



2012 年臺灣經濟計量學會年會議程

主辦單位：臺灣經濟計量學會

共同主辦單位：國立臺灣大學計量理論與應用研究中心

國立臺灣大學經濟學系

時間：2012 年 10 月 27 日(星期六)

地點：國立臺灣大學社會科學院 (臺北市中正區徐州路 21 號)

贊助單位： **國泰金控**
Cathay Financial Holdings

時間	地點	會議內容		
8:45-9:15	法社教室	報到		
9:15-10:30 研討會 (一)	法社教室	計量理論 (第 4 教室)	財務計量 I (第 5 教室)	效率分析 (第 6 教室)
10:30-10:50	綜合大樓	茶會		
10:50-11:40	綜合大樓	年會大會演講：Econometric Techniques and The Empirical Analysis of Economic Phenomena: What Constitutes Good Applied Research? Professor Heather Anderson		
11:40-12:30	綜合大樓	年會大會		
12:30-14:00	法社教室	午餐		
14:00-15:15 研討會 (二)	法社教室	時間序列計量 I (第 4 教室)	財務計量 II (第 5 教室)	個體經濟實證 (第 6 教室)
15:15-15:35	法社教室	茶會		
15:35-16:50 研討會 (三)	法社教室	時間序列計量 II (第 4 教室)	財務經濟實證 (第 5 教室)	總體經濟實證 (第 6 教室)



9:15-10:30 研討會(一) Contributed Session I

研討會(一)為每篇論文報告 20 分，討論 3 分。“*”表示報告人

1.1 計量理論 Econometric Theory

地點：臺灣大學社科院法社第 4 教室

主席：林金龍（國立東華大學財務金融學系）

1. Understanding Mate Preferences from Two-Sided Matching Markets: Identification, Estimation and Policy Analysis

謝鈺偉* (University of Southern California)

2. Estimating the Causal Effects of Education on Dispersion of Potential Wages

陳香如* (中央研究院經濟研究所)

3. Estimating Conditional Average Treatment Effects

Jason Abrevaya (University of Texas)、許育進* (中央研究院經濟研究所)、Robert P. Lieli (Central European University)

1.2 財務計量 I Financial Econometrics I

地點：臺灣大學社科院法社第 5 教室

主席：黃裕烈（國立清華大學計量財務金融學系）

1. Asymmetric Relation between Stock Return Volatility and Informed Trading Activity

黃宜侯（元智大學管理學院）、張慶良* (元智大學管理學院)

2. Choice of Predictors for the Stock Market Cycles

陳宜廷（中央研究院經濟研究所）、羅秉政* (國立臺灣大學國際企業學系)

3. Threshold Cointegration and Dynamics of Crude Oil Futures Volatility and Financial Speculation

李瑞琳* (朝陽科技大學財務金融系)、朱香蕙 (國立暨南國際大學財務金融學系)



1.3 效率分析 Efficiency Analysis

地點：臺灣大學社科院法社第 6 教室

主席：王泓仁（國立臺灣大學經濟學系）

1. 以貝氏隨機前緣分析法衡量鐵路運輸之績效
林村基* (明道大學國際行銷與運籌學系)
2. 金融資產證券化對銀行成本效率之影響
梁連文* (中國文化大學財務金融學系)、鄭政秉 (國立雲林科技大學財務金融系)、許瑞容 (東吳大學經濟學系)
3. Maximum Likelihood Estimation for Linear Mixed Model with Unobserved Common Correlated Effects via EM algorithm
徐之強 (國立中央大學經濟學系)、林常青 (中央研究院經濟研究所)、殷壽鏞* (國立中央大學經濟學系)

10:30-10:50 茶會 Coffee Break

地點：臺灣大學社科院綜合大樓一樓

10:50-11:40 年會大會演講 Keynote Speech

地點：臺灣大學社科院綜合大樓一樓國際會議廳

講者：Prof. Heather Anderson

- Department of Econometrics and Business Statistics, Monash University
- Maureen Brunt Chair in Economics and Econometrics
- Co-Editor of *Empirical Economics*
- Associate Editor of *Journal of Applied Econometrics*

主席：管中閔（中央研究院院士，國立臺灣大學臺大講座教授）

11:40-12:30 年會大會 Annual Assembly

地點：臺灣大學社科院綜合大樓一樓國際會議廳

主席：王泓仁（臺灣經濟計量學會理事長）

12:30-14:00 午餐 Lunch Break

地點：臺灣大學社科院法社第 16 教室



14:00-15:15 研討會(二) Contributed Session II

研討會(二)為每篇論文報告 20 分，討論 5 分。“*”表示報告人

2.1 時間序列計量 I Time Series Econometrics I

地點：臺灣大學社科院法社第 4 教室

主席：陳美源（國立中興大學財務金融學系）

1. A Minimum Distance Estimator for Long Memory Process Using An AR (K_T) Approximation

Shin-Huei Wang (Universite Catholique de Louvain)、洗芻蕘* (國立清華大學經濟學系)

2. The Multiple Quantile Regression on Quantile Ranges Model

管中閔（國立臺灣大學財務金融學系）、Christos Michalopoulos* (國立臺灣大學經濟學系)、Zhijie Xiao (Boston College)

3. Constructing Smooth Tests without Estimating the Eigen-pairs of the Limiting Process

徐士勛* (國立政治大學經濟學系)、管中閔（國立臺灣大學財務金融學系）

2.2 財務計量 II Financial Econometrics II

地點：臺灣大學社科院法社第 5 教室

主席：陳宜廷（中央研究院經濟研究所）

1. What Drives Commodity Prices?

陳淑玲* (國立臺北大學金融與合作經營學系)、John D. Jackson (Auburn University)、Hyeongwoo Kim (Auburn University)、Pramesti Resiandini (Georgia State University)

2. The Informational Association between the S&P 500 Index and VIX Options Markets

高典萱（國立臺灣大學財務金融學系）、蔡維哲* (國立中山大學財務管理學系)、王耀輝（國立臺灣大學財務金融學系）

3. A Range-Based Volatility Approach to Measuring Volatility Contagion in Securitized Real Estate Markets

陳奕奇* (國立成功大學經濟學系)、王立民（中央研究院經濟研究所）



2.3 個體經濟實證 Empirical Studies (Micro)

地點：臺灣大學社科院法社第 6 教室

主席：簡錦漢* (中央研究院經濟研究所)

1. 高等教育擴張對於大專畢業生超額教育和不足教育薪資報酬的影響
徐美* (國立臺北大學經濟學系)
2. Could Schools Compete for Better Students by Choosing Entrance Examination Dates?
高一誠* (中原大學企業管理學系)、Wei-Cheng Chen (Washington University)
3. Effect of Education on Fertility and Marital Status: Evidence from a Compulsory Education Law Change
簡錦漢* (中央研究院經濟研究所)、Myoung-Jae Lee (Korea University)

15:15-15:35 茶會 Coffee Break

地點：臺灣大學社科院法社第 16 教室

15:35-16:50 研討會(三) Contributed Session III

研討會(三)為每篇論文報告 20 分，討論 5 分。“*”表示報告人

3.1 時間序列計量 II Time Series Econometrics II

地點：臺灣大學社科院法社第 4 教室

主席：徐之強 (國立中央大學經濟學系)

1. A New Method of Measuring Voter and Candidate Ideology
林茂廷* (國立臺北大學經濟學系)、謝修 (國立臺北大學經濟學系)
2. Panel Threshold Regression Models with Endogenous Threshold Variables
王健合* (國立臺北大學經濟學系)、林世昌 (國立清華大學經濟學系)
3. Identification and Estimation of Semi-parametric Censored Dynamic Panel Data Models
Yingyao Hu (Johns Hopkins University)、徐吉良* (國立中正大學經濟學系)



3.2 財務經濟實證 Empirical Studies (Finance)

地點：臺灣大學社科院法社第 5 教室

主席：陳聖賢（國立臺灣大學財務金融學系）

1. Effects of Directors' and Officers' Liability Insurance on CEO Pay and Business Performance – Evidence from TWSE-listed Companies

張元*（國立彰化師範大學商業教育學系）、沈中華（國立臺灣大學財務金融學系）

2. CEO Overconfidence and the Long-Term Performance Following R&D Increases

陳聖賢（國立臺灣大學財務金融學系）、何耕宇*（國立臺灣大學財務金融學系）、何柏欣（國立聯合大學財務金融學系）

3. Sustainable Growth Rate, Optimal Growth Rate, and Optimal Payout Ratio: A Joint Optimization Approach

陳鴻毅*（國立中央大學財務金融學系）、Manak C. Gupta (Temple University)、Alice C. Lee (State Street Corporate)、Cheng-Few Lee (Rutgers University)

3.3 總體經濟實證 Empirical Studies (Macro)

地點：臺灣大學社科院法社第 6 教室

主席：黃朝熙（國立清華大學經濟學系）

1. 央行「阻升不阻貶」？—再探臺灣匯率不對稱干預政策

陳旭昇*（國立臺灣大學經濟學系）

2. Silver lifeboat, not silver fetters: Why and how the silver standard insulated China from the 1929 Great Depression

何泰寬*（國立清華大學計量財務金融學系）、賴建誠（國立清華大學經濟學系）

3. Monetary Regimes and Share Price Volatility in East Asia

黃俞寧*（國立政治大學經濟學系）、Paul McNelis (Fordham University)



本次會議注意事項

1. 上午研討會每篇論文報告 20 分，討論 3 分。下午研討會每篇論文報告 20 分，討論 5 分。
2. 議程計時由穿著臺灣經濟計量學會背心的工作人員舉牌提示。時間剩餘 5 分鐘前第一次舉牌提示；剩餘 3 分鐘前第二次舉牌提示；時間結束時第三次舉牌提示。
3. 建議於每篇論文發表完後進行討論，但主席可以彈性調整流程。唯請主席注意時間，切勿延宕下一場講座進行。
4. 臺灣經濟計量學會只提供 1 臺無線網路的電腦在報到處供緊急情況使用。
5. 臺灣經濟計量學會入會資訊：一般會員年費為新臺幣 800 元整；學生會員年費為新臺幣 300 元整；永久會員為新臺幣 15,000 元整。詳情入會方式請見臺灣經濟計量學會網站 <http://www.tesociety.org.tw/> 學會成員之入會申請。



國立臺灣大學社會科學院館交通路線圖



國立臺灣大學社會科學院：臺北市中正區徐州路 21 號

公車

- ◆ 搭乘 15、22、208、295、297、671、665，至「開南商工站」下車。
- ◆ 搭乘 222、297、665，至「北商學院站」下車。
- ◆ 搭乘 222、253、297，至「仁愛路二段站」下車。

捷運

- ◆ 搭乘捷運新店線至臺大醫院站，沿徐州路直行，步行約 10 分鐘。
- ◆ 搭乘捷運板南線至善導寺站，沿紹興南街直行，左轉徐州路，步行約 10 分鐘。