

『總體金融與經濟情勢預測研討會』

經濟預測對於制定貨幣政策扮演舉足輕重之角色。舉凡經濟與商業情勢的即時預報 (nowcasting) 與預測 (forecasting)，金融市場風險與危機之預警系統、經濟成長率、物價、利率、匯率、房價等總體變數之預測，均能提供貨幣政策決策時之重要參考。

舉行本研討會之目的在於，希望能藉此提供學者專家與中央銀行研究人員有一個交流的機會，進而促成研究與決策品質之提升。

主辦單位：台灣經濟學會 中央銀行

協辦單位：台大經濟系

地點：台大社科院 3 樓梁國樹會議廳

日期：2019 年 10 月 25 日

活動議程

時間	內容
09:00—09:40	與會來賓報到
09:40—09:50	開幕致詞 陳恭平（台灣經濟學會理事長，中研院經濟所所長）
09:50—10:20	專題演講： 主講人：楊金龍（中央銀行 總裁）
10:20—12:00	場次一：物價與經濟成長預測 3 篇論文發表（每篇論文 20 分）評論：（每篇 5 分）自由討論：（15 分） 主持人：曹添旺（中經院董事長，中央銀行監事） 1. 繆維正、蕭宇翔（中央銀行） 以高頻物價數據進行通膨預測 評論人：徐士勛（政大經濟系）

	<p>2. 朱浩榜（中央銀行）</p> <p>台灣景氣轉折之即時認定</p> <p>評論人：徐之強（中央經濟系）</p> <p>3. 鄭漢亮（中央銀行）</p> <p>金融變數對台灣經濟成長之預測</p> <p>評論人：何泰寬（台大經濟系）</p>
12:00—13:30	午餐時間
13:30—15:00	<p>場次二：預測方法與應用</p> <p>3 篇論文發表（每篇論文 20 分）評論：（每篇 5 分）自由討論：（15 分）</p> <p>主持人：張勝凱（台大經濟系）</p> <p>1. 鍾經樊（清大計財系，中央銀行監事）</p> <p>Hull and White Interest Rate Model with Nelson-Siegel Term Structure: An Application to Interest Rate Pricing and Risk Measure</p> <p>評論人：周雨田（中研院經濟所）</p> <p>2. 蔡文禎（中研院經濟所，公平交易委員會委員）、王馨徽（清大計財系）</p> <p>On Same-Realization Prediction in the Multivariate Long Memory Process with the VAR Procedure</p> <p>評論人：蔡恆修（中研院統計所）</p> <p>3. 吳俊毅、朱浩榜（中央銀行）</p> <p>即時預報台灣的經濟成長率—MIDAS 模型之應用</p> <p>評論人：姚睿（中央經濟系）</p>

15:00—15:30	中場休息
15:30—17:00	<p>場次三：資產價格與預測</p> <p>3 篇論文發表（每篇論文 20 分）評論：（每篇 5 分）自由討論：（15 分）</p> <p>主持人：陳旭昇（台大經濟系教授）</p> <p>1. 郭炳伸（政大國貿系）、張力尹（政大國貿系）、藍青玉（銘傳大學經濟與金融系）</p> <p>Robust Predictions of Exchange Rate Movements with Google Trends</p> <p>評論人：陳宜廷（中研院經濟所）</p> <p>2. 周有熙（師大公領系）</p> <p>Liquidity Premium and Exchange Rate Predictability</p> <p>評論人：俞欣榮（中央銀行）</p> <p>3. 徐婉容（中央銀行）</p> <p>認定與預測台灣股市熊市</p> <p>評論人：林馨怡（政大經濟系）</p>