

金元顺安价值增长混合型证券投资基金

2022 年第 3 季度报告

2022 年 09 月 30 日

基金管理人：金元顺安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 10 月 26 日

目录

§1	重要提示	4
§2	基金产品概况	5
§3	主要财务指标和基金净值表现	6
3.1	主要财务指标	6
3.2	基金净值表现	6
§4	管理人报告	8
4.1	基金经理（或基金经理小组）简介	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	8
4.3	公平交易专项说明	9
4.4	报告期内基金的投资策略和运作分析	9
4.5	报告期内基金的业绩表现	9
4.6	报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明	10
§5	投资组合报告	11
5.1	报告期末基金资产组合情况	11
5.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	11
5.3	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细	12
5.4	报告期末按债券品种分类的债券投资组合	13
5.5	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	14
5.6	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细	14
5.7	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	14
5.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	14
5.9	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	14
5.10	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	15
5.11	投资组合报告附注	15
§6	开放式基金份额变动	23

§7	基金管理人运用自有资金投资本基金情况.....	24
7.1	基金管理人持有本基金份额变动情况.....	24
7.2	基金管理人运用自有资金投资本基金交易明细.....	24
§8	影响投资者决策的其他重要信息	25
8.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	25
8.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	25
§9	备查文件目录	27
9.1	备查文件目录	27
9.2	存放地点	27
9.3	查阅方式	27

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 10 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 07 月 01 日起至 2022 年 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	金元顺安价值增长混合
基金主代码	620004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 09 月 11 日
报告期末基金份额总额	47,749,998.74 份
投资目标	在 GARP (Growth at reasonable price) 策略指导下, 本基金投资于具有良好成长潜力和价值低估的上市公司股票, 在控制组合风险的前提下, 追求基金资产中长期的稳定增值。
投资策略	本基金的投资将数量模型与定性分析贯穿于资产类别配置、行业资产配置、公司价值评估、投资组合构建的全过程之中, 依靠坚实的基本面分析和科学的金融工程模型, 把握股票市场的有利投资机会, 构建最佳的投资组合, 实现长期优于业绩基准的良好收益。在本基金的投资管理计划中, 投资实现方法由自上而下的资产配置计划和自下而上的股票组合的构建与管理组成。同时, 宏观经济预测和行业趋势分析辅助股票组合的构建与管理。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中证国债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金系主动投资的混合型基金, 其风险收益特征从长期平均及预期来看, 低于股票型基金, 高于债券型基金与货币市场基金, 属于中等风险、中等收益的证券投资基金品种。
基金管理人	金元顺安基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期
	(2022 年 07 月 01 日 - 2022 年 09 月 30 日)
1.本期已实现收益	1,079,887.53
2.本期利润	-3,507,652.36
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1095
4.期末基金资产净值	33,856,728.15
5.期末基金份额净值	0.709

注：

1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）；

3、表中的“期末”均指报告期最后一日，即 09 月 30 日；

4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	-9.22%	1.37%	-11.99%	0.71%	2.77%	0.66%
过去六个月	-19.80%	1.63%	-7.38%	0.95%	-12.42%	0.68%

过去一年	-38.56%	1.76%	-16.88%	0.94%	-21.68%	0.82%
过去三年	-2.34%	1.92%	3.42%	1.01%	-5.76%	0.91%
过去五年	-15.90%	1.71%	5.92%	1.02%	-21.82%	0.69%
自基金合同生效起至今	-29.10%	1.64%	35.55%	1.14%	-64.65%	0.50%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

金元顺安价值增长混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2009年09月11日-2022年09月30日)



注：

- 1、本基金合同生效日为 2009 年 09 月 11 日，业绩基准累计增长率以 2009 年 09 月 10 日指数为基准；
- 2、本基金的投资组合比例为股票及存托凭证资产占基金资产的 60%—95%，债券资产、现金资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%—40%，其中基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；
- 3、本基金业绩比较基准为“沪深 300 指数收益率×80%+中证国债指数收益率×20%”。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孔祥鹏	本基金基金经理	2022-04-28		11年	金元顺安宝石动力混合型证券投资基金、金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金和金元顺安价值增长混合型证券投资基金的基金经理，北京大学理学硕士。曾任上海市盟洋投资管理有限公司投资部研究员，中山证券有限责任公司研究所研究员，德邦证券有限责任公司研究所研究员。2015年5月加入金元顺安基金管理有限公司，历任金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金和金元顺安新经济主题混合型证券投资基金的基金经理，11年证券、基金等金融行业从业经历，具有基金从业资格。

注：

1、此处的任职日期、离任日期均指公司做出决定之日，若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《金元顺安价值增长混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，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

基础上，为基金持有人谋求最大利益。

本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护。本报告期内，本基金管理人严格遵守公司投资交易业务流程及公平交易制度。公司投资交易行为监控体系由风险管理部、监察稽核部和交易部监督，确保公平交易制度的执行和实现。

本报告期内，本基金管理人对旗下开放式基金与其他投资组合之间的收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《金元顺安基金管理有限公司公平交易管理制度》及其他相关法律法规和公司内部规章制度，制定了《金元顺安基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》，涵盖了所有可投资证券的一级市场申购、二级市场交易所公开竞价交易、交易所大宗交易、银行间债券交易以及非公开发行股票申购、以公司名义进行的一级市场债券交易等可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

本基金管理人采用定量分析和定性分析相结合的方式，建立并严格执行有效的异常交易日常监控制度，形成定期交易监控报告，按照报告路线实行及时报告的机制。

本报告期内，未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

受国内经济复苏动能减弱以及海外流动性收紧等因素共同影响，三季度 A 股市场出现大幅调整，上证指数下跌 10.52%，创业板指数下跌 16.99%，分行业来看，31 个申万一级行业指数几乎全线下跌。本基金遵从价值投资理念，自下而上精选个股，对持仓结构进行优化，兼顾估值和成长，进行均衡配置，保持较高仓位。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末金元顺安价值增长混合型证券投资基金份额净值为 0.709 元；

本报告期内，基金份额净值增长率为-9.22%，同期业绩比较基准收益率为-11.99%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，自 2021 年 9 月 13 日起至 2022 年 9 月 30 日，本基金连续二百五十六个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形。

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	25,388,703.73	73.49
	其中：股票	25,388,703.73	73.49
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,917,576.82	5.55
	其中：债券	1,917,576.82	5.55
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	2,996,690.96	8.67
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,070,805.79	8.89
8	其他资产	1,174,286.32	3.40
9	合计	34,548,063.62	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-

C	制造业	22,575,494.73	66.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	142,560.00	0.42
E	建筑业	532,980.00	1.57
F	批发和零售业	337,008.00	1.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	675,792.00	2.00
J	金融业	170,240.00	0.50
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	405,927.00	1.20
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	548,702.00	1.62
S	综合	-	-
	合计	25,388,703.73	74.99

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资的股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例
----	------	------	-------	---------	-----------

					(%)
1	603008	喜临门	22,500	726,300.00	2.15
2	002056	横店东磁	34,500	682,755.00	2.02
3	002929	润建股份	20,800	675,792.00	2.00
4	603886	元祖股份	38,200	674,994.00	1.99
5	002011	盾安环境	46,500	674,250.00	1.99
6	002057	中钢天源	66,800	674,012.00	1.99
7	300258	精锻科技	56,500	651,445.00	1.92
8	002829	星网宇达	20,200	650,036.00	1.92
9	002801	微光股份	24,900	642,669.00	1.90
10	300916	朗特智能	12,000	627,600.00	1.85

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	1,917,576.82	5.66
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	1,917,576.82	5.66

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019674	22国债09	19,000	1,917,576.82	5.66
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未投资资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未投资贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未投资权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

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

1、盾安环境（002011.SZ）

（1）、浙江盾安人工环境股份有限公司于 2021 年 12 月 07 日收到深圳证券交易所下发的《关于对浙江盾安人工环境股份有限公司的关注函》（公司部关注函（2021）第 430 号），具体内容如下：

浙江盾安人工环境股份有限公司董事会：

2021 年 11 月 20 日，你公司披露《浙江盾安人工环境股份有限公司收购报告书摘要》（以下简称“收购报告书摘要”）称，你公司控股股东浙江盾安精工集团有限公司（以下简称“盾安精工”）拟向珠海格力电器股份有限公司（以下简称“格力电器”）协议转让所持你公司 29.48% 股份，你公司的控股股东将变更为格力电器，由于格力电器无实际控制人，你公司将由姚新义为实际控制人变更为无实际控制人。同时格力电器拟作为唯一的发行对象认购你公司非公开发行的股份，本次非公开发行股份完成后，格力电器将持有你公司 409,774,802 股股份，占发行后你公司总股本的 38.78%。

收购报告书摘要显示，截止 2021 年 11 月 16 日，你公司为盾安精工的关联方盾安控股集团有限公司（以下简称“盾安控股”）提供连带担保的本金余额 5.86 亿元、利息 0.75 亿元。根据你公司 2021 年 4 月 10 日披露的《关于 2020 年度计提对外担保损失的公告》《关于金融债务清偿方案的公告》，你对盾安控股的连带保证债务计提了 6.33 亿元的担保损失，并对按照保证合同约定极大可能履行保证责任的担保或有金融负债纳入了你公司未来五年债务清偿计划。

此外，本次定向增发发行价格为 5.81 元/股，协议转让价格 8.10 元/股。你公司股票价格在 2021 年 11 月 10 日停牌前 20 个交易日上涨 41.82%，其中 11 月 8 日、9 日涨幅均达 10%。

我部对上述情况表示关注，请你公司：

1. 说明本次收购是否符合《上市公司收购管理办法（2020 年修订）》第七条“被收购公司的控股股

东或者实际控制人不得滥用权利损害被收购公司或者其他股东的合法权益。被收购公司的控股股东、实际控制人及其关联方有损害被收购公司及其他股东合法权益的，上述控股股东、实际控制人在转让被收购公司控制权之前，应当主动消除损害，对不足以消除损害的部分应当提供充分有效的履约担保或安排，并依照公司章程取得被收购公司股东大会的批准”及第五十三条“控股股东及其关联方未清偿其对公司的负债，未解除公司为其负债提供的担保，或者存在损害公司利益的其他情形的，被收购公司董事会应当对前述情形及时予以披露，并采取有效措施维护公司利益”的规定。

2. 说明定向增发价格与协议转让价格差异较大的原因及合理性，是否存在损害上市公司利益及中小股东合法权益的情形。

3. 说明本次筹划控制权变更事项的具体过程、参与筹划人员及在信息保密方面采取的措施，并结合你公司董事、监事、高级管理人员、持股 5%以上股东及其关联方、该事项内幕信息知情人等近一个月内的交易情况，自查是否存在相关人员利用内幕信息进行股票交易的情形。

4. 说明你公司相应期间接待投资者、机构调研的情况，是否存在违反信息披露公平原则的情形；并结合你公司股价的影响因素，说明你公司是否存在应披露未披露的事项。

请本次收购的财务顾问及律师就上述问题 1-3 进行核查并发表明确意见。

请你公司就上述问题做出书面说明，在 2021 年 12 月 10 日前将有关说明材料报送我部并对外披露，同时抄送派出机构。同时，提醒你公司及全体董事、监事和高级管理人员严格遵守《证券法》《公司法》等法律以及本所《股票上市规则》等规定，真实、准确、完整、及时、公平地履行信息披露义务。

(2)、浙江盾安人工环境股份有限公司于 2022 年 04 月 14 日收到深圳证券交易所上市公司管理一部下发的《关于对浙江盾安人工环境股份有限公司 2021 年年报的问询函》(公司部年报问询函(2022)第 70 号)，具体内容如下：

浙江盾安人工环境股份有限公司董事会：

我部在对你公司 2021 年年度报告(以下简称“年报”)进行事后审查的过程中，关注到如下事项：

1. 年报显示，公司存货期末余额 15.24 亿元，较期初增长 18.66%，报告期计提存货跌价准备 64.44 万元，上年同期计提存货跌价准备 1,649.26 万元。你公司报告期内转回或转销存货跌价准备 241.59 万元。

请你公司：

(1) 说明跌价准备转回涉及的存货类别或性质、跌价准备的计提时间、报告期转回的具体原因，存在 2020 年计提的存货跌价准备在本报告期转回的，结合转回的确定依据及其与计提时测算的差异，说明前期存货跌价准备计提的合理性；

(2) 结合报告期存货跌价准备的测算过程(包括存货类别、可变现净值及其确定的主要方式和参

数等)，说明在存货增长的情况下计提的存货跌价准备比例大幅下降的合理性，说明报告期存货跌价准备计提的合理性和充分性。

请年审会计师对上述问题进行核查并发表明确意见。

2. 年报显示，你公司报告期在投资收益中确认债务重组收益 5,466.22 万元。请说明债务重组的具体情况，包括相关债务形成原因与金额、债务重组过程与时间等，以及履行相关审议程序和临时信息披露的情况（如适用），同时说明债务重组投资收益的计算过程和确认依据，是否符合企业会计准则的有关规定。请年审会计师进行核查并发表明确意见。

3. 年报显示，公司期末应收款项融资账面余额 13.98 亿元，期末已背书或贴现且在资产负债表日尚未到期银行承兑汇票期末终止确认金额 10.39 亿元、应收账款期末终止确认金额 12.43 亿元。你公司称银行承兑汇票的承兑人是商业银行，由于商业银行具有较高的信用，银行承兑汇票到期不获支付的可能性较低，故公司将已背书或贴现的银行承兑汇票予以终止确认。但如果该等票据到期不获支付，依据《票据法》之规定，公司仍将对持票人承担连带责任。

请你公司：

（1）说明报告期应收款项融资的具体内容及产生原因，相关会计处理是否符合会计准则的有关规定，应收款项融资预期信用损失确定的依据；

（2）列示说明应收款项融资中终止确认的应收账款的背书和贴现情况，包括但不限于交易背景、交易方式、交易对手方名称及是否存在关联关系、资产账面余额及已计提减值准备等，并进一步说明终止确认的会计处理过程及确认依据，是否符合企业会计准则的有关规定；

（3）列示说明报告期内银行承兑汇票的背书和贴现情况，包括承兑银行、是否到期、是否附追索权等，贴现的财务费用以及相关会计处理，并进一步说明报告期对背书或贴现票据终止确认的会计处理是否符合企业会计准则的有关规定。

请年审会计师对上述问题进行核查并发表明确意见。

4. 年报显示，年报“重大诉讼、仲裁事项”部分显示，公司涉及 5 起诉讼事项，其中公司作为被告的案件有 2 起，涉案金额合计 9,369 万元，公司未计提预计负债。

请你公司：

（1）说明相关诉讼是否属于重大诉讼、仲裁事项，并重点说明与公司作为被告诉讼的具体情况，包括但不限于诉讼时间、争议内容、判决情况等，前期对诉讼、仲裁事项履行信息披露义务的情况（如适用）；

（2）说明相关诉讼仲裁未形成预计负债的原因，预计负债的计提是否符合企业会计准则的有关规定。

请年审会计师对公司预计负债计提的充分性、合规性进行核查并发表明确意见。

5. 年报显示, 你公司报告期研发费用 36,951.19 万元, 同比增长 24.77%, 你公司称主要系加强研发布局, 其中职工薪酬 12,639.37 万元、同比增长 42.67%, 材料投入 16,439.83 万元、同比增长 26.05%; 你公司研发人员 2021 年 516 人, 2020 年 553 人, 2019 年 516 人。请你公司说明报告期内研发投入大幅增长的原因, 并结合研发人员数量变动、研发项目情况、具体实施进展及同行可比公司研发投入情况等, 说明研发投入大幅增长合理性, 特别是职工薪酬大幅增长是否合理。

6. 年报显示, 你公司在报告期确认使用权资产 2.17 亿元, 你公司称主要系诸暨土地上房屋征收报告期内约定搬迁期满而未搬迁导致。

请你公司:

- (1) 列示前述项目包含的租赁资产、负债的具体内容, 包括但不限于名称、类别、期限、金额等;
- (2) 说明公司因房屋征收未搬迁确认大额使用权资产的原因及合理, 会计处理是否恰当。

请年审会计师对上述问题(2)进行核查并发表明确意见。

7. 年报显示, 你公司报告期营业外支出 7,849.06 万元, 其中出售子公司或有负债确认营业外支出 2,927.38 万元。你公司称系 2019 年全资子公司浙江盾安节能科技有限公司(以下简称“浙江节能”)向水发能源集团有限公司(以下简称“水发能源”)出售盾安(天津)节能系统有限公司(以下简称“天津节能”)65%股权后, 对审计基准日前存在的或有负债支付导致。请你公司结合当时《股权转让协议》约定等, 说明或有负债产生的原因, 未计提预计负债而在支付当期计入营业外支出的原因及合理性, 是否存在跨期调节利润的情形, 相关会计处理是否符合会计准则的有关规定。请年审会计师进行核查并发表明确意见。

8. 年报显示, 你公司货币资金期末余额 10.46 万元, 短期借款期末余额 17.38 亿元, 短期借款期末余额 5.01 亿元; 报告期末资产负债率 80.20%, 流动负债占负债总额的比例为 88.13%, 速动比率、现金比率分别为 0.83、0.18, 较 2020 年末呈下降趋势。请你公司说明公司短期借款的还款来源、偿债能力是否存在重大风险, 截至回函日公司短期负债的偿还情况以及未来应对计划。

9. 与年报同时披露的《非经营性资金占用及其他关联资金往来情况的专项审计说明》显示, 你公司与子公司发生资金调度及代垫费用非经营性往来余额 272,982.12 万元; 因资金调度及代垫费用, 原子公司盾安(天津)节能系统有限公司、上海风神环境设备工程有限公司、鹤壁盾安供热有限公司期末占用你公司资金合计 18,285 万元。

请你公司:

(1) 说明公司对子公司发生大额资金拆借的原因, 是否存在违规资金占用、违规担保情况, 是否存在隐瞒关联交易及关联交易违规情况, 是否按规定履行审批程序及信息披露义务;

(2) 说明对该三笔关联方非经营性资金占用已采取的催收措施及后续处理计划，董事会将采取何种措施维护公司利益，如何追究占用相关责任；结合与资金占用方约定的支付安排、违约责任、实际收款情况，占用方的资金状况和偿付能力等，说明相关款项是否存在回收风险，是否计提相应减值准备。

请你公司就上述问题做出书面说明，在 2022 年 4 月 28 日前将有关说明材料报送我部，同时抄送派出机构。涉及需披露事项的，请及时履行披露义务。

(3)、浙江盾安人工环境股份有限公司于 2022 年 06 月 07 日收到深圳证券交易所上市公司管理一部下发的《关于对浙江盾安人工环境股份有限公司的关注函》（公司部关注函〔2022〕第 266 号），具体内容如下：

浙江盾安人工环境股份有限公司董事会：

你公司 2022 年 6 月 3 日披露《关于董事会提前换届选举的公告》称，第七届董事会提名刘姝威、王晓华、邢子文为公司第八届董事会独立董事候选人。你公司提交的独立董事备案审核材料显示，刘姝威、王晓华、邢子文均为你公司控股股东珠海格力电器股份有限公司（以下简称“格力电器”）的独立董事。你公司同日披露《关于新增关联方及增加日常关联交易预计的公告》称，预计 2022 年度将与格力电器及其下属公司发生关联交易 31 亿元（1-5 月已发生 6.36 亿元），较 2021 年度实际发生额 17.49 亿元增长 77.24%。

我部对上述情况表示关注，请你公司：

1. 说明你公司董事会提名的三名独立董事是否符合《上市公司独立董事规则》第二条“本规则所称独立董事是指不在上市公司担任除董事外的其他职务，并与其所受聘的上市公司及其主要股东不存在可能妨碍其进行独立客观判断的关系的董事”、第六条“独立董事必须具有独立性。独立董事应当独立履行职责，不受上市公司主要股东、实际控制人或者其他与上市公司存在利害关系的单位或个人的影响”及本所《上市公司自律监管指引第 1 号--主板上市公司规范运作》第 3.5.4 条“独立董事候选人应当具有独立性，下列人员不得担任独立董事：（三）在直接或间接持有上市公司已发行股份 5%以上的股东单位或者在上市公司前五名股东单位任职的人员及其直系亲属；（四）在上市公司控股股东、实际控制人及其附属企业任职的人员及其直系亲属；

（六）在与上市公司及其控股股东、实际控制人或者其各自的附属企业有重大业务往来的单位任职的人员，或者在有重大业务往来单位的控股股东单位任职的人员”等的规定。请你公司律师进行核查并发表明确意见。

2. 说明你公司预计 2022 年将与格力电器及其下属公司发生关联交易大幅增长的原因及合理性，1-5 月已发生交易的审议及披露情况，相关定价的公允性及依据。请你公司独立董事进行核查并发表明确意见。

请你公司就上述问题做出书面说明，在 2022 年 6 月 10 日前将有关说明材料报送我部并对外披露，同时抄送派出机构。同时，提醒你公司及全体董事、监事和高级管理人员严格遵守《证券法》《公司法》等法律以及本所《股票上市规则》等规定，真实、准确、完整、及时、公平地履行信息披露义务。

(4)、浙江盾安人工环境股份有限公司于 2022 年 07 月 05 日收到深圳证券交易所上市公司管理部下发的《关于对浙江盾安人工环境股份有限公司的关注函》(公司部关注函〔2022〕第 299 号)，具体内容如下：

浙江盾安人工环境股份有限公司董事会：

2022 年 4 月 2 日，你公司披露关于控股股东签署《关于解决关联担保事宜的专项协议》的公告称，为妥善解决历史上公司为前控股股东盾安控股提供的关联担保事宜（截至融资（贷款）到期日，关联担保本息合计为人民币 66,623.07 万元），盾安控股、盾安精工与现控股股东格力电器、关联担保债权人浙商行杭州分行签署了《关于解决关联担保事宜的专项协议》（以下简称“专项协议”），就关联担保事宜达成如下安排：（1）盾安控股和格力电器分别承担截至融资（贷款）到期日的关联担保债务的 50%，融资（贷款）到期之日起因关联担保债务产生的包括但不限于利息、罚息等新增债务（如有）由盾安控股自行清偿。（2）各方应尽最大努力并确保，关联担保债务应最迟不晚于 2022 年 5 月 15 日前清偿完毕，并解除盾安环境所负担的担保义务。

2022 年 7 月 4 日，你公司披露《关于公司关联担保事项解决方案的进展公告》称，你公司收到浙商行杭州分行催款通知，要求盾安控股及你公司必须于 2022 年 6 月 30 日清偿关联担保债务，若未能在规定时间内清偿债务，债权人将严格按照原借款合同、保证合同的约定，采取司法途径追偿。为维护公司信用，避免对公司生产经营造成重大影响，你公司决定先行由公司代偿由格力电器承诺兜底担保债务 33,311.535 万元。格力电器承诺最迟不晚于 2022 年 10 月 31 日按照 2022 年 4 月 2 日披露的《关于解决关联担保事宜的专项协议》确定的原则就公司的关联担保债务承担最终兜底责任。

我部对上述情况表示关注，请你公司：

1. 说明在专项协议约定盾安控股和格力电器分别承担关联担保债务的 50%的情况下，债权人浙商行杭州分行要求盾安控股及你公司而非盾安控股与格力电器清偿关联担保债务的原因及合理性，你公司先行代偿由格力电器承诺兜底的担保债务的原因及合理性。

2. 结合专项协议对关联担保债务承担形式等的约定，说明格力电器延迟承担担保债务责任的理由是否成立，是否存在违约情况及需承担相应的违约责任（如有）；专项协议签署各方是否对协议条款或格力电器本次延迟承担担保债务责任存在争议、补充约定或拟采取的措施（如有）。

3. 说明你公司先行代偿由格力电器承诺兜底的担保债务是否构成控股股东非经营性资金占用，是否触及《股票上市规则（2022 年修订）》规定的公司股票交易应被实施其他风险警示的情形；如否，说

明理由。

请你公司律师对问题 2、你公司独立董事对问题 3 进行核查并发表明确意见。

请你公司就上述问题做出书面说明，在 2022 年 7 月 8 日前将有关说明材料报送我部并对外披露，同时抄送派出机构。同时，提醒你公司及全体董事、监事和高级管理人员严格遵守《证券法》《公司法》等法律以及本所《股票上市规则》等规定，真实、准确、完整、及时、公平地履行信息披露义务。

本基金管理人做出说明如下：

(1) 投资决策程序：通过对公司的基本面进行分析，认为基本面发展势头良好，业绩表现符合预期，后续业务持续发展尚有一定的潜力；

(2) 因收购报告、独立董事任命、以及关联交易等问题，公司收到深圳证券交易所下发的关注函，因年报披露问题，公司于 2022 年 04 月 14 日收到深圳证券交易所上市公司管理一部下发的问询函。经过分析，我们认为该事项对公司影响可控，因此继续持有该公司股票。

5.11.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	9,129.39
2	应收证券清算款	1,153,650.70
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	11,506.23
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,174,286.32

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	21,639,967.17
报告期期间基金总申购份额	28,865,078.42
减：报告期期间基金总赎回份额	2,755,046.85
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	47,749,998.74

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	9,999,200.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	9,999,200.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	20.94

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金管理人未进行本基金的申购、赎回及红利再投资等交易。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2022 年 07 月 01 日 - 2022 年 09 月 30 日	9,999,200.00	0.00	-	9,999,200.00	20.94%
	2	2022 年 08 月 26 日 - 2022 年 09 月 30 日	0.00	13,036,895.67	-	13,036,895.67	27.30%

产品特有风险

- 持有份额比例较高的投资者（“高比例投资者”）大额赎回时易使本基金发生巨额赎回或连续巨额赎回，中小投资者可能面临赎回申请需要与高比例投资者按同比例部分延期办理的风险，赎回款项延期获得。
- 基金净值大幅波动的风险
高比例投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；若高比例投资者赎回的基金份额收取赎回费，相应的赎回费用按约定将部分或全部归入基金资产，可能对基金资产净值造成较大波动。
- 基金规模较小导致的风险
高比例投资者赎回后，可能导致基金规模较小，从而使得基金投资及运作管理的难度增加。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、2022 年 07 月 15 日，在《证券日报》和 www.jysa99.com 上公布金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加北京创金启富基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告；

2、2022 年 07 月 15 日，在《证券日报》和 www.jysa99.com 上公布金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加上海陆享基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告；

3、2022 年 07 月 21 日，在《证券日报》和 www.jysa99.com 上公布金元顺安价值增长混合型证券投资基金 2022 年第二季度报告；

4、2022 年 08 月 31 日，在《证券日报》和 www.jysa99.com 上公布金元顺安基金管理有限公司旗下证券投资基金 2022 年中期报告；

5、2022 年 09 月 13 日，在《证券日报》和 www.jysa99.com 上公布金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加鼎信汇（北京）投资管理有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告；

6、2022 年 09 月 14 日，在《证券日报》和 www.jysa99.com 上公布金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加国金证券股份有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告；

7、2022 年 09 月 30 日，在《证券日报》和 www.jysa99.com 上公布金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加北京坤元为销售机构并参与费率优惠的公告。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予金元顺安价值增长混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《金元顺安价值增长混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《金元顺安价值增长混合型证券投资基金基金招募说明书》；
- 4、《金元顺安价值增长混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册金元顺安价值增长混合型证券投资基金的法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

金元顺安基金管理有限公司

中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 3608 室

9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间至办公地点进行查询，或登录本基金管理人网站 www.jysa99.com 查阅。投资者对本报告书存有疑问，可咨询本基金管理人金元顺安基金管理有限公司，本公司客服电话 400-666-0666、021-68881898。

金元顺安基金管理有限公司

2022 年 10 月 26 日