

关于首创证券创赢优势策略精选 11 号集合资产管理计划 第一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 11 号集合资产管理计划”于 2022 年 2 月 11 日与华泰证券股份有限公司签订《华泰证券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. 期初观察日：2022 年 2 月 11 日
2. 期末观察日：2022 年 11 月 9 日
3. 挂钩标的：沪深 300 指数（代码：000300.SH）
4. 期权观察日：期末观察日
5. 原定交易日：交易所就标的证券正常交易的日期
6. 期初价格：挂钩标的在期初观察日的收盘价格，即 4601.40
7. 障碍价格：期初价格的 112%，即 5153.57
8. 期末参考价：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

2022 年 2 月 11 日