

## โครงการสนับสนุนทุนวิจัยด้านตลาดทุน ประจำปี 2567/2568 สำหรับนิสิต/นักศึกษา ระดับปริญญาตรีและบัณฑิตศึกษา

### หลักการและเหตุผล

ฝ่ายวิจัย ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (ฝ่ายวิจัยฯ) ส่งเสริมให้มีการทำงานวิจัยเกี่ยวกับตลาดทุนที่มีคุณภาพ โดยให้การสนับสนุนทุนผ่านโครงการสนับสนุนทุนวิจัยด้านตลาดทุนอย่างต่อเนื่องเป็นประจำทุกปี และได้รับการตอบรับจากสถาบันการศึกษาชั้นนำทั่วประเทศ รวมทั้งได้รับความร่วมมือจากผู้ทรงคุณวุฒิในธุรกิจตลาดทุนที่เข้ามามีส่วนร่วมแลกเปลี่ยนความคิดเห็นและให้ข้อเสนอแนะเป็นอย่างดีตลอดมา

เนื่องในโอกาสตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ก้าวสู่ปีที่ 50 ฝ่ายวิจัยฯ ขอเชิญชวนนิสิต/นักศึกษา ที่มีความสนใจในธุรกิจตลาดทุน ร่วมกันสร้างสรรค์งานวิจัย ผ่านโครงการสนับสนุนทุนวิจัยด้านตลาดทุน ประจำปี 2567/2568 สำหรับนิสิต/นักศึกษา ระดับปริญญาตรีและบัณฑิตศึกษา ในการผลิตงานวิจัยเกี่ยวกับตลาดทุนที่มีคุณภาพ สามารถนำไปใช้ได้จริงในทางปฏิบัติหรือสามารถนำไปต่อยอดได้ และสร้างสรรค์เพื่อความเป็นเลิศในด้านต่าง ๆ โดยมีวัตถุประสงค์เพื่อ

1. ส่งเสริม สนับสนุนและกระตุ้นให้คณาจารย์/นิสิต/นักศึกษา ที่มีความสนใจในธุรกิจตลาดทุน ให้มีความสนใจค้นคว้า ศึกษา คิดวิเคราะห์ และสร้างสรรค์ผลงานวิจัยที่ตอบโจทย์ใหม่ๆ ที่เกี่ยวข้องเพื่อพัฒนาตลาดทุนไทย หรือหน่วยงานที่เกี่ยวข้องกับตลาดทุน
2. ส่งเสริมนักวิจัยที่มีคุณภาพ และมีทักษะสื่อสารที่สามารถถ่ายทอดความรู้เกี่ยวกับผลงานให้กับผู้ปฏิบัติจริงในตลาดทุนสามารถนำองค์ความรู้ไปประยุกต์ใช้กับการทำงานและช่วยให้ตลาดทุนพัฒนาในภาพรวมได้
3. ส่งเสริม สนับสนุน และกระตุ้นให้คณาจารย์/นิสิต/นักศึกษา ที่มีความสนใจในธุรกิจตลาดทุนสามารถเข้าถึงข้อมูลเชิงลึก และฐานข้อมูลขนาดใหญ่ (big data) เกี่ยวกับตลาดทุน

### รายละเอียดโครงการสนับสนุนทุนวิจัยด้านตลาดทุน ประจำปี 2567/2568

#### สำหรับนิสิต/นักศึกษา ระดับปริญญาตรีและบัณฑิตศึกษา

ฝ่ายวิจัยฯ จะให้ทุนสนับสนุนเพื่อการวิจัยด้านตลาดทุนแก่สถาบันการศึกษาที่เข้าร่วมโครงการสนับสนุนทุนวิจัยด้านตลาดทุน ประจำปี 2567/2568 ระดับปริญญาตรีและบัณฑิตศึกษา (โครงการฯ) สถาบันละ 10,000 บาท เพื่อเป็นค่าใช้จ่ายสำหรับโครงการฯ (ซึ่งขึ้นอยู่กับดุลพินิจของสถาบันการศึกษา) และเปิดโอกาสให้ผู้วิจัยที่มีโครงร่างงานวิจัย (research proposal) ที่ผ่านการคัดเลือกในรอบที่ 2 สามารถขอข้อมูลเพื่องานวิจัยได้ (ฐานข้อมูลเพื่อการวิจัย ตามเอกสารแนบ 2) และสามารถขอสิทธิ์เพื่อใช้งาน capital market research platform ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

โครงร่างงานวิจัยที่สามารถส่งเข้าร่วมโครงการฯ จะเป็นหัวข้อที่อยู่ในความสนใจและมีความสอดคล้องกับแนวทางการดำเนินงานของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (ตลาดหลักทรัพย์ฯ) โดยไม่จำกัดสาขาวิชา ภาควิชา หรือคณะ ของผู้วิจัย เพื่อให้มีมุมมองที่หลากหลายในการผลิตงานวิจัยด้านตลาดทุน ซึ่งแบ่งการแข่งขันออกเป็น 3 track ดังนี้

## หัวข้อที่น่าสนใจ จำแนกตาม Track ดังนี้

<b>1. Market Quality Track</b>	การสนับสนุนตลาดหุ้นไทยให้มีการเติบโตอย่างมีคุณภาพ
<b>2. ESG Track</b>	ขับเคลื่อนตลาดหุ้นไทย ด้วยข้อมูล ESG สู่เป้าหมายการพัฒนาที่ยั่งยืน
<b>3. Technology - Interdisciplinary Track</b>	การนำเครื่องมือ / เทคโนโลยี รวมถึงการใช้องค์ความรู้หลายสาขาวิชา มาช่วยในการพัฒนากระบวนการวิจัยด้านตลาดหุ้น

(ตัวอย่างหัวข้องานวิจัย ของแต่ละ track ปรากฏตามเอกสารแนบ 1)

ทั้งนี้ ผู้วิจัยสามารถเสนอโครงร่างงานวิจัยที่อยู่ในความสนใจอื่นๆ ที่เป็นประโยชน์ต่อการพัฒนาตลาดหุ้นไทย หรือช่วยเพิ่มประสิทธิภาพต่อกิจกรรมต่างๆ ของผู้มีส่วนร่วมในตลาดหุ้นได้ โดยสามารถเชื่อมโยงกับ track ข้างต้นได้

### กลุ่มเป้าหมาย

- สถาบันการศึกษาในประเทศ
- ผู้วิจัยหลัก (first author) ต้องเป็นนิสิต/นักศึกษา ที่อยู่ระหว่างการศึกษา หรือผู้ที่สำเร็จการศึกษามาแล้วในระยะเวลาไม่เกิน 1 ปี นับตั้งแต่วันที่สำเร็จการศึกษาถึงวันที่เริ่มประชาสัมพันธ์โครงการฯ
  - ระดับปริญญาตรี
  - ระดับบัณฑิตศึกษา

### รายละเอียดโครงการฯ

มีรายละเอียดสรุปดังนี้

1. สถาบันการศึกษา ลงนามในบันทึกข้อตกลงความร่วมมือทางวิชาการ / เอกสารโครงการฯ ซึ่งเป็นเอกสารแนบท้ายบันทึกข้อตกลงความร่วมมือทางวิชาการ ระหว่างตลาดหลักทรัพย์ฯ กับ สถาบันการศึกษาได้นำส่งโครงร่างงานวิจัย โดยมีเงื่อนไขในการร่วมโครงการฯ และให้ทุนสนับสนุน ดังนี้
  - 1.1 สถาบันการศึกษาจะต้องดำเนินการเผยแพร่ประชาสัมพันธ์โครงการฯนี้ให้กับอาจารย์ และนิสิต/นักศึกษา ในสังกัดได้รับทราบ อาทิ ประชาสัมพันธ์ผ่านช่องทางต่าง ๆ ให้บุคลากรของสถาบันการศึกษาทราบ การให้ความร่วมมือโดยการส่งตัวแทนอาจารย์ในสังกัดร่วมเป็นคณะกรรมการพิจารณาตัดสิน เป็นต้น
  - 1.2 ส่งโครงร่างงานวิจัย (research proposal) พร้อมคลิปนำเสนอโครงร่างงานวิจัย ภายในวันที่ **26 สิงหาคม 2567\*** ทั้งนี้ ต้องเป็นงานวิจัยที่จะเป็นประโยชน์ต่อการพัฒนาตลาดหุ้นได้จริง และเชื่อมโยงกับแต่ละ track ตามที่ผู้วิจัยระบุ track ที่ประสงค์ในการเข้าร่วมชิงรางวัล (เอกสารแนบ 1) ซึ่งแต่ละหัวข้องานวิจัยสามารถเลือกเข้าแข่งขันได้เพียง 1 track เท่านั้น
  - 1.3 วันที่ 30 กันยายน 2567\* ฝ่ายวิจัยฯ จะประกาศรายชื่อหัวข้องานวิจัยที่ได้รับการคัดเลือกในรอบที่ 1\*\* ของแต่ละ track (โดยพิจารณาจากโครงร่างงานวิจัยและคลิปนำเสนอโครงร่างงานวิจัย) สำหรับหัวข้องานวิจัยที่ได้รับการคัดเลือกในรอบที่ 1 จะได้รับทุนสนับสนุนการทำงานวิจัย หัวข้อละ 10,000 บาท

- 1.4 กรรมการจากภาคธุรกิจตลาดทุนพิจารณาโครงร่างงานวิจัยและคลิปนำเสนอ และฝ่ายวิจัยฯ จะประกาศรายชื่อหัวข้องานวิจัยที่ได้รับการคัดเลือกในรอบที่ 2\*\* ในวันที่ 25 ตุลาคม 2567\* ทั้งนี้ สถาบันการศึกษาแต่ละแห่งอาจมีโครงร่างงานวิจัยที่ได้รับการคัดเลือกมากกว่า 1 หัวข้อ หรืออาจไม่ได้รับการคัดเลือก ขึ้นอยู่กับการพิจารณาโดยกรรมการจากภาคธุรกิจตลาดทุน
2. ฝ่ายวิจัยฯ จะจัดให้มี “คลินิกงานวิจัยด้านตลาดทุน” ในช่วงปลายเดือนพฤศจิกายน 2567\* เพื่อเปิดโอกาสให้ผู้วิจัยและคณาจารย์ ได้รายงานความก้าวหน้าของงานวิจัยโดยนำเสนอความคืบหน้าของการวิจัย แลกเปลี่ยนความคิดเห็น ตลอดจนรับฟังข้อเสนอแนะและแนวทางปฏิบัติต่างๆ ในธุรกิจตลาดทุนไทยจากผู้ทรงคุณวุฒิที่มีประสบการณ์การทำงานในตลาดทุน เพื่อให้ผู้วิจัยนำแนวทางไปพัฒนากระบวนการวิจัยให้เป็นประโยชน์ต่อภาคธุรกิจมากยิ่งขึ้น และเป็นโอกาสในการสร้างเครือข่ายผู้วิจัยด้านตลาดทุนระหว่างผู้วิจัย คณาจารย์ และผู้ทรงคุณวุฒิในตลาดทุน
  3. ผู้วิจัยที่ผ่านการคัดเลือกในรอบที่ 2 และได้รายงานความคืบหน้าของงานวิจัยโดยนำเสนอรายงานวิจัยฉบับสมบูรณ์ภายในวันที่ 20 มกราคม 2568\* ทั้งนี้ ผู้วิจัยจะได้รับทุนสนับสนุนการทำงานวิจัยเรื่องละ 10,000 บาท เมื่อรายงานความคืบหน้าของงานวิจัยโดยนำเสนอรายงานวิจัยฉบับสมบูรณ์ให้ฝ่ายวิจัยฯ ตามกำหนด
  4. ผู้วิจัยรายงานความคืบหน้าของงานวิจัยโดยนำเสนอผลงานวิจัยเพื่อชิง SET Capital Market Research Award ประจำปี 2567/2568 ภายในเดือนเมษายน 2568\* ทั้งนี้ หากผู้วิจัยไม่สามารถรายงานความคืบหน้าของงานวิจัยโดยนำเสนอรายงานวิจัยฉบับสมบูรณ์และนำเสนอผลงานวิจัยได้ จะถือว่าผู้วิจัยสละสิทธิ์

\* กำหนดการอาจมีการปรับเปลี่ยนได้ตามความเหมาะสม โดยจะแจ้งให้ทราบอีกครั้ง

\*\* จำนวนหัวข้อที่ผ่านการคัดเลือกในแต่ละรอบ ขึ้นอยู่กับคุณภาพของโครงร่างงานวิจัยที่สมัครเข้าร่วมโครงการฯ และการพิจารณาตัดสินจากตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ถือเป็นที่สุด

#### การพิจารณา SET Capital Market Research Award

เพื่อส่งเสริมให้เกิดการผลิตงานวิจัยระดับปริญญาตรีและบัณฑิตศึกษาที่มีคุณภาพ การพิจารณาคัดเลือกผลงานวิจัยที่จะได้รับ SET Capital Market Research Award จะพิจารณาจากคุณภาพของรายงานฉบับสมบูรณ์ และการนำเสนอของผู้วิจัย โดยตลาดหลักทรัพย์ฯ และคณะกรรมการ ประกอบด้วย

- กรรมการจากภาคธุรกิจตลาดทุน ซึ่งเป็นผู้ทรงคุณวุฒิในธุรกิจตลาดทุน
- กรรมการจากภาคการศึกษา ซึ่งเป็นผู้แทนจากสถาบันการศึกษาที่เข้าร่วมโครงการฯ โดยจะต้องไม่มีส่วนเกี่ยวข้องกับงานวิจัยที่สถาบันศึกษานั้นส่งเข้ารับการคัดเลือกชิง SET Capital Market Research Award

## กำหนดการเบื้องต้น (อาจมีการเปลี่ยนแปลงได้)

ช่วงเวลา	การดำเนินการ
เดือนมิถุนายน 2567	<ul style="list-style-type: none"> <li>ประชาสัมพันธ์โครงการฯ และชี้แจงแนวทางและระยะเวลาดำเนินการ</li> </ul>
ภายในวันที่ 5 กรกฎาคม 2567	<ul style="list-style-type: none"> <li>สถาบันการศึกษาแจ้งความประสงค์เข้าร่วมโครงการฯ</li> </ul>
ภายในเดือนสิงหาคม 2567	<ul style="list-style-type: none"> <li><u>สถาบันที่มี MOU ร่วมกับตลาดหลักทรัพย์ฯ แล้ว :</u> ลงนามรับทราบในเอกสารแนบท้าย บันทึกข้อตกลงความร่วมมือระหว่างตลาดหลักทรัพย์ฯ กับสถาบันการศึกษา</li> <li><u>สถาบันการศึกษาที่ยังไม่มี MOU :</u> จัดทำบันทึกข้อตกลงความร่วมมือระหว่างตลาดหลักทรัพย์ฯ กับสถาบันการศึกษา และเอกสารแนบท้ายบันทึกข้อตกลง พร้อมลงนามในบันทึกข้อตกลง</li> </ul>
วันที่ 26 สิงหาคม 2567	<ul style="list-style-type: none"> <li>นำส่งโครงร่างงานวิจัย (research proposal) และคลิปนำเสนอโครงร่างงานวิจัย ชื่อผู้วิจัย และชื่ออาจารย์ที่ปรึกษา</li> </ul>
วันที่ 30 กันยายน 2567	<ul style="list-style-type: none"> <li>ประกาศรายชื่องานวิจัยที่ได้รับการคัดเลือกในรอบที่ 1**</li> </ul>
วันที่ 25 ตุลาคม 2567	<ul style="list-style-type: none"> <li>ประกาศรายชื่องานวิจัยที่ได้รับการคัดเลือกในรอบที่ 2</li> </ul>
เดือนพฤศจิกายน 2567*	<ul style="list-style-type: none"> <li>กิจกรรม “คลินิกงานวิจัยด้านตลาดทุน”</li> </ul>
วันที่ 20 มกราคม 2568	<ul style="list-style-type: none"> <li>ผู้วิจัยรายงานความคืบหน้าของงานวิจัยโดยนำส่งงานวิจัยฉบับสมบูรณ์**</li> </ul>
เดือนเมษายน 2568*	<ul style="list-style-type: none"> <li>ผู้วิจัยรายงานความคืบหน้าของงานวิจัยโดยนำเสนอผลงานวิจัยเพื่อชิง SET Capital Market Research Award ในแต่ละ track</li> </ul>

\* วันที่จะแจ้งให้ทราบในภายหลัง

\*\* ฝ่ายวิจัย ตลาดหลักทรัพย์ฯ มอบเงินสนับสนุนตามเงื่อนไข

## SET Capital Market Research Award

ผู้วิจัยรายงานความคืบหน้าของงานวิจัยโดยนำเสนอผลงานวิจัย ในงานสัมมนาที่ฝ่ายวิจัยฯ จัดขึ้นในเดือนเมษายน 2568 ซึ่งจะมีการพิจารณาเพื่อตัดสินและประกาศรางวัล SET Capital Market Research Award ประจำปี 2567/2568 โดยมีรายละเอียดดังนี้

รางวัลแต่ละ Track	ผู้วิจัย	อาจารย์ที่ปรึกษา
<b>Best Paper Award</b> (งานวิจัยที่ดีที่สุดในแต่ละ track และมีคะแนนผ่านเกณฑ์ Best Paper Award)	80,000 บาท	40,000 บาท
<b>รางวัลพิเศษ</b>		
<ul style="list-style-type: none"> <li><b>Best of the Best Paper Award</b></li> </ul>	40,000 บาท	20,000 บาท
<ul style="list-style-type: none"> <li><b>Young Rising Star Award</b></li> </ul>	30,000 บาท	15,000 บาท

หมายเหตุ:

1. ตลาดหลักทรัพย์ฯ ขอสงวนสิทธิ์ในการปรับเปลี่ยนรางวัลและจำนวนรางวัลตามความเหมาะสม โดยการตัดสินของตลาดหลักทรัพย์ฯ ถือเป็นที่สุด
2. หากคณะกรรมการมีมติเอกฉันท์ว่า ไม่มีผลงานวิจัยใดผ่านตามเกณฑ์ที่จะได้รับรางวัลใดรางวัลหนึ่งดังที่ระบุไว้ข้างต้น ทางตลาดหลักทรัพย์ฯ ขอสงวนสิทธิ์ในการไม่มอบรางวัลดังกล่าว
3. เงื่อนไขการตัดสินรางวัล
  - Best Paper Award
    - ผลงานวิจัยที่ได้คะแนนสูงสุดตามเกณฑ์การตัดสินรางวัลจะได้รับรางวัล Best Paper Award หรือ Outstanding Paper Award เพียงรางวัลใดรางวัลหนึ่ง ขึ้นอยู่กับคุณภาพงานวิจัยตามผลการพิจารณาของคณะกรรมการ
    - เงินรางวัลสำหรับ Outstanding Paper Award : สำหรับผู้วิจัย 40,000 บาท และอาจารย์ที่ปรึกษา 20,000 บาท
  - Best of the Best Paper Award
    - ผลงานวิจัยที่ได้รับรางวัลจะขึ้นอยู่กับผลการพิจารณาของตลาดหลักทรัพย์ฯ ซึ่งจะพิจารณาจากผลงานวิจัยที่ได้รับ Best Paper Award ของแต่ละ track
  - Young Rising Star Award
    - ผู้วิจัยต้องเป็นนิสิต/นักศึกษาในระดับปริญญาตรี โดยผู้วิจัยรายงานความคืบหน้าของงานวิจัยโดยนำเสนอผลงานวิจัยฉบับสมบูรณ์ตามที่ตลาดหลักทรัพย์ฯ กำหนด
    - งานวิจัยที่ได้รับรางวัลนี้ จะต้องได้รับการคัดเลือกเข้ารอบที่ 1 และเป็นงานวิจัยที่เข้ารอบลึกที่สุดของแต่ละ track หากในกรณีที่ม้งานวิจัยเป็นไปตามเงื่อนไขมากกว่าหนึ่งงานวิจัย อาจให้ผู้วิจัยนำเสนอผลงานวิจัยเพื่อชิงรางวัลอีกครั้ง
4. ผลงานวิจัยถือเป็นลิขสิทธิ์ของผู้วิจัย อย่างไรก็ตาม ผู้วิจัยและสถาบันการศึกษายินยอมให้ตลาดหลักทรัพย์ฯ นำเสนอผลงานวิจัยในงานสัมมนาและเผยแพร่ต่อสาธารณะผ่านช่องทางต่างๆ ตามความเหมาะสม

#### ข้อมูลสำหรับการติดต่อสอบถาม

ฝ่ายวิจัย ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

ชั้น 15 อาคารตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

เลขที่ 93 ถนนรัชดาภิเษก คลองเตย กรุงเทพฯ 10400

โทรศัพท์ 02-009-9000 ต่อ 9524, 3655, 9513, 9521

e-mail: [SETResearchScholarship@set.or.th](mailto:SETResearchScholarship@set.or.th)

## งานวิจัยที่น่าสนใจ จำแนกตาม track

ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ให้การสนับสนุนทุนวิจัยด้านตลาดทุน ประจำปี 2567/2568 สำหรับนิสิต/นักศึกษา ระดับปริญญาตรีและบัณฑิตศึกษา โดยหัวข้องานวิจัยที่น่าสนใจจำแนกตาม track ได้แก่

<b>1. Market Quality Track</b>	การสนับสนุนตลาดหุ้นไทยให้มีการเติบโตอย่างมีคุณภาพ
<b>2. ESG Track</b>	ขับเคลื่อนตลาดทุนไทย ด้วยข้อมูล ESG สู่เป้าหมายการพัฒนาที่ยั่งยืน
<b>3. Technology - Interdisciplinary Track</b>	การนำเครื่องมือ / เทคโนโลยี รวมถึงการใช้อัจฉริยะความรู้หลายสาขาวิชา มาช่วยในการพัฒนากระบวนการวิจัยด้านตลาดทุน

**1. Market Quality Track: การสนับสนุนตลาดหุ้นไทยให้มีการเติบโตอย่างมีคุณภาพ**

ในช่วงที่ผ่านมาตลาดหลักทรัพย์ไทยมีมูลค่าหลักทรัพย์ตามราคาตลาดและมูลค่าซื้อขายเติบโตอย่างต่อเนื่อง โดยสาเหตุมาจากทั้งด้านผู้ลงทุนที่เพิ่มมากขึ้น อีกทั้งมีบริษัทจดทะเบียนจำนวนมากเข้ามาระดมทุน และการเพิ่มขึ้นของผลิตภัณฑ์ทางการเงินแบบใหม่ๆ ซึ่งประสิทธิภาพของตลาดหลักทรัพย์มีผลต่อเศรษฐกิจของประเทศ โดยตลาดที่มีคุณภาพสูงควรมีการกำกับดูแลอย่างมีประสิทธิภาพ การเปิดเผยข้อมูลที่โปร่งใส และมีผลิตภัณฑ์ที่หลากหลาย และหากผู้ลงทุนมีความเชื่อมั่น จะส่งผลให้มีสภาพคล่องที่เพียงพอและทำให้ลดต้นทุนการทำธุรกรรม เกิดการจัดสรรทุนที่มีประสิทธิภาพ ทำให้เกิดการพัฒนาเศรษฐกิจที่แข็งแกร่ง จึงเป็นเหตุหนึ่งที่ทำให้ผู้เกี่ยวข้องในตลาดทุนหลายภาคส่วนได้มีการหารือและร่วมมือกันในการปรับปรุงหลักเกณฑ์ แนวปฏิบัติ และการดำเนินการต่างๆ ของตน เพื่อยกระดับการกำกับดูแลให้เหมาะสมและเท่าทันกับสถานการณ์ที่เปลี่ยนแปลงไป ซึ่งพัฒนาการที่เกิดขึ้นนั้นมีผลต่อคุณภาพในมิติต่างๆ

โดยคำถามในงานวิจัยมีตัวอย่างดังต่อไปนี้

- การเพิ่มความโปร่งใสในการเปิดเผยข้อมูลมีผลต่อการตัดสินใจของนักลงทุนและประสิทธิภาพของตลาดหลักทรัพย์อย่างไร?
- สภาพคล่องที่เปลี่ยนแปลงไปมีผลต่อราคาหลักทรัพย์และคุณภาพของตลาดหลักทรัพย์อย่างไร?
- บทบาทของเทคโนโลยีในการซื้อขายหลักทรัพย์ เช่น AI Program trading มีผลต่อพฤติกรรมผู้ลงทุนและคุณภาพของตลาดหลักทรัพย์อย่างไร?
- ผลของการเปลี่ยนแปลงหลักเกณฑ์ แนวปฏิบัติ ประเภทคำสั่งและกลไกการซื้อขาย ต่อคุณภาพของตลาดหลักทรัพย์และความเชื่อมั่นของนักลงทุนอย่างไร?
- เทคนิคการทำ market surveillance ปัจจุบันมีประสิทธิภาพในการตรวจหาและป้องกัน Market Manipulation อย่างไร?
- Investor sentiment และ Behavioral biases มีผลต่อคุณภาพตลาดหลักทรัพย์อย่างไร?
- ความไม่แน่นอนจากทั้งในและต่างประเทศที่เกิดขึ้น ส่งผลกระทบกับ Capital Flow และคุณภาพของตลาดหลักทรัพย์อย่างไร?

## 2. ESG Track: ขับเคลื่อนตลาดทุนไทย ด้วยข้อมูล ESG สู่เป้าหมายการพัฒนาที่ยั่งยืน

การพัฒนาตลาดทุนไทยมีบทบาทสำคัญในการสนับสนุนการเติบโตอย่างยั่งยืนของประเทศในระยะยาว และเพื่อเตรียมให้ตลาดทุนไทย พร้อมรับมือต่อการเปลี่ยนแปลงอย่างรอบด้าน ทั้งเศรษฐกิจ สังคม และสิ่งแวดล้อม นั้น ตลาดหลักทรัพย์ฯ เปิดกว้างสำหรับงานวิจัยที่เกี่ยวข้องกับ Sustainable Finance หรือการใช้ข้อมูลเกี่ยวกับ ESG มาใช้ประโยชน์ในงานวิจัย รวมถึงการพัฒนาผู้มีส่วนได้เสียในห่วงโซ่คุณค่าของตลาดทุนให้สามารถรองรับการเปลี่ยนแปลงในอนาคต โดยคำนึงถึงการเติบโตไปพร้อมกับสังคมและสิ่งแวดล้อม

โดยคำถามในงานวิจัยมีตัวอย่างดังต่อไปนี้

- การศึกษาผลกระทบของ Sustainable Investing ต่อพัฒนาการของตลาดทุน
- ผลกระทบจากปัจจัยด้าน Environment/Social/Governance กับผลการดำเนินงานของบริษัทจดทะเบียน
- การศึกษาอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ที่เกี่ยวข้องกับ ESG ในแต่ละประเภท
- ผลกระทบจาก ESG Factor กับพฤติกรรมผู้ลงทุนที่เปลี่ยนแปลงไป
- การศึกษาความสัมพันธ์ระหว่าง ESG Performance กับผลการดำเนินงานของบริษัทจดทะเบียน
- การวิเคราะห์ผลกระทบของนโยบายภาครัฐต่อการพัฒนาตลาดทุนไทยที่ยั่งยืน

## 3. Technology - Interdisciplinary Track: การนำเครื่องมือ / เทคโนโลยี รวมถึงการใช้องค์ความรู้หลายสาขาวิชา มาช่วยในการพัฒนากระบวนการวิจัยด้านตลาดทุน

คำถามงานวิจัยที่ซับซ้อน อาจมีความจำเป็นต้องใช้ศาสตร์หลายแขนงในการตอบโจทย์ ปัจจุบัน Interdisciplinary Research จึงเป็นทางเลือกที่น่าสนใจ เพื่อจะสามารถตอบโจทย์งานวิจัยได้มากขึ้น รวมถึงการนำ AI และ machine learning มาช่วยให้ผู้วิจัยสามารถวิเคราะห์และทำความเข้าใจข้อมูลมหาศาล และอาจทำให้เกิดทฤษฎีหรือวิธีสร้างแบบจำลอง ที่มีความแม่นยำมากขึ้น อาทิ การนำเทคโนโลยีใหม่ๆ ไปสร้างสินทรัพย์ประเภทใหม่ๆ ที่เรียกรวมๆ กันว่า digital asset

โดยคำถามในงานวิจัยมีตัวอย่างดังต่อไปนี้

- การประยุกต์ใช้ big data และ machine learning โดยเชื่อมโยงกับ ESG และตลาดทุน
- Natural Language Processing (NLP), semantics และ sentiment analysis เพื่อสร้างตัวชี้วัดด้านต่างๆ ที่มีประโยชน์ต่อตลาดทุนไทย
- การสร้าง Prediction Model โดยใช้ศาสตร์ทางด้าน Quant Finance หรือ AI/ Machine Learning
- การวิเคราะห์ความเชื่อมโยงระหว่าง Digital Asset และการเปลี่ยนแปลงในตลาดทุน
- การประยุกต์ใช้ความรู้ด้านอื่นๆ อาทิ จิตวิทยา หรือ วิทยาศาสตร์ มาทำการศึกษาเกี่ยวกับพฤติกรรมผู้ลงทุนในตลาดหลักทรัพย์ที่เปลี่ยนแปลงไป
- ผลกระทบจาก Social media, Influencer, และ Platform ใหม่ๆ ที่อาจสร้างความสนใจในการลงทุนกับ Gen Z

ทั้งนี้ ผู้วิจัยสามารถเสนอโครงร่างงานวิจัยที่อยู่ในความสนใจอื่น ๆ ที่เป็นประโยชน์ต่อการพัฒนาตลาดทุนไทย หรือช่วยเพิ่มประสิทธิภาพต่อกิจกรรมต่าง ๆ ของผู้มีส่วนร่วมในตลาดทุนได้ โดยสามารถเชื่อมโยงกับประเด็นหลักข้างต้นได้อย่างน้อยประเด็นใดประเด็นหนึ่ง

## 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

#### 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 เพื่อเป็นทางเลือกในการลงทุนระยะยาวให้แก่นักลงทุน ในสถานะดอกเบี้ยเงินฝากอยู่ในระดับต่ำ 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>

## ฐานข้อมูล 56-1 One Report Structure Data

ฐานข้อมูลจากแบบแสดงรายการข้อมูลประจำปี/รายงานประจำปี ที่อยู่ในรูปแบบ Structured Data ประกอบด้วยข้อมูลส่วนการประกอบธุรกิจและผลการดำเนินงาน ส่วนการกำกับดูแลกิจการ ของบริษัทจดทะเบียน ทั้งนี้ ฐานข้อมูลนี้ประกอบไปด้วยข้อมูลเพียงบางส่วนจาก 56-1 One Report เท่านั้น และมีข้อมูลย้อนหลังตั้งแต่ปี 2564-2566

รายละเอียดเพิ่มเติม: <https://www.setlink.set.or.th/assets/s-info-pdf-manual/oneReportFAQ.pdf>

หรือ กรณีใช้งาน SETSMART สามารถเข้าถึงได้ที่แถบ Company > Company Information > One Report

หมายเหตุ: สามารถขอเข้าใช้งาน SETSMART หรือติดต่อฝ่ายวิจัย

## ฐานข้อมูล ESG Data Platform

ฐานข้อมูลเกี่ยวกับผลการดำเนินงานด้าน ESG ของบริษัทจดทะเบียน ซึ่งอยู่ในรูปแบบ Structured data ที่เน้นนำเสนอข้อมูลเชิงปริมาณที่สามารถเปรียบเทียบกับอุตสาหกรรมและข้อมูลทางการเงิน เช่น ปริมาณการใช้พลังงานและทรัพยากร ปริมาณการปล่อยก๊าซเรือนกระจก ข้อมูลเกี่ยวกับนโยบายด้านสังคม พนักงาน และข้อมูลด้านการกำกับดูแลกิจการ

รายละเอียดเพิ่มเติม: [link](#) หรือกรณีใช้งาน SETSMART สามารถเข้าถึงได้ที่แถบ Company > ESG Information

หมายเหตุ: สามารถขอเข้าใช้งาน SETSMART หรือ ติดต่อฝ่ายวิจัย

## ข้อมูลการซื้อขายภาพรวม

ข้อมูลการซื้อขายประกอบด้วยสรุปภาพรวมตลาด ราคาหลักทรัพย์ มูลค่าการซื้อขายตามกลุ่มนักลงทุน มูลค่าซื้อขาย 5 วันทำการล่าสุด ข้อมูล NVDR ธุรกรรมขายชอร์ต Program Trading Value และสถิติสำคัญตลาดหลักทรัพย์ เพื่อเป็นข้อมูลในการวิเคราะห์ภาพรวมตลาดหลักทรัพย์ในช่วงปัจจุบัน

รายละเอียดเพิ่มเติม: <https://www.set.or.th/th/market/product/stock/overview>

## ข้อมูลมูลค่าซื้อขายตามประเภทบัญชี จำนวนลูกค้า และบัญชีซื้อขาย และข้อมูลการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบ Internet

ข้อมูลมูลค่าซื้อขายตามประเภทบัญชี จำนวนลูกค้า และบัญชีซื้อขาย และข้อมูลการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบ Internet อาทิ จำนวนบริษัทสมาชิกที่มีการซื้อขายหลักทรัพย์ผ่านระบบ Internet จำนวนลูกค้าที่เปิดบัญชี และมูลค่าซื้อขายผ่านระบบ Internet เป็นต้น ซึ่งข้อมูลนี้เป็นข้อมูลรูปแบบรายเดือน โดยมีข้อมูลย้อนหลังตั้งแต่ปี 2551-ปัจจุบัน

รายละเอียดเพิ่มเติม: <https://www.set.or.th/th/market/statistics/market-statistics/trading-statistics>

หมายเหตุ: สามารถเรียกดูข้อมูลได้ที่เว็บไซต์ตาม [link](#) หรือ ติดต่อฝ่ายวิจัย

## ข้อมูลจำนวนพนักงานของบริษัทจดทะเบียนไทย

ฐานข้อมูลจำนวนพนักงานของบริษัทจดทะเบียนใน SET และ mai โดยมีข้อมูลย้อนหลังตั้งแต่ปี 2561-2565

หมายเหตุ: ติดต่อฝ่ายวิจัย

ทั้งนี้ ผู้วิจัยสามารถดูรายละเอียดเพิ่มเติมได้จาก clip video ได้ที่: <https://www.youtube.com/watch?v=H3BnHwfnVI8>

หมายเหตุ:

- ผู้วิจัยสามารถสอบถามรายละเอียดเกี่ยวกับฐานข้อมูลเพิ่มเติมได้ที่ [SETResearchScholarship@set.or.th](mailto:SETResearchScholarship@set.or.th)