



國立臺灣大學

# 計量理論與應用研究中心

CENTER FOR RESEARCH IN ECONOMETRIC THEORY AND APPLICATIONS  
NATIONAL TAIWAN UNIVERSITY

發行人：管中閔

編輯：李宜芹、葉憶婷、陳智琇

出刊：2009年7月15日（半年報）

總號 01

## NEWSLETTER

2009年第1期

# 簡訊

### 本期目錄 Contents

成立簡介	2
學術活動	2
學術交流	3
CRETA Introduction	4
Academic Events	4
Academic Exchange	5

### CRETA 本期活動摘要

- ※ 2009年3月31日 -  
CRETA 正式成立
- ※ 2009年6月13日 -  
「行銷與計量的對話」學術研討會
- ※ 2009年6月19日 ~ 20日 -  
Workshop on Advanced Econometrics 1

### CRETA 活動預告

- 2009年8月10日 - Professor Zhongjun Qu 演講座談會
- 2009年8月20日 - Workshop on Advanced Econometrics 2
- 2009年10月31日 - 臺灣經濟計量學會 2009年會

地址：臺北市大安區羅斯福四段85號

電話：(02) 3366.1072 / 傳真：(02) 3366.9580

電子信箱：ntucreta@ntu.edu.tw

## 成立簡介與學術活動

「計量理論與應用研究中心」(Center for Research in Econometric Theory and Applications, CRETA) 為國立臺灣大學的校級研究中心，於 2009 年 3 月 31 日學校第 2568 次行政會議決議通過設立；校人字第 0980020320B 號文聘任財務金融學系管中閔教授擔任中心主任，任期 3 年。

CRETA 是國立臺灣大學為推動經濟計量學的教學與研究，並培育學術與實務人才所成立的跨院系功能性中心。主要目標為：在追求學術卓越的原則下，培育一流人才與推動卓越研究。藉助國內外學者引進新的前沿方法與議題，並與各系所合作，積極推動與經濟計量相關的研究。

CRETA 未來除了將支援各種與計量相關的研究計畫，亦將舉辦定期的學術研討會 (seminar)、不定期的計量方法專題講習 (lecture)，研習會 (workshop)，以及國際學術會議。希望能藉此提昇研究水準，培養討論風氣，並強化此一領域的國際對話，增加國內學者的國際能見度。

### 📍 CRETA 主辦

2009 年 6 月 19 日 (五) ~ 20 日 (六)

#### Workshop on Advanced Econometrics 1

主題：Multivariate Volatility Models

講者：Prof. Michael McAleer

Erasmus School of Economics

Erasmus University Rotterdam

主辦單位：CRETA、臺灣經濟計量學會

國立臺灣大學財務金融學系

### 📍 CRETA 協辦

2009 年 6 月 13 日 (六)

#### 「行銷與計量的對話」學術研討會

主辦單位：臺灣行銷科學學會

臺灣經濟計量學會

國立臺灣大學管理學院

協辦單位：CRETA

### 📍 CRETA 活動預告

2009 年 8 月 10 日 (一)

#### Professor Zhongjun Qu 演講座談會

主題：Structural Change: Some Recent Development

講者：Prof. Zhongjun Qu, Boston University

2009 年 8 月 20 日 (四)

#### Workshop on Advanced Econometrics 2

主題：Martingale Hypothesis and Inference  
in Financial Econometrics

講者：Prof. Yongmiao Hong, Cornell University

2009 年 10 月 31 日 (六) 臺灣經濟計量學會 2009 年年會

臺灣經濟計量學會 2009 年年會已經開始徵稿了，詳細情形請參閱學會網站：<http://tes.econ.sinica.edu.tw/>

# 學術交流

## 學者出訪

中心主任管中閔教授受邀參加 -

2009 年 4 月 9 日暨南大學通識講座

講題：請用計量分析說服我

2009 年 4 月 21 ~ 25 日香港城市大學講學

講題：Testing the Predictive Ability of Technical Analysis Using A New Stepwise Test without Data Snooping Bias

2009 年 5 月 7 日中興大學惠蓀講座

講題：請用計量分析說服我

2009 年 6 月 5 日廈門，福建

海西 2009 兩岸經濟暨金融研討會

大會演講：臺灣金融業在海峽西岸經濟區的前景

2009 年 6 月 9 日 ~ 6 月 12 日

廣州中山大學嶺南學院講學

2009 年 6 月 14 日南寧，廣西

北美中國留美經濟學會年會

主題演講：兩岸關係的新環境中臺灣金融業的發展方向

2009 年 7 月 10 日成都，四川

金融統計與金融計量國際研討會

大會演講：Large-Scale Multiple Testing without Data Snooping Bias : Methods and Applications

## 來訪學者



2009 年 6 月 18 日 ~ 6 月 21 日

Prof. Michael McAleer



2009 年 6 月 23 日

上海社會科學院朱平芳教授等五人來訪



2009 年 6 月 14 日

北美中國留美經濟學會年會

## ***CRETA Introduction & Academic Events***

The Center for Research in Econometric Theory and Applications (CRETA) was established in March 2009. Funded by the National Taiwan University, CRETA cultivates an ideal environment for econometric research, facilitating open discussions amongst researchers, strengthening international exchanges, and enhancing our national competitive advantage in this area of expertise.

To raise the bar of analytical Econometrics in Taiwan, CRETA organizes regular seminars, lectures, workshops and international conferences. This not only serves to enhance the econometrics foundation and training of local top scholars, but also to promote econometric theory and its applications in other disciplines.

With equal emphasis placed on advancing the field of econometrics domestically and internationally, CRETA also encourages interdisciplinary and international collaboration by providing various forms of support towards the research and adoption of econometrics in professional applications.

### **Hosted by CRETA**

**June 19 ( Fri. ) ~ June 20 ( Sat. ) 2009**

#### **Workshop on Advanced Econometrics 1**

Theme : Multivariate Volatility Models

Speaker : Prof. Michael McAleer

Erasmus School of Economics

Erasmus University Rotterdam

Host : CRETA, Taiwan Econometric Society

Department of Finance, NTU

### **Co-hosted by CRETA**

**June 13 ( Sat. ) 2009**

#### **Marketing and Econometric Dialogue**

Host : Taiwan Institute of Marketing Science

Taiwan Econometric Society

College of Management, NTU

Co-host : CRETA

### **CRETA Up-Coming Events**

**August 10 ( Mon. ) 2009**

#### **Professor Zhongjun Qu Seminar**

Theme : Structural Change: Some Recent Development

Speaker : Prof. Zhongjun Qu, Boston University

**August 20 ( Thu. ) 2009**

#### **Workshop on Advanced Econometrics 2**

Theme : Martingale Hypothesis and Inference  
in Financial Econometrics

Speaker : Prof. Yongmiao Hong, Cornell University

**October 31 ( Sat. ) 2009**

#### **2009 Taiwan Econometric Society Annual Conference**

Taiwan Econometric Society is calling for paper for 2009 Annual Conference.

For details, please go to TES website : <http://tes.econ.sinica.edu.tw/>

## Academic Exchange

### Visit from CRETA

**Chung-Ming Kuan ( Director of CRETA ) was invited to**

April 9, 2009

General Education Lecture at National Chi Nan University

Title: 請用計量分析說服我

April 21, 2009 ~ April 25, 2009, City University of Hong Kong

Title: Testing the Predictive Ability of Technical Analysis Using

A New Stepwise Test without Data Snooping Bias

May 7, 2009

惠蓀 Lecture at National Chung-Hsing University

Title: 請用計量分析說服我

June 5, 2009, Xiamen, Fujian

Plenary Speech at the Haixi Conference

on The Cross-Strait Economic and Financial Development

Title: 台灣金融業在海峽西岸經濟區的前景

June 9, 2009 ~ June 12, 2009

Lecture at Lingnan College Sun Yat-Sen University

June 14, 2009, Nanning, Guangxi

Keynote Speech at the Chinese Economists Society Annual Conference

Title: 兩岸關係的新環境中台灣金融業的發展方向

July 10, 2009, Chengdu, Sichuan

Plenary Speech at the 2009 International Conference on Financial  
Statistics and Financial Econometrics

Title: Large-Scale Multiple Testing without Data Snooping Bias:  
Methods and Applications

### Visitors



June 18, 2009 ~ June 21, 2009

Prof. Michael McAleer



June 23, 2009

Prof. Pingfang Zhu and his colleagues from  
Shanghai Academy of Social Science



June 14, 2009

Chinese Economists Society Annual Conference