

中信建投国家电投新能源封闭式基础设施证券投资基金

基金份额解除限售的公告

一、公募 REITs 基本信息

公募 REITs 名称	中信建投国家电投新能源封闭式基础设施证券投资基金
公募 REITs 简称	中信建投国家电投新能源 REIT
公募 REITs 代码	508028
公募 REITs 合同生效日	2023 年 3 月 20 日
基金管理人名称	中信建投基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司
公告依据	《中华人民共和国证券投资基金法》及配套法规、《公开募集基础设施证券投资基金指引(试行)》《上海证券交易所公开募集基础设施证券投资基金（REITs）业务办法(试行)》《上海证券交易所公开募集基础设施证券投资基金（REITs）规则适用指引第 5 号——临时报告（试行）》《中信建投国家电投新能源封闭式基础设施证券投资基金基金合同》《中信建投国家电投新能源封闭式基础设施证券投资基金招募说明书》等
业务类型	场内解除限售
生效时间	2024 年 3 月 29 日

二、解除限售份额基本情况

中信建投国家电投新能源封闭式基础设施证券投资基金（以下简称“本基金”）部分战略配售份额将于 2024 年 3 月 29 日解除限售，本次解除限售份额共计 242,400,000.00 份，其中场内解除限售份额 242,400,000.00 份，不涉及场外份额解除锁定。

本次战略配售份额上市流通前，可在二级市场直接交易的本基金流通份额为 200,000,000.00 份，占本基金全部基金份额的 25%。本次战略配售份额解禁后，

可流通份额合计为 442,400,000.00 份，占本基金全部基金份额的 55.30%。前述流通份额均包括场外份额，场外份额在符合相关办理条件的前提下通过跨系统转托管至场内后即可上市流通。

（一）公募 REITs 场内份额解除限售

1、本次解除限售的场内份额情况

序号	证券账户名称	限售份额总量 (份)	限售类型	限售期 (月)
1	中国人寿资管—广发银行—国寿资产—鼎瑞绿色投资1号资产管理产品	16,000,000.00	其他专业机构投资者战略配售限售	12
2	光大证券资管—光大银行—光证资管诚享7号集合资产管理计划	16,000,000.00	其他专业机构投资者战略配售限售	12
3	长城基金管理有限公司	12,000,000.00	其他专业机构投资者战略配售限售	12
4	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	12,000,000.00	其他专业机构投资者战略配售限售	12
5	建信信托有限责任公司	12,000,000.00	其他专业机构投资者战略配售限售	12
6	兴瀚资管—兴业银行—兴瀚资管—兴元18号集合资产管理计划	12,000,000.00	其他专业机构投资者战略配售限售	12
7	深圳云能基金管理有限公司	12,000,000.00	其他专业机构投资者战略配售限售	12
8	华夏基金—国民养老保险股份有限公司—专属商业养老保险产品—华夏基金国民养老2号单一资产管理计划	12,000,000.00	其他专业机构投资者战略配售限售	12
9	泰康保险集团股份有限公司—自有资金	12,000,000.00	其他专业机构投资者战略配售限售	12
10	中国人寿资管—工商银行—国寿资产—工银理财鼎瑞2204保险资产管理产品	8,000,000.00	其他专业机构投资者战略配售限售	12
11	中航基金—北京银行—中航基金REITs京彩1号集合资产管理计划	8,000,000.00	其他专业机构投资者战略配售限售	12
12	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	8,000,000.00	其他专业机构投资者战略配售限售	12

13	长城人寿保险股份有限公司—自有资金	8,000,000.00	其他专业机构投资者战略配售限售	12
14	太平财产保险有限公司—传统—普通保险产品	8,000,000.00	其他专业机构投资者战略配售限售	12
15	永安期货股份有限公司	8,000,000.00	其他专业机构投资者战略配售限售	12
16	申万宏源投资管理（亚洲）有限公司—首欧中国公募REITs投资基金	8,000,000.00	其他专业机构投资者战略配售限售	12
17	嘉实基金—财信吉祥人寿保险股份有限公司—传统产品—嘉实基金宝睿2号单一资产管理计划	8,000,000.00	其他专业机构投资者战略配售限售	12
18	平安证券股份有限公司	8,000,000.00	其他专业机构投资者战略配售限售	12
19	华西证券股份有限公司	8,000,000.00	其他专业机构投资者战略配售限售	12
20	中信建投利信资本管理（北京）有限公司	8,000,000.00	其他专业机构投资者战略配售限售	12
21	中信建投证券股份有限公司	7,200,000.00	其他专业机构投资者战略配售限售	12
22	中信证券股份有限公司	4,800,000.00	其他专业机构投资者战略配售限售	12
23	中国中金财富证券有限公司	4,800,000.00	其他专业机构投资者战略配售限售	12
24	中国银河证券股份有限公司	4,800,000.00	其他专业机构投资者战略配售限售	12
25	广发证券股份有限公司	4,800,000.00	其他专业机构投资者战略配售限售	12
26	华润深国投信托有限公司—华润信托·昌升15号集合资金信托计划	4,000,000.00	其他专业机构投资者战略配售限售	12
27	长城财富资管—工商银行—长城财富朱雀创睿六号资产管理产品	4,000,000.00	其他专业机构投资者战略配售限售	12
28	西部证券股份有限公司	4,000,000.00	其他专业机构投资者战略配售限售	12

注：1、限售期自基金上市之日起计算。

2、中信建投利信资本管理（北京）有限公司曾用名“元达信资本管理（北京）有限公司”。

2、本次解除限售后剩余的场内限售份额情况

序号	证券账户名称	限售份额总量（份）	限售类型	限售期（月）
----	--------	-----------	------	--------

1	国家电投集团江苏电力有限公司	160,000,000.00	原始权益人或其同一控制下的关联方战略配售限售	60
2	国家电投集团江苏电力有限公司	112,000,000.00	原始权益人或其同一控制下的关联方战略配售限售	36
3	中信建投证券股份有限公司	16,800,000.00	其他专业机构投资者战略配售限售	36
4	英大基金—交通银行—英大基金—国英锦瑞1号集合资产管理计划	12,000,000.00	其他专业机构投资者战略配售限售	36
5	华金证券—东兴证券股份有限公司—华金证券东兴1号基础设施基金策略FOF单一资产管理计划	12,000,000.00	其他专业机构投资者战略配售限售	36
6	中信证券股份有限公司	11,200,000.00	其他专业机构投资者战略配售限售	36
7	中国中金财富证券有限公司	11,200,000.00	其他专业机构投资者战略配售限售	36
8	中国银河证券股份有限公司	11,200,000.00	其他专业机构投资者战略配售限售	36
9	广发证券股份有限公司	11,200,000.00	其他专业机构投资者战略配售限售	36

（二）公募 REITs 场外份额解除锁定

本基金战略投资者战略配售份额均通过证券账户场内认购，不涉及场外份额解除锁定。

三、其他需要提示的事项

（一）近期经营情况

本基金投资的基础设施项目为位于江苏省盐城市滨海县滨海北部的中山河口至滨海港之间的近海海域及江苏省盐城市滨海县滨海港经济区的中电投滨海北区 H1#100MW 海上风电工程（简称“滨海北 H1 项目”）、中电投滨海北区 H2#400MW 海上风电工程（简称“滨海北 H2 项目”）及配套建设的国家电投集团滨海北 H1#海上风电运维驿站工程项目（简称“运维驿站”，与滨海北 H1 项目、滨海北 H2 项目合称为“基础设施项目”）。截至本公告发布之日，基础设施项目经营稳定，基金投资运作正常，外部管理机构履职正常。

基础设施项目 2024 年 1 月至 2 月间的主要运营数据如下：

运营指标/单位	1-2 月合计	1-2 月份完成情况 占预测情况的比重
发电量（亿千瓦时）	2.79	21.84%
上网电量（亿千瓦时）	2.73	21.83%
上网电价（元/千瓦时）	0.85	

注：根据滨海北 H1 项目和滨海北 H2 项目的上网电价批复，含税上网电价为 0.85 元/千瓦时，若燃煤发电上网基准价调整，则差价部分（国补）相应调整，保持上网电价 0.85 元/千瓦时至国补到期。

本基金底层基础设施项目在 2024 年 1 月至 2 月间累计实现发电量约 2.79 亿千瓦时，上网电量约 2.73 亿千瓦时。与 2023 年同期相比，发电量增长 34.67%，上网电量增长 34.71%。同时，与基金发行时历史三年（2020 年至 2022 年）同期平均值相比，发电量增长 20.94%，上网电量增长 20.80%。

（二）净现金流分派率的说明

2024 年 3 月 27 日，本基金在二级市场的收盘价（不复权）为 9.957 元，相较于发行价格 9.8 元/份涨幅为 1.60%。根据《中信建投国家电投新能源封闭式基础设施证券投资基金招募说明书（更新）》，本基金预测的 2023 年度 3-12 月可供分配金额为 757,077,654.97 元。基于上述预测数据，净现金流分派率的计算方法举例说明如下：

1、如投资人在首次发行时买入本基金，买入价格 9.8 元/份，该投资者的 2023 年度 3-12 月净现金流分派率预测值= $757,077,654.97 / (9.8 \times 800,000,000) = 9.66\%$ 。

2、如投资人在 2024 年 3 月 27 日通过二级市场交易买入本基金，假设买入价格为当天收盘价 9.957 元/份，以 2023 年度 3-12 月可供分配金额测算的该投资者的净现金流分派率预测值= $757,077,654.97 / (9.957 \times 800,000,000) = 9.50\%$ 。

需特别说明的是：

1、以上计算说明中的 2023 年可供分配金额系根据招募说明书披露的预测数据予以假设，不代表本基金实际年度的可供分配金额。

2、基金发行时的净现金流分派率预测值=预计年度可供分配现金流/基金发行规模，对应到每个投资者的净现金流分派率预测值=预计年度可供分配现金流/基金买入成本。基金二级市场交易价格上涨/下跌会导致买入成本上涨/下降，导致投资者实际的净现金流分派率降低/提高。

3、净现金流分派率不等同于基金的收益率。

（三）内部收益率（IRR）说明

内部收益率（IRR）为使得投资基金产生的未来现金流折现现值等于买入成本的收益率。基金管理人测算的内部收益率是基于本基金发售时的招募说明书和资产评估报告中的全周期各年净现金流测算年度可供分配金额，并结合分派时点等假设条件。假设投资者持有基金至到期，在未来现金流假设要素与资产评估报告所列的假设条件一致的情况下（即投资者各年净现金流分派情况与假设条件保持一致），随着二级市场交易价格上涨，投资者买入成本随之提高，投资者的实际内部收益率将相应降低。

假设投资者买入基金并持有到期，未来净现金流假设条件不变的情况下，内部收益率测算情况如下：

1、如投资人在首次发行时买入本基金，买入价格 9.8 元/份，该投资者内部收益率预测值约为 5.33%。

2、如投资人在 2024 年 3 月 27 日通过二级市场交易买入本基金，假设买入价格为当天收盘价 9.957 元/份，该投资者内部收益率预测值约为 5.05%。

特别说明的是：

以上测算系参考首次发行时预测的全周期各年假设数据，不代表后续年度的实际分配金额。如后续年度降低分配金额的，将影响届时内部收益率的计算结果。因未来经营的不确定性，不代表投资者未来实际可得的 IRR。

四、相关机构联系方式

如有疑问，投资者可登录基金管理人网站（www.cfund108.com）或拨打基金管理人客户服务电话（4009-108-108）了解、咨询有关详情。

五、风险提示

截至目前，本基金投资运作正常，无应披露而未披露的重大信息，基金管理人将严格按照法律法规及基金合同的规定进行投资运作，履行信息披露义务。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，也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。销售机构根

据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基金的风险等级进行划分，并提出适当性匹配意见。投资者在投资本基金前，应当认真阅读本基金基金合同、招募说明书、基金产品资料概要等法律文件，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，在了解产品情况及销售机构适当性意见的基础上，根据自身的投资目标、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和自身风险承受能力相适应，理性判断市场，自主判断基金投资价值，自主、谨慎做出投资决策，并自行承担投资风险。

特此公告。

中信建投基金管理有限公司

2024年3月29日