

# 「2010 年臺灣經濟計量學會年會暨 劉大中先生逝世 35 週年紀念會」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  
財團法人劉大中先生教育文化紀念基金會

時間：2010 年 10 月 30 日(星期六)

地點：福華國際文教會館二樓會議室和十四樓貴賓廳  
(台北市新生南路三段 30 號)

時間	地點	會議內容			
8:30-9:00	會館二樓	報到，會員領取理監事選票各一張			
9:00-10:10 研討會(一)	會館二樓	財務計量 (201 教室)	計量方法 (202 教室)	總體實證 (203 教室)	個體實證 (205 教室)
10:10-10:30	會館十四樓	茶會			
10:30-11:00	會館十四樓	「紀念劉大中先生」專題演講:趙相科教授			
11:00-11:45	會館十四樓	年會大會演講與「紀念劉大中先生」主題演講:華而誠教授			
11:45-12:30	會館十四樓	年會大會			
12:30-14:00	會館一樓	午餐 (理監事投票至兩點結束，兩點開始開票)			
14:00-15:15 研討會(二)	會館二樓	股市與 共同基金 (201 教室)	外匯市場 (202 教室)	勞動經濟 (203 教室)	國際經濟 (205 教室)
15:15-15:30	會館二樓	茶會			
15:30-16:45 研討會(三)	會館二樓	不動產投資與資產 證券化 (201 教室)	個體計量 (202 教室)	金融與保險 (203 教室)	實證經濟 (205 教室)

備註：理監事投票箱與開票地點設置在會館二樓報到處。

## **9:00-10:10 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 財務計量 Financial Econometrics**

地點：福華國際文教會館二樓 201 會議室

主席：俞明德(國立臺灣大學財務金融學系)

1. Volatility Spillover in the US and European Equity Markets: Evidence from Ex-ante and Ex-post Volatility Indicators  
周雨田(中央研究院經濟研究所)、吳志強\* (元智大學財金系)、Sin-Yun Yang (元智大學財金系)
2. Using Volatility Instruments as Extreme Downside Hedges  
Bernard Lee (Singapore Management University)、林月能\* (國立中興大學財務金融學系)
3. A New Dynamic Hedging Model with Futures: Kalman Filter Error Correction Model  
王健合\* (國立臺北大學經濟系)、林常青(中央研究院經濟研究所)、賴竝宇 (玉山銀行)

### **1.2 計量方法 Econometric Methodology**

地點：福華國際文教會館二樓 202 會議室

主席：徐士勛(國立政治大學經濟系)

1. Hypothesis Testing with Definite Signs of Inconsistencies  
冼芻蕘\* (國立清華大學經濟系)
2. Central Dominance: Theory, Test, and Applications  
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)、曾郁仁(國立臺灣大學財務金融學系)
3. Asymmetrically Behavioral Bias on Taiwan's Economic Growth Rate Forecasts  
徐士勛\* (國立政治大學經濟系)、謝子雄(國立政治大學金融學系)

### **1.3 總體實證 Empirical Macroeconomics**

地點：福華國際文教會館二樓 203 會議室

主席：徐之強(國立中央大學經濟系)

1. 退場時機的總體經濟計量分析  
于宗先(中央研究院院士)、何金巡\* (行政院主計處)、林建甫(國立臺灣大學經濟系)
2. 再論台灣非線性利率法則  
吳致寧(國立中山大學)、李慶男(國立中山大學)、張志揚\* (中央銀行)、林依伶(中央銀行)、陳佩玗(中央銀行)、林雅淇(國立中正大學)
3. International Economic Linkages between Taiwan and the World: A Global Vector Autoregressive Approach  
陳淑玲(國立清華大學計量財務金融學系)、黃朝熙(國立清華大學經濟系)、黃裕烈\* (國立清華大學計量財務金融學系)

### **1.4 個體實證 Empirical Microeconomics**

地點：福華國際文教會館二樓 205 會議室

主席：劉錦添(國立臺灣大學經濟系)

1. Unwed Motherhood, Partnership Instability, and Socioeconomic Consequences: A Dynamic Analysis of Maternal Behaviors  
蔡昉涓\* (世新大學經濟系)、劉錦添(國立臺灣大學經濟系)、Jason Hockenberry (Department of Health Management and Policy, University of Iowa)
2. 教育擴張與薪資不均：分配觀點的分析  
陳建良\* (國立暨南大學經濟系)
3. Seller Reputation and Unobserved Heterogeneity in Online Auction  
徐吉良(國立中正大學經濟系)、孫佳宏\* (國立中正大學經濟系)

**10:10-10:30 茶會 Coffee Break**

地點：福華國際文教會館十四樓貴賓廳

**10:30-11:00 「紀念劉大中先生」專題演講**

**Invited Speech: Ta-Chung Liu's Exploratory**

地點：福華國際文教會館十四樓貴賓廳

講者：趙相科(國立清華大學經濟系)

主席：許嘉棟(劉大中先生教育文化紀念基金會)

**11:00-11:45 年會大會演講與「紀念劉大中先生」主題演講**

**Keynote Speech: Post Financial Crisis Economic  
Adjustments in China and Taiwan**

地點：福華國際文教會館十四樓貴賓廳

講者：華而誠(前中國建設銀行首席經濟學家)

主席：管中閔(國立臺灣大學財務金融學系)

**11:45-12:30 年會大會 Annual Assembly**

地點：福華國際文教會館十四樓貴賓廳

主席：管中閔

**12:30-14:00 午餐 Lunch Break**

地點：福華國際文教會館一樓恬園餐廳

備註：理監事投票至兩點結束，兩點開始開票。

理監事投票箱與開票地點設置在會館二樓報到處。

## **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 股市與共同基金 Mutual Fund and Stock Market Investment**

地點：福華國際文教會館二樓 201 會議室

主席：陳聖賢(國立臺灣大學財務金融學系)

#### 1. 市場狀態與投資人對訊息之反應

詹場\* (國立臺北大學金融與合作經營學系)、胡星陽(國立臺灣大學財務金融學系)、呂朝元(國立臺北大學金融與合作經營學系)、徐崇閔(國立臺北大學金融與合作經營學系)

#### 2. 共同基金處分效果、強化承諾與動能投資策略

池祥萱(國立東華大學財務金融學系)、林煜恩\* (國立東華大學企業管理學系)

#### 3. 台灣境內共同基金績效持續性強嗎？

王南喻\* (大華技術學院財務金融學系)、許英麟(國立中興大學應用數學系)、顏盟峯(國立成功大學會計系暨財務金融所)

### **2.2 外匯市場 Exchange Rate Markets**

地點：福華國際文教會館二樓 202 會議室

主席：林金龍(國立東華大學財務金融學系)

#### 1. Accounting for Korea-Japan Real Exchange Rate Persistence

Chun-Chih Chang(國立東華大學)、張銘仁\* (國立東華大學經濟系)、林常青(中央研究院經濟研究所)

#### 2. The Dynamic Relationship among NTD/WON Exchange Rates and the Stock Prices of Taiwan and Korea

林建秀\* (國立政治大學金融學系)、林信助(國立政治大學國際經營與貿易學系)

#### 3. A Bootstrap Granger Causality Test between Exchange Rates and Fundamentals

柯秀欣\* (國立高雄大學應用經濟系)

### **2.3 勞動經濟 Labor Economics**

地點：福華國際文教會館二樓 203 會議室

主席：莊慧玲(國立清華大學經濟學系)

1. 幼兒看護對有偶婦女勞動參與行為之影響研究  
徐美\* (國立臺北大學經濟系)、陳明郎(中央研究院經濟研究所)
2. 台灣人快樂之成因及其跨時變遷之初探  
葉錦徽(國立中央大學財務金融學系)、李亭儒(國立中央大學財務金融學系)、朱珊瑩\* (中原大學國際貿易學系)
3. 所得稅制與勞動供給: EITC 政策之模擬研究  
陳富立\* (國立成功大學)、何志欽(國立成功大學經濟系)、林惠玲(國立臺灣大學經濟系)、林世昌(國立清華大學經濟系)

### **2.4 國際經濟 International Economics**

地點：福華國際文教會館二樓 205 會議室

主席：沈中華(國立臺灣大學財務金融學系)

1. Why World Exports Are so Susceptible to the Economic Crisis -- The Prevailing “Export Overshooting” Phenomenon Especially in Taiwan  
劉碧珍\* (中華經濟研究院)
2. Environmental Effects of Foreign Direct Investment Using Threshold Model with Instrumental Variables  
張淑貞\* (國立虎尾科技大學企業管理學系)、王輝清(國立中興大學應用數學系)
3. 台灣行動聯網的潛在經濟效益分析-以芬蘭為比較基礎  
游張松(國立臺灣大學商學研究所)、翁榮隨(勤業眾信聯合會計師事務所)、譚修齊(思源智庫)、劉鶴龍\* (國立臺灣大學商學研究所)

### **15:15-15:30 茶會 Coffee Break**

地點：福華國際文教會館二樓

### **15:30-16:45 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 不動產投資與資產證券化 Real Estate and Securitization**

地點：福華國際文教會館二樓 201 會議室

主席：王泓仁(國立臺灣大學經濟系)

1. Nonlinear Relationship and Volatility Spillover among House Prices, Interest Rates and Stock Market Returns: Application of STVEC-GARCH Model from Taiwan

劉祥熹\* (國立台北大學國際企業研究所)、陳昇鴻(南華大學財務金融學系系)、林聰賢(國立台北大學統計學系)

2. The Long-Run Neutrality of Real House Price

陳南光(國立臺灣大學經濟系)、鄭漢亮\* (中華經濟研究院)

3. Dynamic Conditional Correlation analysis in International Real Estate Securities Markets

陳靜宜\* (國立政治大學金融學系)

#### **3.2 個體計量 Microeconometrics**

地點：福華國際文教會館二樓 202 會議室

主席：簡錦漢(中央研究院經濟研究所)

1. Identification and Estimation of Nonlinear Dynamic Panel Data Models with Unobserved Covariates

徐吉良\* (國立中正大學經濟系)、Yingyao Hu (Department of Economics, Johns Hopkins University)

2. Dynamic Panel Data Quantile Regression: An Application to Deficits and Inflation

林馨怡\* (國立政治大學經濟系)

3. 全球人口移動之決定因素－引力模型與網絡分析之應用

郭迺鋒\*(世新大學財務金融學系)、熊漢琳(景文科技大學財務金融學系)、林崑峯(世新大學財務金融學系)

### 3.3 金融與保險 Finance and Insurance

地點：福華國際文教會館二樓 203 會議室

主席：曾郁仁(國立臺灣大學財務金融學系)

1. Demand for Insurance among Agricultural Households in China  
張躍華(浙江大學公共管理學院)、利菊秀(逢甲大學經濟系)、劉純之\* (逢甲大學風險管理與保險學系)
2. Sovereign Credit Default Swaps vs. Credit Ratings: Evidence from Error Correction Model  
沈中華(國立臺灣大學財務金融學系)、黃宜侯\* (元智大學財務金融學系)
3. 亞洲新興市場國家外資銀行與本國銀行的績效比較－利用配對方法調整選擇偏誤  
張元\* (淡江大學財務金融學系)、沈中華(國立臺灣大學財務金融學系)、張佩芬(淡江大學財務金融學系)

### 3.4 實證經濟 Empirical Economics

地點：福華國際文教會館二樓 205 會議室

主席：徐美(國立臺北大學經濟系)

1. Validity of Dynamics in Testing the Environmental Kuznets Curve Hypothesis: OECD Evidence  
王宜甲\* (東海大學經濟系)
2. An Empirical Analysis of Divorce or Separation among Cross-Border Marriages in Taiwan  
洪文夏\* (靜宜大學企業管理系)、何淑熙(嶺東科技大學國際企業系)
3. The Impact of Mainland China Tourists on Taiwan's International Tourism Market : An Empirical Study on Tourist Arrivals from Other Eight Countries  
曾翊恆(元智大學國際企業學系)、張嘉玲\* (國立政治大學經濟系)



## 本次會議注意事項：

1. 研討會(一)每篇論文報告 20 分，討論 3 分。  
研討會(二)每篇論文報告 20 分，討論 5 分。  
研討會(三)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 2 時前將選票投入投票箱。投票箱設置於二樓報到處。
5. 臺灣經濟計量學會只提供 2 台無線網路的電腦在報到處供緊急情況使用，若個人有額外需要使用，請洽福華國際文教會館，自行購買帳號密碼。
6. 臺灣經濟計量學會入會資訊：一般會員年費為新台幣 800 元整；學生會員年費為新台幣 300 元整；永久會員為新台幣 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。

## 福華國際會館交通路線圖



福華國際文教會館：台北市新生南路 3 段 30 號

### 公車

龍安國小--52,253,280,284,290,311,505,907,0 南,指南 1  
大安森林公園--3,15,18,52,72,74,211,235,237,278,295,626  
和平新生路口--253,280,290,311,505,642,0 南,指南 1,指南 5  
溫州街口--3,15,18,74,235,237,254,278,295,907,291,672

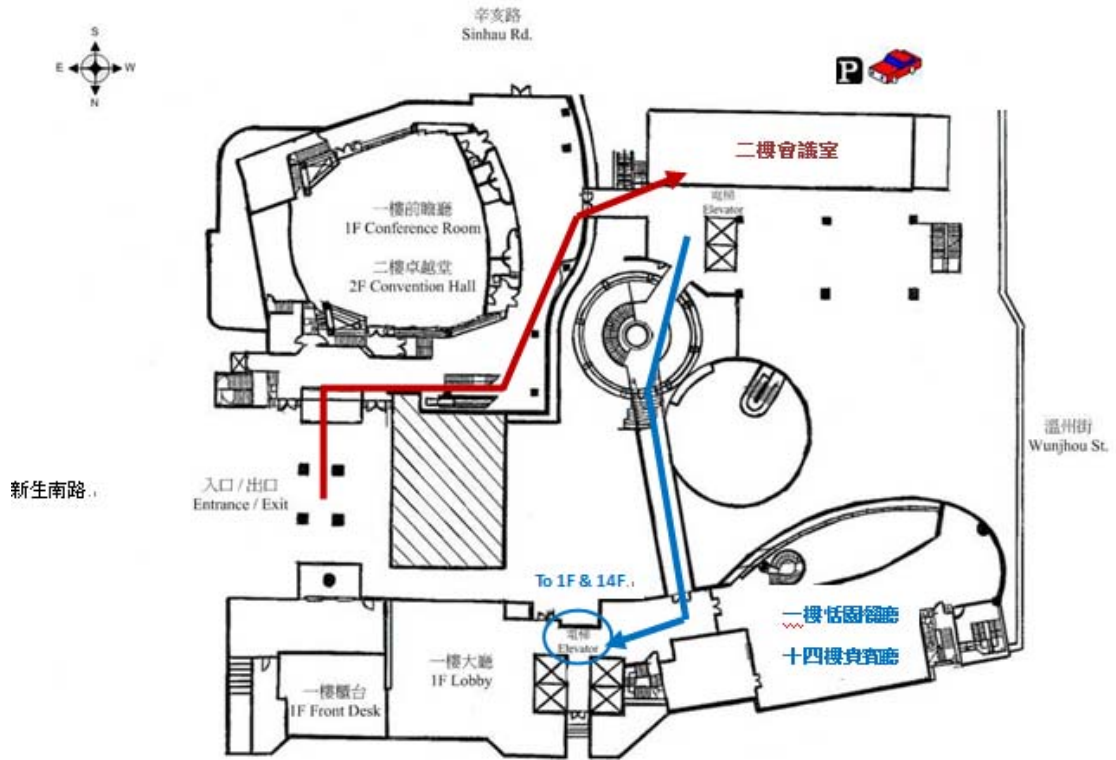
### 捷運

捷運(新店線)台電大樓站 2 號出口，出站左轉沿辛亥路步行約 10~15 分鐘至辛亥路新生南路口，左轉即可達到

### 開車

- I. 中山高（國道一號）：下圓山交流道接建國高架→和平東路出口右轉走內側車道→左轉至新生南路（會館正門）→再直行到辛亥路右轉，即可到福華國際文教會館地下停車場
- II. 北二高（國道三號）：木柵交流道往台北方向→辛亥路過車行地下道直行→經建國南路左轉辛亥路行駛平面車道→過新生南路交叉口→福華國際文教會館地下停車場

# 福華國際文教會館平面圖



→ 由大門入口至二樓會議室

→ 由二樓會議室搭電梯至十四樓貴賓廳



國立臺灣大學

計量理論與應用研究中心

CENTER FOR RESEARCH IN ECONOMETRIC THEORY AND APPLICATIONS

NATIONAL TAIWAN UNIVERSITY

85, Sec. 4, Roosevelt Road, Taipei 106, TAIWAN

計量理論與應用研究中心 (Center for Research in Econometric Theory and Applications) 自 2009 年 3 月 31 日 2568 次行政會議通過成立以來，總秉持最初成立的目的：規劃一個跨院系的計量高等研究中心，以期在臺大推動經濟計量的研究與教學，並促進國際學術合作，不間斷的為邁向學術頂尖而努力，希冀透過本中心的用心投入讓計量經濟的研究潛能在臺灣大學扎根，推廣至全臺灣，更期許未來臺灣經濟計量的研究能在世界的舞台有發光發熱的機會。

儘管國內已有學者從事計量理論與實證研究，但在人數及研究議題的廣度上都未達到一定的深度。故本中心過去一年半以來極力舉辦多場學術活動及邀請多位國際知名學者至本中心訪問，以期能將國外新的前沿方法與議題引導至國內，讓國內學者能對經濟計量研究有新的啟發並進一步培育相關學術與實務的人才。在此方面，中心過去一年半裡舉辦了二種不同類型的學術研討會：

**一、 WETA (Workshop on Econometrics: Theory and Application):**

WETA 是每個月最後一個星期五下午兩點至五點在臺灣大學管理學院一號館舉辦的計量學術研討會。WETA 的主要目的是提供國內學者一個可以分享討論研究方向及成果的平台。從 2010 年 9 月份起，WETA 依領域分為兩類講習並交互舉辦。計量方法與應用領域將由政治大學經濟系林馨怡教授及徐士勛教授負責，財務計量領域則交由臺灣大學財金系何耕宇教授負責。因理論與實證結合度高，每場演講都吸引了相當多國內各大專院校的學生及老師的參與，討論也相當熱烈。

**二、 CRETA Workshop (CRETA Workshop on Advanced Econometrics):**

CRETA Workshop 為不定期的專題講習或研習會，主要是邀請國際學者針對其專長的計量方法，從基礎理論到新研究議題做一完整的專題講授。CRETA Workshop 不僅讓國內學者能習得國外最新的研究方向及結果。另一個更重要的目的是提供國內學者一個能與國外學者互相交流及奠定人脈的機會，故受邀

的國外學者除了在 CRETA Workshop 給予講習之外，也將於本中心進行短期的訪問，讓國內學者能有更深入的交流機會。

過去一年半以來，CRETA 在促進國內學者與國際學者交流方面，共舉辦過 6 次大型的國內研討會，邀請國際知名的經濟計量學者就國際新穎的研究題材做詳盡的介紹之外，也曾與美國普林斯頓大學共同舉辦大型的國際研討會 (FERM, 2010)。在國內學術交流方面，共舉辦過 8 場 WETA 研討會，提供國內學者分享當前研究的良好溝通平台。透過舉辦各類型的研討會，不僅提供國內學者互相交流的機會，更重要的是發揮帶領的作用，促進學術討論的風氣。未來 CRETA 將基於此一經驗，持續致力於提升 CRETA 在經濟計量學界的能見度，並期能啟發國內學者對研究更深層面的體悟，於未來能朝國外新的研究方法與前沿的研究題材而努力。