

Apunts d'Equacions diferencials ordinàries

ALEIX TORRES I CAMPS

PAU MARTÍN (P.MARTIN@GMAIL.COM), MARCEL GUARDIA I RAFAEL RAMÍREZ

Índex

1	Tema 1: Introducció i definicions bàsiques	2
1.1	Sistemes autònoms i no autònoms	2
1.2	Problema de Cauchy o problema de valors inicials	3
1.3	Interpretació geomètrica d'una e.d.o	3
1.4	Exemples importants	3
2	Sistemes lineals d'e.d.o.'s	4
2.1	Motivació	4
2.2	Propietats elementals	4
2.3	E.d.o's lineals unidimensionals	5
2.4	Sistemes lineals de dimensió qualsevol (finita)	7
2.4.1	Sistemes homogenis	7
2.4.2	Sistemes no homogenis	10
2.4.3	Sistemes lineals amb coeficients constants	11

1 Tema 1: Introducció i definicions bàsiques

Definició 1. Una equació diferencial és una equació que involucra una funció incògnita i les seves derivades.

Exemple 1. Alguns exemples d'equacions diferencials:

1. $y(x), x \in \mathbb{R}$ amb $y''(x) - y(x) = 0$
2. $y''(x) = -\sin(y(x))$
3. $y''(x) = -\sin(y(x)) + \cos(x)$
4. $\frac{\delta^2 z}{\delta x^2} + \frac{\delta^2 z}{\delta y^2} = 0$ on la incògnita és una funció de dues variables $z(x, y)$.

Definició 2. Una e.d.o. és una equació diferencial de la forma:

1. Forma implícita: $g(x, y(x), \dots, y^{(n)}(x)) = 0$ on la incògnita és una funció $y(x) = (y_1(x) \dots y_m(x))^t$ d'una variable unidimensional x . Per tant, $g : U \subset \mathbb{R} \times (\mathbb{R}^m)^{n+1} \rightarrow \mathbb{R}^m$.
2. Forma explícita: $y^{(n)}(x) = f(x, y(x), \dots, y^{(n-1)}(x))$. Ara $f : V \subset \mathbb{R} \times (\mathbb{R}^m)^n \rightarrow \mathbb{R}^m$

Nota 2. A partir d'ara treballarem amb només la forma explícita. La qual abreviarem com $y^{(n)} = f(x, y, \dots, y^{(n-1)})$

Definició 3. Direm que $\varphi : (a, b) \rightarrow \mathbb{R}^m$ és una solució si φ és n vegades derivable i:

$$\varphi^{(n)}(x) = f(x, \varphi(x), \dots, \varphi^{(n-1)}(x)), \forall x \in (a, b)$$

Implícitament demantarem que:

$$\{(x, \varphi(x), \dots, \varphi^{(n-1)}(x)) | x \in (a, b)\} \subset \text{Dom } f$$

La solució general és el conjunt de totes les seves solucions.

Definició 4. Es diu que l'e.d.o. $y^{(n)} = f(x, y, \dots, y^{(n-1)})$ on $y = (y_1 \dots y_m)^t$ és un sistema d'e.d.o.'s de m components, d'ordre n .

Nota 3. Sigui $y = (y_1 \dots y_m)$, aleshores, $y^{(n)} = f(x, y, \dots, y^{(n-1)})$ és equivalent a un sistema de $n \times m$ e.d.o.'s d'ordre 1.

Demostració. En efecte, sigui $z_1 = y$ (vector de m components), $z_2 = y', \dots, z_n = y^{(n-1)}$. Per tant, a $z = (z_1, \dots, z_n)^t$ hi ha un total de $n \times m$ components.

Com que $z'_1 = (y)' = y' = z_2$ i, anar fent, $z'_{n-1} = (y^{(n-2)})' = y^{(n-1)} = z_n$ i $z'_n = (y^{(n-1)})' = y^{(n)} = f(x, y, \dots, y^{(n-1)}) = f(x, z_1, \dots, z_n)$. Ens queda l'e.d.o. $z' = g(x, z)$ que realment acaba sent $(z'_1 \ z'_2 \ \dots \ z'_n)^t = (z_2 \ z_3 \ \dots \ z_n \ f(x, z_1, \dots, z_n))^t$. \square

Exemple 4. $y'' = -\sin(y)$. Aleshores, $z_1 = y$ i $z_2 = y'$. Podem prendre per sistema d'equacions $z'_1 = z_2$ i $z'_2 = -\sin(z_1)$.

1.1 Sistemes autònoms i no autònoms

Definició 5. Direm que una e.d.o. és autònoma si és de la forma $y' = f(y)$ (equació que no depen de x). Direm que un sistema es no autònom si $y' = f(x, y)$.

Proposició 6. Sigui $y' = f(y)$ una e.d.o autònoma i $\varphi : (a, b) \rightarrow \mathbb{R}^n$ una solució. Llavors, $\forall x \in \mathbb{R}$ i $\varphi_\alpha : (a + \alpha, b + \alpha) \rightarrow \mathbb{R}^n$ per $x \mapsto \varphi_\alpha(x) = \varphi(x - \alpha)$ també és solució.

Demostració. En efecte: $\varphi'_\alpha(x) = \varphi'(x - \alpha) = f(\varphi(x - \alpha)) = f(\varphi_\alpha(x))$.

Nota 5. Podem transformar el sistema d'ordre 1 i n incògnites d'e.d.o's no autònom $y' = f(x, y)$, en un sistema d'e.d.o's autònom d'ordre 1 i $n + 1$ incògnites.

Demostració. En efecte, fem $z_1 = x$ i $z_2 = y$. Aleshores, amb $z = (z_1 \ z_2)^t$ compleix que $z' = (z'_1 \ z'_2)^t = (1 \ f(x, y))^t = (1 \ f(z))^t = F(z)$, que és un e.d.o. d'ordre 1 amb $n + 1$ incògnites. \square

1.2 Problema de Cauchy o problema de valors inicials

Definició 7. Sigui $U \subset \mathbb{R} \times \mathbb{R}^n$ un obert i $f : U \rightarrow \mathbb{R}^n$ una funció. Sigui $(x_0, y_0) \in U$. Anomenarem problema de Cauchy o problema de valor inicial (p.v.i) a trobar una solució de

$$y' = f(x, y)$$

$$y(x_0) = y_0$$

Exemple 6. Alguns exemples de problemes de Cauchy.

1. Volem trobar una funció que compleixi que: $y' = y$ i $y(0) = 1$. Escollint $\varphi(x) = e^x$ és una solució, ja que si derivem ens dona ella mateixa i si l'igualem a 0 dona 1.
2. Volem trobar una funció que compleixi que: $y' = y$ i $y(x_0) = y_0$. Escollint $\varphi(x) = y_0 e^{x-x_0}$ és solució, ja que si derivem dona ella mateixa i compleix el valor inicial.

Pregunta: Les solucions que hem trobat són totes les possibles? N'hi ha més?

3. $yy' - x = 0$ i $y(0) = 0$. Solucions: $\varphi_{+-}(x) = + - x$ en són solució, substituint es veu.
4. $yy' + x = 0$ i $y(0) = 0$. No té cap solució. Una manera de veure-ho és veient que per $x \neq 0$ ni y ni y' poden ser 0. Llavors fixant-nos en $x > 0$ i suposant que $y > 0$, ens queda que $y' < 0$. Per tant, cal una funció contínua que és positiva per x positiva i que decreixi. Sigui $a = y(1)$, llavors $y(x) > a$ per tota x entre 0 i 1, aleshores, com que en 0 ha de ser 0 i és contínua, hem arribat a contradicció i no pot tenir solució.

1.3 Interpretació geomètrica d'una e.d.o

Sigui $f : U \subset \mathbb{R}^2 \rightarrow \mathbb{R}$ $(x, y) \mapsto f(x, y)$. $y' = f(x, y)$ i $\varphi : (a, b) \rightarrow \mathbb{R}$ n'és solució si $\varphi'(x) = f(x, \varphi(x))$. El que diu és si existeix una funció φ , el pendent de la seva gràfica segueix $f(x, \varphi)$.

1.4 Exemples importants

Exemple 7. Equació d'una molla elàstica (oscil·lador harmònic):

$$my'' = -k^2 y$$

On y és el desplaçament respecte la posició d'equilibri.

Exemple 8. Pèndol de longitud l sota un camp gravitatori constant el qual exerceix una força mg .

$$m\theta''l = -mg \sin \theta \iff \theta'' = -\frac{g}{l} \sin \theta$$

On θ és l'angle del pèndol respecte la vertical.

Exemple 9. Model *SIR*. S és el nombre de persones subceptibles, I infectats i R persones que deixen de ser de la resta tant perquè es curen com perquè moren. $N = S + I + R$

$$\begin{aligned}S' &= -\frac{\beta}{N}SI \\I' &= \frac{\beta}{N}SI - \gamma I \\R' &= \gamma I\end{aligned}$$

Exemple 10. n cossos a l'espai de masses m_1, m_2, \dots, m_n submessos a la seva mutua atracció gravitatòria. q_i és la posició del cos i en un sistema de referència.

$$m_i q_i'' = G \sum_{j \neq i} \frac{m_i m_j}{\|q_j - q_i\|^3} (q_j - q_i)$$

Exemple 11. E.d.o's de famílies de corbes.

Considerem la següent família de corbes: $x^2 + y^2 = r^2$, per $r \in \mathbb{R}$. Tinc les solucions i m'interessa buscar la e.d.o. que la tingui per solució. Si $y = y(x)$, derivant respecte a x : $2x + 2yy' = 0$ o simplificant $y'y + x = 0$, o també $y' = -\frac{x}{y}$.

Família ortogonal. Té el pendent ortogonal, $y' = -\frac{1}{-\frac{x}{y}} = \frac{y}{x}$. Té per solució $y(x) = \alpha x$ per $\alpha \in \mathbb{R}$.

Exercici: Trobeu l'e.d.o de la família de corbes $(x - \alpha)^2 + y^2 = \alpha^2$. I la família de corbes ortogonals.

Crec que:

$$\begin{aligned}y' &= -\frac{x - \alpha}{y} \\y(0) &= 0\end{aligned}$$

2 Sistemes lineals d'e.d.o.'s

Definició 8. Direm que un sistema d'e.d.o's és lineal si és de la forma (de funció incògnita x):

$$x' = A(t)x + b(t), \quad A(t) \in \mathcal{M}_{n \times n}(\mathbb{R}) \quad b(t) \in \mathbb{R}^n$$

Direm que el sistema és homogeni si $b(t) = 0$. El sistema homogeni associat és $x' = A(t)x$.

Direm que el sistema té coeficients constants si A no depèn de t .

2.1 Motivació

Suposem que tenim un sistema d'e.d.o.'s $x' = f(t, x)$, on f és \mathcal{C}^1 respecte de x . Suposem que $x_0(t)$ n'és solució. Volem estudiar el comportament de les solucions "properes".

$$f(t, x) = f(t, x_0(t)) + D_x f(t, x_0(t))(x - x_0(t)) + o(\|x - x_0(t)\|)$$

On D_x és la matriu diferencial.

Sigui $\tilde{x} = x - x_0(t)$, llavors, $\tilde{x}' = x' - x_0'(t) = f(t, x_0(t)) + D_x f(t, x_0(t))\tilde{x} + o(\|\tilde{x}\|) - f(t, x_0(t)) = D_x f(t, x_0(t))\tilde{x} + o(\|\tilde{x}\|)$ el qual s'aproxima a un sistema lineal.

2.2 Propietats elementals

Proposició 9. (*Principi de superposició*) Considerem el sistema lineal homogeni $x' = A(t)x$, on $A(t) \in \mathcal{M}_{n \times n}(\mathbb{R})$. La solució, generat del sistema és un espai vectorial, és a dir, si φ_1 i φ_2 són solució i $\forall \lambda_1, \lambda_2 \in \mathbb{R}$ (o \mathbb{C}), llavors $\lambda_1 \varphi_1 + \lambda_2 \varphi_2$ és també solució.

Demostració. Sabem que $\varphi'_i(t) = A(t)\varphi_i(t)$ per $i = 1, 2$. Donats $\lambda_1, \lambda_2 \in \mathbb{R}$, sigui $\tilde{\varphi} = \lambda_1\varphi_1 + \lambda_2\varphi_2$. Llavors, $\tilde{\varphi}' = \lambda_1\varphi'_1 + \lambda_2\varphi'_2 = \lambda_1A(t)\varphi_1 + \lambda_2A(t)\varphi_2 = A(t)(\lambda_1\varphi_1 + \lambda_2\varphi_2) = A(t)\tilde{\varphi}$. \square

Proposició 10. *Considerem el sistema lineal*

$$x' = A(t)x + b(t)$$

Sigui φ_p una solució del sistema ($\varphi'_p = A(t)\varphi_p + b(t$). La solució general és

$$\{\varphi | \varphi' = A(t)\varphi + b(t)\} = \{\varphi = \varphi_p + \varphi_n | \varphi_n = A(t)\varphi_n\} = \{\varphi_p\} + \{\varphi_n | \varphi_n \text{ solució del sistema homogeni associat}\}$$

Demostració.

\supseteq Sigui $\tilde{\varphi} = \varphi_p + \varphi_n$, on $\varphi'_n = A(t)\varphi_n$. Llavors

$$\tilde{\varphi}' = \varphi'_p + \varphi'_n = A(t)\varphi_p + b(t) + A(t)\varphi_n = A(t)(\varphi_p + \varphi_n) + b(t) = A(t)\tilde{\varphi} + b(t)$$

\subseteq Sigui $\hat{\varphi}$ una solució ($\hat{\varphi}' = A(t)\hat{\varphi} + b(t)$), llavors: $\hat{\varphi} = \varphi_p + \hat{\varphi} - \varphi_p$ i cal veure que $\varphi_n = \hat{\varphi} - \varphi_p$ és solució del sistema homogeni. Com que, $\varphi'_n = \hat{\varphi}' - \varphi'_p = A(t)\hat{\varphi} + b(t) - A(t)\varphi_p - b(t) = A(t)(\hat{\varphi} - \varphi_p) = A(t)\varphi_n$, per tant, φ_n és solució del sistema homogeni i hem acabat. \square

2.3 E.d.o's lineals unidimensionals

Consierem una e.d.o de la forma

$$x' = a(t)x + b(t), \quad a(t) \in \mathbb{R} \text{ (o } \mathbb{C}), \quad x \in \mathbb{R}$$

Per resoldre-la:

1. Trobarem la solució general de $x' = a(t)x$.
2. Trobarem una solució particular de $x' = a(t)x + b(t)$.

Notació: En aquest tema $I \subset \mathbb{R}$ serà un interval obert.

Proposició 11. *Sigui $a : I \subset \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ una funció contínua. Sigui $t_0 \in I$. Llavors, la solució general de l'e.d.o. lineal homogenia $x' = a(t)x$ és*

$$\{\lambda e^{\int_{t_0}^t a(s)ds} | \lambda \in \mathbb{R}\}$$

Equivalentment, per a qualsevol $(t_0, x_0) \in I \times \mathbb{R}$, l'única solució de p.v.i.

$$\begin{aligned} x' &= a(t)x \\ x(t_0) &= x_0 \end{aligned}$$

és

$$\varphi(t, t_0, x_0) = x_0 e^{\int_{t_0}^t a(s)ds}$$

Demostració.

\subseteq Sigui $\varphi(t) = x_0 e^{\int_{t_0}^t a(s)ds}$. Tenim que

$$\varphi(t)' = x_0 e^{\int_{t_0}^t a(s)ds} \left(\int_{t_0}^t a(s)ds \right)' = a(t)x_0 e^{\int_{t_0}^t a(s)ds} = a(t)\varphi(t)$$

Amb això hem vist que és solució de l'equació. Ara anem a veure que és solució del p.v.i.

$$\varphi(t_0) = x_0 e^{\int_{t_0}^{t_0} a(s)ds} = x_0 e^0 = x_0$$

\supseteq Observem que $e^{\int_{t_0}^t a(s)ds} \neq 0, \forall t \in I$.

Segui $\hat{\varphi}$, una solució de $x' = a(t)x$, la podem escriure com $\hat{\varphi}(t) = c(t)e^{\int_{t_0}^t a(s)ds}$ amb $c(t) = e^{-\int_{t_0}^t a(s)ds} \hat{\varphi}(t)$, clarament c és una funció derivable a I .

Llavors, $c'(t)e^{\int_{t_0}^t a(s)ds} + c(t)a(t)e^{\int_{t_0}^t a(s)ds} = \hat{\varphi}'(t) = a(t)\hat{\varphi}(t) = a(t)c(t)e^{\int_{t_0}^t a(s)ds} \iff c'(t)e^{\int_{t_0}^t a(s)ds} = 0 \iff c'(t) = 0 \implies c = \lambda$. És a dir, com que la derivada de la c és 0, tenim que c és una constant. I hem acabat perquè hem vist que qualsevol solució és de la forma descrita. \square

Nota 12. Què va fer que escollíssim $e^{\int_{t_0}^t a(s)ds}$ com a candidat de solució?

Estem buscant solució de $x'(t) = a(t)x(t)$ tal que $x(t_0) = x_0$. Ara, podem veure la equació com $\frac{x'(t)}{x(t)} = a(t) \iff \int_{t_0}^t \frac{x'(t)}{x(t)} dt = \int_{t_0}^t a(s)ds$ que és el mateix que $\ln(x(t) - \ln(x(t_0))) = \int_{t_0}^t a(s)ds \iff \ln(x) = \ln(x_0) + \int_{t_0}^t a(s)ds \iff x(t) = e^{\ln x_0} e^{\int_{t_0}^t a(s)ds} = x_0 e^{\int_{t_0}^t a(s)ds}$.

Proposició 12. La solució general de $x' = a(t)x + b(t)$; $a, b : I \subset \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ contínues és:

$$\{x(t) = e^{\int_{t_0}^t a(s)ds} [\lambda + \int_{t_0}^t e^{-\int_{t_0}^s a(\sigma)d\sigma} b(s)ds], \lambda \in \mathbb{R}\}$$

I, per tant, la solució que satisfà $x(t_0) = x_0$ és:

$$\begin{aligned} \varphi(t, t_0, x_0) &= e^{\int_{t_0}^t a(s)ds} (x_0 + \int_{t_0}^t e^{-\int_{t_0}^s a(\sigma)d\sigma} b(s)ds) = x_0 e^{\int_{t_0}^t a(s)ds} + e^{\int_{t_0}^t a(\sigma)d\sigma} \int_{t_0}^t e^{-\int_{t_0}^s a(\sigma)d\sigma} b(s)ds = \\ &= x_0 e^{\int_{t_0}^t a(s)ds} + \int_{t_0}^t e^{\int_s^t a(\sigma)d\sigma} b(s)ds \end{aligned}$$

Demostració. Per començar, veure que x de la forma descrita son solució és un càlcul. Ara, per veure que tota solució és d'aquella forma fem servir el mètode de variacions de les constants.

Semblant a la proposició del cas homogeni busquem la $c(t)$ tal que $x_p(t) = c(t)e^{\int_{t_0}^t a(s)ds}$, $(\forall t)$. Substituint a l'equació original tenim:

$$\begin{aligned} c'(t)e^{\int_{t_0}^t a(s)ds} + c(t)a(t)e^{\int_{t_0}^t a(s)ds} &= x'_p(t) = a(t)c(t)e^{\int_{t_0}^t a(s)ds} + b(t) \iff c'(t)e^{\int_{t_0}^t a(s)ds} = b(t) \\ \implies c'(t) &= e^{-\int_{t_0}^t a(s)ds} b(t) \implies c(t) - x_0 = \int_{t_0}^t c'(s)ds = \int_{t_0}^t e^{-\int_{t_0}^s a(\sigma)d\sigma} b(s)ds \end{aligned}$$

I, per tant,

$$c(t) = x_0 + \int_{t_0}^t e^{\int_{t_0}^s a(\sigma)d\sigma} b(s)ds$$

\square

Exemple 13. Posem per cas que volem resoldre l'equació $x' = tx + \frac{1}{t}$ (coeficients continus, o bé a $(-\infty, 0)$, o bé a $(0, \infty)$).

Solució. 1. Busquem l'equació homogenia. $x' = tx \implies \frac{x'}{x} = t$, integrant entre t_0 i t , tenim

$$\ln x - \ln x_0 = \frac{1}{2}t^2 - \frac{1}{2}t_0^2 \implies x(t) = x_0 e^{\frac{1}{2}t^2 - \frac{1}{2}t_0^2} = x_0 e^{-\frac{1}{2}t_0^2} e^{\frac{1}{2}t^2}$$

Per tant, la solució general homogenia:

$$\{x(t) = \lambda e^{\frac{1}{2}t^2}, \lambda \in \mathbb{R}\}$$

2. Trobem la solució de l'e.d.o. completa que en t_0 val x_0 :

$x_p(t) = c(t)e^{\frac{1}{2}t^2}$ i substituïm a l'e.d.o:

$$c'(t)e^{\frac{1}{2}t^2} + c(t)e^{\frac{1}{2}t^2}t = x'_p(t) = tc(t)e^{\frac{1}{2}t^2} + \frac{1}{t}$$

Que aleshores queda:

$$c'(t) = \frac{1}{t}e^{-\frac{1}{2}t^2} \implies c(t) = x_0e^{-\frac{1}{2}t_0^2} + \int_{t_0}^t \frac{1}{s}e^{-\frac{1}{2}s^2}ds$$

Perquè $c'(t_0) = x_0e^{-\frac{1}{2}t_0^2}$, finalment, la solució és:

$$x_p(t) = e^{\frac{1}{2}t^2} \left[x_0e^{-\frac{1}{2}t_0^2} + \int_{t_0}^t \frac{1}{s}e^{-\frac{1}{2}s^2}ds \right]$$

□

2.4 Sistemes lineals de dimensió qualsevol (finita)

2.4.1 Sistemes homogenis

Sigui la e.d.o $x' = A(t)x$, per $A \in \mathcal{C}(I, \mathcal{M}_{n \times n}(\mathbb{R}))$, és a dir, A és una matriu $n \times n$ amb coeficients continus a $I \subset \mathbb{R}$.

Proposició 13. *Sigui el sistema $x' = A(t)x$, amb $A \in \mathcal{C}^k(I, \mathcal{M}_{n \times n}(\mathbb{R}))$. Llavors, si φ n'és una solució definida a $I \implies \varphi \in \mathcal{C}^{k+1}(I, \mathbb{R}^n)$.*

Demostració. Provem-ho per inducció:

Pel cas base $k = 0$. Si φ és solució $\implies \varphi'(t) = A(t)\varphi(t) \implies \varphi \in \mathcal{C}^1(I, \mathbb{R}^n)$.

Suposem que A és de classe \mathcal{C}^k i φ és solució de $x' = A(t)x$ de classe \mathcal{C}^k : llavors $\varphi'(t) = A(t)\varphi(t) \implies A, \varphi' \in \mathcal{C}^k \implies \varphi \in \mathcal{C}^{k+1}$. □

Exemple 14. Comproveu que el mateix argument s'aplica a $x' = f(t, x)$, si f és de classe \mathcal{C}^k respecte a (t, x) .

Teorema 14. *(És el teorema 2.8 dels apunts) Sigui $I \subset \mathbb{R}$, interval de \mathbb{R} , $A \in \mathcal{C}(I, \mathcal{M}_{n \times n}(\mathbb{R}))$. Sigui $(t_0, x_0) \in I \times \mathbb{R}^n$, qualsevol. llavors el p.v.i*

$$\begin{aligned} x' &= A(t)x \\ x(t_0) &= x_0 \end{aligned}$$

té una solució \mathcal{C} , definida a I . Una solució és única en el sentit següent: si $\tilde{\varphi} : \tilde{I} \subset I \rightarrow \mathbb{R}^n$ n'és una altra solució $\implies \tilde{\varphi}|_{\tilde{I}} = \varphi|_{\tilde{I}}$

Demostració. És un corol·lari del Teorema de Picard. □

Nota 15. *No sabem calcular φ . El teorema ens permet deduir l'aplicació: $\varphi : I \times I \times \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}^n$ amb $(t, t_0, x_0) \rightarrow \varphi(t, t_0, x_0)$, on $\varphi(t, t_0, x_0)$ és la solució del p.v.i. en l'instant t . A aquesta aplicació l'anomenarem flux del p.v.i.*

Exercici: Fent servir el teorema 2.8. i el fet que la sol·lució general de $x' = A(t)x$ és un espai vectorial, proveu que, fixats $t, t_0 \in I$, l'aplicació de \mathbb{R}^n a \mathbb{R}^n , que envia x_0 a $\varphi(t, t_0, x_0)$ és una aplicació lineal.

$$\varphi(t, t_0, \lambda_0 x_0 + \lambda_1 x_1) = \lambda_0 \varphi(t, t_0, x_0) + \lambda_1 \varphi(t, t_0, x_1)$$

Teorema 15. *Sigui $A \in \mathcal{C}(I, \mathcal{M}_{n \times n}(\mathbb{R}))$. Llavors, la solució general de $x' = A(t)x$ (sistema lineal i homogeni) és un espai vectorial de dimensió n .*

Demostració. Veurem (1) que hi ha n solucions de $x' = A(t)x$ linealment independents (\implies dimensió de la solució general $\geq n$). (2) que aquestes solucions són base.

Per (1). Sigui $t_0 \in I$. Sigui e_i , l' i -èssim vector de la base canònica a \mathbb{R}^n . Pel teorema 2.8, sigui φ_i la solució del p.v.i:

$$\begin{aligned} x' &= A(t)x \\ x(t_0) &= e_i \end{aligned}$$

Afirmem que $\{\varphi_i\}_{i=1,\dots,n}$ són l.i. Hem de veure que si $\lambda_1\varphi_1(t) + \dots + \lambda_n\varphi_n(t) = 0$ ($\forall t \in I$) $\implies \lambda_1 = \dots = \lambda_n = 0$.

Suposem que tenim uns $\lambda_1, \dots, \lambda_n \in \mathbb{R}$ tals que compleixen la condició anterior. En particular, si $t = t_0$, $\lambda_1\varphi_1(t_0) + \dots + \lambda_n\varphi_n(t_0) = \lambda_1e_1 + \dots + \lambda_ne_n = 0$, llavors com els vectors canònics són l.i. llavors $\lambda_1 = \dots = \lambda_n = 0$.

Per (2). Sigui $\tilde{\varphi} : I \subset \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}^n$ una solució qualsevol de $x' = A(t)x$. Siguin $\lambda_1, \dots, \lambda_n$ tals que $\lambda_1e_1 + \dots + \lambda_ne_n = \tilde{\varphi}(t_0)$. Veiem que $\tilde{\varphi}(t) = \lambda_1\varphi_1(t) + \dots + \lambda_n\varphi_n(t)$ ($\forall t \in I$).

Per a veure-ho, comprovem que són solució del mateix p.v.i i apliquem el Teorema 2.8. Tant $\tilde{\varphi}$ com $\lambda_1\varphi_1 + \dots + \lambda_n\varphi_n$ són solució de $x' = A(t)x$. Com que $\lambda_1\varphi_1(t_0) + \dots + \lambda_n\varphi_n(t_0) = \lambda_1e_1 + \dots + \lambda_ne_n = \tilde{\varphi}(t_0)$ coincideixen en $t = t_0$ llavors, com la solució del p.v.i. és única, coincideixen en tot I . \square

Definició 16. Sigui $A \in (I, \mathcal{M}_{n \times n}(\mathbb{R}))$. Anomenarem *sistema fonamental de solucions* de $x' = A(t)x$ a qualsevol base de la solució general del sistema. El teorema anterior ens diu que un s.f.s té exactament n funcions.

Definició 17. Sigui $A \in (I, \mathcal{M}_{n \times n}(\mathbb{R}))$. Direm que una matriu $M(t)$ (per $t \in I$) és una matriu fonamental del sistema $x' = A(t)x$ si les seves columnes són un s.f.s. del sistema. És a dir, si $M(t) = (m_1(t), \dots, m_n(t))$, llavors $m'_i = A(t)m_i$. Podem escriure $M(t)' = A(t)M(t)$ i que $\{m_i\}_{i=1,\dots,n}$ generant l'espai de solucions.

Exercici: Considerem el problema següent: Donada una matriu $C \in \mathcal{M}_{n \times n}(\mathbb{R})$, busquem Φ tal que

$$\begin{aligned} \Phi'(t) &= A(t)\Phi(t) \\ \Phi(t_0) &= C \end{aligned}$$

On $A \in \mathcal{C}(I, \mathcal{M}_{n \times n}(\mathbb{R}))$ i $t_0 \in I$. Proveu que $\exists!$ solució $\Phi(t)$ definida en I .

Exemple 16. Trobem una m.f. de

$$\begin{aligned} x' &= \frac{1}{t}x + y \\ y' &= \frac{1}{t}y \end{aligned}$$

La qual és

$$\begin{pmatrix} x' \\ y' \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} \frac{1}{t} & 1 \\ 0 & \frac{1}{t} \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x \\ y \end{pmatrix}$$

Comencem resolent (2). $y' = \frac{1}{t}y \implies \frac{y'}{y} = \frac{1}{t} \implies \ln y = c + \ln t$ llavors $y(t) = \beta t$. Substituïm a (1):

$$x' = \frac{1}{t}x + \beta t$$

Les solucions de $x' = \frac{1}{t}x$ són $x_n(t) = \alpha t$. Variació de les constants: $x(t) = c(t)t$. $c'(t)t + c(t) = \frac{1}{t}c(t)t + \beta t \implies c'(t) = \beta \implies c(t) = \alpha + \beta t$, llavors $x(t) = (\alpha + \beta t)t = \alpha t + \beta t^2$ i $y(t) = \beta t$ amb $\alpha, \beta \in \mathbb{R}$.

$$\begin{pmatrix} x(t) \\ y(t) \end{pmatrix} = \alpha \begin{pmatrix} t \\ 0 \end{pmatrix} + \beta \begin{pmatrix} t^2 \\ t \end{pmatrix}$$

Exercici: Raoneu que φ_1 i φ_2 són base de la solució general del sistema. Llavors una m.f n'és:

$$\Phi(t) = \begin{pmatrix} t & t^2 \\ 0 & t \end{pmatrix}$$

Proposició 18. *Considem el sistema d'e.d.o homogeni de dimensió finita ($x' = A(t)x$ amb $A \in \mathcal{C}(I, \mathcal{M}_{n \times n}(\mathbb{R}))$). Aleshores,*

1. *Si $M(t)$ n'és una m.f. $\implies \det(M(t)) \neq 0 \forall t \in I$.*
2. *$M(t)$ n'és m.f. $\iff M'(t) = A(t)M(t)$ i $\exists t_0 \in I$ tal que $\det(M(t_0)) \neq 0$.*
3. *Segui $M(t)$ una m.f. llavors $N(t)$ és m.f. $\iff \exists C \in \mathcal{M}_{n \times n}(\mathbb{R})$ constant amb $\det C \neq 0$, tal que $N(t) = M(t)C$.*
4. *Segui $M(t)$ una m.f. La solució del p.v.i. és $\varphi(t, t_0, x_0) = M(t)M(t_0)^{-1}x_0$.*

Demostració.

1. Suposem que en un punt t_0 el determinant de la matriu és 0 ($\det M(t_0) = 0$). Aleshores, el rang $M(t_0) < n \implies \neq \mathbb{R}^n \implies x_0 \in \mathbb{R}^n$ tal que $x_0 \notin \text{Im } M(t_0)$. És a dir, el sistema $M(t_0)\lambda = x_0$ no té solució.

Ara, considerem el p.v.i. $x' = A(t)x$ i $x(t_0) = x_0$ té una única solució $\varphi_0(t)$, però $x_0 = \varphi_0(t_0) \neq M(t_0)\lambda \forall \lambda \in \mathbb{R}^n$. Llavors φ_0 no està generada per les columnes de $M(t)$, per tant, les columnes no son base, contradicció amb el fet que $M(t)$ és m.f.

2. \implies Immediata per 1, perquè si el determinant és diferent de 0 arreu, aleshores ho és per tot punt de l'interval i en particular podem trobar un punt.

\Leftarrow **Exercici:** És refer la demostració del fet que la solució general de $x' = A(t)x$ és un espai vectorial de dimensió n . INDICACIÓ: $M'(t) = A(t)M(t)$ i $\det M(t_0) \neq 0$. Anomenarem v_i a la columna i de $M(t_0)$ llavors $\implies \{v_1, \dots, v_n\}$ són base de \mathbb{R}^n . Llavors la columna i de $M(t)$ és l'única solució del p.v.i. $x' = A(t)x$ i $x(t_0) = v_i$.

3. \Leftarrow Segui C una matriu constant amb $\det C \neq 0$. Segui $N(t) = M(t)C$, per una banda, $\det N(t) = \det M(t) \det C$, llavors el determinant de la matriu $N(t)$ és diferent de 0 per tot t . Per altra banda, $N'(t) = (M(t)C)' = M'(t)C = A(t)M(t)C = A(t)N(t)$. Llavors $N(t)$ és una matriu fonamental.

\implies Segui $t_0 \in I$ un punt qualsevol i sigui $C = M(t_0)^{-1}N(t_0)$. Veurem que $N(t) = M(t)C$, per $\forall t \in I$. Per veure que són iguals, com que les dues són solució del sistema $x' = A(t)x$. Només cal veure que ambdues coincideixen en el punt t_0 , ja que $N(t_0) = M(t_0)M(t_0)^{-1}N(t_0)$. Llavors per unicatat de les solucions del p.v.i. $N(t)$ i $M(t)C$ son la mateixa matriu.

A més, la C és única. (FALTA PROOF)

4. Hem de veure que $M(t)M(t_0)^{-1}x_0$ són solució del p.v.i. Està clar que en t_0 les matrius es cancelen i només queda x_0 . I a més, si derivem l'expressió les constants no són importants i compleix l'equació.

□

Exemple 17. L'aplicació del argument d'existència i unicatat de solucions per a provar coses no trivials.

considerem el sistema d'e.d.o's: (1) $x' = f(x, t)$, amb $f : \mathbb{R} \times U \subset \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}^n$ i $f(t+T, x) = f(t, x) \forall (t, x) \in \mathbb{R} \times U$.

Suposem que $\forall (t_0, x_0) \in \mathbb{R} \times U$, el p.v.i. (2) $x' = f(t, x)$ i $x(t_0) = x_0$. Suposem que $\varphi(t)$ és solució de (1) (definida en l'interval de longitud T). Llavors φ és T -periòdica ($\varphi(t+T) = \varphi(t) \forall t \in \mathbb{R}$) $\iff \exists t_0 \in \mathbb{R}$ tal que $\varphi(t_0+T) = \varphi(t_0)$.

\Leftarrow Considerem $\varphi(t)$ solució $\varphi'(t) = f(t, \varphi(t))$ i $\tilde{\varphi}(t) = \varphi(t+T)$. En $t = t_0$, $\varphi(t_0) = \varphi(t_0+T) = \tilde{\varphi}(t_0)$. Només ens cal comprovar que ambdues són solució de l'e.d.o.

$$\tilde{\varphi}'(t) = \varphi(t+T)' = f(t+T, \varphi(t+T)) = f(t, \varphi(t+T)) = f(t, \tilde{\varphi}(t))$$

Teorema 19. *Sigui Φ una matriu $n \times n$ tal que $\Phi' = A(t)\Phi(t)$, on $A \in \mathcal{C}(I, \mathcal{M}(\mathbb{R}))$. Llavors, (en funció de t):*

$$(\det \Phi(t))' = \text{tr} A(t) \det \Phi(t)$$

Demostració. Sigui φ_i , la columna i de la matriu Φ . Com que $\det \Phi = \det(\varphi_1, \dots, \varphi_n)$, derivant respecte a t :

$$(\det \Phi(t))' = \det(\varphi_1', \varphi_2, \dots, \varphi_n) + \det(\varphi_1, \varphi_2', \dots, \varphi_n) + \dots + \det(\varphi_1, \varphi_2, \dots, \varphi_n')$$

Com que $\varphi_i' = A(t)\varphi_i$, ens queda:

$$= \det(A\varphi_1, \varphi_2, \dots, \varphi_n) + \det(\varphi_1, A\varphi_2, \dots, \varphi_n) + \dots + \det(\varphi_1, \varphi_2, \dots, A\varphi_n)$$

Si definim, fixat t , per a $v_1, \dots, v_n \in \mathbb{R}^n$, $f(v_1, \dots, v_n) = \det(Av_1, \dots, v_n) + \dots + \det(v_1, \dots, Av_n)$. Aleshores f satisfà: (1) $f(v_1, \dots, v_i, \dots, v_j, \dots, v_n) = -f(v_1, \dots, v_j, \dots, v_i, \dots, v_n)$. (2) $f(\lambda v_1, \dots, v_n) = \dots = f(v_1, \dots, \lambda v_n) = \lambda f(v_1, \dots, v_n)$. Llavors, f és una aplicació n lineal alternada.

L'espai d'aplicacions n -lineals alternades a \mathbb{R}^n té dimensió 1. Llavors $f(v_1, \dots, v_n) = a \det(v_1, \dots, v_n)$, anem a determinar la constant a evaluant f en els vectors $\{e_i\}_{i=1, \dots, n}$ de la base canònica:

$$f(e_1, \dots, e_n) = a \det(e_1, \dots, e_n) = a$$

$$f(e_1, \dots, e_n) = \det(Ae_1, e_2, \dots, e_n) + \det(e_1, Ae_2, \dots, e_n) + \dots + \det(e_1, e_2, \dots, Ae_n) = a_{11} + a_{22} + \dots + a_{nn} = \text{tr} A$$

Per tant, $\det \Phi(t)' = \text{tr} A(t) \det \Phi(t)$. \square

Corol·lari 20. (Formula de Liouville). *Sigui Φ una matriu $n \times n$ tal que $\Phi' = A(t)\Phi(t)$, on $A \in \mathcal{C}(I, \mathcal{M}(\mathbb{R}))$. Llavors:*

$$\det \Phi(t) = \det \Phi(t_0) e^{\int_{t_0}^t \text{tr} A(s) ds}$$

Demostració. Pel teorema anterior, el determinant és solució del sistema de p.v.i. $d' = \text{tr} A(t)d$ i $d(t_0) = \det \Phi(t_0)$, la solució de la qual ja l'havíem vista anteriorment. \square

Exercici: (d'aplicació de la fórmula de Liouville) Considerem el sistema:

$$\begin{aligned} x' &= tx + e^{t^2}y \\ y' &= \cos(t)x - ty \end{aligned}$$

Sigui $\varphi(t, t_0, (x_0, y_0))$ el seu flux. És a dir, l'única solució del p.v.i.

$$\begin{aligned} \varphi(t, t_0, (x_0, y_0))' &= A(t)\varphi(t, t_0, (x_0, y_0)) \\ \varphi(t, t_0, (x_0, y_0)) &= (x_0, y_0)^t \end{aligned}$$

Proveu que, per a qualsevol conjunt mesurable $D \subset \mathbb{R}^2$, i qualsevol $t, t_0 \in \mathbb{R}$ fixats,

$$\text{àrea}(D) = \text{àrea}(\varphi(t, t_0, D))$$

INDICACIONS: $\text{àrea}(D) = \int_D 1 dx dy$. I, el teorema de canvi de variable, ens diu que si $\Psi : D \rightarrow \Psi(D)$ que envia $(u, v) \mapsto \Psi(u, v)$ és un canvi de variables, llavors

$$\int_{\Psi(D)} f(x, y) dx dy = \int_D f(\Psi(u, v)) |\det D\Psi(u, v)| du dv$$

2.4.2 Sistemes no homogenis

Considerem el sistema (1): $x' = A(t)x + b(t)$.
on $A \in \mathcal{C}(I, \mathcal{M}_{n \times n}(\mathbb{R}))$ i $b \in \mathcal{C}(I, \mathbb{R}^n)$.

Suposem que $M(t)$ és una m.f. del sistema homogeni (2): $M(t)' = A(t)M(t)$ i $\det M(t) \neq 0$ per tot $t \in I$. Busquem les solucions de la forma $x(t) = M(t)y(t)$ (on $y(t) = M(t)^{-1}x(t)$ que és derivable perquè les dues

parts ho son ja que són solució i el determinant de $M(t) \neq 0$).

Derivem respecte a t , per (1) i per (2) $A(t)x(t) + b(t) = x'(t) = M(t)'y(t) + M(t)y'(t)$, que a banda i banda és igual a $A(t)M(t)y(t) + b(t) = A(t)M(t)y(t) + M(t)y'(t)$. Ens queda que $y(t)$ ha de satisfer (3): $M(t)y'(t) = b(t)$, per tant, $y'(t) = M(t)^{-1}b(t)$. Fixem $t_0 \in I$, la funció y solució de (3) tal que $y(t_0) = 0$ és

$$y(t) = \int_{t_0}^t M(s)^{-1}b(s)ds$$

per tant, una solució de (1) és (satisfà $x_p(t_0) = 0$):

$$x_p(t) = M(t) \int_{t_0}^t M(s)^{-1}b(s)ds$$

La solució del p.v.i. $x' = A(t)x + b(t)$ i $x(t_0) = x_0$ és $\varphi(t, t_0, x_0) = M(t)M(t_0)'x_0 + M(t) \int_{t_0}^t M(s)^{-1}b(s)ds = M(t) \left[M(t_0)^{-1}x_0 + \int_{t_0}^t M(s)^{-1}b(s)ds \right]$.

2.4.3 Sistemes lineals amb coeficients constants

Definició 21. Anomenarem sistema d'e.d.o. lineal amb coeficients constants a un sistema de la forma:

$$x' = Ax + b(t), A \in \mathcal{M}_{n \times n}(\mathbb{R})$$

amb b una funció definida a I (o \mathbb{R}).

Volem resoldre la part homogenia: $x' = Ax$, trobem-ne una matriu fonamental.

Definició 22. Sigui $A \in \mathcal{M}_{n \times n}(\mathbb{R})$. La seva exponencial és

$$e^A = \sum_{j=0}^{\infty} \frac{1}{j!} A^j$$

Observació 23. Escollim una norma a \mathbb{R}^n , $\|\cdot\|$. Llavors, la norma matricial associada és

$$\|A\| = \sup_{x \neq 0} \frac{\|Ax\|}{\|x\|}$$

Aquest compleix que $\|Ax\| \leq \|A\|\|x\|$, a més, $\|AB\| \leq \|A\|\|B\|$.

Llavors, anem a veure que l'exponencial d'una matriu està ben definida:

$$\|e^A\| = \left\| \sum_{j=0}^{\infty} \frac{1}{j!} A^j \right\| \leq \sum_{j=0}^{\infty} \frac{1}{j!} \|A^j\| \leq \sum_{j=0}^{\infty} \frac{1}{j!} \|A\|^j = e^{\|A\|}$$

Lema 24. Sigui $A, B \in \mathcal{M}_{n \times n}(\mathbb{R})$ tals que $AB = BA$. Llavors

$$e^{A+B} = e^A e^B$$

Demostració. Tenim que $e^{A+B} = \sum_{j=0}^{\infty} \frac{1}{j!} (A+B)^j$.

Per altra banda $e^A e^B = \left(\sum_{n \geq 0} \frac{1}{n!} A^n \right) \left(\sum_{l \geq 0} \frac{1}{l!} B^l \right) = \sum_{k \geq 0} \sum_{l \geq 0} \frac{1}{k!l!} A^k B^l$. Ara, fent un canvi de índexos ($j = k + l$); $= \sum_{j \geq 0} \sum_{k=0}^j \frac{1}{k!(j-k)!} A^k B^{j-k} = \sum_{j \geq 0} \frac{1}{j!} \sum_{k=0}^j \binom{j}{k} A^k B^{j-k}$ que pel binomi de Newton (ja que AB commuten) és igual a l'expressió de e^{A+B} . \square

Lema 25. Sigui $A \in \mathcal{M}_{n \times n}(\mathbb{R})$ llavors

$$\frac{d}{dt} e^{tA} = A e^{tA} = e^{tA} A$$

Demostració. Per definició de derivada tenim:

$$\frac{d}{dt}e^{tA} = \lim_{h \rightarrow 0} \frac{e^{(t+h)A} - e^{tA}}{h} = \lim_{h \rightarrow 0} \frac{e^{tA+hA} - e^{tA}}{h} =$$

Ara, com que tA i hA commuten podem utilitzar el lemma anterior:

$$= \lim_{h \rightarrow 0} \frac{e^{hA}e^{tA} - e^{tA}}{h} = \lim_{h \rightarrow 0} \frac{(e^{hA} - \text{Id})e^{tA}}{h}$$

Ara, com que e^{tA} és una constant, només fa falta provar que la resta del límit és igual a A .

$$\lim_{h \rightarrow 0} \frac{e^{hA} - \text{Id}}{h} = \lim_{h \rightarrow 0} \frac{1}{h} \left[\sum_{j \geq 0} \frac{1}{j!} (hA)^j - \text{Id} \right] = [A^0 = \text{Id}] = \lim_{h \rightarrow 0} \sum_{j \geq 1} \frac{1}{j!} h^{j-1} A^j = A$$

□

Proposició 26. Considerem el sistema (*) $x' = Ax$, amb $A \in \mathcal{M}_{n \times n}(\mathbb{R})$. Sigui $\Phi(t)$ la matriu fonamental de (*) tal que $\Phi(0) = \text{Id}$. Llavors

1. $\Phi(t) = e^{tA}$
2. $e^{(t+s)A}\Phi(t+s) = \Phi(t)\Phi(s) = e^{tA}e^{sA}$
3. $e^{-tA} = (e^{tA})^{-1}$
4. Si $M(t)$ és una matriu fonamental qualsevol de (*), llavors $e^{tA} = M(t)M(0)^{-1}$.

Demostració.

1. Pel lemma anterior, e^{tA} satisfà que $(e^{tA})' = Ae^{tA}$, i en $t = 0$, $e^{0A} = \text{Id}$ (llavors el $\det A \neq 0$), pel teorema d'existència i unicitat de solucions, tenim $\Phi(t) = e^{tA}$.
2. Fent servir el que acabem de demostrar i que tA i sA commuten surt automàticament.
3. Si prenem $s = -t$ a (2): $\text{Id} = \Phi(t-t) = \Phi(t+s) = \Phi(t)\Phi(-t) = e^{tA}e^{-tA}$. Llavors, $e^{-tA} = (e^{tA})^{-1}$.
4. Per ser $M(t)$ matriu fonamental, $M(0)$ té determinant diferent de 0 i, per tant, la inversa existeix. Llavors $M(t)M(0)^{-1}$ per una propietat anterior que vam veure, és matriu fonamental. Però com que compleix la mateixa condició inicial en 0 que e^{tA} , $M(0)M(0)^{-1} = \text{Id}$, son solució del mateix p.v.i. i, per tant, son la mateixa matriu ($e^{tA} = M(t)M(0)^{-1}$).

□

Corol·lari 27. La solució del p.v.i. $x' = Ax$ i $x(t_0) = x_0$ és $\varphi(t, t_0, x_0) = \varphi(t - t_0, 0, x_0) = e^{tA}e^{-t_0A}x_0 = e^{(t-t_0)A}x_0$. Perquè en $t = t_0$, $e^{t_0A}e^{-t_0A}x_0 = Ix_0 = x_0$.