

時間	會議內容		
08:30-09:10	來賓報到、領取資料		
09:10-09:20	開幕典禮暨台灣財務工程學會- 中央大學校長 周景揚校長 致歡迎詞		
09:20-09:30	開幕典禮暨台灣財務工程學會- 財工學會理事長 林丙輝理事長 致歡迎詞		
09:30-10:20	<b>專題演講一</b>		
	主持人：中央大學財務金融學系 葉錦徽主任 演講者：Prof. Jun, Yu (SMU) 演講題目： Shrinkage Estimation of Covariance Matrix for Portfolio Choice with High Frequency Data		
10:20-10:40	茶敘		
10:40-12:10	<b>學術論文發表/場次 1A</b>	<b>學術論文發表/場次 1B</b>	<b>學術論文發表/場次 1C</b>
	<b>財務工程實證</b> (主持人: 俞明德 教授)	<b>衍生性商品定價 (1)</b> (主持人: 張傳章 教授)	<b>資本市場 (1)</b> (主持人: 張森林 教授)
	<b>評論者：</b> 岳夢蘭/政大財管系  <b>文章主題/作者：</b> Jump Variance Risk: Evidence from Option Valuation and Stock Returns  張瑄凌/台大財金系 張晏誠/台大財金系 *鄭宏文/東吳財精系 曾俊凱/University of Kansas	<b>評論者：</b> 林士貴/政大金融系  <b>文章主題/作者：</b> Momentum Strategies: An Almost Stochastic Dominance Approach  江彌修/政大金融系 *邱信瑜/政大金融系 黃瑞卿/中央財金系	<b>評論者：</b> 李韋憲/中大財金系  <b>文章主題/作者：</b> How Does Political Connection Shape Firm Value?  *戚永苓/中興財金系
	<b>評論者：</b> 徐之強/中央經濟系  <b>文章主題/作者：</b> Violations of put-call parity, index return predictability, and abnormal return: Evidence from the Taiwan index option market  *陳昭君/東海財金系	<b>評論者：</b> 江彌修/政大金融系  <b>文章主題/作者：</b> Semi-Static Hedging and Pricing American Floating Strike Lookback Option  張森林/台大財金系 *黃以達/台大財金系 石百達/台大財金系 王之彥/台大國企系	<b>評論者：</b> 許育進/中研院經濟所  <b>文章主題/作者：</b> Effect of internal volatility on hedging and safe-haven attributes of stocks, bonds, U.S. dollar and gold  *Meng-Shiuh Chang/江西財經大學

			Jing Xu/西南財大 Shao-Chieh Hsueh/廈門大學
	<p><b>評論者：</b> 蔡維哲/中山財管系</p> <p><b>文章主題/作者：</b> The Information Content of Option-implied Tail Risk on the Future Returns of the Underlying Asset</p> <p>王耀輝/台大財金系 *顏廣杰/台大財金系</p>	<p><b>評論者：</b> 駱建陵/逢甲金融學院</p> <p><b>文章主題/作者：</b> Revisiting the Valuation of Deposit Insurance</p> <p>張傳章/中央財金系 張森林/台大財金系 *何瑞鎮/靜宜大學財金系 蕭育仁/北醫生科管理系</p>	<p><b>評論者：</b> 翁培師/東華財金系</p> <p><b>文章主題/作者：</b> Examining the profitability of similarity-based futures trading strategies</p> <p>江彌修/政大金融系 郭維裕/政大國貿系 *邱信瑜/政大金融系</p>
12:10-13:10	午餐		
	<b>專題演講二</b>		
13:10-14:00	<p>主持人：台灣財務工程學會 林丙輝理事長 演講者：Prof. Chung-Ming Kuan (NTU) 演講題目： Large Scale Multiple Inequality Testing without Data Snooping Bias</p>		
	<b>學術論文發表/場次 2A</b>	<b>學術論文發表/場次 2B</b>	<b>場次 2C</b>
	<b>資本市場 (2)</b> (主持人: 林蒼祥 教授)	<b>衍生性商品定價 (2)</b> (主持人: 許和鈞 教授)	<b>交易實務與應用</b> (主持人: 郭憲章 教授)
14:10-15:40	<p><b>評論者：</b> 徐政義/中大財金系</p> <p><b>文章主題/作者：</b> 資本與績效</p> <p>許永明/政大風管與保險系 *李惠妍/南台科大企管系</p>	<p><b>評論者：</b> 汪琪玲/淡江保險系</p> <p><b>文章主題/作者：</b> Derivative Pricing and Empirical Analysis in CO2 Emission Allowance: Mean Reversion, Stochastic Volatility, and Jump Risks</p> <p>*陳亭甫/政大金融系 林士貴/政大金融系</p>	<p><b>文章主題/作者：</b> 利用 MATLAB 進行演算法交易</p> <p>劉禹農 欽思科技/資深應用工程師</p>
	<p><b>評論者：</b> 鄭宏文/東吳財精系</p> <p><b>文章主題/作者：</b></p>	<p><b>評論者：</b> 黃泓人/中大財金系</p> <p><b>文章主題/作者：</b></p>	<p><b>文章主題/作者：</b> 使用 MATLAB 建立分級及實施風險模型及壓力測試基本架構</p>

	<p>Valuation of Stock Options, Bankruptcy Risk Premium, and the Term Structure of Bankruptcy Probability</p> <p>張森林/台大財金系 *駱建陵/逢甲大學金融學院</p>	<p>Efficient Analytical Approximation of American Options: The Early Exercise Premium and the Binary Power Options</p> <p>江彌修/政大金融系 *傅信豪/政大金融系 黃以達/台大財金系 駱建陵/逢甲金融學院 石百達/台大財金系</p>	<p>劉禹農 鈦思科技/資深應用工程師</p>
	<p><b>評論者：</b> 黃裕烈/清大計財系</p> <p><b>文章主題/作者：</b> What Drives the Low-Nominal-Price Stock Return Premium in China Stock Markets</p> <p>Bing Zhang / 南京大學 *葉宗穎/中興財金系</p>	<p><b>評論者：</b> 王之彥/台大國企系</p> <p><b>文章主題/作者：</b> Variance premium, U-shaped Pricing Kernel and Option Valuation</p> <p>*蔡子皓/清大計財系 鄭宏文/東吳財精系</p>	<p><b>文章主題/作者：</b> 金融大數據應用實例</p> <p>楊志清 中華資料採礦協會/理事</p>
15:40-16:00	茶敘		
16:00-17:30	<b>學術論文發表/場次 3A</b>	<b>學術論文發表/場次 3B</b>	<b>學術論文發表/場次 3C</b>
	<b>ESG 投資</b> (主持人:周賓鳳 教授)	<b>風險管理</b> (主持人:楊曉文 教授)	<b>交易策略</b> (主持人:曾郁仁 教授)
	<p><b>評論者：</b> 陳鴻毅/政大財管系</p> <p><b>文章主題/作者：</b> Financial Literacy and Participation in the Derivatives Markets</p> <p>蕭育仁/北醫科管理系 *蔡維哲/中山財管系</p>	<p><b>評論者：</b> 黃瑞卿/中大財金系</p> <p><b>文章主題/作者：</b> Hellinger Distance Measure and LaVaR:Evidence from Chinese Leverage/Inverse ETFs Listed on TWSE</p> <p>*蔡垂君/靜宜大學會計系 李存修/台大財金系</p>	<p><b>評論者：</b> 高櫻芬/中大財金系</p> <p><b>文章主題/作者：</b> 利用時間序列模型建構市場中性交易策略</p> <p>戴天時/交大資財系 *陳敬生/交大資財系</p>

**評論者：**  
林美珍/台北大企管系

**文章主題/作者：**  
A Resolution of the Differences of Opinion Puzzle

周賓凰/中央財金系  
\*謝佳勳/中央財金系  
S. Ghon Rhee /中央財金系

**評論者：**  
楊曉文/中大財金系

**文章主題/作者：**  
Pension fund optimization with minimum inflation-protected annuities under stochastic interest rates

吳庭斌/中央財金系  
\*湯美玲/虎尾科大財金系  
Gene C.Lai/Department of Finance and Management Science, Washington State University  
Son-Nan Chen/Shanghai Advanced Institute of Finance, Shanghai Jiaotong University

**評論者：**  
石百達/台大財金系

**文章主題/作者：**  
以 CUDA 架構實作在線套利交易機制平台

陳郁文/交大資工系  
陳穎平/交大資工系  
\*戴天時/交大資財系

**評論者：**  
池祥萱/東華財金系

**文章主題/作者：**  
企業社會責任對流動性及風險之影響

\*詹場/北大金合系  
張宸嘉/北大金合系  
邱健嘉/中央財金系  
柯文乾/北大金合系

**評論者：**  
孫立憲/中大數統所

**文章主題/作者：**  
Higher-order Omega: A Performance Index with a Decision-Theoretic Foundation

Hongwei Bi/School of Insurance and Economics, University of International Business and Economics, Beijing  
\*黃瑞卿/中央財金系  
曾郁仁/台大財金系  
Wei Zhu/School of Insurance and Economics, University of International Business and Economics, Beijing

**評論者：**  
翁培師/東華財金系

**文章主題/作者：**  
改單、下單積極度與獲利表現

\*謝佩芳/清大計財系  
陳婉瑜/清大計財系

	<p><b>評論者：</b> 沈信漢/中大財金系</p> <p><b>文章主題/作者：</b> 經理人能力對於公司從事企業社會責任活動與經營績效的影響</p> <p>*池祥萱/東華財金系 林煜恩/吉林大學商學院 林彤璐/東華財金系</p>	<p><b>評論者：</b> 蔡子皓/清大計財系</p> <p><b>文章主題/作者：</b> Valuation Guaranteed Lifetime Withdrawal Benefits / Guaranteed Minimum Withdrawal Benefits in Presence of Longevity Risk</p> <p>*劉議謙/臺中科大保金系 楊曉文/中大財金系 王昭文/中山財管系</p>	<p><b>評論者：</b> 賴慧文/師大管院</p> <p><b>文章主題/作者：</b> Do Cross-Sectional Stock Return Predictors Pass the Test without Data-Snooping Bias?</p> <p>*許育進/中研院經濟所 林修葳/台大國貿系 Kendro Vincent/台大國企系</p>
18:00-21:00	晚宴		