รายงานสถานะการลงทุนการกู้ยืมเงินและการก่อภาระผูกพัน

กองทุนเปิดกรุงไทยตราสารหนี้ เอฟไอเอฟ 166

มูลค่า ณ วันที่ 29 ธันวาคม 2560

รายละเอียดการลงทุน	มูลค่าตามราคาตลาด	%NAV
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ	4,278,697.03	0.07
เงินฝากธนาคาร		
อันดับความน่าเชื่อถือ : AAA	386,946.56	0.01
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย		
อายุคงเหลือน้อยกว่า 1 ปี	3,891,750.47	0.06
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินต่างประเทศ	6,087,423,951.13	98.28
เงินฝากธนาคาร		
อันดับความน่าเชื่อถือ : A	2,312,387,752.78	37.33
บัตรเงินฝาก		
อันดับความน่าเชื่อถือ : AAA	2,283,791,510.00	36.87
อันดับความน่าเชื่อถือ : A	1,062,630,882.72	17.16
อันดับความน่าเชื่อถือ : BBB	428,613,805.63	6.92
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า		
สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน เพื่อป้องกันความเสี่ยง (Hedging)		
สัญญาสวอป/ สัญญาฟอร์เวิร์ด มี 3 คู่สัญญา		
- ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน) (KTB) อันดับความน่าเชื่อถือ : AA+		
- ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน) อันดับความน่าเชื่อถือ : AAA		
- ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน) (SCB) อันดับความน่าเชื่อถือ : AA+		
กำไร/ ขาดทุนจากสัญญา	108,026,239.74	1.74
อื่น ๆ	-5,913,103.91	-0.10
ประเภทรายการค้างจ่ายหรือหนี้สินอื่น ๆ		
	-5,913,103.91	-0.10
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ	6,193,815,783.99	100.00