

โครงการสนับสนุนทุนวิจัยด้านตลาดทุน ประจำปี 2567/2568

ประกาศผลการคัดเลือกหัวข้องานวิจัยที่ผ่านการคัดเลือก รอบที่ 1 จำนวน 15 หัวข้อ

Track 1 - Market Quality Track: การสนับสนุนตลาดหุ้นไทยให้มีการเติบโตอย่างมีคุณภาพ จำนวน 5 หัวข้อ

หัวข้องานวิจัย	ผู้วิจัย/อาจารย์ที่ปรึกษา	สถาบันการศึกษา
1. การวัดประสิทธิภาพของตลาดอนุพันธ์ผ่านเหตุการณ์ที่ส่งผลต่อตลาดหลักทรัพย์ (Measuring Thailand Futures Exchange Performance through event studies)	<u>ผู้วิจัย:</u> คุณกันต์กวี เรืองฤทธิ์ คุณประสพโชค ตริยกุล คุณรัฐศาสตร์ นนทศักดิ์ <u>อาจารย์ที่ปรึกษา:</u> ผศ.ดร.รุ่งเกียรติ รัตนบานชื่น	คณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย
2. การมีอันดับความน่าเชื่อถือให้เห็นส่งผลต่อพฤติกรรมการลงทุนของบริษัทหรือไม่? (Does Observability of Downgrade Risk Matter for Corporate Investment?)	<u>ผู้วิจัย:</u> คุณธวัชวรัตน์ ลิ้มวัฒนาบุญกุล <u>อาจารย์ที่ปรึกษา:</u> รศ.ดร.คณิสร์ แสงโชติ	คณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย
3. การประยุกต์ใช้ Beneish Model สร้างแบบจำลองเพื่อตรวจสอบการตกแต่งงบการเงิน (The Use of Beneish Model to create a model for detecting earnings manipulation)	<u>ผู้วิจัย:</u> คุณณัฐธิดา ไชยกรณ์ คุณธนาทิพย์ ธนกิจวานิชกุล คุณชยภรณ์ จรูญธรรม <u>อาจารย์ที่ปรึกษา:</u> ผศ.ดร.ปิยภัทร ชาระวาณิช	วิทยาลัยการจัดการ มหาวิทยาลัยมหิดล
4. ความสัมพันธ์ของความผันผวนแฝงกับผลตอบแทนในอนาคตของตลาดหลักทรัพย์ (Relationships Between Implied Volatility and Equity Returns)	<u>ผู้วิจัย:</u> คุณคงคา แจ้งจบ <u>อาจารย์ที่ปรึกษา:</u> ผศ.ดร.กฤษฎา นิยมมานันท์	คณะบริหารธุรกิจ สถาบันบัณฑิตพัฒนบริหารศาสตร์
5. ความเสี่ยงทางภูมิรัฐศาสตร์กับการลงทุนโดยตรงในต่างประเทศ กรณีศึกษาประเทศไทย (The Impact of Perceived Geopolitical Risk by Domestic Residents on Economic Exposure: Evidence from Thailand)	<u>ผู้วิจัย:</u> คุณปรารถนา อุษาคทานนท์ <u>อาจารย์ที่ปรึกษา:</u> ผศ.ดร.ปภา คณานุรักษ์	คณะบริหารธุรกิจและเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยอัสสัมชัญ

* ลำดับเรียงตามชื่อสถาบัน ไม่เกี่ยวกับลำดับในการคัดเลือก

Track 2 - ESG Track: ขับเคลื่อนตลาดทุนไทย ด้วยข้อมูล ESG สู่เป้าหมายการพัฒนาที่ยั่งยืน จำนวน 5 หัวข้อ

หัวข้องานวิจัย	ผู้วิจัย/อาจารย์ที่ปรึกษา	สถาบันการศึกษา
1. ผลกระทบของผลการดำเนินงานด้านความยั่งยืนและการบริหารสินทรัพย์ ที่มีต่อผลการดำเนินงานทางการเงินของของบริษัทที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์อาเซียน (The Impact of Sustainability Performance and Asset Management on Corporate Financial Performance of Listed Companies in ASEAN Exchanges)	ผู้วิจัย: คุณอัครฤทธิ์ แก้วโบราณ อาจารย์ที่ปรึกษา: ผศ.ดร.สุนทรี เหล่าพัดจัน	คณะวิทยาการจัดการ มหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์ วิทยาเขตศรีราชา
2. การกำหนดเงื่อนไขและหลักเกณฑ์นโยบายทางภาษีเพื่อดึงดูดผู้ลงทุนในหน่วยลงทุนเพื่อความยั่งยืนเพื่อพัฒนาตลาดทุนไทย (The establishment of conditions and criteria for tax policy to attract investors in sustainable investment units for the development of the Thai capital market)	ผู้วิจัย: คุณณัฐพงษ์ ดิสรานนท์ อาจารย์ที่ปรึกษา: ผศ.ดร.พิตติพล คันธวัฒน์	คณะวิศวกรรมศาสตร์ จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย
3. การศึกษาบทบาทของผู้ทรงอิทธิพลทางการเงินในการกำหนดพฤติกรรมการลงทุนในหลักทรัพย์ที่มีความรับผิดชอบต่อสิ่งแวดล้อม สังคม และธรรมาภิบาลของนักลงทุนรุ่นเจเนอเรชัน Z ในตลาดทุนไทย (A Study on the Role of Financial Influencers in Shaping Investment Behavior in Environmentally, Socially, and Governance-Responsible Securities among Generation Z Investors in the Thai Capital Market)	ผู้วิจัย: คุณทศพล บัวไร่ชิง อาจารย์ที่ปรึกษา: ผศ.ดร.กอบกุล จันทระโคติกา	วิทยาลัยนวัตกรรมการจัดการ มหาวิทยาลัยเทคโนโลยีราชมงคล รัตนโกสินทร์
4. การเชื่อมโยงการเปิดเผยข้อมูลสาธารณะด้าน ESG สู่ผลการดำเนินงานทางการเงินและผลตอบแทนของหุ้นใน SET100 ด้วยวิธีวิเคราะห์แบบผสมผสาน (Linking Public ESG Disclosure to Financial Performance and Stock Returns: A Hybrid Analysis of Thailand's SET100 Firms)	ผู้วิจัย: คุณสรุจ ตันมีสุข อาจารย์ที่ปรึกษา: รศ.ดร.ปริญดา สุขเจริญสิน	คณะพัฒนาการเศรษฐกิจ สถาบันบัณฑิตพัฒนบริหารศาสตร์
5. การรายงานแบบบูรณาการในบริษัทจดทะเบียนไทย: การวิเคราะห์เปรียบเทียบผลกระทบของการบังคับใช้ One Report (Integrated Reporting in Thai-Listed Companies: A Comparative Analysis of One Report Regulation Impact)	ผู้วิจัย: คุณวิลาวัณย์ ดิ่งไทรย์ภพ อาจารย์ที่ปรึกษา: ผศ.ดร.ปานแก้วตา ลัคณาวณิช	สำนักวิชาการบัญชีและการเงิน มหาวิทยาลัยวลัยลักษณ์

* ลำดับเรียงตามชื่อสถาบัน ไม่เกี่ยวกับลำดับในการคัดเลือก

Track 3 - Technology - Interdisciplinary Track: การนำเครื่องมือ / เทคโนโลยี รวมถึงการใช้องค์ความรู้หลายสาขาวิชา มาช่วยในการพัฒนาระบบการวิจัยด้านตลาดทุน จำนวน 5 หัวข้อ

หัวข้องานวิจัย	ผู้วิจัย/อาจารย์ที่ปรึกษา	สถาบันการศึกษา
1. ไฮเปอร์เลดเจอร์ แฟบริก สำหรับความยั่งยืน (Hyperledger Fabric for Green)	ผู้วิจัย: คุณศุภกร สุขใจ คุณวีระชัย สาระคุณ คุณเจริญศักดิ์ นาคงาม อาจารย์ที่ปรึกษา: รศ.ดร.ญาใจ ลีมีปิยะภรณ์	คณะวิศวกรรมศาสตร์ จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย
2. การประเมินประสิทธิภาพของเอไอเอเจนต์ (AI Agents) ในการเป็นที่ปรึกษาทางการเงิน (Evaluating AI Agents as Financial Advisors)	ผู้วิจัย: คุณกาวลี อู่พารติลป อาจารย์ที่ปรึกษา: รศ.ดร.ชนะพงษ์ โพธิพิติ	คณะเศรษฐศาสตร์ จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย
3. การพยากรณ์สำหรับหุ้นในตลาดหลักทรัพย์โดยเทคโนโลยีปัญญาประดิษฐ์เชิงลึกแบบ Generative Adversarial Networks (Stock Market Stock Forecasting with Deep Learning Approach: Generative Adversarial Networks (GANs))	ผู้วิจัย: คุณณัฐภัทร ต้อยจตุรัส คุณอรุณี ไชยะ อาจารย์ที่ปรึกษา: ผศ.ดร.ทีปกร จิริจิตกุลชัย	คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์
4. การศึกษากองทุน ETFs ที่เกี่ยวกับ ESG และการสร้างพอร์ตโฟลิโอโดยใช้ Generative AI (The Study of ESG-related ETFs and Portfolio Construction Using Generative AI)	ผู้วิจัย: คุณกัญญาพัชร สมุทรเพชร คุณชนสร จันท์เพียร คุณชินพัฒน์ สิงห์สุวรรณ คุณปณิตรา ใจบุญยงค์ คุณภคพร รัตนเมืองสง อาจารย์ที่ปรึกษา: ผศ.ดร.สัมพันธ์ เนตยานันท์	คณะบริหารธุรกิจ เศรษฐศาสตร์ และการสื่อสาร มหาวิทยาลัยอัสสัมชัญ
5. การวิเคราะห์โดยใช้การประมวลผลภาษาธรรมชาติ (NLP) จากข่าวที่เผยแพร่สาธารณะในการประเมินความเสี่ยงในการผิดนัดชำระหนี้ของหุ้นกู้ในประเทศไทย (NLP-Driven Analysis of News and Public Statements for Corporate Bond Default Risk Assessment in Thailand)	ผู้วิจัย: คุณธนกร โฆษณิชากร อาจารย์ที่ปรึกษา: รศ.ดร.ปรีดา สุขเจริญสิน	คณะพัฒนาการเศรษฐกิจ สถาบันบัณฑิตพัฒนบริหารศาสตร์

* ลำดับเรียงตามชื่อสถาบัน ไม่เกี่ยวกับลำดับในการคัดเลือก

30/09/2567

สอบถามข้อมูลเพิ่มเติม

ฝ่ายวิจัย ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
ชั้น 15 อาคารตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
เลขที่ 93 ถนนรัชดาภิเษก แขวงดินแดง เขตดินแดง กรุงเทพฯ 10400
โทรศัพท์: 02 009 9000 ต่อ 9524, 3655
e-mail: SETResearchscholarship@set.or.th