

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 年第 4 季度报告
2021 年 12 月 31 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：二〇二二年一月二十四日

§ 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2022年1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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年10月1日起至12月31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	1,322,713,920.00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

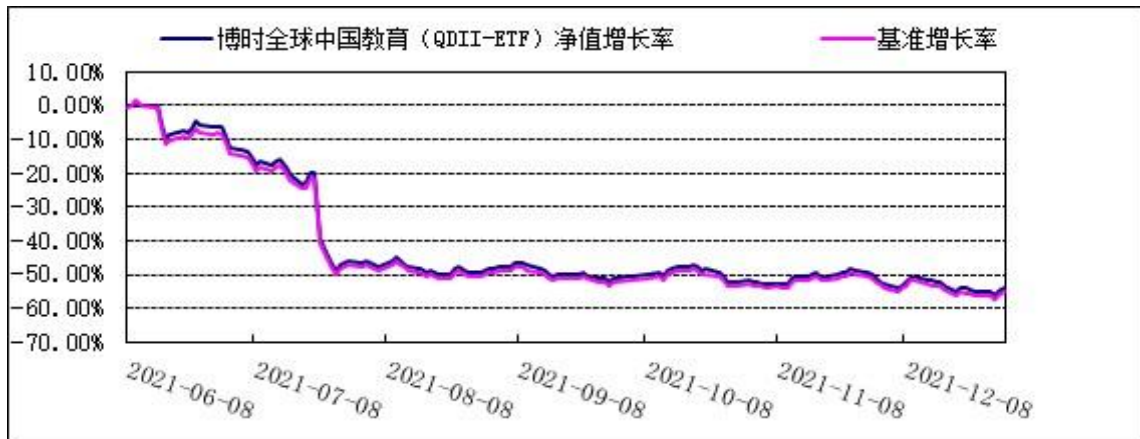
主要财务指标	报告期
	(2021年10月1日-2021年12月31日)
1.本期已实现收益	-9,578,393.25
2.本期利润	-12,403,228.18
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0150
4.期末基金资产净值	612,658,688.03
5.期末基金份额净值	0.4632

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	-5.00%	1.77%	-5.41%	1.76%	0.41%	0.01%
过去 六个月	-50.46%	3.02%	-50.91%	3.03%	0.45%	-0.01%
自基 金合同生 效起至今	-53.68%	2.92%	-55.02%	2.95%	1.34%	-0.03%

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



注：本基金的基金合同于2021年6月8日生效。按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同“投资范围”、“投资禁止行为与限制”章节的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§ 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	基金经理	2021-06-08	-	14.8	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)的基金经理。现任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—至今)、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—至今)、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—至今)、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—至今)、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—至今)、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 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)、博时创业板指数证券投资基金(2021 年 4 月 2 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(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)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，由于证券市场波动等原因，本基金曾出现个别投资监控指标超标的情况，基金管理人在规定期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

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7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

市场回顾:2021年四季度,欧美股市整体表现优异,标普500上涨10.65%,纳斯达克上涨8.28%,英国富时100上涨4.21%,法国CAC40上涨9.71%,德国DAX指数上涨4.09%。亚太股市则出现一定程度调整,日经225下跌2.24%,恒生指数下跌4.79%。A股主要指数普遍上涨,沪深300上涨1.52%,中证500上涨3.6%,创业板指上涨2.4%。展望2022年一季度,宏观上,Omicron高传播性叠加圣诞出行,海外新增病例急升,经济复苏担忧再起。考虑到疫苗接种率的提升,以及全球各国应对疫情积累了足够经验,我们认为疫情总体仍在可控范围内。海外流动性上,美联储Taper靴子落地,市场加息预期升温,美国货币政策预计逐步正常化。国内经济方面,稳增长政策发力、流动性改善等因素保障经济平稳发展。通胀方面,终端消费回暖、猪价周期性回升,中国CPI中枢逐步上移,但总体可控。同时,全球供需缺口收窄,中国PPI将步入回落周期。教育行业在2021年是受政策影响很大的行业,目前幼教,义务教育以及课外培训等板块利空政策相继出清,教育行业估值或已达到历史估值底部区间,叠加高职教/民办高等教育的利好政策,市场情绪逐渐修复。未来行业公司基于业绩、并购等体现基本面积积极变化的事件有望成为2022年板块股价上行的主要驱动力,行业总体估值有望持续修复。

截至2021年12月31日,本基金基金份额净值为0.4632元,份额累计净值为0.4632元。报告期内,本基金基金份额净值增长率为-5.00%,同期业绩基准增长率为-5.41%。

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	610,422,449.72	96.09
	其中:普通股	455,739,587.76	71.74
	存托凭证	154,682,861.96	24.35

	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	24,715,799.01	3.89
8	其他各项资产	136,476.68	0.02
9	合计	635,274,725.41	100.00

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	314,823,476.54	51.39
中国香港	140,916,111.22	23.00
美国	154,682,861.96	25.25
合计	610,422,449.72	99.64

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（%）
非日常生活消费品	353,315,511.23	57.67
信息技术	160,489,396.66	26.20
电信业务	57,082,234.61	9.32
公用事业	21,365,289.00	3.49
原材料	18,170,018.22	2.97
合计	610,422,449.72	99.64

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)	证券代 码	所在证 券市场	所属国 家(地)	数量 (股)	公允价值 (人民币元)	占基金 资产净
----	--------------	-------------	----------	------------	-------------	-----------	----------------	------------

		文)			区)			值比例 (%)
1	NEW ORIENTAL EDUCATION SP ADR	新东方	EDU US	美国 纽约	美国	6,431,151.00	86,106,487.80	14.05
2	OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY-A	中公教育科技股份有限公司	002607 SZ	深圳	中国 大陆	7,011,901.00	55,113,541.86	9.00
3	TAL EDUCATION GROUP-ADR	好未来	TAL US	美国 纽约	美国	1,954,982.00	48,985,008.44	8.00
4	CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	中教控股	839 HK	中国香 港证券 交易所	中国 香港	3,622,000.00	37,490,655.55	6.12
5	GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	广州视源电子科技股份有限公司	002841 SZ	深圳	中国 大陆	417,600.00	33,992,640.00	5.55
6	TALKWEB INFORMATION SYSTEM-A	拓维信息系统股份有限公司	002261 SZ	深圳	中国 大陆	3,775,800.00	31,150,350.00	5.08
7	IFLYTEK CO LTD - A	科大讯飞股份有限公司	002230 SZ	深圳	中国 大陆	574,800.00	30,182,748.00	4.93
8	NEWCAPEC ELECTRONICS CO LT-A	新开普	300248 SZ	深圳	中国 大陆	1,458,622.00	22,054,364.64	3.60
9	NETDRAGON WEBSOFT HOLDINGS L	网龙	777 HK	中国香 港证券 交易所	中国 香港	1,456,500.00	21,816,086.21	3.56
10	GUANGDONG MEIYAN JIXIANG H-A	广东梅雁吉祥水电股份	600868 SH	上海	中国 大陆	7,193,700.00	21,365,289.00	3.49

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衍生品投资。

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 本报告期内，本基金投资的前十名证券中除中公教育（002607）的发行主体外，没有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。

主要违规事实：2021年12月17日，因存在未及时披露公司重大事项，中国证券监督管理委员会对中公教育科技有限公司进行了立案调查。

对该证券投资决策程序的说明：根据我司的基金投资管理相关制度，以相应的研究报告为基础，结合其未来增长前景，由基金经理决定具体投资行为。

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	133,971.69
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,504.99
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	136,476.68

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	653,713,920.00
报告期期间基金总申购份额	679,500,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	10,500,000.00
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	1,322,713,920.00

§ 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	2021-11-25~ 2021-11-28	2,553,600.00	552,053,100.00	421,932,600.00	132,674,100.00	10.03%

产品特有风险

本报告期内，本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20% 的情况，当该基金份额持有人选择大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时，存在一定的流动性风险；为应对巨额赎回而进行投资标的变现时，可能存在仓位调整困难，甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金出现巨额赎回并被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险，未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。

本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20% 的情况，根据基金合同相关约定，该份额持有人可以独立向基金管理人申请召开基金份额持有人大会，并有权自行召集基金份额持有人大会。该基金份额持有人可以根据自身需要独立提出持有人大会议案并就相关事项进行表决。基金管理人会对该议案的合理性进行评估，充分向所有基金份额持有人揭示议案的相关风险。

在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

此外，当单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的 50% 或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50% 时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。

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 2021 年 12 月 31 日，博时基金公司共管理 311 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 16687 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 5366 亿元人民币，累计分红逾 1561 亿元人民币，是目前我国资产管理规模最大的基金公司之一。

其他大事件

2021 年 12 月 15 日，人民银行公示了 2020 年度金融科技发展奖获奖项目，博时基金“新一代投资决策支持系统”荣获二等奖。

2021 年 12 月 1 日，广东省人民政府官网发布《关于 2020 年广东金融创新奖评选结果的通报》，博时基金“新一代投资决策支持系统”荣获三等奖。

2021年11月20日，第五届中国海外基金金牛奖评选揭晓，博时基金海外全资子公司博时基金（国际）有限公司旗下的博时大中华债券基金凭借优异的业绩，荣膺“一年期金牛海外中国债券基金”奖。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

9.1.1 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

9.1.2 《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》

9.1.3 《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》

9.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

9.1.5 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
二〇二二年一月二十四日