

Rezolvarea ecuațiilor și sistemelor de ecuații diferențiale ordinare

Prof.dr.ing. Gabriela Ciuprina

Universitatea "Politehnica" București, Facultatea de Inginerie Electrică

Suport didactic pentru disciplina *Metode numerice*, 2017-2018

Cuprins

- 1 Ecuări diferențiale ordinare
 - Formularea problemei
 - Metoda Euler
 - Exemplu

- 2 Sisteme de ecuații diferențiale ordinare
 - Formularea problemei
 - Metode θ
 - Metode de ordin superior

Notes

Notes

Ecuatie diferențială ordinară (ODE)

Se dau

$$f : \mathbb{R} \times [t_0, T] \rightarrow \mathbb{R} \quad x_0 \in \mathbb{R}$$

Se cere

$$x : [t_0, T] \rightarrow \mathbb{R}$$

care satisface

$$\frac{dx}{dt} = f(x(t), t) \quad (1)$$

$$x(t_0) = x_0 \quad (2)$$

Notes

Ecuatie diferențială ordinară (ODE)

Se dau

$$f : \mathbb{R} \times [t_0, T] \rightarrow \mathbb{R} \quad x_0 \in \mathbb{R}$$

Se cere

$$x : [t_0, T] \rightarrow \mathbb{R}$$

care satisface

$$\frac{dx}{dt} = f(x(t), t) \quad (1)$$

$$x(t_0) = x_0 \quad (2)$$

Problemă cu o valoare inițială

Notes

Ecuație diferențială ordinară (ODE)

Metoda numerică va furniza un tabel de valori:

t_0	t_1	t_2	\cdots	t_n
x_0	x_1	x_2	\cdots	x_l

unde $t_n = T$

Obs:

- De multe ori t reprezintă *temp* și se poate considera $t_0 = 0$;
 - Vom nota: $x(t)$ soluția exactă și x_i aproximarea ei

$$x_j \approx x(t_j)$$

- În cele ce urmează vom pp: $t_i - t_{i-1} = h \Leftrightarrow t_k = t_0 + jh$

Metoda Euler explicită

Dezvoltarea în serie Taylor în jurul lui t_0

$$x(t_j + h) = x(t_j) + \frac{h}{1!}x'(t_j) + \frac{h^2}{2!}x''(t_j) + \dots \quad (3)$$

Formula Taylor

$$x(t_j + h) = x(t_j) + \frac{h}{1!}x'(t_j) + \frac{h^2}{2!}x''(\zeta) \quad (4)$$

$$x(t_i + h) = x(t_i) + hf(x(t_i), t_i) + O(h^2) \quad (5)$$

Dacă am presupune că valoarea la iterația j a fost calculată exact $x_i = x(t_i)$ atunci

$$x(t_i + h) \equiv x_i + hf(x_i, t_i) + O(h^2) \quad (6)$$

Notes

Metoda Euler explicită

Dacă am presupune că valoarea la iterată j nu este afectată de erori $x_j = x(t_j)$ atunci

$$x(t_j + h) = x_j + hf(x_j, t_j) + O(h^2)$$

Dacă adoptăm ca formulă de calcul (Euler explicit)

$$x_{j+1} = x_j + hf(x_j, t_j) \quad (7)$$

atunci *eroarea locală* la iterată j este

$$e_I = |x(t_{j+1}) - x_{j+1}| = O(h^2) \quad (8)$$

Metoda Euler explicită

Dacă am presupune că valoarea la iterată j nu a fost calculată exact $x(t_j) = x_j + e_{x_j}$ atunci

$$x(t_j + h) = x_j + e_{x_j} + hf(x_j, t_j) + O(h^2)$$

Dacă adoptăm ca formulă de calcul (Euler explicit)

$$x_{j+1} = x_j + hf(x_j, t_j) \quad (9)$$

atunci *eroarea locală* este

$$e_{x_{j+1}} = |x(t_{j+1}) - x_{j+1}| = e_{x_j} + O(h^2) \quad (10)$$

Notes

Notes

Metoda Euler explicită

Eroarea globală este eroarea la ultimul moment de timp

$$\begin{aligned} e_g &= |x(t_n) - x_n| = e_{x_n} + O(h^2) = e_{x_{n-1}} + O(h^2) + O(h^2) = \\ &= nO(h^2) = \frac{T - t_0}{h} O(h^2) = O(h) \end{aligned} \quad (11)$$

Notes

Metoda Euler explicită

O altă variantă de deducere a relației de calcul

$$\frac{dx}{dt} = f(x(t), t) \quad (12)$$

- Se scrie ecuația la momentul de timp discret t_j ;
- Pentru derivată: **formulă de diferențe finite progresive de ordinul 1**

$$\frac{x_{j+1} - x_j}{h} = f(x_j, t_j) \Rightarrow \quad (13)$$

$$x_{j+1} = x_j + hf(x_j, t_j) \quad (14)$$

Notes

Metoda Euler explicită

O altă variantă de deducere a relației de calcul

$$\frac{dx}{dt} = f(x(t), t) \quad (12)$$

- Se scrie ecuația la momentul de timp discret t_j ;
- Pentru derivată: **formulă de diferențe finite progresive de ordinul 1**

$$\frac{x_{j+1} - x_j}{h} = f(x_j, t_j) \Rightarrow \quad (13)$$

$$x_{j+1} = x_j + hf(x_j, t_j) \quad (14)$$

Folosirea seriei Taylor este utilă pentru estimarea erorii de trunchiere.

Metoda Euler explicită - algoritm

```
procedură Euler_explicit (xinit,t0,T,h,x)
real xinit
real t0, T
real h
n = [(T - t0)/h]
tabou real t[n + 1]
tabou real x[n + 1]
t0 = t0
x0 = xinit
pentru j = 0, n - 1
    xj+1 = xj + hf(xj, tj)
    tj+1 = tj + h
•
return
```

Notes

Notes

Metoda Euler implicită

Derivata: formulă de diferențe finite regresive de ordinul 1

$$\frac{dx}{dt} = f(x(t), t) \quad (15)$$

$$\frac{x_j - x_{j-1}}{h} = f(x_j, t_j) \Rightarrow \quad (16)$$

$$x_j = x_{j-1} + hf(x_j, t_j) \quad (17)$$

Notes

Metoda Euler implicită

Derivata: formulă de diferențe finite regresive de ordinul 1

$$\frac{dx}{dt} = f(x(t), t) \quad (15)$$

$$\frac{x_j - x_{j-1}}{h} = f(x_j, t_j) \Rightarrow \quad (16)$$

$$x_j = x_{j-1} + hf(x_j, t_j) \quad (17)$$

Relația este implicită, la fiecare pas se rezolvă o ecuație algebrică neliniară pentru determinarea mărimii x_j

Metoda Euler implicită

Notes

Metoda Euler implicită

Derivată: formulă de diferențe finite regresive de ordinul 1

$$\frac{dx}{dt} = f(x(t), t) \quad (15)$$

$$\frac{x_j - x_{j-1}}{h} = f(x_j, t_j) \Rightarrow \quad (16)$$

$$x_j = x_{j-1} + hf(x_j, t_j) \quad (17)$$

Relația este implicită, la fiecare pas se rezolvă o ecuație algebrică neliniară pentru determinarea mărimii x_j

Metoda Euler implicită

Și în acest caz

$$e_I = O(h^2) \quad e_g = O(h)$$

Metoda Euler implicită

$$x_j = x_{j-1} + hf(x_j, t_j) \quad (18)$$

Ecuația neliniară de rezolvat: $F(x) = 0$, unde

$$F(x) = x - x_{j-1} - hf(x, t_j)$$

• Iterații simple:

$$x^{(n)} = x^{(v)} + cF(x^{(v)}) \quad \text{aici} \quad x^{(n)} = x_j^{(n)} \quad x^{(v)} = x_j^{(v)}$$

$$x_j^{(n)} = x_j^{(v)} + c(x_j^{(v)} - x_{j-1} - hf(x_j^{(v)}, t_j))$$

De exemplu, dacă $c = -1$

$$x_j^{(n)} = x_{j-1} + hf(x_j^{(v)}, t_j))$$

Notes

Metoda Euler implicită

$$x_j = x_{j-1} + hf(x_j, t_j) \quad (18)$$

Ecuația neliniară de rezolvat: $F(x) = 0$, unde

$$F(x) = x - x_{j-1} - hf(x, t_j)$$

- Newton:

$$x^{(n)} = x^{(v)} + cF(x^{(v)}) \quad \text{aici} \quad x^{(n)} = x_j^{(n)} \quad x^{(v)} = x_j^{(v)}$$

$$c = -1/F'(x^{(v)}) \quad \text{unde} \quad F'(x) = 1 - h\frac{\partial f}{\partial x}(x, t_j)$$

$$x_j^{(n)} = x_j^{(v)} - \frac{x_j^{(v)} - x_{j-1} - hf(x_j^{(v)}, t_j)}{1 - h\frac{\partial f}{\partial x}(x_j^{(v)}, t_j)}$$

Metoda Euler implicită

- La fiecare pas de timp se rezolvă o ecuație neliniară;
- Initializarea rezolvării ecuației neliniare - de exemplu cu soluția de la Euler explicit;
- Eroarea și numărul maxim admis de iterații pentru procedura neliniară - trebuie să fie parametri de intrare pentru Euler implicit;
- Dacă f este o funcție liniară, atunci $F(x) = 0$ este o ecuație liniară, soluția se poate calcula explicit.
- Metoda Euler este o metodă într-un pas, de ordinul 1.**
Metoda într-un pas = valoarea la un moment de timp se calculează în funcție de o valoare la un singur moment de timp anterior;
Ordinul metodei = se referă la ordinul erorii globale, aici $e_g = O(h)$.

Metoda Euler implicită

```
procedură Euler_implicit (xinit,t0,T,h,err,maxit,x)
real xinit
real t0, T
real h
real err
întreg maxit
n = [(T - t0)/h]
tablou real t[n + 1]
tablou real x[n + 1]
t0 = t0
x0 = xinit
....
```

Metoda Euler implicită

```
procedură Euler_implicit (xinit,t0,T,h,err,maxit,x)
....
pentru j = 0, n - 1
    xn = xj + hf(xj, tj) ; inițializare ca la Euler explicit
    ; iteratii simple (c=1)
    k = 0
    repetă
        xv = xn
        xn = xj + hf(xv, tj)
        k = k + 1
        d = |xv - xn|
    până când (d < err) sau k > maxit
    dacă k > maxit scrie procedura neliniară neconvergentă
    tj+1 = tj + h
    xj+1 = xn
return
sau cu Newton:
```

Notes

Notes

Metoda Euler implicită

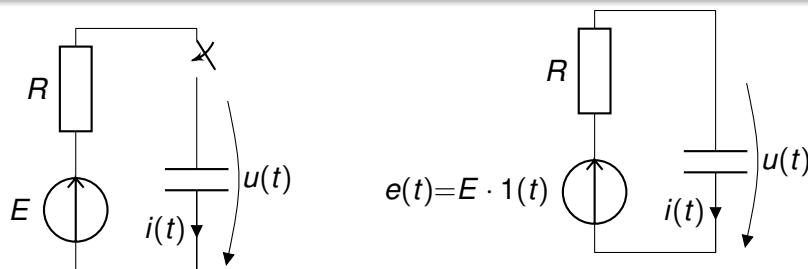
```

procedură Euler_implicit (xinit,t0,T,h,err,maxit,x)
.....
pentru  $j = 0, n - 1$ 
     $xn = x_j + hf(x_j, t_j)$  ; initializare ca la Euler explicit
    ; Newton
     $k = 0$ 
    repetă
         $xv = xn$ 
         $xn = x_j - (xv - x_{j-1} - hf(xv, t_j)) / (1 - h \cdot fder(xv, t_j))$ 
         $k = k + 1$ 
         $d = |xv - xn|$ 
    până când ( $d < err$ ) sau  $k > maxit$ 
    dacă  $k > maxit$  scrie procedura neliniară neconvergentă
     $t_{j+1} = t_j + h$ 
     $x_{j+1} = xn$ 
return

```

Notes

Exemplu



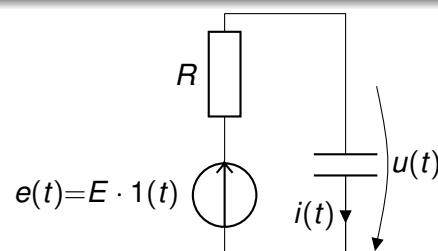
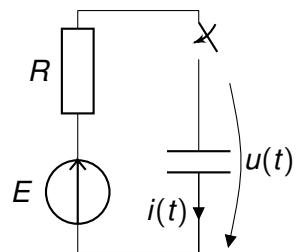
$$C = 4\mu\text{F}, E = 20 \text{ mV}, R = 10 \Omega, u(0) = 0.$$

$$Ri(t) + u(t) = E \quad i(t) = C \frac{du(t)}{dt}, \quad (19)$$

$$RC \frac{du(t)}{dt} + u(t) = E. \quad u(0) = u_0 = 0. \quad (20)$$

Notes

Exemplu



Soluție analitică

$$u(t) = (u_0 - E) \exp(-t/\tau) + E. \quad (19)$$

unde $\tau = RC$ este constanta de timp a circuitului.

Exemplu

Ecuția (20) o rescriem ca

$$\frac{du(t)}{dt} + \frac{1}{\tau} u(t) = \frac{1}{\tau} E. \quad (20)$$

Vom urmări calculul numeric în intervalul de timp $[0, t_{max}]$ unde $t_{max} = 10\tau$ într-o rețea echidistantă de N puncte t_k , unde **pasul de discretizare h** este

$$t_{k+1} - t_k = h, \quad \text{pentru } k = 1, \dots, N-1. \quad (21)$$

Vom nota valorile discrete obținute prin rezolvare numerică cu u_k . Ele vor fi aproximări ale mărimii reale u .

$$u_k \approx u(t_k). \quad (22)$$

Notes

Notes

Exemplu

$$\frac{du(t)}{dt} + \frac{1}{\tau} u(t) = \frac{1}{\tau} E. \quad (23)$$

Varianta I - Euler explicit (dif. finite progresive de ord. 1)

$$\frac{u_{k+1} - u_k}{h} + \frac{1}{\tau} u_k = \frac{1}{\tau} E, \quad (24)$$

$\Rightarrow u_{k+1}$ poate fi calculată explicit cu formula

$$u_{k+1} = u_k \left(1 - \frac{h}{\tau} \right) + \frac{h}{\tau} E. \quad (25)$$

Exemplu

$$u_{k+1} = u_k \left(1 - \frac{h}{\tau} \right) + \frac{h}{\tau} E. \quad (26)$$

```

procedură euler_explicit_RC(u0,E,tau,h,N,u)
; rezolvă ecuația  $\frac{du(t)}{dt} + \frac{1}{\tau} u(t) = \frac{1}{\tau} E$  cu metoda diferențelor finite
; d/dt se discretizează folosind diferențe progresive de ordinul 1
real u0 ; condiția inițială - dată
real E ; coeficient în ecuație - dată
real tau ; constantă de timp - dată
real h ; pas de discretizare al intervalului de timp - dat
intreg N ; număr de valori de timp - dat
tablou_real u[N] ; soluția discretă - rezultat
u(1)=u0
pentru k = 1..N-1
    u(k+1) = u(k)*(1-h/tau) + h*E/tau
•
return

```

Această metodă, este instabilă pentru $h > \tau$.

Notes

Notes

Exemplu

$$\frac{du(t)}{dt} + \frac{1}{\tau} u(t) = \frac{1}{\tau} E. \quad (27)$$

Varianta a II-a - Euler implicit (dif. finite regresive de ord. 1)

$$\frac{u_k - u_{k-1}}{h} + \frac{1}{\tau} u_k = \frac{1}{\tau} E, \quad (28)$$

$\Rightarrow u_k$ poate fi calculată explicit:

$$u_k = \left(u_{k-1} + \frac{h}{\tau} E \right) / \left(1 + \frac{h}{\tau} \right). \quad (29)$$

Notes

Exemplu

$$\frac{du(t)}{dt} + \frac{1}{\tau} u(t) = \frac{1}{\tau} E. \quad (27)$$

Varianta a II-a - Euler implicit (dif. finite regresive de ord. 1)

$$\frac{u_k - u_{k-1}}{h} + \frac{1}{\tau} u_k = \frac{1}{\tau} E, \quad (28)$$

$\Rightarrow u_k$ poate fi calculată explicit:

$$u_k = \left(u_{k-1} + \frac{h}{\tau} E \right) / \left(1 + \frac{h}{\tau} \right). \quad (29)$$

În acest caz nu este nevoie de rezolvarea unei ecuații neliniare

Notes

Exemplu

$$u_k = \left(u_{k-1} + \frac{h}{\tau} E \right) / \left(1 + \frac{h}{\tau} \right). \quad (30)$$

```

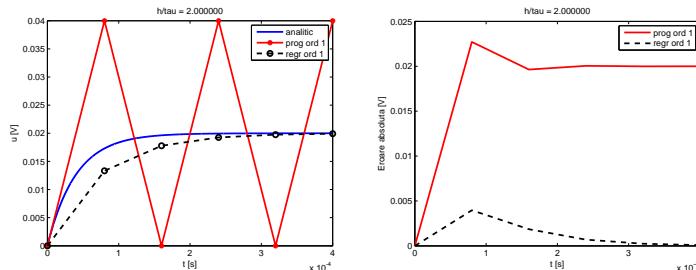
procedură euler_implicit_RC(u0,E,tau,h,N,u)
; rezolvă ecuația  $\frac{du(t)}{dt} + \frac{1}{\tau} u(t) = \frac{1}{\tau} E$  cu metoda diferențelor finite
; d/dt se discretizează folosind diferențe regresive de ordinul 1
real u0 ; condiția initială - dată
real E ; coeficient în ecuație - dată
real tau ; constantă de timp - dată
real h ; pas de discretizare al intervalului de timp - dată
intreg N ; număr de valori de timp - dat
tablou real u[N] ; soluția discretă - rezultat
u(1) = u0
pentru k = 2,N
    u(k) = (h*E/tau + u(k-1))/(1 + h/tau)
• return

```

Notes



Exemplu

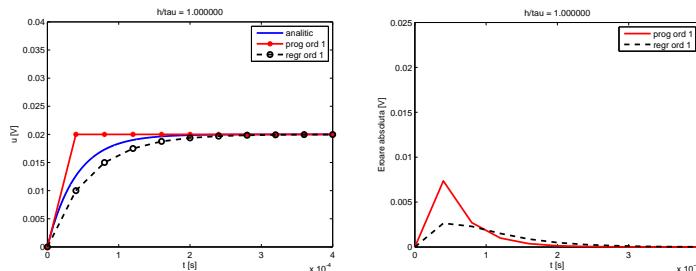


Cazul $h = 2\tau$.

Notes



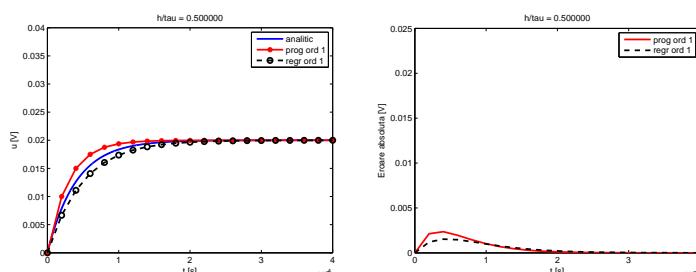
Exemplu



Cazul $h = \tau$.

Notes

Exemplu



Cazul $h = \tau/2$.

Notes

Formularea problemei

Se dau

$$\mathbf{f} : \mathbb{R}^n \times [t_0, T] \rightarrow \mathbb{R}^n \quad \mathbf{x}_0 \in \mathbb{R}^n$$

Se cere

$$\mathbf{x} : [t_0, T] \rightarrow \mathbb{R}^n$$

care satisface

$$\mathbf{x}'(t) = \mathbf{f}(\mathbf{x}(t), t), \quad (31)$$

$$\mathbf{x}(t_0) = \mathbf{x}_0 \quad (32)$$

unde de exemplu $\mathbf{f}(\mathbf{x}(t), t) = \mathbf{A}\mathbf{x}(t) + \mathbf{B}\mathbf{u}(t)$, iar \mathbf{A} și \mathbf{B} sunt date

Metode în m pași

Axa timpului se discretizează în momente discrete: t_0, t_1, t_2, \dots , și se calculează aproximări \mathbf{x}_n ale soluției necunoscute $\mathbf{x}(t_n)$

$$\mathbf{x}_n \approx \mathbf{x}(t_n). \quad (33)$$

O metodă generală în m pași aproximează soluția la un moment discret t_{n+m} în funcție de soluțiile obținute în **m pași anterioari** $t_n, t_{n+1}, \dots, t_{n+m-1}$:

$$\sum_{i=0}^m \rho_i \mathbf{x}_{n+i} = h \sum_{i=0}^m \sigma_i \mathbf{f}(\mathbf{x}_{n+i}, t_{n+i}) \quad (34)$$

unde $h = t_{n+m} - t_{n+m-1}$.

Notes

Metode în m pași

$$\sum_{i=0}^m \rho_i \mathbf{x}_{n+i} = h \sum_{i=0}^m \sigma_i \mathbf{f}(\mathbf{x}_{n+i}, t_{n+i}), \quad (35)$$

unde $h = t_{n+m} - t_{n+m-1}$.

$\rho_m = 1$, iar coeficienților ρ_i și σ_i sunt aleși astfel încât procedeul să fie convergent.

- Dacă $\sigma_m = 0$, atunci calculul valorii noi x_{n+m} se face explicit;
- Dacă $\sigma_m \neq 0$, atunci calculul valorii noi x_{n+m} se face implicit și necesită rezolvarea unei ecuații algebrice, în general neliniare.

Metode într-un pas

Metode într-un pas: $m = 1$

$$-\mathbf{x}_n + \mathbf{x}_{n+1} = h [\sigma_0 \mathbf{f}(\mathbf{x}_n, t_n) + \sigma_1 \mathbf{f}(\mathbf{x}_{n+1}, t_{n+1})], \quad (36)$$

unde $\rho_0 = -1$ din motive de convergență.

Dacă notăm $\sigma_0 = \theta$ și $\sigma_1 = 1 - \theta$, aceste metode cu un pas se numesc **metode θ** .

In particular, și renotând n cu $k - 1$, există următoarele scheme de calcul celebre

Notes

Metode într-un pas - metode θ

- Metoda Euler explicită (sau progresivă) $\theta = 1$:

$$\mathbf{x}_k = \mathbf{x}_{k-1} + h\mathbf{f}(\mathbf{x}_{k-1}, t_{k-1}) \quad (37)$$

unde $h = t_k - t_{k-1}$. (Derivata din sistemul de ecuații:
diferențe finite progresive de ordinul 1).

- Metoda Euler implicită (sau regresivă) $\theta = 0$:

$$\mathbf{x}_k = \mathbf{x}_{k-1} + h\mathbf{f}(\mathbf{x}_k, t_k) \quad (38)$$

unde $h = t_k - t_{k-1}$. (Derivata din sistemul de ecuații:
diferențe finite regresive de ordinul 1.)

- Metoda trapezelor $\theta = 1/2$:

$$\mathbf{x}_k = \mathbf{x}_{k-1} + \frac{h}{2} (\mathbf{f}(\mathbf{x}_{k-1}, t_{k-1}) + \mathbf{f}(\mathbf{x}_k, t_k)) \quad (39)$$

unde $h = t_k - t_{k-1}$.

Metode într-un pas - metode θ

Justificarea numelui metodei trapezelor.

$$\mathbf{x}(t) = \int_{t_0}^t \mathbf{f}(\mathbf{x}(t'), t') dt'. \quad (40)$$

Considerând momentele discrete t_{k-1} și t_k are loc

$$\mathbf{x}(t_k) = \int_{t_0}^{t_{k-1}} \mathbf{f}(\mathbf{x}(t), t) dt + \int_{t_{k-1}}^{t_k} \mathbf{f}(\mathbf{x}(t), t) dt. \quad (41)$$

Schema de calcul va înlocui valorile exacte cu unele
aproximative, în consecință

Notes

Notes

Metode într-un pas - metode θ

$$\mathbf{x}_k = \mathbf{x}_{k-1} + I, \quad (42)$$

unde I reprezinta o aproximare pentru integrala $\int_{t_{k-1}}^{t_k} \mathbf{f}(\mathbf{x}(t), t) dt$.

Dacă \mathbf{f} - funcție scalară \rightarrow cea mai simplă aproximare a integralei = aria trapezului corespunzător intervalului $[t_{k-1}, t_k] \rightarrow (39)$.

Metoda trapezelor este de ordinul 2.

Notes

Metode într-un pas de ordin superior

Dacă pentru I se aleg scheme numerice mai rafinate și mai eficiente, care conduc la iterații în timp de tipul

$$\mathbf{x}_k = \mathbf{x}_{k-1} + h \sum_{j=1}^{\nu} b_j \mathbf{f}(\mathbf{x}(t_{k-1} + c_j h), t_{k-1} + c_j h). \quad (43)$$

Într-o astfel de formulă, valorile $\mathbf{x}(t_{k-1} + c_j h)$ nu sunt cunoscute. Aproximarea lor prin combinații liniare ale unor valori calculate succesiv conduce la scheme de tip **Runge-Kutta** cu ν etape.

Notes

Metode multi-pas de ordin superior

O altă variantă a schemelor multipas date de (35) este cea în care $\sigma_i = 0$ pentru orice $i < m$.

Se numesc scheme **BDF** (*backward differentiation formula*):

$$\sum_{i=0}^{m-1} \rho_i \mathbf{x}_{n+i} + \mathbf{x}_{n+m} = h \sigma_m \mathbf{f}(\mathbf{x}_{n+m}, t_{n+m}) \quad (44)$$

unde $h = t_{n+m} - t_{n+m-1}$.

Renotând $n + m$ cu k , modul de calcul al soluției la iterația k în funcție de m pași anterioari este

$$\mathbf{x}_k - h \sigma_m \mathbf{f}(\mathbf{x}_k, t_k) = - \sum_{i=0}^{m-1} \rho_i \mathbf{x}_{k-m+i} \quad (45)$$

Lectură obligatorie

• Cap.10 din

[1] Gabriela Ciuprina, Mihai Rebican, Daniel Ioan - Metode numerice in ingineria electrica - Indrumar de laborator pentru studentii facultatii de Inginerie electrica, Editura Printech, 2013, disponibil la http://mn.lmn.pub.ro/indrumar/IndrumarMN_Printech2013.pdf

Notes

Notes
