



TAIWAN ECONOMETRIC SOCIETY
臺灣經濟計量學會

2019 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

國立臺灣大學財務金融學系

國立臺灣大學計量理論與應用研究中心

時間：2019 年 11 月 2 日(星期六)

地點：國立臺灣大學管理學院一號館 B1 國際會議廳

(臺北市大安區羅斯福路四段 85 號)

贊助單位：國泰金控

時 間	地 點	會議內容			
8:50-9:10	B1 國際會議廳	報到 (B1 國際會議廳)			
9:10-10:00	B1 國際會議廳	主題演講：台灣金融科技未來發展趨勢及挑戰 王儷玲教授 (國立政治大學國際產學聯盟營運長/金融科技研究中心主任)			
10:00-10:20		茶會			
10:20-11:10	B1 國際會議廳	主題演講：矩陣視覺化與其應用 Matrix Visualization with Applications 陳君厚教授 (中央研究院統計科學研究所所長)			
11:10-11:20		照相			
11:20-11:50	B1 國際會議廳	會員大會			
11:50-13:10	B1 亨利講堂	午餐			
13:10-13:40	管一館 4F	休息 (理監事投票箱與開票地點設置於四樓休息區，投票至 15:00 止)			
13:40-15:00 研討會 (I)	管一館 2F / 4F	財務實證一 (203)	財務實證二 (204)	總體計量 (402)	財務計量一 (405)
15:00-15:20		茶會			
15:20-17:00 研討會 (II)	管一館 2F / 4F	計量理論一 (203)	計量理論二 (204)	個體計量 (402)	財務計量二 (405)



9:10-10:00 主題演講 (I)

地點：國立臺灣大學管理學院一號館 B1 國際會議廳

講者：王儷玲教授（國立政治大學國際產學聯盟營運長/金融科技研究中心主任）

主持人：徐之強教授（臺灣經濟計量學會副理事長）

10:00-10:20 茶 會

地點：國立臺灣大學管理學院一號館 B1 國際會議廳

10:20-11:10 主題演講 (II)

地點：國立臺灣大學管理學院一號館 B1 國際會議廳

講者：陳君厚教授（中央研究院統計科學研究所所長）

主持人：陳宜廷教授（臺灣經濟計量學會理事長）

11:20-11:50 會員大會

地點：國立臺灣大學管理學院一號館 B1 國際會議廳

主持人：陳宜廷教授（臺灣經濟計量學會理事長）

11:50-13:10 午 餐

地點：國立臺灣大學管理學院一號館 B1 亨利講堂

13:40-15:00 研討會 (I)

研討會(I)為每篇論文報告 20 分，討論 5 分。“*”表示報告人

1.1 財務實證一

地點：國立臺灣大學管理學院一號館 2F 203 教室

主席：曾郁仁教授（國立臺灣大學財務金融學系）

1. 台灣股市散戶與法人在盈餘宣告前後之交易行為及投資績效

詹場*（國立台北大學金融與合作經營學系）、張仲豪（國立台北大學金融與合作經營學系碩士班）

2. 董事網絡與公司創新

張景宏*（National Taiwan University）、Qingqing Wu（North Carolina State University）



3. CEO Overconfidence and Bondholder Wealth Effects: Evidence from Mergers and Acquisitions

何柏欣* (國立中央大學財務金融學系) 、陳聖賢 (國立政治大學財務管理學系) 、何耕宇 (國立臺灣大學財務金融學系) 、聶瑋瑩 (中國文化大學/國際貿易學系)

1.2 財務實證二 (英文)

地點：國立臺灣大學管理學院一號館 2F 204 教室

主席：何耕宇教授 (國立臺灣大學財務金融學系)

1. Do Firms Time the Market when Saving Cash?

盧建霖* (National Ilan University) 、Hsuan-Chi Chen (University of New Mexico) 、Robin K. Chou (National Chengchi University)

2. The Real Effect of Institutional Investor Attention in Bank Loan Contracting

Robin* (Department of Management, Universitas Internasional Batam) 、Yin-Siang Huang (Department of Financial Engineering, Fuzhou University of International Studies and Trade) 、Chih-Yung Lin (Department of Information Management and Finance , National Chiao-Tung University) 、Chung-Hua Shen (Institute of Banking and Money, Nanjing Audit University Department of Finance and Banking, Shih Chien University)

3. The Effect of Corporate Taxation on Loss Provisioning of Property-Casualty Insurers: Evidence from the Adoption of SSAP 101

林姿婷* (National Taiwan University) 、Jiang Cheng (Lingnan University) 、Travis Chow (Singapore Management University) 、Jeffrey Ng (The Hong Kong Polytechnic University)

1.3 總體計量

地點：國立臺灣大學管理學院一號館 4F 402 教室

主席：徐士勛教授 (國立政治大學經濟學系)

1. Long-Term Macroeconomic Effects of Climate Change: A Cross-Country Analysis



楊睿中* (國立清華大學經濟學系)、Matthew E. Kahn (University of Southern California)、Kamiar Mohaddes (University of Cambridge)、Ryan N. C. Ng (University of Cambridge)、M. Hashem Pesaran (University of Southern California)、Mehdi Raissi (International Monetary Fund)

2. Shirking with Good Reputation? A Case Study of the Hotel Industry

郭芳彰* (國立中正大學經濟學系)

3. Reversed Order Monitoring CUSUM Test with Factor Structure

殷壽鏞* (國立臺北大學經濟學系)、林常青 (國立成功大學經濟學系)、蔡文禎 (中央研究所經濟研究所)

1.4 財務計量一

地點：國立臺灣大學管理學院一號館 4F 405 教室

主席：柯冠成教授 (國立暨南國際大學財務金融學系)

1. A Timing Momentum Strategy

柯冠成* (National Chi Nan University)、Chaonan Lin (Xiamen University)、Robin K. Chou (National Chengchi University)、Nien-Tzu Yang (National United University)

2. 與組織資本相關的橫斷面股票收益- 研發支出的作用

Cross-Sectional Stock Returns Associated with Organization Capital- The Role of R&D Expenditures

李美萱* (國立臺灣大學/財務金融學系)、湛可南 (國立政治大學/財務管理學系)、林楚彬 (西南交通大學/金融與財務學系)、王衍智 (國立臺灣大學/財務金融學系)

3. 波動度指數選擇權市場的日內淨買壓對隱含波動率影響

莊逸偉* (逢甲大學國貿系)、蔡維哲 (國立中山大學財管系)、吳明鴻 (北京師範大學珠海校區)

15:00-15:20 茶 會

地點：國立臺灣大學管理學院一號館 4F

15:20-17:00 研討會 (II)

研討會(II)為每篇論文報告 20 分，討論 5 分。“*”表示報告人



2.1 計量理論一

地點：國立臺灣大學管理學院一號館 2F 203 教室

主席：許育進教授（中央研究院經濟研究所）

1. Monotonicity Test for Local Average Treatment Effects under Regression Discontinuity

許育進*（中央研究院經濟研究所）、Shu Shen (Department of Economics, University of California, Davis)

2. Trend-corrected Artificial Counterfactual for Cointegrated Non-stationary Series

黃大正* (National University of Singapore)、Pablo Crespo (City University of New York)

3. Variable selection in finite mixture of regression models with an unknown number of components

陳奕奇* (National Cheng Kung University)、Martin Feldkircher (Oesterreichische Nationalbank (OeNB))、Kuo-Jung Lee (National Cheng Kung University)

4. Specification and Estimation of Network Formation and Network Interaction Models with the Exponential Probability Distribution

謝志昇*（國立臺灣大學經濟學系）、Lung-Fei Lee (Department of Economics, The Ohio State University)、Vincent Boucher (Department of Economics, Université Laval)

2.2 計量理論二

地點：國立臺灣大學管理學院一號館 2F 204 教室

主席：林馨怡教授（國立政治大學經濟學系）

1. A Generalized Focused Information Criterion for Extremum Estimators

劉祝安*（中央研究院經濟研究所）、張新雨（中國科學院）

2. 效用極大化二元預測中的模型選擇

Model Selection in Utility-Maximizing Binary Prediction

蘇俊華*（中央研究院經濟研究所）

3. 條件轉移機率之共變量依賴性檢定

Testing Covariate Dependence of Conditional Transition Probabilities



賴宗志* (逢甲大學/經濟學系) 、宋曉軍 (北京大學/光華管理學院)

4. Using heteroskedasticity-consistent variances for possibly weakly dependent data: reviews and some new results

冼芻蕘* (國立清華大學/經濟學系)

2.3 . 個體計量

地點：國立臺灣大學管理學院一號館 4F 402 教室

主席：陳建良教授 (國立暨南國際大學經濟學系)

1. 以行政資料評估基本工資提升

Assessment on Minimum Wage Rise by Using Administrative Data)

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)、林樹明 (Bucknell University, USA, Department of Economics)、李巧琳 (國立暨南國際大學國際企業學系)

2. 高等教育擴張政策對臺灣勞動市場中高教育工作者薪資的影響

The Wage Effect of Expansion Policy of Higher Education Workers in Taiwan's Labor Market- A Quantile Regression Analysis

徐美* (國立臺灣師範大學)

3. 延長失業給付對保留工資的影響：來自台灣失業給付延長的證據

The Effects of Extended Unemployment Benefits on Reservation Wage: Evidence from a Benefit Extension in Taiwan

黃柏鈞* (國立政治大學經濟學系)

4. 中學歷史課綱對國族認同的影響：來自「認識台灣」教科書的證據
Curriculum and National Identity: Evidence from the 1997 Curriculum Reform in Taiwan

楊子霆* (中研院經濟所)、陳煒林 (University of California, San Diego)、林明仁 (國立臺灣大學經濟學系)

2.4 財務計量二

地點：國立臺灣大學管理學院一號館 4F 405 教室

主席：黃瑞卿教授 (國立中央大學財務金融學系)

1. 違約回覆率之產業下行風險:非條件分量回歸應用



Industry distress and default recovery rates: the unconditional quantile regression approach

莊惠菁* (College of Management/Yuan Ze University) 、陳釗而 (Institute for International Strategy/Tokyo International University)

2. The Out-of-Sample Unprofitability of Carry Trades

許博炫* (National Tsing Hua University) 、Mark P. Taylor (Washington University in St. Louis) 、Zigan Wang (University of Hong Kong)

3. Combination Portfolio: A Cocktail Therapy for Boosting Robustness

何宗武* (臺師大管理學院全營所)

4. Estimating Risk Preferences for Most Investors

Rachel J. Huang* (Department of Finance, National Central University) 、Jeffery T. Tasi (Department of Quantitative Finance, National Tsing Hua University,) 、Kili C. Wang (Department of Insurance, Tamkang University)

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，勿延宕下一場次進行。
4. 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。
5. 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://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



- 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，即可享半價優惠。
- 捷運：捷運新店線公館站二號出口，沿舟山路步行至鹿鳴廣場右轉，再步行約 3 分鐘即可到達。



- 公車

- 市公車

0 南 (萬芳社區→公館)、綠 11 (萬芳社區→公館)、74 (建國北路→景美)、207 (松山車站→公館)、505 (撫遠街→公館)、606 (興隆站→榮總)

- 欣欣客運

1 (華江→吳興街)、52 (東園→公館)、236 (東南學院→台北車站)、251 (東南學院→台北車站)、252 (捷運木柵→台北車站)、253 (景美女中→台北車站)、254 (大鵬新城→民生社區)、278 (東湖→公館)、290 (溪園路→榮總)、907 (華江→崇義高中)

- 指南客運

指 1 (指南宮→泰山)、指 2 (動物園→淡海)、208 (中和→大直)、530 (指南宮→公館)、660 (深坑→景美)、668 (汐止→公館)、801 (泰山→松山機場)

- 新店客運

綠 13 (青潭→公館)、642 (青潭→復興北村)、644 (青潭→博愛路)、648 (錦繡→台北)、849 (烏來→台北車站)

- 大有巴士

284 (東湖→景美)

- 光華巴士

280 (天母→公館)

- 中興巴士

311 (中和→松山車站)