



ที่ อว 67 / ร 092

มหาวิทยาลัยราชภัฏสงขลา
รับที่ 446
วันที่ 28 ม.ค. 2569
เวลา 16:24

มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์ ศูนย์รังสิต
99 ม.18 ถ.พหลโยธิน ต.คลองหนึ่ง
อ.คลองหลวง จ.ปทุมธานี 12121

๒๐ มกราคม 2569

เรื่อง ขอเรียนเชิญร่วมรับฟังการบรรยายวิชาการ ในหัวข้อ “Designing ESG Strategic Investment Portfolios for Non-Profit Institutional Investors”

เรียน อธิการบดี

ด้วย มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์ ร่วมกับ ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย กำหนดจัดการบรรยายวิชาการในหัวข้อ “Designing ESG Strategic Investment Portfolios for Non-Profit Institutional Investors” เพื่อเผยแพร่ความรู้ทางวิชาการสู่สังคม โดยมีกลุ่มเป้าหมายหลักเป็นผู้ลงทุนสถาบันซึ่งมิได้แสวงกำไร (Non-Profit Institutional Investors หรือ NPIIs) อาทิ มหาวิทยาลัย มูลนิธิ โรงพยาบาล กองทุนถาวร และขยายสู่ผู้ลงทุนสถาบันกลุ่มอื่น บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน หน่วยงานกำกับดูแล วิศวกรการเงิน และผู้ลงทุนทั่วไป เพื่อให้เข้าใจทฤษฎีและสามารถนำไปประยุกต์ใช้ในการระบุน้ำหนักการลงทุนเชิงกลยุทธ์ (Policy Allocation) ซึ่งการศึกษาเชิงประจักษ์รายงานสอดคล้องกันว่ามีความท้าทายสูงสุดในกรณีกำหนดความสำเร็จของการลงทุน โดยการบรรยายของศาสตราจารย์ ดร.อัญญา ชันธวิทย์ ศาสตราจารย์ในสาขาวิชาการเงินและการธนาคาร และกิริยาจารย์แห่งมหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์ กำหนดจัดขึ้นในวันอังคารที่ 10 กุมภาพันธ์ 2569 เวลา 9.00 ถึง 12.30 น. ณ หอประชุมศาสตราจารย์สังเวียน อินทรวิชัย อาคารตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

ในการนี้ จึงขอเรียนเชิญท่านเข้าร่วมรับฟังการบรรยายวิชาการฯ ดังกล่าว พร้อมทั้งขอความอนุเคราะห์ประชาสัมพันธ์เชิญชวนไปยังหน่วยงานที่เกี่ยวข้องภายในมหาวิทยาลัยของท่านด้วย สำหรับผู้สนใจสามารถแจ้งความจำนงค์โดยการสแกน QR CODE ลงทะเบียน ได้จนถึงวันที่ 6 กุมภาพันธ์ 2569 หรือจนกว่าที่นั่งจะเต็ม ทั้งนี้ ผู้เข้าฟังบรรยายไม่ต้องเสียค่าใช้จ่าย (ฟรี)

จึงเรียนมาเพื่อโปรดพิจารณาเข้าร่วมรับฟังการบรรยายวิชาการ จักขอบคุณยิ่ง

ขอแสดงความนับถือ

(ศาสตราจารย์ ดร.สุกสวัสดิ์ ชัยวาลัย)
อธิการบดีมหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์

สำนักงานยุทธศาสตร์และการคลัง กองคลัง
นางสาวฉัตรวิมล รัตนจินดา ผู้ประสานงาน
โทรศัพท์ 094-6688280



QR CODE สำหรับการลงทะเบียน



Designing ESG Strategic Investment Portfolios

for Non-Profit Institutional Investors

หลักฐานเชิงประจักษ์ชี้ว่า Policy Allocation กำหนดความสำเร็จของการลงทุนได้กว่าร้อยละ 90
การบรรยายแนะนำเทคนิคการจัดทำ Optimum Policy Allocation
ให้ ESG-Motivated NPIIs เพื่อลงทุนบน ESG-Efficient Frontier
พร้อมยกตัวอย่างประกอบ เป็นขั้นตอนละเอียด และมีโปรแกรมสำเร็จรูป
ให้ NPIIs นำไปใช้ศึกษา ทำความเข้าใจเพิ่มเติม สามารถขยายผลไปสู่การปฏิบัติได้จริง

10 กุมภาพันธ์
2569
09.00 – 12.30 น.



หอประชุมศาสตราจารย์สังเวียน อินทรวิชัย ชั้น 7
อาคารตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
ถ.รัชดาภิเษก (MRT ศูนย์วัฒนธรรมฯ ทางออก 3)



ศาสตราจารย์ ดร.อัญญา จันศิริกุล

ศาสตราจารย์ในทางวิชาการและ การธนาคาร
ผู้เชี่ยวชาญด้านความรู้ ESG และระบบการเงิน
กับสถาบันอย่างเช่น กองทุนบำเหน็จบำนาญข้าราชการ



สามารถลงทะเบียนได้ตั้งแต่
วันนี้ - 8 กุมภาพันธ์ 2569

สอบถามเพิ่มเติม

คุณวิจิตา โทร. 0 2009 9810 หรือคุณสุภารัตน์ โทร. 0 2009 9875

Email: SETsustainability@set.or.th



มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์
THAMMASAT UNIVERSITY



ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

การบรรยายวิชาการ

Designing ESG Strategic Investment Portfolios for Non-Profit Institutional Investors

จัดโดย

มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์ ร่วมกับ ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

วันอังคารที่ 10 กุมภาพันธ์ 2569 เวลา 9.00 น. ถึง 12.30 น.

ณ ห้องประชุมศาสตราจารย์สังเวียน อินทรวิชัย อาคารตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

การบรรยายวิชาการจัดขึ้นเพื่อเผยแพร่ความรู้ทางวิชาการสู่สังคม โดยมีกลุ่มเป้าหมายหลักเป็นผู้ลงทุนสถาบันซึ่งมิได้แสวงกำไร (Non-Profit Institutional Investors หรือ NPIIs) อาทิ มหาวิทยาลัย มูลนิธิ โรงพยาบาล กองทุนถาวร และขยายสู่ผู้ลงทุนสถาบันกลุ่มอื่น บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน หน่วยงานกำกับดูแล วิศวกรการเงิน และผู้ลงทุนทั่วไป เพื่อให้เข้าใจทฤษฎีและสามารถนำไปประยุกต์ใช้ในการระบุน้ำหนักการลงทุนเชิงกลยุทธ์ (Policy Allocation) ซึ่งการศึกษาเชิงประจักษ์รายงานสอดคล้องกันว่ามีบทบาทสูงสุดในการกำหนดความสำเร็จของการลงทุน การบรรยายมีศาสตราจารย์ ดร.อัญญา ชันธวิทย์ ศาสตราจารย์ในสาขาวิชาการเงินและการธนาคาร และกิตติยาจารย์แห่งมหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์ เป็นผู้บรรยาย

การบรรยายเริ่มต้นโดยชี้ถึงเหตุผลและความจำเป็นที่ NPIIs ต้องจัดสรรเงินลงทุนส่วนหนึ่งไปลงทุนในกลุ่มสินทรัพย์ที่มีความเสี่ยงเพื่อแลกกับผลตอบแทนที่คาดหวังที่สูงขึ้น การลงทุนในกลุ่มสินทรัพย์ที่มีความเสี่ยงมักกำหนดเงินจำนวนหนึ่งไว้ แล้วมอบให้บริษัทหลักทรัพย์บริหาร ผู้บรรยายอธิบายขั้นตอนการบริหารการลงทุนโดยเริ่มต้นจากการตระหนักถึงวัตถุประสงค์ ความนิยม ปรัชญาและเงื่อนไขข้อจำกัดของ NPIIs จากนั้น เสนอให้ NPIIs ยึด UN Principles for Responsible Investment แล้วลงทุนในฐานะ ESG-Motivated Investors ซึ่งผู้บรรยายแนะนำให้ NPIIs จ้างบริษัทหลักทรัพย์ให้ลงทุนเฉพาะในกลุ่มหลักทรัพย์ที่มีความเสี่ยงและที่อยู่บน ESG-Efficient Frontier

ผู้บรรยายแยกผลตอบแทนที่บริษัทหลักทรัพย์ได้รับจากการบริหาร ว่าเกิดจากการลงทุนตาม Policy Allocation และจากการลงทุนโดยใช้ความสามารถของบริษัทหลักทรัพย์ (Active or Tactical Allocation) ผู้บรรยายจะแสดงหลักฐานเชิงประจักษ์ให้ NPIIs ตระหนักว่า Policy Allocation กำหนดความสำเร็จของการลงทุนได้กว่าร้อยละ 90 จึงเสนอให้ NPIIs ออกแบบ Policy Allocation ด้วยตัวเองตามหลักวิชาการและใช้ข้อมูลประกอบอย่างครบถ้วน จากนั้น ผู้บรรยายแนะนำเทคนิคการจัดทำ Optimum Policy Allocation ซึ่งอ้างอิง Sharpe Ratio สำหรับระยะเวลาการลงทุนที่เหมาะสม พร้อมกำหนดเงื่อนไขประกอบ เมื่อ NPIIs ดำเนินการตามและได้ผลลัพธ์แล้ว NPIIs จะมอบเป็นกรอบให้บริษัทหลักทรัพย์นำไปใช้บริหารเงินลงทุน ผู้บรรยายแนะนำการกำกับดูแล ติดตามและประเมินผลบริษัทหลักทรัพย์ สุดท้ายแนะนำให้ NPIIs ปรับ Policy Allocation ตามรอบหรือตามความจำเป็น



แม้การจัดทำ Optimum Policy Allocation จะอ้างอิงศาสตร์ด้านวิศวกรรมการเงินที่ยากและซับซ้อน แต่ผู้บรรยาย
จะบรรยายโดยยกตัวอย่างประกอบให้เห็นจริง เป็นขั้นตอนละเอียด และจะเขียนโปรแกรมสำเร็จรูปให้ NPIIs นำไปใช้ศึกษา
ทำความเข้าใจเพิ่มเติม สามารถขยายผลไปสู่การปฏิบัติได้จริง

ผู้สนใจสามารถแจ้งความจำนงค์จนถึงวันที่ 6 กุมภาพันธ์ 2569 หรือจนกว่าที่นั่งจะเต็ม ทั้งนี้ ผู้เข้าฟังบรรยายไม่
ต้องเสียค่าใช้จ่าย (ฟรี)



QR CODE สำหรับการลงทะเบียน



มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์
THAMMASAT UNIVERSITY



ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

การบรรยายวิชาการ

Designing ESG Strategic Investment Portfolios for Non-Profit Institutional Investors

จัดโดย

มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์ ร่วมกับ ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

วันอังคารที่ 10 กุมภาพันธ์ 2569 เวลา 9.00 น. ถึง 12.30 น.

ณ ห้องประชุมศาสตราจารย์สังเวียน อินทรวิชัย อาคารตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย

เวลา	กิจกรรม
9.00 – 9.15	พิธีเปิด กล่าวต้อนรับโดย ศาสตราจารย์ ดร.ศุภสวัสดิ์ ชัชวาลย์ อธิการบดี มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์ กล่าวต้อนรับและเปิดงานโดย คุณอัสสเดช คงศิริ กรรมการและผู้จัดการ ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย
9.15 – 10.45	Designing ESG Strategic Investment Portfolios for Non-Profit Institutional Investors ผู้บรรยาย ศาสตราจารย์ ดร.อัญญา ชันธวิทย์ 1. ผู้ลงทุนสถาบันซึ่งมีได้แสงกำไร เงินลงทุนและความจำเป็นที่ต้องลงทุนในสินทรัพย์ที่มีความเสี่ยง 2. ขั้นตอนการลงทุน 3. การระบุวัตถุประสงค์การลงทุน ปรัชญา นโยบายและเงื่อนไขการลงทุน 4. การพิจารณา ESG ประกอบการลงทุน การเป็น ESG-Motivated Investors และการแนะนำ ESG-Efficient Frontier 5. ความจำเป็นของการออกแบบ Policy Allocation 6. เทคนิคการออกแบบ Optimal Policy Allocation (อ้างอิง Sharpe Ratio)
10.45 – 11.00	พักรับประทานอาหารว่าง
11.00 – 12.15	Designing ESG Strategic Investment Portfolios for Non-Profit Institutional Investors (ต่อ) ผู้บรรยาย ศาสตราจารย์ ดร.อัญญา ชันธวิทย์ 7. การกำหนดเงื่อนไขประกอบและโปรแกรมสำเร็จรูป ESG-Motivated Portfolio Optimization 8. การมอบน้ำหนักการลงทุนตามนโยบายและข้อปฏิบัติให้บริษัทหลักทรัพย์ดำเนินการ 9. การกำกับดูแล ติดตามและประเมินผลการลงทุนของบริษัทหลักทรัพย์ 10. การวัดความสามารถในการลงทุนของบริษัทหลักทรัพย์ และโปรแกรมสำเร็จรูปเพื่อการวิเคราะห์ 11. การทบทวน Policy Allocation ตามรอบและตามความจำเป็น 12. ภาคผนวก : เทคนิคการออกแบบ Optimal Policy Allocation (อ้างอิง Sortino Ratio) จากผลการศึกษาที่ว่า ESG ช่วยจัดการ Downside Risks ได้ดี
12.15 – 12.30	กล่าวขอบคุณและปิดการบรรยาย



QR CODE สำหรับการลงทะเบียน