

รายงานสถานะการลงทุนการกู้ยืมเงินและการก่อภาระผูกพัน

กองทุนเปิดกรุงไทยตราสารหนี้ เอฟไอเอฟ 142

มูลค่า ณ วันที่ 30 มีนาคม 2561

รายละเอียดการลงทุน	มูลค่าตามราคาตลาด	%NAV
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ	12,059,806.29	0.55
เงินฝากธนาคาร		
อันดับความน่าเชื่อถือ : AAA	12,059,806.29	0.55
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินต่างประเทศ	2,014,511,394.07	91.21
เงินฝากธนาคาร		
อันดับความน่าเชื่อถือ : A	1,727,112,630.35	78.19
ตราสารภาคเอกชนต่างประเทศ	287,398,763.72	13.01
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า		
สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน เพื่อป้องกันความเสี่ยง (Hedging)		
สัญญาสวอป/ สัญญาฟอร์เวิร์ด มี 4 คู่สัญญา		
- ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน) อันดับความน่าเชื่อถือ : AAA		
- ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน) (KBANK) อันดับความน่าเชื่อถือ : AA+		
- ธนาคารเจพีมอร์แกน เชส อันดับความน่าเชื่อถือ : A		
- ธนาคารทหารไทย จำกัด (มหาชน) (TMB) อันดับความน่าเชื่อถือ : A+		
กำไร/ ขาดทุนจากสัญญา	192,127,306.12	8.70
อื่นๆ	-9,952,982.25	-0.45
ประเภทรายการค้างจ่ายหรือหนี้สินอื่นๆ		
	-9,952,982.25	-0.45
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ	2,208,745,524.23	100.00