



2020년 한국금융공학회 추계학술대회

STO(Security Token Offering)와 지급결제, 핀테크

일시 2020년 11월 13일 (금)

장소 온라인 생중계 (Zoom)

초청의 말씀

안녕하십니까?

한국금융공학회는 2020년 11월 13일 (금) 추계학술대회를 온라인으로 개최합니다. 주지하시는 바와 같이 코로나19 사태 장기화로 인해 오프라인 학술대회를 진행하기에는 무리가 있어 온라인으로 개최하게 되었습니다.

본 학술대회에서는 금융공학과 디지털 금융, 투자론, 금융공학과 인공지능, 금융일반 및 기업재무 등 4개 분과의 학술발표 및 'STO(Security Token Offering)와 지급결제, 핀테크'의 주제로 패널토론이 진행될 예정입니다. 패널토론은 서울과학기술대학교의 천창민 교수님의 주제 발표에 이어 아주대학교 구형건 교수님의 사회로 송수영 교수님(중앙대), 최공필 초빙연구위원님(한국금융연구원), 그리고 신우철 팀장님(한국예탁결제원)께서 블록체인을 활용한 금융 산업 및 지급결제시장, 그리고 핀테크에 대한 심도 있는 논의를 진행할 것 입니다.

이번 학술대회를 준비하는 과정에서 한국예탁결제원과 코스콤의 후원은 본 학술대회 개최에 많은 도움이 되었습니다. 그리고 학술대회의 논문 발표와 토론 및 사회를 맡아주신 많은 분들, 귀한 시간을 내시어 참여해주신 모든 참가자 여러분께 감사드립니다. 또한, 학회 준비를 위해 수고해주신 학회 관계자분들께도 심심한 감사의 마음을 전합니다.

이번 학술대회가 여러 회원님들의 활발한 교류의 장이 되어 정보를 공유하고 학문적으로 많은 발전이 이루어질 수 있는 소중한 자리가 되기를 기원합니다.

2020년 11월 13일

한국금융공학회 회장 **전 인 태**

일정안내

일시 : 2020년 11월 13일 (금)

장소 : 온라인 Zoom

시간	내용
10:00~10:30	등록
10:30~12:10	논문발표 1부 세션1: 금융공학과 디지털 금융 세션2: 투자론
12:10~13:30	중식
13:00~13:30	이사회
13:30~15:30	논문발표 2부 세션3: 금융공학과 인공지능 세션4: 금융일반 및 기업재무
15:30~15:40	휴식
15:40~16:40	패널토론 주제: STO와 지급결제, 핀테크 발제: STO의 개념과 해외 규제 동향 (천창민, 서울과학기술대학교) 사회: 구형건(아주대학교) 패널: 송수영(중앙대학교) 최공필(한국금융연구원) 신우철(한국예탁결제원)
16:40~16:50	휴식
16:50~17:00	우수논문발표
17:00~17:30	정기총회

논문발표 1부 [10:30 ~ 12:10]

세션 1 금융공학과 디지털 금융

사회자 : 김진수(경상대)

발표자	논문제목
김순호(부경대)* 최금화(동아대)	인공신경망을 이용한 주가 방향성 예측 토론자: 배세용(아주대)
이주화(성균관대)* 류두진(성균관대)	뉴스/소셜 미디어 텍스트 데이터를 활용한 주가 등락 예측 연구 (딥러닝 기법을 바탕으로) 토론자: 김병준(POSTECH)
최순혁(Cornell Univ.)* Robert A. Jarrow (Cornell Univ.)	Testing the Local Martingale Theory of Bubbles using Cryptocurrencies 토론자 : 장현진(UNIST)

세션 2 투자론

사회자 : 조영석(목포대)

발표자	논문제목
권준엽(경북대)*	Ambiguity, Risk Aversion and Excess Volatility 토론자: 이우백(한국방송통신대학교)
김동주(미래에셋대우)* 조영석(목포대)	사건연구를 통해 살펴 본 공매도 규제의 정보효과 토론자: 이한경(경상대)
노정희(국민연금연구원)* 박희진(부산대)	Climate change and stock market volatility: An empirical analysis of OECD countries 토론자: 박경현(서울대)
이우백(한국방송통신대)*	코스피200 파생상품 거래승수 인하의 시장 유동성과 결정 요인에 대한 영향력 분석 토론자: 권준엽(경북대)

논문발표 2부 [13:30 ~ 15:30]

세션 3 금융공학과 인공지능

사회자 : 신용현(숙명여대)

발표자	논문제목
배세용(아주대)* 구형건(아주대) 전준기(경희대)	Optimal Life Insurance, Consumption and Portfolio Selection and Early Retirement Decision with Habit Formation 토론자: 노정희(국민연금연구원)
장현진(UNIST)* 최소은(삼성전자) 이경섭(영남대) Harry Zheng (Imperial College)	Optimal Market-Making Strategies under Synchronised Order Arrivals with Deep Neural Networks 토론자: 이주환(성균관대)
박경현(서울대)* 강명주(서울대) 김현욱(서울대)	Candidate Point Selection using a Self-Attention Mechanism for Generating a Smooth Volatility Surface under the SABR Model 토론자: 손판도(동아대)
김병준(POSTECH)* 김태윤(POSTECH) 장봉규(POSTECH)	Forecasting Uncertainty of the Oil Future Prices via Machine Learning 토론자: 김순호(부경대)

세션 4 금융일반 및 기업재무

사회자 : 이현석(성신여대)

발표자	논문제목
류두원(국민대)*	Product market competition & business groups in Korea 토론자: 박종해(경남과기대)
박대현(성균관대)* 류두진(성균관대)	E-commerce Retail and Reverse Factoring: A Newsvendor Approach 토론자: 정미화(성신여대)
권용현(창원대)*	Estimating the Economic Impact of Presidential Twitter Messages: Evidence from the 2019 Mexico Tariff Threat 토론자: 류두원(국민대)
정미화(성신여대)* 이현석(성신여대)	경제정책 불확실성이 기업의 자본비용과 투자에 미치는 영향 토론자: 권용현(창원대)

패널 토론 [15:40 ~ 16:40]

주제 : STO와 지급결제, 핀테크

발제 : STO의 개념과 해외 규제 동향 (천창민, 서울과학기술대학교)

사회 : 구형건 | (아주대학교)

패널 : 송수영 | (중앙대학교)

최공필 | (한국금융연구원)

신우철 | (한국예탁결제원)



