

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 周景行校長 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	專題演講一													
	主持人	葉錦徽	演講者	Prof. Jun, Yu, Cheng Liu, Ningning Xia	演講題目	Shrinkage Estimation of Covariance Matrix for Portfolio Choice with High Frequency Data								
10:40-12:10	學術論文發表/場次1A				學術論文發表/場次1B				學術論文發表/場次1C					
	財務工程實證 (主持人:俞明德 教授)				衍生性商品定價 (1) (主持人:張傳章 教授)				資本市場 (1) (主持人:郭憲章 教授)					
	文章主題	作者	學校/職稱	評論者/職稱	文章主題	作者	學校/職稱	評論者/職稱	文章主題	作者	學校/職稱	評論者/職稱		
	Jump Variance Risk: Evidence from Option Valuation and Stock Returns	Hsuan-Ling Chang	台大財金系	岳夢蘭/政大財管系	Momentum Strategies: An Almost Stochastic Dominance Approach	江彌修	政大金融系	林士貴/政大金融系	What Drives the Low-Nominal-Price Stock Return Premium in China Stock Markets	Bing Zhang	Nanjing University	徐政義/中大財金系		
		張晏誠	台大財金系			邱信瑜	政大金融系			Chung-Ying Yeh	National Chung Hsing University			
		*鄭宏文	東吳財精系			黃瑞卿	中央財金系							
	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	葉仕國/中興財金系	Semi-Static Hedging and Pricing American Floating Strike Lookback Option	張森林	台大財金系	江彌修/政大金融系	How Does Political Connection Shape Firm Value?	Yung-Ling Chi	National Chung-Hsing University	李韋憲/中大財金系		
	3.The Information Content of Option-implied Tail Risk on the Future Returns of the Underlying Asset	王耀輝	台大財金系	謝文良/交大資財系	Revisiting the Valuation of Deposit Insurance	Yi-Ta Huang	台大財金系			駱建陵/逢甲金融學院	Effect of internal volatility on hedging and safe-haven attributes of stocks, bonds, U.S. dollar and gold	Meng-	江西財經大學	許育進/中研院經濟所
		*顏廣杰	台大財金系			石百達	台大財金系					Jing Xu	西南財大	
						王之彥	台大國企系	Shao-Chieh Hsueh	廈門大學					
12:10-13:10	午餐													
13:10-14:00	專題演講二													
	主持人	林丙輝	演講者	Prof. Kuan, Chung-	演講題目	Large Scale Multiple Inequality Testing without Data Snooping Bias								
14:10-15:40	學術論文發表/場次2A				學術論文發表/場次2B				場次2C					
	資本市場 (2) (主持人:張森林 教授)				衍生性商品定價 (2) (主持人:許和鈞 教授)				交易實務與應用 (主持人:邱文昌 期交所總經理)					
	文章主題	作者	學校/職稱	評論者/職稱	文章主題	作者	學校/職稱	評論者/職稱	文章主題	作者	學校/職稱	評論者/職稱		
	資本與績效	*許永明	政大風管與保險系	蕭育仁/北醫生物管理	Derivative Pricing and Empirical Analysis in CO2 Emission Allowance: Mean Reversion, Stochastic	Ting-Fu Chen	政大金融系	張嘉倩/高應大金融系	利用MATLAB進行演算法交易	劉禹農	資深應用工程師	/		
		*李惠妍	南台科技大學企管系			林士貴	政大金融系							
	Valuation of Stock Options, Bankruptcy Risk Premium, and the Term Structure of Bankruptcy Probability	張森林	台大財金系	鄭宏文/東吳財精系	Approximating American Options using Binary Power Derivatives	江彌修	政大金融系	黃泓人/中大財金系	使用MATLAB建立分級及實施風險模型及壓力測試基本架構	劉禹農	資深應用工程師			
		*駱建陵	逢甲大學金融學院			Hsin-Hao Fu	政大金融系							
						*Yi-Ta	台大財金系							
	Examining the profitability of similarity-based futures trading	江彌修	政大金融系	Meng-Shiuh Chang /江西財經大學	Variance premium, U-shaped Pricing Kernel and Option Valuation	駱建陵	逢甲金融學院	王之彥/台大國企系	金融大數據應用實例					
		郭維裕	政大國貿系			Pai-Ta Shih	台大財金系							
*邱信瑜		政大金融系	*蔡子皓			清大計財系								
15:40-16:00	茶敘													
	學術論文發表/場次3A				學術論文發表/場次3B				學術論文發表/場次3C					
ESG投資 (主持人:周賓凰 教授)				風險管理 (主持人:林蒼祥 教授)				交易策略 (主持人:曾郁仁 教授)						
文章主題	作者	學校/職稱	評論者/職稱	文章主題	作者	學校/職稱	評論者/職稱	文章主題	作者	學校/職稱	評論者/職稱			
Financial Literacy and Participation in the	蕭育仁	北醫生物管理	王凱立/東海財金系	Heilinger Distance Measure and LaVaR: Evidence from Chinese	*蔡垂君	靜宜大學會計系	吳庭斌/中大財金系	利用時間序列模型建構市場中性交易策略	戴天時	交大資財系	高櫻芬/中大財金系			

16:00-17:30	Derivatives Markets	*蔡維哲	中山大學財管系		Leverage/Inverse ETFs Listed on TWSE	李存修	台大財金系			*陳敬生	交大資財系		
	A Resolution of the Differences of Opinion Puzzle	Pin-Huang Chou	中央財金系	周冠男/政大財管系	Pension fund optimization with minimum inflation-protected annuities under stochastic interest rates	吳庭斌	中央財金系	楊曉文/中大財金系	以 CUDA 架構實作在線套利交易機制平台	陳郁文	交大資工系	石百達/台大財金系	
		Chia-Hsun Hsieh	中央財金系			湯美玲	虎尾科大財金系			陳穎平	交大資工系		
		S. Ghon Rhee	中央財金系			Gene C.Lai	Department of Finance and Management Science, Washington State University			*戴天時	交大資財系		
						Son-Nan Chen	Shanghai Advanced Institute of Finance, Shanghai Jiaotong University						
	企業社會責任對流動性及風險之影響	詹場	台北大學金合系	池祥萱/東華大學財金系	Higher-order Omega: A Performance Index with an Economics Foundation	Hongwei Bi	School of Insurance and Economics, University of International	許永明/政大風管與保險系	改單、下單積極度與獲利表現	謝佩芳	清大計財系	賴弘能/中大財金系	
		張宸嘉	台北大學金合系			黃瑞卿	中央財金系			陳婉瑜	清大計財系		
		邱健嘉	中央財金系			管郁仁	台大財金系						
		柯文乾	台北大學金合系			Wei Zhu	School of Insurance and Economics, University of International Business and						
	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	池祥萱	東華大學財金系	沈信漢/中大財金系	Valuation Guaranteed Lifetime Withdrawal Benefits / Guaranteed Minimum Withdrawal Benefits in Presence of Longevity Risk	I-Chien Liu	台中科大	汪琪玲/淡江保險系	Do Cross-Sectional Stock Return Predictors Pass the Test without Data-Snooping Bias?	許育進	中研院經濟所	黃瑞卿/中大財金系	
		林煜恩	吉林大學商學院			Sharon S. Yang	中大財金系			林修葺	台大國貿系		
		林丹璐	東華大學財金系			Chou-Wen Wang	中山大學			Kendro Vincent	台大國企系		
	18:00-21:00	晚宴											