

โครงการสนับสนุนทุนวิจัยด้านตลาดทุน ประจำปี 2566

ประกาศผลการคัดเลือกหัวข้องานวิจัยที่ผ่านการคัดกรองรอบที่ 1 จำนวน 20 หัวข้อ

หัวข้องานวิจัย	ผู้วิจัย/อาจารย์ที่ปรึกษา	สถาบัน
1. ความสัมพันธ์ระหว่างการเปิดเผยข้อมูลความยั่งยืน เสถียรภาพกำไร และมูลค่าเพิ่มเชิงเศรษฐกิจของบริษัทจดทะเบียนที่เสนอขายหุ้นที่ออกใหม่ต่อประชาชน ครั้งแรก: หลักฐานเชิงประจักษ์บริษัทจดทะเบียนไทย	ผู้วิจัย: คุณไปรยา กาญจนประภาส อาจารย์ที่ปรึกษา: ผศ. ดร.สุนทรี เหล่าพัดจัน	คณะวิทยาการจัดการ มหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์ วิทยาเขตศรีราชา
2. A Study potential factor investing from the relationship of ESG score, Intangible capital, and stock market performance: Evidence from Thailand	ผู้วิจัย: คุณอศิราภรณ์ วรถาวรวิวัฒน์ อาจารย์ที่ปรึกษา: รศ. ดร.คณิตร์ แสงโชติ	คณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย
3. Trading Bot Platform for Algorithmic Trading Development	ผู้วิจัย: คุณภุชงค์ ตริยดลานนท์ คุณจิรภัทร ชารสุวรรณวงศ์ อาจารย์ที่ปรึกษา: Dr. Jing Tang	คณะวิศวกรรมศาสตร์ จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย
4. ระบบซื้อขายหุ้นอัตโนมัติ โดยการวิเคราะห์ทางเทคนิคด้วยโมเดล หน่วยความจำระยะสั้นแบบยาว และโครงข่ายประสาทเทียมคอนโวลูชัน	ผู้วิจัย: คุณวีรภัทร บัวชื่น อาจารย์ที่ปรึกษา: ดร.พิตติพล คันธวัฒน์	คณะวิศวกรรมศาสตร์ จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย
5. Impacts of Quantitative Easing on Financial Markets: Evidence from Developed and Developing Countries	ผู้วิจัย: คุณกมลภพ จันทร์กระมล อาจารย์ที่ปรึกษา: ผศ. ดร.พงศ์ศักดิ์ เหลืองอร่าม	คณะเศรษฐศาสตร์ จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย
6. Machine learning for Thai Stock Prediction: A Data-Centric Approach	ผู้วิจัย: คุณสุรพัศ กองจันทร์ อาจารย์ที่ปรึกษา: รศ. ดร.ชนะพงษ์ โพธิปิติ	คณะเศรษฐศาสตร์ จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย
7. The impact of ESG report disclosure on the value of listed companies in the Stock Exchange of Thailand	ผู้วิจัย: คุณพชรพล สุขอร่าม อาจารย์ที่ปรึกษา: ผศ. ดร.วัชรพงศ์ รติสุขพิมล	คณะเศรษฐศาสตร์ จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย
8. How does ESG affect listed family firms' performance?	ผู้วิจัย: คุณนรเศรษฐ ศรีธานี อาจารย์ที่ปรึกษา: รศ. ดร.รวี ลังกานี	คณะบริหารธุรกิจ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
9. ความสัมพันธ์ระหว่างการเปิดเผยข้อมูลก๊าซเรือนกระจกกับผลการดำเนินงานของบริษัทในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย	ผู้วิจัย: คุณอาทิตย์ยา พิพัฒน์พงศ์อำไพ อาจารย์ที่ปรึกษา: ผศ. ดร.กอบกุล จันทระโคติกา	วิทยาลัยนวัตกรรมการจัดการ มหาวิทยาลัยเทคโนโลยีราชมงคล รัตนโกสินทร์
10. Quality of financial reporting the relationship between earnings management and corporate diversification in Thailand	ผู้วิจัย: คุณอนุพล นานามั่นคง อาจารย์ที่ปรึกษา: ผศ. ดร.อนุชานาฏ เจริญจิตรกรรม	คณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์
11. Geopolitical risk and firm value: Evidence from emerging markets	ผู้วิจัย: คุณศศิน พริ่งพงษ์ อาจารย์ที่ปรึกษา: ผศ. ดร.ศักดิ์กมล มณีนพ	คณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์
12. Board diversity, military connections, and their effects on initial public offering in Thailand	ผู้วิจัย: Sai Woon Leng อาจารย์ที่ปรึกษา: รศ. ดร.ชัยยุทธ ผดุงศักดิ์สวัสดิ์	คณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์

หัวข้องานวิจัย	ผู้วิจัย/อาจารย์ที่ปรึกษา	สถาบัน
13. Sustainability index and cost of debt: evidence from ASEAN market	ผู้วิจัย: คุณธิดาวรรณ ศรีประเสริฐ อาจารย์ที่ปรึกษา: รศ. ดร.ชัชยุทธ ผดุงศักดิ์สวัสดิ์	คณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์
14. กลุ่มหลักทรัพย์ที่เหมาะสมเพื่อป้องกันความเสี่ยงด้านเงินเฟ้อ ด้วยสินทรัพย์พื้นฐาน กรณีศึกษาประเทศไทย Optimal Portfolio Allocations	ผู้วิจัย: คุณปณณวัฒน์ เกตุรานนท์ คุณศุภวิชญ์ จอมสมสา คุณพลกฤต ธิยาพันธ์ คุณเอกวิศ จิ่งเจริญ อาจารย์ที่ปรึกษา: ผศ. ดร.วศิน ศิวสฤกษ์	คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์
15. แนวทางส่งเสริมการลงทุนใน ESG และตัวชี้วัด ESG ที่เหมาะสม	ผู้วิจัย: คุณศิริวรรณ บำรุงศรี คุณชวกร ทาจันทร์พิพย์ คุณนัฐริญา แก้วแกมทอง อาจารย์ที่ปรึกษา: ผศ. ดร.ธีรวิทย์ ศรีพินิจ	คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์
16. การลงทุนในกลุ่มหุ้น ESG โดยใช้ MAGIC FORMULA ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย	ผู้วิจัย: คุณณภัทรวรรณ กาแพ คุณกรรณิการ์ โกษาจันทร์ คุณณิชาภัท หนูสุด คุณนันทวัน ราชสูงเนิน คุณรัชฎาภรณ์ พุฒดี คุณศิริพร ก้อนทอง อาจารย์ที่ปรึกษา: ผศ. ดร.สัมพันธ์ เนตยานันท์	คณะบริหารธุรกิจ เศรษฐศาสตร์และการสื่อสาร มหาวิทยาลัยนเรศวร
17. ผลกระทบจากการระบาดของ Covid-19 ต่อดัชนีความล้มเหลวทางการเงิน (Z-score) ของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย กรณีศึกษาบริษัทที่อยู่ในกลุ่มดัชนีหุ้นยั่งยืน (THSI)	ผู้วิจัย: คุณธนาภรณ์ ปันปิ่น คุณกมลชนก สีแสง คุณสาวิตรี บุญศิริวัฒนพร คุณศุภกานต์ อินตะกัน คุณศุภิสรา วัฒนาธร คุณอนุสรณ์ แก้วบุญทา อาจารย์ที่ปรึกษา: ผศ. ดร.สุพรรณิ บัวสุข	คณะบริหารธุรกิจ เศรษฐศาสตร์และการสื่อสาร มหาวิทยาลัยนเรศวร
18. Social Discourse and Sentiment on ESG	ผู้วิจัย: Piyush Saraf อาจารย์ที่ปรึกษา: ผศ. ดร.ธนฤกษ์ ธนกิจสมบัติ	วิทยาลัยนานาชาติ มหาวิทยาลัยมหิดล
19. พฤติกรรม Noise Trading กับผลการดำเนินงานจากการลงทุนในช่วงการแพร่ระบาดของ COVID-19	ผู้วิจัย: คุณณัฏรัชต์ จันทร์สีดา อาจารย์ที่ปรึกษา: ศ. ดร.สรศาสตร์ สุขเจริญสิน	คณะพัฒนาการเศรษฐกิจ สถาบันบัณฑิตพัฒนบริหารศาสตร์
20. Liquidity Prediction on Thailand Stock Market using Deep Learning Models	ผู้วิจัย: คุณนิรันดร์ อร่ามรัตนพันธ์ อาจารย์ที่ปรึกษา: รศ. ดร.ยุทธนา เศรษฐบูรพาโมทย์	คณะพัฒนาการเศรษฐกิจ สถาบันบัณฑิตพัฒนบริหารศาสตร์

\* ลำดับเรียงตามชื่อสถาบัน ไม่เกี่ยวกับลำดับในการคัดเลือก

02/03/2566

#### สอบถามข้อมูลเพิ่มเติม

ฝ่ายวิจัย ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย  
ชั้น 15 อาคารตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย  
เลขที่ 93 ถนนรัชดาภิเษก คลองเตย กรุงเทพฯ 10400  
โทรศัพท์: 02 009 9000 ต่อ 9524, 3655  
e-mail: [SETResearchscholarship@set.or.th](mailto:SETResearchscholarship@set.or.th)