



Asignatura: Métodos Numéricos
Código: 30068
Centro: Ciencias
Titulación: Máster en Matemáticas y Aplicaciones
Nivel: Máster M2
Tipo: Optativa
Nº de créditos: 8

ASIGNATURA / COURSE TITLE

Métodos Numéricos / [Numerical Methods](#)

1.1. Código / [Course number](#)

30068

1.2. Materia / [Content area](#)

Métodos Numéricos / [Numerical Methods](#)

1.3. Tipo / [Course type](#)

Formación Optativa / [Elective subject](#)

1.4. Nivel / [Course level](#)

Máster Nivel M2/ [Master M2](#)

1.5. Curso / [Year](#)

2014/2015

1.6. Semestre / [Semester](#)

Primero / [First \(Fall semester\)](#)

1.7. Idioma / [Language](#)

Español e inglés. (El curso se podrá impartir en inglés siempre y cuando, al menos, un alumno internacional matriculado en la asignatura lo solicite). / [Spanish and English. \(The course can be taught in English if at least one officially registered international student requests so\).](#)

1.8. Requisitos previos / [Prerequisites](#)



Asignatura: Métodos Numéricos
Código: 30068
Centro: Ciencias
Titulación: Máster en Matemáticas y Aplicaciones
Nivel: Máster M2
Tipo: Optativa
Nº de créditos: 8

Son necesarios unos conocimientos básicos de análisis numérico y de ecuaciones en derivadas parciales y análisis funcional, por lo que es altamente recomendable haber cursado los respectivos cursos de la licenciatura o grado.

A basic level on the theory of Ordinary Differential Equations, Partial Differential Equations, Functional Analysis and Numerical Analysis is required. It is highly recommended that the student have followed the corresponding courses.

1.9. Requisitos mínimos de asistencia a las sesiones presenciales / **Minimum attendance requirement**

La asistencia a clase es muy recomendable. / **It is strongly recommended to attend class regularly.**

1.10. Datos del equipo docente / **Faculty data**

Docente(s) / **Lecturer(s)** Julia Novo Martín
Departamento de / **Department of** Matemáticas
Facultad / **Faculty** Ciencias
Despacho - Módulo / **Office - Module** 306 Módulo 17
Teléfono / **Phone:** +34 91 497 40 74
Correo electrónico/**Email:** julia.novo@uam.es
Página web/**Website:** <http://portal.uam.es/portal/page/profesor/epd2>
Horario de atención al alumnado/**Office hours:** 10:00 a 17:00

1.11. Objetivos del curso / **Course objectives**

Este curso está pensado para graduados en matemáticas o ingeniería con un nivel básico en teoría de Ecuaciones Diferenciales Ordinarias, Ecuaciones en Derivadas Parciales, Análisis Funcional y Análisis Numérico. Nos centraremos en entender tanto las técnicas clásicas como las modernas para desarrollar métodos numéricos eficientes que aproximan las soluciones de ecuaciones en derivadas parciales.

This course is designed for graduate mathematicians or engineers with a basic level on the theory of Ordinary Differential Equations, Partial Differential Equations, Functional Analysis and Numerical Analysis. We will focus on the understanding of both classic and modern techniques for the development of efficient numerical methods to approximate the solutions of partial differential equations.



Asignatura: Métodos Numéricos
Código: 30068
Centro: Ciencias
Titulación: Máster en Matemáticas y Aplicaciones
Nivel: Máster M2
Tipo: Optativa
Nº de créditos: 8

1.12. Contenidos del programa / **Course contents**

1. Métodos en Diferencias Finitas

1.1) Métodos en Diferencias Finitas para ecuaciones parabólicas en una variable espacial.

1.2) Consistencia, estabilidad y convergencia.

1.3) Métodos en Diferencias Finitas para ecuaciones hiperbólicas en una dimensión espacial.

1.4) El Teorema de Equivalencia de Lax.

1.5) Ecuaciones parabólicas en dos y tres dimensiones. Problemas no lineales.

2. Métodos de elementos finitos.

2.1) Soluciones débiles a problemas elípticos.

2.2) Aproximación de problemas elípticos.

2.3) Construcción de espacios de elementos finitos.

2.4) Implementación práctica del método de los elementos finitos.

2.5) Análisis de error a priori.

2.6) Problemas de evolución.

2.7) Simulaciones de fluidos incomprensibles con métodos de elementos finitos.

2.8) Estimaciones del error a posteriori.

2.9) Métodos estabilizados para problemas de convección-difusión donde domina el término de convección.

3. Introducción a los métodos espectrales

3.1) Cuestiones generales.

3.2) Problemas periódicos. Métodos de Fourier.

3.3) Problemas no periódicos. Métodos de Legendre y Chebyshev.

4. Métodos numéricos para finanzas.



Asignatura: Métodos Numéricos
Código: 30068
Centro: Ciencias
Titulación: Máster en Matemáticas y Aplicaciones
Nivel: Máster M2
Tipo: Optativa
Nº de créditos: 8

1. Finite Difference Methods

- 1.1) Finite difference methods for parabolic equations in one space variable.
- 1.2) Consistency, stability and convergence.
- 1.3) Finite difference methods for hyperbolic equations in one space dimension.
- 1.4) The Lax Equivalence Theorem.
- 1.5) Parabolic equations in two and three dimensions. Non-linear problems.

2. Finite element methods

- 2.1) Weak solutions to elliptic problems.
- 2.2) Approximation of elliptic problems.
- 2.3) Construction of finite element spaces.
- 2.4) Practical implementation of the finite element method.
- 2.5) A priori error analysis.
- 2.6) Evolutionary problems.
- 2.7) Incompressible flow simulations with finite element methods.
- 2.8) A posteriori error estimations.
- 2.9) Stabilized methods for convection-dominated convection-diffusion problems.

3. An introduction to spectral methods

- 3.1) General questions.
- 3.2) Periodic problems. Fourier methods.
- 3.3) Non-periodic problems. Legendre and Chebyshev methods.

4. Numerical methods for finance.



Asignatura: Métodos Numéricos
Código: 30068
Centro: Ciencias
Titulación: Máster en Matemáticas y Aplicaciones
Nivel: Máster M2
Tipo: Optativa
Nº de créditos: 8

1.13. Referencias de consulta / Course bibliography

S. Brenner & R. Scott, The Mathematical Theory of Finite Element Methods, Springer-Verlag, 1994.

C. Canuto, M. Y. Hussaini, A. Quarteroni & T. A. Zang, Spectral Methods in Fluid Dynamics, Springer-Verlag, 1988.

K. W. Morton & D. F. Mayers, Numerical Solution of Partial Differential Equations, Cambridge University Press, Cambridge, 1994.

A. Quarteroni & A. Valli, Numerical Approximation of Partial Differential Equations, Springer Series in Computational Mathematics, 1997.

J. C. Strikwerda, Finite Difference Schemes and Partial Differential Equations, Wadsworth, Pacific Grove, 1989.

E. Suli & D. Mayers, An introduction to Numerical Analysis, Cambridge University Press, 2003.

2. Métodos docentes / Teaching methodology

Clases presenciales. Las clases teóricas se complementarán con clases prácticas en las que se hará uso del programa MATLAB.

Theoretical classes will be complemented with practical lessons using the computer program MATLAB.

3. Tiempo de trabajo del estudiante / Student workload

		Nº de horas	
Presencial	Clases teóricas	40h(20%)	70h (35%)
	Clases prácticas	10 h (5%)	
	Tutorías	8 h (4%)	
	Examen final	2 h (1%)	



Asignatura: Métodos Numéricos
Código: 30068
Centro: Ciencias
Titulación: Máster en Matemáticas y Aplicaciones
Nivel: Máster M2
Tipo: Optativa
Nº de créditos: 8

		Nº de horas	
	Seminarios y trabajos	10h (5%)	
No presencial	Elaboración de problemas	78h(39%)	130h (65%)
	Estudio semanal	46h(23%)	
	Preparación del examen	6h(3%)	
Carga total de horas de trabajo: 25 horas x 8 ECTS		200 h	

4. Métodos de evaluación y porcentaje en la calificación final / Evaluation procedures and weight of components in the final grade

Convocatoria ordinaria:

Realización de trabajos en MATLAB que ilustren los métodos abordados en el curso (70%). Entrega de ejercicios (5%), grado de participación en clase (5%). Examen (20%).

EVALUACIÓN EXTRAORDINARIA / Make up exam:

Examen ante tribunal de Máster/ Examination by a committee.

5. Cronograma* / Course calendar

Semana Week	Contenido Contents	Horas presenciales Contact hours	Horas no presenciales Independent study time
1	Tema 1	4	8
2	Tema 1	4	8
3	Tema 1	4	8
4	Tema 1	4	8
5	Tema 2	4	8
6	Tema 2	4	8
7	Tema 2	4	8
8	Tema 2	4	8



Asignatura: Métodos Numéricos
Código: 30068
Centro: Ciencias
Titulación: Máster en Matemáticas y Aplicaciones
Nivel: Máster M2
Tipo: Optativa
Nº de créditos: 8

Semana Week	Contenido Contents	Horas presenciales Contact hours	Horas no presenciales Independent study time
9	Tema 2	4	8
10	Tema 2	4	8
11	Tema 3	4	8
12	Tema 3	4	8
13	Tema 3	4	12
14	Tema 4	4	12
15-16	Evaluaciones	14	10

*Este cronograma tiene carácter orientativo.