

Numerisches Programmieren, Übungen

9. Übungsblatt: Gewöhnliche Differentialgleichungen (ODE)

1) Kondition von Anfangswertproblemen

Berechnen Sie die analytische Lösung $y(t)$ der beiden folgenden Anfangswertprobleme (AWP) mit Hilfe der Separation der Variablen und diskutieren Sie jeweils die Kondition:

- a) $\dot{y}(t) = 2y(t), \quad y(0) = y_0, \quad t \geq 0,$
- b) $\dot{y}(t) = -2y(t), \quad y(0) = y_0, \quad t \geq 0.$

2) Einschrittverfahren

Gegeben sei das folgende Anfangswertproblem:

$$\dot{y}(t) = t \cdot y(t), \quad y(0) = 1, \quad t \geq 0.$$

- a) Berechnen Sie die analytische Lösung $y(t)$ des AWP's mit Hilfe der Separation der Variablen!
- b) Berechnen Sie im Intervall $[0; 4]$ numerische Lösungswerte y_k , welche die Lösung $y(t)$ in den Stellen t_k approximieren, d.h. $y_k \approx y(t_k)$. Rechnen Sie mit Schrittweite $t_{k+1} - t_k = \delta t = 1$ und verwenden Sie die folgenden Verfahren:

i) Explizites Euler-Verfahren:

Bei diesem Verfahren wird lediglich die Steigung im aktuellen Punkt t_k zur Berechnung der numerischen Lösung betrachtet:

$$\begin{aligned} t_k &= t_0 + k \cdot \delta t; \\ y_{k+1} &= y_k + \delta t \cdot f(t_k, y_k); \end{aligned}$$

ii) Verfahren von Heun:

Analog zur Trapezregel bei der Quadratur wird bei diesem Verfahren im Vergleich zum Euler-Verfahren ein zweiter f -Wert zur numerischen Berechnung der Steigung hinzugezogen:

$$\begin{aligned} t_k &= t_0 + k \cdot \delta t; \\ y_{k+1} &= y_k + \frac{\delta t}{2} \cdot (f(t_k, y_k) + f(t_{k+1}, y_k + \delta t \cdot f(t_k, y_k))); \end{aligned}$$

iii) Klassisches Runge-Kutta-Verfahren:

Analog zur Fassung werden hier Zwischenwerte T_i für die Näherung der Steigung berechnet und mit $1/6$ gewichtet:

$$\begin{aligned}t_k &= t_0 + k \cdot \delta t; \\T_1 &= f(t_k, y_k); \\T_2 &= f\left(t_k + \frac{\delta t}{2}, y_k + \frac{\delta t}{2}T_1\right); \\T_3 &= f\left(t_k + \frac{\delta t}{2}, y_k + \frac{\delta t}{2}T_2\right); \\T_4 &= f(t_{k+1}, y_k + \delta t T_3); \\y_{k+1} &= y_k + \frac{\delta t}{6} \cdot (T_1 + 2T_2 + 2T_3 + T_4); \end{aligned}$$

Vergleichen Sie die Ergebnisse der einzelnen Verfahren mit der analytischen Lösung. Was stellen Sie fest und wie lässt sich dies deuten?

3) Implizites Euler-Verfahren (Rückwärts-Euler)

Gegeben sei das folgende AWP:

$$\begin{aligned}\dot{y}(t) &= -12(y(t))^2 \quad \forall t \geq 1, \\y(1) &= 1.\end{aligned}$$

Dabei ist bekannt, dass $y(t) > 0$ für alle $t \geq 1$ gilt. Gesucht ist eine Näherungslösung $y_1 \approx y(t_1)$ zum Zeitpunkt $t_1 = 1.5$.

- Lösen Sie das AWP analytisch mit Hilfe der Separation der Variablen und berechnen Sie die exakte Lösung $y(1.5)$!
- Berechnen Sie y_1 mit Hilfe des expliziten Eulers.
- Wenden Sie nun das implizite Euler-Verfahren

$$y_{k+1} = y_k + h f(t_{k+1}, y_{k+1})$$

zur Berechnung von y_1 an, und vergleichen Sie das Ergebnis mit b).