

关于首创证券创赢优势策略精选3号集合资产管理计划投资于场外金融衍生品的公告

尊敬的委托人：

您认购的“首创证券创赢优势策略精选3号集合资产管理计划”于【2020】年【04】月【21】日与申万宏源证券有限公司签订《中国证券期货市场场外衍生品交易主协议》及其《补充协议》以及于【2020】年【04】月【23】日签订的《场外衍生品交易确认书》，期权交易情况如下：

一、 期权交易基本情况

- 1) 起始日：【2020年04月23日】
- 2) 行权日：【2020年10月19日】
- 3) 到期日：【2020年10月20日】
- 4) 挂钩标的：中证500指数（代码：000905.SH）
- 5) 交易日：《上海证券交易所交易规则》规定的交易日
- 6) 期初价格：挂钩标的在起始日的收盘价【5357.79】
- 7) 结算价格：行权日当日的标的收盘价（点）
- 8) 行权价格：期初价格 $S_0 \times 103\%$

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。挂钩标的成份股的平均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。

