

企管系 98 學年度博士班「隨機過程與決策研究」教學計畫表

科目代碼	BM77700
科目名稱	隨機過程與決策研究
必選修	選修
授課老師	林達榮/陳啟斌
開課班級	國際企業學系
學分數	3
每週授課時數	3
校內分機	3051
教師電子郵件	tjlin@mail.ndhu.edu.tw
教師辦公室	共 B322
會談時間	星期三 9:00-12:00
課程助教	待公佈
助教電子郵件	公佈於教學網頁中
助教工作項目	
課程目標	<ol style="list-style-type: none"> 1. 連續時間隨機過程導讀與論文研讀 2. 離散時間隨機過程導讀與論文研讀 3. 企業專案價值評估導讀 4. 數理模型開發導引
教學方法	<ol style="list-style-type: none"> 1. 上課講解 2. 論文研讀 3. Term paper 提交 4. 期末報告
教學評量	<ol style="list-style-type: none"> 1. Term paper 50% 2. Final report 25% 3. 論文研讀 15% 4. 出席率 10%
課堂教材	<ol style="list-style-type: none"> 1. Financial in Continuous Time: A Primer (Shimko D.C.), 1992 2. Real Options: A Practitioner's Guide (Copeland T./ Antikarov V.), 2001. 3. Paper reading/TBA
其他教材	補充教材公布於教學網頁
作業備註	補充教材公布於教學網頁
其他標題	教學網頁:TBA
其他內容	家族版: TBA

教學預定規劃

週次	日期	進度	重要事項
1	2009/09/16	● 課程簡介	● Introduction
2	2008/09/23	● 連續時間隨機過程(1)	● Discrete and Continuous Models
3	2008/10/30	● 連續時間隨機過程(2)	● Frequently Occurring Continuous Stochastic Processes ● Ito's Lemma and Its Multivariate Extensions
4	2008/10/07	● 連續時間隨機過程(3)	● An introduction to Jump Process ● Simple Financial Applications of Ito's Lemma (1)
5	2008/10/14	● 連續時間隨機過程(4)	● Simple Financial Applications of Ito's Lemma (2)
6	2008/10/21	● 論文研讀(1)/TBA	●
7	2008/10/28	● 論文研讀(2)/TBA	●
8	2008/11/04	● 論文研讀(3)/TBA	●
9	2008/11/11	● Term Paper (1)	● 停課/提交期中報告
10	2008/11/18	● 離散時間隨機過程(1)	● Comparing Net Present Value, Decision Trees, and Real Options (1)
11	2008/11/25	● 離散時間隨機過程(2)	● Comparing Net Present Value, Decision Trees, and Real Options (2)
12	2008/12/02	● 離散時間隨機過程(3)	● Comparing Net Present Value, Decision Trees, and Real Options (3)
13	2008/12/09	● 離散時間隨機過程(4)	● Comparing Net Present Value, Decision Trees, and Real Options (4)
14	2008/12/16	● 論文研讀(4)/TBA	●
15	2008/12/23	● 論文研讀(5)/TBA	●
16	2008/12/30	● 論文研讀(6)/TBA	●
17	2009/01/06	● Term Paper (2)	
18	2009/01/13	● Final report	● 停課/提交期末報告

以上課程內容與進度依修課者背景彈性調整