

博时中证全球中国教育主题交易型开放式指数证券投资基金(QDII)

2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 月 30 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年十月二十五日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 23 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 2024 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	博时全球中国教育（QDII-ETF）
场内简称	证券简称：教育 ETF，扩位证券简称：教育 ETF
基金主代码	513360
交易代码	513360
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 6 月 8 日
报告期末基金份额总额	1,084,213,920.00 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的最小化。
投资策略	<p>本基金主要采用完全复制法进行投资，即按照成份股在标的指数中的基准权重来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。</p> <p>在正常情况下，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的预期日均跟踪偏离度的绝对值小于 0.35%，预期年化跟踪误差不超过 4%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金日均跟踪偏离度和跟踪误差变大，基金管理人应采取合理措施，避免日均跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。</p> <p>当指数编制方法变更、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量调整而发生变化、成份股派发现金股息、配股及增发、股票长期停牌、市场流动性不足等情况发生时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。</p>
业绩比较基准	中证全球中国教育主题指数（人民币）收益率

风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪中证全球中国教育主题指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。此外，本基金可投资境外市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，还面临汇率风险以及境外市场的风险。
基金管理人	博时基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
境外资产托管人英文名称	Brown Brothers Harriman Co.
境外资产托管人中文名称	布朗兄弟哈里曼银行

§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 (2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	-33,940,463.37
2.本期利润	66,574,040.55
3.加权平均基金份额本期利润	0.0593
4.期末基金资产净值	593,115,353.10
5.期末基金份额净值	0.5470

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不包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。

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，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 本报告期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	13.27%	2.48%	13.86%	2.51%	-0.59%	-0.03%
过去六 个月	-4.79%	2.11%	-4.95%	2.14%	0.16%	-0.03%
过去一 年	-5.35%	2.01%	-5.82%	2.03%	0.47%	-0.02%
过去三 年	12.18%	2.20%	13.98%	2.20%	-1.80%	0.00%
自基金	-45.30%	2.37%	-45.80%	2.39%	0.50%	-0.02%

合同生效起至今						
---------	--	--	--	--	--	--

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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



§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		
万琼	指数与量化投资部投资总监助理/基金经理	2021-06-08	-	17.5	万琼女士，硕士。2004年起先后在中企动力科技股份有限公司、华夏基金工作。2011年加入博时基金管理有限公司。历任投资助理、基金经理助理、博时富时中国 A 股指数证券投资基金(2017年9月29日-2019年9月5日)、上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金(2015年6月8日-2019年10月11日)、博时上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015年6月8日-2019年10月11日)、博时恒生沪深港通大湾区综合交易型开放式指数证券投资基金(2020年4

				<p>月 30 日-2022 年 5 月 27 日)、博时上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015 年 6 月 8 日-2022 年 7 月 7 日)、上证自然资源交易型开放式指数证券投资基金(2015 年 6 月 8 日-2022 年 7 月 7 日)、博时中证可持续发展 100 交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 1 月 19 日-2023 年 3 月 8 日)、博时中证红利交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 3 月 20 日-2023 年 3 月 8 日)、博时沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(2020 年 4 月 3 日-2023 年 3 月 8 日)、博时创业板指数证券投资基金(2021 年 4 月 2 日-2023 年 3 月 8 日)、博时纳斯达克 100 指数型发起式证券投资基金 (QDII) (2022 年 7 月 26 日-2023 年 9 月 25 日)的基金经理。现任指数与量化投资部投资总监助理兼博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2015 年 10 月 8 日—至今)、博时标普 500 交易型开放式指数证券投资基金(2015 年 10 月 8 日—至今)、博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(2019 年 8 月 1 日—至今)、博时中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2019 年 12 月 30 日—至今)、博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2021 年 3 月 18 日—至今)、博时恒生港股通高股息率交易型开放式指数证券投资基金</p>
--	--	--	--	---

					(2021 年 5 月 11 日—至今)、博时恒生科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2021 年 5 月 17 日—至今)、博时中证全球中国教育主题交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2021 年 6 月 8 日—至今)、博时恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)(2021 年 12 月 21 日—至今)、博时恒生医疗保健交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)(2021 年 12 月 28 日—至今)、博时恒生港股通高股息率交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(2022 年 1 月 10 日—至今)、博时中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金(2022 年 3 月 3 日—至今)、博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(2023 年 4 月 19 日—至今)、博时纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(QDII)(2023 年 9 月 26 日—至今)的基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

4.3 报告期内本基金运作合规守信情况说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信

于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 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了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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% 的交易共 38 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2024 年 3 季度，国内经济维持弱势。消费整体处于弱景气，需求仍在复苏中，工业产销率整体偏弱。8 月规模以上工业增加值环比走弱，规模以上工业企业利润也出现了环比下行，近期 PPI 跌幅出现扩大，预计 3 季度企业盈利难有起色。但 9 月份政策层面出现了较大变化，从利率、货币到一线城市房地产限购放松等多个方面出台了一系列刺激政策。特别是央行创设了两项新的货币政策工具支持股票市场稳定发展，对促进股票市场长期健康稳定发展有积极作用。稳增长政策超预期加码后，市场风险偏好得到快速提振。A 股于 9 月下旬触底反弹。随着市场反弹，主要宽基指数在 3 季度最终录得正收益，创业板指、北证 50 和科创 50 等指数表现领先，红利指数相对落后。行业板块方面，非银行金融、房地产、消费者服务和计算机等行业涨幅靠前，石油石化、煤炭、电力及公用事业和农林牧渔等行业涨幅落后。

随着双减 3 周年的到来，市场走出了对政策不确定性的担忧。叠加市场流动性增强和风险偏好的提升，教育指数在 9 月份触底后反弹，3 季度整体有不错表现。随着市场情绪回暖，企业盈利预期改善的背景下，预计 4 季度教育行业市值有望迎来新一轮催化。

本基金作为一只被动策略的指数基金，会以最小化跟踪误差为目标，紧密跟踪标的指数。

截至 2024 年 09 月 30 日，本基金基金份额净值为 0.5470 元，份额累计净值为 0.5470 元。报告期内，本基金基金份额净值增长率为 13.27%，同期业绩基准增长率 13.86%。

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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	587,693,503.03	97.44
	其中：普通股	490,639,016.20	81.35
	存托凭证	97,054,486.83	16.09
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的 买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付 金合计	15,349,705.37	2.54
8	其他各项资产	101,048.98	0.02
9	合计	603,144,257.38	100.00

注：权益投资中通过港股通机制投资香港股票金额 13,377,333.22 元，净值占比 2.26%。

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例（%）
中国大陆	295,915,010.26	49.89
中国香港	194,724,005.94	32.83
美国	97,054,486.83	16.36
合计	587,693,503.03	99.09

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
原材料	9,734,868.00	1.64
工业	67,777,138.65	11.43
非日常生活消费品	309,705,421.63	52.22
日常消费品	23,853,009.22	4.02
金融	1,096,215.92	0.18
信息技术	127,954,741.61	21.57
电信业务	47,572,108.00	8.02
合计	587,693,503.03	99.09

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

5.4 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及存托凭证投资明细

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	TAL EDUCATION GROUP- ADR	TAL EDUCATION GROUP- ADR	TAL US	纽约证券交易所	美国	992,836.00	82,373,236.00	13.89
2	NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	9901 HK	中国香港证券交易所	中国香港	1,431,230.00	80,021,471.91	13.49
3	UBTECH ROBOTICS CORP LTD	UBTECH ROBOTICS CORP LTD	9880 HK	中国香港证券交易所	中国香港	334,550.00	33,578,524.89	5.66

				交易所				
3	优必选	优必选	09880 HS	深港通	中国 大陆	120,750.00	12,119,584.1 6	2.04
4	拓维信息	拓维信息	00226 1 SZ	中国 深圳 证券 交易 所	中国 大陆	2,213,900.00	36,595,767.0 0	6.17
5	视源股份	视源股份	00284 1 SZ	中国 深圳 证券 交易 所	中国 大陆	813,376.00	29,981,039.3 6	5.05
6	中公教育	中公教育	00260 7 SZ	中国 深圳 证券 交易 所	中国 大陆	10,232,182.0 0	28,138,500.5 0	4.74
7	科大讯飞	科大讯飞	00223 0 SZ	中国 深圳 证券 交易 所	中国 大陆	607,000.00	26,975,080.0 0	4.55
8	EAST BUY HOLDING LTD	EAST BUY HOLDING LTD	1797 HK	中国	中国	1,321,600.00	23,550,079.9 2	3.97

				香港 证券 交易 所	香 港			
8	东方甄选	东方甄选	01797 HS	深 港 通	中 国 大 陆	17,000.00	302,929.30	0.05
9	TIANLI INTERNATIONA L HOLDING	TIANLI INTERNATIONA L HOLDING	1773 HK	中 国 香 港 证 券 交 易 所	中 国 香 港	4,486,000.00	20,955,327.0 9	3.53
1 0	学大教育	学大教育	00052 6 SZ	中 国 深 圳 证 券 交 易 所	中 国 大 陆	304,200.00	19,191,978.0 0	3.24

注：所用证券代码采用当地市场代码。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 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基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中，拓维信息系统股份有限公司在报告编制前一年受到深圳证券交易所的通报批评。本基金对上述证券的投资决策程序符合相关法规及公司制度的要求。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

5.10.2 报告期内基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	63,345.14
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	37,703.84
8	其他	-
9	合计	101,048.98

5.10.4 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。

5.10.5 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中不存在流通受限情况。

5.10.6 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，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	1,222,213,920.00
报告期期间基金总申购份额	118,500,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	256,500,000.00
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	1,084,213,920.00

§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

基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未发生运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的情况。

§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	2024-07-01~2024-07-09;2024-07-29~2024-07-29;2024-07-31~2024-07-31;2024-09-30~2024-09-30	271,003,760.00	586,914,501.00	608,923,000.00	248,995,261.00	22.97%

产品特有风险

本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。

在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

注：1.申购份额包含红利再投资份额。

2.份额占比为四舍五入后的结果。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2024 年 9 月 30 日，博时基金公司共管理

380 只公募基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金、职业年金及特定专户，管理资产总规模逾 15835 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金公募资产管理总规模逾 6105 亿元人民币，累计分红逾 2044 亿元人民币，是目前我国资产管理规模领先的基金公司之一。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准博时中证全球中国教育主题交易型开放式指数证券投资基金(QDII)设立的文件
- 2、《博时中证全球中国教育主题交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》
- 3、《博时中证全球中国教育主题交易型开放式指数证券投资基金(QDII)托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 5、博时中证全球中国教育主题交易型开放式指数证券投资基金(QDII)各年度审计报告正本
- 6、报告期内博时中证全球中国教育主题交易型开放式指数证券投资基金(QDII)在指定报刊上各项公告的原稿

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司
二〇二四年十月二十五日

