

2019년 한국금융공학회 추계학술대회 전자금융제도와 금융의 미래

일시: 2019년 10월 26일 (토)

장소: 창원대학교 경영학관 (21호관)



한국금융공학회
The Korean Association of Financial Engineering



창원대학교 경영경제연구소

BNK 경남은행

KSD



한국예탁결제원

Crowe
한올회계법인
Hanul LLC



초청의 말씀

안녕하십니까?

한국금융공학회는 2019년 10월 26일(토요일)에 창원대학교에서 추계학술대회를 개최합니다. 이번 학술대회는 “전자금융제도와 금융의 미래”를 주제하는 특별 심포지엄과 6개 분과의 학술논문 발표회로 구성되어 있습니다.

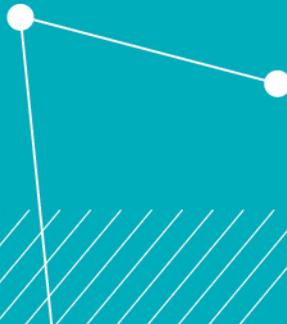
특별 심포지엄에서는 전자증권제도의 도입과 금융의 미래라는 주제로 한국예탁결제원 박철영 예탁결제본부장의 발표와 중앙대 송수영 교수의 사회로 진행되며, 동서대 김홍배 교수, 동아대 손판도 교수, 성신여대 이현석 교수의 토론이 있을 예정입니다. 이러한 발제와 토론은 향후 전자금융제도의 활성화에 많은 도움이 될 수 있으리라 확신합니다.

본 학술 발표회에서는 금융공학 및 투자론, 기업재무, 금융일반 등 다양한 주제의 유익한 논문을 학계와 금융계에 종사하시는 분들이 발표할 것이며, 신진연구자 세션에서는 젊은 연구자들의 참신한 아이디어를 살펴볼 수 있을 것입니다. 연구 및 실무를 통해 쌓은 높은 학문적 업적을 이번 학술대회에서 접하는 기쁨을 누릴 것이라고 봅니다.

이번 학술대회를 준비하는 과정에서 BNK 경남은행, 창원대학교 경영경제연구소, 한올회계법인의 후원은 본 학술대회의 개최에 많은 도움이 되었습니다. 학술대회에서 좌장 및 논문의 발표와 토론 등으로 수고해 주실 많은 분들께 감사드립니다. 또한 귀한 시간을 아끼지 않고 참석하시어 자리를 빛내주시는 참석자 여러분 모두에게도 감사함을 전합니다. 끝으로 학회 준비를 위해 많은 노력을 아끼지 않으신 학회 관계자들에게도 감사를 드립니다.

2019년 10월 26일

한국금융공학회 회장 정정현



일정 안내



일시: 2019년 10월 26일 (토)

장소: 창원대학교 경영학관

시간	내용	장소
10:30 ~ 11:00	등록	경영학관 2층 안내데스크
11:00 ~ 12:20	논문발표 1부	
	세션1 금융공학1	21226호
	세션2 투자론1	21223호
	세션3 금융일반	21225호
12:20 ~ 13:30	중식	경영학관 2층
12:40 ~ 13:20	이사회	21320호
13:30 ~ 14:50	Plenary Session [종합토론회] 〈전자증권제도의 도입과 금융의 미래〉	21406호
14:50 ~ 15:00	휴식	
15:00 ~ 16:20	논문발표 2부	경영학관
	세션4 금융공학2	21226호
	세션5 투자론2	21223호
	세션6 기업재무	21225호
16:20 ~ 16:30	휴식	
16:30 ~ 18:00	정기총회 우수논문상 시상식	21225호
18:00 ~ 20:30	만찬	

| 행사안내 |

점심식사는 도시락으로 12시20분부터 13시 30분까지 제공됩니다.

차량을 이용하시는 분들께는 주차권을 배부해드립니다.



Plenary Session

[종합토론회]

○ 발표주제 : **전자증권제도의 도입과 금융의 미래**

○ 발 표 자 : 박철영 | 한국예탁결제원 예탁결제본부장

○ 사 회 자 : 송수영 | 중앙대

○ 토 론 : 김홍배 | 동서대

손판도 | 동아대

이현석 | 성신여대

2019년
한국금융공학회 추계학술대회
전자금융제도와 금융의 미래



논문발표 1부

[11:00 ~ 12:20]



Session 01 금융공학

발표장 : 21226 / 사회자 : 전인태(가톨릭대)

발표자	논문제목
안세룡(부경대)* 최경진(Univ. of Calgary) 임병화(수원대)	• Retirement and insurance decision with DTI limit 토론자: 백혜연(창원대)
박종해(경남과기대) 정대성(부산대)*	• VPIN과 고빈도 자료를 활용한 거래기법에 관한 실증연구 토론자: 박춘광(동명대)
정희준(전주대)* 이한구(금융투자협회) 김권식(국제금융센터)	• 수요예측제도의 회사채 발행에 대한 영향 분석 토론자: 김홍배(동서대)
홍정효(경남대) 배종가(새진해새마을금고) 조현진(아성테크) 김민재(창민테크론) 남기성(경남대)	• 옵션시장과 주식시장사이의 가격발견기능 연구 토론자: 정희준(전주대)

Session 02 투자론1

발표장 : 21223 / 사회자 : 문규현(경기대)

발표자	논문제목
김봉준(경상대)* 전두배(경상대) 차승연(서울대)	• GSR을 이용한 펀드 성과 평가
김우현(부산대)* 김수경(동명대) 변영태(경성대)	• 투자자별 거래정보가 주식수익률에 미치는 영향
리 이(부산대)* 이장우(부산대) 이수영(경기대) 문규현(경기대)*	• Idiosyncratic Volatility and Firm-Specific News : Evidence from the Chinese Stock Market
	• 우리나라 금시장과 거시경제변수간의 관련성에 연구

Session 03 금융일반

발표장 : 21225 / 사회자 : 김병곤(창원대)

발표자	논문제목
김동주(목포대)* 조영석(목포대)	• 우리나라 공매도의 특성 분석 및 제도개선 방안
류호영(부산대)* 김태혁(부산대)	• 투자자 심리와 차익거래 제약이 고유변동성 이상현상에 미치는 영향
미치카(목포대) 이현보(목포대)* 조영석(목포대)	• 취약계층의 금융교육에 관한 연구
정정현(창원대) 최 철(창원대)*	• 수명주기별 기업구조조정전략의 선택과 그 유효성에 관한 연구

논문발표 2부

[15:00 ~ 16:20]



Session 04 금융공학2

발표장 : 21226 / 사회자 : 이현석(성신여대)

발표자	논문제목
김태구(한국외대)* 송준혁(한국외대)	• Overnight index swap을 이용한 원화 무위험금리 분석 토론자: 김태중(충남대)
김태중(충남대)*	• 기업의 지역적 다각화와 이용된 파생상품의 다양성간의 관계 연구 토론자: 전인태(가톨릭대)
장봉규(POSTECH) 김태윤(POSTECH)* 이승규(POSTECH) 박세영(Loughborough Univer.)	• Ambiguity aversion and optimal investment with transaction costs 토론자: 김태구(한국외대)

Session 05 투자론2

발표장 : 21223 / 사회자 : 조영석(목포대)

발표자	논문제목
구형건(아주대) 배세용(아주대) 안상진(아주대)*	• 확률적 포트폴리오 이론의 연구 동향과 실증 분석 토론자: 이상구(부산가톨릭대)
임현철(전남대)* 배형욱(아주대)	• 박판스플라인 함수를 이용한 내재변동성 곡면 생성 방법의 비교 연구 토론자: 안세룡(부경대)
김창환(NH-Amundi 자산운용)* 송준혁(한국외대)	• 한국 주식시장 특성을 반영한 대안 인덱스 방법론 분석 토론자: 홍정효(경남대)

Session 06 기업재무

발표장 : 21225 / 사회자 : 박춘광(동명대)

발표자	논문제목
김동욱(부산경제진흥원)* 김병곤(창원대)	• 한국 중소기업의 소유구조와 생존확률 토론자: 김진수(경상대)
안요한(동명대)* 김상호(Xi'an Jiotong-Liverpool Univ.)	• Does foreign ownership restrict earnings management? the case of China 토론자: 박종해(경남과기대)
손판도(동아대)* 김진재(동아대)	• 내부통제부재가 자본비용에 미치는 효과 토론자: 안요한(동명대)



2019년
한국금융공학회 추계학술대회
전자금융제도와 금융의 미래