

個人履歷 (CURRICULUM VITA)

黃裕烈 (YU-LIEH HUANG)

2014 年 1 月 1 日

聯絡地址 國立清華大學計量財務金融學系 +886 3 516-2125
新竹市 300 光復路二段 101 號 +886 3 562-1823 (Fax)
E-Mail: ylihuang@mx.nthu.edu.tw
http://mx.nthu.edu.tw/~ylihuang/

主要學歷 臺灣大學經濟研究所博士, 2002 年 6 月
臺灣大學經濟研究所碩士, 1996 年 6 月

專長學科 計量經濟理論、時間序列分析、總體計量、財務時間序列

授課項目 統計學、計量經濟學、時間序列分析、總體經濟學、財務數學

學術經歷 副教授 (2007 年 8 月 – 目前), 清華大學計量財務金融學系 (專任)
助理教授 (2002 年 8 月 – 2007 年 8 月), 清華大學計量財務金融學系 (專任)
講師 (2001 年 2 月 – 2002 年 6 月), 臺灣大學經濟系 (兼任)

學術榮譽 院教學傑出獎, 科技管理學院, 清華大學, 2010.
最佳論文獎, 蔣碩傑先生文教基金會, 台北, 2001.

期刊論文 概分成 (I) 總體與計量領域 (II) 財務與財務計量領域

(I) 總體與計量領域:

Huang, Yu-Lieh, “Testing Markov-switching models”, *Applied Economics*,
forthcoming.

管中閔、徐之強、黃裕烈與徐士勛, 「台灣金融情勢與總體經濟關係」, 《臺灣經濟預測
與政策》, *forthcoming*.

陳淑玲與黃裕烈, 「總體變數之領先、同時與落後性質之認定與指標構成項目之選取
– LARS 方法的運用」, 《臺灣經濟預測與政策》, *forthcoming*.

陳淑玲、黃朝熙與黃裕烈, “International economic linkages between Taiwan and
the world: A global vector autoregressive approach”, *Academia Economic
Papers*, **40**, 343 – 375, 2012.

- Huang, Yu-Lieh, “Measuring business cycles: A temporal disaggregation model with regime switching”, *Economic Modelling*, **29**, 283 – 290, 2012.
- Huang, Yu-Lieh, “Estimating Taiwan’s monthly GDP in an exact Kalman filter framework”, *Taiwan Economic Review*, **38**, 147 – 160, 2010.
- Huang, Yu-Lieh, Chao-Hsi Huang and Chung-Ming Kuan, “Re-examining the permanent income hypothesis with uncertainty in permanent and transitory innovation states”, *Journal of Macroeconomics*, **3**, 1816 – 1836, 2008. 國科會經濟期刊分類 B+ 等級。
- Huang, Yu-Lieh, “An alternative estimation algorithm for innovation regime-switching models”, *Applied Economics Letters*, **15**, 225 – 229, 2008.
- Huang, Yu-Lieh and Chao-Hsi Huang, “The persistence of Taiwan’s output fluctuations: An empirical study using innovation regime-switching model”, *Applied Economics*, **39**, 2673 – 2679, 2007.
- Kuan, Chung-Ming, Yu-Lieh Huang and Ray S. Tsay, “An unobserved component model with switching permanent and transitory innovations”, *Journal of Business and Economic Statistics*, **23**, 443 – 454, 2005. 國科會經濟期刊分類 A+ 等級, 為經濟領域中相當重要的期刊之一。
- 黃裕烈、徐之強與陳惠薇, 「景氣基準循環指數之檢討與修訂」, 《經濟論文叢刊》, **33**, 295 – 319, 2005.
- 林向愷、黃裕烈、與管中閔, 「景氣循環轉折點認定與經濟成長率預測」, 《經濟論文叢刊》, **26**, 431 – 457, 1998.
- (II) 財務與財務計量領域:
- Huang, Yu-Lieh, Tzu-Hao Tsay, Sharon S. Yang, and Hung-Wen Cheng, “Price bounds of mortality-linked security in incomplete insurance market”, *Insurance: Mathematics and Economics*, *forthcoming*. 國科會財務期刊分類 A 等級, 為保險領域中相當重要的期刊之一。
- Lin, Che-Chun, Yu-Lieh Huang and Chiuling Lu, “Estimating mortgage prepayment rates using the Gibbs-sampling approach”, *Advances in Financial Planning and Forecasting*, **5**, 215 – 230, 2012.
- Huang, Yu-Lieh, “Identifying turbulent and calm regimes in Stock Prices: Evidence from the Taiwan stock market”, *Applied Economics Letters*, **14**, 1477 – 1481, 2009.

Huang, Yu-Lieh, Chai-Wen Ho, “Beyond the bull and the bear: Demarcating stable and turbulent regimes in stock markets”, *Economic Bulletin*, **3**, 1 – 11, 2008.

黃裕烈,「擔保債權憑證之評價: Copula 函數的應用」,《經濟論文》, **35**, 21 – 52, 2007.

學術專書 黃裕烈與管中閔,「向量自我迴歸模型: 計量方法與 R 程式」, 雙葉書局, 台北。

學術論文 (WORKING PAPERS)

“Robust good-deal bounds in incomplete markets”, with Chao-An Lai and Jow-Ran Chang.

“Can anomalies be explained by technical analysis? Evidence from candlestick patterns”, with Tung-Hsin Lu.

“Uncertain effects of shocks vs. uncertain unit root: An alternative view of U.S. real GDP”, with Chao-Hsi Huang.

“Taiwan’s reference cycles”, with Shu-Ling Chen.

會議論文 (CONFERENCE PRESENTATIONS)

The 17th International Congress on Insurance: Mathematics and Economics, Copenhagen, July 1-3, 2013. Paper presented: “Robust good-deal bounds in incomplete markets”.

Annual Conference of the Taiwan Econometric Society, Taipei, Taiwan, November 2, 2013. Paper presented: “Robust good-deal bounds in incomplete markets”.

The 16th International Congress on Insurance: Mathematics and Economics, Hong Kong, June 28-30, 2012. Paper presented: “Design of peak runoff index insurance in Taiwan”.

The 15th International Congress on Insurance: Mathematics and Economics, Trieste, June 14, 2011. Paper presented: “Modeling temperature dynamics for aquaculture index insurance in Taiwan: A nonlinear quantile approach”.

The 13th International Congress on Insurance: Mathematics and Economics, Turkey, May 26, 2009. Paper presented: “Modelling El Nino dynamics,

with application to pricing ENSO-based index insurance for Peru”.

The Asia-Pacific Risk and Insurance, Sydney, July 6, 2008. Paper presented: “Modeling El Nino dynamics.”

The 62th European Meeting of the Econometric Society, Budapest, August 27, 2007. Paper presented: “Re-examining long-run PPP under an innovation regime-switching framework”.

The 61th European Meeting of the Econometric Society, Vienna, August 24, 2006. Paper presented: “Re-examining long-run PPP under an innovation regime-switching framework”.

2006 International Symposium on Econometric Theory and Application (SETA 2006) Xiamen, April 4, 2006. Paper presented: “Re-examining long-run PPP under an innovation regime-switching framework”.

The 59th European Meeting of the Econometric Society, Madrid, August 20, 2004. Paper presented: “Testing intertemporal rational expectations model with state uncertainty: An application to the permanent income hypothesis”.

2004 Far Eastern Meeting of the Econometric Society, Seoul, June 30, 2004. Paper presented: “Testing intertemporal rational expectations model with state uncertainty: An application to the permanent income hypothesis”.

2003 Open Economic and Macroeconometric Model Conference, Taipei, October 23, 2003. Paper presented: “Testing intertemporal rational expectations model with state uncertainty: An application to the permanent income hypothesis”.

2001 Taipei International Quantitative Finance Conference, Taipei, July 3, 2001. Paper presented: “The semi-nonstationary process: Model and empirical evidence”.

2001 Far Eastern Meeting of the Econometric Society, Kobe, July 20, 2001. Paper presented: “The semi-nonstationary process: Model and empirical evidence”.

2001 Macroeconometric Model Conference, Taipei, December 13, 2001. Paper presented: “The semi-nonstationary process: Model and empirical

evidence”.

學術補助 行政院國家科學委員會, 2013 年 8 月 – 2014 年 7 月. 計畫名稱: 在模型誤設且市場不完備情況下的資產訂價 (NSC102-2410-H-007-002).

行政院國家科學委員會, 2012 年 8 月 – 2013 年 7 月. 計畫名稱: 衝擊效果之不確定性: 以美、英兩國為例 (NSC101-2410-H-007-008).

行政院國家科學委員會, 2011 年 8 月 – 2012 年 7 月. 計畫名稱: 以大量資料推估即時景氣動向 (NSC100-2410-H-007-018).

行政院經濟建設委員會, 2010 年 11 月 – 2011 年 5 月. 計畫名稱: 運用模型選擇方法檢討景氣指標構成項目之研究.

行政院國家科學委員會, 2010 年 8 月 – 2011 年 7 月. 計畫名稱: 全球動態因子 VAR 模型之建構 (NSC99-2410-H-007-016).

行政院國家科學委員會, 2009 年 8 月 – 2010 年 7 月. 計畫名稱: 微量過濾法 (particle filtering) 與依時拆分模型 (NSC98-2410-H-007-014).

行政院國家科學委員會, 2008 年 8 月 – 2009 年 7 月. 計畫名稱: 景氣大蕭條與景氣趨勢不確定性 (NSC97-2410-H-007-005).

行政院國家科學委員會, 2007 年 8 月 – 2008 年 7 月. 計畫名稱: 考慮馬可夫轉換下的 GDP 月指數: 精確 Kalman filter 模型及 Gibbs 抽樣建構方式 (NSC96-2415-H-007-007).

行政院國家科學委員會, 2006 年 8 月 – 2007 年 7 月. 計畫名稱: IRS 模型估計方式之比較與應用 (NSC95-2415-H-007-005).

行政院經濟建設委員會, 2006 年 4 月 – 2006 年 10 月. 計畫名稱: 景氣基準數列之事前推估: GDP 月指數之建構.

行政院國家科學委員會, 2005 年 8 月 – 2006 年 7 月. 計畫名稱: 購買力平價假說之新檢定方式 (NSC94-2415-H-007-004).

行政院經濟建設委員會, 2005 年 6 月 – 2005 年 11 月. 計畫名稱: 運用領先指標預測景氣變化之研究.

行政院國家科學委員會, 2004 年 8 月 – 2005 年 7 月. 計畫名稱: 衡量金融風暴之新方法 (NSC93-2415-H-007-006).

行政院經濟建設委員會, 2004 年 9 月 – 2005 年 2 月. 計畫名稱: 景氣基準循環指數之檢討與修訂.

行政院國家科學委員會, 2004 年 6 月 – 2005 年 2 月. 九十三年度大專學生參與專題研究計畫 (NSC93-2815-C-007-033-H).

行政院國家科學委員會, 2003 年 8 月 – 2004 年 7 月. 計畫名稱: 恆常所得假說之新驗證方式 (NSC92-2415-H-007-007).

行政院國家科學委員會, 2003 年 6 月 – 2004 年 2 月. 九十二年大專學生參與專題研究計畫 (NSC92-2815-C-007-037-H).

行政院國家科學委員會, 2002 年 8 月 – 2003 年 7 月. 計畫名稱: 半非定態模型之推廣與應用 (NSC91-2415-H-007-011).

學術服務 *Applied Economics, Economics Bulletin, Journal of Business Cycle Measurement and Analysis, Journal of Econometrics*, 人文及社會科學集刊、中國財務學刊、中國統計學報、台灣經濟預測與政策、台灣期貨與衍生性商品學刊、交大管理學報、金融風險管理季刊、東吳經濟商學學報、管理與系統、淡江理工學報、產業論壇評審、朝陽商管評論、經濟論文叢刊、經濟論文、經濟研究、經濟與管理論叢、證券市場發展發展季刊