



## FICHA IDENTIFICATIVA

### DATOS DE LA ASIGNATURA

**Código:** 42203

**Nombre:** Cálculo numérico en finanzas

**Ciclo:** Máster Universitario Oficial

**Créditos ECTS:** 6

**Curso académico:** 2025-26

### TITULACIONES

Titulación	Centro	Curso	Periodo
2081 - Máster Universitario en Banca y Finanzas Cuantitativas	Facultat d'Economia	1	Anual

### MATERIAS

Titulación	Materia	Carácter
2081 - Máster Universitario en Banca y Finanzas Cuantitativas	Materias obligatorias	OBLIGATORIA

### COORDINACIÓN

BENITEZ SUAREZ RAFAEL

## RESUMEN

El objetivo de esta materia es la adquisición de los conocimientos, habilidades y destrezas necesarios para resolver problemas numéricos en finanzas mediante un ordenador.

## CONOCIMIENTOS PREVIOS

### RELACIÓN CON OTRAS ASIGNATURAS DE LA MISMA TITULACIÓN

No se han especificado restricciones de matrícula con otras asignaturas del plan de estudios.

### OTROS TIPOS DE REQUISITOS

Relación con otras asignaturas de la misma titulación:

Los estudiantes deberían haber cursado las asignaturas de Matemáticas y Estadística, Procesos Estocásticos. Los conocimientos adquiridos y las herramientas desarrolladas son útiles para otras asignaturas obligatorias de la titulación, como Derivados, Valoración de Activos, y Gestión de



Riesgos.

Otros tipos de requisitos:

No se han especificado restricciones de matrícula con otras asignaturas del plan de estudios.

## COMPETENCIAS / RESULTADOS DE APRENDIZAJE

## DESCRIPCIÓN DE CONTENIDOS

### 1. Tema 1. Introducción a la programación en Matlab

null

### 2. Tema 2. Introducción al cálculo numérico

Errores numéricos y su propagación  
Sistemas de ecuaciones lineales  
Autovalores y autovectores  
Ceros de funciones  
Interpolación y extrapolación  
Ajuste y aproximación de funciones  
Optimización  
Cuadraturas y diferencias numéricas  
Métodos Montecarlo para cuadratura

### 3. Tema 3. Simulación en finanzas

Métodos Montecarlo para simulación  
Simulación en modelos discretos  
Simulación continua: ecuaciones diferenciales estocásticas  
Series temporales

### 4. Tema 4. Ecuaciones diferenciales ordinarias: métodos explícitos e implícitos

Algunos conceptos básicos: interpretación geométrica de la derivadas y el desarrollo en serie de Taylor.

Resolución numérica de las ecuaciones diferencias ordinarias:

- Método de Euler adelantado (explícito)
  - Método de Euleratrasado (implícito)
  - Método del punto medio.
  - Métodos de Runge-Kutta
- Reducción del orden y un sistema de ecuaciones diferenciales ordinarias.  
Análisis de errores y estabilidad.



## 5. Tema 5. Ecuaciones en derivadas parciales: métodos explícitos e implícitos

Clasificación de las ecuaciones en derivadas parciales lineales de segundo orden.

Condiciones iniciales y de contorno.

Representación en diferencias finitas de la ecuación hiperbólica en derivadas parciales (ecuación de advección):

- a) Método adelantado en el tiempo y centrado en el espacio (método explícito).
- b) Análisis de la estabilidad: método de Von Neumann.
- c) Método de Lax
- d) Análisis de estabilidad: condición Courant-Friedrichs-Lewy
- e) Método de salto escalonado.

Representación en diferencias finitas de la ecuación parabólica en derivadas parciales (ecuación de difusión):

- a) Método adelantado en el tiempo y centrado en el espacio (método explícito).
- b) Métodos implícitos:
  - i. Método implícito completo.
  - ii. Método de Crank-Nicholson (descomposición LU y método SOR).

## 6. Tema 6. La ecuación de Black-Scholes

Derivación de la ecuación de Black-Scholes.

Análisis de la contribución asociada a la difusión y advección en la ecuación de Black-Scholes.

Principales aproximaciones en la ecuación de Black-Scholes.

Condiciones de contorno y condiciones iniciales/finales en la ecuación de Black-Scholes.

Diferentes payoffs en la ecuación de Black-Scholes: opciones europeas y americanas.

Derivación analítica de la solución de la ecuación de Black-Scholes.

Extensiones de la ecuación de Black-Scholes.

## 7. Tema 7. Implementación en diferencias finitas de la ecuación de Black-Scholes

Métodos explícitos:

- a) Derivación de la representación en diferencias finitas del método explícito.
- b) Implementación de diferentes condiciones de contorno.
- c) Errores globales y locales.
- d) Análisis de la estabilidad (método von Neumann).

Métodos implícitos:

- a) Derivación de la representación en diferencias finitas del método implícito completo.
- b) Método de Crank-Nicholson.

Filosofía de un nuevo método.

Esquema de Douglas.



## 8. Tema 8. Otros métodos numéricos

Filosofía de un nuevo método.  
Métodos de tres niveles temporales: Du-Fort Frankel.  
Extrapolación de Richardson.  
Opciones americanas.

### VOLUMEN DE TRABAJO (HORAS)

#### ACTIVIDADES PRESENCIALES

Actividad	Horas
Teoría	30,00
Prácticas en aula	15,00
Aula informática	15,00
<b>Total horas</b>	<b>60,00</b>

#### ACTIVIDADES NO PRESENCIALES

Actividad	Horas
Asistencia a otras actividades	0,00
Elaboración de trabajos individuales o en grupo	0,00
Estudio y trabajo autónomo	0,00
Preparación de clases	0,00
Preparación de actividades de evaluación	0,00
Resolución de casos prácticos	0,00
<b>Total horas</b>	<b>0,00</b>

### METODOLOGÍA DOCENTE

Clase magistral, prácticas en aula y prácticas con ordenador.

### EVALUACIÓN

Los aspectos que se utilizarán en la evaluación del progreso del alumno son las siguientes:

- La participación activa en clases y laboratorios.
- La entrega de hojas de problemas, ejercicios y proyectos de ordenador.
- La realización de un examen final.

### BIBLIOGRAFÍA



- M. T. Heath (2001) Scientific Computing: An Introductory Survey, 2nd. ed. McGraw-Hill. P. Glasserman (2003): Monte Carlo Methods in Financial Engineering Springer-Verlag. P. Wilmott, S. Howison, and J. Dewinne (1996) The mathematics of Financial Derivatives Cambridge University Press.
- C.-E. Fröberg (1985) Numerical Mathematics. Theory and Computer Applications. Addison-Wesley. W.H. Press, S. A. Teukolsky, W. T. Vetterling and B. P. Flannery, (1992) Numerical Recipes in C: The art of Scientific Computing Paul Wilmott (1999) Derivatives: The theory and Practice of Financial Engineering John Wiley and Sons NY J. Michael Steele Stochastic Calculus and Financial Applications, Springer Verlag; (2000) P. J. Brockwell and R. A. Davies (1996) Introduction to Time Series and Forecasting Springer-Verlag. P. J. Brockwell and R. A. Davies (1991) Time Series: Theory and Methods J. D. Hamilton (1994) Time series analysis Princeton University Press, Princeton. J.C. Hull (2000) Options, Futures and other derivatives Prentice Hall. G.D. Smith (1985) Numerical solution of partial differential equations: Finite difference methods, Clarendon Press, Oxford.