

关于首创证券创赢优势策略精选 20 号集合资产管理计划 第三个运作周期投资于场外金融衍生品的公告

尊敬的委托人：

您认/申购的“首创证券创赢优势策略精选 20 号集合资产管理计划”于 2024 年 9 月 2 日与国信证券股份有限公司签订《场外期权交易确认书》，期权交易情况如下：

一、 期权交易基本情况

1. 期初观察日：2024 年 9 月 2 日
2. 期末观察日：2025 年 8 月 18 日
3. 挂钩标的：中证 500 指数（代码：000905.SH）
4. 期权结构：看涨鲨鱼鳍
5. 行权方式：美式
6. 期初价格：挂钩标的在期初观察日的收盘价格，即 4546.88
7. 行权价格：期初价格的 102%，即 4637.82
8. 障碍价格：期初价格的 117%，即 5319.85
9. 期末价格：挂钩标的在期末观察日的收盘价格

二、 挂钩标的的风险

资产管理人特别揭示挂钩标的的风险如下：挂钩标的的波动将影响委托人所获得的挂钩收益。一方面，挂钩标的并不能完全代表整个股票市场，挂钩标的的回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离；另一方面，挂钩标的的成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动，进而导致指数波动，直接影响挂钩标的的表现。

首创证券股份有限公司

2024 年 9 月 3 日