

淡江大學 99 學年度第 1 學期課程教學計畫表

課程名稱	隨機微積分	授課 教師	王仁和 Wang, Ren-he
	STOCHASTIC CALCULUS		
開課系級	財金一碩士班 A	開課 資料	必修 單學期 3學分
	TBBMM1A		
學 系(門) 教 育 目 標			
以完整進階的財務金融課程，培養具獨立分析、判斷與解決問題的財務專業人才。			
學 生 基 本 能 力			
A. 培養進階財務金融理論的知識。 B. 提升應用理論與實務技巧。 C. 加強邏輯推演的能力。 D. 財金研究方法的學習與運用。 E. 具備表達、組織與應用能力。 F. 強化學生溝通與解決問題的能力。 G. 提升考取高階財金專業證照之能力。 H. 具備學術未來深造的潛力。			
課程簡介	本課程教授在財務工程時所需要的數學工具與相關理論。教授的內容包括：一般機率論、布朗運動、隨機微積分、風險測度定價理論及與PDE方法的相關性。		
	This course seeks to survey the underlying mathematics that will be encountered in application with option pricing. It draws from the following areas of mathematics: General probability theory, Brownian motion, Stochastic Calculus, Risk-neutral pricing and Connections with PDE.		

本課程教學目標與目標層級、學生基本能力相關性

一、目標層級(選填)：

- (一)「認知」(Cognitive 簡稱C)領域：C1 記憶、C2 瞭解、C3 應用、C4 分析、C5 評鑑、C6 創造
- (二)「技能」(Psychomotor 簡稱P)領域：P1 模仿、P2 機械反應、P3 獨立操作、P4 聯結操作、P5 自動化、P6 創作
- (三)「情意」(Affective 簡稱A)領域：A1 接受、A2 反應、A3 重視、A4 組織、A5 內化、A6 實踐

二、教學目標與「目標層級」、「學生基本能力」之相關性：

- (一)請先將課程教學目標分別對應前述之「認知」、「技能」與「情意」的各目標層級，惟單項教學目標僅能對應C、P、A其中一項。
- (二)若對應「目標層級」有1~6之多項時，僅填列最高層級即可(例如：認知「目標層級」對應為C3、C5、C6項時，只需填列C6即可，技能與情意目標層級亦同)。
- (三)再依據所訂各項教學目標分別對應該系「學生基本能力」。單項教學目標若對應「學生基本能力」有多項時，則可填列多項「學生基本能力」(例如：「學生基本能力」可對應A、AD、BEF時，則均填列)。

序號	教學目標(中文)	教學目標(英文)	相關性	
			目標層級	學生基本能力
1	學生熟悉隨機微積分的計算及其應用，並能計算其各式選擇權定價。	Students will be familiar with stochastic calculus and be able to solve several options pricing.	P4	ACH

教學目標之教學策略與評量方法

序號	教學目標	教學策略	評量方法
1	學生熟悉隨機微積分的計算及其應用，並能計算其各式選擇權定價。	課堂講授	期中考、期末考

授課進度表

週次	日期	內容 (Subject/Topics)	備註
1	09/13	General Probability Theory	
2	09/20	General Probability Theory	
3	09/27	Information and Conditioning	
4	10/04	Information and Conditioning	
5	10/11	Brownian Motion	
6	10/18	Brownian Motion	
7	10/25	Brownian Motion	
8	11/01	Stochastic Calculus	
9	11/08	Stochastic Calculus	

10	11/15	Midterm Exam.	
11	11/22	Stochastic Calculus	
12	11/29	Stochastic Calculus	
13	12/06	Risk-Neutral Pricing	
14	12/13	Risk-Neutral Pricing	
15	12/20	Risk-Neutral Pricing	
16	12/27	Connections with Partial Differential Equations	
17	01/03	Connections with Partial Differential Equations	
18	01/10	Final Exam.	
修課應 注意事項			
教學設備		電腦、投影機	
教材課本		Stochastic Calculus for Finance II: Continuous-Time Models. Author: Steven E. Shreve.	
參考書籍		Options, Futures, and Other Derivatives, (7th Edition). Author: John C. Hull.	
批改作業 篇數		篇（本欄位僅適用於所授課程需批改作業之課程教師填寫）	
學期成績 計算方式		◆平時考成績：10.0 % ◆期中考成績：40.0 % ◆期末考成績：50.0 % ◆作業成績： % ◆其他〈 〉： %	
備 考		「教學計畫表管理系統」網址： http://info.ais.tku.edu.tw/csp 或由教務處 首頁〈網址： http://www.acad.tku.edu.tw/index.asp/ 〉教務資訊「教學計畫 表管理系統」進入。 ※非法影印是違法的行為。請使用正版教科書，勿非法影印他人著作，以免觸法。	