

鹏华国证钢铁行业指数型证券投资基金
(LOF)
2021 年第 1 季度报告

2021 年 3 月 31 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

报告送出日期：2021 年 4 月 21 日

§ 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。

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 2021 年 04 月 20 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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 03 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	鹏华钢铁
场内简称	钢铁 LOF
基金主代码	502023
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 8 月 13 日
报告期末基金份额总额	415,958,130.09 份
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，力争将日均跟踪偏离度控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资方法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。本基金力争基金份额净值增长率与同期业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 1、股票投资策略 (1) 股票投资组合的构建 本基金在建仓期内，将按照标的指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本。当遇到成份股停牌、流动性不足等其他市场因素而无法依指数权重购买某成份股及预期标的指数的

	<p>成份股即将调整或其他影响指数复制的因素时,本基金可以根据市场情况,结合研究分析,对基金财产进行适当调整,以期在规定的风险承受限度之内,尽量缩小跟踪误差。(2)股票投资组合的调整 本基金所构建的股票投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整,本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况,对其进行适时调整,以保证基金份额净值增长率与标的指数收益率间的高度正相关和跟踪误差最小化。基金管理人将对成份股的流动性进行分析,如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。由于受到各项持股比例限制,基金可能不能按照成份股权重持有成份股,基金将会采用合理方法寻求替代。</p> <p>1) 定期调整 根据标的指数的调整规则和备选股票的预期,对股票投资组合及时进行调整。</p> <p>2) 不定期调整 根据指数编制规则,当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重新调整时,本基金将根据各成份股的权重变化进行相应调整; 根据本基金的申购和赎回情况,对股票投资组合进行调整,从而有效跟踪标的指数; 根据法律、法规规定,成份股在标的指数中的权重因其它特殊原因发生相应变化的,本基金可以对投资组合管理进行适当变通和调整,力求降低跟踪误差。</p> <p>2、债券投资策略 本基金可以根据流动性管理需要,选取到期日在一年以内的政府债券进行配置。本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略,根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化,并利用债券定价技术,进行个券选择。</p> <p>3、衍生品投资策略 本基金可投资股指期货、权证和其他经中国证监会允许的金融衍生产品。 本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及投资组合仓位调整的交易成本,达到稳定投资组合资产净值的目的。 基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组,授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项,同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。 本基金通过对权证标的证券基本面的研究,并结合权证定价模型及价值挖掘策略、价差策略、双向权证策略等寻求权证的合理估值水平,追求稳定的当期收益。</p> <p>4、资产支持证券的投资策略 本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理,并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略,严格遵守法律法规和基金合同的约定,在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。</p>
业绩比较基准	国证钢铁行业指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金,通过跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。
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

注：鹏华国证钢铁行业指数分级证券投资基金取消分级运作变更为鹏华国证钢铁行业指数型证券投资基金（LOF）。《鹏华国证钢铁行业指数型证券投资基金（LOF）基金合同》于 2021 年 1 月 1 日正式生效，《鹏华国证钢铁行业指数分级证券投资基金基金合同》自同一日失效。

§ 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（2021 年 1 月 1 日-2021 年 3 月 31 日）
1. 本期已实现收益	-138,151.81
2. 本期利润	-2,667,929.30
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0138
4. 期末基金资产净值	636,550,004.67
5. 期末基金份额净值	1.530

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. 所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（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），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

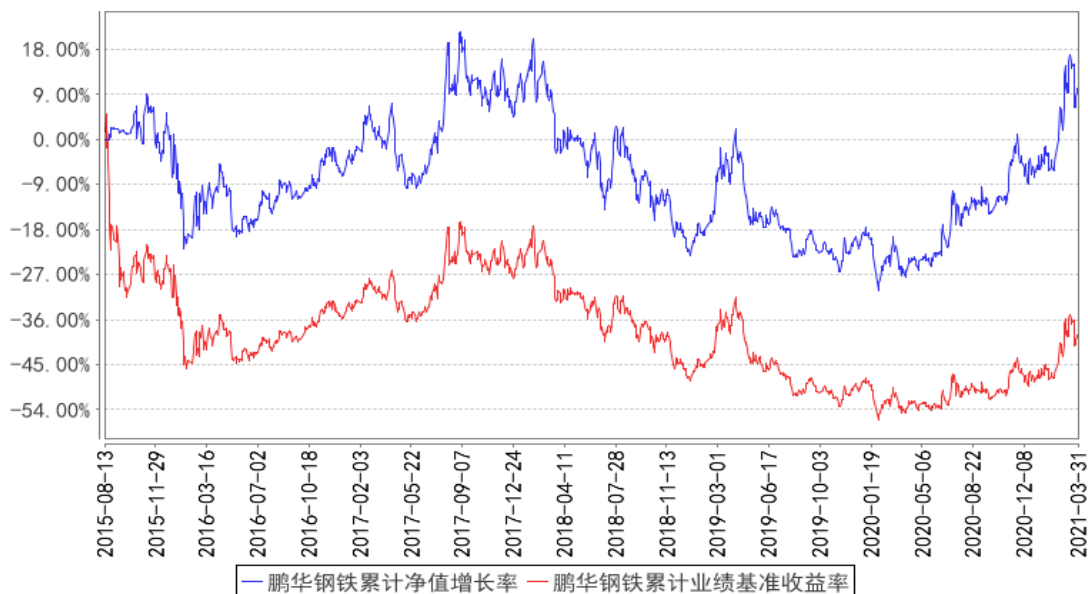
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	16.88%	2.19%	16.15%	2.27%	0.73%	-0.08%
过去六个月	27.71%	1.81%	25.03%	1.86%	2.68%	-0.05%
过去一年	49.37%	1.60%	32.19%	1.64%	17.18%	-0.04%
过去三年	9.27%	1.54%	-12.99%	1.53%	22.26%	0.01%
过去五年	23.47%	1.49%	0.17%	1.45%	23.30%	0.04%
自基金合同 生效起至今	9.15%	1.61%	-39.58%	1.68%	48.73%	-0.07%

注：业绩比较基准=国证钢铁行业指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%

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

鹏华钢铁累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2015 年 08 月 13 日生效。2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.3 其他指标

注：无。

§ 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		
罗英宇	本基金基金经理	2021-01-20	-	14 年	罗英宇先生，国籍中国，管理学硕士，14 年证券基金从业经验。曾任招商银行股份有限公司高级程序员，博时基金管理有限公司信息技术部高级程序员。2008 年 6 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任信息技术部系统分析员、总经理助理、副总经理。2019 年 08 月至今担任量化及衍生品投资部金融科技副总监，从事投资研究相关工作。2020 年 12 月担任芯片基金基金经理，2020 年 12 月担任鹏华股息龙头 ETF 联接基金基金经理，2020 年 12 月担任股息龙头基金基金经理，2021 年 01 月担任鹏华互联网基金基金经理，2021 年 01 月担任鹏华钢铁基金基金经理，2021 年 01 月担任鹏华高铁基金基金经理，2021 年

					01 月担任鹏华信息基金基金经理，2021 年 01 月担任鹏华一带一路基金基金经理。罗英宇先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动，增聘罗英宇为本基金基金经理，张羽翔不再担任本基金基金经理。
张羽翔	本基金基金经理	2018-05-31	2021-01-20	14 年	张羽翔先生，国籍中国，工学硕士，14 年证券基金从业经验。曾任招商银行软件中心(原深圳市融博技术公司)数据分析师；2011 年 3 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任监察稽核部资深金融工程师、量化及衍生品投资部资深量化研究员，先后从事金融工程、量化研究等工作；现任量化及衍生品投资部基金经理。2015 年 09 月至 2020 年 06 月担任民企 ETF 基金基金经理，2015 年 09 月至 2020 年 06 月担任鹏华上证民企 50ETF 联接基金基金经理，2016 年 06 月至 2018 年 05 月担任鹏华新丝路分级基金基金经理，2016 年 07 月至 2020 年 12 月担任鹏华高铁分级基金基金经理，2016 年 09 月担任鹏华中证 500 指数 (LOF) 基金基金经理，2016 年 09 月担任鹏华沪深 300 指数 (LOF) 基金基金经理，2016 年 11 月至 2020 年 07 月担任鹏华新能源分级基金基金经理，2016 年 11 月至 2020 年 12 月担任鹏华一带一路分级基金基金经理，2018 年 04 月至 2020 年 12 月担任鹏华创业板分级基金基金经理，2018 年 04 月至 2020 年 12 月担任鹏华互联网分级基金基金经理，2018 年 05 月至 2018 年 08 月担任鹏华沪深 300 指数增强基金基金经理，2018 年 05 月至 2020 年 12 月担任鹏华钢铁分级基金基金经理，2018 年 05 月担任鹏华香港中小企业指数 (LOF) 基金基金经理，2019 年 04 月担任酒 ETF 基金基金经理，2019 年 07 月担任国防 ETF 基金基金经理，2019 年 11 月担任鹏华香港银行指数 (LOF) 基金基金经理，2019 年 12 月担任银行 FUND 基金基金经理，2020 年 02 月担任证保 ETF 基金基金经理，2020 年 03 月担任传媒 ETF 基金基金经理，2021 年 01 月担任鹏华创业板基金基金经理，2021 年 01 月至 2021 年 01 月担任鹏华互联网基金基金经理，2021 年 01 月至 2021 年 01 月担任鹏华一

					带一路基金基金经理，2021 年 01 月至 2021 年 01 月担任鹏华高铁基金基金经理，2021 年 01 月至 2021 年 01 月担任鹏华钢铁基金基金经理，2021 年 01 月担任鹏华酒基金基金经理，2021 年 01 月担任鹏华银行基金基金经理，2021 年 01 月担任鹏华传媒基金基金经理。张羽翔先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动，增聘罗英宇为本基金基金经理，张羽翔不再担任本基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1. 任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，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关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.1.1 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。

4.2 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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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、分配各环节得到公平对待。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为。本报告期内未发生基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内，本产品采用完全复制的方法跟踪国证钢铁行业指数，努力将跟踪误差控制在合理范围。在此基础上，认真应对投资者日常申购、赎回和成份股调整等工作，并通过遵从严格的风

险、合规管理流程，确保了本基金的安全运作。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 3 月 31 日，本基金份额净值为 1.5300 元，本报告期份额净值增长率为 16.88%，同期业绩比较基准增长率 16.15%。本基金在本报告期的跟踪偏离度为 2.52%，与业绩比较基准产生偏离的主要原因为日常运作费用、指数成份股调整、申购赎回、成份股分红、新股收益等产生的差异。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 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	601,973,988.68	86.29
	其中：股票	601,973,988.68	86.29
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	-	-
	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	64,222,705.54	9.21
8	其他资产	31,459,312.75	4.51
9	合计	697,656,006.97	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	18,744,660.68	2.94
C	制造业	582,481,010.09	91.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-

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	-	-
J	金融业	-	-
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	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	601,225,670.77	94.45

5.2.2 报告期末积极投资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	667,973.83	0.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	24,036.12	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	36,450.14	0.01
J	金融业	-	-
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	19,857.82	0.00
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	748,317.91	0.12

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

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

5.3.1 报告期末指数投资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	600019	宝钢股份	15,949,723	128,873,761.84	20.25
2	600010	包钢股份	39,113,500	61,017,060.00	9.59
3	000708	中信特钢	1,554,940	41,050,416.00	6.45
4	002075	沙钢股份	2,878,000	25,988,340.00	4.08
5	000932	华菱钢铁	3,142,040	21,994,280.00	3.46
6	600282	南钢股份	4,747,200	18,371,664.00	2.89
7	000709	河钢股份	7,670,600	18,102,616.00	2.84
8	000778	新兴铸管	4,501,700	18,096,834.00	2.84
9	600507	方大特钢	2,021,212	18,069,635.28	2.84
10	000825	太钢不锈	3,936,300	17,988,891.00	2.83

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	300999	金龙鱼	1,393	104,962.55	0.02
2	300903	科翔股份	2,899	95,782.96	0.02
3	688630	芯碁微装	3,397	51,736.31	0.01
4	688183	生益电子	3,515	46,925.25	0.01
5	688662	富信科技	2,556	39,899.16	0.01

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

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

注：无。

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

注：无。

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

注：无。

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

注：无。

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

注：无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及投资组合仓位调整的交易成本，达到稳定投资组合资产净值的目的。

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

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

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是否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

方大特钢

一、处罚事由

经上交所查明，2018年8月18日，方大特钢科技股份有限公司（以下简称方大特钢或公司）披露《未来三年股东回报规划（2018-2020年）》（以下简称《股东回报规划》），并于当年9月20日经股东大会审议通过。《股东回报规划》第三条对具体股东回报规划明确，公司未来三年（2018-2020年）每年根据实际情况确定利润分配方案，但2018年至2020年以现金方式累计分配的利润不少于母公司三年实现的年均可分配利润的百分之三十，并根据公司所处发展阶段和重大资金安排需求等因素，区分具体分红政策，但任一分红政策的现金分红在利润分配比例中所占比例最低应达到20%。

2020 年 2 月 28 日，公司披露 2019 年度利润分配预案，拟不进行现金分红。公司未按照其前期公告的《股东回报规划》，向投资者披露说明公司所处的发展阶段及重大资金安排需求，以确定公司当年度所选择的对应分红政策，且最终不进行现金分红的方案未达到《股东回报规划》现金分红最低占比 20% 的要求。经监管督促，公司在 3 月 11 日的补充公告中称，不分红的原因为企业盈利情况、资金状况、企业内外形势、长远发展及股东回报等因素。公司 2019 年度利润分配相关披露事项与《股东回报规划》不符，信息披露前后不一致，可能对投资者产生误导。

另经查明，公司同时存在未按规定履行利润分配相关信息披露义务的行为。公司在报告期内盈利且累计未分配利润为正，未按照《上海证券交易所上市公司现金分红指引》（以下简称《分红指引》）的要求，在审议通过年度报告的董事会公告中，结合所处行业特点、发展阶段和自身经营模式、盈利水平、资金需求等因素，对未进行现金分红原因予以说明，也未单独编制相应的利润分配、公积金转增股本方案公告。

利润分配、现金分红事项，与投资者的回报和权益直接相关，投资者高度关注，对投资者的投资决策具有重要影响。公司的上述行为违反了《上海证券交易所股票上市规则》（以下简称《股票上市规则》）第 1.4 条、第 2.3 条、第 2.7 条、第 11.4.1 条和《现金分红指引》第七条、第十条等相关规定。时任董事会秘书詹柏丹作为信息披露的具体负责人，未勤勉尽责，对公司上述违规行为负有责任，其违反了《股票上市规则》第 3.1.4 条、第 3.1.5 条、第 3.2.2 条的规定及其在《董事（监事、高级管理人员）声明及承诺书》中做出的承诺。

二、处罚机构及处罚结果

鉴于上述事实 and 情节，根据《股票上市规则》第 17.1 条和《上海证券交易所纪律处分和监管措施实施办法》有关规定，上海证券交易所做出如下监管措施决定：对方大特钢科技股份有限公司及时任董事会秘书詹柏丹予以监管关注。

对上述股票的投资决策程序的说明：本基金为指数基金，为更好地跟踪标的指数，控制跟踪误差，对该证券的投资属于按照指数成分股的权重进行配置，符合指数基金的管理规定，该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	56,327.33
2	应收证券清算款	26,230,870.65

3	应收股利	-
4	应收利息	8,544.89
5	应收申购款	5,163,569.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	31,459,312.75

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公 允价值（元）	占基金资产净 值比例（%）	流通受限情况 说明
1	300999	金龙鱼	104,962.55	0.02	锁定期股票
2	300903	科翔股份	95,782.96	0.02	锁定期股票
3	688630	芯碁微装	51,736.31	0.01	新股未上市
4	688183	生益电子	46,925.25	0.01	锁定期股票
5	688662	富信科技	39,899.16	0.01	新股未上市

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	92,304,260.24
报告期期间基金总申购份额	669,233,611.85
减：报告期期间基金总赎回份额	345,579,742.00
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	415,958,130.09

§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

注：无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

§ 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

注：无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- (一) 《鹏华国证钢铁行业指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同》；
- (二) 《鹏华国证钢铁行业指数型证券投资基金 (LOF) 托管协议》；
- (三) 《鹏华国证钢铁行业指数型证券投资基金 (LOF) 2021 年第 1 季度报告》（原文）。

9.2 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。

9.3 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

2021 年 4 月 21 日