

出國報告（出國類別：國際會議）

出席 International Conference for
Academic Disciplines 國際研討會並發
表學術研究成果

服務機關：國立暨南國際大學 財務金融學系

姓名職稱：李享泰 教授

派赴國家：義大利

出國期間：103.6.28~103.7.7

摘要

本次出國目的主要在於參加 International Conference for Academic Disciplines 國際研討會(103.06.28-103.07.07) 並發表最新的學術研究成果。本次出席研討會發表的論文題目為：Dynamic Hedging Oil Risk of Stock Sector Returns with a Dynamic Conditional Correlation MIDAS Model，主要在利用最新提出的 Dynamic Conditional Correlation MIDAS 模型進行類股原油風險的避險，實證結果發現考量長短期波動度及相關性成分的 DCC-MIDAS 模型較傳統 DCC 模型有較佳的原油風險避險效果。本次研討會我被安排在 07 月 03 上午進行發表，也旁聽了許多其他相關文章報告，會後也與國際學者進行交流研討，獲益良多。

目次

封面	1
摘要	2
目次	3
本文.....	3
一、目的.....	4
二、過程.....	4
三、心得及建議.....	4

一、目的

本次出席國際會議旨在發表個人最新的學術研究成果，並藉由論文報告與國際學者進行交流，期能進一步完善論文品質、了解最新研究議題與拓展學術人脈。

二、過程

本次的 International Conference for Academic Disciplines 於義大利威尼斯的 Ca' Foscari University 舉行。本次研討會我被安排在 07 月 03 上午 11:15 的 Business & Economics 場次進行發表，地點在 Ca' Foscari University 的 Sala Archivio 會議室進行。本會議我發表的論文主要在利用最新提出的 Dynamic Conditional Correlation MIDAS 模型進行類股原油風險的避險，報告的時間大約進行 15 分鐘，並在文章報告結束之後進行 5 分鐘左右的公開討論。本論文實證結果發現考量長短期波動度及相關性成分的 DCC-MIDAS 模型較傳統 DCC 模型有較佳的原油風險避險效果。與會學者對本文主要意見在於避險績效的部分，例如來自南非 University of Stellenbosch 的 Soon Nel 學者建議應針對績效進行統計顯著性檢定，以進一步釐清本模型的貢獻，我也做了相對應的回覆。本次研討會除了發表文章外，也旁聽了許多其他相關的文章發表，例如旁聽來自加拿大 University of Windsor 的 Jerry Sun 及 Western University 的 Jae-Dong Han 等教授所發表的文章，Han 任教於加拿大 University of Western Ontario 的 King's University College，主要的研究主題為亞洲國家國際貿易與政治議題，會後我與 Han 教授進行相當時間的交談，獲益良多。

三、心得及建議

本次會議除了增加自己發表文章的國際曝光度，了解相關領域最新的研究議題外，也認識了許多相關領域的國際學者，例如結識了 Liao, Wen-Chi 教授，Liao 教授目前於國立新加坡大學不動產學系任教，在不動產領域有非常傑出的研究表現，會議期間有機會跟廖教授討論其研究方向，希望將來有機會能將自己專長的多重馬可夫狀態轉換鍊 GARCH 模型應用到不動產領域跟其他市場的資訊傳遞議題上。本次的研討會獲益良多，經由此次會議不但增進了財金領域的學術人脈並期待將來有機會可以跟國際頂尖研究學者有進一步的研究成果。





INTERNATIONAL
JOURNAL
OF ARTS AND SCIENCES

Certificate of Merit

Hsiang-Tai Lee

Recognized for Outstanding Research and Presentation at the

INTERNATIONAL CONFERENCE FOR ACADEMIC DISCIPLINES

Ca' Foscari University, Venice, Italy

30 June to 3 July 2014

V42 538

The research program is posted online at <http://ijas2014venice.sched.org/>