



2014 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

國立臺灣大學社會科學院

協辦單位：國立交通大學財務金融研究所

時間：2014 年 11 月 1 日(星期六)

地點：國立臺灣大學社會科學院 (臺北市大安區羅斯福路四段一號)

時間	地點	會議內容		
8:30-9:00	社科院三樓	報到		
9:00-10:15 研討會 (一)	社科院三樓	計量方法 I (301 教室)	總體經濟實證 I (306 教室)	財務經濟實證 I (307 教室)
10:15-10:35	社科院三樓	茶會		
10:35-11:25	社科院三樓 國際會議廳	年會專題演講： Education and Economic Development: Empirical Findings and Policy Implications Prof. Jong-Wha Lee (Korea University)		
11:25-12:15	社科院三樓 國際會議廳	年會大會		
12:15-14:00	社科院三樓	午餐		
14:00-15:15 研討會 (二)	社科院三樓	計量方法 II (301 教室)	時間序列計量 I (306 教室)	財務經濟實證 II (307 教室)
15:15-15:35	社科院三樓	茶會		
15:35-17:15 研討會 (三)	社科院三樓	時間序列計量 II (301 教室)	總體經濟實證 II (306 教室)	個體經濟實證 (307 教室)



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 計量方法 (一) Econometric Methodology I

地點：國立臺灣大學社會科學院三樓 301 教室

主席：陳宜廷 (中央研究院經濟研究所)

1. Consistent Tests for Conditional Treatment Effects

許育進* (中央研究院經濟研究所)

2. Forecasting Treatment Effects

賴宗志* (國立臺灣大學經濟學系)、許育進 (中央研究院經濟研究所)、
Robert P. Lieli (Central European University)

3. A PANIC Raid on Seasonal Data

徐士勛* (國立政治大學經濟學系)

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

地點：國立臺灣大學社會科學院三樓 306 教室

主席：徐之強 (國立中央大學經濟學系)

1. Foreign-Currency Debt and Government Spending Shocks: Empirical Evidence

楊錚穎* (中央研究院經濟研究所)

2. Revisiting the Exchange Rate-Fundamental Nexus

周有熙* (輔仁大學經濟學系)、陳旭昇 (國立臺灣大學經濟學系)

3. How Different Is this time? Investigating the Declines of the U.S. Real GDP During the Great Recession

黃宇凡* (首都經濟貿易大學國際經濟管理學院)、羅穗 (首都經濟貿易大學 國際經濟管理學院)



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

地點：國立臺灣大學社會科學院三樓 307 教室

主席：何耕宇（國立臺灣大學財務金融學系）

1. CEO Perquisites and Voluntary Disclosure

林志彥*（輔仁大學經濟學系）、黃嘉威（元智大學管理學院）

2. Effect of Country Institutional Factors on Bank Privatization Performance

何柏欣*（國立臺北大學企業管理學系）、林智勇（元智大學管理學院）、
蔡維哲（國立中山大學財務金融學系）

3. A Comparison of the Investors' Reaction to Earning News on Shanghai, and Shenzhen Stock Markets

詹場*（國立臺北大學金融與合作經營學系）、柯文乾（國立臺北大學金融與合作經營學系）、池祥麟（國立臺北大學金融與合作經營學系）、黃尚傑（國立臺灣大學經濟學系）

10:15-10:35 茶會 Coffee Break

地點：國立臺灣大學社會科學院三樓

10:35-11:25 臺灣經濟計量學會專題演講 Keynote Speech

地點：國立臺灣大學社會科學院三樓國際會議廳

講者：Prof. Jong-Wha Lee (Korea University)

主席：管中閔（中央研究院院士，國立臺灣大學臺大講座教授）

11:25-12:15 年會大會 Annual Assembly

地點：國立臺灣大學社會科學院三樓國際會議廳

主席：王泓仁（臺灣經濟計量學會理事長）

12:15-14:00 午餐 Lunch Break



地點：國立臺灣大學社會科學院三樓 305 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 計量方法 (二) Econometric Methodology II

地點：國立臺灣大學社會科學院三樓 301 教室

主席：簡錦漢 (中央研究院經濟研究所)

1. Simulation Estimation of Dynamic Panel Discrete Choice Models using the t Distributions

張勝凱* (國立臺灣大學經濟學系)

2. A Unified Approach to Estimating and Testing Income Distributions with Grouped Data

陳宜廷* (中央研究院經濟研究所)

3. Subsampling for Linear Processes with GARCH(1,1) Noises: the Case of Time Series Regression with A Unit Root

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

2.2 時間序列計量 (一) Financial Time Series I

地點：國立臺灣大學社會科學院三樓 306 教室

主席：林金龍 (國立東華大學財務金融學系)

1. Forecast Performance of Supervised Factor Models: An Application to Taiwan's Economic Growth Rates

陳映君* (國立臺灣大學經濟學系)

2. Static and Dynamic Analysis of Factors Affecting Unemployment in Thailand

趙凱* (中國華僑大學)、魏妹金 (中國華僑大學)

3. Nonlinear Impacts of Real Income on Healthcare Expenditure: Evidence from Panel Smooth Transition Regression Approach

陳鳳琴* (新生醫護管理專科學校行銷與流通科)



2.3 財務經濟實證(二) Empirical Studies (Finance) II

地點：國立臺灣大學社會科學院三樓 307 教室

主席：陳聖賢（國立臺灣大學財務金融學系）

1. Political Connection and Earnings Quality

張元*（國立彰化師範大學財務金融技術學系）、王沛濛（國立彰化師範大學財務金融技術學系）

2. Equity Price Manipulation in Taiwan

葉錦徽*（國立中央大學財務金融學系）、林怡諄（國立中央大學）

3. The Impact of Pre-trade Transparency on Order Imbalance: Evidence from the Taiwan Stock Exchange

陳秀桂*（國立臺中科技大學財務金融系）

15:15-15:35 茶會 Coffee Break

地點：國立臺灣大學社會科學院三樓

15:35-17:15 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(二) Financial Time Series II

地點：國立臺灣大學社會科學院三樓 301 教室

主席：俞明德（國立交通大學財務金融研究所）

1. Efficient Risk Measures for Portfolios of High-Dimensional Dependent Assets: A Bayesian Approach

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

2. Of Needles and Haystacks: Revisiting Growth Determinants by Robust Bayesian Variable Selection

陳奕奇*（國立成功大學經濟學系）、李國榮（國立成功大學統計學系）

3. Trend Definition or Holding Strategy: What Determines the Profitability of Candlestick Technical Trading Strategies?

呂宗勳*（實踐大學國際企業學系）、陳奕奇（國立成功大學經濟學系）、許育進（中央研究院經濟研究所）



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

地點：國立臺灣大學社會科學院三樓 306 教室

主席：陳思寬（國立臺灣大學國際企業學系）

1. Monetary Policy Rules in a Small Open Economy with Heuristics: Which One Is Better for Macroeconomic Stability?
葉國俊*（國立中正大學經濟學系）
2. Financial Developments, Economic Development and Energy Consumption
張淑貞*（國立虎尾科技大學企業管理系）
3. Human Capital Investment and Economic Development
吳宜臻*（國立中央大學經濟學系）、林淑琴（淡江大學經濟學系）、朱雲鵬（國立中央大學經濟學系）
4. House Prices Fluctuation Affect Consumption-based Bayesian Estimation of DSGE Model
王勇*（中原大學）

3.3 個體經濟實證 Empirical Studies (Micro)

地點：國立臺灣大學社會科學院三樓 307 教室

主席：劉錦添（國立臺灣大學經濟學系）

1. The Role of Home-Country Cultural Heritage on the Employment Decision of the Southeast Asian Marriage Immigrants in Taiwan
莊慧玲*（國立清華大學經濟學系）、塗千慧（中華經濟研究院）
2. Housing Inequality and Income Inequality
陳建良*（國立暨南國際大學經濟學系）
3. Strategic Behaviors in Primary Elections
江淳芳*（國立臺灣大學經濟學系）、王道一（國立臺灣大學經濟學系）、林欣誼（國立臺灣大學經濟學系）
4. The Relationship Between Financial Literacy and Over-indebtedness: Evidence in Taiwan
蕭育仁*（國立東華大學財務金融學系）、林士傑（國立臺灣大學國家發展研究所）、唐代彪（國立臺灣大學國家發展研究所）、沈中華（國立臺灣大學財務金融學系）



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. 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。
6. 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！



國立臺灣大學社會科學院交通路線圖



國立臺灣大學社會科學院：臺北市大安區羅斯福路四段 1 號

- 開車：可停車於「社會科學院地下停車場」與「語言中心前停車場」，與會者可持臺灣大學校總區停車場停車票卡至報到處蓋章，可享優惠價格（半價）。
- 捷運：
 - 搭乘【新店線】至公館站下車，循 2 號或 3 號出口，即可抵達台大校總區（步行 10-15 分鐘）。
 - 搭乘【文山內湖線】至科技大樓站下車，沿復興南路步行 5-10 分鐘，至辛亥路台大後門。



- 公車

- 臺大資訊大樓站：298、901
- 公務人力訓練中心站：0 南、109、207、253、280、284、290、311、505、52、642、668、675、907、松江幹線、敦化幹線
- 復興南路口站：3、15、18、52、72、74、207、211、235、237、278、284、295、662、663、和平幹線、敦化幹線
- 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)