

2020년
한국금융공학회 하계학술대회
4차 산업혁명과 금융공학

일시: 2020년 08월 25일 (화)

장소: 온라인 생중계 (Zoom)





초청의 말씀

안녕하십니까?

한국금융공학회는 2020년 8월 25일(화요일)에 “4차 산업혁명과 금융공학”의 주제로 온라인 하계학술대회를 개최합니다.

평년이었다면 이미 지난봄에 춘계학술대회가 개최되었겠지만, 주지하시는 바와 같이 코로나 팬데믹 사태의 장기화로 오프라인 학술대회 개최를 더 이상 기다릴 수 없어 온라인으로 하계학술대회를 개최하게 되었습니다.


본 학술대회에서는 디지털 금융과 금융공학 혁신, 금융공학, 투자론, 기업재무, 금융일반 등 6개 분과의 학술논문 발표가 있으며, Plenary Session에서는 4차 산업혁명에서 중요한 역할을 수행할 것으로 기대되고 있는 블록체인에 대하여 학회 회장을 역임한 중앙대 송수영 교수님과 금융위원회 상임위원을 역임하신 김앤장 이종구 변호사님의 keynote speech가 예정되어 있습니다. 제도권으로 편입되고 있는 블록체인의 로드맵 이해에 큰 도움이 될 수 있으리라 확신합니다.

이번 학술대회를 준비하는 과정에서 국민연금연구원의 참여와 한국거래소, 주택금융연구원, 부산은행의 후원은 학술대회 개최에 많은 도움이 되었습니다. 그리고 논문발표와 토론, 그리고 사회를 맡아주신 모든 분들께 감사드립니다. 학회 준비를 위해 많은 노력을 아끼지 않으신 학회 관계자분들께도 감사를 드립니다.

아무쪼록 이번 학술대회가 폭 넓은 상호 교류의 장이 되어, 회원 모든 분들의 활발한 교류 및 발전을 이루는 소중한 자리가 될 수 있기를 기원합니다.

2020년 8월 25일

한국금융공학회 회장 전 인 태



일정 안내



일시: 2020년 08월 25일 (화)

장소: 온라인 생중계(Zoom)

시간	내용	비고
10:00~10:30	등록	
10:30~12:30	논문발표 1부 세션1 디지털 금융과 금융공학 혁신 세션2 투자론 1 세션3 금융일반	
12:30~13:30	중식	
13:30~14:30	Plenary Session [블록체인과 금융] Blockchain: A Pipe Dream or a Dream to Come True 블록체인과 가상자산산업의 규제: 현황과 전망 - 특정금융정보법을 중심으로	송수영 (중앙대) 이종구 (김앤장)
14:30~14:40	휴식	
14:40~16:40	논문발표 2부 세션4 금융공학 세션5 투자론 2 세션6 기업재무	
16:40~16:50	휴식	
16:50~17:00	우수논문발표	온라인
17:00~18:00	이사회	온라인





Plenary Session

[13:30 ~ 14:30]

주 제 : 블록체인과 금융

사회자 : 이현석 | 성신여대

발표 1 : Blockchain: A Pipe Dream or a Dream to Come True

송수영 | 중앙대

발표 2 : 블록체인과 가상자산산업의 규제: 현황과 전망

- 특정금융정보법을 중심으로

이종구 | 김앤장

2020년
한국금융공학회 하계학술대회
4차 산업혁명과 금융공학



논문발표 1부 [10:30 ~ 12:30]

세션 01 디지털 금융과 금융공학 혁신

사회자 : 장봉규(POSTECH)

발표자	논문제목
김형준(영남대)* 조훈(KAIST) 류두진(성균관대)	Forecasting consumer credit recovery: Classification approaches 토론자: 허정규(전남대)
최현정(KIS채권평가)* 전인태(가톨릭대)	Value at Risk estimation through RNN-GAN simulation of deep learning 토론자: 이경섭(영남대)
남유상(부산대)* 강상훈(부산대)	가상화폐시장의 허당현상 분석 : 시간별 자료를 이용하여 토론자: 김형준(영남대)
이동희(부산대)* 김동현(부산대) 윤지훈(부산대)	Prediction of U.S. Gold Futures Prices using Wavelet Analysis; A Study on Deep Learning Models 토론자: 최선용(가천대)

세션 02 투자론 1

사회자 : 이유태(부경대)

발표자	논문제목
노정희(국민연금연구원)* 태엄철(국민연금연구원)	국민연금의 주주행동주의와 회계투명성 토론자: 정재만(숭실대)
정재만(숭실대)* 고영은(국민연금)	국내 연기금 투자성과 분해: 전략적 자산배분, 전술적 자산배분, 자산선택 토론자: 김병곤(창원대)
정민규(경남과기대)* 김동욱(부산경제진흥원) 김병곤(창원대)	외국인 투자자는 가족기업을 선호하지 않는가? 토론자: 정찬식(동아대)

논문발표 1부 [10:30 ~ 12:30]

세션 03 금융일반

사회자 : 구형건(아주대)

발표자	논문제목
구형건(아주대) 정재용(FnGuide)* 배세용(아주대) 안상진(아주대)	금융 중심의 이동: 스퍼퍼드의 논문을 바탕으로 한 역사적 고찰과 전망 토론자: 김창기(고려대)
송수영(중앙대)*	A Theory of Dynamic Bank Loan Rate Clustering 토론자: 구형건(아주대)
권용현(창원대)* 김진민(고려대)	Volcanic Risk and Stock Market Reactions in Airline Ash Industry: Evidence from 2010 European Ash Crisis 토론자: 김성희(수원대)
김창기(고려대)*	포스트 코로나 시대 공유경제의 위험관리 토론자: 권용현(창원대)

2020년

한국금융공학회 하계학술대회
4차 산업혁명과 금융공학



논문발표 2부 [14:40 ~ 16:40]



세션 04 금융공학

사회자 : 최영수(한국외대)

발표자	논문제목
최영수(한국외대)* 이원창(하이투자증권)	주가연계 구조화 상품 포트폴리오 차원의 헤징 전략 토론자: 임현철(전남대)
안세릉(부경대)* 홍정의(한동대)	Penalty Interest Rates, LTV Constraints, and Screening Laxity in Mortgage Markets 토론자: 곽민석(한국외대)
이천영(한국외대)* 백재승(한국외대) 염명훈(키움증권)	한국 보험업지수 구분에 관한 연구 : 손해보험지수와 생명보험업 지수의 개발과 제안 토론자: 안세릉(부경대)
임현철(전남대)*	An Innovation for the Local Volatility Surface 토론자: 윤지훈(부산대)

세션 05 투자론 2

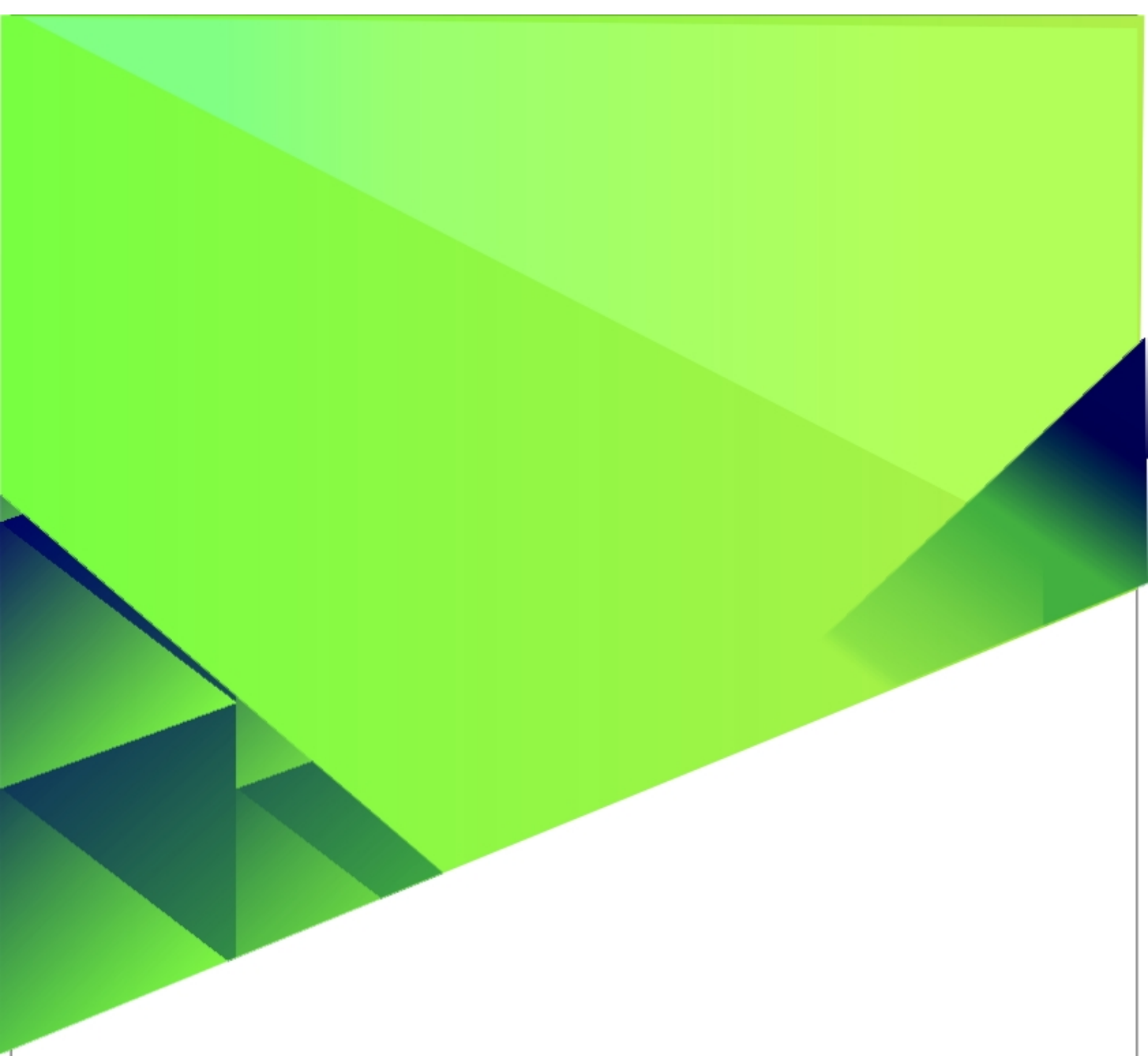
사회자 : 장 욱(덕성여대)

발표자	논문제목
홍정효(경남대)* 조현진(아성테크) 남기성((주)창민테크론) 김민재(경남대)	주식시장과 장단기 금리사이의 인과성 연구 토론자: 김순호(부경대)
김순호(부경대)* 손성진(한국거래소)	단일판매계약의 공시와 주가 반응 토론자: 표동진(창원대)
유진영(성균관대)* 류두진(성균관대)	Information trades of options around holidays 토론자: 홍정효(경남대)
권도형(국민연금연구원)* 김민정(삼성생명)	Dynamic Economic Asset Allocation Strategy: An Regime Approach 토론자: 배광일(전남대)

세션 06 기업재무

사회자 : 손판도(동아대)

발표자	논문제목
박대현(성균관대)* 류두진(성균관대)	OCIO의 대리인 문제 토론자: 손판도(동아대)
조성순(한국해양대)*	대주주의 주식담보대출과 조세회피 토론자: 박대현(성균관대)
김지원(U. St. Andrews)* 장승욱(강릉원주대)	한국 기업의 기업지배구조와 기업위험, 재벌에 관한 고찰 토론자: 조성순(한국해양대)



2020년
한국금융공학회 하계학술대회
4차 산업혁명과 금융공학