

中信华夏股票质押债权一期资产支持专项计划成立公告

根据上海证券交易所于 2015 年 6 月 20 日出具的《关于对中信华夏股票质押债权一期资产支持证券挂牌转让无异议的函》（上证函[2015]976 号），华夏资本管理有限公司（作为管理人）委托销售机构中信证券股份有限公司向潜在合格投资者推广中信华夏股票质押债权一期资产支持专项计划（简称“专项计划”），发售中信华夏股票质押债权一期资产支持证券（简称“资产支持证券”）。

经致同会计师事务所验资，专项计划实际收到的优先级资产支持证券 01 的认购款 10 亿元，优先级资产支持证券 02 的认购款 5 亿元，优先级资产支持证券 03 的认购款 5.5 亿元，次级资产支持证券的认购款 0.95 亿元，并已经满足《中信华夏股票质押债权一期资产支持专项计划计划说明书》及《中信华夏股票质押债权一期资产支持专项计划标准条款》约定的专项计划设立条件，管理人宣布 2015 年 7 月 6 日为专项计划设立日。

一、专项计划基本情况

产品序列	预期到期日	预期收益率	发行规模 (亿元)	面值 (元)
优先级资产支持证券 01	2016 年 3 月最后一日 以后的第 14 个工作日	4.70%	10.00	100
优先级资产支持证券 02	2017 年 3 月最后一日 以后的第 14 个工作日	5.05%	5.00	100
优先级资产支持证券 03	2018 年 3 月最后一日 以后的第 14 个工作日	5.20%	5.50	100
次级资产支持证券	2018 年 3 月最后一日 以后的第 14 个工作日	不设	0.95	100

信用评级	中诚信证券评估有限公司给予优先级资产支持证券 01 的初始评级为 AAA 级，给予优先级资产支持证券 02 的初始评级为 AAA 级，给予优先级资产支持证券 03 的初始评级为 AAA 级；次级资产支持证券未评级。
推广对象	由合格机构投资者认购，优先级资产支持证券 01 最低认购金额 100 万元；优先级资产支持证券 02 最低认购金额 100 万元；优先级资产支持证券 03 最低认购金额 100 万元；次级资产支持证券由原始权益人全额认购。
托管机构	中信证券股份有限公司
监管银行	中信银行股份有限公司总行营业部
登记机构	中国证券登记结算有限公司上海分公司
流动性安排	通过上海证券交易所综合协议交易平台转让

特此公告。



华夏资本管理有限公司

二〇一五年七月六日