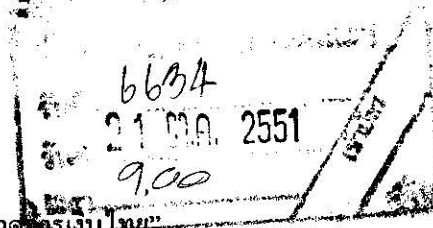




คณะกรรมการศาสตร์และการบัญชี มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์

2 ถนนพระจันทร์ พระนคร กรุงเทพฯ 10200 โทร. 0-2226-4519 โทรสาร 0-2226-4518

13 ตุลาคม 2551



เรื่อง ขอบเชิญเข้าฟังการประชุมทางวิชาการ "ศาสตราจารย์สังเวียน อินทรวิชัย ด้านตลาดการเงินไทย"
ครั้งที่ 16 ประจำปี 2551

เรียน ท่านคณบดี

ด้วยในโอกาสครบรอบ 70 ปี แห่งการสถาปนาคณะกรรมการศาสตร์และการบัญชี มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์ และครบรอบ 10 ปี แห่งการก่อตั้งโครงการปริญญาโททางการเงิน (MIF) คณะกรรมการศาสตร์และการบัญชี มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์ จึงกำหนดจัดประชุมทางวิชาการ "ศาสตราจารย์สังเวียน อินทรวิชัย ด้านตลาดการเงินไทย" ครั้งที่ 16 ประจำปี 2551 ขึ้นในวันจันทร์ที่ 3 พฤศจิกายน 2551 ณ ห้อง 201, ห้อง 205 และห้อง 206 คณะกรรมการศาสตร์และการบัญชี มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์ ท่าพระจันทร์

ผลงานวิจัยที่น่าสนใจในปีนี้มี 9 เรื่อง และบรรยายในหัวข้อสำคัญด้าน Futures and Option Strategies 3 เรื่อง และบรรยายในหัวข้อสำคัญด้าน Corporate Value Creation 3 เรื่อง ตามรายละเอียดที่แนบมาพร้อมนี้

จึงขอเรียนเชิญท่านหรือผู้แทนหรือผู้สนใจเข้าฟังการประชุมทางวิชาการดังกล่าว จำนวนไม่เกิน 2 ท่าน ผู้สนใจแจ้งความจำนงค์เข้าร่วมฟังการบรรยายได้ทาง website ของคณะกรรมการศาสตร์และการบัญชี มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์ (<http://www.bus.tu.ac.th>) ภายในวันพฤหัสบดีที่ 30 ตุลาคม 2551 จักขอบคุณยิ่ง อนึ่ง การเข้าร่วมประชุมทางวิชาการครั้งนี้ ไม่ต้องเสียค่าธรรมเนียม

เรียน รองคณบดีฝ่ายบริหาร
เพื่อโปรดพิจารณา
ผู้ช่วยศาสตราจารย์ ดร. อัญญา ชันขวิทย์
21 ต.ค. 51

ขอแสดงความนับถือ

ศาสตราจารย์ ดร. อัญญา ชันขวิทย์

3) ดำเนินการตามเสนอ

22 ต.ค. 51

(ศาสตราจารย์ ดร. อัญญา ชันขวิทย์)
ประธานคณะกรรมการจัดประชุมทางวิชาการ
เพื่อเสนอผลงานวิจัยชั้นสูงทางด้านตลาดทุน

คณะกรรมการศาสตร์และการบัญชี

โทร. 0-2696-5744-5

โทรสาร 0-2696-5738

เรียน ท่านคณบดี
เพื่อโปรดทราบและดำเนินการ

เรียน คุณหม่องลา
เพื่อโปรดดำเนินการ

14 ต.ค. 51



ขอเชิญเข้าร่วมประชุมทางวิชาการ

“ศาสตราจารย์สังเวียน อินทรวิชัย ด้านตลาดการเงินไทย”

ครั้งที่ 16 ประจำปี 2551

วันจันทร์ที่ 3 พฤศจิกายน 2551

ณ ห้อง 201, ห้อง 205 และห้อง 206 คณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี

มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์ ท่าพระจันทร์

คณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์ ขอเชิญผู้สนใจเข้าร่วมการประชุมทางวิชาการ “ศาสตราจารย์สังเวียน อินทรวิชัย ด้านตลาดการเงินไทย” ครั้งที่ 16 ประจำปี 2551 เพื่อร่วมเฉลิมฉลองในโอกาสครบรอบ 70 ปี แห่งการสถาปนา คณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์ และในโอกาสครบรอบ 10 ปี แห่งการก่อตั้งโครงการปริญญาโททางการเงิน (MIF) การประชุมกำหนดจัดขึ้นในวันจันทร์ที่ 3 พฤศจิกายน 2551 ณ ห้อง 201, ห้อง 205 และห้อง 206 คณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์ ท่าพระจันทร์ โดยมีศาสตราจารย์ ดร.อัญญา ชันธิวิทย์ เป็นประธานการจัดงาน

ผลงานวิจัยที่นำเสนอในปีนี้มี 9 เรื่อง แบ่งการนำเสนอเป็น 4 ช่วง ช่วงที่ 1 นำเสนอผลงานวิจัย 3 เรื่อง เรื่องแรก ศึกษาพฤติกรรมของการเคลื่อนย้ายเงินทุนระหว่างประเทศไทยและสหรัฐอเมริกา เพื่อระบุเหตุปัจจัยสำคัญที่กำหนดปริมาณการไหลเข้าออก เรื่องที่สอง ศึกษาเพื่อเปรียบเทียบเทคนิคการคัดกรองสัญญาณที่บ่งชี้การเกิดขึ้นของเหตุการณ์สำคัญในบริษัทจดทะเบียน ในกรณีที่หุ้นของบริษัทอาจขาดสภาพคล่องโดยใช้ตัวอย่างจากหุ้นในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย เรื่องที่สาม เป็นการใช้เทคนิคนิวรอลเน็ตเวิร์คแบบสองชั้นในการกำหนดราคาออพชัน โดยในขั้นแรกใช้กำหนดค่าความแปรปรวนของหลักทรัพย์อ้างอิงก่อน และต่อไปในขั้นที่สองจึงนำข้อมูลนั้นมาศึกษาร่วมกับข้อมูลอื่นเพื่อระบุราคา

ช่วงที่ 2 เป็นการนำเสนอผลงานวิจัยอีก 2 เรื่อง เรื่องแรกศึกษาผลกระทบจากการมีข้อมูลที่ไม่ถูกต้องแม่นยำเกี่ยวกับค่าพารามิเตอร์ของหลักทรัพย์ในตลาดที่มีผลกระทบต่อความเห็นที่แตกต่างของนักวิเคราะห์หลักทรัพย์และการตัดสินใจค้าหลักทรัพย์ของผู้ลงทุนต่างกลุ่มกัน ส่วนการศึกษาเรื่องที่สองเป็นการศึกษาเชิงประจักษ์เกี่ยวกับสาระของข่าวสารข้อมูลที่มีในรายงานของฝ่ายจัดการเกี่ยวกับการพยากรณ์ภาพรวมอนาคตของบริษัทโดยใช้ตัวอย่างจากบริษัทจดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

สุดท้าย ช่วงที่ 3 และ 4 เป็นการนำเสนอผลงานวิจัยจำนวน 4 เรื่อง ซึ่งเป็นผลงานวิจัยของอาจารย์และมหาบัณฑิตของโครงการ MIF เพื่อร่วมฉลองครบรอบ 10 ปีของการก่อตั้งโครงการ ผลงานที่นำเสนอเป็นการศึกษาเกี่ยวกับพฤติกรรม การเคลื่อนไหวของราคาทองคำทั้งในตลาดเงินสดและในตลาดฟิวเจอร์สที่พบในประเทศอินเดีย ผลงานการศึกษาเกี่ยวกับผลกระทบของการปรับลดช่วงการเคลื่อนไหวของราคาที่มีต่อช่วงห่างของราคาเสนอซื้อขายและต่อสภาพคล่องของหลักทรัพย์ในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย การศึกษาที่ขยายผลเทคนิค Value at Risk (VaR) เพื่อชี้วัดความเสี่ยงจากการเปลี่ยนแปลงราคาหลักทรัพย์ ให้พิจารณาประกอบถึงข้อมูลอื่นเพิ่มเติมจากภายนอกและข้อมูลพฤติกรรมที่สุดโต่งของราคาหลักทรัพย์ด้วย และสุดท้าย เป็นการศึกษาเกี่ยวกับบทบาทของทรัพยากรด้านความรู้ความสามารถ (Intellectual Capital) ที่ส่งเสริมการสร้างมูลค่าของธนาคารพาณิชย์ไทย

ในการประชุมทางวิชาการนี้ ยังมีการบรรยายพิเศษในหัวข้อต่างๆ เกี่ยวกับความก้าวหน้าทางการเงิน โดยแยกเป็น 2 กลุ่ม การบรรยายกลุ่มแรก เป็นกลุ่มเนื้อหาด้านกลยุทธ์การลงทุนในอนุพันธ์ เพื่อการป้องกันความเสี่ยง การกระจายการลงทุนและการทำกำไรระยะสั้นจากผลต่างของราคา ได้แก่ กลยุทธ์การลงทุนในสัญญาฟิวเจอร์สของสินค้าเกษตรในตลาดสินค้าเกษตรล่วงหน้าแห่งประเทศไทย กลยุทธ์การลงทุนในสัญญาออปชันของดัชนี SET50 ในตลาดอนุพันธ์ (ประเทศไทย) และกลยุทธ์การลงทุนในสัญญาฟิวเจอร์สของทองคำที่กำลังจะเกิดขึ้นในอนาคตอันใกล้ในตลาดอนุพันธ์ (ประเทศไทย)

การบรรยายกลุ่มที่สอง เป็นการบรรยายกลุ่มเทคนิคใหม่ด้านการบริหารจัดการเพื่อสร้างมูลค่าให้กิจการ (Value Creation) ได้แก่ การนำระบบการวัดผลการดำเนินงานและการบริหารความเสี่ยงเชิงบูรณาการมาใช้เสริมความสามารถในการสร้างมูลค่า ส่วนในการบรรยายช่วงสุดท้าย เป็นการขยายผลการบริหารความเสี่ยงในเชิงบูรณาการโดยใช้ตัวแบบจำลองของ COSO ซึ่ง ณ เวลานั้นปัจจุบัน เป็นตัวแบบที่ได้รับการยอมรับกว้างขวางไปทั่วโลกแล้วว่าสามารถสร้างมูลค่ากิจการให้มีระดับสูงขึ้นได้จริง

การประชุมทางวิชาการครั้งนี้ได้รับการสนับสนุนจากมูลนิธิศาสตราจารย์สังเวียน อินทรวิชัย และจากคณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์ ผู้เข้าร่วมประชุมไม่ต้องเสียค่าธรรมเนียมเข้าประชุม (ฟรี) ผู้สนใจแจ้งความจำนงค์เข้าร่วมฟังการบรรยายได้ทาง website ของคณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์ (<http://www.bus.tu.ac.th>) ภายในวันพฤหัสบดีที่ 30 ตุลาคม 2551 (สำรองที่นั่งได้ไม่เกินหน่วยงานละ 2 คน)

วันจันทร์ที่ 3 พฤศจิกายน 2551

ณ ห้อง 201, ห้อง 205 และห้อง 206 คณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์ ท่าพระจันทร์

เวลา	กิจกรรม (พ.ร.บ. 251)
08:30 - 08:55 น.	ลงทะเบียน
08:55 - 09:00 น.	พิธีเปิด โดย คณะบดี คณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์
09:00 - 09:30 น.	การนำเสนอผลงานวิจัยเรื่อง "Thailand Capital Flight through Trade with the U.S. During Times of Political and Economic Instability" ผู้นำเสนอ ศาสตราจารย์ ดร. พรชัย ชูผลจินดา คณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์ ผู้วิจารณ์ ผู้ช่วยศาสตราจารย์ ดร.สุกัญญา กัทรธรรมมาศ คณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์
09:30 - 10:00 น.	การนำเสนอผลงานวิจัยเรื่อง "Detecting Abnormal Return of Infrequently Traded Stock in Event Study" ผู้นำเสนอ รองศาสตราจารย์ ดร.อาศิส ลิ้มคณ คณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์ ผู้วิจารณ์ ดร.อนันต์ วัฒโนภรณ์ คณบดีคณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์
10:00 - 10:30 น.	การนำเสนอผลงานวิจัยเรื่อง "A Hybrid Option Pricing Model using a Neural Network for Estimating Volatility" ผู้นำเสนอ ดร.สุวิภา อมรวัฒนา บัณฑิตบริหาร ผู้วิจารณ์ ดร.เจษฎา เก่งศิริวัฒน์ บัณฑิตบริหาร
10:30 - 10:45 น.	พักรับประทานอาหารกลางวัน
10:45 - 11:30 น.	การนำเสนอผลงานวิจัยเรื่อง "Investment Model Uncertainty and Fair Pricing" ผู้นำเสนอ คุณสัจพร ช่างเหล็ก M.S. Financial Engineering, Peter F. Drucker Graduate School of Management, The Claremont Colleges ผู้วิจารณ์ ดร.สุเมธ นาคสุก บัณฑิตบริหาร
11:30 - 12:15 น.	การนำเสนอผลงานวิจัยเรื่อง "The Empirical Evidence on Management Forecast Disclosures in Thailand" ผู้นำเสนอ อาจารย์ ดร.สิริดา จาตุคณาภรณ์ ภาควิชาการบัญชี คณะบริหารธุรกิจและการท่องเที่ยว มหาวิทยาลัยบูรพา ผู้วิจารณ์ ผู้ช่วยศาสตราจารย์ ดร.เกรียงไกร บุญเลิศชัย คณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย
12:15 - 13:15 น.	พักรับประทานอาหารกลางวัน

เวลา	การนำเสนอผลงานวิจัย MUE 10 th Anniversary Research Track (ห้อง 201)	เวลา	การบรรยายพิเศษด้าน Futures and Option Strategies (ห้อง 205)	การบรรยายพิเศษด้าน Corporate Value Creation (ห้อง 206)
13:15 - 14:00 N.	การนำเสนอผลงานวิจัยเรื่อง "Price Discovery in the Indian Gold Futures Market" ผู้นำเสนอ คุณปิยะมา ใต้เพชร มหาวิทยาลัย โครงการ MUE มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์ และบริษัทหลักทรัพย์ เอเชียแอสเซีย (ประเทศไทย) จำกัด ผู้วิจารณ์ อาจารย์ ดร.มนโรจน์ บุญวราโรจน์ คณะอุตสาหกรรมเกษตร มหาวิทยาลัยเทคโนโลยีพระจอมเกล้าธนบุรี	13:15 - 14:45 N.	การบรรยายพิเศษเรื่อง "Practical SET 50 Option Strategies" ผู้บรรยาย คุณธนวัฒน์ พานิชเกษม บริษัทหลักทรัพย์ ฟิวท์ จำกัด (มหาชน) ผู้วิจารณ์ อาจารย์ ดร.มนโรจน์ บุญวราโรจน์ คณะอุตสาหกรรมเกษตร มหาวิทยาลัยเทคโนโลยีพระจอมเกล้าธนบุรี	การบรรยายพิเศษเรื่อง "Risk Management for Value Creation" ผู้บรรยาย ผู้ช่วยศาสตราจารย์ ดร.บุญชู จันทร์ คณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์
14:00 - 14:45 N.	การนำเสนอผลงานวิจัยเรื่อง "Tick Size Change on the Stock Exchange of Thailand" ผู้นำเสนอ คุณศุภกิจญา ปราณีวัฒนพานนท์ มหาวิทยาลัย โครงการ MUE มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์ และตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย ผู้วิจารณ์ รองศาสตราจารย์ ดร.สุกัญญา สิริสม คณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์			
14:45 - 15:00 N.	พักทานอาหาร			
15:00 - 15:45 N.	การนำเสนอผลงานวิจัยเรื่อง "Value-at-Risk and Expected Shortfall under Extreme Value Theory Framework: An Empirical Study on Asian Markets" ผู้นำเสนอ คุณประทีป ปิณฑ มหาวิทยาลัย โครงการ MUE มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์ และงานทางต่างประเทศไทย ผู้วิจารณ์ คุณศุภกิจญา ปราณีวัฒนพานนท์ มหาวิทยาลัยเทคโนโลยีพระจอมเกล้าธนบุรี	15:00 - 16:30 N.	การบรรยายพิเศษเรื่อง "Risks and Opportunities in Gold Futures Strategies" ผู้บรรยาย รองศาสตราจารย์ ดร.สันติศา ภาณุบุตร คณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์	การบรรยายพิเศษเรื่อง "COSO Enterprise Risk Management (ERM) to Enhance Corporate Value" ผู้บรรยาย ศาสตราจารย์ ดร.อัญญา จันทร์ คณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์
15:45 - 16:30 N.	การนำเสนอผลงานวิจัยเรื่อง "The role of Intellectual Capital in creating value in the banking industry" ผู้นำเสนอ อาจารย์ ดร.สุเมธ แสงจันทร์ อาจารย์พิเศษ โครงการ MUE มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์ และ ธนาคารเพื่อการไทย จำกัด (มหาชน) ผู้วิจารณ์ อาจารย์ ดร.สุเมธ แสงจันทร์ คณะบริหารธุรกิจ มหาวิทยาลัยศิลปากร			