

โครงการสนับสนุนทุนวิจัยด้านตลาดทุน ประจำปี 2562

หลักการและเหตุผล

เพื่อส่งเสริมให้มีการทำงานวิจัยเกี่ยวกับตลาดทุนที่มีคุณภาพอย่างกว้างขวาง สถาบันวิจัยเพื่อตลาดทุน ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย จึงได้จัดสรรเงินทุนเพื่อสนับสนุนการทำงานวิจัยด้านตลาดทุนมาอย่างต่อเนื่อง สถาบันวิจัยเพื่อตลาดทุนฯ ได้ให้ทุนสนับสนุนการทำงานวิจัยโดยมีโครงการร่วมกับสถาบันการศึกษา ซึ่งได้รับความร่วมมืออย่างดี อีกทั้งได้รับการตอบรับเป็นอย่างดีจากผู้ทรงคุณวุฒิในธุรกิจตลาดทุนที่เข้ามามีส่วนร่วมแลกเปลี่ยนความคิดเห็นและให้ข้อเสนอแนะ ตลอดจนแนวทางปฏิบัติต่างๆ เพื่อให้ผู้วิจัยและผู้แทนจากสถาบันการศึกษาที่เข้าร่วมโครงการ ได้เข้าใจข้อเท็จจริงในทางปฏิบัติ อันเป็นประโยชน์อย่างยิ่งในการสร้างเครือข่ายที่ประสานและเชื่อมโยงสถาบันการศึกษากับภาคธุรกิจตลาดทุนไทย

เพื่อส่งเสริมและสนับสนุนให้เกิดผลอย่างต่อเนื่อง สถาบันวิจัยเพื่อตลาดทุนฯ จะจัดให้มีโครงการสนับสนุนทุนวิจัยด้านตลาดทุน ประจำปี 2562 โดยมีวัตถุประสงค์เพื่อ

1. ส่งเสริมให้มีการจัดทำงานวิจัยที่เกี่ยวข้องกับตลาดทุนและเสริมสร้างความเข้าใจในตลาดทุนโดยรวม โดยเฉพาะงานวิจัยที่มีประโยชน์สำหรับการพัฒนาตลาดทุนไทยหรือมีประโยชน์เชิงนโยบายของตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย หรือหน่วยงานที่เกี่ยวข้องกับตลาดทุน
2. สร้างนักวิจัยที่มีคุณภาพ และสร้างเครือข่ายระหว่างนักวิชาการและผู้ทรงคุณวุฒิในธุรกิจตลาดทุนไทย
3. ยกระดับงานวิจัยด้านตลาดทุนให้มีคุณภาพ และใช้ประโยชน์ได้จริงในธุรกิจตลาดทุนไทย

รายละเอียดโครงการสนับสนุนทุนวิจัยด้านตลาดทุน ประจำปี 2562

1. สถาบันวิจัยเพื่อตลาดทุนฯ จะให้การสนับสนุนทุนเพื่อการวิจัยด้านตลาดทุนแก่สถาบันการศึกษา สถาบันละ 30,000 บาท เมื่อลงนามในบันทึกข้อตกลงความร่วมมือระหว่างสถาบันวิจัยเพื่อตลาดทุนฯ กับสถาบันการศึกษา และส่งหัวข้องานวิจัย โดยมีเงื่อนไขในการร่วมโครงการดังต่อไปนี้
 - 1.1 สถาบันการศึกษาจะต้องดำเนินการเผยแพร่ประชาสัมพันธ์โครงการนี้ให้กับอาจารย์ และนิสิต/นักศึกษา ในสังกัด ได้รับทราบเป็นวงกว้าง อาทิเช่น ประชาสัมพันธ์ผ่านช่องทางต่างๆ ให้นักลการของสถาบันการศึกษาทราบโดยทั่วกัน การจัดประกวดผลงานวิจัยภายในสถาบันการศึกษา เป็นต้น ทั้งนี้สถาบันวิจัยเพื่อตลาดทุนฯ จะประชาสัมพันธ์โครงการนี้ ผ่านสื่อของสถาบันวิจัยเพื่อตลาดทุนฯ ด้วย
 - 1.2 ผู้วิจัยหลัก (first author) ต้องเป็นนักศึกษาระดับบัณฑิตศึกษา หรือผู้ที่สำเร็จการศึกษาในระดับบัณฑิตศึกษา จากสถาบันดังกล่าวมาแล้วในระยะเวลาไม่เกิน 1 ปี
 - 1.3 สถาบันการศึกษาจะต้องส่งหัวข้องานวิจัยภายในวันที่ 9 กันยายน 2562 โดยสามารถส่งได้สถาบันละไม่เกิน 3 หัวข้อ ทั้งนี้ต้องเป็นงานวิจัยที่จะเป็นประโยชน์ต่อการพัฒนาตลาดทุนได้จริง และอยู่ในความสนใจของผู้เกี่ยวข้องในธุรกิจตลาดทุน ดังตัวอย่างในเอกสารแนบ 1
 - 1.4 ผู้วิจัยจะต้องส่งโครงร่างงานวิจัย (proposal) (โดยมีความยาวไม่เกิน 3 หน้ากระดาษ A4) ภายในวันที่ 16 กันยายน 2562 และนำเสนอโครงร่างงานวิจัยต่อคณะกรรมการฯ ในช่วงปลายเดือนกันยายน – ต้นเดือนตุลาคม 2562* (*วันที่จะแจ้งให้ทราบในภายหลัง)
 - 1.5 สถาบันวิจัยเพื่อตลาดทุนฯ จะประกาศรายชื่องานวิจัยที่ได้รับการคัดเลือกและสนับสนุนทุนในการทำวิจัยจำนวนไม่เกิน 10 เรื่อง ในช่วงต้นเดือนตุลาคม 2562* ทั้งนี้ สถาบันการศึกษาหนึ่งๆ อาจมีโครงร่างงานวิจัยที่ได้รับการคัดเลือกมากกว่า 1 เรื่อง หรืออาจไม่ได้รับการคัดเลือกเลยขึ้นอยู่กับพิจารณาของคณะกรรมการฯ (*วันที่จะแจ้งให้ทราบในภายหลัง)

1.6 งานวิจัยที่ได้รับการคัดเลือกจะได้รับทุนสนับสนุนการทำงานวิจัยเรื่องละ 20,000 บาท เมื่อส่งมอบงานวิจัยฉบับสมบูรณ์

2. ในระหว่างการวิจัย สถาบันวิจัยเพื่อตลาดทุนฯ จะจัดให้มี “คลินิกงานวิจัยด้านตลาดทุน” ในช่วงเดือนพฤศจิกายน 2562 และเดือนมกราคม 2563* เพื่อเปิดโอกาสให้ผู้วิจัยและคณาจารย์ ได้เข้ามานำเสนอความคืบหน้าของการวิจัย แลกเปลี่ยนความคิดเห็นและรับฟังข้อเสนอแนะตลอดจนแนวทางปฏิบัติต่างๆ ในธุรกิจตลาดทุนไทย จากผู้ทรงคุณวุฒิที่มีประสบการณ์การทำงานในตลาดทุนเพื่อให้ผู้วิจัยนำแนวทางไปพัฒนากระบวนการวิจัยให้เป็นประโยชน์ต่อภาคธุรกิจมากยิ่งขึ้น และเป็นโอกาสในการสร้างเครือข่ายผู้วิจัยด้านตลาดทุนระหว่างผู้วิจัย คณาจารย์ และผู้ทรงคุณวุฒิในตลาดทุน (*วันที่จะแจ้งให้ทราบในภายหลัง)
3. ผู้วิจัยจะต้องนำส่งงานวิจัยฉบับสมบูรณ์ ภายในเดือนกุมภาพันธ์ 2563* (รายงานวิจัยฉบับสมบูรณ์ ต้องมีความยาวไม่เกิน 20 หน้ากระดาษ A4) ทั้งนี้ งานวิจัยฉบับสมบูรณ์จะต้องปรับ/เพิ่มเติมตามแนวทางที่ได้รับคำแนะนำจากผู้ทรงคุณวุฒิใน “คลินิกงานวิจัยด้านตลาดทุน” และผู้วิจัยจะต้องนำเสนอผลงานวิจัยเพื่อชิงรางวัลงานวิจัยดีเด่นด้านตลาดทุน ปี 2562 ภายในเดือนมีนาคม 2563* หากไม่สามารถส่งงานวิจัยฉบับสมบูรณ์และนำเสนอผลงานวิจัยได้ จะถือว่าสละสิทธิ์ (*วันที่จะแจ้งให้ทราบในภายหลัง)
4. เพื่อส่งเสริมให้เกิดการผลิตงานวิจัยระดับบัณฑิตศึกษาที่มีคุณภาพ สถาบันวิจัยเพื่อตลาดทุนฯ จะคัดเลือก “ผลงานวิจัยดีเด่นด้านตลาดทุน” จากคุณภาพของรายงานฉบับสมบูรณ์ และการนำเสนอของผู้วิจัย โดยคณะกรรมการพิจารณาตัดสินผลงานวิจัยดีเด่นด้านตลาดทุน จะประกอบด้วยผู้แทนจาก
 - ผู้ทรงคุณวุฒิในธุรกิจตลาดทุน
 - ผู้แทนจากสถาบันการศึกษา โดยจะต้องไม่มีส่วนเกี่ยวข้องกับงานวิจัยที่สถาบันการศึกษานั้นส่งเข้ารับการคัดเลือกเป็นผลงานวิจัยดีเด่น

กำหนดการเบื้องต้น (อาจมีการเปลี่ยนแปลงได้)

ช่วงเวลา	การดำเนินการ
มิถุนายน - กรกฎาคม 2562	ชี้แจงสถาบันการศึกษา ถึงแนวทางและระยะเวลาดำเนินการ และประชาสัมพันธ์โครงการฯ
ภายในวันที่ 15 สิงหาคม 2562	สถาบันการศึกษาแจ้งความจำนงเข้าร่วมโครงการ
ภายในวันที่ 31 สิงหาคม 2562	ลงนามบันทึกข้อตกลงความร่วมมือระหว่างสถาบันวิจัยเพื่อตลาดทุนฯ กับสถาบันการศึกษา
9 กันยายน 2562	สถาบันการศึกษาส่งหัวข้องานวิจัย รายชื่อผู้วิจัย และอาจารย์ที่ปรึกษา**
16 กันยายน 2562	ผู้วิจัยส่งโครงร่างงานวิจัย (proposal)
ปลายเดือนกันยายน – ต้นเดือนตุลาคม 2562*	- ผู้วิจัยหรือคณะผู้วิจัยนำเสนอโครงร่างงานวิจัยต่อคณะกรรมการฯ - สถาบันวิจัยเพื่อตลาดทุนฯ ประกาศรายชื่องานวิจัยที่ได้รับการคัดเลือกจำนวนไม่เกิน 10 เรื่อง
ภายในเดือนพฤศจิกายน 2562*	กิจกรรม “คลินิกงานวิจัยด้านตลาดทุนครั้งที่ 1”
ภายในเดือนมกราคม 2563*	กิจกรรม “คลินิกงานวิจัยด้านตลาดทุนครั้งที่ 2” (ถ้ามี)
ภายในเดือนกุมภาพันธ์ 2563*	ผู้วิจัยนำส่งผลงานวิจัย ฉบับสมบูรณ์**
ภายในเดือนมีนาคม 2563*	นำเสนอผลงานวิจัยเพื่อชิงรางวัลงานวิจัยดีเด่นด้านตลาดทุน

* วันที่จะแจ้งให้ทราบในภายหลัง

** สถาบันวิจัยฯ มอบเงินสนับสนุนตามเงื่อนไข

รางวัลผลงานวิจัยดีเด่นด้านตลาดทุน ระดับบัณฑิตศึกษา

ผู้วิจัยจะต้องนำเสนอผลงานวิจัย ในงานสัมมนาที่สถาบันวิจัยเพื่อตลาดทุนฯ จัดขึ้น ในเดือนมีนาคม 2563 ซึ่งจะมีการพิจารณาเพื่อตัดสินและประกาศผลงานวิจัยดีเด่นด้านตลาดทุน โดยมีเงินรางวัลดังนี้

รางวัล	ผู้วิจัย	อาจารย์ที่ปรึกษา
รางวัลผลงานวิจัยดีเด่นด้านตลาดทุน		
1. รางวัลผลงานวิจัยดีเด่น จำนวน 1 รางวัล	120,000 บาท	60,000 บาท
2. รางวัลผลงานวิจัยดี จำนวน 1 รางวัล	80,000 บาท	40,000 บาท
3. รางวัลประกาศเกียรติคุณ จำนวน 3 รางวัล	40,000 บาท	20,000 บาท

ในกรณีที่คณะกรรมการพิจารณาแล้วเห็นว่าไม่มีงานวิจัยใดสมควรได้รับรางวัลใดรางวัลหนึ่งข้างต้น สถาบันวิจัยเพื่อตลาดทุนฯ ขอสงวนสิทธิ์ไม่มอบรางวัลดังกล่าว

ผู้วิจัยและสถาบันการศึกษายินยอมให้สถาบันวิจัยเพื่อตลาดทุนฯ เผยแพร่ผลงานวิจัยในงานสัมมนาและเผยแพร่ต่อสาธารณะผ่านช่องทางต่างๆ ของสถาบันวิจัยเพื่อตลาดทุนฯ ได้ตามที่เห็นสมควร

รายละเอียดเพิ่มเติม สามารถติดต่อได้ที่

สถาบันวิจัยเพื่อตลาดทุน ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

ชั้น 15 อาคารตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

เลขที่ 93 ถนนรัชดาภิเษก คลองเตย กรุงเทพฯ 10400

โทรศัพท์ 02-009-9512, 9513, 9515, 9521

หรือ E-mail: CMRIscholarship@set.or.th

หัวข้องานวิจัยด้านตลาดทุนเพื่อการจัดทำงานวิจัยต้องเป็นงานวิจัยที่สามารถนำมาใช้ประโยชน์ในการพัฒนาตลาดทุนได้จริง และเป็นผลงานที่อยู่ในความสนใจของผู้เกี่ยวข้องในธุรกิจตลาดทุน

ตัวอย่างหัวข้องานวิจัย:

กลุ่มผู้ลงทุน

1. ทักษะคติของผู้ลงทุนบุคคลต่อการลงทุนในตลาดทุน และสินทรัพย์ดิจิทัล
2. ผลกระทบจากมาตรการทางภาษีต่อทัศนคติของผู้ลงทุนบุคคลต่อการลงทุนในกองทุนรวม
3. พฤติกรรมการบริหารพอร์ตการลงทุนของผู้ลงทุนบุคคล
4. เครื่องมือบริหารความเสี่ยงในการลงทุน

กลุ่มการพัฒนาตลาดทุน

1. ผลกระทบของ program trading ต่อสภาพคล่องและความผันผวนของตลาด
2. การพัฒนาผลิตภัณฑ์การลงทุนและบริการเพื่อเพิ่มสภาพคล่องและประสิทธิภาพในตลาดทุน เช่น
 - 2.1 การเพิ่มสภาพคล่องของ ETF
 - 2.2 การขายชอร์ต และการยืมหุ้น
 - 2.3 bid-ask spread ที่เหมาะสม
 - 2.4 ประสิทธิภาพของ cash balance
3. เครื่องมือวัดความผันผวนของตลาดทุนไทย
4. ความเชื่อมโยงของตลาดทุนในภูมิภาค
5. การบริหารความเสี่ยงของธุรกิจตลาดทุน

กลุ่มบริษัทจดทะเบียน

1. แรงจูงใจในการส่งเสริมให้ธุรกิจมีการกำหนดกลยุทธ์เพื่อพัฒนาการเติบโตอย่างยั่งยืน
2. สภาพแวดล้อมโดยรวมทั้งระบบ (Ecosystem) เพื่อสนับสนุน green business
3. ตัวชี้วัดคุณภาพของบริษัทที่จะเข้าจดทะเบียนใหม่

กลุ่มการพัฒนานวัตกรรม

1. การจัดการข้อมูลขนาดใหญ่ (Big Data) เพื่อประโยชน์กับตลาดทุน
2. นวัตกรรมอื่นๆ เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพของการลงทุน ธุรกิจตลาดทุน และบริษัทจดทะเบียน เช่น
 - 2.1 นวัตกรรมสำหรับระบบ Payments
 - 2.2 นวัตกรรมสำหรับกระบวนการ Market Provisioning
 - 2.3 นวัตกรรมสำหรับ Investment Management
 - 2.4 นวัตกรรมสำหรับ Risk Management