

รายงานสถานะการลงทุนการกู้ยืมเงินและการก่อภาระผูกพัน  
กองทุนเปิดกรุงไทยตราสารหนี้ เอฟไอเอฟ 255  
มูลค่า ณ วันที่ 31 มีนาคม 2563

รายละเอียดการลงทุน	มูลค่าตามราคาตลาด	%NAV
<b>หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ</b>	<b>433,524,186.89</b>	<b>14.65</b>
<b>หุ้นกู้</b>		
อันดับความน่าเชื่อถือ : BBB	252,325,070.00	8.53
<b>เงินฝากธนาคาร</b>		
อันดับความน่าเชื่อถือ : A	361,506.92	0.01
<b>ตัวแลกเปลี่ยน</b>		
ตัวแลกเปลี่ยนที่บริษัทเอกชนเป็นผู้ออกและขึ้นทะเบียนในThai BMAหรือ ตลาดตราสารหนี้	174,841,495.12	5.91
<b>พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย</b>		
อายุคงเหลือน้อยกว่า 1 ปี	5,996,114.85	0.20
<b>หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินต่างประเทศ</b>	<b>2,696,731,436.45</b>	<b>91.13</b>
<b>เงินฝากธนาคาร</b>		
อันดับความน่าเชื่อถือ : A	2,393,780,945.26	80.89
<b>บัตรเงินฝาก</b>		
อันดับความน่าเชื่อถือ : AA	302,950,491.19	10.24
<b>สัญญาซื้อขายล่วงหน้า</b>		
<b>สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน เพื่อป้องกันความเสี่ยง (Hedging)</b>		
สัญญาสวอป/ สัญญาฟอเวิร์ด มี 5 คู่สัญญา		
- ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน) (KTB) อันดับความน่าเชื่อถือ : AA+		
- ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน) (KBANK) อันดับความน่าเชื่อถือ : AA+		
- ธนาคารเกียรตินาคิน จำกัด (มหาชน) อันดับความน่าเชื่อถือ : A		
- ธนาคารทหารไทย จำกัด (มหาชน) (TMB) อันดับความน่าเชื่อถือ : AA-		
- ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน) (SCB) อันดับความน่าเชื่อถือ : AA+		
กำไร/ ขาดทุนจากสัญญา	-166,912,369.10	-5.64
<b>อื่นๆ</b>	<b>-4,118,644.61</b>	<b>-0.14</b>
<b>ประเภทรายการค้างจ่ายหรือหนี้สินอื่นๆ</b>		
	-4,118,644.61	-0.14
<b>มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ</b>	<b>2,959,224,609.63</b>	<b>100.00</b>