

1.2.2008

# VORLESUNG DGL I

## TAUBERT

### Numerische Verfahren für Randwertaufgaben

- Differenzverfahren
- Finite Elemente
- Schiefverfahren (einfach + Mehrziel)
- ...

### Beispiel (Differenzverfahren)

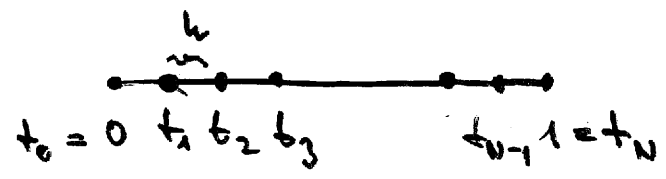
$$-y'' + y = f \quad t \in (0,1)$$

$$y(0) = y(1) = 0$$

$y(\cdot)$  Lösung

$$-\lim_{h \rightarrow 0} \frac{y(t+h) - 2y(t) + y(t-h)}{h^2} + y(t) \approx f(t)$$

Unterteilung von  $[0,1]$   
 N gleiche Teile



Betrachte für  $t = t_1, t_2, \dots, t_{N-1}$  die Relationen

$$-\frac{y(t_2) - 2y(t_1) + y(t_0)}{h^2} + y(t_1) \approx f(t_1)$$

⋮

$$-\frac{y(t_{i+1}) - 2y(t_i) + y(t_{i-1}))}{h^2} + y(t_i) \approx f(t_i) \quad i=2, \dots, N-2$$

⋮

$$-\frac{0 - 2y(t_{N-1}) + y(t_{N-2}))}{h^2} + y(t_{N-1}) \approx f(t_{N-1})$$

mit  $y(t_i) \approx y_i$  ergibt sich ein Gleichungssystem

$$\frac{1}{h^2} \begin{pmatrix} 2 & -1 & & & & \\ -1 & 2 & -1 & & & \\ & \ddots & \ddots & \ddots & & \\ & & & -1 & 2 & -1 \\ & & & & -1 & 2 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} y_1 \\ y_2 \\ \vdots \\ y_{n-2} \\ y_{n-1} \end{pmatrix} + \begin{pmatrix} 1 & & & & & \\ & 1 & & & & \\ & & \ddots & & & \\ & & & & & \\ & & & & & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} y_1 \\ y_2 \\ \vdots \\ y_{n-1} \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} f(t_1) \\ f(t_2) \\ \vdots \\ f(t_{n-1}) \end{pmatrix}$$

$(n-1) \times (n-1)$                        $(n-1) \times (n-1)$                        $(n-1) \times (n-1)$   
 $A$                        $E$                        $f$

$$\left( \frac{1}{h^2} A + E \right) (\bar{y}) = \bar{f} \iff (A + h^2 E) \bar{y} = h^2 \bar{f}$$

Es gilt übrigens

$$\lim_{\substack{h \rightarrow 0 \\ nh \rightarrow t}} y_n = y(t)$$

Beispiel (Finite Elemente)

$$-y'' = f$$

$$y(0) = y(1) = 0$$

Überführen in Variationsaufgabe:

$$\int_0^1 \frac{1}{2} y'^2 - f y \, dt = \int_0^1 F(t, y, y') \, dt = \text{Min!}$$

$$y(0) = y(1) = 0$$

③

$$\begin{array}{lll}
 -y'' = f & \int_0^1 \frac{1}{2}y'^2 - f y dt = \text{Min} & \text{Euler-Lagrange} \\
 y(0) = y(1) = 0 & y(0) = y(1) = 0 & -y'' = f = 0 \\
 & & y(0) = y(1) = 0
 \end{array}$$

Also: gesucht ist eine Funktion aus  $C^1[0,1]$  mit  $y(0) = y(1) = 0$

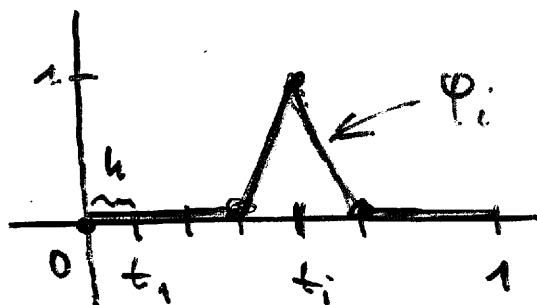
so dass

$$I(y) = \int_0^1 \frac{1}{2}y'^2 - f y dt = \int_0^1 F(t, y, y') dt = \text{Min!!!}$$

Idee: Suche das Minimum nicht in  $C^1[0,1]$  sondern in

$$V = \left\{ \varphi / \varphi = \sum_{i=1}^{N-1} a_i \varphi_i \quad a_i \in \mathbb{R} \right\}$$

$\varphi_i$   
Hütchen-Funktionen



Betrachte

$$I_h: \mathbb{R}^{N-1} \rightarrow \mathbb{R}$$

$$I_h(a_1, a_2, \dots, a_{N-1}) = \int_0^1 F(t, \sum_{i=1}^{N-1} a_i \varphi_i(t), \sum_{i=1}^{N-1} a_i \varphi_i'(t)) dt = \text{Min!}$$

Notwendig für Minimum (Analysis)

$$\frac{\partial I_h}{\partial a_i} = 0 \quad i=1, \dots, N-1$$

Es entsteht das Fließsystem

$$A \begin{pmatrix} a_n \\ \vdots \\ a_{n-1} \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} h \int f_1 dt \\ 0 \\ \vdots \\ h \int f_{n-1} dt \\ 0 \end{pmatrix}$$

$$A = \begin{pmatrix} 2 & -1 & & & \\ -1 & 2 & -1 & & \\ & & \ddots & \ddots & \\ & & & & -1 & 2 \end{pmatrix}$$

Übrigens:

mit  $h \rightarrow 0 \quad \varphi_h(\cdot) \rightarrow \varphi(\cdot)$

• (Einfacher) Schiefverfahren

Beschalte RWAbk zweiter Ordnung

$$\begin{aligned} y'' &= f(t, y, y') \\ y(a) &= y_a \\ y(b) &= y_b \end{aligned}$$

RWAbk

Löse Alternativ mit  $y'(a) = z$

$$\begin{aligned} y'' &= f(t, y, y') \\ y(a) &= y_a \\ y'(a) &= z \end{aligned}$$

AWAbk

Hoffung: Lösung der AWAbk liefert Lösung der RWAbk

$$y'' = f(t, y, y')$$

$$y(a) = y_a$$

$$y(b) = y_b$$



$$y'' = f(t, y, y')$$

$$y(a) = y_a$$

$$y'(a) = z$$

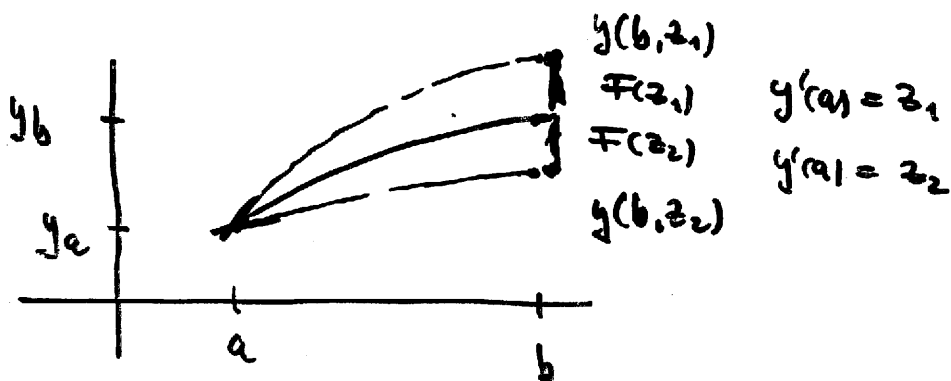
Lösung der AWA sei

$$y = y(t, z)$$

Betrachte

$$F(z) = y(b, z) - y_b$$

$$\left( \begin{array}{l} \text{Wunsch } z = z_0 \\ F(z) = 0 \end{array} \right)$$



Gesucht ist Nullstelle von  $F(z)$

Bisektion

$$F(z) = 0 \quad \checkmark$$

$$F(z_1) F(z_2) < 0 \quad z_1 < z_2$$

$$z_3 = z_1 + \frac{1}{2}(z_2 - z_1)$$

$$F(z_1) F(z_3) < 0 \quad z_2 = z_3$$

$$\text{denn} \quad z_1 = z_3$$

usw.

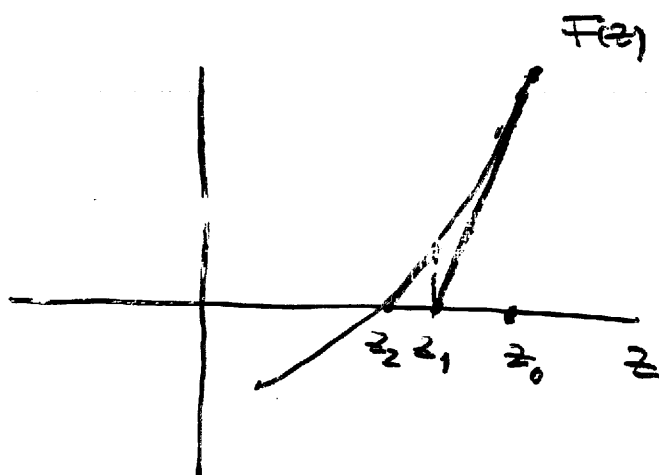


- Newton-Verfahren

$$F: \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$$

$$F(z) = y(y, z) - y_b$$

Wie findet man eine Nullstelle mit dem Newton-Verfahren?



$$z_{n+1} = z_n - \frac{F(z_n)}{F'(z_n)}$$

Bestimmung von  $F'(z_n)$ ?

- Differenzquotient

$$F'(z) \approx \frac{F(z+\Delta z) - F(z)}{\Delta z}$$

$$\Delta z \text{ so da\ss } \frac{|z|}{\Delta z} \leq \varepsilon p_0$$

- Form der Variationsgleichung

- Bestimmung von  $F'(z)$  über eine Variationsgleichung

$$F'(z) = \frac{\partial}{\partial z}(y(b, z) - y_b) = \frac{\partial}{\partial z} y(b, z)$$

Betrachte

$$\omega(t) = \frac{\partial}{\partial z} y(t, z)$$

und

$$y''(t, z) = f(t, y(t, z), y'(t, z))$$

$$\begin{aligned} \frac{\partial}{\partial z} y''(t, z) &= f_y(t, y(t, z), y'(t, z)) \frac{\partial}{\partial z} y(t, z) + \\ &+ f_{y'}(t, y(t, z), y'(t, z)) \frac{\partial}{\partial z} y'(t, z) \end{aligned}$$

$$y \in C^2$$

$$\begin{aligned} \frac{\partial^2}{\partial t^2} \frac{\partial}{\partial z} y(t, z) &= f_y(t, y(t, z), y'(t, z)) \frac{\partial}{\partial z} y(t, z) + \\ &+ f_{y'}(t, y(t, z), y'(t, z)) \frac{\partial}{\partial t} \frac{\partial}{\partial z} y(t, z) \end{aligned}$$

$$\omega''(t) = f_y(t, y(t, z), y'(t, z)) \omega(t) + f_{y'}(t, y(t, z), y'(t, z)) \omega'(t)$$

$$\omega(a) = 0$$

$$\omega'(a) = 1$$

Insgesamt

$$y'' = f(t, y, y')$$

$$y(a) = y_a$$

$$y'(a) = z$$

$$\omega'' = f_y(t, y, y') \omega + f_{y'}(t, y, y') \omega'$$

$$\omega(a) = 0$$

$$\omega'(a) = 1$$

Weiteres: Ansatz - Obile

# Die Laplace-Transformation

Laplace-Transformation  $\leftrightarrow$  Integraltransformation \*

$$f: [0, \infty) \rightarrow \mathbb{R}$$

$$\mathcal{L}(f)(s) = \int_0^{\infty} f(t) e^{-st} dt \quad s \in \mathbb{C}$$

- Praxis (meistens) einfach
- Anwendungen
  - Differentialgleichungen
  - Regelungstechnik
  - Elektrotechnik
- Theorie (etwas) anspruchsvoller

$$\int_0^{\infty} f(t) e^{-st} dt = \lim_{a \rightarrow \infty} \int_0^a \underline{f(t)} e^{-st} dt$$

zulässige Funktionen  $f$  ?

- $f$  lokal Riemann-Integrierbar (hier)
- $f$  lokal (Lebesgue) integrierbar (hier nicht)

\* Aussage, Oberle S. 419-29



$$\mathcal{L}(f)(s) = \int_0^{\infty} f(t) e^{-st} dt \quad s \in \mathbb{C} \quad (9)$$

Beispiel (Heaviside-Funktion)

$$H(t) = \begin{cases} 0 & t=0 \\ 1 & t>0. \end{cases}$$

$$\begin{aligned} \int_0^a H(t) e^{-st} dt &= \int_0^a e^{-st} dt = -\frac{1}{s} e^{-st} \Big|_0^a = -\frac{1}{s} e^{-sa} + \frac{1}{s} \\ &= \frac{1}{s} (1 - e^{-sa}) \end{aligned}$$

$\lim_{a \rightarrow \infty} ? \quad \exists$  nur wenn  $\operatorname{Re} s > 0$

$$\Rightarrow \mathcal{L}(H)(s) = \frac{1}{s} \quad \operatorname{Re} s > 0$$

Beispiel (Exponentialfunktion)

$$u(t) = e^{-\beta t}, \quad \beta \in \mathbb{R}$$

$$\begin{aligned} \int_0^a e^{-\beta t} e^{-st} dt &= \int_0^a e^{-(\beta+s)t} dt = -\frac{1}{\beta+s} e^{-(\beta+s)t} \Big|_0^a \\ &= \frac{1}{\beta+s} (1 - e^{-(\beta+s)a}) \end{aligned}$$

$\lim_{a \rightarrow \infty} ? \quad \exists$  nur wenn  $\operatorname{Re} s > -\operatorname{Re} \beta = -\beta$

$$\Rightarrow \mathcal{L}(e^{-\beta t}) = \frac{1}{\beta+s} \quad \operatorname{Re} s > -\beta$$

Beispiel (Eine trigonometrische Funktion)

$$u(t) = \cos kt \quad k \neq 0$$

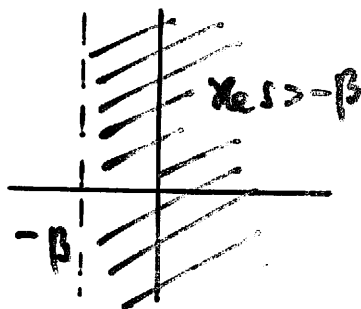
Trick:  $\cos kt = \frac{1}{2}(e^{ikt} - e^{-ikt})$

$$\mathcal{L}(\cos kt)(s) = \frac{1}{s} \left( \frac{1}{s-ik} + \frac{1}{s+ik} \right) = \frac{s}{s^2+k^2} \quad \operatorname{Re} s > 0$$

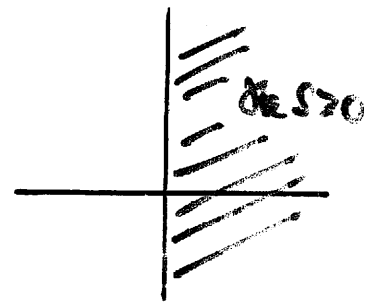
Beachte: In jedem Beispiel existiert die L-Transformation für alle  $s$  mit  $\operatorname{Re} s > \gamma$  ( $\gamma$  geeignet)



Heaviside



$e^{-\beta t}$



$\cos kt$

Satz

$f: [0, \infty) \rightarrow \mathbb{R}$  lokal integrierbar

$$|f(t)| \leq M e^{\gamma t} \quad \forall t \geq 0$$

für Konstanten  $M$  und  $\gamma$ .

Dann existiert die Laplace-Transformation von  $f$  für alle  $s \in \mathbb{C}$  mit  $\operatorname{Re} s > \gamma$ .

Definition (Konvergenzabszisse)

Die kleinste Zahl  $\gamma$  mit  $\int_0^\infty f(t)e^{-st} dt$  existiert für alle  $s$  mit  $\text{Re } s > \gamma$  heißt Konvergenzabszisse von  $f$ .

Existiert die Laplace-Transformation zu  $f$ , dann liefert die Laplace-Transformation eine Funktion  $F$  auf einer Halbebene in  $\mathbb{C}$ .

$$\mathcal{L}(f) = F$$

J.B.

$$\mathcal{L}(1)(s) = \frac{1}{s}$$

$$F(s) = \frac{1}{s} \quad \text{Re } s > 0$$

$$\mathcal{L}(e^{pt})(s) = \frac{1}{p+s}$$

$$F(s) = \frac{1}{p+s} \quad \text{Re } s > -p$$

$$\mathcal{L}(\cos kt)(s) = \frac{s}{s^2+k^2}$$

$$F(s) = \frac{s}{s^2+k^2} \quad \text{Re } s > 0$$

$$\mathcal{L}(\sin kt)(s) = \frac{k}{s^2+k^2}$$

$$F(s) = \frac{k}{s^2+k^2} \quad \text{Re } s > 0$$

$F$  heißt Laplace-Transformierte von  $f$

(Bild-Funktion)

(Originalfunktion)

Definition: Eine lokal integrierbare Funktion  $u: [0, \infty) \rightarrow \mathbb{R}$  heißt Nullfunktion, wenn  $\int_0^t u(\tau) d\tau = 0$  für alle  $t \geq 0$ .

Satz

Sind zwei Bildfunktionen gleich, dann unterscheiden sich die Originalfunktionen höchstens um eine Nullfunktion.

Laplace-Transformation

$f(t) = \mathcal{L}^{-1}(F(s))$	$F(s) = \mathcal{L}(f(t))$	$f(t) = \mathcal{L}^{-1}(F(s))$	$F(s) = \mathcal{L}(f(t))$
$\delta(t)$	1	$\delta(t-a)$	$e^{-as}$
1	$1/s$	$t$	$1/s^2$
$\frac{t^{n-1}}{(n-1)!}$	$\frac{1}{s^n} (n \in \mathbb{N})$	$\frac{t^{a-1}}{\Gamma(a)}$	$\frac{1}{s^a} (a > 0)$
$e^{-at}$	$\frac{1}{s+a}$	$\frac{t^{n-1} e^{-at}}{(n-1)!}$	$\frac{1}{(s+a)^n} (n \in \mathbb{N})$
$\frac{e^{-at} - e^{-bt}}{b-a}$	$\frac{1}{(s+a)(s+b)}$	$\frac{1}{a-b} (a e^{-at} - b e^{-bt})$	$\frac{s}{(s+a)(s+b)}$
$\frac{1}{a} \sin at$	$\frac{1}{s^2+a^2}$	$\cos at$	$\frac{s}{s^2+a^2}$
$\frac{1}{a} \sinh at$	$\frac{1}{s^2-a^2}$	$\cosh at$	$\frac{s}{s^2-a^2}$
$\frac{1-\cos at}{a^2}$	$\frac{1}{s(s^2+a^2)}$	$\frac{at - \sin at}{a^3}$	$\frac{1}{s^2(s^2+a^2)}$
$\frac{\sin at - at \cos at}{2a^3}$	$\frac{1}{(s^2+a^2)^2}$	$\frac{t \sin at}{2a}$	$\frac{s}{(s^2+a^2)^2}$
$\frac{\sin at + at \cos at}{2a}$	$\frac{s^2}{(s^2+a^2)^2}$	$\frac{1}{2} (2 \cos at - at \sin at)$	$\frac{s^3}{(s^2+a^2)^2}$
$\frac{b \sin at - a \sin bt}{ab(b^2-a^2)}$	$\frac{1}{(s^2+a^2)(s^2+b^2)}$	$\frac{\cos at - \cos bt}{(b^2-a^2)}$	$\frac{s}{(s^2+a^2)(s^2+b^2)}$
$\frac{1}{b} e^{-at} \sin bt$	$\frac{1}{(s+a)^2+b^2}$	$e^{-at} \cos bt$	$\frac{s+a}{(s+a)^2+b^2}$
$\frac{\sinh at - \sin at}{2a^3}$	$\frac{1}{s^4-a^4}$	$\frac{\sin at \sinh at}{2a^2}$	$\frac{s}{s^4+4a^4}$
$\frac{\sin at}{t}$	$\arctan \frac{a}{s}$	$\frac{1}{\sqrt{\pi t}}$	$\frac{1}{\sqrt{s}}$
$ \sin at $	$\frac{a \coth(\pi s/2a)}{s^2+a^2}$	$\frac{1}{2} (\sin t +  \sin t )$	$\frac{1}{(s^2+1)(1-e^{-\pi s})}$
$H(t) - H(t-a)$	$\frac{1-e^{-as}}{s}$	$\frac{(t-a)^{b-1}}{\Gamma(b)} H(t-a)$	$\frac{1}{s^b} e^{-as} (b > 0)$
$f(t) \longleftrightarrow F(s)$		$f(t) \longleftrightarrow F(s)$	

## Eigenschaften der Laplace-Transformation · Rechenregeln

- $\mathcal{L}$  ist eine lineare Transformation

$$\mathcal{L}(af_1 + bf_2) = a\mathcal{L}(f_1) + b\mathcal{L}(f_2)$$

$$a, b \in \mathbb{R}$$

- Differentiationsatz ( $\mathcal{L}(y') = s\mathcal{L}(y) - y(0)$ )

$y: [0, \infty) \rightarrow \mathbb{R}$  stetig und stetig differenzierbar

$|y(t)| \leq te^{\beta t}$ ,  $\beta > 0$ . Existiert  $\mathcal{L}(y')$  für

$\operatorname{Re} s > \beta > 0$ , dann gilt

$$\mathcal{L}(y') = s\mathcal{L}(y) - y(0)$$

Beweis:

$$\int_0^{\infty} e^{-st} y'(t) dt = \left[ e^{-st} y(t) \right]_0^{\infty} + s \int_0^{\infty} e^{-st} y(t) dt$$

$$\mathcal{L}(y') = -y(0) + s\mathcal{L}(y)$$

$$\operatorname{Re} s > \beta > 0$$

- Allgemeiner Differentiationsatz

$$\mathcal{L}(y^{(n)}) = s^n \mathcal{L}(y) - s^{n-1} y(0) - s^{n-2} y'(0) - \dots - s y^{(n-2)}(0) - y^{(n-1)}(0)$$

• Integrationsatz  $\mathcal{L}\left(\int_0^t y(\tau) d\tau\right) = \frac{1}{s} \mathcal{L}(y)$

Es sei  $y: [0, \infty) \rightarrow \mathbb{R}$  lokal integrierbar  
 $|y(t)| \leq M e^{\beta t}$ ,  $\beta > 0$  und  $\mathcal{L}(y)$   $\Re s > \beta > 0$

Sei 
$$\varphi(t) = \int_0^t y(\tau) d\tau$$

Dann existiert  $\mathcal{L}(\varphi)$  für  $\Re s > \beta > 0$  und

$$\mathcal{L}(\varphi) = \frac{1}{s} \mathcal{L}(y)$$

• Faltung  $\mathcal{L}(f_1 * f_2) = \mathcal{L}(f_1) \cdot \mathcal{L}(f_2) \leftarrow$

Es seien  $y_1, y_2: [0, \infty) \rightarrow \mathbb{R}$  zwei lokal integrierbare Funktionen und

$$\gamma(t) = \int_0^t y_1(t-\tau) y_2(\tau) d\tau \quad *$$

( $\gamma$  heißt Faltung von  $y_1$  mit  $y_2$ , häufig  $y_1 * y_2$ )

Dann gilt (mit vernünftigen Voraussetzungen)

$$\mathcal{L}(y_1) \mathcal{L}(y_2) = \mathcal{L}(y_1 * y_2) = \mathcal{L}(\gamma)$$

\* Beachte: Fundlöserverfahren ( $y^{(n)} + a_{n-1} y^{(n-1)} + \dots + a_0 y^{(0)} = h$ )  
 führe zu

$$y_p(t) = \int_0^t \omega(t-\tau) h(\tau) d\tau$$

# Elementare Beispiele

- Sprungantwort eines TPT-Gliedes

$$T\dot{x} + x = kH(t) \quad k, T > 0, t \geq 0$$

$$x(0) = 0$$

Formale Anwendung der Laplace-Transformation

$$\mathcal{L}(T\dot{x} + x) = \mathcal{L}(kH)$$

$$T \mathcal{L}(\dot{x}) + \mathcal{L}(x) = k \mathcal{L}(H) \quad \text{Linearität}$$

$$Ts \mathcal{L}(x) + \mathcal{L}(x) = k \mathcal{L}(H) \quad \text{Differenzialregel}$$

$$\mathcal{L}(x) = \frac{k}{1+Ts} \mathcal{L}(H)$$

$$\mathcal{L}(x) = \frac{k}{1+Ts} \cdot \frac{1}{s} \quad \text{Heaviside-Funktion}$$

$$= \frac{T}{\frac{1}{T} + s} \cdot \frac{k}{s}$$

$$= \mathcal{L}(Te^{-\frac{t}{T}}) \mathcal{L}(kH)$$

$$= \mathcal{L}(Te^{-\frac{t}{T}} * kH) \quad \text{Faltung}$$

$$x(t) = \int_0^t Te^{-\frac{(t-\tau)}{T}} kH(\tau) d\tau \quad \text{Originalfunktion}$$

Beispiel ( DGL ohne Anfangsbedingungen )

(16)

$$\ddot{x} + 4x = \sin \omega t$$

Ohne Anfangsbedingungen? Setze

$$x(0) = C_0$$

$$\dot{x}(0) = C_1$$

Anwendung der Laplace-Transformation

$$s^2 \mathcal{L}(x) - sC_0 - C_1 + 4 \mathcal{L}(x) = \frac{\omega}{s^2 + \omega^2}$$

$$(s^2 + 2^2) \mathcal{L}(x) = \frac{\omega}{s^2 + \omega^2} + sC_0 + C_1$$

$$\mathcal{L}(x) = \frac{\omega}{(s^2 + \omega^2)(s^2 + 2^2)} + C_0 \frac{s}{s^2 + 2^2} + \frac{C_1}{2} \frac{2}{s^2 + 2^2}$$

$$x(t) = C_0 \cos 2t + \frac{C_1}{2} \sin 2t + \begin{cases} \frac{1}{2(\omega^2 - 4)} (\omega \sin \omega t - 2 \sin \omega t) & \omega^2 \neq 4 \\ \frac{1}{8} (\sin \omega t - 2t \cos \omega t) & \omega^2 = 4 \end{cases}$$

Beispiel ( System von DGL )

$$\dot{x} = x + y$$

$$\dot{y} = x - y$$

$$x(0) = 1$$

$$y(0) = 0$$

$$s \mathcal{L}(x) - 1 = \mathcal{L}(x) + \mathcal{L}(y)$$

$$s \mathcal{L}(y) = \mathcal{L}(x) - \mathcal{L}(y)$$

$$\Rightarrow (s-1) \mathcal{L}(x) - \mathcal{L}(y) = 1$$

$$-\mathcal{L}(x) + (s+1) \mathcal{L}(y) = 0$$

$$\mathcal{L}(x) = \frac{s+1}{s^2-2}$$

$$\mathcal{L}(y) = \frac{1}{s^2-2}$$

$$x(t) = \frac{1}{\sqrt{2}} \sinh \sqrt{2}t + \frac{1}{\sqrt{2}} \cosh \sqrt{2}t$$

$$y(t) = \frac{1}{\sqrt{2}} \sinh \sqrt{2}t$$



# Keine lineare Temperaturregelung

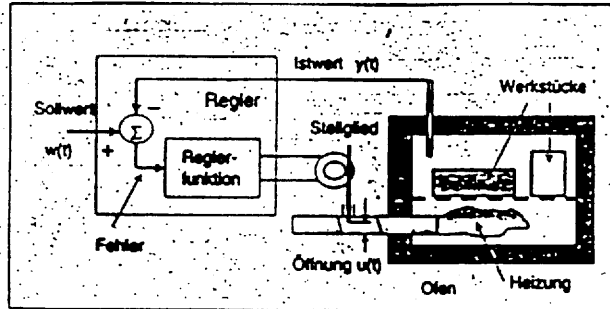


Bild 6.6 Skizze der Temperaturregelung eines Ofens

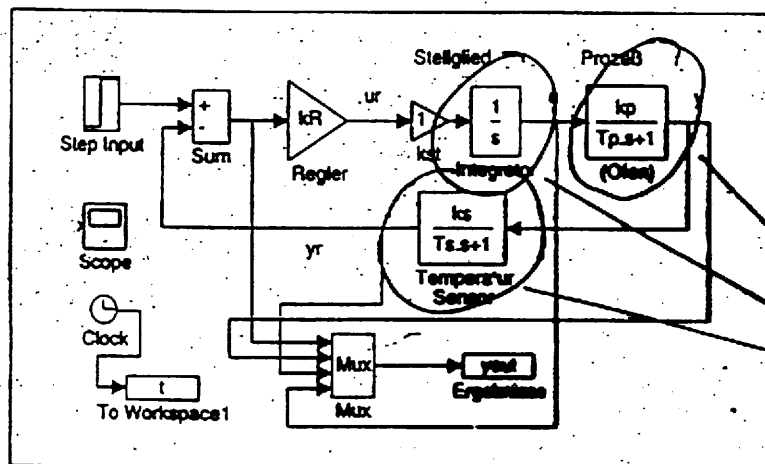


Bild 6.9 SIMULINK-Modell mit Transfer-Funktion-Blöcken aus der Linear-Bibliothek (`s_temp1.m`; `s_temp1.mdl`; `p_temp1.m`; `d_temp1.m`)

## SIMULINK - Modell

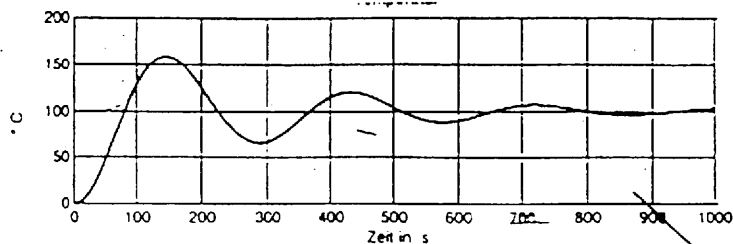


Bild 6.10 Sprungantwort der Temperaturregelung mit  $k_R = 50$  (`s_temp1.m`; `s_temp1.mdl`; `p_temp1.m`; `d_temp1.m`; `temp11.m`)

ERGEBNIS