

平安广州交投广河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：平安基金管理有限公司

基金托管人：中国工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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 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、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。

本报告除特别注明外，金额单位均为人民币元。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 06 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 | 6 |
| 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 | 7 |
| 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 | 9 |
| § 4 基础设施项目运营情况 | 9 |
| 4.1 对报告期内基础设施项目公司运营情况的整体说明 | 9 |
| 4.2 基础设施项目所属行业情况 | 9 |
| 4.3 基础设施项目运营相关财务信息 | 10 |
| 4.4 基础设施项目运营相关通用指标信息 | 12 |
| 4.5 基础设施项目公司经营现金流 | 12 |
| 4.6 基础设施项目公司对外借入款项情况 | 13 |
| 4.7 基础设施项目投资情况 | 13 |
| 4.8 抵押、查封、扣押、冻结等他项权利限制的情况 | 14 |
| 4.9 基础设施项目相关保险的情况 | 14 |
| 4.10 基础设施项目未来发展展望的说明 | 14 |
| 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 | 15 |
| 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 | 15 |
| 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 | 15 |
| 5.5 投资组合报告附注 | 15 |
| 5.6 报告期末其他各项资产构成 | 15 |
| 5.7 投资组合报告附注的其他文字描述部分 | 15 |
| 5.8 报告期内基金估值程序等事项的说明 | 15 |
| 5.9 报告期内基金资产重大减值计提情况的说明 | 16 |
| § 6 管理人报告 | 16 |

| | |
|--|-----------|
| 6.1 基金管理人及主要负责人员情况 | 16 |
| 6.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 18 |
| 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 | 19 |
| 6.4 管理人对报告期内基金的投资和运营分析 | 19 |
| 6.5 管理人对报告期内基金收益分配情况的说明 | 20 |
| 6.6 管理人对宏观经济及行业走势的简要展望 | 20 |
| 6.7 管理人对关联交易及相关利益冲突的防范措施 | 21 |
| § 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内容的真实性、准确性和完整性发表意见 | 22 |
| § 8 中期财务报告（未经审计） | 22 |
| 8.1 资产负债表 | 22 |
| 8.2 利润表 | 25 |
| 8.3 现金流量表 | 27 |
| 8.4 所有者权益变动表 | 30 |
| 8.5 报表附注 | 34 |
| § 9 基金份额持有人信息..... | 66 |
| 9.1 基金份额持有人户数及持有人结构 | 66 |
| 9.2 基金前十名流通份额持有人 | 66 |
| 9.3 基金前十名非流通份额持有人 | 67 |
| 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 68 |
| § 10 基金份额变动情况..... | 68 |
| § 11 重大事件揭示..... | 68 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 | 68 |
| 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 | 68 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 68 |
| 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 | 68 |
| 11.5 基金投资策略的改变 | 69 |
| 11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 69 |
| 11.7 为基金出具评估报告的评估机构情况 | 69 |
| 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 | 69 |
| 11.9 其他重大事件 | 69 |
| § 12 影响投资者决策的其他重要信息 | 70 |
| § 13 备查文件目录..... | 70 |
| 13.1 备查文件目录 | 70 |
| 13.2 存放地点 | 70 |
| 13.3 查阅方式 | 70 |

§ 2 基金简介

2.1 基金产品基本情况

| | |
|--------------|---|
| 基金名称 | 平安广州交投广河高速公路封闭式基础设施证券投资基金 |
| 基金简称 | 平安广交投广河高速 REIT |
| 场内简称 | 平安广州广河 REIT |
| 基金主代码 | 180201 |
| 交易代码 | 180201 |
| 基金运作方式 | 契约型封闭式 |
| 基金合同生效日 | 2021 年 6 月 7 日 |
| 基金管理人 | 平安基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 700,000,000.00 份 |
| 基金合同存续期 | 99 年封闭期，在封闭期内，不接受基金份额申购和赎回。 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 |
| 上市日期 | 2021 年 6 月 21 日 |
| 投资目标 | 本基金主要投资于基础设施资产支持证券全部份额，以取得基础设施项目完全所有权或经营权利。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。 |
| 投资策略 | <p>（一）资产支持证券投资策略</p> <p>1、本基金首次发售募集资金在扣除基金层面预留费用后，全部用于认购平安广州交投广河高速公路基础设施资产支持专项计划的全部资产支持证券份额，以取得基础设施项目的完全所有权或经营权利。</p> <p>2、存续期内，本基金将优先收购广州交投或其他机构拥有的优质收费公路基础设施项目，并根据实际情况选择通过基金扩募募集资金，投资于新的基础设施资产支持专项计划或通过认购已投资资产支持专项计划扩募份额的方式实现资产收购，以扩大本基金持有的基础设施项目规模、分散基础设施项目的经营风险、提高基金的投资收益。</p> <p>（二）固定收益投资策略</p> <p>本基金除投资基础设施资产支持证券外，其余基金资产应当依法投资于利率债、AAA 级信用债或货币市场工具。</p> <p>本基金采用的投资策略包括：期限结构策略、信用策略、个券挖掘策略等。在谨慎投资的前提下，力争获取稳健的投资收益。在以上战略性资产配置的基础上，本基金通过自上而下和自下而上相结合、定性分析和定量分析相补充的方法，进行前瞻性的决策。</p> |
| 业绩比较基准 | 本基金不设立业绩比较基准。 |
| 风险收益特征 | 本基金预期风险和收益高于债券型基金和货币型基金，低于股票型基金。 |
| 基金收益分配政策 | 本基金应当将不低于合并后年度可供分配金额的 95%以现金 |

| | | |
|-----------|---|--------------|
| | 形式分配给投资者。本基金的收益分配在符合分配条件的情况下每年不得少于 1 次。 | |
| 资产支持证券管理人 | 平安证券股份有限公司 | |
| 外部管理机构 | 广州交通投资集团有限公司 | 广州高速运营管理有限公司 |

2.2 基础设施项目基本情况说明

基础设施项目名称：广州至河源高速公路广州段项目

| | |
|--------------|---|
| 基础设施项目公司名称 | 广州交投广河高速公路有限公司 |
| 基础设施项目类型 | 收费公路 |
| 基础设施项目主要经营模式 | 广州至河源高速公路广州段项目（以下简称“本项目”）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 | 本项目位于粤港澳大湾区，是连接广州市中心区至中新知识城、增城区的主要通道，也是往河源和梅州汕头等粤东地区和出省至福建、浙江的大通道。起于广州市天河区龙洞春岗立交，对接华南快速干线（三期），与华南快速干线（二期）相交，自东往西穿越广州市天河区、白云区、黄埔区（萝岗）、增城区，终于增城区九龙江，与广河高速公路惠州段相接。 |

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 | | 平安基金管理有限公司 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 陈特正 | 郭明 |
| | 联系电话 | 0755-22626828 | (010)66105799 |
| | 电子邮箱 | funds@pingan.com.cn | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400-800-4800 | 95588 |
| 传真 | | 0755-23997878 | (010)66105798 |
| 注册地址 | | 深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 办公地址 | | 深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 邮政编码 | | 518048 | 100140 |
| 法定代表人 | | 罗春风 | 陈四清 |

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 | 外部管理机构 2(实施机构) |
|----|---------------|--------|----------------|
|----|---------------|--------|----------------|

| | | | |
|-------|---|-----------------------------------|--------------------------------|
| 名称 | 平安证券股份有限公司 | 广州交通投资集团有限公司 | 广州高速运营管理有限公司 |
| 注册地址 | 深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层 | 广州市海珠区广州大道南 1800 号 | 广州市海珠区广州大道南 1800 号 501 室（仅限办公） |
| 办公地址 | 深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层 | 广州市海珠区新港东路 1138 号智通广场 A 座 14-16 层 | 广州市海珠区新港东路 1138 号智通广场 A 座 12 层 |
| 邮政编码 | 518026 | 510320 | 510320 |
| 法定代表人 | 何之江 | 徐结红 | 何军 |

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 | http://www.fund.pingan.com |
| 基金中期报告备置地点 | 基金管理人、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 | 北京市西城区太平桥大街 17 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（2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日） |
|-------------------|-------------------------------------|
| 本期收入 | 383,040,141.51 |
| 本期净利润 | 136,091,846.98 |
| 本期经营活动产生的现金流量净额 | 294,166,079.35 |
| 期末数据和指标 | 报告期末（2023 年 6 月 30 日） |
| 期末基金总资产 | 9,477,136,367.12 |
| 期末基金净资产 | 8,474,956,017.46 |
| 期末基金总资产与净资产的比例（%） | 111.83 |

3.2 其他财务指标

单位：人民币元

| 数据和指标 | 报告期末（2023 年 6 月 30 日） |
|----------------|-----------------------|
| 期末基金份额净值 | 12.1071 |
| 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 | 254,671,797.03 | 0.3638 | — |
| 2022 年 | 476,911,864.89 | 0.6813 | — |
| 2021 年 | 540,653,355.92 | 0.7724 | — |

注：本基金基金合同于 2021 年 6 月 7 日正式生效，截至报告期末未满三年。

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 | 261,799,926.33 | 0.3740 | 2022 年度第 2 次分红金额：261,799,926.33 元。 |
| 2022 年 | 378,846,611.24 | 0.5412 | 2021 年度第 2 次分红金额：147,349,805.66 元； 2022 年度首次分红金额：231,496,805.58 元。 |
| 2021 年 | 368,969,717.16 | 0.5271 | 2021 年度首次分红。 |

注：本基金基金合同于 2021 年 6 月 7 日正式生效，截至报告期末未满三年。

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 | 136,091,846.98 | — |
| 本期折旧和摊销 | 168,758,341.01 | — |
| 本期利息支出 | 17,282,079.00 | — |
| 本期所得税费用 | 0.00 | — |
| 本期息税折旧及摊销前利润 | 322,132,266.99 | — |
| 调减项 | | |
| 1-应收项目的变动 | -310,764.55 | — |

| | | |
|---------------|----------------|---|
| 2-支付的利息及所得税费用 | -17,566,264.13 | - |
| 3-应付项目的变动 | -27,674,241.28 | - |
| 4-偿还借款支付的本金 | -21,909,200.00 | - |
| 本期可供分配金额 | 254,671,797.03 | - |

3.3.2.2 本期调整项与往期不一致的情况说明

本基金本报告期调整项与往期无不一致的情况。

3.4 报告期内基金及资产支持证券费用收取情况的说明

本报告期内计提基金管理人管理费 3,838,488.17 元, 资产支持证券管理人管理费 1,066,246.71 元, 运营管理机构运营服务费用 5,219,355.94 元, 基金托管人托管费 426,498.69 元, 资产支持证券托管人托管费 852,997.36 元。本报告期内支付基金管理人管理费 4,006,075.82 元, 资产支持证券管理人管理费 1,112,798.84 元, 运营管理机构运营服务费用 5,000,267.41 元, 基金托管人托管费 445,119.54 元, 资产支持证券托管人托管费 890,239.07 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, 基金管理人积极做好基础设施项目的运营管理, 定期召开运营工作例会, 督促运营管理机构做好运营管理工作。项目公司与运营管理机构紧密合作, 路政、收费、养护、安全等管理工作开展顺利, 公路技术状况和路面使用性能保持优良, 收费、监控、通信等联网设施设备运维良好, 收费管理平稳有序, 未发生重大安全责任事故。

报告期内, 本项目的车流量和路费收入较上年同期明显增长, 混合车流量(拆分结算后收费车流量)2,509.24 万车次, 同比增长 23.26%, 实现通行费收入(含增值税的拆分结算收入)39,164.68 万元, 同比增长 18.85%。车流量和路费收入均创通车以来同期历史新高。

基金管理人与运营管理机构紧密配合, 积极采取措施增收提效: 一是深入挖掘广河高速沿线的旅游资源, 联合沿线景区开展节假日旅游营销活动, 持续开展新媒体营销, 实现引流增收; 二是精耕细作提升养护品质, 优化养护方案, 道路状况保持优良的同时降低养护成本; 三是与监管银行及外部金融机构协商开展合格投资, 提高收益水平。

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

本项目所属行业为高速公路行业。高速公路作为重要的交通基础设施, 在国民经济和社会发展中占据重要地位, 高速公路通车里程长期保持快速增长, 2010-2022 年我国高速公路通车里程

由 7.41 万公里增长至 17.73 万公里。2023 年上半年完成公路固定资产投资 1.4 万亿元，同比增长 8.9%。高速公路基础设施的快速发展，对增强城市聚辐射能力、优化城市功能布局、促进区域经济发展起到了重要的推动作用。

2023 年上半年，交通运输经济运行持续恢复、整体好转，人员流动大幅增加，客货运输量实现不同程度的增长。根据交通运输部数据，上半年全国公路货运量 190.1 亿吨，同比增长 7.5%，公路营业性客运量 21.4 亿人，同比增长 18.6%。广东省 2023 年上半年完成公路货运量 11.8 亿吨，同比增长 1.8%；公路货物周转量 1,335.1 亿吨公里，增长 3.3%；完成公路客运量 1.5 亿人，同比增长 27.3%；公路旅客周转量 118.7 亿人公里，增长 23.8%。私家车出行方面，监测数据显示，上半年高速公路 9 座及以下小客车出行量延续快速增长，规模明显超过疫情前同期水平。

4.2.2 基础设施项目所属行业竞争情况的说明

我国高速公路投资、建设主要取决于国家及地方交通规划，高速公路建设前期投资大，投资回收期长，近年来高速公路建设成本逐渐增加，对新进入者的要求越来越高。

高速公路提供实现客货空间转移的服务，在路网线位中具有区位优势的高速公路竞争优势明显。随着国家交通基础设施建设的逐步完善，高速公路项目除了面对来自新建高速公路的竞争，还会受到高铁、地铁等新建交通基础设施的影响。

本基础设施项目位于粤港澳大湾区，是连接广州市中心区至中新知识城、增城区的主要通道，也是往河源、梅州、汕头等粤东地区和出省至福建、浙江的大通道，兼有城市通勤和跨区域大通道交通功能。报告期内，本项目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：1 公司名称：广州交投广河高速公路有限公司

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 1 月 1 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 | 路费收入 | 380,239,659.80 | 99.81 | 320,009,751.86 | 99.54 |

| | | | | | |
|---|------|----------------|--------|----------------|--------|
| 2 | 其他收入 | 735,226.53 | 0.19 | 1,465,817.49 | 0.46 |
| 3 | 合计 | 380,974,886.33 | 100.00 | 321,475,569.35 | 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

序号：1 公司名称：广州交投广河高速公路有限公司

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1月1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 | 财务费用 | 237,083,968.82 | 52.32 | 243,931,257.66 | 56.75 |
| 2 | 管理费用 | 1,089,298.30 | 0.25 | 702,309.94 | 0.17 |
| 3 | 管理人报酬 | 5,219,355.94 | 1.15 | 4,404,215.29 | 1.02 |
| 4 | 税金及附加 | 1,375,930.81 | 0.30 | 1,165,076.19 | 0.27 |
| 5 | 主营业务成本 | 208,373,955.00 | 45.98 | 179,600,829.24 | 41.79 |
| 6 | 其他成本/费用 | - | - | 0.00 | - |
| 7 | 合计 | 453,142,508.87 | 100.00 | 429,803,688.32 | 100.00 |

注：项目公司财务费用包含外部银行借款利息 17,268,905.44 元，资产支持专项计划借款利息 221,621,111.10 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

无。

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：1 公司名称：广州交投广河高速公路有限公司

| 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1月1日至 2022年6月30日 |
|----|------|-------------|------|---|----------------------------------|
| | | | | 指标数值 | 指标数值 |

| | | | | | |
|---|------------|--|----|-----------|----------|
| 1 | 净利率 | 净利润/营业收入×100%(公式中的净利润为: 财务报表净利润+本期计提的专项计划利息支出) | % | 39.25 | 36.04 |
| 2 | 毛利润额 | 营业收入-营业成本-管理人报酬 | 万元 | 16,738.16 | 13747.05 |
| 3 | 毛利润率 | 毛利润额/营业收入×100% | % | 43.94 | 42.76 |
| 4 | 息税折旧摊销前利润率 | (利润总额+利息支出+折旧摊销)/营业收入×100% | % | 88.08 | 85.97 |

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

报告期内,本项目出口车流量(收费站出口车流量与主线出口车流量)1,535.55 万车次,免费车流量(重大节假日免费通行车辆与享受“绿色通道”免费政策鲜活农产品车辆)192.39 万车次,混合车流量(拆分结算后收费车流量)2,509.24 万车次(日均 13.87 万车次),同比增长 23.26%,日均通行费收入(含增值税的拆分结算收入)216.38 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:项目公司在中国工商银行股份有限公司广州庙前直街支行(以下简称“监管银行”)开立了监管账户和基本账户,账户均接受监管银行的监管。监管账户是唯一收取基础设施项目运营收入的银行账户。项目公司向监管银行发出划款指令,经过监管银行的审核后,才能对外支付。监管账户内资金的使用限于偿还项目公司债务、分配利润、运营支出及合格投资等。偿还公司债务、分配利润及合格投资等直接通过监管账户对外支出,运营支出先由监管账户转入基础设施项目公司基本户,监管银行按照《基本户资金监管协议》约定对运营支出审核后,由基本户对外支付。

2. 现金归集和使用情况:本报告期初项目公司货币资金余额 268,680,053.11 元,报告期内,项目公司收入归集总金额为 394,525,872.47 元,其中取得路费收入 391,368,109.12 元。支出总金额为 402,080,217.33 元,其中:偿还借款本金 51,909,200.00 元,支付利息 264,349,597.46 元,支付运营支出 73,481,082.01 元,支付的各项税费 12,340,337.86 元。截至 2023 年 06 月 30 日,项目公司货币资金余额 261,125,708.25 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

本报告期内无新增对外借入款项，截至报告期末对外借入款项余额为 6,469,090,800.00 元，具体为：

1. 工商银行固定资产借款：本报告期初余额 996,000,000.00 元，借款期间 2020 年 12 月 29 日至 2036 年 12 月 10 日，报告期内归还借款本金 21,909,200.00 元，支付利息 17,566,264.13 元。为降低财务成本，提高投资者收益，经基金管理人与工商银行协商，自 2023 年 1 月 17 日起，借款年利率由 4%调整为 3.4%。期末借款余额 974,090,800.00 元。

2. 平安证券股份有限公司（代表“平安广州交投广河高速公路基础设施资产支持专项计划”）借款：本报告期初借款余额 5,525,000,000.00 元，借款期限至 2036 年 12 月 16 日，借款年利率 8%，本报告期内归还借款本金 30,000,000.00 元，支付利息 246,783,333.33 元，期末借款余额 5,495,000,000.00 元。

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

本期期初项目公司对外借入款项余额 6,521,000,000.00 元，本期归还工商银行借款 21,909,200.00 元，归还股东贷款 30,000,000.00 元，无新增对外借入款项，本期期末对外借入款项余额 6,469,090,800.00 元。

上年同期期初项目公司对外借入款项余额 6,573,000,000.00 元，其中工商银行固定资产借款 998,000,000.00 元，专项计划股东借款 5,575,000,000.00 元，上年同期归还外部借款本金 1,000,000.00 元，上年同期无新增对外借入款项，上年同期期末对外借入款项余额 6,572,000,000.00 元。

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

注：本报告期内，除基金成立时初次购入的基础设施项目，无其他购入或出售基础设施项目。

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，除基金成立时初次购入的广州至河源高速公路广州段项目外，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，基础设施项目无抵押/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

根据项目公司与中国人民财产保险股份有限公司广东省分公司（简称“中国人保广东省分公司”）于 2021 年 3 月 26 日签署的《广河高速公路（广州段）2021-2023 年度营运保险项目合同》，项目公司已向中国人保广东省分公司投保了财产一切险、营业中断险、公众责任险、雇主责任险、现金责任险、雇员忠诚险等保险，其中涉及基础设施项目的主要险种及内容如下：（1）财产一切险（编号：PQYC202144010000000598），总保额人民币 4,315,864,948.83 元，保险期限自 2021 年 3 月 1 日零时起至 2023 年 12 月 31 日 24 时止；（2）营业中断险（编号：PQA0202144010000000038），保险金额为人民币 660,000,000 元（2021 年度）、人民币 726,000,000 元（2022 年度）、人民币 798,600,000 元（2023 年度），保险期限自 2021 年 3 月 1 日零时起至 2023 年 12 月 31 日 24 时止；（3）公众责任险（编号：PZCG202144010000000712），每次事故赔偿限额人民币 30,000,000 元，保险期限自 2021 年 3 月 1 日零时起至 2023 年 12 月 31 日 24 时止。

4.10 基础设施项目未来发展展望的说明

本项目位于粤港澳大湾区，是我国经济发展最具活力的区域之一，2023 年上半年广东省实现地区生产总值 6.29 万亿元，同比增长 5.0%，继续保持全国第一。广州作为粤港澳大湾区发展的核心引擎，2023 年上半年实现地区生产总值 1.41 万亿元，同比增长 4.7%，其中本项目途径的增城区、白云区 2023 年上半年地区生产总值同比分别增长 8.6%、8.0%，增速在广州各区中分别排第一、第三位。本项目途经的中新知识城发展迅速，根据《中新广州知识城“十四五”发展规划（2021-2025 年）》，“十四五”期间计划固定资产投资规模达 5000 亿元，预计 2025 年地区生产总值突破 1000 亿元，中新知识城将成为粤港澳大湾区高质量发展重要引擎。本项目是连接广州市中心区至中新知识城的主要通道，区域发展规划的逐步实施，有望为本项目的长期稳定发展产生良好的促进作用。

另一方面，宏观经济发展和行业政策变化的影响、基础设施项目所在区域及周边其他基础设施项目带来的市场竞争，都将给基础设施项目经营带来不确定性，这些不确定性可能影响未来基础设施项目的运营收益，造成投资收益率波动的风险。

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 | 426,536.97 |
| 4 | 其他资产 | — |
| 5 | 合计 | 426,536.97 |

5.2 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：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大小排序的前五名债券投资明细

注：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大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有除基础设施资产支持证券之外的资产支持证券。

5.5 投资组合报告附注

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

5.6 报告期末其他各项资产构成

注：本基金本报告期末未持有他各项资产。

5.7 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

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、中国证券投资基金业协会相关指引

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估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，由研究中心及投资管理部门、运营部、风险管理室及法律合规监察部相关人员组成。估值委员会负责公司基金估值政策、程序及方法的制定和修订，负责定期审议公司估值政策、程序及方法的科学合理性，保证基金估值的公平、合理。估值委员会的相关人员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。

基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值发生重大变化的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与第三方定价服务机构签署服务协议，由其按约定提供相关参考数据。

5.9 报告期内基金资产重大减值计提情况的说明

本基金本报告期内基金资产无重大减值计提情况。

§ 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

平安基金管理有限公司成立于 2011 年 1 月 7 日，平安基金总部位于深圳，注册资本金为 13 亿元人民币。作为中国平安集团旗下成员，平安基金“以专业承载信赖”，为海内外各类机构和个人投资者提供专业、全面的资产管理服务。依托中国平安集团综合金融优势，平安基金建立了以固收投资、权益投资、指数投资、资产配置、资产证券化、专户六大业务板块（其中资产证券化及非标专户业务通过旗下全资子公司深圳平安汇通投资管理有限公司开展）。基于平安集团四大研究院和集团整体科技基础设施，平安基金构建了以智能投研、智能运营、智能销售、智慧风控四大应用方向为基础的资产管理智能解决方案，致力于成为国内领先的科技赋能型智慧资产管理公司。截至 2023 年 6 月 30 日，平安基金共管理 186 只公募基金，公募资产管理总规模约为 5721.58 亿元人民币。

平安基金设置独立的基础设施基金投资管理部门不动产投资信托基金（REITs）投资中心（简称“REITs 投资中心”），REITs 投资中心下设产品部与投资运营部，分别负责项目执行与投资运营，已完成公募 REITs 相关制度建设及组织架构搭建，引进基础设施运营专业人才。项目执行团队共计 12 人，平均金融行业从业年限 7 年，分别来自证券公司、会计师事务所等机构。运营团队

配备了 6 名基础设施项目投资运营的主要负责人员，平均基础设施运营投资运营从业年限 10 年。

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 | | | |
| 韩飞 | 平安广州交投广河高速公路封闭式基础设施证券投资基金基金经理 | 2021 年 6 月 7 日 | — | 10 年 | 在平安信托担任高级投资经理期间，先后参与荆东高速、益常高速、昆明水务、达茂风电等股权投资项目的前期投资，及后期项目运营管理。 | 韩飞女士，会计和金融学硕士。2013 年 5 月入职平安信托有限责任公司基建投资事业部，任高级投资经理。2021 年 4 月入职平安基金管理有限公司，现任平安广州交投广河高速公路封闭式基础设施证券投资基金基金经理。 |
| 马赛 | 平安广州交投广河高速公路封闭式基础设施证券投资基金基金经理 | 2021 年 6 月 7 日 | — | 9 年 | 先后在茂湛高速、开阳高速担任计划财务部经理，负责高速公路项目运营计划和财务管理工作。 | 马赛先生，管理学学士，会计师。2014 年 4 月入职新粤（广州）投资有限公司（广东省交通集团有限公司二级子公司），先后担任广东茂湛高速公路有限公司计划财务部经理、广东开阳高速公路有限公司计划财务部经理。2021 年 4 月入职平安基金管理有限公司，现任平安广州交投广河高速公路封闭式基 |

| | | | | | | |
|----|-------------------------------|----------------|---|-----|--|--|
| | | | | | | 基础设施证券投资基金基金经理，同时兼任项目公司财务总监。 |
| 孙磊 | 平安广州交投广河高速公路封闭式基础设施证券投资基金基金经理 | 2021 年 6 月 7 日 | - | 7 年 | 在上海城建养护管理有限公司从事高速公路运营养护工作，主要项目有沪渝高速上海段；在中交第三航务工程局有限公司从事基础设施投资管理工作，主要项目有盐城快速路网三期 PPP 项目、株洲清水塘产业新城 PPP 项目、徐圩新区达标尾水排海 PPP 项目。 | 孙磊先生，管理学硕士，法律职业资格。2015 年 7 月入职上海城建养护管理有限公司（上海隧道工程股份有限公司全资子公司），任助理工程师。2018 年 8 月入职中交第三航务工程局有限公司，任投资事业部投资经理。2020 年 11 月入职平安基金管理有限公司，现任平安广州交投广河高速公路封闭式基础设施证券投资基金基金经理。 |

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确认的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确认的聘任日期和解聘日期。

2、基础设施项目运营或投资管理年限自基金经理实际从事基础设施项目运营或管理工作之日起统计。

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、中国证监会和本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，本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

本报告期内，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本基金管理人严格遵守《平安基金管理有限公司公平交易制度》、《平安基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》，严格执行法律法规及制度要求，从以下五个方面对交易行为进行严格控制：一是搭建平等的投资信息平台，合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策等方面享有公平的机会。二是制定公平交易规则，建立科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。三是加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。四是明确报告制度和路线，根据法规及公司内部要求，分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的投资业绩进行分析、评估，形成分析报告，由法律合规监察部、督察长、总经理签署后，妥善保存备查，如果发现涉嫌违背公平交易原则的行为，及时向公司管理层汇报并采取相关控制和改进措施。五是建立投资组合投资信息的管理及保密制度，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

6.4 管理人对报告期内基金的投资和运营分析

1. 报告期内基金投资分析

本基金除投资基础设施资产支持证券外，其余基金资产可依法投资于利率债、AAA 级信用债或货币市场工具。报告期内，项目公司监管账户开展了协定存款业务。此外，项目公司与工商银行、中信银行分别签署了定期存款合同，进行合格投资。

本基金投资的基础设施项目本期财务情况详见本报告“4.2 基础设施项目公司运营财务数据”；本基金本期预计实现可供分配金额详见本报告“3.3 基金收益分配情况”。

2. 报告期内基金运营分析

（1）基金运营情况

报告期内，本基金运营正常，管理人秉承投资者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，基金管理人与运营管理机构积极采取措施引流增收、降本增效，全面抓好经营管理，促进项目经营业绩提升。

引流增收方面，深入挖掘广河高速沿线的旅游资源，依托微信公众号、小红书、抖音等新媒体平台，常态化开展节假日旅游营销；抓住春节、暑期等旅游旺季，联合地方旅游局、沿线景区开展包括“畅游交投路 乐享生态美”“夏日炎炎，有‘荔’超甜”“沐浴回归线 康养三伏汤”等特色旅游宣传；举办为期 6 个月的“平安广河，中新有礼”服务区货车营销活动，稳固生产性车流。

安全保畅方面，大力提升收费站窗口服务水平，运用智能收费设备提升通行体验，提高车流通行效率。坚持以“路警联勤”为牵引，持续深化“一路多方”交通工作机制，联合交警建立“网格化+小循环”节假日保畅勤务模式，完成广河高速重点路段交安设施专项改造，推广应用爆闪灯情报板、智能预警快干预系统，持续提升应急响应能力，保障道路安全畅通。

6.5 管理人对报告期内基金收益分配情况的说明

报告期内，基金管理人于 2023 年 4 月 12 日发布《平安基金管理有限公司关于平安广州交投广河高速公路封闭式基础设施证券投资基金收益分配的公告》（简称“收益分配公告”），以 2022 年 12 月 31 日为收益分配基准日，实际向投资者分红 261,799,926.33 元，每份基金份额发放红利 0.3740 元。该次分红为本基金成立以来的第四次分红，分红符合相关法规及基金合同约定。

6.6 管理人对宏观经济及行业走势的简要展望

1. 宏观经济展望

2023 年上半年，随着经济社会全面恢复常态化运行，宏观政策显效发力，我国经济运行整体回升向好。根据国家统计局数据，初步核算，上半年国内生产总值 593,034 亿元，按不变价格计算，同比增长 5.5%。分产业看，第一产业增加值 30,416 亿元，同比增长 3.7%；第二产业增加值 230,682 亿元，增长 4.3%；第三产业增加值 331,937 亿元，增长 6.4%。上半年，社会消费品零售总额同比增长 8.2%，全国规模以上工业增加值同比增长 3.8%，全国规模以上工业企业实现利润同比下降 16.8%。

4 月份以来，经济指标边际走弱，4-6 月全国居民消费价格同比分别增长 0.1%、0.2%、0.0%，环比分别下降 0.1%、0.2%、0.2%；全国工业生产者出厂价格分别同比下降 3.6%、4.6%、5.4%；制造业采购经理指数分别为 49.2%、48.8%和 49.0%，连续 3 个月位于临界点以下；非制造业商务活动指数分别为 56.4%、54.5%、53.2%，仍高于临界点，但呈走弱趋势。

7 月 24 日政治局会议指出，当前经济运行面临新的困难挑战，主要是国内需求不足，一些企

业经营困难，重点领域风险隐患较多，外部环境复杂严峻。但我国经济具有巨大的发展韧性和潜力，长期向好的基本面没有改变。会议强调加大宏观政策调控力度，着力扩大内需、提振信心，不断推动经济运行持续好转。近期，国家发展改革委等部门先后发布了《关于促进汽车消费的若干措施》《关于恢复和扩大消费的措施》，一系列促销费政策密集出台。国家发展改革委还发布了《进一步抓好抓实促进民间投资工作努力调动民间投资积极性的通知》，激发民间投资积极性。随着政策效应的逐步显现，我国经济发展动力将不断增强。

2. 高速公路行业展望

根据“十四五”规划和 2035 年远景目标纲要，我国将加快建设现代化综合交通运输体系，提升国家高速公路网络质量。2023 年 3 月 31 日，交通运输部、国家铁路局、中国民用航空局、国家邮政局、中国国家铁路集团有限公司联合印发《加快建设交通强国五年行动计划（2023—2027 年）》，加速构建“全国 123 出行交通圈”和“全球 123 快货物流圈”，“以联网、补网、强链”为重点，优化综合交通基础设施布局、结构和功能，新增国家高速公路约 1.1 万公里，“71118”国家高速公路网主线总体贯通，将促进高速公路行业高质量发展取得新突破。

截至 2022 年末，广东省高速公路通车总里程达 11211 公里，连续 9 年位居全国第一。根据《广东省高速公路网规划（2020-2035 年）》，到 2025 年，广东省高速公路总里程将达到 12500 公里，形成以粤港澳大湾区为核心、快捷通达周边省区的高速公路网络。广州市高质量发展大会提出广州要聚力建设国际综合交通枢纽，着力构建“通道+枢纽+网络”交通物流体系，高效串联城市内部各组团，提升中心城区和广州东部、南部区域路网互联互通水平。随着交通网络不断完善，人员出行更加方便，物流通达更加快捷，将促进国民经济和高速公路行业良性持续发展。

根据《广东省关于香港机动车经港珠澳大桥珠海公路口岸入出内地的管理办法》，从 2023 年 7 月 1 日起符合条件的香港机动车驾驶人在预约通关获准后，可驾车经港珠澳大桥珠海公路口岸出入内地。“港车北上”政策的实施，香港居民将能驾车自由往来粤港两地，粤港澳大湾区经贸合作和人员往来将更加紧密更加便利。

6.7 管理人对关联交易及相关利益冲突的防范措施

为保证公司规范化运作，有效地防范和化解利益输送、利益冲突的风险，基金管理人建立了科学、严密、高效的内部控制体系，制定了利益冲突管理、关联交易的相关制度，进而防范利益冲突，保障基金份额持有人利益。

§ 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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，本基金的管理人——平安基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

7.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实性、准确性和完整性发表意见

本托管人依法对平安基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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：平安广州交投广河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 | 261,579,164.75 | 268,758,207.86 |
| 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 | 11,788,760.73 | 11,477,996.18 |
| 应收清算款 | | — | — |
| 应收利息 | | — | — |

| | | | |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 存货 | 8.5.7.8 | - | - |
| 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 | 63,478,591.28 | 67,452,565.16 |
| 在建工程 | 8.5.7.13 | - | - |
| 使用权资产 | 8.5.7.14 | 554,630.87 | 614,055.59 |
| 无形资产 | 8.5.7.15 | 9,139,735,219.49 | 9,304,460,161.90 |
| 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 | - | - |
| 其他资产 | 8.5.7.20 | - | - |
| 资产总计 | | 9,477,136,367.12 | 9,652,762,986.69 |
| 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 | 2,979,999.43 | 30,511,512.29 |
| 应付职工薪酬 | 8.5.7.23 | 30,872.40 | 90,600.33 |
| 应付清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 5,792,763.37 | 5,787,814.62 |
| 应付托管费 | | 1,279,496.06 | 1,335,358.62 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | 8.5.7.24 | 5,982,288.91 | 6,312,108.44 |
| 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 | 975,010,774.64 | 997,217,333.33 |
| 预计负债 | 8.5.7.28 | - | - |
| 租赁负债 | 8.5.7.29 | 572,994.59 | 623,795.35 |
| 递延收益 | | - | - |
| 递延所得税负债 | 8.5.7.19.2 | 4,556,206.60 | 4,556,206.60 |
| 其他负债 | 8.5.7.30 | 5,974,953.66 | 5,664,160.30 |
| 负债合计 | | 1,002,180,349.66 | 1,052,098,889.88 |

| | | | |
|---------------|----------|------------------|------------------|
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 8.5.7.31 | 9,114,000,000.00 | 9,114,000,000.00 |
| 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 | -639,043,982.54 | -513,335,903.19 |
| 所有者权益合计 | | 8,474,956,017.46 | 8,600,664,096.81 |
| 负债和所有者权益总计 | | 9,477,136,367.12 | 9,652,762,986.69 |

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 12.1071 元，基金份额总额 700,000,000 份。

8.1.2 个别资产负债表

会计主体：平安广州交投广河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 | 426,536.97 | 59,196.05 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | - | - |
| 衍生金融资产 | | - | - |
| 交易性金融资产 | | 0.00 | - |
| 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 | 9,113,800,000.00 | 9,113,800,000.00 |
| 其他资产 | | - | - |
| 资产总计 | | 9,114,226,536.97 | 9,113,859,196.05 |
| 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 | | 3,838,488.17 | 4,006,075.82 |
| 应付托管费 | | 426,498.69 | 445,119.54 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 其他负债 | | 59,507.37 | 130,000.00 |
| 负债合计 | | 4,324,494.23 | 4,581,195.36 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | | 9,114,000,000.00 | 9,114,000,000.00 |
| 资本公积 | | - | - |
| 其他综合收益 | | - | - |
| 未分配利润 | | -4,097,957.26 | -4,721,999.31 |
| 所有者权益合计 | | 9,109,902,042.74 | 9,109,278,000.69 |
| 负债和所有者权益总计 | | 9,114,226,536.97 | 9,113,859,196.05 |

8.2 利润表

8.2.1 合并利润表

会计主体：平安广州交投广河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 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|------------------------|----------|--|---|
| 一、营业总收入 | | 382,893,190.94 | 323,206,821.18 |
| 1. 营业收入 | | 380,974,886.33 | 321,475,569.35 |
| 2. 利息收入 | | 1,918,304.61 | 1,731,251.83 |
| 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 | - | - |

| | | | |
|----------------------------|----------|----------------|----------------|
| 8. 其他业务收入 | 8.5.7.41 | - | - |
| 二、营业总成本 | | 246,886,486.76 | 221,107,102.65 |
| 1. 营业成本 | | 208,373,955.00 | 179,600,829.24 |
| 2. 利息支出 | 8.5.7.42 | 17,282,079.00 | 21,336,996.66 |
| 3. 税金及附加 | 8.5.7.43 | 8,605,512.68 | 8,480,053.54 |
| 4. 销售费用 | 8.5.7.44 | - | - |
| 5. 管理费用 | 8.5.7.45 | 1,089,298.30 | 702,309.94 |
| 6. 研发费用 | | - | - |
| 7. 财务费用 | 8.5.7.46 | 58,820.71 | 33,907.26 |
| 8. 管理人报酬 | | 10,124,090.82 | 9,465,463.13 |
| 9. 托管费 | | 1,279,496.05 | 1,320,325.52 |
| 10. 投资顾问费 | | - | - |
| 11. 信用减值损失 | 8.5.7.47 | - | - |
| 12. 资产减值损失 | 8.5.7.48 | - | - |
| 13. 其他费用 | 8.5.7.49 | 73,234.20 | 167,217.36 |
| 三、营业利润（营业亏损以“-”号填列） | | 136,006,704.18 | 102,099,718.53 |
| 加：营业外收入 | 8.5.7.50 | 146,950.57 | 335,936.29 |
| 减：营业外支出 | 8.5.7.51 | 61,807.77 | 385,287.24 |
| 四、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 136,091,846.98 | 102,050,367.58 |
| 减：所得税费用 | 8.5.7.52 | - | - |
| 五、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 136,091,846.98 | 102,050,367.58 |
| 1. 持续经营净利润（净亏损以“-”号填列） | | 136,091,846.98 | 102,050,367.58 |
| 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 | | 136,091,846.98 | 102,050,367.58 |

8.2.2 个别利润表

会计主体：平安广州交投广河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 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|--------------------------|--|------------------------------------|------------------------------------|
| 一、收入 | | 266,748,612.68 | 150,165,076.52 |
| 1. 利息收入 | | 13,332.92 | 37,304.26 |
| 2. 投资收益（损失以“-”号填列） | | 266,735,279.76 | 150,127,772.26 |
| 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 | | 4,324,644.30 | 4,560,796.04 |
| 1. 管理人报酬 | | 3,838,488.17 | 3,960,976.57 |
| 2. 托管费 | | 426,498.69 | 440,108.50 |
| 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 | | 59,657.44 | 159,710.97 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 262,423,968.38 | 145,604,280.48 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 262,423,968.38 | 145,604,280.48 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 262,423,968.38 | 145,604,280.48 |

8.3 现金流量表

8.3.1 合并现金流量表

会计主体：平安广州交投广河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 1 月 1 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 | | 391,368,109.12 | 328,419,307.06 |
| 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 | | 1,918,304.61 | 1,731,251.83 |
| 6. 收到的税费返还 | | - | 20,211,291.61 |
| 7. 收到其他与经营活动有关的现金 | 8.5.7.53.1 | 1,279,721.36 | 2,931,450.32 |
| 经营活动现金流入小计 | | 394,566,135.09 | 353,293,300.82 |
| 8. 购买商品、接受劳务支付的现金 | | 70,882,154.73 | 59,502,370.79 |
| 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 | | 238,547.59 | 264,887.05 |
| 13. 支付的各项税费 | | 20,390,745.63 | 16,431,302.08 |
| 14. 支付其他与经营活动有关的现金 | 8.5.7.53.2 | 8,888,607.79 | 12,810,280.39 |
| 经营活动现金流出小计 | | 100,400,055.74 | 89,008,840.31 |
| 经营活动产生的现金流量净额 | | 294,166,079.35 | 264,284,460.51 |
| 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 | | - | 10,135,088.13 |
| 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 | | - | 10,135,088.13 |
| 投资活动产生的现金流量净额 | | - | -10,135,088.13 |
| 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 | | 21,909,200.00 | 1,000,000.00 |
| 26. 偿付利息支付的现金 | | 17,566,264.13 | 21,469,634.19 |
| 27. 分配支付的现金 | | 261,799,926.33 | 147,349,805.66 |
| 28. 支付其他与筹资活动有关的现金 | 8.5.7.53.6 | 69,732.00 | - |
| 筹资活动现金流出小计 | | 301,345,122.46 | 169,819,439.85 |
| 筹资活动产生的现金流量净额 | | -301,345,122.46 | -169,819,439.85 |
| 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 | | -7,179,043.11 | 84,329,932.53 |
| 加：期初现金及现金等价物余额 | | 268,758,207.86 | 171,683,638.76 |
| 六、期末现金及现金等价物余额 | | 261,579,164.75 | 256,013,571.29 |

8.3.2 个别现金流量表

会计主体：平安广州交投广河高速公路封闭式基础设施证券投资基金

报告截止日：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 1 月 1 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 | | 266,735,279.76 | 150,127,772.26 |
| 2. 取得基础设施投资收益收到的现金 | | - | - |
| 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 | | 13,332.92 | 37,304.26 |
| 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 | | 266,748,612.68 | 150,165,076.52 |
| 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 | | - | - |
| 13. 支付其他与经营活动有关的现金 | | 4,581,345.43 | 5,373,935.11 |
| 经营活动现金流出小计 | | 4,581,345.43 | 5,373,935.11 |
| 经营活动产生的现金流量净额 | | 262,167,267.25 | 144,791,141.41 |
| 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 | | 261,799,926.33 | 147,349,805.66 |
| 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 | | 261,799,926.33 | 147,349,805.66 |
| 筹资活动产生的现金流量净额 | | -261,799,926.33 | -147,349,805.66 |
| 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 | | 367,340.92 | -2,558,664.25 |
| 加：期初现金及现金等价物余额 | | 59,196.05 | 4,586,879.08 |

| | | | |
|----------------|--|------------|--------------|
| 五、期末现金及现金等价物余额 | | 426,536.97 | 2,028,214.83 |
|----------------|--|------------|--------------|

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：平安广州交投广河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 | 9,114,000,000.00 | - | - | - | - | - | -513,335,903.19 | 8,600,664,096.81 |
| 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 | 9,114,000,000.00 | - | - | - | - | - | -513,335,903.19 | 8,600,664,096.81 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | - | - | - | - | - | - | -125,708,079.35 | -125,708,079.35 |
| （一）综合收益总额 | - | - | - | - | - | - | 136,091,846.98 | 136,091,846.98 |
| （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 | - | - | - | - | - | - | -261,799,926.33 | -261,799,926.33 |
| (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 | 9,114,000,000.00 | - | - | - | - | - | -639,043,982.54 | 8,474,956,017.46 |
| 项目 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 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 | 9,114,000,000.00 | - | - | - | - | - | -238,883,679.06 | 8,875,116,320.94 |
| 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 | 9,114,000,000.00 | - | - | - | - | - | -238,883,679.06 | 8,875,116,320.94 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | - | - | - | - | - | - | -45,299,438.08 | -45,299,438.08 |
| （一）综合收益总额 | - | - | - | - | - | - | 102,050,367.58 | 102,050,367.58 |
| （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 | - | - | - | - | - | - | -147,349,805.66 | -147,349,805.66 |
| （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 | 9,114,000,000.00 | - | - | - | - | - | -284,183,117.14 | 8,829,816,882.86 |

8.4.2 个别所有者权益变动表

会计主体：平安广州交投广河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 | 9,114,000,000.00 | - | - | -4,721,999.31 | 9,109,278,000.69 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 二、本期期初余额 | 9,114,000,000.00 | - | - | -4,721,999.31 | 9,109,278,000.69 |
| 三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列) | - | - | - | 624,042.05 | 624,042.05 |
| (一)综合收益总额 | - | - | - | 262,423,968.38 | 262,423,968.38 |
| (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 | - | - | - | -261,799,926.33 | -261,799,926.33 |
| (四)其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - | - |
| (五)其他 | - | - | - | - | - |
| 四、本期期末余额 | 9,114,000,000.00 | - | - | -4,097,957.26 | 9,109,902,042.74 |
| 项目 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 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 | 9,114,000,000.00 | - | - | -886,852.43 | 9,113,113,147.57 |

| | | | | | |
|-----------------------------|------------------|---|---|-----------------|------------------|
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 二、本期期初余额 | 9,114,000,000.00 | - | - | -886,852.43 | 9,113,113,147.57 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | - | - | - | -1,745,525.18 | -1,745,525.18 |
| （一）综合收益总额 | - | - | - | 145,604,280.48 | 145,604,280.48 |
| （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 | - | - | - | -147,349,805.66 | -147,349,805.66 |
| （四）其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - | - |
| （五）其他 | - | - | - | - | - |
| 四、本期期末余额 | 9,114,000,000.00 | - | - | -2,632,377.61 | 9,111,367,622.39 |

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：

罗春风

林婉文

张南南

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

8.5 报表附注

8.5.1 基金基本情况

平安广州交投广河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”)证监许可[2021]1669号《关于准予平安广州交投广河高速公路封闭式基础设施证券投资基金注册的批复》核准,由平安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安广州交投广河高速公路封闭式基础设施证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型封闭式,存续期限为99年,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币9,114,000,000.00元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第0588号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安广州交投广河高速公路封闭式基础设施证券投资基金基金合同》于2021年6月7日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为700,000,000.00份基金份额。本基金的基金管理人为平安基金管理有限公司,基金

托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)。

经深圳证券交易所审核同意,本基金 697,076,279 份基金份额于 2021 年 6 月 21 日在深交所上市交易。其中,本次上市交易无限售安排的份额为 144,267,279 份,有限售安排的份额为 552,809,000 份。

根据《平安广州交投广河高速公路封闭式基础设施证券投资基金基金合同》的相关规定,本基金以契约型封闭式的方式运作,在封闭运作期内,本基金不办理申购与赎回业务。基金上市后,除按照基金合同约定进行限售的基金份额外,场内份额可以上市交易,投资者可将其持有的场外基金份额通过基金通平台转让基金份额或通过办理跨系统转托管业务转至场内后上市交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安广州交投广河高速公路封闭式基础设施证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金存续期内以 80%以上基金资产投资于以广州交投或其他机构拥有的优质收费公路基础设施项目为投资标的的资产支持专项计划,并持有资产支持专项计划的全部资产支持专项计划份额。本基金的其余基金资产应当依法投资于利率债、AAA 级信用债或货币市场工具。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的其他品种,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合理地调整投资范围。本基金暂不设立业绩比较基准。

本基金所投资基础设施项目的基本信息如下:

本基金初始投资的基础设施项目为广州交投广河高速公路有限公司(以下简称“项目公司”)享有的广州至河源高速公路(广州段)的特许经营权。

项目公司是由广州交通投资集团有限公司(以下简称“广交投集团”)于 2020 年 11 月 30 日在中华人民共和国广东省广州市黄埔区投资成立的有限责任公司。原注册资本为人民币 1,000,000.00 元。项目公司经批准的经营范围为道路运输业。

广交投集团为本基金的原始权益人。

本基金购买基础设施项目交易的具体情况如下:

平安证券股份有限公司(以下简称“平安证券”)按照国家相关法律、法规设立平安广州交投广河高速公路基础设施资产支持专项计划(以下简称“资产支持专项计划”),本基金出资人民币 9,113,800,000.00 元认购资产支持专项计划全部份额。资产支持专项计划的计划管理人为平安证券。

根据平安证券(代表资产支持专项计划)与广交投集团签订的《股权转让协议》,于 2021 年 6 月 8 日,资产支持专项计划取得项目公司享有的广州至河源高速公路(广州段)的特许经营权,转

让对价为人民币 6,490,664,543.60 元。同时,根据平安证券(代表资产支持专项计划)与项目公司签订的《借款合同》,资产支持专项计划向项目公司提供无固定期限借款人民币 2,619,038,296.13 元。

8.5.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《平安广州交投广河高速公路封闭式基础设施证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

8.5.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的财务报表符合企业会计准则及其他有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2023 年 6 月 30 日的合并及个别财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的合并及个别经营成果和现金流量等有关信息。

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。

8.5.5 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

8.5.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

8.5.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

8.5.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55 号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、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《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》、财税[2017]2 号

《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税 [2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

企业所得税税率为 25%，税基为应纳税所得额；

增值税税率为 13%及 3%，税基为应纳税增值额（一般计税方式：应纳税额按应纳税销售额乘以适用税率扣除当期允许抵扣的进项税后的余额计算；简易计税方式：应纳税额按应纳税销售额乘以征收率计算）；

城市维护建设税税率为 7%，税基为缴纳的增值税税额；

教育费附加税率为 5%，税基为缴纳的增值税税额；

房产税税率为 1.2%及 12%，税基为房屋原值的 70%或租金收入；

土地使用税税率为 3-12/元 平方米，税基为土地面积。

(1) 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。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

根据财政部和国家税务总局《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》(财税[2016]36 号)规定，项目公司作为公路经营企业中的一般纳税人收取试点前开工的高速公路的车辆通行费，可以选择适用简易计税方法，减按 3%的征收率计算应纳税额。

一般纳税人应税收入按 13%的税率计算销项税，并按扣除当期允许抵扣的进项税额后的差额计缴增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

(3) 资产支持专项计划及本基金以契约形式的形式存在，其并非企业所得税纳税主体，其从项目公司取得的利息收入或投资收益及分红无需缴纳企业所得税。项目公司按《中华人民共和国企业所得税法》计算及缴纳企业所得税，所得税率为 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 2023 年 6 月 30 日 |
|--------|------------------------|
| 库存现金 | - |
| 银行存款 | 261,579,164.75 |
| 其他货币资金 | - |
| - | - |
| 小计 | 261,579,164.75 |
| 减：减值准备 | - |
| 合计 | 261,579,164.75 |

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 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 61,579,164.75 |
| 定期存款 | 200,000,000.00 |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | 200,000,000.00 |
| 其他存款 | - |
| 应计利息 | - |
| 小计 | 261,579,164.75 |
| 减：减值准备 | - |
| 合计 | 261,579,164.75 |

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

本基金本报告期末不存在因抵押、质押或冻结等对使用有限制、有潜在回收风险的款项。

8.5.7.2 交易性金融资产

注：本基金本报告期末无交易性金融资产。

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：本基金于本报告期末未持有买入返售金融资产。

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

本基金于本报告期末未持有买入返售金融资产。

8.5.7.4 债权投资

8.5.7.4.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

8.5.7.4.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

8.5.7.5 其他债权投资

8.5.7.5.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

8.5.7.5.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

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

注：本基金本报告期末无其他权益工具投资。

8.5.7.6.2 报告期内其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末无其他权益工具投资。

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 |
|--------|------------------------|
| 1 年以内 | 11,788,760.73 |
| 1—2 年 | — |
| 小计 | 11,788,760.73 |
| 减：坏账准备 | — |
| 合计 | 11,788,760.73 |

8.5.7.7.2 按坏账准备计提方法分类披露

注：于 2023 年 6 月 30 日，本基金的应收账款均为按组合计提预期信用损失。本基金管理人经评估对手方的偿还能力以及账龄情况，认为信用风险较低，预期信用损失影响不重大。

8.5.7.7.3 单项计提坏账准备的应收账款

注：本基金本报告期末无单项计提坏账准备的应收账款。

8.5.7.7.4 按组合计提坏账准备的应收账款

注：本基金本报告期末无按组合计提坏账准备的应收账款。

8.5.7.7.5 本期坏账准备的变动情况

注：本基金本期坏账准备未发生变动，本报告期末坏账准备为零。

8.5.7.7.6 本期实际核销的应收账款情况

注：本基金本报告期无实际核销的应收账款。

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 |
|--------------------|---------------|-----------------|---------|---------------|
| 广东联合电子服务股份有限公司 | 11,441,556.59 | 97.05 | — | 11,441,556.59 |
| 广州高速运营管理有限公司 | 109,459.32 | 0.93 | — | 109,459.32 |
| 广州市增城区城市建设投资集团有限公司 | 78,300.00 | 0.66 | — | 78,300.00 |
| 广州德明物业管理有限公司 | 69,600.00 | 0.59 | — | 69,600.00 |
| 广州市开发区市政设施管理中心 | 13,291.50 | 0.11 | — | 13,291.50 |
| 合计 | 11,712,207.41 | 99.35 | — | 11,712,207.41 |

8.5.7.8 存货

8.5.7.8.1 存货分类

注：本基金本报告期末无存货。

8.5.7.8.2 存货跌价准备及合同履约成本减值准备

注：本基金本报告期末无存货。

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：本基金本报告期末无合同资产。

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：本基金本报告期末无合同资产。

8.5.7.9.3 报告期内合同资产计提减值准备情况

注：本基金本报告期末无合同资产。

8.5.7.10 持有待售资产

注：本基金本报告期末无持有待售资产。

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：本基金本报告期末无投资性房地产。

8.5.7.11.2 采用公允价值计量模式的投资性房地产

注：本基金本报告期末无投资性房地产。

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 |
|--------|------------------------|
| 固定资产 | 63,478,591.28 |
| 固定资产清理 | - |
| 合计 | 63,478,591.28 |

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 | 公路附属设施 | 其他 | 合计 |
|-----------|--------|------|------|------|---------------|-----------|---------------|
| 一、账面原值 | | | | | | | |
| 1. 期初余额 | - | - | - | - | 92,515,173.41 | 46,427.00 | 92,561,600.41 |
| 2. 本期增加金额 | - | - | - | - | - | - | - |
| 购置 | - | - | - | - | - | - | - |
| 在建工程转入 | - | - | - | - | - | - | - |
| 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 | - | - | - | - | 92,515,173.41 | 46,427.00 | 92,561,600.41 |
| 二、累计折旧 | | | | | | | |
| 1. 期初余额 | - | - | - | - | 25,087,608.33 | 21,426.92 | 25,109,035.25 |
| 2. 本期增加金额 | - | - | - | - | 3,966,622.86 | 7,351.02 | 3,973,973.88 |

| | | | | | | | |
|----------------|---|---|---|---|-------------------|---------------|-------------------|
| 本 期 计提 | - | - | - | - | 3,966,62 2.86 | 7,351.02 | 3,973,97 3.88 |
| 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 | - | - | - | - | 29,054,2 31.19 | 28,777.9 4 | 29,083,0 09.13 |
| 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 | - | - | - | - | 63,460,9 42.22 | 17,649.0 6 | 63,478,5 91.28 |
| 2. 期 初 账面价值 | - | - | - | - | 67,427,5 65.08 | 25,000.0 8 | 67,452,5 65.16 |

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：本基金本报告期末无工程物资。

8.5.7.14 使用权资产

单位：人民币元

| 项目 | 房屋及建筑物 | 合计 |
|-----------|------------|------------|
| 一、账面原值 | | |
| 1. 期初余额 | 673,480.31 | 673,480.31 |
| 2. 本期增加金额 | - | - |
| 3. 本期减少金额 | - | - |
| 4. 期末余额 | 673,480.31 | 673,480.31 |
| 二、累计折旧 | | |
| 1. 期初余额 | 59,424.72 | 59,424.72 |
| 2. 本期增加金额 | 59,424.72 | 59,424.72 |
| 本期计提 | 59,424.72 | 59,424.72 |
| 3. 本期减少金额 | - | - |
| 处置 | - | - |
| 4. 期末余额 | 118,849.44 | 118,849.44 |
| 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 | 554,630.87 | 554,630.87 |
| 2. 期初账面价值 | 614,055.59 | 614,055.59 |

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 | 软件 | 合计 |
|-----------|------------------|-------|-----|-------|------------|------------------|
| 一、账面原值 | | | | | | |
| 1. 期初余额 | 9,871,192.745.02 | - | - | - | 382,661.21 | 9,871,575,406.23 |
| 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 | 9,871,192,745.02 | - | - | - | 382,661.21 | 9,871,575,406.23 |
| 二、累计摊销 | | | | | | |
| 1. 期初余额 | 567,039,273.22 | - | - | - | 75,971.11 | 567,115,244.33 |
| 2. 本期增加金额 | 164,700,017.81 | - | - | - | 24,924.60 | 164,724,942.41 |
| 本期计提 | 164,700,017.81 | - | - | - | 24,924.60 | 164,724,942.41 |
| 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 | 731,739,291.03 | - | - | - | 100,895.71 | 731,840,186.74 |
| 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 | 9,139,453,453.99 | - | - | - | 281,765.50 | 9,139,735,219.49 |
| 2. 期初账面价值 | 9,304,153,471.80 | - | - | - | 306,690.10 | 9,304,460,161.90 |

8.5.7.15.2 无形资产的其他说明

无。

8.5.7.16 开发支出

注：本基金本报告期末及期初无开发支出。

8.5.7.17 商誉

8.5.7.17.1 商誉账面原值

注：本基金本报告期末及期初无商誉。

8.5.7.17.2 商誉减值准备

注：本基金本报告期末及期初无商誉。

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

本基金本报告期末及期初无商誉。

8.5.7.18 长期待摊费用

注：本基金本报告期末及期初无长期待摊费用。

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 | |
|-----------|------------------------|----------------|
| | 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 | - | - |
| 可抵扣亏损 | 620,657,187.28 | 155,164,296.82 |
| 合计 | 620,657,187.28 | 155,164,296.82 |

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 2023 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 | - | - |
| 无形资产 | 638,882,013.68 | 159,720,503.42 |
| 合计 | 638,882,013.68 | 159,720,503.42 |

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 | 155,164,296.82 | - | 121,953,618.15 | - |
| 递延所得税负债 | 155,164,296.82 | 4,556,206.60 | 121,953,618.15 | 4,556,206.60 |

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

注：无。

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

注：本基金本报告期末无其他资产。

8.5.7.20.2 预付账款

8.5.7.20.2.1 按账龄列示

注：本基金本报告期末无预付账款。

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

注：无。

8.5.7.20.3 其他应收款

8.5.7.20.3.1 按账龄列示

注：本基金本报告期末无其他应收款。

8.5.7.20.3.2 按款项性质分类情况

注：无。

8.5.7.20.3.3 其他应收款坏账准备计提情况

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

注：无。

8.5.7.21 短期借款

注：本基金本报告期末无短期借款。

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 |
|-------|------------------------|
| 应付质保金 | 2,748,303.46 |
| 其他 | 231,695.97 |
| 合计 | 2,979,999.43 |

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 | 90,600.33 | 158,325.72 | 218,053.65 | 30,872.40 |
| 离职后福利-设定 提存计划 | - | 20,926.04 | 20,926.04 | - |
| 合计 | 90,600.33 | 179,251.76 | 238,979.69 | 30,872.40 |

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 | 75,600.00 | 130,725.16 | 190,453.09 | 15,872.07 |
| 二、职工福利费 | - | - | - | - |
| 三、社会保险费 | - | 10,386.56 | 10,386.56 | - |
| 其中：医疗保险费 | - | 9,827.04 | 9,827.04 | - |
| 工伤保险费 | - | 559.52 | 559.52 | - |
| 生育保险费 | - | - | - | - |
| 四、住房公积金 | - | 17,214.00 | 17,214.00 | - |
| 五、工会经费和职 工教育经费 | 15,000.33 | - | - | 15,000.33 |
| 合计 | 90,600.33 | 158,325.72 | 218,053.65 | 30,872.40 |

8.5.7.23.3 设定提存计划

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 |
|--------|------|-----------|-----------|------|
| 基本养老保险 | - | 20,084.40 | 20,084.40 | - |
| 失业保险费 | - | 841.64 | 841.64 | - |
| 合计 | - | 20,926.04 | 20,926.04 | - |

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 |
|---------|------------------------|
| 增值税 | 5,315,767.65 |
| 消费税 | — |
| 企业所得税 | — |
| 个人所得税 | 64.61 |
| 城市维护建设税 | 388,766.38 |
| 教育费附加 | 277,690.27 |
| 房产税 | — |
| 土地使用税 | — |
| 土地增值税 | — |
| 其他 | — |
| 合计 | 5,982,288.91 |

8.5.7.25 应付利息

注：详见 8.5.7.27 长期借款。

8.5.7.26 合同负债

8.5.7.26.1 合同负债情况

注：本基金本报告期末无合同负债。

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

单位：人民币元

| 借款类别 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 |
|-----------------|------------------------|
| 质押借款 | — |
| 抵押借款 | — |
| 保证借款 | — |
| 信用借款 | 974,090,800.00 |
| 未到期应付利息 | — |
| 分期付息到期还本的长期借款利息 | 919,974.64 |
| 合计 | 975,010,774.64 |

注：2023 年 6 月 30 日，长期借款的加权平均年利率为 3.63% (2022 年 12 月 31 日：4.19%)。

8.5.7.28 预计负债

注：本基金本报告期末及期初无预计负债。

8.5.7.29 租赁负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 |
|------|------------------------|
| 办公场地 | 572,994.59 |
| 合计 | 572,994.59 |

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 |
|--------|------------------------|
| 其他应付款 | 5,534,160.30 |
| 预收款项 | 381,285.99 |
| 其他流动负债 | 59,507.37 |
| 合计 | 5,974,953.66 |

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 2023 年 6 月 30 日 |
|-------|------------------------|
| 路产赔偿款 | 381,285.99 |
| 合计 | 381,285.99 |

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 |
|---------|------------------------|
| 施工安全保证金 | 5,500,000.00 |
| 代收款项 | 30,327.30 |
| 其他 | 3,833.00 |
| 合计 | 5,534,160.30 |

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 | 700,000,000.00 | 9,114,000,000.00 |
| 本期末 | 700,000,000.00 | 9,114,000,000.00 |

8.5.7.32 资本公积

注：本基金本报告期末及期初无资本公积。

8.5.7.33 其他综合收益

注：本基金本报告期末及期初无其他综合收益。

8.5.7.34 盈余公积

注：本基金本报告期末及期初无盈余公积。

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 | -513,335,903.19 | - | -513,335,903.19 |
| 本期利润 | 136,091,846.98 | - | 136,091,846.98 |
| 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 | -261,799,926.33 | - | -261,799,926.33 |
| 本期末 | -639,043,982.54 | - | -639,043,982.54 |

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 | |
|-----------|---------------------------------------|----------------|
| | 广州交投广河高速公路有限公司 | 合计 |
| 营业收入 | - | - |
| 通行费收入 | 380,239,659.80 | 380,239,659.80 |
| 其他 | 735,226.53 | 735,226.53 |
| 合计 | 380,974,886.33 | 380,974,886.33 |
| 营业成本 | - | - |
| 折旧与摊销 | 168,692,166.29 | 168,692,166.29 |
| 运营服务费 | 24,545,400.00 | 24,545,400.00 |
| 公路养护成本 | 10,717,992.23 | 10,717,992.23 |
| 联网收费系统管理费 | 1,375,895.57 | 1,375,895.57 |
| 其他 | 3,042,500.91 | 3,042,500.91 |
| 合计 | 208,373,955.00 | 208,373,955.00 |

8.5.7.37 投资收益

注：本基金本报告期内无投资收益。

8.5.7.38 公允价值变动收益

注：本基金本报告期内无公允价值变动损益。

8.5.7.39 资产处置收益

注：本基金本报告期内无资产处置收益。

8.5.7.40 其他收益

注：本基金本报告期内无其他收益。

8.5.7.41 其他业务收入

注：本基金本报告期内无其他业务收入。

8.5.7.42 利息支出

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|--------------|---------------------------------------|
| 短期借款利息支出 | - |
| 长期借款利息支出 | 17,268,905.44 |
| 卖出回购金融资产利息支出 | - |
| 租赁利息支出 | 13,173.56 |
| 其他 | - |
| 合计 | 17,282,079.00 |

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 |
|---------|---------------------------------------|
| 增值税 | 6,454,983.81 |
| 消费税 | - |
| 企业所得税 | - |
| 个人所得税 | - |
| 城市维护建设税 | 1,253,731.91 |
| 教育费附加 | 895,522.80 |
| 房产税 | - |
| 土地使用税 | - |
| 土地增值税 | - |
| 印花税 | 1,274.16 |
| 其他 | - |
| 合计 | 8,605,512.68 |

8.5.7.44 销售费用

注：本基金本报告期内无销售费用。

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 30 日 |
|-------|---------------------------------------|
| 中介机构费 | 780,000.00 |

| | |
|-------|--------------|
| 职工薪酬 | 179,251.76 |
| 折旧与摊销 | 66,174.72 |
| 办公费用 | 63,871.82 |
| 合计 | 1,089,298.30 |

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 |
|-------|---------------------------------------|
| 银行手续费 | 58,820.71 |
| 其他 | - |
| 合计 | 58,820.71 |

8.5.7.47 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

8.5.7.48 资产减值损失

注：本基金本报告期内无资产减值损失。

8.5.7.49 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|-------|---------------------------------------|
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 其他 | 13,726.83 |
| 合计 | 73,234.20 |

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 |
|-------------|---------------------------------------|
| 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 | - |
| 赔偿收入 | 83,813.61 |
| 其他 | 63,136.96 |
| 合计 | 146,950.57 |

8.5.7.50.2 计入当期损益的政府补助

注：本基金本报告期内无计入当期损益的政府补助。

8.5.7.51 营业外支出

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|-------------|---------------------------------------|
| 非流动资产报废损失合计 | - |
| 其中：固定资产报废损失 | - |
| 无形资产报废损失 | - |
| 对外捐赠 | - |
| 损坏维修支出 | 61,807.77 |
| 其他 | - |
| 合计 | 61,807.77 |

8.5.7.52 所得税费用

8.5.7.52.1 所得税费用情况

注：本基金本报告期内无所得税费用。

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 | 136,091,846.98 |
| 按法定/适用税率计算的所得税费用 | - |
| 子公司适用不同税率的影响 | -18,020,619.94 |
| 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 | - |
| 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 | 18,020,619.94 |
| 合计 | 0.00 |

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|--------|---------------------------------------|
| 用地补偿款 | 569,396.23 |
| 路产赔偿款 | 465,099.60 |
| 其他业务收入 | 182,088.57 |
| 其他 | 63,136.96 |
| 合计 | 1,279,721.36 |

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 |
|----|----|
|----|----|

| | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------|
| 管理人报酬 | 5,118,874.66 |
| 支付运营保险费 | 1,360,923.67 |
| 基金托管费 | 1,335,358.61 |
| 审计及咨询费 | 790,000.00 |
| 办公费用 | 65,655.09 |
| 其他 | 217,795.76 |
| 合计 | 8,888,607.79 |

8.5.7.53.3 收到其他与投资活动有关的现金

注：本基金本报告期内无收到其他与投资活动有关的现金。

8.5.7.53.4 支付其他与投资活动有关的现金

注：本基金本报告期内无支付其他与投资活动有关的现金。

8.5.7.53.5 收到其他与筹资活动有关的现金

注：本基金本报告期内无收到其他与筹资活动有关的现金。

8.5.7.53.6 支付其他与筹资活动有关的现金

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 融资租赁所支付的现金 | 69,732.00 |
| 合计 | 69,732.00 |

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 |
|--------------------------------------|---------------------------------------|
| 1. 将净利润调节为经营活动现金流量 | |
| 净利润 | 136,091,846.98 |
| 加：信用减值损失 | - |
| 资产减值损失 | - |
| 固定资产折旧 | 3,973,973.88 |
| 投资性房地产折旧 | - |
| 使用权资产折旧 | 59,424.72 |
| 无形资产摊销 | 164,724,942.41 |
| 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） | - |
| 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） | - |
| 经营性应收项目的减少（增加以“-”号填列） | -310,764.55 |
| 经营性应付项目的增加（减少以“-”号填列） | -27,655,423.09 |
| 利息支出 | 17,282,079.00 |
| 其他 | - |
| 经营活动产生的现金流量净额 | 294,166,079.35 |
| 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 | 61,579,164.75 |
| 减：现金的期初余额 | 268,758,207.86 |
| 加：现金等价物的期末余额 | 200,000,000.00 |
| 减：现金等价物的期初余额 | - |
| 现金及现金等价物净增加额 | -7,179,043.11 |

8.5.7.54.2 报告期内支付的取得子公司的现金净额

注：本基金本报告期内无支付的取得子公司的现金净额。

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 |
|----------------------------|---------------------------------------|
| 一、现金 | 61,579,164.75 |
| 其中：库存现金 | - |
| 可随时用于支付的银行存款 | 61,579,164.75 |
| 可随时用于支付的其他货币资金 | - |
| 二、现金等价物 | 200,000,000.00 |
| 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 | 261,579,164.75 |
| 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

注：本基金本报告期内未发生非同一控制下企业合并。

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：本基金本报告期内未发生企业合并。

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：本基金本报告期内未发生同一控制下企业合并。

8.5.8.2.2 合并成本

注：本基金本报告期内未发生同一控制下企业合并。

8.5.8.2.3 或有对价及其变动的说明

本基金本报告期内未发生同一控制下企业合并。

8.5.8.2.4 合并日被合并方资产、负债的账面价值

注：本基金本报告期内未发生同一控制下企业合并。

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

本基金本报告期内未发生同一控制下企业合并。

8.5.8.3 反向购买

本基金本报告期内未发生反向购买。

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 | |
| 平安广州交投广河高速公路基础设施资产支持专项计划 | 深圳 | 深圳 | 资产支持计划 | 100.00 | — | 认购 |
| 广州交投广河高速公路有限公司 | 广州 | 广州 | 高速公路运营 | — | 100.00 | 收购 |

8.5.10 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

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，本基金并无须作披露的承诺事项。

8.5.11.2 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

8.5.11.3 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于 2023 年 8 月 9 日宣告 2023 年度第 1 次分红，向截至 2023 年 8 月 11 日止在本基金登记机构登记在册的本基金份额持有人，按每 10 份基金份额派发红利 3.6381 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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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 |
|----------------------|--------------|
| 平安基金管理有限公司（“平安基金”） | 基金管理人、基金销售机构 |
| 中国工商银行股份有限公司（“工商银行”） | 基金托管人 |

| | |
|--------------------------|-------------------------------------|
| 大华资产管理有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 三亚盈湾旅业有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 平安信托有限责任公司 | 基金管理人的股东 |
| 深圳平安汇通投资管理有限公司（“平安汇通”） | 基金管理人的子公司 |
| 平安证券股份有限公司（“平安证券”） | 基金管理人的股东的子公司、广州广河基金资产支持专项计划管理人 |
| 平安银行股份有限公司（“平安银行”） | 基金销售机构、与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司 |
| 中国平安保险(集团)股份有限公司（“平安集团”） | 基金管理人的最终控股母公司 |
| 中国平安人寿保险股份有限公司（“平安人寿”） | 与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司 |
| 广州交通投资集团有限公司（“广交投集团”） | 运营管理机构及其控股股东 |
| 广州高速运营管理有限公司 | 运营管理机构 |
| 广州市高速公路有限公司（“市高公司”） | 运营管理机构全资子公司、持有本基金 30%以上基金份额的法人 |
| 广州交投机电工程有限公司 | 运营管理机构全资子公司 |
| 广州公路工程集团有限公司 | 运营管理机构全资子公司 |
| 广州从埔高速有限公司 | 持有本基金 30%以上基金份额的法人控制的法人、运营管理机构全资子公司 |
| 广州机场第二高速公路有限公司 | 持有本基金 30%以上基金份额的法人控制的法人、运营管理机构子公司 |
| 广东联合电子服务股份有限公司（“联合电服”） | 运营管理机构董事长出任董事 |
| 广州交投汽车救援服务有限公司 | 运营管理机构全资子公司 |
| 广州交投城市道路建设有限公司 | 运营管理机构全资子公司 |
| 方正证券股份有限公司（“方正证券”） | 与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司 |
| 广州市常尝餐饮管理有限公司 | 运营管理机构全资子公司 |
| 广州交投发展控股有限公司 | 运营管理机构全资子公司 |
| 广州交投实业有限公司 | 运营管理机构全资子公司 |
| 广州交投睿郡置业有限公司 | 运营管理机构全资子公司 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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 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 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|----------|------------|--|---|
| 广州高速运营管理 | 养护费、通行征收费等 | 40,482,748.17 | 36,227,587.55 |

| | | | |
|----------------|---------|---------------|---------------|
| 有限公司 | | | |
| 广东联合电子服务股份有限公司 | 联网结算服务费 | 1,375,895.57 | 1,408,710.93 |
| 合计 | - | 41,858,643.74 | 37,636,298.48 |

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 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|----------------|--------|--|---|
| 广州交投机电工程有限公司 | 租赁收入 | - | 181,944.69 |
| 广州交投城市道路建设有限公司 | 占地补偿收入 | - | 1,283,047.62 |
| 广州高速运营管理有限公司 | 电费收入 | 96,866.65 | - |
| 广州交投机电工程有限公司 | 电费收入 | 10,942.73 | - |
| 广州公路工程集团有限公司 | 电费收入 | 9,111.02 | - |
| 广州交投汽车救援服务有限公司 | 电费收入 | 4,824.36 | - |
| 合计 | - | 121,744.76 | 1,464,992.31 |

8.5.13.2 关联租赁情况

8.5.13.2.1 作为出租方

注：无。

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 |
|--------------|--------|-----------|---------------|
| 广州交投发展控股有限公司 | 办公场地 | 69,732.00 | - |
| 合计 | - | 69,732.00 | - |

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：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券交易。

8.5.13.3.2 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

8.5.13.3.3 应支付关联方的佣金

注：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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 10,124,090.82 | 9,465,463.13 |
| 其中：固定管理费 | 10,124,090.82 | 9,465,463.13 |
| 浮动管理费 | - | - |
| 支付销售机构的客户维护费 | 207,458.13 | 131,209.17 |

注：固定管理费包括以前一个估值日本基金资产净值为基数（首个估值日之前，以成立日基金募集资金规模为基数）按 0.115% 的年费率计提及项目公司已实现营业收入为基础按 1.37% 的年费率计提两部分。固定管理费包含支付销售机构的客户维护费。

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 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,279,496.05 | 1,320,325.52 |

注：支付基金托管人工商银行的托管费按前一个估值日本基金资产净值为基数（首个估值日之前，以成立日基金募集资金规模为基数）0.03% 的年费率计提，其计算公式为：

日托管费 = 以前一个估值日本基金资产净值数（首个估值日之前，以成立日基金募集资金规模为基数）× 0.03% / 当年天数。

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：本基金本报告期及上年度可比期间均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/卖出份额 | 期末持有 | |
| | 份额 | 比例（%） | 份额 | | | 份额 | 比例（%） |
| 市高公司 | 357,000,000.00 | 51.0000 | - | - | - | 357,000,000.00 | 51.00 |

| | | | | | | 00 | |
|--|----------------|---------|--------------|-----------|--------------|----------------|---------|
| 方正证券 | 113,377.00 | 0.0200 | 2,495,644.00 | - | 569,884.00 | 2,039,137.00 | 0.29 |
| 平安人寿 | 69,300,000.00 | 9.9000 | - | - | - | 69,300,000.00 | 9.90 |
| 平安证券 | 2,933,228.00 | 0.4200 | 1,010,843.00 | - | 998,587.00 | 2,945,484.00 | 0.42 |
| 合计 | 429,346,605.00 | 61.34 | 3,506,487.00 | - | 1,568,471.00 | 431,284,621.00 | 61.61 |
| 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 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（%） |
| 市高公司 | 357,000,000.00 | 51.0000 | - | - | - | 357,000,000.00 | 51.0000 |
| 平安人寿 | 69,300,000.00 | 9.9000 | - | - | - | 69,300,000.00 | 9.9000 |
| 平安证券 | 1,406,240.00 | 0.2000 | 1,474,877.00 | - | 1,391,094.00 | 1,490,023.00 | 0.2100 |
| 合计 | 427,706,240.00 | 61.1000 | 1,474,877.00 | - | 1,391,094.00 | 427,790,023.00 | 61.11 |

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 1 月 1 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 |
| 工商银行-活期 | 61,559,291.38 | 1,918,279.56 | 256,013,571.29 | 1,731,251.83 |
| 工商银行-定期 | 50,000,000.00 | - | - | - |
| 合计 | 111,559,291.38 | 1,918,279.56 | 256,013,571.29 | 1,731,251.83 |

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，活期存款按银行同业存款利率计息，定期存款按照协议利率计息。

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：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

8.5.13.9 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

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 |
| 通行费结算款 | 联合电服 | 11,441,556.59 | — | 11,194,964.11 | — |
| 电费收入 | 广州高速运营管理有限公司 | 109,459.32 | — | 94,078.35 | — |
| 电费收入 | 广州公路工程集团有限公司 | 10,295.45 | — | 11,552.83 | — |
| 电费收入 | 广州交投机电工程有限公司 | 12,365.28 | — | 9,500.86 | — |
| 电费收入 | 广州交投汽车救援服务有限公司 | 5,451.53 | — | 6,404.43 | — |
| 合计 | — | 11,579,128.17 | — | 11,316,500.58 | — |

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 |
|-----------|----------------|------------------------|--------------------------|
| 施工安全保证金 | 广州机场第二高速公路有限公司 | 5,000,000.00 | 5,000,000.00 |
| 工程款、管理人报酬 | 广州高速运营管理有限公司 | 888,028.49 | 28,080,295.42 |
| 工程款 | 广州交投机电工程有限公司 | 436,869.93 | 436,869.93 |
| 工程款 | 广州公路工程集团有限公司 | 1,310,927.95 | 1,310,927.95 |
| 托管费 | 工商银行 | 1,279,496.06 | 1,335,358.62 |
| 管理人报酬 | 平安基金 | 3,838,488.17 | 4,006,075.82 |
| 管理人报酬 | 平安证券 | 1,066,246.71 | 1,112,798.84 |
| 合计 | — | 13,820,057.31 | 41,282,326.58 |

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：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

8.5.15.2.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无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。

8.5.15.2.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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 04 月 14 日 | 2023 年 4 月 17 日 | 3.7400 | 261,799,926.33 | 54.89 | 2022 年 度第二 次分红， 占 2022 年可供 分配金 额比例 54.89% |
| 合计 | | | | 261,799,926.33 | 54.89 | — |

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同责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金管理人对信用风险按组合分类进行管理。信用风险主要产生于银行存款、应收账款及其他应收款等。于资产负债表日，本基金金融资产的账面价值已代表其最大信用风险敞口。

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，因而与银行存款相关的信用风险不重大。

此外，对于应收账款和其他应收款，本基金管理人设定相关政策以控制信用风险敞口。本基

金管理人基于对客户的财务状况、从第三方获取担保的可能性、信用记录及其他因素诸如目前市场状况等评估客户的信用资质并设置相应信用期。本基金管理人会定期对客户信用记录进行监控，对于信用记录不良的客户，本基金管理人会采用书面催款、缩短信用期或取消信用期等方式，以确保本基金的整体信用风险在可控的范围内。

于本期末，本基金无债券投资。

8.5.17.2 流动性风险

本基金管理人负责基于项目公司运营的现金流量预测，持续监控短期和长期的资金需求，以确保维持充裕的现金储备。本基金持有充足的使用未受限的货币资金，以满足日常营运以及偿付有关到期债务的资金需求。

本期末，本基金除长期借款、租赁负债以外的各项金融负债的到期日均在一年以内，本基金持有的金融负债按未折现剩余合同义务的到期期限分析如下：

1 年以内合计：92,296,782.80 元；
1 至 2 年合计：81,559,022.34 元；
2 至 5 年合计：276,920,009.39 元；
5 年以上合计：788,907,240.26 元。

上年度末，本基金除长期借款、租赁负债以外的各项金融负债的到期日均在一年以内，本基金持有的金融负债按未折现剩余合同义务的到期期限分析如下：

1 年以内合计：88,474,043.16 元；
1 至 2 年合计：32,296,182.34 元；
2 至 5 年合计：85,418,645.69 元；
5 年以上合计：1,075,174,027.90 元。

8.5.17.3 市场风险

市场风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格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。本基金管理人通过对不同类型的风险分别设定风险限制，并由独立于投资部门的风险管理人员监控、报告以及定期风险回顾的方法管理投资组合的市场风险。

(a) 利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金长期带息债务主要为 5 年期以上 LPR，金额为 974,090,800.00 元(2022 年 12 月 31 日：996,000,000.00 元)(附注 11.5.7.12)。于 2023 年 06 月 30 日，如果以浮动利率 LPR 计算的借款利率上升或下降 50 个基点，而其他因素保持不变，本基金的净利润会减少或增加 4,870,454.00 元

(2022 年 12 月 31 日：减少或增加 4,980,000.00 元)。

(b) 外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

(c) 其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险。本年末本基金未持有权益类资产，因此当市场价格发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响。

8.5.18 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期末无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

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 |
|--------|------------------------|
| 库存现金 | — |
| 银行存款 | 426,536.97 |
| 其他货币资金 | — |
| — | — |
| 小计 | 426,536.97 |
| 减：减值准备 | — |
| 合计 | 426,536.97 |

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 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 426,536.97 |
| 定期存款 | — |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | — |
| 其他存款 | — |
| 应计利息 | — |
| 小计 | 426,536.97 |
| 减：减值准备 | — |
| 合计 | 426,536.97 |

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

本基金本报告期末不存在因抵押、质押或冻结等对使用有限制、有潜在回收风险的款项。

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 | | |
|--------|------------------------|------|------------------|
| | 账面余额 | 减值准备 | 账面价值 |
| 对子公司投资 | 9,113,800,000.00 | - | 9,113,800,000.00 |
| 合计 | 9,113,800,000.00 | - | 9,113,800,000.00 |

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 |
|--------------------------|------------------|------|------|------------------|----------|--------|
| 平安广州交投广河高速公路基础设施资产支持专项计划 | 9,113,800,000.00 | - | - | 9,113,800,000.00 | - | - |
| 合计 | 9,113,800,000.00 | - | - | 9,113,800,000.00 | - | - |

§ 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 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（%） |
| 55,085 | 12,707.63 | 660,566,990.00 | 94.37 | 39,433,010.00 | 5.63 |
| 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（%） |
| 59,383 | 11,787.89 | 667,048,025.00 | 95.29 | 32,951,975.00 | 4.71 |

9.2 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 | 中国平安人寿保险股份有限 | 69,300,000.00 | 9.90 |

| | | | |
|----|----------------------------------|----------------|-------|
| | 公司一分红一个险分红 | | |
| 2 | 东兴证券股份有限公司 | 34,428,750.00 | 4.92 |
| 3 | 中国国际金融股份有限公司 | 28,282,037.00 | 4.04 |
| 4 | 中铁信托有限责任公司—中铁信托—锦信 44 号集合资金信托计划 | 17,436,000.00 | 2.49 |
| 5 | 中国银河证券股份有限公司 | 15,168,122.00 | 2.17 |
| 6 | 中信建投证券股份有限公司 | 9,140,312.00 | 1.31 |
| 7 | 招商财富资管—广州农商行—招商财富—鑫悦 1 号集合资产管理计划 | 7,678,044.00 | 1.10 |
| 8 | 国泰君安证券股份有限公司 | 7,480,794.00 | 1.07 |
| 9 | 国金证券股份有限公司 | 7,257,466.00 | 1.04 |
| 10 | 中国财产再保险有限责任公司—传统—普通保险产品 | 7,203,900.00 | 1.03 |
| 合计 | | 203,375,425.00 | 29.05 |

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 | 中国平安人寿保险股份有限公司—分红—个险分红 | 69,300,000.00 | 9.90 |
| 2 | 东兴证券股份有限公司 | 34,428,750.00 | 4.92 |
| 3 | 中国国际金融股份有限公司 | 25,441,564.00 | 3.63 |
| 4 | 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 | 16,330,748.00 | 2.33 |
| 5 | 中国银河证券股份有限公司 | 15,498,320.00 | 2.21 |
| 6 | 中信建投证券股份有限公司 | 12,308,081.00 | 1.76 |
| 7 | 招商财富资管—广州农商行—招商财富—鑫悦 1 号集合资产管理计划 | 9,051,000.00 | 1.29 |
| 8 | 国泰君安证券股份有限公司 | 8,118,794.00 | 1.16 |
| 9 | 中国财产再保险有限责任公司—传统—普通保险产品 | 7,695,000.00 | 1.10 |
| 10 | 广发证券股份有限公司 | 7,270,025.00 | 1.04 |
| 合计 | | 205,442,282.00 | 29.35 |

9.3 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 | 广州市高速公路有限公司 | 357,000,000.00 | 51.00 |
| 合计 | | 357,000,000.00 | 51.00 |

| 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 | 广州市高速公路有限公司 | 357,000,000.00 | 51.00 |
| 合计 | | 357,000,000.00 | 51.00 |

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 | 10,948.00 | 0.0016 |

§ 10 基金份额变动情况

单位：份

| | |
|--------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2021年6月7日）基金份额总额 | 700,000,000.00 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 700,000,000.00 |
| 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 | 700,000,000.00 |

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

本基金管理人公司董事杨玉萍女士因工作安排不再出任公司第四届董事会董事，公司股东平安信托有限责任公司根据《公司章程》推荐郭晓涛先生接替杨玉萍女士出任公司董事。经公司 2023 年第二次股东会审议，同意郭晓涛先生出任公司董事，杨玉萍女士不再担任公司董事。上述变更自 2023 年 3 月 17 日公司 2023 年第二次股东会做出决议之日起生效。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

11.3 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，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

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

本基金本报告期内，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的基金份额。

11.5 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘用普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

11.7 为基金出具评估报告的评估机构情况

本报告期内，本基金评估机构未发生变更。

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

注：本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.8.2 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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受到稽查或处罚等情况。

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 | 平安基金管理有限公司关于提醒投资者及时完善、更新身份信息资料以免影响业务办理的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023 年 01 月 05 日 |
| 2 | 平安基金管理有限公司关于面向特定投资者(养老金客户)通过直销柜台认、申购旗下所有基金实施费率优惠的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023 年 01 月 19 日 |
| 3 | 平安广州交投广河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 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023 年 01 月 20 日 |
| 4 | 平安广州交投广河高速公路封闭式基础设施证券投资基金 2022 年度评估报告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023 年 03 月 30 日 |
| 5 | 平安广州交投广河高速公路封闭式基础设施证券投资基金 2022 年年度报告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023 年 03 月 30 日 |
| 6 | 平安广州交投广河高速公路封闭式基础设施证券投资基金 2022 年度财务报表及审计报告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023 年 03 月 30 日 |
| 7 | 平安基金管理有限公司关于平安广州交投广河高速公路封闭式基础设施证券投资基金收益分配的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023 年 04 月 12 日 |
| 8 | 平安广州交投广河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 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023 年 04 月 22 日 |

| | | | |
|----|---|--------------|------------------|
| 9 | 关于平安广州交投广河高速公路封闭式基础设施证券投资基金深圳证券交易所基金通平台做市商的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023 年 05 月 26 日 |
| 10 | 平安基金管理有限公司关于平安广州交投广河高速公路封闭式基础设施证券投资基金停复牌、在基金通平台暂停转让及风险提示的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023 年 06 月 06 日 |
| 11 | 平安广州交投广河高速公路封闭式基础设施证券投资基金招募说明书（更新） | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023 年 06 月 07 日 |
| 12 | 平安广州交投广河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 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023 年 06 月 07 日 |

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- （1）中国证监会准予平安广州交投广河高速公路封闭式基础设施证券投资基金募集注册的文件
- （2）平安广州交投广河高速公路封闭式基础设施证券投资基金基金合同
- （3）平安广州交投广河高速公路封闭式基础设施证券投资基金托管协议
- （4）法律意见书
- （5）基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

13.2 存放地点

深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

13.3 查阅方式

- （1）投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件
- （2）投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人平安基金管理有限公司，客户服务电话：400-800-4800（免长途话费）

平安基金管理有限公司

2023 年 8 月 30 日