

2023년도 「KRX 증권·파생상품 학술연구지원사업」 시행 공고

한국거래소(이하 '거래소')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. 사업 내용

- ① 지원자격 : 증권·파생상품 관련 학회 회원, 금융업계 종사자, 연구원, 석·박사, 대학원생, 기타 금융전문가 등
- ② 지원분야 : 거래소가 사전에 제시하는 지정과제 및 국내 증권·파생상품 시장 발전과 관련된 연구로서 지원자가 자율적으로 선정한 연구과제

가. 지정과제

- 개별주식선물/옵션시장의 활성화(상장) 필요성 (현물시장 변동성 완충 역할 등에 관한 효과분석)
- 국내 파생상품시장의 경제적 기능*에 대한 계량적 분석 및 계량지표개발
* 가격발견기능, 유동성 공급, 위험관리, 시장효율성 등

나. 자유과제

< 자유과제 분야 예시 >

- 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
- 증권·파생상품시장의 시장조성활동에 관한 분야
- CCP, 증거금제도, RFR 관련 연구 등 기타 자본시장 및 거래소 발전에 관한 분야

③ 연구비 지원 과제 수 : 9편 이내

- 지정과제 2편 이내, 자유과제 7편 이내
- 상기 지원과제 수는 조정될 수 있으며, 지정과제에 적격 응모자가 없는 경우에는 자유과제를 9편 이내로 선정

④ 학술연구비 지원

가. 지원금액 : 총 7,500만원(세전)

- 지정과제 과제당 2,000만원, 자유과제 과제당 500만원(세전)
- 학술연구비는 지원과제 선정 시 선금으로 50%를 지급(협약서 작성)하며, 연구결과를 최종보고 기한까지 제출하는 등 제반 지원요건을 충족한 이후에 잔금을 지급할 예정(지원요건 미충족 시 선지급한 학술연구비도 회수)
- 학술연구비는 '학술연구지원사업 응모 신청서'의 책임연구자에게 일괄 지급
- ※ 연구 결과가 상당히 부실한 경우 연구 결과 접수가 거부될 수 있음

나. 지원요건 : 응모 후 선정된 연구과제가 다음의 요건을 모두 충족한 경우

- 논문을 거래소가 정한 제출기한까지 문서파일 형태로 제출
- 논문에 거래소의 연구지원과제로 선정되어 작성되었음을 명기(사의표명*)

* (예시) “이 논문은 2023년도 한국거래소 연구비 지원에 의한 논문임” 또는
“The work reported in this paper was supported by the Korea Exchange in 2023”

※ 타 기관 등으로부터 중복 지원을 받거나 중복 사의를 기재하는 경우 학술연구비를 지급하지 않음

- 논문을 거래소가 정한 학술지에 최종보고 기한까지 게재 또는 게재확정*

◆ (국내 학술지) 한국증권학회, 한국파생상품학회, 한국금융공학회, 한국재무학회, 한국재무관리학회, 한국금융학회, 한국증권법학회, 한국상사법학회, 한국기업법학회, 한국금융법학회, 한국법학회, 대한경영학회, 한국기업경영학회, 한국경영학회, 한국국제경영학회, 한국경제학회 등 16개 학회지

◆ (해외학술지) SCI, SCIE, SSCI 급 학술지

⑤ 우수논문상 : 제출된 자유과제 논문 중 별도 심사를 통하여 시상
(지정과제는 시상 대상에서 제외)

가. 상금규모 : 총 2,200만원 이내(세전)

나. 시상내역 : 총 3편 이내

- 최우수상 : 상금 1,000만원(세전)과 상패

- 우수상 : 상금 700만원(세전)과 상패
최우수상 미선정 시 2편 이내

- 장려상 : 상금 500만원(세전)과 상패
최우수상 및 우수상 미선정 시 3편 이내

※ 시상에 적합한 논문이 없다고 판단될 경우 선정하지 않을 수 있음

2. 응모 및 선정

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

② 제출기한 : 2023년 8월 18일(금)

③ 제출방법 : 홈페이지 접수(<http://krxrnd.krx.co.kr>)

④ 선정방법 : 주제와 연구방법상의 현실성, 독창성, 중요성, 활용도 등을 기준으로 거래소의 연구지원과제 선정위원회에서 결정

⑤ 결과통보 : 2023년 9월 22일(금) 이후 개별통보 예정

- 거래소는 일정상 부득이한 경우 선정 및 통보 일자를 조정할 수 있음

- 선정결과는 '학술연구지원사업 응모 신청서'의 책임연구자에게 통보

3. 선정과제 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)를

거래소가 지정한 다음의 2회의 변경요청기간 중에만 제출 가능함

- [1차 변경요청 기간] 2023.11.20 ~ 2023.12.08. (1차 기한)

- [2차 변경요청 기간] 2024.05.13 ~ 2024.05.31. (2차 기한)

- ③ 거래소는 상기 기한 내에 접수된 승인 요청서를 검토하여 승인 여부를 책임 연구자에게 통보하며, 승인 내용대로 연구과제를 수행하여 제출
 - 변경이 필요할 경우 **상기 2차례의 변경요청 기간에 승인 요청서를 제출하여야 하며, 변경요청 기간 이외에는 승인 요청 접수 불가**
- ④ 사전승인(거래소의 승인통보)을 거치지 않은 제목 또는 내용의 변경사항이 포함된 연구과제의 경우는 연구비 지급이 거부되거나 사전 지급된 연구비가 회수될 수 있으며, 해당 연구자의 향후 학술연구지원사업 지원 시 불이익이 있을 수 있음

4. 연구결과 보고

① 보고(제출) 기한 : 2024년 9월 27일(금) (도착일 기준)

② 보고(제출) 방법 : 홈페이지 제출(<http://krxrnd.krx.co.kr>)

- 학술지의 심사 지연 등으로 불가피하게 최종보고(제출) 기한을 넘겨 학술지에 게재될 것으로 예상되는 경우에는 반드시 거래소 담당자와 협의해야 함
- 이 경우에도 논문은 반드시 보고 기한 내에 제출되어야 하며, 해당 논문은 우수 논문상 심사대상에서는 제외될 수 있음

③ 기타사항

- 거래소는 해당 논문을 홈페이지, 간행물, 보고서 등에 게재하거나, 응모자에게 거래소가 주최 또는 후원하는 세미나, 컨퍼런스 등에서 발표할 것을 요청할 수 있으며, 응모자는 특별한 사유가 없는 한 이를 수용하여야 함