รายงานสถานะการลงทุนการกู้ยืมเงินและการก่อภาระผูกพัน

กองทุนเปิดกรุงไทยตราสารหนี้ เอฟไอเอฟ 199

มูลค่า ณ วันที่ 28 ธันวาคม 2561

รายละเอียดการลงทุน	มูลค่าตามราคาตลาด	%NAV
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ	8,080,140.75	0.78
เงินฝากธนาคาร		
อันดับความน่าเชื่อถือ : A	108,972.36	0.01
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย		
อายุคงเหลือน้อยกว่า 1 ปี	7,971,168.39	0.77
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินต่างประเทศ	1,024,077,913.70	98.65
เงินฝากธนาคาร		
อันดับความน่าเชื่อถือ : AAA	190,237,548.09	18.33
อันดับความน่าเชื่อถือ : A	647,452,106.36	62.37
บัตรเงินฝาก		
อันดับความน่าเชื่อถือ : A	186,388,259.25	17.96
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า		
สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน เพื่อป้องกันความเสี่ยง (Hedging)		
สัญญาสวอป/ สัญญาฟอร์เวิร์ด มี 4 คู่สัญญา		
- ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน) อันดับความน่าเชื่อถือ : AAA		
- ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน) (KBANK) อันดับความน่าเชื่อถือ : AA+		
- ธนาคารทหารไทย จำกัด (มหาชน) (TMB) อันดับความน่าเชื่อถือ : AA-		
- ธนาคารยูโอบี จำกัด (มหาชน) อันดับความน่าเชื่อถือ : AAA		
กำไร/ ขาดทุนจากสัญญา	7,220,384.40	0.70
อื่น ๆ	-1,305,841.21	-0.13
ประเภทรายการค้างจ่ายหรือหนี้สินอื่น ๆ		
	-1,305,841.21	-0.13
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ	1,038,072,597.64	100.00