信诚沪深300指数分级证券投资基金

【2015】年度报告摘要

基金管理人:信诚基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司

送出日期:2016年3月25日

§1重要提示

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。本年度报告已经三分之一以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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2016年3月24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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容应阅读年度报告正文。

本报告期自2015年1月1日起至12月31日止。

§2基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	信诚沪深300指数分级		
场内简称	信诚300		
基金主代码	165515		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012年2月1日		
基金管理人	信诚基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	1,775,790,895.02份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2012年2月17日		
下属分级基金的基金简称	信诚沪深300指数分级A	信诚沪深300指数分级B	信诚沪深300指数分级
下属分级基金的场内简称	沪深300A	沪深300B	信诚300
下属分级基金的交易代码	150051	150052	165515
报告期末下属分级基金的份额总额	826,378,496.00份	826,378,497.00份	123,033,902.02份

2.2基金产品说明

投资目标	本基金力争通过对沪深300指数的跟踪复制,为投资人提供一个投资沪深300指数的有效工具。
投资策略	本基金采用完全复制法跟踪指数,即按照沪深300指数中成份股组成及在权重构建股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整,力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。 基金管理人可运用股指期货,以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。此外,本基金还将运用股指期货来对冲转换情况下的流动性风险以进行有效的现金管理,以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。
业绩比较基准	95%×沪深300指数收益率+5%×金融同业存款利率
风险收益特征	本基金为跟踪指数的股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征。其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额来看,信诚沪深300A份额具有较风险、收益相对稳定的特征,信诚沪深300B份额具有高风险、高预期收益的特征。
下属分级基金的风险收益特征	信诚沪深300指数分级A份额具有较低风险、收益相对稳定的特征 / 信诚沪深300指数分级B份额具有高风险、高预期收益的特征 / 本基金为跟踪指数的股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征。其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金

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		信诚基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周浩	田青
	联系电话	021-68649788	010-67596096
	电子邮箱	haozhou@citicpru.com.cn	tianqing1.zb@ccb.com
客户服务电话		400-666-0066	010-67596006
传真		021-50120888	010-66275853

2.4信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.xcfunda.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§3主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015年	2014年	2013年
本期已实现收益	-23,232,209.17	60,080,318.94	7,044,099.51
本期利润	-294,006,900.94	298,912,437.46	-28,892,903.46
加权平均基金份额本期利润	-0.2465	0.3327	-0.0870
本期基金份额净值增长率	0.63%	44.94%	-6.37%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	0.0510	0.0476	-0.0898
期末基金资产净值	1,379,463,119.68	902,829,262.71	595,630,901.69
期末基金份额净值	0.777	1.215	0.861

注:1.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。

2.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求降相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.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。

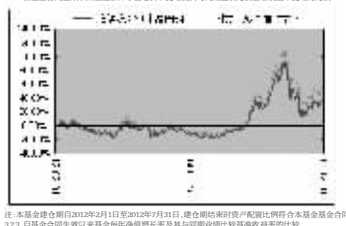
3.2基金净值表现

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	份额净值增长率①1	份额净值增长率标准差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	14.90%	1.53%	15.66%	1.59%	-0.76%	-0.06%
过去六个月	-17.06%	2.56%	-15.63%	2.54%	-1.43%	0.01%
过去一年	0.63%	2.36%	5.72%	2.36%	-5.09%	0.00%
过去三年	365.7%	1.71%	45.99%	1.70%	-9.42%	0.01%
自基金合同生效起至今	33.43%	1.59%	49.46%	1.58%	-16.03%	0.01%

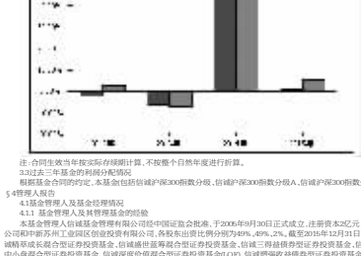
注:本基金的业绩比较标准为95%×沪深300指数收益率+5%×金融同业存款利率。

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



注:本基金建仓期自2012年2月1日至2012年7月31日,建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3过去三年基金的利润分配情况

根据基金合同的约定,本基金包括信诚沪深300指数分级、信诚沪深300指数分级A、信诚沪深300指数分级B三个份额,其中信诚沪深300指数分级份额不进行收益分配。

§4管理人报告

4.1基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人信诚基金管理有限公司经中国证监会批准,于2006年6月30日正式成立,注册资本2亿元,注册地为上海。公司股东为中信信托有限责任公司,英国保诚集团投份有限公司和印新苏州工业园区创业投资有限公司,各股东出资比例分别为49%、49%、2%。截至2015年12月31日,本基金管理人共管理38只基金,分别为信诚四季红混合型证券投资基金、信诚精萃成长混合型证券投资基金、信诚盛世蓝筹混合型证券投资基金、信诚三得益债券型证券投资基金、信诚货币基金、信诚优质债券型证券投资基金、信诚优胜精选混合型证券投资基金、信诚中小盘混合型证券投资基金、信诚深证价值混合型证券投资基金LOF)、信诚增强收益债券型证券投资基金LOF)、信诚全球资本市场股票型证券投资基金LOF)、信诚中证500指数分级证券投资基金、信诚货币市场证券投资基金、信诚新机遇混合型证券投资基金、信诚新兴产业混合型证券投资基金、信诚中证800指数证券投资基金、信诚季季红债券型证券投资基金、信诚双赢分级债券型证券投资基金、信诚新兴产业混合型证券投资基金、信诚中证800医药指数分级证券投资基金、信诚中证800有色指数分级证券投资基金、信诚季季红债券型证券投资基金、信诚年年有余定期开放债券型证券投资基金、信诚中证800金融指数分级证券投资基金、信诚月月红债券型证券投资基金、信诚双赢债券型证券投资基金、信诚新动力混合型证券投资基金、信诚中证800证券指数分级证券投资基金、信诚月月定期支付债券型证券投资基金、信诚双赢债券型证券投资基金、信诚新兴产业混合型证券投资基金、信诚中证800有色指数分级证券投资基金、信诚季季红债券型证券投资基金、信诚季季红债券型证券投资基金、信诚年年有余定期开放债券型证券投资基金、信诚中证800金融指数分级证券投资基金、信诚月月定期支付债券型证券投资基金、信诚双赢债券型证券投资基金、信诚新动力混合型证券投资基金、信诚中证800证券指数分级证券投资基金、信诚月月定期支付债券型证券投资基金、信诚中证智能家居指数分级证券投资基金和信诚中证基建工程指数分级证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理助理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨旭	本基金基金经理、属任信诚中证500指数分级基金、信诚中证800医药指数分级基金、信诚中证800有色指数分级基金、信诚中证800金融指数分级基金及信诚中证TMT产业主题指数分级基金、信诚中证500医药指数分级基金、信诚中证800医药指数分级基金、信诚中证800有色指数分级基金、信诚中证800金融指数分级基金、信诚中证TMT产业主题指数分级基金、信诚中证信息安全指数分级基金、信诚新兴产业混合型证券投资基金、信诚新动力混合型证券投资基金、信诚新兴产业混合型证券投资基金、信诚新动力混合型证券投资基金、信诚中证基建工程指数分级基金的基金经理	2015年1月15日	-	3	数学金融硕士,运筹管理学硕士,组约大学化学硕士。曾担任美国对冲基金Robust methods分司数量分析师,华宝证券研究部金融工程分析师,信诚基金管理有限公司量化投资部总监。2012年9月加入信诚基金,曾分别担任债券投资经理,股票投资经理,投任信诚中证500指数分级基金、信诚沪深300指数分级基金、信诚中证800医药指数分级基金、信诚中证800有色指数分级基金、信诚中证800金融指数分级基金、信诚中证TMT产业主题指数分级基金、信诚中证信息安全指数分级基金、信诚新动力混合型证券投资基金、信诚新兴产业混合型证券投资基金的基金经理。
吴鹰楠	本基金基金经理、属任信诚中证500指数分级基金、信诚中证800医药指数分级基金、信诚中证800有色指数分级基金、信诚中证800金融指数分级基金及信诚中证TMT产业主题指数分级证券投资基金的基金经理,信诚基金管理有限公司投资管理部量化投资组合	2012年2月1日	2015年3月27日	18	统计物理学博士,CFA,18年证券,基金从业经验。拥有丰富的量化投资和指数基金管理经验。曾任职于加拿大Geophysical Research Corporation公司和加拿大证券投资管理公司(TD Asset Management)。

注:1.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。

2.证券从业年限是按照证券业从业人员资格管理的规则执行,制度适用公司管理所有投资组合(包括公募基金,特定客户资产管理组合),对应的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动。

在实际的公司管理实践中,公司在公平交易制度的指引下采用事前、事中、事后的全流程控制方法。事前管理主要包括:已搭建了合理的资产管理业务之间及资产管理业务内的组织架构,赋予合理的权限,设立的关键人员资格管理,设立的关键岗位,建立内部控制制度,制定业务操作流程,设置信息墙,确保机构独立;事中管理主要包括:公司管理的不同投资组合均实行集中交易制度,确保一般情况下不同投资组合同向买卖同一证券时期望过程的交易公平性进行自动化处理,按照时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量;同时原则上禁止同日反向交易,如因流动性等问题需要反向交易须经过严格审批和留档。一般市场,非集中竞价市场等的投资同期要经过合理调价,速度平均公平分配,原则上要求同一证券的交易价格在当日内保持一致,以保证公平性。公司管理人设置了公司层面的风控委员会,对公司管理的不同投资组合的风险收益特性,改善组合的风险收益特性。此外,本基金还将运用股指期货来对冲转换情况下的流动性风险以进行有效的现金管理,以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。

§5管理人报告

5.1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,本基金管理人在投资决策、风控管理等方面,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。

本报告期,本基金管理人在投资决策、风控管理等方面,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。

5.2管理人对报告期内本基金投资策略和业绩表现的说明

本报告期,本基金管理人在投资决策、风控管理等方面,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。

5.3管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

5.3.1公平交易制度的执行情况

本报告期,本基金管理人在投资决策、风控管理等方面,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。

5.3.2异常交易的专项说明

本报告期,本基金管理人在投资决策、风控管理等方面,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。

5.4管理人对报告期内内部审计工作的说明

本报告期,本基金管理人在投资决策、风控管理等方面,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。

5.5管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期,本基金管理人在投资决策、风控管理等方面,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。

5.6管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期,本基金管理人在投资决策、风控管理等方面,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。

5.7管理人对报告期内基金投资收益分配情况的说明

本报告期,本基金管理人在投资决策、风控管理等方面,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。

§6托管人报告

6.1报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

6.2托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

根据本基金合同的约定,本基金不进行收益分配。

6.3托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核本度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。

§7审计报告

7.1审计意见表

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第1600075号

7.2审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	信诚沪深300指数分级证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的第1页至第30页的信诚沪深300指数分级证券投资基金(以下简称"信诚沪深300基金")财务报表,包括2015年12月31日的资产负债表、2015年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是信诚沪深300基金管理人信诚基金管理有限公司管理层的责任,这种责任包括:(1)按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价信诚基金管理有限公司管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。 我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为,信诚沪深300基金财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则和在财务报表附注六中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制,公允反映了信诚沪深300基金2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果及基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	莫小明 / 查希菁
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	北京市东长安街1号东方广场东二办公楼八层
审计报告日期	2016年3月24日

§7年度财务报表

7.1资产负债表

会计主体:信诚沪深300指数分级证券投资基金
报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资产:			
银行存款		164,565,677.70	1,233,009.73
结算备付金		8,416,238.14	8,228,134.86
存出保证金		4,675,486.20	261,723.38
交易性金融资产		1,175,050,041.21	862,716,675.11
其中:股票投资		1,174,614,823.61	817,799,401.22
基金投资		-	-
债券投资		435,217.60	44,917,273.89
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	4,683,830.33
应收利息		27,335.48	1,091,170.32
应收股利		-	-
应收申购款		29,697,798.76	50,268,940.29
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,382,322,617.49	928,483,482.02
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		106,694.32	23,374,779.13
应付管理人报酬		989,025.49	743,560.53
应付托管费		217,585.60	163,581.11
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		997,796.83	711,619.52
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		548,395.57	660,689.02
负债合计		2,859,497.81	25,654,219.31
所有者权益:			
实收基金		1,033,979,931.28	680,948,821.13
未分配利润		348,483,188.40	221,880,441.58
所有者权益合计		1,379,463,119.68	902,829,262.71
负债和所有者权益总计		1,382,322,617.49	928,483,482.02

注:截止本报告期末,基金份额总额1,775,790,895.02份。信诚沪深300指数分级的基金份额净值0.777元,基金份额总额123,033,902.02份。下属两级基金:信诚沪深300指数分级A的基金份额净值1.000元,基金份额总额826,378,496.00份;信诚沪深300指数分级B的基金份额净值0.552元,基金份额总额826,378,497.00份。

7.2利润表

会计主体:信诚沪深300指数分级证券投资基金
本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入		-266,355,784.33	313,610,528.00
1.利息收入		1,753,205.93	2,040,813.75
其中:存款利息收入		615,091.38	102,841.11
债券利息收入		1,138,114.55	1,926,430.17
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	9,542.47
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-2,840,706.22	71,401,638.66
其中:股票投资收益		-29,383,140.69	50,701,984.21
基金投资收益		-	-
债券投资收益		2,147,398.13	419,167.67
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-1,343,400.00	-2,461,860.00
股利收益		25,738,436.34	22,742,236.78
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-270,774,691.77	238,832,118.52
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		5,506,407.73	1,336,057.07
减:二、费用		27,651,116.61	14,698,090.54
1. 管理人报酬		10,827,905.79	7,643,042.10
2. 托管费		2,382,139.26	1,681,469.20
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		13,709,594.26	4,615,437.78
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		731,477.32	698,141.46
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-294,006,900.94	298,912,437.46
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-294,006,900.94	298,912,437.46

7.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:信诚沪深300指数分级证券投资基金
本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	680,948,821.13	221,880,441.58	902,829,262.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-294,006,900.94	-294,006,900.94
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	353,031,110.15	417,609,647.76	770,640,757.91
其中:1.基金申购款	3,276,630,553.85	1,888,047,964.32	5,164,578,518.17
2.基金赎回款	-2,923,599,443.70	-1,470,438,316.56	-4,394,037,760.26
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,033,979,931.28	345,483,188.40	1,379,463,119.68

项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	651,521,821.01	-55,890,919.32	595,630,901.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	298,912,437.46	298,912,437.46
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	29,427,000.12	-21,141,076.56	8,285,923.56
其中:1.基金申购款	1,136,846,615.90	-44,542,801.91	1,092,303,813.99
2.基金赎回款	-1,107,419,615.78	23,401,725.35	-1,084,017,890.43
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	680,948,821.13	221,880,441.58	902,829,262.71

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1 至 7.4财务报表由下列负责人签署:

吕俊	陈晓华	时慧
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4报表附注

7.4.1 基金基本情况

信诚沪深300指数分级证券投资基金(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")关于核准信诚沪深300指数分级证券投资基金募集的批复[证监许可[2011]1472号文]和《关于信诚沪深300指数分级证券投资基金备案确认的函[基金部函[2012]42号文]批准,由信诚基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《信诚沪深300指数分级证券投资基金合同》发售,基金合同于2012年2月1日正式生效,本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金为股票型证券投资基金,其业绩比较基准为95%×沪深300指数收益率+5%×金融同业存款利率。本基金于2014年12月21日至2015年1月16日募集,募集期间共募集了有效认购资金人民币1,033,149,821.01元,其中:本基金于2014年12月21日募集了有效认购资金人民币1,033,149,821.01元,共计认购了人民币1,033,149,821.01元的基金份额,其中:信诚沪深300指数分级证券投资基金募集的份额为:信诚沪深300指数分级A份额826,378,496.00份,信诚沪深300指数分级B份额826,378,497.00份,合计1,652,756,993.00份