

鹏华深圳能源清洁能源封闭式基础设施证
券投资基金
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：招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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 29 日复核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。

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 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 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	8
2.3 基金管理人和基金托管人	8
2.4 基础设施资产支持证券管理人和外部管理机构	8
2.5 信息披露方式	8
2.6 其他相关资料	9
§ 3 主要财务指标和基金收益分配情况	9
3.1 主要会计数据和财务指标	9
3.2 其他财务指标	9
3.3 基金收益分配情况	9
3.4 报告期内基金及资产支持证券费用收取情况的说明	11
§ 4 基础设施项目运营情况	11
4.1 对报告期内基础设施项目公司运营情况的整体说明	11
4.2 基础设施项目所属行业情况	11
4.3 基础设施项目运营相关财务信息	12
4.4 基础设施项目运营相关通用指标信息	14
4.5 基础设施项目公司经营现金流	14
4.6 基础设施项目公司对外借入款项情况	15
4.7 基础设施项目投资情况	15
4.8 抵押、查封、扣押、冻结等他项权利限制的情况	15
4.9 基础设施项目相关保险的情况	16
4.10 基础设施项目未来发展展望的说明	16
4.11 其他需要说明的情况	16
§ 5 除基础设施资产支持证券之外的投资组合报告	16
5.1 报告期末基金的资产组合情况	16
5.2 报告期末按债券品种分类的债券投资组合	16
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	16
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	16
5.5 投资组合报告附注	17
5.6 报告期末其他各项资产构成	17
5.7 投资组合报告附注的其他文字描述部分	17
5.8 报告期内基金估值程序等事项的说明	17
5.9 报告期内基金资产重大减值计提情况的说明	17
§ 6 管理人报告	17

6.1 基金管理人及主要负责人员情况	17
6.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	20
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.....	20
6.4 管理人对报告期内基金的投资和运营分析	21
6.5 管理人对报告期内基金收益分配情况的说明.....	21
6.6 管理人对宏观经济及行业走势的简要展望	22
6.7 管理人对关联交易及相关利益冲突的防范措施.....	22
§ 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等内容的真实性、准确性和完整性发表意见	23
§ 8 中期财务报告（未经审计）	23
8.1 资产负债表.....	23
8.2 利润表.....	26
8.3 现金流量表.....	28
8.4 所有者权益变动表.....	30
8.5 报表附注.....	33
§ 9 基金份额持有人信息	54
9.1 基金份额持有人户数及持有人结构	54
9.2 基金前十名流通份额持有人	55
9.3 基金前十名非流通份额持有人	56
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	57
§ 10 基金份额变动情况	57
§ 11 重大事件揭示.....	57
11.1 基金份额持有人大会决议	57
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.....	57
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
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	58
11.5 基金投资策略的改变.....	58
11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
11.7 为基金出具评估报告的评估机构情况	58
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.....	58
11.9 其他重大事件.....	58
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
§ 13 备查文件目录.....	59
13.1 备查文件目录.....	59
13.2 存放地点.....	59
13.3 查阅方式.....	60

§ 2 基金简介

2.1 基金产品基本情况

基金名称	鹏华深圳能源清洁能源封闭式基础设施证券投资基金
基金简称	鹏华深圳能源 REIT
场内简称	鹏华深圳能源 REIT
基金主代码	180401
交易代码	180401
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	2022 年 7 月 11 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	600,000,000.00 份
基金合同存续期	34 年
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2022 年 7 月 26 日
投资目标	本基金主要投资于基础设施资产支持证券，并持有其全部份额；本基金通过资产支持证券持有基础设施项目公司全部股权，并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。基金管理人主动运营管理基础设施项目，以获取基础设施项目运营收入等稳定现金流及基础设施项目增值为主要目的。
投资策略	<p>（一）基础设施项目投资策略</p> <p>1、专项计划投资策略</p> <p>专项计划投资的基础设施项目包括： 东部电厂（一期）项目及因本基金扩募或其他原因所持有的其他符合《基础设施基金指引》和中国证监会其他规定的基础设施项目；东部电厂（一期）项目为深圳市东部电力有限公司持有的位于深圳市龙岗区大鹏镇秤头角的东部电厂（一期）项目，包括项目相关建筑（构）物的房屋所有权及其占用范围内的国有建设用地使用权，1#、2#、3#机组，电费收费权。</p> <p>在满足相关法律法规及政策规定并经基金份额持有人大会有效决议的前提下，项目公司股东可以对外申请并购贷款收购基础设施项目或对外申请经营性贷款。针对并购贷款和经营性贷款，可以以项目公司自有资产为债权人设定抵押、质押等担保。</p> <p>2、基础设施项目的购入与出售投资策略</p> <p>本基金将审慎论证宏观经济因素、粤港澳大湾区发展情况、天然气发电的行业环境及竞争格局情况、以及其他可比投资资产项目的风险和预期收益率来判断专项计划间接持有的基础设施资产当前的投资价值以及未来的发展空间。在此基础</p>

上，本基金将深入调研项目公司所持基础设施资产的基本面情况，通过合适的估值方法评估其收益状况和增值潜力、预测现金流收入的规模和建立合适的估值模型，对于已持有和拟投资的项目进行价值评估，在此基础上判断是否购入或出售。

对拟购入的基础设施项目，基金管理人将进行全面的尽职调查。在基金管理人认为必要的情况下，基金管理人可聘请其他中介机构对基础设施项目的购入提供专业服务。对于拟出售已持有的基础设施项目，基金管理人还将在评估其收益状况和增值潜力的基础上，综合考量交易程序和交易成本，评估基础设施项目出售的必要性和可行性，制定基础设施项目出售方案并负责实施。

3、基础设施项目运营管理策略

本基金管理人将主动履行基础设施项目运营管理职责，并有权聘请具备丰富能源基础设施运营管理经验的外部管理机构根据基金合同、《运营管理协议》的约定承担基础设施项目运营管理职责，通过主动管理，积极提升基础设施项目的运营业绩表现。本基金关于基础设施项目的具体运营管理安排详见招募说明书第十八部分“基础设施项目运营管理安排”。

4、基础设施项目的机组延寿策略

根据基础设施项目对应的《电力业务许可证》，基础设施项目机组设计寿命均为 30 年，预计于 2037 年到期。

基金存续期内，基金管理人将根据市场环境 with 基础设施运营情况制定基础设施项目机组延寿方案并负责实施。

2032 年开始进入延寿准备阶段，2034 年由深圳能源、东部电厂作为运营管理机构协助基金管理人、项目公司根据法律法规及监管部门要求，向主管部门申请机组延寿审批并办理相关手续。

2036 年，取得相关主管部门申请机组延寿审批后，运营管理机构将协助基金管理人制定机组延寿方案。基金管理人根据《基金合同》约定召开基金份额持有人大会就延寿方案进行决议，包括但不限于延寿期限、延寿资本性支出、管理费等事项。

延寿方案经基金份额持有人大会表决通过，由基金管理人实施。

若基础设施项目 1 号、2 号、3 号机组未在到期前取得主管部门延寿批准，或延寿方案未获基金份额持有人大会决议通过，则基金管理人将于机组设计寿命到期后，依照《基金合同》约定处置基础设施项目。

如本基金通过专项计划持有的基础设施项目在《基金合同》期限届满前全部处置，且连续六十个工作日未成功购入新的基础设施项目，则《基金合同》终止，基金进入清算程序。

（二）基金扩募收购策略

本基金存续期间扩募的，基金管理人应当按照《运作办法》

	<p>第四十条、《深圳证券交易所公开募集基础设施证券投资基金业务指引第 3 号——新购入基础设施项目（试行）》以及基金合同相关规定履行变更注册等程序，并在履行变更注册程序后，提交基金份额持有人大会投票表决。在变更注册程序履行完毕并取得基金份额持有人大会表决通过后，基金管理人根据中国证监会、证券交易所等相关要求履行适当程序启动扩募发售工作。</p> <p>（三）债券投资策略</p> <p>本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略等积极投资策略，自上而下地管理组合的久期，灵活地调整组合的券种搭配，同时精选个券，以增强组合的持有期收益。</p>
业绩比较基准	<p>本基金暂不设立业绩比较基准。</p> <p>如果今后有适当的、能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，本基金管理人与基金托管人协商一致后可以在报中国证监会备案以后设置本基金的业绩比较基准并及时公告，但不需要召开基金份额持有人大会。</p>
风险收益特征	<p>本基金与股票型基金、混合型基金和债券型基金等有不同的风险收益特征，本基金的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。</p>
基金收益分配政策	<p>1、本基金收益分配采取现金分红方式；</p> <p>2、在符合有关基金分红的条件下，本基金每年至少进行收益分配 1 次，每次收益分配的比例应不低于合并后基金年度可供分配金额的 90%。若《基金合同》生效不满 6 个月可不进行收益分配。具体分配时间由基金管理人根据基础设施项目实际运营情况另行确定；</p> <p>3、每一基金份额享有同等分配权；</p> <p>4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。</p> <p>如自 2038 年起至基金存续期届满之日，基础设施项目仍产生运营收入等现金流，由此产生的基金收益由基金份额持有人享有。在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可在与基金托管人协商一致的情况下调整基金收益分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日在规定媒介公告。</p>
资产支持证券管理人	指国信证券股份有限公司（简称“国信证券”）或其继任主体及基金投资的其他专项计划的资产支持证券管理人
外部管理机构	深圳能源集团股份有限公司 深圳能源集团股份有限公司东部电厂

注：无。

2.2 基础设施项目基本情况说明

基础设施项目名称：东部电厂（一期）项目

基础设施项目公司名称	深圳市东部电力有限公司
基础设施项目类型	水电气热
基础设施项目主要经营模式	以液化天然气为主要燃料，提供电力生产及相关服务并获取电费收入
基础设施项目地理位置	广东省深圳市大鹏新区大鹏下沙秤头角

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	鹏华基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	高永杰
	联系电话	0755-81395402
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn
客户服务电话	4006788999	95555
传真	0755-82021126	0755-83195201
注册地址	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	518048	518040
法定代表人	何如	缪建民

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	国信证券股份有限公司	深圳能源集团股份有限公司
注册地址	深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层	深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦北塔楼 9 层、29-31 层、34-41 层
办公地址	北京市西城区复兴门金融大街兴盛街 6 号国信证券大厦 3 层	深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦北塔楼 9 层、29-31 层、34-41 层
邮政编码	518000	518000
法定代表人	张纳沙	李英峰

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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
基金中期报告备置地点	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司

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日至2023年6月30日）
本期收入	878,761,501.81
本期净利润	178,064,106.03
本期经营活动产生的现金流量净额	184,573,781.17
期末数据和指标	报告期末（2023年6月30日）
期末基金总资产	3,870,725,688.68
期末基金净资产	3,638,613,260.28
期末基金总资产与净资产的比例（%）	106.38

3.2 其他财务指标

单位：人民币元

数据和指标	报告期（2023年1月1日至2023年6月30日）
期末基金份额净值	6.0644

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	204,986,219.23	0.3416	-
2022年	457,435,573.08	0.7624	-

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	436,199,907.00	0.7270	2022年年度分红

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	178,064,106.03	-
本期折旧和摊销	85,016,595.48	-
本期利息支出	4,655,154.10	-
本期所得税费用	53,696,018.19	-
本期息税折旧及摊销前利润	321,431,873.80	-
调增项		
1-基础设施基金发行募集资金	-	-
2-应付项目变动	-79,283,867.48	-
调减项		
1-购买基础设施项目的支出	-	-
2-需支付的所得税	-53,696,018.19	-
3-本期利息支出	-4,655,154.10	-
4-应收项目的变动	-36,305,558.72	-
5-未来合理相关支出预留，包括重大资本性支出（如固定资产正常更新、大修、改造等）、未来合理期间内的债务利息、运营费用等	57,494,943.92	注 1
本期可供分配金额	204,986,219.23	-

注：1、2022 年度报告中预留的运营管理服务费、检修费已实际支付，因此相关预留现金加回；同时考虑 2023 年下半年检修费用等支出，合计预留为 57,494,943.92 元，本报告期预留支出合计为正数，对可供分配金额为正向影响。

2、调增项增加用正号填列，调增项减少用负号填列；调减项增加用负号填列，调减项减少用正号填列。

3、提请投资者关注，上述可供分配金额并不代表最终实际分配的金额。由于收入和费用并非在一年内平均发生，电价及收益受电力供需情况影响，季节性温度变化和全社会生产用电情况将影响电力供需。所以不能按照本期占全年的时长比例来推算本基金全年的可供分配金额，请投资者理性看待。

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

根据《鹏华深圳能源清洁能源封闭式基础设施证券投资基金招募说明书》、《鹏华深圳能源清洁能源封闭式基础设施证券投资基金基金合同》等约定，本报告期内，基金管理人与资产支持专项计划管理人计提管理费合计 5,398,549.44 元（含税），其中已向计划管理人划付 805,308.75 元；基金托管人计提托管费 192,804.82 元（含税），暂未划付；外部管理机构固定管理费 11,973,610.57（含税）元，暂未划付。本报告期内已分别向基金管理人、计划管理人划付 2022 年度管理费合计 4,711,113.40 元（含税），向基金托管人划付 2022 年度托管费合计 168,642.54 元（含税），向外部管理机构划付 2022 年度固定及浮动管理费 74,874,943.92 元（含税），与年报披露金额一致。

§ 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，深圳市东部电力有限公司（以下简称“项目公司”）坚持“安全第一、运营高效、节能减排、低碳环保”的经营理念，持续为深圳市提供稳定可靠的清洁能源电力供应。

基金管理人和项目公司共同委托深圳能源集团股份有限公司和深圳能源集团股份有限公司东部电厂作为基础设施项目的运营管理机构，负责基础设施项目运营管理的统筹和实施工作。基金管理人按照《鹏华深圳能源清洁能源封闭式基础设施证券投资基金运营管理服务协议》对运营管理机构进行监督和考核。

本报告期项目公司实现发电收入 878,713,877.06 元（不含税），上网电量 168,176.80 万千瓦时，天然气成本 435,797,299.54 元（不含税），消耗 LNG 约 23.31 万吨。项目公司和运营管理机构密切沟通、紧密合作，统筹做好安全生产工作，确保项目公司安全稳定运营，为电力平稳供应做出积极贡献。

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

1. 宏观经济概况

2023 年上半年，我国国民经济持续恢复、总体回升向好，高质量发展扎实推进，社会大局保持稳定，为实现全年经济社会发展目标打下了良好基础。根据国家统计局数据，经初步核算，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%，比一季度加快 1.0 个百分点。

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%。

2. 行业概况及展望

根据中电联数据，2023 年上半年，全国全社会用电量 4.31 万亿千瓦时，同比增长 5.0%，上半年国民经济恢复向好拉动电力消费增速同比提高。分季度看，一、二季度全社会用电量同比分别增长 3.6%和 6.4%；一、二季度两年平均增速分别为 5.0%和 4.3%。从生产端看，全国新增发电装机容量 1.4 亿千瓦；截至 2023 年 6 月底全国全口径发电装机容量 27.1 亿千瓦，同比增长 10.8%。从分类型投资、发电装机增速及结构变化等情况看，电力行业延续绿色低碳转型趋势。

(1) 《关于深化电力体制改革加快构建新型电力系统的指导意见》审议通过

2023 年 7 月 11 日，中共中央总书记、国家主席、中央军委主席、中央全面深化改革委员会主任习近平 7 月 11 日下午主持召开中央全面深化改革委员会第二次会议，审议通过了《关于深化电力体制改革加快构建新型电力系统的指导意见》，提出要深化电力体制改革，加快构建清洁低碳、安全充裕、经济高效、供需协同、灵活智能的新型电力系统，更好推动能源生产和消费革命，保障国家能源安全。

(2) 广东省能源局印发《广东省推进能源高质量发展实施方案的通知》

2023 年 5 月 22 日，广东省能源局印发了《广东省推进能源高质量发展实施方案》，切实推动广东能源高质量发展。方案提出，加强油气供应保障；提升储气能力；推进灵活性气电建设，综合考虑调峰需求、建设条件、天然气资源保障情况，在负荷中心合理规划布局建设调峰气电。

在我国加快构建新型电力系统和广东推进能源高质量发展过程中，电力生产消费清洁低碳化方向、电力系统安全稳定要求和电力交易市场化趋势等，将推动天然气发电行业不断发展，促进行业保价稳供、可持续发展，为国家能源生产和消费革命、保障国家能源安全发挥更大作用。

4.2.2 基础设施项目所属行业竞争情况的说明

随着电力市场化改革的深化发展，发电行业市场竞争机制逐步成熟。广东电力市场也基本形成了“竞争充分、开放有序、健康发展”的市场体系，在变动成本补偿机制下，各类型机组能够进入电力市场同台竞争，同时交易结果需接受电力调度控制中心进行安全校核及统一实时调度。

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：深圳市东部电力有限公司

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	
		金额	占该项目总收入比例 (%)
1	售电收入	878,713,877.06	100.00
2	其他收入	-	-
3	合计	878,713,877.06	100.00

注：本报告期内，基础设施项目收入 878,713,877.06 元，全部为售电收入。

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

本报告期内，基础设施项目营业收入不存在重大变化。

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：深圳市东部电力有限公司

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	
		金额	占该项目总成本比例 (%)
1	原材料(燃气费)	435,797,299.54	54.77
2	其他主营业务成本	196,818,153.20	24.74
3	财务费用	154,581,135.09	19.43
4	管理费用	307,719.78	0.04
5	税金及附加	8,153,787.06	1.02
6	其他成本/费用	-	-
7	合计	795,658,094.67	100.00

注：报告期内，项目营业成本及主要费用总额 795,658,094.67 元，其中：燃气费用占 54.77%，其他主营业务成本包括折旧摊销、运营管理费用等占 24.74%，财务费用占 19.43%。本报告期内仅计提固定运营管理费，浮动运营管理费在每年度末根据当年利润考核情况计提。

其中财务费用主要为在深圳市东部电力有限公司对资产支持专项计划的有息负债计提的利息费用，计息期间为 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日。该利息属于内部利息费用，在年末补提且在基金合并层面将会抵消，不影响基金合并层面利润。

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

本报告期内，基础设施项目营业成本及主要费用不存在重大变化。

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：深圳市东部电力有限公司

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
				指标数值
1	净利率	净利润/营业收入*100%	%	3.34
2	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%	%	37.32

注：本报告期项目公司净利润 29,359,764.20 元，净利润率 3.34%；息税折旧摊销前利润 327,904,418.90 元，占营业收入的比例为 37.32%。

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

本报告期内，基础设施项目营财务业绩衡量指标重不存在重大变化。

4.4 基础设施项目运营相关通用指标信息

2023 年上半年基础设施项目发电用液化天然气 233,091.19 吨；累计上网电量 168,176.80 万千瓦时，其中电网代购电量 59,242.20 万千瓦时，年度双边协商电量 118,075.61 万千瓦时，年度集中竞争电量 1,861.10 万千瓦时，月度双边协商电量 1,850.00 万千瓦时，现货电量-12,852.11 万千瓦时。2023 年上半年累计电网代购电费收入 29,957.24 万元，年度双边协商电量电费 60,015.14 万元，年度集中竞争电费 947.02 万元，月度双边协商电量电费 921.46 万元，现货电费-3390.96 万元，其他电费收入（分摊补偿、调频及两个细则等）-578.51 万元；2023 年上半年加权平均售电单价约为 0.5904 元/千瓦时（含税）。

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

基础设施项目现有 2 个银行账户，根据已签署的《深圳市东部电力有限公司资金监管协议》及《深圳市东部电力有限公司账户监管协议》约定，基础设施项目接受招商银行股份有限公司深圳分行的监管。

其中，深圳市东部电力有限公司运营收入账户（一般户，开户行：中国农业银行股份有限公司深业上城支行）主要用于收取基础设施项目电费收入并定期向项目公司在监管银行开立的基本账户划付电费收入。

深圳市东部电力有限公司资金运作账户（基本户/监管账户，开户行：招商银行股份有限公司

深圳福田支行) 主要接收运营收入账户划转的资金, 用于各项运营成本支出、运营税费支出、对外融资的本息还款支出及其他支出。

项目公司银行账户均实行三级审批制度, 分别由项目公司、基金管理人、监管银行对付款真实性、准确性、适当性进行审核, 监管银行审批通过后方可对外划付资金。

本报告期内, 项目公司经营活动现金总流入为 962, 817, 321. 76 元, 总流出 765, 138, 788. 46 元, 经营活动产生的现金流量净额 197, 678, 533. 30 元, 经营性现金流情况良好。现金流主要提供方为深圳供电局有限公司。现金收入主要来源为: 其中收取 2022 年 12 月-2023 年 5 月的电费收入占经营活动现金总流入的 99. 36%; 现金支出主要为: 支付燃气成本费用等运营管理费用占经营活动现金总流出的 89. 04%; 税费支出和其他支出分别占经营活动现金总流出的 10. 34%和 0. 62%。

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

报告期间主要现金流来源为深圳市供电局有限公司, 从穿透来看, 电费收入来源主要为深圳市供电局有限公司的电力用户, 现金流来源合理分散, 不依赖第三方补助等非经常性收入。

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

注: 本报告期内, 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

报告期内, 无其他购入或出售基础设施项目的情况。截止 2023 年 6 月 30 日, 本基金收盘价为 6. 421 元 (除权价), 后复权收盘价为 7. 104 元, 后复权收盘价较发行价涨幅为 20. 49%。

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，基础设施项目不存在抵押、查封、扣押、冻结等其他权利限制的情况。

4.9 基础设施项目相关保险的情况

本报告期内基础设施项目购买了电厂财产一切险、电厂财产一切险项下的营业中断险、电厂机器损坏险、电厂机器损坏险项下的营业中断险、公众责任险、雇主责任险、环境污染责任险等，全部由永诚财产保险股份有限公司深圳分公司负责承保，上一期保险期间为 2021 年 5 月 1 日至 2023 年 4 月 30 日止，本报告期续签保险合同保险期限为 2023 年 5 月 1 日零时起至 2024 年 4 月 30 日二十四时止，1 年期。报告期内基础设施项目购买的上述险种均未出险，未适用理赔服务。

4.10 基础设施项目未来发展展望的说明

关于基础设施项目未来发展展望详见 4.2.1 章节。

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	1,117,815.82
4	其他资产	-
5	合计	1,117,815.82

5.2 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

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：无。

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：无。

5.5 投资组合报告附注

本基金投资的前十名证券中本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

5.6 报告期末其他各项资产构成

注：无。

5.7 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

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、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。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术。

本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。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，由登记结算部、监察稽核部、各投资部门、研究部门负责人、基金经理等成员组成，估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规和基金估值运作等方面的专业能力。基金经理可与估值委员会成员共同商定估值原则和政策，但不参与日常估值的执行。

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

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 基金管理人及其管理基础设施基金的经验

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日，注册资本 15,000 万元人民币，总部设在

深圳，在北京、上海、广州、武汉设有分公司。目前的股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有限公司组成，三家股东的出资比例分别为 50%、49%、1%，业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截至本报告期末，公司管理资产总规模达到 11,517 亿元，301 只公募基金、13 只全国社保投资组合、7 只基本养老保险投资组合。

鹏华基金管理有限公司设置了独立的基础设施基金投资部以作为基础设施基金投资管理部门，负责基础设施基金的研究、投资及运营管理等。基础设施基金投资部具有 5 年以上基础设施项目运营或基础设施项目投资管理经历的主要负责人员不少于 3 名，其中具备 5 年以上基础设施项目运营经历的主要负责人员不少于 2 名。

鹏华基金是国内较早开展 REITs 业务研究的基金公司，鹏华基金在知识和人才储备上做了长期而充足的准备。

2015 年，鹏华基金联手前海金控，积极借鉴国内外行业先进经验，探索金融创新与前海开发建设相结合的新路径，申请以深圳市前海片区前海企业公馆项目为基础资产，进行 REITs 业务的尝试。2015 年 6 月 8 日，中国证监会正式批复准予“鹏华前海万科 REITs 封闭式混合型发起式证券投资基金”（以下简称“鹏华前海万科 REITs”）注册。

鹏华前海万科 REITs 基金于 2015 年 7 月 6 日募集成立，并于 2015 年 9 月 30 日正式在深交所挂牌交易。鹏华前海万科 REITs 自成立以来运营良好，为投资者创造了长期、稳健的收益回报。

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历	说明
		任职日期	离任日期			
臧钊	基金经理	2022-07-11	-	5 年以上	曾担任中国广核电力股份有限公司会计核算主管，中国广核能源国际控股有限责任公司马来西亚区域埃德拉公司管理会计部资金主管。2021 年 10 月加盟鹏华基金管理有限公司，现担任基础设施基金投资部基金经理，臧钊具备基金从业资格，满足 5 年以上基础设施投资/运营管理经历要	臧钊先生，国籍中国，会计硕士，2 年证券从业经验。曾担任中国广核电力股份有限公司会计核算主管，中国广核能源国际控股有限责任公司马来西亚区域埃德拉公司管理会计部资金主管。2021 年 10 月

					求。	加盟鹏华基金管理有限公司，现担任基础设施基金投资部基金经理。2022 年 07 月至今担任鹏华深圳能源清洁能源封闭式基础设施证券投资基金基金经理，臧钊先生具备基金从业资格。
王弈哲	基金经理	2022-12-24	-	5 年以上	曾任普华永道中天会计师事务所深圳分所审计员，南方资本管理有限公司产品开发部总监助理，南方基金管理股份有限公司基础设施基金投资管理部总经理。2022 年 12 月加盟鹏华基金管理有限公司，现担任基础设施基金投资部总经理/基金经理，王弈哲具备基金从业资格，满足 5 年以上基础设施投资/运营管理经验要求。	王弈哲先生，国籍中国，金融及会计双学位硕士，9 年证券从业经验。曾任普华永道中天会计师事务所深圳分所审计员，南方资本管理有限公司产品开发部总监助理，南方基金管理股份有限公司基础设施基金投资管理部总经理。2022 年 12 月加盟鹏华基金管理有限公司，现担任基础设施基金投资部总经理/基金经理。2022 年 12 月至今担任鹏华深圳能源清洁能源封闭式基础设施证券投资基金基金经理，王弈哲先

						生具备基金从业资格。
刘一璠	基金经理	2022-07-11	-	5 年以上	曾任职于广东电网公司江门供电局，从事电力、信息等基础设施维护管理工作。2021 年 9 月加盟鹏华基金管理有限公司，现担任基础设施基金投资部基金经理。刘一璠具备基金从业资格，满足 5 年以上基础设施投资/运营管理经验要求。	刘一璠先生，国籍中国，工学学士，2 年证券从业经验。曾任职于广东电网公司江门供电局，从事电力、信息等基础设施维护管理工作。2021 年 9 月加盟鹏华基金管理有限公司，现担任基础设施基金投资部基金经理。2022 年 07 月至今担任鹏华深圳能源清洁能源封闭式基础设施证券投资基金基金经理，刘一璠先生具备基金从业资格。

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

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，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，本基金运作合规，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

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

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《鹏华基金管理有限公司公平交易管理规定》，将公司所管理的封闭式基金、开放式基金、社保组合、养老组合、特定客户资产管理组合等不同资产组合的授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评

估等投资管理活动均纳入公平交易管理，在业务流程和岗位职责中制定公平交易的控制规则和控制活动，建立对公平交易的执行、监督及审核流程，严禁在不同投资组合之间进行利益输送。

报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度，确保不同投资组合在研究、交易、分配等各环节得到公平对待。公司对不同投资组合在不同时间窗口下（日内、3日内、5日内）的同向交易价差进行专项分析，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

6.4 管理人对报告期内基金的投资和运营分析

1. 管理人对报告期内基金投资分析

本基金全部募集资金在扣除“基础设施基金需预留的全部资金和费用”后，剩余基金资产全部用于购买资产支持证券份额，报告期间 80%以上的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，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，并取得基础设施项目完全所有权。基金管理人通过主动的投资管理和运营管理，争取为基金份额持有人提供稳定的收益。

本基金报告期内按照基金合同的约定主要投资于基础设施资产支持证券份额。本基金的其他基金资产按照指引要求进行投资。基础设施项目公司已开展了协定存款业务，基金管理人在充分考虑安全性、流动性的前提下，对基础设施项目运行过程中产生的闲置资金进行有效投资，增厚基金收益。

2. 管理人对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，基础设施项目运营正常。基金管理人和运营管理机构密切合作，统筹抓好生产运营，保证基础设施项目安全、稳定运行。

6.5 管理人对报告期内基金收益分配情况的说明

本基金于 2023 年 5 月 19 日（场外）、5 月 22 日（场内）进行了 2023 年度第一次现金分红，收益分配基准日为 2022 年 12 月 31 日，每 10 份基金份额发放红利 7.27 元人民币，分红金额为 436,199,907.00 元。

基金管理人在计算年度可供分配金额过程中，将合并净利润调整为息税折旧及摊销前利润（EBITDA），并在此基础上进行了以下项目的调整：本基金发行份额募集的资金、购买基础设施

项目的支出、应收和应付项目的变动、支付的利息及所得税费用、未来合理的相关支出预留、期初现金余额等。

经上述项目调整后，本基金 2022 年 1 月 1 日至收益分配基准日 2022 年 12 月 31 日期间的累计可供分配金额为人民币 457,435,573.08 元，2023 年 5 月实际的分红比例为 95.36%，每 10 份基金份额发放红利 7.27 元人民币。

本报告期内分红符合“应当以 90%以上合并基金年度可供分配利润以现金形式分配给投资者”、“收益分配分配在符合分配条件的情况下每年分红不得低于一次”的监管要求及合同约定，履行了公司相应的内部审批程序，并按监管要求进行了公告。

6.6 管理人对宏观经济及行业走势的简要展望

参见 4.2.1 章节。

6.7 管理人对关联交易及相关利益冲突的防范措施

公司制定了《鹏华基金管理有限公司关联交易管理规定》，对关联方、关联关系及关联交易进行了界定，明确关联交易管理要求与决策机制；建立了《鹏华基金管理有限公司防范利益冲突管理办法》，明确利益冲突防范原则、措施及处理的相关机制安排。报告期内公司严格落实执行以上规定，有效管控关联交易及防范利益冲突、利益输送等情形。

针对运营管理过程中的关联交易事项，公司建立了关联交易审批和检查机制，并严格按照法律法规和中国证监会的有关规定履行关联交易审批程序。对于确有必要开展的、存在潜在利益冲突的关联交易，公司遵循投资者利益优先原则，以公允的价格和方式开展，并按法律法规和基金合同约定的方式予以披露。

§ 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

7.3 托管人对本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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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：鹏华深圳能源清洁能源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	470,521,264.85	723,068,362.79
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
衍生金融资产		-	-
交易性金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
债权投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收票据		-	-
应收账款	8.5.7.2	235,808,822.70	199,503,263.98
应收清算款		-	-
应收利息		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
存货	8.5.7.3	128,290,509.51	124,389,337.29
合同资产		-	-
持有待售资产		-	-
长期股权投资		-	-
投资性房地产		-	-
固定资产	8.5.7.4	2,977,413,040.17	3,060,252,829.62
在建工程	8.5.7.5	20,308,191.90	13,956,752.15
使用权资产		-	-
无形资产	8.5.7.6	19,358,541.20	20,075,524.22
开发支出		-	-

商誉		-	-
长期待摊费用		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	8.5.7.7	19,025,318.35	25,231,229.11
资产总计		3,870,725,688.68	4,166,477,299.16
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		-	-
应付票据		-	-
应付账款	8.5.7.8	167,317,770.02	251,387,683.01
应付职工薪酬		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		4,593,240.69	4,711,113.40
应付托管费		192,804.82	168,642.54
应付投资顾问费		-	-
应交税费	8.5.7.9	54,951,489.27	17,746,803.23
应付利息		-	-
应付利润		-	-
合同负债		-	-
持有待售负债		-	-
长期借款		-	-
预计负债		-	-
租赁负债		-	-
递延收益		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	8.5.7.10	5,057,123.60	4,400,000.00
负债合计		232,112,428.40	278,414,242.18
所有者权益：			
实收基金	8.5.7.11	3,537,600,000.00	3,537,600,000.00
其他权益工具		-	-
资本公积		-	-
其他综合收益		-	-
专项储备		8,686,004.27	-
盈余公积		-	-
未分配利润	8.5.7.12	92,327,256.01	350,463,056.98
所有者权益合计		3,638,613,260.28	3,888,063,056.98
负债和所有者权益总计		3,870,725,688.68	4,166,477,299.16

注：1、报告截止日2023年6月30日，基金份额净值6.0644元，基金份额总额 600,000,000.00

份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日。

8.1.2 个别资产负债表

会计主体：鹏华深圳能源清洁能源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	8.5.18.1	1,117,815.82	9,638,165.27
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	8.5.18.2	3,536,500,000.00	3,536,500,000.00
其他资产		-	-
资产总计		3,537,617,815.82	3,546,138,165.27
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		4,318,839.19	3,777,574.80
应付托管费		192,804.82	168,642.54
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
其他负债		322,328.42	370,000.00

负债合计		4,833,972.43	4,316,217.34
所有者权益：			
实收基金		3,537,600,000.00	3,537,600,000.00
资本公积		-	-
其他综合收益		-	-
未分配利润		-4,816,156.61	4,221,947.93
所有者权益合计		3,532,783,843.39	3,541,821,947.93
负债和所有者权益总计		3,537,617,815.82	3,546,138,165.27

8.2 利润表

8.2.1 合并利润表

会计主体：鹏华深圳能源清洁能源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
一、营业总收入		878,761,501.81
1. 营业收入	8.5.7.13	878,713,877.06
2. 利息收入		47,624.75
3. 投资收益（损失以“-”号填列）		-
4. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	8.5.7.14	-
5. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
6. 资产处置收益（损失以“-”号填列）		-
7. 其他收益		-
8. 其他业务收入		-
二、营业总成本		647,001,377.59
1. 营业成本	8.5.7.13	632,615,452.74
2. 利息支出	8.5.7.15	4,655,154.10
3. 税金及附加	8.5.7.16	8,712,423.37
4. 销售费用		-
5. 管理费用	8.5.7.17	677,899.06

6. 研发费用		-
7. 财务费用	8.5.7.18	-5,250,905.94
8. 管理人报酬		5,398,549.44
9. 托管费		192,804.82
10. 投资顾问费		-
11. 信用减值损失		-
12. 资产减值损失		-
13. 其他费用	8.5.7.19	-
三、营业利润（营业亏损以“-”号填列）		231,760,124.22
加：营业外收入		-
减：营业外支出		-
四、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		231,760,124.22
减：所得税费用	8.5.7.20	53,696,018.19
五、净利润（净亏损以“-”号填列）		178,064,106.03
1. 持续经营净利润（净亏损以“-”号填列）		178,064,106.03
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		178,064,106.03

注：本基金合同于 2022 年 07 月 11 日生效，无上年度可比较期间及可比较数据。

8.2.2 个别利润表

会计主体：鹏华深圳能源清洁能源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
一、收入		431,996,143.15
1. 利息收入		21,771.11
2. 投资收益（损失以“-”号填列）		431,974,372.04
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		4,834,340.69
1. 管理人报酬		4,318,839.19
2. 托管费		192,804.82
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		322,696.68
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		427,161,802.46
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		427,161,802.46
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		427,161,802.46

注：本基金合同于 2022 年 07 月 11 日生效，无上年度可比较期间及可比较数据。

8.3 现金流量表

8.3.1 合并现金流量表

会计主体：鹏华深圳能源清洁能源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
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		956,641,122.36
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		48,696.38
6. 收到的税费返还		-
7. 收到其他与经营活动有关的现金	8.5.7.21.1	6,176,199.40
经营活动现金流入小计		962,866,018.14
8. 购买商品、接受劳务支付的现金		681,266,360.19
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		-
13. 支付的各项税费		86,180,261.77
14. 支付其他与经营活动有关的现金	8.5.7.21.2	10,845,615.01
经营活动现金流出小计		778,292,236.97
经营活动产生的现金流量净额		184,573,781.17
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		-
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		920,048.87
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		-
投资活动现金流出小计		920,048.87
投资活动产生的现金流量净额		-920,048.87
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		-
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		436,199,907.00
28. 支付其他与筹资活动有关的现金		-
筹资活动现金流出小计		436,199,907.00
筹资活动产生的现金流量净额		-436,199,907.00
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		-252,546,174.70
加：期初现金及现金等价物余额		723,067,314.05
六、期末现金及现金等价物余额		470,521,139.35

注：本基金合同于 2022 年 07 月 11 日生效，无上年度可比较期间及可比较数据。

8.3.2 个别现金流量表

会计主体：鹏华深圳能源清洁能源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
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		431,974,372.04
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		22,693.00
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		431,997,065.04
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		4,316,585.60
经营活动现金流出小计		4,316,585.60
经营活动产生的现金流量净额		427,680,479.44
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		436,199,907.00
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		436,199,907.00
筹资活动产生的现金流量净额		-436,199,907.00
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		-8,519,427.56
加: 期初现金及现金等价物余额		9,637,134.68
五、期末现金及现金等价物余额		1,117,707.12

注: 本基金合同于 2022 年 07 月 11 日生效, 无上年度可比较期间及可比较数据。

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: 鹏华深圳能源清洁能源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	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	3,537,600,000.00	-	-	-	-	-	350,463,056.98	3,888,063,056.98
加: 会计政	-	-	-	-	-	-	-	-

策变更								
前期差错更正	-	-	-	-	-	-	-	-
同一控制下企业合并	-	-	-	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-	-	-	-
、本 期 期 初 余 额	3,537,600,000.00	-	-	-	-	-	350,463,056.98	3,888,063,056.98
三、本 期 增 减 变 动 （ 减 少 以 “-” 号 填 列）	-	-	-	-	8,686,004.27	-	-258,135,800.97	-249,449,796.70
（一） 综 合 收 益 总 额	-	-	-	-	-	-	178,064,106.03	178,064,106.03
（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	-	-	-	-	-	-	-436,199,907.00	-436,199,907.00
（四） 其 他 综 合	-	-	-	-	-	-	-	-

收益结转留存收益								
(五) 专项储备		-	-	-	8,686,004.27	-	-	8,686,004.27
其中：本期提取		-	-	-	-	-	-	-
本期使用		-	-	-	-	-	-	-
(六) 其他		-	-	-	-	-	-	-
四、本期末余额	3,537,600,000.00	-	-	-	8,686,004.27	-	92,327,256.01	3,638,613,260.28

8.4.2 个别所有者权益变动表

会计主体：鹏华深圳能源清洁能源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	3,537,600,000.00	-	-	4,221,947.93	3,541,821,947.93
加：会计政策变更	-	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
二、本期期初余额	3,537,600,000.00	-	-	4,221,947.93	3,541,821,947.93
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-	-	-	-9,038,104.54	-9,038,104.54
(一)综合收益总额	-	-	-	427,161,802.46	427,161,802.46
(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	-	-	-	-436,199.90	-436,199.90

				907.00	7.00
(四)其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-	-
(五)其他	-	-	-	-	-
四、本期期末余额	3,537,600,00 0.00	-	-	-4,816,15 6.61	3,532,783,8 43.39

注：本基金合同于 2022 年 07 月 11 日生效，无上年度可比较期间及可比较数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>邓召明</u>	<u>邢彪</u>	<u>郝文高</u>
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

鹏华深圳能源清洁能源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[2022]1305号《关于准予鹏华深圳能源清洁能源封闭式基础设施证券投资基金注册的批复》核准,由鹏华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《鹏华深圳能源清洁能源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 34 年,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 3,537,600,000.00 元,业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)毕马威华振验字第 2200496 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华深圳能源清洁能源封闭式基础设施证券投资基金基金合同》于 2022 年 7 月 11 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 600,000,000.00 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

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”)、《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14 号)、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》、《鹏华深圳能源清洁能源封闭式基础设施证券投资基金基金合同》和在财务报表附注中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 年上半年财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年上半年的经营成果和基金净资产变动情况等有关信息。

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

无。

8.5.5.2 会计估计变更的说明

无。

8.5.5.3 差错更正的说明

无。

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：

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。

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。

对金融同业往来利息收入免征增值税。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. 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3. 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。

本基金使用的主要税率列示如下：

- (1) 增值税，税率 13%、9%、6%、3%；
- (2) 城市维护建设税，税率 7%；
- (3) 教育费附加，税率 5%；
- (4) 企业所得税，税率 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	470,486,705.18
其他货币资金	34,559.67
小计	470,521,264.85
减：减值准备	-
合计	470,521,264.85

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	470,486,579.68
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
应计利息	125.50
小计	470,486,705.18
减：减值准备	-
合计	470,486,705.18

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 应收账款

8.5.7.2.1 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	235,808,822.70
1—2 年	-
小计	235,808,822.70
减：坏账准备	-
合计	235,808,822.70

8.5.7.2.2 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
深圳供电局有限公司	235,808,822.70	100.00	-	235,808,822.70
合计	235,808,822.70	100.00	-	235,808,822.70

8.5.7.3 存货

8.5.7.3.1 存货分类

单位：人民币元

项目	本期末 2023 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	-	-	-
周转材料	-	-	-
合同履约成本	-	-	-
备品备件	123,027,456.73	-	123,027,456.73
材料	5,136,599.77	-	5,136,599.77
其他	126,453.01	-	126,453.01
合计	128,290,509.51	-	128,290,509.51

8.5.7.3.2 报告期末存货余额含借款费用资本化金额的说明

无。

8.5.7.3.3 报告期内合同履约成本摊销金额的说明

无。

8.5.7.4 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	2,977,413,040.17
固定资产清理	-
合计	2,977,413,040.17

8.5.7.4.1 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	其他设备	合计
一、账面原值						
1. 期初余额	190,966,699.98	5,650,158,404.01	-	-	11,279,661.11	5,852,404,765.10
2. 本期增加金额	-	1,459,823.01	-	-	-	1,459,823.01
购置	-	-	-	-	-	-
在建工程转入	-	1,459,823.01	-	-	-	1,459,823.01
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	190,966,699.98	5,651,618,227.02	-	-	11,279,661.11	5,853,864,588.11
二、累计折旧						
1. 期初余额	147,321,920.17	2,634,954,004.27	-	-	9,876,011.04	2,792,151,935.48
2. 本期增加金额	4,447,362.42	79,611,304.82	-	-	240,945.22	84,299,612.46
本期计提	4,447,362.42	79,611,304.82	-	-	240,945.22	84,299,612.46
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	151,769,282.59	2,714,565,309.09	-	-	10,116,956.26	2,876,451,547.94
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	39,197,417.39	2,937,052,917.93	-	-	1,162,704.85	2,977,413,040.17
2. 期初账面价值	43,644,779.81	3,015,204,399.74	-	-	1,403,650.07	3,060,252,829.62

8.5.7.5 在建工程

单位：人民币元

账龄	本期末 2023年6月30日
在建工程	20,308,191.90
工程物资	-
小计	20,308,191.90
减：减值准备	-
合计	20,308,191.90

8.5.7.5.1 在建工程情况

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		
	账面余额	减值准备	账面价值
技术改造项目	20,308,191.90	-	20,308,191.90
合计	20,308,191.90	-	20,308,191.90

8.5.7.5.2 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
技术改造项目	13,956,752.15	7,811,262.76	1,459,823.01	-	20,308,191.90
合计	13,956,752.15	7,811,262.76	1,459,823.01	-	20,308,191.90

8.5.7.6 无形资产

8.5.7.6.1 无形资产情况

单位：人民币元

项目	特许经营	土地使用	专利权	非专有技	软件使用	其他	合计
----	------	------	-----	------	------	----	----

	权	权		术	权		
一、账面原值							
1. 期初余额	-	32,188,950.17	-	-	6,449,142.19	2,949,178.84	41,587,271.20
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	-	32,188,950.17	-	-	6,449,142.19	2,949,178.84	41,587,271.20
二、累计摊销							
1. 期初余额	-	12,113,425.95	-	-	6,449,142.19	2,949,178.84	21,511,746.98
2. 本期增加金额	-	716,983.02	-	-	-	-	716,983.02
本期计提	-	716,983.02	-	-	-	-	716,983.02
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	-	12,830,408.97	-	-	6,449,142.19	2,949,178.84	22,228,730.00
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	-	19,358,541.20	-	-	-	-	19,358,541.20
2. 期初账面价值	-	20,075,524.22	-	-	-	-	20,075,524.22

8.5.7.7 其他资产

8.5.7.7.1 其他资产情况

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
预付账款	452,676.12
碳排放权资产	140,959.30
待抵扣税额	18,431,682.93
合计	19,025,318.35

注：无。

8.5.7.7.1.1 按账龄列示

单位：人民币元

账龄	本期末 2023年6月30日
1年以内	452,676.12
1-2年	-
合计	452,676.12

8.5.7.7.1.2 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
深圳能源集团股份有限公司东部电厂	452,676.12	100.00	-	-
合计	452,676.12	100.00	-	-

8.5.7.8 应付账款

8.5.7.8.1 应付账款情况

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付运行维护费	73,130,920.42

应付运营管理费	11,973,610.57
应付原材料采购款	24,826,532.07
应付天然气采购款	47,508,580.43
应付财产保险费	7,185,836.34
应付外购电	782,925.00
应付采购工程款	1,711,251.98
应付审计费	198,113.21
合计	167,317,770.02

注：运营管理费为应付 2023 年 1-6 月固定运营管理服务费。

8.5.7.9 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	14,060,908.16
消费税	-
企业所得税	39,051,918.31
个人所得税	-
城市维护建设税	984,263.57
教育费附加	421,827.25
房产税	-
土地使用税	-
土地增值税	-
地方教育附加	281,218.17
环境保护税	60,000.00
印花税	91,353.81
其他	-
合计	54,951,489.27

8.5.7.10 其他负债

8.5.7.10.1 其他应付款

8.5.7.10.1.1 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
往来款	4,000,001.00
其他	1,057,122.60
合计	5,057,123.60

8.5.7.11 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	600,000,000.00	3,537,600,000.00
本期认购	-	-

本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	600,000,000.00	3,537,600,000.00

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

8.5.7.12 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	350,463,056.98	-	350,463,056.98
本期利润	178,064,106.03	-	178,064,106.03
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	-436,199,907.00	-	-436,199,907.00
本期末	92,327,256.01	-	92,327,256.01

8.5.7.13 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	
	-	合计
营业收入	-	-
售电收入	878,713,877.06	878,713,877.06
合计	878,713,877.06	878,713,877.06
营业成本	-	-
售电成本	632,615,452.74	632,615,452.74
合计	632,615,452.74	632,615,452.74

8.5.7.14 公允价值变动收益

注：无。

8.5.7.15 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	
	-	合计
短期借款利息支出	-	-
长期借款利息支出	-	-
卖出回购金融资产利息支出	-	-
不可抵扣的利息支出	-	4,655,154.10
其他	-	-
合计	-	4,655,154.10

注：该部分利息支出为项目公司与专项计划之间的内部债务产生的不可抵扣增值税。

8.5.7.16 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	-
消费税	-
企业所得税	-
个人所得税	-
城市维护建设税	4,268,355.45
教育费附加	1,829,295.20
房产税	-
土地使用税	-
土地增值税	-
印花税	1,283,807.31
地方教育附加	1,219,530.13
环境保护税	111,435.28
其他	-
合计	8,712,423.37

8.5.7.17 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
评估费	49,588.57
审计费	467,949.45
咨询费	47,169.81
其他	113,191.23
合计	677,899.06

8.5.7.18 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	215,284.35
项目公司利息收入	-5,466,190.29
其他	-
合计	-5,250,905.94

8.5.7.19 其他费用

注：无。

8.5.7.20 所得税费用

8.5.7.20.1 所得税费用情况

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期所得税费用	53,696,018.19
递延所得税费用	-

合计	53,696,018.19
----	---------------

8.5.7.20.2 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	231,760,124.22
按法定/适用税率计算的所得税费用	57,940,031.06
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	-4,244,012.87
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	-
合计	53,696,018.19

8.5.7.21 现金流量表附注

8.5.7.21.1 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
银行结息	5,466,192.10
其他	710,007.30
合计	6,176,199.40

8.5.7.21.2 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
财产保险款	4,042,705.85
危险废物处理	41,940.00
其他	6,760,969.16
合计	10,845,615.01

8.5.7.22 现金流量表补充资料

8.5.7.22.1 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	178,064,106.03
加：信用减值损失	-
资产减值损失	-

固定资产折旧	84,299,612.46
投资性房地产折旧	-
使用权资产折旧	-
无形资产摊销	716,983.02
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)	-595,751.84
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)	-3,901,172.22
经营性应收项目的减少(增加以“-”号填列)	-30,099,647.96
经营性应付项目的增加(减少以“-”号填列)	-43,910,348.32
-	-
其他	-
经营活动产生的现金流量净额	184,573,781.17
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	470,486,579.68
减: 现金的期初余额	723,067,314.05
加: 现金等价物的期末余额	34,559.67
减: 现金等价物的期初余额	-
现金及现金等价物净增加额	-252,546,174.70

8.5.7.22.2 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	470,521,139.35
其中: 库存现金	-
可随时用于支付的银行存款	470,486,579.68
可随时用于支付的其他货币资金	34,559.67
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	470,521,139.35
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	-

8.5.8 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	
国信证券深圳能源清洁能源第一期基础设施资产支持专项计划	广东省深圳市	广东省深圳市	资产支持证券	100.00	-	现金购买
深圳市东部电力有限公司	广东省深圳市	广东省深圳市	天然气发电经营	100.00	-	现金购买

8.5.9 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。

8.5.10 承诺事项、或有事项、资产负债表日后事项的说明

8.5.10.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金不存在需要披露的重要承诺事项。

8.5.10.2 或有事项

截至资产负债表日，本基金不存在需要披露的重要或有事项。

8.5.10.3 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

8.5.11 关联方关系

8.5.11.1 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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

8.5.11.2 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
鹏华基金管理有限公司（“鹏华基金公司”）	基金管理人
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	计划管理人、基金管理人股东
深圳能源集团股份有限公司（“深圳能源”）	原始权益人

集团”)	
深圳能源集团股份有限公司东部电厂	同一控制下非合并范围企业

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。

8.5.12 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金基金合同于 2022 年 07 月 11 日生效，截至本报告期末不满一年，无上年度可比期间数据。

8.5.12.1 关联采购与销售情况

8.5.12.1.1 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
深圳能源集团股份有限公司东部电厂	运行维护费	73,130,920.42
深圳能源集团股份有限公司东部电厂	运营管理费	11,973,610.57
深圳能源集团股份有限公司东部电厂	材料采购费	23,519,718.31
合计	-	108,624,249.30

注：1、运行维护费是项目公司 2023 年 1-6 月日常实际发生的与东部电厂进行结算的运行维护费，包含人员工资、日常检修费用和折旧等费用

2、运营管理费是计提 2023 年 1-6 月的固定运营管理费。

3、根据《运营管理协议》约定运营管理费收取包含营运支出、雇员成本、折旧费、固定运营管理服务费、浮动管理费，其中：

①固定运营管理服务费用计算公式如下：

固定运营管理服务费=净收入 1*固定管理费率

净收入 1=营业收入-营业支出（不考虑运营管理服务费、折旧摊销、财务费用、税金及附加）

上述净收入 1 应根据项目公司年度审计报告进行计算。

其中：

营业收入为考核期间内项目公司的主营业务收入及其他业务收入；营业支出为考核期间内项目公司直接支付的营业支出、外部管理机构运营支出及雇员成本，不考虑运营管理服务费、折旧摊销、财务费用及税金及附加。

固定管理费率=3.5%

基金管理人与基金托管人双方核对固定运营管理服务费无误后，以协商确定的日期及方式从

基金财产中支付，若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

②浮动管理费

每一个会计年度结束后，基金管理人对项目公司的净收入指标进行考核，根据项目公司年度 EBITDA 完成率确定外部管理机构浮动管理费。具体而言：

净收入 2=营业收入-营业支出（不考虑运营管理服务费、折旧摊销、财务费用、税金及附加）-固定运营管理服务费上述净收入 2 应根据项目公司年度审计报告进行计算。

基金管理人根据考核结果对外部管理机构的浮动管理费进行调整，其中：

A. 2022 年~2023 年的考核指标如下：

项目公司年度 EBITDA 完成率(年度 EBITDA 完成率=根据当期项目公司年度审计报告计算的净收入 2/基金初始发行《鹏华深圳能源清洁能封闭式基础设施证券投资基金 2022 年度及 2023 年度可供分配金额测算报告及审核报告》(简称”基金初始发行现金流预测报告及其附表”)计算的当期净收入 2)。

1) 当 EBITDA 完成率 $\geq 120\%$ 时，浮动管理费=(根据当期项目公司年度审计报告计算的净收入 2-基初始发行现金流预测报告及其附表计算的当期净收入 2) *30%。

2) 当 $110\% \leq \text{EBITDA 完成率} < 120\%$ 时，浮动管理费=(根据当期项目公司年度审计报告计算的净收入 2-基金初始发行现金流预测报告及其附表计算的当期净收入 2) *20%。

3) 当 $100\% \leq \text{EBITDA 完成率} < 110\%$ 时，浮动管理费=(根据当期项目公司年度审计报告计算的净收入 2-基金初始发行现金流预测报告及其附表计算的当期净收入 2) *10%。

4) 当 EBITDA 完成率 $< 100\%$ 时，浮动管理费=0。

B. 2024 年至 2037 年的的考核指标如下：

项目公司年度 EBITDA 完成率(年度 EBITDA 完成率=据当期项目公司年度审计报告计算的净收入 2/基金初始发行《鹏华基金管理有限公司拟公开募集基础设施证券投资基金涉及的深圳市东部电力有限公司东部电厂基础设施资产组组合项目资产评估报告》(大正评报字(2022)第 160A 号)(以下简称”基金初始发行资产评估报告及其附表”)计算的当期净收入 2)。

1) 当 EBITDA 完成率 $\geq 120\%$ 时，浮动管理费=(根据当期项目公司年度审计报告计算的净收入 2-基金初始发行资产评估报告及其附表预测计算的当期净收入 2) *30%。

2) 当 $110\% \leq \text{EBITDA 完成率} < 120\%$ 时，浮动管理费=(根据当期项目公司年度审计报告计算的净收入 2-基金初始发行资产评估报告及其附表预测计算的当期净收入 2) *20%。

3) 当 $100\% \leq \text{EBITDA 完成率} < 110\%$ 时，浮动管理费=(根据当期项目公司年度审计报告计算的净收入 2-基金初始发行资产评估报告及其附表预测计算的当期净收入 2) *10%。

4) 当 EBITDA 完成率 < 100% 时, 浮动管理费=0。

基金管理人与基金托管人双方核对浮动管理费无误后, 以协商确定的日期及方式从基金财产中支付, 若遇法定节假日、公休假等, 支付日期顺延。

2038 年度(含)及以后年度考核指标, 由基金管理人根据届时审计报告及资产评估报告制定, 经基金份额持有人大会一般决议通过。

8.5.12.2 通过关联方交易单元进行的交易

8.5.12.2.1 债券交易

注: 无。

8.5.12.2.2 债券回购交易

注: 无。

8.5.12.2.3 应支付关联方的佣金

注: 无。

8.5.12.3 关联方报酬

8.5.12.3.1 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
当期发生的基金应支付的管理费	5,398,549.44
其中: 固定管理费	5,398,549.44
浮动管理费	-
支付销售机构的客户维护费	27,911.43

注: 1、支付基金管理人鹏华基金公司的管理人报酬年费率为 0.224%, 逐日计提, 按年支付。日管理费=上年度基金资产净值×0.224%÷当年天数; 支付国信证券的管理人报酬年费率为 0.056%, 逐日计提, 收益分配时划付。日管理费=上年度基金资产净值×0.056%÷当年天数。

2、根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》, 基金管理人依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费, 用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用, 客户维护费从基金管理费中列支。

3、外部管理机构的运营管理费详见本报告第 3.4 章节以及 8.5.12.1 章节。

8.5.12.3.2 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
当期发生的基金应支付的托管费	192,804.82

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.01%的年费率计提，逐日累计至每年年底，按年支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.01%/当年天数。

8.5.12.4 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：无。

8.5.12.5 各关联方投资本基金的情况

8.5.12.5.1 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。

8.5.12.5.2 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 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（%）
国信证券	12,025,359.00	2.00	272,057.00	0.00	314,704.00	11,982,712.00	2.00
合计	12,025,359.00	2.00	272,057.00	0.00	314,704.00	11,982,712.00	2.00

注：除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

8.5.12.6 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	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	339,717,732.78	5,240,651.12
合计	339,717,732.78	5,240,651.12

8.5.12.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

8.5.12.8 其他关联交易事项的说明

无。

8.5.13 关联方应收应付款项

8.5.13.1 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
应付运行维护费	深圳能源集团股份有限公司东部电厂	73,130,920.42	69,736,727.88
应付运营管理费	深圳能源集团股份有限公司东部电厂	11,973,610.57	74,874,943.92
应付材料采购费	深圳能源集团股份有限公司东部电厂	23,519,718.31	-
应付管理人报酬	鹏华基金管理有限公司	4,318,839.19	3,777,574.80
应付管理人报酬	国信证券股份有限公司	274,401.50	933,538.60
应付托管费	招商银行股份有限公司	192,804.82	168,642.54
合计	-	113,410,294.81	149,491,427.74

8.5.14 期末（2023年06月30日）基金持有的流通受限证券

8.5.14.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

8.5.14.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

8.5.14.2.1 银行间市场债券正回购

无。

8.5.14.2.2 交易所市场债券正回购

无。

8.5.15 收益分配情况

8.5.15.1 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5 月17日	2023年5月 17日	7.2700	436,199,907.00	95.36	2022年 分红
合计				436,199,907.00	95.36	-

注：本基金第一次分红的场内除息日为2023年5月18日，场外除息日为2023年5月17日。本基金自基金合同生效日至第一次收益分配基准日的累计可供分配金额为人民币457,435,573.08元，第一次分配金额为人民币436,199,907.00元，占前述可供分配金额的95.36%。

8.5.15.2 可供分配金额计算过程

参见3.3.2.1。

8.5.16 金融工具风险及管理

8.5.16.1 信用风险

信用风险是基金在交易过程中发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降，或者债券回购交易到期时交易对手方不能履行付款或结算义务等，造成基金资产损失的风险。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。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行招商银行股份有限公司及其他具有基金托管资格的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2022 年 12 月 31 日：未持有）。

8.5.16.2 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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短期内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2023 年 6 月 30 日，本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

8.5.16.3 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，主要包括利率风险，外汇风险和其他价格风险。

本基金所投资的基础设施项目现金流受到经济环境，运营管理等因素影响，具有一定波动性。同时，本基金在二级市场交易的过程中，交易价格受到基础设施经营情况、所在行业情况、市场情绪、供求关系等多因素作用，存在基金份额交易价格相对于基金份额净值折溢价的现象，因此具有市场风险。

8.5.17 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

8.5.18 个别财务报表重要项目的说明

8.5.18.1 货币资金

8.5.18.1.1 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	1,117,815.82
其他货币资金	-
小计	1,117,815.82
减：减值准备	-
合计	1,117,815.82

8.5.18.1.2 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	1,117,707.12
定期存款	-

其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
应计利息	108.70
小计	1,117,815.82
减：减值准备	-
合计	1,117,815.82

8.5.18.1.3 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。

8.5.18.2 长期股权投资

8.5.18.2.1 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	3,536,500,000.00	-	3,536,500,000.00
合计	3,536,500,000.00	-	3,536,500,000.00

8.5.18.2.2 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
国信证券深圳能源清洁能源第一期基础设施资产支持专项计划	3,536,500,000.00	-	-	3,536,500,000.00	-	-
合计	3,536,500,000.00	-	-	3,536,500,000.00	-	-

§ 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（%）
31,431	19,089.43	579,226,442.00	96.54	20,773,558.00	3.46
上年度末 2022年12月31日					
持有人户	户均持有的	持有人结构			

数（户）	基金份额 （份）	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 （%）
38,209	15,703.11	581,727,769.00	96.95	18,272,231.00	3.05

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	浙商证券股份有限公司	26,830,427.00	4.47
2	华金证券—横琴人寿保险有限公司—华金证券横琴人寿基础设施策略2号FOF单一资产	20,709,445.00	3.45
3	中铁信托有限责任公司—中铁信托—锦信43号集合资金信托计划	11,521,000.00	1.92
4	华金证券—国任财产保险股份有限公司—华金证券国任保险5号基础设施基金策略FOF	8,066,356.00	1.34
5	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	5,476,115.00	0.91
6	广发证券股份有限公司	5,429,026.00	0.90
7	国信证券股份有限公司	2,862,712.00	0.48
8	中信证券—光大银行—中信证券基础设施2号集合资产管理计划	2,775,000.00	0.46
9	招商证券股份有限公司	2,770,444.00	0.46
10	中国银河证券股份有限公司	2,627,992.00	0.44
合计		89,068,517.00	14.83
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	华金证券—横琴人寿保险有限公司—华金证券横琴人寿基础设施策略2号FOF单一资产	21,752,721.00	3.63
2	浙商证券股份有限公司	18,595,746.00	3.10
3	华金证券—国任财产保险股份有限公司—华金证券国任保险5号基础设施基金策略	9,317,988.00	1.55

FOF			
4	招商财富资管—光大银行—招商财富—鑫彩 2 号集合资产管理计划	6,890,631.00	1.15
5	中信证券—光大银行—中信证券基础设施 1 号集合资产管理计划	5,618,414.00	0.94
6	广发证券股份有限公司	5,094,960.00	0.85
7	上海玖时私募基金管理有限公司—上海玖时 1 号私募证券投资基金	3,989,138.00	0.66
8	中国银河证券股份有限公司	3,615,502.00	0.60
9	招商证券股份有限公司	2,928,424.00	0.49
10	国信证券股份有限公司	2,905,359.00	0.48
合计		80,708,883.00	13.45

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	深圳能源集团股份有限公司	306,000,000.00	51.00
2	国信证券股份有限公司	9,120,000.00	1.52
2	招商财富资管—招商银行—招商财富—招银基础设施 1 号集合资产管理计划	9,120,000.00	1.52
2	国寿投资保险资产管理有限公司—自有资金	9,120,000.00	1.52
2	中银国际证券—中国银行—中银证券中国红—汇中 27 号集合资产管理计划	9,120,000.00	1.52
2	中国中金财富证券有限公司	9,120,000.00	1.52
7	国泰君安证券股份有限公司	6,840,000.00	1.14
7	生命保险资管—兴业银行—生命资产睿驰精选 1 号资产管理产品	6,840,000.00	1.14
7	中国银河证券股份有限公司	6,840,000.00	1.14
7	深圳市亿鑫投资有限公司	6,840,000.00	1.14
合计		378,960,000.00	63.16
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	深圳能源集团股份有限公司	306,000,000.00	51.00
2	国信证券股份有限公司	9,120,000.00	1.52

2	招商财富资管—招商银行—招商财富—招银基础设施 1 号集合资产管理计划	9,120,000.00	1.52
2	中银国际证券—中国银行—中银证券中国红—汇中 27 号集合资产管理计划	9,120,000.00	1.52
2	国寿投资保险资产管理有限公司—自有资金	9,120,000.00	1.52
2	中国中金财富证券有限公司	9,120,000.00	1.52
7	中国银河证券股份有限公司	6,840,000.00	1.14
7	国泰君安证券股份有限公司	6,840,000.00	1.14
7	生命保险资管—兴业银行—生命资产睿驰精选 1 号资产管理产品	6,840,000.00	1.14
7	深圳市亿鑫投资有限公司	6,840,000.00	1.14
合计		378,960,000.00	63.16

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	53,173.00	0.0089

注：截至本报告期末，本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

§ 10 基金份额变动情况

单位：份

基金合同生效日（2022 年 7 月 11 日） 基金份额总额	600,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	600,000,000.00
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	600,000,000.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本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

无。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

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

无。

11.5 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

11.7 为基金出具评估报告的评估机构情况

本报告期内未改聘为本基金出具评估报告的评估机构。

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：无。

11.8.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：无。

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	鹏华基金管理有限公司澄清公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年01月04日
2	关于调整旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司申购、定期定额申购费率优惠活动时间的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年01月05日
3	鹏华深圳能源清洁能源封闭式基础设施证券投资基金2022年第4季度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年01月20日
4	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与东方财富证券股份有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年03月14日
5	鹏华深圳能源清洁能源封闭式基础设施证券投资基金2022年年度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年03月30日
6	鹏华基金管理有限公司关于新增人民	《中国证券报》、基金管	2023年04月07日

	币直销资金专户的公告	理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
7	鹏华深圳能源清洁能源封闭式基础设施证券投资基金2023年第1季度报告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年04月21日
8	鹏华深圳能源清洁能源封闭式基础设施证券投资基金关于召开2022年度及2023年一季度业绩说明会的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年05月09日
9	鹏华基金管理有限公司关于鹏华深圳能源清洁能源封闭式基础设施证券投资基金收益分配的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年05月15日
10	鹏华基金管理有限公司关于注意防范以协助办理贷款为借口进行诈骗活动的风险提示	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年06月03日
11	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国海证券股份有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年06月05日
12	鹏华深圳能源清洁能源封闭式基础设施证券投资基金更新的招募说明书	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年06月09日
13	鹏华深圳能源清洁能源封闭式基础设施证券投资基金基金产品资料概要（更新）	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年06月09日
14	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京中植基金销售有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	《中国证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年06月20日

注：无。

§ 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

- （一）《鹏华深圳能源清洁能源封闭式基础设施证券投资基金基金合同》；
- （二）《鹏华深圳能源清洁能源封闭式基础设施证券投资基金托管协议》；
- （三）《鹏华深圳能源清洁能源封闭式基础设施证券投资基金2023年中期报告》（原文）。

13.2 存放地点

深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心第43层鹏华基金管理有限公司。

13.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站（<http://www.phfund.com.cn>）查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司，本公司已开通客户服务系统，咨询电话：4006788999。

鹏华基金管理有限公司

2023年8月30日