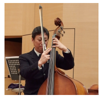
A. Asano, Kansai Univ.

2015年度秋学期　応用数学（解析）　　第７回

第２部・基本的な微分方程式

２階線形微分方程式（１）

浅野　晃
関西大学総合情報学部



A. Asano, Kansai Univ.

２階線形微分方程式とは

A. Asano, Kansai Univ.

２階線形微分方程式

一般には $x'' + P(t)x' + Q(t)x = R(t)$

ここが恒等的に0なのが［斉次］
そうではないのが［非斉次］

一番簡単なのは $x'' + ax' + bx = 0$

定数係数の斉次方程式

とりあえず，$x \equiv 0$ は解［自明解］

それ以外には？

A. Asano, Kansai Univ.

２階線形微分方程式の解

とりあえず

$x'' + ax' + bx = 0$ に $x(t) = e^{\lambda t}$ を代入すると

$$\lambda^2 e^{\lambda t} + a\lambda e^{\lambda t} + b e^{\lambda t} = 0$$

$$\left(\lambda^2 + a\lambda + b\right) e^{\lambda t} = 0$$

ここが 0 になるような λ については

$x = e^{\lambda t}$ は解，その定数倍も解

λ の２次方程式だから，みたす λ はたいてい２つ　λ_1, λ_2

一般解は $x = C_1 e^{\lambda_1 t} + C_2 e^{\lambda_2 t}$　　$x \equiv 0$ を含む

A. Asano, Kansai Univ.

おわり

A. Asano, Kansai Univ.

こんなんでいいのか？

A. Asano, Kansai Univ.

本当に一般解であるためには

$x = C_1 e^{\lambda_1 t} + C_2 e^{\lambda_2 t}$ が本当に一般解であることは，
以下の２項目が正しいことと同じ

１．解が一意
初期値 $x(t_0), x'(t_0)$ を定めると，特殊解はひとつに定まる
初期値はこの２つ

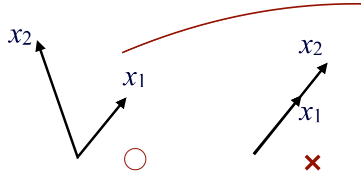
２．１次独立な特殊解の１次結合で一般解が表せる
1次独立な特殊解 $x_1(t), x_2(t)$ が得られれば，
一般解は $C_1x_1(t) + C_2x_2(t)$ で表される

A. Asano, Kansai Univ.

本当に一般解であるためには

２．１次独立な特殊解の１次結合で一般解が表せる
1次独立な特殊解 $x_1(t), x_2(t)$ が得られれば，
一般解は $C_1x_1(t) + C_2x_2(t)$ で表される

２つの関数が1次独立とは
$C_1x_1(t) + C_2x_2(t) = 0$ がどんな t についても
なりたつのは，$C_1 = C_2 = 0$ のときだけ



解全体は
２次元ベクトル空間
をなす

本当に一般解であるためには

1．解が一意
2．１次独立な特殊解の１次結合で一般解が表せる

さっきの例では

$e^{\lambda_1 t}, e^{\lambda_2 t}$ は $\lambda_1 \neq \lambda_2$ なら１次独立

一般解は $C_1 e^{\lambda_1 t} + C_2 e^{\lambda_2 t}$ だけで，他にはない

一般の斉次形 n 階線形微分方程式
（定数係数でない場合も含む）についてなりたつ

定数係数の場合に，証明してみる

A. Asano, Kansai Univ.

2015年度秋学期

行列で表現する

$x'' + P(t)x' + Q(t)x = R(t)$ を，　$x_1 = x, x_2 = x'$ とおいて

$$x_1' = x_2$$
$$x_2' = -Q(t)x_1 - P(t)x_2 + R(t)$$

と表す

行列で $\begin{pmatrix} x_1' \\ x_2' \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 0 & 1 \\ -Q(t) & -P(t) \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x_1 \\ x_2 \end{pmatrix} + \begin{pmatrix} 0 \\ R(t) \end{pmatrix}$

$$\boldsymbol{x}' = A(t)\boldsymbol{x} + \boldsymbol{b}(t)$$

１階線形微分方程式の形になる
何階線形微分方程式でも，この形にできる

A. Asano, Kansai Univ.

2015年度秋学期

条件１の証明の概略

1．解が一意
初期値 $x(t_0), x'(t_0)$ を定めると，特殊解はひとつに定まる

リプシッツ条件をつかう

A. Asano, Kansai Univ.

2015年度秋学期

特異解と解の一意性

初期値がひとつ定まったときに，
解がひとつだけに決まることを，
解が一意(unique)であるという

一意性の十分条件のひとつ「リプシッツ条件」
微分方程式が $x'(t) = f(t, x)$ のとき，
初期値のまわりでどんな x_1, x_2 についても

$$|f(t, x_1) - f(t, x_2)| \leqq L|x_1 - x_2|$$

となる定数 L があるなら，その初期値について一意

x のわずかな変化について，
f がいくらでも大きく変化する，ということはない

A. Asano, Kansai Univ.

2015年度秋学期

条件１の証明の概略

１．解が一意

初期値 $x(t_0), x'(t_0)$ を定めると，特殊解はひとつに定まる

リプシッツ条件をつかう

$\boldsymbol{x}' = A(t)\boldsymbol{x} + \boldsymbol{b}(t)$ の右辺について，関数 $\boldsymbol{x}, \boldsymbol{y}$ を考えると

$\|(A(t)\boldsymbol{x}+\boldsymbol{b}(t)) - (A(t)\boldsymbol{y}+\boldsymbol{b}(t))\| = \|A(t)\boldsymbol{x} - A(t)\boldsymbol{y}\|$ で，

$\|A(t)\boldsymbol{x} - A(t)\boldsymbol{y}\| \le \|A(t)\|\|\boldsymbol{x}-\boldsymbol{y}\|$ となるような
ノルムがある

ノルムが連続なので，任意の有界閉区間で
上限が存在する

リプシッツ条件
が成り立ち，一意

A. Asano, Kansai Univ.

条件２の証明の概略

２．１次独立な特殊解の１次結合で一般解が表せる

１次独立な特殊解 $x_1(t), x_2(t)$ が得られれば，

一般解は $C_1x_1(t) + C_2x_2(t)$ で表される

斉次形の場合を考える　$\boldsymbol{x}' = A(t)\boldsymbol{x}$

プリントは n 階の場合を示しているが，

ここでは２階の場合を示す

まず，

一般解を $\boldsymbol{x}(t)$ とするとき

$\boldsymbol{e}_1 = (1,0), \boldsymbol{e}_2 = (0,1)$
は，2次元の基本ベクトル

$t = t_0$ のときの初期値は $\boldsymbol{x}(t_0) = x_1\boldsymbol{e}_1 + x_2\boldsymbol{e}_2$ の形で表せる

A. Asano, Kansai Univ.

条件２の証明の概略

２．１次独立な特殊解の１次結合で一般解が表せる

$\boldsymbol{x}' = A(t)\boldsymbol{x}$ の特殊解を，２つ考える

初期値 $\boldsymbol{x}(t_0) = \boldsymbol{e}_1$ をみたすもの $\xi_1(t)$

初期値 $\boldsymbol{x}(t_0) = \boldsymbol{e}_2$ をみたすもの $\xi_2(t)$

$\boldsymbol{e}_1 = (1,0), \boldsymbol{e}_2 = (0,1)$
は，2次元の
基本ベクトル

この特殊解 $\xi_1(t), \xi_2(t)$ は，１次独立。本当？

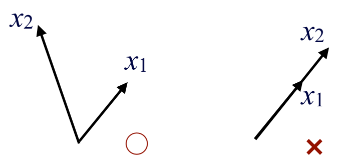
A. Asano, Kansai Univ.

本当に一般解であるためには

２つの関数が１次独立とは

$C_1x_1(t) + C_2x_2(t) = 0$ がどんな t についても

なりたつのは，$C_1 = C_2 = 0$ のときだけ



A. Asano, Kansai Univ.

条件２の証明の概略

２．１次独立な特殊解の１次結合で一般解が表せる

$\boldsymbol{x}' = A(t)\boldsymbol{x}$ の特殊解を，２つ考える

初期値 $\boldsymbol{x}(t_0) = \boldsymbol{e}_1$ をみたすもの $\boldsymbol{\xi}_1(t)$

初期値 $\boldsymbol{x}(t_0) = \boldsymbol{e}_2$ をみたすもの $\boldsymbol{\xi}_2(t)$

$\boldsymbol{e}_1 = (1, 0), \boldsymbol{e}_2 = (0, 1)$ は，2次元の基本ベクトル

この特殊解 $\boldsymbol{\xi}_1(t), \boldsymbol{\xi}_2(t)$ は，１次独立

$\because$ $c_1\boldsymbol{\xi}_1(t) + c_2\boldsymbol{\xi}_2(t) = \boldsymbol{0}$ が任意の t についてなりたつとする

$t = t_0$ のときも当然なりたつ

$c_1\boldsymbol{\xi}_1(t_0) + c_2\boldsymbol{\xi}_2(t_0) = \boldsymbol{0}$　$\boldsymbol{e}_1, \boldsymbol{e}_2$ は１次独立だから

$c_1\boldsymbol{e}_1 + c_2\boldsymbol{e}_2 = \boldsymbol{0}$ ← これがなりたつのは $c_1 = c_2 = 0$ に限る

A. Asano, Kansai Univ.

条件２の証明の概略

２．１次独立な特殊解の１次結合で一般解が表せる

初期値 $\boldsymbol{x}(t_0) = \boldsymbol{e}_1$ をみたす $\boldsymbol{\xi}_1(t)$

初期値 $\boldsymbol{x}(t_0) = \boldsymbol{e}_2$ をみたす $\boldsymbol{\xi}_2(t)$

一般解を $\boldsymbol{x}(t)$ とするとき

$t = t_0$ のときの初期値は $\boldsymbol{x}(t_0) = x_1\boldsymbol{e}_1 + x_2\boldsymbol{e}_2$ の形で表せる

特殊解の１次結合 $x_1\boldsymbol{\xi}_1(t) + x_2\boldsymbol{\xi}_2(t)$ を考えると

$t = t_0$ のとき $x_1\boldsymbol{e}_1 + x_2\boldsymbol{e}_2$

- 一般解で表された $\boldsymbol{x}(t)$
- 特殊解の１次結合 $x_1\boldsymbol{\xi}_1(t) + x_2\boldsymbol{\xi}_2(t)$

どちらも同じ初期値をもつ

一意だから，それらは同じ解

$\boldsymbol{x}(t) = x_1\boldsymbol{\xi}_1(t) + x_2\boldsymbol{\xi}_2(t)$

A. Asano, Kansai Univ.

定数係数の斉次形２階線形微分方程式を解く

A. Asano, Kansai Univ.

２階線形微分方程式を解く

$x'' + ax' + bx = 0$　定数係数の斉次形２階線形微分方程式

$\lambda^2 + a\lambda + b = 0$ をみたす λ について $x = e^{\lambda t}$ は解

特性方程式という

特性方程式の解の形によって，３パターン

異なる２つの実数解の場合

異なる２つの虚数解の場合

重解の場合

A. Asano, Kansai Univ.

実数解が２つの場合

特性方程式の異なる２つの実数解 λ_1, λ_2

微分方程式の１次独立な解 $e^{\lambda_1 t}, e^{\lambda_2 t}$

一般解は $x(t) = C_1 e^{\lambda_1 t} + C_2 e^{\lambda_2 t}$

（つまり，最初のとおり）

A. Asano, Kansai Univ.

虚数解が２つの場合

一般解は $x(t) = C_1 e^{(\alpha+i\beta)t} + C_2 e^{(\alpha-i\beta)t}$

さらに計算すると

$$
\begin{aligned}
x(t) &= C_1 e^{(\alpha+i\beta)t} + C_2 e^{(\alpha-i\beta)t} \\
&= e^{\alpha t}\left(C_1 e^{i\beta t} + C_2 e^{-i\beta t}\right) \\
&= e^{\alpha t}\left(C_1(\cos(\beta t) + i\sin(\beta t)) + C_2(\cos(\beta t) - i\sin(\beta t))\right) \\
&= e^{\alpha t}\left((C_1 + C_2)\cos(\beta t) + i(C_1 - C_2)\sin(\beta t)\right)
\end{aligned}
$$

なぜ三角関数になるのかは，また先で

定数を置き直して，一般解は

$$x(t) = e^{\alpha t}\left(C_1 \cos(\beta t) + C_2 \sin(\beta t)\right)$$

振動を表している　これも先で

A. Asano, Kansai Univ.

重解の場合

ふつうにやると，微分方程式の解は

$C_1 e^{\lambda_1 t}$ しか出て来ない

これと１次独立なもうひとつの解は $te^{\lambda_1 t}$

確かめるため，解を微分して，微分方程式に代入してみる

$$(te^{\lambda_1 t})' = \lambda_1 te^{\lambda_1 t} + e^{\lambda_1 t} = (\lambda_1 t + 1)e^{\lambda_1 t}$$

$$(te^{\lambda_1 t})'' = \lambda_1(\lambda_1 t + 1)e^{\lambda_1 t} + \lambda_1 e^{\lambda_1 t} = (\lambda_1^2 t + 2\lambda_1)e^{\lambda_1 t}$$

微分方程式の左辺に代入すると

$$
\begin{aligned}
&(\lambda_1^2 t + 2\lambda_1)e^{\lambda_1 t} + a\lambda_1 te^{\lambda_1 t} + bte^{\lambda_1 t} \\
&= \underline{\{\lambda_1^2 + a\lambda_1 + b\}}te^{\lambda_1 t} + \underline{(2\lambda_1 + a)}e^{\lambda_1 t}
\end{aligned}
$$

λ_1は特性方程式の解だから0

特性方程式の解と係数の関係で0

一般解は

$C_1 e^{\lambda_1 t} + C_2 te^{\lambda_1 t}$

見つけ方はプリントで（定数変化法）

A. Asano, Kansai Univ.

例題

A. Asano, Kansai Univ.

例題

$x'' - 5x' + 6x = 0$ を解いて，
初期値 $x(0) = 1,\ x'(0) = 0$ での特殊解を求めよ。

特性方程式は $\lambda^2 - 5\lambda + 6 = 0$ その解は $\lambda = 2, 3$
異なる２つの実数解なので，微分方程式の一般解は

$$x(t) = C_1 e^{2t} + C_2 e^{3t}$$

初期条件から

$$x(0) = C_1 + C_2 = 1$$
$$x'(0) = 2C_1 + 3C_2 = 0$$
$$\downarrow$$
$$C_1 = 3, C_2 = -2$$

よって，求める
特殊解は

$$x(t) = 3e^{2t} - 2e^{3t}$$

A. Asano, Kansai Univ.

2015年度秋学期

今日のまとめ

定数係数・斉次形の
２階線形微分方程式 $x'' + ax' + bx = 0$

次回は非斉次形
（右辺が０でない）
をやります

A. Asano, Kansai Univ.

2015年度秋学期