

国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施
证券投资基金
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：国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：2023 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	6
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	8
2.6 其他相关资料	8
§ 3 主要财务指标和基金收益分配情况	8
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	9
3.4 报告期内基金及资产支持证券费用收取情况的说明	10
§ 4 基础设施项目运营情况	10
4.1 对报告期内基础设施项目公司运营情况的整体说明	10
4.2 基础设施项目所属行业情况	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	14
4.7 基础设施项目投资情况	14
4.8 抵押、查封、扣押、冻结等他项权利限制的情况	15
4.9 基础设施项目相关保险的情况	15
4.10 基础设施项目未来发展展望的说明	15
4.11 其他需要说明的情况	15
§ 5 除基础设施资产支持证券之外的投资组合报告	15
5.1 报告期末基金的资产组合情况	15
5.2 报告期末按债券品种分类的债券投资组合	16
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	16
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	16
5.5 投资组合报告附注	16
5.6 报告期末其他各项资产构成	16
5.7 投资组合报告附注的其他文字描述部分	16
5.8 报告期内基金估值程序等事项的说明	16
5.9 报告期内基金资产重大减值计提情况的说明	17
§ 6 管理人报告	17
6.1 基金管理人及主要负责人员情况	17

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	21
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	22
6.7 管理人对关联交易及相关利益冲突的防范措施	22
§ 7 托管人报告	22
7.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	22
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	22
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
§ 8 中期财务报告（未经审计）	23
8.1 资产负债表	23
8.2 利润表	26
8.3 现金流量表	28
8.4 所有者权益变动表	31
8.5 报表附注	36
§ 9 评估报告	72
9.1 管理人聘任评估机构及评估报告内容的合规性说明	72
9.2 评估报告摘要	72
9.3 评估机构使用评估方法的特殊情况说明	73
§ 10 基金份额持有人信息	73
10.1 基金份额持有人户数及持有人结构	73
10.2 基金前十名流通份额持有人	73
10.3 基金前十名非流通份额持有人	75
10.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	76
§ 11 基金份额变动情况	76
§ 12 重大事件揭示	76
12.1 基金份额持有人大会决议	76
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	77
12.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	77
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	77
12.5 基金投资策略的改变	77
12.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	77
12.7 为基金出具评估报告的评估机构情况	77
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	77
12.9 其他重大事件	77
§ 13 影响投资者决策的其他重要信息	78
§ 14 备查文件目录	79
14.1 备查文件目录	79
14.2 存放地点	79

14.3 查阅方式 79

§ 2 基金简介

2.1 基金产品基本情况

基金名称	国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金
基金简称	国金中国铁建高速 REIT
场内简称	铁建 REIT（扩位简称：国金中国铁建 REIT）
基金主代码	508008
交易代码	508008
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	2022 年 6 月 27 日
基金管理人	国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	500,000,000.00 份
基金合同存续期	自基金合同生效之日起 40 年。
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2022 年 7 月 8 日
投资目标	本基金主要投资于基础设施资产支持证券，并持有其全部份额；本基金通过资产支持证券等间接持有基础设施项目公司全部股权，最终取得相关基础设施项目经营权利。本基金通过积极主动的运营管理，在保障公共利益的基础上，争取提升基础设施项目的品牌价值和运营收益水平，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	本基金的投资策略可以细分为基础设施项目投资策略（初始基金资产投资策略、运营管理策略、资产收购策略、资产处置策略、资产升级改造策略）、基金的融资策略（扩募方式、借款方式）、债券投资策略（久期策略、期限结构配置策略、骑乘策略、息差策略、信用债投资策略）等。详见本基金基金合同及招募说明书等法律文件。
业绩比较基准	本基金无业绩比较基准
风险收益特征	本基金在存续期内主要投资于基础设施资产支持证券，以获取基础设施项目运营收益并承担基础设施价值波动，与主要投资于股票或债券的公募基金具有不同的风险收益特征，其风险低于股票基金且高于债券基金、货币基金。
基金收益分配政策	在符合有关基金分红的条件下，本基金每年至少进行收益分配 1 次，若基金合同生效不满 6 个月可不进行收益分配，每次收益分配的比例应不低于合并后基金年度可供分配金额的 90%。
资产支持证券管理人	国金证券资产管理有限公司
外部管理机构	中铁建重庆投资集团有限公司

2.2 基础设施项目基本情况说明

基础设施项目名称：渝遂高速公路（重庆段）

基础设施项目公司名称	重庆铁发遂渝高速公路有限公司（以下简称“项目公司”）
基础设施项目类型	收费公路
基础设施项目主要经营模式	渝遂高速（重庆段）的运营与管理。根据《特许经营权协议》，项目公司享有渝遂高速公路重庆段的特许经营权，即渝遂高速公路（重庆段）车辆通行费的收费权，以及渝遂高速公路重庆段沿线范围内的公路服务设施的经营权、广告经营权。
基础设施项目地理位置	基础设施项目位于重庆，路段途径重庆市沙坪坝区、璧山区、铜梁区、潼南区。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	国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	张静
	联系电话	010-88005695
	电子邮箱	zhangjing@gfund.com
客户服务电话	4000-2000-18	95555
传真	010-88005666	0755-83195201
注册地址	北京市怀柔区府前街三号楼 3-6	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	北京市海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 14 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	100089	518040
法定代表人	邵海波	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	国金证券资产管理有限公司	中铁建重庆投资集团有限公司
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区芳甸路 1088 号 1106	重庆市南岸区江桥路一号
办公地址	上海市浦东新区芳甸路 1088 号紫竹国际大厦 3 楼	重庆市渝北区洪湖东路 55 号财富中心 19 栋
邮政编码	200120	400060
法定代表人	马骏	刘一鸣

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	www.gfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

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
会计师事务所	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区延安东路 222 号外滩中心 30 楼
评估机构	中资资产评估有限公司	北京市海淀区首体南路 22 号国兴大厦 17 层 A

§ 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	2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日
本期收入	388,609,650.19
本期净利润	73,288,686.51
本期经营活动产生的现金流量净额	308,495,494.76
期末数据和指标	2023 年 6 月 30 日
期末基金总资产	4,870,438,807.89
期末基金净资产	4,477,549,627.22
期末基金总资产与净资产的比例 (%)	108.77

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

3.2 其他财务指标

单位：人民币元

数据和指标	2023 年 6 月 30 日
期末基金份额净值	8.9551
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	270,915,938.72	0.5418	-
2022 年	390,321,619.58	0.7806	该金额计算时间段为 2022 年 6 月 27 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日。

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	386,400,007.86	0.7728	2023 年度第 1 次分红（收益分配基准日为 2022 年 12 月 31 日）
本年累计	386,400,007.86	0.7728	2023 年度第 1 次分红（收益分配基准日为 2022 年 12 月 31 日）

3.3.2 本期可供分配金额

3.3.2.1 本期可供分配金额计算过程

单位：人民币元

项目	金额	备注
本期合并净利润	73,288,686.51	-
本期折旧和摊销	219,864,477.85	-
本期利息支出	-	-
本期所得税费用	26,689,956.07	-
本期息税折旧及摊销前利润	319,843,120.43	-
调减项		
1-购买基础设施项目等资本性支出	-710,200.00	-
2-支付的所得税费用	-26,689,956.07	-
3-未来合理相关支出预留	-21,527,025.64	-
本期可供分配金额	270,915,938.72	-

注：1、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）、运营费用、应收应付的变动等。

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

3.3.2.2 本期调整项与往期不一致的情况说明

无。

3.4 报告期内基金及资产支持证券费用收取情况的说明

根据《国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）、《国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金托管协议》以下简称“《托管协议》”、《国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金招募说明书》（以下简称“《招募说明书》”）等相关法律文件，本报告期内计提基金管理人管理费 4,633,496.92 元，计提资产支持证券管理人管理费 118,808.12 元，计提基金及资产支持计划托管人托管费合计 237,616.26 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，实际支付固定管理费用为 25,361,977.02 元，支付 2022 年度浮动管理费为 4,581,759.04 元（其中 2022 年度计提浮动管理费 3,176,601.21 元，本期根据 2022 年度实际净现金流分派率补提浮动管理费 1,405,157.83 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

报告期内，渝遂高速（重庆段）出入口通行量为 1940.48 万辆，与去年同期基本持平；断面标准车流量为 560.37 万辆，较去年同期增长 8.52%。报告期内，实现营业收入 383,395,720.18 元（不含税），同比增长 9.17%；其中实现通行费收入 369,266,330.69 元（不含税），同比增长 10.08%，同比增速超过重庆市路网平均水平。

报告期内，基金管理人和外部管理机构在充分保障基础设施项目正常运营的同时，深入各运营板块开展“高速公路+文旅”、“引车上路”活动、推行智慧化收费、错峰养护施工等方式加强引流增收；同时，在日常养护、安全管理等方面持续推行精细化管理工作，做好成本管控。报告期内，未发生重大安全责任事故，高速公路通行费收入来源分散，无重要现金流提供方，外部管理机构未发生变动。

得益于 2023 年上半年川渝地区经济稳定发展，企业生产稳步恢复，消费需求持续释放，居民出行意愿增强等因素，在基金管理人与外部管理机构的协同运营管理下，渝遂高速（重庆段）整体运营表现稳定。

4.2 基础设施项目所属行业情况

4.2.1 基础设施项目所属行业整体情况的说明

本基金基础设施资产为渝遂高速公路（重庆段），属于收费公路行业。高速公路作为重要的交通基础设施，在中国国民经济和社会发展中发挥重要作用。

截至 2022 年末，全国公路里程 535.48 万公里，比上年末增加 7.41 万公里，其中高速公路里程 17.73 万公里、增加 0.82 万公里，国家高速公路里程 11.99 万公里、增加 0.29 万公里，高速公路里程稳居全球第一。运输装备方面，2022 年末全国拥有公路营运汽车 1222.08 万辆，其中，拥有载客汽车 55.42 万辆、1647.24 万客位，比上年末分别减少 3.28 万辆、103.79 万客位；拥有载货汽车 1166.66 万辆、16967.33 万吨位，分别减少 6.60 万辆、132.17 万吨位。运输服务方面，2022 年高速公路车流量 95.32 亿辆，比上年下降 18.4%，其中 9 座及以下小客车 69.74 亿辆、下降 20.6%。普通国省道机动车年平均断面交通量 9358 辆/日，下降 12.7%。固定资产投资方面，2022 年完成公路固定资产投资 28527 亿元，比上年增长 9.7%。其中，高速公路完成 16262 亿元、增长 7.3%。

2023 年上半年全国交通运输经济运行持续恢复、整体好转，人员流动大幅增加，货运量、港口货物吞吐量、交通固定资产投资同比均实现较快增长，为推动经济回升向好提供了有力保障。其中，公路货运量实现 190.1 亿吨，同比增长 7.5%；公路客运量实现 21.4 亿人，同比增长 18.6%；完成公路投资 1.4 万亿元，同比增长 8.9%，其中，高速公路投资同比增长 7.5%。

2023 年上半年，重庆地区公路客运量实现 8245.5 万人，同比增长 1.8%；公路货运量实现 56067.4 万吨，同比增长 1.1%；交通固定资产投资实现 579.1 亿元，同比增长 10.2%。同期，四川省公路客运量实现 18368 万人，同比增长 9.8%；公路货运量实现 88287 万吨，同比增长 2.6%，公路水路建设完成投资 1445 亿元，同比增长 27.2%。

4.2.2 基础设施项目所属行业竞争情况的说明

本基础设施项目为高速公路，其实际运营表现会受到所在区域经济发展、周边道路规划等方面影响。可能会面临部分功能相同、路线相近的公路、铁路、水运及航空等交通方式的竞争情形，进而存在一定的替代效应，对本基础设施项目车流量带来一定分流效果，造成对车流量收入的不利影响，存在一定的市场竞争风险。

本基金成立至本报告期末，渝遂高速（重庆段）近距离范围内暂未有新建成开通的高速公路或高铁项目，市场竞争情况较报告期初未发生明显变化。

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

序号：- 公司名称：重庆铁发遂渝高速公路有限公司

金额单位：人民币元

序号	构成	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日		上年同期 2022年6月27日（基金合同生效 日）至2022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	369,266,330.69	96.31	-	-
2	其他收入	14,129,389.49	3.69	-	-
-	合计	383,395,720.18	100.00	-	-

注：本基金合同生效日为 2022 年 6 月 27 日，项目公司于 2022 年 7 月纳入本基金合并范围，故本期报告无上年同期数。

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

本报告期内，基础设施项目公司营业收入无重大变化。

4.3.2 基础设施项目公司的营业成本及主要费用分析

4.3.2.1 基础设施项目公司名称

序号：- 公司名称：重庆铁发遂渝高速公路有限公司

金额单位：人民币元

序号	构成	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日		上年同期 2022年6月27日（基金合同 生效日）至2022年6月 30日	
		金额	占该项目总 成本比例 (%)	金额	占该项目 总成本比 例 (%)
1	主营业务成本	268,975,586.64	70.65	-	-
2	其他业务成本	8,627,325.34	2.27	-	-
3	税金及附加	1,675,225.14	0.44	-	-
4	财务费用	101,436,997.30	26.64	-	-
5	其他成本/费用	8,000.00	0.00	-	-
-	合计	380,723,134.42	100.00	-	-

注：1、本基金合同生效日为 2022 年 6 月 27 日，项目公司于 2022 年 7 月纳入本基金合并范围，故本期报告无上年同期数。

2、以上财务费用包含专项计划的股东借款利息支出 106,069,726.36 元,非项目公司实际运行发生的利息支出。扣除该利息支出后本期营业总成本为 274,653,408.06 元。

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

本报告期内,管理人对基础设施项目公司营业成本及主要费用无重大变化情况。

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

序号: - 公司名称: 重庆铁发遂渝高速公路有限公司

序号	指标名称	指标含义说明及计算公式	指标单位	本期 2023年1月1 日至2023年6 月30日	上年同期 2022年6月27日 (基金合同生效 日)至2022年6月 30日
				指标数值	指标数值
1	毛利率	毛利率=(营业收入-营业成本)/营业收入*100%	%	27.59	-
2	净利率	净利润/营业收入*100%	%	-6.23	-
3	息税折旧摊销前净利率	息税折旧摊销前净利率=(利润总额+利息支出+折旧摊销)/营业收入*100%	%	85.74	-

注:1、本基金合同生效日为 2022 年 6 月 27 日,项目公司于 2022 年 7 月纳入本基金合并范围,故本期报告无上年同期数。

2、项目公司净利润扣除了专项计划的股东借款利息支出 106,069,726.36 元,若不考虑该项安排,则项目公司本期净利率为 21.43%。

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

2023 年 1-6 月,本基础设施收费道口通行车辆总数为 1940.48 万辆,与去年同期基本持平;其中,入口车流量 972.94 万辆,出口车流量 967.54 万辆;断面标准车流量为 560.37 万辆,较去年同期增长 8.52%。2023 年 1-6 月,本基础设施项目实现通行费收入(不含税)36,926.63 万元,日均通行费收入为 204.01 万元,单公里单车道通行费收入 98.99 万元。

4.5 基础设施项目公司经营现金流

4.5.1 经营活动现金流归集、管理、使用及变化情况

1、收入归集和支出管理

本报告期内，项目公司存续账户有四个，分别为资金运用归集账户、基本账户、ETC 收款清分结算账户和现金收款账户，通过项目公司资金监管协议、项目公司账户监管协议对账户及资金进行监管。资金运用归集账户是根据资金监管协议在监管银行开立的项目公司资金运用归集的唯一账户，作为项目公司监管账户，系项目公司在监管银行开立的用于接收项目公司收入及进行项目公司支出的人民币资金账户。除资金监管协议相关条款另有约定外，项目公司的相关货币资金收支活动均需通过监管账户进行。监管银行应根据资金监管协议约定对监管账户的资金流向进行监督。

2、现金归集和使用情况

报告期内，项目公司收到总收入 399,055,703.49 元，其中收到通行费收入 375,798,392.63 元。支出总金额为 486,508,159.06 元，其中支付运营支出 55,584,237.34 元，支付税金 23,813,721.72 元，支付固定资产、护栏改造等 710,200.00 元，划至专项计划 406,400,000.00 元用于本基金分红、支付基金管理费、托管费等等。截至 2023 年 6 月 30 日，项目公司货币资金余额 566,225,171.84 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

本报告期内，未发生影响未来项目正常现金流的重大情况。

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

本报告期内，本基金无对外借入款项。

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

无。

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

注：报告期内，无购入或出售基础设施项目情况。

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，无其他购入或出售基础设施项目的情况。

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，不存在抵押、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，足额购买财产一切险、财产一切险下营业中断险及公共责任险。

本报告期内，基础设施项目财产险未发生理赔；公众责任险理赔 10 次，理赔总金额 7,627 元。

4.10 基础设施项目未来发展展望的说明

报告期内，基础设施项目运营情况良好，管理人预期基础设施项目发展前景良好。

本基础设施项目地处重庆，是连通重庆-成都的主要高速公路之一。国家“十四五”规划首次将成渝城市群提升至“国家增长第四极”地位，将推进成渝地区双城经济圈建设，打造具有全国影响力的重要经济中心、科技创新中心、改革开放型高地，优化提升成渝城市群。

重庆市是成渝地区双城经济圈核心城市，中西部唯一直辖市、国家重要先进制造业中心、西部金融中心、西部国际综合交通枢纽和国际门户枢纽。根据《成渝地区双城经济圈建设规划纲要》，成渝地区的经济互动将不断增强、不断整合优化现有的优势产业集群和产业园区，并合作共建新产业园区，预计可以为项目带来较为充足的车源流量。

2023 年上半年重庆市实现地区生产总值 14345.95 亿元，同比增长 4.6%，其中，基础设施投资增长 9.4%；四川地区生产总值为 27901.01 亿元，同比增长 5.5%，其中成都实现地区生产总值 10705.5 亿元，同比增长 5.8%，比一季度加快 0.5 个百分点。川渝地区的良好经济发展态势，为本基础设施项目的车流量增长创造了良好的基础条件。

本基础设施项目运营主要面临车流量波动风险、市场替代风险、安全管理风险、日常运营养护风险、异常恶劣天气风险等风险。

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	12,489,494.83
4	其他资产	-
5	合计	12,489,494.83

5.2 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

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

注：无。

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

注：无。

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

注：无。

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，本基金管理人按照相关法律法规及基金合同关于估值的约定，严格执行内部估值控制程序，对基金所持有的投资品种进行估值。

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，估值委员会由公司督察长、投资总监、运营总监、清算业务负责人、研究部门负责人、风控业务负责人、合规业务负责人组成，可根据需要邀请产品托管行代表、公司独立董事、会计师事务所代表等外部人员参加。公司运营总监为公司基金估值委员会主席。运营支持部根据估值委员会的估值意见进行相关具体的估值调整或处理，并负责与托管行进行估值结果的核对，运营支持部业务人员复核后使用。基金经理作为估值工作小组成员，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估

值方案提议的制定，估值政策和估值方案最终由估值委员会决定，基金经理不具有表决权。本基金管理人参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

5.9 报告期内基金资产重大减值计提情况的说明

无。

§ 6 管理人报告

6.1 基金管理人及主要负责人员情况

6.1.1 基金管理人及其管理基础设施基金的经验

国金基金管理有限公司（以下简称“国金基金”）成立于 2011 年 11 月 2 日，注册资本人民币 3.6 亿元，是经中国证监会批准成立的从事基金募集、基金销售、资产管理以及中国证监会许可的其他业务的专业资产管理公司。2012 年 5 月，国金基金经中国证监会核准获得特定客户资产管理业务资格，可开展特定客户资产管理业务。

国金基金拥有多年基础设施领域研究、投资及投后管理经验。为推进基础设施基金业务，基金管理人设置了独立的业务部门-REITs 投资部，主要负责公开募集基础设施证券投资基金相关业务的尽职调查、投资运营管理以及风险控制管理等工作。报告期内，基金管理人持续加强专业人员配备，保障基金的规范运作，切实保护基金份额持有人合法权益。

截至报告期末，国金基金共计管理 1 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			
唐耀祥	本基金的基金经理	2022 年 6 月 27 日	-	11 年	2011 年至 2021 年任职于招商局集团旗下基础设施投资建设和运营管理单位从事基础设施项目运营相关工作，参与重庆曾家岩大桥、重庆东水门长江大桥、千厮门嘉陵江大桥	唐耀祥先生，西北农林科技大学硕士。2006 年 7 月至 2008 年 8 月在西藏大学担任教师，2009 年 7 月至 2010 年 9 月在西部证

					等投资建设项目的运营管理。	券股份有限公司担任投资顾问，2010年9月至2011年6月在大连万达商业地产股份有限公司担任财务主管，2011年6月至2021年9月先后在招商局重庆交通科研设计院有限公司担任财务主管、重庆全通工程建设管理有限公司担任财务部经理、重庆曾家岩大桥建设管理有限公司担任财务负责人、招商公路外派山西交通实业发展集团有限公司担任党委副书记/总经理。现任国金基金管理有限公司 REITs 投资部基金经理。
梁贤超	本基金的基金经理	2022年6月27日	-	9年	2013年11月至2020年12月在北京千石创富资本管理有限公司从事基础设施项目投资相关工作，主要项目有溧阳城市发展 PPP 项目、常州市经开区生态环保工程、武进市重点 PPP 项目等。	梁贤超先生，英国兰卡斯特大学硕士，2013年11月至2020年12月在北京千石创富资本管理有限公司历任专项业务一部业务经理，资产证券化部副总经理，专项资产管理总部

						项目经理，专项资产管理总部代理总经理。现任国金基金管理有限公司 REITs 投资部基金经理。
吴婷	本基金的基金经理	2023 年 6 月 19 日	-	14 年	2008 年至 2022 年 2 月任职于招商局集团旗下基础设施建设、运营管理相关单位，从事基础设施项目建设、运营相关工作，参与乐昌至广州高速公路、珠江三角洲外环高速公路肇庆至花都段土建工程、四川汶川至马尔康高速公路鹧鸪山隧道土建工程等高速公路监理项目、武汉港化学品船舶洗舱站陆域污水处理工程、G5021 石渝高速公路等建设、经营项目的运营管理。2022 年 6 月至 2023 年 6 月任职于国金基金基金项目，负责参与并跟进基础设施 REITs 的运营管理。	吴婷女士，西南大学学士，高级会计师。历任招商中宇工程咨询（重庆）有限公司计划财务部主管，重庆沪渝高速公路有限公司财务管理部副经理，招商局生态环保科技有限公司计划财务部报表及资金主管，渝航翼（重庆）航空货运有限责任公司财务部经理。现任国金基金管理有限公司 REITs 投资部基金经理。
朱霞	本基金的基金经理	2022 年 6 月 27 日	2023 年 07 月 03 日	11 年	2006 年 7 月至 2015 年 7 月先后在上海申通轨道交通咨询有限公司，上海申通地铁集团技术中心从事基础设施项目运营相关工作，参与上海轨道交通基础设施项目的运营管理。	朱霞女士，同济大学硕士。2006 年 7 月至 2010 年 12 月在上海申通轨道交通研究咨询有限公司运营管理部担任助理工程师，2011 年 1 月至 2015 年 7 月在上海申通地铁

					集团技术中心 技术中心担任 工程师，2015 年 8 月至 2016 年 4 月在上海 振华重工（集 团）有限公司 投资部担任投 资经理，2016 年 5 月至 2018 年 4 月在上海 德勤税务师事 务师事务所全 球基础设施业 务中心经 理，2018 年 5 月至 2020 年 11 月 19 日在 北京明树数据 科技有限公司 咨询研究部担 任部门总监， 2020 年 11 月 至 2021 年 1 月在浙商基金 管理有限公司 REITs 投资管 理部担任运营 经理。2022 年 6 月 27 日至 2023 年 7 月 3 日在国金基金 管理有限公司 REITs 投资部 担任本基金基 金经理。
--	--	--	--	--	--

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

注：无。

6.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《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》、《国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管

理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

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

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《国金基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定，通过制度、流程和系统等方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下所有投资组合。在投资决策内部控制方面，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；在交易执行控制方面，通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；在行为监控和分析评估方面，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，确保做好公平交易的监控和分析。

6.4 管理人对报告期内基金的投资和运营分析

1. 管理人对报告期内基金投资分析

投资方面，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“国金证券-遂渝高速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。本基金持有的基础设施资产为渝遂高速公路（重庆段）。

报告期内，项目公司在监管银行开展了协定存款业务。

2. 管理人对报告期内基金运营分析

报告期内，基金管理人和外部管理机构积极推出多项举措，实施规范化、精细化管理，各业务板块根据实际工作情况，逐一梳理各项成本费用支出情况，进一步优化年度工作计划，压减各项成本费用支出；同时，注重健康安全防控、保障一线工作人员健康安全，确保基础资产运管职能正常运转；重视道路日常养护，保证车辆通行有序。在引流增收方面，基金管理人与运管管理机构合作密切，通过培训、稽查等方式提升运营人员业务水平，关注过往司乘亲切感和满意度，增加过往司乘粘性；同时，外部管理机构积极开展查补增收专项活动，实现创效增收。

6.5 管理人对报告期内基金收益分配情况的说明

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

报告期内，本基金共进行 1 次收益分配。于 2023 年 4 月 12 日（场外）、2023 年 4 月 12 日（场内）进行了首次现金分红，权益登记日为 2023 年 4 月 10 日，收益基准分配日为 2022 年 12 月 31 日，每 10 份基金份额派发红利 7.728 元，共计派发红利 386,400,007.86 元。

6.6 管理人对宏观经济及行业走势的简要展望

2023 年上半年，重庆市实现地区生产总值 14345.95 亿元，同比增长 4.6%。其中，第一产业实现增加值 686.33 亿元，增长 4.5%；第二产业实现增加值 5747.37 亿元，增长 4.0%；第三产业实现增加值 7912.25 亿元，增长 5.0%。固定资产投资同比增长 1.4%。分领域看，基础设施和工业投资分别增长 9.7%和 8.8%，二者合计拉动重庆市投资增长 5.3 个百分点。四川地区实现生产总值 27901.01 亿元，同比增长 5.5%。其中，第一产业增加值为 2105.16 亿元，增长 4.0%；第二产业增加值为 10109.06 亿元，增长 3.6%；第三产业增加值为 15686.79 亿元，增长 7.0%。

2023 年上半年，重庆市公路客运量实现 8245.5 万人，同比增长 1.8%；公路货运量实现 56067.4 万吨万吨，同比增长 1.1%。四川省公路客运量实现 18368 万人，同比增长 9.8%；公路货运量实现 88287 万吨万吨，同比增长 2.6%。

总体来看，随着重庆市、四川省经济社会全面恢复常态化运行，企业生产稳步恢复、消费需求持续释放、市场供给不断增加、新产业新业态较快发展，区域经济发展总体平稳。

6.7 管理人对关联交易及相关利益冲突的防范措施

本基金管理人制定了《国金基金管理有限公司关联方交易管理办法》、《国金基金管理有限公司公平交易管理办法》和《国金基金管理有限公司异常交易管理办法》等，有效防范本基金层面的利益冲突和关联交易风险，保障基金管理人管理的不同基金之间的公平性。针对公募 REITs 业务，基金管理人还制定了《国金基金管理有限公司基础设施证券投资基金业务管理办法(试行)》、《国金基金管理有限公司基础设施证券投资基金运营管理办法》和《国金基金管理有限公司基础设施证券投资基金业务风险管理办法》等，建立了基础设施证券投资基金的内部运营管理规则，有效防范利益冲突。

§ 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

托管人声明：

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，我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。

本年度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

本年度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：国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	8.5.7.1	578,865,478.74	657,479,376.93
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
衍生金融资产		-	-
交易性金融资产	8.5.7.2	-	-
买入返售金融资产	8.5.7.3	-	-
债权投资	8.5.7.4	-	-
其他债权投资	8.5.7.5	-	-
其他权益工具投资	8.5.7.6	1,500,000.00	1,500,000.00
应收票据		-	-
应收账款	8.5.7.7	27,488,165.47	24,135,334.82
应收清算款		-	-
应收利息		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
存货	8.5.7.8	81,005.00	-
合同资产	8.5.7.9	-	-
持有待售资产	8.5.7.10	-	-
长期股权投资		-	-
投资性房地产	8.5.7.11	-	-
固定资产	8.5.7.12	7,915,570.19	8,244,427.90
在建工程	8.5.7.13	-	-
使用权资产	8.5.7.14	-	-
无形资产	8.5.7.15	4,205,655,011.81	4,388,475,231.95

开发支出	8.5.7.16	-	-
商誉	8.5.7.17	-	-
长期待摊费用	8.5.7.18	-	-
递延所得税资产	8.5.7.19.1	37,123,519.66	31,602,988.70
其他资产	8.5.7.20	11,810,057.02	17,438,894.48
资产总计		4,870,438,807.89	5,128,876,254.78
负债和所有者权益	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
负 债:			
短期借款	8.5.7.21	-	-
衍生金融负债		-	-
交易性金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付票据		-	-
应付账款	8.5.7.22	82,522,669.06	81,559,619.92
应付职工薪酬	8.5.7.23	6,355,224.54	7,189,439.38
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		4,686,618.34	4,939,369.22
应付托管费		171,929.56	245,721.74
应付投资顾问费		-	-
应交税费	8.5.7.24	18,574,183.80	1,251,146.33
应付利息	8.5.7.25	-	-
应付利润		-	-
合同负债	8.5.7.26	-	-
持有待售负债		-	-
长期借款	8.5.7.27	-	-
预计负债	8.5.7.28	269,790,784.99	233,785,584.99
租赁负债	8.5.7.29	-	-
递延收益		-	-
递延所得税负债	8.5.7.19.2	-	-
其他负债	8.5.7.30	10,787,770.38	12,430,572.13
负债合计		392,889,180.67	341,401,453.71
所有者权益:			
实收基金	8.5.7.31	4,792,999,565.42	4,792,999,565.42
其他权益工具		-	-
资本公积	8.5.7.32	-	-
其他综合收益	8.5.7.33	-	-
专项储备		3,186,147.50	-
盈余公积	8.5.7.34	-	-
未分配利润	8.5.7.35	-318,636,085.70	-5,524,764.35
所有者权益合计		4,477,549,627.22	4,787,474,801.07
负债和所有者权益总计		4,870,438,807.89	5,128,876,254.78

注：1、报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 8.9551 元，基金份额总额 500,000,000.00 份。

2、本期根据《企业安全生产费用提取和使用管理办法》（财资〔2022〕136 号）的规定计提和使用专项储备。

8.1.2 个别资产负债表

会计主体：国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	8.5.19.1	12,489,494.83	3,732,622.03
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
衍生金融资产		-	-
交易性金融资产		-	-
债权投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收清算款		-	-
应收利息		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
长期股权投资	8.5.19.2	4,792,460,000.00	4,792,460,000.00
其他资产		-	-
资产总计		4,804,949,494.83	4,796,192,622.03
负债和所有者权益	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 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		4,633,496.92	4,817,165.36
应付托管费		118,808.14	123,517.88
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
其他负债		297,535.04	540,000.00
负债合计		5,049,840.10	5,480,683.24
所有者权益：			
实收基金		4,792,999,565.42	4,792,999,565.42
资本公积		-	-
其他综合收益		-	-
未分配利润		6,900,089.31	-2,287,626.63
所有者权益合计		4,799,899,654.73	4,790,711,938.79
负债和所有者权益总计		4,804,949,494.83	4,796,192,622.03

8.2 利润表

8.2.1 合并利润表

会计主体：国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 6 月 27 日（基金 合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		388,374,026.56	3,328,501.66
1. 营业收入	8.5.7.36	383,395,720.18	-
2. 利息收入		4,974,184.23	3,328,501.66
3. 投资收益（损失以“-”号填列）	8.5.7.37	-	-
4. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	8.5.7.38	-	-
5. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
6. 资产处置收益（损失以“-”号填列）	8.5.7.39	-	-
7. 其他收益	8.5.7.40	4,122.15	-
8. 其他业务收入	8.5.7.41	-	-
二、营业总成本		288,631,007.61	146,276.04
1. 营业成本	8.5.7.36	277,602,911.98	-

2. 利息支出	8.5.7.42	-	-
3. 税金及附加	8.5.7.43	2,250,443.45	-
4. 销售费用	8.5.7.44	-	-
5. 管理费用	8.5.7.45	3,387,511.80	33,271.04
6. 研发费用		8,000.00	-
7. 财务费用	8.5.7.46	268,679.33	-
8. 管理人报酬		4,752,305.04	106,434.94
9. 托管费		237,616.26	6,570.06
10. 投资顾问费		-	-
11. 信用减值损失	8.5.7.47	123,539.75	-
12. 资产减值损失	8.5.7.48	-	-
13. 其他费用	8.5.7.49	-	-
三、营业利润（营业亏损以“-”号填列）		99,743,018.95	3,182,225.62
加：营业外收入	8.5.7.50	235,623.63	-
减：营业外支出	8.5.7.51	-	-
四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		99,978,642.58	3,182,225.62
减：所得税费用	8.5.7.52	26,689,956.07	-
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		73,288,686.51	3,182,225.62
1. 持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）		73,288,686.51	3,182,225.62
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		73,288,686.51	3,182,225.62

注：本基金的基金合同生效日为 2022 年 6 月 27 日，专项计划和项目公司分别于 2022 年 6 月和 2022 年 7 月纳入本基金合并范围，上年度可比期间不完整。

8.2.2 个别利润表

会计主体：国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
----	-----	----	---------

		2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 6 月 27 日 (基金合同生效日)至 2022 年 6 月 30 日
一、收入		400,638,131.15	3,328,501.66
1. 利息收入		17,229.91	3,328,501.66
2. 投资收益 (损失以“-”号填列)		400,620,901.24	-
其中: 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)		-	-
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他业务收入		-	-
二、费用		5,050,407.35	125,866.32
1. 管理人报酬		4,633,496.92	105,120.92
2. 托管费		118,808.14	5,256.04
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		298,102.29	15,489.36
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		395,587,723.80	3,202,635.34
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		395,587,723.80	3,202,635.34
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		395,587,723.80	3,202,635.34

8.3 现金流量表

8.3.1 合并现金流量表

会计主体: 国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金

本报告期: 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 6 月 27 日 (基金合同生效日)至 2022 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		391,915,337.83	-
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		4,972,970.13	3,141,877.69
6. 收到的税费返还		-	-
7. 收到其他与经营活动有关的现金	8.5.7.53.1	2,239,356.46	-
经营活动现金流入小计		399,127,664.42	3,141,877.69
8. 购买商品、接受劳务支付的现金		53,739,194.11	-
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		834,214.84	-
13. 支付的各项税费		29,190,900.70	-
14. 支付其他与经营活动有关的现金	8.5.7.53.2	6,867,860.01	-
经营活动现金流出小计		90,632,169.66	0.00
经营活动产生的现金流量净额		308,495,494.76	3,141,877.69
二、投资活动产生的现金流量：			
15. 处置固定资产、无形资产和其他长期资产收到的现金净额		-	-
16. 处置子公司及其他营业单位收到的现金净额		-	-
17. 收到其他与投资活动有关的现金	8.5.7.53.3	-	-
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		35,400.00	-
19. 取得子公司及其他营业单位支付的现金净额		-	-
20. 支付其他与投资活动有关的现金	8.5.7.53.4	674,800.00	-
投资活动现金流出小计		710,200.00	0.00
投资活动产生的现金流量净额		-710,200.00	0.00
三、筹资活动产生的现金流量：			
21. 认购/申购收到的现金		-	-
22. 取得借款收到的现金		-	-
23. 收到其他与筹资活动有关的现金	8.5.7.53.5	-	-
筹资活动现金流入小计		-	-
24. 赎回支付的现金		-	-
25. 偿还借款支付的现金		-	-
26. 偿付利息支付的现金		-	-
27. 分配支付的现金		386,400,007.86	-
28. 支付其他与筹资活动有关的现金	8.5.7.53.6	-	-
筹资活动现金流出小计		386,400,007.86	0.00

筹资活动产生的现金流量净额		-386,400,007.86	0.00
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		-78,614,713.10	3,141,877.69
加：期初现金及现金等价物余额		657,478,977.74	4,792,999,565.42
六、期末现金及现金等价物余额		578,864,264.64	4,796,141,443.11

注：本基金的基金合同生效日为 2022 年 6 月 27 日，专项计划和项目公司分别于 2022 年 6 月和 2022 年 7 月纳入本基金合并范围，上年度可比期间不完整。

8.3.2 个别现金流量表

会计主体：国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 6 月 27 日 (基金合同生效 日)至 2022 年 6 月 30 日
一、经营活动产生的现金流量：			
1. 收回基础设施投资收到的现金		-	-
2. 取得基础设施投资收益收到的现金		400,620,901.24	-
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		16,415.00	3,141,877.69
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		400,637,316.24	3,141,877.69
8. 取得基础设施投资支付的现金		-	4,792,460,000.00
9. 取得证券投资支付的现金净额		-	-
10. 买入返售金融资产净增加额		-	-
11. 卖出回购金融资产款净减少额		-	-
12. 支付的各项税费		-	-
13. 支付其他与经营活动有关的现金		5,481,250.49	-
经营活动现金流出小计		5,481,250.49	4,792,460,000.00
经营活动产生的现金流量净额		395,156,065.75	-4,789,318,122.31
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		386,400,007.86	-
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		386,400,007.86	0.00
筹资活动产生的现金流量净额		-386,400,007.86	0.00
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		8,756,057.89	-4,789,318,122.31
加：期初现金及现金等价物余额		3,732,222.84	4,792,999,565.42
五、期末现金及现金等价物余额		12,488,280.73	3,681,443.11

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：国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金

本报告期：2023年1月1日至2023年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日							所有者权益合计
	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	
一、上期期末余额	4,792,999,565.42	-	-	-	-	-	-5,524,764.35	4,787,474,801.07
加：会计政策变更	-	-	-	-	-	-	-	0.00
前期差错更正	-	-	-	-	-	-	-	0.00
同一控制下企业合并	-	-	-	-	-	-	-	0.00
其他	-	-	-	-	-	-	-	0.00
	4,792,999,565	-	-	-	-	-	-5,524,764.3	4,787,474,801

、本期初余额	.42						5	.07
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-	-	-	3,186,147.50	0.00	-313,111,321.35	-309,925,173.85
（一）综合收益总额	-	-	-	-	-	-	73,288,686.51	73,288,686.51
（二）产品持有人申购和赎回	-	-	-	-	-	-	-	0.00
其中：产品申购	-	-	-	-	-	-	-	0.00
产品赎回	-	-	-	-	-	-	-	0.00
（三）利润分配	-	-	-	-	-	-	-386,400,007.86	-386,400,007.86
（四）其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-	-	-	-	0.00
（五）专项储备	-	-	-	-	3,186,147.50	-	-	3,186,147.50
其中：本期提取	-	-	-	-	3,251,737.26	-	-	3,251,737.26

本期使用	-	-	-	-	65,589.76	-	-	65,589.76
(六)其他	-	-	-	-	-	-	-	0.00
-	-	-	-	-	-	-	-	0.00
四、本期末余额	4,792,999,565.42	-	-	-	3,186,147.50	-	-318,636,085.70	4,477,549,627.22
项目	上年度可比期间 2022年6月27日(基金合同生效日)至2022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	-	-	-	-	-	-	-	0.00
加:会计政策变更	-	-	-	-	-	-	-	0.00
前期差错更正	-	-	-	-	-	-	-	0.00
同一控制下企业合并	-	-	-	-	-	-	-	0.00
其他	-	-	-	-	-	-	-	0.00
、本期初余额	4,792,999,565.42	-	-	-	-	-	-	4,792,999,565.42
三、本期增减变动额	-	-	-	-	-	-	3,182,225.62	3,182,225.62

(减少以“-”号填列)									
(一) 综合收益总额	-	-	-	-	-	-	3,182,225.62	3,182,225.62	
(二) 产品持有人申购和赎回	-	-	-	-	-	-	-	0.00	
其中：产品申购	-	-	-	-	-	-	-	0.00	
产品赎回	-	-	-	-	-	-	-	0.00	
(三) 利润分配	-	-	-	-	-	-	-	0.00	
(四) 其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-	-	-	-	0.00	
(五) 专项储备	-	-	-	-	-	-	-	0.00	
其中：本期提取	-	-	-	-	-	-	-	0.00	
本期使用	-	-	-	-	-	-	-	0.00	
(六) 其他	-	-	-	-	-	-	-	0.00	
-	-	-	-	-	-	-	-	0.00	
四、本期末	4,792,999,565.42	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	3,182,225.62	4,796,181,791.04	

余额							
----	--	--	--	--	--	--	--

注：本基金的基金合同生效日为 2022 年 6 月 27 日，专项计划和项目公司分别于 2022 年 6 月和 2022 年 7 月纳入本基金合并范围，上年度可比期间不完整。

8.4.2 个别所有者权益变动表

会计主体：国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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	4,792,999,56 5.42	-	-	-2,287,62 6.63	4,790,711,9 38.79
加：会计政策变更	-	-	-	-	0.00
前期差错更正	-	-	-	-	0.00
其他	-	-	-	-	0.00
二、本期期初余额	4,792,999,56 5.42	-	-	-2,287,62 6.63	4,790,711,9 38.79
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-	-	-	9,187,715 .94	9,187,715.9 4
(一)综合收益总额	-	-	-	395,587,7 23.80	395,587,723 .80
(二)产品持有人申购和赎回	-	-	-	-	0.00
其中：产品申购	-	-	-	-	0.00
产品赎回	-	-	-	-	0.00
(三)利润分配	-	-	-	-386,400, 007.86	-386,400,00 7.86
(四)其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-	0.00
(五)其他	-	-	-	-	0.00
-	-	-	-	-	0.00
四、本期期末余额	4,792,999,56 5.42	-	-	6,900,089 .31	4,799,899,6 54.73
项目	上年度可比期间 2022 年 6 月 27 日（基金合同生效日）至 2022 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	-	-	-	-	0.00
加：会计政策变更	-	-	-	-	0.00
前期差错更正	-	-	-	-	0.00

其他	-	-	-	-	0.00
二、本期期初余额	4,792,999,565.42	-	-	-	4,792,999,565.42
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-	-	-	3,202,635.34	3,202,635.34
(一)综合收益总额	-	-	-	3,202,635.34	3,202,635.34
(二)产品持有人申购和赎回	-	-	-	-	0.00
其中：产品申购	-	-	-	-	0.00
产品赎回	-	-	-	-	0.00
(三)利润分配	-	-	-	-	0.00
(四)其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-	0.00
(五)其他	-	-	-	-	0.00
-	-	-	-	-	0.00
四、本期期末余额	4,792,999,565.42	-	-	3,202,635.34	4,796,202,200.76

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：

郇海波

基金管理人负责人

聂武鹏

主管会计工作负责人

聂武鹏

会计机构负责人

8.5 报表附注

8.5.1 基金基本情况

国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人国金基金管理有限公司(以下简称“国金基金”或“基金管理人”)依照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集基础设施证券投资基金指引(试行)》和其他相关法律法规的规定以及《国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”),并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)于 2022 年 6 月 2 日以证监许可(2022)1165 号文批准注册募集。本基金首次设立募集基金份额为 500,000,000.00 份,募集资金人民币 4,792,999,565.42 元。基金合同于 2022 年 6 月 27 日生效。本基金的基金管理人为国金基金,基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”或“基金托管人”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金募集资金全部投

资于国金证券-渝遂高速资产支持专项计划(以下简称“专项计划”)并持有其全部份额,并由专项计划收购基础设施项目公司重庆铁发遂渝高速公路有限公司(以下简称“项目公司”)股权。本基金及本基金投资的专项计划和项目公司,以下合称“本集团”。项目公司主要负责基础设施项目渝遂高速公路重庆段的运营和管理,收入来源主要包括车辆通行费、服务区商铺租赁以及广告收入,基础设施项目位于重庆,路段途经重庆市沙坪坝区、璧山区、铜梁区、潼南区。

8.5.2 会计报表的编制基础

编制基础

本财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)及《资产管理产品相关会计处理规定》、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》和《公开募集基础设施证券投资基金指引(试行)》、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)》的有关规定编制。

持续经营

本集团对自 2023 年 6 月 30 日起 12 个月的持续经营能力进行了评价,未发现对持续经营能力产生重大怀疑的事项和情况。因此,本财务报表系在持续经营假设的基础上编制。

记账基础和计价原则

本集团会计核算以权责发生制为记账基础。除某些金融工具以公允价值计量外,本财务报表以历史成本作为计量基础。资产如果发生减值,则按照相关规定计提相应的减值准备。

在历史成本计量下,资产按照购置时支付的现金或者现金等价物的金额或者所付出的对价的公允价值计量。负债按照因承担现时义务而实际收到的款项或者资产的金额,或者承担现时义务的合同金额,或者按照日常活动中为偿还负债预期需要支付的现金或者现金等价物的金额计量。

公允价值是市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。无论公允价值是可观察到的还是采用估值技术估计的,在本财务报表中计量或披露的公允价值均在此基础上予以确定。

以公允价值计量非金融资产时,考虑市场参与者将该资产用于最佳用途产生经济利益的能力,或者将该资产出售给能够用于最佳用途的其他市场参与者产生经济利益的能力。

对于以交易价格作为初始确认时的公允价值,且在公允价值后续计量中使用了涉及不可观察输入值的估值技术的金融资产,在估值过程中校正该估值技术,以使估值技术确定的初始确认结果与交易价格相等。

公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性,被划分为三个层次:

- 第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
- 第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
- 第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

8.5.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合企业会计准则和中国证监会发布的关于公开募集基础设施证券投资基金实务操作有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和净值变动等有关信息。

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

本报告期，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

本基金在本报告期末发生重大会计政策变更。

8.5.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计的变更。

8.5.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大差错更正。

8.5.6 税项

1、主要税种及税率

1.1 国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金

主要税种及税率内容如下：增值税，计税依据为根据相关税法规定的销售额和应税劳务收入等，税率 3%；城市维护建设税，计税依据为按照实际缴纳的增值税等流转税税额，税率 7%；教育费附加，计税依据为按照实际缴纳的增值税等流转税税额，税率为 3%；地方教育费附加，计税依据为按照实际缴纳的增值税等流转税税额，税率 2%。

1.2 国金证券-渝遂高速资产支持专项计划

主要税种及税率内容如下：增值税，计税依据为根据相关税法规定的销售额和应税劳务收入等，税率为 3%；城市维护建设税，计税依据为按照实际缴纳的增值税等流转税税额，税率为 7%；教育费附加，计税依据为按照实际缴纳的增值税等流转税税额，税率为 3%；地方教育费附加，计税依据为按照实际缴纳的增值税等流转税税额，税率为 2%。

1.3 重庆铁发遂渝高速公路有限公司

主要税种及税率内容如下：增值税，计税依据为根据相关税法规定的销售额和应税劳务收入

等，税率为 3%、5%、6%、13%；城市维护建设税，计税依据为按照实际缴纳的增值税等流转税税额，税率为 7%；教育费附加，计税依据为按照实际缴纳的增值税等流转税税额，税率为 3%；地方教育费附加，计税依据为按照实际缴纳的增值税等流转税税额，税率为 2%；企业所得税，计税依据为应纳税所得额，税率为 15%。

2、税收优惠政策

2.1 国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金

无。

2.2 国金证券-渝遂高速资产支持专项计划

无。

2.3 重庆铁发遂渝高速公路有限公司

根据《财政部、税务总局、国家发展改革委关于延续西部大开发企业所得税政策的公告》(财政部公告 2020 年第 23 号)，自 2021 年 1 月 1 日至 2030 年 12 月 31 日，对设在西部地区的鼓励类产业企业减按 15% 的税率征收企业所得税。根据国家和发展改革委员会于 2014 年 8 月 20 日发布的《西部地区鼓励类产业目录》(中华人民共和国国家发展和改革委员会令 15 号)和《产业结构调整指导目录(2011 年本)(修正)》(国家发展改革委令 2013 年第 21 号)，西部开发公路干线、国家高速公路网项目建设纳入鼓励类产业。重庆铁发遂渝高速公路有限公司满足上述文件规定，适用西部大开发税收优惠政策。

注：本基金及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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
库存现金	-	-
银行存款	578,865,478.74	657,479,376.93
其他货币资金	-	-
小计	578,865,478.74	657,479,376.93
减：减值准备	-	-
合计	578,865,478.74	657,479,376.93

8.5.7.1.2 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
----	------------------------	--------------------------

活期存款	578,864,264.64	657,478,977.74
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
应计利息	1,214.10	399.19
小计	578,865,478.74	657,479,376.93
减：减值准备	-	-
合计	578,865,478.74	657,479,376.93

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

无。

8.5.7.2 交易性金融资产

注：无。

8.5.7.3 买入返售金融资产

8.5.7.3.1 买入返售金融资产情况

注：无。

8.5.7.3.2 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

8.5.7.4 债权投资

8.5.7.4.1 债权投资情况

注：无。

8.5.7.4.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

8.5.7.5 其他债权投资

8.5.7.5.1 其他债权投资情况

注：无。

8.5.7.5.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

8.5.7.6 其他权益工具投资

8.5.7.6.1 其他权益工具投资情况

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
单位 1	1,500,000.00	1,500,000.00
合计	1,500,000.00	1,500,000.00

8.5.7.6.2 报告期内其他权益工具投资情况

单位：人民币元

项目	指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的原因	本期确认的股利收入	累计利得	累计损失	其他综合收益转入留存收益的金额	其他综合收益转入留存收益的原因
单位 1	注		2,995,957.05	-	-	-
合计	-	-	2,995,957.05	-	-	-

注：本基金的权益工具投资是本基金出于战略目的而计划长期持有的投资，因此本基金将其指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

8.5.7.7 应收账款

8.5.7.7.1 按账龄披露应收账款

单位：人民币元

账龄	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
1年以内	27,598,471.12	24,144,322.03
1—2年	-	-
3年以上	23,354,154.30	23,354,154.30
小计	50,952,625.42	47,498,476.33
减：坏账准备	23,464,459.95	23,363,141.51
合计	27,488,165.47	24,135,334.82

注：3年以上应收账款为本基金合并时项目公司遗留的以前年度工程款，已全额计提减值。

8.5.7.7.2 按坏账准备计提方法分类披露

金额单位：人民币元

类别	本期末 2023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	23,354,154.30	45.84	23,354,154.30	100	-
按组合计提预期信用损失的应收账款	27,598,471.12	54.16	110,305.65	0.40	27,488,165.47
其中：账龄组合	27,598,471.12	54.16	110,305.65	0.40	27,488,165.47
合计	50,952,625.42	100	23,464,459.95	46.05	27,488,165.47

	2		5		7
类别	上年度末 2022 年 12 月 31 日				
	账面余额		坏账准备		账面价值
	金额	比例 (%)	金额	计提比例 (%)	
单项计提预期信用损失的应收账款	23,354,154.30	49.17	23,354,154.30	100	-
按组合计提预期信用损失的应收账款	24,144,322.03	50.83	8,987.21	0.04	24,135,334.82
其中：账龄组合	24,144,322.03	50.83	8,987.21	0.04	24,135,334.82
合计	47,498,476.33	100	23,363,141.51	49.19	24,135,334.82

注：单项计提预期信用损失的应收账款为本基金合并时项目公司遗留的以前年度工程款，已全额计提减值。

8.5.7.7.3 单项计提坏账准备的应收账款

金额单位：人民币元

债务人名称	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	账面余额	坏账准备	计提比例 (%)	计提理由
单位 1	18,583,872.19	18,583,872.19	100	-
单位 2	4,770,282.11	4,770,282.11	100	-
合计	23,354,154.30	23,354,154.30	100	-

注：本基金结合款项可收回情况，对其全部计提信用损失准备。

8.5.7.7.4 按组合计提坏账准备的应收账款

金额单位：人民币元

债务人名称	本期末 2023 年 6 月 30 日		
	账面余额	坏账准备	计提比例 (%)
单位 1	17,958,165.47	93,446.39	0.52
单位 2	3,342,052.25	-	-
单位 3	2,789,678.00	13,948.39	0.50
单位 4	1,435,633.86	-	-
单位 5	1,382,851.02	1,382.85	0.10
单位 6	371,081.56	371.08	0.10
单位 7	209,484.50	1,047.42	0.50
单位 8	109,524.46	109.52	0.10
合计	27,598,471.12	110,305.65	0.40

8.5.7.7.5 本期坏账准备的变动情况

单位：人民币元

类别	上年度末 2022年12月 31日	本期变动金额				本期末 2023年6月 30日
		计提	转回或收 回	核销	其他变动	
单项计提 预期信用 损失的应 收账款	21,919,944.6 4	0.00	0.00	0.00	1,434,209 .66	23,354,154. 30
按组合计 提预期信 用损失的 应收账款	1,443,196.87	231,686.84	130,368.4 0	0.00	-1,434,20 9.66	110,305.65
其中：账 龄组合	1,443,196.87	231,686.84	130,368.4 0	0.00	-1,434,20 9.66	110,305.65
合计	23,363,141.5 1	231,686.84	130,368.4 0	0.00	0.00	23,464,459. 95

本期坏账准备发生重要转回或收回的应收账款情况

债务人名称	转回或收回金额	转回或收回方式	备注
合计	130,368.40	-	-

注：无。

8.5.7.7.6 本期实际核销的应收账款情况

注：无。

8.5.7.7.7 按债务人归集的报告期末余额前五名的应收账款

金额单位：人民币元

债务人名称	账面余额	占应收账款期末余 额的比例 (%)	已计提坏账准备	账面价值
单位 1	18,583,872.19	36.47	18,583,872.19	-
单位 2	17,958,165.47	35.24	93,446.39	17,864,719.08
单位 3	4,770,282.11	9.36	4,770,282.11	-
单位 4	3,342,052.25	6.56	-	3,342,052.25
单位 5	2,789,678.00	5.48	13,948.39	2,775,729.61
合计	47,444,050.02	93.11	23,461,549.08	23,982,500.94

8.5.7.8 存货

8.5.7.8.1 存货分类

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			上年度末 2022年12月31日		
	账面余额	存货跌价准备/ 合同履约成本 减值准备	账面价值	账面余额	存货跌价准备/ 合同履约成本 减值准备	账面价值

原材料	-	-	-	-	-	-
在产品	-	-	-	-	-	-
库存商品	-	-	-	-	-	-
周转材料	-	-	-	-	-	-
合同履约成本	-	-	-	-	-	-
其他	81,005.00	-	81,005.00	-	-	-
合计	81,005.00	-	81,005.00	-	-	-

注：其他为未领用低值易耗品。

8.5.7.8.2 存货跌价准备及合同履约成本减值准备

注：无。

8.5.7.8.3 报告期末存货余额含借款费用资本化金额的说明

无。

8.5.7.8.4 报告期内合同履约成本摊销金额的说明

无。

8.5.7.9 合同资产

8.5.7.9.1 合同资产情况

注：无。

8.5.7.9.2 报告期内合同资产账面价值发生重大变动的金额和原因

注：无。

8.5.7.9.3 报告期内合同资产计提减值准备情况

注：无。

按预期信用损失一般模型计提减值准备的注释或说明：

无。

8.5.7.10 持有待售资产

注：无。

8.5.7.11 投资性房地产

8.5.7.11.1 采用成本计量模式的投资性房地产

注：无。

8.5.7.11.2 采用公允价值计量模式的投资性房地产

注：无。

8.5.7.11.3 投资性房地产主要项目情况

注：无。

8.5.7.12 固定资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
固定资产	7,915,570.19	8,244,427.90
固定资产清理	-	-
合计	7,915,570.19	8,244,427.90

8.5.7.12.1 固定资产情况

单位：人民币元

项目	房屋及建筑物	机器设备	运输工具	电子设备	其他固定资产	合计
一、账面原值						
1. 期初余额	297,551.70	-	477,911.15	-	7,871,261.05	8,646,723.90
2. 本期增加金额	-	-	-	-	35,400.00	35,400.00
购置	-	-	-	-	35,400.00	35,400.00
在建工程转入	-	-	-	-	-	0.00
-	-	-	-	-	-	0.00
其他原因增加	-	-	-	-	-	0.00
3. 本期减少金额	-	-	-	-	-	0.00
处置或报废	-	-	-	-	-	0.00
-	-	-	-	-	-	0.00
其他原因减少	-	-	-	-	-	0.000
4. 期末余额	297,551.70	0.00	477,911.15	0.00	7,906,661.05	8,682,123.90
二、累计折旧						
1. 期初余额	101,517.78	-	84,257.29		216,520.93	402,296.00
2. 本期增加金额	101,517.78	0.00	47,025.00	0.00	215,714.93	364,257.71
本期计提	101,517.78	-	47,025.00		215,714.93	364,257.71
-	-	-	-	-	-	0.00
其他原因增加	-	-	-	-	-	0.00
3. 本期减	-	-	-	-	-	0.00

少金额						
处置或 报废	-	-	-	-	-	0.00
-	-	-	-	-	-	0.00
其他原 因减少	-	-	-	-	-	0.00
4. 期末余 额	203,035.56	0.00	131,282.29	0.00	432,235.86	766,553.71
三、减值准 备						
1. 期初余 额	-	-	-	-	-	0.00
2. 本期增 加金额	-	-	-	-	-	0.00
本期计 提	-	-	-	-	-	0.00
-	-	-	-	-	-	0.00
其他原 因增加	-	-	-	-	-	0.00
3. 本期减 少金额	-	-	-	-	-	0.00
处置或 报废	-	-	-	-	-	0.00
-	-	-	-	-	-	0.00
其他原 因减少	-	-	-	-	-	0.00
4. 期末余 额	-	-	-	-	-	0.00
四、账面价 值						
1. 期末账 面价值	94,516.14	0.00	346,628.86	0.00	7,474,425. 19	7,915,570. 19
2. 期初账 面价值	196,033.92	-	393,653.86	-	7,654,740. 12	8,244,427. 90

8.5.7.12.2 固定资产的其他说明

无。

8.5.7.12.3 固定资产清理

注：无。

8.5.7.13 在建工程

注：无。

8.5.7.13.1 在建工程情况

注：无。

8.5.7.13.2 报告期内重要在建工程项目变动情况

注：无。

8.5.7.13.3 报告期内在建工程计提减值准备情况

注：无。

8.5.7.13.4 工程物资情况

注：无。

8.5.7.14 使用权资产

注：无。

8.5.7.15 无形资产

8.5.7.15.1 无形资产情况

单位：人民币元

项目	特许经营权	土地使用权	专利权	非专有技术	合计
一、账面原值					
1. 期初余额	4,571,295,452.10	-	-	-	4,571,295,452.10
2. 本期增加金额	-	-	-	-	-
购置	-	-	-	-	-
内部研发	-	-	-	-	-
其他原因增加	-	-	-	-	-
3. 本期减少金额	-	-	-	-	-
处置	-	-	-	-	-
其他原因减少	-	-	-	-	-
4. 期末余额	4,571,295,452.10	-	-	-	4,571,295,452.10
二、累计摊销					
1. 期初余额	182,820,220.15	-	-	-	182,820,220.15
2. 本期增加金额	182,820,220.14	-	-	-	182,820,220.14
本期计提	182,820,220.14	-	-	-	182,820,220.14
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	365,640,440.29	-	-	-	365,640,440.29
三、减值准备					
1. 期初余额	-	-	-	-	-
2. 本期增加金额	-	-	-	-	-
本期计提	-	-	-	-	-
其他原因增加	-	-	-	-	-
3. 本期减少金额	-	-	-	-	-
处置	-	-	-	-	-
其他原因减少	-	-	-	-	-
4. 期末余额	-	-	-	-	-
四、账面价值					
1. 期末账面价值	4,205,655,011.81	-	-	-	4,205,655,011.81
2. 期初账面价值	4,388,475,231.95	-	-	-	4,388,475,231.95

注：截至 2023 年 6 月 30 日，本基金无所有权受到限制的无形资产。

8.5.7.15.2 无形资产的其他说明

无。

8.5.7.16 开发支出

注：无。

8.5.7.17 商誉

8.5.7.17.1 商誉账面原值

注：无。

8.5.7.17.2 商誉减值准备

注：无。

8.5.7.17.3 商誉减值测试过程、关键参数及商誉减值损失的确认方法

无。

8.5.7.18 长期待摊费用

注：无。

8.5.7.19 递延所得税资产和递延所得税负债

8.5.7.19.1 未经抵销的递延所得税资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	可抵扣暂时性 差异	递延所得税 资产	可抵扣暂时性 差异	递延所得税 资产
资产减值准备	-	-	-	-
内部交易未实现利润	-	-	-	-
信用减值准备	23,599,883.55	3,539,982.53	23,476,343.80	3,521,451.57
资产减值损失	51,061.14	7,659.17	51,061.14	7,659.17
预计负债	222,920,410.17	33,575,877.96	186,915,210.17	28,073,877.96
合计	246,571,354.86	37,123,519.66	210,442,615.11	31,602,988.70

8.5.7.19.2 未经抵销的递延所得税负债

注：无。

8.5.7.19.3 以抵销后净额列示的递延所得税资产或负债

注：无。

8.5.7.19.4 未确认递延所得税资产的可抵扣暂时性差异明细

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
资产减值准备	-	-
预计负债	46,870,374.82	46,870,374.82
可抵扣亏损	-	-
合计	46,870,374.82	46,870,374.82

8.5.7.19.5 未确认递延所得税资产的可抵扣亏损将于以下年度到期

注：无。

8.5.7.20 其他资产

8.5.7.20.1 其他资产情况

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
预付款项	753,983.28	691,359.98
其他应收款	636,579.81	1,611,649.17
其他流动资产	258,327.07	4,974,718.47
其他非流动资产	10,161,166.86	10,161,166.86
合计	11,810,057.02	17,438,894.48

8.5.7.20.2 预付账款

8.5.7.20.2.1 按账龄列示

单位：人民币元

账龄	本期末	上年度末
----	-----	------

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
1 年以内	731,914.78	679,291.48
1-2 年	-	-
2 年以上	22,068.50	12,068.50
合计	753,983.28	691,359.98

8.5.7.20.2 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
单位 1	330,506.59	43.83	2023 年 6 月 20 日	当季预付, 下月结算
单位 2	220,682.87	29.27	2022 年 7 月 27 日	当年预付, 下年结算
单位 3	139,786.54	18.54	2023 年 5 月 25 日	当季预付, 下月结算
单位 4	27,964.81	3.71	2023 年 6 月 26 日	当月预付, 下月结算
单位 5	12,973.97	1.72	2023 年 3 月 8 日	当月预付, 下月结算
合计	731,914.78	97.07	-	-

8.5.7.20.3 其他应收款

8.5.7.20.3.1 按账龄列示

单位：人民币元

账龄	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
1 年以内	518,389.38	1,471,237.43
1-2 年	170,347.22	172,347.22
2-3 年	2,000.00	-
3 年以上	81,266.81	81,266.81
小计	772,003.41	1,724,851.46
减：坏账准备	135,423.60	113,202.29
合计	636,579.81	1,611,649.17

8.5.7.20.3.2 按款项性质分类情况

单位：人民币元

款项性质	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应收垫付款	314,856.70	1,295,571.55
其他存出保证金	83,266.81	83,266.81
其他	373,879.90	346,013.10
小计	772,003.41	1,724,851.46
减：坏账准备	135,423.60	113,202.29
合计	636,579.81	1,611,649.17

8.5.7.20.3.3 其他应收款坏账准备计提情况

单位：人民币元

坏账准备	第一阶段	第二阶段	第三阶段	合计
	未来 12 个月预期	整个存续期预期	整个存续期预期	

	信用损失	信用损失(未发生 信用减值)	信用损失(已发生 信用减值)	
期初余额	113,202.29	-	-	113,202.29
期初余额在本期	-	-	-	0.00
-转入第二阶段	-	-	-	0.00
-转入第三阶段	-81,266.81	-	81,266.81	0.00
-转回第二阶段	-	-	-	0.00
-转回第一阶段	-	-	-	0.00
本期计提	26,630.95	-	-	26,630.95
本期转回	4,409.64	-	-	4,409.64
本期转销	-	-	-	0.00
本期核销	-	-	-	0.00
其他变动	-	-	-	0.00
期末余额	54,156.79	0.00	81,266.81	135,423.60

本期发生坏账准备显著变动的其他应收款情况说明：

无。

本期计算坏账准备计提金额与评估金融工具信用风险是否显著增加的依据：

无。

本期坏账准备发生重要转回或收回的其他应收款情况

注：无。

8.5.7.20.3.4 报告期内实际核销的其他应收款情况

注：无。

8.5.7.20.3.5 按债务人归集的报告期末余额前五名的其他应收款

金额单位：人民币元

债务人名称	账面余额	占其他应收款期 末余额的比例 (%)	已计提坏账准备	账面价值
单位 1	303,988.72	39.38	1,519.94	302,468.78
单位 2	170,347.22	22.07	51,104.17	119,243.05
单位 3	81,266.81	10.53	81,266.81	-
单位 4	70,000.00	9.07	350.00	69,650.00
单位 5	60,000.00	7.77	300.00	59,700.00
合计	685,602.75	88.81	134,540.92	551,061.83

8.5.7.21 短期借款

注：无。

8.5.7.22 应付账款

8.5.7.22.1 应付账款情况

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
应付工程款	77,008,177.57	71,459,347.66
应付劳务款	5,267,401.49	9,611,532.26
应付购货款	247,090.00	488,740.00
合计	82,522,669.06	81,559,619.92

注：应付劳务款和应付工程款中部分为本基金合并时项目公司遗留的以前年度应收工程款对应的应付款项。

8.5.7.22.2 账龄超过一年的重要应付账款

注：无。

8.5.7.23 应付职工薪酬

8.5.7.23.1 应付职工薪酬情况

单位：人民币元

项目	期初余额	本期增加金额	本期减少金额	期末余额
短期薪酬	7,189,439.38		834,214.84	6,355,224.54
离职后福利-设定 提存计划	-	-	-	-
合计	7,189,439.38		834,214.84	6,355,224.54

注：本期减少金额为支付原项目公司人员在本基金合同生效前已计提的以前年度薪酬及职工教育经费。

8.5.7.23.2 短期薪酬

单位：人民币元

项目	期初余额	本期增加金额	本期减少金额	期末余额
一、工资、奖金、 津贴和补贴	5,547,437.19	-	723,477.04	4,823,960.15
二、职工福利费	-	-	-	-
三、社会保险费	-	-	-	-
其中：医疗保险费	-	-	-	-
工伤保险费	-	-	-	-
生育保险费	-	-	-	-
四、住房公积金	-	-	-	-
五、工会经费和职 工教育经费	1,642,002.19	-	110,737.80	1,531,264.39
合计	7,189,439.38	0.00	834,214.84	6,355,224.54

8.5.7.23.3 设定提存计划

注：无。

8.5.7.24 应交税费

单位：人民币元

税费项目	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
增值税	-	1,036,415.35
消费税	-	-
企业所得税	18,482,753.60	-
个人所得税	-	16,505.21
城市维护建设税	53,334.27	115,631.71
教育费附加	38,095.93	82,594.06
房产税	-	-
土地使用税	-	-
土地增值税	-	-
其他	-	-
合计	18,574,183.80	1,251,146.33

8.5.7.25 应付利息

注：无。

8.5.7.26 合同负债

8.5.7.26.1 合同负债情况

注：无。

8.5.7.26.2 报告期内合同负债账面价值发生重大变动的金额和原因

注：无。

8.5.7.27 长期借款

注：无。

8.5.7.28 预计负债

单位：人民币元

项目	期初余额	本期增加金额	本期减少金额	期末余额	形成原因及经济利益流出不确定性的说明
未决诉讼	-	-	-	-	-
高速公路大修预提费用	233,785,584.99	36,680,000.00	674,800.00	269,790,784.99	高速公路大修预提费用
其他	-	-	-	-	-
合计	233,785,584.99	36,680,000.00	674,800.00	269,790,784.99	

8.5.7.29 租赁负债

注：无。

8.5.7.30 其他负债

8.5.7.30.1 其他负债情况

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
其他应付款	7,521,366.45	7,103,653.59
一年内到期的非流动负债	1,390,901.89	762,251.31
其他流动负债	1,875,502.04	3,830,518.17
长期应付款	-	734,149.06
合计	10,787,770.38	12,430,572.13

8.5.7.30.2 预收款项

8.5.7.30.2.1 预收款项情况

注：无。

8.5.7.30.2.2 账龄超过一年的重要预收款项

注：无。

8.5.7.30.3 其他应付款

8.5.7.30.3.1 按款项性质列示的其他应付款

单位：人民币元

款项性质	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
押金及保证金	4,549,262.58	3,795,236.58
其他	2,972,103.87	3,308,417.01
合计	7,521,366.45	7,103,653.59

8.5.7.30.3.2 账龄超过一年的重要其他应付款

注：无。

8.5.7.31 实收基金

金额单位：人民币元

项目	基金份额（份）	账面金额
上年度末	500,000,000.00	4,792,999,565.42
本期末	500,000,000.00	4,792,999,565.42

8.5.7.32 资本公积

注：无。

8.5.7.33 其他综合收益

注：无。

8.5.7.34 盈余公积

注：无。

8.5.7.35 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	合计
上年度末	-5,524,764.35	-	-5,524,764.35
本期利润	73,288,686.51	-	73,288,686.51
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	-386,400,007.86	-	-386,400,007.86
本期末	-318,636,085.70	-	-318,636,085.70

注：2023年4月10日，本基金按7.7280元/10份基金份额进行2023年第一次分红，实际分配386,400,007.86元。

8.5.7.36 营业收入和营业成本

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年6月27日（基金合同生效日） 至2022年6月30日
	-	合计	合计
营业收入	383,395,720.18	383,395,720.18	-
主营业务收入	369,266,330.69	369,266,330.69	-
其他业务收入	14,129,389.49	14,129,389.49	-
合计	383,395,720.18	383,395,720.18	-
营业成本	277,602,911.98	277,602,911.98	-
主营业务成本	268,975,586.64	268,975,586.64	-
其他业务成本	8,627,325.34	8,627,325.34	-
合计	277,602,911.98	277,602,911.98	-

注：本基金的基金合同生效日为2022年6月27日，专项计划和项目公司分别于2022年6月和2022年7月纳入本基金合并范围，上年度可比期间不完整。

8.5.7.37 投资收益

注：无。

8.5.7.38 公允价值变动收益

注：无。

8.5.7.39 资产处置收益

注：无。

8.5.7.40 其他收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月	上年度可比期间 2022年6月27日（基金合同生效日）

	30 日	至 2022 年 6 月 30 日
个人所得税扣缴手续费 返还	4,122.15	-
合计	4,122.15	-

注：本基金的基金合同生效日为 2022 年 6 月 27 日，专项计划和项目公司分别于 2022 年 6 月和 2022 年 7 月纳入本基金合并范围，上年度可比期间不完整。

8.5.7.41 其他业务收入

注：无。

8.5.7.42 利息支出

注：无。

8.5.7.43 税金及附加

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 6 月 27 日（基金合 同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
增值税	-	-
消费税	-	-
企业所得税	-	-
个人所得税	-	-
城市维护建设税	1,177,148.97	-
教育费附加	840,820.74	-
房产税	156,204.49	-
土地使用税	49,893.44	-
土地增值税	-	-
印花税	23,149.00	-
车船税	2,340.00	-
环境保护税	886.81	-
其他	-	-
合计	2,250,443.45	-

注：本基金的基金合同生效日为 2022 年 6 月 27 日，专项计划和项目公司分别于 2022 年 6 月和 2022 年 7 月纳入本基金合并范围，上年度可比期间不完整。

8.5.7.44 销售费用

注：无。

8.5.7.45 管理费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月	上年度可比期间 2022 年 6 月 27 日（基金合同生效日）
----	----------------------------------	-------------------------------------

	30 日	至 2022 年 6 月 30 日
基金信息披露费用	59,507.37	1,276.60
基金中介服务费用	238,027.67	14,212.76
不可抵扣的销项税额	3,089,409.51	17,781.68
其他	567.25	-
合计	3,387,511.80	33,271.04

注：本基金的基金合同生效日为 2022 年 6 月 27 日，专项计划和项目公司分别于 2022 年 6 月和 2022 年 7 月纳入本基金合并范围，上年度可比期间不完整。

8.5.7.46 财务费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 6 月 27 日（基金合 同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
银行手续费	6,357.00	-
其他手续费	262,322.33	-
其他	-	-
合计	268,679.33	-

注：1、本基金的基金合同生效日为 2022 年 6 月 27 日，专项计划和项目公司分别于 2022 年 6 月和 2022 年 7 月纳入本基金合并范围，上年度可比期间不完整。

2、其他手续费为路网中心划拨通行费手续费。

8.5.7.47 信用减值损失

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 6 月 27 日（基金合 同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
债权投资减值损失	-	-
应收账款坏账损失	101,318.44	-
其他应收款坏账损失	22,221.31	-
其他	-	-
合计	123,539.75	-

注：本基金的基金合同生效日为 2022 年 6 月 27 日，专项计划和项目公司分别于 2022 年 6 月和 2022 年 7 月纳入本基金合并范围，上年度可比期间不完整。

8.5.7.48 资产减值损失

注：无。

8.5.7.49 其他费用

注：无。

8.5.7.50 营业外收入

8.5.7.50.1 营业外收入情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 6 月 27 日（基金合同生效日）至 2022 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	-	-
路产赔偿收入	174,929.23	-
无法支付的款项	54.40	-
其他	60,640.00	-
合计	235,623.63	-

注：本基金的基金合同生效日为 2022 年 6 月 27 日，专项计划和项目公司分别于 2022 年 6 月和 2022 年 7 月纳入本基金合并范围，上年度可比期间不完整。

8.5.7.50.2 计入当期损益的政府补助

注：无。

8.5.7.51 营业外支出

注：无。

8.5.7.52 所得税费用

8.5.7.52.1 所得税费用情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 6 月 27 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
当期所得税费用	32,210,487.03	-
递延所得税费用	-5,520,530.96	-
合计	26,689,956.07	-

注：本基金的基金合同生效日为 2022 年 6 月 27 日，专项计划和项目公司分别于 2022 年 6 月和 2022 年 7 月纳入本基金合并范围，上年度可比期间不完整。

8.5.7.52.2 会计利润与所得税费用调整过程

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
利润总额	99,978,642.58
按法定/适用税率计算的所得税费用	14,996,796.39

子公司适用不同税率的影响	-
调整以前期间所得税的影响	8,753,014.96
非应税收入的影响	-
不可抵扣的成本、费用和损失的影响	17,518,622.34
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	-
非应税收入的影响	-14,578,477.62
合计	26,689,956.07

注：由于本基金及专项计划并非企业所得税纳税义务人，故将其利润总额作为非应税收入。

8.5.7.53 现金流量表附注

8.5.7.53.1 收到其他与经营活动有关的现金

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年6月27日(基金合同生效日)至2022年6月30日
代垫款收回	980,714.85	-
其他	1,258,641.61	-
合计	2,239,356.46	-

注：本基金的基金合同生效日为2022年6月27日，专项计划和项目公司分别于2022年6月和2022年7月纳入本基金合并范围，上年度可比期间不完整。

8.5.7.53.2 支付其他与经营活动有关的现金

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年6月27日(基金合同生效日)至2022年6月30日
支付管理人报酬	5,005,055.92	-
支付托管费	311,408.44	-
支付中介机构费用	480,000.00	-
其他	1,071,395.65	-
合计	6,867,860.01	-

注：本基金的基金合同生效日为2022年6月27日，专项计划和项目公司分别于2022年6月和2022年7月纳入本基金合并范围，上年度可比期间不完整。

8.5.7.53.3 收到其他与投资活动有关的现金

注：无。

8.5.7.53.4 支付其他与投资活动有关的现金

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 6 月 27 日(基金合同生效日)至 2022 年 6 月 30 日
护栏改造	674,800.00	-
合计	674,800.00	-

注：本基金的基金合同生效日为 2022 年 6 月 27 日，专项计划和项目公司分别于 2022 年 6 月和 2022 年 7 月纳入本基金合并范围，上年度可比期间不完整。

8.5.7.53.5 收到其他与筹资活动有关的现金

注：无。

8.5.7.53.6 支付其他与筹资活动有关的现金

注：无。

8.5.7.54 现金流量表补充资料

8.5.7.54.1 现金流量表补充资料

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 6 月 27 日(基金合同生效日)至 2022 年 6 月 30 日
1. 将净利润调节为经营活动现金流量		
净利润	73,288,686.51	3,182,225.62
加：信用减值损失	123,539.75	-
资产减值损失	-	-
固定资产折旧	364,257.71	-
投资性房地产折旧	-	-
使用权资产折旧	-	-
无形资产摊销	182,820,220.14	-
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)	-	-
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)	-5,520,530.96	-
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)	-81,005.00	-
经营性应收项目的减少(增加以“-”	2,151,652.16	-186,623.98

号填列)		
经营性应付项目的增加(减少以“-”号填列)	18,668,674.45	146,276.05
预计负债的计提	36,680,000.00	-
其他	-	-
经营活动产生的现金流量净额	308,495,494.76	3,141,877.69
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	578,864,264.64	4,796,141,443.11
减: 现金的期初余额	657,478,977.74	4,792,999,565.42
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	-78,614,713.10	3,141,877.69

注: 本基金的基金合同生效日为 2022 年 6 月 27 日, 专项计划和项目公司分别于 2022 年 6 月和 2022 年 7 月纳入本基金合并范围, 上年度可比期间不完整。

8.5.7.54.2 报告期内支付的取得子公司的现金净额

注: 无。

8.5.7.54.3 现金和现金等价物的构成

单位: 人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 6 月 27 日(基金合 同生效日)至 2022 年 6 月 30 日
一、现金	578,864,264.64	4,796,141,443.11
其中: 库存现金	-	-
可随时用于支付的银行存款	578,864,264.64	4,796,141,443.11
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	578,864,264.64	4,796,141,443.11
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: 本基金的基金合同生效日为 2022 年 6 月 27 日, 专项计划和项目公司分别于 2022 年 6 月和 2022 年 7 月纳入本基金合并范围, 上年度可比期间不完整。

8.5.7.55 所有者权益变动表项目注释

无。

8.5.8 合并范围的变更

8.5.8.1 非同一控制下企业合并

8.5.8.1.1 报告期内发生的非同一控制下企业合并

注：无。

8.5.8.1.2 合并成本及商誉

8.5.8.1.2.1 合并成本及商誉情况

注：无。

8.5.8.1.2.2 合并成本公允价值的确定方法、或有对价及其变动的说明

无。

8.5.8.1.2.3 大额商誉形成的主要原因

无。

8.5.8.1.3 被购买方于购买日可辨认资产、负债

8.5.8.1.3.1 被购买方于购买日可辨认资产、负债的情况

注：无。

8.5.8.1.3.2 可辨认资产、负债公允价值的确定方法

无。

8.5.8.1.3.3 企业合并中承担的被购买方的或有负债

无。

8.5.8.2 同一控制下企业合并

8.5.8.2.1 报告期内发生的同一控制下企业合并

注：无。

8.5.8.2.2 合并成本

注：无。

8.5.8.2.3 或有对价及其变动的说明

无。

8.5.8.2.4 合并日被合并方资产、负债的账面价值

注：无。

8.5.8.2.5 企业合并中承担的被合并方的或有负债的说明

无。

8.5.8.3 反向购买

无。

8.5.8.4 其他

本基金于 2022 年 6 月 27 日成立，共募集资金人民币 4,792,999,565.42 元。本基金成立后，扣除本基金预留的基金运营费用人民币 539,565.42 元后，以人民币 4,792,460,000.00 元购买专项计划全部份额。专项计划扣除预留费用人民币 330,000 元后，以人民币 4,792,130,000.00 元收购基础设施项目。专项计划和项目公司分别于 2022 年 6 月和 2022 年 7 月纳入本基金合并范围。项目公司主要负责基础设施项目渝遂高速公路重庆段的运营和管理，主要包括日常养护、运行、服务和安全应急等运营管理工作，必要时需进行更新改造工作，这些工作需要由具有相关技能、知识和经验的专业人员完成。专项计划收购项目公司时点，项目公司不具有完成上述工作所需要的专业人员，不具有实质性的加工处理过程，因此本集团判断不构成业务，将收购项目公司股权作为购买资产，以公允价值作为初始计量金额。

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	
渝遂高速(重庆段)基础设施项目专项计划	重庆	上海	专项计划资产支持证券	100.00	-	认购
重庆铁发遂渝高速公路有限公司	重庆	重庆	高速公路特许经营	-	100.00	资产收购

8.5.10 分部报告

无。

8.5.11 承诺事项、或有事项、资产负债表日后事项的说明

8.5.11.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大承诺事项。

8.5.11.2 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

8.5.11.3 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的重大资产负债表日后事项。

8.5.12 关联方关系

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

本基金本报告期不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。

8.5.12.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国金基金管理有限公司	基金管理人
国金证券资产管理有限公司	专项计划管理人
招商银行股份有限公司	基金托管人
中铁建重庆投资集团有限公司（“重庆投资”）	基础设施项目委托管理人、持有本基金 51%份额的原始权益人
重庆渝东高速公路有限公司	持有本基金 20%份额的原始权益人
中铁建重庆投资集团实业发展有限公司	原始权益人之子公司
重庆中油铁建实业有限公司	原始权益人之子公司
中铁建生态环境有限公司	原始权益人之子公司
重庆金路交通工程有限责任公司	原始权益人之子公司
重庆铁发建新高速公路有限公司	原始权益人之联营公司
重庆铁发秀松高速公路有限公司	原始权益人之联营公司
中国铁建股份有限公司（“中国铁建”）	重庆投资的最终控制方
中国铁建电气化局集团有限公司	中国铁建之子公司
中铁物资集团港澳有限公司	中国铁建之子公司
中铁十六局集团有限公司	中国铁建之子公司
北京中铁装饰工程有限公司	中国铁建之子公司
中铁十一局集团有限公司	中国铁建之子公司
中铁二十局集团有限公司	中国铁建之子公司
中铁建设集团有限公司	中国铁建之子公司
中铁二十三局集团有限公司	中国铁建之子公司
重庆高速公路集团有限公司联网收费结算中心	原始权益人之子公司

8.5.13 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金的基金合同生效日为 2022 年 6 月 27 日，专项计划和项目公司分别于 2022 年 6 月和 2022 年 7 月纳入本基金合并范围，上年度可比期间不完整。

8.5.13.1 关联采购与销售情况

8.5.13.1.1 采购商品、接受劳务情况

单位：人民币元

关联方名称	关联交易内容	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 6 月 27 日（基金 合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
重庆金路交通工程 有限责任公司	日常、专项养护工程及 路产维修项目	6,832,874.90	-

中铁建重庆投资集团有限公司	运营管理	26,767,134.85	-
中铁建重庆投资集团实业发展有限公司	物业管理	4,855,471.54	-
中铁建生态环境有限公司	日常养护	96,285.97	-
合计	-	38,551,767.26	-

注：本基金的基金合同生效日为 2022 年 6 月 27 日，专项计划和项目公司分别于 2022 年 6 月和 2022 年 7 月纳入本基金合并范围，上年度可比期间不完整。

8.5.13.1.2 出售商品、提供劳务情况

单位：人民币元

关联方名称	关联交易内容	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 6 月 27 日（基金 合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
中国铁建电气化局集团有限公司	采购机电设备	994,785.21	-
合计	-	994,785.21	-

注：本基金的基金合同生效日为 2022 年 6 月 27 日，专项计划和项目公司分别于 2022 年 6 月和 2022 年 7 月纳入本基金合并范围，上年度可比期间不完整。

8.5.13.2 关联租赁情况

8.5.13.2.1 作为出租方

单位：人民币元

承租方名称	租赁资产种类	本期确认的租赁收入	上年度可比期间确认的租赁收入
中铁建重庆投资集团实业发展有限公司	场地租赁	2,646,852.76	-
重庆中油铁建实业有限公司	场地租赁	3,245,238.85	-
合计	-	5,892,091.61	-

注：本基金的基金合同生效日为 2022 年 6 月 27 日，专项计划和项目公司分别于 2022 年 6 月和 2022 年 7 月纳入本基金合并范围，上年度可比期间不完整。

8.5.13.2.2 作为承租方

注：无。

8.5.13.3 通过关联方交易单元进行的交易

8.5.13.3.1 债券交易

注：无。

8.5.13.3.2 债券回购交易

注：无。

8.5.13.3.3 应支付关联方的佣金

注：无。

8.5.13.4 关联方报酬**8.5.13.4.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年6月27日(基金合同生效日)至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,752,305.04	106,434.94
其中：固定管理费	4,752,305.04	106,434.94
浮动管理费	-	-
支付销售机构的客户维护费	23,697.65	382.40

注：本基金的基金合同生效日为2022年6月27日，专项计划和项目公司分别于2022年6月和2022年7月纳入本基金合并范围，上年度可比期间不完整。

8.5.13.4.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年6月27日(基金合同生效日)至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	237,616.26	6,570.06

注：本基金的基金合同生效日为2022年6月27日，专项计划和项目公司分别于2022年6月和2022年7月纳入本基金合并范围，上年度可比期间不完整。

8.5.13.5 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：无。

8.5.13.6 各关联方投资本基金的情况**8.5.13.6.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

注：无

8.5.13.6.2 报告期内除基金管理人外其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

本期 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	期间因拆分变动份额	减：期间赎回/卖出份	期末持有

	份额	比例 (%)	份额	额	份额	比例 (%)	
国金证 券股 份有 限公 司	2,000,00 0.00	0.4000	-	-	2,000, 000.00	0.4000	
合计	2,000,00 0.00	0.4000	-	-	2,000, 000.00	0.4000	
上年度可比期间 2022年6月27日（基金合同生效日）至2022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 (%)
国金证 券股 份有 限公 司	2,000,00 0.00	0.4000		-	-	2,000, 000.00	0.4000
合计	2,000,00 0.00	0.4000		-	-	2,000, 000.00	0.4000

注：除基金管理人之外的其他关联方持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

8.5.13.7 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30 日		上年度可比期间 2022年6月27日（基金合同生效日）至2022 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	528,248,444.92	4,931,478.79	4,796,141,443.11
合计	528,248,444.92	4,931,478.79	4,796,141,443.11	186,623.97

注：本基金的基金合同生效日为2022年6月27日，专项计划和项目公司分别于2022年6月和2022年7月纳入本基金合并范围，上年度可比期间不完整。

8.5.13.8 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

8.5.13.9 其他关联交易事项的说明

无。

8.5.14 关联方应收应付款项

8.5.14.1 应收项目

单位：人民币元

项目名称	关联方名称	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022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	中铁建重庆投资集团实业发展有限公司	1,435,633.86	-	2,519,533.10	2,519.53
应收账款	重庆中油铁建实业有限公司	3,342,052.25	-	96,813.40	96.81
应收账款	中国铁建电气化局集团有限公司	480,606.02	480.60	4,240,203.38	4,240.21
应收账款	中铁物资集团港澳有限公司	1,382,851.02	1,382.85	1,959,880.62	1,959.88
其他应收款	重庆铁发建新高速公路有限公司	4,730.88	23.65	4,730.88	23.65
其他应收款	重庆铁发秀松高速公路有限公司	10,935.00	54.68	10,935.00	54.68
其他应收款	重庆铁发高速公路有限公司	27,866.80	0.01	-	-
其他应收款	重庆渝东高速公路有限公司	-	-	892,796.92	4,463.98
预付账款	重庆高速公路集团有限公司联网收费结算中心	220,682.87	-	-	-
合计	-	6,905,358.70	1,941.79	9,724,893.30	13,358.74

8.5.14.2 应付项目

单位：人民币元

项目名称	关联方名称	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
应付管理人报酬	国金基金管理有限公司	4,633,496.92	4,817,165.36
应付管理人报酬	国金证券资产管理有限公司	53,121.42	122,203.86
应付托管费	招商银行股份有限公司	171,929.56	245,721.74
应付账款	重庆金路交通工程有限责任公司	12,043,324.59	10,951,571.38
应付账款	中铁建生态环境有限公司	27,078.12	401,558.62
应付账款	中铁建重庆投资集团实业发展有限公司	4,857,031.54	1,560.00
应付账款	中铁十六局集团有限公司	3,249,766.01	3,249,766.01
应付账款	北京中铁装饰工程有限公司	36,916.20	36,916.20
应付账款	中国铁建电气化局集团有限公司	2,744,866.49	2,694,632.10
应付账款	中铁二十局集团有限公司	4,984,519.49	5,477,466.34
应付账款	中铁十一局集团有限公司	3,405,426.28	3,405,426.28

应付账款	中铁建设集团有限公司	19,615.50	19,615.50
应付账款	中铁二十三局集团有限公司	3,246.75	3,246.75
应付账款	中铁建重庆投资集团有限公司	0.00	7,787,397.86
合计	-	36,230,338.87	39,214,248.00

8.5.15 期末（2023 年 06 月 30 日）基金持有的流通受限证券

8.5.15.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

8.5.15.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

8.5.15.2.1 银行间市场债券正回购

注：无。

8.5.15.2.2 交易所市场债券正回购

无。

8.5.16 收益分配情况

8.5.16.1 收益分配基本情况

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额分红数	本期收益分配合计	本期收益分配占可供分配金额比例 (%)	备注
1	2023 年 4 月 10 日	2023 年 4 月 11 日	7.7820	386,400,007.86	99.00	-
合计				-	-	-

8.5.16.2 可供分配金额计算过程

参见 3.3.2.1。

8.5.17 金融工具风险及管理

8.5.17.1 信用风险

本基金仅与经认可的、信誉良好的交易方进行交易。按照本基金的政策，需对所有要求采用信用方式进行交易的客户进行信用审核。另外，本基金对应收账款收回情况进行持续监控，以确保本基金不致面临重大信用损失。此外，本基金于每个资产负债表日审核金融资产的回收情况，以确保对相关资产计提了充分的预期信用损失准备。本基金其他金融资产为货币资金和其他应收款，这些金融资产的信用风险源自交易对手违约，最大风险敞口等于这些工具的账面金额。本基金货币资金存放于具有独立法人资格的商业银行金融机构，拥有良好的信用评级。本基金通过上

述措施限制货币资金存放的信用风险。

除对单项金额重大且已发生信用减值的款项单独确定其信用损失外，本基金在组合基础上采用减值矩阵评估应收账款的预期信用损失。对于其他金融资产，本基金通过违约风险敞口和未来12个月内或整个存续期的预期信用损失率，计算预期信用损失。

8.5.17.2 流动性风险

管理流动性风险时，本基金保持管理层认为充分的现金及现金等价物并对其进行监控，以满足本基金经营需要，并降低现金流量波动的影响。

本基金拥有充足的资金，能够完全覆盖本基金的到期债务以满足流动性需求。

8.5.17.3 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的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。本基金持有的带息金融工具仅有银行存款，与市场变动关联度较低，因而与该银行存款相关的利率风险不重大。

本基金未持有以外币计价的金融工具，因此没有重大的外汇风险敞口及汇率风险。

本基金根据市场环境来对持有的银行存款在协定存款等收益率基于中国人民银行发布的基准利率浮动的存款类产品间进行配置，并通过定期审阅与监察维持适当的组合比例，在有效控制潜在利率风险的情况下，在风险和收益之间取得适当的平衡。

8.5.18 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

8.5.19 个别财务报表重要项目的说明

8.5.19.1 货币资金

8.5.19.1.1 货币资金情况

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
库存现金	-	-
银行存款	12,489,494.83	3,732,622.03
其他货币资金	-	-
小计	12,489,494.83	3,732,622.03
减：减值准备	-	-
合计	12,489,494.83	3,732,622.03

8.5.19.1.2 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
----	-------------------	---------------------

活期存款	12,488,280.73	3,732,222.84
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
应计利息	1,214.10	399.19
小计	12,489,494.83	3,732,622.03
减：减值准备	-	-
合计	12,489,494.83	3,732,622.03

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

无。

8.5.19.2 长期股权投资

8.5.19.2.1 长期股权投资情况

单位：人民币元

	本期末 2023年6月30日			上年度末 2022年12月31日		
	账面余额	减值准备	账面价值	账面余额	减值准备	账面价值
对子公司投资	4,792,460,000.00	-	4,792,460,000.00	4,792,460,000.00	-	4,792,460,000.00
合计	4,792,460,000.00	-	4,792,460,000.00	4,792,460,000.00	-	4,792,460,000.00

8.5.19.2.2 对子公司投资

单位：人民币元

被投资单位	期初余额	本期增加	本期减少	期末余额	本期计提减值准备	减值准备余额
国金证券-渝遂高速资产支持专项计划	4,792,460,000.00	-	-	4,792,460,000.00	-	-
合计	4,792,460,000.00	-	-	4,792,460,000.00	-	-

§ 9 评估报告

9.1 管理人聘任评估机构及评估报告内容的合规性说明

本报告期内，基金管理人聘请了中资资产评估有限公司（以下简称“中资评估”）作为本基金的评估机构，中资评估是本基金成立、发行阶段聘请的评估机构，现持有中华人民共和国财政部、中国证监会于 2009 年 1 月 6 日核发的《证券期货相关业务评估资格证书》（证书编号：0100024011），已按照《中华人民共和国基金法》第九十七条规定在中国证监会备案。中资评估具备为基金提供资产评估服务的资格，且为本基金提供评估服务未连续超过 3 年。

本次评估报告价值时点为 2022 年 12 月 31 日，中资评估经过查询、收集评估所需的市场资讯等相关资料，遵循相关法律法规和评估准则以及《公开募集基础设施证券投资基金指引（试行）》等所载的规定，选用收益法（现金流折现法）评估估价对象的市场价值。

评估机构在执行评估业务中，遵循相关法律法规和评估准则，恪守独立、客观和公正的原则；在估价报告中对事实的说明真实和准确，没有虚假记载、误导性陈述和重大遗漏；与估价对象没有现实或潜在的利益，与委托人及估价利害关系人没有利害关系，对估价对象、委托人及估价利害关系人不存在偏见；估价报告的分析、意见和结论时评估机构独立、客观、公正的专业分析、意见和结论。

评估报告相关评估结果不代表基础设施项目资产的真实市场价值，也不代表基础设施项目资产能够按照评估结果进行转让。

9.2 评估报告摘要

中资资产评估有限公司接受国金基金管理有限公司的委托，根据有关法律、法规和资产评估准则，遵循独立、客观、公正的原则，按照必要的评估程序，对重庆铁发遂渝高速公路有限公司特许经营权资产组在评估基准日的市场价值进行了评估。现将资产评估报告摘要如下：

评估目的：根据《公开募集基础设施证券投资基金指引（试行）》的规定，国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金需编制基金年度报告，为此，需对所涉及的重庆铁发遂渝高速公路有限公司特许经营权资产组价值进行评估，为该行为提供价值参考依据。

评估对象：重庆铁发遂渝高速公路有限公司的特许经营权资产组

评估范围：重庆铁发遂渝高速公路有限公司与特许经营权相关的长期资产组合，具体包括：固定资产（房屋、设备）、在建工程、无形资产（特许经营权）。

价值类型：市场价值

评估基准日：2022 年 12 月 31 日

评估方法：收益法

评估结论：在持续经营前提下，重庆铁发遂渝高速公路有限公司特许经营权资产组价值于评估基准日 2022 年 12 月 31 日的评估结果为 451,611.75 万元。

有关本评估结论的详细情况见本评估报告之《资产评估明细表》。

本资产评估报告评估结论的使用有效限自评估基准日起一年有效期。

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 2023 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 (%)
62,621	7,984.54	481,081,763.00	96.22	18,918,237.00	3.78
上年度末 2022 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 (%)
76,111	6,569.35	485,074,768.00	97.01	14,925,232.00	2.99

10.2 基金前十名流通份额持有人

本期末 2023 年 6 月 30 日			
序号	持有人名称	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
1	中国国际金融股份有限公司	10,810,045.00	2.16
2	浙商证券股份有限公司	9,252,240.00	1.85
3	长城人寿保险股份有限公司 — 自有资金	5,906,438.00	1.18
4	海通证券股份有限公司	4,689,555.00	0.94
5	中信证券股份有限公司	3,733,121.00	0.75
6	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	3,345,362.00	0.67
7	太平人寿保险有限公司—传 统—普通保险产品— 022L-CT001 沪	2,819,670.00	0.56

8	太平人寿保险有限公司一分 红一个险分红	2,819,670.00	0.56
9	太平人寿保险有限公司一分 红-团险分红	2,819,670.00	0.56
10	中国平安人寿保险股份有限 公司-分红一个险分红	2,819,670.00	0.56
11	中国平安人寿保险股份有限 公司-万能一个险万能	2,819,670.00	0.56
12	中国平安人寿保险股份有限 公司-传统-普通保险产品	2,819,670.00	0.56
13	中国平安人寿保险股份有限 公司-自有资金	2,819,670.00	0.56
14	中国平安财产保险股份有限公司-传统-普通保险产品	2,819,670.00	0.56
合计		60,294,121.00	12.06
上年度末 2022年12月31日			
序号	持有人名称	持有份额（份）	占总份额比例（%）
1	长城人寿保险股份有限公司 -自有资金	11,290,498.00	2.26
2	中国国际金融股份有限公司	8,978,990.00	1.80
3	浙商证券股份有限公司	7,349,098.00	1.47
4	海通证券股份有限公司	4,899,101.00	0.98
5	中信证券股份有限公司	4,701,151.00	0.94
6	太平人寿保险有限公司一分 红一个险分红	2,819,670.00	0.56
7	太平人寿保险有限公司一分 红-团险分红	2,819,670.00	0.56
8	中国平安人寿保险股份有限 公司-自有资金	2,819,670.00	0.56
9	太平人寿保险有限公司-传 统-普通保险产品- 022L-CT001 沪	2,819,670.00	0.56
10	中国平安人寿保险股份有限 公司-分红一个险分红	2,819,670.00	0.56
11	中国平安人寿保险股份有限 公司-传统-普通保险产品	2,819,670.00	0.56
12	中国平安财产保险股份有限公司-传统-普通保险产品	2,819,670.00	0.56
13	中国平安人寿保险股份有限 公司-万能一个险万能	2,819,670.00	0.56
合计		59,776,198.00	11.96

10.3 基金前十名非流通份额持有人

本期末 2023年6月30日			
序号	持有人名称	持有份额（份）	占总份额比例（%）
1	中铁建重庆投资集团有限公司	255,000,000.00	51.00
2	重庆渝东高速公路有限公司	100,000,000.00	20.00
3	中银国际证券—中国银行—中银证券中国红—汇中 27 号集合资产管理计划	2,000,000.00	0.40
4	中国中金财富证券有限公司	2,000,000.00	0.40
5	兴瀚资管—兴业银行—兴瀚资管—兴元 18 号集合资产管理计划	2,000,000.00	0.40
6	申万宏源证券有限公司	2,000,000.00	0.40
7	国金证券股份有限公司	2,000,000.00	0.40
8	光大证券资管—光大银行—光证资管诚享 7 号集合资产管理计划	2,000,000.00	0.40
9	工银瑞信投资—工商银行—工银瑞投—工银理财四海甄选集合资产管理计划	2,000,000.00	0.40
10	中保投资有限责任公司—中国保险投资基金（有限合伙）	1,500,000.00	0.30
11	嘉实基金—东兴证券股份有限公司—嘉实基金睿鑫单一资产管理计划	1,500,000.00	0.30
12	和谐健康保险股份有限公司—万能产品	1,500,000.00	0.30
13	国新新格局（北京）私募证券投资基金管理有限公司—国新央企新发展格局私募证券投资基金	1,500,000.00	0.30
合计		375,000,000.00	75.00
上年度末 2022年12月31日			
序号	持有人名称	持有份额（份）	占总份额比例（%）
1	中铁建重庆投资集团有限公司	255,000,000.00	51.00
2	重庆高速公路股份有限公司	100,000,000.00	20.00
3	中银国际证券—中国银行—中银证券中国红—汇中 27 号集合资产管理计划	2,000,000.00	0.40

4	中国中金财富证券有限公司	2,000,000.00	0.40
5	兴瀚资管—兴业银行—兴瀚资管—兴元 18 号集合资产管理计划	2,000,000.00	0.40
6	申万宏源证券有限公司	2,000,000.00	0.40
7	国金证券股份有限公司	2,000,000.00	0.40
8	光大证券资管—光大银行—光证资管诚享 7 号集合资产管理计划	2,000,000.00	0.40
9	工银瑞信投资—工商银行—工银瑞投—工银理财四海甄选集合资产管理计划	2,000,000.00	0.40
10	中保投资有限责任公司—中国保险投资基金（有限合伙）	1,500,000.00	0.30
11	嘉实基金—东兴证券股份有限公司—嘉实基金睿鑫单一资产管理计划	1,500,000.00	0.30
12	和谐健康保险股份有限公司—万能产品	1,500,000.00	0.30
13	国新新格局（北京）私募证券投资基金管理有限公司—国新央企新发展格局私募证券投资基金	1,500,000.00	0.30
合计		375,000,000.00	75.00

10.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	175.00	0.0000

§ 11 基金份额变动情况

单位：份

基金合同生效日（-）基金份额总额	500,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	500,000,000.00
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	500,000,000.00

§ 12 重大事件揭示

12.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

原督察长张丽女士自 2023 年 6 月 14 日起由于个人原因离任基金管理人督察长职务，自 2023 年 6 月 14 日至 2023 年 7 月 23 日由公司总经理邵海波先生代任督察长职务，张静女士自 2023 年 7 月 24 日起担任基金管理人督察长职务。

除上述人事调整以外，本报告期内基金管理人无其他重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

12.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

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

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

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

本报告期内，本基金的审计机构为德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙），无改聘情况。

12.7 为基金出具评估报告的评估机构情况

本报告期内，本基金的评估机构为中资资产评估有限公司，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

注：本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

12.8.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

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	《国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金 2022 年第 4 季度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2023 年 01 月 19 日
2	《国金基金管理有限公司关于旗下基金开展网上直销平台费率优惠活动的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2023 年 03 月 10 日
3	《国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金 2022 年年度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2023 年 03 月 30 日

4	《国金基金管理有限公司关于公司系统升级的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 03 月 31 日
5	《关于召开国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金 2022 年度业绩说明会的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 03 月 31 日
6	《国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金 2023 年第一次分红公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 04 月 04 日
7	《国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金 2023 年第 1 季度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 04 月 21 日
8	《关于召开国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金 2023 年第一季度业绩说明会的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 05 月 17 日
9	《国金基金管理有限公司高级管理人员变更公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 06 月 16 日
10	《关于国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金基金经理变更的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 06 月 20 日
11	《国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金招募说明书（更新）》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 06 月 21 日
12	《国金铁建重庆渝遂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）》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 06 月 21 日
13	国金基金管理有限公司关于国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金基金份额解除限售的提示性公告	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 06 月 27 日
14	《国金铁建重庆渝遂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》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 06 月 28 日
15	《国金基金管理有限公司关于国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金基金份额解除限售的提示性公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2023 年 06 月 30 日

§ 13 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 14 备查文件目录

14.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金基金合同；
- 3、国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金托管协议；
- 4、国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金招募说明书；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、报告期内披露的各项公告。

14.2 存放地点

北京市海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 14 层。

14.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的办公场所或基金管理人网站免费查阅备查文件。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。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：4000-2000-18

公司网址：www.gfund.com

国金基金管理有限公司

2023 年 8 月 30 日