

DUT



DALIAN UNIVERSITY OF TECHNOLOGY

第7章

常微分方程的数值解法

7.1.1 一阶常微分方程的初值问题

考虑常微分方程的初值问题

$$\begin{cases} u' = f(t, u), & a \le t \le b \\ u(a) = u_0 \end{cases}$$
 (7-1)

或与其等价的积分方程

$$u(t) = u_0 + \int_a^t f(\tau, u(\tau)) d\tau$$
 (7-2)

若f(t,u)满足Lipschitz条件,即存在常数L,对任意 $t \in [a,b]$,均有

$$|f(t,u) - f(t,\overline{u})| \le L|u - \overline{u}|$$

则(7-1)的解存在且唯一。



DALIAN UNIVERSITY OF TECHNOLOGY

首先我们建立求解(7-1)或(7-2)的数值方法。

什么是数值解法?

它是一种离散化方法,利用这种方法,可以在一系列事先取定的[a,b]中的离散点(称为节点)

$$a < t_1 < t_2 < \dots < t_N \le b$$

通常取成等距,即 $t_i=t_0=ih$, $i=1,2,\cdots,N$,其中h>0称为步长。

求出其上的未知函数u(t)之值 $u(t_1), u(t_2), \dots, u(t_N)$ 的近似值:

$$u_1, u_2, \cdots, u_N$$

 $\Pi u_1, u_2, \dots, u_N$ 通常称为初值问题的数值解。

7.1.2 线性单步法

考虑初值问题 (7-1),首先将区间 [a,b] 划分为N个等距小区间,小区间长度 $h = \frac{b-a}{N}$ 并选取网格点,点列 $t_i = ih$, $i = 0, 1, \dots, N$ 。 已知 $u(t_0) = u_0$,则可计算

$$f(t_0, u(t_0)) = f(t_0, u_0) = u'(t_0),$$

利用**Taylor**公式,在 $t=t_0$ 处将 $u(t_1)$ 展开

$$u(t_1) = u(t_0) + u'(t_0)h + \frac{1}{2!}u''(\xi)h^2$$

= $u(t_0) + f(t_0, u_0)h + R_0$,

其中 $R_0 = \frac{1}{2!}u''(\xi)h^2$,若步长h足够小,则可忽略二次项

$$R_0$$
, 记得: $u_1 = u_0 + h f(t_0, u_0)$

DALIAN UNIVERSITY OF TECHNOLOGY

这里 u_1 是 $u(t_1)$ 的近似值,利用 u_1 又可以算出 u_2 ,如此下去可算出u(t)在所有节点上的近似值。

一般的计算公式为:

$$u_{n+1} = u_n + h f(t_n, u_n)$$

$$n = 0, 1, 2, \dots, N-1$$
(7-3)

这就是求解初值问题的Euler公式。

Euler方法是最简单的数值方法。

练习 用Euler公式计算如下初值问题

$$\begin{cases} u'(t) = t^2 + 100u^2 & 0 < t \le 1 \\ u(0) = 0 \end{cases}$$

的解u(t)在t=0.3处的数值解 u_3 。(取步长h=0.1,小数点后保留4位)解:相应的Euler公式:

$$u_{n+1} = u_n + h\left(t_n^2 + 100u_n^2\right) = u_n + 0.1 \times \left(t_n^2 + 100u_n^2\right)$$

由初值 $u(0) = u_0 = 0$, 计算得

$$u(0.1) \approx u_1 = u_0 + 0.1 \times \left(t_0^2 + 100u_0^2\right)$$

$$= 0.0 + 0.1 \times (0.0 + 100 \times 0.0) = 0.0000$$

$$u(0.2) \approx u_2 = u_1 + 0.1 \times \left(t_1^2 + 100u_1^2\right)$$

$$=0.0+0.1\times(0.1^2+100\times0.0)=0.0010$$

$$u(0.3) \approx u_3 = u_2 + 0.1 \times (t_2^2 + 100u_2^2)$$

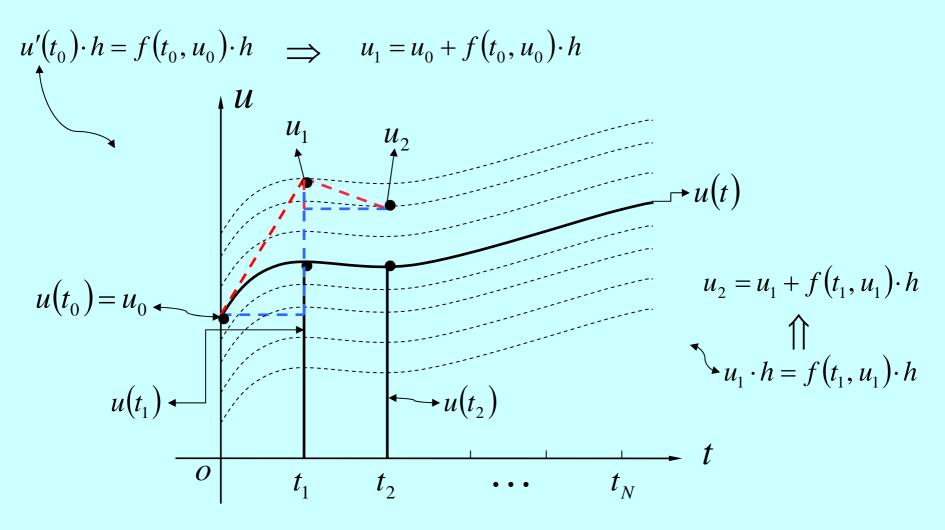
$$= 0.0010 + 0.1 \times \left(0.2^2 + 100 \times (0.0010)^2\right) = 0.0051$$



DUT



DALIAN UNIVERSITY OF TECHNOLOGY



Euler法 (切线法) 的几何解释

利用**Taylor**公式,在 $t=t_{n+1}$ 处将 $u(t_n)$ 展开成:

$$u(t_n) = u(t_{n+1}) - u'(t_{n+1})h + \frac{1}{2!}u''(\xi)h^2$$

舍去二次项 $-\frac{1}{2!}u''(\xi)h^2$, 用 u_n 近似代替 $u(t_n)$ 得:

一般的计算公式为:

$$u_{n+1} = u_n + h f(t_{n+1}, u_{n+1})$$
 $n = 0, 1, 2, \dots, N-1$ (7-4)

这就是求解初值问题的隐式Euler公式。

将Euler与隐式Euler公式做算术平均,可得梯形公式:

$$u_{n+1} = u_n + \frac{h}{2} [f(t_n, u_n) + f(t_{n+1}, u_{n+1})]$$

$$n = 0, 1, 2, \dots, N-1$$
(7-5)

也可用数值积分公式推到上述公式,即令(7-2)式中的积分限为区间[t_n, t_{n+1}]的端点,即有

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

$$n = 0, 1, 2, \dots, N-1$$

对(7-2)右端积分项使用左矩形求积公式,则得

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

分别用 u_n 替代 $u(t_n)$, u_{n+1} 替代 $u(t_{n+1})$, 并记

$$u_{n+1} = u_n + h f(t_n, u_n)$$
 $n = 0, 1, 2, \dots, N-1$

Euler公式又称矩形公式。

DALIAN UNIVERSITY OF TECHNOLOGY

对(7-2)右端积分项使用右矩形求积公式,则得

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

分别用 u_n 替代, u_{n+1} 替代 $u(t_{n+1})$ 的近似值 u_{n+1} 记

$$u_{n+1} = u_n + h f(t_{n+1}, u_{n+1})$$

 $n = 0, 1, 2, \dots, N-1$

隐式(后)Euler公式,又称右矩形公式。



DUT



DALIAN UNIVERSITY OF TECHNOLOGY

对(7-2)右端的积分使用梯形求积分式计算,

$$\int_{t_n}^{t_{n+1}} f(t, u(t)) dt \approx \frac{h}{2} [f(t_n, u(t_n)) + f(t_{n+1}, u(t_{n+1}))]$$

则得

$$u(t_{n+1}) \approx u(t_n) +$$

$$u_{n+1} = u_n + \frac{h}{2} (f(t_n, u_n) + f(t_{n+1}, u_{n+1}))$$

$$n = 0, 1, 2, \dots, N$$

得梯形法。



DALIAN UNIVERSITY OF TECHNOLOGY

梯形公式与Euler公式相比要精确的多,但是梯形公式的计算量要大一些。每步计算要解一个关于 u_{n+1} 的非线性方程,从而要用如下迭代公式:

取初值为 $u_{n+1}^{[0]} = u_n$, 反复迭代, 即

$$u_{n+1}^{[\mathbf{R}]} = u_n + \frac{h}{2} [f(t_n, u_n) + f(t_{n+1}, u_{n+1}^{[\mathbf{Q}]})]$$

一般的迭代公式表示为: $k=0,1,2,\cdots$,

$$u_{n+1}^{[k+1]} = u_n + \frac{h}{2} \left[f(t_n, u_n) + f(t_{n+1}, u_{n+1}^{[k]}) \right]$$



DALIAN UNIVERSITY OF TECHNOLOGY

如此迭代下去得到迭代序列:

$$u_{n+1}^{[0]}, u_{n+1}^{[1]}, u_{n+1}^{[2]}, \cdots, u_{n+1}^{[k]}, \cdots$$

若序列 $\{u_{n+1}^{[k]}\}_{k=0}^{\infty}$ 收敛于 $u_{n+1}^{[*]}$, 当 $k \to \infty$ 时,得到:

$$u_{n+1}^{[*]} = u_n + \frac{h}{2} \Big(f(t_n, u_n) + f(t_{n+1}, u_{n+1}^{[*]}) \Big)$$

则取 $u_{n+1} = u_{n+1}^{[*]}$ 为第 n+1 个近似值。

在实际计算中,通常要求满足 $\left|u_{n+1}^{[k+1]}-u_{n+1}^{[k]}\right|<\varepsilon$ 为终止条件,此时取 $u_{n+1}^{[k+1]}$ 作为 $u(t_{n+1})$ 的近似值 u_{n+1} 。



DALIAN UNIVERSITY OF TECHNOLOGY

为了避免求解非线性代数方程,可以用Euler法将它显化,

建立预测——校正系统:

$$\begin{cases} \overline{u}_{n+1} = u_n + hf(t_n, u_n) \\ u_{n+1} = u_n + \frac{h}{2} (f(t_n, u_n) + f(t_{n+1}, \overline{u}_{n+1})) \\ u(t_0) = u_0 \end{cases}$$
 (7-6)

此求解公式称为改进的Euler法,其中 \overline{u}_{n+1} 称为预测值, u_{n+1} 称为校正值. 其求解顺序为:

$$u_0 \rightarrow \overline{u}_1 \rightarrow u_1 \rightarrow \overline{u}_2 \rightarrow u_2 \rightarrow \cdots \rightarrow \overline{u}_N \rightarrow u_N$$



DALIAN UNIVERSITY OF TECHNOLOGY

改进的Euler法还可写成如下形式:

$$u_{n+1} = u_n + \frac{h}{2} [f(t_n, u_n) + f(t_{n+1}, u_n + h f(t_n, u_n))]$$
 (7-7)

如果f(t, u(t))关于u是线性函数,则隐式公式可以显式化。

例如 若方程为:
$$u'(t) = t \cdot u + 5$$

隐式**Euler**公式:
$$u_{n+1} = u_n + h(t_{n+1}u_{n+1} + 5)$$

$$u_{n+1} = \frac{u_n + 5h}{1 - t_{n+1}h}$$
 , $n = 0, 1, 2, \dots, N$

梯形公式:
$$u_{n+1} = u_n + \frac{h}{2} (t_n u_n + t_{n+1} u_{n+1} + 10)$$

$$u_{n+1} = \frac{1}{1 - \frac{h}{2} t_{n+1}} \left(\left(1 + \frac{h}{2} t_n \right) u_n + 5h \right) \quad n = 0, 1, 2, \dots, N$$



Euler公式、隐式Euler公式、梯形公式

$$u_{n+1} = u_n + h f(t_n, u_n)$$

$$u_{n+1} = u_n + h f(t_{n+1}, u_{n+1})$$

$$u_{n+1} = u_n + \frac{h}{2} (f(t_n, u_n) + f(t_{n+1}, u_{n+1}))$$



DALIAN UNIVERSITY OF TECHNOLOGY

一般可统一写成:

$$u_{n+1} = u_n + h\varphi(t_n, u_n, t_{n+1}, u_{n+1}; h)$$

$$n = 0, 1, 2, \dots, N-1$$
(7-8)

其中 ϕ 是依赖于(7-1)右端的函数 f(t,u)。

当取 $\phi = f(t_n, u_n)$ 时, 为**Euler**法;

当取 $\phi = f(t_{n+1}, u_{n+1})$ 时, 为隐式Euler法;

当取 $\varphi = \frac{h}{2} [f(t_n, u_n) + f(t_{n+1}, u_{n+1})]$ 时, 为梯形法。

通过(**7-8**)计算结点 $t_n = t_0 + nh$, $n = 0, 1, 2, \cdots$ 的近似值 u_{n+1} , 每次只用到前一结点的值 u_n ,所以从初值 u_0 出发可逐步算出以后各结点的值 u_1 , u_2 , …, u_N 。 故称为单步法。

衡量求解公式好坏的一个主要标准是求解公式的精度。

定义 假设 $u_i = (u(t_i)), i=0,1,2,\dots,n-1,$ 则称

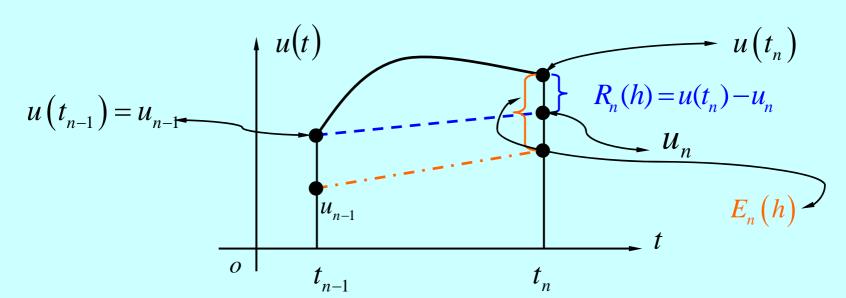
$$R_n(h) = u(t_n) - u_n$$

为求解公式第n步的局部截断误差。

定义

$$E_n(h) = u(t_n) - u_n = \sum_{i=1}^n R_i(h)$$

为求解公式在tn点上的整体截断误差。







DALIAN UNIVERSITY OF TECHNOLOGY

如果设某求解公式的局部截断误差: $R_n(h) = O(h^{p+1})$

则我们可以证明其整体截断误差为: $E_n(h) = O(h^p)$

这样我们就称该求解公式具有 p 阶精度。

事实上,若 $R_i(h) = O(h^{p+1}), i = 1, 2, \dots, n, 则$

$$E_n(h) = \sum_{i=1}^n R_i(h) = \sum_{i=1}^n O(h^{p+1}) = \sum_{i=1}^n h \cdot O(h^p)$$
$$= h \cdot O(h^p) \cdot n = O(h^p) \cdot n \times \frac{b-a}{n} = O(h^p)$$

求解公式的精度越高,计算解的精确性可能越好。 通过简单的分析,可知Euler法具有一阶精度,梯形法具二阶精度。





下面利用Taylor展开, 求Euler法的局部截断误差

$$R_{n+1}(h) = u(t_{n+1}) - u_{n+1} = u(t_{n+1}) - [u_n + h f(t_n, u_n)]$$

$$= u(t_{n+1}) - [u(t_n) + h f(t_n, u(t_n))] \qquad u(t_n) = u_n$$

$$= u(t_{n+1}) - [u(t_n) + h u'(t_n)] \qquad u'(t_n) = f(t_n, u(t_n))$$

$$= u(t_n) + h u'(t_n) + \frac{h^2}{2!} u'(t_n) + O(h^3) - u(t_n) - h u'(t_n)$$

$$= O(h^2)$$

7.1.3 Taylor展开法

初值问题(7-1)的解充分光滑, 将u(t) 在 t_0 处用Taylor公式展开:

$$u(t) = u(t_0) + hu'(t_0) + \frac{h^2}{2!}u''(t_0) + \dots + \frac{h^p}{p!}u^{(p)}(t_0) + O(h^{p+1})$$
 (7-9)

其中
$$u(t_0) = u_0,$$

$$u'(t_0) = f(t_0, u(t_0)) = f(t_0, u_0),$$

$$u''(t_0) = \frac{\mathrm{d}f}{\mathrm{d}t}\Big|_{t=t_0} = f_t(t_0, u_0) \frac{\mathrm{d}t}{\mathrm{d}t} f_u(t_0, u_0) \frac{\mathrm{d}u(t_0)}{\mathrm{d}t} f_u(t_0, u_0) \frac{\mathrm{d}u(t_0)}{\mathrm{d}t} dt$$

$$u^{(3)}(t_0) = \frac{\mathrm{d}}{\mathrm{d}t} \left[\frac{\mathrm{d}f}{\mathrm{d}t} \right]_{t=t_0} = \frac{\mathrm{d}f_t(t, u)}{\mathrm{d}t} \Big|_{t=t_0} + \frac{\mathrm{d}\left[f(t, u)f_u(t, u)\right]}{\mathrm{d}t} \Big|_{t=t_0}$$
(7-10)

$$= f_{tt}(t_{0}, u_{0}) + f_{tu}(t_{0}, u_{0}) f(t_{0}, u_{0}) + \left[f_{t}(t_{0}, u_{0}) + f(t_{0}, u_{0}) f_{u}(t_{0}, u_{0}) \right] f_{u}(t_{0}, u_{0})$$

$$+ \left[f_{ut}(t_{0}, u_{0}) + f_{uu}(t_{0}, u_{0}) f(t_{0}, u_{0}) \right] f(t_{0}, u_{0})$$

$$= f_{tt}(t_{0}, u_{0}) + 2f(t_{0}, u_{0}) f_{tu}(t_{0}, u_{0}) + f^{2}(t_{0}, u_{0}) f_{uu}(t_{0}, u_{0})$$

$$+ f_{t}(t_{0}, u_{0}) f_{u}(t_{0}, u_{0}) + f(t_{0}, u_{0}) \left(f_{u}(t_{0}, u_{0}) \right)^{2}$$



$$\varphi(t, u(t); h) = \sum_{j=1}^{p} \frac{1}{j!} \frac{d^{j}u(t)}{dt^{j}} h^{j-1} = \sum_{j=1}^{p} \frac{1}{j!} \frac{d^{j-1}f(t, u(t))}{dt^{j-1}} h^{j-1}$$
 (7-11)

则可将(7-9)改写成为

$$u(t_0+h)-u(t_0) = h\varphi(t_0, u(t_0); h)+O(h^{p+1})$$

舍去余项 $O(h^{p+1})$, 则得 $u_1 - u_0 = h \varphi(t_0, u_0; h)$ 。

一般而言,若已知и,,则

$$u_{n+1} = u_n + h \varphi(t_n, u_n; h)$$
 $n = 0, 1, 2, \dots,$

这是一个单步法,局部截断误差为 $O(h^{p+1})$, 由(**7-10**) (7-11),可知 φ 关于 f 是非线性的,当 p=1时,它是**Euler**法。由于计算 $\varphi(t_n,u_n,h)$ 的工作量过大,一般不直接用**Taylor** 展开法做数值计算,但可用它计算附加值。



THE END



欧拉(Leonard Euler, 公元1707-1783年),历史上最伟大的数学家之一,与阿基米德、牛顿、高斯一起被称为有史以来贡献最大的四位数学家。

欧拉从小就特别喜欢数学,不满10岁就开始自学《代数学》。13岁上大学,两年后获得瑞士巴塞尔大学的学士学位,次年又获得巴塞尔大学的哲学硕士学位。1725年,欧拉来到彼得堡,开始了他的数学生涯.

1733年,年仅26岁的欧拉担任了彼得堡科学院数学教授. 过度的工作使他得了眼病, 右眼失明, 时年28岁. 1741年欧拉到柏林担任科学院物理数学所所长。1766年,重回彼得堡任职。没过多久, 左眼视力衰退, 最后完全失明。不幸的事情接踵而来, 1771年一场大火将他的书房和大量研究成果全部化为灰烬。

在生命最后17年中他完全失明,这并没有妨碍他的无以伦比的多产的;他既靠视觉又靠听觉记忆。它还有惊人的心算本领,不仅心算算术类型的问题,也心算高等代数和微积分学中要求的更难的问题。他那个时代整个数学领域中的全部主要公式,都精确地储藏在他的记忆中。他还口述了几本书和400篇左右的论文。当大火烧掉他几乎全部的著述之后,欧拉用了一年的时间口述了所有这些论文并作了修订。

可以说欧拉是科学史上最多产的一位杰出的数学家,据统计他共写下了886本书籍和论文,彼得堡科学院为了整理他的著作,足足忙碌了四十七年。



他被同时代的人称为"分析的化身"。人们评价他:"欧拉计算毫不费力,就像人呼吸、或者鹰在风中保持平衡一样",欧拉一算法学家,为解决特殊类型的问题设计"算法"的数学家。

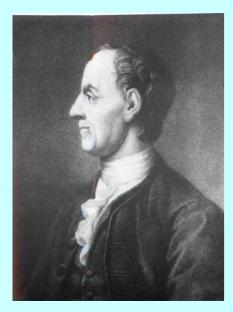
欧拉的数学事业开始于牛顿去世的那一年(1727年),他在1748年1755年和1768~1770所著关于微积分的伟大论著(《无穷小分析引论》、《微分学原理》,《积分学原理》),立即就成为了经典著作,并且在四分之三个世纪中,继续鼓舞着想成为大数学家的年轻人。

欧拉1707年4月15日出生于瑞士的巴塞尔,其父是牧师,欧拉是能在任何地方、任何条件下工作的几个大数学家之一。他常常抱着一个婴儿写作他的论文,同时稍大一点的孩子们在他周围嬉戏着。

据说,在家人两次叫他吃饭的半个小时左右的间隔中,他就能草就一篇数学文章。欧拉是为月球问题形成一个可计算解(月球理论)的第一人。

欧拉直到他临终的那一刻仍然神志清醒、思想敏捷,他享年77岁,于1783年9月18日去世。那天下午他计算气球上升的规律消遣—像往常一样,在他的石板上计算,然后他和家人一起吃晚饭。天王星是新近发现的,欧拉略述了对它的轨道的计算。过了一会儿,他让人把他的孙子带进来。在与孩子玩和喝茶的时候,欧拉突然中风。烟斗从他的手里掉下来,他说了一句"我死了",就中止了他的生命和计算。

欧拉的一生,是为数学发展而奋斗的一生,他那杰出的智慧,顽强的毅力,孜孜不倦的奋斗精神和高尚的科学道德,永远是值得我们学习的。



欧 拉 Léonard Euler

莱昂纳尔·欧拉(Léonard Euler, 1707~1783)是历史上著作最多的数学家,被同时代的人称为"分析的化身"。人们评价他:"欧拉计算毫不费力,就像人呼吸、或者鹰在风中保持平衡一样",欧拉一算法学家,为解决特殊类型的问题设计"算法"的数学家。

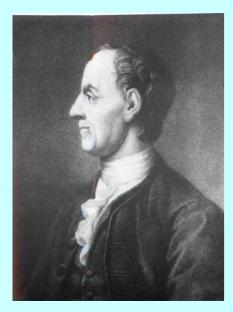
欧拉的数学事业开始于牛顿去世的那一年(1727年)。他在1748年、1755年和1768~1770所著关于微积分的伟大论著(《无穷小分析引论》、《微分学原理》、《积分学原理》),立即就成为了经典著作,并且在四分之三个世纪中,继续鼓舞着想成为大数学家的的年轻人。

欧拉1707年4月15日出生于瑞士的巴塞尔,其父是牧师,欧拉是能在任何地方、任何条件下工作的几个大数学家之一。他常常抱着一个婴儿写作他的论文,同时稍大一点的孩子们在他周围嬉戏着。据说,在家人两次叫他吃饭的半个小时左右的间隔中,他就能草就一篇数学文章。

欧拉是为月球问题形成一个可计算解(月球理论)的第一人。

在生命最后17年中他完全失明,这并没有妨碍他的无以伦比的多产的;他既靠视觉又靠听觉记忆。它还有惊人的心算本领,不仅心算算术类型的问题,也心算高等代数和微积分学中要求的更难的问题。他那个时代整个数学领域中的全部主要公式,都精确地储藏在他的记忆中。

欧拉直到他临终的那一刻仍然神志清醒、思想敏捷,他享年77岁,于1783年9月18日去世。那天下午她计算气球上升的规律消遣—像往常一样,在他的石板上计算,然后他和家人一起吃晚饭。天王星是新近发现的,欧拉略述了对它的轨道的计算。过了一会儿,他让人把他的孙子带进来。在与孩子玩和喝茶的时候,欧拉突然中风。烟斗从他的手里掉下来,他说了一句"我死了",就中止了他的生命和计算。



欧 拉 Léonard Euler

莱昂纳尔·欧拉(Léonard Euler, 1707~1783)是历史上著作最多的数学家,被同时代的人称为"分析的化身"。人们评价他:"欧拉计算毫不费力,就像人呼吸、或者鹰在风中保持平衡一样",欧拉一算法学家,为解决特殊类型的问题设计"算法"的数学家。

欧拉的数学事业开始于牛顿去世的那一年(1727年)。他在1748年、1755年和1768~1770所著关于微积分的伟大论著(《无穷小分析引论》、《微分学原理》、《积分学原理》),立即就成为了经典著作,并且在四分之三个世纪中,继续鼓舞着想成为大数学家的的年轻人。

欧拉1707年4月15日出生于瑞士的巴塞尔,其父是牧师,欧拉是能在任何地方、任何条件下工作的几个大数学家之一。他常常抱着一个婴儿写作他的论文,同时稍大一点的孩子们在他周围嬉戏着。据说,在家人两次叫他吃饭的半个小时左右的间隔中,他就能草就一篇数学文章。

欧拉是为月球问题形成一个可计算解(月球理论)的第一人。

在生命最后17年中他完全失明,这并没有妨碍他的无以伦比的多产的;他既靠视觉又靠听觉记忆。它还有惊人的心算本领,不仅心算算术类型的问题,也心算高等代数和微积分学中要求的更难的问题。他那个时代整个数学领域中的全部主要公式,都精确地储藏在他的记忆中。

欧拉直到他临终的那一刻仍然神志清醒、思想敏捷,他享年77岁,于1783年9月18日去世。那天下午她计算气球上升的规律消遣—像往常一样,在他的石板上计算,然后他和家人一起吃晚饭。天王星是新近发现的,欧拉略述了对它的轨道的计算。过了一会儿,他让人把他的孙子带进来。在与孩子玩和喝茶的时候,欧拉突然中风。烟斗从他的手里掉下来,他说了一句"我死了",就中止了他的生命和计算。