

โครงการสนับสนุนทุนวิจัย : เชื่อมโยงตลาดทุนไทยเพื่อเป้าหมายการพัฒนาอย่างยั่งยืน ระดับอาจารย์

หลักการและเหตุผล

เพื่อส่งเสริมให้มีการทำงานวิจัยที่มีคุณภาพ และสนับสนุนให้อาจารย์/ ผู้เชี่ยวชาญในสถาบันการศึกษาดำเนินการจัดทำงานวิจัยในประเด็นที่เชื่อมโยงตลาดหลักทรัพย์/ ตลาดทุนไทย

ฝ่ายวิจัย ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (ฝ่ายวิจัยฯ) จึงได้จัดสรรเงินทุนเพื่อสนับสนุนการทำงานวิจัย โดยเน้นการเชื่อมโยงด้านตลาดทุนเพื่อนำไปสู่เป้าหมายการพัฒนาอย่างยั่งยืน โดยจะสนับสนุนทุนในการทำงานวิจัยกับผู้วิจัยไทย ระดับอาจารย์ ในสถาบันการศึกษาทั้งในและต่างประเทศ

ฝ่ายวิจัยฯ ได้กำหนดกรอบและทิศทางของการสนับสนุนให้มีการผลิตงานวิจัยที่สามารถนำไปใช้ได้จริงในทางปฏิบัติหรือสามารถนำไปต่อยอดได้ โดยการผสมองค์ความรู้และแนวคิดใหม่ๆ ที่เกี่ยวข้องกับเป้าหมายการพัฒนาอย่างยั่งยืน ในหลายมิติ ซึ่งต้องการองค์ความรู้ที่จะผสมผสานในหลายสาขาวิชา โดยสามารถเชื่อมโยงกับบริบทของตลาดทุนไทย

วัตถุประสงค์

1. ส่งเสริม สนับสนุนและกระตุ้นให้คณาจารย์/ ผู้เชี่ยวชาญ ที่มีความสนใจในบริบทของเป้าหมายการพัฒนาอย่างยั่งยืน โดยสามารถเชื่อมโยงในบริบทธุรกิจตลาดทุนไทย เพื่อสร้างสรรค์ผลงานวิจัยที่ตอบโจทย์ใหม่ๆ ที่เกี่ยวข้องเพื่อพัฒนาตลาดทุนไทย หรือหน่วยงานที่เกี่ยวข้องกับตลาดทุน โดยงานวิจัยสามารถตอบโจทย์และสะท้อนบทบาทของตลาดหลักทรัพย์ ให้สามารถเป็นประโยชน์ต่อ เศรษฐกิจ สังคม และสิ่งแวดล้อม

2. ส่งเสริมผู้วิจัย ที่มีคุณภาพ และมีทักษะสื่อสาร ที่สามารถถ่ายทอดความรู้เกี่ยวกับผลงานให้กับผู้ปฏิบัติจริงในตลาดทุน สามารถนำองค์ความรู้ไปประยุกต์ใช้เพื่อการพัฒนาอย่างยั่งยืนและเชื่อมโยงบทบาทของธุรกิจตลาดทุน ให้สามารถแก้ไขปัญหาในมิติต่างๆ ของประเทศได้

3. ส่งเสริม และสนับสนุนให้คณาจารย์/ ผู้เชี่ยวชาญ ที่มีความสนใจในบริบทของการพัฒนาอย่างยั่งยืน สามารถบูรณาการ เชื่อมโยงกับตลาดทุน โดยสามารถเข้าถึงข้อมูลเชิงลึก และฐานข้อมูลขนาดใหญ่ (big data) เชื่อมตลาดทุน กับเป้าหมายการพัฒนาอย่างยั่งยืน

วิธีดำเนินการวิจัย

ตลาดหลักทรัพย์ฯ มีความประสงค์ให้คณาจารย์/ผู้เชี่ยวชาญ ดำเนินการศึกษาและวิจัยเชิงลึก โดยสามารถเข้าถึงและเชื่อมโยง ข้อมูลของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์ไทย โดยมีพื้นฐานทางทฤษฎีที่เกี่ยวข้อง หรือ เครื่องมือทางเศรษฐมิติที่น่าเชื่อถือ ทั้งนี้ตลาดหลักทรัพย์จะสนับสนุนข้อมูลและเงินทุนสำหรับการดำเนินโครงการ โดยงานศึกษาสามารถเชื่อมโยงให้เห็นปัญหา แนวทางแก้ไข โดยเชื่อมโยงกับธุรกิจตลาดทุนไทย

ระยะเวลาดำเนินงาน

ในช่วงเดือนมิถุนายน 2566 ถึงเดือนเมษายน 2568 เพื่อนำเสนอผลงานในวาระที่ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยครบรอบ 50 ปี

ขอบเขตการดำเนินงาน

การนำเสนอความคืบหน้าในการศึกษา** เบื้องต้นให้เป็นไปตามระยะเวลาที่กำหนดดังต่อไปนี้

1. ภายในเดือนตุลาคม 2566 นำส่ง ร่าง รายงานความคืบหน้าผลการศึกษา phase 1 พร้อมทั้งนำเสนอรายงาน (presentation) ต่อ คณะกรรมการพิจารณาทุนวิจัย ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
2. ภายในเดือนกุมภาพันธ์ 2567 นำส่ง รายงานความคืบหน้าผลการศึกษา phase 1 พร้อมทั้งนำเสนอรายงาน (presentation) ต่อ คณะกรรมการพิจารณาทุนวิจัย ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
3. ภายในเดือนเมษายน 2567 นำส่ง รายงานฉบับสมบูรณ์ (Final Report) พร้อมทั้งนำเสนอรายงาน (presentation) ฝ่ายวิจัย ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และ นำเสนอผลงานวิจัยใน SET Capital Market Research Forum

** ทั้งนี้ ขึ้นกับงานวิจัยที่จะนำส่ง หากผู้วิจัยจัดทำงานวิจัย ที่ต้องการใช้เวลาในการดำเนินการเกิน 12 เดือน สามารถระบุกรอบเวลาที่จะดำเนินการให้แล้วเสร็จ โดยจะต้องเสร็จสิ้นภายในเดือนเมษายน 2568 เงื่อนไขในการมอบเงินสนับสนุนขึ้นอยู่กับข้อตกลงระหว่างตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยและผู้วิจัย

กลุ่มเป้าหมาย

- ผู้วิจัยหลัก (first author) ต้องเป็นอาจารย์/ผู้เชี่ยวชาญ สัญชาติไทย สังกัดสถาบันการศึกษา ทั้งในและต่างประเทศ

กำหนดส่งข้อเสนองานวิจัย (Proposal)

อาจารย์/ผู้เชี่ยวชาญส่งข้อเสนองานวิจัย ภายในวันที่ 25 พฤษภาคม 2566

หมายเหตุ ตลาดหลักทรัพย์ฯ สงวนสิทธิ์ที่จะยกเลิกการจัดทำโครงการวิจัยฯ หรือเปลี่ยนแปลง/ปรับปรุงลักษณะการดำเนินการ รวมถึงหัวข้อและประเด็นที่จะศึกษาวิจัยในแผนงานโครงการฯ ตามความเหมาะสม

รายละเอียดโครงการสนับสนุนทุนวิจัย เชื่อมโยงตลาดทุนไทยเพื่อเป้าหมายการพัฒนาอย่างยั่งยืน

ฝ่ายวิจัยฯ จะให้ทุนสนับสนุนทุนวิจัย เชื่อมโยงตลาดทุนไทยเพื่อเป้าหมายการพัฒนาอย่างยั่งยืน โดยผู้ได้รับทุนสามารถเข้าถึงข้อมูลเชิงลึก และฐานข้อมูลขนาดใหญ่ (big data) ที่เกี่ยวกับตลาดทุน ผ่าน capital market research platform ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ที่อนุญาตให้เฉพาะผู้ทำวิจัยในโครงการ สามารถเข้ามาใช้ข้อมูลได้ผ่านโครงข่ายคอมพิวเตอร์

ในวาระที่ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยจะครบรอบ 50 ปี เพื่อที่จะสนับสนุนให้นักวิจัย/ ผู้เชี่ยวชาญ ในทุกสาขาวิชาได้รังสรรค์งานวิจัย และใช้องค์ความรู้ในหลากหลายสาขา เข้ามามีส่วนร่วมในการร่วมแก้ไขปัญหาและตอบโจทย์ในทุกกระดับ ในทุกมิติ ทั้งด้านเศรษฐกิจ สังคม และสิ่งแวดล้อม โดยการบูรณาการให้เข้ากับบริบทของตลาดทุน

ฝ่ายวิจัยฯ เปิดรับโครงร่างงานวิจัย ในหัวข้อที่อยู่ในความสนใจและมีความสอดคล้องกับบทบาทของตลาดหลักทรัพย์ฯ ที่เดินหน้าพัฒนาตลาดทุนไทย ให้เป็นประโยชน์ต่อ เศรษฐกิจ สังคม และสิ่งแวดล้อม อันจะนำไปสู่การแก้ไขปัญหาของประเทศและเพื่อการพัฒนาอย่างยั่งยืน โดยไม่จำกัดสาขาวิชา ภาควิชา หรือคณะของผู้วิจัย เพื่อให้มีมุมมองที่หลากหลายในการผลิตงานวิจัยด้านตลาดทุน

กำหนดการเบื้องต้น (อาจมีการเปลี่ยนแปลงได้)

ช่วงเวลา	การดำเนินการ
เดือนเมษายน 2566	● ประชาสัมพันธ์โครงการฯ
25 พฤษภาคม 2566	● ผู้วิจัยส่งข้อเสนองานวิจัย
ภายในเดือนพฤษภาคม 2566*	● ฝ่ายวิจัย SET ติดต่อผู้วิจัย เพื่อนำเสนอและหารือ
ภายในเดือนมิถุนายน 2566*	● ฝ่ายวิจัย SET ประกาศผลงานวิจัยที่ได้รับทุนสนับสนุน ● ประสานงานจัดเตรียมเอกสาร เพื่อระบุเงื่อนไขในการรับทุน** และลงนาม
เดือนตุลาคม 2566*	● ผู้วิจัยรายงานความคืบหน้า
เดือนกุมภาพันธ์ 2567*	● ผู้วิจัยส่งมอบร่าง ผลงานวิจัย**
เดือนเมษายน 2567*	● นำเสนอผลงานวิจัย ในงาน SET Capital Market Research Forum
ภายในเดือนเมษายน 2568	● หากงานวิจัย ใช้เวลาในการดำเนินการเกิน 1 ปี

* วันที่จะแจ้งให้ทราบในภายหลัง

** ฝ่ายวิจัย ตลาดหลักทรัพย์ฯ มอบเงินสนับสนุนตามเงื่อนไข

ข้อมูลสำหรับการประสานงาน

ฝ่ายวิจัย ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

ชั้น 15 อาคารตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

เลขที่ 93 ถนนรัชดาภิเษก คลองเตย กรุงเทพฯ 10400

คุณกุลนิดา จิราจินดากุล (02-009-9524) คุณบุษบา คงปัญญากุล (02-009-9512) คุณปฏิธรรม เหมือนเนื้อทอง (02-009-9000 ต่อ 3655)

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

ตัวอย่างงานวิจัยที่น่าสนใจ

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ให้การสนับสนุนทุนวิจัยเชื่อมโยงตลาดทุนไทยเพื่อเป้าหมายการพัฒนาอย่างยั่งยืน

- ESG investment มีผลกระทบกับมูลค่าของบริษัทจดทะเบียนและการพัฒนาเศรษฐกิจของประเทศอย่างไร
- ผลกระทบจากปัจจัยด้าน Environment/Social/Governance กับผลการดำเนินงานของบริษัทจดทะเบียน
- แนวทางในการพัฒนาคุณภาพของข้อมูล และการเปิดเผยข้อมูลที่เป็น non-financial data
- ความเชื่อมโยงระหว่าง circular economy/ BCG ESG และ sustainable development
- การใช้กลไกตลาดทุน แก้ไขปัญหา climate change / PM 2.5
- เสนอแนวทาง / ecosystem ที่เหมาะสมกับบริบทของไทย ในเรื่องต่างๆ ในมุมมองจากผู้เชี่ยวชาญ เพื่อแก้ไขปัญหาต่างๆ ในเชิงโครงสร้าง อาทิ การจัดการขยะ / ปัญหาขยะพลาสติก ...ฯลฯ
- ผลกระทบของ CBAM ต่ออุตสาหกรรมต่างๆ ในตลาดหลักทรัพย์
- แนวทางการสนับสนุนการเข้าถึงแหล่งระดมทุนของธุรกิจเพื่อสิ่งแวดล้อม
- ตัวชี้วัดด้าน ESG สำหรับ SMEs และ startups ควรเป็นอย่างไร
- ความเชื่อมโยงด้าน SDG ในระดับโลก ระดับประเทศ ระดับอุตสาหกรรม และระดับบริษัท
- ผลิตภัณฑ์ใหม่ๆ ที่เกี่ยวข้องกับ green financial products
- การประยุกต์ใช้ big data และ machine learning โดยเชื่อมโยงกับ ESG และตลาดทุน
- ความสัมพันธ์ระหว่างการลดการปล่อยก๊าซเรือนกระจก กับมูลค่าของกิจการ
- emerging new themes in environmental, social and governance investing
- Does ESG Affect the Stability of Dividend Policies?
- clean energy investment / green bonds policy
- sustainable investing: establishing long-term value and performance

ทั้งนี้ ผู้วิจัยสามารถเสนอโครงร่างงานวิจัยที่อยู่ในความสนใจอื่น ๆ ที่เป็นประโยชน์ต่อเศรษฐกิจ สังคมและสิ่งแวดล้อม หรือช่วยเพิ่มประสิทธิภาพต่อกิจกรรมต่าง ๆ ที่ผู้มีส่วนร่วมในตลาดทุนสามารถดำเนินการในบริบทที่สามารถเชื่อมโยงสู่การพัฒนาอย่างยั่งยืนได้

ฐานข้อมูลเพื่อการวิจัย

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย สนับสนุนงานวิจัยด้านตลาดทุน โดยได้จัดเตรียมฐานข้อมูลต่างๆ เพื่องานวิจัยอย่างต่อเนื่อง จากข้อมูลที่มีการเปิดเผยเป็นการทั่วไป และพัฒนาศูนย์ข้อมูลทางการเงินและเศรษฐกิจของประเทศจำแนกตามอุตสาหกรรมต่างๆ ให้สะดวกในการทำวิจัย

ทั้งนี้ ผู้วิจัย สามารถเข้าถึงฐานข้อมูล และแพลตฟอร์มเพื่องานวิจัย (capital market research platform) เพื่อบริหารจัดการฐานข้อมูลและเพื่อผลิตงานวิจัย ในช่วงระยะเวลาตามข้อเสนอ 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

ฐานข้อมูลบรรษัทภิบาล (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 เพื่อเป็นทางเลือกในการลงทุนระยะยาวให้แก่นักลงทุน ในสภาวะดอกเบี้ยเงินฝากอยู่ในระดับต่ำ โดยพิจารณาจากความสามารถในการทำกำไร การอยู่รอดของกิจการ การจ่ายเงินปันผล ระดับคะแนนบรรษัทภิบาล

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 อีกทั้งผู้ประกอบการก็ยังสามารถสร้างผลิตภัณฑ์อ้างอิงจากข้อมูล 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