

邱哲修

實踐大學財務金融學系 專任教授

學歷：美國密蘇里大學 哥倫比亞校區 經濟學博士
美國愛荷華大學 經濟學碩士
中國文化大學 經濟學學士

經歷：中國科技大學教授，系主任，學群召集人
中國技術學院副教授、系主任
中國工商專科學校副教授、科主任

到校：93年8月1日 ~ 迄今

研究室：L7127

電話：02-25381111#8927

e-mail：jschiou@mail.usc.edu.tw



期刊論文

- 1、Lee, Yen-Hsien, Jer-Shiou Chiou*, Cheng-I Lee, (2016.09), "The Bivariate Component GARCH Approach to Investigating the Relation between VIX and VIX Futures", International Research Journal of Applied Finance, Vol.VII(9), pp.226~239.
- 2、Jer-Shiou Chiou, Bor-Yi Huang, (2015.10), "The Impact of Policy-based Financing and Credit Guarantee Schemes on SME Lending", The Empirical Economics Letters, Vol.14(10), pp.967~977.
- 3、Tang, Hersong, Jer-Shiou Chiou, Oliver Jarsaillon, (2015.05), "Efficacy of Task-Based Learning in a Chinese EFL Classroom: A Case Study", English Language Teaching, Vol.5(8), pp.168-176.
- 4、Lee, Yen-Hsien, Jer-Shiou Chiou, Ming-Chih Lee, Chun-Ta Lee, (2014.05), "The Information Flow of Different Investor Trading under Different Market Conditions and Moneyness", 158(5), pp.126-148.
- 5、Chiou, Jer-Shiou, Wu, Pei-Shan, (2013.04), "Price Discovery in Jump Dynamics between Gold and Oil", The Empirical Economics Letters, Vol.13(4).
- 6、Chiou, Jer-Shiou, Bor-Yi Huang, Pei-Shan Wu, Chun-Ni Tsai, (2012.09), "The Impacts of Diversified Operations on Lending of Financial Institution", Journal of Business Economics and Management, Vol.13(4), pp.587-599.
- 7、Chiou, Jer-Shiou, Pei-Shan Wu, (2012.07), "News Arrival and Volatility Components: Oil and the Stock Markets", African Journal of Business Management, Vol.6(26).
- 8、Chiou, Jer-Shiou, Yi-Chieh Lee, (2011.11), "Efficiency and Profitability on Biotech-Industry in Small Economy", International Journal of Business and Commerce, Vol.1(2).
- 9、Wu, Pei-Shan, Jer-Shiou Chiou*, (2011.09), "Strategic Change for the Banking Industry

- under Financial Innovation”, *The Empirical Economics Letters* , Vol.10(9).
- 10 · Chiou, Jer-Shiou, Pei-Shan Wu, Bor-Yi Huang, (2011.04), “How Derivative Trading Among Banks Impacts SME Lending”, *Interdisciplinary Journal of Research in Business* , Vol.1(4), pp.01-11.
 - 11 · Lee, Yen-Hsien, Jer-Shiou Chiou*, (2011.01), “Oil Sensitivity and its Asymmetric Impact on the Stock Market”, *Energy* , Vol.36(1), pp.168-174.
 - 12 · Chiou, Jer-Shiou*, Pei-Shan Wu, Bor-Yi Huang, (2010.07), “The Influence of Biotechnology R&D Expenditure on Stock Market Valuation”, *The Empirical Economics Letters* , Vol.9(7).
 - 13 · Lee, Yen-Hsien, Hsu-Ning Hu, Jer-Shiou Chiou*, (2010.03), “Jump Dynamics with Structural Breaks for Crude Oil Prices”, *Energy Economics* , Vol.32, pp.343–350.
 - 14 · Chiou, Jer-Shiou*, Yen-Hsien Lee, (2009.06), “Jump Dynamics and Volatility: Oil and the Stock Markets,” *Energy* , Vol.34(6), pp.788-796.
 - 15 · Lin, Yong-Huang, Yun-Wu Wu, Jer-Shiou Chiou*, (2008,12), “The Impacts of Sociopolitical Instability on Construction Dimension,” *Applied Economics Letters* , Vol.15(15), pp.1207-1211.
 - 16 · Chiou, Jer-Shiou*, Yen-Hsien Lee, Cho-Min Lin, (2008.10), “Existence of a Long-run Equilibrium between the S&P 500 and Oil Prices,” *International Research Journal of Finance and Economics* , 21, pp.68-75.
 - 17 · Chiou, Jer-Shiou*, Jui-Cheng Hung, Mei-Maun Hseu, (2008.10), “A VaR Investigation of Currency Composition in Foreign Exchange Reserves,” *International Research Journal of Finance and Economics* , 21, pp.76-92.
 - 18 · Huang, Bor-Yi, Jer-Shiou Chiou*, Pei-Shan Wu, (2007.10), “Abnormal Profitability and Foreign Investment based on the Investigation of Covered Interest Parity,” *Physica A* , Vol.384(2), pp.475-484.
 - 19 · Wu, Pei-Shan, Jer-Shiou Chiou, (2007.09), “Multivariate test of Sharpe-Lintner CAPM with time varying beta,” Vol.3(5), *Applied Financial Economics Letters* , pp.335-341.
 - 20 · Chiou, Jer-Shiou, Lee, Ming-Chih, Jui-Cheng Hung, (2007.09), “A VaR Study of Required Margin for Securities Margin Trading,” *Journal of Statistics & Management Systems*, Vol.10(5), pp.699-714.
 - 21 · Chiu, Chien-Liang, Jer-Shiou Chiou, Pei-Shan Wu, (2007.05), “Restricted VAR Hedging with the Presence of Multiple Breaks,” Vol.10(1), *Zagreb International Review of Economics and Business* , pp.1-9.
 - 22 · Chiou, Jer-Shiou*, Pei-Shan Wu, Antony W. Chang, Bor-Yi Huang, (2007.04), “The Asymmetric Information and Price Manipulation in Stock Market,” *Applied Economics* , Vol.39(7), pp.883-891.
 - 23 · Chiou, Jer-Shiou*, Pei-Shan Wu, Ming-Chih Lee, (2006.11), “Variation of Interest-Rate Parity and Its Asymmetry on Stock Return in a Jump-Diffusion Process,” *Applied Financial Economics* , Vol.16(17), pp.1309-1316.
 - 24 · Lee, Ming-Chih, Jer-Shiou Chiou, Cho-Min Lin, (2006.05), “A Study of Value-at-Risk

- on Foreign Exchange Portfolio Using DCC Multivariate GARCH," *Applied Financial Economics Letters*, V.2(3), pp.183-188.
- 25、Chen, Chun-Da, Ming-chih Lee and Jer-Shiou Chiou, (2005.11), "The Optimal Dynamic Hedging Strategy for Nikkei 225 Index and Futures," *Journal of Statistics & Management Systems*, Vol.8(3), pp.477-491.
- 26、Lee, Ming-chih, Jer-Shiou Chiou, Pei-Shan Wu and Chun-Da Chen, (2005.07), "Hedging with S&P500 and E-mini S&P500 Stock Index Futures," *Journal of Statistics & Management Systems*, Vol.8(2), pp.275-294.
- 27、Chyi-Ing Lin, Jer-Shiou Chiou* and Ben-Chieh Liu, (1999), "Quality, Complementarity and Prices in Japanese Penetration of the U.S. Automobile Market", in *Interlocking Global Business Systems, The Restructuring of Industries, Economies and Capital Markets*, edited by Edward B. Flowers, Thomas P. Chen and Jonchi Shyu, Greenwood Publishing Group Inc., pp.259-273.
- 28、Chyi-Ing Lin, Jer-Shiou Chiou* and Ben-Chieh Liu, (1997), "Product Quality, Gasoline Prices, and Japanese Shares in the U.S. Automobile Market", *International Journal of Business*, Vol 2, (2), pp.61-80.
- 1、邱哲修、黃博怡、羅士宇、林芳如，(102.10)，「信保主管機關改隸對銀行中小企業融資行為的影響」，*創新與管理*，第十卷第三期。
- 2、馬珂，邱哲修，楊家彥，(100.03)，「中國資本市場政策開放對A-H股雙重上市公司溢價影響」，*文大商管學報*，第十六卷第一期。
- 3、黃博怡，邱哲修，孫維儂，(99.06)，「銀行承作中小企業融資業務影響因素的實證分析」，*中小企業發展季刊*，16，經濟部中小企業處，pp.79-108。
- 4、黃博怡，邱哲修，馬珂，葉立仁，(98.06)，「由金融觀點轉向產業思維的台灣中小企業信用保證制度」，*台灣金融財務季刊*，10:2，台灣金融研訓院，pp.67-114。
- 5、黃博怡，邱哲修，王怜又，(96.09)，「S&P500指數與原油價格之動態結構性變化」，*台灣銀行季刊*，58：3，台灣銀行經濟研究室，pp.219-244。
- 6、李命志，邱哲修，張志成，(95.03)，「投資組合選取準則之實證研究-Sharpe Ratio之應用」，*台銀季刊*，第五十七卷第一期，p.89-112。
- 7、邱哲修，林卓民，洪瑞成，徐明傑(94.12)，「價格不連續下的最適避險策略-ARJI模型之應用」，*計量管理期刊*，第二卷第二期，p.189-206。
- 8、邱哲修，林卓民，洪瑞成、柯月華(94.12)，「價格跳躍與避險策略之探討—以道瓊工業指數現貨與期貨為例」，*經營管理論叢*，第一卷第二期，p.93-116。
- 9、林卓民、邱哲修、陳玉瓏、吳佩珊(94.07)，「台灣政府支出與對外投資對經濟成長之影響」，*企銀季刊*，第二十八卷第三期，p.137-154。
- 10、黃博怡、邱哲修、林卓民、陳建宏(94.06)，「短期利率之動態條件變異與預測績效之探討」，*金融風險管理季刊*，第一卷第二期，p.17-32。

- 11、邱哲修、張清模、蕭政行 (94.06),「匯率與利率共整合因果關係之探討」, 貨幣市場, 第九卷第三期, p.1-15。
- 12、邱哲修、林卓民、洪崇譎 (94.04),「原油價格波動性之風險評價與預測績效探討」, 貨幣市場, 第九卷第二期, p.25-46。
- 13、鄭婉秀、邱哲修、陳玉瓏、洪偉哲 (93.12),「亞洲股市價量關係之不對稱效果」, 華岡經濟論叢, 第四卷第一期, p.27-48。
- 14、林卓民、邱哲修、林秀美 (93.10),「即期匯率與遠期匯率之因果關係檢定」, 貨幣市場, 第八卷第五期, p.23-34。
- 15、邱建良、吳佩珊、邱哲修(93.08),「亞洲外匯市場行為之探討-不對稱門檻 GARCH 模型之應用」, 台灣管理學刊, 第四卷第二期, p.187-202。
- 16、黃俊仁、林貞純、邱哲修 (93.07),「影響資訊人員工作滿意因素之分析-以台灣金融業為例之實證研究」, 企銀季刊, 第二十七卷第三期, p.205-232。
- 17、邱建良、邱哲修、魏志良 (93.06),「TAIFEX 與 MSCI 台股指數期貨與現貨直接避險策略之研究」, 商管科技季刊, 第五卷第二期, p.169-184。
- 18、李命志、邱哲修、李英萇、鄭婉秀 (93.01),「利率價差對國際匯價走勢之影響」, 朝陽商管評論, 第三卷第一期, p.55-76。
- 19、邱哲修、林卓民、陳玉瓏、林君黛 (92.12),「股票市場報酬率之緩長記憶—亞洲開發中國家股票市場之研究」, 真理財經學報, 第九期, p29-52。
- 20、陳玉瓏、邱哲修、林秀美 (92.10),「外匯市場之長期均衡與短期動態」, 貨幣市場, 第七卷第五期, p.31-46。
- 21、李命志、邱哲修、黃景明 (92.09),「台灣股價指數期貨最適避險策略之研究」, 企業管理學報, 第五十八期, p.85-104。
- 22、鄭婉秀、邱建良、李命志、邱哲修 (92.03),「歐元地區即期與遠期匯率動態關連性之探討—不對稱性門檻 GARCH 模型之應用」, 輔仁管理評論, 第十卷第一期, p.147-162。
- 23、邱建良、李命志、邱哲修 (92.02),「即期匯率與遠期匯率之動態關聯性」, 亞太社會科技學報, 第二卷第二期, p.75-99。
- 24、邱哲修、李命志 (92.02),「緩長記憶在國際匯率模型上之應用」, 貨幣市場, 第七卷第一期, p.13-29。