



2009年經濟學卓越營記略[#]

蔡文禎*

一、前言

國科會為使國內研究人員與經濟學國際知名學者密切交流，並在國際學術界逐步佔有一席之地，於2001年、2002年、2004年委託中央研究院經濟研究所、2007年由台灣大學經濟學系規劃一系列的研習營課程，邀請具有國際聲望的學者，分別在2001年暑假、2002年寒假、2002年暑假、2004年暑假、2007年寒假與2007年暑假等，來台進行一至二週的短期訪問，同時並教授6至12小時的高階學程。這些研習營對國內學者研究水準的提升，有莫大的助益。為延續此一精神，2009年國科會委託中央研究院經濟研究所再次舉辦經濟學卓越研究營，計畫主持人為中央研究院經濟研究所蔡文禎教授、葉俊顯教授及台灣大學經濟學系王泓仁教授；本次計畫共邀請六位國際知名學者來訪，分別是Michigan State University的John D. Wilson教授、Boston College的Arthur Lewbel教授、University of Southern California的Vincenzo Quadrini教授、Rice University的Hervé Moulin教授、Columbia University的Lena Edlund教授，以及Cornell University的Michael Waldman教授。涵蓋的領域包括公共經濟、經濟計量、總體經濟、個體經濟、人口、健康及勞動等領域。此次研習營每位學者訪問台灣約一星期，期間講演六小時的課程，除了能有充足的時間讓國內外學者互相討論外，我們更期望研究營的舉辦，能藉由這些學者們在課堂上點出的研究方向與傳授研究技巧，帶動國內年輕學者和博士班學生的研究品質。

二、邀請學者與授課內容：

(一) John D. Wilson (2009年6月2日、2009年6月5日)

Wilson教授為租稅理論專家，現任教於美國Michigan State University經

[#] 本計畫推行跨越約一年半的時間。如果加計協調及討論時間，整個過程近約兩年。

* 中央研究院經濟研究所研究員

濟學系。主要研究領域包含 International Trade、Microeconomic Theory、Public Economics、Urban Public Economics。其論文散見於 *American Economic Review*、*Econometrica*、*Journal of International Economics*、*Journal of Political Economy*、*Journal of Public Economics* 等知名期刊。目前並擔任 *International Tax and Public Finance* 主編，以及 *Economics & Politics*、*FinanzArchiv*、*Journal of Public Economic Theory* 副主編。此外，Wilson 教授並曾獲選為 CESifo Research Network Fellow、International Research Fellow of Oxford University Centre for Business Taxation。

Wilson 教授的第一場演講主題是租稅競爭。租稅競爭是指各政府間以非合作的方式各自訂定租稅；依定義嚴謹度的不同，包含水平租稅競爭 (horizontal tax competition)、垂直租稅競爭 (vertical tax competition) 與標竿租稅競爭 (yardstick tax competition) 三種不同狀況。租稅競爭的基準模型是假設經濟體中有多個同質的小型政府、可移動的資本與不可移動的勞工兩項生產要素，以及採用固定規模報酬生產函數的多個競爭公司；公司可將產出賣給該區居民成為消費財，或是賣給政府成為公共財；在考慮賦稅後，求解代表性居民對兩項財貨的效用函數得到最適值。此解會產生低稅率與低公共財供應的無效率狀況。延伸此基準模型的狀況有多種，包括考慮政府有大小之分、勞工可移動、產品貿易、多種賦稅工具等狀況。此次演講著重水平租稅競爭，並討論了對資本的競爭及公司間互相競爭的影響。

第二場演講探討在租稅競爭下的最適財政聯邦制 (optimal fiscal federalism)，並探討各級政府間如何分配徵稅及支出的權力問題，得到的結論是部分分權有其必要。而針對租稅天堂 (tax havens) 與租稅競爭 (tax competition)，Wilson 教授也做了一番講解，包括租稅天堂的定義與其影響。租稅天堂是指提供低稅率或免稅給非該國居民，以進行避稅的特殊的經濟領域或法域 (jurisdiction)；在此狀況下租稅天堂依附其他國家的收益為生，但該國政府會採取額外方式避免本國公司進行租稅移轉。雖然在模型中，設定的條件是資本可移動、勞工不可移動，但考慮薪資所得同樣可以避稅下，勞動與資本必須同樣放入模型中求得最適稅率。最後得到的結論是：減少或消除租稅天堂，可以讓非租稅天堂的國家福利提升；小國會因對其有利而選擇成為租稅天堂；少數幾個租稅天堂大國若是能不再進行此活動，將可使包括他們自己與其他國家都變得更好。



(二) Arthur Lewbel (2010 年 1 月 26 日、2010 年 1 月 29 日)

Arthur Lewbel 教授為個體經濟計量學家，現任教於美國 Boston College 經濟學系，主要研究領域為 Econometrics 與 Applied Microeconomics，論文主要發表於 *American Economic Review*、*Econometrica*、*Journal of Econometrics*、*Journal of Political Economy*、*Review of Economics and Statistics* 等頂尖期刊，並曾先後擔任 *Econometric Theory*、*Journal of Business and Economic Statistics*、*Journal of Applied Econometrics*、*Journal of Econometrics* 等期刊之共同主編或副主編。此外，Lewbel 教授亦於 2000 年獲選為 Fellow of the Journal of Econometrics，2003 年獲選為 Fellow of the Econometric Society，2005 年獲頒 Inaugural Holder of the Boston College Roche Chair in Economics，以及 2008 年獲得 Multa Scripsit Econometric Theory Award。

Lewbel 教授的演講主題是探討非參數與半參數估計方法 (nonparametric and semiparametric estimation methods)，並著重於其在計量理論中的演進與觀念。一般而言，如果資料可明確知道它的分配函數，我們可以用參數估計法 (parametric estimation method) 進行估計；在此類研究範疇中，待估計參數只允許為有限的維度。但是在一般狀況下，我們其實並沒有理論引導我們預知資料本身真正的分配函數為何，這時可以利用非參數估計法 (nonparametric estimation method) 進行估計；這個方法是由統計學發展而來，好處是以統計觀點來看，處理資料時我們並不需要理論模型，不過此方法在模型維度 (變數) 增加時，估計的資料量與資料複雜度會出現幾何倍數的成長，這個缺點稱為「維度的詛咒」(curse of dimensionality)。因此，綜合上述參數及非參數估計法的半參數估計法 (semiparametric estimation method) 近來在經濟計量文獻中有廣泛的討論與應用，它的特點就是在較參數估計模型更為廣泛的架構下，仍允許資料生成過程中含有需以無限維度參數刻劃的部分，但在估計上側重於以有限維度參數表述的函數部分。研究目標著重克服非參數估計法的不便之處，但同時保有其描繪資料的彈性。

Lewbel 教授以任一單維隨機變數作為假設的開端，介紹非參數估計模型的估計方法，以及不同 kernel 對估計參數的影響，並探討估計參數的不偏性 (unbiasedness)、一致性 (consistency)、收斂速度 (convergent rate) 與其漸進分配模型 (asymptotic distribution)，再延伸到如何降低估計參數偏誤、多維隨機變數的狀況與改變 bandwidth 對估計結果的影響等。在講解了非參數估計

模型後，再介紹半參數估計模型，因為大部分半參數估計模型的參數估計式，仍需仰賴非參數估計模型的估計技巧，以控制無限維度函數對有限維度函數的估計影響。之後，針對一般的半參數估計模型的估計方法、不同估計方法的比較，以及估計參數的不偏性、一致性、收斂速度與其漸進分配模型，詳細說明其直觀的想法及證明的要點，並舉二項選擇模型（binary choice model）為例及進行延伸。由於半非參數估計模型的可能應用非常廣泛，且國內相關研究學者並不多，Lewbel 教授的演講吸引不少國內研究者的參與。

（三）Vincenzo Quadrini（2010 年 6 月 7 日、2010 年 6 月 10 日）

Vincenzo Quadrini 教授是總體經濟學家，任教於 University of Southern California，主要研究領域包括 Macroeconomics 及 International Finance，並有多篇論文發表於 *American Economic Review*、*Journal of Economic Theory*、*Journal of Political Economy* 及 *Review of Economic Studies* 等重要期刊。Vincenzo Quadrini 教授目前亦擔任 *Economic Inquiry* 共同主編、*Review of Economic Dynamics* 副主編及 *Quantitative Economics* 副主編。

Quadrini 教授的演講主題是 Adding Financial Frictions in Macroeconomic Models。目前財務金融上對金融磨擦（financial friction）的動態設定已多有討論，總體經濟學探討景氣循環的主要方法，也是由此磨擦延伸而來，尤其是 2007 年起的金融危機，更讓我們認知到應該看重財務部門（financial sector）在總體經濟模型中的地位。以往文獻中，財務部門是配角，經濟衝擊由其他部門引起，財務部門只是直接或間接受到影響，例如討論在生產面受到衝擊時，不完全的財務市場將會如何受到影響等；這部分最早由 Bernake 與 Gertler（1989）進行研究。Kiyotaki 與 Moore（1997）則是提供了另一個角度將財務部門納入一般均衡模型。以上兩者為近二十年來總體經濟學對財務部門的處理，但此次演講則以財務部門為主角，尤其側重由財務部門所引起的衝擊，並討論這樣的看法如何能解釋近年的金融風暴。

Quadrini 教授以兩篇論文說明以上論點：在模型設定上，Jermann 與 Quadrini（2009）把金融磨擦與信用衝擊（credit shock）加入實質景氣循環模型（real business cycle）中，觀察生產面與信用衝擊對總體經濟會造成什麼樣的波動，並做模擬校準（calibration）測試理論結果。Perri 與 Quadrini 則將模型中的參與者分為投資者與勞動者兩部分，設定不同的效用函數與折現因子，求得均衡解，並討論在信用擴張與信用緊縮時財務部門均衡的改變。綜合以



上得到的結論是：加入財務部門的磨擦與衝擊後，可以讓我們清楚了解一些財務項目的變動（financial flow）為何會與總體經濟變數連動、勞動市場為何對整體市場財務狀況改變有如此明顯反應。他的演講適時指出高度連動的國際金融市場對這次美國經濟衰退的影響，以及金融自由化可能會降低總體經濟的穩定度與提高金融危機的機率等議題，讓我們省思面對現今高度發展的國際資本市場，何種政策及制度設計方可以維繫經濟的穩定與繁榮的迫切性。

（四）Hervé Moulin（2010年6月22日、2010年6月24日）

Hervé Moulin 教授為資深之個體經濟學家，目前任教於 Rice University，為 George Peterkin Professor of Micro Economic Theory，主要研究範疇為 Microeconomics、Game Theory 及 Social Choice 等，論文散見於 *Econometrica*、*Games and Economic Behavior*、*Journal of Economic Theory*、*Journal of Public Economics*、*Quarterly Journal of Economics*、*Review of Economic Studies* 等國際知名期刊，並先後擔任 *Games and Economic Behavior*、*International Journal of Game Theory*、*Journal of Mathematical Economics*、*Journal of Public Economic Theory*、*Mathematical Social Sciences*、*Social Choice and Welfare* 等期刊之主編或副主編。Hervé Moulin 教授曾得之重要學術獎項有：Fellow of the Econometric Society（since 1983）、President of the Society for Social Choice and Welfare（1998-1999）及 Game Theory Society, Council Member（since 2000）。

Moulin 教授的第一場演講主題是 Clearing Supply and Demand in a One-dimensional Economy。在某些市場中，交易並無法由貨幣移轉（monetary transfer）達成（例如交易無法分割的物品、醫療市場勞動分配、學校選擇、購屋位置選擇等可以配對問題（matching problem）解決的問題）；在缺乏價格作為訊號的狀況下，如果存在一個集中式的機制（centralized mechanism）可以無偏誤的得到所有有興趣參與者的私有資訊，並達成一個有效率的結果，將可以是除了雙方協議（bilateral agreements）外的另一種市場結清（market clearing）方法。因此，模型假設為一個沒有貨幣的經濟體，且只有一種無法儲存、無法分割、且無法移轉的商品，目標是設計出一個具有有效移轉（efficient transfer）、公平、誘因相容（incentive compatible）特色的市場結清機制（clearing-house mechanism），能平衡供需兩方。最後的結論是平等交換機制（egalitarian transfers mechanism）符合此結果。

Moulin 教授的第二場演講主題是 Incentive-compatible Utilization of a Commons。此議題是探討無法以誘因相容機制平衡預算的狀態下，如何在計算出個人偏好最差的狀況下，找出相對不平衡最小值的方法。Moulin 教授以兩種分配問題進行討論，其一是分派一種（或多種）物品的問題，另一個是共同分擔報酬遞減技術的成本問題。

（五）Lena Edlund（2010 年 7 月 20 日、2010 年 7 月 22 日）

Lena Edlund 教授為勞動及人口經濟學家，任教於 Columbia University，研究領域主要為 Labor, and Gender Economics，且有多篇論文發表於 *American Economic Review*、*Journal of Political Economy*、*Quarterly Journal of Economics* 等著名期刊。Edlund 教授目前並擔任 *Economica* 副主編。

Edlund 教授的講題是 Marriage, Reproduction and Son Preference，以多篇她所發表的論文研究結果來講述所觀察到的現象，包括婚姻型態、生產與性別選擇、生子偏好等。Edlund 教授的研究特色之一是以敏銳的視角，觀察我們周遭容易被忽略的日常生活模式，加上她充足的國際視野，針對不同國家與民族的採樣，使我們看到國際比較中突顯出來的人類行為的多樣性。加上她精彩的經濟分析，成功透析出婚姻選擇、男女地位、生產、收養等權利義務的許多不同構面的意涵。例如婦女因結婚所讓渡或與先生分享的子女監護權的經濟分析，以及各種不同婚姻制度如一妻多夫或其他制度的形成原因。從她的演講可看出其研究一貫的細膩形式，以及對研究所付出的心力。

Edlund 教授除了以經濟觀點考慮生育問題，如是否生育外，也對性別比進行研究，特別是針對中國在實施一胎化政策後所造成的嚴重失衡問題加以分析。東方社會因文化的關係，向來較偏重生子而不重生女，尤其是中國，在一胎化之下，女嬰數目遠低於自然情況下的結果，其中更有相當數量被送養。Edlund 教授也對被送養的女兒，以及文化與政策所引起的一連串社會、婚姻、移民等問題做了詳細探討。

（六）Michael Waldman（2010 年 10 月 19 日、2010 年 10 月 21 日）

Michael Waldman 教授為應用個體經濟學者，目前任教於 Cornell University，為該校 Charles H. Dyson Professor in Management，主要研究領域為 Industrial Organization、Labor Economics，以及 Organizational Economics，論文發表於 *American Economic Review*、*Journal of Political Economy*、*Quarterly Journal of Economics* 及 *Review of Economic Studies* 等傑出期刊，並



先後擔任 *Journal of Economic Perspectives* 共同主編、*Quarterly Journal of Economics* 副主編、與 *Journal of Labor Economics* 主編。Michael Waldman 教授於 2003 年獲得 Cornell University Johnson School's Faculty Research Award、2008 年獲得 Robert F. Lanzillotti Prize for the Best Paper in Antitrust Economics。

Waldman 教授的演講主題是 Durability Choice and “Killing Off” Second-hand Markets: Classic and Modern Approaches 與 Akerlof's Market for Lemons: A Seminal Analysis in Durable Goods Theory。我們熟知在競爭市場下，可以得到效率產出水準，但產出水準所延伸的問題我們卻很少關心。Waldman 教授以一個競爭市場的基本模型開始說明，導入到耐久財 (durable goods) 市場的無效率性，以及介紹消除此無效率的方法。基本模型考慮在市場無效率的情形下，如果有一個新的市場訂價模式可以消除這樣的扭曲，則這個訂價方式將會被採用，並將會使消費者與整體社會效用增加。舉例來說，在 Akerlof 的反向選擇問題中的二手車交易，若引進新車租用的方式則可消除市場無效率。另外，與耐久財相關的後市 (aftermarket) 問題也會造成效率扭曲；後市是指與此耐久財互補的產品或服務，例如維修保固或是使用這個耐久財必須用到的產品的更換。Waldman 教授解釋為何在競爭的耐久財市場中，生產者可以藉由壟斷後市，以減少消費者對該產品的維護決策所產生的無效率性，並舉美國柯達公司 (Kodak) 的傳統相機與軟片為例。

三、心得分享及結語

2009 經濟卓越營總報名人次為 247 人，成員背景大多為國內各院校相關科系的教授與博士班學生，以及國內經濟相關研究機構的研究人員，許多資深學者也積極參與，其中有些學者遠從中南部兩度專程前來，在沒有國科會補助其國內差旅費的情形下，這些熱情參與顯示受邀學者的研究成果對於參與學員有相當的吸引力。

卓越營除了知識的交流之外，也是讓國際知名學者深入了解台灣的重要平台。藉由國外學者大約一周的停留時間，卓越營不僅提供國內參與學者有較多的時間與受邀學者交流，同時也透過這些參與學者的熱心投入，在討論或用餐之際，深入介紹台灣的地理人情，學術雄心。長此以往將使得國內外的學術對話直接有效率，更為未來的國際合作紮下根基。

卓越營的功能多樣，但其經營並不容易。開辦之前，我們主辦三人得到

多位國內學者的熱心幫助，除了花費相當時間與我們開會討論適當人選外，並在多次（數十次）被候選人拒絕接受邀訪後，這些學者仍持續為我們三人提供新的人選名單，其中有些學者並為我們熱心接待這些國際講員。卓越營得以圓滿完成，他們的功勞實不可沒。

讀者如果參閱六位演講者的訪台時間可以清楚看出計畫推行跨越約一年半的時間。如果加計上述的協調及討論時間，整個過程近約兩年，幾乎超過原先規劃執行期間的一倍。原因很容易理解，也與前期卓越營主持人台灣大學經濟學系劉錦添教授的看法一致，我們提供給國際講員的補助遠低於國際行情。明確來說，此期每位演講者需講演近六小時的課程，這相當於四次的一般專題演講時間。但我們補助的金額扣除機票外，每位訪員每天所得的生活費扣稅後，大概不到兩百美金，再去掉必須的住宿費後，所餘多少大家可以想像，再加上我們希望能找到具有相當國際知名度的學者為我們開課，被拒數十次也就不奇怪了。

此期經濟學卓越營計畫的完成，得到台灣大學經濟學系及中央研究院經濟研究所的大力協助，而周建富系主任及彭信坤所長是此期計畫圓滿達成的重要功臣之一，其提供了相當的行政支援，在此一併致謝。中央研究院經濟研究所的簡錦漢研究員為當時國科會經濟學門召集人，他不僅催生此次計畫，也投注相當心力協助完成，也在此感謝。

本計畫研討會網頁請見：<http://econcamp.econ.sinica.edu.tw/>。