

# 투자설명서

2025년 01월 06일

(발행회사명)  
키움증권 주식회사

(증권의 종목과 발행증권수)

키움증권 제570회 키움드림공모파생결합사채(주가연계파생결합사채) / 5,000,000증권

(모집 또는 매출 총액)  
50,000,000,000 원

- 증권신고의 효력발생일 : 2025년 01월 06일
- 모집가액 : 50,000,000,000 원
- 청약기간 : 2025.01.24 (13:00) ~ 2025.01.24 (16:00)
- 납입기일 : 2025. 01. 24
- 증권신고서 및 투자설명서의 열람장소
  - 증권신고서 : 전자문서 : 금융위(금감원) 전자공시시스템 → <http://dart.fss.or.kr>
  - 일괄신고 추가서류 : 전자문서 : 금융위(금감원) 전자공시시스템 → <http://dart.fss.or.kr>

6. 안정조작 또는 시장조성에 관한 사항

-

이 투자설명서에 대한 증권신고의 효력발생은 정부가 증권신고서의 기재

사항이 진실 또는 정확하다는 것을 인정하거나 이 증권의 가치를 보증 또는 승인한 것이 아니며, 이 투자설명서의 기재사항은 청약일 전에 정정될 수 있음을 유의하시기 바랍니다.

( 대 표 주 관 회 사 명 )  
키움증권 주식회사

### [ 투자결정시 유의사항 ]

본 문서는 법령 및 내부통제기준에 따른 절차를 거쳐 제공됩니다.

1. 투자판단시 **일괄신고서, 일괄신고추가서류, 투자설명서 및 간이투자설명서**를 반드시 참고하시기 바랍니다.
2. 금융투자상품의 특성상 **투자원금의 손실**이 있을 수 있으며 **예금자 보호대상이 아닌 점**을 숙지하고 투자하시기 바랍니다.
3. 미리 정한 조건을 충족하지 못하는 경우 **약정 수익을 받지 못하거나** 상품에 따라서는 **원금손실이 발생**될 수 있는 **복잡한 구조**이므로 **관련 투자 위험요소**를 충분히 이해하고 투자하시기 바랍니다.
4. 기초자산의 가격에 연계하여 증권의 수익률이 결정되므로 투자결정시 **기초자산의 성격 및 과거 가격 추이, 기초자산 관련 경영 환경 변화 등에 따른 권리변경 가능성** 등을 충분히 감안하시기 바랍니다. 기초자산이 신용위험인 경우 신용사건 발생여부에 따라 수익률이 결정되므로 신용사건 발생에 영향을 미칠 수 있는 다양한 요소를 숙지하고 투자하여야 합니다.
5. 발행인의 신용상태에 따라 투자원금이 보호되지 않을 수 있는 신용위험이 있으므로 **발행인의 재무현황 및 신용등급(키움증권, 발행사 신용등급 AA-, 2024년 06월 21일 한국기업평가, 202**

4년 06월 21일 한국신용평가, 2024년 06월 21일 NICE신용평가) 등을 파악하고 투자결정을 하시기 바랍니다.

6. 투자금은 법적으로 **별도 예치의무가 없기 때문에 발행인의 고유재산과 분리되어 보호되지 않는다는 점**을 충분히 이해하고 투자하여야 합니다.

7. 동 파생결합사채의 투자금은 금융위원회의 퇴직연금감독규정[시행 2023. 11. 16] [금융위원회고시 제2023-56호, 2023. 11. 16., 일부개정]을 준수하여 운용되며, 동 규정의 제8조의2 제2항에 따라 **발행인의 파생결합증권 및 다음 각 목의 어느 하나라도 충족하지 못하는 사채와 각각 계정분리 등의 형태로 독립성을 갖춘다는 점**을 확인하시기 바랍니다.

가. 상환금액이 원금 이외의 수익을 보장할 것

나. 중도해지시에도 원금의 손실이 발생하지 않을 것

다. 「자본시장법」 제9조제7항에 따른 "모집"이나 제9항에 따른 "매출"의 방법(이하 "공모"라 한다)으로 발행되고 복수의 신용평가기관으로부터 투자적격 신용평가등급을 받을 것

8. 동 파생결합사채는 금융위원회의 퇴직연금감독규정[시행 2023. 11. 16][금융위원회고시 제2023-56호, 2023. 11. 16., 일부개정]을 준수하며, 동 규정의 제8조의2 제2항 제나목에 따라 **발행인에게 중도상환 요청 시, 원금의 손실이 발생하지 않음**을 확인하시기 바랍니다.

9. 동 파생결합사채는 **기초자산의 안전성과 원금상환여부는 아무런 관련이 없으며, 원금상환여부는 발행인의 지급여력에 따라 결정된다**는 점을 충분히 이해하고 투자하여야 합니다.

10. **(자료열람요구권)** 금융소비자는 분쟁 조정 또는 소송의 수행 등 권리 구제를 위한 목적으로 금융투자상품 판매업자 등이 기록 및 유지·관리하는 자료의 열람(사본의 제공 또는 청취를 포함)을 요구할 수 있습니다. 회사는 금융소비자로부터 분쟁 조정 신청 또는 소송 제기 등의 목적 및 열람의 범위가 기재된 열람 요구서를 제출받아 자료 열람의 요

구를 받은 경우 그 요구받은 날부터 6영업일 이내에 해당 자료를 열람할 수 있도록 해야 합니다. 회사는 법령, 다른 사람의 생명·신체를 해칠 우려가 있거나 다른 사람의 재산과 그 밖의 이익을 부당하게 침해할 우려가 있는 경우, 회사의 영업 비밀이 현격히 침해되는 등 열람하기 부적절한 경우 금융소비자에게 그 사유를 알리고 열람을 제한하거나 거절할 수 있습니다.

11. **(위법계약해지권)** 금융소비자는 「금융소비자 보호에 관한 법률」 제47조 및 관련 규정이 정하는 바에 따라 금융상품판매업자등이 적합성·적정성 원칙, 설명의무, 불공정영업행위, 부당권유행위 금지를 위반하여 계약을 체결하는 경우 금융소비자는 위법사실을 안 날로부터 1년, 계약 체결일로부터 5년 이내에 서면 등으로 계약의 해지를 요구할 수 있습니다. 금융상품판매업자등은 해지를 요구받은 날부터 10일 이내에 금융소비자에게 수락여부를 통지하여야 하며, 거절할 때에는 거절사유를 함께 통지하여야 합니다.

12. **(민원·상담·분쟁조정 연락처)** 당사 인터넷 홈페이지(<http://www.kiwoom.com>) 또는 키움금융센터(1544-9000)로 문의하시기 바랍니다. 분쟁이 발생한 경우에는 금융감독원 e-금융민원센터(<http://www.fcsc.kr>) 또는 대표번호(국번 없이 ☎1332) 등에 도움을 요청하실 수 있습니다.

## 【 본 문 】

### 모집 또는 매출에 관한 사항의 요약

키움증권 제570회 키움드림공모파생결합사채 (주가연계파생결합사채) (

5등급, 낮은위험)

(단위 : 원, 주)

증권의 종류	회 차	모집총액	기초자산	발행가액
주가연계파생결합사채	ELB DREAM 570	50,000,000,000	삼성전자 보통주	10,000

행사가격	행사기간	옵션종류	전환비율	만기일
-	-	-	-	2026.01.23

청약기일	납입기일	청약공고일	배정공고일	배정기준일
2025.01.24	2025.01.24	2025.01.06	2025.01.24	2025.01.24

인수인		증권의 종류	인수수량	인수금액	인수대가	인수방법
대표	-	주가연계파생결합사채	-	-	-	-
공동	-	주가연계파생결합사채	-	-	-	-

매출인에 관한 사항				
보유자	회사와의 관계	매출전 보유증권수	매출증권수	매출후 보유증권수
-	-	-	-	-
-	-	-	-	-

【기 타】	-
-------	---

## [ 모집 또는 매출의 개요 ]

[종목명: **키움증권 제570회 키움드림공모파생결합사채(주가연계파생결합사채)**(5등급, 낮은위험)]

- 본 증권은 키움증권의 신용으로 발행되는 증권이므로 원금상환과 수익지급에 대하여는 키움증권이 전적으로 책임을 지며, 키움증권의 파산, 회생절차 개시, 기초자산의 거래정지 또는 기타 천재지변 및 이에 준하는 사유에 해당될 경우 고객의 의사와 상관없이 중도에 상환될 수 있으며, 이 경우 **원금손실이 발생할 수 있습니다.**

- 본 증권은 **예금자보호법에 따라 보호되지 않습니다.**

※ 상품가입 후 의문사항 또는 불만(민원)이 있을 경우 **키움증권 키움금융센터(1544-9000)**, **민원부서(02-785-7424)** 또는 **인터넷 홈페이지(<http://www.kiwoom.com>)**에 문의할 수 있고, 분쟁이 발생한 경우에는 **금융감독원(국번없이 1332)** 등의 도움을 요청할 수 있습니다.

### ※ 금융투자상품 위험도 분류기준

구 분	1등급 매우 높은 위험	2등급 높은 위험	3등급 다소 높은 위험	4등급 보통 위험	5등급 낮은 위험	6등급 매우 낮은 위험
파생결합증권(사채) ELS ELB	원화로 거래하는 중 목형 원금비보장형 ELS	원화로 거래하는 지 수형 원금비보장형 ELS	원화로 거래하는 E LS 중 원금부분지 급형(80% 이상 90 % 미만 지급)	원화로 거래하는 EL S 중 원금부분지급 형(90% 이상 지급)	원화로 거래하는 원 금지급형 ELB	-
파생결합증권(사채) DLS, DLB	-	원화로 거래하는 원 금비보장형 DLS	원화로 거래하는 D LS 중 원금부분지 급형(80% 이상 90 % 미만 지급)	원화로 거래하는 DL S 중 원금부분지급 형 (90% 이상 지급)	원화로 거래하는 원 금지급형 DLB	-

\*[파생결합증권 평가 세부기준] : 최대원금손실 가능금액이 20%를 초과하는 경우 원칙적으로 2등급을 부여함

다음 어느 하나 해당 시 1개 등급 상향된 위험등급을 따름

- 외화상품 여부: 외화로 거래되는 경우
- 기초자산의 개수: 기초자산의 수가 3개 초과 시
- 기초자산의 종류: 특수한 형태로 기초자산에 연계되어 상품구조에 대한 투자자의 이해가능성이 낮은

경우

(당사 홈페이지 'ELS 기초자산정보'에서 정의, 일간 증가데이터와 차트를 제공할 수 없는 기초자산에 연계하여 처음 판매하는 구조의 상품을 만들어 판매하는 경우 등)

- 기초자산 가격의 변동성 : ELS, DLS의 기초자산 중 하나라도 개별주식 종목의 주가인 경우
- 원금손실조건: ELS, DLS의 낙인배리어가 60% 이상일 경우 및 노낙인형 상품의 만기배리어가 70% 이상인 경우
- 레버리지 여부: 손실발생구간의 손실배수가 기초자산 변동률의 1배를 초과 시

### ※ 유동성 위험에 관한 사항

구 분	중도환매불가	중도환매 시 비용발생	중도환매 가능
해당여부			√

- 투자자의 요청에 의한 증권의 일부 또는 전부에 대하여 중도상환을 청구 할 수 있습니다. 중도상환시 중도상환 신청일이 본 증권의 발행일 이후 만기일 미만인 경우 연 3.370%에서 연 1.00%를 차감한 금리를 기준으로, 액면금액과 발행일부터 중도상환 지급일까지 일할 계산한 수익금액을 합산한 금액을 지급합니다. 단, 근로자퇴직급여보장법에서 정하는 퇴직사유 등의 특별중도해지의 경우 중도환매금액은 액면금액과 함께 연 3.370%를 기준으로 경과일수로 계산된 수익금액을 지급합니다.

## I. 모집 또는 매출에 관한 일반사항

### 1. 공모개요

#### (1) 용어의 정의

1) 거래소	각 기초자산과 관련된 아래 각 거래소 - 삼성전자 보통주 : 한국거래소 또는 그 승계기관
2) 관련 거래소	각 기초자산과 관련된 선물·옵션 등이 거래되는 아래 각 거래소 - 삼성전자 보통주 : 한국거래소 또는 그 승계기관
3) 예정거래일	거래소 및 관련 거래소가 정규거래시간 동안 개장하기로 예정된 날
4) 거래소영업일	거래소 및 관련 거래소가 정규거래시간 개장하여 거래소가 모두 공식적으로 해당일의 종가를 발표한 날
5) 영업일	공휴일이 아닌 날로서 대한민국의 시중 은행들이 정상적으로 영업을 하는 날

6) 기초자산 산출기관	기초자산 가격을 산출하는 아래 각 기관 - 삼성전자 보통주: 한국거래소
7) 계산대리인	발행인인 키움증권 주식회사
8) 교란일	예정거래일 중 거래소 또는 관련 거래소가 개장하지 못하거나 시장교란사유가 발생한 날
9) 시장교란사유	<p>(ㄱ) 거래 장애(Trading Disruption): 정규거래시간 종료시간 직전 1시간 동안에 거래소 또는 관련 거래소에서 기초자산(기초자산이 지수인 경우에는 지수의 20% 이상을 구성하는 증권)의 거래가 중단 또는 중지되거나(상·하한가 기타 이에 준하는 사유를 포함), 기초자산과 관련된 선물 또는 옵션 등의 거래가 중단 또는 중지되는 경우로서 발행인이 중요하다고 판단하는 경우</p> <p>(ㄴ) 거래소 장애(Exchange Disruption): 정규거래시간 종료시간 직전 1시간 동안에 시장참여자(들)가 거래소에서 기초자산(기초자산이 지수인 경우에는 지수의 20% 이상을 구성하는 증권)을 거래하거나 그 시장가격을 얻는 것 또는 관련 거래소에서 기초자산과 관련된 선물 또는 옵션 등을 거래하거나 그 시장가격을 얻는 것이 제한 또는 사실상 불가능한 경우로서 발행인이 중요하다고 판단하는 경우</p> <p>(ㄷ) 조기 폐장(Early Closure): 거래소 또는 관련 거래소가 거래소영업일에 정규거래시간의 실제 폐장시간과 정규거래시간 종료시 거래 체결을 위한 호가제출마감 시간 중 먼저 도래하는 시간의 1시간 이전까지 폐장시간을 공표하지 아니한 채 예정폐장시간 이전에 폐장한 경우</p> <p>(ㄹ) 그 밖에 기초자산과 관련하여 발행인이 본 증권의 조건을 변경 및 결정하는 것이 요청되는 상관례상 합리적인 사유가 발생 또는 존재하는 경우</p>
10) 종가	거래소 또는 기초자산 산출기관이 정규거래시간 종료시간에 발표하는 기초자산의 최종가격
11) 예정폐장시간	거래소 또는 관련 거래소가 예정거래일에 해당 거래소 또는 관련 거래소의 정규거래시간을 종료하기로 예정한 시간
12) 평가일	최초기준가격평가일 또는 만기평가일

## (2) 모집 또는 매출의 개요



1) 종목명	키움증권 제570회 키움드림공모파생결합사채 (주가연계파생결합사채) <b>(5등급, 낮은위험)</b>	
2) 기초자산	삼성전자 보통주	
3) 모집총액	50,000,000,000원	
4) 1증권당 액면가액	10,000원	
5) 1증권당 발행가액	10,000원	
6) 발행 수량	5,000,000 증권	
7) 최소청약금액	10,000원	
8) 청약기간	청약시작일	2025년 01월 24일 (13:00 부터)
	청약종료일	2025년 01월 24일 (16:00 까지) <b>(청약기간이후 청약취소 불가)</b>
9) 납입일(예정)	2025년 01월 24일	
10) 배정 및 환불일(예정)	2025년 01월 24일	
11) 발행일(예정)	2025년 01월 24일	
12) 예탁기관	한국예탁결제원	
13) 증권의 상장여부	비상장	
14) 만기일(예정)	2026년 01월 23일	
15) 만기상환	본 일괄신고추가서류 'II. 증권의 권리내용 2. 권리의 내용'을 참조하시기 바랍니다.	
16) 고난도금융투자상품 해당여부	본 증권은 자본시장법 시행령 제2조제7호에서 정하는 <b>고난도금융투자상품에 해당하지 아니하며</b> 만기 또는 자동조기상환시 <b>원금 이상을 지급하는 구조</b> 입니다. 그러나 기초자산 가격변동 이외의 요인(투자자 요청에 따른 중도상환, 발행인의 지급 불이행 등)으로 <b>추가 손실이 발생할 수 있습니다.</b>	
17) 발행취소에 관한 사항	청약금액의 합계가 5억원 미만일 경우, 발행인은 본 증권의 발행을 취소할 수 있습니다. 이 경우 청약금액은 환불일에 투자자들의 해당 청약계좌로 반환됩니다.	
18) 기타 유의사항	본 증권은 주식·사채 등의 전자등록에 관한 법률에 따라 전자등록기관인 한국예탁결제원을 통하여 전자등록하여 발행하고, 실물을 발행하지 않습니다. 본 증권의 보유자는 전자등록기관의 계좌관리기관등 자기계좌부 또는 계좌관리기관의 고객계좌부에의 전자등록을 통하여 본 증권을 보유합니다.	

### (3) 예상손익구조

본 증권의 예상손익구조에 대한 자세한 내용은 본 일괄신고추가서류 'II. 증권의 권리내용 1. 예상손익구조'를 참조하시기 바랍니다.

## 2. 공모방법

본 증권은 일반 공모의 방식으로 공모하며, 퇴직연금사업자의 위탁계좌로 청약을 제한합니다.

(발행사의 확인 결과 청약조건에 부합하지 않는 청약자에 대해서는 그 전부를 청약하지 아니한 것으로 간주합니다.)

## 3. 공모가격 결정방법

(1) 본 증권의 발행가액은 1증권당 10,000원으로 모집합니다.

(2) 본 증권의 이론가격은 본 신고서 제출일 전전일 10,015.34원으로 추산됩니다.

\* 이는 본 신고서 제출일 전전일 기준으로 제3의 평가기관으로부터 제시받은 이론상의 평가금액으로, 본 거래에 따른 위험회피 거래에 소요되는 만기까지의 헤지비용은 가산하지 않은 가격입니다.

\* 기초자산가격 변동성 및 기초자산 일별수익률간의 상관계수

항 목	내 용
기초자산가격 변동성	- 삼성전자 보통주 : 31.16%

[변동성 기준: Volatility Surface에 대하여 VIX방법론을 이용(Jiang and Tian(2005))하여 Volatility Term Structure를 산출한 뒤 해당만기에 상응하는 변동성을 적용, 상관계수 기준: 180영업일 역사적 상관계수]

※ 발행 이후 발행인의 홈페이지에 게시하는 공정가액(기준가)은 확정된 기초자산의 기준가격과 당시 시장상황을 감안하여 추산된 헤지비용 등이 반영되므로 본 일괄신

고추가서류 제출일 현재 제시한 가격과 달라질 수 있습니다.

## 4. 모집 또는 매출절차 등에 관한 사항

### (1) 모집 및 매출관련 공고일자와 공고방법

증권 발행의 공고	청약 종료일에 개별통지에 같음하며 본점에서 확인할 수 있습니다.
모집 또는 매출가액 확정의 공고	청약 종료일에 개별통지에 같음하며 본점에서 확인할 수 있습니다.
청약안내의 공고	청약 종료일에 개별통지에 같음하며 본점에서 확인할 수 있습니다.
청약결과 배정의 공고	청약 종료일에 개별통지에 같음하며 본점에서 확인할 수 있습니다.

### (2) 청약의 방법

1) 청약의 방식 및 절차	<p>- 근로자퇴직급여보장법에 의한 퇴직연금적립금에 한해, 소정의 청약서에 필요한 사항을 기입하고 서명 또는 날인하여 청약 증거금과 함께 청약취급처에서 청약하시기 바랍니다.</p> <p>- 청약자는 "금융실명거래 및 비밀보장에 관한 법률"의 규정에 의한 실명확인이 된 계좌를 통하여 청약을 하거나 별도로 실명 확인을 하여야 합니다. 또한, 대리인을 선임하는 경우 청약서에는 대리인이 본인 및 대리인을 표시하고, 대리인이 기명날인 또는 서명하여야 합니다.</p>
2) 청약기간	[2025년 01월 24일(13:00)] 부터 [2025년 01월 24일(16:00)]까지 (청약기간 이후 청약취소 불가)
3) 청약취급처	키움증권의 본·지점
4) 청약단위	최소 청약금액 1만원으로 하되 1만원 이상은 1만원을 청약단위로 합니다.
5) 청약증거금	- 청약시 청약금액의 100%를 청약증거금으로 징구합니다. 단, 청약증거금은 납입기일에 증권납입금으로 대체충당하며 청약증거금에 대하여는 예탁금 이용료를 지급하지 않습니다.

	- 초과청약금은 납입일에 해당 청약계좌로 반환합니다.
6) 배정 및 환불일	2025년 01월 24일
7) 납입일	2025년 01월 24일
8) 청약시 유의사항	<p>1) 현금청약, 대체청약, 자금과 대체청약 가능합니다.</p> <p>2) 청약취소는 청약기간에 한하여 가능하며, 청약취소시 청약자 예수금에서 인출하여 해당 계좌에 정상잔고로 입금처리 됩니다.</p> <p>3) 주가연계파생결합사채 발행을 위한 신규청약만 허용되며, 발행 이후 운용기간 중 추가청약은 허용되지 않습니다.</p> <p>4) 청약기간 중 동일인이 동일계좌로 추가 청약을 하고자 하는 경우 기존 청약을 취소 후 재청약 하셔야 합니다.</p> <p>5) 청약자격을 구비하지 못한 청약은 어떠한 경우에도 유효한 청약으로 인정되지 아니합니다.</p> <p>6) 발행한도는 주가연계파생결합사채의 발행가능금액을 말하며 [발행가액 x 발행수량]입니다.</p> <p>7) 청약금액은 [발행가액 x 청약수량]입니다.</p> <p>8) 청약금액의 합계가 5억원 미만일 경우, 발행인은 본 증권의 발행을 취소할 수 있습니다.</p>

### (3) 청약결과 배정 방법

가. 청약금액의 합계가 모집총액의 100%에 미달하는 경우는 부분납입으로 종결하고 해당 청약 금액만을 발행하기로 합니다.

나. 청약금액의 합계가 모집총액의 100% 이상인 경우 청약금액에 비례하여 **안분배정**합니다(1좌 미만 절사). 단, 위 안분배정으로 발생한 잔여수량에 대해서는 청약자의 청약금액이 큰 순서대로 해당 청약자에게 각 1좌씩 배정하되, 청약금액이 동일한 청약자가 경합하는 경우에는 위탁계좌 개설일이 앞서는 순서, 위탁계좌 개설일이 동일한 청약자가 경합하는 경우에는 위탁계좌번호가 앞서는 순서대로 잔여수량을 1좌씩 배정합니다. 그러한 배정에 따른 후에도 남게되는 잔여수량에 대해서는 배정

을 하지 아니함으로써 미발행으로 처리합니다.

#### (4) 납입 및 청약증거금의 대체·반환

가. 청약증거금은 납입일에 본 증권의 납입금으로 자동대체하며, 청약증거금에 대하여는 예탁금 이용료 또는 이자를 지급하지 않습니다.

나. 본 증권의 발행이 취소되거나 청약금액에 비례하여 안분배정됨에 의하여 청약증거금을 반환해야 하는 경우 환불일에 청약금액을 해당 청약계좌로 송금하는 방법으로 반환합니다. 단, 그에 대한 이자는 가산하지 않는다는 점을 유의하시기 바랍니다.

#### (5) 증권의 발행 및 교부등에 관한 사항

가. 본 증권은 「주식·사채 등의 전자등록에 관한 법률」에 따라 한국예탁결제원을 전자등록기관으로 하여 전자등록의 방법으로 발행합니다. 본 증권의 실물발행, 분할 및 병합은 인정되지 아니합니다.

나. 본 증권의 보유자는 전자등록기관의 계좌관리기관등 자기계좌부 또는 계좌관리기관의 고객계좌부에의 전자등록을 통하여 본 증권을 보유합니다.

다. 본 증권의 분할 또는 병합은 인정되지 아니합니다.

### 5. 인수 등에 관한 사항

#### (1) 기타 발행과 관련한 대리인등에 관한 사항

가. 본 증권의 모든 지급금액 및 상환금액은 발행인인 키움증권이 계산대리인(Calculation Agent)으로서 거래소 또는 기초자산 산출기관이 발표하는 기초자산 가격을 기준으로 산정합니다.

나. 본 증권의 발행인은 본 증권에서 발생하는 모든 지급금액 및 상환금액의 지급사무를

아래와 같이 위탁하였습니다.

○ 지급금액 및 상환금액 지급대행기관:

(주)우리은행 여의도중앙지점 여의도중앙업무팀(주소: 서울시 영등포구 국제금융로2길 25)

((주)우리은행은 발행인의 지시에 따라 상환금액의 지급업무를 대행하는 것일 뿐 상환금액의 지급을 보증하거나 보장하는 것은 아닙니다.)

## II. 증권의 주요 권리내용

### 1. 예상 손익구조

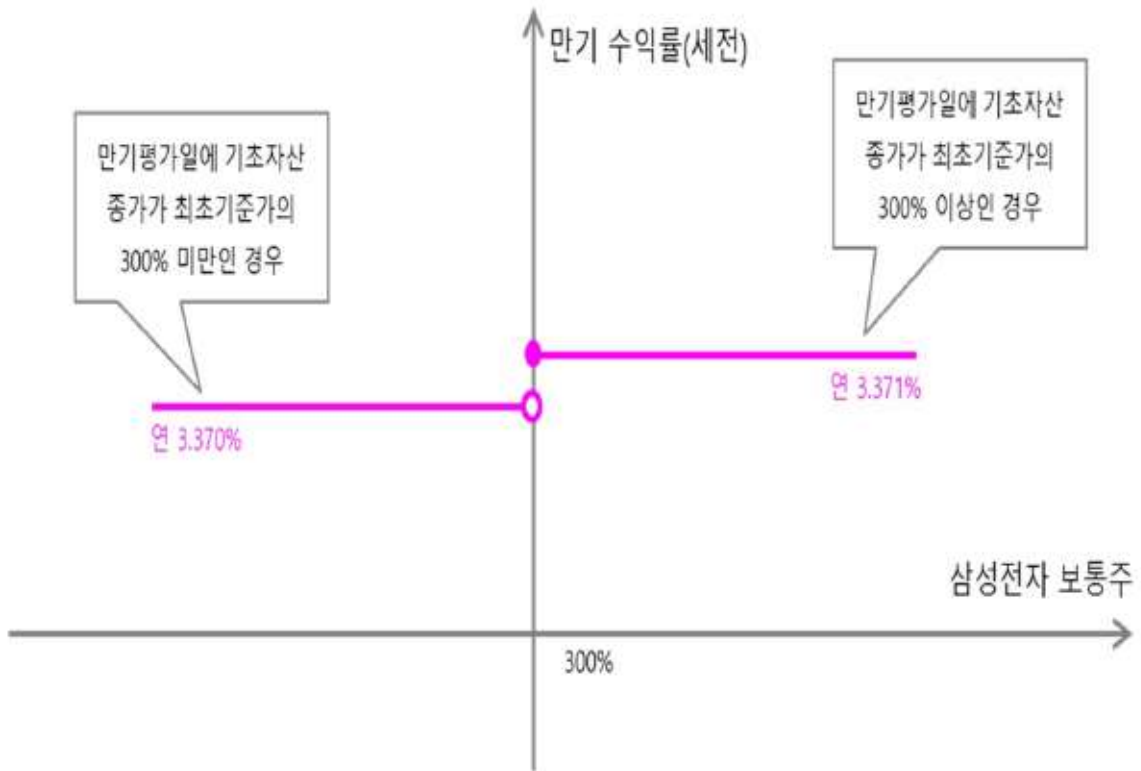
#### (1) 상황별 손익구조

구분	내용	투자수익률(세전)
만기 상황	① 만기평가일에 삼성전자 보통주의 최종기준가격이 최초기준 가격의 300% 이상인 경우 → 원금 + 세전 연 3.371% 지급	3.3617% (연 3.3710%)
	② 만기평가일에 삼성전자 보통주의 최종기준가격이 최초기준 가격의 300% 미만인 경우 → 원금 + 세전 연 3.37% 지급	3.3607% (연 3.3700%)

- 단, 투자수익률은(세전) 소수점 넷째자리까지 표기 되어있으며 상환지급액은 [액면금액 + 액면금액 × (연 투자수익률 × 만기일수/365)] 기준으로 산출된 금액에서 원단위 미만 절사합니다.

\* 만기일수 = 364일 [발행일(불포함)로부터 만기일(포함)까지의 달력일수]

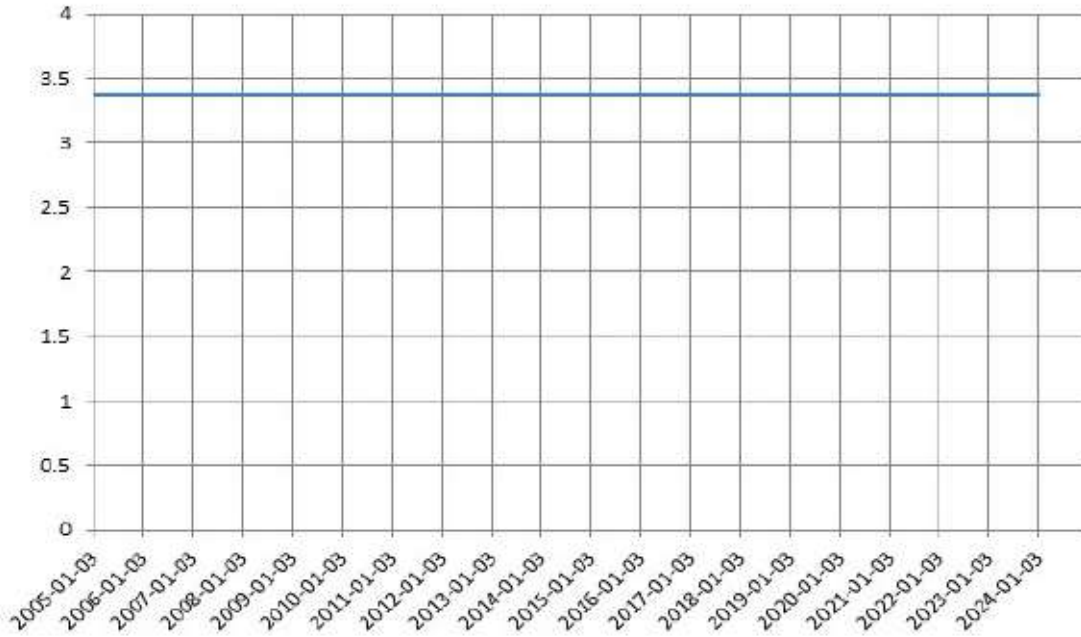
#### (2) 예상 손익구조 그래프



제570회 키움드림공모파생결합사채 (예상 손익구조 그래프)

### (3) 기초자산의 과거 데이터를 이용한 수익률 모의실험





제570회 키움드림공모파생결합사채 (수익률 모의실험)

**(4) 수익률 모의실험 빈도표**

수익률 구간		발생횟수	발생빈도
만기상환1	연 3.371%	0	0.000%
만기상환2	연 3.37%	4,695	100.000%
Total		4,695	100.000%

주1) 위 그래프와 표는 2005년 01월 03일부터 2024년 12월 30일 까지의 기초자산의 증가를 이용하여 분석한 결과입니다.

주2) 분석시작일(2005년 01월 03일)로부터 분석기간동안 매 거래소영업일에 동일한 상품이 신규발행되어 투자자가 이를 반복해서 매입하는 것을 가정하였으며 이 경우 각각의 만기수익률을 표본으로 추출하였습니다. (총 4,695회)

주3) 자동조기상환금액의 재투자자는 가정하지 않았으며, 자동조기상환이 발생한 경우에는 자동조기상환시의 수익률을 만기수익률로 인식하였습니다.

주4) 위 그래프와 표는 과거 기초자산의 증가를 이용한 손익구조 예시에 불과하며, 본 증

권의 투자에 따른 미래의 만기상환수익률의 예측치가 아님을 주의하셔야 합니다.

## (5) 최소이익액 및 최대이익액

구 분	내 용	투자수익률
최소이익액	만기평가가격이 최초기준가격의 [300%] 미만인 경우, 발행인은 본 증권의 보유자에게 액면금액의 [103.3607%]를 지급합니다.	3.3607% (연 3.37%)
최대이익액	만기평가가격이 최초기준가격의 [300%] 이상인 경우, 발행인은 본 증권의 보유자에게 액면금액의 [103.3617%]를 지급합니다.	3.3617% (연 3.371%)

- 단, 투자수익률은(세전) 소수점 넷째자리까지 표기 되어있으며 상환지급액은 [액면금액 + 액면금액 × (연 투자수익률 × 만기일수/365)] 기준으로 산출된 금액에서 원단위 미만 절사합니다.

## 2. 권리의 내용

### (1) 상환금액의 지급에 관한 사항

투자자는 본 일괄신고추가서류에 정하여진 산식에 따라 계산된 상환금액을 해당 지급일에 지급받을 권리가 있으며, 그 구체적인 사항은 다음과 같습니다.

#### 가. 최초기준가격

- 최초기준가격 : 최초기준가격평가일 기초자산 증가
- 최초기준가격평가일 : 2025년 01월 24일

#### 나. 만기상환

- 발행인은 만기일에 아래 만기상환금액 결정조건에 따라 결정된 상환금액을 지급

함으로써 본 증권을 상환함.

만기상환금액 결정조건	상환금액(세전)
① 만기평가일에 삼성전자 보통주의 최종기준가격이 최초 기준가격의 300% 이상인 경우	총액면가액 × 약 103.3617% (연 3.371%)
② 만기평가일에 삼성전자 보통주의 최종기준가격이 최초 기준가격의 300% 미만인 경우	총액면가액 × 약 103.3607% (연 3.37%)

○ 만기평가가격 : 만기평가일 기초자산 증가

○ 만기평가일 : 2026년 01월 21일

#### 다. 기타 중요사항

○ 만기일은 발행일 현재를 기준으로 발행회사가 예측하여 예상되는 일자를 기재한 것입니다. 따라서, 향후 영업일 여부가 발행회사의 예측과 달라지는 경우 만기일은 최종관찰일을 기준으로 만기일 결정 방식에 따라 조정 및 결정되며 추가적인 이자는 가산하지 아니합니다.

○ 평가일이 예정거래일이 아닌 경우 이후 최초로 도래하는 예정거래일을 평가일로 합니다.

○ 평가일이 2일 이상으로 연속되는 경우, 어느 한 평가일이 연기되면 그에 연속해서 이어지는 이후 평가일들도 순차적으로 익 예정거래일들로 순연됩니다.  
(단, 기초자산이 20이상의 거래소에서 거래되는 경우, 평가일은 해당 거래소 모두의 거래소영업일로 한다.)

○ 평가일이 교란일인 경우 해당 평가일이 변경될 수 있음을 유의하시기 바랍니다.(보다 자세한 내용은 '3. 권리내용의 변경 및 결제불이행에 관한 사항'을 참조하시기 바랍니다.)

○ 평가일이 변경되는 경우, 상환일은 변경된 평가일(불포함) 후 2영업일로 하고 (평가일이 2일 이상으로 연속되는 경우 변경된 마지막 평가일(불포함) 후 2영업일)추가

적인 이자는 가산하지 않습니다.

○ 상환금액 계산시 원미만은 절사합니다.

○ 발행인은 '3. 권리내용의 변경 및 결제불이행에 관한 사항'에 정해진 바에 따라 본 증권의 권리내용을 변경하거나 만기 이전이라도 조기종결 할 수 있습니다.

## (2) 통지방법 및 절차

가. 발행인은 만기평가가격의 결정 후 지체 없이 상환금액을 산정하여 개별 통지 합니다.

## (3) 결제방법 및 절차

본 증권은 현금결제 방식으로 상환됩니다. 만기시 또는 투자자의 요청에 의한 중도상환 시 별도의 의사표시나 권리행사 없이 자동으로 본 증권신고서에서 정해진 기준에 따라 계산된 금액을 본 증권을 보유하고 있는 계좌에 지급일 당일에 현금으로 지급합니다.

## (4) 투자자의 요청에 의한 중도상환

가. 본 증권은 운용성과에 따라 지급액이 결정되는 수익증권과는 달리 증권의 발행조건에서 정하여진 방식에 따라 상환금액이 결정되는 증권이므로, 수익증권과 같은 환매(일종의 중도상환청구권)의 절차가 존재하지 않습니다.

나. 그러나, 본 증권의 투자자는 중도상환을 요청할 수 있고, 발행인은 본 증권의 환금성 및 유동성 제고를 위하여 본 증권 보유자의 청구에 따라 본 증권을 중도상환 할 수 있으며, 그에 대한 상세 내용은 아래 표와 같습니다. 발행인은 투자자가 본 증권의 중도상환을 요청할 경우 본 증권에 대한 위험회피(Hedge)거래의 상황, 기초자산의 가격, 시중금리, 기초자산가격의 변동성, 기초자산의 배당률, 관련 선물 옵션의 가격, 만기까지의 잔존기간 등 가격결정 요인들을 고려하여 합리적으로 중도상환 하도록

하며, 이 경우 일정부분 원금의 손실이 발생할 수 있습니다.

다. 단, 발행인은 주식시장이 시장 붕괴 등으로 인하여 정상적으로 운영되지 않아 본 증권의 시장청산이 불가능할 경우에 한하여 중도상환에 응하지 아니하거나 일부 물량에 대해서만 중도상환에 응할 수 있으며, 중도상환에 응하는 경우에도 상환금액 결정방식은 아래 표의 기준을 따르지 않을 수 있습니다. 이 경우 발생하는 손실은 모두 투자자에게 귀속됩니다.

1) 중도상환 요청가능 일	발행일의 익영업일부터 만기평가일 직전 2영업일까지의 기간 중에 중도상환 요청불가일을 제외한 매 영업일
2) 중도상환 신청단위	1만원을 최소금액으로 하며 1만원 단위로 신청 가능합니다.
3) 중도상환금액 평가 일	중도상환 요청일(불포함) 후 [1]거래소영업일 단, 천재지변, 거래제한 등 불가피한 사유가 있는 경우에는 계산 대리인의 합리적인 판단으로 중도상환금액 평가일을 연기할 수 있습니다.
4) 중도상환금액 지급 일	중도상환금액 평가일(불포함) 후 [2]영업일
5) 중도상환가격	<p>중도상환시 중도상환 신청일이 본 증권의 발행일 이후 만기일 미만인 경우 연 3.370%에서 연 1.00%를 차감한 금리를 기준으로, 액면금액과 발행일부터 중도상환 지급일까지 일할 계산한 수익금액을 합산한 금액을 지급합니다. 단, 근로자퇴직급여보장법에서 정하는 퇴직사유 등의 특별중도해지의 경우 중도환매금액은 액면금액과 함께 연 3.370%를 기준으로 경과일수로 계산된 수익금액을 지급합니다.</p> <p>*특별중도해지 사유</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 퇴직, 연금지급 등 급여 지급의 사유가 발생하는 경우</li> <li>2. 근로자 퇴직급여보장법상 퇴직연금 중도인출 사유인 경우</li> <li>3. 퇴직연금 제도전환</li> <li>4. 수수료 지급을 위한 경우</li> <li>5. 퇴직연금 가입 법인의 합병/영업양수, 양도 등으로 인하여 제도의 해지를 요청하는 경우</li> <li>6. 퇴직연금 가입법인의 파산 및 폐업으로 해지를 요청하는 경우</li> <li>7. 관련 법령의 변경으로 해지가 불가피한 경우</li> <li>8. 퇴직연금 사업자의 사임 및 계약위반의 경우</li> </ol>
	중도상환금액은 본 거래의 위험회피(Hedge) 등을 위하여 체결한 거래의 청산비용 및 중도상환가격평가일의 기초자산 가격의 변동 등으로 인하여 중도상환요청일, 중도상환금액 평가일 및 중도상

<p>6) 투자자유지사항</p>	<p>환금액 지급일 등에 공시된 공정가액과 다를 수 있으며, 이 경우 원금의 손실이 발생할 수 있으므로 중도상환 신청 시 유의하시기 바랍니다.</p> <p>투자자의 중도상환요청이 있는 경우 그러한 중도상환 요청일에 그 효력이 발생하며, 이에 따라 발행인은 중도상환금액 지급의무 외에 추가적인 상환의무를 부담하지 않습니다. 만일 천재지변, 거래제한 등 불가피한 사유가 발생한 경우에는 발행인의 합리적인 판단으로 중도상환금액 평가일을 연기할 수 있으며 이에 따라 중도상환금액 지급일 또한 연기될 수 있습니다.</p>
<p>7) 증권의 조기상환 사유 발생시 투자자 요청에 의한 중도상환의 처리</p>	<p>투자자가 본 증권의 중도상환을 요청하여 위 절차에 따라 중도상환금액을 지급하려 하였으나 중도상환금액 지급일 전에 Ⅱ.3.가.에 기재된 본 증권의 조기상환 사유가 발생하거나 조기상환일이 지정되었거나 또는 Ⅱ.3.다.의 권리내용의 변경에 따른 증권의 조기상환이 발생한 경우에는, 위 6)에도 불구하고 해당 중도상환요청은 철회된 것으로 간주하고 아래 Ⅱ.3.가., Ⅱ.3.나. 및 Ⅱ.3.다.에 따라 본 증권을 조기상환 처리합니다.</p>

## (5) 증권의 발행 취소 및 환불

가. 본 증권의 발행금액이 일정 금액 이하일 경우 발행조건에 의한 상환금을 안정적으로 지급할 수 있는 기초자산의 매매가 용이하지 않습니다. 따라서 본 증권의 청약금액의 합계가 5억원 미만인 경우에는 증권의 발행이 취소될 수 있으며 발행이 취소되는 경우 환불일에 청약금액을 환불하되 이자는 가산하지 않으니 이 점 유의하시기 바랍니다.

## (6) 증권의 상장 및 매매

가. 증권의 상장에 관한 사항

본 증권은 상장되지 않습니다.

나. 증권의 매매에 관한 사항

### 1) 본 증권 가격에 영향을 주는 요소

○ 본 증권의 공정가액(기준가)에 영향을 미치는 요인으로는 금리수준, 기초자산의 가격수준, 만기까지의 잔존기간, 기초자산의 변동성, 발행인의 재무상태 등이 있습니다. 본 증권의 발행시 발행인이 산정한 본 증권의 공정가액에 대한 사항은 'I. 모집 또는 매출에 관한 일반사항 3. 공모가액 결정방법'을 참고하시기 바랍니다.

○ 한편, 본 증권의 발행 이후 거래되는 실제 거래가격은 본 증권의 공정가액 외 시장 상황, 시장수급 및 세제 등 기타 가격결정요인들을 반영하여 결정될 것입니다. 이와 관련한 투자위험요소에 대한 상세한 사항은 “ III. 투자위험요소” 부분을 참고하시기 바랍니다.

### 2) 본 증권의 매매에 관한 사항

○ 본 증권은 운용성과에 따라 지급액이 결정되는 수익증권과는 달리 증권의 발행조건에서 정하여진 방식에 따라 상환금액이 결정되는 증권입니다. 따라서, 수익증권과 같은 환매의 절차가 존재하지 않습니다. 다만, 본 증권의 보유자는 매매를 통하여 본 증권을 만기 이전에 현금화할 수 있으나 본 증권은 한국거래소에 상장하지 않을 예정이므로 장내에서는 거래하실 수 없으며 일반적인 장외에서의 거래는 매우 제한적일 것으로 예상됩니다.

### 3) 만기이전 중도상환에 관한 사항

○ 발행인은 본 증권의 유동성 제고를 위하여 본 증권의 보유자의 청구에 따라 본 증권을 중도상환할 수 있으며, 그에 대한 절차는 '(4) 투자자의 요청에 의한 중도상환' 부분을 참고하시기 바랍니다.

## 3. 권리내용의 변경 및 결제 불이행에 관한 사항

본 증권은 다음에서 정하는 바에 따라 발행일로부터 만기일 이전의 기간 중 발행인에

의하여 (1) 만기일 이전에 조기 상환되거나 (2) 그 권리내용이 변경될 수 있음을 유의하여야 합니다.

## (1) 본 증권의 조기종결 및 상환

### 가. 조기종결 사유

1) 다음 각 호의 사유가 발생한 경우 발행인은 기한의 이익을 상실하며, 만기일 이전 '나. 조기종결 방법'에 따라 본 증권을 상환하여야 합니다. 그러한 경우 발행인은 해당 사유 및 상환의무의 발생 사실, 조기종결기준일 및 조기종결금액을 명시하여 본 증권의 보유자에게 통지하여야 합니다.

○ 발행인이 파산 또는 회생절차(기타 이와 유사한 절차를 포함함) 개시의 신청을 한 경우 또는 발행인 이외의 제3자의 신청에 의하여 발행인에게 파산이 선고되거나 회생절차가 개시된 경우

○ 발행인에게 정관에 정한 해산사유가 발생하거나 해산에 관한 주주총회의 결의가 있는 경우 또는 법원의 해산명령 또는 해산판결이 있는 경우

○ 발행인에게 어음교환소 또는 거래은행의 거래정지처분이 있는 경우

○ 발행인이 예금자보호법 또는 금융산업의 구조개선에 관한 법률에 따라 부실금융기관으로 지정된 경우

○ 발행인의 휴업 또는 폐업으로 인하여 발행인이 더 이상 본 증권의 의무를 이행하기 곤란하게 된 경우

2) 다음 각 호의 사유가 발생한 경우 발행인은 [신의성실의 원칙에 따른 합리적 판단에 따라] 본 증권의 만기일 이전 '나. 조기종결 방법'에 따라 본 증권을 상환할 수 있습니다. 그러한 경우 본 증권의 보유자에 대하여 해당 사유 및 상환의무의 발생 사실, 조기종결기준일 및 조기종결금액을 명시하여 통지하여야 합니다.



- 본 증권의 기초자산에 대해 일부 또는 전부의 상장폐지가 발생하여 기초자산의 매매불가능으로 본 증권을 유지하는 것이 곤란하게 된 경우
- 기초자산이 주식인 경우 기초자산 발행사의 영업양도, 합병, 부도, 파산 등의 사유가 발생하는 경우
- 거래소의 영구폐지가 결정되거나 거래소가 [10]예정거래일 이상을 연속하여 개장하지 아니하는 경우
- 거래소에서 기초자산 가격의 계산 및 공시를 폐지하기로 발표하는 경우
- 본 증권의 발행 이후 관련 법령의 제정·개정, 관련 법령의 해석의 변경 등으로 인하여 본 거래가 위법하게 된 경우
- 본 증권의 발행 이후 관련 법령의 제정·개정, 관련 법령의 해석의 변경 등으로 인하여 발행인에게 여하한 추가적인 조세 기타 공과금 납부 의무가 발생한 경우
- 천재지변, 전시, 사변, 금융시장(외환시장 포함)에서의 거래중지사태, 기타 이에 준하는 사유로 인하여 본 증권을 유지하는 것이 곤란하게 된 경우

#### 나. 조기종결 방법

1) 본 증권의 조기종결 사유가 발생하여 발행인이 만기일 이전에 본 증권을 상환(지급)하는 경우 발행인은 조기종결기준일로부터 10영업일 이내에 본 증권의 보유자에게 조기종결금액을 지급하여야 합니다.

○ "조기종결기준일"은 위 가. 1)의 경우 각 호의 사유 발생일 (거래소영업일이 아닌 경우는 다음 거래소영업일)을 의미하며, 위 가. 2)의 경우에는 통지일 이후의 특정 거래소영업일로서 발행인이 조기종결기준일로 지정한 날을 의미합니다.

2) 본 증권의 조기종결 사유가 발생하여 발행인이 만기일 이전에 본 증권을 상환하는

경우 발행인은 조기종결기준일의 기초자산의 가격 및 시장상황 등을 고려하여 조기종결금액을 신의성실의 원칙에 따른 합리적 판단에 따라 결정합니다. 이때 적용되는 기초자산의 가격은 기초자산이 거래되는 거래소(또는 관련 거래소 및 장외시장)의 시장가격을 기초로 판단하게 되며, 조기종결금액은 해당 증권의 청산가치로 결정하게 됩니다. 단, 해당 증권을 청산할 수 있는 가격이 존재하지 않는 경우(거래소, 관련 거래소 또는 장외시장에서 해당 기초자산 발행자의 부도발생 등의 사유로 인하여 해당 기초자산의 매수호가 존재하지 않는 경우 등)에는 기초자산 가격을 영(0)으로 결정할 수 있으며, 이 경우에 투자자는 상품의 유형에 따라 투자원금 전체의 손실이 가능함을 유의하셔야 합니다. 조기종결금액은 본 증권의 발행조건에 기재된 만기 시 지급수준과 차이가 발생할 수 있으며, 기초자산의 거래정지사유로 인하여 본 증권의 즉각적인 청산이 불가능할 경우에는 조기종결금액의 지급이 최초 예정되었던 지급일에서 유예될 수 있으므로 이에 유의하길 바랍니다.

## (2) 권리내용의 변경

본 증권은 아래의 각 호에 따라 권리의 내용이 변경될 수 있습니다. 발행인은 본 증권의 지급조건, 지급절차 및 기타 권리내용의 변동 등에 관한 통보를 하여야 할 경우 지체없이 개별 통지 합니다.

o 단, 이러한 사유의 발생이 위 ' (1) 가. 조기종결 사유'에 해당하는 경우 발행인은 위 ' (1) 본 증권의 조기종결 및 상환'에 정한 바에 따라 본 증권을 만기 전조기 상환하여야 하거나 조기상환 할 수 있습니다.

### 가. 권리내용 변경사유

1) 지수 산정의 오류 등[(Index Disruption)]:

거래소 또는 기초지수 산출기관의 기초자산 가격의 산정, 발표 또는 통신상의 오류로 인하여 상환금액이 잘못 산정·지급된 경우 발행인은 추후 정정발표 또는 확인된 정확한 기초자산의 가격을 기준으로 산출한 금액과의 차액을 정산합니다. 단, 그 기초자산 가격의 정정이 지급일로부터 2영업일 내에 정정된 경우에 한하며 발행인은 별도의 귀책사유가 없는 한 그러한 정산의무 외에 별도의 손해배상책임을 부담하지 않

습니다.

## 2) 시장교란사유[(Market Disruption)]:

어느 평가일이 교란일인 경우 교란일이 아닌 최초의 익 예정거래일로 해당 평가일이 변경됩니다.

○ 단, 그 다음 8예정거래일이 모두 교란일인 경우 8번째 예정거래일이 교란일임에도 불구하고 평가일로 간주됩니다. 이 경우 발행인이 8번째 예정거래일의 기초자산 가격을 신의성실의 원칙에 의거하여 산정하며, 기초자산이 지수인 경우 발행인은 시장교란사유가 발생하기 직전에 사용된 기초자산 산출 공식과 방법에 따라 8번째 예정거래일의 각 해당 지수의 구성종목의 매매가격 또는 호가를 사용하여 기초자산 가격을 산출합니다.

○ 복수의 기초자산이 각각 다른 거래소에서 거래되는 경우(기초자산이 지수인 경우 해당 지수의 구성종목이 거래되는 거래소 기준) 어느 평가일이 어느 한 기초자산에 대하여 교란일이면 모든 기초자산에 대하여 교란일이 발생한 것으로 간주합니다.

○ 평가일이 2일 이상으로 연속되는 경우, 어느 한 평가일이 연기되면 그에 연속해서 이어지는 이후 평가일들도 순차적으로 익 예정거래일들로 순연됩니다.

○ 시장교란사유의 발생에 따라 평가일이 변경되는 경우, 상환일은 변경된 평가일(불포함) 후 2영업일로 하고 (평가일이 2일 이상으로 연속되는 경우 변경된 마지막 평가일(불포함) 후 2영업일) 추가적인 이자는 가산하지 않습니다.

## 3) 기초자산 거래 장애 등[(Hedging Disruption)]:

본 증권은 발행인은 본 증권의 상환금액 지급과 관련한 위험을 회피하기 위하여 기초자산 구성종목, 기초자산과 관련된 선물·옵션 등 파생상품의 거래 또는 제3자(비거주자를 포함)와의 장외파생상품거래 등의 위험회피(Hedge)거래를 수행할 수 있으며, 해당 거래소·청산소 또는 거래상대방의 파산, 이행지연 등의 사유가 발생하거나 또는 외환시장을 포함한 금융시장의 중대한 장애(천재지변, 전쟁, 내란, 폭동, 법령, 정부관계당국의 명령 기타 통제가 불가능한 사항 등)가 발생하여 발행인이 본 증권과 관련한 위험회피거래에 중대한 제한이 따른다고 판단하는 경우, 발행인은 만기

일, 지급일 및 만기상환금액 등 본 증권의 권리내용을 조정할 수 있습니다.

○ 단, 이러한 사유의 발생이 위 '(1) 조기종결 사유' 에 해당하는 경우 발행인은 본 증권을 만기 전 조기 상환할 수 있습니다.

4) 기타 본 일괄신고추가서류에서 정한 조건에 정하지 않은 사항으로 인해 본 증권의 권리내용 변경이 불가피 한 것으로 발행인이 신의성실의 원칙에 따라 판단하는 경우 발행인은 선량한 관리자로서의 주의의무를 다하여 본 증권의 권리내용을 변경할 수 있습니다.

5) 단, 향후 관련 법규 등에 의하여 증권을 상장하게 되는 경우 권리의 변경에 대하여 본 증권이 상장된 해당 거래소의 조치는 본 일괄신고추가서류에서 정한 조건에 우선하여 적용될 수 있습니다.

#### 나. 기초자산이 지수인 경우의 추가적인 권리내용 변경사유

1) 기초자산의 계산 발표는 기초자산 산출기관의 소관이며, 기초자산의 구성종목과 산출방식의 변경, 기초자산의 계산 및 발표의 정지 및 재개, 폐지 등에 관한 사항은 기초자산 산출기관의 정함에 따릅니다.

##### 2) 지수 변경[(Index Modification)]:

기초자산 산출기관이 기초자산을 계산하기 위한 공식 또는 방법을 변경하거나 기타 다른 방식으로 기초자산을 중요하게 변경한 경우(구성주식, 자본구성 기타 다른 사소한 사유의 변경이 있는 경우 기초자산을 유지하기 위한 공식 또는 방법에 명시되어있는 변경을 제외), 발행인은 선량한 관리자의 주의의무를 다하여 i) 본 증권의 발행조건 및 권리내용에 대한 변경이 적절하다고 판단하는 경우 이를 조정하거나 또는 ii) 변경일 전 마지막으로 유효한 지수를 계산하는 공식 및 방법에 따라 지수 변경 전 기초자산을 구성하는 주식(다만, 그러한 주식이 거래소에서 상장폐지된 경우는 제외함)을 이용하여 산출한 지수를 만기평가가격 또는 자동조기상환평가가격으로 사용할 수 있습니다.

##### 3) 지수 폐지[(Index Cancellation)]:

기초자산 산출기관이 기초자산의 산출을 폐지할 경우 본 증권의 발행인은 선량한 관리자의 주의의무를 다하여 만기상환금액, 만기일 등 본 증권의 권리내용을 변경할 수 있습니다. 이 경우 지수 폐지 직전에 기초자산 산출기관이 마지막으로 유효한 가격을 계산한 공식 및 방법을 사용하여 그에 따라 기초자산의 가격을 산출할 수 있습니다.

단, 기초자산 산출기관 이외의 제3자가 기초자산의 산출기능을 승계한 경우에는 아래와 같이 처리합니다.

○ 해당 승계기관의 산출방식이 기존의 기초자산 산출방식과 동일하다고 발행인이 선의로 판단하는 경우 승계기관이 발표하는 새로운 기초자산이 본 증권에 사용된 기초자산을 대체하는 것으로 봅니다.

○ 해당 승계기관의 산출방식이 기존의 기초자산의 산출방식과 본질적으로 매우 유사하여 본 증권에 사용된 기초자산을 수정하여 본 증권의 권리내용을 조정하는 것이 적절하다고 발행인이 선의로 판단하는 경우 발행인은 승계기관의 산출방식에 근거하여 이를 조정합니다.

#### **다. 기초자산이 개별주식인 경우의 추가적인 권리내용 변경사유**

##### **1) 기초자산 발행사의 증자 및 기타 변동 사유가 발생한 경우**

○ 기초자산 발행사의 증자, 감자, 합병, 분할, 분할합병, 기초자산에 대한 주식배당, 액면분할, 액면병합 등으로 인하여 기초자산의 가치 변동이 있는 경우 본 증권의 발행인은 해당사유 발생 전후에 수정주가의 연속성이 최대한 유지되도록 선량한 관리자의 주의의무를 다하여 상관례에 따라 기초자산의 기준가격 등 본 증권의 내용을 조정할 수 있습니다.

다음에 의하여 산출된 조정 후 기준가격은 원미만 절사합니다. 증자전 주식수는 신주 배정 기준일 전전일 주식수이며, 권리부종가는 권리락이 실시되는 날의 전일종가를 말합니다.

변경사유	조정후 기준가격
유상증자 (구주주에게 청약권리가 배정된 경우에 한함)	조정 후 기준가격 = 조정 전 기준가격 * (기발행주식수 + 신 발행주식수 * 1주당 발행가액 / 시가) / (기발행주식수 + 신 발행주식수)
무상증자 및 주식배당	조정 후 기준가격 = 조정 전 기준가격 / (1+기발행주식 1주당 신발행주식수)
무상감자, 액면분할 및 병합시	조정전 기준가격에 해당비율을 감안하여 기준가격을 조정
합병, 분할합병, 주식교환 (이전)	계산대리인은 해당사유 발생 전후에 수정주가의 연속성이 최대한 유지되도록 한국거래소의 변경방식을 우선적으로 고려하여 선량한 관리자의 주의의무를 다하여 기초자산의 기준가격 등 본 증권에의 내용을 조정할 수 있음.
기타	전환사채 및 신주인수권부사채의 전환, Stock Option행사 등으로 인해 신주가 발행되는 경우에는 본 증권에의 기준가격 을 조정하지 아니함.

○ 다만, 다음에서 예시한 사항 등과 같이 위에서 정한 기준가격 조정방식이 적용되  
기 어려운 경우 발행인은 선량한 관리자의 주의의무에 따라 별도의 조정방법을 정하  
여 본 증권에의 권리내용을 변경할 수 있습니다.

- ① “ 신배정주식수 ” 가 주주의 유형별로 구분하여 발행되는 경우 발행인은 소액투  
자 자에게 배정된 주식수를 기준으로 함. 단, 관련 법규 등에 의하여 발행인이 신주를  
청약할 수 있는 비율이 상이한 경우 해당 내역을 반영할 수 있음
- ② 유상증자 등의 경우에 신주의 발행가격이 기초자산의 유통가격대비 할인하여 발  
행되지 않아 기초자산에 대한 합리적인 투자자의 관점에서 청약의 실익이 없는 경우
- ③ 배정되는 신주가 기초자산과는 다른 권리관계를 가지는 경우 (보통주에 대한 우선  
주 증자 등)
- ④ 기타 기초자산의 변동사유와 관련되어 구주주에게 부여된 권리 등을 행사하지 아  
니하는 경우가 기초자산의 투자자관점에서 합리적인 경우

⑤ 기초자산에 대한 복수의 변동사유가 동일한 일자에 동시 또는 순차적으로 일어나는 경우(일자에 차이가 있는 경우에도 각 사유가 발생한 일자 사이에 정규시장에서의 경쟁매매에 의한 가격형성이 이루어지지 않는 경우를 포함)

⑥ 기초자산이 거래되는 거래소가 한국거래소가 아닌 국외에 소재하는 경우로서 해당국가의 법규 또는 상관습에 따라 발행인이 선량한 관리자의 의무를 다하여 합리적으로 판단한 결과 조정방법을 달리하여야 하는 경우

2) 거래소의 기초자산 증가 산출· 발표를 다른 기관이 승계하는 경우

발행인은 ① 새로 발표된 기초자산 증가가 종전의 기준종가와 실질적으로 동일하다고 인정하는 경우 새로운 증가를 기준종가로 정하거나, 혹은 ② 본 증권의 발행조건 및 권리내용에 대한 변경이 적절하다고 판단하는 경우 이를 조정할 수 있습니다.

## 라. 변경된 권리내용의 통지

1) 본 증권의 조건, 상환 및 기타 권리내용의 변동이 있는 경우 발행인은 지체없이 그 내용을 한국예탁결제원에 통보하기로 합니다.

2) 본 증권의 보유자에 대하여 본 증권의 조건, 상환 및 기타 권리내용의 변동 등에 관한 통보를 하여야 할 경우 발행인은 지체없이 개별 통지 합니다.

## (3) 발행인의 결제불이행에 대한 투자자의 권리구제절차

가. 발행인이 자동조기상환일 또는 만기일에 상환금액을 지급하지 못하였을 경우에 발행인은 지급할 금액에 대하여 자동조기상환일 또는 만기일 익일로부터 실제 지급일까지의 경과기간에 대하여 시중은행의 은행계정 대기업 원화대출에 적용되는 연체이자율 중 최고이율을 적용한 연체이자를 투자자에게 지급하기로 합니다. 단, 영업일 조정 및 공휴일 또는 시장교란사유 등으로 인하여 자동조기상환일 또는 만기일이 조정되는 경우에는 경과이자를 지급하지 않습니다.

나. 발행인이 지급의무를 불이행한 경우 본 증권 보유자는 발행인을 상대로 소를 제기하거나 파산 또는 회생절차 등에 따라 그 권리를 구제 받을 수 있습니다. 다만, 발행인이 관련 법령에 의거 파산 또는 회생절차 등 채무재조정 내지 채권자의 권리 행사가 제한되는 절차에 놓여있는 경우 본 증권 보유자의 권리 행사는 관련 법령 등에 의한 제한을 받을 수 있습니다. 본 증권의 법적지위는 다른 무담보, 무보증 채무와 동등한 지위를 가집니다.

#### (4) 준거법과 재판관할

가. 본 증권의 권리내용에 대한 다툼이 있는 경우 법령의 범위내에서 본 증권의 발행시 교부된 투자설명서에 따라 분쟁을 해결합니다. 다만, 본 증권의 투자설명서에 기재되지 않은 사항에 대해서는 대한민국 법률에 따르며 관련 법률에 명시되지 않은 사항에 대해서는 상관례에 따라 해결합니다.

나. 본 증권으로부터 또는 이와 관련하여 발생하는 모든 소송 또는 절차에 대해서는 대한민국 법원을 관할 법원으로 합니다.



### Ⅲ. 투자위험요소

정부가 증권신고서(또는 일괄신고추가서류)의 기재사항이 진실 또는 정확하다는 것을 인정하거나 그 증권의 가치를 보증 또는 승인하지 아니함을 유의하시기 바랍니다. 또한 이 파생결합사채는 「예금자보호법」에 따라 보호되지 않는 금융투자상품으로 투자원금의 손실이 발생할 수 있으므로 투자에 신중을 기하여 주시기 바랍니다.

#### 1. 가격변동 위험

구분	투자위험의 주요내용
<p>기초자산의 가격변동에 연동한 수익구조에 의한 위험</p>	<p>-본 증권은 기초자산의 가격변동에 따라 그 수익률이 결정되는 상품입니다만, 상품의 수익구조가 매우 복잡하게 구성되어 있으므로 기초자산의 가격이 투자자에게 불리한 방향으로 움직이는 경우 투자자는 예상치 못한 커다란 손실을 입게 될 수 있으며, 대상이 되는 기초자산에 직접 투자했을 때 얻을 수 있는 수익률과 본 증권에 투자하여 얻은 수익률이 전혀 다를 수 있습니다. 따라서 투자자는 본 증권의 상환금액의 산정방식이나 조기상환의 조건 등을 충분히 이해하고 투자하여야 합니다.</p> <p>-본 증권은 기초자산의 가격변동에 연동하여 수익구조가 결정되는 파생상품적 성격을 지니고 있습니다. 따라서 만기상환 이전에 기초자산이 존재하지 않게 되거나, 기초자산의 성격이 중대하게 변경되어 본 증권 발행 당시의 기초자산과 동일한 것으로 보기 어려워지는 경우, 기초자산 또는 기초자산을 구성하고 있는 종목에 대한 매매가 곤란해 지는 경우 등에 있어서는 발행조건에 명시된 만기상환금액, 자동조기상환 또는 중도상환금액을 산출할 수 없게 됩니다.</p> <p>이러한 경우 계산대리인(Calculation Agent)인 키움증권은 상환금액 산정방식과 상환금액 지급일을 포함한 본 증권의 권리내용을 합리적으로 조정할 수 있으니 투자에 유의하시기 바랍니다. 또 경우에 따라서는 그러한 조정의 결과에 의해 투자원금 전체의 손실이 가능함을 유의하셔야 합니다. 그러나 그러한 조정에도 불구하고 본 증권을 유지하기 어렵다고 발행회사가 판단하는 경우에는 본 증권을 만기 이전에 조기상환할 수 있습니다. 기초자산에 이러한 조정이나 조기상환사유가 발생하게 되면 본 증권의 가격은 현저하게 하락할 수 있습니다. 위와 같은 본 증권의 권리내용의 조정이나 조기상환 등에 대한 설명은 'II. 증권의 주요 권리내용 중 3. 권리내용의 변경 및 결제불이행에 관한 사항</p>

	'에 상세하게 기술되어 있습니다.
공정가액(기준가)에 영향을 미치는 요인별 위험	<p>- 기초자산가격 수준에 따른 위험 : 기준일자 대비 기초자산가격이 하락할수록 공정가액(기준가)이 하락하는 경향이 있습니다.</p> <p>- 기초자산가격 변동에 따른 공정가액(기준가) 하락속도 증가위험: 조기상환/만기상환조건에 가까울수록 기초자산의 변화에 따른 공정가액(기준가)의 변동이 크기 때문에 공정가액(기준가)의 상승 또는 하락의 정도가 가장 높고, 자동조기상환/만기상환 조건에서 멀어질수록 공정가액(기준가)의 상승 또는 하락의 정도가 줄어드는 경향이 있습니다.</p> <p>- 기초자산가격 변동성에 따른 위험: 기준일자 대비 기초자산의 변동성이 높을수록 공정가액(기준가)이 하락하는 경향이 있습니다.</p> <p>- 시간경과에 따른 위험: 잔존만기가 길수록 시간가치는 증가하고, 공정가액(기준가)이 하락하는 경향이 있습니다.</p> <p>- 이자율수준에 따른 위험: 이자율이 낮을수록 채권의 가치는 소폭 상승하지만 옵션의 가치는 하락하는 경향이 있습니다. 따라서 파생결합사채의 상품구조상 채권과 옵션의 비중에 따라 공정가액(기준가)이 상승 또는 하락할 수 있습니다.</p> <p>- 기초자산간 상관계수에 따른 위험 : 기초자산간 상관계수가 하락할수록 공정가액(기준가)이 하락하는 경향이 있습니다.</p>
이해상충구조에 따른 위험	<p>- 발행인은 본 증권과 관련하여 기초자산, 기초자산 구성종목, 기초자산 또는 기초자산 구성종목과 관련된 선물, 옵션 등 파생상품의 매매, 비거주자를 포함한 다른 기관과의 장외파생상품거래 등의 헷지거래를 수행할 수 있습니다. 이러한 <u>헷지거래로 인하여 기초자산의 가격이 변동될 수 있으며, 그 결과 본 증권의 상환금액에 영향을 미칠 수도 있습니다.</u></p> <p>특히, <u>발행인의 헷지거래에 의해 자동조기상환평가일 또는 만기평가일에는 기초자산의 대량매매가 이루어질 수 있으며, 그 중 만기평가일에는 기초자산 가치의 변동으로 인한 위험 관리 및 본 증권의 상환금액 확보를 위하여 발행인은 보유하고 있는 기초자산을 전부 또는 일부 매도할 수 있습니다.</u></p> <p>.</p> <p>- 발행인은 이러한 <u>헷지거래가 불공정거래 행위에 해당하지 않도록</u> 자체적으로 제정한 헷지거래 운용지침 및 한국거래소가 제정한 'ELS 기초주식의 공정시세 형성을 위한 헷지거래 가이드</p>

	라인'에 따라 <b>최선의 주의를 기울이고 있습니다.</b>
<b>발행인의 정상적인 영업활동이 미치는 영향</b>	<p>- 발행인은 금융투자업을 영위하는 금융기관으로서 현재 <b>일상적인 업무의 일환으로 증권의 인수, 중개 및 매매거래를 수행</b> 하고 있으며, 그 거래 대상에 본 증권의 기초자산, 기초자산 구성종목 또는 기초자산과 관련된 파생상품등이 포함될 수 있습니다. 이러한 거래는 발행인의 정상적인 영업활동의 일부이지만, <b>그러한 영업활동의 결과로 기초자산가격이 급격히 변동</b>될 수 있으며, <b>그에 따라 본 증권의 가치 또한 급격히 하락</b>할 수 있습니다. 발행인의 특수관계인 등 이해관계자들 역시 정상적인 영업활동의 일환으로서 기초자산, 기초자산 구성종목 또는 기초자산과 관련된 파생상품 등에 대한 매매거래를 수행할 수 있으며, 그로 인하여 기초자산가격 및 본 증권의 가치 등에 중대한 변동을 초래할 수 있습니다. 발행인 및 발행인의 이해관계자의 이러한 정상적인 거래활동이 결과적으로 본 증권의 투자자의 손익에 영향을 미칠 수 있습니다.</p>
<b>평가손실위험</b>	<p>- 본 증권과 같은 파생결합사채(주가연계파생결합사채)는 <b>만기 이전에 중도상환 요청이 있을 경우에 원금이 보장되지 않을 수 있으며, 보유기간 동안 증권의 시가평가를 하는 경우 평가손실을 초래</b>할 수 있습니다.</p>

## 2. 발행회사 위험

구 분	투자위험의 주요내용
<b>발행인의 재무, 손익상황과 관련한 위험</b>	<p>- 본 증권의 발행인이 속한 산업인 금융투자업은 증권시황 등의 움직임에 따라 수익성이 매우 민감하게 변동되는 손익의 변동성이 매우 높은 산업입니다. 이러한 금융투자업의 특성상 발행인의 재무, 손익상황 역시 매우 큰 변동성을 지니고 있으며, 동 업계의 경쟁이 점차 심화되고 국내외 경기마저 불투명한 관계로 발행인의 재무, 손익상황이 향후급격히 악화될 가능성도 배제할 수는 없습니다.</p> <p>- <b>본 증권은 발행인의 신용으로 발행</b>되는 무보증, 무담보 증권이므로 발행인의 재무, 손익상황이 본 증권의 상환에 중대한 영향을 미칠 수 있습니다. 따라서 발행인이 재무상태의 악화로 지급불능 상황에 처할 경우 투자자는 투자원금 및 투자수익 모두에 대하여 지급받지 못할 수 있다는 점을 유의하시기 바랍니다.</p> <p>- 본 증권과 관련하여 키움증권이 부담하게 되는 채무는 다른 무</p>

	<p>담보, 무보증 채권과 동일한 순위를 가집니다.</p> <p>- 발행인에 대한 보다 자세한 자료는 <b>발행인이 2024.11.13일자로 제출한 키움증권 제26기 3분기보고서의 기재내용 및 첨부서류를 참조</b>하시기 바랍니다.</p>
결제지연위험	<p>- 본 증권의 지급일에 지급이 이루어지지 않는 경우 발행인은 해당 지급액에 대하여 지급일 다음날부터 실제 지급일까지의 경과 기간에 대하여 시중은행 은행계정 대기업 원화대출에 적용되는 연체이자율 중 최고이율을 적용한 연체이자를 투자자에게 지급하게 됩니다. 단, 본 증권신고서에 따라 증권의 권리내용이 변경되어 지급일 등이 연기되었을 경우에는 그러하지 아니합니다.</p>

### 3. 조기종결 및 중도상환 위험

구분	투자위험의 주요내용
조기종결 위험	<p>- 상기 기초자산과 관련하여 권리내용을 조정함에도 불구하고 본 증권을 유지하기 어렵다고 발행회사가 판단하는 경우에는 본 증권을 만기이전에 조기종결할 수 있습니다. 이와 같은 증권의 조기종결사유 발생시 본 증권의 가격은 현저하게 하락할 수 있습니다.</p>
중도상환청구권 행사가 제한될 위험	<p>- 발행회사는 투자자가 본 증권의 매수를 요청하였으나 천재지변, 거래제한 등 불가피한 사유가 발생한 경우에는 이에 응하지 못할 수 있다는 점에서 본 증권의 환금성이 제한될 수 있으며, 투자시 이러한 점을 감안하시기 바랍니다.</p> <p>- 본 증권과 같이 환금성이 제한되어 있는 증권에 있어서 어떠한 조건 하에 만기 전 상황이 가능한지 여부는 매우 중요한 투자결정요인이 될 수 있습니다. 따라서, 투자자는 본 일괄신고추가서류에 기재된 각 사유에 따른 만기 전 상황의 내용을 사전에 충분히 숙지함으로써 만기 전 상황이 제한되는 제반 상황 및 만기 전 상황에 따른 상환금액 결정구조에 따른 위험을 고려하여 투자여부를 결정하여야 합니다.</p>
중도상환시 원금손실 위험	<p>- 투자자 요청으로 본 증권을 중도상환하는 경우 발행회사는 투자자의 중도상환 요청에 응해야 하며, 본 증권은 금융위원회의 퇴직연금감독규정[시행2023.11.16][금융위원회고시 제2023-56호, 2023.11.16., 일부개정]의 제3장 제8조의2 제2항 제나목에 따라, 동 목의 규정에 따른 투자자의 중도상환 요청 시 원금손실이 발생하지 않습니다.</p>

<p>중도상환가격 산정 관련 이해상충 위험 (계산대리인이 발행인인 경우)</p>	<p>- 본 증권의 투자자가 중도상환을 요청하는 경우 중도상환가격의 평가는 발행인이 하게 됩니다. 따라서 발행인의 지급액을 발행인이 계산하게 되는 이해상충리스크가 발생하게 되나, 발행인은 고객에 대한 신의성실의 의무에 따라 최대한 공정한 평가를 통하여 이해상충 위험을 최소화하고자 최선을 다하겠습니다.</p>
--	--

#### 4. 기타 투자위험

구 분	투자위험의 주요내용
일반적인 위험	<p>- 본 증권은 기초자산의 가격에 따라 본질가치가 변동되는 파생상품적 성격을 포함한 증권으로서, 원금 손실이 초래될 수 있을 뿐 아니라 주식 또는 채권 등과는 달리 복잡한 손익구조를 가지고 있습니다. 또한, 본 증권은 주식 또는 채권 등의 증권과는 달리 발행회사의 자금조달 목적보다는 발행회사가 투자자에 대하여 금융상품을 판매하기 위한 목적으로 설계됨으로써 본 증권 취득에 따른 권리의 내용이 다른 증권에 비하여 매우 복잡한 특성을 가지고 있습니다.</p> <p>- 따라서, 본 증권에 투자하기 위해서는 사전에 본 증권의 손익구조, 권리내용 및 제반 위험요인 등에 대한 본 일괄신고추가서류의 기재내용(특히 본 항에 기재된 투자위험에 관한 사항)을 충분히 숙지하신 후 최종적인 투자결정을 하여야만 하며, 이를 소홀히 한 채 투자가 행하여질 경우 예상했던 것과는 매우 다른 투자결과가 발생하는 투자위험이 따를 수 있습니다.</p> <p>- 본 투자위험에 관한 사항에 투자위험과 관련하여 가능한 한 상세하게 설명을 하였으나, 발행회사가 현재 인식하지 못하고 있거나 중요하지 않다고 판단하여 본 투자위험에 관한 사항에 기재하지 않은 내용이라 하더라도 본 증권의 거래 및 가격에 중대한 영향을 미칠 수 있는 요인이 존재할 수 있습니다. 그러므로, 투자자는 본 투자위험에 관한 사항에 기재된 내용을 기초로 본 증권에 투자하는 것이 투자자의 투자목적에 부합하는지 여부, 법률상 또는 세법상의 불이익은 없는지 여부 등 세부적인 제반 사항에 대한 검토를 통해 다양한 측면의 투자 위험을 고려하여 투자결정을 내려야 합니다.</p>
	<p>- 본 증권은 거래소시장 등 장내시장에서 거래되지 않으므로,</p>

<p><b>환금성 위험</b></p>	<p>본 증권을 취득하게 되는 투자자가 본 증권을 만기 이전에 처분 또는 양도하고자 하는 경우에는 장외거래를 통하여야만 합니다. 따라서 본 증권에 투자를 하는 경우 유동성이 극히 제한되어 만기 이전에는 본 증권을 현금화하는 것이 불가능할 수 있습니다.</p>
<p><b>세제 및 법률상 위험</b></p>	<p>본 증권과 관련하여 투자자가 얻게 되는 <b>발행가액 대비 초과소득은 관련세법에 따라 배당소득으로 간주되어 발행인이 소득세를 원천징수</b>하게 됩니다. 만기전 장외에서 매수하여 만기 상환 받는 경우에 <b>과세기준 금액은 매입금액 대비 초과소득으로 산정되는 것이 아니라 본 파생결합사채(주가연계파생결합사채)의 발행가액 기준으로 과세</b>되므로 주의하시기 바랍니다.</p> <p>한편, 투자자가 법인세법상 납세의무자인 경우 본 증권에서 발생하는 모든 소득(본 증권의 상환 및 발행회사가 만기일 이전에 중도매입하는 것이 증권의 내용이 되는 경우 그러한 중도매입에 따라 발생하는 소득을 모두 포함)에 대해서는 법인세법 등 관련 법령이 정한 바에 따라 과세가 이루어지게 되며, 법인세법 등 관련법령상 원천징수대상 소득이 아닌 한 발행회사는 원천징수를 하지 않습니다.</p> <p>본 증권의 투자자는 본 증권을 매입하고 보유함에 있어 요구되는 자격과 관리능력이 있어야하며, 필요한 경우 모든 사전 승인 절차를 거친후 투자하여야 합니다.</p> <p>본 증권의 투자자는 투자에 앞서 본 증권을 매입하거나 보유하는 것이 현행 법령, 법원의 판결이나 결정 및 명령, 투자자의 정관, 투자자가 당사자로 되어 있는 계약 등이 제한하는 바에 위배되지 않는지 여부를 확인하여야 합니다.</p>

## IV. 기초자산에 관한 사항

### 1. 기초자산의 명칭

삼성전자 보통주

### 2. 기초자산의 개요

#### (1) 삼성전자 보통주

동사는 한국 및 CE, IM부문 해외 9개 지역총괄과 DS부문 해외 5개 지역총괄, Harman 등 252개의 종속기업으로 구성된 글로벌 전자기업입니다.

세트사업에는 TV, 냉장고 등을 생산하는 CE부문과 스마트폰, 네트워크시스템, 컴퓨터 등을 생산하는 IM부문이 있습니다.

부품사업에서는 D램, 낸드 플래쉬, 모바일AP 등의 제품을 생산하는 반도체 사업과 TFT-LCD 및 OLED 디스플레이 패널을 생산하는 DP사업의 DS부문으로 구성되어 있습니다.

### 3. 지수산출기관 및 구성종목 거래소

#### (1) 삼성전자 보통주

- 한국거래소 주소 : 부산광역시 남구 문현금융로 40
- 한국거래소 홈페이지 : <http://www.krx.co.kr>

### 4. 기초자산 가격 및 기초자산에 대한 제반정보 취득방법

## (1) 기초자산의 가격정보

- 삼성전자 보통주 : 한국거래소, 한국거래소 홈페이지(<http://www.krx.co.kr>) 및 키움증권 홈페이지(<http://www.kiwoom.com>), 당사 HTS 영웅문4 [0101] 키움현재가 등에서 삼성전자 보통주의 가격에 관한 정보를 취득하실 수 있습니다.

## (2) 기초자산의 가격산출기관의 정보

- 삼성전자 보통주 : 기초자산 주식의 발행인인 삼성전자 주식회사 홈페이지(<http://www.samsung.com>), 상장기업분석 책자 및 한국거래소 자료실 등에서 삼성전자 보통주의 발행인에 관한 정보를 취득하실 수 있습니다.

## 5. 기초자산의 최근 20년간 가격변동 추이

가. 대상기간 : 2005년 01월 03일 ~ 2024년 12월 31일

나. 기간 중 최고치 (종가기준)

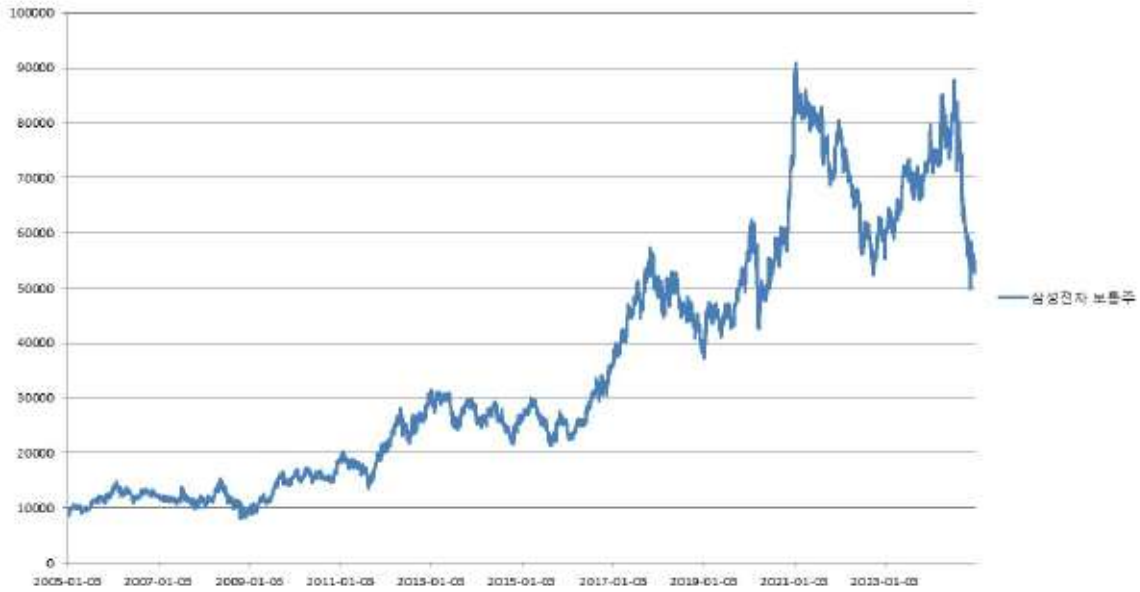
삼성전자 보통주 : 91,000.00 (2021년 01월 11일)

다. 기간 중 최저치 (종가기준)

삼성전자 보통주 : 8,150.00 (2008년 10월 24일)



### 삼성전자 보통주



삼성전자 보통주 변동추이

주1) 기초자산의 가격변동 추이와 파생결합사채의 수익구조는 상품의 구조별로 상이할 수 있습니다.

## 6. 주요 공시 사항(최근 6개월간)

### (1) 삼성전자 주식회사

번호	공시대상회사	보고서명	제출인	접수일자
1	삼성전자	[기재정정]기타경영사항(자율공시)	삼성전자	2024.12.23
2	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	김상하	2024.12.23
3	삼성전자	주식등의대량보유상황보고서(일반)	삼성물산	2024.12.20
4	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	홍준화	2024.12.19
5	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	송기재	2024.12.17
6	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	강종호	2024.12.12
7	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	김진철	2024.12.12
8	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	한기욱	2024.12.11

9	삼성전자	임원 · 주요주주특정증권등소유상황보고서	박상훈	2024.12.09
10	삼성전자	임원 · 주요주주특정증권등소유상황보고서	이석림	2024.12.09
11	삼성전자	임원 · 주요주주특정증권등소유상황보고서	CHONG DAVID TAKCHUNG	2024.12.06
12	삼성전자	임원 · 주요주주특정증권등소유상황보고서	박승일	2024.12.06
13	삼성전자	임원 · 주요주주특정증권등소유상황보고서	이명준	2024.12.06
14	삼성전자	임원 · 주요주주특정증권등소유상황보고서	전중원	2024.12.06
15	삼성전자	임원 · 주요주주특정증권등소유상황보고서	이상빈	2024.12.05
16	삼성전자	최대주주등소유주식변동신고서	삼성전자	2024.12.05
17	삼성전자	임원 · 주요주주특정증권등소유상황보고서	채수연	2024.12.05
18	삼성전자	임원 · 주요주주특정증권등소유상황보고서	김도형	2024.12.05
19	삼성전자	임원 · 주요주주특정증권등소유상황보고서	김원경	2024.12.05
20	삼성전자	임원 · 주요주주특정증권등소유상황보고서	박일한	2024.12.05
21	삼성전자	임원 · 주요주주특정증권등소유상황보고서	이창수	2024.12.04
22	삼성전자	임원 · 주요주주특정증권등소유상황보고서	김창수	2024.12.04
23	삼성전자	임원 · 주요주주특정증권등소유상황보고서	인우성	2024.12.04
24	삼성전자	임원 · 주요주주특정증권등소유상황보고서	이문근	2024.12.04
25	삼성전자	임원 · 주요주주특정증권등소유상황보고서	김형수	2024.12.04
26	삼성전자	임원 · 주요주주특정증권등소유상황보고서	류철우	2024.12.04
27	삼성전자	임원 · 주요주주특정증권등소유상황보고서	함민기	2024.12.04
28	삼성전자	임원 · 주요주주특정증권등소유상황보고서	하지훈	2024.12.04
29	삼성전자	임원 · 주요주주특정증권등소유상황보고서	류호열	2024.12.04
30	삼성전자	임원 · 주요주주특정증권등소유상황보고서	김동수	2024.12.04
31	삼성전자	임원 · 주요주주특정증권등소유상황보고서	임지운	2024.12.03
32	삼성전자	임원 · 주요주주특정증권등소유상황보고서	성중훈	2024.12.03
33	삼성전자	임원 · 주요주주특정증권등소유상황보고서	고상도	2024.12.03
34	삼성전자	임원 · 주요주주특정증권등소유상황보고서	이경우	2024.12.03
35	삼성전자	임원 · 주요주주특정증권등소유상황보고서	조원희	2024.12.03
36	삼성전자	임원 · 주요주주특정증권등소유상황보고서	문태화	2024.12.03
37	삼성전자	임원 · 주요주주특정증권등소유상황보고서	최중훈	2024.12.03
38	삼성전자	임원 · 주요주주특정증권등소유상황보고서	서재홍	2024.12.03
39	삼성전자	임원 · 주요주주특정증권등소유상황보고서	이지연	2024.12.03
40	삼성전자	임원 · 주요주주특정증권등소유상황보고서	홍정우	2024.12.03
41	삼성전자	임원 · 주요주주특정증권등소유상황보고서	인우성	2024.12.03
42	삼성전자	임원 · 주요주주특정증권등소유상황보고서	조성욱	2024.12.02
43	삼성전자	대규모기업집단현황공시[분기별공시(대표회사 용)]	삼성전자	2024.12.02

44	삼성전자	기타경영사항(자율공시)	삼성전자	2024.11.29
45	삼성전자	기타경영사항(자율공시)	삼성전자	2024.11.29
46	삼성전자	특수관계인에대한부동산매도	삼성전자	2024.11.29
47	삼성전자	특수관계인과의보험거래	삼성전자	2024.11.29
48	삼성전자	특수관계인과의보험거래	삼성전자	2024.11.29
49	삼성전자	[기재정정]특수관계인과의보험거래	삼성전자	2024.11.29
50	삼성전자	동일인등출자계열회사와의상품·용역거래	삼성전자	2024.11.29
51	삼성전자	[기재정정]임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	정연일	2024.11.27
52	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	박병수	2024.11.25
53	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	김용관	2024.11.22
54	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	박정호	2024.11.21
55	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	반효동	2024.11.20
56	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	김원경	2024.11.19
57	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	박철웅	2024.11.19
58	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	신현진	2024.11.19
59	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	이재호	2024.11.18
60	삼성전자	주요사항보고서(자기주식취득결정)	삼성전자	2024.11.18
61	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	최철환	2024.11.18
62	삼성전자	[기재정정]주요사항보고서(자기주식취득결정)	삼성전자	2024.11.18
63	삼성전자	수시공시의무관련사항(공정공시)	삼성전자	2024.11.15
64	삼성전자	주식등의대량보유상황보고서(일반)	삼성물산	2024.11.15
65	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	조미선	2024.11.15
66	삼성전자	분기보고서(2024.09)	삼성전자	2024.11.14
67	삼성전자	동일인등출자계열회사와의상품·용역거래변경	삼성전자	2024.11.14
68	삼성전자	동일인등출자계열회사와의상품·용역거래변경	삼성전자	2024.11.14
69	삼성전자	동일인등출자계열회사와의상품·용역거래변경	삼성전자	2024.11.14
70	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	윤준오	2024.11.14
71	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	안중현	2024.11.11
72	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	민현진	2024.11.11
73	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	민현진	2024.11.01
74	삼성전자	주요사항보고서(해외증권시장주권등상장결정)	삼성전자	2024.10.31
75	삼성전자	주요사항보고서(해외증권시장주권등상장폐지결정)	삼성전자	2024.10.31
76	삼성전자	기타경영사항(자율공시)	삼성전자	2024.10.31
77	삼성전자	기타경영사항(자율공시)	삼성전자	2024.10.31
78	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	조미선	2024.10.31

79	삼성전자	현금·현물배당결정	삼성전자	2024.10.31
80	삼성전자	장래사업·경영계획(공정공시)	삼성전자	2024.10.31
81	삼성전자	[기재정정]연결재무제표기준영업(잠정)실적(공정공시)	삼성전자	2024.10.31
82	삼성전자	연결재무제표기준영업(잠정)실적(공정공시)	삼성전자	2024.10.31
83	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	김원경	2024.10.30
84	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	조영준	2024.10.29
85	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	최청호	2024.10.29
86	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	김동욱	2024.10.29
87	삼성전자	최대주주등소유주식변동신고서	삼성전자	2024.10.28
88	삼성전자	주식등의대량보유상황보고서(일반)	삼성물산	2024.10.25
89	삼성전자	[기재정정]주식등의대량보유상황보고서(일반)	삼성물산	2024.10.25
90	삼성전자	[기재정정]주식등의대량보유상황보고서(일반)	삼성물산	2024.10.25
91	삼성전자	[기재정정]주식등의대량보유상황보고서(일반)	삼성물산	2024.10.25
92	삼성전자	[기재정정]주식등의대량보유상황보고서(일반)	삼성물산	2024.10.25
93	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	최경식	2024.10.25
94	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	박승희	2024.10.24
95	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	황보용	2024.10.22
96	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	김수목	2024.10.18
97	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	황상준	2024.10.16
98	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	안재용	2024.10.16
99	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	임전식	2024.10.15
100	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	반효동	2024.10.15
101	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	임전식	2024.10.15
102	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	반효동	2024.10.15
103	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	김한조	2024.10.11
104	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	노태문	2024.10.11
105	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	김한조	2024.10.11
106	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	노태문	2024.10.11
107	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	박훈철	2024.10.10
108	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	박훈철	2024.10.10
109	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	박훈철	2024.10.10
110	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	박훈철	2024.10.10
111	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	최진혁	2024.10.08
112	삼성전자	기업설명회(IR)개최(안내공시)	삼성전자	2024.10.08
113	삼성전자	연결재무제표기준영업(잠정)실적(공정공시)	삼성전자	2024.10.08
114	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	최진혁	2024.10.08

115	삼성전자	기업설명회(IR)개최(안내공시)	삼성전자	2024.10.08
116	삼성전자	연결재무제표기준영업(잠정)실적(공정공시)	삼성전자	2024.10.08
117	삼성전자	최대주주등소유주식변동신고서	삼성전자	2024.10.07
118	삼성전자	최대주주등소유주식변동신고서	삼성전자	2024.10.07
119	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	박용인	2024.10.04
120	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	박형신	2024.10.04
121	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	윤주한	2024.09.27
122	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	윤태양	2024.09.27
123	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	최완우	2024.09.27
124	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	김홍경	2024.09.27
125	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	송재혁	2024.09.27
126	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	남석우	2024.09.27
127	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	최시영	2024.09.27
128	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	이정배	2024.09.27
129	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	전영현	2024.09.27
130	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	최경식	2024.09.27
131	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	김수목	2024.09.26
132	삼성전자	[기재정정]임원·주요주주특정증권등소유상황 보고서	윤준오	2024.09.26
133	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	윤성호	2024.09.25
134	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	김병도	2024.09.25
135	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	안재용	2024.09.24
136	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	박순철	2024.09.23
137	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	최주호	2024.09.23
138	삼성전자	주식등의대량보유상황보고서(일반)	삼성물산	2024.09.20
139	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	김대주	2024.09.20
140	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	용석우	2024.09.20
141	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	이영희	2024.09.20
142	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	손태용	2024.09.20
143	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	이종우	2024.09.19
144	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	정용준	2024.09.19
145	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	박학규	2024.09.12
146	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	노태문	2024.09.10
147	삼성전자	최대주주등소유주식변동신고서	삼성전자	2024.09.06
148	삼성전자	주식등의대량보유상황보고서(일반)	삼성물산	2024.09.06
149	삼성전자	임원·주요주주특정증권등소유상황보고서	한중희	2024.09.06
		대규모기업집단현황공시[분기별공시(대표회사		

150	삼성전자	용]	삼성전자	2024.09.02
151	삼성전자	임원 · 주요주주특정증권등소유상황보고서	오문욱	2024.08.28
152	삼성전자	임원 · 주요주주특정증권등소유상황보고서	박태훈	2024.08.26
153	삼성전자	주식등의대량보유상황보고서(일반)	삼성물산	2024.08.16
154	삼성전자	동일인등출자계열회사와의상품 · 용역거래변경	삼성전자	2024.08.14
155	삼성전자	동일인등출자계열회사와의상품 · 용역거래변경	삼성전자	2024.08.14
156	삼성전자	동일인등출자계열회사와의상품 · 용역거래변경	삼성전자	2024.08.14
157	삼성전자	지급수단별 · 지급기간별지급금액및분쟁조정기 구에관한사항	삼성전자	2024.08.14
158	삼성전자	반기보고서 (2024.06)	삼성전자	2024.08.14
159	삼성전자	[기재정정]임원 · 주요주주특정증권등소유상황 보고서	고현목	2024.08.14
160	삼성전자	임원 · 주요주주특정증권등소유상황보고서	고현목	2024.08.13
161	삼성전자	임원 · 주요주주특정증권등소유상황보고서	정용준	2024.08.07
162	삼성전자	최대주주등소유주식변동신고서	삼성전자	2024.08.06
163	삼성전자	주식등의대량보유상황보고서(일반)	삼성물산	2024.08.02
164	삼성전자	임원 · 주요주주특정증권등소유상황보고서	Sohn Sug Je	2024.08.01
165	삼성전자	기타경영상황(자율공시)	삼성전자	2024.07.31
166	삼성전자	특수관계인과의보험거래	삼성전자	2024.07.31
167	삼성전자	특수관계인과의보험거래	삼성전자	2024.07.31
168	삼성전자	특수관계인에대한증여	삼성전자	2024.07.31
169	삼성전자	특수관계인에대한증여	삼성전자	2024.07.31
170	삼성전자	현금 · 현물배당결정	삼성전자	2024.07.31
171	삼성전자	[기재정정]연결재무제표기준영업(잠정)실적(공 정공시)	삼성전자	2024.07.31
172	삼성전자	연결재무제표기준영업(잠정)실적(공정공시)	삼성전자	2024.07.31
173	삼성전자	주식등의대량보유상황보고서(일반)	삼성물산	2024.07.26
174	삼성전자	주식등의대량보유상황보고서(일반)	삼성물산	2024.07.19
175	삼성전자	최대주주등소유주식변동신고서	삼성전자	2024.07.05
176	삼성전자	기업설명회(IR)개최(안내공시)	삼성전자	2024.07.05
177	삼성전자	연결재무제표기준영업(잠정)실적(공정공시)	삼성전자	2024.07.05

기초자산의 공시에 관한 보다 자세한 사항은 금융감독원 전자공시사이트(<http://dart.fss.or.kr/>)에서 확인할 수 있습니다.

## 7. 기타사항

본 증권은 발행과 관련하여 발행인인 키움증권은 투자자에게 투자기간 중 각 기초자산가격의 변동에 대하여 어떠한 전망이나 특정수준을 보장하지 않습니다.

## V. 인수인의 의견

본 증권은 키움증권 주식회사가 직접 모집하므로 별도의 주관회사를 두지 아니합니다. 따라서, 본 증권의 분석 및 가격 결정 등에 관한 사항은 발행인의 의사에 따라 정하여졌습니다.



## VI. 자금의 사용목적

### 1. 자금조달의 개요 및 제비용

(단위 : 원)

구분	금액
모집 또는 매출총액 (1)	50,000,000,000원
발행제비용 (2)	2,500,000원
순수입금 [ (1)-(2) ]	49,997,500,000원

※ 발행금액을 500억원으로 가정했을 경우의 수치입니다. 청약금액이 모집금액의 100%에 미달할 경우에는 청약금액 만을 발행하므로 실제로는 변경될 수 있습니다.

### 2. 조달된 자금의 운용계획

키움증권 주식회사는 향후 발행조건에 의한 상환금의 안정적인 지급을 위하여, 당해 증권의 발행으로 조달된 자금 일부 또는 전체를 기초자산 거래, 장내외 파생상품 거래 등의 위험회피거래(헷지거래) 및 금융투자상품 투자에 사용할 계획입니다. 본 증권의 공모를 통해 조달하는 자금은 상품의 고유특성에 맞지 않는 투자위험에 노출되지 않도록 발행회사의 내부통제절차 및 시스템에 의하여 지속적으로 통제, 관리될 것입니다.

## Ⅶ. 그 밖에 투자자보호를 위해 필요한 사항

### 1. 발행회사의 파생상품관련 현황

#### 가. 파생결합증권/파생결합사채 발행총계표 (2024년 12월 31일 현재)

(단위: 억원)

구분			ELS/ELB						DLS/DLB						
			발행총계			발행잔액			발행총계			발행잔액			
			공모	사모	계	공모	사모	계	공모	사모	계	공모	사모	계	
원금 지급형	2021년	건	77	1	78	-	-	-	24	3	27	-	-	-	
		금액	24,766	200	24,966	-	-	-	3,828	2	3,830	-	-	-	
	2022년	건	110	7	117	2	-	2	18	2	20	-	-	-	
		금액	20,945	10	20,955	32	-	32	6,626	222	6,848	-	-	-	
	2023년	건	292	1	293	56	-	56	22	3	25	9	-	9	
		금액	25,335	8	25,343	1,153	-	1,153	3,574	400	3,974	1,260	-	1,260	
	2024년	건	271	-	271	199	-	199	8	-	8	5	-	5	
		금액	18,200	-	18,200	16,919	-	16,919	227	-	227	114	-	114	
	합계	건	750	9	759	257	-	257	72	8	80	14	-	14	
		금액	89,245	218	89,463	18,104	-	18,104	14,255	624	14,878	1,374	-	1,374	
	원금 비보장형	2021년	건	404	-	404	-	-	-	3	-	3	-	-	-
			금액	5,742	-	5,742	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2022년		건	584	-	584	6	-	6	3	-	3	-	-	-	
		금액	7,898	-	7,898	30	-	30	-	-	-	-	-	-	
2023년		건	844	4	848	56	-	56	3	-	3	-	-	-	
		금액	12,747	9	12,756	480	-	480	-	-	-	-	-	-	
2024년		건	733	-	733	391	-	391	3	-	3	3	-	3	
		금액	9,781	-	9,781	6,023	-	6,023	-	-	-	-	-	-	
합계		건	2565	4	2569	453	-	453	12	-	12	3	-	3	
		금액	36,168	9	36,177	6,534	-	6,534	-	-	-	-	-	-	
			건	481	1	482	-	-	-	27	3	30	-	-	-

합계	2021년	금액	30,508	200	30,708	-	-	-	3,828	2	3,830	-	-	-
	2022년	건	694	7	701	8	-	8	21	2	23	-	-	-
		금액	28,843	10	28,853	63	-	63	6,626	222	6,848	-	-	-
	2023년	건	1136	5	1141	112	-	112	25	3	28	9	-	9
		금액	38,082	17	38,099	1,633	-	1,633	3,574	400	3,974	1,260	-	1,260
	2024년	건	1004	-	1004	590	-	590	11	-	11	8	-	8
		금액	27,981	-	27,981	22,943	-	22,943	227	-	227	114	-	114
	합계	건	3315	13	3328	710	-	710	84	8	92	17	-	17
		금액	125,413	227	125,641	24,639	-	24,639	14,255	624	14,879	1,374	-	1,374

구분			ELW						ETN					
			발행총계			발행잔액			발행총계			발행잔액		
			공모	사모	계	공모	사모	계	공모	사모	계	공모	사모	계
원금 지급형	2021년	건	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
		금액	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	2022년	건	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
		금액	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	2023년	건	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
		금액	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	2024년	건	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
		금액	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	합계	건	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
		금액	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
원금 비보장형	2021년	건	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
		금액	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	2022년	건	-	-	-	-	-	-	8	-	8	4	-	4
		금액	-	-	-	-	-	-	2,600	-	2,600	800	-	800
	2023년	건	-	-	-	-	-	-	3	-	3	3	-	3
		금액	-	-	-	-	-	-	700	-	700	700	-	700
	2024년	건	-	-	-	-	-	-	13	-	13	13	-	13
		금액	-	-	-	-	-	-	5,000	-	5,000	5,000	-	5,000
	합계	건	-	-	-	-	-	-	24	-	24	20	-	20
		금액	-	-	-	-	-	-	8,300	-	8,300	6,500	-	6,500
2021년	건	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
	금액	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	

합계	2022년	건	-	-	-	-	-	-	8	-	8	4	-	4
		금액	-	-	-	-	-	-	2,600	-	2,600	800	-	800
	2023년	건	-	-	-	-	-	-	3	-	3	3	-	3
		금액	-	-	-	-	-	-	700	-	700	700	-	700
	2024년	건	-	-	-	-	-	-	13	-	13	13	-	13
		금액	-	-	-	-	-	-	5,000	-	5,000	5,000	-	5,000
	합계	건	-	-	-	-	-	-	24	-	24	20	-	20
		금액	-	-	-	-	-	-	8,300	-	8,300	6,500	-	6,500

나. 신용환산액 (2024. 12. 31 기준)

거래상대방명	ELS/ELB	ELW	기타파생상품	계
기타	53,145,648,850	-	3,145,403,654	56,291,052,504
합계	53,145,648,850	-	3,145,403,654	56,291,052,504

(신용환산액이 자본의 5% 이상인 거래상대방 : 해당사항 없음)

주1) 신용환산액이란 거래상대방의 상황이 악화되어 증권회사가 입을 수 있는 손실을 계량화한 수치입니다. 신용환산액 = 대체비용 + (명목원금 × 신용환산율) 의 공식에 따라 계산하며, 자기자본 대비 5% 이상인 경우에만 기재합니다.

주2) 신용환산율은 거래 종류 및 잔존만기에 따라 아래 표와 같이 결정됩니다.

잔존기간	거래 종류			
	금리관련계약	통화계약	주식	기타
1년이하	0.0%	1.0%	6.0%	10.0%
1년초과 5년이하	0.5%	5.0%	8.0%	12.0%

5년초과	1.5%	7.5%	10.0%	15.0%
------	------	------	-------	-------

주3) 'ELS+ELB+ELW+DLS+DLB' 신용환산액이 자기자본의 5% 이상인 상대방만 표시하고 나머지 신용환산액은 기타로 합산하여 기재

예) 거래상대방 A에 판매한 만기 3년 짜리 ELS(100억원)을 헤지하기 위해 BTB거래 상대방 B로부터 옵션을 사왔을 경우

신용환산액 = 대체비용 (=시가평가 95억) + (명목금액 100억원 × 신용환산율 8%) = 103억

## 2. 세금에 관한 사항

가. 본 증권을 취득한 투자자가 소득세법상 납세의무자인 경우 본 증권과 관련하여 투자자가 얻게 되는 발행가액 대비 초과소득은 관련세법에 따라 배당소득으로 간주되어 발행인이 소득세를 원천징수하게 됩니다. 만기전 장외에서 매수하여 만기상환 받는 경우에 과세기준 금액은 매입금액 대비 초과소득으로 산정되는 것이 아니라 본 파생결합사채(주가연계파생결합사채)의 발행가액 기준으로 과세되므로 주의하시기 바랍니다.

나. 본 증권을 취득한 투자자가 법인세법상 납세의무자인 경우 본 증권에서 발생하는 모든 소득(만기상환 및 발행인이 만기일 이전에 중도매입하는 것이 증권의 내용이 되는 경우 그러한 중도매입에 따라 발생하는 소득을 모두 포함)에 대해서는 법인세법 등 관련법령이 정한 바에 따라 과세가 이루어지게 되며, 법인세법 등 관련법령상 원천징수대상 소득이 아닌 한 발행인은 원천징수를 하지 않습니다.

## 【 전문가의 확인 】

### 1. 전문가의 확인

- 해당사항 없음

### 2. 전문가와의 이해관계

- 해당사항 없음