

2015 年總體經濟計量模型研討會

會議主題：產業發展的困境與突破

日期：2015 年 12 月 3-4 日 (星期四、五)

地點：中央研究院經濟研究所

主辦單位：中央研究院經濟研究所、行政院主計總處

12 月 3 日 (星期四)

8:30 - 9:00 報到

B 棟大廳

9:00 - 9:10 開幕致詞

慕寰廳

簡錦漢 (中央研究院經濟研究所)

刁錦寰 (University of Chicago Booth School of Business)

9:10 - 10:10 專題演講 I

慕寰廳

主 席：刁錦寰 (University of Chicago Booth School of Business)

主講人：蔡瑞胸 (University of Chicago Booth School of Business)

Forecasting with Mixed-Frequency Data

10:10 - 10:30 休息

10:30 - 12:30 平行場次 I

1A Volatility Models

B110

Chair : Min-Teh Yu (俞明德, Department of Information
Management and Finance, NCTU)

*Price Discovery, Jump and News Announcements in Foreign
Exchange Markets*

Presenter : Yin-Feng Gau (高櫻芬, Department of Finance,
National Central University), Zhen-Xing Wu, Jin-Huei Yeh

Discussant : Shinn-Juh Lin (林信助, Department of International
Business, National Chengchi University)

The Asymmetry in Carry Trade and the US Dollar

Presenter : Chih-Chiang Wu (吳志強, College of Management, Yuan Ze University), Chang-Che Wu

Discussant : Chor-Yiu Sin (冼蜀龔, Department of Economics, National Tsing Hua University)

Correlation Dynamics between Stock and Government Bond Markets: Evidence from the European Debt Crisis

Presenter : Li-Min Wang (王立民, SinoPac Holdings), Yi-Chi Chen, Ray Yeutien Chou

Discussant : Yu-Min Yen (顏佑銘, Department of International Business, National Chengchi University)

Root-n-Predictions of Generalized Heteroskedastic Transformation Regression Models

Presenter : Songnian Chen, Hanghui Zhang (張杭輝, The School of Economics of SUFE)

Discussant : Le-Yu Chen (陳樂昱, Institute of Economics, Academia Sinica)

1B 中國貿易實證

C103 會議室

主席 : 張靜貞 (中央研究院經濟研究所)

中國大陸與美國貿易摩擦：臺灣身受其害？

主講人 : 林家慶 (國立臺中科技大學國際貿易經營系), 林昱君

評述人 : 李叢禎 (國立臺北大學經濟學系)

Trade Liberalization, Export Participation, and Income Inequality: Evidence from China's Electrical Machinery and Equipment Manufacturing Industry

主講人 : Chia-Ying Chen (陳佳楹, 北京清華大學經濟系)

評述人 : 徐世勳 (國立臺灣大學農業經濟學系)

中國大陸進口潛能分析—隨機邊界引力模型的應用

主講人 : 劉孟俊 (中華經濟研究院)、吳佳勳

評述人 : 林純如 (國立臺北商業大學國際商務系)

12:30 - 13:30 午餐

13:30 - 14:30 專題演講 II

慕寰廳

主 席：吳中書 (中華經濟研究院)

主講人：Keun Lee (Seoul National University)

*Catch-up and Post-Catch-up in Korea and Taiwan:
A Neo-Schumpeterian Perspective*

14:30 - 15:00 大合照 及 休息

15:00 - 17:00 平行場次 II

2A 產業實證

B110 會議室

主席：傅祖壇 (東吳大學經濟學系)

國際專利合作決定因素之探討：臺灣半導體產業之實證初探

主講人：劉文獻 (國立中正大學經濟學系), 徐振傑

評述人：李文傑 (國立政治大學經濟學系)

*政府擴大公共建設投資支出對我國總體經濟財政及所得分配影響
之一般均衡分析*

主講人：謝德衍, 劉瑞文, 林幸君, 許聖民, 張靜貞, 徐世勳 (國立
臺灣大學農業經濟學系)

評述人：陳坤銘 (國立政治大學國際經營與貿易學系)

臺灣與韓國產業別總要素生產力之比較: 1981-2010

主講人：傅祖壇 (東吳大學經濟學系), 林億明, 林幸君, 孔維新,
陳柏鈞

評述人：郭炳伸 (國立政治大學國際經營與貿易學系)

2B 國際貿易

C103 會議室

主席：梁啟源 (中華經濟研究院)

國際產業科技合作、區域經貿整合與國家創新系統型態

主講人：劉孟俊, 吳佳勳 (中華經濟研究院)

評述人：黃登興 (中央研究院經濟研究所)

臺灣出口品附加價值內涵之演進解析

主講人：李浩仲, 王信實 (國立政治大學經濟學系)

評述人：陳彥煌 (文化大學國際貿易學系)

服務業研發與國際化的決定因素

主講人：歐宜佩, 陳信宏 (中華經濟研究院), 溫蓓章

評述人：溫肇東 (國立政治大學商學院)

Structural Change of China's Export Sector: The Effect of Renminbi Revaluation

主講人：Yu-Ning Hwang, Shi-Shu Peng (彭喜樞, 中央研究院經濟研究所), Fu-Ching Yang

評述人：李浩仲 (國立政治大學經濟學系)

2C 計量理論

C101 會議室

主席：林金龍 (國立東華大學財務金融學系)

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

主講人：Yi-Ting Chen, Yu-Chin Hsu, Hung-Jen Wang (王泓仁, 國立臺灣大學經濟學系)

A Two-Tier Stochastic Frontier Model with Correction for Sample Selection

主講人：Hung-Pin Lai (賴宏彬, 國立中正大學經濟學系)

Asymptotic Inefficiency of BIC and Asymptotic Efficiency of TSIC: The Case of an $I(d)$ Process

主講人：Shu-Hui Yu (俞淑惠, 國立高雄大學統計學研究所)

Estimation of Semiparametric Nonlinear Panel Data Models with Correlated Random Effects

主講人：Ji-Liang Shiu (徐吉良, 大陸人民大學漢青經濟與金融高級研究院)

2015 年總體經濟計量模型研討會

會議主題：產業發展的困境與突破

12 月 4 日 (星期五)

9:00 - 11:00 平行場次 III

3A 勞動研究

B110 會議室

主席：李庸三 (力仁教育基金會)

中國大陸城鎮社區對外來人員之主觀態度研究

主講人：溫芳宜 (中華經濟研究院)

評述人：魯慧中 (輔仁大學經濟系)

中國人口結構及社會保險對居民儲蓄行為的影響：分量迴歸之應用

主講人：鄭漢亮 (中華經濟研究院)

評述人：林世昌 (國立清華大學經濟學系)

Family Labor Supply and the Timing of Cash Transfers: Evidence from the Earned Income Tax Credit

主講人：Tzu-Ting Yang (楊子霆, 中央研究院經濟研究所)

評述人：王惠貞 (國立清華大學經濟學系)

3B Financial Econometrics

C103

Chair: Juin-Jen Chang (Institute of Economics, Academia Sinica)

Combining Markov Switching and Smooth Transition in Modeling Volatility: A Fuzzy Regime MEM

Presenter : Giampiero M. Gallo (University of Florence),
Edoardo Otranto

Discussant : Ching-Fan Chung (鍾經樊, Department of
Quantitative Finance, National Tsing Hua University)

Examining Strategic Investments Based on Asset Price Bubbles

Presenter : Jin-Huei Yeh (葉錦徽, Department of Finance,
National Central University), Shi-Jung Fan-Jian,
Yu-Tung Lin, Kai-Huei Yu

Discussant : Robin K. Chou (周冠男, Department of Finance,
National Chengchi University)

*The Term Structures of Domestic and Foreign Forward
Premiums as Predictors of Spot Exchange Rates:*

A Cross-Countries Comparison

Presenter : Xi Wang, Jiao-Hui Yang, Kai-Li Wang (王凱立,
Department of finance, Tunghai University)

Discussant : Min-Hsien Chiang (江明憲, Department of Business
Administration, National Cheng-Kung University)

*Forecasting Volatility with Multiple Horizon Extreme Values: The
Multiple Horizon Conditional Autoregressive Range (MHCARR)
Model*

Presenter : Ray Yeutien Chou (周雨田, Institute of Economics,
Academia Sinica), Chen-Sheng Lin, Shou-Yung Yin

Discussant : Giampiero M. Gallo (University of Florence)

11:00 - 11:30 休息

11:30 - 12:30 專題演講 III

慕寰廳

主 席：蔡瑞胸 (University of Chicago Booth School of Business)

主講人：段錦泉 (新加坡國立大學風險管理研究所)

Dynamic Macro Scenario Analysis via Bridge Sampling

12:30 - 13:30 午餐

13:30 - 15:30 平行場次 IV

4A 國際金融

B110 會議室

主席：許嘉棟 (國立臺灣大學經濟學系)

What Are the Main Sources of Interest Rate Persistence? Some International Evidence

主講人：Ming-Jen Chang, Chang-Ching Lin, Shou-Yung Yin (殷壽鏞, 中央研究院經濟研究所)

評述人：陳旭昇 (國立臺灣大學經濟學系)

How to Evaluate Money Doctors Objectively? Monetary Reform Proposals for China Reconsidered

主講人：Tai-Kuang Ho (何泰寬, 國立清華大學計量財務金融學系)

評述人：黃俞寧 (國立政治大學經濟學系)

The Asymmetric Contagion Effect from the U.S. Stock Market around the Subprime Mortgage Crisis between 2007 and 2010

主講人：Yu-Sheng Kao (高友笙, 廈門華僑大學數量經濟研究院),
Yu-Cheng Ku, Chien-Chung Nieh

評述人：姚 睿 (國立中央大學經濟系)

4B 總體計量

C103 會議室

主席：蔡文禎 (中央研究院經濟研究所)

Bayesian Approaches to Variable Selection with Highly Correlated Regressors: Predictive Perspectives from Cross-Country Growth Regressions

主講人：Kuo-Jung Lee, Yi-Chi Chen (陳奕奇, 國立成功大學經濟學系)

評述人：劉祝安 (中央研究院經濟研究所)

A Mixed-Frequency Smooth Measurement for the Evolution of Business Conditions

主講人：Yi-Ting Chen (陳宜廷, 中央研究院經濟研究所)

評述人：徐之強 (國立中央大學經濟學系)

Forecasting Taiwan Manufacturing Index with Midas Factor Model

主講人：Wen Jen Tsay, Hong-Ming Chen (陳宏銘, 中央研究院經濟研究所)

評述人：林常青 (國立成功大學經濟學系)

A Time-Frequency Analysis of Stock Return, Investor Sentiment and Macroeconomic Factors

主講人：Tzu-Pu Chang (張子溥, 國立雲林科技大學財務金融學系), Erdost Torun

評述人：劉炳麟 (逢甲大學財務金融學系)

15:30 - 15:45 休息

15:45 - 17:35 「產業發展的困境與突破」論壇

慕寰廳

主 席：段錦泉 (新加坡國立大學風險管理研究所)

引言人：陳添枝 (國立臺灣大學經濟學系)

與談人：杜紫宸 (工業技術研究院知識經濟與競爭力研究中心)

胡貝蒂 (經濟部工業局產業政策組)

高仙桂 (國家發展委員會)

~~感謝您的參與~~