

中金山高集团高速公路封闭式基础设施

证券投资基金

2024 年第 2 季度报告

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：平安银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 7 月 19 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 7 月 18 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 4 月 1 日起至 6 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	中金山高集团高速公路封闭式基础设施证券投资基金
基金简称	中金山东高速 REIT
场内简称	山东高速（扩位简称：中金山东高速 REIT）
基金主代码	508007
交易代码	508007
基金运作方式	契约型、封闭式
基金合同生效日	2023 年 10 月 16 日
基金管理人	中金基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	400,000,000.00 份
基金合同存续期	19 年
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2023 年 10 月 27 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	本基金暂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	山东高速股份有限公司

2.2 基础设施项目基本情况说明

基础设施项目名称：鄄菏高速项目

基础设施项目公司名称	山东鄄菏高速公路有限公司
基础设施项目类型	收费公路
基础设施项目主要经营模式	鄄菏高速项目的运营管理，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	基础设施资产位于山东省菏泽市鄄城县、牡丹区，起点位于鄄城县李进士堂以北，与鄄城黄河大桥南端相接，终点位于菏泽市牡丹区，与日东高速公路日东枢纽互通主线连接。

§ 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4月1日-2024年6月30日)
1. 本期收入	74,540,338.97
2. 本期净利润	12,368,179.51
3. 本期经营活动产生的现金流量净额	60,090,222.03

3.2 其他财务指标

截至 2024 年 6 月 30 日，基金资产净值为 2,622,221,749.52 元，期末基金份额净值 6.5556 元。

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	47,769,836.88	0.1194	-
本年累计	96,817,364.15	0.2420	-
2023 年	356,177,335.07	0.8904	-

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	173,199,999.85	0.4330	-
本年累计	173,199,999.85	0.4330	-
2023 年	231,751,987.26	0.5794	-

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	12,368,179.51	-
本期折旧和摊销	31,174,459.94	-
本期利息支出	2,326,617.86	-
本期所得税费用	-	-
本期息税折旧及摊销前利润	45,869,257.31	-
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	60,016,560.98	-
2. 应收应付账款的变动	16,538,922.36	-
调减项		
1. 支付的利息及所得税费用	-2,326,617.86	-
2. 未来合理相关支出预留，包括重大资本性支出（如固定资产正常更新、大修、改造等）、未来合理期间内的债务利息、运营费用等	-72,328,285.91	-
本期可供分配金额	47,769,836.88	-

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、应交税费以及未来合理期间内的运营费用、养护支出等，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

无。

§ 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

基金管理人委托山东高速股份有限公司（以下简称“山东高速股份”）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，基础设施项目公司整体运营平稳。报告期内项目公司实现通行费收入（含税）7,670.29 万元（日均含税通行费收入 84.29 万元），年化后完成首发招募说明预测值（28,437 万元）的 108.48%，同比降低 10.03%，环比增长 7.91%。报告期内，日均自然车流量（不含免费车）为 22,394 辆/天，同比降低 4.60%，环比降低 2.42%；其中客车日均自然车流量为 9,353 辆/天，同比降低 13.94%，环比降低 22.89%；货车日均自然车流量为 13,040 辆/天，同比增长 3.45%，环比增长 20.53%。

通行费收入同比降低的主要原因分析：一是路网结构变化带来一定的影响，濮阳至阳新高速公路部分路段逐步开通、济南至菏泽高速公路通行条件改善对鄄菏高速有一定的分流影响。二是 2024 年 2 季度受部分地区高温、降雨等天气因素影响，客车车流量有所降低。

通行费收入环比增长的主要原因分析：2024 年 2 月受恶劣天气及春节免费通行的影响导致 2024 年 1 季度通行费收入基数较低。

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：山东鄄菏高速公路有限公司

序号	构成	本期（2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日）	
		金额（元）	占该项目总收入比例（%）
1	通行费收入	73,712,281.96	99.96
2	其他收入	27,801.88	0.04
3	合计	73,740,083.84	100.00

注：1、上表中通行费收入与通行费拆账收入存在差异的原因是通行费拆账收入数据在次月获得，财务报表确认当月收入时为预估收入。

2、其他收入指清障救援收入。

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：山东鄄菏高速公路有限公司

序号	构成	本期（2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日）	
		金额（元）	占该项目总成本比例（%）
1	营业成本	50,334,806.20	38.60
2	税金及附加	616,769.70	0.47
3	财务费用	79,396,229.93	60.88
4	管理费用	66,589.26	0.05
5	其他成本/费用	-	-
6	合计	130,414,395.09	100.00

注：本报告期项目公司财务费用主要为股东借款利息。

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：山东鄄菏高速公路有限公司

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 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日）
				指标数值
1	毛利率	毛利润额/营业收入×100%	%	31.74
2	净利率	净利润/营业收入×100%	%	23.74
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×100%	%	63.52

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。

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（2023 年 10 月 17 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。

基础设施项目公司现有银行账户共四个，包括原有开立在平安银行股份有限公司（简称“平安银行”）的运营收入账户、基本账户和通行费备付金账户三个账户，以及

本期在中国农业银行股份有限公司新开立的纳税专户（因税款缴纳的属地化管理，基金管理人按照税务部门要求在菏泽当地开立纳税专户，纳税专户按照账户监督协议约定接受基金管理人、托管人监管）。

运营收入账户用于收取专项计划通过专项计划账户发放的《股东借款协议》项下股东借款、归集项目公司各类现金资产、收取标的高速公路的车辆通行费收入和其他所有各类收入。基本账户用于收取运营收入账户拨付的项目公司运营资金。通行费备付金账户用于向运营收入账户划付清分结算后的通行费收入、收取运营收入账户划付的通行费清分结算备付金等。纳税专户专门用于向税务主管部门缴纳项目公司应缴税款。

基础设施项目公司本期收入归集总金额 78,091,369.29 元，对外支出总金额 11,411,957.37 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



图片来源：施伟拔咨询(深圳)有限公司，2024

①濮阳至阳新高速开通影响

2023 年，濮阳至阳新高速公路部分路段逐步开通，对濮阳至菏泽、商丘及开封东部的交通有一定分流影响，2024 年该影响仍然存在。

②国道 G240 杨集黄河大桥开通影响

根据菏泽日报社报道，国道 G240 杨集黄河特大桥及接线工程开通时间预计由 2024

年 9 月底延迟至 2024 年底（最终完工开通时间届时以实际为准），据此预计该项目 2024 年对鄆菏高速将无影响。该项目未来开通后区域内新增一条跨黄河六车道一级公路，预计对目前鄆菏高速上跨黄河的短途车辆会有分流影响。

③济菏高速改扩建影响

根据齐鲁高速公路股份有限公司（济菏高速的运营管理公司，简称“齐鲁高速”）相关公告，济菏高速自 2023 年 2 月 16 日起至 2024 年 12 月 31 日封闭菏泽到济南方向半幅车道进行改扩建施工。自 2023 年 12 月 26 日济南到菏泽方向通行全面转序至新建半幅以来，该方向由单向两车道变为单向四车道，道路通行能力显著提升，预计济南到菏泽方向因济菏高速改扩建而转移到鄆菏高速的部分车辆将回流到济菏高速。

与上述竞争性道路相比，鄆菏高速也具有一些较为显著的竞争优势，包括但不限于：一是鄆菏高速属于交通干道，区位优势显著。鄆菏高速是国家高速公路网德州-商丘-上饶高速公路的重要组成部分，属于国家高速公路网首都放射主干线北京至台北高速公路（编号 G3）的西并行线组成部分，属于交通干道。二是鄆菏高速收费标准具有竞争优势。按照山东省高速公路收费标准，鄆菏高速项目属于 2018 年前开通高速公路，其执行的收费标准比 2018 年后新建的高速公路低；更低的出行成本有利于吸引交通量。鄆菏高速周边人口、经济和产业发展的较好的势头，预计会为鄆菏高速的交通量增长提供持续助力。

（2）拟采取的相应措施

基金管理人、外部管理机构将持续关注济菏高速改扩建、国道 G240 杨集黄河大桥建设进展以及鄆菏高速车流量变化情况，与交通主管部门、相关建设单位保持沟通。

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

本报告期内不存在对外借入款项情况。

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

本报告期内不存在上年同期情况。

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的情况。

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	2,387,578.44
4	其他资产	-
5	合计	2,387,578.44

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

本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期未被监管部门立案调查，未有在本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			
李耀光	本基金的基金经理	2023 年 10 月 16 日	-	10.5 年	曾负责东久中国智能制造产业园资产支持专项计划、新派公寓权益型房托资产支持专项计划、晋江房建安置房资产支持专项计划等多单资产证券化项目，项目类型覆盖产业园区及仓储、住房租赁、保障房及城市基础设施等基础设施领域，以及商业办公等不动产领域。	李耀光先生，经济学硕士，CFA、CPA。历任中国农业银行股份有限公司托管业务部经理，中信证券股份有限公司资产管理部高级经理，摩根士丹利华鑫证券有限责任公司（现“摩根士丹利证券（中国）有限公司”）固定收益部经理和副总裁、全球资本市场部副总裁和执行董事，渤海汇金证券资产管理有限公司资本市场部总经理、金融市场部总经理（兼）、不动产投资管理部总经理（兼）、公司副总经理。现任中金基金管理有限公司

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			
						司副总经理。
赵一飞	本基金的基金经理	2023 年 10 月 16 日	-	9 年	曾负责北京、西北、江浙、广东地区电力、储能项目尽调、估值、投资收购和投后管理,对发电、供热、储能等行业产业链条上的资产评估与交易有成熟的经验。	赵一飞先生,理学硕士,CFA,FRM。历任中核能源科技有限公司项目经理;国网绿色能源有限公司项目专责,国网综合能源服务集团有限公司电力环保事业部项目经理、新能源事业部项目经理、储能事业部项目经理;光大保德信基金管理有限公司投资经理。现任中金基金管理有限公司创新投资部高级经理。
吕静杰	本基金的基金经理	2023 年 10 月 16 日	-	8 年	曾负责招商局公路网络科技控股股份有限公司合并报表、预算及信息披露等集团财务管理工作,并参与高速公路项目投资的财务尽调工作,项目类型覆盖高速公路、光伏等基础设施领域。	吕静杰女士,经济学学士,CPA。历任信永中和会计师事务所项目经理;招商局公路网络科技控股股份有限公司财务部高级经理;国金基金管理有限公司投资经理。现任中金基金管理有限公司创新投资部高级经理。

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 585,656.89 元，资产支持证券管理人的管理费计提金额 103,351.43 元，基金托管人的托管费计提金额 68,900.65 元，外部管理机构的浮动管理费用计提金额 760,515.19 元。

6.3 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。本报告期内，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，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-山高集团鄆菏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，基金管理人委托山东高速股份作为外部管理机构，负责基础设施项目的部分运营管理职责。基金管理人、项目公司和山东高速股份根据签订的《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，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%，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%，上半年国民经济运行总体平稳，稳中有进。根据交通运输部数据，2024

年 1-5 月，全国完成公路货运量约 162.23 亿吨，同比增速 4.4%；公路客运量约 48.37 亿人次，同比增速 12.4%。

根据山东省统计局数据，2024 年 1-5 月，全省规模以上工业增加值同比增长 8.5%。根据交通运输部数据，2024 年 1-5 月，山东省完成公路货运量约 11.60 亿吨，同比增速 3.2%；公路客运量约 2.40 亿人次，同比增速 14.3%。2024 年 1-5 月，山东省经济延续稳定向好态势。

根据菏泽市统计局数据，2024 年 1-5 月，全市规模以上工业增加值同比增长 9.3%，高于山东省 0.8 个百分点，1-5 月全市经济运行平稳向好。

（2）高速行业分析

①《2023 年交通运输行业发展统计公报》正式发布，我国已建成全球最大的高速公路网。2024 年 6 月 18 日，根据交通运输部发布的《2023 年交通运输行业发展统计公报》，2023 年末我国高速公路里程 18.36 万公里、比上年增加 0.64 万公里，国家高速公路里程 12.23 万公里、比上年增加 0.24 万公里，已建成全球最大的高速公路网。

②高速公路数字化转型升级获国家政策支持，成为高速公路行业未来重点发展方向。2024 年 5 月 1 日，根据财政部、交通运输部印发的《关于支持引导公路水路交通基础设施数字化转型升级的通知》，为推进公路水路交通基础设施数字转型、智能升级、融合创新，加快发展新质生产力，自 2024 年起，通过 3 年左右时间，我国将支持 30 个左右的示范区域，打造一批线网一体化的示范通道及网络，力争推动 85%左右的繁忙国家高速公路实现数字化转型升级。

③安全运营依然是高速公路行业重点任务。根据交通运输部、公安部联合印发《关于进一步推进公路安全设施和交通秩序管理精细化提升工作的通知》，各地要因地制宜精心打造公路安全精品路。到 2025 年，公路安全精品路建设取得重大进展，公路安全保障能力系统提升、安全管理水平显著提升、交通事故明显下降，高水平适应经济高质量发展，有力支撑交通强国建设，满足人民美好生活需要。

④山东省货车 ETC 85 折优惠政策将延长至 2025 年底。根据山东省交通运输厅 5 月 14 日发布信息，对行驶山东省高速公路安装 ETC 套装设备的货车用户继续实行 85 折通行费优惠，政策执行期延长至 2025 年底。该优惠政策一方面可降低全社会物流成本，另一方面也可吸引货车行驶高速公路，与本基金招募说明书预测情况一致。

§ 7 基金份额变动情况

单位：份

报告期期初基金份额总额	400,000,000.00
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	400,000,000.00
-------------	----------------

§ 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份额。

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份额。

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 其他有助于投资者了解的信息

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	德商高速公路鄆城至菏泽段	/
币种	人民币	/
项目公司形成/购买资产时间	2015 年 12 月 28 日	/
基金购买资产时间	2023 年 10 月 17 日	注 1
初始成本（元）	2,325,487,445.94	注 2
资产组评估价值（元）	2,797,026,100.00	注 3
采用成本法计量的账面价值（元）	2,267,590,731.40	注 4
基金购买资产的投资成本（元）	2,982,995,745.00	/
报告期	2024 年 2 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《鄆荷高速特许经营权基础设施价值项目资产评估报告》（中联评报字【2024】第 0572 号）；

4、本项目公司采用历史成本法对基础设施项目计量，为成本法计量的基础设施项目账面价值。

§ 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山高集团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) 《中金山高集团高速公路封闭式基础设施证券投资基金基金合同》

(三) 《中金山高集团高速公路封闭式基础设施证券投资基金托管协议》

(四) 《中金山高集团高速公路封闭式基础设施证券投资基金招募说明书》

(五) 关于申请募集中金山高集团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 7 月 19 日