## Методические материалы: Разностные схемы для ОДУ колебаний

С. Лемешевский $^1$ 

Институт математики НАН Беларуси<sup>1</sup>

Mar 13, 2017

### Простейшая модель колебательного процесса

$$u'' + \omega^2 u = 0, \quad t \in (0, T],$$
 (1)

$$u(0) = U, \quad u'(0) = 0.$$
 (2)

Точное решение

$$u(t) = U\cos\omega t,\tag{3}$$

описывает колебания с постоянной амплитудой U и угловой частотой  $\omega$ . Соответствующий период колебаний равен  $P=2\pi/\omega$ .

### Разностная схема

ullet Введем равномерную сетку по переменной t с шагом au:

$$\omega_{\tau} = \{t_n = n\tau, n = 0, 1, ... N\}.$$

• Простейшая разностная схема

$$\frac{y^{n+1} - 2y^n + y^{n-1}}{\tau^2} = -\omega^2 y^n. \tag{4}$$

• Для формулировки вычислительного алгоритма, предположим, что мы уже знаем значение  $y^{n-1}$  и  $y^n$ . Тогда из мы можем выразитьнеизвестное значение  $y^{n+1}$ :

$$y^{n+1} = 2y^n - y^{n-1} - \tau^2 \omega^2 y^n.$$
 (5)

### Вычисление решения на первом шаге

Очевидно, что для вычисления  $y^1$  необходимо знать неопределенное значение  $y^{-1}$  при t=- au.

Аппроксимируем начальное условие u'(0) = 0 центральной разностной производной:

$$\frac{y^1 - y^{-1}}{2\tau} = 0 \Rightarrow y^1 = y^{-1}$$

Подставляя последнее в разностную схему при n=0, получим

$$y^1 = y^0 - \frac{1}{2}\tau^2\omega^2 y^0.$$
(6)

### Вычислительный алгоритм

- $y^0 = U$
- вычисляем y<sup>1</sup>
- для n = 1, 2, . . . ,
  - вычисляем y<sup>n</sup>

Более строго вычислительный алгоритм напишем на Python:

### Безындексные обозначения

Разностную схему можно записать, используя безындексные обозначения.

Левая и правая разностные производные

$$y_{\overline{t}} \equiv \frac{y^n - y^{n-1}}{\tau}, \quad y_t \equiv \frac{y^{n+1} - y^n}{\tau}.$$

Вторая разностная производная

$$y_{\bar{t}t} = \frac{y_t - y_{\bar{t}}}{\tau} = \frac{y^{n+1} - 2y^n + y^{n-1}}{\tau^2}.$$

Центральная разностная производная:

$$y_{\hat{t}} = \frac{y^{n+1} - y^{n-1}}{2\tau}.$$

```
def visualize(u, t, U, omega):
    plt.plot(t, u, 'r-o')
    t.fine = np.linspace(o, t[-1], 1001) # \T2A\cyrm \T2A\cyre \T2A\c
    u.e = u.exact(t.fine, U, omega)
    plt.plot(t.fine, u.e, 'b-')
    plt.legend([u'\T2A\cyrr \T2A\cyrr \T2A\cyrr \T2A\cyrb \T2A\cyrl \T
    plt.xlabel('$t$')
    plt.ylabel('$t$')
    plt.ylabel('$t$')
    plt.title("$\T2A\cyrr \T2A\cyrr \T2A\cyrr \T2A\cyrb \T2A\cyrl \T
    plt.stitle("$\T2A\cyrb \T
    plt.savefig("tmp1.png"); plt.savefig("tmp1.pdf")
```

### Основная программа

```
U = 1
omega = 2*pi
tau = 0.05
num_periods = 5
P = 2*np.pi/tau  # \T2A\cyro \T2A\cyrd \T2A\cyri \T2A\cyrn \T2A\cy
T = P*num_periods
u, t = solver(U, omega, tau, T)
visualize(u, t, U, omega, tau)
```

### Интерфейс пользователя: командная строка

```
import argparse
parser = argparse.ArgumentParser()
parser.add_argument('--U', type=float, default=1.0)
parser.add_argument('--twpe=float, default=2*np.pi)
parser.add_argument('--tau', type=float, default=0.05)
parser.add_argument('--tmuperiods', type=int, default=5)
a = parser.parse_args()
U, omega, tau, num_periods = a.U, a.omega, a.tau, a.num_periods
```

Стандартный вызов основной программы выглядит следующим образом:

Terminal> python vib\_undamped.py --num\_periods 20 --tau 0.1

### Простейшие способы тестирования

- Тестирование на простейших решениях:  $u = {
  m const}$  или u = ct + d не применимы здесь (без правой части в уравнении).
- Ручные вычисления:

вычислить значений  $y^1, y^2$  и  $y^3$  и сравнить с результатом программы.

```
def test_three_steps():
    from math import pi
    U = 1;    omega = 2*pi;    tau = 0.1;    T = 1
    u_by_hand = np.array([
    1.00000000000000,
    0.802607911978213,
    0.28858920740053])
    u, t = solver(U, omega, tau, T)
    diff = np.abs(u_by_hand - u[:3]).max()
    tol = 1E-14
    assert diff < tol</pre>
```

### Оценка скорости сходимости

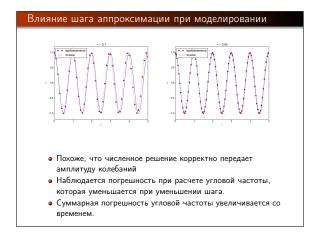
Чтобы оценить скорость сходимости для рассматриваемой задачи, нужно выполнить

- ullet провести m расчетов, уменьшая на каждом из них шаг в два раза:  $au_k = 2^{-k} au_0, \; k=0,1,\ldots,m-1,$
- ullet вычислить  $L_2$  -норму погрешности для каждого расчета  $arepsilon_k = \sqrt{\sum_{n=0}^{N-1} (y^n u_e(t_n))} au_k,$
- ullet оценить скорость сходимости на основе двух последовательных экспериментов  $( au_{k-1}, arepsilon_{k-1})$  и  $( au_k, arepsilon_k)$

```
| TPOFFMMHAR PEAJUSALUMS

| def convergence_rates(m, solver_function, num_periods=8):
| """ | TZA|CYTR | TZA|cyro | TZA|Cyrz | TZA|Cyrr | TZA|
```

## Юнит-тест для скорости сходимости Используем последнего элемента r[-1] в юнит-тесте: def test\_convergence\_rates(): r = convergence\_rates(m=5, solver\_function=solver, num\_periods=8) tol = 0.1 assert abs(r[-1] - 2.0) < tol</td>



```
Оспользование изменяющихся графиков

При моделировании на длительном временном отрезке нам нужно строить график "следующий"за решением.

Пакет SciTools содержит удобный инструмент для этого: MovingPlotWindow.

Пример вызова:

Тетminal> python vib_undamped.py --dt 0.05 --num_periods 40

Видео
```

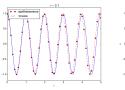
```
Использование Bokeh для сравнения графиков
```

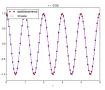
```
Kak выглядит код для построения графиков с помощью Bokeh?

def bokeh.plot(u, t, legends, U, omega, t_range, filename):
    """
    "TZAICYRS | TZAIcyrt | TZAIcyrr | TZAIcyro | TZAIcyri | TZAIcyrs |
```

### Анализ конечно-разностной схемы

Можем ли понять появление ошибки в частоте?





### Видео с развитием ошибки частоты

Movie 1: mov-fdm-for-ode/movie. mp4

### Можно получить точное решение дискретной задачи

- ullet Мы имеем линейное однородное разностное уравнение относительно  $y^n$
- Решение этого уравнения имеет вид  $y^n = Uq^n$ , где q неизвестное число
- ullet Здесь:  $u_e(t) = U\cos\omega t \sim Uexp(i\omega t) = U*e^{i\omega au n}$
- ullet Прием для упрощения алгебраических выкладок:  $y^n = Uq^n$  с  $q = \exp(i ilde{\omega} au)$ , затем находим  $ilde{\omega}$
- $\tilde{\omega}$  неизвестная *численная частота* (проще в вычислении, чем q)
- ullet  $\omega \tilde{\omega}$  погрешность частоты
- Используем действительную часть как физически обоснованную часть комплексного выражения

### Вывод решения конечно-разностной схемы

$$y^n = Uq^n = U \exp(\tilde{\omega}\tau n) = U \exp i\tilde{\omega}t = U \cos(\tilde{\omega}t) + iU \sin(\tilde{\omega}t).$$

$$\begin{split} y_{tt}^n &= \frac{y^{n+1} - 2y^n + y^{n-1}}{\tau^2} \\ &= U \frac{q^{n+1} - 2q^n + q^{n-1}}{\tau^2} \\ &= \frac{U}{\tau^2} \left( e^{i(\tilde{\omega}t + \tau)} - 2e^{i(\tilde{\omega}t)} + e^{i(\tilde{\omega}t - \tau)} \right) \\ &= U e^{i(\tilde{\omega}t)} \frac{1}{\tau^2} \left( e^{i\tau} + e^{-i\tau} - 2 \right) \\ &= U e^{i(\tilde{\omega}t)} \frac{2}{\tau^2} \left( \cos(\tilde{\omega}\tau) - 1 \right) \\ &= -U e^{i(\tilde{\omega}t)} \frac{4}{\tau^2} \sin^2 \left( \frac{\tilde{\omega}\tau}{2} \right) \end{split}$$

### Решение относительно численной частоты

Подставляя  $y^n = U e^{\tilde{\omega} au n}$  в разностную схему, получим

$$-\mathit{U}\mathrm{e}^{i(\tilde{\omega}t)}\frac{4}{\tau^2}\sin^2\left(\frac{\tilde{\omega}\tau}{2}\right)+\omega^2\mathit{U}\mathrm{e}^{i(\tilde{\omega}t)}=0.$$

Разделив последнее выражение на  $Ue^{i(\tilde{\omega}t)}$ , получим

$$\frac{4}{\tau^2}\sin^2\left(\frac{\tilde{\omega}\tau}{2}\right) = \omega^2.$$

Отсюда

$$\tilde{\omega} = \pm \frac{2}{\pi} \arcsin\left(\frac{\omega\tau}{2}\right). \tag{7}$$

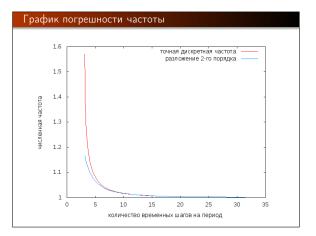
- ullet Численная частота  $ilde{\omega}$  никогда не равна точной  $\omega.$
- Насколько хороша аппроксимация?

### Полиномиальная аппроксимация погешности частоты

Разложение в ряд Тейлора по au дает

$$\tilde{\omega} = \omega \left( 1 + \frac{1}{24} \omega^2 \tau^2 \right) + \mathcal{O}(\tau^4). \tag{8}$$

Слишком большая численная частота дает слишком быстро колеблющийся профиль.



### Точное дискретное решение

$$y^n = U\cos(\tilde{\omega}\tau n), \quad \tilde{\omega} = \frac{2}{\tau}\arcsin\left(\frac{\omega\tau}{2}\right).$$
 (9)

Сеточная функция погрешности:

$$e^{n} = u_{e}(t_{n}) - u^{n} = U \cos(\omega \tau n) - U \cos(\tilde{\omega} \tau n)$$

$$= -2U \sin\left(\frac{t}{2}(\omega - \tilde{\omega})\right) \sin\left(\frac{t}{2}(\omega + \tilde{\omega})\right). \tag{10}$$

Построенная сеточная функция погрешности идеальна для целей тестирования.

### Сходимость

Можно легко показать сходимость:

$$e^n \to 0$$
 при $\tau \to 0$ ,

T.K.

$$\lim_{\tau \to 0} = \lim_{\tau \to 0} \frac{2}{\tau} \arcsin\left(\frac{\omega \tau}{2}\right) = \omega.$$

Это можно проверить, например, с помощью sympy:

```
>>> import sympy as sym
>>> tau, omega = sym.symbols('tau omega')
>>> sym.limit((2/tau)*sym.asin(omega*tau/2),tau,0,dir='+')
omega
```

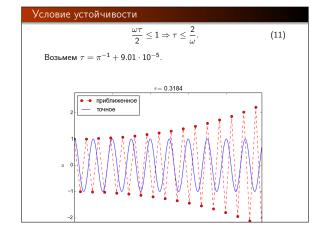
### Устойчивость

Наблюдения:

- Численное решение имеет правильную постоянную амплитуду, но ошибку в частоте.
- Постоянная амплитуда будет, если  $\mathrm{arcsin}(\omega au/2)$  будет действительнозначным  $\Rightarrow |\omega au/2| < 1$
- ullet При  $|\omega au/2|>1$  значения  $\arcsin(\omega au/2)$  и, следовательно,  $ilde{\omega}$  являются комплексными:

Какие последствия того, что  $\tilde{\omega}$  комплексное?

- Пусть  $\tilde{\omega} = \tilde{\omega}_r + i\tilde{\omega}_i$ .
- ullet Так как  $\arcsin(x)$  имеет отрицательную мнимую часть при x>1,  $\ddot{\omega}_i<0$ , то  $e^{i\ddot{\omega}t}=e^{-\ddot{\omega}t}e^{i\ddot{\omega}t}$ , что означает экспоненциальный рост со временем, так как  $e^{-\ddot{\omega}t}$  при  $\ddot{\omega}<0$  имеет положительную степень.
- Это и есть неустойчивость.



### Выводы

Из анализа точности и устойчивости можно сделать некоторые выводы:

- Ключевой параметр в формулах  $p=\omega \tau$ . Пусть период колебаний  $P=2\pi/\omega$ , количество временных шагов на период  $N_P=P/\tau$ . Тогда  $p=\omega \tau=2\pi N_P$ , т.е. основным параметром является количество временных шагов на период. Наименьшее возможное  $N_P=2$ , т.е.  $p\in (0,\pi]$ .
- **4** Если  $p \le 2$ , то амплитуда численного решения постоянна.
- $m{\Theta}$  Отношение численной угловой частоты к точной есть  $\tilde{\omega}/\omega \approx 1+rac{
  ho^2}{2^4}$ . Погрешность  $rac{
  ho^2}{2^4}$  приводит к смещенным пикам численного решения, и это погрешность расположения пиков растет линейно со временем.

## Обобщения: затухание, нелинейные струны и внешние воздействия

$$mu'' + f(u') + s(u) = F(t), \quad t \in (0, T], \quad u(0) = U, \quad u'(0) = V.$$
(12)

Здесь m, f(u'), s(u), F(t), U, V и T — входные параметры.

Типичные варианты выбора f и s:

- ullet линейное затухание f(u') = bu' или
- ullet квадратичное затухание f(u') = bu'|u'|
- линейные пружины: s(u) = cu
- $\bullet$  нелинейные пружины  $s(u) \sim \sin(u)$  (маятник)

### Разностная схема для линейного затухания

$$my_{\tilde{t}t}^n + by_{\tilde{t}}^n + s(y^n) = F^n, \quad n = 1, 2, \dots, N - 1,$$
 (13)

$$y^0 = U, \quad y_{\hat{t}}^0 = \frac{y^1 - y^{-1}}{2\tau} = V.$$
 (14)

В индексной форме:

$$m\frac{y^{n+1}-2y^n+y^{n-1}}{\tau^2}+b\frac{y^{n+1}-y^{n-1}}{2\tau}+s(y^n)=F^n, \quad n=1,2,\ldots,N$$
(15)

$$y^{0} = U, \quad \frac{y^{1} - y^{-1}}{2\tau} = \frac{(15)}{(16)}$$

$$y^{n+1} = \frac{2my^n + (0.5\tau - m)y^{n-1} + \tau^2(F^n - s(y^n))}{m + 0.5b\tau}, \quad n = 1, 2, \dots, N-1.$$
(17)

### Начальные условия

При n=0 с учетом второго начального условия имеем

$$y^{1} = y^{0} + \tau V + \frac{\tau^{2}}{2m} (F^{0} - s(y^{0}) - bV).$$
 (18)

### Разностная схема для квадратичного затухания

- Пусть f(u') = bu'|u'|.
- Аппроксимацию f(u') выполним, основываясь на использовании геометрического среднего:

$$(w^2)^n \approx w^{n-1/2} w^{n+1/2}$$

При w = u' имеем

$$(u'|u'|)^n \approx u'(t_{n+1/2})|u'(t_{n-1/2})|.$$

Для аппроксимации u' в точках  $t_{n\pm 1}$  воспользуемся направленными разностями, которые имеют второй порядок аппроксимации относительно полуцелых точек:

$$u'(t_{n+1/2}) \approx \frac{y^{n+1}-y^n}{\tau} = y_t^n, \quad u'(t_{n-1/2}) \approx \frac{y^n-y^{n-1}}{\tau} = y_t^n.$$

### Разностная схема для квадратичного затухания

Таким образом, получим разностное уравнение

$$my_{tt}^n + by_t^n y_t^n + s(y^n) = F^n, \quad n = 1, 2, \dots, N - 1,$$
 (19)

которая является линейной относительно  $y^{n+1}$ :

$$y^{n+1} = \frac{2my^n - my^{n-1} + by^n|y^n - y^{n-1}| + \tau^2(F^n - s(y^n))}{m + b|y^n - y^{n-1}|}.$$
(20)

### Начальные условия для квадратичного затухания

Для t=0 имеем u'(0)|u'(0)|=bV|V|. Используя это выражение в уравнении и значение u(0)=U при t=0, получим

$$my_{tt}^1 + bV|V| + s(U) = F^0.$$

Отсюда

$$y^{1} = y^{0} + \tau V + \frac{\tau^{2}}{2m} (F^{0} - mV|V| - s(U)).$$
 (21)

### Алгоритм

- $v^0 = U;$
- вычисляем y<sup>1</sup> (формула зависит от линейного/квадратичного затухания)
- $\bigcirc$  для  $n = 1, 2, \ldots, N-1$ :
  - вычисляем  $y^{n+1}$  (формула зависит от линейного/квадратичного затухания)

### Верификация реализации алгоритма

- Постоянное решение  $u_e(t) = U(V=0)$  удовлетворяет дифференциальной и дискретной задаче. Идеально для отладки!
- Линейная функция  $u_e(t) = ct + d$  дифференциальной и дискретной задаче.
- Функция  $u_e(t) = bt^2 + Vt + U$  удовлетворяет дифференциальной задаче и дискретной задаче с линейным затуханием, но не с квадратичным. Специальный вид дискретной правой части может допускать  $u_e$  как решение дискретной задачи с квадратичным затуханием.

# Демонстрационная программа Сценарий vib.py допускает вызов с параметрами командной строки: Terminal> python vib.py --s 'sin(u)' --F '3\*cos(4\*t)' --b 0.03 --T 60