

# 2007 行為財務學暨新興市場理論與實證研討會

時 間：96年1月6日（星期六）8:30~13:00

地 點：世新大學管理學院大樓國際會議廳（台北市文山區木柵路一段111號2樓）

主辦單位：世新大學財務金融學系

## 研討會議程

時間	活動內容	會議地點	
8:30~8:50	報到	管院大樓 國際會議廳	
8:50~9:00	開幕式 貴賓致詞：牟宗燦 校長（世新大學校長）		
9:00~9:45	專題演講 講題：經濟與道德：從亞當·史密斯談起 主講人：薛琦 院長（台灣金融研訓院院長）		
9:45~10:00	茶敘		
學術研討會			
時間	場次 1-A 新興市場	主持人	會議地點
10:00~11:10	1.發表題目：公司技術定位策略與公司價值關聯性—以台灣上市電子業公司為例 發表人：莊忠柱（真理大學管理科學研究所教授兼管理學院院長） 蔡中民（真理大學管理科學研究所研究生） 評論人：邱永和（東吳大學教授兼商學院院長）	何宗武 世新大學財務金融學系教授	管院大樓 M308 教室
	2.發表題目：Expected Returns and Volatility in Emerging Markets: Analysis of Stochastic Volatility in Mean model 發表人：何宗武（世新大學財務金融學系教授） 張淑華（世新大學財務金融學系教授） 評論人：莊忠柱（真理大學管理科學研究所教授兼管理學院院長）		
	3.發表題目：股票報酬率與違約風險關係之研究--台灣市場之驗證 發表人：王克陸（交通大學財務金融研究所副教授） 彭雅惠（玄奘大學財務金融學系助理教授） 陳坤熙（交通大學管理科學研究所研究生） 評論人：楊浩彥（國立台北商業技術學院財務金融系教授兼系主任）		
場次 1-B 財務工程及資本市場			
11:10~11:20	1.發表題目：不動產抵押貸款證券化之評價—以中信銀 RMBS 為例 發表人：李俊民（群益證券債券部資產證券化商品處專員） 劉淑鶯（世新大學財務金融學系教授） 評論人：聶建中（淡江大學財務金融學系教授兼系主任）	劉淑鶯 世新大學財務金融學系教授	管院大樓 M304 教室
	2.發表題目：多種價差策略與台指選擇權套利機會之研究 發表人：程言信（高雄應用科技大學金融資訊研究所助理教授） 陳秀萍（高雄應用科技大學金融資訊研究所研究生） 評論人：盧陽正（銘傳大學財務金融學系教授兼系主任）		
	3.發表題目：Pricing Average Interest Rate Options in a LIBOR Market Model 發表人：吳庭斌（政治大學金融學系博士候選人） 陳松男（政治大學金融學系教授） 評論人：林師模（中原大學國際貿易學系教授）		
11:10~11:20	茶敘		

時間	場次 2-A 行為財務學(I)	主持人	會議地點	
	1.發表題目：Disposition Effect – An International Comparison Study 發表人：陳正佑（國立屏東商業技術學院財務金融系副教授） 黃湘雯（國立屏東商業技術學院國際企業研究所研究生） 評論人：童心達（實踐大學企業管理學系助理教授）	周行一 政治大學財務管理學系教授兼商學院院長	管院大樓 M308 教室	
	2.發表題目：Size and Book-to-Market Effects under a Threshold Framework 發表人：萬哲鈺（淡江大學經濟學系副教授） 高崇璋（淡江大學財務金融學系博士生） 評論人：尙瑞國（景文技術學院財政稅務系副教授兼系主任）			
	3.發表題目：Undervaluation Followed by Overvaluation 發表人：王祝三（中正大學財務金融學系副教授） 評論人：胡星陽（台灣大學財務金融學系副教授）			
	4.發表題目：Decomposing the Bid-Ask Spread of ETFs on the AMEX Pre-/Post- Decimalization 發表人：段昌文（淡江大學財務金融學系助理教授） 林容竹（德明技術學院財務金融系副教授） 評論人：周麗娟（台北商業技術學院國際商務系副教授）			
11：20~13：00	場次 2-B 行為財務學(II)		周濟 世新大學經濟學系教授	管院大樓 M304 教室
	1.發表題目：散戶情緒與股票報酬:台灣股市實證研究 發表人：王錦瑩（銘傳大學風險管理與保險學系助理教授） 劉玉珍（政治大學財務管理學系教授） 林晏竹（中國信託金融控股公司專員） 評論人：周濟（世新大學經濟學系教授）			
	2.發表題目：財務狀況對生活滿意度之影響：主觀與客觀之分析比較 發表人：郭敏華（世新大學財務金融學系副教授） 吳瑋絹（世新大學財務金融學系研究生） 評論人：吳政穎（空中大學管理與資訊學系副教授）			
	3.發表題目：Does Weekday Effect Still Exist? Evidence from DJIA and NASDAQ High Frequency Indices 發表人：俞海琴（中原大學國際貿易學系教授） 巫佳宜（中央研究院經濟研究所研究助理） 評論人：劉祥熹（台北大學國際企業研究所教授兼所長）			
	4.發表題目：台灣股票市場機構投資人過度自信之研究 發表人：劉祥熹（台北大學國際企業研究所教授兼所長） 袁正大（台北大學企業管理學系研究生） 評論人：趙振瑛（景文技術學院財務金融系副教授）			
13：00~	午餐			

每篇論文發表：發表人十五分鐘，評論人五分鐘，答辯與提問二分鐘。