

# 第一创业信壹1号集合资产管理计划拟投资 场外衍生品的提示公告

尊敬的投资者：

根据《第一创业信壹1号集合资产管理计划资产管理合同》约定，本计划未投资场外期权期间，每周一、三、四为开放期，投资者可办理参与和/或退出业务（如遇非工作日不开放、不顺延）。本计划每次公告拟开始投资场外期权后，本计划开始封闭运作，每个封闭期不少于3个月且场外期权合约存续期间不设开放期。具体开放期安排以管理人公告为准。

本集合计划拟于近期投资场外衍生品，拟投交易要素如下表（实际投资情况以管理人的后续公告为准）：

拟投资的期权类型	欧式看涨期权
标的资产	国泰海通大类资产全天候增强指数
起始日	2026/5/22
投资期限	拟【10】个月（实际以管理人公告为准）
期初价格	具体以管理人公告为准
行权结算价格	由标的资产点数发布机构在万得终端公布的标的资产在到期日当日的点数。标的资产点数四舍五入保留两位小数。 为免疑义，标的资产在到期日当日的点数会于到期日后的下一指数计算日公布。指数计算日是指，本确认书附件一中定义的指数计算日。 具体以管理人公告为准。
行权价格	100%*期初价格

期权费	名义本金×期权费率×参与率 期权费金额四舍五入保留两位小数
期权费率	具体以管理人公告为准
参与率	具体以管理人公告为准
行权日	2027/4/1
终止日	2027/4/1
行权通知方式	默认自动行权：交易双方同意并认可，本交易项下视为期权买方在到期日的下一个指数计算日标的资产点数发布机构公布行权结算价格的时间行权，无须特别提示行权，也不涉及在其他时间主动行权等安排。
<p><b>重要提示：</b></p> <p>1、管理人将在本计划完成场外衍生品交易后，发布投资场外衍生品情况公告，披露相关具体交易要素。本公告中，本产品拟投资衍生品相关情况不构成管理人的承诺，请以届时实际投资情况为准。</p> <p>2、特殊风险揭示：</p> <p>(1) 时间价值衰减风险：看涨期权的时间价值会随着到期日临近而加速衰减。即使标的资产价格小幅上涨，若涨幅不足以覆盖时间价值的损耗，买方仍可能亏损；</p> <p>(2) 行权价格设定不当风险：行权结算收益的计算方式为“名义本金×参与率×Max((行权结算价格-行权价格)/期初价格, 0)”，若行权价格设定过高，标的资产需大幅上涨才能盈利；</p> <p>(3) 流动性风险：若底层期权合约交易量低，可能面临难以平仓或价格折价的风险。</p> <p>上述风险揭示仅为针对此次拟投期权结构特点进行的特别补充，无法涵盖本产品投资场外期权交易所面临的的全部风险和可能导致投资者资产损失的全部情形。</p>	

鉴于本计划此前的投资安排，根据《第一创业信壹1号集合资产管理计划资产管理合同》，本计划自2026年5月15日起已经封闭运作，不办理参与、退出业务。本计划管理人将结合场外衍生品实际投

资情况，确定后续开放期，具体以管理人后续公告为准。

特此公告

第一创业证券股份有限公司

二〇二六年五月二十一日