第四届中国计量经济学者论坛 (2020)

会议手册

主办单位: 上海社会科学院数量经济研究中心

经济研究杂志社

厦门大学王亚南经济研究院与邹至庄经济研究中心

中国科学院预测科学研究中心

东北财经大学经济学院

上海财经大学经济学院

承办单位:上海社会科学院数量经济研究中心

协办单位: 上海社会科学院研究生院

系统工程理论与实践杂志社

计量经济与金融学报杂志社

金融发展杂志社

2020年12月19日-20日中国 • 上海

一、会议背景

本次论坛由经济研究杂志社、厦门大学王亚南经济研究院与邹至庄经济研究中心、中国科学院预测科学研究中心、东北财经大学经济学院、上海社会科学院数量经济研究中心、上海财经大学经济学院共同主办,由上海社会科学院数量经济研究中心承办,由《系统工程理论与实践》期刊、《计量经济与金融学报》期刊和《金融发展》期刊协办。

首届论坛于 2017 年 12 月 29-30 日在厦门大学成功举办,第二届论坛于 2018 年 12 月 15-16 日在中国科学院大学成功举办,第三届论坛于 2019 年 12 月 21-22 日在东北财经大学成功举办,在中国计量经济学者之间乃至整个经济学界引起了较为广泛、热烈的反响。第四届中国计量经济学者论坛于 2020 年 12 月 19-20 日在上海社会科学院举办。

二、会议时间

2020年12月19-20日

三、会议地点

上海社会科学院分部 2 号楼五层多功能厅 上海社会科学院分部 2 号楼五层、六层(分组报告)

四、总体日程

日期	时间	日程安排	地点	
	07:50~08:20	报到、注册	2号楼5层多功能厅	
	08:20~08:30	大会致辞	2号楼5层多功能厅	
	08:30~12:00	主题报告	2号楼5层多功能厅	
	12:00~13:30	午餐	1号楼1层餐厅	
12月19日			2号楼5层第二、四、五、六	
	13:30~15:15	分组报告	会议室,6层621、628、630、	
			632 教室	
	15:15~17:15	主题报告	2号楼5层多功能厅	
	17:30~19:30	晚餐	1号楼1层餐厅	
	08:20~08:50	论坛开幕式	2号楼5层多功能厅	
	08:50~09:10	大会拍照	2号楼1层大厅	
			2号楼5层第二、四、五、六	
12月20日	20 日 09:10~12:05	分组报告	会议室,6层621、628、630、	
			632 教室	
	12:05~12:20	论坛闭幕式	2号楼5层多功能厅	
	12:20~13:20	午餐	1号楼1层餐厅	

六、详细日程

12月19日(周六)			
时间	日程安排	地点	
07:50-08:20	会议注册	2号楼5层多 功能厅前	
08:20-08:30	大会致辞 :干春晖,上海社会科学院	2号楼5层多功能厅	
08:30-09:15	主题演讲I(主持人: 朱平芳,上海社会科学院) 演讲嘉宾: Hsiao Cheng, University of Southern California 演讲题目: Some Thoughts on Prediction in the Presence of Big Data	2 号楼 5 层多 功能厅	
09:15-10:00	主题演讲II (主持人: 朱平芳, 上海社会科学院) 演讲嘉宾: 陈嵘, Rutgers University 演讲题目: AR and Reduced Rank AR Models for Matrix Time Series	-7J HE/J	
10:00-10:15	茶歇	2 号楼 5 层休 息区	
10:15-11:00	主题演讲III (主持人: 洪永淼, Cornell University) 演讲嘉宾: Whitney Newey, Massachusetts Institute of Technology 演讲题目: On Bunching and Identification of the Taxable Income Elasticity		
11:00-11:30	主题演讲 IV (主持人: 洪永淼, Cornell University) 演讲嘉宾: 李雪松,中国社会科学院工业经济研究所 演讲题目: 聚焦新发展格局,深化改革开放	2 号楼 5 层多 功能厅	
11:30-12:00	主题演讲 V (主持人: 洪永淼, Cornell University) 演讲嘉宾: 左学金,上海社会科学院 演讲题目:中国人口总量缩减和人口与经济活动的空间集 聚:趋势与政策选择		
12:00-13:30	午餐	1号楼1层餐 厅	

12月19日 13:30-15:00	分组报告I-1: (主持人: 张征字, 上海财经大学) 每个报告 30 分钟, 其中报告人 20 分钟, 点评人各 5 分钟。 时 间: 12 月 19 日 13:30-14:00 题 目: Bootstrap Inference for Quantile Treatment Effects in Randomized Experiments with Matched Pairs 报告人: 刘晓彬, 浙江大学 点评人 1: 廖小赛, 西南财经大学 点评人 2: 雷罗宇凡, 湖南大学 时 间: 12 月 19 日 14:00-14:30 题 目: Robust Inference for Asset Return Predictability with Persistent Predictors and Conditional Heteroscedasticity 报告人: 廖小赛, 西南财经大学 点评人 1: 刘晓彬, 浙江大学 点评人 2: 雷罗宇凡, 湖南大学 点评人 2: 雷罗宇凡, 湖南大学 点评人 1: 刘晓彬, 浙江大学 点评人 1: 刘晓彬, 浙江大学	2号楼5层第二会议室
12月19日 13:30-15: 00	分组报告I-2: (主持人: 苏梽芳, 华侨大学) 每个报告 30 分钟, 其中报告人 20 分钟, 点评人各 5 分钟。 时 间: 12 月 19 日 13:30-14:00 题 目: A double-projection Test for Regression Models 报告人: 戴圣涛, 北京大学 点评人 1: 蒋斐宇, 清华大学 点评人 2: 曹一秋, 中山大学 时 间: 12 月 19 日 14:00-14:30 题 目: Adaptive Inference for a Semiparametric GARCH Model 报告人: 蒋斐宇, 清华大学 点评人 1: 戴圣涛, 北京大学 点评人 2: 曹一秋, 中山大学 时 间: 12 月 19 日 14:30-15:00 题 目: Estimating and Testing Multiple Structural Breaks in Nonparametric Regressions 报告人: 曹一秋, 中山大学 点评人 1: 戴圣涛, 北京大学 点评人 1: 戴圣涛, 北京大学 点评人 2: 蒋斐宇, 清华大学	2号楼5层第四会议室

12月19日 13:30-15:00	分组报告I-3:(主持人:纪园园,上海社会科学院)每个报告 30 分钟,其中报告人 20 分钟,点评人各 5 分钟。 时 间: 12 月 19 日 13:30-14:00 题 目: An Agglomeration Index Based on Micro-Geographic Data and Innovation Agglomeration 报告人: 王浩宇,厦门大学点评人 1: 龚嫣然,复旦大学点评人 2: 杨炳铎,中山大学时 间: 12 月 19 日 14:00-14:30 题 目: 更可信的因果效应识别: 基于机器学习的视角报告人: 龚嫣然,复旦大学点评人 1: 王浩宇,厦门大学点评人 2: 杨炳铎,中山大学时 间: 12 月 19 日 14:30-15:00 题 目: Testing Predictability of Stock Returns under Possible Bubbles报告人: 杨炳铎,中山大学点评人 1: 王浩宇,厦门大学点评人 1: 王浩宇,厦门大学点评人 1: 王浩宇,厦门大学点评人 2: 龚嫣然,复旦大学点评人 2: 龚嫣然,复旦大学点评人 2: 龚嫣然,复旦大学点评人 2: 龚嫣然,复旦大学	2号楼5层第五会议室
12月19日 13:30-15:00	分组报告I-4:(主持人:谢婼青,上海社会科学院)每个报告 30 分钟,其中报告人 20 分钟,点评人各 5 分钟。 时 间:12 月 19 日 13:30-14:00 题 目:Financial Intermediary Leverage and Monetary Policy Transmission 报告人:李泽昊,香港中文大学(深圳)点评人 1:宋玉平,上海师范大学点评人 2:谢婼青,上海社会科学院 时 间:12 月 19 日 14:00-14:30 题 目:重复交易编制综合指数中多重共线性问题的处理研究报告人:谢婼青,上海社会科学院点评人 1:李泽昊,香港中文大学(深圳)点评人 2:宋玉平,上海师范大学 时 间:12 月 19 日 14:30-15:00 题 目:M-estimation for Jump-diffusion Models with Nonstationary High Frequency Data报告人:宋玉平,上海师范大学点评人 1:谢婼青,上海社会科学院点评人 2:李泽昊,香港中文大学(深圳)	2号楼5层第六会议室

12月19日 13:30-15:00	分组报告I-5: (主持人: 张涤新, 南京大学) 毎个报告 30 分钟, 其中报告人 20 分钟, 点评人各 5 分钟。 时 间: 12 月 19 日 13:30-14:00 题 目: Separate Noise and Jumps: A Price Duration Approach 报告人: 赵晓璐, 东北财经大学 点评人 1: 李愚昊, 武汉大学 点评人 2: 孙佳婧, 中国科学院大学 时 间: 12 月 19 日 14:00-14:30 题 目: Self-exciting Modeling Recurrent Decisions 报告人: 李愚昊, 武汉大学 点评人 1: 赵晓璐, 东北财经大学 点评人 2: 孙佳婧, 中国科学院大学 时 间: 12 月 19 日 14:30-15:00 题 目: Testing Structural Breaks - A New Self-normalization Approach Based on the Adjusted Sample Range 报告人: 孙佳婧, 中国科学院大学 点评人 1: 赵晓璐, 东北财经大学 点评人 2: 李愚昊, 武汉大学	2号楼 621 教室
12月19日 13:30-15:00	分组报告I-6:(主持人: 邸俊鹏,上海社会科学院)每个报告 30 分钟,其中报告人 20 分钟,点评人各 5 分钟。 时 间: 12 月 19 日 13:30-14:00 题 目: 产品智能化与中国工业增长报告人: 韩宝国,广东轻工职业技术学院点评人 1: 邸俊鹏,上海社会科学院点评人 2: 李杰伟,上海海事大学时 间: 12 月 19 日 14:00-14:30 题 目: 互联网与城市的未来: 宽带对城市生产性服务业集聚的影响研究报告人: 李杰伟,上海海事大学点评人 1: 邸俊鹏,上海社会科学院点评人 2: 韩宝国,广东轻工职业技术学院制 间: 12 月 19 日 14:30-15:00 题 目: 工业机器人冲击下的中国制造业劳动力市场: "升级"还是"极化"?报告人: 邸俊鹏,上海社会科学院点评人 1: 韩宝国,广东轻工职业技术学院点评人 1: 韩宝国,广东轻工职业技术学院点评人 1: 韩宝国,广东轻工职业技术学院点评人 1: 韩宝国,广东轻工职业技术学院点评人 2: 李杰伟,上海海事大学	2号楼 628 教室

	T	
	分组报告I-7: (主持人: 张美星,上海社会科学院)	
	每个报告 30 分钟,其中报告人 20 分钟,点评人各 5 分钟。	
	时间: 12月19日 13:30-14:00	
	题 目: High-dimensional VARs with common factors	
	报告人: 苗克,复旦大学	
	点评人 1: 金飞,复旦大学 点评人 2: 王俏,首都经济贸易大学	
	从17.2. 工间,目即经历页勿八子	
	时间: 12月19日 14:00-14:30	
12月19日	题 目: Consistent non-Gaussian pseudo maximum likelihood	2 号楼
13:30-15:00	estimators of spatial autoregressive models	630 教室
	报告人:金飞,复旦大学	
	点评人 1: 苗克,复旦大学 点评人 2: 王俏,首都经济贸易大学	
	从广 八 2: 工们,目即经价页勿入子	
	时 间: 12月19日 14:30-15:00	
	题 目: How strong is the Chinese government's intervention in the	
	labor market? Empirical evidence from non-parametric analysis	
	报告人: 王俏,首都经济贸易大学	
	点评人1:金飞,复旦大学	
	点评人 2: 苗克,复旦大学	
	分组报告I-8: (主持人: 陶长琪, 江西财经大学)	
	每个报告 30 分钟,其中报告人 20 分钟,点评人各 5 分钟。	
	时间: 12月19日 13:30-14:00	
	题 目: Wishart 二次型利率期限结构模型:贝叶斯估计与实证	
	分析	
	报告人: 张晨,厦门大学	
	点评人 1: 陈枷梓,厦门大学	
	点评人 2: 李欣珏,云南大学	
_	时 间: 12月19日 14:00-14:30	
12月19日	题目: A Semiparametric Model for Bond Pricing with Life Cycle	2 号楼
13:30-15:00	Fundamental	632 教室
	报告人:陈枷梓,厦门大学	
	点评人 1: 张晨,厦门大学	
	点评人 2: 李欣珏,云南大学	
	时间: 12月19日 14:30-15:00	
	题目: Combining Penalization & Adaption in High Dimension	
	with Application in Bond Risk Premia Forecasting	
	报告人: 李欣珏, 云南大学	
	点评人 1: 张晨,厦门大学	
	点评人 2: 李欣珏,云南大学	

15:00-15:15	茶歇	2 号楼 5 层休息 区
15:15-15:45	主题演讲 VI (主持人: 朱平芳, 上海社会科学院) 演讲嘉宾: 汪寿阳, 中国科学院大学 演讲题目: 新冠肺炎疫情预测与评估研究	2号楼 5 层多功 能厅
15:45-16:30	主题演讲 VII(主持人:董朝华,中南财经政法大学) 演讲嘉宾:Oliver Linton,University of Cambridge 演讲题目:A Remedi for Microstructure Noise	2号楼 5 层多功 能厅
16:30-17:15	主题演讲 VIII (主持人: 王文举, 北京物资学院) 演讲嘉宾: 洪永淼, Cornell University 演讲题目: Estimating High-Dimensional Multivariate GARCH Models: A New Regularization Approach	2号楼 5 层多功 能厅
12月19日 17:30-19:30	晚餐	1 号楼 1 层餐厅

12月20日(周日) 时间 地点 日程安排 开幕式(主持人:朱平芳,上海社会科学院) 嘉宾致辞: 王 振,上海社会科学院 2号楼5层多 洪永淼, Cornell University 08:20-08:50 功能厅 王维国, 东北财经大学 金成武, 经济研究杂志社 胡 毅,中国科学院大学 2号楼1层大 08:50-09:10 大会拍照 厅 分组报告Ⅱ-1:(主持人: 金成武, 经济研究杂志社) 每个报告 40 分钟, 其中报告人 30 分钟, 点评人各 5 分钟。 时间: 12月20日 09:10-09:50 题 目: 非国有产业视角下的科技激励政策宽度与深度的 效应研究 报告人: 朱平芳, 上海社会科学院 点评人1:方颖,厦门大学 点评人 2: 陈诗一, 复旦大学 时间: 12月20日 09:50-10:30 题 目: 中国宏观经济与物价水平的高频监测与实时分析 报告人:王霞,中山大学 点评人1: 陈磊, 东北财经大学 12月20日 点评人2: 刘金全,广州大学 2号楼5层第 09:10-12:05 二会议室 **茶歇(10:30-10:45)(**2号楼5层休息区) 时间: 12月20日 10:45-11:25 题 目:融资经历与气馁客户:借不到还是不敢借?—— 基于小微商户贷款意愿调查数据的分析 报告人: 袁煜玲, 厦门大学 点评人1: 齐鹰飞, 东北财经大学

点评人2: 李志生,中南财经政法大学

时 间: 12月20日 11:25-12:05 **题 目:** 初育延迟与二孩生育意愿

报告人:付裕,东北财经大学 点评人 1: 傅十和,厦门大学 点评人 2: 胡毅,中国科学院大学 **分组报告Ⅱ-2:**(主持人: 陈小亮,经济研究杂志社) 每个报告 40 分钟,其中报告人 30 分钟,点评人各 5 分钟。

时间: 12月20日 09:10-09:50

题 目: 新劳动法能否"精准"保护弱势群体?一种新的因变量条件双重差分评估法

报告人:张征宇,上海财经大学

点评人 1: 周先波,中山大学 **点评人 2:** 林建浩,中山大学

时间: 12月20日 09:50-10:30

题 目:"好"、"坏"波动非对称及其风险信息容量——基于

上证 50ETF 期权的实证分析

报告人: 王琳玉, 上海大学

点评人1: 郭晔,厦门大学

点评人 2: 周颖刚, 厦门大学

12月20日 09:10-12:05

茶歇(10:30-10:45)(2号楼5层休息区)

2 号楼 5 层第四 会议室

时间: 12月20日 10:45-11:25

题 目:中国家庭收入冲击向消费的传导

报告人: 纪园园,上海社会科学院

点评人1:杨继生,华中科技大学

点评人2:封进,复旦大学

时间: 12月20日 11:25-12:05

题 目:转融券费率、日内交易限制与定价效率——基于科创

板转融券市场化改革的研究

报告人: 倪博, 厦门大学

点评人1: 朱小能, 上海财经大学

点评人2: 李楠, 上海交通大学

分组报告II-3:(主持人:李琳,系统工程理论与实践杂志社)每个报告40分钟,其中报告人30分钟,点评人各5分钟。

时间: 12月20日 09:10-09:50

题 目: Time-varying Model Averaging via Adaptive LASSO

报告人: 孙玉莹, 中国科学院数学与系统科学研究院

点评人1: 董朝华, 中南财经政法大学

点评人 2: 付中昊, 复旦大学

时间: 12月20日 09:50-10:30

题 目:环境规制与城市制造业转型升级——基于产业结构绿

色转型和企业技术升级双视角分析

报告人:杨岚,上海财经大学

点评人1:于明哲,北京工商大学

点评人2: 高理翔, 华东政法大学

茶歇(10:30-10:45)(2号楼5层休息区)

12月20日 09:10-12:05

时间: 12月20日 10:45-11:25

题 目:资本要素合理流动与国内外经济维度中的产业升级机

制

报告人: 高理翔, 华东政法大学

点评人1:于明哲,北京工商大学

点评人2: 杨岚,上海财经大学

时间: 12月20日 11:25-12:05

题 目: 金融市场对中国实体经济下行风险的加速器效应-

基于系统性金融风险的研究视角

报告人:于明哲,北京工商大学

点评人1: 高理翔, 华东政法大学

点评人2: 杨岚, 上海财经大学

2 号楼 5 层第五 会议室 分组报告II-4:(主持人:刘莹,经济研究杂志社) 每个报告 40 分钟,其中报告人 30 分钟,点评人各 5 分钟。

时间: 12月20日 09:10-09:50

题 目: 经济政策不确定性、通胀预期与企业投资

报告人:张靖泽,上海财经大学 点评人1:沈一帆,同济大学 点评人2:徐敬之,厦门大学

时间: 12月20日 09:50-10:30

题 目:货币政策与分布式居民消费价格指数:从微观数据到 宏观分析

报 告 人: 沈一帆,同济大学 点评人 1: 王蕊,浙江农林大学 点评人 2: 徐敬之,厦门大学

茶歇(10:30-10:45)(2号楼5层休息区)

12月20日 09:10-12:05

时间: 12月20日 10:45-11:25

题 目: Ensemble Learning with Statistical and Structural Models

报告人: 徐敬之, 厦门大学

点评人 1: 张靖泽,上海财经大学 **点评人 2:** 王蕊,浙江农林大学

时间: 12月20日 11:25-12:05

题 目: 基于多维数据的宏观经济不确定性测度

报告人: 王蕊, 浙江农林大学

点评人1: 张靖泽,上海财经大学

点评人 2: 沈一帆,同济大学

2 号楼 5 层第六 会议室 分组报告II-5:(主持人:李鲲鹏,首都经济贸易大学)每个报告 40 分钟,其中报告人 30 分钟,点评人各 5 分钟。

时间: 12月20日 09:10-09:50

题 目: 支出波动与消费损失: 中国的农村空间贫困

报告人:罗翔,华中师范大学 点评人 1:吴茂华,复旦大学 点评人 2:陈婷玉,东北财经大学

时间: 12月20日 09:50-10:30

题 目: Local Information and the Stabilizing Role of Local Government: Evidence from a Natural Experiment in China

报 告 人: 李戎,中国人民大学 点评人 1: 吴茂华,复旦大学 点评人 2: 陈婷玉,东北财经大学

茶歇 (10:30-10:45) (2号楼5层休息区)

12月20日 09:10-12:05

时间: 12月20日 10:45-11:25

题 目: 多维需求驱动视角下中国不同所有制企业增长模式的 对比研究

报告人:陈婷玉,东北财经大学 点评人 1:罗翔,华中师范大学 点评人 2:李戎,中国人民大学

时间: 12月20日 11:25-12:05

题 目:服务业占比提高如何影响经济增长?

报告人:吴茂华,复旦大学 点评人1:罗翔,华中师范大学 点评人2:李戎,中国人民大学 2号楼 621教室 分组报告II-6:(主持人:徐大丰,华东政法大学) 每个报告 40 分钟,其中报告人 30 分钟,点评人各 5 分钟。

时间: 12月20日 09:10-09:50

题 目: 住房公积金与家庭金融资产配置——来自中国家庭金

融调查 (CHFS) 的证据

报告人:周华东,合肥工业大学 点评人1:刘丰,上海社会科学院 点评人2:陈莹莹,上海财经大学

时间: 12月20日 09:50-10:30

题 目: 1999 年大学扩招幅度是否合适——从政策边际强度参数角度的讨论

报 告 人: 曹思力,上海财经大学 点评人 1: 刘丰,上海社会科学院 点评人 2: 陈莹莹,上海财经大学

12月20日 09:10-12:05

茶歇 (10:30-10:45) (2 号楼 5 层休息区)

2 号楼 628 教室

时间: 12月20日 10:45-11:25

题 目: 长寿、人力资本投资与不平等

报告人: 刘丰,上海社会科学院 **点评人 1:** 周华东,合肥工业大学

点评人2: 曹思力, 上海财经大学

时间: 12月20日 11:25-12:05

题 目:信息不对称下的收入分配与社会投资

报告人: 陈莹莹,上海财经大学 **点评人 1:** 周华东,合肥工业大学

点评人2: 曹思力,上海财经大学

分组报告II-7:(主持人:陈海强,厦门大学)每个报告 40 分钟,其中报告人 30 分钟,点评人各 5 分钟。

时间: 12月20日 09:10-09:50

题 目:条件异方差动态 Nelson-Siegel 利率期限结构模型及其应用

报告人:沈根祥,上海财经大学

点评人 1: 刘洋,吉林大学 **点评人 2:** 顾明,厦门大学

时间: 12月20日 09:50-10:30

题 目:房价波纹效应测度及其系统性风险的概率图模型

报告人: 刘洋, 吉林大学

点评人1: 沈根祥, 上海财经大学

点评人 2: 顾明,厦门大学

茶歇(10:30-10:45)(2号楼5层休息区)

12月20日 09:10-11:25

2 号楼 630 教室

时间: 12月20日 10:45-11:25

题 目: Relative Basis and Risk Premia in Commodity Futures Markets

报告人: 顾明, 厦门大学

点评人1: 沈根祥, 上海财经大学

点评人2: 刘洋, 吉林大学

12月20日 09:10-11:25	分组报告II-8:(主持人: 张同斌,东北财经大学) 每个报告 40 分钟,其中报告人 30 分钟,点评人各 5 分钟。 时间:12 月 20 日 09:10-09:50 题目:个体闲暇、家庭责任和主观幸福感报告人:许玲丽,上海大学点评人1:许博宇,华侨大学点评人2:张瑜,中国科学院数学与系统科学研究院 时间:12 月 20 日 09:50-10:30 题目:企业异质性视角下反倾销对中国出口的影响报告人:张瑜,中国科学院数学与系统科学研究院点评人1:许博宇,华侨大学点评人2:许玲丽,上海大学	2 号楼 632 教室
12月20日 12:05-12:20	 闭幕式(主持人: 朱平芳,上海社会科学院) 一、本届论坛承办方致辞 朱平芳,上海社会科学院 二、下届论坛承办方致辞 孙燕,上海财经大学 三、论坛闭幕 	2 号楼 5 层多功 能厅
12月20日 12:20-13:20	午餐	1 号楼 1 层餐厅