

Sistemas de ecuaciones diferenciales ordinarias lineales no homogéneas

Método de variación de parámetros

Carlos M. Mora

$$\frac{d}{dt} \vec{Z}(t) = \begin{pmatrix} a_{1,1}(t) & a_{1,2}(t) & \cdots & a_{1,d}(t) \\ a_{2,1}(t) & a_{2,2}(t) & \cdots & a_{2,d}(t) \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ a_{d,1}(t) & a_{d,2}(t) & \cdots & a_{d,d}(t) \end{pmatrix} \vec{Z}(t) + \begin{pmatrix} f_1(t) \\ f_2(t) \\ \vdots \\ f_d(t) \end{pmatrix},$$

donde $a_{i,j}(t)$, con $i, j = 1, \dots, d$, y $f_i(t)$, con $i = 1, \dots, d$, son funciones continuas en $]a, b[$.

Tomemos $A(t) := \begin{pmatrix} a_{1,1}(t) & a_{1,2}(t) & \cdots & a_{1,d}(t) \\ a_{2,1}(t) & a_{2,2}(t) & \cdots & a_{2,d}(t) \\ \vdots & \vdots & \ddots & \vdots \\ a_{d,1}(t) & a_{d,2}(t) & \cdots & a_{d,d}(t) \end{pmatrix}$ y $\vec{F}(t) := \begin{pmatrix} f_1(t) \\ f_2(t) \\ \vdots \\ f_d(t) \end{pmatrix}$.

Entonces

$$\frac{d}{dt} \vec{Z}(t) = A(t) \vec{Z}(t) + \vec{F}(t)$$

Ejemplo

Considere el sistema de ecuaciones diferenciales ordinarias

$$\begin{cases} X'(t) = -5X(t) + 3Y(t) + e^{-2t} \\ Y'(t) = 2X(t) - 10Y(t) + 1 \end{cases}$$

con $X(t), Y(t) \in \mathbb{R}$

Escritura matricial

$$\frac{d}{dt} \begin{pmatrix} X(t) \\ Y(t) \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} -5 & 3 \\ 2 & -10 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} X(t) \\ Y(t) \end{pmatrix} + \begin{pmatrix} e^{-2t} \\ 1 \end{pmatrix}$$

Elegimos $\vec{Z}(t) = \begin{pmatrix} X(t) \\ Y(t) \end{pmatrix} \in \mathbb{R}^2$ y $A = \begin{pmatrix} -5 & 3 \\ 2 & -10 \end{pmatrix} \in \mathbb{R}^{2,2}$ y $\vec{F}(t) = \begin{pmatrix} e^{-2t} \\ 1 \end{pmatrix}$. Luego

$$\frac{d}{dt} \vec{Z}(t) = A \vec{Z}(t) + \vec{F}(t)$$

Paso 1

Encontrar un sistema de fundamental de soluciones $\vec{Z}_1(t), \vec{Z}_2(t), \dots, \vec{Z}_d(t)$ para

$$\frac{d}{dt} \vec{Z}_h(t) = A(t) \vec{Z}_h(t) \quad \forall t \in]a, b[.$$

Ejemplo

$$\frac{d}{dt} \vec{Z}(t) = \begin{pmatrix} -5 & 3 \\ 2 & -10 \end{pmatrix} \vec{Z}(t) + \begin{pmatrix} e^{-2t} \\ 1 \end{pmatrix}$$

$$\frac{d}{dt} \vec{Z}_h(t) = \begin{pmatrix} -5 & 3 \\ 2 & -10 \end{pmatrix} \vec{Z}_h(t)$$

Cálculo de autovalores: $A \vec{v} = \lambda \vec{v}$

$$|A - \lambda I| = 0 \Leftrightarrow \left| \begin{pmatrix} -5 & 3 \\ 2 & -10 \end{pmatrix} - \lambda I \right| = 0 \Leftrightarrow \begin{vmatrix} -5 - \lambda & 3 \\ 2 & -10 - \lambda \end{vmatrix} = 0.$$

$$(-5 - \lambda)(-10 - \lambda) - 6 = 0 \Leftrightarrow (5 + \lambda)(10 + \lambda) - 6 = 0 \Leftrightarrow \lambda^2 + 15\lambda + 44 = 0$$

Como $0 = \lambda^2 + 15\lambda + 44 = (\lambda + 4)(\lambda + 11), \quad \lambda = -4 \quad \text{ó} \quad \lambda = -11.$

Cálculo de autovectores

$$A = \begin{pmatrix} -5 & 3 \\ 2 & -10 \end{pmatrix} \quad A \vec{v} = \lambda \vec{v} \Leftrightarrow (A - \lambda I) \vec{v} = 0$$

Cuando $\lambda = -4$, buscamos $\vec{v} \neq 0$ tal que

$$(A - \lambda I) \vec{v} = 0 \Leftrightarrow \left(\begin{pmatrix} -5 & 3 \\ 2 & -10 \end{pmatrix} + 4I \right) \vec{v} = 0 \Leftrightarrow \begin{pmatrix} -1 & 3 \\ 2 & -6 \end{pmatrix} \vec{v} = 0$$

$$\begin{pmatrix} -1 & 3 \\ 2 & -6 \end{pmatrix} \vec{v} = 0 \Leftrightarrow \begin{pmatrix} -1 & 3 \\ 0 & 0 \end{pmatrix} \vec{v} = 0 \Leftrightarrow -v_1 + 3v_2 = 0 \Leftrightarrow v_1 = 3v_2 \Leftrightarrow \vec{v} = v_2 \begin{pmatrix} 3 \\ 1 \end{pmatrix}.$$

Tomado $v_2 = 1$ llegamos a $\vec{v} = \begin{pmatrix} 3 \\ 1 \end{pmatrix}$, que genera la solución $\vec{Z}_1(t) = e^{-4t} \begin{pmatrix} 3 \\ 1 \end{pmatrix}$.

Cálculo de autovectores

$$A = \begin{pmatrix} -5 & 3 \\ 2 & -10 \end{pmatrix} \quad A \vec{v} = \lambda \vec{v} \Leftrightarrow (A - \lambda I) \vec{v} = 0$$

Cuando $\lambda = -11$, buscamos $\vec{u} \neq 0$ tal que

$$(A - \lambda I) \vec{u} = 0 \Leftrightarrow \begin{pmatrix} 6 & 3 \\ 2 & 1 \end{pmatrix} \vec{u} = 0 \Leftrightarrow 2u_1 + u_2 = 0 \Leftrightarrow u_2 = -2u_1$$

Eligiendo $u_1 = 1$ obtenemos $\vec{u} = \begin{pmatrix} 1 \\ -2 \end{pmatrix}$, que tiene asociada la solución

$$\vec{Z}_2(t) = e^{-11t} \begin{pmatrix} 1 \\ -2 \end{pmatrix}.$$

$$\vec{Z}_h(t) = c_1 e^{-4t} \begin{pmatrix} 3 \\ 1 \end{pmatrix} + c_2 e^{-11t} \begin{pmatrix} 1 \\ -2 \end{pmatrix}$$

con $c_1, c_2 \in \mathbb{R}$

Paso 2: Formar la matriz fundamental de soluciones

Sea $\vec{Z}_1(t), \vec{Z}_2(t), \dots, \vec{Z}_d(t)$ un sistema de fundamental de soluciones de

$$\frac{d}{dt} \vec{Z}_h(t) = A(t) \vec{Z}_h(t) \quad \forall t \in]a, b[.$$

Entonces, definimos

$$\Phi(t) := \left(\vec{Z}_1(t) : \vec{Z}_2(t) : \dots : \vec{Z}_d(t) \right).$$

Entonces la solución general de la EDO homogénea asociada es: $\vec{Z}_h(t) = \Phi(t) \vec{C}$, con $\vec{C} \in \mathbb{R}^d$.

$$\text{Ejemplo: } \frac{d}{dt} \vec{Z}(t) = \begin{pmatrix} -5 & 3 \\ 2 & -10 \end{pmatrix} \vec{Z}(t) + \begin{pmatrix} e^{-2t} \\ 1 \end{pmatrix}$$

$$\Phi(t) := \begin{pmatrix} 3e^{-4t} & e^{-11t} \\ e^{-4t} & -2e^{-11t} \end{pmatrix}$$

Entonces

$$\vec{Z}_h(t) = \begin{pmatrix} 3e^{-4t} & e^{-11t} \\ e^{-4t} & -2e^{-11t} \end{pmatrix} \begin{pmatrix} c_1 \\ c_2 \end{pmatrix},$$

donde c_1, c_2 son números reales arbitrarios.

Paso 3: Calcular solución particular

Una solución particular tiene la forma

$$\vec{Z}_p(t) = \Phi(t) \begin{pmatrix} c_1(t) \\ \vdots \\ c_d(t) \end{pmatrix} \longleftrightarrow \vec{Z}_p(t) = c_1(t) \vec{Z}_1(t) + \cdots + c_d(t) \vec{Z}_d(t)$$

donde

$$\Phi(t) \frac{d}{dt} \begin{pmatrix} c_1(t) \\ \vdots \\ c_d(t) \end{pmatrix} = \vec{F}(t) \longleftrightarrow c'_1(t) \vec{Z}_1(t) + \cdots + c'_d(t) \vec{Z}_d(t) = \vec{F}(t)$$

Ejemplo (vía 1): $\frac{d}{dt} \vec{Z}(t) = \begin{pmatrix} -5 & 3 \\ 2 & -10 \end{pmatrix} \vec{Z}(t) + \begin{pmatrix} e^{-2t} \\ 1 \end{pmatrix}$

$$\Phi(t) \vec{c}'(t) = \vec{F}(t) \Leftrightarrow \begin{pmatrix} 3e^{-4t} & e^{-11t} \\ e^{-4t} & -2e^{-11t} \end{pmatrix} \begin{pmatrix} c'_1(t) \\ c'_2(t) \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} e^{-2t} \\ 1 \end{pmatrix}$$

Restando la primera ecuación por la segunda multiplicada por 3 obtenemos

$$c'_2(t) = \frac{1}{7} (e^{9t} - 3e^{11t}) \rightsquigarrow c'_1(t) = \frac{1}{7} (2e^{2t} + e^{4t}).$$

$$\vec{c}(t) = \frac{1}{7} \int \begin{pmatrix} 2e^{2t} + e^{4t} \\ e^{9t} - 3e^{11t} \end{pmatrix} dt$$

$$\vec{Z}_p(t) = \Phi(t) \vec{c}(t) = \frac{1}{7} \begin{pmatrix} 3e^{-4t} & e^{-11t} \\ e^{-4t} & -2e^{-11t} \end{pmatrix} \begin{pmatrix} e^{2t} + e^{4t}/4 \\ e^{9t}/9 - 3e^{11t}/11 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} \frac{4}{9}e^{-2t} + \frac{3}{44} \\ \frac{1}{9}e^{-2t} + \frac{5}{44} \end{pmatrix}$$

Ejemplo (vía 2) $\frac{d}{dt} \vec{Z}(t) = \begin{pmatrix} -5 & 3 \\ 2 & -10 \end{pmatrix} \vec{Z}(t) + \begin{pmatrix} e^{-2t} \\ 1 \end{pmatrix}$

$$\Phi(t) \vec{c}'(t) = \vec{F}(t) \Rightarrow \vec{Z}_p(t) = \Phi(t) \int \Phi(t)^{-1} \vec{F}(t) dt, \quad \begin{pmatrix} a & b \\ c & d \end{pmatrix}^{-1} = \frac{1}{ad-bc} \begin{pmatrix} d & -b \\ -c & a \end{pmatrix}$$

$$\Phi(t) = \begin{pmatrix} 3e^{-4t} & e^{-11t} \\ e^{-4t} & -2e^{-11t} \end{pmatrix} \rightsquigarrow \Phi(t)^{-1} = \frac{1}{-7e^{-15t}} \begin{pmatrix} -2e^{-11t} & -e^{-11t} \\ -e^{-4t} & 3e^{-4t} \end{pmatrix} = \frac{1}{7} \begin{pmatrix} 2e^{4t} & e^{4t} \\ e^{11t} & -3e^{11t} \end{pmatrix}$$

$$\int \Phi(t)^{-1} \vec{F}(t) dt = \frac{1}{7} \int \begin{pmatrix} 2e^{4t} & e^{4t} \\ e^{11t} & -3e^{11t} \end{pmatrix} \begin{pmatrix} e^{-2t} \\ 1 \end{pmatrix} dt = \frac{1}{7} \int \begin{pmatrix} 2e^{2t} + e^{4t} \\ e^{9t} - 3e^{11t} \end{pmatrix} dt$$

$$\Phi(t) \int \Phi(t)^{-1} \vec{F}(t) dt = \frac{1}{7} \begin{pmatrix} 3e^{-4t} & e^{-11t} \\ e^{-4t} & -2e^{-11t} \end{pmatrix} \begin{pmatrix} e^{2t} + e^{4t}/4 \\ e^{9t}/9 - 3e^{11t}/11 \end{pmatrix}$$

$$\vec{Z}_p(t) = \begin{pmatrix} \frac{4}{9}e^{-2t} + \frac{3}{44} \\ \frac{1}{9}e^{-2t} + \frac{5}{44} \end{pmatrix}$$

Justificación del cálculo de solución particular (Paso 3)

La solución general de $\frac{d}{dt} \vec{Z}_h(t) = A(t) \vec{Z}_h(t)$ es:

$$\vec{Z}_h(t) = c_1 \vec{Z}_1(t) + c_2 \vec{Z}_2(t) + \cdots + c_d \vec{Z}_d(t), \text{ donde } c_1, c_2, \dots, c_d \in \mathbb{R}.$$

Se busca una solución particular de $\frac{d}{dt} \vec{Z}(t) = A(t) \vec{Z}(t) + \vec{F}(t)$ con la forma:

$$\vec{Z}_p(t) = c_1(t) \vec{Z}_1(t) + c_2(t) \vec{Z}_2(t) + \cdots + c_d(t) \vec{Z}_d(t) \Rightarrow \vec{Z}_p(t) = \Phi(t) \begin{pmatrix} c_1(t) \\ \vdots \\ c_d(t) \end{pmatrix}$$

Ya que $\vec{Z}'_k(t) = A(t) \vec{Z}_k(t)$,

$$\vec{Z}'_p(t) = c'_1(t) \vec{Z}_1(t) + c'_2(t) \vec{Z}_2(t) + \cdots + c'_d(t) \vec{Z}_d(t)$$

$$+ c_1(t) \vec{Z}'_1(t) + c_2(t) \vec{Z}'_2(t) + \cdots + c_d(t) \vec{Z}'_d(t)$$

$$= c'_1(t) \vec{Z}_1(t) + c'_2(t) \vec{Z}_2(t) + \cdots + c'_d(t) \vec{Z}_d(t)$$

$$+ c_1(t) A(t) \vec{Z}_1(t) + c_2(t) A(t) \vec{Z}_2(t) + \cdots + c_d(t) A(t) \vec{Z}_d(t)$$

$$A(t) \vec{Z}_p(t) + \vec{F}(t) = \vec{Z}'_p(t) = c'_1(t) \vec{Z}_1(t) + c'_2(t) \vec{Z}_2(t) + \cdots + c'_d(t) \vec{Z}_d(t) + A(t) \vec{Z}_p(t)$$

Justificación del cálculo de solución particular (Paso 3)

$$\vec{F}(t) = c_1'(t) \vec{Z}_1(t) + c_2'(t) \vec{Z}_2(t) + \cdots + c_d'(t) \vec{Z}_d(t)$$

$$\vec{F}(t) = \Phi(t) \frac{d}{dt} \begin{pmatrix} c_1(t) \\ \vdots \\ c_d(t) \end{pmatrix} \rightsquigarrow \frac{d}{dt} \begin{pmatrix} c_1(t) \\ \vdots \\ c_d(t) \end{pmatrix} = \Phi(t)^{-1} \vec{F}(t) \rightsquigarrow \begin{pmatrix} c_1(t) \\ \vdots \\ c_d(t) \end{pmatrix} = \int \Phi(t)^{-1} \vec{F}(t) dt$$

$$\vec{Z}_p(t) = \Phi(t) \begin{pmatrix} c_1(t) \\ \vdots \\ c_d(t) \end{pmatrix} \rightsquigarrow \vec{Z}_p(t) = \Phi(t) \int \Phi(t)^{-1} \vec{F}(t) dt$$

Paso 4: Calcular solución general

$$\vec{Z}(t) = \Phi(t) \vec{C} + \vec{Z}_p(t).$$

$$\vec{Z}_h(t) = \Phi(t) \vec{C}$$

$$\begin{aligned} \frac{d}{dt} (\Phi(t) \vec{C} + \vec{Z}_p(t)) &= \frac{d}{dt} (\Phi(t) \vec{C}) + \vec{Z}'_p(t) = A(t) \Phi(t) \vec{C} + A(t) \vec{Z}_p(t) + \vec{F}(t) \\ &= A(t) (\Phi(t) \vec{C} + \vec{Z}_p(t)) + \vec{F}(t) \end{aligned}$$

$$\text{Ejemplo: } \frac{d}{dt} \vec{Z}(t) = \begin{pmatrix} -5 & 3 \\ 2 & -10 \end{pmatrix} \vec{Z}(t) + \begin{pmatrix} e^{-2t} \\ 1 \end{pmatrix}$$

$$\vec{Z}(t) = \begin{pmatrix} 3e^{-4t} & e^{-11t} \\ e^{-4t} & -2e^{-11t} \end{pmatrix} \begin{pmatrix} c_1 \\ c_2 \end{pmatrix} + \begin{pmatrix} \frac{4}{9}e^{-2t} + \frac{3}{44} \\ \frac{1}{9}e^{-2t} + \frac{5}{44} \end{pmatrix},$$

donde c_1, c_2 son números reales arbitrarios.

$$X(t) = 3c_1 e^{-4t} + c_2 e^{-11t} + \frac{4}{9}e^{-2t} + \frac{3}{44} \longrightarrow_{t \rightarrow +\infty} \frac{3}{44}$$

$$Y(t) = c_1 e^{-4t} - 2c_2 e^{-11t} + \frac{1}{9}e^{-2t} + \frac{5}{44} \longrightarrow_{t \rightarrow +\infty} \frac{5}{44}$$

Encuentre la solución general de

$$\frac{d}{dt} \vec{Z}(t) = \begin{pmatrix} -5 & 3 \\ 2 & -10 \end{pmatrix} \vec{Z}(t) + \begin{pmatrix} e^{-2t} \\ 1 \end{pmatrix}$$

Solución alternativa

$$\begin{pmatrix} -5 & 3 \\ 2 & -10 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 3 & 1 \\ 1 & -2 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} -4 & 0 \\ 0 & -11 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 3 & 1 \\ 1 & -2 \end{pmatrix}^{-1},$$

$$\frac{d}{dt} \begin{pmatrix} 3 & 1 \\ 1 & -2 \end{pmatrix}^{-1} \vec{Z}(t) = \begin{pmatrix} 3 & 1 \\ 1 & -2 \end{pmatrix}^{-1} \begin{pmatrix} -5 & 3 \\ 2 & -10 \end{pmatrix} \vec{Z}(t) + \begin{pmatrix} 3 & 1 \\ 1 & -2 \end{pmatrix}^{-1} \begin{pmatrix} e^{-2t} \\ 1 \end{pmatrix}$$

$$\frac{d}{dt} \begin{pmatrix} 3 & 1 \\ 1 & -2 \end{pmatrix}^{-1} \vec{Z}(t) = \begin{pmatrix} -4 & 0 \\ 0 & -11 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 3 & 1 \\ 1 & -2 \end{pmatrix}^{-1} \vec{Z}(t) + \begin{pmatrix} 3 & 1 \\ 1 & -2 \end{pmatrix}^{-1} \begin{pmatrix} e^{-2t} \\ 1 \end{pmatrix}$$

$$\frac{d}{dt} \begin{pmatrix} 3 & 1 \\ 1 & -2 \end{pmatrix}^{-1} \vec{Z}(t) = \begin{pmatrix} -4 & 0 \\ 0 & -11 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} 3 & 1 \\ 1 & -2 \end{pmatrix}^{-1} \vec{Z}(t) + \frac{1}{7} \begin{pmatrix} 2 & 1 \\ 1 & -3 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} e^{-2t} \\ 1 \end{pmatrix}$$

$$\vec{V}(t) := \begin{pmatrix} 3 & 1 \\ 1 & -2 \end{pmatrix}^{-1} \vec{Z}(t) \Rightarrow \begin{cases} v_1'(t) = -4 v_1(t) + \frac{1}{7} (2 e^{-2t} + 1) \\ v_2'(t) = -11 v_2(t) + \frac{1}{7} (e^{-2t} - 3) \end{cases}$$

Encuentre la solución general de

$$\frac{d}{dt} \vec{Z}(t) = \begin{pmatrix} -5 & 3 \\ 2 & -10 \end{pmatrix} \vec{Z}(t) + \begin{pmatrix} e^{-2t} \\ 1 \end{pmatrix}$$

Solución alternativa

$$\vec{V}(t) := \begin{pmatrix} 3 & 1 \\ 1 & -2 \end{pmatrix}^{-1} \vec{Z}(t) \Rightarrow \begin{cases} v_1'(t) = -4 v_1'(t) + \frac{1}{7} (2 e^{-2t} + 1) \\ v_2'(t) = -11 v_2'(t) + \frac{1}{7} (e^{-2t} - 3) \end{cases}$$

$$\begin{cases} v_1(t) = e^{-4t} c_1 + \frac{1}{7} e^{-4t} \int e^{4t} (2 e^{-2t} + 1) dt \\ v_2(t) = e^{-11t} c_2 + \frac{1}{7} e^{-11t} \int e^{11t} (e^{-2t} - 3) dt \end{cases}$$

$$\begin{pmatrix} 3 & 1 \\ 1 & -2 \end{pmatrix}^{-1} \vec{Z}(t) = \begin{pmatrix} e^{-4t} c_1 \\ e^{-11t} c_2 \end{pmatrix} + \frac{1}{7} \begin{pmatrix} e^{-4t} \int e^{4t} (2 e^{-2t} + 1) dt \\ e^{-11t} \int e^{11t} (e^{-2t} - 3) dt \end{pmatrix}$$

$$\vec{Z}(t) = \begin{pmatrix} 3 & 1 \\ 1 & -2 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} e^{-4t} c_1 \\ e^{-11t} c_2 \end{pmatrix} + \frac{1}{7} \begin{pmatrix} 3 & 1 \\ 1 & -2 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} e^{-2t} + \frac{1}{4} \\ \frac{1}{9} e^{-2t} - \frac{3}{11} \end{pmatrix}$$

$$\vec{Z}(t) = \begin{pmatrix} 3 e^{-4t} c_1 + e^{-11t} c_2 \\ e^{-4t} c_1 - 2 e^{-11t} c_2 \end{pmatrix} + \begin{pmatrix} \frac{4}{9} e^{-2t} + \frac{3}{44} \\ \frac{1}{9} e^{-2t} + \frac{5}{44} \end{pmatrix}$$