

## 2020년도 「KRX 증권·파생상품 학술연구지원사업」 시행 공고

한국거래소(KRX)는 증권·파생상품에 대한 연구개발을 장려하고, 국내 증권·파생상품시장의 발전을 도모하기 위해서 아래와 같이 「KRX 증권·파생상품 학술연구지원사업」을 시행하고 있습니다. 우리나라 자본시장의 발전을 위해 많은 분들의 관심과 참여를 바랍니다.

### 1. 지원대상 및 지원 내용

① 지원자격 : 증권·파생상품 관련 학회 회원\*, 금융업계 종사자, 연구원, 석·박사, 대학생, 기타 금융전문가 등

\* 증권학회, 파생상품학회, 금융공학회, 재무학회, 재무관리학회, 금융학회, 지급결제학회, 증권법학회, 상사법학회, 기업법학회 (10개 학회)

② 지원분야 : 국내 증권·파생상품시장 발전과 관련된 연구

- 국내 증권·파생상품시장 활성화방안, 시장간 연계 등 시장구조개선에 관한 분야
- 증권·파생상품 및 파생관련 복합상품 개발·발전에 관한 분야
- 석유, 금, 배출권 등 일반상품시장 제도개선 및 활성화, 신상품도입에 관한 분야
- CCP, 증거금제도, FinTech의 거래소 활용방안 등 기타 거래소 발전에 관한 분야

< 연구과제 예시 > \* 아래 과제 중에서도 연구과제 선택 가능

- 무위험금리(RFR) 대상 파생상품시장 개설 관련 기초자산별 특성과 해외 거래소 사례 등에 대한 분석 및 시사점
- 해외배출권 선물 현황 및 국내 배출권 선물시장 개설 방안
- 해외 금거래소와 국내(KRX금시장) 법·제도와의 차이점 및 시사점
- 해외시장의 대량매매 및 다크폴 관련 규제·제도 조사 및 시사점
- 통합발행기간 확대와 국채 유동성간 상관관계 분석 및 시사점
- 내부자 주식거래 전후의 정보비대칭 변화분석 (유가증권시장, 코스닥시장 비교분석)
- 고빈도거래 현황 및 유가증권·코스닥시장에 미치는 영향 분석
- 해외 시장조성자 제도 현황과 효과, 국내 시장조성자 제도와의 비교 분석 및 시사점
- 수시공시 항목의 정보효과 분석 및 시사점

③ 연구비 지원 과제수 : 9개 이내

- 필요시 거래소는 2개 내외에서 '우선 지원과제'를 선정할 수 있으며, 상기 지원과제 수는 조정될 수 있음

④ 사업금액 : 총 6,100만원(세전)

가. 지원금액 : 총 4,500만원(세전)

- '우선 지원과제' 편당 1,000만원(세전), '일반 지원과제' 편당 500만원(세전)
- 지원금은 논문 파일을 거래소에 제출하고, 연구결과의 최종보고 기한 이후 부터 지급 개시 예정
- 지원금은 '학술연구지원사업 응모 신청서'의 책임연구자에게 일괄 지급
- ※ 내용이 상당히 부실한 경우 연구결과 접수가 거부될 수 있음

나. 특전 : 제출된 논문 중 별도 심사를 통하여 우수논문상 시상

◇ 총 상금규모 : 1,600만원(세전)

- 최우수상 1편 : 상금 800만원(세전)과 상패
- 우수상 1편 : 상금 500만원(세전)과 상패
- 장려상 1편 : 상금 300만원(세전)과 상패

※ 시상에 적합한 논문이 없다고 판단될 경우 선정하지 않을 수 있음

⑤ 지원대상 : 응모하여 선정된 연구과제가 다음의 요건을 모두 충족한 경우

- 거래소에 논문을 문서파일 형태로 제출한 경우
- 거래소의 연구지원과제로 선정되어 작성되었음이 명기된 경우(사의표명 문구)
- 논문은 거래소가 인정한 학술지\*에 최종보고 기한까지 게재 또는 게재확정 필요
- \* 가. (국내학술지) 증권학회, 파생상품학회, 금융공학회, 재무학회, 재무관리학회, 금융학회, 지급결제학회, 증권법학회, 상사법학회, 기업법학회의 학회지
- 나. (해외학술지) SCI(E), SSCI급 학술지
- 보고서는 최종보고 기한까지 거래소에 제출 필요

## 2. 응모 및 선정

① 제출서류 : 응모신청서 및 연구계획서 각1부, 개인정보보호동의서 1인당 1부

② 제출기한 : 2020년 6월 30일(화)

③ 제출방법 :

- (홈페이지 접수) <http://krxrnd.krx.co.kr>
- (이메일 접수) Derivatives\_rnd@krx.co.kr

④ 선정기준 : 주제와 연구방법상의 현실성, 독창성, 중요성, 활용도 등을 기준으로 거래소의 연구지원사업 선정위원회에서 결정함

⑤ 선정 및 통보 : 2020년 7월 17일(금)까지 선정하여 개별통보

- 거래소는 일정상 부득이한 경우 선정 및 통보 일자를 조정할 수 있음
- 선정결과는 '학술연구지원사업 응모 신청서'의 책임연구자에게 통보

### 3. 선정 연구과제의 관리(제목 또는 내용 중 중요부분 등 변경, 연구자 변경의 사전승인)

- ① 선정된 연구과제의 제목 또는 내용 중 중요부분 등의 변경, 연구자 변경은 거래소의 사전승인을 얻어야 함
  - 연구자의 변경은 공동연구자의 추가·제외·교체의 경우를 말함
- ② 사전승인 요청은 '연구과제 변경 승인 요청서'(이하 '승인 요청서'라고 한다)을 거래소가 지정한 다음의 2회의 기간 중에 제출해야 함
  - [1차 변경요청 기간] 2020.12.07 ~ 2020.12.25(1차 기한)
  - [2차 변경요청 기간] 2021.05.03 ~ 2021.05.28(2차 기한)
- ③ 위의 각 기한내 접수된 승인 요청서를 검토하여 변경 요청사항의 승인여부를 결정하여 책임연구자에게 통보하며, 승인받은 경우는 변경된 연구과제를 수행하여 제출하는 경우 원래의 연구과제 수행으로 인정
  - 변경이 필요할 경우 상기 변경요청 기간에 승인 요청서를 제출하기를 바라며, 각 변경요청 기간을 제외하고 승인 요청서를 접수받지 않음
- ④ 사전승인(거래소의 승인통보)을 거치지 않은 제목 또는 내용의 변경사항이 포함된 연구과제의 경우는 연구비 지급이 거부될 수 있으며, 해당 연구자의 향후 학술연구지원사업 지원 시 불이익이 있을 수 있음

### 4. 연구결과보고

- ① 최종보고 기한 : 2021년 7월 5일(월) (도착일 기준)
  - (접수) <http://krxrnd.krx.co.kr> [홈페이지]
  - 학술지의 심사과정 등으로 부득이하게 최종보고 기한을 넘겨서 제출하는 경우에는 연구센터 담당자와 협의 후 연구비 지원이 가능하며, 우수논문상 심사대상에서는 제외될 수 있음
- ② 최종보고 방법 : 논문 문서파일 형태로 제출
  - 다음의 사의표명 문구\*가 반드시 논문에 포함되어야 함
  - \* (사의표명) “이 논문은 OOOO년도 한국거래소 연구비 지원에 의한 논문임” 또는 “The work reported in this paper was supported by the Korea Exchange in OOOO”

**\*\* (중복지원금지) 타 기관 등으로부터 중복 지원을 받거나 중복 사의를 기재하는 경우 학술연구비를 지급하지 않음**

- 논문은 최종보고 기한까지 상기 학회의 학회지 또는 해외학술지(SCI(E), SSCI급)에 게재 또는 게재확정

**※ 최종보고 기한까지 학술지 게재가 어려운 경우에는 게재 확정 여부가 표시된 게재확정본을 제출하고, 추후 실제 게재 논문파일을 제출해야 연구비 지급**

- 거래소는 자체 홈페이지, 발간 간행물, 발간 보고서 등에 게재할 수 있음

금번 학술연구지원사업에 선정된 연구과제 수행에 도움이 되고자 시장정보 데이터를 무상으로 열람·분석할 수 있는 'KRX 데이터 라이브러리' 서비스를 제공하고 있습니다.

관심 있는 분들의 많은 이용을 바랍니다.

◎ KRX 데이터 라이브러리 이용안내

- 위치: 부산시 남구 문현금융로 40 BIFC 한국거래소 57층
- 이용시간: 09:00~17:00 (사전협의된 이용기간 내)
- 문의: KRX 증권·파생상품 연구센터 051) 662-2861, 2867
- 신청절차: 홈페이지(<http://krxmd.krx.co.kr>) 방문 → 인터넷 신청 → 사전협의 → 연구수행

(첨부1) 증권·파생상품 학술연구지원사업 관련 양식

(양식1)

**OOOO년도 한국거래소 학술연구지원사업 응모 신청서**

|  |                                     |                  |      |  |      |  |
|--|-------------------------------------|------------------|------|--|------|--|
| 과제번호 :   |                                     | * 과제번호는 거래소에서 부여 |      |  |      |  |
| 연구과제명  | (국문)                                |                  |      |  |      |  |
|  | (영문)                                |                  |      |  |      |  |
| 연구개요(400자 이내) :  |                                     |                  |      |  |      |  |
| (논문 게재할 학술지명 : )   |                                     |                  |      |  |      |  |
| 책임연구자  | 성명                                  |                  | 소속기관 |  | 직급   |  |
|  | 전화번호                                | (사무실, 휴대폰)       |      |  | 소속학회 |  |
|  | 주소                                  |                  |      |  |      |  |
|  | <b>※ 선정과제 완료 시 책임연구자에게 연구지원비 지급</b> |                  |      |  |      |  |
| 공동연구자  | 성명                                  |                  | 소속기관 |  | 직급   |  |
|  | 전화번호                                | (사무실, 휴대폰)       |      |  | 소속학회 |  |
|  | 주소                                  |                  |      |  |      |  |
| 공동연구자  | 성명                                  |                  | 소속기관 |  | 직급   |  |
|  | 전화번호                                | (사무실, 휴대폰)       |      |  | 소속학회 |  |
|  | 주소                                  |                  |      |  |      |  |
| <p>본인은 별첨 서류를 첨부하여 위 연구비 지원을 신청하며, 연구비 지원이 결정될 경우, 한국거래소가 정한 학술연구 지원사업 관리와 관련된 제반 사항을 준수하여 정해진 기한 내에 충분한 연구성과를 거둘 것을 서약합니다.</p> <p style="text-align: center;">2020년      월      일</p> <p style="text-align: right;">책임연구자 _____ (서명)<br/> 공동연구자 _____ (서명)<br/> 공동연구자 _____ (서명)</p> <p>* 별첨 : 연구계획서 1부</p> <p style="text-align: center;">한국거래소 이사장 귀하</p> |                                     |                  |      |  |      |  |

(양식2)

## 연구 계획서

1.

|       |    |  |
|-------|----|--|
| 연구과제명 | 국문 |  |
|       | 영문 |  |

2. 연구목적 및 필요성(3쪽 이내)

3. 연구내용 및 방법(5쪽 이내)

4. 국내외 연구동향(2쪽 이내)

5. 연구결과의 기대효과 및 활용방안

6. 연구일정

7. 주요 참고문헌

## 「KRX 증권·파생상품 학술연구지원사업」 개인정보 활용 동의서

본인은 한국거래소가 '증권·파생상품 학술연구지원사업' 및 '증권·파생상품 우수 논문상'의 신청 접수 및 관리에 필요한 본인의 개인정보를 '개인정보보호법' 및 관련 법령에 따라 다음과 같이 수집하여 활용하는 것에 동의합니다.

| ■ 개인정보 수집 및 이용에 관한사항 |  |   |                             |
|----------------------|--|---|-----------------------------|
| 수집항목                 |  | 수집 및 이용목적                                     | 보유기간                        |
| 일반정보                 | 성명, 소속, 유선/휴대전화번호, 이메일, 주소, 학력, 경력, 사진 | 학술연구지원사업 신청·접수 및 관리                           | 신청 접수 후 2년간                 |
|                      | 계좌번호                                   | 연구 지원비 및 우수 논문상 상금 지급과 관련 소득세 처리 (소득세법 제166조) | 처리완료일로부터 5년간 (국세기본법 제85조의3) |
| 고유식별 정보              | 주민등록번호                                 |   |                             |

본인은 귀사가 상기의 내용으로 본인의 일반정보를 활용하는 것에 동의합니다.

[ 동의함  동의하지 않음  ]

본인은 귀사가 상기의 내용으로 본인의 고유식별정보를 활용하는 것에 동의합니다.

[ 동의함  동의하지 않음  ]

※ 상기 내용에 대해 동의를 거부할 수 있으나, 동의 거부 시 학술연구지원사업 선정 및 우수 논문상 수상에 있어서 제한을 받을 수 있습니다.

개인정보 활용에 대한 자세한 사항은 KRX 한국거래소 홈페이지 ([www.krx.co.kr](http://www.krx.co.kr))에 공개된 '개인정보처리방침'을 참조하시기 바랍니다.

작성일 : \_\_\_\_\_

작성자 : \_\_\_\_\_ (서명)

### 한국거래소 귀중

(양식4)

## 연구과제 변경 승인 요청서

|         |                  |          |        |  |
|---------|------------------|----------|--------|--|
| 승인요청 일자 | 0000.00.00       | 지원사업시행년도 | 0000년도 |  |
| 과제번호 :  | * 과제번호는 거래소에서 부여 |          |        |  |
| 선정과제명   | 국문               |          |        |  |
|         | 영문               |          |        |  |
| 연구자     | 성명               | 소속       | 서명란    |  |
|         | 성명               | 소속       | 서명란    |  |
|         | 성명               | 소속       | 서명란    |  |

\* '선정과제명'은 최초 연구과제 선정 시 제출하여 채택된 연구과제명

### 1. 연구과제명 변경사항(2쪽 이내)

|               |    |  |
|---------------|----|--|
| 변경희망<br>연구과제명 | 국문 |  |
|               | 영문 |  |
| (연구과제명 변경 사유) |    |  |

\* '변경희망연구과제명'은 선정과제명을 변경하여 논문에 게재하고자 하는 경우 해당 연구과제명

### 2. 연구과제 내용 변경사항(5쪽 이내)

|                 |
|-----------------|
| (연구과제 내용 변경 내용) |
| (연구과제 내용 변경 사유) |



### 3. 연구자 변경 사항

|      |      |            |      |  |      |  |
|------|------|------------|------|--|------|--|
| 변경 전 | 성명   |            | 소속기관 |  | 직급   |  |
|      | 전화번호 | (사무실, 휴대폰) |      |  | 소속학회 |  |
|      | 주소   |            |      |  |      |  |
| 변경 후 | 성명   |            | 소속기관 |  | 직급   |  |
|      | 전화번호 | (사무실, 휴대폰) |      |  | 소속학회 |  |
|      | 주소   |            |      |  |      |  |

\* 연구자 변경 후에는 개인정보 활용 동의서 제출해야 함