

รายงานสถานะการลงทุนการกู้ยืมเงินและการก่อภาระผูกพัน
กองทุนเปิดกรุงไทยตราสารหนี้ เอฟไอเอฟ 265
มูลค่า ณ วันที่ 31 มีนาคม 2563

รายละเอียดการลงทุน	มูลค่าตามราคาตลาด	%NAV
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินในประเทศ	453,470,030.57	14.71
หุ้นกู้		
อันดับความน่าเชื่อถือ : BBB	201,386,658.00	6.53
เงินฝากธนาคาร		
อันดับความน่าเชื่อถือ : A	947,864.20	0.03
ตัวแลกเปลี่ยน		
ตัวแลกเปลี่ยนที่บริษัทเอกชนเป็นผู้ออกและขึ้นทะเบียนในThai BMAหรือ ตลาดตราสารหนี้	249,138,595.65	8.08
พันธบัตรธนาคารแห่งประเทศไทย		
อายุคงเหลือน้อยกว่า 1 ปี	1,996,912.72	0.06
หลักทรัพย์หรือทรัพย์สินต่างประเทศ	2,834,758,523.22	91.97
เงินฝากธนาคาร		
อันดับความน่าเชื่อถือ : AAA	634,761,167.05	20.60
อันดับความน่าเชื่อถือ : AA	317,380,583.52	10.30
อันดับความน่าเชื่อถือ : A	1,269,201,779.71	41.18
บัตรเงินฝาก		
อันดับความน่าเชื่อถือ : A	295,399,648.25	9.58
อันดับความน่าเชื่อถือ : BBB	318,015,344.69	10.32
สัญญาซื้อขายล่วงหน้า		
สัญญาที่อ้างอิงกับอัตราแลกเปลี่ยน เพื่อป้องกันความเสี่ยง (Hedging)		
สัญญาสวอป/ สัญญาฟอว์เวิร์ด มี 5 คู่สัญญา		
- ธนาคารกรุงไทย จำกัด (มหาชน) (KTB) อันดับความน่าเชื่อถือ : AA+		
- ธนาคารกรุงศรีอยุธยา จำกัด (มหาชน) อันดับความน่าเชื่อถือ : AAA		
- ธนาคารกสิกรไทย จำกัด (มหาชน) (KBANK) อันดับความน่าเชื่อถือ : AA+		
- ธนาคารทหารไทย จำกัด (มหาชน) (TMB) อันดับความน่าเชื่อถือ : AA-		
- ธนาคารไทยพาณิชย์ จำกัด (มหาชน) (SCB) อันดับความน่าเชื่อถือ : AA+		
กำไร/ ขาดทุนจากสัญญา	-203,676,534.82	-6.61
อื่นๆ	-2,443,144.23	-0.08
ประเภทรายการค้างจ่ายหรือหนี้สินอื่นๆ		
	-2,443,144.23	-0.08

รายงานสถานะการลงทุนการกู้ยืมเงินและการก่อภาระผูกพัน
กองทุนเปิดกรุงไทยตราสารหนี้ เอฟไอเอฟ 265
มูลค่า ณ วันที่ 31 มีนาคม 2563

รายละเอียดการลงทุน	มูลค่าตามราคาตลาด %NAV
มูลค่าทรัพย์สินสุทธิ	3,082,108,874.74 100.00