

# 中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证 券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：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：2024 年 08 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告中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 2024 年 8 月 30 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 2024 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>6</b>
2.1 基金产品基本情况	6
2.2 基础设施项目基本情况说明	7
2.3 基金管理人和基金托管人	7
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	8
<b>§ 3 主要财务指标和基金收益分配情况</b>	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	8
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	9
<b>§ 4 基础设施项目运营情况</b>	<b>9</b>
4.1 对报告期内基础设施项目公司运营情况的整体说明	9
4.2 基础设施项目所属行业情况	10
4.3 基础设施项目运营相关财务信息	11
4.4 基础设施项目运营相关通用指标信息	13
4.5 基础设施项目公司经营现金流	13
4.6 基础设施项目公司对外借入款项情况	16
4.7 基础设施项目投资情况	17
4.8 抵押、查封、扣押、冻结等他项权利限制的情况	17
4.9 基础设施项目相关保险的情况	17
4.10 基础设施项目未来发展展望的说明	17
4.11 其他需要说明的情况	17
<b>§ 5 除基础设施资产支持证券之外的投资组合报告</b>	<b>18</b>
5.1 报告期末基金的资产组合情况	18
5.2 报告期末按债券品种分类的债券投资组合	18
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	18
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	18
5.5 投资组合报告附注	18
5.6 报告期末其他各项资产构成	18
5.7 投资组合报告附注的其他文字描述部分	18
5.8 报告期内基金估值程序等事项的说明	18
5.9 报告期内基金资产重大减值计提情况的说明	19
<b>§ 6 管理人报告</b>	<b>19</b>

6.1 基金管理人及主要负责人员情况 .....	19
6.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	20
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 .....	20
6.4 管理人对报告期内基金的投资和运营分析 .....	21
6.5 管理人对报告期内基金收益分配情况的说明 .....	21
6.6 管理人对宏观经济及行业走势的简要展望 .....	21
6.7 管理人对关联交易及相关利益冲突的防范措施 .....	22
<b>§ 7 托管人报告.....</b>	<b>23</b>
7.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	23
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 .....	23
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 .....	23
<b>§ 8 中期财务报告（未经审计） .....</b>	<b>24</b>
8.1 资产负债表 .....	24
8.2 利润表 .....	27
8.3 现金流量表 .....	28
8.4 所有者权益变动表 .....	32
8.5 报表附注 .....	36
<b>§ 9 评估报告.....</b>	<b>59</b>
9.1 管理人聘任评估机构及评估报告内容的合规性说明 .....	59
9.2 评估报告摘要 .....	59
9.3 评估机构使用评估方法的特殊情况说明 .....	59
<b>§ 10 基金份额持有人信息.....</b>	<b>60</b>
10.1 基金份额持有人户数及持有人结构 .....	60
10.2 基金前十名流通份额持有人 .....	60
10.3 基金前十名非流通份额持有人 .....	61
10.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	61
<b>§ 11 基金份额变动情况.....</b>	<b>61</b>
<b>§ 12 重大事件揭示.....</b>	<b>62</b>
12.1 基金份额持有人大会决议 .....	62
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 .....	62
12.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	62
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 .....	62
12.5 基金投资策略的改变 .....	62
12.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	62
12.7 为基金出具评估报告的评估机构情况 .....	62
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 .....	63
12.9 其他重大事件 .....	63
<b>§ 13 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>64</b>
<b>§ 14 备查文件目录.....</b>	<b>64</b>
14.1 备查文件目录 .....	64

14.2 存放地点 .....	65
14.3 查阅方式 .....	65

## § 2 基金简介

### 2.1 基金产品基本情况

基金名称	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）
基金主代码	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基础设施资产支持证券并持有其全部份额，通过基础设施资产支持证券、项目公司等载体穿透取得基础设施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，提升基础设施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）基础设施项目投资策略。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。
业绩比较基准	不设立业绩比较基准。
风险收益特征	本基金为基础设施证券投资基金，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基础设施项目完全所有权或经营权利，通过积极运营管理以获取基础设施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
外部管理机构	安徽省交通控股集团有限公司

## 2.2 基础设施项目基本情况说明

基础设施项目名称：沿江高速公路芜湖（张韩）至安庆（大渡口）段

基础设施项目公司名称	安徽省沿江高速公路有限公司
基础设施项目类型	收费公路
基础设施项目主要经营模式	沿江高速公路芜湖（张韩）至安庆（大渡口）段项目（以下简称“本项目”）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。
基础设施项目地理位置	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 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		中金基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李耀光	张姗
	联系电话	010-63211122	400-61-95555
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-868-1166	400-61-95555
传真		010-66159121	0755-83195201
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		100004	518040
法定代表人		李金泽	缪建民

## 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	中国国际金融股份有限公司	安徽省交通控股集团有限公司
注册地址	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	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2座27层及28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	陈亮	项小龙

## 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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.ciccfund.com/">http://www.ciccfund.com/</a>

基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所
------------	----------------

## 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	2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日
本期收入	409,653,144.93
本期净利润	-68,927,893.25
本期经营活动产生的现金流量净额	321,196,394.65
期末数据和指标	2024 年 6 月 30 日
期末基金总资产	10,669,907,357.28
期末基金净资产	9,283,195,872.37
期末基金总资产与净资产的比例 (%)	114.94

### 3.2 其他财务指标

单位：人民币元

数据和指标	2024 年 6 月 30 日
期末基金份额净值	9.2832
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	292,529,378.83	0.2925	-
2023 年	780,445,986.54	0.7804	-
2022 年	683,653,137.44	0.6837	-

##### 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	375,000,049.98	0.3750	-
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	-68,927,893.25	-
本期折旧和摊销	387,323,737.26	-
本期利息支出	19,323,470.84	-
本期所得税费用	2,017,983.48	-
本期息税折旧及摊销前利润	339,737,298.33	-
调增项		
1-其他可能的调整项，如基础设施基金发行份额募集的资金、处置基础设施项目资产取得的现金、金融资产相关调整、期初现金余额等	390,445,931.64	-
调减项		
1-应收应付账款的变动	-16,662,346.84	-
2-支付的利息及所得税费用	-21,341,454.32	-
3-偿还借款本金支付的现金	-13,650,000.00	-
4-未来合理的相关支出预留，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	-11,000,000.00	-
5-本年分配上年度的可供分配金额	-375,000,049.98	-
本期可供分配金额	292,529,378.83	-

注：本期“未来合理相关支出预留”调整项为未来合理期间内的运营支出，包括：应付账款、应交税费等，上述费用将根据相应协议约定及实际发生情况支付。上述可供分配金额不代表最终实际分配金额。由于收入和费用并非在一年内平均发生，不得按本期占全年的时长比例简单判断本基金全年的可供分配金额。

### 3.3.2.2 本期调整项与往期不一致的情况说明

本报告期内，本基金不存在调整项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

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 3,700,292.96 元，资产支持证券管理人的管理费计提金额 652,992.98 元，基金托管人的托管费计提金额 483,697.76 元。外部管理机构的管理费包括固定管理费用和浮动管理费用，合计计提金额 3,266,671.94 元。

## § 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

基金管理人委托安徽省交通控股集团有限公司（以下简称“安徽交控集团”）负责基础设施项目的日常运营工作。基金管理人按照《基础设施项目运营管理服务协议》（以下简称“运营管理服务协议”）对外部管理机构进行监督和考核。

报告期内，本项目实现通行费（含税）41,847.97 万元，同比下降 19.33%，日均通行费收入（含税）229.93 万元。沿江高速日均断面自然车流量（含免费车流量）为 2.09 万辆、同比下降 18.57%。其中，客车（不含免费车辆）断面车流量 1.39 万辆/日、同比下降 21.18%；货车（不含免费车辆）断面车流量 0.58 万辆/日、同比下降 16.39%。

交通量及通行费收入同比下降的主要原因是：（1）周边路网变化、路段改扩建对车流量及收入产生一定的影响，具体情况详见“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”；（2）报告期受大雾、雨雪等恶劣天气影响，沿江高速采取封闭收费站、分流、限速等交通管制措施；（3）报告期内受梅雨季节影响，项目所在地池州、铜陵、芜湖等地连续 10 多天降雨，对沿江高速交通量及收入造成一定影响。

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”。

## 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

项目所属行业为高速公路行业。公路作为最基础、最广泛的交通基础设施，是衔接其他各种运输方式和发挥综合交通网络整体效率的主要支撑，在综合交通运输体系中具有不可替代的作用。

根据交通运输部数据，2023 年末全国公路里程 543.68 万公里，其中高速公路里程 18.36 万公里。2024 年上半年，全国公路投资完成 1.2 万亿元，完成公路货运量 197.7 亿吨，同比增长 4.0%，完成公路人员流动量 298.4 亿人次，同比增长 6.6%。

根据安徽省交通运输厅数据，2024 年 1-6 月，安徽省完成公路货运量 12.8 亿吨、货物周转量 1,833.9 亿吨公里，同比分别增长 3.2 %和 1.9%，公路货运小幅回升。

### 4.2.2 基础设施项目所属行业竞争情况的说明

目前随着国内高速公路建设布局日趋完善，高速公路路网也呈现出区域性特征，中东部路网建设基本成型，资产增速明显降低，新建项目以加密或改扩建工程为主。

周边区域交通网络发生重大变化，竞争性路段的建设完成并投入使用，高铁、航空、水运等替代性运输途径的发展和完善，均可能对高速公路经营单位产生一定的负面影响。车流量预测报告已对竞品项目的影响进行了考虑，沿江高速部分竞争性路段情况如下：

（1）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

流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，2024 年随着宁芜高速改扩建完成，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，途径沿江高速大渡口至殷家汇段。G236 查殷段改建工程期间将对沿江高速的交通量有一定的提升作用。

(4) 北沿江高速无为至安庆段：2025 年以后北沿江高速无为至安庆段开通，部分马鞍山、南京往来安庆的车辆会选择走马巢高速、巢无高速和北沿江高速。另外，铜陵、芜湖、浙江、宣城等方向去往安庆的部分交通也会选择从宣城至池州高速过江，然后走北沿江高速，避开九华山至大渡口桥段。

(5) 池州至宣城高速（以下简称“池宣高速”）：池宣高速预计 2026 年 6 月开通，池宣高速长约 145 公里，与沿江高速相交于九华山收费站附近的园林村。主要分流从沪渝高速苏南、浙北、上海、宣城过来，往来安庆、铜陵、池州、湖北的车辆。

沿江高速竞争性路段情况具体详见《中金基金管理有限公司拟披露基础设施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特许经营权以及因享有特许经营权而持有的沿江高速公路芜湖（张韩）至安庆（大渡口）段资产组价值项目资产评估报告》（以下简称“《沿江高速资产评估报告（2024）》”）（世联资产评估字 ZCODXJJ[2024]0061ZQQC，披露时间：2024 年 3 月 30 日）。

沿江高速作为沪渝高速（G50）和宁芜高速（G4211）的重要组成部分，实现了长江上、中、下游的快速互通，是首条真正意义的贯穿“长三角”的高速公路通道，对于加强泛长三角区域的经济活动具有重要意义。

### 4.3 基础设施项目运营相关财务信息

#### 4.3.1 基础设施项目公司的营业收入分析

##### 4.3.1.1 基础设施项目公司名称

基础设施项目名称：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	上年同期
		2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

		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	406,933,820.46	99.66	504,200,696.02	99.76
2	其他收入	1,400,172.39	0.34	1,215,415.39	0.24
3	合计	408,333,992.85	100.00	505,416,111.41	100.00

注：其他收入包含清障救援收入、路损赔付收入、涉路工程补偿收入等。

#### 4.3.1.2 管理人对基础设施项目公司营业收入重大变化情况的分析

报告期内，本项目实现通行费（不含税）40,693.38 万元，同比下降 19.29%。主要原因为周边新建及改扩建道路分流、恶劣天气及汛期影响，车流量同比下降明显。具体详见“4.1 对报告期内基础设施项目公司运营情况的整体说明”。

#### 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

基础设施项目公司名称：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		上年同期	
		2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	占该项目总成本比例 (%)	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	占该项目总成本比例 (%)
1	营业成本	429,952,571.87	43.98	424,622,100.66	37.66
2	税金及附加	1,878,135.98	0.19	2,130,398.28	0.19
3	财务费用	542,581,237.15	55.49	696,607,852.21	61.79
4	管理费用	3,305,686.36	0.34	4,043,328.89	0.36
5	其他成本费用	-	-	-	-
6	合计	977,717,631.36	100.00	1,127,403,680.04	100.00

注：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 19,323,470.84 元及股东借款利息 524,329,534.82 元等。

##### 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

基础设施项目公司名称：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	上年同期
				2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
				指标数值	指标数值

序号	指标名称	指标含义说明及计算公式	指标单位	本期	上年同期
				2024年1月1日至 2024年6月30日	2023年1月1日至 2023年6月30日
				指标数值	指标数值
1	资产负债率	负债总额/资产总额	%	86.98	76.90
2	毛利率	毛利润额/营业收入	%	-5.30	15.99
3	净利率	净利润/营业收入	%	-33.67	-6.15
4	息税折旧摊销前 净利率	基础设施项目息税折旧摊销前 净利润/营业收入	%	88.55	92.43

注：净利率计算公式中的净利润调整为项目公司财务报表净利润+计提的股东借款利息-税前可抵扣利息×所得税率。毛利率及净利率变动较大，主要是因为周边新建及改扩建道路分流、恶劣天气及汛期影响导致交通量及通行费收入下降的影响，具体详见“4.1 对报告期内基础设施项目公司经营情况的整体说明”。

#### 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，本项目实现通行费（含税）41,847.97 万元，同比下降 19.33%，日均通行费收入（含税）229.93 万元。沿江高速出口车流量 622.63 万辆，其中出口免费车 110.46 万辆。沿江高速日均断面自然车流量（含免费车流量）为 2.09 万辆、同比下降 18.57%。其中，客车（不含免费车辆）断面车流量 1.39 万辆/日、同比下降 21.18%；货车（不含免费车辆）断面车流量 0.58 万辆/日、同比下降 16.39%。

#### 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

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基础设施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。基础设施项目公司本期收入归集总金额 414,209,096.54 元，对外支出总金额 70,171,966.39 元。基础设施项目公司去年同期归集总金额 532,122,484.82 元，对外支出总金额 169,118,326.71 元。

##### 4.5.2 对报告期内单一客户经营性现金流占比较高情况的说明

无。

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

#### (1) 影响未来项目正常现金流的重大情况

##### ①宣广高速改扩建工程

G50 沪渝高速广德至宣城段（以下简称“宣广高速”）改扩建工程全长 91.554 公里。宣广高速现状为双向四车道高速公路，设计速度 100 公里/小时。按不同改扩建标准，将宣广高速共分为五段，其中三段为四改八工程，一段为四改六工程，一段维持四车道，设计速度 100-120 公里/小时。宣广高速改扩建工程于 2022 年底开始，2023 年 4 月逐步涉路施工，计划 2024 年 12 月建成通车。

根据宣广高速公告，2024 年 3 月 8 日 8:00 至 9 月 29 日 17:00，对 G50 沪渝高速（即宣广高速）芜宣枢纽至广德互通、广德东互通至浙江省界半幅主线（浙江方向）及相应的枢纽、收费站、服务区匝道进行封闭施工；拟于 2024 年 5 月 31 日 8:00 至 9 月 29 日 17:00，对广德互通至广德东互通半幅主线（浙江方向）及相应的收费站匝道进行封闭施工。宣广高速改扩建工程完成后将大幅提升整体的通行能力，有利于周边整体路网长期交通量的增长。

##### ②无岳高速

无岳高速于 2023 年 10 月底开通，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。2024 年随着宁芜高速、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，途径沿江高速大渡桥至殷家汇段。G236 查殷段改建工程期间将对沿江高速的交通量有一定的提升作用。

##### ④国道 G318 东至段及国道 G237 贵池段

东至县人民政府公告显示，国道 G318 东至段 K506+725—K509+810（以下简称“国道 G318 东至段”）于 2024 年 6 月 21 日至 2024 年 11 月 12 日进行半幅封闭施工，半幅双向通行，施工期间过境重中型货车请从沪渝高速（即沿江高速）绕行。施工期间预计对沿江高速的交通量有一定的提升作用。

池州市交通运输局公告显示，G237 贵池段 K764+550—K770+330（牛头山敬老院一股汇高速路口）（以下简称“G237 贵池段”）于 2024 年 6 月 12 日至 2024 年 11 月 12 日进行半幅封闭施工，

半幅双向通行，施工期间过境重中型货车请从沪渝高速（即沿江高速）绕行。施工期间预计对沿江高速的交通量有一定的提升作用。

根据外部管理机构现场尽调情况，截至本报告报出日，G237 贵池段已于 2024 年 7 月 15 日正式管控，国道 G318 东至段暂未正式开工。外部管理机构将持续跟进后续进展情况。

区位示意图如下：



图例来源：《安徽省沿江高速交通量及通行费收入预测研究（2024）》，施伟拔咨询（深圳）有限公司

## (2) 拟采取的相应措施

针对上述情况，基金管理人将督促外部管理机构持续采取各项措施保障公路运营质量，控制

运营成本等。本报告期内采取的措施主要包括：

①探索“交旅融合”。立足区位优势，充分挖掘周边旅游资源，积极探索“高速+旅游”模式，与周边部分景区达成合作机制，在景区设置高速宣传栏，并在高速公路收费道口发放旅游信息导游图、景区优惠等吸引客流。

②注重成本管控。外部管理机构通过采购询比、严格控制预算执行等多项管理举措强化成本管控，在保障运营工作基础上，节约成本以提升经营效益。

③积极应对恶劣天气影响。针对春节期间的雨雪恶劣天气，迅速启动应急预案，密切关注雪情、实时路况、信息共享、协同巡查、联合处置等方式，高效发挥“一路多方”联动联动机制；信息中心实行三班三运转，及时跟踪、分析研判极端天气，做好路况信息和预警提示信息发布，有力保障了沿江高速安全畅通。入汛以来，外部管理机构建立健全防汛应急体系，持续开展安全隐患排查，备足备齐应急物资，切实抓好防洪水、防雷电、防泥石流等安全生产工作，基础设施项目未发生较大险情及施工路段交通事故。

④持续对接周边道路改扩建进展情况。外部管理机构前往宣广高速改扩建工程项目办交流分析改扩建中可能影响车辆通行的因素，督促项目办及时实现单幅双向通行交通组织方案。同时外部管理机构前往国道 G318 东至段及 G237 贵池段属地公安机关及交管部门实地了解情况，走访工程的建设单位和施工单位，加强多方合作。

## 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，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。报告期内支付利息 19,442,150.00 元，偿还本金 13,650,000.00 元，期末借款本金余额 1,274,000,000.00 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

本报告期内，本基金对外借入款项情况与上年同期情况一致。

### 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

本报告期内，基础设施项目无不符合借款要求的对外借入款项。



## 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

本报告期内，除基金成立时初次购入的基础设施项目，无购入或出售基础设施项目。

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

本报告期内，除基金成立时初次购入的基础设施项目，无购入或出售基础设施项目。

## 4.8 抵押、查封、扣押、冻结等他项权利限制的情况

本报告期内，基础设施项目除“4.6.1 报告期内对外借入款项基本情况”所述的收费权质押以外，无抵押、查封、扣押、冻结等他项权利限制的情况。

## 4.9 基础设施项目相关保险的情况

基础设施项目已按照《公开募集基础设施证券投资基金指引（试行）》要求，购买基础设施资产的财产一切险、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，上述保险为基础设施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。

## 4.10 基础设施项目未来发展展望的说明

根据安徽省统计局数据，2024 上半年安徽省地区生产总值 23,967 亿元，按不变价格计算，同比增长 5.3%。根据安徽省交通运输厅数据，2024 年 1-6 月，安徽省完成公路货运量 12.8 亿吨、货物周转量 1,833.9 亿吨公里，同比分别增长 3.2%和 1.9%。安徽省经济运行平稳向好，高质量发展扎实推进，公路货运小幅回升。

长三角区域合作办公室于 2024 年 7 月 25 日举行《长三角地区一体化发展三年行动计划（2024—2026 年）》新闻发布会。沪苏浙皖三省一市共同编制实施新一轮三年行动计划，通过项目化、清单式推进，确保长三角一体化发展国家战略各项任务加快落实。随着交通的互联互通，长三角正在“破圈”，中国的超级城市群，正在加速“进化”。长三角一体化推进 20 多年来，历经多次“扩容”，从最初的 15 个城市，逐步扩大到今天的 41 城。

本基础设施项目贯穿安徽沿江地区经济发达的芜湖、铜陵、池州等城市，是串联皖江城市群的高速“项链”。同时，沿江高速也是沪渝高速（G50）安徽段的重要组成部分，实现了长江上、中、下游的快速互通，是首条真正意义的贯穿“长三角”的高速公路通道，对于加强泛长三角区域的经济活动具有重要意义。沿江高速将受益于并助力周边城市及长三角地区的发展。

## 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	5,045,900.86
4	其他资产	-
5	合计	5,045,900.86

### 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投资。

### 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除基础设施资产支持证券以外的资产支持证券投资。

### 5.5 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。

### 5.6 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

无。

### 5.8 报告期内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基础设施资产支持证券，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。

## 5.9 报告期内基金资产重大减值计提情况的说明

本基金主要资产投资于基础设施资产支持证券，无其他投资品种。报告期内本基金资产无重大减值计提情况。

## § 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 6 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基础设施基金（或称“公募 REITs”）的研究、投资及运营管理工作，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 6 只基础设施基金。

#### 6.1.2 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任职期限		基础设施项目运营或投资管理年限	基础设施项目运营或投资管理经验	说明
		任职日期	离任日期			
牛天罡	本基金的基金经理	2022 年 11 月 11 日	-	7 年	曾参与徽杭高速类 REITs 项目、菜鸟仓储物流类 REITs 项目等多个基础设施 REITs 的投资工作，投资类别涵盖高速公路、仓储物流、产业园区等领域。	牛天罡先生，理学硕士。历任中信金石基金管理有限公司投资部高级经理；金石投资有限公司不动产投资部高级经理；北京中联合国新投资基金管理有限公司不动产金融部高级经理；现任中金基金管理有限公司创新投资部副总经理。
吴亚琼	本基金的基金经理	2022 年 11 月 11 日	-	8 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	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

姓名	职务	任职期限		基础设施项目运营或投资管理年限	基础设施项目运营或投资管理经验	说明
		任职日期	离任日期			
					盖轨道交通、铁路等基础设施领域。	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高级经理。
郑霜	本基金的基金经理	2022 年 11 月 11 日	-	7.5 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、租赁住房等基础设施领域。	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经理。

注：1、基础设施项目运营或投资管理年限为参与基础设施相关行业运营或投资管理工作经历年限总和。

2、本基金无基金经理助理。

### 6.1.3 报告期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期，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。

### 6.2 管理人对报告期内本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，履行基础设施项目运营管理职责，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。

### 6.3 管理人对报告期内公平交易制度及执行情况的专项说明

本基金管理人根据《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。

#### 6.4 管理人对报告期内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基础设施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基础设施项目运营管理职责，同时，基金管理人委托安徽交控集团作为外部管理机构，负责基础设施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外部管理机构履职情况的检查工作，检查内容包括其从事基础设施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基础设施项目运营情况详见“4 基础设施项目运营情况”。

#### 6.5 管理人对报告期内基金收益分配情况的说明

本报告期内，基金管理人于 2023 年剩余可供分配金额进行了分配。本期实际分配金额约为 2023 年度剩余可供分配金额的 99.88%。

截至本报告期末，2024 年累计可供分配金额为 292,529,378.83 元，基金管理人将按照适用法规规定及本基金基金合同约定，分配总计不少于 90%本年度可供分配金额的基金收益。

#### 6.6 管理人对宏观经济及行业走势的简要展望

##### (1) 宏观经济分析

根据国家统计局数据，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%。上半年，全国规模以上工业增加值同比增长 6.0%，全国居民消费价格（CPI）同比上涨 0.1%，全国工业生产者出厂价格同比下降 2.1%。上半年我国经济运行总体平稳，转型升级稳步推进。同时也要看到，当前外部环境错综复杂，国内有效需求依然不足，经济回升向好基础仍需巩固。

根据安徽省统计局数据，上半年安徽省地区生产总值 23,967 亿元，按不变价格计算，同比增长 5.3%，全省规模以上工业增加值同比增长 8.5%，工业生产者出厂价格同比下降 3.3%，居民消费价格同比上涨 0.2%。2024 年 1-6 月，完成公路货运量 12.8 亿吨、货物周转量 1,833.9 亿吨公里，同比分别增长 3.2% 和 1.9%。随着各项政策举措显效发力，上半年安徽省经济运行稳中有进，积极因素持续累积，高质量发展扎实推进。同时也要看到，当前不稳定、不确定因素依然较多，经济持续回升向好仍面临困难挑战。

根据芜湖市统计局数据，上半年芜湖市生产总值 2,435.87 亿元，按不变价格计算，同比增长 5.3%；全市规模以上工业增加值同比增长 8.1%。根据池州市统计局数据，上半年池州市实现生产总值 583.5 亿元，按不变价格计算，同比增长 6.2%；全市规模以上工业增加值同比增长 14.3%。根据铜陵市统计局数据，上半年铜陵市生产总值 619.1 亿元，同比增长 5.9%；全市规模以上工业增加值同比增长 8.5%。

## （2）高速行业分析

根据安徽省交通运输厅数据，今年上半年安徽省累计完成交通固定资产投资 753.9 亿元、同比增长 7.6%，安徽省交通运输重大项目建设加力提速，上半年“县城通”高速公路项目进展顺利，和襄高速公路、引江济淮东淝河一线船闸改造、合肥机场改扩建等一批重点项目加快推进。

从长三角地区来看，交通运输一体化推进有力，沪苏浙皖间的互联互通正在加快步伐。三省一市交通运输部门不断完善务实高效的体制机制，围绕基础设施硬联通以及信用、执法等软联通签署 34 项合作协议。截至 2023 年，高快速路网建设取得新进展，高速公路总里程达 1.7 万公里，新建成高速公路省际接口 7 个，总数达 34 个。2024 年，三省一市将持续提升交通基础设施互联互通水平，有序推进交通领域公共服务便利共享，扎实推进长三角区域交通一体化制度创新。

长期综合来看，我国经济长期向好的基本面没有变，高速公路的交通量预计将随着国民经济的发展和路网的不断完善而逐步提升。

## 6.7 管理人对关联交易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东高速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基础设施项目的基础设施基金，因此，基金管理人目前管理与本基金具有同类型基础设施资产的基础设施基金。

综合考量中金山东高速 REIT 和本基金项下基础设施资产处在距离较远的不同区域，分别聘请了外部管理机构，且外部管理机构不存在关联关系，以及 2 只基础设施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。

为有效防范基础设施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，基金管理人制定基础设施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，基础设施基金开展关联交易需提交基础设施基金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基础设施基金投资决策委员会会议，预防和评估不同基础设施基金之间同业竞争和潜在利益冲突情况，制定公平对待所有基础设施项目的相关措施；对可能发生的同业竞争和可能存在的利益冲突，由基础设施基金投资决策委员会召开临时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 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

招商银行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，招商银行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 7.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、收益分配等情况的说明

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在

虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	8.5.7.1	303,529,378.83	390,445,931.64
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
衍生金融资产		-	-
交易性金融资产		-	-
买入返售金融资产	8.5.7.2	-	-
债权投资	8.5.7.3	-	-
其他债权投资	8.5.7.4	-	-
其他权益工具投资	8.5.7.5	-	-
应收票据		-	-
应收账款	8.5.7.6	17,842,280.43	10,219,558.59
应收清算款		-	-
应收利息		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
存货	8.5.7.7	143,880.00	204,750.00
合同资产	8.5.7.8	-	-
持有待售资产		-	-
长期股权投资		-	-
投资性房地产	8.5.7.9	-	-
固定资产	8.5.7.10	8,842,798.46	9,637,280.90
在建工程	8.5.7.11	-	-
使用权资产		-	-
无形资产	8.5.7.12	10,245,228,232.82	10,631,757,487.64
开发支出		-	-
商誉	8.5.7.13	-	-
长期待摊费用		-	-
递延所得税资产	8.5.7.14.1	83,785,804.23	85,803,787.71
其他资产	8.5.7.15	10,534,982.51	10,518,536.35
资产总计		10,669,907,357.28	11,138,587,332.83



负债和所有者权益	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<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		-	-
应付票据		-	-
应付账款	8.5.7.16	9,404,163.87	54,395,037.42
应付职工薪酬	8.5.7.17	-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		7,292,438.40	14,317,676.08
应付托管费		483,697.76	1,082,852.80
应付投资顾问费		-	-
应交税费	8.5.7.18	24,014,548.99	19,712,875.02
应付利息		-	-
应付利润		-	-
合同负债	8.5.7.19	-	-
持有待售负债		-	-
长期借款	8.5.7.20	1,244,750,000.00	1,268,150,000.00
预计负债		-	-
租赁负债		-	-
递延收益		-	-
递延所得税负债	8.5.7.14.2	-	-
其他负债	8.5.7.21	100,766,635.89	53,805,075.91
负债合计		1,386,711,484.91	1,411,463,517.23
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	8.5.7.22	10,880,000,000.00	10,880,000,000.00
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	8.5.7.23	-1,596,804,127.63	-1,152,876,184.40
所有者权益合计		9,283,195,872.37	9,727,123,815.60
负债和所有者权益总计		10,669,907,357.28	11,138,587,332.83

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 9.2832 元，基金份额总额 1,000,000,000.00 份。

### 8.1.2 个别资产负债表

会计主体：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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	8.5.18.1	5,045,900.86	9,332,162.83
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	8.5.18.2	9,885,909,919.50	9,885,909,919.50
其他资产		-	-
资产总计		9,890,955,820.36	9,895,242,082.33
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6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		3,700,292.96	8,283,836.49
应付托管费		483,697.76	1,082,852.80
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
其他负债		133,325.65	270,000.00
负债合计		4,317,316.37	9,636,689.29
<b>所有者权益：</b>			
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		-993,361,496.01	-994,394,606.96
所有者权益合计		9,886,638,503.99	9,885,605,393.04

负债和所有者权益总计		9,890,955,820.36	9,895,242,082.33
------------	--	------------------	------------------

## 8.2 利润表

### 8.2.1 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		409,653,142.13	512,551,890.65
1. 营业收入	8.5.7.24	408,333,992.85	505,416,111.41
2. 利息收入		1,319,149.28	7,135,631.42
3. 投资收益（损失以“-”号填列）		-	-
4. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
6. 资产处置收益（损失以“-”号填列）		-	-
7. 其他收益		-	147.82
8. 其他业务收入		-	-
<b>二、营业总成本</b>		476,563,054.70	478,878,037.29
1. 营业成本	8.5.7.24	429,952,571.87	424,622,100.66
2. 利息支出	8.5.7.25	19,323,470.84	20,203,789.31
3. 税金及附加	8.5.7.26	18,982,478.81	24,419,839.15
4. 销售费用		-	-
5. 管理费用		-	-
6. 研发费用		-	-
7. 财务费用	8.5.7.27	19,530.66	534.75
8. 管理人报酬		7,619,957.88	8,876,123.81
9. 托管费		483,697.76	536,976.32
10. 投资顾问费		-	-
11. 信用减值损失		-	-
12. 资产减值损失		-	-
13. 其他费用	8.5.7.28	181,346.88	218,673.29
<b>三、营业利润（营业亏损以“-”号填列）</b>		-66,909,912.57	33,673,853.36
加：营业外收入	8.5.7.29	2.80	-
减：营业外支出		-	-
<b>四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-66,909,909.77	33,673,853.36
减：所得税费用	8.5.7.30	2,017,983.48	15,929,867.35
<b>五、净利润（净亏损以“-”号填</b>		-68,927,893.25	17,743,986.01

列)			
1. 持续经营净利润(净亏损以“-”号填列)		-68,927,893.25	17,743,986.01
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		-68,927,893.25	17,743,986.01

### 8.2.2 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、收入		380,340,477.30	683,538,700.21
1. 利息收入		204,157.30	220,300.21
2. 投资收益(损失以“-”号填列)		380,136,320.00	683,318,400.00
其中：以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-	-
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他业务收入		-	-
二、费用		4,307,316.37	4,704,359.22
1. 管理人报酬		3,700,292.96	4,107,875.53
2. 托管费		483,697.76	536,976.32
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		123,325.65	59,507.37
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		376,033,160.93	678,834,340.99
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		376,033,160.93	678,834,340.99
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		376,033,160.93	678,834,340.99

### 8.3 现金流量表

#### 8.3.1 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年1月1日至 2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至 2023年6月30日
<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		412,872,175.27	508,193,468.82
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		1,320,889.95	6,953,741.18
6. 收到的税费返还		-	-
7. 收到其他与经营活动有关的现金	8.5.7.31.1	245,622.10	2,198,265.75
<b>经营活动现金流入小计</b>		414,438,687.32	517,345,475.75
8. 购买商品、接受劳务支付的现金		49,843,728.59	73,266,952.15
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		-	217,434.84
13. 支付的各项税费		26,898,041.96	89,155,056.59
14. 支付其他与经营活动有关的现金	8.5.7.31.2	16,500,522.12	10,809,617.66
<b>经营活动现金流出小计</b>		93,242,292.67	173,449,061.24
<b>经营活动产生的现金流量净额</b>		321,196,394.65	343,896,414.51
<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		-	13,538,328.60
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		-	-
<b>投资活动现金流出小计</b>		-	13,538,328.60
<b>投资活动产生的现金流量净额</b>		-	-13,538,328.60
<b>三、筹资活动产生的现金流量：</b>			
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		-	-
<b>筹资活动现金流入小计</b>		-	-
24. 赎回支付的现金		-	-
25. 偿还借款支付的现金		13,650,000.00	12,350,000.00

项目	附注号	本期 2024年1月1日至 2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至 2023年6月30日
26. 偿付利息支付的现金		19,442,150.00	20,326,368.47
27. 分配支付的现金		375,000,049.98	683,600,007.75
28. 支付其他与筹资活动有关的现金		19,006.81	34,165.92
<b>筹资活动现金流出小计</b>		<b>408,111,206.79</b>	<b>716,310,542.14</b>
<b>筹资活动产生的现金流量净额</b>		<b>-408,111,206.79</b>	<b>-716,310,542.14</b>
<b>四、汇率变动对现金及现金等价物的影响</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>五、现金及现金等价物净增加额</b>		<b>-86,914,812.14</b>	<b>-385,952,456.23</b>
加：期初现金及现金等价物余额		390,442,468.07	805,715,301.37
<b>六、期末现金及现金等价物余额</b>		<b>303,527,655.93</b>	<b>419,762,845.14</b>

### 8.3.2 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：2024年1月1日至2024年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年1月1日至 2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至 2023年6月30日
<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		380,136,320.00	683,318,400.00
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		205,896.46	38,397.11
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>380,342,216.46</b>	<b>683,356,797.11</b>
8. 取得基础设施投资支付的现金		-	-
9. 取得证券投资支付的现金净额		-	-
10. 买入返售金融资产净增加额		-	-
11. 卖出回购金融资产款净减少额		-	-
12. 支付的各项税费		-	-
13. 支付其他与经营活动有关的现金		9,626,689.29	272,021.82
<b>经营活动现金流出小计</b>		<b>9,626,689.29</b>	<b>272,021.82</b>
<b>经营活动产生的现金流量净额</b>		<b>370,715,527.17</b>	<b>683,084,775.29</b>
<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>		<b>-</b>	<b>-</b>
16. 赎回支付的现金		-	-

项目	附注号	本期 2024年1月1日至 2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至 2023年6月30日
17. 偿付利息支付的现金		-	-
18. 分配支付的现金		375,000,049.98	683,600,007.75
19. 支付其他与筹资活动有关的现金		-	-
筹资活动现金流出小计		375,000,049.98	683,600,007.75
筹资活动产生的现金流量净额		-375,000,049.98	-683,600,007.75
三、汇率变动对现金及现金等价物的影响		-	-
四、现金及现金等价物净增加额		-4,284,522.81	-515,232.46
加：期初现金及现金等价物余额		9,328,742.27	6,554,415.02
五、期末现金及现金等价物余额		5,044,219.46	6,039,182.56

## 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日							
	实收基金	其他权益工具	资本公积	其他综合收益	专项储备	盈余公积	未分配利润	所有者权益合计
一、上期期末余额	10,880,000,000.00	-	-	-	-	-	-1,152,876,184.40	9,727,123,815.60
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	10,880,000,000.00	-	-	-	-	-	-1,152,876,184.40	9,727,123,815.60
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-	-	-	-	-	-443,927,943.23	-443,927,943.23
（一）综合收益总额	-	-	-	-	-	-	-68,927,893.25	-68,927,893.25
（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	-	-	-	-	-	-	-375,000,049.98	-375,000,049.98
（四）其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-	-	-	-	-
（五）专项储备	-	-	-	-	-	-	-	-
其中：本期提取	-	-	-	-	-	-	-	-



本期使用	-	-	-	-	-	-	-	-
(六) 其他	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>四、本期期末余额</b>	10,880,000,000.00	-	-	-	-	-	-1,596,804,127.63	9,283,195,872.37
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日							
	实收基金	其他权益工具	资本公积	其他综合收益	专项储备	盈余公积	未分配利润	所有者权益合计
<b>一、上期期末余额</b>	10,880,000,000.00	-	-	-	-	-	-51,454,540.37	10,828,545,459.63
加：会计政策变更	-	-	-	-	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-	-	-	-	-
同一控制下企业合并	-	-	-	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>二、本期期初余额</b>	10,880,000,000.00	-	-	-	-	-	-51,454,540.37	10,828,545,459.63
<b>三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）</b>	-	-	-	-	-	-	-665,856,021.74	-665,856,021.74
（一）综合收益总额	-	-	-	-	-	-	17,743,986.01	17,743,986.01
（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	-	-	-	-	-	-	-683,600,007.75	-683,600,007.75
（四）其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-	-	-	-	-
（五）专项储备	-	-	-	-	-	-	-	-
其中：本期提取	-	-	-	-	-	-	-	-
本期使用	-	-	-	-	-	-	-	-
（六）其他	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>四、本期期末余额</b>	10,880,000,000.00	-	-	-	-	-	-717,310,562.11	10,162,689,437.89

### 8.4.2 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日				
	实收基金	资本公积	其他综合收益	未分配利润	所有者权益合计
一、上期期末余额	10,880,000,000.00	-	-	-994,394,606.96	9,885,605,393.04
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	-	-	-994,394,606.96	9,885,605,393.04
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-	-	1,033,110.95	1,033,110.95
（一）综合收益总额	-	-	-	376,033,160.93	376,033,160.93
（二）产品持有人申购和赎回	-	-	-	-	-
其中：产品申购	-	-	-	-	-
产品赎回	-	-	-	-	-
（三）利润分配	-	-	-	-375,000,049.98	-375,000,049.98
（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	-	-	-993,361,496.01	9,886,638,503.99
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日				
	实收基金	资本公积	其他综合收益	未分配利润	所有者权益合计

一、上期期末余额	10,880,000,000.00	-	-	5,121,828.69	10,885,121,828.69
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	-	-	5,121,828.69	10,885,121,828.69
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-	-	-4,765,666.76	-4,765,666.76
（一）综合收益总额	-	-	-	678,834,340.99	678,834,340.99
（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	-	-	-	-683,600,007.75	-683,600,007.75
（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	-	-	356,161.93	10,880,356,161.93

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 8.1 至 8.4 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

## 8.5 报表附注

### 8.5.1 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。

### 8.5.2 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基础设施证券投资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。

### 8.5.3 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>》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。

### 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,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。

### 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

无。

#### 8.5.5.2 会计估计变更的说明

无。

#### 8.5.5.3 差错更正的说明

无。

### 8.5.6 税项

#### 8.5.6.1. 主要税种及税率

税目	纳税（费）基础	税（费）率
增值税	应纳税增值额	13%、6%、5%、3%（征收率）
城市维护建设税	应交流转税额	7%
教育费附加	应交流转税额	3%
地方教育费附加	应交流转税额	2%
企业所得税	应纳税所得额	25%

#### 8.5.6.2. 重要税收优惠政策及其依据

根据财政部、国家税务总局财税《关于企业所得税若干优惠政策的通知》（财税〔2008〕1号），本基金和专项计划暂不征收企业所得税。

### 8.5.7 合并财务报表重要项目的说明

#### 8.5.7.1 货币资金

##### 8.5.7.1.1 货币资金情况

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
库存现金	-
银行存款	303,529,378.83
其他货币资金	-
小计	303,529,378.83
减：减值准备	-
合计	303,529,378.83

##### 8.5.7.1.2 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
----	-------------------

活期存款	5,470,907.36
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	298,056,748.57
应计利息	1,722.90
小计	303,529,378.83
减：减值准备	-
合计	303,529,378.83

注：1、其他存款为组合存款。

2、期末应收存款利息 1,722.90 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。

### 8.5.7.2 买入返售金融资产

无。

### 8.5.7.3 债权投资

无。

### 8.5.7.4 其他债权投资

无。

### 8.5.7.5 其他权益工具投资

无。

### 8.5.7.6 应收账款

#### 8.5.7.6.1 按账龄披露应收账款

单位：人民币元

账龄	本期末 2024 年 6 月 30 日
1 年以内	17,842,280.43
1—2 年	-
小计	17,842,280.43
减：坏账准备	-
合计	17,842,280.43

#### 8.5.7.6.2 按坏账准备计提方法分类披露

金额单位：人民币元

类别	本期末 2024 年 6 月 30 日				账面价值
	账面余额		坏账准备		
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)	
单项计提预期信用损失的应收账款	-	-	-	-	-
按组合计提预期信	17,842,280.43	100.00	-	-	17,842,280.43

类别	本期末 2024 年 6 月 30 日				账面价值
	账面余额		坏账准备		
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)	
用损失的应收账款					
其中：关联方组合	17,842,280.43	100.00	-	-	17,842,280.43
合计	17,842,280.43	100.00	-	-	17,842,280.43

#### 8.5.7.6.3 单项计提坏账准备的应收账款

无。

#### 8.5.7.6.4 按组合计提坏账准备的应收账款

金额单位：人民币元

债务人名称	本期末 2024 年 6 月 30 日		
	账面余额	坏账准备	计提比例 (%)
关联方组合	17,842,280.43	-	-
合计	17,842,280.43	-	-

#### 8.5.7.6.5 本期实际核销的应收账款情况

无。

#### 8.5.7.6.6 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	17,842,280.43	100.00	-	-
合计	17,842,280.43	100.00	-	-

#### 8.5.7.7 存货

##### 8.5.7.7.1 存货分类

单位：人民币元

项目	本期末 2024 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	143,880.00	-	143,880.00
合同履约成本	-	-	-
合计	143,880.00	-	143,880.00

##### 8.5.7.7.2 存货跌价准备及合同履约成本减值准备

无。

8.5.7.8 合同资产

无。

8.5.7.9 投资性房地产

无。

8.5.7.10 固定资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
固定资产	8,842,798.46
固定资产清理	-
合计	8,842,798.46



## 8.5.7.10.1 固定资产情况

单位：人民币元

项目	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	5,194,468.68	55,619.43	3,302,350.98	813,543.00	277,550.00	1,633,447.59	142,144.36	11,419,124.04
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	5,194,468.68	55,619.43	3,302,350.98	813,543.00	277,550.00	1,633,447.59	142,144.36	11,419,124.04
二、累计折旧								
1. 期初余额	562,630.05	22,479.51	805,817.63	60,105.84	107,689.41	176,049.35	47,071.35	1,781,843.14
2. 本期增加金额	251,931.81	5,395.08	320,328.15	78,900.30	26,922.36	88,024.68	22,980.06	794,482.44
本期计提	251,931.81	5,395.08	320,328.15	78,900.30	26,922.36	88,024.68	22,980.06	794,482.44
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	814,561.86	27,874.59	1,126,145.78	139,006.14	134,611.77	264,074.03	70,051.41	2,576,325.58
三、减值准备								
1. 期初余额	-	-	-	-	-	-	-	-
2. 本期增加金额	-	-	-	-	-	-	-	-
本期计提	-	-	-	-	-	-	-	-

项目	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
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	4,379,906.82	27,744.84	2,176,205.20	674,536.86	142,938.23	1,369,373.56	72,092.95	8,842,798.46
2. 期初账面价值	4,631,838.63	33,139.92	2,496,533.35	753,437.16	169,860.59	1,457,398.24	95,073.01	9,637,280.90

#### 8.5.7.10.2 固定资产的其他说明

无。

#### 8.5.7.10.3 固定资产清理

无。

## 8.5.7.11 在建工程

无。

## 8.5.7.12 无形资产

## 8.5.7.12.1 无形资产情况

单位：人民币元

项目	特许经营权	合计
一、账面原值		
1. 期初余额	11,501,625,386.97	11,501,625,386.97
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	-	-
其他原因减少	-	-
4. 期末余额	11,501,625,386.97	11,501,625,386.97
二、累计摊销		
1. 期初余额	869,867,899.33	869,867,899.33
2. 本期增加金额	386,529,254.82	386,529,254.82
本期计提	386,529,254.82	386,529,254.82
其他原因增加	-	-
3. 本期减少金额	-	-
处置	-	-
其他原因减少	-	-
4. 期末余额	1,256,397,154.15	1,256,397,154.15
三、减值准备		
1. 期初余额	-	-
2. 本期增加金额	-	-
本期计提	-	-
其他原因增加	-	-
3. 本期减少金额	-	-
处置	-	-
其他原因减少	-	-
4. 期末余额	-	-
四、账面价值		
1. 期末账面价值	10,245,228,232.82	10,245,228,232.82
2. 期初账面价值	10,631,757,487.64	10,631,757,487.64

## 8.5.7.12.2 无形资产的其他说明

无。

### 8.5.7.13 商誉

无。

### 8.5.7.14 递延所得税资产和递延所得税负债

#### 8.5.7.14.1 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 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	-	-
无形资产折旧	122,676,503.26	30,669,125.80
可抵扣亏损	212,466,713.72	53,116,678.43
合计	335,143,216.98	83,785,804.23

#### 8.5.7.14.2 未经抵销的递延所得税负债

无。

#### 8.5.7.14.3 以抵销后净额列示的递延所得税资产或负债

无。

#### 8.5.7.14.4 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 2024 年 6 月 30 日
资产减值准备	-
预计负债	-
可抵扣亏损	189,205,307.68
合计	189,205,307.68

#### 8.5.7.14.5 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 2024 年 6 月 30 日	备注
2027 年	83,993,976.94	-
2029 年	105,211,330.74	-
合计	189,205,307.68	-

### 8.5.7.15 其他资产

#### 8.5.7.15.1 其他资产情况

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
其他流动资产	10,515,320.51

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
其他应收款	19,662.00
合计	10,534,982.51

#### 8.5.7.15.2 预付账款

无。

#### 8.5.7.15.3 其他应收款

##### 8.5.7.15.3.1 按账龄列示

单位：人民币元

账龄	本期末 2024 年 6 月 30 日
1 年以内	5,182.00
1-2 年	14,480.00
小计	19,662.00
减：坏账准备	-
合计	19,662.00

##### 8.5.7.15.3.2 按款项性质分类情况

单位：人民币元

款项性质	本期末 2024 年 6 月 30 日
关联方往来	14,480.00
其他	5,182.00
小计	19,662.00
减：坏账准备	-
合计	19,662.00

##### 8.5.7.15.3.3 其他应收款坏账准备计提情况

无。

##### 8.5.7.15.3.4 报告期内实际核销的其他应收款情况

无。

##### 8.5.7.15.3.5 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	14,480.00	73.64	-	14,480.00
路损赔偿款	5,182.00	26.36	-	5,182.00
合计	19,662.00	100.00	-	19,662.00

### 8.5.7.16 应付账款

#### 8.5.7.16.1 应付账款情况

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
1年以内	1,216,261.55
1-2年	7,286,676.61
2-3年	901,225.71
合计	9,404,163.87

#### 8.5.7.16.2 账龄超过一年的重要应付账款

无。

### 8.5.7.17 应付职工薪酬

无。

### 8.5.7.18 应交税费

单位：人民币元

税费项目	本期末 2024年6月30日
增值税	21,324,214.42
消费税	-
企业所得税	-
个人所得税	-
城市维护建设税	1,226,158.75
教育费附加	1,332,746.48
房产税	39,452.56
土地使用税	36,033.85
土地增值税	-
印花税	16,094.86
水利建设基金	39,848.07
其他	-
合计	24,014,548.99

### 8.5.7.19 合同负债

无。

### 8.5.7.20 长期借款

单位：人民币元

借款类别	本期末 2024年6月30日
质押借款	1,244,750,000.00
抵押借款	-
保证借款	-

借款类别	本期末 2024 年 6 月 30 日
信用借款	-
未到期应付利息	-
合计	1,244,750,000.00

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。

### 8.5.7.21 其他负债

#### 8.5.7.21.1 其他负债情况

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
其他应付款	70,454,969.21
一年内到期的非流动负债	30,311,666.68
合计	100,766,635.89

#### 8.5.7.21.2 预收款项

无。

#### 8.5.7.21.3 其他应付款

##### 8.5.7.21.3.1 按款项性质列示的其他应付款

单位：人民币元

款项性质	本期末 2024 年 6 月 30 日
质保金	898,325.55
运营服务成本	67,554,674.02
其他	2,001,969.64
合计	70,454,969.21

##### 8.5.7.21.3.2 账龄超过一年的重要其他应付款

无。

### 8.5.7.22 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
本期末	1,000,000,000.00	10,880,000,000.00

### 8.5.7.23 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	-1,152,876,184.40	-	-1,152,876,184.40
本期利润	-68,927,893.25	-	-68,927,893.25

项目	已实现部分	未实现部分	合计
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	-375,000,049.98	-	-375,000,049.98
本期末	-1,596,804,127.63	-	-1,596,804,127.63

#### 8.5.7.24 营业收入和营业成本

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	安徽省沿江高速公路有限公司	合计
营业收入	408,333,992.85	408,333,992.85
通行费收入	406,933,820.46	406,933,820.46
其他业务收入	1,400,172.39	1,400,172.39
合计	408,333,992.85	408,333,992.85
营业成本	429,952,571.87	429,952,571.87
公路养护成本	42,127,870.87	42,127,870.87
折旧与摊销	387,323,737.26	387,323,737.26
其他	500,963.74	500,963.74
合计	429,952,571.87	429,952,571.87

#### 8.5.7.25 利息支出

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
短期借款利息支出	-
长期借款利息支出	19,323,470.84
卖出回购金融资产利息支出	-
其他	-
合计	19,323,470.84

#### 8.5.7.26 税金及附加

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
增值税	15,271,734.66
消费税	-
企业所得税	-
个人所得税	-
城市维护建设税	1,924,227.72
教育费附加	1,374,448.36
房产税	78,905.12
土地使用税	72,067.70
土地增值税	-
其他	261,095.25



项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
合计	18,982,478.81

#### 8.5.7.27 财务费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
银行手续费	19,530.66
其他	-
合计	19,530.66

#### 8.5.7.28 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
中介服务费	39,014.42
登记费	19,006.81
信息披露费	59,672.34
其他费用	63,653.31
合计	181,346.88

#### 8.5.7.29 营业外收入

##### 8.5.7.29.1 营业外收入情况

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
非流动资产报废利得合计	-
其中：固定资产报废利得	-
无形资产报废利得	-
政府补助	-
其他	2.80
合计	2.80

#### 8.5.7.30 所得税费用

##### 8.5.7.30.1 所得税费用情况

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期所得税费用	-
递延所得税费用	2,017,983.48
合计	2,017,983.48

##### 8.5.7.30.2 会计利润与所得税费用调整过程

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
利润总额	-569,383,635.71
按法定/适用税率计算的所得税费用	-142,345,908.93
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	118,061,059.70
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	26,302,832.71
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。

### 8.5.7.31 现金流量表附注

#### 8.5.7.31.1 收到其他与经营活动有关的现金

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
营业外收入	2.80
其他（保证金等）	245,619.30
合计	245,622.10

#### 8.5.7.31.2 支付其他与经营活动有关的现金

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
管理人报酬	14,819,576.44
基金托管费	1,082,852.80
其他（保证金、手续费等）	598,092.88
合计	16,500,522.12

### 8.5.7.32 现金流量表补充资料

#### 8.5.7.32.1 现金流量表补充资料

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 将净利润调节为经营活动现金流量	
净利润	-68,927,893.25
加：信用减值损失	-
资产减值损失	-
固定资产折旧	794,482.44
投资性房地产折旧	-

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
使用权资产折旧	-
无形资产摊销	386,529,254.82
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)	19,323,470.84
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)	60,870.00
经营性应收项目的减少(增加以“-”号填列)	-7,637,427.33
经营性应付项目的增加(减少以“-”号填列)	-10,964,346.35
其他	-
经营活动产生的现金流量净额	321,196,394.65
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	303,527,655.93
减: 现金的期初余额	390,442,468.07
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	-86,914,812.14

### 8.5.7.32.2 现金和现金等价物的构成

单位: 人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、现金	303,527,655.93
其中: 库存现金	-
可随时用于支付的银行存款	303,527,655.93
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	303,527,655.93
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	-

注: 应收利息 1,722.90 元不属于现金及现金等价物。

### 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	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

### 8.5.10 承诺事项、或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 8.5.10.1 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。

#### 8.5.10.2 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。

#### 8.5.10.3 资产负债表日后事项

本集团于 2024 年 7 月 19 日公告进行 2024 年度第三次分红，权益登记日为 2024 年 7 月 23 日，场内和场外除息日分别为 2024 年 7 月 24 日和 2024 年 7 月 23 日，场内和场外现金红利发放日分别为 2024 年 7 月 29 日和 2024 年 7 月 25 日。本基金每 10 份基金份额分红数为人民币 1.2900 元。

截至本财务报告批准报出日，除以上事项外，本集团没有其他需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

### 8.5.11 关联方关系

#### 8.5.11.1 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。

#### 8.5.11.2 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、外部管理机构、直接或间接持有本基金 30%以上基金份额的法人
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	其他关联关系
安徽省高速公路联网运营有限公司	其他关联关系
安徽交通数智科技有限公司	其他关联关系
安徽交控工程集团有限公司	其他关联关系

关联方名称	与本基金的关系
安徽交控道路养护有限公司	其他关联关系
安徽省交通规划设计研究总院股份有限公司	其他关联关系
安徽交控信息产业有限公司	其他关联关系
安徽交控建设工程集团有限公司	其他关联关系
安徽省盛轩市政园林工程有限公司	其他关联关系
安徽省中兴工程监理有限公司	其他关联关系

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。

## 8.5.12 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 8.5.12.1 关联采购与销售情况

#### 8.5.12.1.1 采购商品、接受劳务情况

单位：人民币元

关联方名称	关联交易内容	本期	上年度可比期间
		2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
安徽省交通控股集团有限公司	运营服务成本	38,067,795.30	35,591,219.70
安徽省高速公路联网运营有限公司	联网结算费	484,560.31	1,194,459.12
安徽交通数智科技有限公司	联网结算费	695,238.71	1,713,789.17
安徽交控工程集团有限公司	机电养护	70,339.50	205,185.00
安徽交控道路养护有限公司	公路养护	952,360.75	-
合计	-	40,270,294.57	38,704,652.99

注：原“安徽交通一卡通控股有限公司”名称变更为“安徽交通数智科技有限公司”。

#### 8.5.12.2 关联租赁情况

无。

#### 8.5.12.3 通过关联方交易单元进行的交易

无。

#### 8.5.12.4 关联方报酬

##### 8.5.12.4.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	7,619,957.88	8,876,123.81
其中：固定管理费	7,619,957.88	8,876,123.81
浮动管理费	-	-
支付销售机构的客户维护费	400.40	399.44

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×0.09%÷当年天数。

(2) 固定管理费用 2

项目公司当年净现金流量≥80%×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×0.8%；

80%×净现金流量预测值≥项目公司当年净现金流量≥60%×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×0.6%；

60%×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=Max[(项目公司累计净现金流量-初始评估报告计算的预测累计净现金流量), 0]×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。

8.5.12.4.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	483,697.76	536,976.32

注：本基金的托管费用按上年度经审计的基金净资产的 0.01%年费率计提，未有经审计的基金净资产数据的，按照募集规模的 0.01%年费率计提。托管费用的计算方法如下：

$$T = E \times 0.01\% \div \text{当年天数}$$

T 为当日应计提的托管费用；

E 在基金成立首年为初始募集规模，自基金成立的第二个自然年度起（含）为上一年度合并报表审计报告披露的基金合并净资产。若因基金扩募等原因导致基金规模变化时，需按照实际规模变化进行调整，分段计算。

8.5.12.5 各关联方投资本基金的情况

8.5.12.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期，基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

8.5.12.5.2 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 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日					
	期初持有		期间申	期间因	减：期间	期末持有
份额	比例(%)	购/买入	拆分变	赎回/卖	份额	比例(%)
		份额	动份额	出份额		

安徽省交通控股集团有限公司	531,974,995	53.20	83,521	-	-	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	21,560,382	2.16	38,949,288	-	40,881,749	19,627,921	1.96
中金财富证券有限公司	5,793,037	0.58	3,931,505	-	9,285,142	439,400	0.04
合计	622,228,414.00	62.22	42,964,314	-	50,166,891	615,025,837	61.50

上年度可比期间

2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

关联方名称	期初持有		期间申购/买入 份额	期间因 拆分变 动份额	减：期间 赎回/卖 出份额	期末持有	
	份额	比例(%)				份额	比例(%)
安徽省交通控股集团有限公司	513,009,548.00	51.30	-	-	-	513,009,548.00	51.30
安徽皖通高速公路股份有限公司	38,900,000.00	3.89	-	-	-	38,900,000.00	3.89
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	-	-	-	24,000,000.00	2.40
中国国际金融股份有限公司	19,087,414.00	1.91	42,285,482.00	-	37,850,070.00	23,522,826.00	2.35
中金财富证券有限公司	9,700,000.00	0.97	-	-	-	9,700,000.00	0.97
合计	604,696,962.00	60.47	42,285,482.00	-	37,850,070.00	609,132,374.00	60.91

8.5.12.6 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 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	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	303,527,655.93	1,319,149.28	419,947,187.17	7,135,631.42
合计	303,527,655.93	1,319,149.28	419,947,187.17	7,135,631.42

8.5.12.7 其他关联交易事项的说明

沿江公司向招商银行股份有限公司合肥分行借款，期初余额 12.8765 亿元，本期末借入借款，本期归还借款 0.1365 亿元，期末余额为 12.7400 亿元。本期应计付其利息 19,323,470.84 元。

### 8.5.13 关联方应收应付款项

#### 8.5.13.1 应收项目

单位：人民币元

项目名称	关联方名称	本期末 2024年6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
应收账款	安徽省高速公路联网运营有限公司	17,842,280.43	-	10,219,558.59	-
其他应收款	安徽省交通控股集团有限公司	14,480.00	-	14,480.00	-
合计	-	17,856,760.43	-	10,234,038.59	-

#### 8.5.13.2 应付项目

单位：人民币元

项目名称	关联方名称	本期末	上年度末
		2024年6月30日	2023年12月31日
应付账款	安徽省高速公路联网运营有限公司	969,807.34	485,247.03
应付账款	安徽省交通规划设计研究总院股份有限公司	1,201,345.36	11,937,168.53
应付账款	安徽交控工程集团有限公司	2,779,850.12	13,502,764.35
应付账款	安徽交控信息产业有限公司	12,410.16	12,410.16
应付账款	安徽交控建设工程集团有限公司	489,290.40	2,136,346.24
应付账款	安徽省盛轩市政园林工程有限公司	35,324.74	353,247.41
应付账款	安徽省中兴工程监理有限公司	130,494.27	130,494.27
应付账款	安徽交控道路养护有限公司	509,398.46	8,869,364.83
应付账款	安徽交通数智科技有限公司	1,391,462.71	696,224.00
其他应付款	安徽省交通控股集团有限公司	70,819,345.96	29,659,259.60
一年内到期的非流动负债	招商银行股份有限公司	30,311,666.68	20,680,345.84
长期借款	招商银行股份有限公司	1,244,750,000.00	1,268,150,000.00
应付管理人报酬	中金基金管理有限公司	3,700,292.96	8,283,836.49
应付管理人报酬	中国国际金融股份有限公司	325,473.50	276,350.52
应付管理人报酬	安徽省交通控股集团有限公司	3,266,671.94	5,757,489.07
应付托管费	招商银行股份有限公司	483,697.76	1,082,852.80
合计	-	1,361,176,532.36	1,372,013,401.14

#### 8.5.14 期末（2024年06月30日）基金持有的流通受限证券

无。

### 8.5.15 收益分配情况

#### 8.5.15.1 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
----	-------	-----	-------------	----------	--------------------	----



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 年 1 月 23 日	2024 年 1 月 23 日	1.9000	190,000,000.00	-	-
2	2024 年 4 月 2 日	2024 年 4 月 2 日	1.8500	185,000,049.98	-	-
合计	-	-	-	375,000,049.98	-	-

### 8.5.15.2 可供分配金额计算过程

参见 3.3.2.1。

## 8.5.16 金融工具风险及管理

### 8.5.16.1 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，或者基础设施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。

### 8.5.16.2 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。本基础设施基金的现金流来自于其所持有的资产支持证券，最终来源于基础设施项目。

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基础设施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，来确保基础设施项目和基金现金储备充裕。

### 8.5.16.3 市场风险

市场风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### (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。

### 8.5.17 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

### 8.5.18 个别财务报表重要项目的说明

#### 8.5.18.1 货币资金

##### 8.5.18.1.1 货币资金情况

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
库存现金	-
银行存款	5,045,900.86
其他货币资金	-
-	-
小计	5,045,900.86
减：减值准备	-
合计	5,045,900.86

##### 8.5.18.1.2 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
活期存款	5,044,219.46
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
应计利息	1,681.40
小计	5,045,900.86

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
减：减值准备	-
合计	5,045,900.86

注：期末应收存款利息 1,681.40 元不属于现金及现金等价物。

### 8.5.18.1.3 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。

### 8.5.18.2 长期股权投资

#### 8.5.18.2.1 长期股权投资情况

单位：人民币元

	本期末 2024 年 6 月 30 日		
	账面余额	减值准备	账面价值
对子公司投资	10,880,000,000.00	994,090,080.50	9,885,909,919.50
合计	10,880,000,000.00	994,090,080.50	9,885,909,919.50

#### 8.5.18.2.2 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	-	994,090,0 80.50
合计	10,880,000, 000.00	-	-	10,880,000 ,000.00	-	994,090,0 80.50

## § 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

无。

### 9.2 评估报告摘要

无。

### 9.3 评估机构使用评估方法的特殊情况说明

无。

## § 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6月30日					
持有人户数 (户)	户均持有的基金份额 (份)	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额 (份)	占总份额比例 (%)	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
19,435	51,453.56	976,222,388.00	97.62	23,777,612.00	2.38
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 (%)
20,737	48,222.98	975,626,635.00	97.56	24,373,365.00	2.44

### 10.2 基金前十名流通份额持有人

本期末 2024年6月30日			
序号	持有人名称	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
1	安徽省交通控股集团有限公司	22,058,516.00	2.21
2	中国国际金融股份有限公司	19,627,921.00	1.96
3	上海合晟资产管理股份有限公司—合晟同晖7号私募证券投资基金	19,108,370.00	1.91
4	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
5	太平财产保险有限公司—传统—普通保险产品	14,144,400.00	1.41
6	同方全球人寿保险有限公司	12,632,597.00	1.26
7	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	9,967,840.00	1.00
8	东方证券股份有限公司	9,873,775.00	0.99
9	中金公司—弘康人寿保险股份有限公司—传统险—中金瑞赢1号单一资产管理计划	9,700,000.00	0.97
10	工银安盛人寿保险有限公司—短期分红	9,500,000.00	0.95
合计		143,113,419.00	14.31
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	安徽省交通控股集团有限公司	21,974,995.00	2.20
2	中国国际金融股份有限公司	21,560,382.00	2.16
3	太平财产保险有限公司—传统—普通保险产品	18,597,256.00	1.86
4	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
5	上海合晟资产管理股份有限公司—合晟同晖 7 号私募证券投资基金	14,619,889.00	1.46
6	中金公司—弘康人寿保险股份有限公司—传统险—中金瑞赢 1 号单一资产管理计划	9,700,000.00	0.97
7	工银安盛人寿保险有限公司—短期分红	9,500,000.00	0.95
8	中国银河证券股份有限公司	9,141,372.00	0.91
9	招商证券股份有限公司	8,971,242.00	0.90
10	上海机场投资有限公司	8,500,000.00	0.85
合计		139,065,136.00	13.91

注：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。

### 10.3 基金前十名非流通份额持有人

本期末 2024 年 6 月 30 日			
序号	持有人名称	持有份额（份）	占总份额比例（%）
1	安徽省交通控股集团有限公司	510,000,000.00	51.00
2	安徽皖通高速公路股份有限公司	38,900,000.00	3.89
3	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
合计		572,900,000.00	57.29
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	安徽省交通控股集团有限公司	510,000,000.00	51.00
2	安徽皖通高速公路股份有限公司	38,900,000.00	3.89
3	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
合计		572,900,000.00	57.29

### 10.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,696.00	0.0002

## § 11 基金份额变动情况

单位：份

基金合同生效日（2022 年 11 月 11 日）基金份额总额	1,000,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	1,000,000,000.00
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	1,000,000,000.00

## § 12 重大事件揭示

### 12.1 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。

### 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

#### (1) 基金管理人的重大人事变动情况

2024 年 1 月 20 日，本基金管理人发布公告，李金泽先生自 2024 年 1 月 19 日起担任公司董事长、法定代表人；宗喆先生自 2024 年 1 月 19 日起担任公司总经理、董事；胡长生先生自 2024 年 1 月 19 日起不再担任公司董事长、法定代表人，不再代履公司总经理职务。

2024 年 3 月 2 日，本基金管理人发布公告，宗喆先生自 2024 年 2 月 29 日起担任公司财务负责人。

#### (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，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 12.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 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，本基金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基金份额。

### 12.5 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。

### 12.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内无改聘情况。

### 12.7 为基金出具评估报告的评估机构情况

本基金本报告期内无改聘情况。

## 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

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内未受到稽查或处罚。

### 12.8.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金托管人及其高级管理人员在本报告期内未受到稽查或处罚。

## 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二〇二三年十二月主要运营数据的公告	中国证监会规定媒介	2024年1月19日
2	中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2024年1月19日
3	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 2024 年第一次分红公告	中国证监会规定媒介	2024年1月19日
4	中金基金管理有限公司董事长、高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2024年1月20日
5	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二〇二四年一月主要运营数据的公告	中国证监会规定媒介	2024年2月28日
6	中金基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2024年3月2日
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 2024 年第二次分红公告	中国证监会规定媒介	2024年3月29日
8	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二〇二四年二月主要运营数据的公告	中国证监会规定媒介	2024年3月30日
9	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二〇二三年度基础设施项目现金流变化情况的临时公告	中国证监会规定媒介	2024年3月30日
10	中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金 2023 年年度审计报告	中国证监会规定媒介	2024年3月30日
11	中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金 2023 年年度评估报告	中国证监会规定媒介	2024年3月30日
12	中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会规定媒介	2024年3月30日
13	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 2023 年度业绩说明会的公告	中国证监会规定媒介	2024年4月9日
14	中金安徽交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2024年4月20日
15	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二〇二四年二季度投资者开放日暨走进原始权益人活动的公告	中国证监会规定媒介	2024年4月20日

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
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二〇二四年三月主要运营数据的公告	中国证监会规定媒介	2024 年 4 月 22 日
17	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外部管理机构聘任高级管理人员的公告	中国证监会规定媒介	2024 年 4 月 30 日
18	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外部管理机构聘任高级管理人员的公告	中国证监会规定媒介	2024 年 5 月 15 日
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二〇二四年四月主要运营数据的公告	中国证监会规定媒介	2024 年 5 月 25 日
20	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产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024 年 6 月 21 日
21	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二〇二四年五月主要运营数据的公告	中国证监会规定媒介	2024 年 6 月 28 日

### § 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	沿江高速公路芜湖（张韩）至安庆（大渡口）段	/
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	注 1
项目初始成本	5,445,579,300.00	注 2
资产组评估价值	10,721,000,000.00	注 3
采用成本法计量的账面价值	10,198,635,512.73	注 4
基金购买资产的投资成本	12,170,000,000.00	/
报告期	2024 年中期	/

注：1. 本基金购买基础设施资产交割日；

2. 项目形成或购买资产的成本；

3. 根据《沿江高速资产评估报告（2024）》（世联资产评报字 ZCODXJJ[2024]0061ZQQC）取资产组评估价值；

4. 本项目公司采用历史成本法对基础设施项目计量，高速公路特许经营权计入无形资产。

### § 14 备查文件目录

#### 14.1 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

## 14.2 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。

## 14.3 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

2024 年 8 月 31 日