

华夏基金管理有限公司
关于华夏中国交建高速公路封闭式基础设施证券投资基金
基金份额解除限售的公告

一、公募 REITs 基本信息

公募REITs名称	华夏中国交建高速公路封闭式基础设施证券投资基金
公募REITs简称	华夏中国交建高速REIT
场内简称	中交REIT（扩位简称：华夏中国交建REIT）
公募REITs代码	508018
公募REITs合同生效日	2022 年 4 月 13 日
基金管理人名称	华夏基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司
公告依据	《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集基础设施证券投资基金指引（试行）》《华夏中国交建高速公路封闭式基础设施证券投资基金基金合同》《华夏中国交建高速公路封闭式基础设施证券投资基金招募说明书（更新）》等
业务类型	场内解除限售、场外解除锁定
生效时间	2023 年 4 月 28 日

二、解除限售份额基本情况

（一）公募 REITs 场内份额解除限售

1、本次解除限售的份额情况：

序号	证券账户名称	限售份额 （份）	限售类型	限售期 （月）
1	华金证券横琴人寿基础设施策略2号FOF单一资产管理计划	43,000,000	其他专业机构投资者战略配售限售	12
2	工银安盛人寿自营账户	40,000,000	其他专业机构投资者战略配售限售	12
3	华润信托 锐盈1号集合资金信托计划	23,000,000	其他专业机构投资者战略配售限售	12
4	国新投资有限公司	23,000,000	其他专业机构投资者战略配售限售	12
5	国新央企新发展格局私募证券投资基金	23,000,000	其他专业机构投资者战略配售限售	12
6	中信证券固收多元1号集合资产管理计划	22,000,000	其他专业机构投资者战略配售限售	12
7	华宝信托-宝富投资1号集合资金信托计划	22,000,000	其他专业机构投资者战略配售限售	12

8	兴瀚资管-兴元18号集合资产管理计划	22,000,000	其他专业机构投资者战略配售限售	12
9	江苏信托-禾享添利1号集合资金信托计划	22,000,000	其他专业机构投资者战略配售限售	12
10	中国保险投资基金（有限合伙）	22,000,000	其他专业机构投资者战略配售限售	12
11	英大泰和人寿保险股份有限公司	20,000,000	其他专业机构投资者战略配售限售	12
12	光大永明资产管理股份有限公司	20,000,000	其他专业机构投资者战略配售限售	12
13	光证资管诚享7号集合资产管理计划	20,000,000	其他专业机构投资者战略配售限售	12
14	申万宏源证券有限公司	18,000,000	其他专业机构投资者战略配售限售	12
15	申万宏源证券有限公司	18,000,000	其他专业机构投资者战略配售限售	12
16	中信证券睿驰增利单一资产管理计划	16,000,000	其他专业机构投资者战略配售限售	12
17	东兴证券股份有限公司	16,000,000	其他专业机构投资者战略配售限售	12
18	华金证券股份有限公司	13,000,000	其他专业机构投资者战略配售限售	12
19	中信证券股份有限公司	12,000,000	其他专业机构投资者战略配售限售	12
20	中航证券有限公司	12,000,000	其他专业机构投资者战略配售限售	12
21	长城人寿-传统险-长城财富-工行北京	11,000,000	其他专业机构投资者战略配售限售	12
22	嘉实基金东兴1号单一资产管理计划	10,500,000	其他专业机构投资者战略配售限售	12
23	国寿投资保险资产管理有限公司	10,000,000	其他专业机构投资者战略配售限售	12
24	招商证券股份有限公司	10,000,000	其他专业机构投资者战略配售限售	12
25	国寿资产-工银理财鼎瑞2204保险资产管理产品	10,000,000	其他专业机构投资者战略配售限售	12
26	朗和基础设施策略一号私募证券投资基金	10,000,000	其他专业机构投资者战略配售限售	12
27	中国人寿保险股份有限公司	8,800,000	其他专业机构投资者战略配售限售	12
28	招商财富-招银基础设施1号集合资产管理计划	6,600,000	其他专业机构投资者战略配售限售	12
29	中金青金1号单一资产管理计划	5,000,000	其他专业机构投资者	12

			者战略配售限售	
30	富国基金智享8号FOF集合资产管理计划	5,000,000	其他专业机构投资者战略配售限售	12
31	中粮信托-丰泽TOF4号集合资金信托计划	5,000,000	其他专业机构投资者战略配售限售	12
32	中国中金财富证券有限公司	5,000,000	其他专业机构投资者战略配售限售	12
33	招商财富-招银基础设施2号集合资产管理计划	4,400,000	其他专业机构投资者战略配售限售	12
34	中信证券三一尊享定制1号单一资产管理计划	4,000,000	其他专业机构投资者战略配售限售	12
35	中国人寿财产保险股份有限公司	2,200,000	其他专业机构投资者战略配售限售	12
36	华金证券基础设施基金策略1号FOF单一资产管理计划	1,000,000	其他专业机构投资者战略配售限售	12

注：上述份额限售期为自上市之日起12个月，自2023年4月28日起满足解除限售条件。

2、本次解除限售后剩余的限售份额情况：

序号	证券账户名称	限售份额 (份)	限售类型	限售期 (月)
1	中交投资有限公司	120,000,000	原始权益人或其同一控制下的关联方	60
2	中交第二公路勘察设计研究院有限公司	20,000,000	原始权益人或其同一控制下的关联方	60

注：上述份额限售期自本基金上市之日起计算。

(二) 公募 REITs 场外份额解除锁定

1、本次解除锁定的份额情况：

序号	账户名称	申请锁定份额 (份)	限售类型	限售期 (月)
1	前海再保险股份有限公司	11,000,000	其他专业机构投资者战略配售限售	12
2	嘉实基金宝睿1号单一资产管理计划	3,500,000	其他专业机构投资者战略配售限售	12

注：上述份额限售期为自上市之日起12个月，自2023年4月28日起满足解除限售条件。

2、本次解除锁定后剩余的锁定份额情况：

序号	账户名称	申请锁定份额 (份)	限售类型	限售期 (月)
1	中交第二航务工程局有限公司	60,000,000	原始权益人或其同一控制下的关联方	60

注：上述份额限售期自本基金上市之日起计算。

三、本次限售份额上市后流通份额变化情况

本次战略配售份额上市流通前，可在二级市场直接交易的本基金流通份额为250,000,000.00份，占本基金全部基金份额的25.00%。本次战略配售份额解禁后，可流通份额合计为800,000,000.00份，占本基金全部基金份额的80.00%。

四、其他需要提示的事项

（一）净现金流分派率说明

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

2023年度，基金管理人聘请了招商局重庆交通科研设计院有限公司对嘉通高速的交通量及预期通行费收入进行预测并出具《武深高速公路嘉鱼至通城段存续期交通量及通行费收入预测评估咨询报告》（以下简称“交通量预测报告”），根据交通量预测报告所载的2023年通行费收入及本基金发行时可供分配金额测算报告中预测可供分配金额的计算方法，2023年预测可供分配金额为386,955,834.90元。基于上述预测数据，净现金流分派率的计算方法举例说明如下：

1、投资人在首次发行时买入本基金，买入价格9.399元/份，该投资者的2023年度净现金流分派率预测值=386,955,834.90/(9.399*1,000,000,000)=4.12%。

2、投资人在2023年4月18日通过二级市场交易买入本基金，假设买入价格为2023年4月18日收盘价8.020元/份，该投资者的2023年度净现金流分派率预测值=386,955,834.90/(8.020*1,000,000,000)=4.82%。

需特别说明的是：

1、以上计算说明中的可供分配金额系根据交通量预测报告所载的2023年通行费收入及本基金发行时可供分配金额测算报告中预测可供分配金额的计算方法等假设予以计算而得，不代表实际年度的可供分配金额，如实际年度可供分配金额降低，将影响届时净现金流分派率的计算结果。

2、净现金流分派率不等同于基金的收益率。

（二）内部收益率（IRR）预测情况

内部收益率（IRR）为使得投资基金产生的未来现金流折现现值等于买入成本的收益率。基金管理人测算的内部收益率基于2022年末的资产评估价值、资产评估报告中的全周期各年净现金流假设数据等假设条件。二级市场交易价格上涨会导致买入成本上涨，导致投资者实际全周期内部收益率降低。二级市场交易价格下跌会导致买入成本下降，导致投资者实际全周期内部收益率提高。全周期内部收益率的计算举例说明如下：

1、投资人在首次发行时买入本基金，买入价格9.399元/份，考虑分红除权后，预测该投资者剩余存续期内基金全周期内部收益率预测值约6.55%。

2、投资人在2023年4月18日通过二级市场交易买入本基金，假设买入价格为2023年4月18日收盘价8.020元/份，预测该投资者存续期内基金全周期内部收益率预测值约7.90%。

以上IRR预测值系基于资产评估报告中的全周期各年净现金流假设数据等假设条件，因未来经营的不确定性，不代表投资者未来实际可得的IRR。

（三）本基金不同于股票、债券或主要投资于股票、债券的基金。本基金80%以上基金资产投资于基础设施资产支持证券，并持有其全部份额，基金通过基础设施资产支持证券持有基础设施项目公司全部股权，通过资产支持证券和项目公司等载体取得基础设施项目完全所有权或经营权利。基金交易价格会因为基础设施项目运营情况、证券市场波动等因素产生波动，投资人在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，并承担基金投资中出现的各类风险，包括但不限于：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，基金管理人在基础设施项目运营过程中产生的风险等。

五、相关机构联系方式

如有疑问，投资者可登录基金管理人网站（www.ChinaAMC.com）或拨打基金管理人客户服务电话（400-818-6666）了解、咨询相关信息。

六、风险提示

公开募集基础设施证券投资基金（以下简称基础设施基金）采用“公募基金+基础设施资产支持证券”的产品结构，主要特点如下：一是基础设施基金与投资股票或债券的公募基金具有不同的风险收益特征，基础设施基金80%以上

基金资产投资于基础设施资产支持证券，并持有其全部份额，基金通过基础设施资产支持证券持有基础设施项目公司全部股权，通过资产支持证券和项目公司等载体取得基础设施项目经营权利；二是基础设施基金以获取基础设施项目收费等稳定现金流为主要目的，收益分配比例不低于合并后基金年度可供分配金额的 90%；三是基础设施基金采取封闭式运作，不开放申购与赎回，在证券交易所上市，场外份额持有人需将基金份额转托管至场内才可卖出或申报预受要约。本基金与股票型基金和债券型基金有不同的风险收益特征。一般市场情况下，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。本基金需承担投资基础设施项目因投资环境、投资标的以及市场制度等差异带来的特有风险。

投资基础设施基金可能面临以下风险，包括但不限于：

1、与公募基金相关的风险

本基金为公开募集基础设施证券投资基金，可能面临的与公募基金相关的风险包括：交易失败的风险、本基金整体架构所涉及相关交易风险、管理风险、关联交易及利益冲突风险、税收等政策调整风险、集中投资风险、新种类基金收益不达预期风险、作为特许经营权类产品基金净值逐年降低直至趋于零的风险、基金管理人管理同类型基础设施基金的风险等。

2、与基础设施项目相关的风险

本基金可能面临的与基础设施项目相关的风险包括：基础设施项目的政策风险、基础设施项目运营管理机构解聘及更换风险、基础设施项目市场风险、基础设施项目特许经营权到期风险、基础设施项目运营风险、因缴纳履约保证金从而当年可分配现金流减少的风险、基础设施项目车流量预测偏差风险、基础设施基金现金流预测偏差风险、基础设施项目经营业绩波动风险、基础设施估值无法体现公允价值的风险、基金份额交易价格上涨导致IRR为0甚至亏损的风险（基础设施项目能够产生的可供分配金额存在上限，基金交易价格上涨过高将导致全周期IRR下降为0甚至出现本金亏损的风险）、基础设施项目借款相关风险、《特许权协议》违约风险、不可抗力、极端天气和重大事故给基础设施项目运营造成的风险。

3、市场波动风险

本公告中，本基金采用公告报出日前一交易日的二级市场价格作为现金流分派率的计算依据。二级市场交易价格上涨/下跌会导致买入成本上涨/下降，导致投资者实际的现金流分派率降低/提高。本公告中基金管理人计算的2023年预测可供分配金额及分派率，不代表实际年度的可供分配金额及分派率，如实际年度可供分配金额降低，将影响届时分派率的计算结果。

基金管理人测算的内部收益率基于2022年末的资产评估价值、资产评估报告中的全周期各年净现金流假设数据等假设条件。二级市场交易价格上涨会导致买入成本上涨，导致投资者实际全周期内部收益率降低。二级市场交易价格下跌会导致买入成本下降，导致投资者实际全周期内部收益率提高，所依据的各种假设具有不确定性，投资者进行投资决策时应谨慎使用。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。投资者在参与本基金相关业务前，应当认真阅读本基金基金合同、招募说明书、基金产品资料概要等信息披露文件，熟悉基础设施基金相关规则，自主判断基金投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和自身风险承受能力相适应，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

特此公告

华夏基金管理有限公司

二〇二三年四月二十一日