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 3 季度报告

2024 年 9 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

报告送出日期：2024 年 10 月 25 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、收益分配情况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，投资者在做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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

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
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。

§3 主要财务指标和基金收益分配情况

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日）
1.本期收入	215,787,594.08
2.本期净利润	-21,416,803.62
3.本期经营活动产生的现金流量净额	197,119,719.54

3.2 其他财务指标

无。

3.3 基金收益分配情况

3.3.1 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	183,452,558.99	0.1835	
本年累计	475,981,937.82	0.4760	
2023 年	780,445,986.54	0.7804	
2022 年	683,653,137.44	0.6837	

3.3.2 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	129,000,017.40	0.1290	
本年累计	504,000,067.38	0.5040	
2023 年	1,088,600,062.65	1.0886	
2022 年	-	-	

3.3.3 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	-21,416,803.62	
本期折旧和摊销	193,662,605.79	
本期利息支出	9,168,155.22	
本期所得税费用	1,008,991.74	
本期税息折旧及摊销前利润	182,422,949.13	

项目	金额	备注
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	10,984,800.00	
2.应收应付账款的变动	15,571,956.82	
调减项		
1.支付的利息及所得税费用	-10,177,146.96	
2.偿还借款本金支付的现金	-5,850,000.00	
3.其他资本性支出	-	
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	-9,500,000.00	
本期可供分配金额	183,452,558.99	

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、其他应付款等，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。

3.3.4 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。

§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，本基金持有的基础设施资产实现通行费收入（含税）21,965.74 万元，环比上升 9.65%，同比下降 14.45%。沿江高速日均断面自然车流量（含免费车流量）为 2.09 万辆，环比上升 10.76%，同比下降 12.25%。其中，客车（不含免费车辆）断面车流量 1.45 万辆/日，环比上升 24.05%，同比下降 11.54%；货车（不含免费车辆）断面车流量 0.60 万辆/日，环比下降 0.46%，同比下降 13.70%。

交通量及通行费收入同比下降的主要原因是：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“4.3.2 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”。

项目公司其他信息参见“9.1 其他有助于投资者了解的信息”。

4.2 基础设施项目公司运营财务数据

4.2.1 基础设施项目公司的营业收入分析

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	构成	本期（2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日）		去年同期（2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日）	
		金额（元）	占该项目总收入比例（%）	金额（元）	占该项目总收入比例（%）
1	通行费收入	214,742,516.74	99.85	256,046,225.11	99.88
2	其他收入	316,387.20	0.15	314,288.31	0.12
3	合计	215,058,903.94	100.00	256,360,513.42	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。

4.2.2 基础设施项目公司的营业成本及主要费用分析

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	构成	本期（2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日）		去年同期（2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日）	
		金额（元）	占该项目总成本比例（%）	金额（元）	占该项目总成本比例（%）
1	营业成本	217,065,402.31	52.97	215,243,337.24	37.48
2	税金及附加	984,483.59	0.24	1,158,041.46	0.20
3	财务费用	191,326,338.21	46.68	355,846,146.22	61.96
4	管理人报酬	473,685.44	0.11	2,050,884.11	0.36
5	其他费用	-	-	-	-
6	合计	409,849,909.55	100.00	574,298,409.03	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 9,168,155.22 元及股东借款利息 182,790,137.44 元。

4.2.3 基础设施项目公司的财务业绩衡量指标分析

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（2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日）	去年同期（2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日）
				指标数值	指标数值
1	毛利率	毛利润额/营业收入	%	-0.93	16.04
2	净利率	净利润/营业收入	%	-27.41	-6.40

序号	指标名称	指标含义说明及计算公式	指标单位	本期（2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日）	去年同期（2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日）
				指标数值	指标数值
3	息税折旧摊销前利润率	基础设施项目息税折旧摊销前净利润/营业收入	%	88.73	90.67

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，主要是因为周边路网变化、路段改造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运营情况的整体说明”。

4.3 基础设施项目公司经营现金流

4.3.1 经营活动现金流归集、管理、使用情况

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 218,003,130.52 元，对外支出总金额 16,246,229.09 元。基础设施项目公司去年同期归集总金额 245,278,126.67 元，对外支出总金额 35,253,456.45 元。

4.3.2 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 月底建成通车。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。

根据安徽省交通运输厅及时路况信息及外部管理机构现场调查，截至本报告报出日，宣广高速誓节枢纽至宣广枢纽段已结束全封闭施工，芜宣枢纽至广德西、广德东至

广祠全程约 63km 已实现双向通行，广德西至广德东段 26km 实施半幅单向通行。上述交通组织方案的调整有助于宣广高速及周边路段部分车辆回流。

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，该分流交通量有望有所减少。

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—殷汇高速路口）（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调查情况，截至本报告报出日，G237 贵池段施工已结束，国道 G318 东至段路面施工已全部完成，车辆正常通行。

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，与周边九华天池、永泉小镇、大王洞等景区达成合作机制，利用暑期及中秋

节自驾出游车流，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。（1）与借款行协商变更贷款利率浮动周期由 12 个月调整为 1 个月，节约财务费用约 100 万元；（2）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现场了解涉铁施工项目施工进度和路网通行恢复条件。同时外部管理机构前往国道施工路段通过开展 OD 调查和行驶信息采集等方式，为过境中、重型货车合理规划行驶路线，开展“夏日送清凉”服务，力争服务引流。

4.4 基础设施项目公司对外借入款项情况

4.4.1 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 个基本点（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 9,295,835.07 元，期末借款本金余额 1,268,150,000.00 元。

4.4.2 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“4.4.1 报告期内对外借入款项基本情况”。

4.5 基础设施项目投资情况

4.5.1 报告期内购入或出售基础设施项目情况

本报告期内，本基金不存在购入或出售基础设施项目情况。

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

无。

§5 除基础设施资产支持证券之外的投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）
1	固定收益投资	-
	其中：债券	-
	资产支持证券	-
2	买入返售金融资产	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-
3	银行存款和结算备付金合计	6,177,555.71
4	其他资产	-
5	合计	6,177,555.71

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占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例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，未有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.6 其他资产构成

本基金本报告期末无其他资产。

§6 管理人报告

6.1 基金管理人及主要负责人员情况

6.1.1 管理人及其管理基础设施基金的经验

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 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	任本基金的基金经理期限		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，项目类型覆盖轨道交通、铁路等基础设施领域。	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高级经理。
郑霜	本基金的基金	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	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

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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			
	经理				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。	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 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。

6.2 报告期内基金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 1,870,477.76 元，资产支持证券管理人的管理费计提金额 330,084.36 元，基金托管人的托管费计提金额 244,506.56 元。外部管理机构的固定管理费用计提金额 473,685.44 元,浮动管理费用根据经营业绩完成情况年末一次性计提。

6.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集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。

6.4 公平交易制度及执行情况的专项说明

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。

6.5 管理人对报告期内基金投资和运营分析

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。

权利义务转移日起，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。

6.6 管理人对宏观经济及基础设施项目所在行业的简要展望

（1）宏观经济分析

根据国家统计局数据，前三季度国内生产总值 949,746 亿元，按不变价格计算，同比增长 4.8%。全国规模以上工业增加值同比增长 5.8%，全国居民消费价格（CPI）同比上涨 0.3%，前三季度经济运行总体平稳，稳中有进，同时也要看到，外部环境更趋复杂严峻，经济回升向好基础仍需巩固。根据国家交通运输部数据，2024 年 1-8 月公路货运量 269.63 亿吨，同比增长 3.2%。

根据安徽省统计局数据，2024 年 1-8 月份，安徽省规模以上工业增加值同比增长 8.4%。2024 年 8 月份，安徽省居民消费价格同比上涨 1.5%。根据安徽省交通运输厅数据，2024 年 1-8 月，安徽省完成公路货运量 17.1 亿吨、货物周转量 2,460.0 亿吨公里，同比分别增长 1.4%和 0.5%。当前安徽省经济延续平稳增长态势，但经济运行中的制约因素依然较多。

根据池州市统计局数据，2024 年 1-8 月份，池州市规模以上工业增加值同比增长 12.1%，居民消费价格同比上涨 0.1%。根据芜湖市统计局数据，2024 年 1-8 月，芜湖市规模以上工业增加值同比增长 8.6%，城市居民消费价格同比上涨 0.5%。

长三角地区作为全国经济发展的重要引擎，其一体化发展进程备受瞩目。安徽承东启西、连南接北，是长三角连接中西部的重要通道，拥有独特的区位优势。安徽紧扣一体化和高质量两个关键词，坚持上海龙头带动，携手苏浙、扬皖所长，推动一体化发展取得一批标志性成果，安徽在全国发展格局中的位势显著提升。

（2）高速行业分析

根据交通运输部数据，2024 年 1-8 月全国公路建设固定资产投资同比下降 12.4%。根据安徽省交通运输厅数据，2024 年 1-8 月安徽省高速公路固定资产投资完成 591.8 亿元，同比增长 13.2%。

区域一体化，交通先行。根据国家发改委、交通运输部印发的《长江三角洲地区交通运输更高质量一体化发展规划》，到 2025 年，加快构建长三角地区现代化综合交通运输体系。优化高速公路网络层次结构，加快省际高速公路建设，实施打通省际高速公路待贯通路段专项行动，逐步实现相邻城市间高速公路直连。

§7 基金份额变动情况

单位：份

报告期期初基金份额总额	1,000,000,000.00
报告期期间基金总申购份额	-
报告期期间其他份额变动情况	-
报告期期末基金份额总额	1,000,000,000.00

§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

8.2 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§9 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	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	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	10,084,582,967.90	注 4
基金购买资产的投资成本	12,170,000,000.00	
报告期	2024 年三季度	

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。

§10 备查文件目录

10.1 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）中国证监会要求的其他文件

10.2 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。

10.3 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 10 月 25 日