

กำหนดการ  
งานสัมมนาเพื่อการพัฒนาตลาดทุนไทย ประจำปี 2555  
นำเสนอผลงานวิจัยเพื่อชิงรางวัลงานวิจัยดีเด่นด้านตลาดทุน  
วันที่ 19 มกราคม 2555

ณ ห้องประชุม 1104 และ 1109 ชั้น 11 อาคารตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

เวลา	หัวข้อ	หัวข้อ
09.00 - 09.30	Price impacts and contributions to price discovery from disposition-prone selltrades in Thai stock market โดย คุณธีรสุด พุทธพงษ์ศิริพร สถาบันบัณฑิตบริหารธุรกิจศศินทร์แห่งจุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย	การวิเคราะห์กลยุทธ์การลงหุ้นในกองทุนรวมหุ้นระยะยาวที่ลงทุนใน SET50 Index โดย คุณพิชญา ชุณหารักษ์ คณะบริหารธุรกิจ สถาบันบัณฑิตพัฒนบริหารศาสตร์
09.30 - 10.00	Trading differences among different investor types in Thai stock market โดย คุณธีรสุด พุทธพงษ์ศิริพร สถาบันบัณฑิตบริหารธุรกิจศศินทร์แห่งจุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย	Long-Horizon Returns Predictability and Structural Break in Stock Exchange of Thailand โดย คุณสุธาวัลย์ พฤกษ์อำไพ คณะบริหารธุรกิจ สถาบันบัณฑิตพัฒนบริหารศาสตร์
10.00 - 10.30	The Impact of Change in the Federal Funds Rate Target on the Stock Return in the Stock Exchange of Thailand: A Firm Level Analysis โดย คุณเยาวลักษณ์ เตชะรุ่งโรจน์วงศ์ คณะบริหารธุรกิจ มหาวิทยาลัยอัสสัมชัญ	ผลกระทบของวินัยตลาดต่อการดำรงอัตราเงินกองทุนส่วนเกินของธนาคารพาณิชย์ไทย โดย คุณสาวินี โกครกษ์ คณะเศรษฐศาสตร์ จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย
10.30 - 11.00	Overreaction and Value Strategy during Thai Market Declines: Evidence from the 2007 Financial Crisis โดย คุณธนัย สุทธิโก คณะบริหารธุรกิจ มหาวิทยาลัยอัสสัมชัญ	ธรรมชาติกับการจัดการกำไร กรณีศึกษาธนาคารพาณิชย์ของประเทศไทย โดย คุณกวิณ เอี่ยมตระกูล คณะเศรษฐศาสตร์ จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย
11.00 - 11.30	Portfolio Choice toward Bank Related and Non Bank Related Mutual Funds: A Case of Bangkok โดย คุณชาญชัย เมธีพิทักษ์ธรรม คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์	ทัศนคติต่อการวางแผนการเงินส่วนบุคคลของประชาชนวัยทำงานในเขตภาคเหนือ โดย คุณพิรารวรรณ จิระนันทราพร คณะบริหารธุรกิจ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่
11.30 - 12.00	SGT Density with Conditional Volatility , Skewness and Kurtosis in the Estimation of VaR: A Case of the Stock Exchange of Thailand โดย คุณกอล์ฟ อรรถบุรณวงศ์ คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์	ผลกระทบของเศรษฐกิจมหภาคต่อสภาพคล่องของธุรกิจในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ระหว่างปี พ.ศ. 2543-2553 โดย คุณพัชราพรรณ ลิมตักตกุล คณะบริหารธุรกิจ มหาวิทยาลัยเชียงใหม่

พักรับประทานอาหารกลางวัน

13.30 - 14.00	Yield Curve Reaction to Monetary Policy Surprises : Evidence in Thailand โดย คุณอาทิตย์ ทิวไผ่งาม คณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย	พฤติกรรมนักลงทุนเชิงพลวัตในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย : การตอบสนองของนักลงทุนแต่ละกลุ่ม โดย คุณศรายุทธ ทองอร่าม คณะพัฒนาการเศรษฐกิจ สถาบันบัณฑิตพัฒนบริหารศาสตร์
14.00 - 14.30	Global Factors on the Thai Yield Curve and the Effect of a Recent Crisis โดย คุณภาคิณี บานชื่น คณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย	Institutional Ownership, Analyst Recommendation and Liquidity: Evidence from The Stock Exchange of Thailand โดย คุณธัชชานันต์ โฆษิตนันท์,คุณเชรพรรณ เลิศลักษณ์กุล,คุณนิธิตา แก้วคง วิทยาลัยการจัดการ มหาวิทยาลัยมหิดล
14.30 - 15.00	โครงสร้างความผันผวนรูปรอยยิ้ม (Volatility Smile) และความสามารถในการอธิบายและการคาดการณ์ความผันผวนที่เกิดขึ้นจริงของผลตอบแทนดัชนี SET50 โดยความผันผวนแฝง (Implied Volatility) ที่ได้จาก SET50 Index Options โดย คุณธนศักดิ์ ปะทักษิณ,คุณลดาวัลย์ ทองสุพรรณ,คุณศศิภา ชลาภาบุญ วิทยาลัยการจัดการ มหาวิทยาลัยมหิดล	ตัวแบบและการพยากรณ์ความผันผวนของอัตราผลตอบแทนของดัชนี SET โดยการใช้ Realized Volatility โดย คุณณัฐวุฒิ คงลำพันธ์ คณะพัฒนาการเศรษฐกิจ สถาบันบัณฑิตพัฒนบริหารศาสตร์
15.00 - 15.30	Black-Litterman Asset Allocation Technique with GARCH derived investor's view and extensions for Thai market โดย คุณพงศธร ลีลาประชากุล คณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์	Asset pricing puzzle in emerging countries : an evidence of Thailand โดย คุณสมภพ ตังทอง มหาวิทยาลัยหอการค้าไทย