

รายงานสถานะการลงทุนการกู้ยืมเงินและการก่อภาระผูกพัน
กองทุนเปิดกรุงไทยตราสารหนี้ เอฟไอเอฟ 237
มูลค่า ณ วันที่ 30 กันยายน 2562

รายละเอียดการลงทุน	มูลค่าตามราคาตลาด	%NAV
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ	599,232,369.07	15.00
เงินฝากธนาคาร		
อันดับความน่าเชื่อถือ : AAA	681,036.59	0.02
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย		
อายุคงเหลือน้อยกว่า 1 ปี	598,551,332.48	14.98
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินต่างประเทศ	3,362,079,632.25	84.15
เงินฝากธนาคาร		
อันดับความน่าเชื่อถือ : AAA	301,097,972.88	7.54
อันดับความน่าเชื่อถือ : AA	753,380,669.10	18.86
อันดับความน่าเชื่อถือ : A	2,307,600,990.27	57.76
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า		
สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน เพื่อป้องกันความเสี่ยง (Hedging)		
สัญญาสวอป/ สัญญาฟอเวิร์ด มี 4 คู่สัญญา		
- ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน) (KBANK) อันดับความน่าเชื่อถือ : AA+		
- ธนาคารเกียรตินาคิน จำกัด (มหาชน) อันดับความน่าเชื่อถือ : A		
- ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน) (SCB) อันดับความน่าเชื่อถือ : AA+		
- ธนาคารยูโอบี จำกัด (มหาชน) อันดับความน่าเชื่อถือ : AAA		
กำไร/ ขาดทุนจากสัญญา	35,781,188.20	0.90
อื่น ๆ	-1,798,263.71	-0.05
ประเภทรายการค้างรับอื่น ๆ		
	152,592.11	0.00
ประเภทรายการค้างจ่ายหรือหนี้สินอื่น ๆ		
	-1,950,855.82	-0.05
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ	3,995,294,925.81	100.00