

Numeryczne metody rozwiązywania ODE

1. Numeryczne metody rozwiązywania równań różniczkowych zwyczajnych pierwszego rzędu

1.1. Równania pierwszego rzędu

Rozważamy równanie

$$y' = f(t, y) \quad (1)$$

Zagadnienie Cauche'go polega na znalezieniu funkcji $y = y(t)$ spełniającej powyższe równanie różniczkowe (w przedziale (a, b)) oraz **warunek początkowy**

$$y(t_0) = y_0,$$

dla danych t_0, y_0 .

Przykład 1. Niech będzie

$$f(t, y) = 1 - 2t + 4y.$$

In [1]: `f(t,y) = 1-2t+4y;`

Można sprawdzić, że rozwiązanie ogólne wyraża się wzorem

$$y(t) = c_1 \exp(4t) + \frac{t}{2} - \frac{1}{8}$$

Rozpatrzmy następujące **zagadnienie początkowe**

$$\begin{cases} y' &= f(t, y), \\ y(0) &= 1 \end{cases}$$

Można sprawdzić, że rozwiązaniem jest funkcja

$$y(t) = \frac{9}{8}e^{4t} + t/2 - \frac{1}{8}.$$

```
In [2]: t0 = 0.0;
        y0 = 1.0;

        c1 = ( y0+1/8-t0/2 ) / exp(4*t0);
        @show c1
        exactSolution(t) = c1 * exp(4t)+t/2-1/8;

c1 = 1.125
```

```
In [3]: using Plots
        plot( exactSolution, 0.0, 2.0 )
```

1.2. Metody numeryczne

Rozważamy aproksymację rozwiązania $y(t)$ w przedziale (t_0, b) w równoodległych punktach

$$t_j = t_0 + jh, \quad t_N = b$$

Metoda Eulera * Najprostszą metodą jest **metoda jawna Eulera**

$$y_{n+1} = y_n + hf(t_n, y_n)$$

Jest to metoda rzędu pierwszego.

```
In [4]: # Metoda jawna Eulera
a = t0
b = 2.0      # konstruujemy rozwiązanie y(t) dla t \in (0, 2)

N = 10000    # liczba iteracji w metodzie Eulera
h = (b-a)/N   # krok w metodzie Eulera

tic()
t, y = t0, y0
for i=1:N
    y = y+h*f(t,y)
    t = t+h
end
toc()

@printf("Liczba kroków = %d\n", N);
@printf("Krok = %.2e\n", h);
@printf("Rozwiązanie przybliżone = %5.16f\n", y);
exact = exactSolution(b)
@printf("Rozwiązanie dokładne      = %5.16f\n", exact);
@printf("Błąd bezwzględny          = %5.3e\n", abs(y-exact));

elapsed time: 0.032921974 seconds
Liczba kroków = 10000
Krok = 2.00e-04
Rozwiązanie przybliżone = 3343.7441404238365976
Rozwiązanie dokładne    = 3354.4527354219444533
Błąd bezwzględny        = 1.071e+01
```

1.3. Metody niejawne

Dużo lepsze rezultaty można uzyskać stosując **metody niejawne**.

— wzór wsteczny Eulera

$$y_{n+1} = y_n + hf(t_{n+1}, y_{n+1})$$

Jak widać, niewiadoma y_{n+1} jest podana wyżej w sposób niejawny. Aby zaprogramować taką metodę, należy wcześniej rozwiązać powyższe równanie ze względu na niewiadomą y_{n+1} . Metoda ta jest również rzędu pierwszego. >W wypadku, gdy $f(t, y)$ jest funkcją liniową zmiennej y , to sytuacja jest bardzo prosta. Mianowicie, mamy

$$y_{n+1} = y_n + h(1 - 2t_{n+1} + 4y_{n+1}),$$

czyli

$$y_{n+1} = \frac{y_n + h - 2ht_{n+1}}{1 - 4h} = y_n + \frac{h}{1 - 4h}f(t_{n+1}, y_n).$$

```
In [5]: # wzór wsteczny Eulera (metoda niejawna)
tic()
t, y = t0, y0
```

```

for i=1:N
    y = y+h/(1-4h)*f(t+h,y)
    t = t+h
end
toc()

@printf("Liczba kroków = %d\n", N);
@printf("Krok = %.2e\n", h);
@printf("Rozwiązanie przybliżone = %5.16f\n", y);
@printf("Rozwiązanie dokładne = %5.16f\n", exact);
@printf("Błąd bezwzględny = %5.3e\n", abs(y-exact));

elapsed time: 0.034434611 seconds
Liczba kroków = 10000
Krok = 2.00e-04
Rozwiązanie przybliżone = 3365.2071180588568495
Rozwiązanie dokładne = 3354.4527354219444533
Błąd bezwzględny = 1.075e+01

```

— **wzór trapezów** Ponieważ, rozwiązanie dokładne $y(t)$ spełnia równanie całkowe

$$y(t_{n+1}) = y(t_n) + \int_{t_n}^{t_{n+1}} f(t, y(t)) dt,$$

więc jeśli powyższą całkę przybliżamy za pomocą **wzoru trapezów**, to otrzymujemy następującą metodę niejawną

$$y_{n+1} = y_n + \frac{h}{2} [f(t_n, y_n) + f(t_{n+1}, y_{n+1})].$$

Znow, jeśli f jest funkcją liniową zmiennej y , to łatwo uzyskujemy wzory dla y_{n+1} :

$$y_{n+1} = y_n + \frac{h}{2} [1 - 2t_n + 4y_n + 1 - 2t_{n+1} + 4y_{n+1}]$$

$$y_{n+1} = y_n + h [1 - t_n + 2y_n - t_{n+1} + 2y_{n+1}]$$

$$y_{n+1} = \frac{y_n + h - ht_n + 2hy_n - ht_{n+1}}{1 - 2h}$$

$$y_{n+1} = y_n + h \frac{f(t_{n+1}, y_n) + h}{1 - 2h}$$

```

In [6]: # wzór trapezów (metoda niejawną)
        h = (b-a)/N      # krok w metodzie

tic()
t, y = t0, y0
for i=1:N
    y = y+h/(1-2h)*(f(t+h,y)+h)
    t = t+h
end
toc()

@printf("Liczba kroków = %d\n", N);
@printf("Krok = %.2e\n", h);
@printf("Rozwiązanie przybliżone = %5.16f\n", y);
@printf("Rozwiązanie dokładne = %5.16f\n", exact);
@printf("Błąd bezwzględny = %5.3e\n", abs(y-exact));

elapsed time: 0.025064992 seconds
Liczba kroków = 10000
Krok = 2.00e-04
Rozwiązanie przybliżone = 3354.4541662822439321

```

Rozwiązanie dokładne = 3354.4527354219444533
 Błąd bezwzględny = 1.431e-03

Można udowodnić, że jest to metoda **rzędu drugiego**.

1.4. Ulepszone metody

W metodach niejawnych, największym problemem jest rozwiązywanie równania, często nieliniowego, ze względu na niewiadomą y_{n+1} . Można się tego problemu pozbyć, jeśli wartość jej *przybliżymy* za pomocą innej — jawnej — metody. Na przykład: * **ulepszony wzór wsteczny Eulera** określony jest w następujący sposób:

$$y_{n+1} = y_n + hf(t_{n+1}, \hat{y}_{n+1}), \quad \text{gdzie} \quad \hat{y}_{n+1} = y_n + hf(t_n, y_n).$$

* **ulepszony wzór trapezów**

$$y_{n+1} = y_n + \frac{h}{2} [f(t_n, y_n) + f(t_{n+1}, \hat{y}_{n+1})], \quad \text{gdzie} \quad \hat{y}_{n+1} = y_n + hf(t_n, y_n).$$

1.4.1. Predict-Corrector

Co ciekawe, proces ulepszania można iterować, tzn. obliczać

$$\begin{aligned} \hat{y}_{n+1}^{(0)} &= (\text{wzór jawny/niejawny/ulepszony metody}) \\ \hat{y}_{n+1}^{(1)} &= (\text{ulepszony wzór niejawny metody dla } \hat{y}_{n+1} := \hat{y}_{n+1}^{(0)}) \\ \hat{y}_{n+1}^{(2)} &= (\text{ulepszony wzór niejawny metody dla } \hat{y}_{n+1} := \hat{y}_{n+1}^{(1)}) \\ &\vdots \end{aligned}$$

W ten sposób otrzymujemy * **iterowany ulepszony wzór wsteczny Eulera**

$$\begin{aligned} \hat{y}_{n+1}^{(0)} &= y_n + hf(t_n, y_n) && (\text{jawny wzór Eulera}) \\ \hat{y}_{n+1}^{(1)} &= y_n + hf(t_{n+1}, \hat{y}_{n+1}^{(0)}) && (\text{ulepszony wzór wsteczny Eulera}) \\ \hat{y}_{n+1}^{(2)} &= y_n + hf(t_{n+1}, \hat{y}_{n+1}^{(1)}) && (\text{ulepszony wzór wsteczny Eulera}) \\ &\vdots \\ \hat{y}_{n+1}^{(K)} &= y_n + hf(t_{n+1}, \hat{y}_{n+1}^{(K-1)}) && (\text{ulepszony wzór wsteczny Eulera}) \end{aligned}$$

* **iterowany ulepszony wzór trapezów**

$$\begin{aligned} \hat{y}_{n+1}^{(0)} &= y_n + hf(t_n, y_n) && (\text{jawny wzór Eulera}) \\ \hat{y}_{n+1}^{(1)} &= y_n + \frac{h}{2} [f(t_n, y_n) + f(t_{n+1}, \hat{y}_{n+1}^{(0)})] && (\text{ulepszony wzór trapezów}) \\ \hat{y}_{n+1}^{(2)} &= y_n + \frac{h}{2} [f(t_n, y_n) + f(t_{n+1}, \hat{y}_{n+1}^{(1)})] && (\text{ulepszony wzór trapezów}) \\ &\vdots \\ \hat{y}_{n+1}^{(K)} &= y_n + \frac{h}{2} [f(t_n, y_n) + f(t_{n+1}, \hat{y}_{n+1}^{(K-1)})] && (\text{ulepszony wzór trapezów}) \end{aligned}$$

In [7]: # *Iterowany ulepszony wzór trapezów*

```
h = (b-a)/N      # krok w metodzie

tic()
t,y = t0,y0
for i=1:N
    y_predictor = y+h*f(t,y)          # jawny wzór Eulera
    y_corrector = y_predictor
```

```

    for k=1:5
        y_corrector = y + h/2*( f(t,y) + f(t+h,y_corrector) )    # ulepszony wzór trapezów
    end
    t,y = t+h, y_corrector
end
toc()

@printf("Liczba kroków = %d\n", N);
@printf("Krok = %.2e\n", h);
@printf("Rozwiązanie przybliżone = %5.16f\n", y);
@printf("Rozwiązanie dokładne      = %5.16f\n", exact);
@printf("Błąd bezwzględny          = %5.3e\n", abs(y-exact));
# wyniki podobne do metody niejawnej

elapsed time: 0.057214324 seconds
Liczba kroków = 10000
Krok = 2.00e-04
Rozwiązanie przybliżone = 3354.4541662822389299
Rozwiązanie dokładne    = 3354.4527354219444533
Błąd bezwzględny        = 1.431e-03

```

1.5. Metody z punktem środkowym

Przypomnijmy, że wszystkie poprzednie metody otrzymano stąd, że

$$y_{n+1} = y_n + \int_{t_n}^{t_{n+1}} f(t, y(t)) dt.$$

Do przybliżenia powyższej całki używano jedynie wartości na końcach przedziału całkowania, tj. w punktach t_n, t_{n+1} . Oczywiście jest, że jeśli użyjemy większej informacji o funkcji $f(t, y(t))$, to powinniśmy otrzymać jeszcze lepsze przybliżenia powyższej całki.

W metodach z punktem środkowym wykorzystuje się dodatkowy punkt $t_{n+1/2} = t_n + h/2$. Podobnie, jak poprzednio, możemy w ten sposób otrzymywać metody jawne, niejawne, ulepszone, a nawet możemy stosować itrowane ulepszenie.

Na przykład, korzystając z przybliżenia

$$\int_a^b f(t) dt \approx (b-a) f\left(\frac{a+b}{2}\right),$$

otrzymujemy następującą **jawną metodę punktu środkowego**

$$y_{n+1} = y_n + hf\left(t_n + \frac{h}{2}, y_{n+1/2}\right), \quad \text{gdzie} \quad y_{n+1/2} = y_n + \frac{h}{2}f(t_n, y_n).$$

Można ją zapisać w następującej postaci:

$$\begin{aligned} K_1 &= hf(t_n, y_n) \\ K_2 &= hf\left(t_n + \frac{h}{2}, y_n + \frac{1}{2}K_1\right) \\ y_{n+1} &= y_n + K_2. \end{aligned}$$

Drobna zmiana daje **niejawną metodę z punktem środkowym**

$$\begin{aligned} K_1 &= hf\left(t_n + \frac{h}{2}, y_n + \frac{1}{2}K_1\right) \\ y_{n+1} &= y_n + K_1. \end{aligned}$$

In [8]: # Jawna metoda punktu środkowego

```

h = (b-a)/N    # krok w metodzie

tic()

```

```

t,y = t0,y0
for i=1:N
    K1 = h*f(t,y)
    K2 = h*f(t+h/2,y+K1/2)
    y = y + K2
    t = t+h
end
toc()

@printf("Liczba kroków = %d\n", N);
@printf("Krok = %.2e\n", h);
@printf("Rozwiązanie przybliżone = %5.16f\n", y);
@printf("Rozwiązanie dokładne = %5.16f\n", exact);
@printf("Błąd bezwzględny = %5.3e\n", abs(y-exact));

elapsed time: 0.031048116 seconds
Liczba kroków = 10000
Krok = 2.00e-04
Rozwiązanie przybliżone = 3354.4498754200058102
Rozwiązanie dokładne = 3354.4527354219444533
Błąd bezwzględny = 2.860e-03

```

1.6. Metody Rungego-Kutty

Jeśli w metodzie punktu środkowego zastosujemy proces ulepszania, to możemy uzyskać w ten sposób, np. następujące dwa warianty **ulepszonej metody punktu środkowego**:

$$\begin{aligned}
 K_1 &= h f(t_n, y_n) \\
 K_2 &= h f(t_n + \frac{h}{2}, y_n + \frac{1}{2} K_1) \\
 K_3 &= h f(t_n + \frac{h}{2}, y_n + \frac{1}{2} K_2) \quad (\text{ulepszona wartość } K_2) \\
 y_{n+1} &= y_n + K_3 \quad (\text{wariant 1}) \\
 y_{n+1} &= y_n + \frac{1}{2} K_2 + \frac{1}{2} K_3 \quad (\text{wariant 2})
 \end{aligned}$$

W ogólności, można tak

$$y_{n+1} = y_n + c_1 K_1 + c_2 K_2 + c_3 K_3, \quad \text{gdzie } c_1 + c_2 + c_3 = 1.$$

W metodzie Rungego-Kutty stosuje się ten sam pomysł, z tym, że starujemy od wzoru

$$\int_a^b f(t) dt = h \left(\frac{1}{6} f(a) + \frac{4}{6} f\left(\frac{a+b}{2}\right) + \frac{1}{6} f(b) \right).$$

Otrzymujemy wówczas związek

$$y_{n+1} = y_n + \frac{1}{6} h f(t_n, y_n) + \frac{4}{6} h f(t_n + \frac{h}{2}, y_{n+1/2}) + \frac{1}{6} h f(t_n + h, y_{n+1}),$$

w którym występują nieznane $y_{n+1/2}$ i y_{n+1} odpowiednio w drugim i trzecim składniku. Proponuje się rozbić drugi składnik na dwa:

$$\frac{4}{6} h f(t_n + \frac{h}{2}, y_{n+1/2}) = \frac{2}{6} h f(t_n + \frac{h}{2}, y_{n+1/2}) + \frac{2}{6} h f(t_n + \frac{h}{2}, y_{n+1/2}),$$

a następnie w pierwszym zastosować przybliżenie

$$y_{n+1/2}^{(0)} := y_n + \frac{h}{2} f(t_n, y_n) \quad \text{czyli wzór jawny Eulera,}$$

a w drugim — przybliżenie

$$y_{n+1/2}^{(1)} := y_n + \frac{h}{2} f(t_n + \frac{h}{2}, y_{n+1}^{(0)}) \quad \text{czyli ulepszony wzór jawny Eulera,}$$

Klasyczną wersję tej metody opisują więc wzory

$$\begin{aligned} K_1 &= h f(t_n, y_n) \\ K_2 &= h f(t_n + \frac{h}{2}, y_n + \frac{1}{2}K_1) \\ K_3 &= h f(t_n + \frac{h}{2}, y_n + \frac{1}{2}K_2) && \text{(ulepszona wartość } K_2) \\ K_4 &= h f(t_n + h, y_n + K_3) \\ y_{n+1} &= y_n + \frac{1}{6}K_1 + \frac{2}{6}K_2 + \frac{2}{6}K_3 + \frac{1}{6}K_4 \end{aligned}$$

In [10]: # Metoda Rungego-Kutty

```
h = (b-a)/N      # krok w metodzie

tic()
t,y = t0,y0
for i=1:N
    K1 = f(t, y)
    K2 = f(t+h/2, y+h*K1/2)
    K3 = f(t+h/2, y+h*K2/2)
    K4 = f(t+h, y+h*K3)
    y = y + h/6*(K1+2*(K2+K3)+K4)
    t = t+h
end
toc()

@printf("Liczba kroków = %d\n", N);
@printf("Krok = %.2e\n", h);
@printf("Rozwiązanie przybliżone = %5.16f\n", y);
@printf("Rozwiązanie dokładne = %5.16f\n", exact);
@printf("Błąd bezwzględny = %5.3e\n", abs(y-exact));

elapsed time: 0.065161376 seconds
Liczba kroków = 10000
Krok = 2.00e-04
Rozwiązanie przybliżone = 3354.4527354218771507
Rozwiązanie dokładne = 3354.4527354219444533
Błąd bezwzględny = 6.730e-11
```

2. Równania różniczkowe wyższych rzędów

2.1. Przykład (równanie drugiego rzędu)

$$y'' = f(t, y, y')$$

Wówczas zagadnienie początkowe Cauchy'ego ma następujące **warunki początkowe**

$$\begin{cases} y(t_0) &= y_0, \\ y'(t_0) &= y'_0. \end{cases}$$

Równanie różniczkowe możemy sprowadzić do układu dwóch równań rzędu pierwszego. Mianowicie wprowadzamy oznaczenia

$$a(t) = y(t), \quad b(t) = y'(t).$$

Szukamy zatem dwóch funkcji $a(t), b(t)$ spełniających układ równań

$$\begin{cases} a' &= b, \\ b' &= f(t, a, b). \end{cases}$$

2.1.1. Przykład

Rozważmy kulkę o masie m zawieszoną na sprężynie o sprężystości k . Jeśli początkowa długość sprężyny wynosi L , a przez zawieszenie kulki, jej długość wzrosła o ΔL , to łatwo sprawdzić, że $k = mg/\Delta L$, gdzie g oznacza przyspieszenie związane z grawitacją.

Jeśli $x(t)$ oznacza długość sprężyny w chwili t , to z drugiej zasady dynamiki Newtona, można łatwo otrzymać następujące równanie ruchu kulki:

$$mx'' = mg - k(x - L).$$

Stąd

$$mx'' = -k(x - L - \Delta L),$$

a dodając jeszcze opór — otrzymujemy równanie

$$mx'' = -k(x - L - \Delta L) - rx',$$

gdzie r jest pewnym współczynnikiem ($r = 0$ oznacza brak oporu).

2.2. Rozwiązywanie układu równań pierwszego rzędu

Całą teorię rozwiązywania równań pierwszego rzędu można również zastosować do układów równań. Wystarczy zastąpić funkcję $y = y(t)$ funkcją wektorową $\vec{y} = \vec{y}(t) = [y_1(t), y_2(t)]$ oraz przyjąć notację

$$\vec{y}' = [y_1'(t), y_2'(t)]$$

Na przykład, dla równania sprężyny otrzymujemy następujący układ równań pierwszego rzędu

$$\begin{cases} y_1' &= y_2, \\ y_2' &= -k(y_1 - L - \Delta L) - ry_2. \end{cases}$$

Inaczej możemy napisać

$$\vec{y}' = f(t, \vec{y}),$$

gdzie

$$f(t, \vec{y}) = [y_2, -k(y_1 - L - \Delta L) - ry_2].$$

```
In [16]: L = 2.0;      # długość sprężyny (stan swobodny)
        g = 9.81;     # przyspieszenie ziemskie

        m = 5.0;      # masa kulki

        ΔL = 4.0;     # przyrost długości sprężyny po zawieszeniu kulki
        k = m*g/ΔL;   # współczynnik sprężystości sprężyny

        r = 0.10;     # współczynnik oporu

#### Zagadnienie początkowe
y_0 = [ L+ΔL+3.0, 0.0 ]; # umieszczamy kulkę w pozycji y_0[1] oraz nadajemy jej prędkość y_0[2]

# m*y'' + k*(y-L-ΔL) = 0
# y1 = y
# y2 = y'

f(x,y::Vector{Float64}) = [ y[2] , -k*(y[1]-L-ΔL) - r*y[2] ]

function method_step_RK(t, y::Vector{Float64}, h, f::Function)
    K1 = f(t, y)
    K2 = f(t+h/2 , y+h*K1/2)
    K3 = f(t+h/2 , y+h*K2/2)
    K4 = f(t+h , y+h*K3 )
    return y + h/6*(K1+2*(K2+K3)+K4);
```



```

end

method_step = method_step_RK;

a, b = 0.0, 30.0 # b-a = czas (w sekundach)
fps = 25;

x_0 = a
N = convert(Int, (b-a)*fps );
x = linspace(a,b,N);
global y = zeros(2,N)
y[:,1] = y_0

for i=1:N-1
    y[:,i+1] = method_step(x[i],y[:,i],x[i+1]-x[i],f);
    # @printf("y(%6.2f) = %19.16f\n", x[i+1], y[1,i+1]);
end

plot( y[1,:] )

```

WARNING: Method definition f(Any, Array{Float64, 1}) in module Main at In[15]:18 overwritten at In[15]:18
 WARNING: Method definition method_step_RK(Any, Array{Float64, 1}, Any, Function) in module Main at In[15]:18

```

In [13]: using PyPlot
         using PyCall

y[1,:] = -y[1,:];

@pyimport matplotlib as mat_pl
mat_pl.rc("font", family="Arial")

fig = figure();
ax = axes(xlim=(-1, 1), ylim=(-1.6*(y_0[1]), 0.5));

# plot( 0.7, -(L+ΔL), "ko", markersize=5);
text(-0.9, -1.5, """Analiza numeryczna (3 stycznia 2017).
                Zawieszona kulka na sprężynie (z oporem powietrza)""")
text(-0.9, -4.5, """Masa kulki = $m$ kg
                Długość sprężyny = $L$ m
                Długość sprężyny po zawieszeniu kulki $(L+ΔL)$ m
                Zagadnienie początkowe [ $(y_0[1])$, $(y_0[2])$ m/s ]""")
text(0.6, -13, "Rafał Nowak")
global line = ax[:plot]([], [], lw=4, alpha=0.2)[1]
global vel = ax[:plot]([], [], lw=1)[1]
global ball = ax[:plot]([], [], "ro", markersize=10)[1]
text(0.2, -0.1, "Czas ")
global time_text = ax[:text](0.4, -0.1, "")
text(0.6, -0.1, "s")

# initialization function: plot the background of each frame
function init()
    global line, time_text
    line[:set_data]([], [])
    vel[:set_data]([], [])
    time_text[:set_text]("");
    ball[:set_data]([], [])
    return (line,time_text)
end

```

```

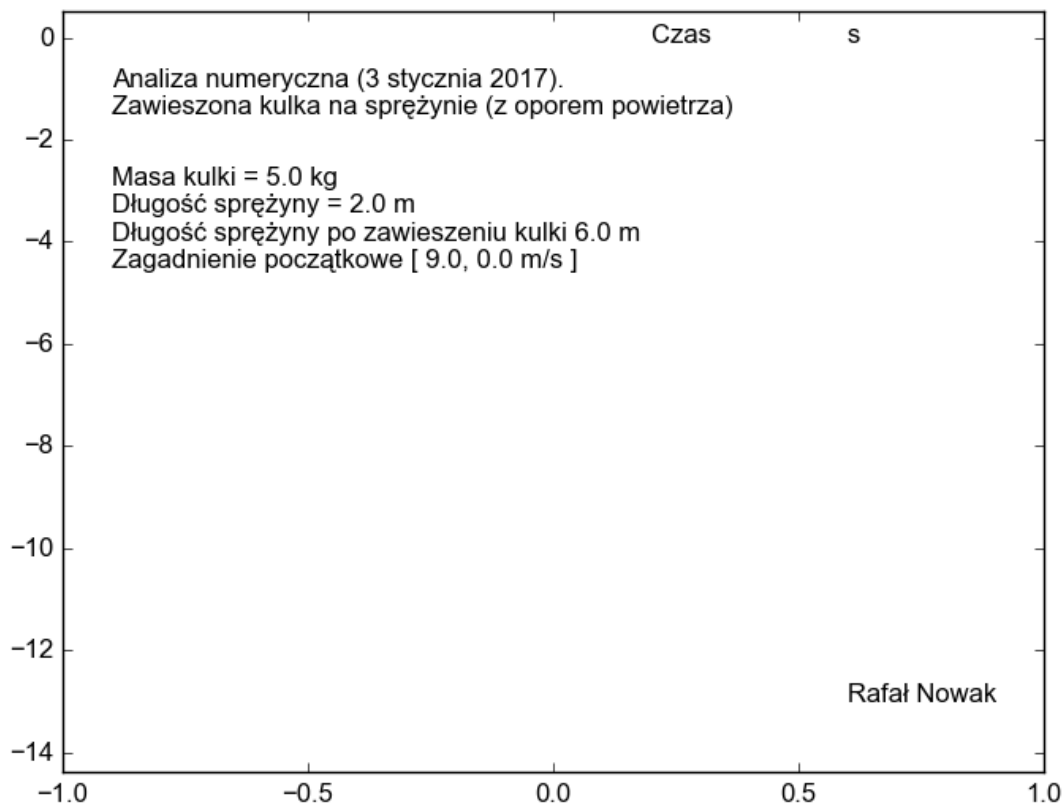
end

# animation function. This is called sequentially
function animate(i)
    global line, time_text, y
    line[:set_data]([0.7,0.7], [0,y[1,i]])
    vel[:set_data]([0.7,0.7], [y[1,i],y[1,i]-y[2,i]])
    time_text[:set_text](@sprintf("%.2f",i/fps));
    ball[:set_data]([0.7], [y[1,i]] )
    return (line,time_text)
end

@pyimport matplotlib.animation as anim

myanim = anim.FuncAnimation(fig, animate, 1:N, init_func=init, interval=1000.0/fps);
# show() # do not work in IJulia
myanim[:save]("/tmp/anim.mp4", extra_args=["-vcodec", "libx264", "-pix_fmt", "yuv420p"],fps

```



WARNING: using PyPlot.plot in module Main conflicts with an existing identifier.

```

In [14]: display("text/html", string("""<video autoplay controls><source src="data:video/x-m4v;base64
base64encode(open(read,"/tmp/anim.mp4")),""" type="video/mp4"></video>"""))

In [ ]:

```