



# 2013 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

國立臺灣大學財務金融學系

時間：2013 年 11 月 2 日(星期六)

地點：國立臺灣大學管理學院 (臺北市大安區羅斯福路四段 1 號)

贊助單位：



**國泰金控**

Cathay Financial Holdings

時間	地點	會議內容			
8:30-9:00	管一館四樓	報到			
9:00-10:15 研討會 (一)	管一館四樓	總體經濟實證 1 (405 教室)	財務經濟實證 1 (403 教室)	計量理論 1 (402 教室)	個體經濟實證 (401 教室)
10:15-10:30	管一館 B1	茶會			
10:30-11:20	管一館 B1 正大國際會議廳	國泰金控經濟計量專題演講 A Regime-Switching SVAR Analysis of Quantitative Easing <b>Prof. Fumio Hayashi</b>			
11:20-11:25	管一館 B1	茶會			
11:25-12:15	管一館 B1 正大國際會議廳	臺灣經濟計量學會專題演講 失散後的重逢：從學術研究到政策研究 <b>管中閔院士</b>			
12:15-12:45	管一館 B1 正大國際會議廳	年會大會			
12:45-14:00	管一館一樓 103 教室	午餐			
14:00-15:40 研討會 (二)	管一館四樓	財務經濟實證 2 (405 教室)	計量方法 (403 教室)	財務時間序列 (402 教室)	R 的資料 管理與分析 (401 教室)
15:40-15:55	管一館四樓	茶會			
15:55-17:35 研討會 (三)	管一館四樓	財務計量 (405 教室)	計量理論 2 (403 教室)	總體經濟實證 2 (402 教室)	R 的時間 序列分析 (401 教室)

備註：理監事投票箱與開票地點設置在會管院一號館四樓報到處，投票至 15:00 結束。



## 9:00-10:15 研討會(一) Contributed Session I

研討會(一)為每篇論文報告 20 分，討論 5 分。“\*”表示報告人

### 1.1 總體經濟實證 (一) Empirical Studies (Macro) I

地點：臺灣大學管理學院一號館四樓 405 教室

主席：周雨田 (中央研究院經濟研究所)

1. 油價衝擊與臺灣總體經濟波動：動態隨機一般均衡模型之應用  
徐之強 (國立中央大學經濟學系)、姚睿 (國立中央大學經濟學系)、  
印永翔 (國立臺灣師範大學企業管理學程)、黃俞寧 (國立政治大學經濟學系)、吳俊毅\*(財團法人商業發展研究院)
2. True or Fiction: The Relationship between Carbon Linkage and Carbon Dioxide EKC Curve  
王健合\*(國立臺北大學經濟學系)、林常青 (中央研究院經濟研究所)、  
陳宛君 (中國文化大學經濟學系)、Chia-Hsiang Hsu (國立臺北大學經濟學系)
3. Forecasting Crude Oil Price Movements with Oil-Sensitive Stocks  
陳旭昇\*(國立臺灣大學經濟學系)

### 1.2 財務經濟實證 (一) Empirical Studies (Finance) I

地點：臺灣大學管理學院一號館四樓 403 教室

主席：陳聖賢 (國立臺灣大學財務金融學系)

1. Property Bubbles and the Driving Forces in the PIGS countries  
Philipp Klotz \* (國立政治大學亞太研究博士學位學程)、林左裕 (國立政治大學地政系)、徐士勛 (國立政治大學經濟學系)
2. Measure of downturn connectedness and systemic risk in financial institutions  
莊惠菁\* (元智大學管理學院)
3. Earnings management surrounding forced CEO turnover: Evidence from the property-casualty insurance industry  
程江\* (Shanghai University of Finance and Economics)、林姿婷 (國立臺灣大學財務金融學系)



### 1.3 計量理論 (一) **Econometric Theory I**

地點：臺灣大學管理學院一號館四樓 402 教室

主席：陳宜廷（中央研究院經濟研究所）

1. Identification and Estimation of Sample Selection Models Without Additivity

廖仁哲\* (中央研究院經濟研究所)

2. Estimation and Inference for Distribution Functions and Quantile Functions in Endogenous Treatment Effect Models

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

3. Structural Estimation of Sponsored Search Auctions

謝鈺偉\* (University of Southern California)、Matt Shum (California Institute of Technology)、Sha Yang (University of Southern California)

### 1.4 個體經濟實證 **Empirical Studies (Micro)**

地點：臺灣大學管理學院一號館四樓 401 教室

主席：陳建良（國立暨南國際大學經濟學系）

1. 金融知識與退休金規劃關聯性之研究-臺灣地區的驗證

蕭育仁（國立東華大學財務金融學系）、陳錦村（德明財經科技大學財金學院與保險金融管理學系）、廖志峰\*（實踐大學財務金融學系）

2. 首次公開發行定價效果與股票買回行為關係之研究

陳怡珮(中原大學財務金融學系)、林翠蓉\* (文化大學財務金融學系)、王榆賢（中原大學財務金融學系）

3. 青少年在校學習成就和教育跨代移轉機制之研究

徐美\* (國立臺北大學經濟學系)、陳明郎（中央研究院經濟研究所）



### **10:15-10:30 茶會 Coffee Break**

地點：臺灣大學管理學院一號館 B1

### **10:30-11:20 國泰金控經濟計量專題演講 Keynote Speech I**

地點：臺灣大學管理學院一號館 B1 正大國際會議廳

講者：Prof. Fumio Hayashi (Hitotsubashi University)

主席：王泓仁（臺灣經濟計量學會理事長）

### **11:20-11:25 茶會 Coffee Break**

地點：臺灣大學管理學院一號館 B1

### **11:25-12:15 臺灣經濟計量學會專題演講 Keynote Speech II**

地點：臺灣大學管理學院一號館 B1 正大國際會議廳

講者：管中閔（中央研究院院士，國立臺灣大學臺大講座教授）

主席：曾郁仁（國立臺灣大學財務金融學系）

### **12:15-12:45 年會大會 Annual Assembly**

地點：臺灣大學管理學院一號館 B1 正大國際會議廳

主席：王泓仁（臺灣經濟計量學會理事長）

### **12:45-14:00 午餐 Lunch Break**

地點：臺灣大學管理學院一號館一樓 103 教室

備註：理監事投票至三點結束，三點開始開票。

理監事投票箱與開票地點設置在管理學院一號館四樓報到處。



## 14:00-15:40 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 財務經濟實證 (二) Empirical Studies (Finance) II

地點：臺灣大學管理學院一號館四樓 405 教室

主席：徐美 (國立臺北大學經濟學系)

1. Corporate Social Responsibility, Cost of Equity and Cost of Bank Loan  
張元\* (國立彰化師範大學財務金融技術系)、Chia-Hui Hsieh (國立彰化師範大學財務金融技術系)、Tsung-Cheng Wang (淡江大學財務金融學系)、Tsung-Yu Hsieh (淡江大學財務金融學系)
2. Can Price Anomalies be Obtained by Using Candlestick Patterns?  
呂宗勳\* (國立清華大學)
3. The Bright Side of Government Banks-Evidence from the Global Financial Crisis  
陳彥行 (國立臺灣大學財務金融學系)、陳業寧 (國立臺灣大學財務金融學系)、Iftekhar Hasan (Fordham University and Bank of Finland)、林智勇\* (元智大學管理學院)
4. Idiosyncratic risk and long-run stock performance following seasoned equity offerings  
何柏欣\*(國立聯合大學財務金融學系)、黃嘉威 (元智大學管理學院)、林智勇 (元智大學管理學院)、顏汝芳 (國立臺北大學統計學系)

### 2.2 計量方法 Econometric Methodology

地點：臺灣大學管理學院一號館四樓 403 教室

主席：簡錦漢 (中央研究院經濟研究所)

1. Time Evolution of Income Distributions  
陳宜廷\*(中央研究院經濟研究所)、Ruey S. Tsay (University of Chicago)



2. On functional limits of short- and long-memory linear processes with GARCH(1,1) noises

張榮茂 (中國浙江大學)、冼芻蕘\* (國立清華大學經濟學系)、凌仕卿 (香港科技大學)

3. Durbin-Watson 檢定的限制

李玫郁\* (元培科技大學應用財務管理系)

4. Spatio-Temporal Valuation of Real Estate Using Geostatistical Technique- A Case Study in Taichung City

陳靜宜\*(國立政治大學金融學系)、廖四郎 (國立政治大學金融學系)

### 2.3 財務時間序列 Financial Time Series

地點：臺灣大學管理學院一號館四樓 402 教室

主席：俞明德 (國立交通大學財務金融研究所)

1. Dynamic international co-movements among cross-sector REIT markets during the recent housing boom-bust cycle

黃美綺\* (國立臺北大學企業管理學系)、吳志強 (元智大學管理學院)

2. An Efficient Bayesian Inference for the State Space Models with the Stochastic Volatility

黃宇凡\* (北京首都經貿大學國際經濟管理學院)

3. Risk measures based on first four moments and resulting trading strategies

莊額嘉\* (國立臺灣大學財務金融學系)、管中閔 (國立臺灣大學財務金融學系)

4. Stochastic trends and structural breaks

羅穗\*(北京首都經貿大學國際經濟管理學院)



## 2.4 R 的資料管理與分析 Data Management and Analysis with R

地點：臺灣大學管理學院一號館四樓 401 教室

主席：何宗武（世新大學財務金融學系）

1. R 介紹與資料結構  
何宗武教授\*（世新大學財務金融學系）
2. 我的資料庫很大怎麼辦？  
陳景祥教授\*（淡江大學統計學系）
3. 資料可視化  
郭迺鋒教授\*（世新大學財務金融學系）

## 15:40-15:55 茶會 Coffee Break

地點：臺灣大學管理學院一號館四樓

## 15:55-17:35 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 財務計量 Financial Econometrics

地點：臺灣大學管理學院一號館四樓 405 教室

主席：莊慧玲（國立清華大學經濟學系）

1. Wavelet Based Denoising Method for High Frequency Data Analysis: A Smoothness Oriented Approach  
陳怡廷\*（國立交通大學資訊工程所）、Edward W. Sun (Karlsruhe Institute of Technology)、俞明德（國立交通大學財務金融研究所）
2. Electricity consumption and bank deposits for pollution prevented policy: A Threshold co-integration  
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）、蘇香珍（朝陽科技大學財務金融系）



### 3. The Multivariate Risk Measures: Estimation and Asymptotics

Edward W. Sun (Karlsruhe Institute of Technology)、俞明德 (國立交通大學財務金融研究所)、王鈺仁\* (國立交通大學)

### 3.2 計量理論 (二) Econometric Theory II

地點：臺灣大學管理學院一號館四樓 403 教室

主席：林金龍 (國立東華大學財務金融學系)

1. Estimating and testing for unit root processes with nonstationary nonlinear heteroskedasticity  
邱惠玉\* (輔仁大學經濟學系)
2. Distribution Structural Functions and Quantile Structural Functions in Treatment Effect Models  
許育進 (中央研究院經濟研究所)、賴宗志\* (國立臺灣大學經濟學系)
3. A note on mean squared prediction error under the unit root model with deterministic trend  
俞淑惠\* (國立高雄大學統計學研究所)、林建志 (淡江大學財務金融學系)、鄭宏文 (東吳大學財務工程與精算數學系)
4. The Markovian Sequences in State-Space Models with Regime Switching  
劉家妙\* (工業技術研究院產業經濟與趨勢研究中心)

### 3.3 總體經濟實證 (二) Empirical Studies (Macro) II

地點：臺灣大學管理學院一號館四樓 402 教室

主席：黃朝熙 (國立清華大學經濟學系)

1. Information Transmission and Cross-Market Hedging between Stock and Government Bond 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. **Nonlinear Adjustment to Purchasing Power Parity for Seven High-Growth Countries**

陳鳳琴\*(新生醫護管理專科學校)

3. **臺灣出口產品品質的演進**

李浩仲\*(國立政治大學經濟學系)、翁培真 (國立政治大學經濟學系)

4. **臺灣經濟成長、出口與能源消耗因果關係之探討**

陳美惠 (國防大學管理學院財務管理學系)、郭國誠\*(中國文化大學國際貿易學系暨研究所)、郭正傑 (中國文化大學國際貿易學系暨研究所)

**3.4 R 的時間序列分析 Time Series Analysis With R**

地點：臺灣大學管理學院一號館四樓 401 教室

主席：陳美源 (國立中興大學財務金融學系)

1. **Unit Root and Cointegration Analysis by urca**

陳美源教授\*(國立中興大學財務金融學系)

2. **Vector Autoregression Model**

黃裕烈教授\*(國立清華大學計量財務金融學系)

3. **Dynamic Panel Data**

陳釗而教授\*(國立臺灣大學經濟學系)

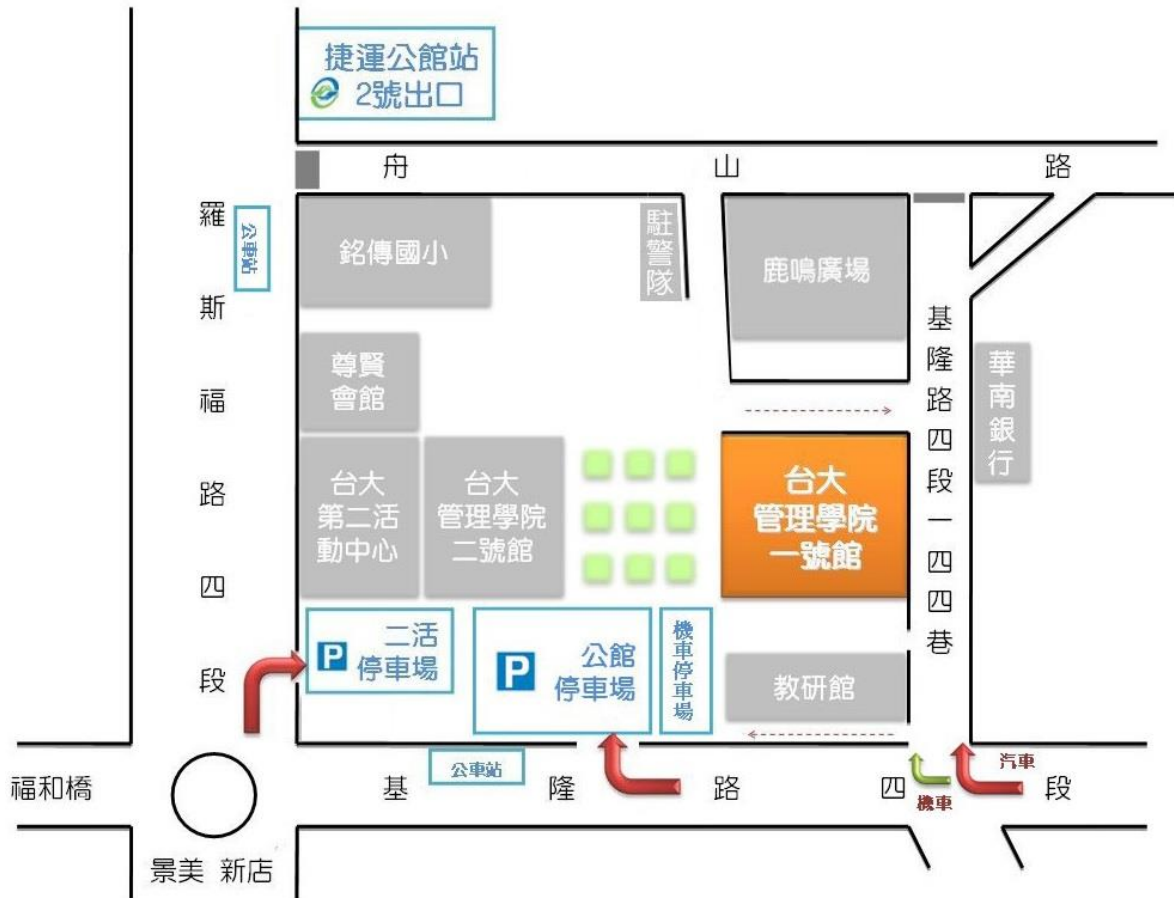


## 本次會議注意事項

1. 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. 此次理監事選舉選票各有一張，會員請於下午 3 時前將選票投入投票箱。投票箱設置於管理學院一號館四樓報到處。
5. 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。
6. 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。
7. 由於本會經費有限，會議當日僅能提供主席、發表人及本會會員午餐，您可於當日入會，即附贈午餐券；非會員恕無供應，請您自理。不便之處，敬請見諒！



## 國立臺灣大學管理學院交通路線圖



國立臺灣大學管理學院：臺北市大安區羅斯福路四段 1 號

- 開車：公館水源市場對面羅斯福路上，近羅斯福路與基隆路交叉口
  - 國道一號：由松江路交流道下，轉建國高架道路南行至和平東路出口，續行辛亥路至基隆路右轉，直行至羅斯福路再右轉，隨即於右側「臺灣大學公館二活停車場」停車即可。
  - 國道三號：由臺北聯絡道下辛亥路端，接基隆路右轉羅斯福路，隨即於右側「臺灣大學公館二活停車場」停車即可。
  - 若停車於「臺灣大學公館二活停車場」可持停車票卡至報到處蓋章，可享優惠價格 (20 元/小時)



- 捷運：捷運新店線 公館站二號出口 (步行 5 分鐘)
- 公車
  - 捷運公館站 (羅斯福路)：254
  - 捷運公館站 (公車專用道-往西區方向)：0 南、1、109、208、208 (高架線)、208 (區間車)、208 (基河二期國宅線)、236、251、252、253、278、284、284 (直行)、290、52、642、643、644、648、660、671、672、673、676、74、907、景美女中-榮總快速公車、棕 12、綠 11、綠 13、藍 28
  - 捷運公館站 (公車專用道-往新店方向)：207、278、280、280 (直達車)、284、311、505、530、606、606 區間車、668、675、676、松江幹線、松江-新生幹線、敦化幹線、藍 28
  - 公館 (羅斯福路基隆路口)：671
  - 公館 (基隆路)：1、207、254、275、275 (副)、650、672、673、907、南港軟體園區通勤專車 (雙和線)