

## **СОДЕРЖАНИЕ**

|   |           |
|---|-----------|
| <b>ВВЕДЕНИЕ . . . . .</b>   | <b>3</b>  |
| <b>1 Задача Коши для систем обыкновенных дифференциальных уравнений . . . . .</b> | <b>4</b>  |
| <b>1.1 Метод Эйлера решения задачи Коши. . . . .</b>                              | <b>5</b>  |
| <b>1.2 Оценка погрешности решения задачи Коши. . . . .</b>                        | <b>7</b>  |
| <b>1.3 Численное решение задачи Коши методом Эйлера . . . . .</b>                 | <b>8</b>  |
| <b>ЗАКЛЮЧЕНИЕ . . . . .</b>   | <b>15</b> |
| <b>СПИСОК ИСПОЛЬЗОВАННЫХ ИСТОЧНИКОВ . . . . .</b>                                 | <b>16</b> |

## ВВЕДЕНИЕ

Особенно острая потребность в развитии численных методов появилась в связи с необходимостью решения новых сложных задач, возникающих в ходе развития современной физики и новейших областей техники и технологий. Кроме того, использование численных методов допускает применения простых и вполне осуществимых вычислений.

— Обыкновенными дифференциальными уравнениями можно описать задачи движения системы взаимодействующих материальных точек, химической кинетики, электрических цепей, сопротивления материалов (например, статический прогиб упругого стержня) и многие другие.

Ряд важных задач для уравнений в частных производных также сводится к задачам для обыкновенных дифференциальных уравнений. Например, если многомерная задача допускает разделение пространственных переменных (например, задачи на нахождение собственных колебаний упругих балок и мембран простейшей формы, или определение спектра собственных значений энергии частицы в сферически-симметричном поле), или если ее решение зависит только от некоторой комбинации переменных (автомодельные решения), то задача нахождения решения уравнений в частных производных сводится к задачам на собственные значения для обыкновенных дифференциальных уравнений.

Таким образом, решение обыкновенных дифференциальных уравнений занимает важное место среди прикладных задач физики, химии и техники.

**Цель** данной работы состоит в приобретении практических навыков применения численных методов решения задачи Коши для систем обыкновенных дифференциальных уравнений первого порядка.

## 1 Задача Коши для систем обыкновенных дифференциальных уравнений

При рассмотрении физических явлений и процессов часто не удается найти непосредственную взаимосвязь между величинами, характеризующими эволюционный, т.е. изменяющийся во времени, процесс. Однако во многих случаях можно установить связь между искомыми характеристиками изучаемого явления (функциями) и скоростями их изменения относительно других переменных, т.е. найти уравнения, в которые входят производные от неизвестных функций. Такие уравнения называют *дифференциальными*.

Задача Коши обычно возникает при анализе процессов, определяемых дифференциальным законом эволюции и начальным состоянием (начальным условием) и для системы обыкновенных дифференциальных уравнений эта задача формулируется в виде системы уравнений:

$$\frac{du}{dt} = f(t, u), \quad u(0) = \dot{u}, \quad (1)$$

где  $u(t)$  – неизвестные функции, которые подлежат определению;  $f(t, u)$  – известные функции, зависящие от времени и неизвестных функций;  $\dot{u}$  – *начальные условия*, т.е. значения неизвестных функций в начальный момент времени ( $t = 0$ ).

Система обыкновенных дифференциальных уравнений первого порядка и начальные условия (1) в развернутом виде могут быть записаны как:

$$\begin{cases} \frac{du_1}{dt} = f_1(t, u_1, u_2, \dots, u_n), & u_1(0) = \dot{u}_1 \\ \frac{du_2}{dt} = f_2(t, u_1, u_2, \dots, u_n), & u_2(0) = \dot{u}_2 \\ \dots = \dots \dots \dots \dots = \dots \\ \frac{du_n}{dt} = f_n(t, u_1, u_2, \dots, u_n), & u_n(0) = \dot{u}_n \end{cases}, \quad (2)$$

где  $n$  – количество дифференциальных уравнений в системе (1).

Точное решение систем дифференциальных уравнений вида (2), которые описывают многообразие прикладных задач, может быть получено лишь в исключительных случаях. Поэтому возникает необходимость *приближенного решения* таких задач. В настоящее время создано и разработано значительное чис-

ло приближенных методов решения дифференциальных уравнений, каждый из которых имеет свои преимущества и недостатки.

### 1.1 Метод Эйлера решения задачи Коши

Будем полагать, что решение задачи Коши (2) существует, единственно и обладает необходимыми свойствами гладкости.

Введем временную сетку, т.е. будем рассматривать изменения неизвестных функций только в заданные моменты времени:

$$\{t_j\}, \quad j = 1, 2, \dots N,$$

где  $j$  – номер временного интервала;  $\Delta t_{j+1} = (t_{j+1} - t_j)$  – шаг сетки, т.е. временной интервал между двумя последовательными моментами времени;  $N$  – количество узлов временной сетки.

Основная идея метода Эйлера заключается в предположении, о том что неизвестные функции  $\mathbf{u}(t)$  изменяются линейно в интервале  $[t_j, t_{j+1}]$  между двумя соседними узлами временной сетки и интерполяция неизвестных функций проводится полиномом первого порядка  $\mathbf{L}_1(t)$ :

$$\mathbf{u}(t) \approx \mathbf{L}_1(t) = \frac{t - t_{j+1}}{t_j - t_{j+1}} \cdot \mathbf{u}(t_j) + \frac{t - t_j}{t_{j+1} - t_j} \cdot \mathbf{u}(t_{j+1}).$$

Производная от неизвестной функции приближенно аппроксимируется выражением вида:

$$\frac{d\mathbf{u}}{dt} \approx \mathbf{L}'_1(t) = \frac{\mathbf{u}(t_{j+1}) - \mathbf{u}(t_j)}{t_{j+1} - t_j}, \quad (3)$$

где  $t_{j+1}$  и  $t_j$  – два последовательных момента времени.

Тогда систему дифференциальных уравнений первого порядка (1) приближенно можно записать в виде:

$$\frac{\mathbf{u}(t_{j+1}) - \mathbf{u}(t_j)}{\Delta t_{j+1}} \approx \mathbf{f}(t_j, \mathbf{u}(t_j)) \quad (4)$$

Относительно неизвестных  $\mathbf{u}(t_{j+1})$  это система линейных алгебраических уравнений и решение системы (4) находится явным образом по рекуррентным

формулам:

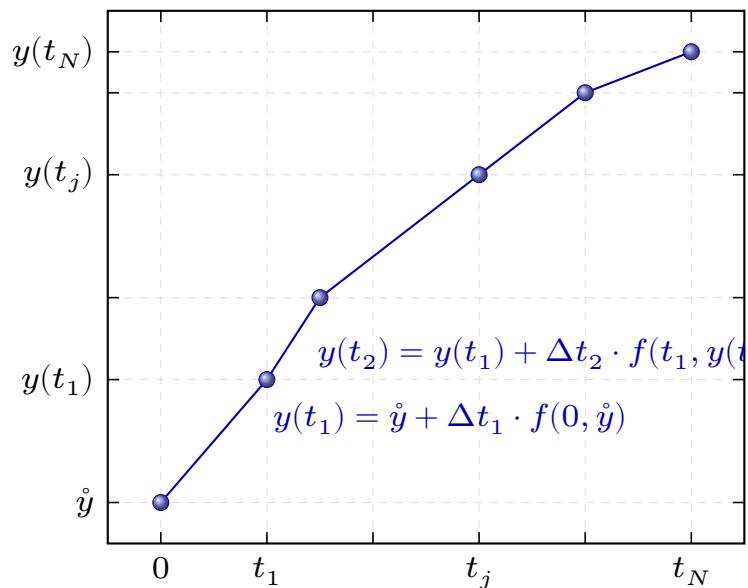
$$\mathbf{u}(t_{j+1}) = \mathbf{u}(t_j) + \Delta t_{j+1} \cdot \mathbf{f}(t_j, \mathbf{u}(t_j)), \quad \mathbf{u}(0) = \dot{\mathbf{u}}. \quad (5)$$

Метод Эйлера является простейшим численным методом решения задачи Коши. К недостаткам метода можно отнести малую точность и систематическое накопление ошибок.

Для простоты рассмотрим только одно дифференциальное уравнение с единственным начальным условием:

$$y(t_{j+1}) = y(t_j) + \Delta t_{j+1} \cdot f(t_j, y(t_j)), \quad y(0) = \dot{y}$$

На рисунке 1 представлена графическая иллюстрация метода Эйлера численного решения задачи Коши для одного дифференциального уравнения первого порядка.



a)

Рисунок 1 – Ломаная Эйлера

## 1.2 Оценка погрешности решения задачи Коши

Интегрирование системы дифференциальных уравнений (1) по временной переменной  $t$  с учетом начальных условий:

$$\mathbf{v}(t) = \mathbf{u}(0) + \int_0^t \mathbf{f}(\xi, \mathbf{v}) d\xi. \quad (6)$$

Уравнение (6) является интегральным уравнением для неизвестной функции  $\mathbf{v}(t)$ , а его решение эквивалентно решению задачи Коши (1), что можно проверить прямой подстановкой (6) в (1).

На временной сетке  $\{t_j\}$  интеграл в правой части равенства (6) приближенно вычисляется по *формуле трапеций*:

$$\int_0^{t_{j+1}} \mathbf{f}(\xi, \vec{v}) d\xi \approx \sum_{k=0}^j \frac{\mathbf{f}(t_{k+1}, \mathbf{v}(t_{k+1})) + \mathbf{f}(t_k, \mathbf{v}(t_k))}{2} \cdot (t_{k+1} - t_k). \quad (7)$$

Воспользовавшись (7), выражение для решения интегрального уравнения (6) можно записать в рекуррентной форме:

$$\mathbf{v}(t_{j+1}) = \mathbf{v}(t_j) + \frac{\mathbf{f}(t_{j+1}, \mathbf{v}(t_{j+1})) + \mathbf{f}(t_j, \mathbf{v}(t_j))}{2} \cdot \Delta t_{j+1}. \quad (8)$$

Для определения приближенного значения решения интегрального уравнения (8) могут быть использованы значения неизвестных функций  $\mathbf{u}(t_j)$ , рассчитанные по методу Эйлера (5) на  $j$ -ом временном слое:

$$\mathbf{v}(t_{j+1}) \approx \mathbf{v}(t_j) + \frac{\mathbf{f}(t_{j+1}, \mathbf{u}(t_{j+1})) + \mathbf{f}(t_j, \mathbf{u}(t_j))}{2} \cdot \Delta t_{j+1}. \quad (9)$$

В качестве предельной абсолютной погрешности приближенного решения  $\mathbf{u}(t_j)$  задачи Коши (1) можно принять какую-либо норму:

$$\boldsymbol{\varepsilon}(t_j) = \mathbf{v}(t_j) - \mathbf{u}(t_j) \quad (10)$$

Контроль точности приближенного решения может вестись покомпонентно или по норме. Для различных компонент решения задачи  $u_i(t_j)$  могут использоваться различные допустимые значения погрешности.

Контроль точности по норме означает, что контролируется некоторая опре-

деленная норма оценки погрешности:

$$\|\varepsilon\|_\infty = \max_{i=1..n} \varepsilon_i \quad \|\varepsilon\|_1 = \sum_{i=1}^n \varepsilon_i, \quad \|\varepsilon\|_2 = \sqrt{\sum_{i=1}^n \varepsilon_i^2}$$

### 1.3 Численное решение задачи Коши методом Эйлера

Применяя метод Эйлера, найдем решение задачи Коши системы дифференциальных уравнений:

$$\begin{cases} \frac{du_1}{dt} = 0.2 \cdot t + u_2, & u_1(0) = 1 \\ \frac{du_2}{dt} = -\frac{u_1}{2}, & u_2(0) = 0 \end{cases}, \quad (11)$$

в пределах отрезка  $t \in [0, 10]$  на равномерной сетке с количеством временных интервалов  $n = 5$ .

Введем обозначения

$$\begin{cases} f_1(t) = 0.2 \cdot t + u_2(t) \\ f_2(t) = -\frac{u_1(t)}{2} \end{cases},$$

где  $f_1$  и  $f_2$  – функции, стоящие в правых частях дифференциальных уравнений системы (11):

Рекуррентные соотношения (5) для решения задачи Коши (11) методом Эйлера:

$$\begin{cases} u_1(t_{j+1}) = u_1(t_j) + \tau \cdot f_1(t_j), & u_1(0) = 1 \\ u_2(t_{j+1}) = u_2(t_j) + \tau \cdot f_2(t_j), & u_2(0) = 0 \end{cases}, \quad (12)$$

где  $\tau = (t_{j+1} - t_j)$  – временной шаг метода Эйлера, т.е. интервал между двумя последовательными моментами времени

Решение системы интегральных уравнений (6) определяется рекуррентными соотношениями:

$$\begin{cases} \tilde{u}_1(t_{j+1}) = \tilde{u}_1(t_j) + \frac{f_1(t_j) + f_1(t_{j+1})}{2} \cdot \tau, & \tilde{u}_1(0) = 1 \\ \tilde{u}_2(t_{j+1}) = \tilde{u}_2(t_j) + \frac{f_2(t_j) + f_2(t_{j+1})}{2} \cdot \tau, & \tilde{u}_2(0) = 0 \end{cases}. \quad (13)$$

Определим временной шаг метода Эйлера, зная длину временного отрезка (“время наблюдения”) и количество интервалов:

$$\tau = \frac{T - t_0}{n} = \frac{10 - 0}{5} = 2,$$

где  $t_0 = 0$  – начальный момент времени;  $T = 10$  – максимальное время (“время наблюдения”).

Введем по переменной  $t$  равномерную сетку с шагом  $\tau = 2$ :

$$\{t_j\} = \{0, 2, 4, 6, 8, 10\}$$

Последовательно определяем приближенное решение задачи Коши (11) методом Эйлера, используя рекуррентные соотношения (12).

1) Определим значения неизвестных функций  $u_1$  и  $u_2$  в точке  $t_1 = 2$ :

$$f_1(0) = 0.2 \cdot 0 + u_2(0) = 0.2 \cdot 0 + 0 = 0$$

$$f_2(0) = -\frac{u_1(0)}{2} = -\frac{1}{2} = -0.5$$

$$\begin{cases} u_1(2) = u_1(0) + 2 \cdot f_1(0) = 1 + 2 \cdot 0 = 1 \\ u_2(2) = u_2(0) + 2 \cdot f_2(0) = 0 + 2 \cdot (-0.5) = -1 \end{cases}.$$

2) Определим значения неизвестных функций  $u_1$  и  $u_2$  в точке  $t_2 = 4$ :

$$f_1(2) = 0.2 \cdot 2 + u_2(2) = 0.2 \cdot 2 + (-1) = -0.6$$

$$f_2(2) = -\frac{u_1(2)}{2} = -\frac{1}{2} = -0.5$$

$$\begin{cases} u_1(4) = u_1(2) + 2 \cdot f_1(2) = 1 + 2 \cdot (-0.6) = -0.2 \\ u_2(4) = u_2(2) + 2 \cdot f_2(2) = -1 + 2 \cdot (-0.5) = -2 \end{cases}.$$

3) Определим значения неизвестных функций  $u_1$  и  $u_2$  в точке  $t_3 = 6$ :

$$f_1(4) = 0.2 \cdot 4 + u_2(4) = 0.2 \cdot 4 + (-2) = -1.2$$

$$f_2(4) = -\frac{u_1(4)}{2} = -\frac{-0.2}{2} = 0.1$$

$$\begin{cases} u_1(6) = u_1(4) + 2 \cdot f_1(4) = -0.2 + 2 \cdot (-1.2) = -2.6 \\ u_2(6) = u_2(4) + 2 \cdot f_2(4) = -2 + 2 \cdot (0.1) = -1.8 \end{cases} .$$

4) Определим значения неизвестных функций  $u_1$  и  $u_2$  в точке  $t_4 = 8$ :

$$f_1(6) = 0.2 \cdot 6 + u_2(6) = 0.2 \cdot 6 + (-1.8) = -0.6$$

$$f_2(6) = -\frac{u_1(6)}{2} = -\frac{-2.6}{2} = 1.3$$

$$\begin{cases} u_1(8) = u_1(6) + 2 \cdot f_1(4) = -2.6 + 2 \cdot (-0.6) = -3.8 \\ u_2(8) = u_2(6) + 2 \cdot f_2(6) = -1.8 + 2 \cdot (1.3) = 0.8 \end{cases} .$$

5) Определим значения неизвестных функций  $u_1$  и  $u_2$  в точке  $t_5 = 10$ :

$$f_1(8) = 0.2 \cdot 8 + u_2(8) = 0.2 \cdot 8 + 0.8 = 2.4$$

$$f_2(8) = -\frac{u_1(8)}{2} = -\frac{-3.8}{2} = 1.9$$

$$\begin{cases} u_1(10) = u_1(8) + 2 \cdot f_1(4) = -3.8 + 2 \cdot (2.4) = 1 \\ u_2(10) = u_2(8) + 2 \cdot f_2(8) = 0.8 + 2 \cdot (1.9) = 4.6 \end{cases} .$$

На рисунке 2 представлено решение задачи Коши системы дифференциальных уравнений (11).

Последовательно определяем приближенное решение интегрального уравнения (11), используя рекуррентные соотношения (13).

1) Определим значения неизвестных функций  $\tilde{u}_1$  и  $\tilde{u}_2$  в точке  $t_1 = 2$ :

$$\begin{cases} \tilde{u}_1(2) = \tilde{u}_1(0) + \tau \cdot \frac{f_1(0) + f_1(2)}{2} = 1 + 2 \cdot \frac{0 + (-0.6)}{2} = 0.4 \\ \tilde{u}_2(2) = \tilde{u}_2(0) + \tau \cdot \frac{f_2(0) + f_2(2)}{2} = 0 + 2 \cdot \frac{-0.5 + (-0.5)}{2} = -1 \end{cases} .$$

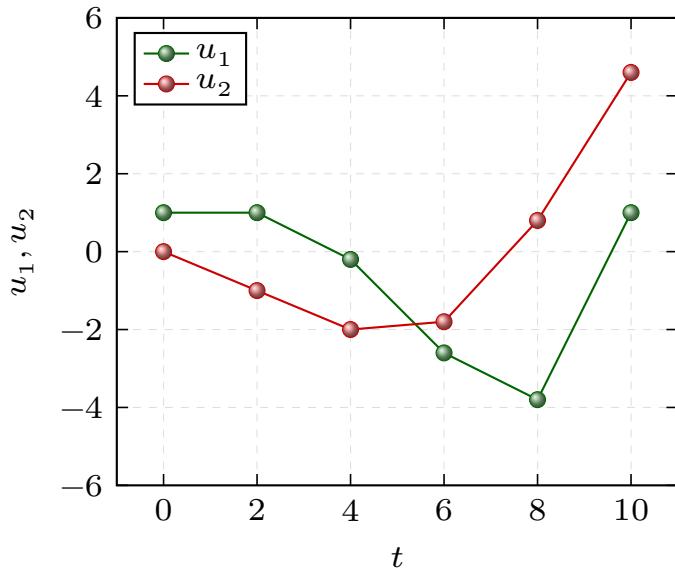


Рисунок 2 – Зависимость неизвестных функций от времени

2) Определим значения неизвестных функций  $\tilde{u}_1$  и  $\tilde{u}_2$  в точке  $t_2 = 4$ :

$$\begin{cases} \tilde{u}_1(4) = \tilde{u}_1(2) + \tau \cdot \frac{f_1(2) + f_1(4)}{2} = 0.4 + 2 \cdot \frac{(-0.6) + (-1.2)}{2} = -2.4 \\ \tilde{u}_2(4) = \tilde{u}_2(2) + \tau \cdot \frac{f_2(2) + f_2(4)}{2} = -1 + 2 \cdot \frac{-0.5 + 0.1}{2} = -1.4 \end{cases}$$

3) Определим значения неизвестных функций  $\tilde{u}_1$  и  $\tilde{u}_2$  в точке  $t_3 = 6$ :

$$\begin{cases} \tilde{u}_1(6) = \tilde{u}_1(4) + \tau \cdot \frac{f_1(4) + f_1(6)}{2} = -2.4 + 2 \cdot \frac{-1.2 + (-0.6)}{2} = -4.2 \\ \tilde{u}_2(6) = \tilde{u}_2(4) + \tau \cdot \frac{f_2(4) + f_2(6)}{2} = -1.4 + 2 \cdot \frac{0.1 + 1.3}{2} = 0 \end{cases}$$

4) Определим значения неизвестных функций  $\tilde{u}_1$  и  $\tilde{u}_2$  в точке  $t_4 = 8$ :

$$\begin{cases} \tilde{u}_1(8) = \tilde{u}_1(6) + \tau \cdot \frac{f_1(6) + f_1(8)}{2} = -4.2 + 2 \cdot \frac{-0.6 + 2.4}{2} = -2.4 \\ \tilde{u}_2(8) = \tilde{u}_2(6) + \tau \cdot \frac{f_2(6) + f_2(8)}{2} = 0 + 2 \cdot \frac{1.3 + 1.9}{2} = 3.2 \end{cases}$$

5) Определим значения неизвестных функций  $\tilde{u}_1$  и  $\tilde{u}_2$  в точке  $t_5 = 10$ :

$$f_1(10) = 0.2 \cdot 10 + u_2(10) = 0.2 \cdot 8 + 4.6 = 6.2$$

$$f_2(10) = -\frac{u_1(10)}{2} = -\frac{1}{2} = -0.5$$

$$\begin{cases} \tilde{u}_1(10) = \tilde{u}_1(8) + \tau \cdot \frac{f_1(8) + f_1(10)}{2} = -2.4 + 2 \cdot \frac{2.4 + 6.2}{2} = 6.2 \\ \tilde{u}_2(10) = \tilde{u}_2(8) + \tau \cdot \frac{f_2(8) + f_2(10)}{2} = 3.2 + 2 \cdot \frac{1.9 + (-0.5)}{2} = 4.6 \end{cases}.$$

На рисунке 3 представлены решения задачи Коши (1) и интегрального уравнения (6), рассчитанные в различные моменты времени.

В таблице 1 и на рисунке 4 представлены значения предельной абсолютной погрешности приближенного решения задачи Коши для различных моментов времени.

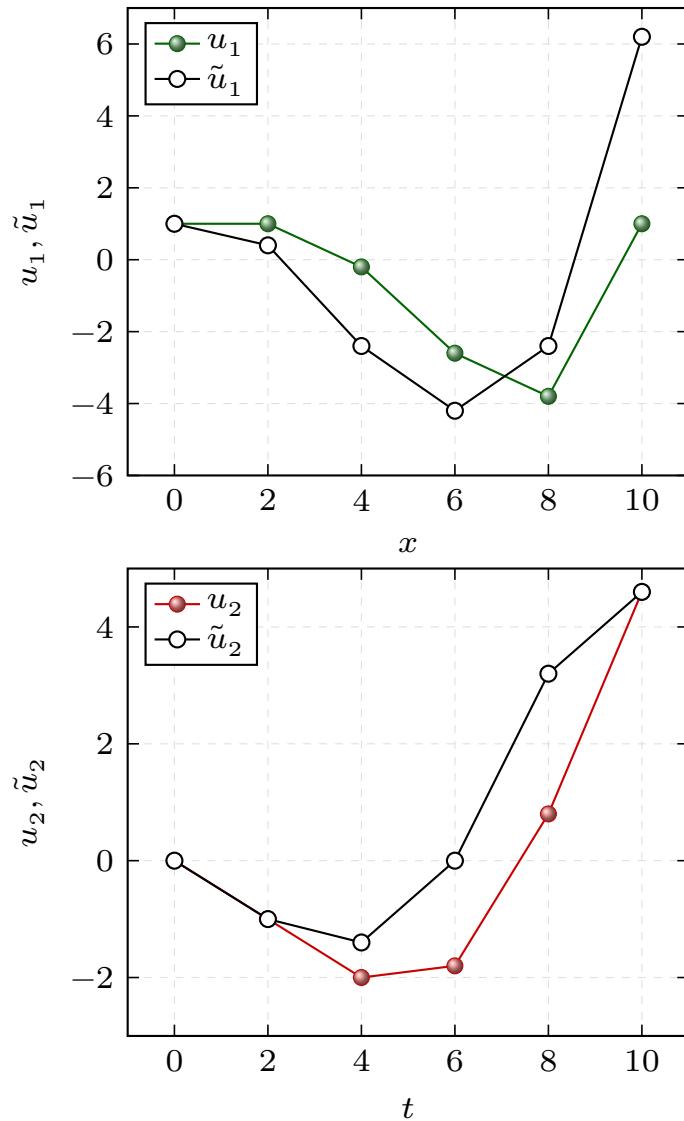


Рисунок 3 – Приближенное решение задачи Коши и соответствующего интегрального уравнения

Таблица 1 – Предельная абсолютная погрешность приближенного решения задачи Коши (11)

| $i$  | 0 | 1   | 2    | 3    | 4    | 5   |
|--|---|-----|------|------|------|-----|
| $t_i$  | 0 | 2   | 4    | 6    | 8    | 10  |
| <b>Задача Коши</b>   |   |     |      |      |      |     |
| $u_1(t_i)$   | 1 | 1   | -0.2 | -2.6 | -3.8 | 1   |
| $u_2(t_i)$   | 0 | -1  | -2   | -1.8 | 0.8  | 4.6 |
| <b>Интегральное уравнение</b>  |   |     |      |      |      |     |
| $\tilde{u}_1(t_i)$   | 1 | 0.4 | -2.4 | -4.2 | -2.4 | 6.2 |
| $\tilde{u}_2(t_i)$   | 0 | -1  | -1.4 | 0    | 3.2  | 4.6 |
| <b>Абсолютная погрешность <math>\varepsilon =  \tilde{u} - u </math></b> |   |     |      |      |      |     |
| $\varepsilon_1$  | 0 | 0.6 | 2.2  | 1.6  | 1.4  | 5.2 |
| $\varepsilon_2$  | 0 | 0   | 0.6  | 1.8  | 2.4  | 0   |

Из рисунка 4 видно, что максимальная предельная абсолютная погрешность для  $u_1(t)$  составляет  $\varepsilon_1 = 5.2$ , а для функции  $u_2(t) - \varepsilon_2 = 2.4$ .

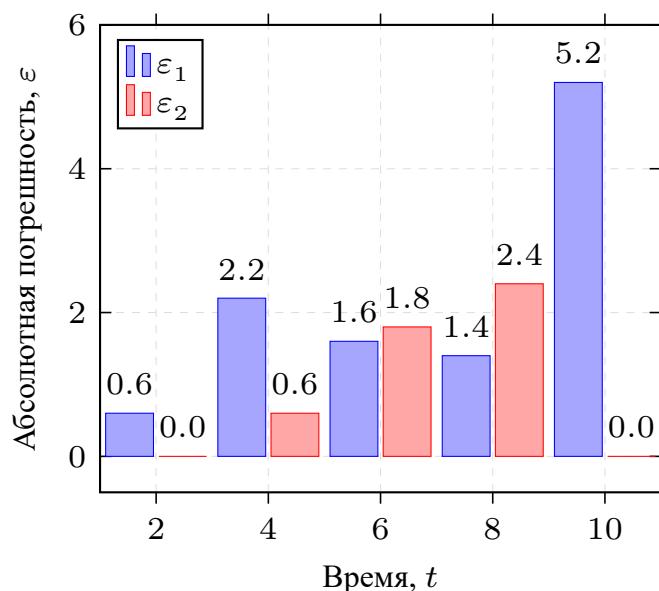


Рисунок 4 – Предельная абсолютная погрешность приближенного решения задачи Коши (11)

## ЗАКЛЮЧЕНИЕ

В работе рассмотрен метод Эйлера численного решения задачи Коши для системы обыкновенных дифференциальных уравнений первого порядка. Для заданной системы дифференциальный уравнений первого порядка построены рекуррентные соотношения для неизвестных функций  $u_1(t)$  и  $u_2(t)$ , которые позволяют последовательно определить их значения в узлах временной сетке  $\omega_\tau$ .

На основе построенных рекуррентных соотношений найдено численное решение задачи Коши в узлах равномерной сетке  $\omega_\tau = \{0, 2, 4, 6, 8, 10\}$ . Построены графики функций  $u_1(t)$  и  $u_2(t)$  на основании вычисленных значений неизвестных функций в различных узлах временной сетки  $\omega_\tau$ .

Определена предельная абсолютная погрешность приближенного решения задачи Коши в пределах всего заданного временного интервала. Установлено, что максимальная предельная абсолютная погрешность для  $u_1(t)$  составляет  $\epsilon_1 = 5, 1$ , а для функции  $u_2(t) - \epsilon_2 = 2, 4$ .

Приобретен практический навык применения численных методов решения задачи Коши для систем обыкновенных дифференциальных уравнений первого порядка.

## **СПИСОК ИСПОЛЬЗОВАННЫХ ИСТОЧНИКОВ**

- 1 Самарский А. А. Введение в численные методы. – Лань, 2009. –288 с.
- 2 Самарский А. А., Гулин А. В. Численные методы: учебное пособие для вузов // М.: Наука. Гл. ред. физ-мат. лит. 1989. –432 с.
- 3 Самарский А. А. и др. Задачи и упражнения по численным методам: Учебное пособие // М.: Эдиториал УРСС, 2000. –208 с.
- 4 Калиткин Н. Н. Численные методы. 2 изд. –СПб.: БХВ-Петербург, 2011. –592 с.
- 5 Калиткин Н. Н. Численные методы: Учебное пособие. – Наука. Гл. ред. физ.-мат. лит., 1978. –511 с.
- 6 Демидович, Б.П. Численные методы анализа: приближение функций, дифференциальные и интегральные уравнения / Б.П. Демидович, И.А. Марон, Э.З. Шувалова ; под ред. Б.П. Демидович. – Изд. 3-е, перераб. – Москва : Главная редакция физико-математической литературы, 1967. –368 с.