TAIWAN ECONOMETRIC SOCIETY
臺灣經濟計量學會

2016 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：2016 年 10 月 29 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 1 號)

贊助單位：國泰金控

時 間	地點	會議內容		
8:30-9:00	社科院 3F	報到		
9:00-10:15 研討會 (一)	社科院 3F	個體計量 (301 教室)	財務實證 I (306 教室)	金融實證 (307 教室)
10:15-10:35	社科院 3F	茶會		
10:35-11:25	國際會議廳	主題演講 I：Anti-Corruption Reforms and Shareholder Valuations: Event Study Evidence from China **Prof. Bernard Y. Yeung (National University of Singapore)**		
11:25-12:15	國際會議廳	主題演講 II：當前兩岸關係之發展 **劉大年教授 (中華經濟研究院)**		
12:15-12:40	國際會議廳	年會大會		
12:40-14:00	社科院 3F	午餐		
14:00-15:15 研討會 (二)	社科院 3F	總體計量 I (301 教室)	計量方法 (306 教室)	財務計量 (307 教室)
15:15-15:35	社科院 3F	茶會		
15:35-17:15 研討會 (三)	社科院 3F	計量理論 (301 教室)	財務實證 II (306 教室)	總體計量 II (307 教室)

備註：理監事投票箱與開票地點設置在社會科學院三樓報到處，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 個體計量 Microeconometrics

地點：國立臺灣大學社會科學院三樓 301 教室

主席：陳建良 (國立暨南國際大學經濟學系)

1. The Impact of Amateur Film Reviews on Movie Theater Attendance: Predictors versus Influencers
   佘健源 (國立中山大學企業管理研究所)、劉玉皙* (科技部人文社會科學研究中心)、朱珮綺 (國立中山大學企業管理研究所)
2. Uncover Components of Individual's Strategic IQ: An Experimental Study
   劉書彧* (國立臺灣大學計量理論與應用研究中心)、王道一 (國立臺灣大學經濟學系)
3. The Impact of Psychiatric Disorders on Employment in Taiwan
   胡登淵 (淡江大學產業經濟學系)、張士軒* (淡江大學產業經濟學系)、薛欣怡 (淡江大學產業經濟學系)

1.2 財務實證 (一) Empirical Studies (Finance) I

地點：國立臺灣大學社會科學院三樓 306 教室

主席：陳聖賢 (國立臺灣大學財務金融學系)

1. Equity Short Selling and the Bank Loan Market 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)、Tse-Chun Lin (University of Hong Kong)
2. Yesterday Once More: Short Selling and Two Banking Crises
   裴典富* (國立臺灣大學財務金融學系)、林智勇 (元智大學管理學院)、Tse-Chun Lin (University of Hong Kong)
3. Bankers Need New Clothes: Bank Capital, Leverage, and Default Probability Adjustment Through The Macroeconomic Cycle
   葉家譽* (國立臺灣大學財務金融研究所)

1.3 金融實證 Empirical Studies (Banking)

地點：國立臺灣大學社會科學院三樓 307 教室

主席：陳思寬 (國立臺灣大學國際企業學系)

1. 成為全球系統性重要銀行是好還是壞
   蕭育仁* (臺北醫學大學生物科技高階管理碩士在職專班)、陳明賢 (國立臺灣大學財務金融學系)、楊詠軒 (國立東華大學財務金融學系)
2. 臺灣公債市場交易量之影響因素
   陳俊豪 (國立臺灣大學財務金融研究所)、胡星陽 (國立臺灣大學財務金融學系)、陳明賢 (國立臺灣大學財務金融學系)、陳鴻崑* (淡江大學財務金融學系)
3. The Anti-Inflationary Effect of Central Bank Independence: Heterogeneity and Endogeneity
   林馨怡* (國立政治大學經濟學系)

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 臺灣經濟計量學會主題演講 (一) Keynote Speech I

Anti-Corruption Reforms and Shareholder Valuations: Event Study Evidence from China

地點：國立臺灣大學社會科學院三樓梁國樹國際會議廳

講者：Prof. Bernard Y. Yeung (National University of Singapore)

主席：管中閔 (臺灣經濟計量學會理事長)

11:25-12:15 臺灣經濟計量學會主題演講 (二) Keynote Speech II

當前兩岸關係之發展

地點：國立臺灣大學社會科學院三樓梁國樹國際會議廳

講者：劉大年教授 (中華經濟研究院)

主席：王泓仁 (國立臺灣大學經濟學系)

12:15-12:40 年會大會 Annual Assembly

地點：國立臺灣大學社會科學院三樓梁國樹國際會議廳

主席：管中閔 (臺灣經濟計量學會理事長)

12:40-14:00 午餐 Lunch Break

地點：國立臺灣大學社會科學院三樓東側廣場

備註：理監事投票箱與開票地點設置在社會科學院三樓報到處，投票至 15:00 結束。

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 總體計量 (一) Macroeconometrics I

地點：國立臺灣大學社會科學院三樓 301 教室

主席：徐之強 (國立中央經濟學系)

1. 臺灣所得不均度變化趨勢：報稅資料分析
   陳建良* (國立暨南國際大學經濟學系)
2. Education, Health and Income Inequality
   金東炫 (Korea University)、林淑琴 (淡江大學經濟學系)、吳宜臻* (淡江大學經濟學系)
3. Optimal Timing and Hedging under Adaptive Market Hypothesis with S&P500 Index
   游凱卉 (國立中央大學財務金融學系)、葉錦徽* (國立中央大學財務金融學系)

2.2 計量方法 Econometric Methodology

地點：國立臺灣大學社會科學院三樓 306 教室

主席：簡錦漢 (中央研究院經濟研究所)

1. Finite Mixture of Regression Modeling for Exchange Market Pressures during the Financial Crisis: A Robust Bayesian Approach to Variable Selection
   李國榮 (國立成功大學統計學系)、陳奕奇* (國立成功大學經濟學系)
2. Double Local Polynomial Conditional Density Estimators
   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. Hierarchical Factor Models with Possible Non-stationary Components
   徐士勛* (國立政治大學經濟學系)

2.3 財務計量 Financial Econometrics

地點：國立臺灣大學社會科學院三樓 307 教室

主席：王耀輝 (國立臺灣大學財務金融學系)

1. Can Investing in Hedge Funds Improve Efficiency for Economically Important Investors?
   許育進 (中央研究院經濟研究所)、黃瑞卿 (國立中央大學財務金融學系)、曾郁仁 (國立臺灣大學財務金融學系)、王薇婷* (新加坡大學風險管理研究所)
2. Modeling DAX by Applying Parabola Approximation Method
   李明融 (國立政治大學應用數學學系)、繆維中 (國立臺灣科技大學財務金融研究所)、姜林宗叡* (國立臺灣科技大學財務金融研究所)、李詠玄 (國立政治大學統計學系)
3. Default and Recovery: The Copula-Based Sample Selection Model Approach
   莊惠菁* (元智大學管理學院)

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 計量理論 Econometric Theory

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. Testing for Treatment Effect Heterogeneity in Regression Discontinuity Design
   許育進* (中央研究院經濟研究所)、Shu Shen (University of California, Davis)
2. Tests for the Presence of Clusters in Heterogenous Panel Data Models
   林常青* (國立成功大學經濟學系)、殷壽鏞 (中央研究院經濟研究所)
3. Asymptotic Risk of Order Selection in High-dimensional AR Models: The Cases of Finite-Order Processes
   冼芻蕘* (國立清華大學經濟學系)、俞淑惠 (國立高雄大學統計學研究所)

3.2 財務實證 (二) Empirical Studies (Finance) II

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. Price Limits and the Value Premium in the Taiwan Stock Market
   林朝南 (廈門大學管理學院)、柯冠成* (國立暨南國際大學財務金融學系)、林霖 (國立暨南國際大學財務金融學系)、楊念慈 (國立聯合大學經營管理學系)
2. Examining the Profitability of Similarity-based Futures Trading Strategies

江彌修 (國立政治大學金融學系)、郭維裕 (國立政治大學國際經營與貿易學系)、邱信瑜* (國立政治大學金融學系)

3. Analyzing the Performance of Multi-Factor Investment Strategies under Multiple Testing Framework
   許育進 (中央研究院經濟研究所)、林修葳 (國立臺灣大學國際企業學系)、羅秉政* (國立臺灣大學國際企業學系)
4. Innovation, R&D Capability, and Cash Holdings
   陳聖賢 (國立臺灣大學財務金融學系)、李正元* (國立臺灣大學財務金融學系)、王衍智 (國立臺灣大學財務金融學系)

3.3 總體計量 (二) Macroeconometrics II

地點：國立臺灣大學社會科學院三樓 307 教室

主席：陳旭昇 (國立臺灣大學經濟學系)

1. 以 GVAR 模型分析量化寬鬆貨幣政策對臺灣經濟衝擊
   吳俊毅 (財團法人臺灣地理資訊中心)、黃裕烈 (國立清華大學計量財務金融學系)、陳俊宏* (財團法人臺灣地理資訊中心)
2. Fiscal Stimulus on Bayesian DSGE Models
   秦國軒* (逢甲大學經濟學系)
3. Liquidity Commonality in Foreign Exchange Markets during Financial Crises
   張雅婷* (國立中央大學經濟學系)、高櫻芬 (國立中央大學財務金融學系)、徐之強 (國立中央大學經濟學系)

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. 議程計時由穿著本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並響鈴提示。
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 15:00 前將選票投入投票箱。投票箱設置於社會科學院三樓報到處。
5. 由於國立臺灣大學校園網路僅供具帳號密碼之教職員生使用，若您有緊急情況需要使用，請至會議報到處詢問。
6. 由於本會經費有限，會議當天僅提供主席、發表人、本年度會員及邀請人員午餐。會議當天開放現場繳納會費，歡迎成為本年度會員。
7. 本會入會資訊：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。詳情入會方式請見本會網站 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交通路線圖

國立臺灣大學社會科學院 (辛亥路復興南路口)

- 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」，與會者可持國立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【文山內湖線】至科技大樓站下車，沿復興南路步行 5-10 分鐘，至辛亥路國立臺灣大學後門。
  - 搭乘【新店線】至公館站下車，循 2 號或 3 號出口，即可抵達國立臺灣大學校總區，尚需步行 10-15 分鐘抵達國立臺灣大學社會科學院。

- 公車
  - 國立臺灣大學資訊大樓站：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)