



# 2018 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

國立政治大學經濟學系

國立臺灣大學計量理論與應用研究中心

時間：2018 年 11 月 3 日(星期六)

地點：國立政治大學綜合院館（臺北市文山區指南路二段 64 號）

贊助單位：國泰金控

時間	地點	會議內容			
9:00-9:30	綜合院館	報到			
9:30-10:20	國際會議廳	<b>主題演講：“What drives monetary policy shifts? A new approach to regime switching in DSGE models”</b> <b>Prof. Yoosoon Chang (Department of Economics, Indiana University)</b>			
10:20-10:35	綜合院館	茶會			
10:35-11:25	國際會議廳	<b>主題演講：Studies on Taiwan's Monetary Policy: Review and Outlook</b> <b>王泓仁教授（國立臺灣大學社會科學院院長）</b>			
11:25-11:35	綜合院館	照相			
11:35-12:00	國際會議廳	會員大會			
12:00-13:20	綜合院館	午餐			
13:20-13:50	國際會議廳	<b>年輕學者研究獎頒獎及演講：</b> <b>Estimating Conditional Average Treatment Effects</b> <b>得獎人：許育進教授（中央研究院經濟研究所）</b> <b>頒獎人：管中閔院士（國立臺灣大學財務金融學系）</b> <b>主持人：曾郁仁教授（國立臺灣大學財務金融學系）</b>			
13:50-14:00	綜合院館	休息			
14:00-15:40 研討會 (I)	綜合院館	計量理論一 (409)	個體實證 (404)	總體實證 (405)	財務實證一 (416)
15:40-16:00	綜合院館	茶會			
16:00-17:15 研討會 (II)	綜合院館	計量理論二 (409)	實證分析一 (404)	實證分析二 (405)	財務實證二 (416)
18:30-		晚宴			



### **9:30-10:20 主題演講 (I)**

地點：國立政治大學綜合院館 5F 國際會議廳

講者：Professor Yoosoon Chang (Department of Economics, Indiana University)

主持人：陳宜廷教授 (臺灣經濟計量學會理事長)

### **10:20-10:35 茶 會**

地點：國立政治大學綜合院館 5F 國際會議廳

### **10:35-11:25 主題演講 (II)**

地點：國立政治大學綜合院館 5F 國際會議廳

講者：王泓仁教授 (國立臺灣大學社會科學院院長)

主持人：徐之強教授 (臺灣經濟計量學會副理事長)

### **11:35-12:00 會員大會**

地點：國立政治大學綜合院館 5F 國際會議廳

主持人：陳宜廷教授 (臺灣經濟計量學會理事長)

### **12:00-13:20 午 餐**

地點：國立政治大學綜合院館 5F 國際會議廳

### **13:20-13:50 年輕學者研究獎頒獎及演講**

地點：國立政治大學綜合院館 5F 國際會議廳

得獎人：許育進教授 (中央研究院經濟研究所)

頒獎人：管中閔院士 (國立臺灣大學財務金融學系)

主持人：曾郁仁教授 (國立臺灣大學財務金融學系)

### **14:00-15:40 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 計量理論一 (英文)**

地點：國立政治大學綜合院館 4F 409 教室

主席：許育進教授 (中央研究院經濟研究所)



1. Double Machine Learning with Gradient Boosting for Treatment Effect  
楊睿中\* (國立清華大學經濟學系)、莊惠菁 (元智大學管理學院)、  
管中閔 (國立臺灣大學財務金融學系)
2. Various Asymptotic Distributions of the Error-components Test for Cross-  
Section Correlation 冼芻蕘\* (國立清華大學經濟學系)
3. Forecasting Expected Shortfall and Value-at-Risk with Realized Conditional  
Variance Measures  
顏佑銘\* (國立政治大學國際經營與貿易學系)、周雨田 (中央研究院經濟  
研究所)、顏佐榕 (中央研究院統計學研究所)
4. Testing Monotonicity in a Model with Nonseparable Time-Invariant  
Heterogeneity 蘇俊華\* (中央研究院經濟研究所)

## 1.2 個體實證

地點：國立政治大學綜合院館 4F 404 教室

主席：莊慧玲教授 (國立清華大學管理學院院長)

1. 婚姻移民子女與本國居民子女之教育不均—台灣資料分量迴歸結果  
徐美\* (國立師範大學企業管理學系)、Tobias Haepf (北京大學)
2. Employment Effects of Unemployment Insurance Tax Base  
黃柏鈞\* (國立政治大學經濟學系)
3. The Diaoyu/Senkaku Islands Incident and the Effects of the Chinese Boycott  
of Japanese Cars: Historical Persistence and Nationalism  
胡偉民\* (國立政治大學財政學系)
4. 受雇人員薪資與雇主經營盈餘相關性分析  
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 (Department of Economics, Bucknell University,  
USA)、李巧琳 (國立暨南國際大學國際企業)

## 1.3 總體實證

地點：國立政治大學綜合院館 4F 405 教室

主席：黃裕烈 (國立清華大學計量財務金融學系)



1. **Financial Cycles and the Business Cycles: Evidence from Taiwan**  
陳南光\* (國立臺灣大學經濟學系)、鄭漢亮 (中央銀行)
2. **臺灣不確定指標之建構**  
黃裕烈\* (國立清華大學計量財務金融學系)、葉錦徽 (國立中央大學財務金融學系)、陳重吉 (國立臺灣大學資訊工程學系)
3. **Macroeconomic Uncertainty Index in Taiwan**  
Shih-Hsun Hsu\* (Department of Economics, National ChengChi University)、  
Chih-Chiang Hsu (Department of Economics, National Central University)、  
Yu-Lieh Huang (Department of Quantitative Finance, National Tsing Hua University)、  
Jyun-Yi Wu (National Central University)
4. **A Distributional Synthetic Control Method for Policy Evaluation**  
陳宜廷\* (中央研究院經濟研究所)

#### 1.4 財務實證

地點：國立政治大學綜合院館 4F 416 教室

主席：曾郁仁教授 (國立臺灣大學財務金融學系)

1. **The Matching of Banks and Firms in the Loan Market: Evidence from the Similarity of Risk Attitude** 林智勇\* (元智大學管理學院)、何柏欣 (國立台北大學企業管理學系)、黃嘉威 (國立師範大學企業管理學系)、顏汝芳 (國立台北大學統計學系)
2. **Distance and M&A Performance in the U.S. Property-Liability Insurance Industry** 林姿婷\* (國立臺灣大學財務金融學系)
3. **Higher-order Omega: A Performance Index with a Decision-Theoretic Foundation** 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)
4. **Finance and Income Inequality: Does Financial Structure Matter?**  
陳亭慈\* (淡江大學經濟學系)

**15:40-16:00 茶 會**

地點：國立政治大學綜合院館 4F

**16:00-17:15 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 計量理論二

地點：國立政治大學綜合院館 4F 409 教室

主席：林馨怡教授（國立政治大學經濟學系）

1. Nonparametric Quantile Regression for Double Censored Data with Application to Stock Markets with Price Limits  
朱紀仰\*（國立台北大學經濟學系）
2. Estimation of Dynamic Stochastic Frontier Model using Likelihood-based Approaches 賴宏彬\*（國立中正大學經濟學系）、Subal C Kumbhakar (Department of Economics, Binghamton University)
3. Nonparametric Estimation and Testing for Heteroskedasticity in Sample Selection Models  
廖仁哲\*（中央研究院經濟研究所）、陳樂昱（中央研究院經濟研究所）、Xiaojun Song (Guanghua School of Management, Peking University)

## 2.2 計量實證 I

地點：國立政治大學綜合院館 4F 404 教室

主席：簡錦漢教授（中央研究院經濟研究所）

1. 經濟成長、薪資停滯?初探台灣實質薪資與勞動生產力成長脫鉤之成因  
楊子霆\*（中央研究院經濟研究所）、林依伶（中央銀行）
2. Finance and Carbon Dioxide Emissions  
吳宜臻\*（東吳大學國際經營與貿易學系）
3. The Case for Starting a New Exchange Rate after Debt Settlement: Reexamining Alternatives to Argentina's Exchange Rate Policy in 2001-2  
丁千容\*（南台科技大學休閒事業管理系）、葉國俊（國立臺灣大學國家發展研究所）、何泰寬（國立清華大學計量財務金融系）

## 2.3 . 計量實證 II (英文)

地點：國立政治大學綜合院館 4F 405 教室

主席：陳旭昇教授（國立臺灣大學經濟學系）

1. The Importance of Matching Frictions in Unemployment: A Bayesian-Estimated Model with Job Rationing  
吳致謙\*（國立政治大學經濟學系）



2. Investigating the Inefficiency of the CBO' s Budgetary Projections  
荒井夏來\* (國立政治大學國際經營與貿易學系)
3. Physicians' Supply under Global Budgeting: Empirical Evidence for the Treadmill Effect 唐孟祺\* (國立中正大學經濟學系)

## 2.4 財務實證

地點：國立政治大學綜合院館 4F 416 教室

主席：何耕宇教授 (國立臺灣大學財務金融學系)

1. CSR 報告書揭露帶給我們的啟發與想像--以金融業為例  
葉錦徽\* (國立中央大學財務金融學系)、許至廷 (國立中央大學財務金融學系)、楊時鈞 (國立中央大學財務金融學系)、許襄伶 (國立中央大學財務金融學系)
2. The Dark Side of Bank CEO Risk-taking Incentives: Evidence from Bank Lending Decisions 何柏欣\* (國立台北大學企業管理學系)、林智勇 (元智大學管理學院)、Tran Thi Thuy Linh (元智大學管理學院)
3. Liquidity Spillover in the Foreign Exchange Market  
張雅婷\* (國立中央大學校務研究辦公室)、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，勿延宕下一場次進行。



### 國立政治大學綜合院館（臺北市文山區指南路二段 64 號）

- 開車：請於政治大學校門進入，離開前請跟工作人員索取取停車券
- 捷運及公車：
  - 搭乘捷運新店線（綠線）至景美站，轉搭 棕 6 至「政大」站下車
  - 搭乘捷運文湖線（棕線）至動物園，轉搭 236、237、611、282、295、棕 3、棕 6、棕 18、綠 1、指南客運 1503 至「政大」站下車。
  - 搭乘欣欣客運 236、237、611、295、指南客運 1501、1503、282、530、小型公車 10、捷運接駁公車 棕 3、棕 5、棕 6、棕 11、棕 15、棕 18、綠 1，至「政大」站下車

至「政大」站下車後，由麥當勞對面的行人步行側門進入，直行約 5 分鐘到達