Price Calculation

SET5027C2412B

RHB Derivative Warrant 27

S50U24 (Bid Price)	SET5027C2412B						
	03 Jul 24	04 Jul 24	05 Jul 24	08 Jul 24	09 Jul 24	10 Jul 24	11 Jul 24
777.00	0.17	0.17	0.16	0.15	0.15	0.15	0.15
778.00	0.17	0.17	0.17	0.16	0.16	0.15	0.15
779.00	0.18	0.18	0.17	0.16	0.16	0.16	0.16
780.00	0.18	0.18	0.18	0.17	0.17	0.16	0.16
781.00	0.19	0.19	0.18	0.17	0.17	0.17	0.16
782.00	0.20	0.19	0.19	0.18	0.18	0.17	0.17
783.00	0.20	0.20	0.19	0.18	0.18	0.18	0.17
784.00	0.21	0.20	0.20	0.19	0.19	0.18	0.18
785.00	0.21	0.21	0.21	0.20	0.19	0.19	0.19
786.00	0.22	0.22	0.21	0.20	0.20	0.19	0.19
787.00	0.23	0.22	0.22	0.21	0.20	0.20	0.20
788.00	0.23	0.23	0.22	0.21	0.21	0.21	0.20
789.00	0.24	0.23	0.23	0.22	0.22	0.21	0.21
790.00	0.25	0.24	0.24	0.23	0.22	0.22	0.21
791.00	0.25	0.25	0.24	0.23	0.23	0.22	0.22
792.00	0.26	0.26	0.25	0.24	0.24	0.23	0.23
793.00	0.27	0.26	0.26	0.25	0.24	0.24	0.23
794.00	0.27	0.27	0.27	0.25	0.25	0.24	0.24
795.00	0.28	0.28	0.27	0.26	0.26	0.25	0.25
796.00	0.29	0.28	0.28	0.27	0.26	0.26	0.25
797.00	0.30	0.29	0.29	0.27	0.27	0.27	0.26
798.00	0.31	0.30	0.30	0.28	0.28	0.27	0.27
799.00	0.31	0.31	0.30	0.29	0.29	0.28	0.28
800.00	0.32	0.32	0.31	0.30	0.29	0.29	0.28
801.00	0.33	0.33	0.32	0.31	0.30	0.30	0.29
802.00	0.34	0.33	0.33	0.31	0.31	0.30	0.30
803.00	0.35	0.34	0.34	0.32	0.32	0.31	0.31
804.00	0.36	0.35	0.35	0.33	0.33	0.32	0.32
805.00	0.37	0.36	0.36	0.34	0.34	0.33	0.33
806.00	0.38	0.37	0.37	0.35	0.34	0.34	0.33
807.00	0.39	0.38	0.38	0.36	0.35	0.35	0.34
808.00	0.40	0.39	0.38	0.37	0.36	0.36	0.35
809.00	0.41	0.40	0.39	0.38	0.37	0.37	0.36

DW Specification		Indicators	
DW Name	**SET5027C2412B**	Moneyness *	**-18.64% OTM**
Underlying	**S50U24**	Effective Gearing *	**21.66**
Type	**Call**	Sensitivity	**0.73**
Exercise Price	**975.000**	Implied Volatility	**16.5%**
Conversion Ratio	**7.00000**	Time to Last Trading Date	**177**
Last Trading Date	**27 Dec 2024**	Time Decay % per Day *	**-1.59%**
Expiry Date	**03 Jan 2025**	Time Decay THB per Day *	**-0.0042**

* Calculated from underlying price at 793 Baht as of 02 July 2024

Historical Volatility: 10.88%

DW27 contact: Tel. 02 088 9750, Email: DW27@rhbgroup.com , Line: @DW27