

淡江大學 98 學年度第 1 學期課程教學計畫表

科目名稱：隨機微積分 (Stochastic Calculus)

授課教師：

劉威漢 E-mail: liuwh2002@gmail.com

Tel: (02)26215656#2783

研究室：B923

開課班級：財務金融所

學分數：必修 上學期 3 學分

教材課本：

Iacus, Stefano M. 2008. *Simulation and Inference for Stochastic Differential Equations With R Examples*: Springer.

Mikosch, Thomas. 1999. *Elementary Stochastic Calculus with Finance in View*: World Scientific.

Lefebvre, Mario. 2007. *Applied Stochastic Process*: Springer.

Stirzaker, David. 2005. *Stochastic Processes and Models*: Oxford University Press.

教學內容及進度：

- Stochastic Processes
- Stochastic Integral
- Stochastic Differential Equation
- Applications of Stochastic Calculus in Finance

授課方式：課堂講授、電腦軟體操作(會視學生學習狀況適度調整進度)

會視學生學習狀況適度調整進度，惟非誠勿試。

痛恨數學，或不慣於準時到課學習者，選課時請慎重考慮。

成績考核方式：

作業與平常成績：20% (到課情況與習題抽點演練成績)

期中成績：40%

期末考成績：40%