

华泰紫金江苏交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金

2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：华泰证券（上海）资产管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇二四年八月二十九日

§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董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、收益分配情况、财务会计报告和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 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	5
2.1 基金产品基本情况	5
2.2 基础设施项目基本情况说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 基础设施资产支持证券管理人和外部管理机构	7
2.5 信息披露方式	7
2.6 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金收益分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 其他财务指标	8
3.3 基金收益分配情况	8
3.4 报告期内基金及资产支持证券费用收取情况的说明	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	12
4.3 基础设施项目运营相关财务信息	14
4.4 基础设施项目运营相关通用指标信息	16
4.5 基础设施项目公司经营现金流	16
4.6 基础设施项目公司对外借入款项情况	17
4.7 基础设施项目投资情况	17
4.8 抵押、查封、扣押、冻结等他项权利限制的情况	17
4.9 基础设施项目相关保险的情况	17
4.10 基础设施项目未来发展展望的说明	18
4.11 其他需要说明的情况	18
§5 除基础设施资产支持证券之外的投资组合报告	19
5.1 报告期末基金资产组合情况	19
5.2 报告期末按债券品种分类的债券投资组合	19
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	19
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	19
5.5 投资组合报告附注	19
5.6 报告期末其他各项资产构成	20
5.7 投资组合报告附注的其他文字描述部分	20
5.8 报告期内基金估值程序等事项的说明	20
5.9 报告期内基金资产重大减值计提情况的说明	20
§6 管理人报告	20
6.1 基金管理人及主要负责人员情况	20
6.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	25
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	25
6.4 管理人对报告期内基金的投资和运营分析	25
6.5 管理人对报告期内基金收益分配情况的说明	26

6.6	管理人对宏观经济及行业走势的简要展望	26
6.7	管理人对关联交易及相关利益冲突的防范措施	27
§ 7	托管人报告	27
7.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	27
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	27
7.3	托管人对本年度报告/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	28
§ 8	中期财务报告（未经审计）	28
8.1	资产负债表	28
8.2	利润表	32
8.3	现金流量表	35
8.4	所有者权益变动表	38
8.5	报表附注	42
§ 9	基金份额持有人信息	86
9.1	基金份额持有人户数及持有人结构	86
9.2	基金前十名流通份额持有人	86
9.3	基金前十名非流通份额持有人	88
9.4	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	89
§ 10	基金份额变动情况	90
§ 11	重大事件揭示	90
11.1	基金份额持有人大会决议	90
11.2	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	90
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	90
11.4	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	90
11.5	基金投资策略的改变	90
11.6	为基金进行审计的会计师事务所情况	90
11.7	为基金出具评估报告的评估机构情况	90
11.8	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	91
11.9	其他重大事件	91
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息	93
§ 13	备查文件目录	93
13.1	备查文件目录	93
13.2	存放地点	94
13.3	查阅方式	94

§ 2 基金简介

2.1 基金产品基本情况

基金名称	华泰紫金江苏交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金	
基金简称	华泰江苏交控 REIT	
场内简称	苏交 REIT	
基金主代码	508066	
交易代码	508066（前端）	-（后端）
基金运作方式	契约型封闭式	
基金合同生效日	2022 年 11 月 3 日	
基金管理人	华泰证券（上海）资产管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	400,000,000.00 份	
基金合同存续期	基金合同生效之日起 12 年	
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2022-11-15	
投资目标	本基金主要投资于基础设施资产支持证券的全部份额,通过基础设施资产支持证券投资于项目公司,最终取得由项目公司持有的基础设施项目的完全所有权或经营权利。基金管理人通过主动的投资管理和运营管理,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,并争取提升基础设施项目价值。	
投资策略	初始投资策略、基础设施项目的购入策略、基础设施项目的出售及处置策略、融资策略、基础设施项目的运营管理策略、权属到期后的安排、固定收益投资策略等。	
业绩比较基准	本基金不设置业绩比较基准。	
风险收益特征	本基金为基础设施证券投资基金,通过主动运营管理基础设施项目,以获取基础设施项目车辆通行费等稳定的现金流为主要	

	目的，其风险收益特征与股票型基金、债券型基金和货币市场基金不同；一般市场情况下，长期风险和收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。
基金收益分配政策	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 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式为现金分红；每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。
资产支持证券管理人	华泰证券（上海）资产管理有限公司
外部管理机构	江苏沿江高速公路有限公司 -

2.2 基础设施项目基本情况说明

基础设施项目名称：沪苏浙高速公路

基础设施项目名称	江苏沪苏浙高速公路有限公司
基础设施项目类型	收费公路
基础设施项目主要经营模式	沪苏浙高速公路收入主要来源于收费业务、清障业务和经营租赁，具体为车辆通行费收入、清排障业务收入、广告牌租赁和服务设施租赁收入。
基础设施项目地理位置	沪苏浙高速公路位于江苏省苏州市吴江区，起于：上海市青浦区与江苏省苏州市吴江区的交界处；止于：江苏省苏州市吴江区与浙江省湖州市的交界处

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		华泰证券（上海）资产管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	白海燕	王小飞
	联系电话	4008895597	021-60637103
	电子邮箱	baihaiyan@htsc.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		4008895597	021-60637228
传真		021-28972120	021-60635778
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区基	中国北京西城区金融大街25号

	隆路6号1222室	
办公地址	上海市浦东新区东方路18号21楼	中国北京西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	崔春	张金良

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	华泰证券（上海）资产管理有限公司	江苏沿江高速公路有限公司
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区基隆路 6 号 1222 室	南京市中山东路 291 号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区东方路 18 号 21 楼	常熟市海虞北路 518 号
邮政编码	200120	215505
法定代表人	崔春	阚有俊

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	https://htamc.htsc.com.cn/
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区锦什坊街 26 号

§ 3 主要财务指标和基金收益分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

期间数据和指标	报告期（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日）
本期收入	176,506,087.78

本期净利润	33,013,302.13
本期经营活动产生的现金流量净额	78,577,215.61
期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)
期末基金总资产	2,073,185,267.97
期末基金净资产	1,957,931,257.45
期末基金总资产与净资产的比例(%)	105.89%

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、基金管理人的浮动管理费根据项目公司年度审计数据进行计算，因截至本期末财务数据未经审计，本表中的“本期净利润”未扣减相应浮动管理费。

3.2 其他财务指标

单位：人民币元

数据和指标	2024 年
期末基金份额净值	4.8948
期末基金份额公允价值参考净值	7.3615

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	127,424,900.39	0.3186	-
2023 年	227,778,602.49	0.5694	-
2022 年	83,734,641.39	0.2093	-

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	97,743,958.60	0.2444	2024 年 5 月进行 2023 年度第二次分红, 收益分配基准日 2023 年 12 月 31 日, 实际分配金额 97,743,958.60 元
2023 年	213,764,091.12	0.5344	2023 年 10 月进行 2023 年度第一次分红, 收益分配基准日 2023 年 6 月 30 日, 实际分配金额 130,032,066.11 元; 2023 年 4 月进行 2022 年度第一次分红, 收益分配基准日 2022 年 12 月 31 日, 实际分配金额 83,732,025.01 元
2022 年	-	-	-

注: 本基金于 2022 年 11 月 3 日成立, 未满 3 年。

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	33,013,302.13	-
本期折旧和摊销	91,065,329.72	-
本期利息支出	-1,604,052.70	-
本期所得税费用	0.00	-
本期税息折旧及摊销前利润	122,474,579.15	-
调增项		
1. 期初现金余额	206,926,447.34	-
调减项		
1. 尚未分配的 2023 年可供分配金额	-97,746,536.38	-
2. 应收和应付项目的变动	-35,386,395.01	-
3. 其他资本性支出	-330,680.72	-
4. 确认的其他收益	-588,548.40	-
5. 未来合理的相关支出预留	-67,923,965.59	-
本期可供分配金额	127,424,900.39	-

注: 1、“未来合理的相关支出预留”预留了应付账款、应交税费、平望服务区的土地租金、应付公路统筹发展费、已收的保证金及押金等对应的资金;

2、沪苏浙高速公路的通行费收入呈现出一定的季节性特征，且费用并非在一年内平均发生，故每个季度的基金可供分配金额不等；

3、本基金 2024 年 1-6 月合并报表未经审计，本期基金可供分配金额为本期未经审计基金合并净利润基础上合理调整后的计算结果。2024 年各期基金可供分配金额之和可能与 2024 年度基金审计报告中的年度基金可供分配金额存在偏差，2024 年度基金可供分配金额以审计报告金额为准。

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

截止 2024 年 6 月 30 日，本报告期内计提基金管理人管理费 3,017,414.40 元，计提基金托管人托管费 100,580.48 元，截至本报告期末以上费用尚未支付。本报告期内支付 2022 及 2023 年管理费 13,831,953.84 元，支付 2022 及 2023 年托管费 355,015.20 元。外部管理机构的管理费包括基础服务费用和浮动服务费用，其中本期财务预提 2024 年 1 至 6 月基础服务费用为 33,506,735.70 元并已支付，支付 2022 年基础服务费用 10,333,645.16 元，浮动服务费本期未计提，待年末出具审计报告后进行结算。

§ 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、资产支持证券管理人和项目公司与江苏沿江高速公路有限公司（以下简称“运营管理机构”）签署了《华泰紫金江苏交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金运营管理服务协议》（以下简称《运营管理服务协议》），委托运营管理机构负责运营管理服务，负责沪苏浙高速公路的运营管理工作。基金管理人按照《运营管理服务协议》对运营管理机构进行监督和考核。

报告期内，基础设施项目整体运营良好，无安全事故发生。报告期内实现车辆通行费收入（不含税和统筹发展费）17,174.86 万元，较 2023 年同期减少 7.95%。报告期内日均自然车流量 48,856 辆，较 2023 年同期增长 5.56%；日均收费自然车流量 36,197 辆，较 2023 年同期减少 6.75%。其中，客车日均自然车流量 42,695 辆，较 2023 年同期增长 7.28%；客车

日均收费自然车流量 30,036 辆,较 2023 年同期减少 7.10%;货车日均自然车流量/货车日均收费自然车流量 6,161 辆,较 2023 年同期减少 5.04%,日均收费自然车流量客货比 83:17。客车收入(不含税和统筹发展费)11,989.22 万元,日均 65.87 万元,较 2023 年同期减少 7.64%;货车收入(不含税和统筹发展费)5,185.64 万元,日均 28.49 万元,较 2023 年同期减少 8.80%,通行费收入客货比为 70:30。报告期内,沪苏浙高速公路客车、货车通行费收费标准无变化。

注:数据来源于江苏省高速公路联网运营管理中心。因补缴退费等原因,与财务口径的车辆通行费收入存在些许差异,最终以年度审计报告数据为准。按照《收费公路车辆通行车型分类》(JT/T489-2019)规定,1 类客车指车长小于 6000mm 且核定载人数不大于 9 人的载客汽车,法定节假日免费通行指 1 类客车中 7 座以下(含 7 座)载客车辆免费通行。考虑 1 类客车中 8-9 座的载客车辆法定节假日通行情况较少,本处收费自然车流量由自然车流量扣除法定节假日通行的的 1 类客车计算得到。

在基金管理人的统筹管理下,项目公司与运营管理机构通力合作,以安全保畅为基础,多措并举提升道路通行效率,定期召开运营管理会议,进一步推动运营管理工作的规范化和精细化,实现降本增效的目标。营运方面,收费稽核工作“一站一策”有突破,每个收费站建立稽核骨干队伍,通过稽核交流群、稽核经验分享交流会等举措,提升全员稽核能力,有效形成“指标评价+现场稽核”的闭环管控监督链。工程养护方面,各项技术指标良好,一是提倡巡查工作做细做实,上半年累计开展道路日常巡查 183 次计 18240 公里,开展桥梁经常性检查 438 座次,涵洞经常性检查 665 次,开展特殊巡查和专项巡查、联合巡查 9 次,开展穿跨越项目专项巡查 48 余次,开展各类隐患排查 6 次。二是提倡预防性养护和全寿命周期成本理念,积极处理巡查检查发现的问题,上半年修补坑塘 65 处,更换护栏板 249 块,立柱 91 根、补缺隔离栅 769 片,新增及更换标志牌版面 296.19 m²。联合路政部门进行了 1 次涉航桥墩隐患排查、4 次桥下堆积物清理和普法宣传工作,利用无人机对人工不便检查的通航桥孔进行辅助性检查,全面提升道路管养水平。安全生产方面,按制度要求完成各项安全生产工作,积极引入第三方安全管理机构,进一步提高安全管理水平。保畅方面,强化一路多方协同机制,厘清各单位职责,上半年平均 30 分钟到达率 100%,60 分钟通车率为 98.55%,有效地保障了道路通行效率。服务区方面,做好节日保畅,推进“一区一策”建设,充分遵循修旧利废的原则,积极开展卫生间亮化专项提升活动。综合方面,根据 REITs 运营管理工作的实际需要,修编项目公司管理制度,项目公司的档案、流程、采购、会议、公文等各项工作已取得较好的标准化管理成果,项目公司治理水平进一步提升。

报告期在投资人关系、ESG 和交通行业荣誉表彰均有所收获。2024 年 3 月 20 日，协同长三角 REITs 产业联盟组织“走进 REIT”活动莅临项目公司现场调研，接待了来自保险、券商、基金、银行理财、产业资本等 50 多家 REITs 投资机构近 100 名投资人代表的现场调研，全面展示了苏交 REIT 的运营情况。2024 年 4 月 8 日，发布了 2023 年度华泰江苏交控 REIT 的 ESG 报告，这是苏交 REIT 的首份年度 ESG 报告，报告秉承客观、透明的原则，向份额持有人等利益相关方展示了苏交 REIT 在环境、社会和治理方面的不懈努力。2024 年 3 月，项目公司《G50 沪渝高速江苏段桥梁智慧管养实践》荣获中国公路学会 2023 年度“桥梁创新工程”（运维管理创新类）。

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

本基础设施项目高速公路属于交通运输行业，交通运输是国民经济中基础性、先导性、战略性产业和重要的服务性行业，是可持续发展的重要支撑，也直接影响着人民群众生产生活水平与幸福感、获得感。交通运输部发布的《2023 年交通运输行业发展统计公报》，截至 2023 年末，全国公路里程 543.68 万公里，高速公路里程 18.36 万公里（占比 3.4%）。我国高速公路经过大规模的建设发展，已经从增量为主逐渐转变为增量与存量并存的阶段。随着公路通行能力和运输效率的不断提高，有力地促进了经济社会的持续健康发展。

交通运输部网站 2024 年 1~6 月公路水路运输量统计数据显示 2024 年上半年全国公路客运量 58.24 亿人次，同比增速 11.2%；上半年全国公路货运量 193.73 亿吨，同比增速 4.0%。具体到与路段相关的上海、江苏和浙江，上半年三省市公路客运量分别为 0.35 亿人次、3.84 亿人次和 3.74 亿人次，同比增速分别为 5.4%、6.0%和 9.7%；上半年三省市公路货运量分别为 2.45 亿吨、9.08 亿吨和 11.29 亿吨，同比增速分别为 1.7%、6.0%和 9.6%。从上半年全国和上海、江苏及浙江的客运及货运数据显示全国及长三角区域的公路运输量正处于增长阶段，按此预期发展下去，高速公路车流量将有较好的预期增长。

根据国家统计局初步核算，根据国家统计局初步核算，2024 年一季度国内生产总值 29.63 万亿元，按不变价格计算，环比增长 1.6%，同比增长 5.3%，高于 2023 年第四季度同比增速；2024 年上半年国内生产总值 61.68 万亿元，按不变价格计算，同比增长 5.0%，比 2024 年一季度同比增速下降 0.3%。总体来看，2024 年上半年经济运行情况明显优于 2023 年，交通运输行业呈现较快的复苏形势，对高速公路行业收入的增长产生正向预期。

4.2.2 基础设施项目所属行业竞争情况的说明

高速公路行业由于其特殊的产品特性具有不可移动的典型特征，从而具有较强的区域性，不同区域以及不同路线的高速公路之间不可相互替代。高速公路行业主要受不同区域的经济水平、工业化程度、消费水平等因素的影响。

从整个交通运输行业来看，高速公路起着重要的通行及连接作用，其他交通设施的完善和升级一定程度上会对高速公路行业带来竞争与挑战。航空运输业在长途运输中有着速度快、不受地形条件限制等优点，但短途运输成本高、受天气环境限制较多；高速公路行业在短途运输中具有快捷、省时、服务设施齐全等优势，因此航空运输行业对高速公路不会产生实质性影响。铁路运输业在长途运输中具有连续性强、运输速度快、运输量大等优点，与高速公路行业的承运服务对象和市场有一定的重合与差异，因此铁路运输与高速公路存在一定的竞争关系，特别是近年来迅速发展的高速铁路对高速公路客运有所分流，但截至目前对高速公路货运影响较小。城际轨道，又称城际客运专线铁路，是指专门服务于相邻城市或城市群内部之间的旅客运输专线铁路，具有运量大、速度快、安全、准点、保护环境、节约能源和用地等特点，给市民提供了另一种更方便、更快捷的出行方式，未来随着城际轨道的普及，将对高速公路客运有所分流，但是对高速公路的货运影响较小。高速公路相比普通公路具有快捷安全、省时省油、服务设施齐全等优势，但普通公路免费通行也给高速公路带来一定影响。

根据高速公路行业的特性，只有等级相同、起点、终点相同或相似、路线走向基本平行且间隔较近的公路之间才会产生同业竞争。沪苏浙高速公路作为上海至重庆 G50 国家重点干线公路的重要路段，完善了长三角地区的交通路网。根据《江苏省高速公路网规划(2017-2035 年)》目标：到 2035 年，节点连通度提高至 2.0，总体上实现四路连通。相关联通路段不断完善拓展，有助于沪苏浙高速公路承接更多地区的车流通过。同时，基础设施项目所处的江苏省高速公路路网较密集，已形成较为完善的高速公路网络，未来出现竞争性道路的可能性较小。此外，沪苏浙高速公路在其所处区域高速路网中功能较为独立，暂无其他替代道路分担其交通压力。

报告期内，根据公开媒体的消息，本项目路段周边路网及相关交通工程进展如下：1、G50 安徽段：2024 年 3 月 8 日 8 时至 2024 年 9 月 29 日 17 时，封闭芜宣枢纽至广德收费站下行线、广德东收费站往浙江方向下行线（数据来源：大皖新闻）。2、G50 浙江段：2024 年 6 月 22 日至 2024 年 9 月 29 日，申苏浙皖高速浙皖省界至长兴西收费站上海方向高速公路主线封闭施工（数据来源：长兴县人民政府网站）。3、G50 上海段：2024 年 4 月 30 日 G50 沪渝高速公路拓宽改建工程勘察设计招标中标结果公告发布，G50 改扩建项目在 2024 年上

海市重大工程清单中，被列为预备项目（数据来源：《西虹桥青浦生活》微信公众号）。4、S17 苏台高速：苏台高速公路七都北至桃源段按计划今年底将完成建设（数据来源：《苏州日报》微信公众号）。5、G1522 常台高速：2024 年 7 月 11 日常台高速公路尹山枢纽至苏浙省界段扩建工程获得国家批复，计划于 2025 年开工，2029 年完工。（来源：网易）6、沪苏湖高铁：目前全线铺轨全部完成，预计 7 月底转入静态验收阶段，年底具备开通运营条件（数据来源：《苏州发布》微信公众号）。基金管理人和运营管理机构一直关注周边路网变化对项目的影 响，主动对接相关的运营管理机构，积极应对周边交通工程变化对沪苏浙高速的正向和反向影响。

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：

江苏沪苏浙高速公路有限公司

金额单位：人民币元

序号	构成	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年同期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 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	172,675,245.99	98.23	186,894,245.00	98.51
2	清障收入	184,113.21	0.10	179,964.15	0.09
3	经营租赁收入	2,931,258.87	1.67	2,648,717.97	1.40
4	其他收入	-	-	-	-
5	合计	175,790,618.07	100.00	189,722,927.12	100.00

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

无。

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：

江苏沪苏浙高速公路有限公司

金额单位：人民币元

序号	构成	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年同期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 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	收费业务成本	130,387,816.38	97.02	119,714,239.13	96.08
2	清障成本	532,298.12	0.40	1,648,437.00	1.32
3	经营租赁成本	3,469,132.13	2.58	3,240,944.26	2.60
4	其他成本/费用	-	-	-	-
5	合计	134,389,246.63	100.00	124,603,620.39	100.00

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

2024 年 1-6 月份收费业务成本高于去年同期的原因：一是因为 2024 年上半年无形资产摊销高于上年同期；二是 2023 年一季度出具 2021 年交安提质升级的决算报告，对应下调当个季度路桥养护费。

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：

江苏沪苏浙高速公路有限公司

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 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年同期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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%	%	23.55	34.32
2	净利率	净利率 = 净利润 / 营业收入 * 100%	%	-46.48	-35.24
3	息税折旧摊销	息税折旧摊销前净	%	76.68	81.62

	前净利率	利率=(利润总额+利息支出+折旧摊销)/营业收入×100%			
--	------	-------------------------------	--	--	--

注：1、根据江苏交通控股有限公司的《企业会计制度》，收费业务成本包括了安全设施维护、路面维护等支出，养护支出直接计入当期成本，而非计入资本性支出，导致项目公司营业成本偏高，直接影响当期损益； 2、项目公司 2024 年上半年、2023 年上半年净利润扣除了专项计划的股东借款利息支出，若不考虑该项安排，则项目公司 2024 年上半年、2023 年上半年净利率分别为 23.97%、33.83%。

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

2024 年 1-6 月份收费业务成本高于去年同期的原因：一是因为 2024 年上半年无形资产摊销高于上年同期；二是 2023 年一季度出具 2021 年交安提质升级的决算报告，对应下调当个季度路桥养护费。

4.4 基础设施项目运营相关通用指标信息

报告期内收费道口通行车辆总数为 545.32 万辆，同比增长 5.96%，日均 3.0 万辆。其中入口车流量 267.97 万辆，日均 1.48 万辆，客货比 82:18；出口车流量 277.35 万辆，日均 1.53 万辆，客货比 82:18。

报告期内收费站出口免费车流量共计 401,656 辆，其中节假日免费车流量 395,865 辆，绿通车免费车流量 5,040 辆，紧急车 35 辆，军警车及其他车 15 辆；联合收割机 701 辆。

报告期内收费道口通行费收入为 16,800.96 万元，同比减少 11.12%，日均 92.31 万元。其中，绿通车减免金额 301.73 万元，收割机减免 15.39 万元，紧急车减免金额 486.58 元，军车减免 649.85 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

目前沪苏浙项目公司共有现金通行费账户和资金运作账户及定期存款/七天通知存款账户共 9 个。

现金通行费账户（1 个汇总账户）主要用于接收自现金通行费（6 个收费口账户）划转的现金通行费。定期存款/七天通知存款账户（1 个）主要用于为增加利息收入，进行的定期及七天通知存款。资金运作账户（1 个）主要接收基础设施项目运营收入及其他收入资金，包括通行费拆账收入，支付包括因基础设施资产的运营而承担的经营成本及费用、相关税费

等支出；用于债务清偿、分配股东红利、支付基础服务费、缴纳统筹发展费、进行合格投资等相关货币资金收入和支出。本报告期内（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日），年初银行存款 198,521,512.42 元，本期收款 204,689,874.18 元。本期支付统筹发展费、工程款、营运成本、管理费用及税金等共 107,416,843.38 元，已归集 113,811,012.38 元至专项计划及基金，截止 6 月 30 日项目公司银行余额 181,983,530.84 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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

4.8 抵押、查封、扣押、冻结等他项权利限制的情况

无。

4.9 基础设施项目相关保险的情况

2023 年 12 月 28 日，项目公司与中国人民财产保险股份有限公司南京市分公司签订了保险合同，向保险公司投保了江苏沪苏浙高速公路有限公司财产一切险（保险单号码：PQYC202332010000005029 和 PQYC202332010000005024）和公众责任险（保险单号码：

PZCG20233201000005936), 保险期限均为: 2024 年 1 月 1 日零时起至 2024 年 12 月 31 日 24 时止。具体保险内容如下: 沪苏浙高速财产一切险总保额为 3,813,960,655.79 元, 每次事故绝对免赔额人民币 5000 元; 公众责任险每次事故绝对免赔额 0 元, 每次事故及累计赔偿限额人身伤亡及财产损失合计: 人民币 2000 万元, 每人赔偿限额人民币 100 万元, 其中每次事故是指一次事故或一个事故引起的一系列事故。

2023 年 12 月 30 日项目公司与中国太平洋财产保险股份有限公司江苏分公司签订了 2024 年度机动车辆保险服务协议(沪苏浙), 为项目公司的公务用车及生产用车进行了投保, 机动车辆投保种包括交强险、车船险、车辆损失险、第三者商业责任险(限额 100 万元)、班车加保车上人员责任险, 2 万/座, 机动车损失保险按车辆实际价值确定保额, 保险期限为 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日。

4.10 基础设施项目未来发展展望的说明

受消费场景修复、积压需求释放等因素带动, 本基础设施项目在报告期间运营情况良好, 2024 年上半年营业收入较 2023 年同期下降 7.34%; 2024 年上半年日均自然车流量 48,856 辆/日, 较 2023 年同期上升 5.56%; 2024 年上半年日均收费车流量 36,197 辆/日, 较 2023 年同期下降 6.75%。

基础设施项目位于长三角地区, 长三角地区是我国经济发展最活跃、开放程度最高、创新能力最强的区域之一。2024 年上半年上海市、江苏省、浙江省生产总值分别为 22,346 亿元、63,326 亿元、40,920 亿元, 分别同比增长 4.8%、5.8%、5.6%, 其中规模以上工业企业完成工业总产值/增加值分别同比下跌 0.9%和同比增长 8.6%、8.0% (注: 上海市为总产值、江苏省和浙江省为增加值), 固定资产投资分别同比增长 10.2%、3.7%、4.0%。良好的经济发展基础, 为本基础设施项目的通行费收入、车流量增长创造了良好条件。

本基础设施项目运营主要面临车流量波动风险、市场替代或项目竞争风险、安全管理风险、日常运营养护风险等风险。本报告期内, 本基础设施项目管理情况良好, 未发生重大不利事件。随着国家稳增长促消费的政策出台和居民消费信心的恢复, 本基础设施项目 2024 年下半年及未来的经营情况预计会恢复增长。

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 报告期末基金资产组合情况

单位：人民币元

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	货币资金和结算备付金合计	1,691,523.74
4	其他资产	-
5	合计	1,691,523.74

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。

5.3 报告期末按公允价值大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.4 报告期末按公允价值大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.5 投资组合报告附注

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.6 报告期末其他各项资产构成

本基金本报告期末未持有其他资产。

5.7 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

5.8 报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，本基金托管人根据法律法规要求履行复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，公司领导担任估值委员会主任委员，投资研究部门、运营部、交易部、风险管理部指定人员担任委员。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

5.9 报告期内基金资产重大减值计提情况的说明

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 管理人及其管理基础设施基金的经验

华泰证券（上海）资产管理有限公司（简称“华泰证券资管”、“华泰资管”）成立于 2014 年 10 月 16 日，系经中国证监会批准（证监许可【2014】679 号），由华泰证券股份有限公司 100%控股设立。2016 年 7 月 26 日，公司经中国证监会证监许可【2016】1682 号文批准，获得公开募集证券投资基金管理业务资格。公司注册地位于上海，在北京、南京、深圳等地设有办公地点。

公司前身为华泰证券股份有限公司资产管理总部，自 1999 年起开展客户资产管理业务，2003 年首批获得证监会受托客户资产管理业务资格，2005 年发行首批券商集合资产管理计

划。2014 年 10 月 16 日，公司系经中国证监会批准（证监许可【2014】679 号），由华泰证券股份有限公司出资人民币 3 亿元在上海自贸区注册成立。办公地址为上海市浦东新区东方路 18 号保利广场 E 座 21 层，联系方式 021-68984200，邮编：200120。

华泰证券于 2015 年 9 月 16 日向公司增资人民币 7 亿元，公司累计实收资本为人民币 10 亿元。华泰证券于 2016 年 7 月 21 日向公司增资人民币 16 亿元，公司累计实收资本为人民币 26 亿元。

2016 年 7 月 26 日，中国证监会出具《关于核准华泰证券（上海）资产管理有限公司公开募集证券投资基金管理业务资格的批复》（证监许可〔2016〕1682 号）的文件批复，核准公司公开募集证券投资基金管理业务资格。

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			
陈宇峰	本基金的基金经理	2022-11-03	-	14	2010 年至 2013 年曾任上海神剑精密机械科技有限公司投资建设处，主要负责园区基础设施及固定资产投资管理工作。2013 年至 2018 年任职于上海市体育俱乐部	陈宇峰先生，东华大学工程管理硕士学位，中级工程师（土建）和中级经济师。现华泰证券（上海）资产管理有限公司不动产基金部基金经理。曾任就职于上海神剑精密机械科技有限公司、上海市体育俱乐部和上海市长宁区发展和改革委员会。自参加工作以来，即从事固定资产投资和运营管理工作，具有 10 年以上基础设施投资、运营管理经验。

					<p>总务科。主要负责崇明体育训练基地建设,市属体育场馆改造、修缮和运营工作。2018 年至 2020 年任职于上海市长宁区发展和改革委员会投资管理科,主要负责固定资产投资项目管理,包括辖区内市政道路、项目水电气等公建配套工程。2020 年 9 月底加入华泰证券(上海)资产管理有限公司,从事基础设施不动产信</p>	
--	--	--	--	--	--	--

					托基金 (REITs) 项目等运营工作。	
张亮	本基金的基金经理	2022-11-03	-	10	在广东省南粤交通投资建设有限公司 (广东省交通集团直属二级企业) 工作期间, 全过程参与国家高速公路网汕昆高速 (G78) 广东省境内龙川至连平段 (批复概算 144.16 亿元) 的筹建、建设与运营管理。先后从事高速公路的投资、技术、质量、安全、造价和运营等专业管理工	张亮先生, 长安大学桥梁与隧道工程硕士学位, 清华大学工程管理硕士学位, 高级工程师和中级经济师 (金融)。现任华泰证券 (上海) 资产管理有限公司不动产基金部基金经理。曾任职于广东省南粤交通投资建设有限公司, 自参加工作以来, 即从事高速公路的投资、建设和运营管理相关工作, 具有 5 年以上基础设施运营管理经验。

					作,并牵头或参与完成管理制度、预算管理、机电系统养护管理、取消省界收费站工程、重大节假日保通畅等相关运营管理工作。	
王轶	本基金的基金经理	2022-11-03	-	10	自 2014 年开始从事基础设施与不动产相关的投资工作,曾参与葛洲坝水电收费权项目、顺丰产业园项目、四川高速隆纳高项目等,涵盖了水利发电、仓储物流发电、高速公路、消费等基础设施类型。	王轶先生,2014 年获南京大学工业工程专业硕士,现任华泰证券(上海)资产管理有限公司不动产基金部基金经理。曾任职于华泰证券股份有限公司资产管理总部。自参加工作以来,即从事基础设施投资相关工作,具有 5 年以上基础设施投资经验。

注：1、上述基金经理的任职日期及离任日期均以基金公告为准；首任基金经理的任职日期为基金合同的生效日期。

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券投资基金从业人员范围的相关规定。

3、基础设施项目运营或管理年限的计算标准为该人员基础设施运营或基础设施投资管理经验年限与管理基础设施证券投资基金的年限加总。

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

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》等有关法律法规、中国证监会和《华泰紫金江苏交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金基金合同》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最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

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

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》建立并健全了有效的公平交易执行体系，保证公平对待旗下的每一个基金组合。

本报告期内，本公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动和环节得到公平对待，各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，本报告期内未发现任何违反公平交易的行为。

6.4 管理人对报告期内基金的投资和运营分析

（1）基金运营情况

报告期内，本基金运营正常，基金管理人秉承基金份额持有人利益优先的原则审慎开展业务管理，未发生有损投资人利益的风险事件。

（2）项目公司运营情况

报告期内，按照“基金管理人总体把控+项目全面预算控制+运营管理机构前置审批+资金严格监管”的管理模式对基础资产开展运营管理工作，以安全保畅为基础，以管理流程标准化和加大信息化技术应用为措施，以降本增效、提升通行效率和项目公司收入为目标，定期召开运营管理会议，全面推进项目的规范化管理，基础设施项目运营情况详见 § 4 基础设施项目运营情况。

报告期内累计查处出口小改大 5,932 辆，违规绿优车 240 辆，违规驶出 28 辆（追回 28 辆）；其他违规行为 112 辆，共挽回路网损失 63.22 万元。

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本基金合同的约定，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 3 个月可不进行收益分配。

本基金于 2024 年 5 月 16 日发布收益分配公告，以 2023 年 12 月 31 日为收益分配基准日，实际向投资者分红 97,743,958.60 元，每 10 份基金份额派发红利 2.4436 元。

6.6 管理人对宏观经济及行业走势的简要展望

1、宏观数据

根据国家统计局初步核算，2024 年上半年国内生产总值 61.68 万亿元，按不变价格计算，同比增长 5.0%，经季节调整后，2024 年二季度国内生产总值环比增长 0.7%，环比增速连续八个季度正增长，经济保持平稳向好态势。2024 年上半年，全国规模以上工业增加值同比增长 6.0%，比一季度加快 0.1%。其中，上海市、江苏省和浙江省规模以上工业企业完成工业总产值/增加值分别同比下跌 0.9%和同比增长 8.6%、8.0%（注：上海市为总产值、江苏省和浙江省为增加值）。

总体来看，2024 年上半年，国内外环境复杂多变，全球经济增长动能偏弱，外部环境复杂性严峻性不确定性明显上升，国内结构调整持续深化，有效需求不足，企业经营压力较大，重点领域风险隐患较多，但宏观政策效应持续释放、外需有所回暖、新质生产力加速发展等因素形成了合力和支撑。总的来看，上半年国民经济延续恢复向好态势，经济运行总体平稳，转型升级稳中有进。

2、高速公路行业展望

2024 年上半年全国公路货物运输量 1,977,268 万吨,同比增加 4.0%。其中上海市、江苏省和浙江省的公路货物运输量分别为 24,503 万吨、90,765 万吨、112,884 万吨,同比分别增加 1.7%、6.0%、9.6%,公路货运增速良好。

2024 年上半年全国公路旅客运输量 582,397 万人,同比增加 11.2%。其中上海市、江苏省和浙江省的公路旅客运输量分别为 3,525 万人、38,351 万人和 37,423 万人,同比分别增加 5.4%、6.0%、9.7%,公路客运增速较好(注:根据客运统计改革要求,自 2024 年 1 月起,公路营业性客运量包括班车包车客运量、公共汽电车城际城乡客运量、出租汽车(含巡游出租汽车、网络预约出租汽车)城际城乡客运量)。

本基础设施项目所在区域的公路货运及客运增长速度良好。中长期来看,随着经济持续复苏,本基础设施项目的车流量有望实现持续增长。

6.7 管理人对关联交易及相关利益冲突的防范措施

管理人建立了不动产投资公募基金投资及运营决策委员会领导下的投资决策及授权制度,针对运营管理过程中的关联交易事项,已建立了成熟的关联交易审批和检查机制。管理人严格执行《华泰证券(上海)资产管理有限公司关联交易管理制度》、《华泰证券(上海)资产管理有限公司不动产投资公募基金项目运营与管理制度》和《华泰证券(上海)资产管理有限公司不动产投资公募基金投资及运营决策委员会议事规则》,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

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期,本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

7.3 托管人对本年度报告/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

本托管人复核审查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。

§ 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：华泰紫金江苏交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	8.5.7.1	187,699,763.05	206,926,447.34
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	-	-
应收票据		-	-
应收账款	8.5.7.7	15,919,275.12	16,583,779.12
应收清算款		-	-
应收利息		-	-

应收股利		-	-
应收申购款		-	-
存货	8.5.7.8	715,347.00	738,171.00
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	130,742,594.83	139,659,370.17
在建工程	8.5.7.13	227,524.60	-
使用权资产	8.5.7.14	28,862,737.52	30,553,782.26
无形资产	8.5.7.15	1,689,588,677.06	1,769,943,030.58
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	15,588,591.36	15,588,591.36
其他资产	8.5.7.20	3,840,757.43	3,468,794.15
资产总计		2,073,185,267.97	2,183,461,965.98
负债和所有者权益		本期末	上年度末
		2024年6月30日	2023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	50,831,033.01	84,203,770.99
应付职工薪酬	8.5.7.23	4,542,130.38	4,542,130.38
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		3,017,414.40	13,831,953.84
应付托管费		100,580.48	355,015.20
应付投资顾问费		-	-
应交税费	8.5.7.24	3,839,637.04	3,474,397.56
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	-	-
租赁负债	8.5.7.29	40,401,053.25	38,797,000.55
递延收益		4,119,838.51	4,708,386.91
递延所得税负债		-	-
其他负债	8.5.7.30	8,402,323.45	10,887,396.63
负债合计		115,254,010.52	160,800,052.06
所有者权益：			
实收基金	8.5.7.31	3,053,999,761.94	3,053,999,761.94
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		-	-
盈余公积	8.5.7.34	-	-
未分配利润	8.5.7.35	-1,096,068,504.49	-1,031,337,848.02
所有者权益合计		1,957,931,257.45	2,022,661,913.92
负债和所有者权益总计		2,073,185,267.97	2,183,461,965.98

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 4.8948 元，期末基金份额公允价值参考净值 7.3615 元，基金份额总额 400,000,000.00 份。

8.1.2 个别资产负债表

会计主体：华泰紫金江苏交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产:			
货币资金	8.5.19.1	1,691,523.74	1,989,912.84
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	3,054,000,000.00	3,054,000,000.00
其他资产		-	-
资产总计		3,055,691,523.74	3,055,989,912.84
负债和所有者权益		本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 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		3,017,414.40	13,831,953.84
应付托管费		100,580.48	355,015.20
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
其他负债		109,398.38	220,000.00
负债合计		3,227,393.26	14,406,969.04
所有者权益：			
实收基金		3,053,999,761.94	3,053,999,761.94
资本公积		-	-
其他综合收益		-	-
未分配利润		-1,535,631.46	-12,416,818.14
所有者权益合计		3,052,464,130.48	3,041,582,943.80
负债和所有者权益总计		3,055,691,523.74	3,055,989,912.84

8.2 利润表

8.2.1 合并利润表

会计主体：华泰紫金江苏交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		176,403,981.14	190,391,383.49
1. 营业收入	8.5.7.36	175,790,618.07	189,722,927.12
2. 利息收入		24,814.67	38,550.07
3. 投资收益（损失以“-”号填列）	8.5.7.37	-	32,996.53

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	588,548.40	596,909.77
8. 其他业务收入	8.5.7.41	-	-
二、营业总成本		143,492,785.65	135,832,086.43
1. 营业成本	8.5.7.36	134,389,246.63	124,603,620.39
2. 利息支出	8.5.7.42	-	-
3. 税金及附加	8.5.7.43	1,527,522.56	959,402.36
4. 销售费用	8.5.7.44	-	-
5. 管理费用	8.5.7.45	613,915.03	478,635.34
6. 研发费用		-	-
7. 财务费用	8.5.7.46	3,342,388.01	4,801,423.84
8. 管理人报酬		3,017,414.40	4,546,533.57
9. 托管费		100,580.48	151,551.30
10. 投资顾问费		-	-
11. 信用减值损失	8.5.7.47	-	-68,196.31
12. 资产减值损失	8.5.7.48	-	-
13. 其他费用	8.5.7.49	501,718.54	359,115.94
三、营业利润（营业亏损以“-”号填列）		32,911,195.49	54,559,297.06
加：营业外收入	8.5.7.50	102,106.64	60,542.29
减：营业外支出	8.5.7.51	-	2,049.04
四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		33,013,302.13	54,617,790.31
减：所得税费用	8.5.7.52	-	1,042,266.64
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		33,013,302.13	53,575,523.67
1. 持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）		33,013,302.13	53,575,523.67
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		33,013,302.13	53,575,523.67

8.2.2 个别利润表

会计主体：华泰紫金江苏交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、收入		112,244,858.70	84,228,128.42
1. 利息收入		14,858.70	28,128.42
2. 投资收益（损失以“-”号填列）		112,230,000.00	84,200,000.00
其中：以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他业务收入		-	-
二、费用		3,619,713.42	4,807,238.70
1. 管理人报酬		3,017,414.40	4,546,533.57
2. 托管费		100,580.48	151,551.30
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		-	37.89
8. 其他费用		501,718.54	109,115.94
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		108,625,145.28	79,420,889.72
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		108,625,145.28	79,420,889.72
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		108,625,145.28	79,420,889.72

8.3 现金流量表

8.3.1 合并现金流量表

会计主体：华泰紫金江苏交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
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		200,710,357.78	215,631,775.33
2. 处置证券投资收到的现金净额		-	32,996.53
3. 买入返售金融资产净减少额		-	-
4. 卖出回购金融资产款净增加额		-	-
5. 取得利息收入收到的现金		1,325,876.85	38,905.14
6. 收到的税费返还		276,614.07	22,812,051.19
7. 收到其他与经营活动有关的现金	8.5.7.53.1	2,253,466.60	4,142,367.67
经营活动现金流入小计		204,566,315.30	242,658,095.86
8. 购买商品、接受劳务支付的现金		79,820,027.09	63,890,006.20
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		2,057.88	125,396.60
13. 支付的各项税费		10,782,244.80	10,711,593.69

14. 支付其他与经营活动有关的现金	8.5.7.53.2	35,384,769.92	20,601,456.87
经营活动现金流出小计		125,989,099.69	95,328,453.36
经营活动产生的现金流量净额		78,577,215.61	147,329,642.50
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		59,893.00	54,697.00
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	-	-
投资活动现金流出小计		59,893.00	54,697.00
投资活动产生的现金流量净额		-59,893.00	-54,697.00
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		97,743,958.60	83,732,025.01
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		97,743,958.60	83,732,025.01
筹资活动产生的现金流量净额		-97,743,958.60	-83,732,025.01
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		-19,226,635.99	63,542,920.49
加：期初现金及现金等价物余额		156,926,234.60	199,439,962.23

六、期末现金及现金等价物余额		137,699,598.61	262,982,882.72
----------------	--	----------------	----------------

8.3.2 个别现金流量表

会计主体：华泰紫金江苏交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、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		112,230,000.00	84,200,000.00
3. 处置证券投资收到的现金净额		-	-
4. 买入返售金融资产净减少额		-	-
5. 卖出回购金融资产款净增加额		-	-
6. 取得利息收入收到的现金		14,907.00	28,483.49
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		112,244,907.00	84,228,483.49
8. 取得基础设施投资支付的现金		-	-
9. 取得证券投资支付的现金净额		-	-
10. 买入返售金融资产净增加额		-	-
11. 卖出回购金融资产款净减少额		-	-
12. 支付的各项税费		-	416.77
13. 支付其他与经营活动有关的现金		14,799,289.20	30,020.00
经营活动现金流出小计		14,799,289.20	30,436.77

经营活动产生的现金流量净额		97,445,617.80	84,198,046.72
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		97,743,958.60	83,732,025.01
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		97,743,958.60	83,732,025.01
筹资活动产生的现金流量净额		-97,743,958.60	-83,732,025.01
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		-298,340.80	466,021.71
加：期初现金及现金等价物余额		1,989,700.10	2,210,891.03
五、期末现金及现金等价物余额		1,691,359.30	2,676,912.74

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：华泰紫金江苏交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期							
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日							
	实收基金	其他权益	资本公积	其他综合	专项储备	盈余公积	未分配	所有者权益合计

		工具		收益			利润	
一、上期期末余额	3,053,999,761.94	-	-	-	-	-	-1,031,337,848.02	2,022,661,913.92
加：会计政策变更	-	-	-	-	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-	-	-	-	-
同一控制下企业合并	-	-	-	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-	-	-	-
二、本期期初余额	3,053,999,761.94	-	-	-	-	-	-1,031,337,848.02	2,022,661,913.92
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-	-	-	-	-	-	-64,730,656.47	-64,730,656.47
(一) 综合收益总额	-	-	-	-	-	-	33,013,302.13	33,013,302.13
(二) 产品持有人申购和赎回	-	-	-	-	-	-	-	-
其中：产品申购	-	-	-	-	-	-	-	-
产品赎回	-	-	-	-	-	-	-	-
(三) 利润分配	-	-	-	-	-	-	-97,743,958.60	-97,743,958.60
(四) 其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-	-	-	-	-
(五) 专项储备	-	-	-	-	-	-	-	-
其中：本期提取	-	-	-	-	-	-	-	-
本期使用	-	-	-	-	-	-	-	-
(六) 其他	-	-	-	-	-	-	-	-
四、本期期末余额	3,053,999,761.94	-	-	-	-	-	-1,096,068,504.49	1,957,931,257.45

	, 999, 761.9 4						, 504. 49	
项目	上年度可比期间							
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日							
	实收 基金	其他 权益 工具	资本 公积	其他 综合 收益	专项 储备	盈余 公积	未分 配 利润	所有者权益 合计
一、上期期末余额	3,053 ,999, 761.9 4	-	-	-	-	-	-909, 506,3 80.17	2,144,493,3 81.77
加：会计政策变更	-	-	-	-	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-	-	-	-	-
同一控制下企业 合并	-	-	-	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-	-	-	-
二、本期期初余额	3,053 ,999, 761.9 4	-	-	-	-	-	-909, 506,3 80.17	2,144,493,3 81.77
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-	-	-	-	-	-	-30,1 56,50 1.34	-30,156,501 .34
(一) 综合收益总额	-	-	-	-	-	-	53,57 5,523 .67	53,575,523. 67
(二) 产品持有人申 购和赎回	-	-	-	-	-	-	-	-
其中：产品申购	-	-	-	-	-	-	-	-
产品赎回	-	-	-	-	-	-	-	-
(三) 利润分配	-	-	-	-	-	-	-83,7 32,02 5.01	-83,732,025 .01
(四) 其他综合收益	-	-	-	-	-	-	-	-

结转留存收益								
(五) 专项储备	-	-	-	-	-	-	-	-
其中：本期提取	-	-	-	-	-	-	-	-
本期使用	-	-	-	-	-	-	-	-
(六) 其他	-	-	-	-	-	-	-	-
四、本期期末余额	3,053,999,761.94	-	-	-	-	-	-939,662,881.51	2,114,336,880.43

8.4.2 个别所有者权益变动表

会计主体：华泰紫金江苏交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日				
	实收基金	资本公积	其他综合收益	未分配利润	所有者权益合计
一、上期期末余额	3,053,999,761.94	-	-	-12,416,818.14	3,041,582,943.80
加：会计政策变更	-	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
二、本期期初余额	3,053,999,761.94	-	-	-12,416,818.14	3,041,582,943.80
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-	-	-	10,881,186.68	10,881,186.68
(一) 综合收益总额	-	-	-	108,625,145.28	108,625,145.28
(二) 产品持有人申购和赎回	-	-	-	-	-
其中：产品申购	-	-	-	-	-
产品赎回	-	-	-	-	-
(三) 利润分配	-	-	-	-97,743,958.60	-97,743,958.60
(四) 其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-	-
(五) 其他	-	-	-	-	-

四、本期期末余额	3,053,999,761.94	-	-	-1,535,631.46	3,052,464,130.48
项目	上年度可比期间				
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日				
	实收基金	资本公积	其他综合收益	未分配利润	所有者权益合计
一、上期期末余额	3,053,999,761.94	-	-	649,945.55	3,054,649,707.49
加：会计政策变更	-	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
二、本期期初余额	3,053,999,761.94	-	-	649,945.55	3,054,649,707.49
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-	-	-	-4,311,135.29	-4,311,135.29
(一) 综合收益总额	-	-	-	79,420,889.72	79,420,889.72
(二) 产品持有人申购和赎回	-	-	-	-	-
其中：产品申购	-	-	-	-	-
产品赎回	-	-	-	-	-
(三) 利润分配	-	-	-	-83,732,025.01	-83,732,025.01
(四) 其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-	-
(五) 其他	-	-	-	-	-
四、本期期末余额	3,053,999,761.94	-	-	-3,661,189.74	3,050,338,572.20

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 8.1 至 8.5，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：江晓阳 主管会计工作负责人：白海燕 会计机构负责人：白海燕

8.5 报表附注

8.5.1 基金基本情况

华泰紫金江苏交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予华泰紫金江苏交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金注册的批复》(证监许可[2022]2396号)批准,由华泰证券(上

海)资产管理有限公司(以下简称“华泰资管”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《华泰紫金江苏交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金基金合同》发售,基金合同于 2022 年 11 月 3 日生效。本基金为契约型、封闭式基金,存续期限为 12 年,首次募集资金为 3,053,999,761.94 元(不含认购资金利息),设立份额为 400,000,000.00 份。本基金的基金管理人为华泰资管,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“建设银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《华泰紫金江苏交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金基金合同》和《华泰紫金江苏交控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,主要投资于高速公路类基础设施资产支持证券份额。本基金的其他基金资产可以投资于利率债(国债、政策性金融债、央行票据等)、AAA 级信用债(企业债、公司债、金融债、中期票据、短期融资券、超短期融资债券、公开发行的次级债、可分离交易可转债的纯债部分)或货币市场工具(包括银行存款、债券回购、同业存单)等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金不投资于股票等权益类资产,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,并可依据届时有效的法律法规适时调整投资范围。

除《基金合同》另有约定外,本基金的投资组合比例为:本基金投资于基础设施资产支持证券的资产比例不低于基金资产的 80%。若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许,本基金管理人在履行适当程序后,可对上述资产配置比例进行调整。

8.5.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证券业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

8.5.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2024 年 6 月 30 日的财务状况及 2024 年上半年的经营成果和净资产变动情况。

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

本基金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。

8.5.4.1 基金的收益分配政策

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 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式为现金分红；每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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

本基金在本报告期内未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会计差错更正。

8.5.6 税项

(1) 本基金适用税项

根据财税字[1998]55 号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》（以下简称“财税[2016]36 号”）、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》（以下简称“财税[2016]140 号”）、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》（以下简称“财税[2017]2 号”）、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》（以下简称“财税[2017]56 号”）、财政部、税务总局公告 2022 年第 3 号《关于基础设施领域不动产投资信托基金(REITs)试点税收政策的公告》（“财政部、税务总局公告 2022 年第 3 号”）及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(c) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税(以下称营改增)试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。2018 年 1 月 1 日(含)以后，资管产品管理人(以下称管理人)运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

(d) 金融商品持有期间(含到期)利息(保本收益、报酬、资金占用费、补偿金等)收入，需缴纳增值税。“保本收益、报酬、资金占用费、补偿金”，是指合同中明确承诺到期本金可全部收回的投资收益。金融商品持有期间(含到期)取得的非保本的上述收益，不属于利息或利息性质的收入，不征收增值税。

(e) 金融商品转让，是指转让外汇、有价证券、非货物期货和其他金融商品所有权的业务活动。金融商品转让按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额缴纳增值税。

个人从事金融商品转让业务免征增值税。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 个人投资者从基金分配中获得的股票的股息、红利收入以及企业债券的利息收入，由上市公司和发行债券的企业代扣代缴 20%的个人所得税，基金向个人投资者分配股息、红利、利息时，不再代扣代缴个人所得税。对投资者从基金分配中获得的国债利息、储蓄存款利息以及买卖股票价差收入，暂不征收所得税。个人投资者来源于公开募集基础设施证券投资基金的收益分配是否适用该政策有待明确。

(h) 对企业投资者买卖基金单位获得的差价收入，应并入企业的应纳税所得额，征收企业所得税。

(i) 对个人投资者买卖基金单位获得的差价收入，在对个人买卖股票的差价收入未恢复征收个人所得税以前，暂不征收个人所得税。

(j) 对基金在 2018 年 1 月 1 日(含)以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

(2) 专项计划适用税项

(a) 根据财政部和国家税务总局发布的财政部、税务总局公告 2022 年第 3 号第三条，对公开募集基础设施证券投资基金运营、分配等环节涉及的税收，按现行税收法律法规的规定执行。

(b) 根据财政部和国家税务总局发布的财税[2016]36 号、财税[2016]140 号、财税[2017]2 号及财税[2017]56 号，自 2016 年 5 月 1 日起，金融业纳入“营改增”试点范围；自 2018 年 1 月 1 日以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

(c) 根据财税[2016]140 号，金融商品持有期间(含到期)利息(保本收益、报酬、资金占用费、补偿金等)收入，需缴纳增值税。“保本收益、报酬、资金占用费、补偿金”，是指合同中明确承诺到期本金可全部收回的投资收益。金融商品持有期间(含到期)取得的非保本的上述收益，不属于利息或利息性质的收入，不征收增值税。

(d) 截至本财务报表批准日，财政部和国家税务总局并未出台针对资产管理产品所得税问题的具体规定。因此，截至报告期末，专项计划没有计提有关所得税费用。如果涉及专项计划业务的有关税收法规颁布，专项计划所涉及的所得税可能会根据日后出台的相关税务法规而作出调整。

(e) 对资管产品在 2018 年 1 月 1 日(含)以后运营过程中缴纳的增值税，按照资管产品管理人所在地适用的城市维护建设税税率，计算缴纳城市维护建设税。

(f) 对资管产品在 2018 年 1 月 1 日(含)以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照资管产品管理人所在地适用的费率计算缴纳教育费附加、地方教育费附加。

(g) 专项计划转让项目公司股权，需按照股权转让协议所载金额的万分之五缴纳印花税。

(3) 项目公司主要税种及税率：增值税，按税法规定的应税劳务收入的 6%计算销项税额，在扣除当期允许抵扣的进项税额后，差额部分为应缴增值税。对于按照简易征收办法计算的高速公路通行费收入和不动产经营租赁服务收入，按税法规定的高速公路通行费收入的 3%和不动产经营租赁服务收入的 5%计算应纳税额；城市维护建设税，按实际缴纳增值税的 5%；教育费附加，按实际缴纳增值税的 3%；地方教育费附加，按实际缴纳增值税的 2%；房产税，房屋租赁收入的 12%或房产原值一次减除 30%后的余值的 1.2%；城镇土地使用税，5 元/每平方米；项目公司本报告期适用的所得税税率为 25%。

8.5.7 合并财务报表重要项目的说明

8.5.7.1 货币资金

8.5.7.1.1 货币资金情况

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2024 年 6 月 30 日
库存现金	-
银行存款	187,699,763.05
其他货币资金	-
小计	187,699,763.05
减：减值准备	-
合计	187,699,763.05

8.5.7.1.2 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	9,699,598.61
定期存款	50,000,000.00
其中：存款期限 1—3 个月	-
存款期限 3 个月-1 年	50,000,000.00
其他存款	128,000,000.00
应计利息	164.44
小计	187,699,763.05
减：减值准备	-
合计	187,699,763.05

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

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

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

无。

8.5.7.4.2 债权投资减值准备计提情况

无。

8.5.7.5 其他债权投资

8.5.7.5.1 其他债权投资情况

无。

8.5.7.5.2 其他债权投资减值准备计提情况

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

无。

8.5.7.6.2 报告期内其他权益工具投资情况

无。

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 2024年6月30日
1年以内	10,798,097.30
1—2年	421,053.39
2—3年（含3年）	2,797,113.04
3年以上	3,216,838.68
小计	17,233,102.41
减：坏账准备	1,313,827.29
合计	15,919,275.12

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 2024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	1,254,001.00	7.28	1,254,001.00	100.00	0.00
按组合计提预期信用损失的应收账款	15,979,101.41	92.72	59,826.29	0.37	15,919,275.12
- 组合 1	15,124,101.41	87.76	0.00	0.00	15,124,101.41
- 组合 2	855,000.00	4.96	59,826.29	7.00	795,173.71
合计	17,233,102.41	100.00	1,313,827.29	7.62	15,919,275.12

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 2024年6月30日			
	账面余额	坏账准备	计提比例(%)	计提理由
浙江新团圆投资管理有限公司	1,254,001.00	1,254,001.00	100.00	对方违约
合计	1,254,001.00	1,254,001.00	100.00	—

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 2024年6月30日		
	账面余额	坏账准备	计提比例(%)
客商	15,979,101.41	59,826.29	0.37
合计	15,979,101.41	59,826.29	0.37

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 2023年12月31日	本期变动金额				本期末 2024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	1,254,001.00	-	-	-	-	1,254,001.00
按组合计提预期信用损失的应收账款	59,826.29	-	-	-	-	59,826.29
组合 1	-	-	-	-	-	-

类别	上年度末 2023年12 月31日	本期变动金额				本期末 2024年6月30日
		计提	转回或收回	核销	其他变动	
组合 2	59,826.29	-	-	-	-	59,826.29
合计	1,313,827.29	-	-	-	-	1,313,827.29

本期坏账准备发生重要转回或收回的应收账款情况无。

8.5.7.7.6 本期实际核销的应收账款情况

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
江苏高速公路联网运营管理有限公司	6,567,543.81	38.11	-	6,567,543.81
上海四次元文化集团有限公司	5,262,358.97	30.54	59,826.29	5,202,532.68
江苏交通控股集团财务有限公司	1,774,181.07	10.30	-	1,774,181.07
江苏高速公路能源发展有限公司	1,560,887.64	9.06	-	1,560,887.64
浙江新团圆投资管理有限公司	1,254,001.00	7.28	1,254,001.00	-
合计	16,418,972.49	95.28	1,313,827.29	15,105,145.20

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 2024年6月30日

	账面余额	存货跌价准备/合同履约成本减值准备	账面价值
原材料	-	-	-
在产品	-	-	-
库存商品	715,347.00	-	715,347.00
周转材料	-	-	-
合同履约成本	-	-	-
合计	715,347.00	-	715,347.00

8.5.7.8.2 存货跌价准备及合同履约成本减值准备

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

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

无。

8.5.7.9.3 报告期内合同资产计提减值准备情况

无。

8.5.7.9.4 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

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

无。

8.5.7.11.2 采用公允价值计量模式的投资性房地产

无。

8.5.7.11.3 投资性房地产主要项目情况

无。

8.5.7.12 固定资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
固定资产	130,742,594.83
固定资产清理	-
合计	130,742,594.83

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	三大 系统	安全 设施	家具	其他	合计
一、账面 原值									
1. 期初 余额	171,646 ,465.74	28,156, 834.56	2,365,0 20.34	4,442,5 34.49	117,2 46,37 8.67	74,63 6,470. 01	3,587, 404.5 0	10,22 4,184 .95	412,305 ,293.26
2. 本期 增加金额	-	-	-	65,525. 00	-	-	33,45 0.00	11,10 0.00	110,075 .00
购置	-	-	-	65,525. 00	-	-	33,45 0.00	11,10 0.00	110,075 .00
在建 工程转 入	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他 原因增 加	-	-	-	-	-	-	-	-	-
3. 本期 减少金额	6,918.8 8	-	-	-	-	-	-	-	6,918.8 8
处置 或报废	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他 原因减少	6,918.8 8	-	-	-	-	-	-	-	6,918.8 8
4. 期末 余额	171,639 ,546.86	28,156, 834.56	2,365,0 20.34	4,508,0 59.49	117,2 46,37 8.67	74,63 6,470. 01	3,620, 854.5 0	10,23 5,284 .95	412,408 ,449.38
二、累计 折旧									
1. 期初 余额	98,889, 933.32	17,313, 394.24	1,723,4 07.96	3,067,1 74.65	66,89 3,632 .97	71,35 3,653. 01	3,246, 905.5 7	10,15 7,821 .37	272,645 ,923.09
2. 本期 增加金额	3,483,0 52.98	725,831 .47	78,202. 35	217,514 .69	4,331 ,561.	134,7 07.74	38,24 7.07	10,81 3.88	9,019,9 31.46

					28				
本期 计提	3,483,052.98	725,831.47	78,202.35	217,514.69	4,331,561.28	134,707.74	38,247.07	10,813.88	9,019,931.46
其他 原因增加	-	-	-	-	-	-	-	-	-
3. 本期 减少金额	-	-	-	-	-	-	-	-	-
处置 或报废	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他 原因减少	-	-	-	-	-	-	-	-	-
4. 期末 余额	102,372,986.30	18,039,225.71	1,801,610.31	3,284,689.34	71,225,194.25	71,488,360.75	3,285,152.64	10,168,635.25	281,665,854.55
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 或报废	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他 原因减少	-	-	-	-	-	-	-	-	-
4. 期末 余额	-	-	-	-	-	-	-	-	-
四、账面 价值									
1. 期末 账面价值	69,266,560.56	10,117,608.85	563,410.03	1,223,370.15	46,021,184.42	3,148,109.26	335,701.86	66,649.70	130,742,594.83
2. 期初 账面价值	72,756,532.42	10,843,440.32	641,612.38	1,375,359.84	50,352,745.70	3,282,817.00	340,498.93	66,363.58	139,659,370.17

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

无。

8.5.7.13 在建工程

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
在建工程	227,524.60
工程物资	-
小计	227,524.60
减：减值准备	-
合计	227,524.60

8.5.7.13.1 在建工程情况

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		
	账面余额	减值准备	账面价值
在建工程	227,524.60	-	227,524.60
合计	227,524.60	-	227,524.60

8.5.7.13.2 报告期内重要在建工程项目变动情况

单位：人民币元

项目	期初余额	本期增加金额	本期转入 固定资产金额	本期其他减少 金额	期末余额
在建工程 1	-	174,374.60	-	-	174,374.60
在建工程 2	-	53,150.00	-	-	53,150.00
合计	-	227,524.60	-	-	227,524.60

8.5.7.13.3 报告期内在建工程计提减值准备情况

无。

8.5.7.13.4 工程物资情况

无。

8.5.7.14 使用权资产

单位：人民币元

项目	土地	合计
一、账面原值		
1. 期初余额	34,936,984.59	34,936,984.59
2. 本期增加金额	-	-
3. 本期减少金额	-	-
4. 期末余额	34,936,984.59	34,936,984.59
二、累计折旧		
1. 期初余额	4,383,202.33	4,383,202.33

2. 本期增加金额	1,691,044.74	1,691,044.74
本期计提	-	1,691,044.74
3. 本期减少金额	-	-
处置	-	-
4. 期末余额	6,074,247.07	6,074,247.07
三、减值准备		
1. 期初余额	-	-
2. 本期增加金额	-	-
本期计提	-	-
3. 本期减少金额	-	-
处置	-	-
4. 期末余额	-	-
四、账面价值		
1. 期末账面价值	28,862,737.52	28,862,737.52
2. 期初账面价值	30,553,782.26	30,553,782.26

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	3,408,269,809.55	-	-	-	3,408,269,809.55
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	3,408,269,809.55	-	-	-	3,408,269,809.55
二、累计摊销					
1. 期初余额	1,638,326,778.97	-	-	-	1,638,326,778.97
2. 本期增加金额	80,354,353.52	-	-	-	80,354,353.52
本期计提	80,354,353.52	-	-	-	80,354,353.52
其他原因增加	-	-	-	-	-

3. 本期减少 金额	-	-	-	-	-
处置	-	-	-	-	-
其他原 因减少	-	-	-	-	-
4. 期末余额	1,718,681,13 2.49	-	-	-	1,718,681,13 2.49
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	1,689,588,67 7.06	-	-	-	1,689,588,67 7.06
2. 期初账面 价值	1,769,943,03 0.58	-	-	-	1,769,943,03 0.58

8.5.7.15.2 无形资产的其他说明

无。

8.5.7.16 开发支出

无。

8.5.7.17 商誉

8.5.7.17.1 商誉账面原值

无。

8.5.7.17.2 商誉减值准备

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

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 2024年6月30日	
	可抵扣暂时性 差异	递延所得税 资产
资产减值准备	-	-
内部交易未实现利润	-	-
坏账准备	1,691,994.46	422,998.62
无形资产	32,505,248.59	8,126,312.15
预提费用	12,498,968.10	3,124,742.03
递延收益	4,119,838.51	1,029,959.63
租赁负债	40,401,053.25	10,100,263.31
合计	91,217,102.91	22,804,275.74

8.5.7.19.2 未经抵销的递延所得税负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日	
	应纳税暂时性 差异	递延所得税 负债
非同一控制企业合并资 产评估增值	-	-
公允价值变动	-	-
使用权资产	28,862,737.52	7,215,684.38
合计	-	-

8.5.7.19.3 以抵销后净额列示的递延所得税资产或负债

单位：人民币元

项目	递延所得税资产和 负债期末互抵金额	抵销后递延所得税 资产或负债期末余 额	递延所得税资产和 负债期初互抵金额	抵销后递延所得税 资产或负债期初余 额
递延所得税资产	7,215,684.38	15,588,591.36	7,638,445.57	15,588,591.36
递延所得税负债	-	-	-	-

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 2024年6月30日
资产减值准备	-
预计负债	-
可抵扣亏损	86,850,148.18

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
合计	86,850,148.18

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

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 2024 年 6 月 30 日
应收利息	2,696,461.17
其他应收款	704,114.23
预付账款	423,752.79
其他流动资产	16,429.24
合计	3,840,757.43

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 2024 年 6 月 30 日
1 年以内	408,874.91
1-2 年	14,877.88
2-3 年（含 3 年）	-
3 年以上	-
合计	423,752.79

注：账龄自预付款项确认日起开始计算。

8.5.7.20.2.2 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
中国石化销售股份有限公司江苏苏州吴江石油分公司	172,190.02	40.63	2024-01-06	先充值后报销
江苏通行宝智慧交通科技股份有限公司	56,827.23	13.41	2023-08-01	先充值后报销
国网江苏省电力	128,532.65	30.33	2024-01-01	先充值后报销

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
有限公司苏州市吴江区供电分公司				
国网浙江省电力有限公司湖州供电公司	51,325.01	12.11	2024-06-01	先充值后报销
国家税务总局江苏省税务局	14,877.88	3.51	2022-11-01	车辆购置税, 后报销
合计	423,752.79	100.00		

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 2024年6月30日
1年以内	366,689.67
1-2年	29,843.31
2-3年(含3年)	976.57
3年以上	684,771.85
小计	1,082,281.40
减：坏账准备	378,167.17
合计	704,114.23

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 2024年6月30日
应收关联公司	256,176.39
其他	826,105.01
小计	1,082,281.40
减：坏账准备	378,167.17
合计	704,114.23

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个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失(未发生信用减值)	整个存续期预期信用损失(已发生信用减值)	
期初余额	378,167.17	-	-	378,167.17

坏账准备	第一阶段	第二阶段	第三阶段	合计
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失(未发生信用减值)	整个存续期预期信用损失(已发生信用减值)	
期初余额在本期	-	-	-	-
—转入第二阶段	-	-	-	-
—转入第三阶段	-	-	-	-
—转回第二阶段	-	-	-	-
—转回第一阶段	-	-	-	-
本期计提	-	-	-	-
本期转回	-	-	-	-
本期转销	-	-	-	-
本期核销	-	-	-	-
其他变动	-	-	-	-
期末余额	378,167.17	-	-	378,167.17

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
无。

8.5.7.20.3.4 报告期内实际核销的其他应收款情况

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
江苏通行宝智慧交通科技股份有限公司	47,214.90	4.36	0.00	47,214.90
江苏省交通工程建设局	111,192.90	10.27	0.00	111,192.90
上海四次元文化集团有限公司	181,264.04	16.75	0.00	181,264.04
江苏广靖锡澄高速公路有限责任公司	158,114.05	14.61	0.00	158,114.05
江苏高速公路能	4,175.85	0.39	0.00	4,175.85

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
源发展有限公司				
合计	501,961.74	46.38	0.00	501,961.74

8.5.7.21 短期借款

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
	2024年6月30日
应付工程款	50,831,033.01
合计	50,831,033.01

8.5.7.22.2 账龄超过一年的重要应付账款

单位：人民币元

单位名称	期末余额	未偿还或结转原因
江苏长天智远交通科技有限公司	823,177.38	未到质保期
陕西交通科技有限公司	492,942.50	资料不完善
江苏省交通工程建设局	2,337,316.28	待结算
江苏现代路桥有限责任公司	24,872,702.35	未到质保期
合计	28,526,138.51	—

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	4,542,130.38	-	-	4,542,130.38
离职后福利-设定提存计划	-	-	-	-
合计	4,542,130.38	-	-	4,542,130.38

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	-	-	-	-
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	4,542,130.38	-	-	4,542,130.38
合计	4,542,130.38	-	-	4,542,130.38

8.5.7.23.3 设定提存计划

无。

8.5.7.24 应交税费

单位：人民币元

税费项目	本期末 2024年6月30日
增值税	3,235,598.27
消费税	-
企业所得税	-
个人所得税	-
城市维护建设税	142,554.80
教育费附加	85,532.88
房产税	207,167.35
土地使用税	108,284.28
土地增值税	-
地方教育附加费	57,021.92
印花税	3,477.54
其他	-
合计	3,839,637.04

8.5.7.25 应付利息

无。

8.5.7.26 合同负债

8.5.7.26.1 合同负债情况

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

无。

8.5.7.27 长期借款

无。

8.5.7.28 预计负债

无。

8.5.7.29 租赁负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
长期租赁负债	40,401,053.25
合计	40,401,053.25

注：主要由于服务区土地由原始权益人控股股东江苏交通控股有限公司租赁给沪苏浙项目公司，在新会计准则下，承租人以租赁负债列示。

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 2024 年 6 月 30 日
预收账款	1,784,273.93
其他应付款	6,618,049.52
合计	8,402,323.45

8.5.7.30.2 预收款项

8.5.7.30.2.1 预收款项情况

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
预收客户租金	1,260,625.48
预收清障款	15,590.00
通行费往来	508,058.45
合计	1,784,273.93

8.5.7.30.2.2 账龄超过一年的重要预收款项

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 2024 年 6 月 30 日
------	------------------------

款项性质	本期末 2024 年 6 月 30 日
质保金	-
押金及保证金	770,537.52
公路统筹发展费	3,536,204.25
其他	2,311,307.75
合计	6,618,049.52

8.5.7.30.3.2 账龄超过一年的重要其他应付款

单位：人民币元

债权人名称	期末余额	未偿还或结转的原因
中国联合网络通信有限公司江苏省分公司	1,260,625.48	预收款项按合同期限分摊
合计	1,260,625.48	-

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	400,000,000.00	3,053,999,761.94
本期认购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	400,000,000.00	3,053,999,761.94

8.5.7.32 资本公积

无。

8.5.7.33 其他综合收益

无。

8.5.7.34 盈余公积

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	-1,031,337,848.02	-	-1,031,337,848.02
本期利润	33,013,302.13	-	33,013,302.13
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	-97,743,958.60	-	-97,743,958.60
本期末	-1,096,068,504.49	-	-1,096,068,504.49

8.5.7.36 营业收入和营业成本

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	江苏沪苏浙高速公路有限公司	合计
营业收入	-	-
通行费收入	172,675,245.99	172,675,245.99
清障收入	184,113.21	184,113.21
经营租赁收入	2,931,258.87	2,931,258.87
合计	175,790,618.07	175,790,618.07
营业成本	-	-
收费业务成本	130,387,816.38	130,387,816.38
清障成本	532,298.12	532,298.12
经营租赁成本	3,469,132.13	3,469,132.13
合计	134,389,246.63	134,389,246.63

8.5.7.37 投资收益

无。

8.5.7.38 公允价值变动收益

无。

8.5.7.39 资产处置收益

无。

8.5.7.40 其他收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	与日常活动相关的政府补助	
合计		588,548.40

8.5.7.41 其他业务收入

无。

8.5.7.42 利息支出

无。

8.5.7.43 税金及附加

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
增值税	-
消费税	-
企业所得税	-
个人所得税	-
城市维护建设税	444,115.21
教育费附加	266,469.15
房产税	412,643.27
土地使用税	216,568.56
土地增值税	-
地方教育费附加	177,646.07
车船使用税	4,634.88
其他	5,445.42
合计	1,527,522.56

8.5.7.44 销售费用

无。

8.5.7.45 管理费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
折旧费	121,345.98
物业管理费	222,598.54
其他	269,970.51

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
合计	613,915.03

8.5.7.46 财务费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
银行手续费	0.00
利息收入	-1,821,770.03
利息支出	3,560,105.34
其他	1,604,052.70
合计	3,342,388.01

注：其他是租赁负债利息支出。

8.5.7.47 信用减值损失

无。

8.5.7.48 资产减值损失

无。

8.5.7.49 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费	49,726.04
信息披露费	59,672.34
银行手续费	320.16
其他	392,000.00
合计	501,718.54

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
----	----

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
非流动资产报废利得合计	-
其中：固定资产报废利得	-
无形资产报废利得	-
政府补助	-
路产赔偿	102,106.64
其他	-
合计	102,106.64

8.5.7.50.2 计入当期损益的政府补助

无。

8.5.7.51 营业外支出

无。

8.5.7.52 所得税费用

8.5.7.52.1 所得税费用情况

无。

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
利润总额	33,013,302.13
按法定/适用税率计算的所得税费用	-20,426,491.45
子公司适用不同税率的影响	-
调整以前期间所得税的影响	-
非应税收入的影响	-
不可抵扣的成本、费用和损失的影响	11,251,165.07
使用前期未确认递延所得税资产的可抵扣亏损的影响	-

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
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	9,175,326.38
合计	-

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 2024年1月1日至2024年6月30日
收到的银行存款利息	49,811.72
收回的代付水电费	907,180.85
收到的路产赔偿	600.00
其他（租金等）	1,295,874.03
合计	2,253,466.60

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 2024年1月1日至2024年6月30日
付管理人报酬	13,831,953.84
付托管费	355,015.20
付统筹发展费	18,744,737.47
付服务区物业费	624,054.40
付宽带费	38,555.04
付水电费	34,244.07
其他	1,756,209.90
合计	35,384,769.92

8.5.7.53.3 收到其他与投资活动有关的现金

无。

8.5.7.53.4 支付其他与投资活动有关的现金

无。

8.5.7.53.5 收到其他与筹资活动有关的现金

无。

8.5.7.53.6 支付其他与筹资活动有关的现金

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 将净利润调节为经营活动现金流量	
净利润	33,013,302.13
加：信用减值损失	-
资产减值损失	-
固定资产折旧	9,019,931.46
投资性房地产折旧	-
使用权资产折旧	1,691,044.74
无形资产摊销	80,354,353.52
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）	3,342,388.01
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）	-
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）	22,824.00
经营性应收项目的减少（增加以“-”号填列）	315,413.02
经营性应付项目的增加（减少以“-”号填列）	-48,593,492.87

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
递延收益的减少	-588,548.40
其他	-
经营活动产生的现金流量净额	78,577,215.61
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	137,699,598.61
减：现金的期初余额	156,926,234.60
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	-19,226,635.99

8.5.7.54.2 报告期内支付的取得子公司的现金净额

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
一、现金	137,699,598.61
其中：库存现金	-
可随时用于支付的银行存款	137,699,598.61
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	137,699,598.61
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	-

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

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

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

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

无。

8.5.8.2.2 合并成本

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

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

无。

8.5.9 集团的构成

子公司名称	主要经营地	注册地	业务性质	持股比例 (%)		取得方式
				直接	间接	
华泰资管-江苏交控沪苏浙高速公路资产支持专项计划	上海	上海	投资载体	100.00	-	投资设立
江苏沪苏浙高速公路有限公司	苏州	苏州	高速公路运营	-	100.00	同一控制下企业合并

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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的承诺事项。

8.5.11.2 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

8.5.11.3 资产负债表日后事项

本基金于资产负债表日之后、报告批准报出日之前批准、公告或实施的利润分配情况如下：

向截至 2024 年 8 月 26 日止登记在册的基金份额持有人分配红利，全部以现金分红方式分配，分配金额 127,424,029.55 元，每 10 份基金份额派发红利 3.1856 元。

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
江苏宁靖盐高速公路有限公司	同受江苏交通控股有限公司最终控制
江苏宁宿徐高速公路有限公司	同受江苏交通控股有限公司最终控制
江苏润扬大桥发展有限责任公司	同受江苏交通控股有限公司最终控制
江苏苏通大桥有限责任公司	同受江苏交通控股有限公司最终控制
江苏泰州大桥有限公司	同受江苏交通控股有限公司最终控制
江苏宿淮盐高速公路管理有限公司	同受江苏交通控股有限公司最终控制
江苏东部高速公路管理有限公司	同受江苏交通控股有限公司最终控制

江苏扬子大桥股份有限公司	同受江苏交通控股有限公司最终控制
江苏现代工程检测有限公司	同受江苏交通控股有限公司最终控制
江苏金融租赁股份有限公司	同受江苏交通控股有限公司最终控制
江苏高速公路工程养护技术有限公司	同受江苏交通控股有限公司最终控制
南通通沙港务有限公司	江苏省高速公路管理中心之子公司
江苏省通沙汽车轮渡管理处	江苏省高速公路管理中心下属事业单位
江苏交通控股集团财务有限公司	同受江苏交通控股有限公司最终控制
江苏通昌置业投资有限公司	同受江苏交通控股有限公司最终控制
江苏苏锡常南部高速公路有限公司	同受江苏交通控股有限公司最终控制
江苏云杉资本管理有限公司	同受江苏交通控股有限公司最终控制
江苏云杉清洁能源投资控股有限公司	同受江苏交通控股有限公司最终控制
江苏省高速公路经营管理中心	江苏交通控股有限公司受托管理的事业单位
江苏京沪高速公路有限公司	同受江苏交通控股有限公司最终控制
江苏连徐高速公路有限公司	同受江苏交通控股有限公司最终控制
江苏宁常镇溧高速公路有限公司	同受江苏交通控股有限公司最终控制
江苏宁杭高速公路有限公司	同受江苏交通控股有限公司最终控制
江苏宁沪高速公路股份有限公司	同受江苏交通控股有限公司最终控制
江苏高速公路联网运营管理有限公司	同受江苏交通控股有限公司最终控制
江苏广靖锡澄高速公路有限责任公司	同受江苏交通控股有限公司最终控制
江苏通行宝智慧交通科技股份有限公司	同受江苏交通控股有限公司最终控制
江苏现代路桥有限责任公司	同受江苏交通控股有限公司最终控制
江苏高速公路信息工程有限公司	同受江苏交通控股有限公司最终控制
江苏交通文化传媒有限公司	同受江苏交通控股有限公司最终控制
江苏高速公路能源发展有限公司	同受江苏交通控股有限公司最终控制
江苏沿江高速公路有限公司	同受江苏交通控股有限公司最终控制
江苏交控商业运营管理有限公司	同受江苏交通控股有限公司最终控制
江苏华通工程技术有限公司	同受江苏交通控股有限公司最终控制
江苏快鹿汽车运输股份有限公司	同受江苏交通控股有限公司最终控制
南京感动科技有限公司	同受江苏交通控股有限公司最终控制
江苏溧芜高速公路有限公司	同受江苏交通控股有限公司最终控制
江苏泰高高速公路有限公司	同受江苏交通控股有限公司最终控制
盐城云杉光伏发电有限公司	同受江苏交通控股有限公司最终控制
江苏溧马高速公路有限责任公司	同受江苏交通控股有限公司最终控制
江苏宁扬高速公路有限公司	同受江苏交通控股有限公司最终控制
江苏大丰港疏港高速公路有限公司	同受江苏交通控股有限公司最终控制
江苏现代路桥有限责任公司	同受江苏交通控股有限公司最终控制
江苏镇丹高速公路有限公司	同受江苏交通控股有限公司最终控制
江苏交通控股有限公司	最终控制方
华泰证券(上海)资产管理有限公司	基金管理人、资产支持证券管理人
华泰证券股份有限公司	基金管理人的股东
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、资产支持证券托管人
华泰资管长江财险 1 号单一资产管理计划	基金管理人管理的资产管理计划
华泰紫金保险 1 号单一资产管理计划	基金管理人管理的资产管理计划

华泰德利 1 号单一资产管理计划	基金管理人管理的资产管理计划
------------------	----------------

8.5.13 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

8.5.13.1 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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
江苏沿江高速公路有限公司	委托管理费	33,506,735.70	33,215,542.54
江苏高速公路联网运营管理有限公司	联网技术服务费	593,830.00	638,757.00
南京感动科技有限公司	工程款	42,457.90	44,120.00
江苏交控数字交通研究院有限公司	技术服务费	264,669.00	-
江苏通行宝智慧交通科技股份有限公司	技术服务费	929,580.13	1,188,364.00
合计	—	35,337,272.73	35,086,783.54

8.5.13.1.1 出售商品、提供劳务情况

通行费收入均由江苏高速公路联网运营管理有限公司和江苏交通控股集团财务有限公司进行汇总后打入沪苏浙项目公司，此为江苏省统一业务操作，不作为关联方出售商品及劳务列示。

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
江苏高速公路能源发展有限公司	加油站租赁	1,560,887.64	1,614,323.17
江苏交通文化传媒有限公司	广告收入	443,044.98	610,875.42
合计	—	2,003,932.62	2,225,198.59

8.5.13.2.2 作为承租方

单位：人民币元

出租方名称	租赁资产种类	本期确认的租赁费	上年度可比期间 确认的租赁费
江苏交通控股有限公司	服务区土地	1,604,052.70	1,479,209.07
合计	—	1,604,052.70	1,479,209.07

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

8.5.13.3.2 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额 的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
华泰证券股份有限公司	—	—	174,937,000.00	100.00
合计	—	—	174,937,000.00	100.00

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

8.5.13.3.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

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 2024年1月1日至2024年 6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,017,414.40	4,546,533.57
其中：固定管理费	3,017,414.40	4,546,533.57
浮动管理费	—	—
支付销售机构的客户维护费	332,778.72	496,511.06

注：1、固定管理费

固定管理费按最近一期经审计年度报告中披露的基金净资产[产品成立日后至第一次披露年未经审计的基金净资产前为本基金募集资金金额（含募集期利息）]，依据相应费率按日计提，计算方法如下：

$$B=A \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

B 为每日以基金资产净值为基数应计提的固定管理费。

A 为最近一期经审计年度报告中披露的基金净资产[产品成立日后至第一次披露年未经审计的基金净资产前为本基金募集资金金额（含募集期利息）]。

2、浮动管理费

基金收取的浮动管理费计算方法如下：

以基础设施资产净收入为基数，依据相应费率按年度计提，计算方法如下：

$$D=C \times 1.1\%$$

D 为每年度以基础设施资产净收入为基数应计提的基金管理费。

C 为年度基础设施资产净收入（首次计提时不满一年的，为项目公司股权交割日起至当年度最后一日期间的基础设施资产净收入；基金清算当年，为当年度第一日至基金清算前一日期间的基础设施资产净收入）。

上述基础设施资产净收入应根据项目公司上一年度审计数据进行计算，年度基础设施资产净收入=营业收入-营业成本-税金及附加-销售费用-管理费用-外部借款本息（如有）+折旧及摊销。

8.5.13.4.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	100,580.48	151,551.30

注：本基金的托管费按最近一期经审计年度报告中披露的基金净资产[产品成立日后至第一次披露年未经审计的基金净资产前为本基金募集资金金额（含募集期利息）]的 0.01% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=L \times 0.01\% \div \text{当年天数}$$

H 为按日应计提的基金托管费。

L 为按最近一期经审计年度报告中披露的基金净资产[产品成立日后至第一次披露年末经审计的基金净资产前为本基金募集资金金额（含募集期利息）]。

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

本基金在本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日
期初持有的基金份额	13,800,000.00	13,800,000.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	13,800,000.00	13,800,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例（%）	3.45%	3.45%

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

关联方名称	本期						
	2024年1月1日至2024年6月30日						
	期初持有		期间申购/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	
江苏沿江高速公路有限公司	80,000,000.00	20.00%	-	-	-	80,000,000.00	20.00%
江苏镇扬汽渡有限公司	25,360,000.00	6.34%	-	-	-	25,360,000.00	6.34%

华泰紫金江苏交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金 2024 年中期报告

司	0						
江苏航空产业集团有限公司	12,680,000.00	3.17%	-	-	-	12,680,000.00	3.17%
江苏高速公路能源发展有限公司	12,680,000.00	3.17%	-	-	-	12,680,000.00	3.17%
江苏交通文化传媒有限公司	5,440,000.00	1.36%	-	-	-	5,440,000.00	1.36%
江苏交控商业运营管理有限公司	3,840,000.00	0.96%	-	-	-	3,840,000.00	0.96%
华泰证券股份有限公司	14,680,000.00	3.67%	2,928,835.00	-	-	17,608,835.00	4.40%
华泰德利1号单一资产管理计划	-	-	168,156.00	-	-	168,156.00	0.04%
华泰资管长江财险1号单一资产管理计划	-	-	2,680,000.00	-	-	2,680,000.00	0.67%
华泰紫金保险1号单一资产管理计划	-	-	2,680,000.00	-	-	2,680,000.00	0.67%
合计	154,680,000.00	38.67%	8,456,991.00	-	-	163,136,991.00	40.78%

上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日							
关联方 名称	期初持有		期间申购/买入 份额	期间因拆分变 动份额	减：期间赎回/ 卖出份额	期末持有	
	份额	比例				份额	比例
江苏沿江高速公路有限公司	80,000,000.00	20.00%	-	-	-	80,000,000.00	20.00%
江苏镇扬汽渡有限公司	25,360,000.00	6.34%	-	-	-	25,360,000.00	6.34%
江苏航空产业集团有限责任公司	12,680,000.00	3.17%	-	-	-	12,680,000.00	3.17%
江苏高速公路能源发展有限公司	12,680,000.00	3.17%	-	-	-	12,680,000.00	3.17%
江苏交通文化传媒有限公司	5,440,000.00	1.36%	-	-	-	5,440,000.00	1.36%
江苏交控商业运营管理有限公司	3,840,000.00	0.96%	-	-	-	3,840,000.00	0.96%
华泰证券股份有限公司	29,185,000.00	7.30%	16,131,763.00	-	18,892,504.00	26,424,259.00	6.61%
合计	169,185,000.00	42.30%	16,131,763.00	-	18,892,504.00	166,424,259.00	41.61%

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		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年6月30日		2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	5,716,232.21	24,814.67	2,677,172.94	14,339.74
合计	5,716,232.21	24,814.67	2,677,172.94	14,339.74

8.5.13.8 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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		上年度末	
		2024年6月30日		2023年12月31日	
		账面余额	坏账准备	账面余额	坏账准备
应收账款	江苏高速公路联网运营管理有限公司	6,567,543.81	-	6,166,306.57	-
应收账款	江苏交通控股集团财务有限公司	1,774,181.07	-	1,684,714.16	-
应收账款	江苏高速公路能源发展有限公司	1,560,887.64	-	1,653,451.54	-
应收账款	江苏交通文化传媒有限公司	451,130.39	-	450,133.84	-
其他应收款	江苏广靖锡澄高速公路有限责任公司	158,114.05	-	158,114.05	-
其他应收款	江苏通行宝智慧交通科技股份有限公司	47,214.90	-	47,214.90	-
其他应收款	江苏沿江高速公路有限公司	10,576.91	-	1,543.31	-
其他应收款	江苏高速公路能源发展有限公司	4,175.85	-	-	-

预付账款	江苏通行宝智慧交通科技股份有限公司	56,827.23	-	62,998.29	-
合计	—	10,630,651.85	-	10,224,476.66	-

注：通行费收入均由江苏高速公路联网运营管理有限公司和江苏交通控股集团财务有限公司进行归集汇总及拆分帐后打入沪苏浙项目公司，此为江苏省统一业务操作，不作为关联方出售商品、提供劳务情况。

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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
其他应付款	江苏交通控股有限公司	3,536,204.25	3,152,361.72
其他应付款	江苏高速公路能源发展有限公司	-	6,831.03
其他应付款	江苏沿江高速公路有限公司	-	900.00
应付账款	江苏现代路桥有限责任公司	25,087,409.84	51,206,570.79
应付账款	江苏华通工程技术有限公司	732,111.71	979,506.11
应付账款	江苏快鹿汽车运输股份有限公司	-	430,690.41
应付账款	南京感动科技有限公司	232,457.90	295,899.00
应付账款	江苏高速公路工程养护技术有限公司	364,993.60	364,993.60
应付账款	江苏高速公路联网运营管理有限公司	115,794.00	91,607.00
应付账款	江苏通行宝智慧交通科技股份有限公司	315,011.81	89,138.35
应付账款	江苏高速公路信息工程有限公司	2,593.17	58,490.39
应付账款	江苏交控数字交通研究院有限公司	6,902.00	-
应付账款	江苏交通控股集团财务有限公司	19,995.40	19,995.40
其他应付款	江苏交控商业运	-	-

项目名称	关联方名称	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	营管理有限公司		
应付账款	江苏现代工程检测有限公司	-	-
合计	—	30,413,473.68	56,696,983.80

8.5.15 期末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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

8.5.15.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0,无抵押债券。

8.5.15.2.1 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0,无抵押债券。

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	2024-05-20	2024-05-20	2.4436	97,743,958.60	100.00	场外除息日: 2024-05-20; 场内除息日: 2024-05-21
合计				97,743,958.60	-	-

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

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基础设施基金所持有资产支持证券的基础资产出现因付款人合同违约等导致现金流大幅波动的情况,造成基金资

产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人和资产支持证券管理人建立了信用风险管理流程,通过对资产支持证券信用风险的评估和监控来控制信用风险,在产品成立前和存续阶段持续评估信用风险及监控信用风险变化情况。

8.5.17.2 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基础设施基金的现金流来自于其所持有的资产支持证券,最终来源于基础设施项目。

本基金的基金管理人和资产支持证券管理人通过持续监控基础设施项目运营和现金流情况、对比实际现金流与现金流预测变化情况,并评估短期和长期资金需求,来确保基础设施项目和基金现金储备充裕。

8.5.17.3 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。

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 2024年6月30日
库存现金	-
银行存款	1,691,523.74
其他货币资金	-
小计	1,691,523.74
减:减值准备	-
合计	1,691,523.74

8.5.19.1.2 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末	
	2024 年 6 月 30 日	
活期存款	1,691,359.30	
定期存款	-	
其中：存款期限 1—3 个月	-	
其他存款	-	
应计利息	164.44	
小计	1,691,523.74	
减：减值准备	-	
合计	1,691,523.74	

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		
	2024 年 6 月 30 日		
	账面余额	减值准备	账面价值
对子公司投资	3,054,000,000.00	-	3,054,000,000.00
合计	3,054,000,000.00	-	3,054,000,000.00

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
华泰资管-江苏交控沪苏浙高速公路资产支持专项计划	3,054,000,000.00	-	-	3,054,000,000.00	-	-
合计	3,054,000,000.00	-	-	3,054,000,000.00	-	-

§9 基金份额持有人信息

9.1 基金份额持有人户数及持有人结构

本期末 2024年6月30日					
持有人 户数 (户)	人均持有的 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 (%)
34,797	11,495.24	391,953,103.00	97.99	8,046,897.00	2.01

本期末 2024年6月30日					
持有人 户数 (户)	人均持有的 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 (%)
34,797	11,495.24	391,953,103.00	97.99	8,046,897.00	2.01
上年度末 2023年12月31日					
持有人 户数 (户)	人均持有的 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 (%)
37,869	10,562.73	393,771,943.00	98.44	6,228,057.00	1.56

9.2 基金前十名流通份额持有人

本期末 2024年6月30日			
序号	持有人名称	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
1	中国国际金融股份有限公司	18,166,284.00	4.54
2	国信证券股份有限公司	12,346,650.00	3.09

3	利安人寿保险股份有限公司—利安利尊稳赢两全保险	6,885,374.00	1.72
4	上海合晟资产管理股份有限公司—合晟同晖 7 号私募证券投资基金	3,998,878.00	1.00
5	紫金财产保险股份有限公司	3,900,637.00	0.98
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	3,600,535.00	0.90
7	华泰证券股份有限公司	2,928,029.00	0.73
8	申港证券股份有限公司	1,908,568.00	0.48
9	新华人寿保险股份有限公司—新分红产品	1,741,293.00	0.44
10	新华人寿保险股份有限公司—万能—得意理财—018L—WN001 沪	1,433,723.00	0.36
合计		56,909,971.00	14.23
上年度末 2023 年 12 月 31 日			
序号	持有人名称	持有份额（份）	占总份额比例（%）
1	中国国际金融股份有限公司	19,108,431.00	4.78
2	国信证券股份有限公司	5,352,932.00	1.34
3	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	4,019,239.00	1.00
4	广发证券股份有限公司	3,486,421.00	0.87
5	紫金财产保险股份有限公司	3,334,332.00	0.83
6	中国银河证券股份有限公司	2,028,957.00	0.51
7	申万宏源证券有限公司	1,661,703.00	0.42

8	上海金得私募基金管理有限公司—金得至诚 10 号私募证券投资基金	1,449,685.00	0.36
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	1,174,193.00	0.29
10	上海金得私募基金管理有限公司—金得尧典 20 号私募证券投资基金	1,171,403.00	0.29
合计		42,787,296.00	10.70

注：因四舍五入原因，前十名客户份额占总份额比例中分项之和与合计可能存在尾差。

9.3 基金前十名非流通份额持有人

本期末 2024 年 6 月 30 日			
序号	持有人名称	持有份额（份）	占总份额比例（%）
1	江苏沿江高速公路有限公司	80,000,000.00	20.00
2	江苏镇扬汽渡有限公司	25,360,000.00	6.34
3	华泰证券股份有限公司	14,680,000.00	3.67
4	中信证券股份有限公司	14,000,000.00	3.50
5	华泰证券（上海）资产管理有限公司	13,800,000.00	3.45
6	江苏航空产业集团有限责任公司	12,680,000.00	3.17
7	江苏高速公路能源发展有限公司	12,680,000.00	3.17
8	华润深国投信托有限公司—华润信托·锐盈 2 号集合资金信托计划	11,000,000.00	2.75
9	兴瀚资管—兴业银行—兴瀚资管—兴元 18 号集合资产管理计划	10,680,000.00	2.67

10	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	10,680,000.00	2.67
合计		205,560,000.00	51.39
上年度末 2023年12月31日			
序号	持有人名称	持有份额（份）	占总份额比例（%）
1	江苏沿江高速公路有限公司	80,000,000.00	20.00
2	江苏镇扬汽渡有限公司	25,360,000.00	6.34
3	华泰证券股份有限公司	14,680,000.00	3.67
4	中信证券股份有限公司	14,000,000.00	3.50
5	华泰证券（上海）资产管理有限公司	13,800,000.00	3.45
6	江苏航空产业集团有限责任公司	12,680,000.00	3.17
7	江苏高速公路能源发展有限公司	12,680,000.00	3.17
8	华润深国投信托有限公司—华润信托·锐盈2号集合资金信托计划	11,000,000.00	2.75
9	兴瀚资管—兴业银行—兴瀚资管—兴元18号集合资产管理计划	10,680,000.00	2.67
10	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	10,680,000.00	2.67
合计		205,560,000.00	51.39

注：因四舍五入原因，前十名客户份额占总份额比例中分项之和与合计可能存在尾差。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,742.00	0.00%

§ 10 基金份额变动情况

单位：份

基金合同生效日(2022年11月3日)基金份额总额	400,000,000.00
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

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 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

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

本报告期内，自 2024 年 1 月 29 日起，聂挺进先生因个人原因离职，不再担任公司总经理职务；自 2024 年 2 月 28 日起，江晓阳先生新任本基金管理人总经理；自 2024 年 3 月 31 日起，刘玉生先生因个人原因离职，不再担任公司副总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内未发生涉及基金管理人基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 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

无。

11.5 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所在本报告期未发生变更。

11.7 为基金出具评估报告的评估机构情况

基金管理人为本基金聘任的评估机构在本报告期未发生变更。

11.8 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.8.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。行政监管措施方面，2024 年 5 月 17 日，上海证监局发布对管理人及公司分管相关业务的高级管理人员采取出具警示函措施的决定。该监管函指出，管理人存在支持民营企业发展资产管理计划投向纾困用途的资金未达到规定比例、对交易对手方尽职调查不充分等问题。对于前述警示函中指出的问题，管理人高度重视、诚恳接受，已采取措施积极推进整改。

11.8.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.9 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	华泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-01-15
2	华泰紫金江苏交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金关于二零二三年十二月主要运营数据暨二〇二三年第四季度经营情况的临时公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-01-17
3	华泰紫金江苏交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-01-19
4	华泰证券（上海）资产管理有限公司旗下部分基金 2023 年 4 季度报告的提示性公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-01-19
5	华泰证券（上海）资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-01-30
6	华泰证券（上海）资产管理有限公司关于提醒投资者及时更新身份信息资料的提示	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-02-02
7	华泰紫金江苏交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金关于二零二四年一月主要运营数据的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-02-23
8	华泰证券（上海）资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-02-29
9	华泰紫金江苏交控高速公路封闭式基础设	基金管理人网站、中国	2024-03-21

	施证券投资基金关于“走进 REITs”活动情况的公告	证监会基金电子披露网站、规定报刊等	
10	华泰紫金江苏交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金关于二零二四年二月主要运营数据的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-03-22
11	华泰紫金江苏交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金 2023 年度评估报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-03-28
12	华泰紫金江苏交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金 2023 年度审计报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-03-28
13	华泰紫金江苏交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金 2023 年年度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-03-28
14	华泰证券（上海）资产管理有限公司旗下全部基金 2023 年年度报告的提示性公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-03-28
15	华泰证券（上海）资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-04-01
16	华泰证券（上海）资产管理有限公司旗下部分基金 2024 年 1 季度报告的提示性公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-04-08
17	关于华泰紫金江苏交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金召开 2023 年度业绩说明会的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-04-09
18	华泰紫金江苏交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-04-19
19	华泰证券（上海）资产管理有限公司旗下部分基金 2024 年 1 季度报告的提示性公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-04-19
20	华泰紫金江苏交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金关于二零二四年三月主要运营数据的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-04-23
21	华泰证券（上海）资产管理有限公司关于华泰紫金江苏交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金收益分配的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-05-16
22	华泰紫金江苏交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金关于二零二四年四月主要运营数据的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-05-22
23	关于华泰紫金江苏交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金外部管理机构高级管理人员变更的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-05-29

24	华泰紫金江苏交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金关于二零二四年五月主要运营数据的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-06-21
25	关于华泰紫金江苏交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金外部管理机构高级管理人员变更的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-06-22
26	华泰紫金江苏交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金基金产品资料概要更新(202406)	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2024-06-24

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金管理人根据监管规定要求于 2024 年 1 月 30 日在本基金管理人官网及监管规定渠道发布了《华泰证券（上海）资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，自 2024 年 1 月 29 日起，聂挺进先生因个人原因离职，不再担任公司总经理职务。

2、本基金管理人根据监管规定要求于 2024 年 2 月 29 日在本基金管理人官网及监管规定渠道发布了《华泰证券（上海）资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，自 2024 年 2 月 28 日起，江晓阳先生新任本基金管理人总经理。

3、本基金管理人根据监管规定要求于 2024 年 4 月 1 日在本基金管理人官网及监管规定渠道发布了《华泰证券（上海）资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，自 2024 年 3 月 31 日起，刘玉生先生因个人原因离职，不再担任公司副总经理职务。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予本基金募集注册的文件；
- 2、《华泰紫金江苏交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金基金合同》；
- 3、《华泰紫金江苏交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金托管协议》；
- 4、《华泰紫金江苏交控高速公路封闭式基础设施证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、《关于申请募集注册华泰紫金江苏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》；

- 8、基金产品资料概要；
- 9、中国证监会规定的其他备查文件。

13.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人、基金托管人的住所。

13.3 查阅方式

部分备查文件可通过本基金管理人公司网站查询，也可咨询本基金管理人。客服电话：4008895597；公司网址：<https://htamc.htsc.com.cn/>。

华泰证券（上海）资产管理有限公司

二〇二四年八月二十九日