

出國報告（出國類別：出席國際會議）

赴泰國出席國際會議報告

服務機關：國立政治大學應數系

姓名職稱：吳柏林教授

派赴國家：泰國清邁

出國期間：2014/1/7-2014/1/10

報告日期：2014/1/23

摘要

泰國計量經濟學會國際會議，採取為期三天的場地是在研究生院，清邁大學，泰國的一次重要會議。本次會議的主要著力點是匯集誰與計量經濟學和經濟學的定量分析相關研究人員。提供計量經濟學者有機會提出和討論的理論和應用研究的問題。本次計量經濟學會國際大會是這將促進研究合作的研究人員之間的理想場所。本研討會之議題主要包含有計量經濟、Copula，公司管理及經營議題 (Management Exercise PRIME)、分組討論有關財經風險，相關程度等議題及創意資訊分析。

研討會中議題及實務分享外，同時也能從此研討會中與來自世界各國的計量經濟人員共同分享經驗與看法，擴大彼此視野，吸收其他國家計量經濟專業知識及實務經驗，藉以提升計量經濟專業能力。

目次

摘要	- 2 -
壹、研討會目的與過程.....	- 4 -
貳、研討會議題摘要	- 5 -
參、心得及建議	- 5 -

壹、研討會目的與過程

第 7 屆國際會議計量經濟學 2014 年，於 2014 年 1 月 8 日至 1 月 10 日在 Chingmai，泰國舉行，由 Chinagmai 大學主辦。，韓國台灣，美國，加拿大，澳洲，南非，馬來西亞，捷克等來自各國之學者專家約有 70 餘人參加，包括地主國大陸與日本外 10 餘國。本次會議旨在匯集研究人員在計量經濟學和定量分析在經濟學中一個機會，介紹和討論的理論和應用研究的問題，以及促進研究合作。會議開到計量經濟學特別是 Copula 函數和最大熵任何主題。所有的定量分析方法與經濟學等 CGE 建模，模糊建模，神經網絡，遺傳算法和數據挖掘應用的歡迎。這第五次國際會議的主題是金融計量和會議是開放的，以經濟學的任何話題。第五次會議將具有兩個主題演講：(1) 保羅 Embrechts，科技，瑞士蘇黎世瑞士聯邦理工學院 (2) 基督教 Gourieroux，經濟學，統計學和金融，法國和著名經濟學家邀請幾個地址的巴黎研究生院。

貳、研討會議題與摘要

本次大會就以下幾項重點主題進行研討：會議主要有兩個主題演講：(1) 保羅 Embrechts，科技，瑞士蘇黎世瑞士聯邦理工學院 (2) 基督教 Gourieroux，經濟學，統計學和金融，法國巴黎大學研究生院和由著名經濟學家邀請幾個地址。以及一些新觀念如：感知測量，隨機指標的有效性，創新管理與創新計算等新看法。

本人則提出預測與績效評估，模糊時間序列區間的數據。本研究採用模糊時間序列分析來執行上的變化週期檢測和間隔時間序列模型構建的深入研究。著眼於時間序列區間，我們建立合適的模型並進行預測一下吧。我們構建的模型是基於與變化週期檢測的模糊閾值的評價。我們使用比熵修改了傳統的預測結果。預測結果的性能是由該中心的均方誤差和模糊數據的範圍進行比較。實證研究表明，我們所提出的評估方法為區間預測值可以在預測區間值提供了更客觀的決策空間。關鍵詞：模糊數據，模糊時間序列，變化時期，比率熵

參、心得及建議

3.1 攜回的資料：

1. The 7th International Conference on Econometrics 2014 研討會論文集 2.與 Professor Nguyen, Hung, Vladick Kreinovich 等學者討論有關最近著作與研究結果。相關資料可見間網頁：
<http://www.cmse-conference.org/index.php/19-sample-data-articles/joomla/24-tes2015>

3.2 建議與其他

目前筆者在政大應數研究所開設模糊統計與時間數列分析與預測課程多年，深感學術研究發展日新月異、一日千里。國科會能給予補助出國出席國際學術研討會，收穫相當大。希望將來能多利用課餘時間出國做短期研究，吸收國外新知、及研究方向。回國後繼續開設模糊時間數列分析與預測課

程，指導博、碩士班研究生，籌辦國際學術研討會，推動國際財金與管理學術研究工作。並於國際著名學術論文期刊，發表學術論文。

Program: Thursday January 8th, 2014

Time	Main Hall	ECB 1201	ECB 1202	ECB 1207
08:00-09:00	Registration			
09:00-10:30	Keynote Speech: "Four theorems and a financial crisis" by Prof. Paul Embrechts <i>at the Main Hall</i>			
10:30-11:00	Coffee break			
11.00 - 11.45	Macroeconomic Determinants of Stock Market Volatility and Volatility Risk-Premiums (Valentina Corrad, Walter Distaso, and Antonio Mele)	Forecasting Financial Time Series: Normal GARCH with Outliers or Heavy Tailed Distribution Assumptions? (Christoph Hartz and Marc S. Paoletta)	The Establishment of Assessment Indicators of Environmentally Sustainable Development and Its Application in National Park (Wan-Tran Huang*, Chun-Yu Chien, Yun Jhang, Ya-Xuan Xu, and Han-Shen Chen)	Economic Factors Influencing the Urban Real Estate Price in the People's Republic of China (Lianting Cheng*, Prasert Chaitip, and Chukiat Chalboonsri)
11.45 - 12.30	On Permutation Tests for Serial Independence (Lanh Tran* and Jiexiang Li)	Subsampling Tests of Parameter Hypotheses and Overidentifying Restrictions with Possible Failure of Identification (Patrik Guggenberger and Michael Wolf)	Do We Still Need to Finance Energy until Next 10-20 Years? : An Energy Model giving a Brief Picture of Our 2010 Policy (Aphada Chhprateep)	Does Price Matter? The FMOLS Estimation of Rich Countries Tourist Outbound to Four ASEAN Countries (Komkrit Wongkhae* and Chukiat Chalboonsri)
12:30-14:00	Lunch			
14.00 - 14.45	Prediction in Econometrics: Towards mathematical justification of simple (and successful) heuristics (Vladik Kreinovich*, Hung T. Nguyen, and Songsak Sriboonchitta)	Modelling Risk Premium using Capital Asset Pricing Model with Asymmetric Error Distributions (Nuttanan Wichitaksorn and S.T.Boris Choy)	Does off-balance sheet activities affect the banks' profit efficiency? Empirical evidence from the Indian banking sector (Sunil Kumar)	Analysis of Equilibriopathy Acupuncture Involving Chronic Pain Treatment and Healing Rates (Sangkhae Suthi*, Songsak Sriboonchitta and Patharat Paspipatku)
14.45 - 15.30	Forecasting and Performance Evaluation (Berlin Wu)	Smooth Transition Quantile Capital Asset Pricing Models with Heteroscedasticity (Cathy W.S. Chen*, Simon Lin, and Philip L.H. Yu)	Banking reforms and total factor productivity growth in the banking industry: evidence from India (Rachita Gulati and Sunil Kumar)	Dynamic correlations between local APIs and corresponding regional, national levels in China (He Zhanqiong)
15:30-16:00	Coffee break			
16.00 - 16.45	Detecting Changepoints in Segmented Linear Regression Heteroscedastic Models by Empirical Likelihood Methods (Hualing Zhao and Hanfeng Chen)	Forecast combination for discrete choice models: predicting FOMC monetary policy decisions (Laurent L. Pauwels* and Andrey Vasnev)	The relationship between Leisure Participated Motivation and Constraints on Senior Students (Cheng-Chuan Chen*, Chih-Chuan Wang, and Rui-Cheng Hong)	Modeling the effects of community-based tourism on household income and poverty alleviation in Thailand with econometric treatments of endogeneity and selection bias problems (Komsan Suriya)
16.45 - 17.30	Fuzzy modeling of survival function from interval or censored observations (Andrzej Szymanski* and Agnieszka Rossa)	An Innovative Financial Time Series Model: The Geometric Process Model (Jennifer S.K. Chan*, Connie P.Y. Lam and S.T. Boris Choy)	A New Approach on Standard Setting in Education with Fuzzy Statistical Analysis (Mingchuan Hsieh)	Effects of microcredit on poverty reduction in Thailand using propensity score matching and average treatment effect model (Siwaporn Fongthong* and Komsan Suriya)
17:30-18:00			Performance Evaluation in After School Care Policy (Huang-Yu Shih)	Determinants of Borrowers and Loan Sizes of Microcredit for Villages and Urban Communities in Thailand (Siwaporn Fongthong* and Komsan Suriya)
				An optimal model of monetary and fiscal policy interaction in the case of Indonesia (Haryo Kuncoro* and K. Dianta A. Sebayang)