门有序落实。投资者关系管理方面，组织建立健全投资者沟通联络机制，协调开展投资者关系活动，安排相关人员参加本基金业绩说明会，持续关注媒体报道，重视投资者教育活动等。

基金管理人信息披露负责人未来将继续以维护基金份额持有人利益为原则，勤勉尽责履行信息披露管理义务。

7.4.2 报告期内信息披露事务负责人的变更情况

报告期内基金管理人信息披露负责人未发生变更。

7.4.3 报告期内信息披露管理制度的落实情况

基金管理人根据适用法律法规、自律规则在公司内部建立并执行不动产基金相关信息披露管理办法、工作流程，明确了公司管理的不动产基金的信息披露事务管理、审核和发布流程、敏感信息管理、暂缓 and 豁免信息披露机制、基金各阶段信息披露的基本要求及信息披露档案管理等内容。

基金管理人按照前述内部制度要求，有序执行不动产基金信息披露文件的编制、复核、审核、发布和存档流程，规范履行信息披露义务，并积极与运营管理机构、原始权益人等业务参与人建立信息传递与沟通机制，提升信息披露工作质量。

基金管理人重视不动产基金敏感信息管理，控制基金管理人不动产基金敏感信息知情人范围、开展基金敏感信息知情人登记、执行敏感信息防控管理措施，并通过签署保密协议/承诺函、书面提示等方式约定、督促原始权益人、运营管理机构等专业机构和人员强化其不动产基金敏感信息管理。

报告期内，未发生暂缓和豁免信息披露的情况。

8 运营管理机构报告

8.1 报告期内运营管理机构管理职责履行情况

8.1.1 报告期内运营管理协议的落实情况

报告期内，本基金运营管理机构严格遵守运营管理服务协议约定，不存在违反运营管理服务协议相关条款的重大情形。

8.1.2 报告期内运营管理机构合规守信情况声明

报告期内，本基金运营管理机构严格遵守《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）》等法律法规、规章、规范性文件、证券交易所有关不动产基金的相关业务规则，以及本基金基金合同、招募说明书、运营管理服务协议等相关法律文件的约定，本着

诚实信用、勤勉尽责的原则履行运营管理机构职责。报告期内，本基金运营管理机构履职情况整体合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

8.1.3 报告期内运营管理机构采取的运营管理措施以及效果

2026 年上半年，运营管理机构多措并举，保障不动产项目沿江高速平稳运行。上半年未发生安全生产责任事故、重大风险及损失事件、重大舆情事件、重大诉讼事件等。本报告期运营管理机构采取的主要措施如下：

（1）筑牢安全防线，保障路网平稳运行

运营管理机构紧扣全年路网安全保障目标，针对不同阶段、不同类型的风险，持续完善防控措施。一是加强团雾、低温雨雪冰冻等恶劣天气防范，提前完善预警和值守机制，备足应急物资和设备，重点排查隧道、陡坡、急弯等路段的安全隐患，切实保障车辆通行安全；二是结合“安全生产月”等专项行动，对道路施工、防汛度汛等重点领域开展全面检查，并通过模拟季节性风险和突发事件开展应急演练，深入乡村、校园和企业开展安全宣传，进一步增强全员安全意识，保障路网安全平稳运行。

（2）深化引流增收，促进路地合作共赢

围绕增加车流、提升效益、促进路地融合，运营管理机构积极开展引流增收工作。一是把握地方道路施工、国省道改扩建和交通管制等带来的车流转移机会，联合相关单位合理设置绕行指引，引导车辆选择高速公路通行；二是主动走访沿线企业和货运车队，面向过境车辆宣传高速公路的通行优势和便民服务，通过提升通行体验吸引更多车辆；三是积极拓展高速公路与沿线旅游资源的合作，联合景区、民宿推出出行优惠和旅游指引，带动高速公路车流增长，更好服务地方经济发展。

（3）挖掘资产潜力，推动降本增效

运营管理机构坚持修旧利废、经济实用的原则，持续开展设备改造和维修。一是对大渡口、铜陵东收费站的称重设备进行改造，在保障使用效果的同时，有效降低设备更新成本；二是自主修复殷汇收费站入口的信息显示设备，减少设备更换支出；三是针对户外识别设备容易受潮、识别效果不稳定等问题，对部分路段的摄像设备和车辆识别设备采取防潮、防雨改造。相关措施以较低成本改善了设备运行状况，明显提升了车牌识别准确性，也为今后推广更加便捷的通行服务打下基础。

（4）坚持创新提效，提升运营管理水平

运营管理机构持续改进道路养护和收费管理方式，不断提升工作效率和服务质量。一是在道路养护中应用遥控除草设备，并自主研发结构简单、成本较低的过滤装置和专用清理工具，通过机械化作业和小型设备改造，降低养护成本，提升作业效率和质量；二是铜陵东收费站改变传统固定排班方式，根据车流变化灵活安排人员，实现人力资源合理调配；三是池州收费站探索现场操作与远

程控制相结合的车道管理方式，根据实际车流灵活开关车道，有效提高车辆通行效率，减少拥堵和相关投诉。

8.2 报告期内运营管理机构配合信息披露工作开展情况

8.2.1 信息披露事务负责人的履职情况

运营管理机构信息披露事务负责人负责组织和协调运营管理机构信息披露各项事务，组织安排信息披露相关信息和数据的整理、报告工作，对信息披露的合规性和质量承担相应责任。报告期内，运营管理机构信息披露事务负责人组织建立了与投资者的沟通联络渠道，协同基金管理人及时做好与投资者的沟通联络工作，组织运营管理机构相关专业人员积极参加 2025 年度基金业绩说明会等投资关系活动。

8.2.2 信息披露事务负责人的变更情况

报告期内，运营管理机构信息披露事务负责人未发生变更。

8.2.3 信息披露配合制度的落实情况

报告期内，运营管理机构严格执行《安徽省交通控股集团有限公司关于中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金存续期信息披露配合工作管理办法》相关规定，落实未公开信息管理要求，并及时向基金管理人提供有关信息，确保提供的信息真实、准确、完整。

8.2.4 配合信息披露情况

报告期内，运营管理机构严格遵守不动产基金信息披露相关法律法规、规范性文件、业务规则及《安徽省交通控股集团有限公司关于中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金存续期信息披露配合工作管理办法》，积极配合基金管理人履行信息披露义务，及时向基金管理人提供有关信息，并确保提供的信息真实、准确、完整，按照法规要求对相应披露内容进行确认。

8.9 其他业务参与人履职报告

9.1 托管人报告

9.1.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”或“本基金托管人”）具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规规定、基金合同和托管协议约定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

9.1.2 托管人对报告期内本基金资金账户、不动产项目运营收支账户等重要账户资金的

监督情况

本报告期内，本基金托管人根据法律法规规定、基金合同和托管协议约定，对本基金资金账户、不动产项目运营收支账户等重要资金账户及资金流向进行了监督，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

9.1.3 托管人对报告期内不动产基金运作的监督情况

本报告期内，本基金托管人根据法律法规规定、基金合同和托管协议约定，对不动产基金的投资运作、收益分配进行了监督和复核；对基金管理人为不动产项目购买足额保险、借入款项安排进行了监督，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

9.1.4 托管人在报告期内履行信息披露相关义务情况

本报告期内，在管理人提供的各项数据和信息真实、准确、有效的前提下，在托管人能够知悉和掌握的情况范围内，本基金托管人根据法律法规规定、基金合同和托管协议约定的信息披露条款，对本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告及管理人资产确认计量过程等内容进行了复核，认为以上内容真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

9.1.5 托管人在报告期内其他规定或者约定的职责履行情况

无。

9.2 资产支持证券管理人报告

9.2.1 报告期内不动产资产支持专项计划作为项目公司股东的股东权利情况

中国国际金融股份有限公司（代表“中金-安徽交控高速公路基础设施资产支持专项计划”）持有相关项目公司 100% 股权，并根据《专项计划标准条款》的约定按照基金管理人（代表基金的利益）事先作出的专项计划直接决议行使及履行其作为项目公司股东依据项目公司章程及/或中国法律规定所享有及承担的股东权利、权力及/或职责。

9.2.2 作为项目公司债权人的权利情况

中国国际金融股份有限公司（代表“中金-安徽交控高速公路基础设施资产支持专项计划”）通过股东借款构成对项目公司的股东债权。

9.2.3 报告期内不动产资产支持专项计划信息披露情况

报告期内，不动产资产支持专项计划严格按照《证券公司及基金管理公司子公司资产证券化业务管理规定》《证券公司及基金管理公司子公司资产证券化业务信息披露指引》等相关法律法规以及标准条款的规定进行信息披露。

9.2.4 报告期内资产支持证券管理人遵规守信情况以及其他规定或者约定的职责履行情况

报告期内，本基金资产支持证券管理人按照规定或约定履行了资产支持证券管理人的职责和义务，不存在严重违反相关规定、约定或损害资产支持证券投资者利益行为的情况。

9.3 原始权益人报告

9.3.1 报告期内原始权益人或者其同一控制下关联方卖出战略配售取得的不动产基金份额情况

报告期内，原始权益人或其同一控制下的关联方未卖出战略配售取得的不动产基金份额。

9.3.2 报告期末原始权益人或者其同一控制下关联方持有不动产基金份额情况

本报告期末，安徽交控集团持有本基金的基金份额 532,058,516.00 份，安徽交控集团的一致行动人安徽皖通高速公路股份有限公司、安徽省交通规划设计研究总院股份有限公司分别持有本基金基金份额 38,900,000.00 份、24,000,000.00 份，即安徽交控集团及其一致行动人合计持有本基金基金份额 594,958,516.00 份，持有份额比例为 59.50%。

9.3.3 报告期内原始权益人及其一致行动人增持计划和进展情况

无。

9.3.4 报告期内信息披露配合义务的落实情况

报告期内，原始权益人及其人员积极配合基金管理人履行信息披露义务，及时向基金管理人提供有关信息，并确保提供的信息真实、准确、完整。

9.3.5 报告期内其他可能对基金份额持有人权益产生重大影响的变化情况

无。

§10 中期财务报告（未经审计）

10.1 资产负债表

10.1.1 合并资产负债表

会计主体：中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	10.5.7.1	281,656,734.18	326,495,541.27
结算备付金		-	-

存出保证金		-	-
衍生金融资产		-	-
交易性金融资产	10.5.7.2	-	-
买入返售金融资产	10.5.7.3	-	-
债权投资	10.5.7.4	-	-
其他债权投资	10.5.7.5	-	-
其他权益工具投资	10.5.7.6	-	-
应收票据		-	-
应收账款	10.5.7.7	9,861,948.25	11,536,469.01
应收清算款		-	-
应收利息		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
存货	10.5.7.8	181,170.00	199,620.00
合同资产	10.5.7.9	-	-
持有待售资产	10.5.7.10	-	-
长期股权投资		-	-
投资性房地产	10.5.7.11	-	-
固定资产	10.5.7.12	16,679,514.99	18,394,016.48
在建工程	10.5.7.13	-	-
使用权资产	10.5.7.14	-	-
无形资产	10.5.7.15	7,912,592,872.77	8,264,072,267.49
开发支出	10.5.7.16	-	-
商誉	10.5.7.17	-	-
长期待摊费用	10.5.7.18	-	-
递延所得税资产	10.5.7.19.1	22,597,191.91	24,615,175.39
其他资产	10.5.7.20	76,560.00	263,662.78
资产总计		8,243,645,992.10	8,645,576,752.42
负债和所有者权益	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款	10.5.7.21	-	-
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	10.5.7.22	10,449,551.97	28,960,597.88
应付职工薪酬	10.5.7.23	-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,239,550.91	6,341,788.08
应付托管费		359,951.08	793,688.85
应付投资顾问费		-	-

应交税费	10.5.7.24	12,479,676.31	25,951,555.15
应付利息	10.5.7.25	-	-
应付利润		-	-
合同负债	10.5.7.26	-	-
持有待售负债		-	-
长期借款	10.5.7.27	1,173,900,000.00	1,189,500,000.00
预计负债	10.5.7.28	-	-
租赁负债	10.5.7.29	-	-
递延收益		-	-
递延所得税负债	10.5.7.19.2	-	-
其他负债	10.5.7.30	128,756,366.26	135,365,177.44
负债合计		1,329,185,096.53	1,386,912,807.40
所有者权益：			
实收基金	10.5.7.31	10,880,000,000.00	10,880,000,000.00
其他权益工具		-	-
资本公积	10.5.7.32	-	-
其他综合收益	10.5.7.33	-	-
专项储备		-	-
盈余公积	10.5.7.34	-	-
未分配利润	10.5.7.35	-3,965,539,104.43	-3,621,336,054.98
所有者权益合计		6,914,460,895.57	7,258,663,945.02
负债和所有者权益总计		8,243,645,992.10	8,645,576,752.42

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 6.9145 元，基金份额总额 1,000,000,000.00 份。

10.1.2 个别资产负债表

会计主体：中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	10.5.19.1	36,067,403.46	3,862,750.15
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	10.5.19.2	7,934,672,081.33	7,934,672,081.33
其他资产		-	-
资产总计		7,970,739,484.79	7,938,534,831.48
负债和所有者权益	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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		2,753,618.16	6,071,716.60
应付托管费		359,951.08	793,688.85
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
其他负债		114,055.34	230,000.00
负债合计		3,227,624.58	7,095,405.45
所有者权益:			
实收基金		10,880,000,000.00	10,880,000,000.00
资本公积		-	-
其他综合收益		-	-
未分配利润		-2,912,488,139.79	-2,948,560,573.97
所有者权益合计		7,967,511,860.21	7,931,439,426.03
负债和所有者权益总计		7,970,739,484.79	7,938,534,831.48

10.2 利润表

10.2.1 合并利润表

会计主体：中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		411,619,166.52	455,343,690.47
1.营业收入	10.5.7.36	411,110,520.47	453,895,426.90
2.利息收入		508,646.05	1,448,263.57
3.投资收益（损失以“-”号填列）	10.5.7.37	-	-

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
4.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	10.5.7.38	-	-
5.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
6.资产处置收益（损失以“-”号填列）	10.5.7.39	-	-
7.其他收益	10.5.7.40	-	-
8.其他业务收入	10.5.7.41	-	-
二、营业总成本		432,954,279.16	443,957,973.79
1.营业成本	10.5.7.36	402,683,333.21	407,756,870.54
2.利息支出	10.5.7.42	14,131,072.23	15,088,224.29
3.税金及附加	10.5.7.43	11,896,758.82	13,807,573.28
4.销售费用	10.5.7.44	-	-
5.管理费用	10.5.7.45	-	-
6.研发费用		-	-
7.财务费用	10.5.7.46	610.44	35,576.26
8.管理人报酬		3,239,550.91	6,265,614.90
9.托管费		359,951.08	393,582.69
10.投资顾问费		-	-
11.信用减值损失	10.5.7.47	-	-
12.资产减值损失	10.5.7.48	-	-
13.其他费用	10.5.7.49	643,002.47	610,531.83
三、营业利润（营业亏损以“-”号填列）		-21,335,112.64	11,385,716.68
加：营业外收入	10.5.7.50	150,058.66	14.10
减：营业外支出	10.5.7.51	-	-
四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-21,185,053.98	11,385,730.78
减：所得税费用	10.5.7.52	2,017,983.48	2,017,983.48
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		-23,203,037.46	9,367,747.30
1.持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）		-23,203,037.46	9,367,747.30
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		-23,203,037.46	9,367,747.30

10.2.2 个别利润表

会计主体：中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、收入		360,300,070.75	308,131,500.20
1.利息收入		237,350.75	129,580.20
2.投资收益（损失以“-”号填列）		360,062,720.00	308,001,920.00

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
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		3,227,624.58	3,533,420.46
1.管理人报酬		2,753,618.16	3,010,906.04
2.托管费		359,951.08	393,582.69
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		114,055.34	128,931.73
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		357,072,446.17	304,598,079.74
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		357,072,446.17	304,598,079.74
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		357,072,446.17	304,598,079.74

10.3 现金流量表

10.3.1 合并现金流量表

会计主体：中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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		424,654,717.97	442,914,707.52
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		499,224.95	1,451,242.34
6.收到的税费返还		-	-
7.收到其他与经营活动有关的现金	10.5.7.53.1	617,188.30	164,477.10
经营活动现金流入小计		425,771,131.22	444,530,426.96
8.购买商品、接受劳务支付的现金		75,485,179.16	62,967,517.16
9.取得证券投资支付的现金净额		-	-

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
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		37,723,214.71	39,448,374.75
14.支付其他与经营活动有关的现金	10.5.7.53.2	9,371,725.03	9,644,434.57
经营活动现金流出小计		122,580,118.90	112,060,326.48
经营活动产生的现金流量净额		303,191,012.32	332,470,100.48
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	10.5.7.53.3	-	-
投资活动现金流入小计		-	-
18.购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金		3,056,030.70	-
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	10.5.7.53.4	-	-
投资活动现金流出小计		3,056,030.70	
投资活动产生的现金流量净额		-3,056,030.70	-
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	10.5.7.53.5	-	-
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		9,750,000.00	9,750,000.00
26.偿付利息支付的现金		14,214,750.69	15,212,934.02
27.分配支付的现金		321,000,011.99	308,000,053.35
28.支付其他与筹资活动有关的现金	10.5.7.53.6	18,447.13	15,400.10
筹资活动现金流出小计		344,983,209.81	332,978,387.47
筹资活动产生的现金流量净额		-344,983,209.81	-332,978,387.47
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		-44,848,228.19	-508,286.99
加：期初现金及现金等价物余额		326,494,038.56	318,342,323.47
六、期末现金及现金等价物余额		281,645,810.37	317,834,036.48

10.3.2 个别现金流量表

会计主体：中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、经营活动产生的现金流量：		-	-
1.收回不动产投资收到的现金		-	-
2.取得不动产投资收益收到的现金		360,062,720.00	308,001,920.00
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		227,949.55	132,769.42
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		360,290,669.55	308,134,689.42
8.取得不动产投资支付的现金		-	-
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		7,095,405.45	8,673,959.36
经营活动现金流出小计		7,095,405.45	8,673,959.36
经营活动产生的现金流量净额		353,195,264.10	299,460,730.06
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		321,000,011.99	308,000,053.35
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		321,000,011.99	308,000,053.35
筹资活动产生的现金流量净额		-321,000,011.99	-308,000,053.35
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		32,195,252.11	-8,539,323.29
加：期初现金及现金等价物余额		3,861,334.34	10,281,498.10
五、期末现金及现金等价物余额		36,056,586.45	1,742,174.81

10.4 所有者权益变动表

10.4.1 合并所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	10,880,000,000.00	-	-	-3,621,336,054.98	7,258,663,945.02
加：会计政策变更	-	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
二、本期期初余额	10,880,000,000.00	-	-	-3,621,336,054.98	7,258,663,945.02
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-	-	-344,203,049.45	-344,203,049.45
（一）综合收益总额	-	-	-	-23,203,037.46	-23,203,037.46
（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	-	-	-	-321,000,011.99	-321,000,011.99
（四）其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-	-
（五）其他	-	-	-	-	-
四、本期期末余额	10,880,000,000.00	-	-	-3,965,539,104.43	6,914,460,895.57
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	10,880,000,000.00	-	-	-2,943,116,610.01	7,936,883,389.99
加：会计政策变更	-	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
二、本期期初余额	10,880,000,000.00	-	-	-2,943,116,610.01	7,936,883,389.99
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-	-	-298,632,306.05	-298,632,306.05
（一）综合收益总额	-	-	-	9,367,747.30	9,367,747.30
（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	-	-	-	-308,000,053.35	-308,000,053.35
（四）其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-	-
（五）其他	-	-	-	-	-
四、本期期末余额	10,880,000,000.00	-	-	-3,241,748,916.06	7,638,251,083.94

10.4.2 个别所有者权益变动表

会计主体：中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	10,880,000,000.00	-	-	-2,948,560,573.97	7,931,439,426.03
加：会计政策变更	-	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-	-

其他	-	-	-	-	-
二、本期期初余额	10,880,000,000.00	-	-	-2,948,560,573.97	7,931,439,426.03
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-	-	36,072,434.18	36,072,434.18
（一）综合收益总额	-	-	-	357,072,446.17	357,072,446.17
（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	-	-	-	-321,000,011.99	-321,000,011.99
（四）其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-	-
（五）其他	-	-	-	-	-
四、本期期末余额	10,880,000,000.00	-	-	-2,912,488,139.79	7,967,511,860.21
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	10,880,000,000.00	-	-	-2,943,716,610.01	7,936,283,389.99
加：会计政策变更	-	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
二、本期期初余额	10,880,000,000.00	-	-	-2,943,716,610.01	7,936,283,389.99
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-	-	-3,401,973.61	-3,401,973.61
（一）综合收益总额	-	-	-	304,598,079.74	304,598,079.74
（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	-	-	-	-308,000,053.35	-308,000,053.35
（四）其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-	-

（五）其他	-	-	-	-	-
四、本期期末余额	10,880,000,000.00	-	-	-2,947,118,583.62	7,932,881,416.38

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 10.1 至 10.4 财务报表由下列负责人签署：

宗喆

基金管理人负责人

吕静杰

主管会计工作负责人

吴亚琼

会计机构负责人

10.5 报表附注

10.5.1 基金基本情况

中金安徽交控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 2022 年 10 月 12 日证监许可〔2022〕2459 号《关于准予中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金注册的批复》核准，由中金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《中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金基金合同》公开募集。中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金于 2022 年 11 月 11 日根据《关于中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金备案确认的函》（基金成立备案函【2022】1208 号）文备案成立。本基金为契约型封闭式，存续期限为 17 年，管理人为中金基金管理有限公司，托管人为招商银行股份有限公司。首次设立募集（不包括募集期认购资金利息）共计人民币 10,880,000,000 元，基金合同生效日的基金份额总额为 1,000,000,000 份基金份额。本基金已依据基金合同、招募说明书的约定，在基金合同生效后，将扣除必要费用后的全部募集资金投资于“中金-安徽交控高速公路基础设施资产支持专项计划资产支持证券”并持有该基础设施资产支持证券全部份额。

10.5.2 会计报表的编制基础

（一）编制基础

本基金财务报表以持续经营为编制基础。根据实际发生的交易事项，按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于公开募集不动产投资信托基金实务操作的有关规定，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

本基金不存在导致对报告期末起 12 个月内的持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况。

10.5.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》的要求，同时亦按照中国证券投资基金业协会颁布的《公开募集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》以及中国证券投资基金业协会颁布的《公开募集基础设施证券投资基金运营操作指引（试行）》《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

10.5.4 本报告期采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致的说明

本报告期，本基金所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

10.5.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

10.5.5.1 会计政策变更的说明

无。

10.5.5.2 会计估计变更的说明

无。

10.5.5.3 差错更正的说明

无。

10.5.6 税项

（一）主要税种及税率

增值税：13%、6%、5%、3%（征收率）、城市维护建设税：7%、教育费附加：3%、地方教育费附加：2%、企业所得税：25%。

（二）重要税收优惠政策及其依据

根据财政部、国家税务总局《关于企业所得税若干优惠政策的通知》（财税〔2008〕1号），本基金暂不征收企业所得税。截至本财务报表批准日，财政部和国家税务总局并未出台针对资产管理产品所得税问题的具体规定。因此，截至 2026 年 6 月 30 日，专项计划没有计提有关所得税费用。如果涉及专项计划业务的有关税收法规颁布，专项计划所涉及的所得税可能会根据日后出台的相关税务法规而作出调整。

10.5.7 合并财务报表重要项目的说明

10.5.7.1 货币资金

10.5.7.1.1 货币资金情况

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
库存现金	-
银行存款	281,656,734.18
其他货币资金	-
小计	281,656,734.18
减：减值准备	-
合计	281,656,734.18

10.5.7.1.2 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	37,155,404.60
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	244,490,405.77
应计利息	10,923.81
小计	281,656,734.18
减：减值准备	-
合计	281,656,734.18

注：1、其他存款为协定存款；

2、期末应收存款利息 10,923.81 元不属于现金及现金等价物。

3、期末无存放在境外且资金汇回受到限制的款项。

10.5.7.1.3 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。

10.5.7.2 交易性金融资产

无。

10.5.7.3 买入返售金融资产

无。

10.5.7.4 债权投资

无。

10.5.7.5 其他债权投资

无。

10.5.7.6 其他权益工具投资

无。

10.5.7.7 应收账款

10.5.7.7.1 按账龄披露应收账款

单位：人民币元

账龄	本期末 2026 年 6 月 30 日
1 年以内	9,861,948.25

账龄	本期末 2026 年 6 月 30 日
1-2 年	-
小计	9,861,948.25
减：坏账准备	-
合计	9,861,948.25

10.5.7.7.2 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 2026 年 6 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	-	-	-	-	-
按组合计提预期信用损失的应收账款	9,861,948.25	100.00	-	-	9,861,948.25
其中：关联方组合	9,861,948.25	100.00	-	-	9,861,948.25
无风险组合	-	-	-	-	-
账龄组合	-	-	-	-	-
合计	9,861,948.25	100.00	-	-	9,861,948.25

10.5.7.7.3 单项计提坏账准备的应收账款

无。

10.5.7.7.4 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 2026 年 6 月 30 日		
	账面余额	坏账准备	计提比例 (%)
关联方组合	9,861,948.25	-	-
合计	9,861,948.25	-	-

10.5.7.7.5 本期坏账准备的变动情况

无。

10.5.7.7.6 本期实际核销的应收账款情况

无。

10.5.7.7.7 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
安徽省高速公路联网运营有限公司	9,861,948.25	100.00	-	9,861,948.25
合计	9,861,948.25	100.00	-	9,861,948.25

10.5.7.8 存货

10.5.7.8.1 存货分类

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 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
原材料	-	-	-
在产品	-	-	-
库存商品	-	-	-
周转材料	181,170.00	-	181,170.00
合同履约成本	-	-	-
合计	181,170.00	-	181,170.00

10.5.7.8.2 存货跌价准备及合同履约成本减值准备

无。

10.5.7.8.3 报告期末存货余额含借款费用资本化金额的说明

无。

10.5.7.8.4 报告期内合同履约成本摊销金额的说明

无。

10.5.7.9 合同资产

无。

10.5.7.10 持有待售资产

无。

10.5.7.11 投资性房地产

无。

10.5.7.12 固定资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
固定资产	16,679,514.99
固定资产清理	-
合计	16,679,514.99

10.5.7.12.1 固定资产情况

单位：人民币元

项目	房屋及建筑物	安全设施	通讯设施	监控设施	收费设施	供配电及照明设施	机器设备	其他	合计
一、账面原值									
1.期初余额	194,000.00	10,482,622.45	55,619.43	6,734,576.55	3,480,052.33	1,317,206.92	1,633,447.59	142,144.36	24,039,669.63
2.本期增加金额	-	-	-	-	-	-	-	-	-
购置	-	-	-	-	-	-	-	-	-
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	194,000.00	10,482,622.45	55,619.43	6,734,576.55	3,480,052.33	1,317,206.92	1,633,447.59	142,144.36	24,039,669.63
二、累计折旧									
1.期初余额	522.72	1,887,326.01	44,059.83	2,231,174.59	581,686.79	234,855.13	528,148.07	137,880.01	5,645,653.15
2.本期增加金额	3,136.32	487,585.39	5,395.10	653,253.76	349,336.80	127,769.43	88,024.68	0.01	1,714,501.49
本期计提	3,136.32	487,585.39	5,395.10	653,253.76	349,336.80	127,769.43	88,024.68	0.01	1,714,501.49
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	3,659.04	2,374,911.40	49,454.93	2,884,428.35	931,023.59	362,624.56	616,172.75	137,880.02	7,360,154.64
三、减值准备									
1.期初余额	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2.本期增加金额	-	-	-	-	-	-	-	-	-

项目	房屋及建筑物	安全设施	通讯设施	监控设施	收费设施	供配电及照明设施	机器设备	其他	合计
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	190,340.96	8,107,711.05	6,164.50	3,850,148.20	2,549,028.74	954,582.36	1,017,274.84	4,264.34	16,679,514.99
2.期初账面价值	193,477.28	8,595,296.44	11,559.60	4,503,401.96	2,898,365.54	1,082,351.79	1,105,299.52	4,264.35	18,394,016.48

10.5.7.12.2 固定资产的其他说明

无。

10.5.7.12.3 固定资产清理

无。

10.5.7.13 在建工程

无。

10.5.7.13.1 在建工程情况

无。

10.5.7.13.2 报告期内重要在建工程项目变动情况

无。

10.5.7.13.3 报告期内在建工程计提减值准备情况

无。

10.5.7.13.4 工程物资情况

无。

10.5.7.14 使用权资产

无。

10.5.7.15 无形资产

10.5.7.15.1 无形资产情况

单位：人民币元

项目	特许经营权	软件	专利权	非专有技术	合计
一、账面原值	-	-	-	-	-
1.期初余额	11,501,606,986.97	87,600.00	-	-	11,501,694,586.97
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	-	-	-	-	-

项目	特许经营权	软件	专利权	非专有技术	合计
其他原因减少	-	-	-	-	-
4.期末余额	11,501,606,986.97	87,600.00	-	-	11,501,694,586.97
二、累计摊销	-	-	-	-	-
1.期初余额	2,345,835,283.74	14,161.98	-	-	2,345,849,445.72
2.本期增加金额	351,458,151.84	21,242.88	-	-	351,479,394.72
本期计提	351,458,151.84	21,242.88	-	-	351,479,394.72
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	2,697,293,435.58	35,404.86	-	-	2,697,328,840.44
三、减值准备	-	-	-	-	-
1.期初余额	891,772,873.76	-	-	-	891,772,873.76
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	891,772,873.76	-	-	-	891,772,873.76
四、账面价值	-	-	-	-	-
1.期末账面价值	7,912,540,677.63	52,195.14	-	-	7,912,592,872.77
2.期初账面价值	8,263,998,829.47	73,438.02	-	-	8,264,072,267.49

10.5.7.15.2 无形资产的其他说明

无。

10.5.7.16 开发支出

无。

10.5.7.17 商誉

无。

10.5.7.18 长期待摊费用

无。

10.5.7.19 递延所得税资产和递延所得税负债

10.5.7.19.1 未经抵销的递延所得税资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日	
	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	-	-
无形资产摊销	90,388,767.72	22,597,191.91
可抵扣亏损	-	-
合计	90,388,767.72	22,597,191.91

10.5.7.19.2 未经抵销的递延所得税负债

无。

10.5.7.19.3 以抵销后净额列示的递延所得税资产或负债

无。

10.5.7.19.4 未确认递延所得税资产的可抵扣暂时性差异明细

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
资产减值准备	-
预计负债	-
可抵扣亏损	736,734,935.13
合计	736,734,935.13

10.5.7.19.5 未确认递延所得税资产的可抵扣亏损将于以下年度到期

单位：人民币元

年份	本期末 2026 年 6 月 30 日	备注
2028 年	212,466,713.72	-
2029 年	271,686,738.96	-
2030 年	209,232,721.09	-
2031 年	43,348,761.36	-
合计	736,734,935.13	-

10.5.7.20 其他资产

10.5.7.20.1 其他资产情况

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
其他流动资产	-
其他应收款	32,880.00
预付账款	43,680.00
合计	76,560.00

10.5.7.20.2 预付账款

10.5.7.20.2.1 按账龄列示

单位：人民币元

账龄	本期末 2026 年 6 月 30 日
1 至 2 年	43,680.00
合计	43,680.00

10.5.7.20.2.2 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
中国联合网络通信有限公司合肥市分公司	33,600.00	76.92	2025 年 10 月 28 日	预付款按月摊销
中国电信股份有限公司合肥分公司	10,080.00	23.08	2025 年 10 月 28 日	预付款按月摊销
合计	43,680.00	100.00	-	-

10.5.7.20.3 其他应收款

10.5.7.20.3.1 按账龄列示

单位：人民币元

账龄	本期末 2026 年 6 月 30 日
1 年以内	-
1 至 2 年	18,400.00
3 至 4 年	14,480.00
小计	32,880.00
减：坏账准备	-
合计	32,880.00

10.5.7.20.3.2 按款项性质分类情况

单位：人民币元

款项性质	本期末 2026 年 6 月 30 日
关联方往来	32,880.00

款项性质	本期末 2026 年 6 月 30 日
小计	32,880.00
减：坏账准备	-
合计	32,880.00

10.5.7.20.3.3 其他应收款坏账准备计提情况

无。

10.5.7.20.3.4 报告期内实际核销的其他应收款情况

无。

10.5.7.20.3.5 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
安徽省交通控股集团有限公司	32,880.00	100.00	-	32,880.00
合计	32,880.00	100.00	-	32,880.00

10.5.7.21 短期借款

无。

10.5.7.22 应付账款

10.5.7.22.1 应付账款情况

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付工程款及运营支出	10,449,551.97
合计	10,449,551.97

10.5.7.22.2 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
安徽交控工程集团有限公司	6,176,701.93	资金统筹支付
合计	6,176,701.93	

10.5.7.23 应付职工薪酬

无。

10.5.7.24 应交税费

单位：人民币元

税费项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
增值税	10,997,386.68
消费税	-
企业所得税	-
个人所得税	-
城市维护建设税	769,946.11
教育费附加	551,368.69
房产税	38,045.26
土地使用税	36,033.85
土地增值税	-
印花税	44,978.45
水利建设基金	41,917.27
其他	-
合计	12,479,676.31

10.5.7.25 应付利息

无。

10.5.7.26 合同负债

无。

10.5.7.27 长期借款

单位：人民币元

借款类别	本期末 2026 年 6 月 30 日
质押借款	1,173,900,000.00
合计	1,173,900,000.00

注：根据质押合同（编号：Z551HT2022102401-03），长期借款以沿江高速公路芜湖（张韩）至安庆（大渡口）段公路收费权进行质押。

10.5.7.28 预计负债

无。

10.5.7.29 租赁负债

无。

10.5.7.30 其他负债

10.5.7.30.1 其他负债情况

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
其他应付款	89,631,250.28
一年内到期的非流动负债	39,125,115.98
合计	128,756,366.26

10.5.7.30.2 预收款项

无。

10.5.7.30.3 其他应付款

10.5.7.30.3.1 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 2026 年 6 月 30 日
运营服务成本	89,212,997.59
履约保证金	288,955.00
其他	129,297.69
合计	89,631,250.28

10.5.7.30.3.2 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
安徽省交通控股集团有限公司	46,236,055.67	资金统筹支付
合计	46,236,055.67	-

10.5.7.31 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	10,880,000,000.00
本期认购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,000,000,000.00	10,880,000,000.00

10.5.7.32 资本公积

无。

10.5.7.33 其他综合收益

无。

10.5.7.34 盈余公积

无。

10.5.7.35 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	-3,621,336,054.98	-	-3,621,336,054.98
本期利润	-23,203,037.46	-	-23,203,037.46
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	-321,000,011.99	-	-321,000,011.99
本期末	-3,965,539,104.43	-	-3,965,539,104.43

10.5.7.36 营业收入和营业成本

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	安徽省沿江高速公路有限公司	合计
营业收入	411,110,520.47	411,110,520.47
通行费收入	409,302,467.66	409,302,467.66
其他业务收入	1,808,052.81	1,808,052.81
合计	411,110,520.47	411,110,520.47
营业成本	402,683,333.21	402,683,333.21
折旧与摊销	353,193,896.21	353,193,896.21
运营服务成本	42,867,445.92	42,867,445.92
养护成本	2,998,084.26	2,998,084.26
其他营业成本	3,623,906.82	3,623,906.82
合计	402,683,333.21	402,683,333.21

10.5.7.37 投资收益

无。

10.5.7.38 公允价值变动收益

无。

10.5.7.39 资产处置收益

无。

10.5.7.40 其他收益

无。

10.5.7.41 其他业务收入

无。

10.5.7.42 利息支出

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
短期借款利息支出	-
长期借款利息支出	14,131,072.23
卖出回购金融资产利息支出	-
其他	-
合计	14,131,072.23

10.5.7.43 税金及附加

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
增值税	8,903,207.19
消费税	-
企业所得税	-
个人所得税	-
城市维护建设税	1,488,044.90
教育费附加	1,062,889.17
房产税	78,905.12
土地使用税	72,067.70
土地增值税	-
印花税	44,978.44
水利建设基金	246,666.30
其他	-
合计	11,896,758.82

10.5.7.44 销售费用

无。

10.5.7.45 管理费用

无。

10.5.7.46 财务费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
银行手续费	610.44
其他	-
合计	610.44

10.5.7.47 信用减值损失

无。

10.5.7.48 资产减值损失

无。

10.5.7.49 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
中介服务费	565,047.97
登记费	18,447.13
信息披露费	59,507.37
办公费	-
合计	643,002.47

10.5.7.50 营业外收入

10.5.7.50.1 营业外收入情况

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	-
养护废旧材料处置	150,058.66
合计	150,058.66

10.5.7.50.2 计入当期损益的政府补助

无。

10.5.7.51 营业外支出

无。

10.5.7.52 所得税费用

10.5.7.52.1 所得税费用情况

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期所得税费用	-

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
递延所得税费用	2,017,983.48
合计	2,017,983.48

10.5.7.52.2 会计利润与所得税费用调整过程

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
利润总额	-313,421,859.95
按法定/适用税率计算的所得税费用	-78,355,464.99
子公司适用不同税率的影响	-
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	69,536,258.13
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	10,837,190.34
合计	2,017,983.48

注：根据财政部、国家税务总局《关于企业所得税若干优惠政策的通知》（财税〔2008〕1 号），本基金暂不征收企业所得税。截至本财务报表批准日，财政部和国家税务总局并未出台针对资产管理产品所得税问题的具体规定。因此，截至 2026 年 6 月 30 日，专项计划没有计提有关所得税费用。如果涉及专项计划业务的有关税收法规颁布，专项计划所涉及的所得税可能会根据日后出台的相关税务法规而作出调整。本基金与专项计划暂不征收企业所得税，利润总额仅包括沿江公司。

10.5.7.53 现金流量表附注

10.5.7.53.1 收到其他与经营活动有关的现金

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
营业外收入	150,058.66
保证金	100,000.00
其他	367,129.64
合计	617,188.30

10.5.7.53.2 支付其他与经营活动有关的现金

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
管理人报酬	6,341,788.08
基金托管费	793,688.85
其他(保证金、手续费等)	2,236,248.10
合计	9,371,725.03

10.5.7.53.3 收到其他与投资活动有关的现金

无。

10.5.7.53.4 支付其他与投资活动有关的现金

无。

10.5.7.53.5 收到其他与筹资活动有关的现金

无。

10.5.7.53.6 支付其他与筹资活动有关的现金

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
手续费	18,447.13
合计	18,447.13

10.5.7.54 现金流量表补充资料

10.5.7.54.1 现金流量表补充资料

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 将净利润调节为经营活动现金流量	-
净利润	-23,203,037.46
加：信用减值损失	-
资产减值损失	-
固定资产折旧	1,714,501.49
投资性房地产折旧	-
使用权资产折旧	-
无形资产摊销	351,479,394.72
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）	14,131,072.23
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）	2,017,983.48
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）	18,450.00
经营性应收项目的减少（增加以“-”号填列）	1,880,070.67
经营性应付项目的增加（减少以“-”号填列）	-44,847,422.81
其他	-
经营活动产生的现金流量净额	303,191,012.32

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
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	281,645,810.37
减：现金的期初余额	326,494,038.56
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	-44,848,228.19

10.5.7.54.2 报告期内支付的取得子公司的现金净额

无。

10.5.7.54.3 现金和现金等价物的构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
一、现金	281,645,810.37
其中：库存现金	-
可随时用于支付的银行存款	281,645,810.37
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	281,645,810.37
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	-

10.5.7.55 所有者权益变动表项目注释

无。

10.5.8 合并范围的变更

10.5.8.1 非同一控制下企业合并

无。

10.5.8.2 同一控制下企业合并

无。

10.5.8.3 反向购买

无。

10.5.8.4 其他

无。

10.5.9 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	
中金-安徽交控高速公路基础设施资产支持专项计划	北京	北京	投资	100.00	-	投资设立
安徽省沿江高速公路有限公司	安徽合肥	安徽合肥	高速公路经营	-	100.00	其他

10.5.10 分部报告

无。

10.5.11 承诺事项、或有事项、资产负债表日后事项的说明

10.5.11.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无应披露的重要承诺事项。

10.5.11.2 或有事项

截至资产负债表日，本基金无应披露的重要或有事项。

10.5.11.3 资产负债表日后事项

本基金 2026 年 7 月 22 日对外公告分配 88,000,000.00 元，截至本报告发布日，已全部分配完毕。

10.5.12 关联方关系

10.5.12.1 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。

10.5.12.2 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
安徽省交通控股集团有限公司	原始权益人、运营管理机构
中金基金管理有限公司	基金管理人
招商银行股份有限公司	基金托管人、专项计划托管人
中国国际金融股份有限公司	专项计划管理人、基金管理人股东
中国中金财富证券有限公司	基金管理人关联方

关联方名称	与本基金的关系
安徽省交通控股集团沿江高速公路管理分公司	运营管理机构分公司
安徽省高速公路联网运营有限公司	运营管理机构控股子公司
安徽交控工程集团有限公司	运营管理机构控股子公司
安徽省交通规划设计研究总院股份有限公司	运营管理机构控股子公司
安徽交控信息产业有限公司	运营管理机构控股子公司
安徽交控建设工程集团有限公司	运营管理机构控股子公司
安徽省七星工程测试有限公司	运营管理机构控股子公司
安徽省中兴工程监理有限公司	运营管理机构控股子公司
安徽交控道路养护有限公司	运营管理机构控股子公司
安徽皖通高速公路股份有限公司	运营管理机构控股子公司
安徽交通数智科技有限公司	运营管理机构控股子公司
安徽省高速公路试验检测科研中心有限公司	运营管理机构控股子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

10.5.13 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

10.5.13.1 关联采购与销售情况

10.5.13.1.1 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
安徽省交通控股集团有限公司	运营服务成本	42,867,445.92	41,089,754.00
安徽省高速公路联网运营有限公司	联网服务费	1,391,219.09	1,540,912.60
安徽交控工程集团有限公司	公路养护	2,779,450.51	10,604,602.25
安徽交控工程集团有限公司	机电养护	39,600.00	211,666.61
安徽交通数智科技有限公司	联网服务费	1,391,219.09	1,540,912.60
合计	-	48,468,934.61	54,987,848.06

10.5.13.1.2 出售商品、提供劳务情况

无。

10.5.13.2 关联租赁情况

无。

10.5.13.3 通过关联方交易单元进行的交易

无。

10.5.13.4 关联方报酬

10.5.13.4.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,239,550.91	6,265,614.90
其中：固定管理费	3,239,550.91	6,265,614.90
浮动管理费	-	-
支付销售机构的客户维护费	398.20	398.20

注：1、固定管理费用

(1) 固定管理费用 1

日固定管理费 1 = 上一年度合并报表审计报告披露的基金合并净资产 $\times 0.09\% \div$ 当年天数。

(2) 固定管理费用 2

项目公司当年净现金流量 $\geq 80\% \times$ 净现金流量初始评估报告预测值时，固定管理费用 2 = 营业收入 $\times 0.8\%$ ；

$80\% \times$ 净现金流量预测值 $>$ 项目公司当年净现金流量 $\geq 60\% \times$ 净现金流量初始评估报告预测值时，固定管理费用 2 = 营业收入 $\times 0.6\%$ ；

$60\% \times$ 净现金流量初始评估报告预测值 $>$ 项目公司当年净现金流量时，固定管理费用 2 = 0。

2、浮动管理费

浮动管理费 = $\text{Max}[(\text{项目公司累计净现金流量} - \text{初始评估报告计算的预测累计净现金流量}), 0] \times 20\%$ 。

3、客户维护费

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，该费用按照约定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。

10.5.13.4.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	359,951.08	393,582.69

10.5.13.5 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

10.5.13.6 各关联方投资本基金的情况**10.5.13.6.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金的基金管理人在本报告期内及上期间均未持有过本基金。

10.5.13.6.2 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日							
关联方名称	期初持有		期间申 购/买入	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			份额	比例 (%)
安徽省交通控股集团 集团有限公司	532,058,516	53.21	-	-	-	532,058,516	53.21
安徽皖通高速公 路股份有限公司	38,900,000	3.89	-	-	-	38,900,000	3.89
安徽省交通规划 设计研究总院股 份有限公司	24,000,000	2.40	-	-	-	24,000,000	2.40
中国国际金融股 份有限公司	22,536,508	2.25	586,293	-	7,466,844	15,655,957	1.57
中国中金财富证 券有限公司	2,287,768	0.23	5,145,13 5	-	2,409,023	5,023,880	0.50
合计	619,782,792	61.98	5,731,42 8	-	9,875,867	615,638,353	61.56
上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日							
关联方名称	期初持有		期间申 购/买入	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			份额	比例 (%)
安徽省交通控股 集团有限公司	532,058,516	53.21	-	-	-	532,058,516	53.21
安徽皖通高速公 路股份有限公司	38,900,000	3.89	-	-	-	38,900,000	3.89
安徽省交通规划 设计研究总院股 份有限公司	24,000,000	2.40	-	-	-	24,000,000	2.40
中国国际金融股 份有限公司	20,053,596	2.01	6,184,94 2	-	6,608,056	19,630,482	1.96
合计	615,012,112	61.50	6,184,94 2	-	6,608,056	614,588,998	61.46

10.5.13.7 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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
招商银行股份有限公司	281,645,810.37	508,646.05	317,834,036.48	1,448,263.57
合计	281,645,810.37	508,646.05	317,834,036.48	1,448,263.57

10.5.13.8 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

10.5.13.9 其他关联交易事项的说明

本基金向招商银行股份有限公司合肥分行借款，期初余额 12.22 亿元，本期无新增借款，本期归还借款本金 0.098 亿元，期末借款余额为 12.123 亿元。本期计提利息 14,131,072.23 元。

10.5.14 关联方应收应付款项

10.5.14.1 应收项目

单位：人民币元

项目名称	关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
		账面余额	坏账准备	账面余额	坏账准备
应收账款	安徽省高速公路联网运营有限公司	9,861,948.25	-	11,536,469.01	-
其他应收款	安徽省交通控股集团有限公司	32,880.00	-	32,880.00	-
其他应收款	安徽交控工程集团有限公司	-	-	29,582.78	-
合计	-	9,894,828.25	-	11,598,931.79	-

10.5.14.2 应付项目

单位：人民币元

项目名称	关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
应付账款	安徽省高速公路联网运营有限公司	689,944.66	658,192.91
应付账款	安徽省交通规划设计研究总院股份有限公司	1,372,758.34	7,734,886.86
应付账款	安徽交控工程集团有限公司	6,241,785.42	16,850,997.27
应付账款	安徽交控信息产业有限公司	59,276.00	487,416.00
应付账款	安徽交控建设工程集团有限公司	61,764.59	95,698.01
应付账款	安徽交通数智科技有限公司	689,944.66	658,192.91
应付账款	安徽省中兴工程监理有限公司	12,380.00	12,380.00
应付账款	安徽交控道路养护有限公司	537,290.62	537,290.62
其他应付款	安徽省交通控股集团有限公司	89,103,501.59	101,213,316.30

项目名称	关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
其他应付款	安徽交控工程集团有限公司	100,000.00	100,000.00
其他应付款	安徽省交通控股集团沿江高速公路管理分公司	9,496.00	9,496.00
一年内到期的非流动负债	招商银行股份有限公司	39,125,115.98	33,358,794.44
长期借款	招商银行股份有限公司	1,173,900,000.00	1,189,500,000.00
应付管理人报酬	中金基金管理有限公司	2,753,618.16	6,071,716.60
应付管理人报酬	中国国际金融股份有限公司	485,932.75	270,071.48
应付托管费	招商银行股份有限公司	359,951.08	793,688.85
合计	-	1,315,502,759.85	1,358,352,138.25

10.5.15 期末基金持有的流通受限证券

10.5.15.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末，本基金未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。

10.5.15.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

10.5.16 收益分配情况

10.5.16.1 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	2026 年 1 月 26 日	场内：2026 年 1 月 27 日 场外：2026 年 1 月 26 日	1.60	160,000,000.00	81.70	
2	2026 年 4 月 1 日	场内：2026 年 4 月 2 日 场外：2026 年 4 月 1 日	1.61	161,000,011.99	99.69	
合计				321,000,011.99	-	

10.5.16.2 可供分配金额计算过程

参见 3.3.2.1。

10.5.17 金融工具风险及管理

10.5.17.1 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，或者不动产基金所持有资产支持证券的基础资产出现因付款人合同违约等导致现金流大幅波动的情况，造成基金资产损失和收益变

化的风险。

信用风险主要产生于银行存款、应收账款等。于资产负债表日，本基金及其子公司金融资产的账面价值已代表其最大信用风险敞口。

本基金货币资金主要存放于信用良好的金融机构，存放银行存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险。此外，对于应收账款和其他应收款，本基金设定相关机制以控制本基金的整体信用风险在可控的范围内。

10.5.17.2 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本不动产基金的现金流来自于其所持有的资产支持证券，最终来源于不动产项目。

本基金采取封闭式运作，不开通申购赎回，本基金份额只能在二级市场交易，不存在因无法应付投资者赎回要求引起的流动性风险。本基金的基金管理人通过持续监控不动产项目运营和现金流情况、对比实际现金流与现金流预测变化情况，并评估短期和长期资金需求，来确保不动产项目和基金现金储备充裕。

10.5.17.3 市场风险

（1）利率风险

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。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款，银行存款的利率在同期银行同业存款利率的基础上与各存款银行协商确定，银行存款的利息收入随市场利率的变化而波动。

本基金持有的利率敏感性负债主要为长期借款，长期借款的利率随市场利率的变化而波动。

（2）外汇风险

外汇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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

（3）其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险。本期末本基金未持有权益类资产，因此当市场价格发生合理、可能的变动时，对于本基金及专项计划资产净值无重大影响。

10.5.18 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

10.5.19 个别财务报表重要项目的说明

10.5.19.1 货币资金

10.5.19.1.1 货币资金情况

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
库存现金	-
银行存款	36,067,403.46
其他货币资金	-
小计	36,067,403.46
减：减值准备	-
合计	36,067,403.46

10.5.19.1.2 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	36,056,586.45
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
应计利息	10,817.01
小计	36,067,403.46
减：减值准备	-
合计	36,067,403.46

10.5.19.1.3 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

本基金于报告期末未持有因抵押、质押或冻结等对使用有限制、有潜在回收风险的款项。

10.5.19.2 长期股权投资

10.5.19.2.1 长期股权投资情况

单位：人民币元

	本期末 2026 年 6 月 30 日		
	账面余额	减值准备	账面价值
对子公司投资	10,880,000,000.00	2,945,327,918.67	7,934,672,081.33
合计	10,880,000,000.00	2,945,327,918.67	7,934,672,081.33

10.5.19.2.2 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
专项计划	10,880,000,000.00	-	-	10,880,000,000.00	-	2,945,327,918.67
合计	10,880,000,000.00	-	-	10,880,000,000.00	-	2,945,327,918.67

§11 评估报告

无。

§12 基金份额持有人信息

12.1 基金份额持有人户数及持有人结构

本期末 2026 年 6 月 30 日					
持有人 户数 (户)	户均持有的 不动产基金 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 (%)
14,665	68,189.57	968,887,962.00	96.89	31,112,038.00	3.11
上年度末 2025 年 12 月 31 日					
持有人 户数 (户)	户均持有的 不动产基金 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 (%)
15,046	66,462.85	977,833,898.00	97.78	22,166,102.00	2.22

12.2 不动产基金前十名流通份额持有人

本期末 2026 年 6 月 30 日			
序号	持有人名称	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
1	安徽省交通控股集团有限公司	332,058,516.00	33.21
2	安徽皖通高速公路股份有限公司	38,900,000.00	3.89
3	东方证券股份有限公司	31,073,312.00	3.11
4	国泰海通证券股份有限公司	26,944,079.00	2.69

5	安徽省交通规划设计研究总院股份有限公司	24,000,000.00	2.40
6	长城人寿保险股份有限公司－自有资金	17,846,669.00	1.78
7	中金公司－农银人寿保险股份有限公司－传统－中金安鑫睿盈 1 号单一资产管理计划	16,500,000.00	1.65
8	中国国际金融股份有限公司	15,655,957.00	1.57
9	中信证券资管－同方全球人寿保险有限公司－中信证券资管同全睿驰稳健单一资产管理计划	13,099,000.00	1.31
10	工银安盛人寿保险有限公司－短期分红	9,003,000.00	0.90
合计		525,080,533.00	52.51

上年度末
2025 年 12 月 31 日

序号	持有人名称	持有份额（份）	占总份额比例（%）
1	安徽省交通控股集团有限公司	332,058,516.00	33.21
2	安徽皖通高速公路股份有限公司	38,900,000.00	3.89
3	东方证券股份有限公司	28,518,623.00	2.85
4	安徽省交通规划设计研究总院股份有限公司	24,000,000.00	2.40
5	中国国际金融股份有限公司	22,536,508.00	2.25
6	国泰海通证券股份有限公司	17,325,533.00	1.73
7	长城人寿保险股份有限公司－自有资金	16,745,040.00	1.67
8	中金公司－农银人寿保险股份有限公司－传统－中金安鑫睿盈 1 号单一资产管理计划	16,500,000.00	1.65
9	同方全球人寿保险有限公司	13,099,123.00	1.31
10	广发证券股份有限公司	9,538,761.00	0.95
合计		519,222,104.00	51.92

12.3 不动产基金前十名非流通份额持有人

本期末 2026 年 6 月 30 日			
序号	持有人名称	持有份额（份）	占总份额比例（%）
1	安徽省交通控股集团有限公司	200,000,000.00	20.00
合计		200,000,000.00	20.00

上年度末
2025 年 12 月 31 日

序号	持有人名称	持有份额（份）	占总份额比例（%）
1	安徽省交通控股集团有限公司	200,000,000.00	20.00
合计		200,000,000.00	20.00

12.4 期末基金管理人的从业人员持有本不动产基金的情况

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不动产基金	602.00	0.0001

§13 不动产基金份额变动情况

单位：份

不动产基金合同生效日（2022 年 11 月 11 日）基金份额总额	1,000,000,000.00
本报告期期初不动产基金份额总额	1,000,000,000.00
本报告期不动产基金份额变动情况	-
本报告期末不动产基金份额总额	1,000,000,000.00

§14 重大事件揭示

14.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

14.2 基金管理人、基金托管人的专门不动产基金托管部门的重大人事变动

（1）基金管理人的重大人事变动情况

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

（2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，基金托管人的专门不动产基金托管部门无重大人事变动。

14.3 不动产基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

14.4 为不动产基金进行审计的会计师事务所情况

无。

14.5 为不动产基金出具评估报告的评估机构情况

无。

14.6 报告期内信息披露义务人、运营管理机构及其高级管理人员，原始权益人、资产支持证券管理人、资产支持证券托管人、项目公司和专业机构等业务参与人涉及对不动产项目运营有重大影响的稽查、处罚、诉讼或者仲裁等情况

无。

14.7 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	中金基金管理有限公司关于中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金 2026 年第一次分红公告	中国证监会规定媒介	2026/1/22
2	中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2026/1/22
3	中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金关于二〇二五年十二月主要运营数据的公告	中国证监会规定媒介	2026/1/22
4	中金基金管理有限公司关于中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金新增做市商的公告	中国证监会规定媒介	2026/1/29
5	关于中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金运营管理机构人员变动情况的公告	中国证监会规定媒介	2026/2/7
6	中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金关于二〇二六年一月主要运营数据的公告	中国证监会规定媒介	2026/2/28
7	中金基金管理有限公司关于中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金 2026 年第二次分红公告	中国证监会规定媒介	2026/3/28
8	中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会规定媒介	2026/3/31
9	中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金 2025 年评估报告	中国证监会规定媒介	2026/3/31
10	中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金 2025 年审计报告	中国证监会规定媒介	2026/3/31
11	中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金关于二〇二六年二月主要运营数据的公告	中国证监会规定媒介	2026/3/31
12	关于中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金召开 2025 年度业绩说明会的公告	中国证监会规定媒介	2026/4/8
13	中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2026/4/22
14	中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金关于二〇二六年三月主要运营数据的公告	中国证监会规定媒介	2026/4/22
15	关于中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金运营管理机构人员情况的公告	中国证监会规定媒介	2026/4/24
16	中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金关于二〇二六年四月主要运营数据的公告	中国证监会规定媒介	2026/5/15

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
17	中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金关于停复牌、暂停恢复基金通平台份额转让业务及交易情况的提示公告	中国证监会规定媒介	2026/5/16
18	中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金交易情况提示公告	中国证监会规定媒介	2026/5/20
19	中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金关于二〇二六年五月主要运营数据的公告	中国证监会规定媒介	2026/6/25

§15 影响投资者决策的其他重要信息

本基金穿透持有的不动产项目相关信息如下：

金额单位：人民币元

资产名称	沿江高速公路芜湖（张韩）至安庆（大渡口）段	备注
币种	人民币	
项目公司形成/购买资产时间	2022 年 3 月 23 日	
基金购买资产时间	2022 年 11 月 14 日	1
项目初始成本	5,445,579,300.00	2
资产组评估价值	8,186,224,900.00	3
采用成本法计量的账面价值	7,856,759,365.90	4
基金购买资产的投资成本	12,170,000,000.00	
报告期	2026 年中期	

注：1.本基金购买不动产资产交割日；

2.项目形成或购买资产的成本；

3. 根据北京国友大正资产评估有限公司出具的《中金基金管理有限公司拟披露不动产基金定期报告涉及的安徽省沿江高速公路有限公司享有的芜湖至安庆（池州大渡口）高速公路收费经营权及相关资产组价值项目资产评估报告》（大正评报字（2026）第 039A 号）资产组评估价值；

4.本项目公司采用历史成本法对不动产项目计量，高速公路特许经营权计入无形资产。

§16 备查文件目录

16.1 备查文件目录

- （一）中国证监会准予中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金募集注册的文件
- （二）《中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金基金合同》

- (三)《中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金托管协议》
- (四)《中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金招募说明书》及其更新
- (五)关于申请募集中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金之法律意见书
- (六)基金管理人业务资格批复和营业执照
- (七)基金托管人业务资格批复和营业执照
- (八)报告期内中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金在指定媒介上发布的各项公告
- (九)中国证监会要求的其他文件

16.2 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。

16.3 查阅方式

投资者可在基金管理人和/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。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人中金基金管理有限公司。

咨询电话：（86）010-63211122 400-868-1166

传真：（86）010-66159121

中金基金管理有限公司

2026 年 8 月 28 日