Global Exercise - Gue07

Tuan Vo

27th May, 2022

1 Numerics: FDM \cdot BC \cdot Derivation of $A_h \& b_h$

Example 1. Discretization of the following convection-diffusion problem:

$$-u''(x) - 5u'(x) = 3, \quad for \ x \in (0, 1)$$
 (1)

with boundary conditions u(0) = u(1) = 1.

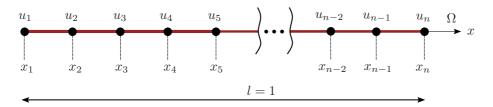


Figure 1: Discretization of domain Ω with n points.

Approach: Central method for u''(x) is obtained as follows

$$u''(x) = \frac{u(x+h) - 2u(x) + u(x-h)}{h^2} + \mathcal{O}(h^2).$$
 (2)

Forward method for u'(x) is obtained as follows

$$u'(x) = \frac{u(x+h) - u(x)}{h} + \mathcal{O}(h). \tag{3}$$

which leads to the system $A_h u_h = b_h$ where A_h and b_h are recognized as follows

$$A_{h} = \frac{1}{h^{2}} \begin{pmatrix} 2+5h & -1-5h \\ -1 & 2+5h & -1-5h \\ & \ddots & \ddots & \ddots \\ & & \ddots & \ddots & \ddots \\ & & & -1 & 2+5h & -1-5h \\ & & & & -1 & 2+5h \end{pmatrix} \in \mathbb{R}^{(n-2)\times(n-2)},$$

$$(4)$$

$$b_h = \begin{pmatrix} 3 + \frac{1}{h^2} \\ 3 \\ \vdots \\ 3 \\ 3 + \frac{1}{h^2} + \frac{5}{h} \end{pmatrix} \in \mathbb{R}^{(n-2)}.$$
 (5)

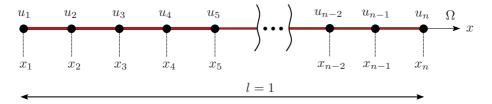


Figure 2: Discretization of domain Ω with n points.

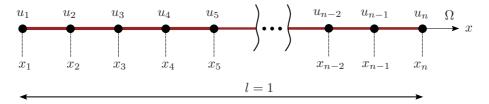


Figure 3: Discretization of domain Ω with n points.

2 Analysis: Spectral theory · Laplace operators

Example 2. Examine the following problem

$$\partial_t u(x,t) = \partial_{xx} u(x,t) + a,$$
 $x \in (0,1), t > 0,$
 $u(0,t) = 0,$ $t > 0,$
 $u(1,t) = 0,$ $t > 0,$
 $u(x,0) = \sin(\pi x),$ $x \in (0,1),$

with constant source term $a \in \mathbb{R}$.

- 1. Compute the Eigenvalues and the normalized Eigenfunctions from ∂_{xx} ...
- 2. Develop the source term $a \in \mathbb{R}$ in these Eigenfunctions.
- 3. Compute the solution of the problem with the Eigenfunction ansatz.
- 1. Die zum Problem geh" orenden Eigenfunktionen und Eigenwerte erf" ullen

$$\varphi''(x) + \lambda \varphi(x) = 0, \quad x \in (0, 1)$$

$$\varphi(0) = \varphi(1) = 0$$

$$\Rightarrow \quad \varphi(x) = C_1 \sin(\sqrt{\lambda}x) + C_2 \cos(\sqrt{\lambda}x)$$

Mit den Randbedingungen f"ur φ erh" alt man

$$0 = \varphi(0) = C_2 \Rightarrow C_2 = 0$$

$$0 = \varphi(1) = C_1 \sin(\sqrt{\lambda}x) \Rightarrow \lambda_k = (k\pi)^2, k \in \mathbb{N}$$

$$\Rightarrow \varphi_k(x) = C_1 \sin(k\pi x), \ k \in \mathbb{N}$$

 C_1 erh" alt man durch Normierung

$$1 \stackrel{!}{=} \int_0^1 \varphi_k(x)^2 dx = C_1^2 \int_0^1 \sin^2(k\pi x) dx$$
$$= C_1^2 \left[\frac{x}{2} - \frac{\sin(2k\pi x)}{4k\pi} \Big|_0^1 \right] = C_1^2 \frac{1}{2}$$
$$\Rightarrow C_1 = \sqrt{2}$$

damit lauten die Eigenwerte und normierten Eigenfunktionen

$$\varphi_k(x) = \sqrt{2}\sin(k\pi x)$$

und $\lambda_k = (k\pi)^2$ f'ur $k \in \mathbb{N}$

2. Die Entwicklung des konstanten Quellterms a(x,t)=a in Eigenfunktionen lautet

$$a = \sum_{k=1}^{\infty} \beta_k \varphi_k(x)$$
$$= \sum_{k=1}^{\infty} \beta_k \sqrt{2} \sin(k\pi x)$$

Die Koeffizienten berechnet man durch

$$\beta_k = \int_0^1 a\sqrt{2}\sin(k\pi x)dx$$

$$= a\sqrt{2} \left[-\frac{\cos(k\pi x)}{k\pi} \Big|_0^1 \right]$$

$$= \frac{a\sqrt{2}}{k\pi} (1 - \cos(k\pi)) = \begin{cases} \frac{2a\sqrt{2}}{k\pi} & , k \text{ ungerade} \\ 0 & , \text{ sonst} \end{cases}$$

3. F"ur die L"osung u wird der Eigenfunktionen-Ansatz

$$u(x,t) = \sum_{k=1}^{\infty} \alpha_k(t) \varphi_k(x)$$

gew"ahlt, mit zeitabh"angigen Koeffizienten $\alpha_k(t)$, $t > 0, k \in \mathbb{N}$. Einsetzen der Entwicklungen von u(x,t) und a in die Differentialg

Einsetzen der Entwicklungen von u(x,t) und a in die Differentialgleichung liefert

$$(\sum_{k=1}^{\infty} \alpha_k(t)\varphi_k(x))_t = (\sum_{k=1}^{\infty} \alpha_k(t)\varphi_k(x))_{xx} + \sum_{k=1}^{\infty} \beta_k \varphi_k(x)$$

$$\Leftrightarrow \sum_{k=1}^{\infty} \alpha'_k(t)\varphi_k(x) = -\sum_{k=1}^{\infty} \alpha_k(t)\lambda_k \varphi_k(x) + \sum_{k=1}^{\infty} \beta_k \varphi_k(x)$$

$$\Leftrightarrow \sum_{k=1}^{\infty} (\alpha'_k(t) + \lambda_k \alpha_k(t) - \beta_k)\varphi_k(x) = 0$$

Wir erhalten eine gew"ohnliche Differentialgleichung f"ur die Koeffizienten $\alpha_k(t)$

$$\alpha_k'(t) = -\lambda_k \alpha_k(t) + \beta_k$$

mit der allgemeinen L"osung

$$\alpha_k(t) = \frac{\beta_k}{\lambda_k} + C_k e^{-\lambda_k t}.$$

Die Konstante C_k wird durch die Anfangsbedingung f'ur $\alpha_k(0)$ bestimmt. Dazu betrachten wir die Anfangsbedingung f'ur u:

$$u(x,0) = \sum_{k=1}^{\infty} \alpha_k(0)\sqrt{2}\sin(k\pi x) \stackrel{!}{=} \sin(\pi x)$$

$$\Rightarrow \alpha_1(0) \stackrel{!}{=} \frac{1}{\sqrt{2}} \text{ und } \alpha_k(0) = 0 \ \forall \ k > 1$$

Also gilt f''ur k = 1

$$\alpha_1(0) = \frac{\beta_1}{\lambda_1} + C_1 \stackrel{!}{=} \frac{1}{\sqrt{2}}$$

$$\Rightarrow C_1 = \frac{1}{\sqrt{2}} - \frac{\beta_1}{\lambda_1} = \frac{1}{\sqrt{2}} - \frac{2a\sqrt{2}}{\pi^3} = \frac{\pi^3 - 4a}{\sqrt{2}\pi^3}$$

und f''ur k > 1

$$\alpha_k(0) = \frac{\beta_k}{\lambda_k} + C_k \stackrel{!}{=} 0$$

$$\Rightarrow C_k = -\frac{\beta_k}{\lambda_k} = \begin{cases} -\frac{2a\sqrt{2}}{k^3\pi^3} & , k \text{ ungerade} \\ 0 & , \text{sonst} \end{cases}$$

Die L"osung u lautet daher insgesamt

$$u(x,t) = \alpha_1(t)\sqrt{2}\sin(\pi x) + \sum_{k=2}^{\infty} (\frac{\beta_k}{\lambda_k} + C_k e^{-\lambda_k t})\sqrt{2}\sin(k\pi x)$$

$$= \left(\frac{4a}{\pi^3} + (1 - \frac{4a}{\pi^3})e^{-\pi^2 t}\right)\sin(\pi x) + \sum_{k=2 \atop k \text{ ungerade}}^{\infty} \left(\frac{4a}{k^3\pi^3} - \frac{4a}{k^3\pi^3}e^{-k^2\pi^2 t}\right)\sin(k\pi x)$$

Example 3. Examine the following problem

$$\partial_t u(x,t) = \partial_{xx} u(x,t) + \sin(\pi x),$$
 $x \in (0,1), t > 0,$
 $u(0,t) = 0,$ $t > 0,$
 $u(1,t) = 0,$ $t > 0,$
 $u(x,0) = a,$ $x \in (0,1),$

with constant $IC \ a \in \mathbb{R}$.

- 1. Compute the Eigenvalues and the normalized Eigenfunctions from ∂_{xx} ..
- 2. Develop the IC and source term in these Eigenfunctions.
- 3. Compute the solution of the problem with the Eigenfunction ansatz.
- 1. Die zum Problem geh" orenden Eigenfunktionen und Eigenwerte erf" ullen

$$\varphi''(x) + \lambda \varphi(x) = 0, \quad x \in (0, 1)$$
$$\varphi(0) = \varphi(1) = 0$$

$$\Rightarrow \varphi(x) = C_1 \sin(\sqrt{\lambda}x) + C_2 \cos(\sqrt{\lambda}x)$$

Mit den Randbedingungen f"ur φ erh" alt man

$$0 = \varphi(0) = C_2 \implies C_2 = 0$$

$$0 = \varphi(1) = C_1 \sin(\sqrt{\lambda}) \implies \lambda_k = (k\pi)^2, \ k \in \mathbb{N}$$

$$\implies \varphi_k(x) = C_1 \sin(k\pi x), \ k \in \mathbb{N}$$

 C_1 erh" alt man durch Normierung

$$1 \stackrel{!}{=} \int_0^1 \varphi_k(x)^2 dx = C_1^2 \int_0^1 \sin^2(k\pi x) dx$$
$$= C_1^2 \left[\frac{x}{2} - \frac{\sin(2k\pi x)}{4k\pi} \Big|_0^1 \right] = C_1^2 \frac{1}{2}$$
$$\Rightarrow C_1 = \sqrt{2}$$

damit lauten die Eigenwerte und normierten Eigenfunktionen

$$\varphi_k(x) = \sqrt{2}\sin(k\pi x)$$

und $\lambda_k = (k\pi)^2$ f''ur $k \in \mathbb{N}$

2. Die Entwicklung der konstanten Anfangsbedingung a(x,t)=a in Eigenfunktionen lautet

$$a = \sum_{k=1}^{\infty} \beta_k \varphi_k(x)$$
$$= \sum_{k=1}^{\infty} \beta_k \sqrt{2} \sin(k\pi x)$$

Die Koeffizienten berechnet man durch

$$\beta_k = \int_0^1 a\sqrt{2}\sin(k\pi x)dx$$

$$= a\sqrt{2} \left[-\frac{\cos(k\pi x)}{k\pi} \Big|_0^1 \right]$$

$$= \frac{a\sqrt{2}}{k\pi} (1 - \cos(k\pi)) = \begin{cases} \frac{2a\sqrt{2}}{k\pi} & , k \text{ ungerade} \\ 0 & , \text{sonst.} \end{cases}$$

Der Quellterm hat offenbar die Entwicklung

$$\sin(\pi x) = \sum_{k=1}^{\infty} \gamma_k \sqrt{2} \sin(k\pi x)$$
mit $\gamma_k = \begin{cases} \frac{1}{\sqrt{2}} & , k = 1\\ 0 & , \text{sonst.} \end{cases}$

3. F"ur die L"osung u wird der Eigenfunktionen-Ansatz

$$u(x,t) = \sum_{k=1}^{\infty} \alpha_k(t)\varphi_k(x)$$

gew"ahlt, mit zeitabh"angigen Koeffizienten $\alpha_k(t)$, $t > 0, k \in \mathbb{N}$. Einsetzen der Entwicklungen von u(x,t) und $\sin(\pi x)$ in die Differentialgleichung liefert

$$(\sum_{k=1}^{\infty} \alpha_k(t)\varphi_k(x))_t = (\sum_{k=1}^{\infty} \alpha_k(t)\varphi_k(x))_{xx} + \sum_{k=1}^{\infty} \gamma_k\varphi_k(x)$$

$$\Leftrightarrow \sum_{k=1}^{\infty} \alpha'_k(t)\varphi_k(x) = -\sum_{k=1}^{\infty} \alpha_k(t)\lambda_k\varphi_k(x) + \sum_{k=1}^{\infty} \gamma_k\varphi_k(x)$$

$$\Leftrightarrow \sum_{k=1}^{\infty} (\alpha'_k(t) + \lambda_k\alpha_k(t) - \gamma_k)\varphi_k(x) = 0$$

Wir erhalten eine gew"ohnliche Differentialgleichung f"ur die Koeffizienten $\alpha_k(t)$

$$\alpha_k'(t) = -\lambda_k \alpha_k(t) + \gamma_k$$

mit der allgemeinen L"osung

$$\alpha_k(t) = \frac{\gamma_k}{\lambda_k} + C_k e^{-\lambda_k t}.$$

Die Konstante C_k wird durch die Anfangsbedingung f'ur $\alpha_k(0)$ bestimmt. Dazu betrachten wir die Anfangsbedingung f'ur u:

$$u(x,0) = \sum_{k=1}^{\infty} \alpha_k(0)\sqrt{2}\sin(k\pi x) \stackrel{!}{=} a = \sum_{k=0}^{\infty} \frac{2\sqrt{2}a}{(2k+1)\pi}\sqrt{2}\sin((2k+1)\pi x)$$

$$\Rightarrow \alpha_{2j}(0) = 0 \quad \text{und} \quad \alpha_{2j+1}(0) = \frac{2\sqrt{2}a}{(2j+1)\pi} \forall j$$

Also gilt f"ur j = 0

$$\alpha_1(0) = \frac{\gamma_1}{\lambda_1} + C_1 \stackrel{!}{=} \frac{2\sqrt{2}a}{\pi}$$

$$\Rightarrow C_1 = \frac{2\sqrt{2}a}{\pi} - \frac{\gamma_1}{\lambda_1} = \frac{2\sqrt{2}a}{\pi} - \frac{1}{\pi^2\sqrt{2}}$$

und f''ur j > 0

$$\alpha_{2j}(0) = \frac{\gamma_{2j}}{\lambda_{2j}} + C_{2j} = C_{2j} \stackrel{!}{=} 0$$

$$\Rightarrow C_{2j} = 0$$

$$\alpha_{2j+1}(0) = \frac{\gamma_{2j+1}}{\lambda_{2j+1}} + C_{2j+1} = C_{2j+1} \stackrel{!}{=} \frac{2\sqrt{2}a}{(2j+1)\pi}$$

$$\Rightarrow C_{2j+1} = \frac{2\sqrt{2}a}{(2j+1)\pi}$$

Die L"osung u lautet daher insgesamt

$$u(x,t) = \left(\frac{\gamma_1}{\lambda_1} + \left(\frac{2\sqrt{2}a}{\pi} - \frac{1}{\pi^2\sqrt{2}}\right)e^{-\lambda_1 t}\right)\sqrt{2}\sin(\pi x) + \sum_{k=2}^{\infty} C_k e^{-\lambda_k t}\sqrt{2}\sin(k\pi x)$$

$$= \left(\frac{4a}{\pi} - \frac{1}{\pi^2}\right)e^{-\pi^2 t}\sin(\pi x) + \frac{1}{\pi^2}\sin(\pi x)$$

$$+ \sum_{j=1}^{\infty} \frac{4a}{(2j+1)\pi}e^{-(2j+1)^2\pi^2 t}\sin((2j+1)\pi x)$$

Example 4. Examine the following problem

$$\partial_{tt}u(x,t) = \partial_{xx}u(x,t) + a,$$
 $x \in (0,1), t > 0$
 $u(0,t) = 0,$ $t > 0$
 $u(1,t) = 0,$ $t > 0$
 $u(x,0) = x,$ $x \in (0,1)$
 $u_t(x,0) = 0,$ $x \in (0,1)$

with constant source term $a \in \mathbb{R}$.

- 1. Compute the Eigenvalues and the normalized Eigenfunctions from ∂_{xx} .
- 2. Develop the IC and source term in these Eigenfunctions.
- 3. Compute the solution of the problem with the Eigenfunction ansatz.

Die Gleichung y''(x) = -cy(x) + b besitzt die allg. Lösung

$$y(x) = \frac{b}{c} + k_1 \sin(\sqrt{c}x) + k_2 \cos(\sqrt{c}x), \quad k_1, k_2 \in \mathbb{R}$$

1. Die zum Problem geh" orenden Eigenfunktionen und Eigenwerte erf" ullen

$$\varphi''(x) + \lambda \varphi(x) = 0, \quad x \in (0, 1)$$

$$\varphi(0) = \varphi(1) = 0$$

$$\Rightarrow \varphi(x) = C_1 \sin(\sqrt{\lambda}x) + C_2 \cos(\sqrt{\lambda}x)$$

Mit den Randbedingungen f''ur φ erh''alt man

$$0 = \varphi(0) = C_2 \Rightarrow C_2 = 0$$

$$0 = \varphi(1) = C_1 \sin(\sqrt{\lambda}x) \Rightarrow \lambda_k = (k\pi)^2, k \in \mathbb{N}$$

$$\Rightarrow \varphi_k(x) = C_1 \sin(k\pi x), \ k \in \mathbb{N}$$

 C_1 is obtained by taking into the consideration of normalization

$$1 \stackrel{!}{=} \int_0^1 \varphi_k(x)^2 dx = C_1^2 \int_0^1 \sin^2(k\pi x) dx$$
$$= C_1^2 \left[\frac{x}{2} - \frac{\sin(2k\pi x)}{4k\pi} \Big|_0^1 \right] = C_1^2 \frac{1}{2}$$
$$\Rightarrow C_1 = \sqrt{2}$$

damit lauten die Eigenwerte und normierten Eigenfunktionen

$$\varphi_k(x) = \sqrt{2}\sin(k\pi x)$$

und $\lambda_k = (k\pi)^2$ f'ur $k \in \mathbb{N}$

2. Die Entwicklung des konstanten Quellterms a(x,t)=a in Eigenfunktionen lautet

$$a = \sum_{k=1}^{\infty} \beta_k \varphi_k(x)$$
$$= \sum_{k=1}^{\infty} \beta_k \sqrt{2} \sin(k\pi x)$$

Die Koeffizienten berechnet man durch

$$\beta_k = \int_0^1 a\sqrt{2}\sin(k\pi x)dx$$

$$= a\sqrt{2} \left[-\frac{\cos(k\pi x)}{k\pi} \Big|_0^1 \right]$$

$$= \frac{a\sqrt{2}}{k\pi} (1 - \cos(k\pi)) = \begin{cases} \frac{2a\sqrt{2}}{k\pi} & , k \text{ ungerade} \\ 0 & , \text{ sonst} \end{cases}$$

Für die Entwicklung der Anfangsbedingung u(x,0) = x gilt:

$$x = \sum_{k=1}^{\infty} \gamma_k \varphi_k(x)$$
$$= \sum_{k=1}^{\infty} \gamma_k \sqrt{2} \sin(k\pi x)$$

mit

$$\gamma_k = \int_0^1 x\sqrt{2}\sin(k\pi x)dx$$

$$= \sqrt{2} \left[-x\cos(k\pi x) \frac{1}{k\pi} \right]_0^1 + \sqrt{2} \int_0^1 \frac{1}{k\pi} \cos(k\pi x)dx$$

$$= \frac{\sqrt{2}}{k\pi} \cos(k\pi) + \frac{\sqrt{2}}{k\pi} \left[\frac{1}{k\pi} \sin(k\pi x) \right]_0^1$$

$$= (-1)^k \frac{\sqrt{2}}{k\pi}$$

3. F"ur die L"osung u wird der Eigenfunktionen-Ansatz

$$u(x,t) = \sum_{k=1}^{\infty} \alpha_k(t)\varphi_k(x)$$

gew"ahlt, mit zeitabh"angigen Koeffizienten $\alpha_k(t)$, $t > 0, k \in \mathbb{N}$. Einsetzen der Entwicklungen von u(x,t) und a in die Differentialgleichung liefert

$$(\sum_{k=1}^{\infty} \alpha_k(t)\varphi_k(x))_{tt} = (\sum_{k=1}^{\infty} \alpha_k(t)\varphi_k(x))_{xx} + \sum_{k=1}^{\infty} \beta_k\varphi_k(x)$$

$$\Leftrightarrow \sum_{k=1}^{\infty} \alpha_k''(t)\varphi_k(x) = -\sum_{k=1}^{\infty} \alpha_k(t)\lambda_k\varphi_k(x) + \sum_{k=1}^{\infty} \beta_k\varphi_k(x)$$

$$\Leftrightarrow \sum_{k=1}^{\infty} (\alpha_k''(t) + \lambda_k\alpha_k(t) - \beta_k)\varphi_k(x) = 0$$

Wir erhalten eine gew"ohnliche Differentialgleichung f"ur die Koeffizienten $\alpha_k(t)$

$$\alpha_k''(t) = -\lambda_k \alpha_k(t) + \beta_k$$

mit der allgemeinen L"osung (Hinweis)

$$\alpha_k(t) = \frac{\beta_k}{\lambda_k} + C_{k,1} \sin(\sqrt{\lambda_k}t) + C_{k,2} \cos(\sqrt{\lambda_k}t).$$

Die Konstanten werden durch die Anfangsbedingungen bestimmt. Dazu gilt zunächst wegen $u_t(x,0) = 0$:

$$u_t(x,0) = \sum_{k=1}^{\infty} \alpha'_k(0)\sqrt{2}\sin(k\pi x) \stackrel{!}{=} 0$$

$$\Rightarrow \alpha'_k(0) = \sqrt{\lambda_k}C_{k,1}\cos(0) - \sqrt{\lambda_k}C_{k,2}\sin(0) \stackrel{!}{=} 0$$

$$\Rightarrow C_{k,1} = 0$$

Die Konstante $C_{k,2}$ wird durch die Anfangsbedingung u(x,0)=x bestimmt. Dazu betrachte

$$u(x,0) = \sum_{k=1}^{\infty} \alpha_k(0)\sqrt{2}\sin(k\pi x) \stackrel{!}{=} \sum_{k=1}^{\infty} \gamma_k \sqrt{2}\sin(k\pi x)$$
$$\Rightarrow \alpha_k(0) \stackrel{!}{=} \gamma_k$$

Also gilt

$$\alpha_k(0) = \frac{\beta_k}{\lambda_k} + C_{k,2} \stackrel{!}{=} \gamma_k = (-1)^k \frac{\sqrt{2}}{k\pi}$$

$$\Rightarrow C_{k,2} = \begin{cases} -\frac{2a\sqrt{2}}{(k\pi)^3} - \frac{\sqrt{2}}{k\pi}, & \text{ungerade} \\ \frac{\sqrt{2}}{k\pi}, & \text{sonst} \end{cases}$$

Die L"osung u lautet daher insgesamt

$$u(x,t) = \sum_{k=1}^{\infty} \left(\frac{\beta_k}{\lambda_k} + C_{k,1} \sin(\sqrt{\lambda_k}t) + C_{k,2} \cos(\sqrt{\lambda_k}t) \right) \sqrt{2} \sin(k\pi x)$$

$$= \sum_{k=1}^{\infty} \left[\frac{4a}{(k\pi)^3} + \left(\frac{2}{k\pi}\right) \cos(k\pi t) \right] \sin(k\pi x)$$

$$+ \sum_{k=1}^{\infty} \left[\frac{4a}{(k\pi)^3} - \left(\frac{2a}{(k\pi)^3} + \frac{2}{k\pi}\right) \cos(k\pi t) \right] \sin(k\pi x)$$