

โครงการสนับสนุนทุนวิจัยด้านตลาดทุน ประจำปี 2565/2566 สำหรับนิสิต/นักศึกษา ระดับปริญญาตรีและบัณฑิตศึกษา

หลักการและเหตุผล

เพื่อส่งเสริมให้มีการทำงานวิจัยเกี่ยวกับตลาดทุนที่มีคุณภาพอย่างกว้างขวาง ฝ่ายวิจัย ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (ฝ่ายวิจัยฯ) จึงได้จัดสรรเงินทุนเพื่อสนับสนุนการทำงานวิจัยด้านตลาดทุนมาโดยต่อเนื่อง ฝ่ายวิจัยฯ ได้ให้ทุนสนับสนุนการทำงานวิจัยโดยมีโครงการร่วมกับสถาบันการศึกษา ซึ่งได้รับความร่วมมืออย่างดี อีกทั้งได้รับการตอบรับเป็นอย่างดีจากผู้ทรงคุณวุฒิในธุรกิจตลาดทุนที่เข้ามามีส่วนร่วมแลกเปลี่ยนความคิดเห็นและให้ข้อเสนอแนะ ตลอดจนแนวทางปฏิบัติต่างๆ เพื่อให้ผู้วิจัยและผู้แทนจากสถาบันการศึกษาที่เข้าร่วมโครงการ ได้เข้าใจข้อเท็จจริงในทางปฏิบัติ อันเป็นประโยชน์อย่างยิ่งในการสร้างเครือข่ายที่ประสานและเชื่อมโยงสถาบันการศึกษากับภาคธุรกิจตลาดทุนไทย

ฝ่ายวิจัย ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย มีความประสงค์ที่จะสนับสนุนงานวิจัยด้านตลาดทุนที่สามารถนำไปใช้ได้จริงในทางปฏิบัติหรือสามารถนำไปต่อยอดได้ โดยการผสมองค์ความรู้และแนวคิดใหม่ๆ ที่เกี่ยวข้องกับตลาดทุนในหลายมิติ ซึ่งต้องการองค์ความรู้ที่จะผสมผสานในหลายสาขาวิชา โดยมีวัตถุประสงค์เพื่อ

1. ส่งเสริม สนับสนุนและกระตุ้นให้คณาจารย์/นิสิต/นักศึกษา ที่มีความสนใจในธุรกิจตลาดทุน ให้มีความสนใจค้นคว้า ศึกษา คติวิเคราะห์ และสร้างสรรค์ผลงานวิจัยที่ตอบโจทย์ใหม่ๆ ที่เกี่ยวข้องเพื่อพัฒนาตลาดทุนไทย หรือหน่วยงานที่เกี่ยวข้องกับตลาดทุน
2. ส่งเสริมนักวิจัย ที่มีคุณภาพ และมีทักษะสื่อสารที่สามารถถ่ายทอดความรู้เกี่ยวกับผลงานให้กับผู้ปฏิบัติจริงในตลาดทุน สามารถนำองค์ความรู้ไปประยุกต์ใช้กับการทำงานและช่วยให้ตลาดทุนพัฒนาในภาพรวมได้
3. ส่งเสริม สนับสนุน และกระตุ้นให้คณาจารย์/นิสิต/นักศึกษา ที่มีความสนใจในธุรกิจตลาดทุนสามารถเข้าถึงข้อมูลเชิงลึก และฐานข้อมูลขนาดใหญ่ (big data) เกี่ยวกับตลาดทุน

รายละเอียดโครงการสนับสนุนทุนวิจัยด้านตลาดทุน ประจำปี 2565/2566 ระดับปริญญาตรีและบัณฑิตศึกษา

ฝ่ายวิจัยฯ จะให้ทุนสนับสนุนเพื่อการวิจัยด้านตลาดทุนแก่สถาบันการศึกษาที่เข้าร่วมโครงการสนับสนุนทุนวิจัยด้านตลาดทุน ประจำปี 2565/2566 ระดับปริญญาตรีและบัณฑิตศึกษา (โครงการฯ) สถาบันละ 10,000 บาท และเปิดโอกาสให้ผู้วิจัยที่มีโครงร่างงานวิจัย (draft of research proposal) ผ่านการคัดเลือกในรอบที่ 1 (จำนวน 20 หัวข้อ) สามารถเข้าถึงข้อมูลเชิงลึก และฐานข้อมูลขนาดใหญ่ (big data) เกี่ยวกับตลาดทุน ผ่าน capital market research platform ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ที่อนุญาตให้เฉพาะผู้ทำวิจัยในโครงการ สามารถเข้ามาใช้ข้อมูลได้ผ่านโครงข่ายคอมพิวเตอร์

ฝ่ายวิจัยฯ เปิดรับโครงร่างงานวิจัย ในหัวข้อที่อยู่ในความสนใจและมีความสอดคล้องกับแนวทางการดำเนินงานของตลาดหลักทรัพย์ฯ โดยไม่จำกัดสาขาวิชา ภาควิชา หรือคณะ ของผู้วิจัย เพื่อให้มีมุมมองที่หลากหลายในการผลิตงานวิจัยด้านตลาดทุน

งานวิจัยที่น่าสนใจใน 3 ประเด็นหลัก

1. การพัฒนาด้านความยั่งยืนในตลาดทุน
2. การนำเทคโนโลยีมาพัฒนากระบวนการ หรือผลิตภัณฑ์ใหม่ ๆ ในตลาดทุน
3. การวิเคราะห์ผลกระทบต่อสถานะการลงทุนในอนาคต

(ตัวอย่างหัวข้องานวิจัย ตามเอกสารแนบ 1)

ทั้งนี้ ผู้วิจัยสามารถเสนอโครงร่างงานวิจัยที่อยู่ในความสนใจอื่นๆ ที่เป็นประโยชน์ต่อการพัฒนาตลาดทุนไทย หรือช่วยเพิ่มประสิทธิภาพต่อกิจกรรมต่างๆ ของผู้มีส่วนร่วมในตลาดทุนได้

กลุ่มเป้าหมาย

- สถาบันการศึกษาในประเทศ
- ผู้วิจัยหลัก (first author) ต้องเป็นนิสิต/นักศึกษา ที่อยู่ระหว่างการศึกษาก่อนสำเร็จการศึกษามาแล้วในระยะเวลาไม่เกิน 1 ปี ของสถาบันการศึกษาที่เข้าร่วมโครงการ
 - ระดับปริญญาตรี
 - ระดับบัณฑิตศึกษา

รายละเอียดโครงการ

มีรายละเอียดสรุปดังนี้

1. สถาบันการศึกษา ลงนามในบันทึกข้อตกลงความร่วมมือทางวิชาการ / เอกสารแนบโครงการฯ ภายใต้บันทึกข้อตกลงความร่วมมือทางวิชาการ ร่วมกับตลาดหลักทรัพย์ฯ และสถาบันการศึกษาได้นำส่งโครงร่างงานวิจัย โดยมีเงื่อนไขในการร่วมโครงการฯ และให้ทุนสนับสนุน ดังนี้
 - 1.1 สถาบันการศึกษาจะต้องดำเนินการเผยแพร่ประชาสัมพันธ์โครงการนี้ให้กับอาจารย์ และนิสิต/นักศึกษา ในสังกัดได้รับทราบเป็นวงกว้าง อาทิ ประชาสัมพันธ์ผ่านช่องทางต่างๆ ให้บุคลากรของสถาบันการศึกษาทราบโดยทั่วกัน หรือ การจัดประกวดผลงานวิจัยภายในสถาบันการศึกษา เป็นต้น ทั้งนี้ ฝ่ายวิจัยฯ จะประชาสัมพันธ์โครงการนี้ ผ่านสื่อต่างๆ ด้วย
 - 1.2 สถาบันการศึกษาจะต้องนำส่งโครงร่างงานวิจัย (proposal) (โดยมีความยาวไม่เกิน 3 หน้ากระดาษ A4) ภายในวันที่ 20 มกราคม 2566 โดยสถาบันการศึกษาแต่ละแห่งสามารถส่งโครงร่างงานวิจัยได้ ไม่เกิน 5 หัวข้อ ทั้งนี้ ต้องเป็นงานวิจัยที่จะเป็นประโยชน์ต่อการพัฒนาตลาดทุนได้จริง และอยู่ในความสนใจของผู้เกี่ยวข้องในธุรกิจตลาดทุน (เอกสารแนบ 1)
 - 1.3 ฝ่ายวิจัยฯ จะประกาศรายชื่อหัวข้องานวิจัยที่ได้รับการคัดเลือกในรอบที่ 1 จำนวน 20 หัวข้อ โดยพิจารณาจากโครงร่างงานวิจัยและคลิปนำเสนองานวิจัย* (ตามเงื่อนไขของแต่ละรางวัล)
 - 1.4 สำหรับหัวข้องานวิจัยที่ได้รับการคัดเลือกในรอบที่ 1 จำนวน 20 หัวข้อ ผู้วิจัยจะต้องนำเสนอโครงร่างงานวิจัยต่อคณะกรรมการพิจารณาตัดสินผลงานวิจัยดีเด่นด้านตลาดทุน (คณะกรรมการฯ) ในช่วงเดือนกุมภาพันธ์

- 2566* (*วันที่จะแจ้งให้ทราบในภายหลัง) โดยงานวิจัยที่ได้รับการคัดเลือกเข้ารอบที่ 1 จำนวน 20 หัวข้อ และได้เข้ามานำเสนองานวิจัยต่อคณะกรรมการฯ จะได้รับทุนสนับสนุนการทำงานวิจัย หัวข้อละ 10,000 บาท
- 1.5 ฝ่ายวิจัยฯ จะประกาศรายชื่องานวิจัยที่ได้รับการคัดเลือกและสนับสนุนทุนในการทำวิจัย จำนวนไม่เกิน 10 หัวข้อ ในช่วงเดือนมีนาคม 2566* ทั้งนี้ สถาบันการศึกษาแต่ละแห่ง อาจมีโครงการงานวิจัยที่ได้รับการคัดเลือกมากกว่า 1 หัวข้อ หรืออาจไม่ได้รับการคัดเลือก ขึ้นอยู่กับการพิจารณาของคณะกรรมการฯ (*วันที่จะแจ้งให้ทราบในภายหลัง)
2. ฝ่ายวิจัยฯ จะจัดให้มี “คลินิกงานวิจัยด้านตลาดทุน” ในช่วงต้นเดือนเมษายน 2566 เพื่อเปิดโอกาสให้ผู้วิจัยและคณาจารย์ ได้เข้ามานำเสนอความคืบหน้าของการวิจัย แลกเปลี่ยนความคิดเห็น ตลอดจนรับฟังข้อเสนอแนะและแนวทางปฏิบัติต่างๆ ในธุรกิจตลาดทุนไทยจากผู้ทรงคุณวุฒิที่มีประสบการณ์การทำงานในตลาดทุน เพื่อให้ผู้วิจัยนำแนวทางไปพัฒนากระบวนการวิจัยให้เป็นประโยชน์ต่อภาคธุรกิจมากยิ่งขึ้น และเป็นโอกาสในการสร้างเครือข่ายผู้วิจัยด้านตลาดทุนระหว่างผู้วิจัย คณาจารย์ และผู้ทรงคุณวุฒิในตลาดทุน (*วันที่จะแจ้งให้ทราบในภายหลัง)
 3. ผู้วิจัยจะต้องนำส่งงานวิจัยฉบับสมบูรณ์ ที่มีความยาวไม่เกิน 20 หน้ากระดาษ A4 ภายในเดือนมิถุนายน 2566 (วันที่จะแจ้งให้ทราบในภายหลัง) ทั้งนี้ งานวิจัยฉบับสมบูรณ์จะต้องปรับ/เพิ่มเติม ตามคำแนะนำที่ได้รับจากผู้ทรงคุณวุฒิใน “คลินิกงานวิจัยด้านตลาดทุน” โดยผู้วิจัยจะได้รับทุนสนับสนุนการทำงานวิจัยเรื่องละ 20,000 บาท เมื่อส่งมอบงานวิจัยฉบับสมบูรณ์ให้ฝ่ายวิจัยฯ ตามกำหนดการ
 4. ผู้วิจัยจะต้องนำเสนอผลงานวิจัยเพื่อชิงรางวัลงานวิจัยดีเด่นด้านตลาดทุน ประจำปี 2565/2566 ภายในเดือนกรกฎาคม 2566* ทั้งนี้ หากผู้วิจัยไม่สามารถส่งมอบงานวิจัยฉบับสมบูรณ์และนำเสนอผลงานวิจัยได้ จะถือว่าผู้วิจัยสละสิทธิ์

การพิจารณาผลงานวิจัยฯ

เพื่อส่งเสริมให้เกิดการผลิตงานวิจัยระดับปริญญาตรี และบัณฑิตศึกษาที่มีคุณภาพ การพิจารณาคัดเลือก “ผลงานวิจัยดีเด่นด้านตลาดทุน” จะพิจารณาจากคุณภาพของรายงานฉบับสมบูรณ์ และการนำเสนอของผู้วิจัย โดยตลาดหลักทรัพย์ฯ และคณะกรรมการฯ ประกอบด้วย

- ผู้ทรงคุณวุฒิในธุรกิจตลาดทุน
- ผู้แทนจากสถาบันการศึกษา โดยจะต้องไม่มีส่วนเกี่ยวข้องกับงานวิจัยที่สถาบันการศึกษานั้นส่งเข้ารับการคัดเลือกเป็นผลงานวิจัยดีเด่น

กำหนดการเบื้องต้น (อาจมีการเปลี่ยนแปลงได้)

ช่วงเวลา	การดำเนินการ
พฤศจิกายน - ธันวาคม 2565	<ul style="list-style-type: none"> ประชาสัมพันธ์โครงการฯ และชี้แจงแนวทางและระยะเวลาดำเนินการ
วันที่ 23 ธันวาคม 2565	<ul style="list-style-type: none"> สถาบันการศึกษาแจ้งความประสงค์เข้าร่วมโครงการฯ
ภายในกุมภาพันธ์ 2566	<ul style="list-style-type: none"> สถาบันที่มี MOU ร่วมกับตลาดหลักทรัพย์ฯ แล้ว: ลงนามรับทราบในเอกสารแนบท้าย บันทึกข้อตกลงความร่วมมือระหว่างตลาดหลักทรัพย์ฯ กับสถาบันการศึกษา สถาบันการศึกษาที่ยังไม่มี MOU: ลงนามในบันทึกข้อตกลงความร่วมมือระหว่างตลาดหลักทรัพย์ฯ กับสถาบันการศึกษา
วันที่ 20 มกราคม 2566	<ul style="list-style-type: none"> สถาบันการศึกษา นำส่งโครงร่างงานวิจัย (proposal) รายชื่อผู้วิจัย และอาจารย์ที่ปรึกษา
กุมภาพันธ์ - มีนาคม 2566	<ul style="list-style-type: none"> ประกาศรายชื่องานวิจัย 20 หัวข้อ ที่ผ่านการคัดเลือกในรอบที่ 1** ผู้วิจัยที่ผ่านการคัดเลือกในรอบที่ 1 นำเสนอโครงร่างงานวิจัยต่อคณะกรรมการ ประกาศรายชื่องานวิจัยที่ได้รับการคัดเลือกในรอบที่ 2** จำนวนไม่เกิน 10 หัวข้อ
เดือนเมษายน 2566*	<ul style="list-style-type: none"> กิจกรรม “คลินิกงานวิจัยด้านตลาดทุน”
เดือนมิถุนายน 2566*	<ul style="list-style-type: none"> ผู้วิจัยส่งมอบผลงานวิจัยฉบับสมบูรณ์**
เดือนกรกฎาคม 2566*	<ul style="list-style-type: none"> นำเสนอผลงานวิจัยเพื่อชิงรางวัลงานวิจัยดีเด่นด้านตลาดทุน

* วันที่จะแจ้งให้ทราบในภายหลัง

** ฝ่ายวิจัย ตลาดหลักทรัพย์ฯ มอบเงินสนับสนุนตามเงื่อนไข

รางวัลผลงานวิจัยดีเด่นด้านตลาดทุน ระดับปริญญาตรี/บัณฑิตศึกษา

ผู้วิจัยจะต้องนำเสนอผลงานวิจัย ในงานสัมมนาที่ฝ่ายวิจัยฯ จัดขึ้นในเดือนกรกฎาคม 2566 ซึ่งจะมีการพิจารณาเพื่อตัดสินและประกาศผลงานวิจัยดีเด่นด้านตลาดทุน ประจำปี 2565/2566 โดยมีเงินรางวัลดังนี้

รางวัล	ผู้วิจัย	อาจารย์ที่ปรึกษา
รางวัลงานวิจัย		
1. รางวัลงานวิจัยดีเด่น จำนวน 1 รางวัล	120,000 บาท	60,000 บาท
2. รางวัลงานวิจัยดี จำนวน 1 รางวัล	80,000 บาท	40,000 บาท
3. รางวัลประกาศเกียรติคุณ จำนวน 3 รางวัล	40,000 บาท	20,000 บาท
รางวัลพิเศษ		
รางวัลนักวิจัยรุ่นใหม่ จำนวน 1 รางวัล*	30,000 บาท	15,000 บาท
รางวัลงานวิจัยด้านความยั่งยืน จำนวน 1 รางวัล**	50,000 บาท	25,000 บาท

* รางวัลนักวิจัยรุ่นใหม่ จำนวน 1 รางวัล

- ผู้วิจัยหลัก (first author) ต้องเป็นนิสิต/นักศึกษาในระดับปริญญาตรี โดยต้องนำส่งผลงานวิจัยฉบับสมบูรณ์ตามที่ตลาดหลักทรัพย์ฯ กำหนด
- เกณฑ์การตัดสินรางวัล
 - ผลงานวิจัยที่ผ่านการคัดเลือกเข้ารอบลึกที่สุดและได้คะแนนสูงสุด หรือ
 - ผลงานวิจัยที่ผ่านเข้ารอบที่ 1 (รอบ 20 หัวข้อ) และนำเสนอต่อตลาดหลักทรัพย์ฯ

** รางวัลงานวิจัยด้านความยั่งยืน จำนวน 1 รางวัล

- ผู้วิจัยนำส่งหัวข้องานวิจัย โครงร่างงานวิจัย โดยระบุในแบบฟอร์มว่า “ประสงค์จะเข้าร่วมชิงรางวัลงานวิจัยด้านความยั่งยืน” พร้อมนำส่งคลิปนำเสนอ 5 นาที
- ผลงานวิจัยที่ผ่านการคัดเลือกจากคณะกรรมการฯ เข้ารอบที่ 2 (รอบ 10 ผลงานสุดท้าย)
- ผู้วิจัยต้องนำส่งผลงานวิจัยฉบับสมบูรณ์ตามที่ตลาดหลักทรัพย์ฯ กำหนด

หมายเหตุ:

- ตลาดหลักทรัพย์ฯ สามารถพิจารณาเปลี่ยนแปลงรางวัลผลงานวิจัยตามความเหมาะสม
- ในกรณีที่คณะกรรมการพิจารณาแล้วเห็นว่าไม่มีงานวิจัยใดสมควรได้รับรางวัลใดรางวัลหนึ่งข้างต้น ตลาดหลักทรัพย์ฯ ขอสงวนสิทธิ์ไม่มอบรางวัลดังกล่าว
- ผลงานวิจัยเป็นลิขสิทธิ์ของผู้วิจัย อย่างไรก็ตาม ผู้วิจัยและสถาบันการศึกษายินยอมให้ตลาดหลักทรัพย์ฯ เผยแพร่ผลงานวิจัยในงานสัมมนาและเผยแพร่ต่อสาธารณะผ่านช่องทางต่างๆ ของตลาดหลักทรัพย์ฯ ได้ตามที่เห็นสมควร

ข้อมูลสำหรับการประสานงาน

ฝ่ายวิจัย ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

ชั้น 15 อาคารตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

เลขที่ 93 ถนนรัชดาภิเษก คลองเตย กรุงเทพฯ 10400

โทรศัพท์ 02-009-9524, 9513, 9521, 3655

หรือ e-mail: SETResearchScholarship@set.or.th

งานวิจัยที่น่าสนใจใน 3 ประเด็นหลัก

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ให้การสนับสนุนทุนวิจัยด้านตลาดทุน ประจำปี 2565/2566 สำหรับนิสิต/นักศึกษา ระดับปริญญาตรีและบัณฑิตศึกษา โดย 3 ประเด็นงานวิจัยหลักที่อยู่ในความสนใจ ได้แก่

1. การพัฒนาด้านความยั่งยืนในตลาดทุน
2. การนำเทคโนโลยีมาพัฒนากระบวนการ หรือผลิตภัณฑ์ใหม่ๆ ในตลาดทุน
3. การวิเคราะห์ผลกระทบต่อสถานะการลงทุนในอนาคต

ประเด็นหลัก 1: การพัฒนาด้านความยั่งยืนในตลาดทุน

ESG Investing เป็นการลงทุนที่ผู้ลงทุนทั่วโลกให้ความสนใจ โดยเฉพาะในช่วงหลังของการแพร่ระบาด COVID-19 มีคำถามเกิดขึ้นว่า “บริษัทที่ยึดหลัก ESG มาใช้ในการประกอบธุรกิจจะมีผลการดำเนินงาน รวมถึงผลตอบแทนของหลักทรัพย์ดีกว่าในช่วงที่เศรษฐกิจเผชิญความท้าทายหรือไม่”

แม้ว่างานวิจัยที่มุ่งตอบคำถามเกี่ยวกับ Performance ของ ESG investing จะเริ่มแพร่หลายแล้ว แต่งานวิจัยที่เกี่ยวข้องกับด้านการเงินอื่นๆ ผ่านมุมมองด้าน ESG ยังมีค่อนข้างจำกัด อีกทั้งการประชุม COP27 ในปี 2565 นี้ยังช่วยเร่งให้ภาครัฐและหน่วยงานกำกับดูแลให้ความสนใจเกี่ยวกับ Climate Change และ Green Financing มากขึ้น ตลาดหลักทรัพย์ฯ เปิดกว้างสำหรับงานวิจัยที่เกี่ยวข้องกับ Environment Social และ Governance ซึ่งมีความสำคัญไม่น้อยไปกว่ากัน

ตัวอย่างหัวข้องานวิจัย

- ESG investment มีผลกระทบต่อมูลค่าของบริษัทจดทะเบียนและการพัฒนาเศรษฐกิจของประเทศอย่างไร
- ผลกระทบจากปัจจัยด้าน Environment/Social/Governance กับผลการดำเนินงานของบริษัทจดทะเบียน
- ปัจจัยที่ขับเคลื่อนผู้บริหารให้หันมาหลัก ESG practice มาบรรจุอยู่ในกระบวนการทำงานของบริษัท
- แนวทางในการพัฒนาคุณภาพของข้อมูล และการเปิดเผยข้อมูลที่เป็น non-financial data
- กฎระเบียบและนโยบายเชิงนโยบายที่เกี่ยวข้อง ESG investment และการประกอบธุรกิจของบริษัทจดทะเบียน
- ความเชื่อมโยงระหว่าง circular economy/ BCG ESG และ sustainable development
- ตัวชี้วัดด้าน ESG สำหรับ SMEs และ startups ควรเป็นอย่างไร
- ความเชื่อมโยงด้าน ESG ในระดับโลก ระดับประเทศ ระดับอุตสาหกรรม และระดับบริษัท
- การใช้ตราสารอนุพันธ์ในการบริหารความเสี่ยงที่เกี่ยวข้องกับ ESG และผลตอบแทนของกอง ESG fund
- ผลิตภัณฑ์ใหม่ๆ ที่เกี่ยวข้องกับ green financial products
- การประยุกต์ใช้ big data และ machine learning โดยเชื่อมโยงกับ ESG และตลาดทุน

ประเด็นหลัก 2: การนำเทคโนโลยีมาพัฒนากระบวนการ หรือผลิตภัณฑ์ใหม่ๆ ในตลาดทุน

Digitalization สร้างโอกาสมากมายให้กับระบบเศรษฐกิจ และตลาดทุนให้เกิดการเติบโต อีกทั้งยังมีข้อมูลจำนวนมากถูกสร้างขึ้นในแต่ละกระบวนการ ซึ่งประกอบด้วยข้อมูลที่ถูกนำมาวิเคราะห์แล้ว และข้อมูลที่ยังไม่มีใครนำมาใช้ อย่างไรก็ตามการมี AI และ machine learning ที่ถูกพัฒนาให้มีประสิทธิภาพจะช่วยให้ผู้วิจัยสามารถทำความเข้าใจข้อมูลมหาศาลเหล่านี้ และอาจทำให้เกิดทฤษฎีหรือวิธีสร้างแบบจำลองแบบใหม่ๆ ที่มีความแม่นยำมากขึ้น นอกจากนี้ยังมีการนำเทคโนโลยีใหม่ๆ ไปสร้างสินทรัพย์ประเภทใหม่ๆ ที่เรียกรวมๆ กันว่า digital asset ซึ่งมีความแตกต่างในรายละเอียดค่อนข้างหลากหลาย ซึ่งเปิดโอกาสให้นักวิจัยทำการศึกษาทั้งในด้าน theoretical และ empirical อีกเป็นจำนวนมาก

ตัวอย่างหัวข้องานวิจัย

- Natural Language Processing (NLP), semantics และ sentiment analysis เพื่อสร้างตัวชี้วัดด้านต่างๆ
- การนำ big data และ advanced machine learning มาใช้ในการทำความเข้าใจเชิงลึกในเชิงเศรษฐศาสตร์ พฤติกรรมของนักลงทุนประเภทต่างๆ
- การใช้ฐานข้อมูล (structured or unstructured data sources) และวิธีการวิเคราะห์ใหม่ๆ ที่ใช้ประมาณการอนาคตในภาคเศรษฐกิจมหภาค, asset price forecasting models, portfolio construction and analysis
- การศึกษาการทำงานของ algorithmic/high frequency trading
- งานวิจัยที่เกี่ยวข้องกับ cyber risks and cybersecurity
- แนวโน้มการพัฒนาด้าน digital payment and trading systems ในตลาดทุน
- การนำเทคโนโลยีมาประยุกต์ใช้กับ financial fraud detection
- ประโยชน์และข้อควรระวังในการนำ Blockchain และ Distributed Ledger Technology (DLT) มาใช้ในธุรกิจตลาดทุนไทย
- การทำความเข้าใจเกี่ยวกับตลาดทุนจากข้อมูล market microstructure

ประเด็นหลัก 3: การวิเคราะห์ผลกระทบต่อสถานะการลงทุนในอนาคต

เศรษฐกิจโลกอยู่ในช่วงฟื้นตัวจากการแพร่ระบาด COVID-19 โดยแต่ละประเทศมีอัตราการฟื้นตัวที่แตกต่างกัน ในขณะที่ระดับเงินเฟ้อคาดว่าจะสูงต่อเนื่องไปอีกสักระยะ ทำให้นโยบายการเงินการคลังของแต่ละประเทศนำมาใช้ไม่สอดคล้องกัน ส่งผลกระทบต่อเงินทุนไหลเข้า/ออก เกิดความผันผวนทั้งในอัตราแลกเปลี่ยน รวมถึงในตลาดเงินตลาดทุนทั่วโลก ดังนั้นการคาดการณ์แนวโน้มการลงทุนในช่วงที่ความไม่แน่นอนสูงจึงเป็นเรื่องที่ท้าทาย อย่างไรก็ตามตลาดทุนไทยได้รับความสนใจจากผู้ลงทุนต่างชาติเนื่องจากมี story การเติบโตดีในระยะ 1-2 ปีข้างหน้าจากภาคการส่งออก และท่องเที่ยว แต่ในระยะยาวเศรษฐกิจไทยยังจำเป็นต้องหา growth engine ใหม่ๆ เพื่อเพิ่มขีดความสามารถในการแข่งขันในอนาคต

ตัวอย่างหัวข้องานวิจัย

- การเปลี่ยนแปลงของเงินเฟ้อในช่วง Post-COVID
- ผลกระทบระยะยาวที่เกิดขึ้นจากปัญหา supply shocks กับตลาดทุน
- สาเหตุและผลกระทบจากการเกิดปรากฏการณ์ sectoral reallocation
- การเปรียบเทียบกลยุทธ์ในการใช้นโยบายการเงินและการคลังกับผลกระทบต่อตลาดทุนในระดับสากล

- มุมมองของบริษัทจดทะเบียนจากเงินเฟ้อและต้นทุนที่เพิ่มขึ้น
- การเคลื่อนย้ายเงินทุนและวัฏจักรตลาดหุ้นของ advanced economy และ developing economy
- ความขัดแย้งด้าน geopolitics และผลด้านการค้าและการเคลื่อนย้ายเงินทุนระหว่างประเทศ
- สภาวะตลาดหุ้นหลังจากแผนกระตุ้นขนาดใหญ่จากนโยบายการคลัง และการเร่งตัวของหนี้สาธารณะ
- แบบจำลองสำหรับคาดการณ์ปัญหาขาดสภาพคล่อง และมีความเสี่ยงด้านเครดิตในระดับประเทศ/ บริษัท
- megatrend กับการปรับตัวของบริษัทจดทะเบียนไทย
- กลยุทธ์การลงทุนด้วย factor investing ในแต่ละสภาวะตลาด และ investment strategy แบบอื่นๆ

ทั้งนี้ ผู้วิจัยสามารถเสนอโครงร่างงานวิจัยที่อื่น ๆ ที่เป็นประโยชน์ต่อการพัฒนาตลาดทุนไทย หรือช่วยเพิ่มประสิทธิภาพต่อกิจกรรมต่าง ๆ ของผู้มีส่วนร่วมในตลาดทุนได้

ฐานข้อมูลเพื่อการวิจัย

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย สนับสนุนงานวิจัยด้านตลาดทุน โดยได้จัดเตรียมฐานข้อมูลต่างๆ เพื่องานวิจัยอย่างต่อเนื่อง จากข้อมูลที่มีการเปิดเผยเป็นการทั่วไป และพัฒนาศูนย์ข้อมูลทางการเงินและเศรษฐกิจของประเทศจำแนกตามอุตสาหกรรมต่างๆ ให้สะดวกในการทำวิจัย

ทั้งนี้ นิสิต/นักศึกษา ที่เข้าร่วมโครงการฯ สามารถเข้าถึงฐานข้อมูล และแพลตฟอร์มเพื่องานวิจัย (capital market research platform) เพื่อบริหารจัดการฐานข้อมูลและเพื่อผลิตงานวิจัย ในช่วงระยะเวลาหนึ่งปี (สิ้นสุดตามเอกสารแนบโครงการสนับสนุนทุนวิจัย) โดยประสานงานกับฝ่ายวิจัย ตลาดหลักทรัพย์ฯ เพื่อขอใช้ข้อมูล ตามเงื่อนไขที่ตลาดหลักทรัพย์ฯ กำหนด ซึ่งตลาดหลักทรัพย์ฯ จะพิจารณาอนุมัติเป็นรายกรณี

รายละเอียดฐานข้อมูลต่างๆ

ฐานข้อมูลที่เกี่ยวข้องกับตลาดหลักทรัพย์ (Market Data)

ข้อมูลสารสำคัญของบริษัทจดทะเบียนและหลักทรัพย์ มูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์ ข้อมูลการเปลี่ยนแปลงทุน เป็นต้น

รายละเอียดเพิ่มเติม: <https://www.set.or.th/th/education-research/research/database/setsmart/overview>

หมายเหตุ: สามารถขอเข้าใช้งาน SETSMART Enterprise บน Platform

ฐานข้อมูลบริษัทภิบาล (CG Database)

ฐานข้อมูลเกี่ยวกับโครงสร้างคณะกรรมการบริษัทจดทะเบียน คุณสมบัติกรรมการ การเข้าร่วมประชุมของกรรมการ และคำตอบแทนกรรมการแต่ละชุดตามที่บริษัทจดทะเบียนเปิดเผยในรายงาน 56-1 รายงานประจำปี รายงานการประชุมผู้ถือหุ้น ตลอดจนรายงานที่เปิดเผยเป็นการทั่วไป

รายละเอียดเพิ่มเติม: <https://www.set.or.th/th/education-research/research/database/cg-database/overview>

ฐานข้อมูลการคัดเลือกหุ้นปันผล (Dividend Universe)

ฐานข้อมูลเกี่ยวกับการคัดเลือกหุ้นปันผล เพื่อเป็นทางเลือกในการลงทุนระยะยาวให้นักลงทุน ในสภาวะดอกเบี้ยเงินฝากอยู่ในระดับต่ำ โดยพิจารณาจากความสามารถในการทำกำไร การอยู่รอดของกิจการ การจ่ายเงินปันผล ระดับคะแนนบริษัทภิบาล

รายละเอียดเพิ่มเติม: <https://www.set.or.th/th/education-research/research/database/dividend-universe/overview>

ฐานข้อมูลการลงทุนในต่างประเทศ (Economic Exposure Universe)

ฐานข้อมูลเกี่ยวกับการลงทุนทางตรงในต่างประเทศ ตลอดจนรายได้จากต่างประเทศของบริษัทจดทะเบียนไทย ซึ่งสะท้อนศักยภาพในการเติบโตในต่างประเทศของบริษัทจดทะเบียน

รายละเอียดเพิ่มเติม: <https://www.set.or.th/th/education-research/research/database/economic-exposure-universe/overview>

ห้องสมุดข้อมูลปัจจัยขับเคลื่อนผลตอบแทนหุ้น (Factor Library)

ฐานข้อมูล “ปัจจัย” (factors) ที่ส่งผลต่อผลตอบแทนของหุ้นสามัญที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ไทย โดยถูกนำมาใช้ในการคำนวณแบบจำลองกำหนดราคาสินทรัพย์ (asset pricing model) ซึ่งมีความสำคัญในการทำวิจัยด้านตลาดทุน อีกทั้งผู้ประกอบการวิจัยยังสามารถสร้างผลิตภัณฑ์อ้างอิงจากข้อมูล factor model นี้

รายละเอียดเพิ่มเติม: <https://www.set.or.th/education-research/research/database/factor-library/overview>

Financial & Economic Data Bureau

เว็บไซต์รวมข้อมูลเศรษฐกิจและการเงินของประเทศ จำแนกตามแต่ละกลุ่มอุตสาหกรรม เพื่อเป็นข้อมูลในการวิเคราะห์ปัจจัยพื้นฐานของแต่ละอุตสาหกรรม

รายละเอียดเพิ่มเติม: <https://www.fe-data.or.th/>

ฐานข้อมูลการซื้อขายหลักทรัพย์ ระดับ Market Microstructure (ราย Order และราย Deal)

ฐานข้อมูลการซื้อขายระดับองค์ประกอบย่อย ที่ช่วยให้ศึกษาพฤติกรรมนักลงทุนจากการส่งคำสั่งซื้อขายหลักทรัพย์ และศึกษาถึงผลกระทบของปัจจัยต่างๆ อาทิ การเปลี่ยนแปลงกฎระเบียบต่อพฤติกรรมนักลงทุน เป็นต้น

หมายเหตุ: ผู้มีสิทธิ์ใช้ฐานข้อมูล Market Microstructure ต้องเป็นบุคลากรที่อยู่ในสถาบันการศึกษาที่ได้ลงนามในบันทึกข้อตกลงความร่วมมือโครงการ Market Microstructure Research ร่วมกับตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

รายละเอียดเพิ่มเติม: <https://www.set.or.th/education-research/research/database/market-microstructure/overview>

ทั้งนี้ ผู้วิจัยสามารถดูรายละเอียดเพิ่มเติมได้จาก clip video ได้ที่: <https://youtu.be/LcOobpK6IDl>

หมายเหตุ:

- ตลาดหลักทรัพย์ฯ อยู่ระหว่างการดำเนินการพัฒนาฐานข้อมูล เกี่ยวกับจำนวนบัญชีและจำนวนนักลงทุนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย จำนวนพนักงานของบริษัทจดทะเบียนไทย ค่าสอบบัญชีที่บริษัทจดทะเบียนไทยจ่ายให้บริษัทสอบบัญชี ซึ่งหากดำเนินการเสร็จสิ้น จะนำเสนอใน <https://www.set.or.th/th/education-research/research/database/main>
- ผู้วิจัยสามารถสอบถามรายละเอียดเกี่ยวกับฐานข้อมูลเพิ่มเติมได้ที่ SETResearchScholarship@set.or.th