

รายงานสถานะการลงทุนการกู้ยืมเงินและการก่อภาระผูกพัน
กองทุนเปิดกรุงไทยตราสารหนี้ เอฟไอเอฟ 246
มูลค่า ณ วันที่ 30 ธันวาคม 2562

รายละเอียดการลงทุน	มูลค่าตามราคาตลาด	%NAV
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ	2,915,651.87	0.05
เงินฝากธนาคาร		
อันดับความน่าเชื่อถือ : AAA	916,345.01	0.02
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย		
อายุคงเหลือน้อยกว่า 1 ปี	1,999,306.86	0.03
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินต่างประเทศ	5,791,836,766.14	98.06
เงินฝากธนาคาร		
อันดับความน่าเชื่อถือ : AAA	1,092,287,837.25	18.49
อันดับความน่าเชื่อถือ : A	4,139,754,254.94	70.09
บัตรเงินฝาก		
อันดับความน่าเชื่อถือ : AA	559,794,673.95	9.48
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า		
สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน เพื่อป้องกันความเสี่ยง (Hedging)		
สัญญาสวอป/ สัญญาฟอเวิร์ด มี 5 คู่สัญญา		
- ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน) (KTB) อันดับความน่าเชื่อถือ : AA+		
- ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน) อันดับความน่าเชื่อถือ : AAA		
- ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน) (KBANK) อันดับความน่าเชื่อถือ : AA+		
- ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน) (SCB) อันดับความน่าเชื่อถือ : AA+		
- ธนาคารธนชาต จำกัด (มหาชน) อันดับความน่าเชื่อถือ : AA-		
กำไร/ ขาดทุนจากสัญญา	113,875,810.20	1.93
อื่น ๆ	-2,015,266.64	-0.03
ประเภทรายการค้างจ่ายหรือหนี้สินอื่น ๆ		
	-2,015,266.64	-0.03
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ	5,906,612,961.57	100.00