



2011 年臺灣經濟計量學會年會 暨兩岸經濟計量學術研討會 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

國立政治大學經濟學系

時間：2011 年 10 月 29 日(星期六)

地點：國立政治大學綜合院館四樓

(臺北市文山區指南路二段 64 號)

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

時間	地點	會議內容			
8:45-9:15	綜合院館四樓	報到			
9:15-10:30 研討會(一)	綜合院館四樓	個體計量理論 (411 教室)	計量方法 1 (412 教室)	總體實證計量 1 (415 教室)	數量分析 (416 教室)
10:30-10:45	綜合院館五樓	茶會			
10:45-11:00	綜合院館五樓	歡迎致詞			
11:00-11:50	綜合院館五樓	年會大會演講：China's Emergence in the World Economy and Business Cycles in Latin America Professor M. Hashem Pesaran			
11:50-12:30	綜合院館五樓	年會大會			
12:30-14:00	綜合院館四樓	午餐			
14:00-15:15 研討會(二)	綜合院館四樓	個體實證計量 (411 教室)	計量方法 2 (412 教室)	應用財務計量 (415 教室)	實證經濟 (416 教室)
15:15-15:35	綜合院館四樓	茶會			
15:35-16:50 研討會(三)	綜合院館四樓	博士候選人論文 -實證財務 (411 教室)	計量方法 3 (412 教室)	總體實證計量 2 (415 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 5 分。“*”表示報告人

1.1 個體計量理論 Microeconometrics

地點：政治大學綜合院館四樓 411 教室

主席：陳宜廷（中央研究院經濟研究所）

1. Estimation of a Panel Stochastic Frontier Model with Unobserved Interactive Effects

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）

2. Correlated Unobserved Heterogeneity in Labor Supply Models under Hausman Framework

朱喜*（上海交通大學安泰經濟與管理學院）

3. Semiparametric Mixed-effects Transformation Models for Ranking Data with An Application

倪中新*（上海大學財務金融學系）、Ming Gao Gu（香港中文大學統計系）、Yuk Fai Lam（香港中文大學統計系）

1.2 計量方法 I Econometric Methodology I

地點：政治大學綜合院館四樓 412 教室

主席：林金龍（國立東華大學財務金融學系）

1. Factor Instrumental Variable Quantile Regression

陳釗而*（國立臺灣大學經濟學系）

2. Copula 方法使用在檢定區域相關：應用於環境顧志耐曲線

王健合*（國立臺北大學經濟學系）、邱惠玉（輔仁大學經濟學系）

3. Semiparametric Estimation of a Generalized Threshold Model under Conditional Quantile Restriction

張征宇*（上海社會科學院數量經濟研究中心）、朱平芳（上海社會科學院數量經濟研究中心）、韓清（上海社會科學院數量經濟研究中心）



1.3 總體實證計量 I Applied Macroeconometrics I

地點：政治大學綜合院館四樓 415 教室

主席：陳旭昇（國立臺灣大學經濟學系）

1. 前行測試型的交易策略於外匯期貨市場之獲利性研究
王友利* (國立東華大學經濟學系)、曾文賢 (國立東華大學經濟學系)
2. When Should We Reverse the Sign of BN Cycle?
王少平* (華中科技大學經濟學系)、Sun Xiaotao (華中科技大學經濟學系)
3. 國內就業率、工資報酬與宏觀經濟穩定—基於金融發展的視角
李巍* (華東師範大學世界經濟研究中心)

1.4 數量分析 Quantitative Analysis

地點：政治大學綜合院館四樓 416 教室

主席：張曉峒（南開大學數量經濟研究所）

1. 出口規模、結構調整與碳排放增長—基於浙江省投入產出表分析
呂品* (浙江理工大學經濟管理學院)、雲鶴 (浙江理工大學經濟管理學院)、黃依萍 (明新科技大學國際企業系)
2. 碳生產率、產業關聯與低碳經濟結構調整—基於我國投入產出表的實證分析
徐大豐* (華東政法大學商學院)
3. 廠商動態競爭性差別定價和競爭優勢實現—基於消費者尋求多樣化購買行為的分析
蔣傳海* (上海財經大學國際工商管理學院)、唐丁祥 (上海財經大學國際工商管理學院)



10:30-10:45 茶會 Coffee Break

地點：政治大學綜合院館五樓

10:45-11:00 歡迎致詞 Welcome Address

地點：政治大學綜合院館五樓國際會議廳

主席：管中閔（臺灣經濟計量學會理事長，中央研究院院士，國立臺灣大學臺大講座教授）

講者：汪同三（中國數量經濟學會理事長，中國社科院數量經濟研究所所長）、

朱平芳（上海市數量經濟學會副理事長兼秘書長，上海社會科學院數量經濟研究中心主任）

11:00-11:50 年會大會演講 Keynote Speech

地點：政治大學綜合院館五樓國際會議廳

講者：Prof. M. Hashem Pesaran

（英國劍橋大學經濟學系講座教授暨三一學院院士，美國南加州大學經濟學系暨 John Elliott 講座教授，美國經濟計量學會會士）

主席：王泓仁（國立臺灣大學經濟學系主任）

11:50-12:30 年會大會 Annual Assembly

地點：政治大學綜合院館五樓國際會議廳

主席：管中閔（臺灣經濟計量學會理事長）

12:30-14:00 午餐 Lunch Break

地點：政治大學綜合院館四樓



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 應用個體計量 Applied Microeconometrics

地點：政治大學綜合院館四樓 411 教室

主席：曾郁仁（國立臺灣大學財務金融學系）

1. 研究所入學考試的市場區隔與撞期策略
高一誠* (中原大學企業管理學系)、林健暉 (中原大學企業管理學系)
2. Import Competition and Company Training: Evidence from the US Microdata on Individuals
李浩仲* (國立政治大學經濟學系)
3. 台灣家戶保健醫療支出在全民健保後的改變
陳建良* (國立暨南國際大學經濟學系)

2.2 計量方法 II Econometric Methodology II

地點：政治大學綜合院館四樓 412 教室

主席：王健合（國立臺北大學經濟學系）

1. Time Series Regression with a Unit Root and Possibly Heavy-tailed GARCH(1,1)/IGARCH(1,1) Errors
Shiqing Ling (香港科技大學)、冼芻蕘* (國立清華大學經濟系)、Rong-Mao Zhang (浙江大學)
2. Indirect Inference on Predictive Regression
陳致綱* (國立政治大學國際經營與貿易學系)、郭炳伸 (國立政治大學國際經營與貿易學系)
3. 均值和方差雙重變點的貝葉斯偵測
朱平芳* (上海社會科學院數量經濟研究中心)、廖遠甦 (上海社會科學院數量經濟研究中心)



2.3 應用財務計量 Applied Financial Econometrics

地點：政治大學綜合院館四樓 415 教室

主席：陳聖賢（國立臺灣大學財務金融學系）

1. 財務約束下高技術企業 R&D 行為及其效率分析
劉弘* (上海財經大學教育技術中心)、徐偉民 (華東政法大學商學院)
2. Asymmetric Nonlinear Mean Reversion in Implied Volatility
李瑞琳* (朝陽科技大學財務金融系)
3. Detecting Jump Activity on Ultra-High Frequency VIX Data
林月能* (國立中興大學財務金融學系)、Jeremy C. Goh (Singapore Management University)

2.4 實證經濟 Empirical Economics

地點：政治大學綜合院館四樓 416 教室

主席：徐美（國立臺北大學經濟學系）

1. 碳稅政策對二氧化碳排放減量之影響：建立在環境顧志耐曲線上的一些實證結果
周佑霖* (國立清華大學經濟學系)、黃鈺愷 (國立臺灣大學農業經濟系)
2. Information Communication Technology and Productivity Growth: OECD Evidence
George Barker (Centre for Law and Economics)、王宜甲* (東海大學經濟學系)
3. The Predictive Power of Household's Expectation in the Housing Nonlinear Dynamics
黃美綺* (元智大學管理學院財務金融學群)

15:15-15:35 茶會 Coffee Break

地點：政治大學綜合院館四樓



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 博士候選人論文-實證財務 PhD Candidate Session in Empirical Finance

地點：政治大學綜合院館四樓 411 教室

主席：徐之強（國立中央大學經濟學系）

1. Determinant of Credit Default Swaps by Information-based Trading Activity
黃宜侯（元智大學管理學院）、胡文正*（元智大學管理學院）
2. Corporate Governance, Risk and, Performance—Evidence from Taiwanese Enterprises' Foreign Direct Investment in Mainland China
官宗翰*（逢甲大學經濟系）、利菊秀（亞洲大學管理學院）、劉純之（逢甲大學風險管理與保險學系）
3. Application of Spline Regression Model in Estimating Hedonic Price Models: Empirical Evidence with Taiwan Data
廖四郎（國立政治大學金融學系）、陳靜宜*（國立政治大學金融學系）

3.2 計量方法 III Econometric Methodology III

地點：政治大學綜合院館四樓 412 教室

主席：朱平芳（上海社會科學院數量經濟研究中心）

1. Semiparametric Estimation of the Random Coefficient Dummy Endogenous Variable Model under Symmetry
周亞虹*（上海財經大學經濟學系）
2. Identification of Semiparametric Measurement Error Models
Yingyao Hu (Johns Hopkins University)、徐吉良*（國立中正大學經濟學系）
3. Exceedance Correlation Tests for Financial Returns
陳宜廷*（中央研究院經濟研究所）



3.3 總體實證計量 II Applied Macroeconometrics II

地點：政治大學綜合院館四樓 415 教室

主席：黃朝熙（國立清華大學經濟學系）

1. 中國大陸假日效應在季節調整中的處理

張曉峒*（南開大學數量經濟研究所）、王群勇（南開大學數量經濟研究所）、陳雄強（南開大學數量經濟研究所）、張岩（南開大學數量經濟研究所）、孫茜（南開大學數量經濟研究所）

2. The Impacts of the Expected Real Exchange Rate on Japan's Real Output: An Application of Nonlinear Cointegration Analysis

陳奕奇*（國立成功大學經濟學系）、王健合（國立臺北大學經濟學系）

3. 總體變數領先、同時與落後性質之認定與指標構成項目之選取 – **LARS** 方法的運用

陳淑玲*（國立臺北大學金融與合作經營學系）、黃裕烈（國立清華大學計量財務金融學系）

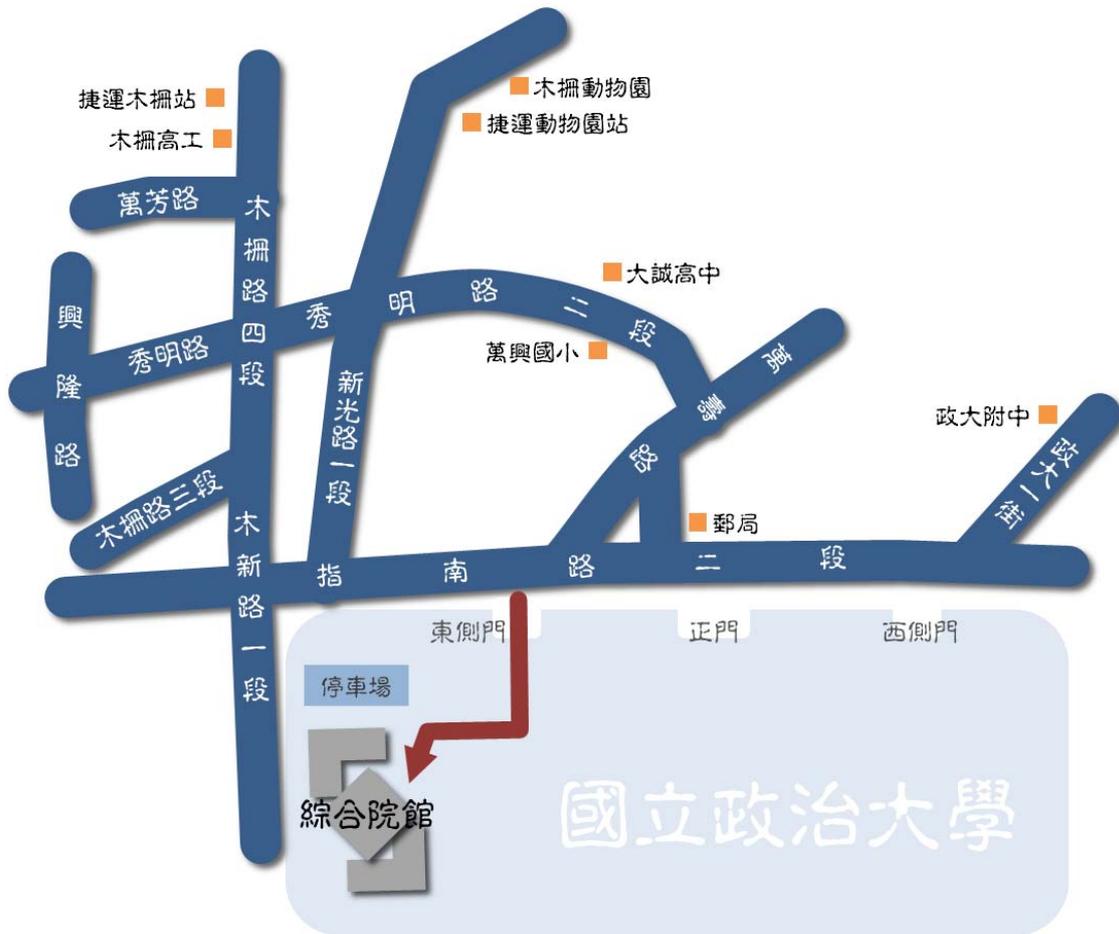


本次會議注意事項

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 2 台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。



國立政治大學綜合院館交通路線圖



國立政治大學綜合院館：臺北市文山區指南路二段 64 號

公車

236、237、611、295、1501、1503、282、530、小 10、棕 3、棕 5、棕 6、棕 11、棕 15、綠 1，至「政大站」下車。

捷運

- ◆ 搭乘捷運新店線至景美站，轉搭棕 3、棕 6 至「政大站」下車。
- ◆ 搭乘捷運木柵線至動物園，轉搭 236、237、611、282、295、棕 3、棕 6、棕 18、綠 1、1503 至「政大站」下車。

開車

- ◆ 從國道三號高速公路（木柵交流道—台北聯絡道—萬芳交流道）
萬芳交流道下北二高→右轉木柵路四段→左轉秀明路經萬壽橋直行至萬壽路右轉。
- ◆ 從羅斯福路（公館）
羅斯福路四段向南走→左轉興隆路→左轉木柵路二段接秀明路過萬壽橋直行至萬壽路右轉。