

2014

經濟學門學術研習營

○東海大學經濟學系、財務金融學系

科技部人文社會科學研究中心聯合主辦

○時間與地點：2014 年10月02日（四）9:30-16:30
東海大學社會科學院 一樓 SS102

Model Specification Tests

主講人：陳宜廷 教授

■ 經濟學門學術研習營

完整的經濟實證研究通常應具有模型設定 (Specification)、估計 (Estimation) 與檢驗 (Hypothesis testing) 這三項基本的計量分析步驟。但相對於模型設定與估計，模型檢驗在實證研究中經常未受到足夠的重視。實際上，不同的模型設定方式可能代表不同的經濟意義，亦可能使研究者得出不同的估計結果進而產生不同的詮釋。藉由模型設定檢驗，我們可以評估各種潛在模型設定方式的適切性，並從中選取或修正出較為合適的模型，再據以詮釋出同時具有經濟與計量意義的實證結果。

東海大學經濟學系、財務金融學系與科技部人文社會科學研究中心共同主辦「經濟學門學術研習營」，邀請陳宜廷教授（中央研究院經濟研究所研究員），以「Model Specification Tests」研究為主題，進行專題講座與問題研討，敬邀學術先進撥冗參加！

■ 講師簡介：陳宜廷 教授 (Prof. Chen, Yi-Ting)

陳宜廷教授為國立台灣大學經濟學博士(1998)，曾任中央研究院社科所助研究員(2000-2004)，中研院人社中心副研究員(2005)，現為中研院經濟所研究員。亦曾獲中央研究院年輕學者研究著作獎(2004)及國科會吳大猷先生紀念獎(2004)。其主要研究領域為計量經濟理論、時間序列分析及實證財務。陳教授的研究曾發表於多個國內外知名期刊，包括 Journal of Econometrics、Journal of Business & Economic Statistics、Journal of Applied Econometrics、Journal of Financial Econometrics、Econometric Reviews、Oxford Bulletin of Economics and Statistics、Journal of Forecasting、Journal of Banking & Finance、Studies in Nonlinear Dynamics and Econometrics、Economic Modelling、Economics Letter、經濟論文、經濟論文叢刊。

■ 講題簡介：

我們將在這個講題中介紹一般化的參數化設定檢驗(Parametric specification tests)的原則。這個原則係基於計量模型的設定正確性，經常可以表現成特定的動差條件(Moment condition)，故可藉此推演出動差檢定(Moment test)以判斷模型的適切性。這個原則的基本相法相當的簡單、容易瞭解。但在將其進一步延伸成實際的設定檢驗時，則會隨著不同的情況產生許多重要的計量議題。例如，如何使設定檢驗對特定的或一般的對立假設產生檢定力？如何使得設定檢驗具有最適化的詮釋？如何控制出設定檢驗大樣本正確的型一誤差機率？如何使設定檢驗的大樣本正確性不受到模型估計方法的影響？如何修正計量文獻中既有的設定檢驗使之適用於新的計量模型？如何使低階動差檢驗不受到高階動差誤設的影響？如何使高階動差檢定的方法適用於正確的低階動差設定方式？與設計出易於實證研究中操作的動差檢定？。我們預計在課程視情況討論其中一些議題。

- 主辦單位：東海大學經濟學系、財務金融學系、科技部人文社會科學研究中心
- 時間地點：2014年10月2日上午10:00-16:30 東海大學社會科學院一樓 SS102
- 研習內容：

日期	時間	主題
2014/10/2(四)	9:30~10:00	報到
	10:00~12:00	專題進行(一)
	12:00~13:00	午餐與交流
	13:00~13:30	午休
	13:30~15:30	專題進行(二)
	15:30~16:30	交流

- 聯絡報名資訊：東海大學經濟學系 系所網址：<http://economic.thu.edu.tw/main.php>
聯絡人：張雅嵐小姐 電子郵件：changyl@thu.edu.tw 聯絡電話：04-23590255 傳真專線：04-23590702
- 報名表 及 研習內容相關資訊 下載

經濟學門學術研習營

Model Specification Tests

講題簡介

一、講題重要性：

一個完整的經濟實證研究，通常應具有模型的設定(Specification)、估計(Estimation)與檢驗(Testing) 這三項基本的計量分析。但相對於模型設定與估計，模型檢驗在實證研究中經常未受到足夠的重視。實際上，不同的模型設定方式，可能代表不同的經濟意義，亦可能產生出不同的估計結果進而使研究者產生不同的詮釋。顯然我們需藉由適當的模型設定檢驗，判斷各種潛在模型設定方式的正確性，並從中選取出甚或修正出適當的模型，再據以詮釋出同時具有經濟與計量意義的實證結果。

二、內容：

我們將在這個講題中介紹一般化的參數化設定檢驗(Parametric specification tests)的原因。這個原則係基於計量模型的設定正確性，經常可以表現成特定的動差條件(Moment condition)，故可藉此推演出動差檢定(Moment test)以判斷模型的適切性。這個原則的基本相法相當的簡單、容易瞭解。但在將其進一步延伸成實際的設定檢驗時，則會隨著不同的情況產生許多重要的計量議題。例如，如何使設定檢驗對特定的或一般的對立假設產生檢定力？如何使得設定檢驗具有最適化的詮釋？如何控制出設定檢驗大樣本正確的型一誤差機率？如何使設定檢驗的大樣本正確性不受到模型估計方法的影響？如何修正計量文獻中既有的設定檢驗使之適用於新的計量模型？如何使低階動差檢驗不受到高階動差誤設的影響？如何使高階動差檢定的方法適用於正確的低階動差設定方式？與設計出易於實證研究中操作的動差檢定？。我們預計在個課程視情況討論其中一些議題。

三、課程安排

在第一個部分，我們將回顧參數化設定檢驗的原則等基本觀念，並整理出設定檢驗的幾個重要的計量議題。

在第二個部分，我們將以實際的研究經驗說明文獻中相關的計量方法，與我們對這些議題所提出的方法及其在實際資料中的應用。

經濟學門學術研習營

主講人：陳宜廷 教授（中研院經濟所研究員）

編號：_____（由本單位填寫）

「Model Specification Tests」學術研習營 報名表	
• 講座時間與地點：	講座時間：2014年10月2日(四) 講座地點：東海大學社會科學院一樓 SS102 報名截止日：2014年9月25日(四)下午5:00前
• 參加人姓名：	• 性別： <input type="checkbox"/> 女士 <input type="checkbox"/> 先生
• 參加人身份：	<input type="checkbox"/> 東海大學教職員 _教師_職員 <input type="checkbox"/> 東海大學學生 _研究生_大學生 <input type="checkbox"/> 其他外校教職員 _教師_職員 <input type="checkbox"/> 其他外校學生 _研究生_大學生 <input type="checkbox"/> 其他外界學術單位人士
• 交通方式與用餐：	<input type="checkbox"/> 自行開車 請填寫車號：_____ *搭公共運輸工具則不用填寫 <input type="checkbox"/> 中午用餐 <input type="checkbox"/> 葷食 <input type="checkbox"/> 素食 *主辦單位代訂餐盒
• 服務單位名稱：	• 系別/職稱：
• E-MAIL： (本中心首要聯絡窗口)	•
• 聯絡電話：	(辦公室/住宅) (行動)
• 傳真電話：	
• 通訊地址：	
• 訊息取得來源：	<input type="checkbox"/> 網站 <input type="checkbox"/> 電子郵件 <input type="checkbox"/> 海報宣傳 <input type="checkbox"/> 來電洽詢 <input type="checkbox"/> 朋友推薦 <input type="checkbox"/> 其他_____
• 活動辦理單位	東海大學經濟學系、財務金融學系 科技部人文社會科學研究中心

備註：1. 參加講座當日可憑本報名表作為汽車進出校園之識別
2. 講座參與報名專線：東海大學經濟學系 張雅嵐小姐 04-2359-0255

歡迎您的參與

東海大學經濟學系暨研究所

聯絡人：張雅嵐 助教

電子郵件：changyl@thu.edu.tw

系所網址：<http://economic.thu.edu.tw/main.php>

聯絡電話：04-23590255 或04-23590121轉36102

傳真專線：04-23590702

東海大學校園平面示意圖

