

1.

ประมาณการผลตอบแทนของหุ้นกู้ที่มีอนุพันธ์แฝงอ้างอิงอัตราดอกเบี้ย
ttb Interest Rate Linked Note Performance Update

Interest Rate Linked Note - ข้อมูลผลิตภัณฑ์



Product	อายุหุ้นกู้	อัตราผลตอบแทน*	การจ่าย ผลตอบแทน	วันที่ออกหุ้นกู้	วันครบกำหนด
Inverse Floater Note รุ่นที่ 1	3 ปี	7.7% - (2 x THOR)	ทุกๆ 3 เดือน	23 พ.ย. 2566	23 พ.ย. 2569
Inverse Floater Note รุ่นที่ 2	5 ปี	7.1% - (2 x THOR)		22 ธ.ค. 2566	22 ธ.ค. 2571
Callable Range Accrual รุ่นที่ 1	5 ปี (ธนาคารมีสิทธิ์ไถ่ถอน ณ สิ้นปีที่ 2)	<u>3.5% หากดอกเบี้ยอ้างอิง อยู่ในกรอบที่กำหนด 1.45-2.65</u>		20 มิ.ย. 2567	20 มิ.ย. 2572
Callable Range Accrual รุ่นที่ 2		<u>0.25% หากอัตราดอกเบี้ยอ้างอิง อยู่นอกกรอบที่กำหนด 1.45-2.65</u>		08 ก.ค. 2567	09 ก.ค. 2572
USD - Callable Range Accrual รุ่นที่ 3	2 ปี (ธนาคารมีสิทธิ์ไถ่ถอน ณ สิ้นปีที่ 1)	<u>5.0% หากดอกเบี้ยอ้างอิง อยู่ในกรอบที่กำหนด 3.00-5.00</u> <u>0.50% หากอัตราดอกเบี้ยอ้างอิง อยู่นอกกรอบที่กำหนด 3.00-5.00</u>		30 ต.ค. 2567	30 ต.ค. 2569

*ผลตอบแทนก่อนหักภาษี ณ ที่จ่าย 15%

ผลการดำเนินการล่าสุด Inverse Floater Note รุ่นที่ 1



อัตราดอกเบี้ยอ้างอิง	อัตราผลตอบแทน	อัตราผลตอบแทนขั้นต่ำ	การจ่ายผลตอบแทน	อายุหุ้นกู้	วันที่ออกหุ้นกู้	วันครบกำหนดหุ้นกู้ (23 พ.ย. 2569)
3M THOR Average	7.7% - (2 x THOR)	0%	ทุกๆ 3 เดือน	36 เดือน	23 พ.ย. 2566	

งวด	จำนวนวันในงวด	วันจ่ายผลตอบแทน	3 Months THOR Compounding	ผลตอบแทน (ก่อนหักภาษี)
1	92 วัน	23 ก.พ. 2567	2.50061%	2.69878%
2	90 วัน	23 พ.ค. 2567	2.50041%	2.69918%
3	92 วัน	23 ส.ค. 2567	2.49920%	2.70160%

ผู้ลงทุนสามารถติดตามความเคลื่อนไหวของดัชนีได้ที่ <http://app.bot.or.th/THOR/en>

ผลการดำเนินการล่าสุด Inverse Floater Note รุ่นที่ 2



อัตราดอกเบี้ยอ้างอิง	อัตราผลตอบแทน	อัตราผลตอบแทนขั้นต่ำ	การจ่ายผลตอบแทน	อายุหุ้นกู้	วันที่ออกหุ้นกู้	วันครบกำหนดหุ้นกู้ (22 ธ.ค. 2571)
3M THOR Average	7.1% - (2 x THOR)	0%	ทุกๆ 3 เดือน	60 เดือน	22 ธ.ค. 2566	

งวด	จำนวนวันในงวด	วันจ่ายผลตอบแทน	3 Months THOR Compounding	ผลตอบแทน (ก่อนหักภาษี)
1	91 วัน	22 มี.ค. 2567	2.50093%	2.09814%
2	94 วัน	24 มี.ย. 2567	2.50015%	2.0997%
3	91 วัน	23 ก.ย. 2567	2.49827%	2.10346%

ผู้ลงทุนสามารถติดตามความเคลื่อนไหวของดัชนีได้ที่ <http://app.bot.or.th/THOR/en>

ผลการดำเนินการล่าสุด Callable Range Accrual Note รุ่นที่ 1



อัตราดอกเบี้ย อ้างอิง	กรอบอัตรา ดอกเบี้ยอ้างอิง (Range)	ผลตอบแทน กรณีอัตรา ดอกเบี้ยอ้างอิง อยู่ใน Range	ผลตอบแทน กรณีอัตรา ดอกเบี้ยอ้างอิง อยู่นอก Range	การจ่าย ผลตอบแทน	อายุหุ้นกู้	วันที่ออกหุ้นกู้	วันครบกำหนด หุ้นกู้ (20 มิ.ย. 2572)
3M THOR Average	1.45 – 2.65%	3.50%	0.25%	ทุกๆ 3 เดือน	5 ปี (ธนาคารมีสิทธิได้ ถอน ณ สิ้นปีที่ 2 เป็นต้นไป)	20 มิ.ย. 2567	

งวด	จำนวนวันในงวด	จำนวนวันที่อัตราดอกเบี้ย อ้างอิงเคลื่อนไหวอยู่ ใน Range	จำนวนวันที่อัตราดอกเบี้ย อ้างอิงเคลื่อนไหวอยู่ นอก Range	วันจ่ายผลตอบแทน	ผลตอบแทน (ก่อนหัก ภาษี)
1	92 วัน	92 วัน	-	20 ก.ย. 2567	3.50%

ผลการดำเนินการล่าสุด Callable Range Accrual Note รุ่นที่ 2



อัตราดอกเบี้ย อ้างอิง	กรอบอัตรา ดอกเบี้ยอ้างอิง (Range)	ผลตอบแทน กรณีอัตรา ดอกเบี้ยอ้างอิง อยู่ ใน Range	ผลตอบแทน กรณีอัตรา ดอกเบี้ยอ้างอิง อยู่ นอก Range	การจ่าย ผลตอบแทน	อายุหุ้นกู้	วันที่ออกหุ้นกู้	วันครบกำหนด หุ้นกู้ (09 ก.ค. 2572)
3M THOR Average	1.45 – 2.65%	3.50%	0.25%	ทุกๆ 3 เดือน	5 ปี (ธนาคารมีสิทธิได้ ถอน ณ สิ้นปีที่ 2 เป็นต้นไป)	08 ก.ค. 2567	

งวด	จำนวนวันในงวด	จำนวนวันที่อัตราดอกเบี้ย อ้างอิงเคลื่อนไหวอยู่ ใน Range	จำนวนวันที่อัตราดอกเบี้ย อ้างอิงเคลื่อนไหวอยู่ นอก Range	วันจ่ายผลตอบแทน	ผลตอบแทน (ก่อนหัก ภาษี)
1	92 วัน	92 วัน	-	08 ตุลาคม 2567	3.50%

ผลการดำเนินการล่าสุด USD Callable Range Accrual Note รุ่นที่ 3



อัตราดอกเบี้ย อ้างอิง	กรอบอัตรา ดอกเบี้ยอ้างอิง (Range)	ผลตอบแทน กรณีอัตรา ดอกเบี้ยอ้างอิง อยู่ ใน Range	ผลตอบแทน กรณีอัตรา ดอกเบี้ยอ้างอิง อยู่ นอก Range	การจ่าย ผลตอบแทน	อายุหุ้นกู้	วันที่ออกหุ้นกู้	วันครบกำหนด หุ้นกู้ (30 ต.ค. 2569)
SOFR	3.00 – 5.00%	5.00%	0.50%	ทุกๆ 3 เดือน	2 ปี (ธนาคารมีสิทธิได้ ถอน ณ สิ้นปีที่ 1 เป็นต้นไป)	30 ต.ค. 2567	

งวด	จำนวนวันในงวด	จำนวนวันที่อัตราดอกเบี้ย อ้างอิงเคลื่อนไหวอยู่ ใน Range	จำนวนวันที่อัตราดอกเบี้ย อ้างอิงเคลื่อนไหวอยู่ นอก Range	วันจ่ายผลตอบแทน	ผลตอบแทน (ก่อนหัก ภาษี)
1	-	-	-	-	-

ผู้ลงทุนสามารถติดตามความเคลื่อนไหวของดัชนีได้ที่ <https://www.newyorkfed.org/markets/reference-rates/sofr>