



2015 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

國立臺灣大學財務金融學系

時間：2015 年 10 月 31 日(星期六)

地點：國立臺灣大學管理學院一號館 (臺北市大安區羅斯福路四段 1 號)

贊助單位：



國泰金控



富邦金控

時間	地點	會議內容			
8:30-9:00	管一館 1F	報到			
9:00-10:10 研討會 (一)	管一館 1F	計量方法 I (101 教室)	總體經濟實證 I (102 教室)	財務計量 (103 教室)	計量與經濟實證 I (104 教室)
10:10-10:25	管一館 B1	茶會			
10:25-10:30	管一館 B1	歡迎致詞			
10:30-11:20	管一館 B1	臺灣經濟計量學會專題演講 I The Middle-Income Trap in China and Malaysia Prof. Wing Thye Woo			
11:20-12:10	管一館 B1	臺灣經濟計量學會專題演講 II Non-Gaussian Bridge Sampling with Applications 段錦泉院士			
12:10-12:30	管一館 B1	年會大會			
12:30-14:00	管一館 B1	午餐			
14:00-15:35 研討會 (二)	管一館 1F	計量方法 II (101 教室)	總體經濟實證 II (102 教室)	財務經濟實證 I (103 教室)	個體經濟實證 I (104 教室)
15:35-15:50	管一館 1F	茶會			
15:50-17:25 研討會 (三)	管一館 1F	計量與經濟實證 II (101 教室)	總體經濟實證 III (102 教室)	財務經濟實證 II (103 教室)	個體經濟實證 II (104 教室)

備註：會議當天本會使用管理學院一號館一樓 101 至 104 教室的時間為 9:00-10:30 及 14:00-17:30，其餘時間由管理學院 EMBA 使用，造成不便之處，敬請見諒。



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 計量方法 (一) Econometric Methodology I

地點：國立臺灣大學管理學院一號館一樓 101 教室

主席：簡錦漢 (中央研究院經濟研究所)

1. Model Averaging in Predictive Regressions

劉祝安* (中央研究院經濟研究所)、郭炳伸 (國立政治大學國際經營與貿易學系)

2. A Study of GMM Estimation and Their Statistic Properties for a Class of Approximate Factor Models

白仲林* (天津財經大學)、白強 (天津財經大學)

3. A Stochastic Frontier Model with an Endogenous Treatment Status and a Mediator

陳宜廷* (中央研究院經濟研究所)、許育進 (中央研究院經濟研究所)、王泓仁 (國立臺灣大學經濟學系)

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

地點：國立臺灣大學管理學院一號館一樓 102 教室

主席：黃裕烈 (國立清華大學計量財務金融學系)

1. The Threshold Effect of Human Capital in the China's Economic Growth

王永水* (上海社會科學院)、朱平芳 (上海社會科學院)

2. 估測均衡匯率的新架構

汪建南* (中央銀行經濟研究處)

3. 基於 RBC 模型的稅收效應分析

黃蹟琳 (上海財經大學)、朱保華* (上海交通大學)



1.3 財務計量 Financial Econometrics

地點：國立臺灣大學管理學院一號館一樓 103 教室

主席：陳聖賢（國立臺灣大學財務金融學系）

1. Heterogeneity and Risk-Return Tradeoff: Evidence from Extreme Value Adjusted Method

何宗武（世新大學財務金融學系）、張淑華*（世新大學財務金融學系）

2. Dynamic Risk Premia and Asset Pricing Puzzles

葉家譽*（國立臺灣大學財務金融學系）

3. Loss Reserves and the Role of the Actuary: Independent or In-House?

程江（上海財經大學）、Mary A. Weiss (Temple University)、林姿婷*（國立臺灣大學財務金融學系）

1.4 計量與經濟實證（一） Empirical Studies (Econometrics) I

地點：國立臺灣大學管理學院一號館一樓 104 教室

主席：王少平（華中科技大學經濟學系）

1. Plug-in Averaging Estimator in the Panel Data Framework with Multifactor Error Structure

殷壽鏞*（中央研究院經濟研究所）、劉祝安（中央研究院經濟研究所）、林常青（國立成功大學經濟學系）

2. 贏在起跑線？出生季與未來表現

邸俊鵬*（上海社會科學院）、朱平芳（上海社會科學院）、李世奇（上海社會科學院）

3. Governance, Government Size and Economic Development : New Panel Evidence

金東炫（Korea University）、林淑琴（淡江大學經濟學系）、吳宜臻*（國立中央大學經濟學系）



10:10-10:25 茶會 Coffee Break

地點：國立臺灣大學管理學院一號館 B1

10:25-10:30 歡迎致詞 Welcome Address

地點：國立臺灣大學管理學院一號館 B1 正大國際會議廳

致詞貴賓：朱平芳（中國數量經濟學會副理事長、上海社會科學院數量經濟研究中心主任）

主席：管中閔（中央研究院院士、國立臺灣大學臺大講座教授）

10:30-11:20 臺灣經濟計量學會專題演講（一）Keynote Speech I

地點：國立臺灣大學管理學院一號館 B1 正大國際會議廳

講者：Prof. Wing Thyee Woo (University of California, Davis)

講題：The Middle-Income Trap in China and Malaysia

主席：管中閔（中央研究院院士、國立臺灣大學臺大講座教授）

11:20-12:10 臺灣經濟計量學會專題演講（二）Keynote Speech II

地點：國立臺灣大學管理學院一號館 B1 正大國際會議廳

講者：段錦泉院士 (National University of Singapore)

講題：Non-Gaussian Bridge Sampling with Applications

主席：鄒至莊院士 (Princeton University)

12:10-12:30 年會大會 Annual Assembly

地點：國立臺灣大學管理學院一號館 B1 正大國際會議廳

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：國立臺灣大學管理學院一號館 B1 國學講堂

備註：會議當天本會使用管理學院一號館一樓 101 至 104 教室的時間為 9:00-10:30 及 14:00-17:30，其餘時間由管理學院 EMBA 使用，造成不便之處，敬請見諒。



14:00-15:35 研討會(二) Contributed Session II

研討會(二)為每篇論文報告 20 分，討論 3 分。“*”表示報告人

2.1 計量方法 (二) Econometric Methodology II

地點：國立臺灣大學管理學院一號館一樓 101 教室

主席：張曉峒（南開大學數量經濟研究所）

1. Nonseparable Regression Function for Panel Data Models with Correlated Random Effects
徐吉良（中國人民大學）、冼芻蕘*（國立清華大學經濟學系）
2. Estimation of Single-index Model with Spatial Interaction
孫燕*（上海財經大學）
3. On Consistency of Minimum Description Length Model Selection for Piecewise Autoregressions
Richard Davis (Columbia University)、Stacey Hancock (University of California, Irvine)、姚怡慶*（中研院統計科學研究所）
4. Testing Conditional Mean Independence under Symmetry
Tao Chen (University of Waterloo)、周亞虹*（上海財經大學）、
Pingfang Zhu（上海社會科學院）

2.2 總體經濟實證 (二) Empirical Studies (Macroeconomics) II

地點：國立臺灣大學管理學院一號館一樓 102 教室

主席：王泓仁（國立臺灣大學經濟學系）

1. Important Laws Governing China's Macro-economy
鄒至莊* (Princeton University)
2. 中國工業行業間 R&D 溢出效應研究
朱平芳* (上海社會科學院)
3. Analysis on the Changes of Income Distribution of Taiwan's Tax Reporting Households
陳建良*（國立暨南國際大學經濟學系）、管中閔（國立臺灣大學財務金融學系）
4. Fiscal Sustainability and Borrowing Cost: County Evidence from China
Chunyu He（上海交通大學）、Zhuyan Wang（上海交通大學）、朱喜*（上海交通大學）



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

地點：國立臺灣大學管理學院一號館一樓 103 教室

主席：林金龍（國立東華大學財務金融學系）

1. Effects of Managerial Overconfidence on Analyst Recommendations

林美珍（國立臺北大學企業管理學系）、何柏欣*（國立臺北大學企業管理學系）

2. The Collaborative Effect between Wage level, Wage Structure and Firms Profit

周雲波（南開大學經濟研究所）、趙紅梅*（南開大學數量經濟研究所）、吳婷（南開大學經濟研究所）

3. Are Overconfident Firms the Ideal Borrowers to Banks?

陳業寧（國立臺灣大學財務金融學系）、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）、顏汝芳（國立臺北大學統計學系）

4. Do Perks Matter? Evidence from Chinese Banks

丁秀儀*（國立臺北科技大學資訊與財務金融管理系）

2.4 個體經濟實證 (一) Empirical Studies (Microeconomics) I

地點：國立臺灣大學管理學院一號館一樓 104 教室

主席：莊慧玲（國立清華大學經濟學系）

1. A Study of Mixed Oligopoly in a Supply Chain

陶愛元*（上海立信會計學院）、鄒香清（上海立信會計學院）、朱穎雋（上海立信會計學院）

2. Subsidizing Fuel Efficient Cars: Evidence from China's Automobile Industry

陳嘉雯*（國立臺北大學經濟學系）、胡偉民（國立政治大學財政學系）

3. The Role of Education in Self-employment: Evidence from Urban China

王群勇*（南開大學）、Zeguang Li（南開大學）、Belton M. Fleisher（Ohio State University）



4. Bomb, Building and Congestion

李杰偉* (上海海事大學)、陸銘 (復旦大學、上海交通大學)

15:35-15:50 茶會 Coffee Break

地點：國立臺灣大學管理學院一號館一樓

15:50-17:25 研討會(三) Contributed Session III

研討會(三)為每篇論文報告 20 分，討論 3 分。“*”表示報告人

3.1 計量與經濟實證 (二) Empirical Studies (Econometrics) II

地點：國立臺灣大學管理學院一號館一樓 101 教室

主席：陳宜廷 (中央研究院經濟研究所)

1. The Theory and Applications of Seasonal Adjustment in Frequency Domain

張曉峒* (南開大學經濟學院)、何永濤 (南開大學經濟學院)

2. Nonparametric Regressions with Thresholds: Identification, Estimations and Inference

邱晏瑜 (國立中興大學財務金融學系)、陳美源* (國立中興大學財務金融學系)

3. Factor-augmented Regression Model with Structure Change

王少平* (華中科技大學經濟學院)、崔國偉 (華中科技大學經濟學院)、李鯤鵬 (首都經貿大學國際經濟學院)

4. Model Selection Tests for Conditional Moment Restriction Models

許育進* (中央研究院經濟研究所)、Xiaoxia Shi (University of Wisconsin)

3.2 總體經濟實證 (三) Empirical Studies (Macroeconomics) III

地點：國立臺灣大學管理學院一號館一樓 102 教室

主席：陳思寬 (國立臺灣大學國際企業學系)



1. Intraday Arbitrage Opportunities of Basis Trading in Current Futures Markets: An Application of the Threshold Autoregressive Model
郭文忠 (國立臺北大學經濟學系)、王健合* (國立臺北大學經濟學系)
2. Estimating the Growth Effect of FDI Using A Quantile Panel Data Model with Partially Varying Coefficients
蔡宗武 (University of Kansas)、陳琳娜 (University of Kansas)、方穎* (廈門大學)
3. What Are the Main Sources of Interest Rate Persistence? Some International Evidence
張銘仁 (國立東華大學經濟學系)、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)
4. Determinants of Vulnerability to the Recent Financial Crisis: New Results Applying the Bayesian Sparse Group Selection
陳奕奇* (國立成功大學經濟學系)

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

地點：國立臺灣大學管理學院一號館一樓 103 教室

主席：何耕宇 (國立臺灣大學財務金融學系)

1. Forecasting Volatility with Multiple Horizon Extreme Values
周雨田* (中央研究院經濟研究所)
2. Nonparametric Estimation for Spot Volatility of Asset Price Using Bipower Variations
沈根祥* (上海財經大學)
3. Capital Asset Pricing Model Based on a Generalized Economic Index of Riskiness
陳宜廷 (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)、石百達 (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)



4. Strategic Investments Based on Pricing Bubbles-An Empirical Examination

葉錦徽* (國立中央大學財務金融學系)、范姜士君 (國立中央大學財務金融學系)、林玉堂 (國立中央大學財務金融學系)、游凱卉 (國立中央大學財務金融學系)

3.4 個體經濟實證 (二) Empirical Studies (Microeconomics) II

地點：國立臺灣大學管理學院一號館一樓 104 教室

主席：徐之強 (國立中央大學經濟學系)

1. Regional Public Cultural Service Equalization Spatial Dependence and Correlation

單薇* (上海立信會計學院)、吳佳 (上海立信會計學院)

2. Predicting Recovery Rate at the Time of Corporate Default

段錦泉 (國立新加坡大學)、黃瑞卿* (國立東華大學財務金融學系)

3. Measurement on the Coordination of Distributive Justice, Economic Efficiency and Social Stability Measurement and Precautions on the Coordination of Distributive Justice, Economic Efficiency and Social Stability

葉曉佳* (上海立信會計學院數學與資訊學院)

4. Contagion in Financial Markets: Dynamic Conditional Correlation Model

林楚雄 (國立高雄第一科技大學財務管理系)、張簡彰程 (長榮大學財務金融學系)、高子荃 (崑山科技大學財務金融系)、高偉舜* (國立高雄第一科技大學財務金融研究所)

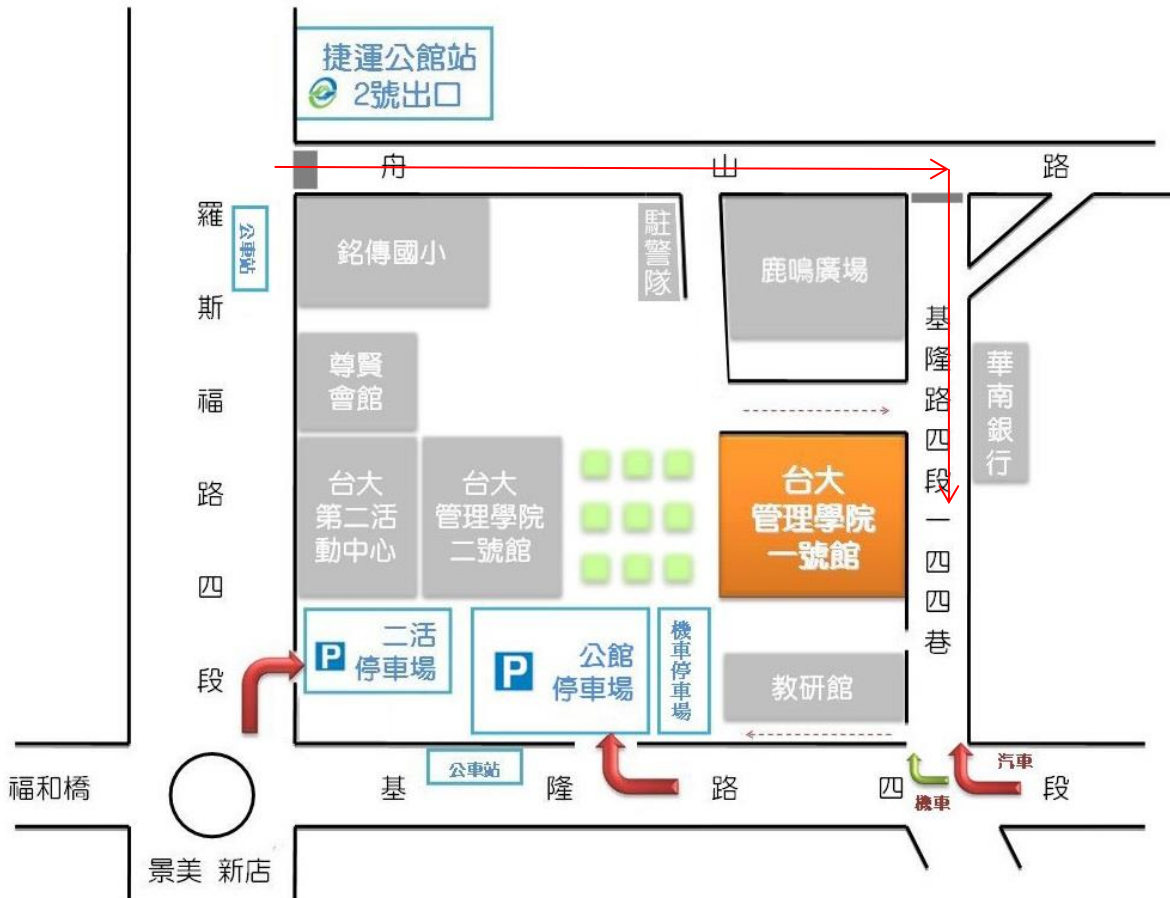


本次會議注意事項

1. 研討會每篇論文報告 20 分，討論 3 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. 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。
5. 會議當天本會使用由國立臺灣大學管理學院一號館一樓 101 至 104 教室的時間為 9:00-10:30 及 14:00-17:30，其餘時間由國立臺灣大學管理學院 EMBA 使用，造成不便之處，敬請見諒。
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。



國立臺灣大學管理學院一號館交通路線圖



國立臺灣大學管理學院一號館：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「國立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「國立臺灣大學公館二活停車場」停車即可。
 - 若停車於「國立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（半價）。



- 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)