

รายงานสถานะการลงทุนการกู้ยืมเงินและการก่อภาระผูกพัน

กองทุนเปิดกรุงไทยตราสารหนี้ เอฟไอเอฟ 190

มูลค่า ณ วันที่ 28 ธันวาคม 2561

รายละเอียดการลงทุน	มูลค่าตามราคาตลาด	%NAV
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ	108,151,996.82	5.19
เงินฝากธนาคาร		
อันดับความน่าเชื่อถือ : A	206,649.70	0.01
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย		
อายุคงเหลือน้อยกว่า 1 ปี	107,945,347.12	5.19
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินต่างประเทศ	1,947,199,129.47	93.53
เงินฝากธนาคาร		
อันดับความน่าเชื่อถือ : AAA	389,373,822.22	18.70
อันดับความน่าเชื่อถือ : A	1,168,616,867.09	56.13
บัตรเงินฝาก		
อันดับความน่าเชื่อถือ : AA	389,208,440.16	18.70
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า		
สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน เพื่อป้องกันความเสี่ยง (Hedging)		
สัญญาสวอป/ สัญญาฟอร์เวิร์ด มี 3 คู่สัญญา		
- ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน) อันดับความน่าเชื่อถือ : AAA		
- ธนาคารเจพีมอร์แกน เชส อันดับความน่าเชื่อถือ : A		
- ธนาคารทหารไทย จำกัด (มหาชน) (TMB) อันดับความน่าเชื่อถือ : AA-		
กำไร/ ขาดทุนจากสัญญา	32,178,944.67	1.55
อื่นๆ	-5,660,394.63	-0.27
ประเภทรายการค้างจ่ายหรือหนี้สินอื่นๆ		
	-5,660,394.63	-0.27
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ	2,081,869,676.33	100.00