

Capital Market Research Institute: CMRI Virtual Open House

วันอังคารที่ 9 กุมภาพันธ์ 2564 เวลา 14.00 - 16.00 น.

Online Seminar (MS Team)

ทำความรู้จัก CMRI ผ่านโครงการทุนฯ ที่ผ่านมาและฐานข้อมูล

(บทบาทของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยในการส่งเสริมการผลิตงานวิจัยด้านตลาดทุน)



Slide Presentation ชุดนี้เป็นส่วนหนึ่งของงาน CMRI Virtual Open House

จัดทำโดย ฝ่ายวิจัย ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

ทำความรู้จัก CMRI

01

ภาพรวมการส่งเสริมการผลิตงานวิจัยด้านตลาดทุน

02

ฐานข้อมูลเพื่อการวิจัยด้านตลาดทุน

- Financial & Economic Data Bureau
- ฐานข้อมูลเพื่องานวิจัยด้านตลาดทุน

03

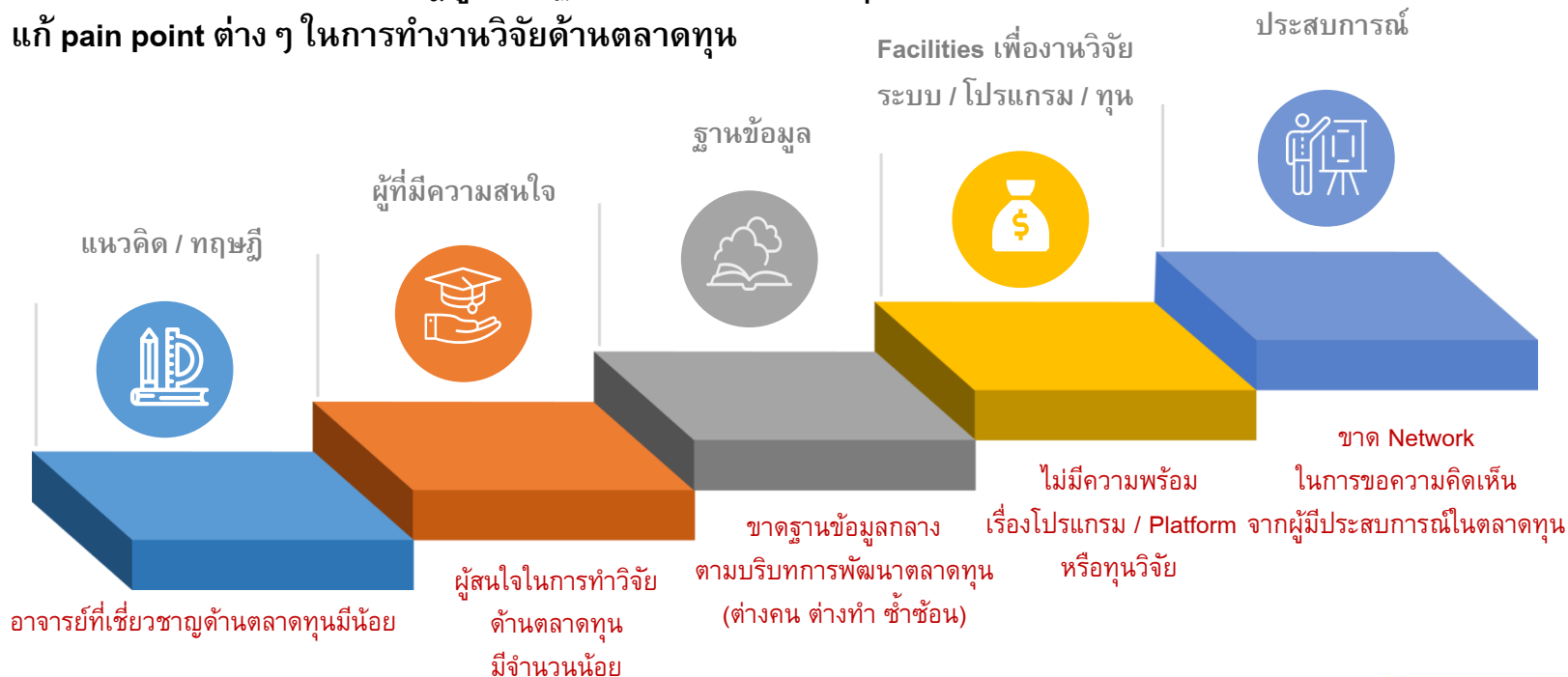
แพลตฟอร์มเพื่องานวิจัยด้านตลาดทุน

04

Research innovation and use cases of textual data

การส่งเสริมการผลิตงานวิจัยด้านตลาดทุน

- ส่งเสริมให้มีงานวิจัยด้านตลาดทุนทั้งด้านปริมาณและคุณภาพ เพื่อการพัฒนาตลาดทุนไทยอย่างยั่งยืน
- ยกกระดับงานวิจัยจากภาคทฤษฎีสู่ภาคปฏิบัติ ตอบโจทย์ตลาดทุนไทย
- แก้ pain point ต่าง ๆ ในการทำงานวิจัยด้านตลาดทุน

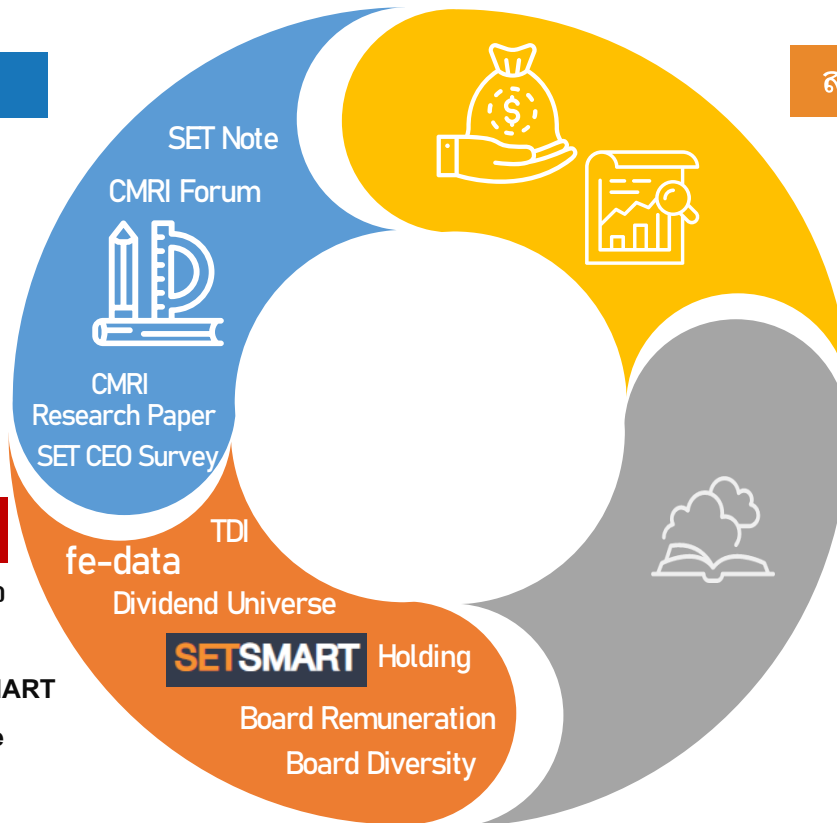


การส่งเสริมการผลิตงานวิจัยด้านตลาดทุนของ SET



ให้ความรู้ / กิจกรรมต่าง ๆ

- จัดทำงานวิจัยด้านตลาดทุน (SET Research / CMRI)
- เผยแพร่บทความ/ รายงาน
- กิจกรรม คลินิกทุนวิจัย
- ประกวดงานวิจัยดีเด่นด้านตลาดทุน
- จัดงานสัมมนา CMRI Forum



สนับสนุนทุน / ข้อมูลในการทำวิจัย

- โครงการสนับสนุนทุนวิจัย
 - ระดับอาจารย์
 - ระดับบัณฑิตศึกษา
- โครงการ Market Microstructure Research
- โครงการความร่วมมือระหว่าง CMRI และสถาบันต่าง ๆ
- สนับสนุนการจัดสัมมนาวิชาการ

พัฒนาแพลตฟอร์มสำหรับการวิจัย

- แพลตฟอร์มรองรับจากทำงาน new normal (Cloud Platform)
- Application on platform

พัฒนาฐานข้อมูลเพื่อการวิจัย

- ฐานข้อมูลวิเคราะห์เศรษฐกิจและธุรกิจ
- ฐานข้อมูลวิจัยด้านตลาดทุน
 - SET Commercial Data: SETSMART
 - โครงการ Market Microstructure Research
 - TDI/ CG... etc.

ทำความรู้จัก CMRI

01

ภาพรวมการส่งเสริมการผลิตงานวิจัยด้านตลาดทุน

02

ฐานข้อมูลเพื่อการวิจัยด้านตลาดทุน

- Financial & Economic Data Bureau
- ฐานข้อมูลเพื่องานวิจัยด้านตลาดทุน

03

แพลตฟอร์มเพื่องานวิจัยด้านตลาดทุน

04

Research innovation and use cases of textual data

ฐานข้อมูลเพื่องานวิจัยด้านตลาดทุน

ฐานข้อมูลเพื่องานวิจัย

ศูนย์ข้อมูล
fe-data bureau

ฐานข้อมูลจากระบบงาน
ของตลาดหลักทรัพย์ฯ

ฐานข้อมูลจากการเก็บรวบรวม
ข้อมูลจากรายงานต่าง ๆ



Financial & Economic Data Bureau

ศูนย์ข้อมูลทางธุรกิจที่สำคัญ ใช้ประเมินทิศทางเศรษฐกิจและธุรกิจได้อย่างมีประสิทธิภาพและเป็นองค์รวม

SETSMART

Market
Microstructure

TDI: Thailand Direct investment

CG: Board Remuneration
Board Diversity

Audit fee

Holding

Employment

IPO



Financial & Economic Data Bureau

www.fe-data.or.th

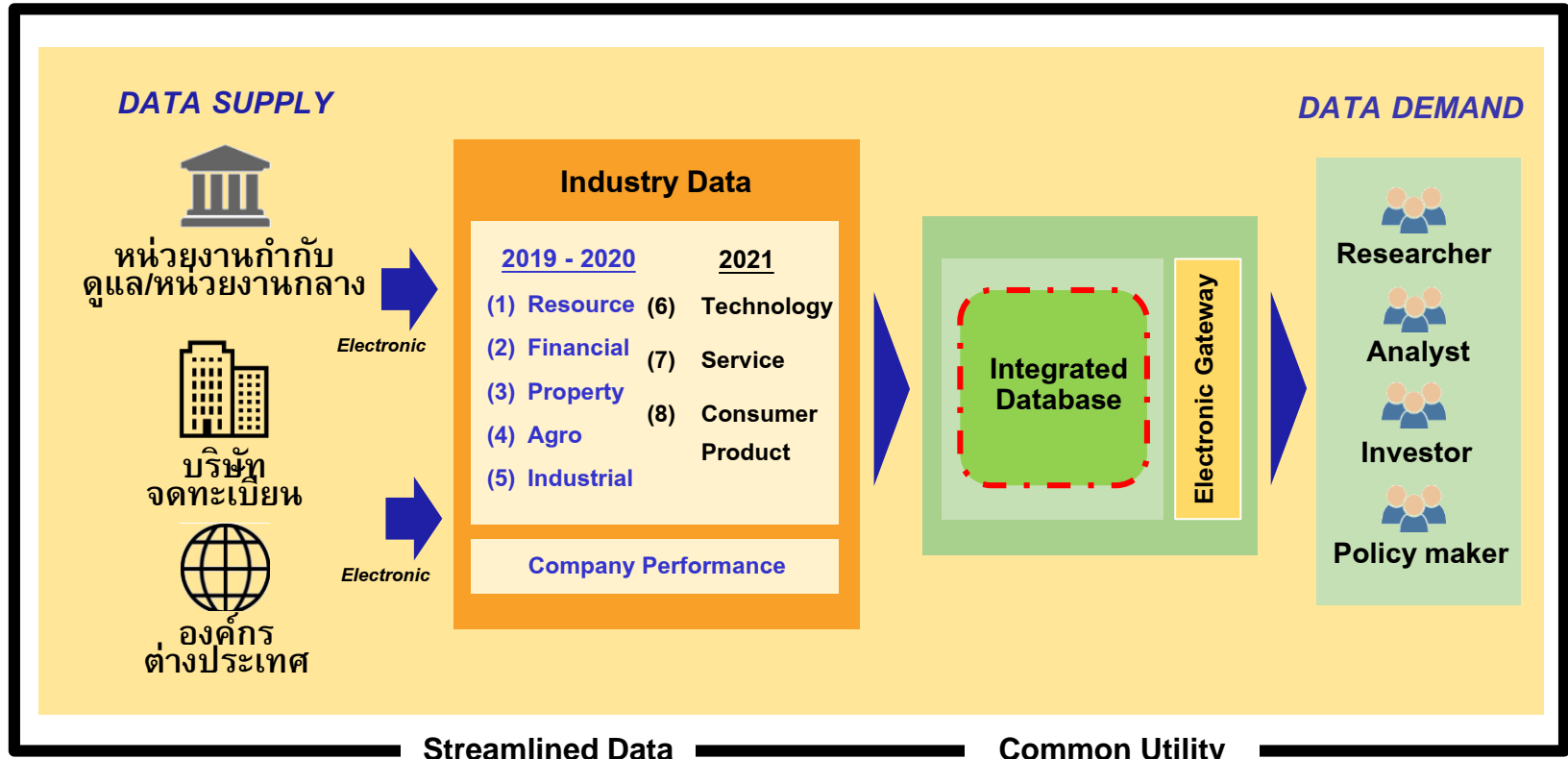
February 2021

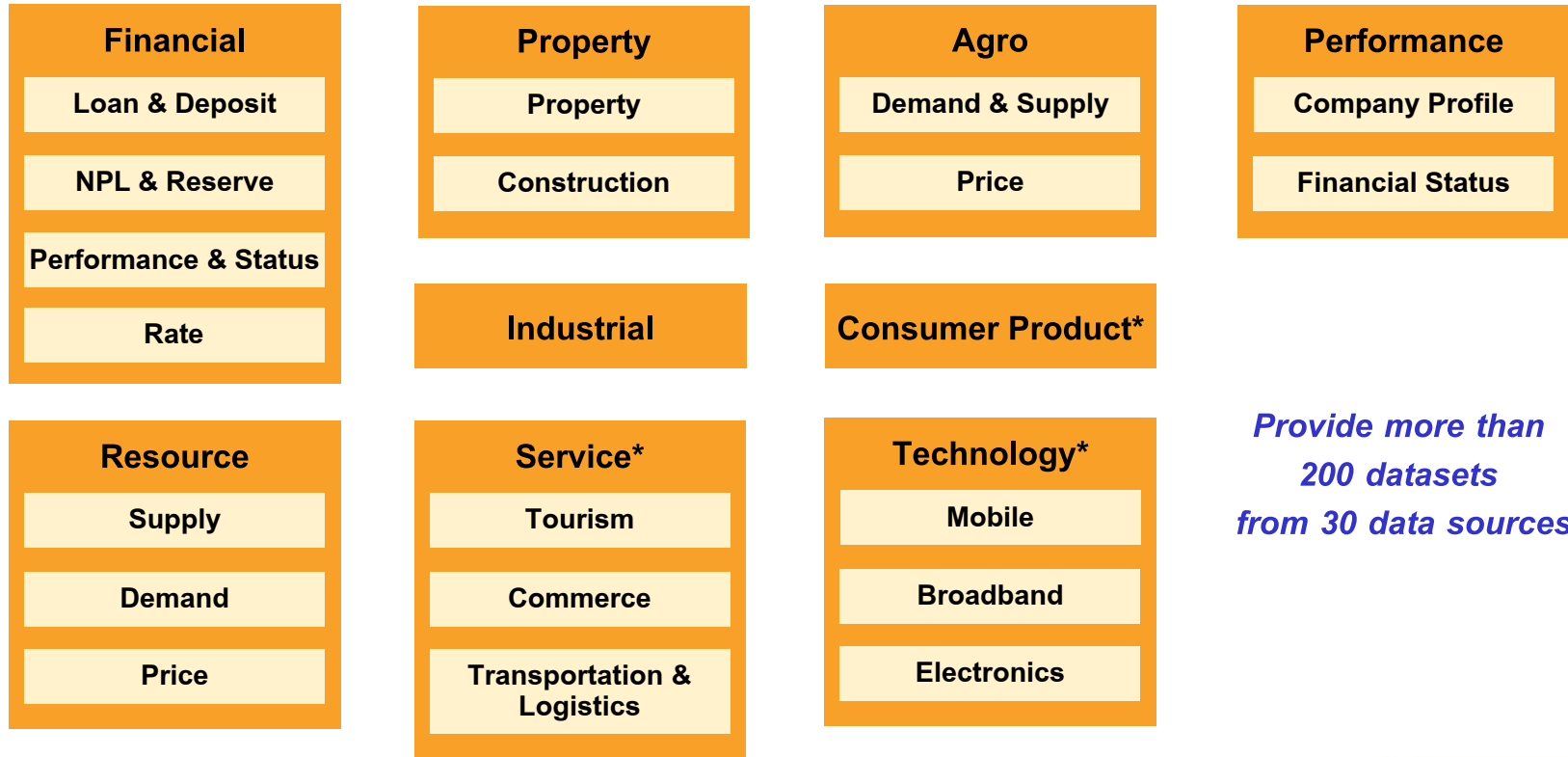
สถานการณ์ในปัจจุบัน



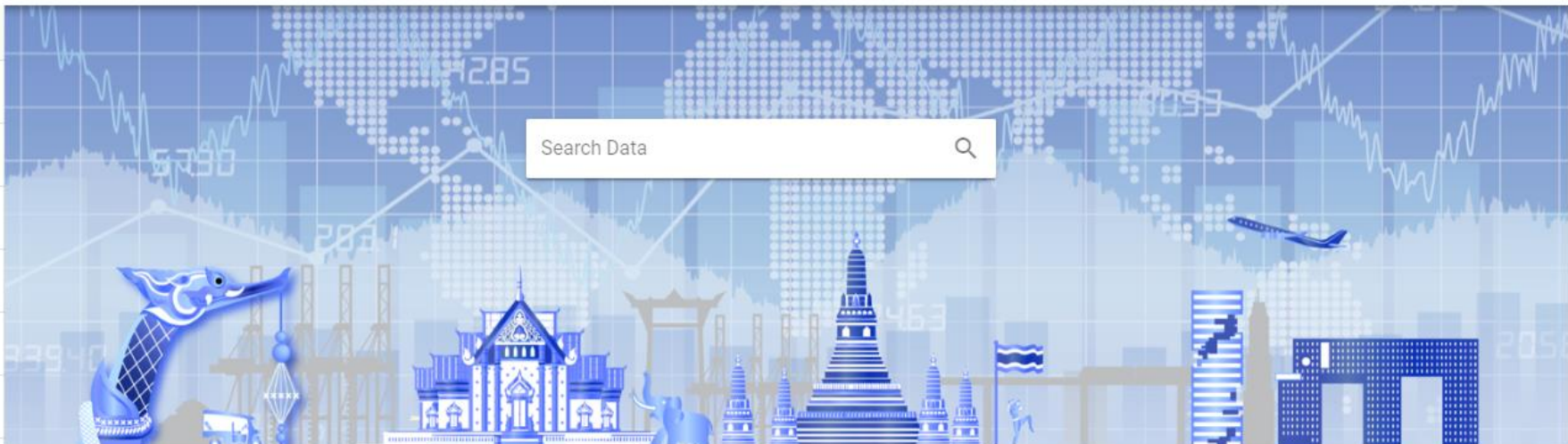
Pain point ของผู้ใช้ข้อมูลในปัจจุบัน

- | | |
|---------------------------|---|
| ข้อมูลกระจาย | <ul style="list-style-type: none"> แหล่งข้อมูลถูกจัดเก็บกระจายอยู่ในหลายองค์กรตามลักษณะการกำกับดูแล ทำให้ผู้ใช้ข้อมูลต้อง <ul style="list-style-type: none"> รวบรวมข้อมูลจากหลายแหล่ง หาข้อมูลยากและอาจไม่ทราบว่า มีข้อมูลเปิดเผยอยู่ |
| ใช้งานยาก เกิดภาระซ้ำซ้อน | <ul style="list-style-type: none"> ข้อมูลบางส่วนยังไม่เป็นรูปแบบ electronic หรือ ready to use format ทำให้ผู้ใช้จำเป็นต้องยัดเยียดวิเคราะห์ได้ยาก ไม่คล่องตัว ต้อง rekey และรวบรวมเป็น time series อาจเกิด human error ได้ มีโอกาสทำซ้ำซ้อนกันระหว่างผู้ใช้ข้อมูลในแต่ละองค์กร ทำให้สูญเสียทรัพยากรทางเศรษฐกิจโดยไม่จำเป็น |





*Provide more than
200 datasets
from 30 data sources*



Search Data

NEW RELEASES










TOP DOWNLOADS

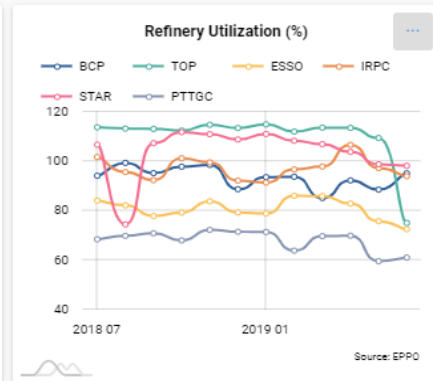
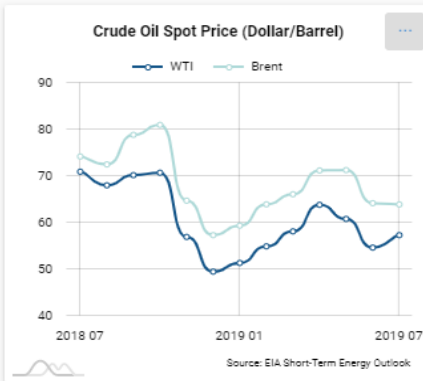
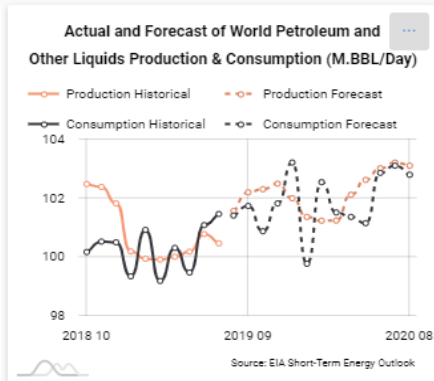
Data Table	Metadata	File
RP_008_Petroleum Price, Classified by Petroleum Type and Source		
RS_015_Petroleum Production, Classified by Energy Type and Field (Unit: Original Unit, BBL/Day-Crude Oil Equivalent)		
RP_004_WTI Crude Oil Futures Price (Cushing, OK Crude Oil Futures Contract 1) (Unit: Dollar/BBL)		
RP_005_Natural Gas Futures Price (Unit: Dollar/BBL)		
RD_015_Sales of LPG and Propane, Classified by Sector and		






















Data Table	Metadata	File
RP_008_Petroleum Price, Classified by Petroleum Type and Source		
PP_001 Profile of Listed Companies in SET and mai		
PS_001_Key Financial Statement by Company (Calendar Year) (Unit: Million Baht)		
RS_016_Refining Capacity, Material Intake and Utilization, Classified by Refinery (Unit: BBL/Day, Percent)		
PR_001_Key Financial Ratio by Company (Calendar Year)		

< Resource

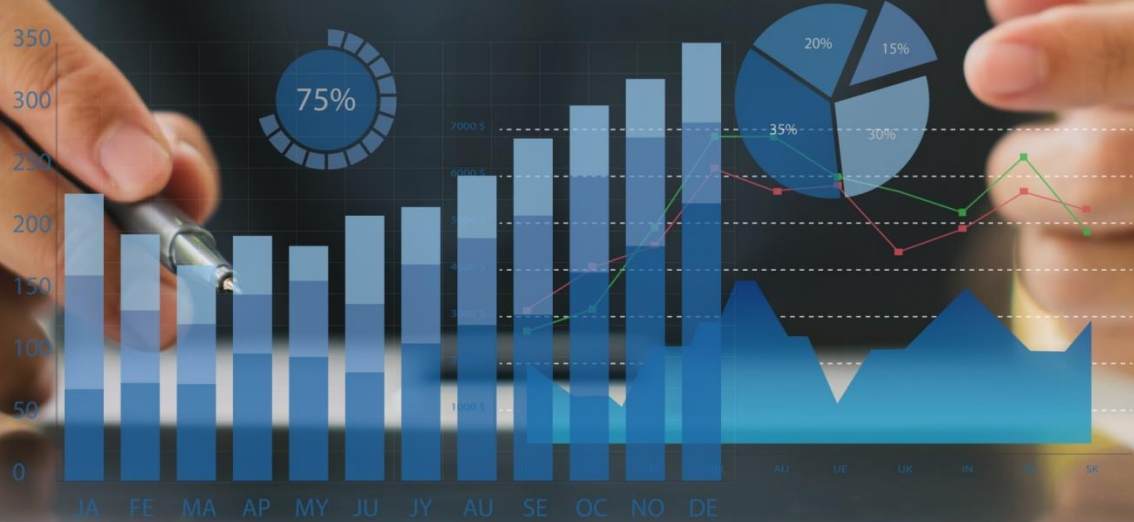
Search Within Resource

-  Performance
-  Resource
- Supply
- Demand
- Price
-  Financial
-  Property
-  Service
-  Technology
-  Industrial
-  Agro
-  Consumer Product



Data Table	Metadata	File	Frequency	Release Date
RD_021_Number of Registered Vehicles, Classified by Fuel Type (Unit: Unit)		 	Monthly	23/01/2020
RD_022_Actual and Forecast of World Petroleum and Other Liquids Consumption (Unit: Million BBL/Day)		 	Monthly	16/01/2020
Price				
RP_001_Price Structure Of Petroleum Product in Bangkok, Classified by Petroleum Type (Unit: Baht/Litre, Baht/KG)		 	Daily	24/01/2020
RP_002_Ethanol and Biodiesel Reference Price (Unit: Baht/Litre)		 	Daily	24/01/2020
RP_003_Marketing and Gross Refinery Margin of Petroleum Product in Bangkok (Unit: Baht/Litre)		 	Daily	24/01/2020
RP_004_WTI Crude Oil Futures Price (Cushing, OK Crude Oil Futures Contract 1) (Unit: Dollar/BBL)		 	Daily	24/01/2020
RP_005_Natural Gas Futures Price (Unit: Dollar/BBL)		 	Daily	24/01/2020

Capital Market Research Database (Data object) by SET



การพัฒนาฐานข้อมูลโดย SET: SET Research website



The image shows two overlapping screenshots of the SET Research website. The top screenshot is the main page (set.or.th/set/mainpage.do) featuring a banner for 'สร้างพอร์ตเครื่องปี 5G' and a 'Market Alerts' sidebar with a 'SET SMART' logo. The bottom screenshot is a detailed page (set.or.th/th/setresearch/setresearch_p1.html) for 'SET Research' with a navigation menu and a 'CMRI Virtual Open House' banner. The banner includes details about a virtual open house on Feb 9, 2021, at 2-4 pm, via online (MS Team), and lists topics like 'ความร่วมมือในการทำวิจัยด้านตลาดทุน SET-CMDF' and 'ทำควมรู้จัก CMRI'. A QR code and a 'คลิกเพื่อลงทะเบียน' button are also present.

การพัฒนาฐานข้อมูลโดย SET: SET Research website



set.or.th/th/setresearch/database/overview.html

YouTube Maps

เกี่ยวกับ คน. กฎเกณฑ์การค้ากับ สัมกับบริการ ข้อมูลซื้อขาย ข้อมูลบริษัทหลักทรัพย์ หน่วยงาน ความรู้การลงทุน ข่าว/กิจกรรม Get Quote ทย่อย

หน้าแรก > SET Research > Database E-mail or Username ลงชื่อเข้าใช้ Log In สมัครสมาชิก สมัครสมาชิกใหม่อยู่ในระบบ

SET Research Overview

SET Research Database Overview Market Microstructure SETSMART CG Database Economic Exposure Universe Dividend Universe Information Research Events ICMC Sentiment Indices Research Grant

➔

- ฐานข้อมูลการซื้อขายหลักทรัพย์
 - Market Microstructure คืออะไร
 - ตัวอย่างผลงานวิจัยจากข้อมูล Market Microstructure
 - การลดขนาดพอร์ตการลงทุนด้วยข้อมูล
- ฐานข้อมูลการซื้อขายหลักทรัพย์
 - รายละเอียดของฐานข้อมูล
 - การลดขนาดพอร์ตข้อมูล
- ฐานข้อมูลบริษัทการเงิน
 - ที่มา
 - รายละเอียดของฐานข้อมูล
 - การลดขนาดพอร์ตข้อมูล
- ฐานข้อมูลการจ่ายปันเงิน
 - Dividend Universe คืออะไร
 - รายชื่อ Dividend Universe

Market Microstructure

SETSMART SET Market Analysis and Reporting Tool

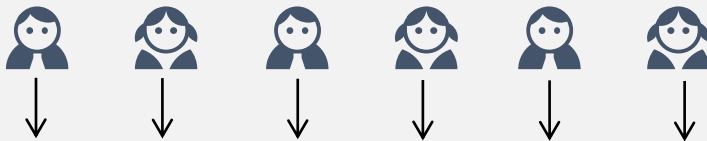
Economic Exposure Universe

CG Database

Dividend Universe

1

stakeholders



SET Operation Platform
Trading / Corporate action / News



SETSMART

**DIVIDEND
UNIVERSE**

**Market
Microstructure**

2

Internal

External



ประชุมหารือถึงข้อจำเป็น ข้อจำกัด
แหล่งข้อมูล ในการใช้ข้อมูล

SET: Research Department

รวบรวม Requirement / พิจารณาความเป็นไป
เสนอเพื่อดำเนินการ / ดำเนินการพัฒนาฐานข้อมูล /
ปรับรูปแบบข้อมูล / ทดลองใช้ฐานข้อมูลในการทำวิจัย



TDI

CG

Others



SETSMART

เครื่องมือการลงทุนที่ใช้วิเคราะห์ข้อมูล Multi-Asset Class ด้วยปัจจัยพื้นฐานเทียบเท่ากับนักวิเคราะห์มืออาชีพ ส่งตรงจากตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย



เข้าถึงข้อมูลดัชนี หุ้น อนุพันธ์ กองทุนรวม และบริษัทจดทะเบียน แบบ Real-time และย้อนหลัง 5 ปี



ใช้งานผ่าน Internet ได้ทุกที่ทุกเวลา



สามารถเลือกดูข้อมูลได้ทั้งภาษาไทยและอังกฤษ



Export สู่ Excel ได้ทันที ง่ายต่อการนำเสนอข้อมูล

Market Summary

ตามติดภาวะตลาดหุ้น อนุพันธ์ แบบ Real-time

Stock Screening

คัดกรองหุ้นเด่น พื้นฐานแกร่ง

Most Active

จัดอันดับหุ้นด้วยเงื่อนไขที่น่าสนใจ

Financial Statement

ครบถ้วนด้วยงบการเงินล่าสุดและย้อนหลัง 5 ปี

วิธีการใช้งานผ่าน Youtube

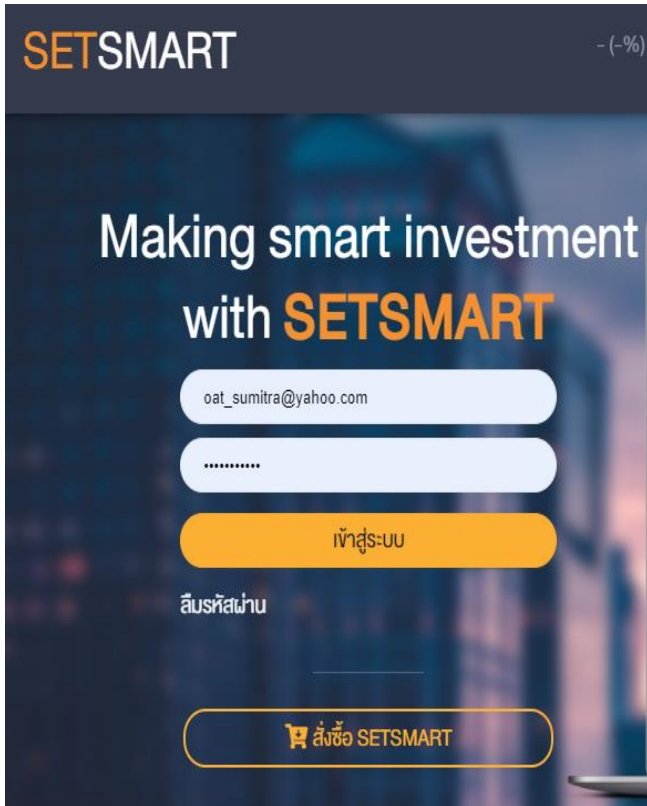
https://www.youtube.com/watch?v=_BG8SlcqKIA&list=PLQtIXHTArVHsEUea2Q3DphQpC7_xvfX5b&index=1

https://www.youtube.com/watch?v=5RlqujJzj6A&list=PLQtIXHTArVHsEUea2Q3DphQpC7_xvfX5b&index=2

เลือก Package

Free Trial	ใช้งาน 1 เดือน	ใช้งาน 6 เดือน	ใช้งาน 12 เดือน Recommended
สมาชิก SET Member ทดลองใช้ฟรี 15 วัน	ราคา 250 บาท	ราคา 1,350 บาท <small>ราคาปกติ 1,500 บาท ลด 10%</small>	ราคา 2,400 บาท <small>ราคาปกติ 3,000 บาท ลด 20%</small>
ใช้สิทธิ์แล้ว	สั่งซื้อ	สั่งซื้อ	สั่งซื้อ

กรณีต้องการข้อมูลย้อนหลัง 5 ปี สามารถติดต่อฝ่ายบริการข้อมูล
(https://www.set.or.th/th/products/info/details_p1.html)



SETSMART - (-%)

Making smart investment with SETSMART


oat_sumitra@yahoo.com

.....

[เข้าสู่ระบบ](#)

ลืมรหัสผ่าน


[🛒 สั่งซื้อ SETSMART](#)



บริการข้อมูลระหว่างวัน (Real time)

บริการข้อมูลราคาซื้อขาย คณิต และข่าว ณ เวลาซื้อขาย (Real-time Information) ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแห่งประเทศไทย รวมถึงระบบข้อมูลอื่นๆ ที่เกี่ยวข้อง

[คลิก](#)



บริการข้อมูล ณ สิ้นวันทำการ (End of day)

บริการข้อมูลราคาปิดของหลักทรัพย์และดัชนีตลาดหลักทรัพย์ ณ สิ้นวันทำการ รวมถึงข้อมูลย้อนหลัง ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแห่งประเทศไทย


[คลิก](#)



บริการข้อมูลย้อนหลังแบบรายครั้ง (Historical Data Request)

บริการข้อมูลย้อนหลังของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแห่งประเทศไทยแบบรายครั้ง เพื่อการวิเคราะห์ในเชิงลึก สำหรับการใช้งานแบบบุคคลหรือภายในองค์กรโดยไม่เผยแพร่ (Internal Use)

[คลิก](#)



บริการข้อมูลในรูปแบบ Website

เว็บไซต์ที่รวบรวมข้อมูลราคาซื้อขายหลักทรัพย์ และอนุพันธ์ย้อนหลัง คณิตย้อนหลัง ข้อมูลกองทุน ข้อมูลทางสถิติที่สำคัญ และข้อมูลสารสนเทศของบริษัทจดทะเบียนของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแห่งประเทศไทยเพื่อให้นักลงทุนสามารถเข้าถึงได้ และมีฟังก์ชันในการวิเคราะห์อย่างเท่าเทียมกับนักวิเคราะห์มืออาชีพ

[คลิก](#)



The screenshot shows the SETSMART website interface. A modal window is open in the center, displaying the SET logo, the text "ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย" (Stock Exchange of Thailand), and "คู่มือ (Manual Guides)". Below this, the SETSMART logo and tagline "SET Market Analysis and Reporting Tool" are shown. At the bottom of the modal, there are two bullet points: "Key Statistics" and "Financial Ratios". A blue arrow points from the "More" menu in the top right of the website to the "Glossary" option in the modal. The background shows the website's navigation bar with "Data for Industry" and "More" tabs, a search bar with "Symbol", and a table with columns for "Volume" and "OI".

DBO1_SETSMART - Tip#2 add data field

Stock Comparison

Comparison Type: Adjusted Price

View By:

1. 2. 3. 4. 5.
6. 7. 8. 9. 10.

Period: To

Remark: Excluding Foreign securities
Price of NVDR security is the same as the price of underlying security from Auto Matching Method.

Set to default (Click on function at column name to sort result or add/remove columns)

Remark : Volume, Value and Avg Price include Off-hour Trading
Other Prices only Auto-Matching

Symbol	Trading										Statistics			
	Prior	Open	High	Low	Close	%Chg.	AOM Volu... ('000 Shar...	AOM Value (M.Baht)	Total Volu... ('000 Shar...	Total Value (M.Baht)	Market Cap.(M.Ba...	P/E* (Tim...	PEG (Tim...	12M ... Divid...
BBL	120.50	124.00	125.00	121.00	123.00	2.07	38,176.50	4,714.71	38,268.19	4,725.4			N/A	4.07

Page 1 of 1

- Bid/Offer price showed as ATC means the best bid/offer at the end of day is still ATO/ATC because the security is halted/suspended during Pre-Open or Pre-Close session until the end of the day. During those periods are not cancelled.
* For securities under Property Fund sector, EPS and P/E will not be calculated, moreover, BV and P/BV denotes NAV and P/NAV respectively. (effective 31 March 2009 onwards)
** Annualized volatility of daily returns for the last date of the selected period.

- Sort Ascending
- Sort Descending
- Add or Remove Columns

เพียง Click ที่ Column ของค่าสถิติ และเลือก Add or Remove column

DBO1_SETSMART- Tip#2 add data field

Comparison Type : Trading & Statistics Adjusted Price

View By : Enter Symbols

1. 2.

6. 7.

Period : 1D 5D 1M 3M 6M 1Y 3Y YTD

Daily To

Go

Remark: Excluding Foreign securities
Price of NVDR

[Set to default](#) (Click on function at c

Symbol	Prior	Open	High	Low	Close	%Chg.	AOM Volu... (*000 Shar...
BBL	120.50	124.00	125.00	121.00	123.00	2.07	38,176.5

Page 1 of 1

- Bid/Offer price showed as ATC means the best bid/offer at the end of day is still ATO/ATC because the security is halt
* For securities under Property Fund sector, EPS and P/E will not be calculated, moreover, BV and P/BV denotes NAV and
** Annualized volatility of daily returns for the last date of the selected period.

The Stock Exchange of Thailand does not intend information in this website to be a
is complete, timely, or accurate. The SET is not responsible for any loss
Copyright © [The Stock Exchange of Thailand](#)

- Trading : Close
- Trading : Chg.
- Trading : %Chg.
- Trading : Avg
- Trading : Bid
- Trading : Offer
- Trading : AOM Volume (*000 Shares)
- Trading : AOM Value (M.Baht)
- Trading : Total Volume (*000 Shares)
- Trading : Total Value (M.Baht)
- Statistics : Market Cap.(M.Baht)
- Statistics : P/E* (Times)
- Statistics : PEG (Times)
- Statistics : P/BV (Times)
- Statistics : Book Value per Share*(Baht)
- Statistics : Dividend Yield(%)
- Statistics : 12M Trailing Dividend Yield(%)
- Statistics : Turnover Ratio(%)
- Statistics : Listed Shares (*000 Shares)
- Statistics : AUM (M.Baht)
- Statistics : Par (Baht)
- Statistics : Beta**
- Statistics : ROI

Remark : Volume, Value and Avg Price include Off-hour Trading
Other Prices only Auto-Matching

Statistics			
Market Cap.(M.Ba...	P/E* (Tim...	PEG (Tim...	12M ... Divid...
		N/A	4.07

Sort Ascending

Sort Descending

Add or Remove Columns

... during those periods are not cancelled.

... does not claim that the information provided
... using information from its website.
[Party Terms](#)

Tick เลือกค่าสถิติที่ต้องการ

	MOU	SET Corner	SET IC	Info Service	Data Request
ผู้มีสิทธิใช้ข้อมูล	บุคลากรของคณะที่มีข้อตกลงร่วมกับตลาด			On Demand	นักศึกษา อาจารย์ ผู้วิจัย ขออนุญาตให้ฝ่ายวิจัย วิจัย
ลักษณะข้อมูล	SETSMART Enterprise เรียกผ่าน Access / SQL	SETSMART Web-based ผ่าน Excel เรียกด้วย SQL ไม่ได้		SETSMART Enterprise by Info Services ผ่าน Access / SQL	ฝ่ายวิจัยติดต่อฝ่ายบริการ ข้อมูลถึงข้อมูลให้
ค่าใช้จ่ายในการใช้ข้อมูล	ไม่มีค่าใช้จ่าย	ไม่มีค่าใช้จ่าย	ไม่มีค่าใช้จ่าย	First entry and monthly payment (3 University)* And by data request	ไม่มีค่าใช้จ่าย
Pain Point	ผู้วิจัยไม่ทราบว่ามีข้อมูล	<ul style="list-style-type: none"> ผู้วิจัยไม่ทราบว่ามีข้อมูล ดึงข้อมูลยาก เนื่องจากไม่สามารถดึงด้วยชุดคำสั่ง ได้ 		<ul style="list-style-type: none"> สถาบัน / ผู้วิจัยมี ค่าใช้จ่าย ปัจจุบันมี 3 มหาวิทยาลัย 	<ul style="list-style-type: none"> เป็นภาระงานของ ฝ่ายงานในตลาดใน การประสานงาน

DBO1_SETSMART – การสนับสนุนของ SET เพื่อการวิจัย



 <p>บริการข้อมูลระหว่างวัน (Real time)</p> <p>บริการข้อมูลราคาซื้อขาย ดัชนี และข่าว ณ เวลาซื้อขาย (Real-time Information) ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแห่งประเทศไทย รวมถึงระบบข้อมูลอื่นๆที่เกี่ยวข้อง</p> <p>คลิก</p>	 <p>บริการข้อมูล ณ สิ้นวันทำการ (End of day)</p> <p>บริการข้อมูลราคาปิดของหลักทรัพย์และดัชนีตลาดหลักทรัพย์ ณ สิ้นวันทำการ รวมถึงข้อมูลย้อนหลัง ของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแห่งประเทศไทย</p> <p>คลิก</p>	 <p>บริการข้อมูลย้อนหลังแบบรายครั้ง (Historical Data Request)</p> <p>บริการข้อมูลย้อนหลังของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแห่งประเทศไทยแบบรายครั้ง เพื่อการวิเคราะห์เชิงลึก สำหรับการใช้งานครึ่งปี (Internal Use)</p> <p>คลิก</p>	 <p>บริการข้อมูลในรูปแบบ Website</p> <p>เว็บไซต์ที่รวบรวมข้อมูลราคาซื้อขายหลักทรัพย์ และอนุพันธ์ย้อนหลัง ดัชนีย้อนหลัง ข้อมูลกองทุน ข้อมูลทางสถิติที่สำคัญ และข้อมูลสารสนเทศของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และตลาดสัญญาซื้อขายล่วงหน้าแห่งประเทศไทย เพื่อให้นักลงทุนสามารถเข้าถึงได้ และมีฟังก์ชันในการวิเคราะห์อย่างเท่าเทียมกับนักวิเคราะห์มืออาชีพ</p> <p>คลิก</p>
---	--	--	--



หนังสือขออนุญาตให้ข้อมูลจากคณะ
แบบฟอร์มขออนุญาตให้ข้อมูล
ร่างรายงาน

ฝ่ายวิจัย ตลาดหลักทรัพย์ฯ

สอบถามรายละเอียดเพิ่มเติม

ถ้ามหาวิทยาลัยมีฐานข้อมูลอยู่แล้วให้ contact ทีมมหาวิทยาลัย / อธิบายช่องทางใช้ข้อมูล

ถ้ามหาวิทยาลัยไม่มีฐานข้อมูล

- รายงานนี้มีประโยชน์กับตลาดทุนโดยรวมหรือไม่
- เสนอเพื่อลดค่าบริการข้อมูล 50%
- ยกเว้นค่าบริการข้อมูลทั้งหมด



ข้อมูลการซื้อขายหลักทรัพย์เชิงลึก ทั้งจากข้อมูลการส่งคำสั่งซื้อขายหลักทรัพย์ (Order) และข้อมูลการจับคู่การซื้อขายหลักทรัพย์ (Deal)

- ⊕ ข้อมูลชุดนี้ปฏิสัมพันธ์ระหว่างองค์ประกอบในตลาดทุน ตลอดจนพฤติกรรมของส่งคำสั่งการซื้อขายของนักลงทุน ตามบริบทของตลาด
- ⊕ ช่วยให้นักลงทุนเข้าใจกลไกการทำงานของตลาดทุน รู้จักประเภทของนักลงทุนต่างๆ และเหตุจูงใจที่นักลงทุนเหล่านั้นใช้ในการดำเนินการซื้อขายหลักทรัพย์หรือตราสาร
- ⊕ ผู้กำกับดูแลกฎ กติกาการซื้อขายหลักทรัพย์หรือตราสาร สามารถออกแบบระเบียบและรูปแบบการซื้อขายที่เหมาะสมในตลาดทุน เพื่อส่งเสริมให้การซื้อขายหลักทรัพย์หรือตราสารมีสภาพคล่องสูงและโปร่งใสเป็นธรรม

Data sources



ข้อมูลการซื้อขายจากระบบการซื้อขายของตลาดหลักทรัพย์
ระดับความลึกข้อมูล ตามเกณฑ์การเปิดเผยข้อมูลของตลาดหลักทรัพย์



Key Information:

- วัน / เวลาซื้อขาย หรือจับคู่
- ฝ่ายที่ทำธุรกรรม: ซื้อ / ขาย
- ประเภทหลักทรัพย์
- ชื่อย่อหลักทรัพย์
- เลขที่ธุรกรรม
- จำนวนหุ้นที่ทำรายการ
- ตลาด: SET / mai
- รายการชอร์ต: Yes / No
- รายการ NVDR: Yes / No



Data Dictionary



วิธีปฏิบัติเกี่ยวกับการซื้อขายหลักทรัพย์

ผู้มีสิทธิ์ใช้ข้อมูล: 9 คณะ 9 มหาวิทยาลัย

เฉพาะนักศึกษาและอาจารย์ของมหาวิทยาลัยที่มี MOU





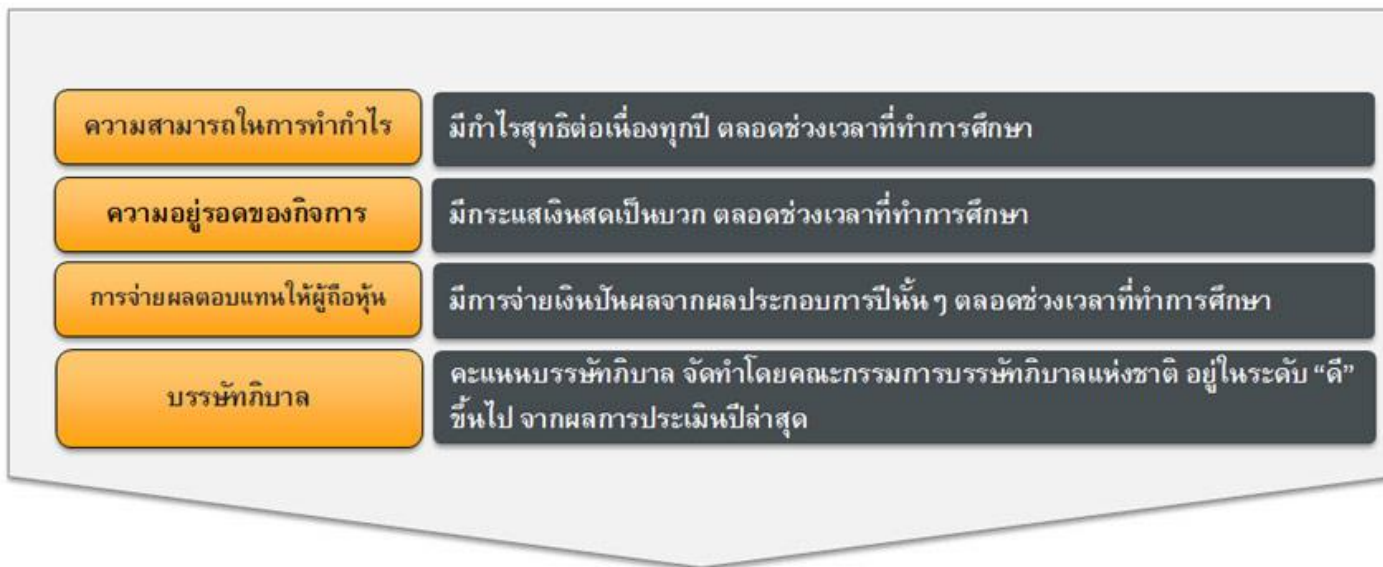
ข้อมูลของบริษัทจดทะเบียนเกี่ยวกับผลประกอบการ สภาพคล่อง ประวัติการจ่ายปันผล และ
บรรษัทภิบาล

Data sources



SETSMART

Dividend Universe





Key Information:

- ✔ ชื่อย่อหลักทรัพย์
- ✔ กำไรสุทธิย้อนหลัง 7 ปี
- ✔ ประวัติการจ่ายเงินปันผลย้อนหลัง 7 ปี
- ✔ กระแสเงินสดจากการดำเนินงานย้อนหลัง 7 ปี
- ✔ ลำดับคะแนนบรรษัทภิบาลล่าสุด (จำนวนดาว)

Sample use case

- ✔ SET Note
- ✔ SET Research Paper

10 อันดับ หุ้นปันผล ในกลุ่ม Dividend Universe*



ชื่อย่อ	ชื่อบริษัท	ธุรกิจ	Dividend Yield (%) เฉลี่ย 5 ปี	คะแนนบริษัท กิตา	P/E (เท่า) ณ 28 ก.พ. 63
1 MODERN	บมจ. โมเดิร์นฟอรัมกรุ๊ป	ของใช้ในครัวเรือนและสำนักงาน	9.95	★★★★★	13.24
2 SWC	บมจ. เซอร์วิค คอร์ปอเรชั่น (ประเทศไทย) (มหาชน)	สินค้าอุตสาหกรรม	9.87	★★★★★	9.62
3 LHK	บมจ. โลหะกิจ เม็กคอส	เหล็ก	9.46	★★★★★	9.43
4 KGI	บจ. เคจีไอ (ประเทศไทย)	เงินทุนและหลักทรัพย์	8.54	★★★★★	8.78
5 MFC	บจ. เอ็มเอฟซี	เงินทุนและหลักทรัพย์	8.14	★★★★★	14.16
6 MBAX	บมจ. เม็คสิเบกซ์ (มหาชน)	สินค้าอุตสาหกรรม	7.96	★★★★★	11.07
7 PT	บมจ. พรีเมียร์ เทคโนโลยี	เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร	7.89	★★★★★	7.79
8 INTUCH	บมจ. อินทัช โฮลดิ้งส์	เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร	7.86	★★★★★	15.62
9 PATO	บมจ. พาตเคมิคัลอุตสาหกรรม	ปิโตรเคมีและเคมีภัณฑ์	7.58	★★★★★	16.33
10 AIT	บมจ. เอ็ดวาทซ์ อินฟอร์เมชั่น เทคโนโลยี	เทคโนโลยีสารสนเทศและการสื่อสาร	7.57	★★★★★	9.79

คำนวณจากค่าเฉลี่ยของอัตราผลตอบแทนทุกสิ้นปี ในช่วงปี 2558-2562

168 บริษัทจดทะเบียนคัดรายชื่อหุ้นปันผลโดดเด่น Dividend Universe

*เกณฑ์การคัดเลือก Dividend Universe

- 1 มีกำไรสุทธิต่อเนื่อง 5 ปี
- 2 มีกระแสเงินสดจากการดำเนินงานเป็นบวกต่อเนื่อง 5 ปี
- 3 มีการจ่ายเงินปันผล (พิจารณาจากจ่ายเงินปันผลที่เป็นตัวเงิน) ต่อเนื่อง 5 ปี (คำนวณจากอัตราผลตอบแทนจากเงินปันผลเฉลี่ยจากทุกสิ้นปี)
- 4 มีคะแนนบรรษัทภิบาล (CG Score) ในปี 2562 อยู่ในระดับที่ดี ตั้งแต่ 3 ดาวขึ้นไป



ที่มา: www.set.or.th/setresearch

การพัฒนาฐานข้อมูลโดยการเก็บรวบรวมจากรายงานต่าง ๆ

Clear Research Question

ผู้วิจัยมีความเข้าใจอย่างชัดเจนเกี่ยวกับประเด็นที่ต้องการศึกษา

Expert Key Informants

ผู้ให้ข้อมูลมีความเข้าใจเกี่ยวกับความหมายของข้อมูลและความสำคัญของข้อมูล

Appropriate Data Source

แหล่งข้อมูลที่ใช้ในการศึกษามีความเหมาะสม



Data Integrity

ผู้ที่ทำหน้าที่รวบรวมข้อมูลมีความเข้าใจในฐานข้อมูลนั้นๆ และมีหลักการที่ชัดเจนในการทำฐานข้อมูล เพื่อให้ข้อมูลถูกต้อง สมบูรณ์.

Appropriate Research Tools

เลือกใช้เครื่องมือในการทำวิจัยที่เหมาะสม

Comply to related regulations

การใช้ข้อมูลเป็นไปตามกฎหมายที่เกี่ยวข้อง

Data Continuity

ความต่อเนื่องของฐานข้อมูล



ข้อมูลสะท้อนศักยภาพในการเติบโตในต่างประเทศของบริษัทจดทะเบียน จากสถานะการลงทุนทางตรงในต่างประเทศ และ/หรือรายได้จากต่างประเทศ

Data sources



งบการเงินประจำปี และ
หมายเหตุประกอบงบ



รายงาน 56-1

Key information

ชื่อย่อบริษัท

อุตสาหกรรม

ปีบัญชี

ประเทศ / ภูมิภาค

ธุรกิจ

ประเภทการลงทุน

มูลค่าเงินลงทุน

รายได้

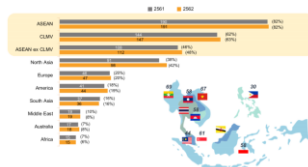
Data Definition





Sample use cases

✓ SET Research paper *



✓ SET CLMV Exposure Index

SETCLMV Index Highlight Monthly Report



- SET50
- SET100
- sSET
- SETCLMV
- SETHD
- SETTHSI
- SETWB
- mai

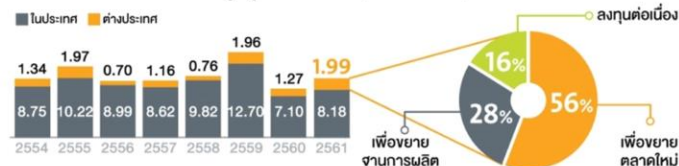
ปี	ม.ค.	ก.พ.	มี.ค.	เม.ย.	พ.ค.	มิ.ย.	ก.ค.	ส.ค.	ก.ย.	ต.ค.	พ.ย.	ธ.ค.
2564												
2563												
2562												

บจ.ไทย เต็มโตแข็งแกร่ง ในต่างประเทศ



ณ สิ้นปี 2561
231 บริษัท (44%) ใน SET
ลงทุนในต่างประเทศ

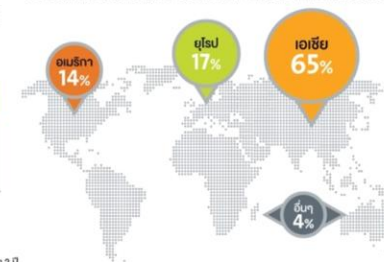
ปี 2561 พบ 113 บริษัท ลงทุนในต่างประเทศ มูลค่ารวม 1.99 แสนล้านบาท สูงสุดในรอบ 8 ปี (หน่วย: แสนล้านบาท)



รายได้จากต่างประเทศ เต็มโตต่อเนื่องตลอด 3 ปีที่ผ่านมา (ปี 59-61)



65% ของรายได้ปี 61 มาจากประเทศในเอเชีย







www.set.or.th











- 1) ข้อมูลคำตอบแทนกรรมการ ทั้งนโยบายการจ่ายค่าตอบแทน การจ่ายค่าตอบแทนที่ระบุถึงประเภทค่าตอบแทน อัตราการจ่าย มูลค่าการจ่าย ตลอดจนกิจกรรมการเข้าร่วมประชุมของคณะกรรมการ
- 2) ข้อมูลคุณสมบัติกรรมการ ทั้ง เพศ อายุ การศึกษา ประสบการณ์ การอบรม การถือครองหุ้น เป็นต้น

Data sources

-  งบการเงินประจำปี
-  รายงาน 56-1
-  เอกสารประกอบการประชุมผู้ถือหุ้น
-  SETSMART / ข้อมูลในเว็บไซต์ของ บจ.

Key information

-  ข้อมูลคณะกรรมการบริษัท / คณะกรรมการชุดย่อย
-  ข้อมูลการจัดประชุมของแต่ละชุดกรรมการ
-  ข้อมูลการเข้าร่วมประชุมของกรรมการแต่ละท่านในแต่ละชุด
-  นโยบายการจ่ายค่าตอบแทนกรรมการ
-  การจ่ายค่าตอบแทนกรรมการแต่ละท่าน
-  ข้อมูลคุณสมบัติกรรมการ

Co-Contributors



CHULALONGKORN
BUSINESS SCHOOL
FLASHPUP FOR LIFE



ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย



Data Dictionary



ฐานข้อมูลคุณสมบัติกรรมการ

Volume

1

CORPORATE GOVERNANCE PROJECT

Research Department, The Stock Exchange of Thailand

Corporate Governance and Remuneration Data Dictionary

Dataset 1: Board Qualification

Version 1.0

Effective Date: November7, 2017

All rights reserved. The Stock Exchange of Thailand is the owner of this Data Dictionary for Corporate Governance and Remuneration Database Version 1.0. No part of this Data Dictionary may be reproduced, stored in a retrieval system, or transmitted in any form or by any other means, electronic, mechanical, photocopying, recording, or otherwise without the prior written permission from the owner.

Table 1 Board of Director

Description: รายชื่อคณะกรรมการของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยและตลาดหลักทรัพย์เอ็ม เอ ไอ

Field Name	Description	Type	Length	Key Index	Possible Value
I_BOD	รหัสกรรมการ	Integer		1	
N_TITLE_T	คำนำหน้าชื่อ (ไทย)	Character	30		
N_FIRST_T	ชื่อ (ไทย)	Character	40		
N_LAST_T	นามสกุล (ไทย)	Character	70		
N_TITLE_E	คำนำหน้าชื่อ (อังกฤษ)	Character	30		
N_FIRST_E	ชื่อ (อังกฤษ)	Character	40		
N_LAST_E	นามสกุล (อังกฤษ)	Character	70		

Table 2 Detail of Board of Director

Description: วันที่ได้รับมอบหมายให้เป็นกรรมการ ประเภทกรรมการ ของคณะกรรมการของบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทยและตลาดหลักทรัพย์เอ็ม เอ ไอ

Field Name	Description	Type	Length	Key Index	Possible Value
I_COMPANY	รหัสบริษัท	Integer		1	
I_BOD	รหัสกรรมการ	Integer		2	
I_BOD_POS	รหัสตำแหน่งกรรมการ	Integer		3	
D_START	วันที่เริ่มเป็นกรรมการ	Date		4	
I_BOD_TYPE	รหัสประเภทกรรมการ	Character			
D_END	วันที่สิ้นสุดการเป็นกรรมการ	Date			
S_BOD	ลำดับตำแหน่งคณะกรรมการ	Character			



Sample use cases

- CMRI Working paper *
- Thai Directorship Report

Thai Directorship 2015



Board Size and Number of Independent Directors (IDs)



ปี	หัวข้อ	จัดทำโดย
2560	สรุปผลสำรวจข้อมูลกรรมการและผู้บริหารของบริษัทจดทะเบียน 2559	รศ. ดร.พรอนงค์ นุชราตระกูล ดร.จณัญญา เสถียรโชค อ. ณรงค์ฤทธิ์ อิศวเรืองพิทพ จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย ผศ. ดร.สุนทรี เหล่าพัฒน์ ดร.ศรินทร์ช อินละคร มหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์ วิทยาเขตศรีราชา
2559	การศึกษาความสัมพันธ์ระหว่างค่าตอบแทนกรรมการ ระดับของการกำกับดูแลกิจการที่ดี และผลการดำเนินงานของบริษัทจดทะเบียนของประเทศไทย	รศ. ดร.พรอนงค์ นุชราตระกูล จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย ผศ. ดร.สุนทรี เหล่าพัฒน์ มหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์ วิทยาเขตศรีราชา
2559	Director Remuneration in Thai Publicly Listed Firms: Trends over the last 15 years (2001-2015)	Sirinuch Inlakorn Suntharee Lhaopadcha Nuthawut Sabsombat Kasetsart University Si Racha campus
2559	Board Diversity in Thai Publicly Listed Firms	Sirinuch Inlakorn Suntharee Lhaopadcha Nuthawut Sabsombat Kasetsart University Si Racha campus
2559	สรุปผลสำรวจข้อมูลกรรมการและผู้บริหารของบริษัทจดทะเบียน 2558	รศ. ดร.พรอนงค์ นุชราตระกูล ดร.จณัญญา เสถียรโชค อ. ณรงค์ฤทธิ์ อิศวเรืองพิทพ จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย ผศ. ดร.สุนทรี เหล่าพัฒน์ ดร.ศรินทร์ช อินละคร มหาวิทยาลัยเกษตรศาสตร์ วิทยาเขตศรีราชา

R&D Cost

Innovation

Sustainability

Essential Products

Circular Economy

Risk: Operation Area

ทำความรู้จัก CMRI

01

ภาพรวมการส่งเสริมการผลิตงานวิจัยด้านตลาดทุน

02

ฐานข้อมูลเพื่อการวิจัยด้านตลาดทุน

- Financial & Economic Data Bureau
- ฐานข้อมูลเพื่องานวิจัยด้านตลาดทุน

03

แพลตฟอร์มเพื่องานวิจัยด้านตลาดทุน

04

Research innovation and use cases of textual data

Capital Market Research Platform

Pilot Project

“Any time, Anywhere.”

Platform Initiatives



Increase
Researchers



Database and Cost
Sharing



Research
From Anywhere



Access
Anytime

Requirement from Universities



Remote to Work



Research Database



Software / Application

Platform Specification



Cloud Technology



Info support Team



IT support Team

ทำความรู้จัก CMRI

01

ภาพรวมการส่งเสริมการผลิตงานวิจัยด้านตลาดทุน

02

ฐานข้อมูลเพื่อการวิจัยด้านตลาดทุน

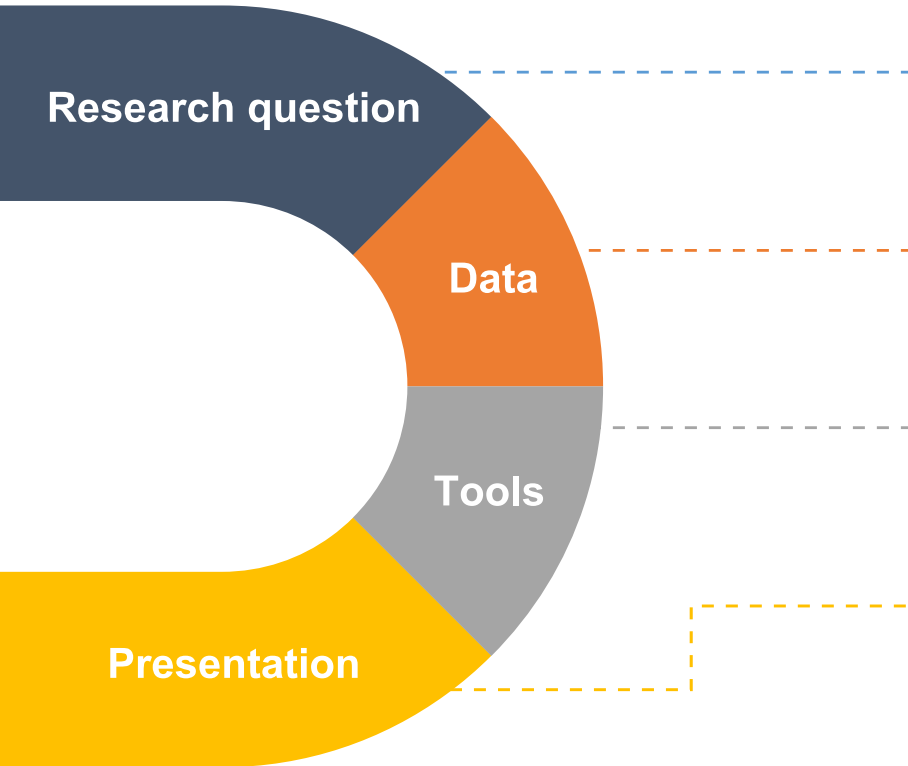
- Financial & Economic Data Bureau
- ฐานข้อมูลเพื่องานวิจัยด้านตลาดทุน

03

แพลตฟอร์มเพื่องานวิจัยด้านตลาดทุน

04

Research innovation and use cases of textual data



When we are disrupted by technology

ตลาดทุนในปัจจุบันมีการเปลี่ยนแปลงที่สำคัญในหลายด้านโดยเฉพาะการเปลี่ยนแปลงด้านเทคโนโลยี ทำให้มีนวัตกรรมทางการเงิน อาทิเช่น Blockchain, ICO, Fintech, Algorithm Trading, Roboadvisor ซึ่งส่งผลต่อพฤติกรรมผู้ลงทุน

Data grows exponentially

ข้อมูลต่างๆ มีปริมาณเพิ่มขึ้นและถูกจัดเก็บไว้ใน database ขนาดใหญ่ โดยไม่เพียงแต่ตัวเลขที่สามารถย้อนกลับไปในอดีตได้ยาวขึ้นด้วยความถี่ที่สูงขึ้นเท่านั้น ข้อมูลในยุคดิจิทัลยังรวมไปถึงข้อมูลที่อยู่ในลักษณะของตัวอักษรและรูปภาพอีกด้วย

Computer was made for this

การวิเคราะห์ข้อมูลปริมาณมากเหล่านี้จำเป็นต้องอาศัยเครื่องมือหรือเทคนิคใหม่ๆ ซึ่งต้องพึ่งพาความสามารถในการเขียนโปรแกรมคอมพิวเตอร์ซึ่งในปัจจุบันมี software ที่เป็น open source และเปิดให้ดาวน์โหลดมาใช้โดยไม่มีค่าใช้จ่าย

New way for communication

การนำเสนอผลงานวิจัยต้องมีรูปแบบที่ทันสมัยและน่าสนใจผ่านบนช่องทางหรือ platform ที่มีผู้ใช้งานจำนวนมาก เพื่อเป็นการเพิ่ม visibility ซึ่งนำไปสู่การเพิ่ม impact ของผลการศึกษา

Make it Work for Everyone

สถาบันวิจัยเพื่อตลาดทุน ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย มีความประสงค์ที่จะสนับสนุนแนวคิดสร้างสรรค์ที่สามารถนำไปใช้ได้จริงในทางปฏิบัติ หรือสามารถนำไปต่อยอดได้ โดยการผสมองค์ความรู้และแนวคิดใหม่ๆ ที่เกี่ยวข้องกับตลาดทุนในหลายมิติ ซึ่งต้องการองค์ความรู้ที่จะผสมผสานในหลายสาขาวิชา

2018

2019

2020

Capital Market Smart Idea

สรรหาแนวคิด/ คำถามที่น่าสนใจ โดยเปิดให้ผู้ที่สนใจเข้าร่วมโครงการสามารถนำเสนอแนวคิดหรือคำถามที่สามารถนำมาทำการศึกษาเพื่อหาคำตอบ โดยผู้ที่สนใจสามารถเสนอแนวคิดหรือคำถามผ่านการ Survey บนช่องทาง Online

CM Research innovation Contest

เปิดรับสมัครทีมวิจัยจากภาคการศึกษาหรือหน่วยงานภาคเอกชนที่สนใจนำเสนอแนวทางการแก้ปัญหาในหัวข้อที่กำหนด โดยส่งเสริมให้ใช้ data หรือ methodology ที่ผสมผสานกันจากหลายสาขา พร้อมรับรางวัลเป็นทุนสนับสนุนงานวิจัย

Premier VDO clip on SET social media

ฝ่ายวิจัย ร่วมกับฝ่ายการตลาดจัดทำคลิป VTR ที่เป็น teaser ของงานวิจัยสั้นๆ ประมาณไม่เกิน 5 นาที โดยมีผู้จัดการตลาดหลักทรัพย์มาเกริ่นนำให้ในทุกตอน ทั้งหมด 5 ตอนและเผยแพร่เป็น Clip premier ใน facebook ของตลาดหลักทรัพย์ในทุกเที่ยงตรงของวันเสาร์



News Sentiment

Bloomberg มีฟังก์ชันที่จับบอกรายงานข่าวใน topic ต่างๆ และยังบอกด้วยว่าในข่าวที่ออกมาในเวลาต่างๆ นั้นมีเนื้อหาไปในทางบวกหรือลบ ในขณะที่ Refinitiv อนุญาตให้ใช้ python เข้ามาดึง API ในฐานข้อมูลข่าวไปวิเคราะห์แบบ real time



Macro Leading indicators

World Economic Outlook (WEO) ปี 2021 ที่จัดทำโดย IMF นั้นใช้ Economic Policy Uncertainty (EPU) ซึ่งพัฒนาจาก Bank of England ซึ่งเป็นดัชนีที่สร้างจากการนับคำในหัวข้อข่าวที่เกี่ยวข้องกับความไม่แน่นอนเกี่ยวกับนโยบายเศรษฐกิจ



ESG third party verifier

บริษัท Arabesque S-ray ผู้ให้บริการข้อมูลด้าน ESG ที่มีชื่อเสียง และประเมินบริษัทมาแล้วกว่า 7,000 บริษัททั่วโลกโดย ESG score ที่ได้นั้นมาจาก Machine learning ซึ่งมีการใช้ Textual analysis มาช่วยวิเคราะห์



Volatility measurement

บริษัท JP Morgan ซึ่งเป็นธนาคารรายใหญ่ของ US ได้พัฒนาดัชนี Volfefe ซึ่งคำนวณมาจากจำนวนการโพสต์ใน twitter ของ Trump ซึ่งสามารถอธิบายความผันผวนของอัตราผลตอบแทนของตลาดพันธบัตร US ได้

Common risk factors in the returns on stocks and bonds

[EF Fama, KR French](#) - *Journal of financial economics*, 1993 - Elsevier

This paper identifies five common risk factors in the returns on stocks and bonds. There are three stock-market factors: an overall market factor and factors related to firm size and book-to-market equity. There are two bond-market factors, related to maturity and default risks. Stock returns have shared variation due to the stock-market factors, and they are linked to bond returns through shared variation in the bond-market factors. Except for low-grade corporates, the bond-market factors capture the common variation in bond returns. Most ...

☆ ๑๑ อ้างโดย24718 บทความที่เกี่ยวข้อง ทั้งหมด 41 ฉบับ

When is a liability not a liability? Textual analysis, dictionaries, and 10-Ks

[T Loughran, B McDonald](#) - *The Journal of finance*, 2011 - Wiley Online Library

Previous research uses negative word counts to measure the tone of a text. We show that word lists developed for other disciplines misclassify common words in financial text. In a large sample of 10-Ks during 1994 to 2008, almost three-fourths of the words identified as ...

☆ ๑๑ อ้างโดย2761 บทความที่เกี่ยวข้อง ทั้งหมด 8 ฉบับ

[PDF] Latent dirichlet allocation

[DM Blei, AY Ng, MI Jordan](#) - *the Journal of machine Learning research*, 2003 - jmlr.org

We describe latent Dirichlet allocation (LDA), a generative probabilistic model for collections of discrete data such as text corpora. LDA is a three-level hierarchical Bayesian model, in which each item of a collection is modeled as a finite mixture over an underlying set of ...

☆ ๑๑ อ้างโดย36051 บทความที่เกี่ยวข้อง ทั้งหมด 112 ฉบับ ๑๑

Do managements tell us the whole truth and nothing but the truth? Impact of textual sentiment in financial disclosure to future firm performance and market response in ...

[S Chuthanondha](#) - *International Journal of Monetary ...*, 2020 - inderscienceonline.com

This paper empirically explores causal relation between financial news and stock price performance by applying textual analysis to listed firms' financial disclosure in Thailand. Managers generally use language in management discussion and analysis (MD&A) report ...

☆ ๑๑ บทความที่เกี่ยวข้อง ทั้งหมด 5 ฉบับ

A survey of behavioral finance

[N Barberis, R Thaler](#) - *Handbook of the Economics of Finance*, 2003 - Elsevier

Behavioral finance argues that some financial phenomena can plausibly be understood using models in which some agents are not fully rational. The field has two building blocks: limits to arbitrage, which argues that it can be difficult for rational traders to undo the ...

☆ ๑๑ อ้างโดย4560 บทความที่เกี่ยวข้อง ทั้งหมด 34 ฉบับ

On the pricing of corporate debt: The risk structure of interest rates

[RC Merton](#) - *The Journal of finance*, 1974 - JSTOR

THE VALUE OF a particular issue of corporate debt depends essentially on three items:(1) the required rate of return on riskless (in terms of default) debt (eg, government bonds or very high grade corporate bonds);(2) the various provisions and restrictions contained in the ...

☆ ๑๑ อ้างโดย14001 บทความที่เกี่ยวข้อง ทั้งหมด 22 ฉบับ

Measuring economic policy uncertainty

[SR Baker, N Bloom, SJ Davis](#) - *The quarterly journal of ...*, 2016 - academic.oup.com

We develop a new index of economic policy uncertainty (EPU) based on newspaper coverage frequency. Several types of evidence—including human readings of 12,000 newspaper articles—indicate that our index proxies for movements in policy-related ...

☆ ๑๑ อ้างโดย4916 บทความที่เกี่ยวข้อง ทั้งหมด 48 ฉบับ

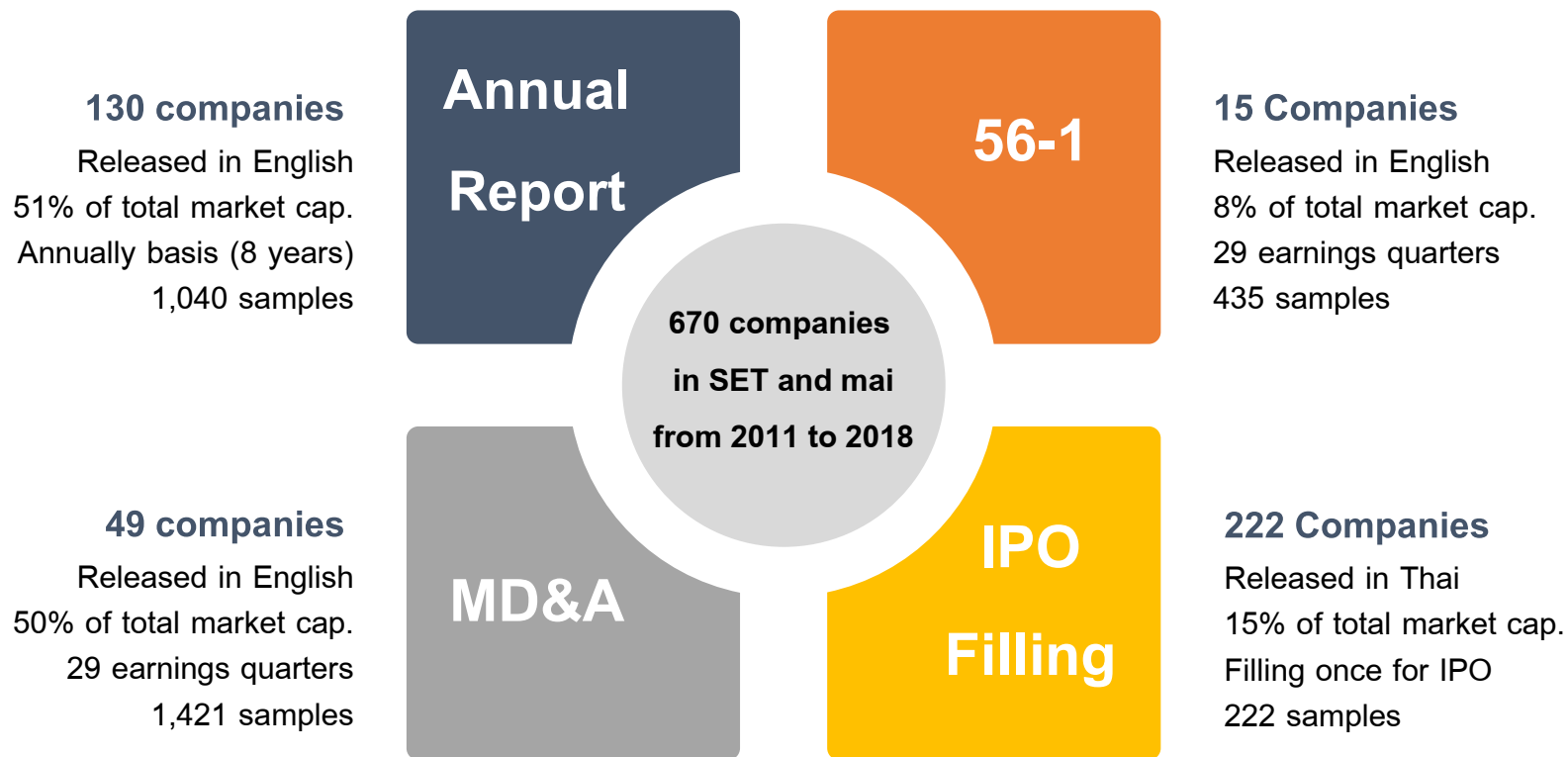
More than words: Quantifying language to measure firms' fundamentals

[PC Tetlock, M Saar-Tsechansky...](#) - *The Journal of ...*, 2008 - Wiley Online Library

We examine whether a simple quantitative measure of language can be used to predict individual firms' accounting earnings and stock returns. Our three main findings are:(1) the fraction of negative words in firm-specific news stories forecasts low firm earnings;(2) firms' stock prices briefly underreact to the information embedded in negative words; and (3) the earnings and return predictability from negative words is largest for the stories that focus on fundamentals. Together these findings suggest that linguistic media content captures ...

☆ ๑๑ อ้างโดย1928 บทความที่เกี่ยวข้อง ทั้งหมด 17 ฉบับ

Textual analysis in financial disclosure (4 sources of data)



Textual analysis in financial disclosure (4 sources of data)



The Stock Exchange of Thailand

set.or.th/set/companynews.do?symbol=ADVANC&soPagel=8&language=en&country=US

Home > Companies/Securities Info > Equities > Companies/Securities in Focus

Companies/Securities Info

News

Equities

Companies/Securities in Focus

Stock Calendar

IPOs

IPO Performance

List of Companies/Securities

ISIN

Listed Companies with Reported Concessions

Bonds

Opportunity Day & Company Highlights

Companies/Securities in Focus

ADVANC : ADVANCED INFO SERVICE PUBLIC COMPANY LIMITED

Company/Securities Search

Company Summary

Profile | F/S & Highlights | Major Shareholder | Rights & Benefits | News | Daily Quote | Historical Trading

News Today

Date/Time	Source	Headline
No information found.		

News Archive (5 years)

Total 175 headlines.

Date/Time	Source	Headline	Detail
22 Jan 2021 17:13	ADVANC	The judgement of the Central Administrative Court between AIS and TOT on the revenue shares from international direct dialing service	Detail
14 Jan 2021 17:31	ADVANC	Progress of legal dispute between DPC and CAT on transferring telecom equipment	Detail
13 Jan 2021 17:26	ADVANC	Receiving the 700 MHz spectrum license	Detail
05 Nov 2020 18:02	ADVANC	Management Discussion and Analysis Quarter 3 Ending 30 Sep 2020	Detail
05 Nov 2020 18:02	ADVANC	Financial Performance Quarter 3 (F45) (Reviewed)	Detail



ptt investor relations

ทั้งหมด ค้นพบ ข่าวสาร Maps วิดีโอ : เพิ่มเพิ่ม การตั้งค่า เครื่องมือ

ผลการค้นหาประมาณ 714,000 รายการ (0.42 วินาที)

ptt.listedcompany.com > **พหลหนัก**
PTT Public Company Limited (PTT)

About PTT; Investor Relations. IR Home; Financial Information, Financial Highlights - Financial Ratio - Credit Rating - Factsheet. Stock Information, Stock Quote ...

Annual Report

Annual Report 2019. File size
 18.24 Mb. PDF HTML Annual ...

Financial Highlights

Earnings before Interest, Taxes,
 Depreciation and Amortization ...

ผลการค้นหาเพิ่มเติมจาก listedcompany.com >

The Stock Exchange of Thailand

set.or.th/en/company/ipo/upcoming_ipo_set.html

SET

Home > Companies/Securities Info > Equities > IPOs

Companies/Securities Info

News

Equities

Bonds

Opportunity Day & Company Highlights

List of Companies/Securities

ISIN

Listed Companies with Reported Concessions

Bonds

Opportunity Day & Company Highlights

IPOs

IPOs | IPO Statistics | IPO Showcase

List of companies under listing application consideration.

SET	ma	REIT	Infrastructure Fund
Last Update February 4, 2021			

ASW : Assewathai Public Company Limited

Type of Business The company is a holding company which its subsidiaries mainly operate in property development business focusing in residential properties including condominiums and landed properties and also operate in property related businesses.

Secondary Market The Stock Exchange of Thailand (SET)

Industry Group / Sector Property & Construction / Property Development

Status Approved

No. of IPO 205,000,000 newly issued shares (27.07% of total issued shares after IPO)

IPO Method n/a

IPO Price n/a

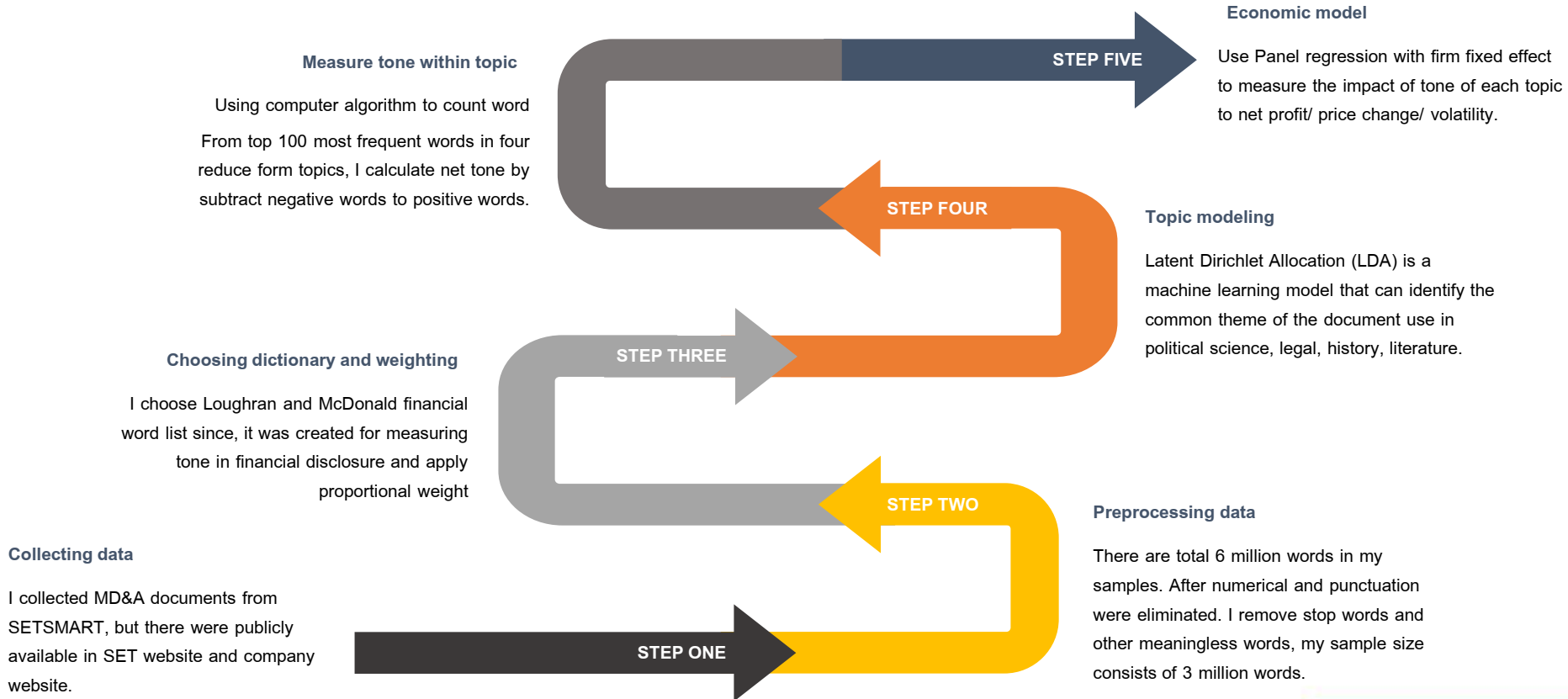
Par Value 1.00 Baht

First Day of Trading n/a

Financial Advisor Asia Plus Advisory Company Limited

Filing (Thai only) <https://set.or.th/>

Textual analysis in financial disclosure (step by step)



**Future firms'
performance**

H1

Management discussion reports four main topics, which are financial performance, financial status, external factor and industry specific topic. The result shows that managements discuss more proportion on financial performance topic with more positive net tone, when future ROA is increasing

Stock returns

H2

Investors place greater value on management tone in other topics rather than tone in financial performance. Investors reacted to this kind of information asymmetrically. The effect of the unfavorable tone of financial disclosures on stock market price was more pronounced and had more predictive power than the favorable tone.

Stock volatility

H3

Finally, I found that net tones in MD&A report contain the critical information in predicting the stock return volatility. In addition, the positive sentiments actually have significant impact on the volatility of stock returns rather than negative sentiment.



www.set.or.th