2018年度秋学期　応用数学（解析）　第８回

第２部・基本的な微分方程式

２階線形微分方程式（２）

浅野　晃
関西大学総合情報学部

２階線形微分方程式（復習）

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？

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

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

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

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

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

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）

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

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

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

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

微分方程式の左辺に代入すると

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

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
前回のテキストで
（定数変化法）

非斉次形
2 階線形微分方程式🤔

A. Asano, Kansai Univ.

非斉次形 2 階線形微分方程式

前回のは $x'' + ax' + bx = 0$

定数係数の斉次方程式

今回は $x''+ax'+bx = \underline{R(t)}$

［非斉次］tの式

A. Asano, Kansai Univ.

非斉次形 2 階線形微分方程式

前回のは $x'' + ax' + bx = 0$

定数係数の斉次方程式

今回は $x''+ax'+bx = \underline{R(t)}$

［非斉次］tの式

結論からいうと

非斉次形の一般解 ＝

非斉次形の特殊解なにかひとつ（何でもいい）

＋ 対応する斉次形の一般解

A. Asano, Kansai Univ.

一般的にいうと

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

$$\begin{aligned} x_1' &= x_2 \\ x_2' &= -Q(t)x_1 - P(t)x_2 + R(t) \end{aligned}$$

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.

一般的にいうと

非斉次形 n 階線形微分方程式

$\boldsymbol{x}' = A(t)\boldsymbol{x} + \boldsymbol{b}(t)$ の一般解 $\boldsymbol{x}_s(t)$ は

非斉次形方程式

$\boldsymbol{x}' = A(t)\boldsymbol{x} + \boldsymbol{b}(t)$ の任意の特殊解 $\boldsymbol{x}_p(t)$ と

対応する斉次形方程式

$\boldsymbol{x}' = A(t)\boldsymbol{x}$ の一般解 $\boldsymbol{x}_h(t)$ の　和で表される。

$$\boldsymbol{x}_s(t) = \boldsymbol{x}_h(t) + \boldsymbol{x}_p(t)$$

何階微分方程式でも
定数係数でなくても

A. Asano, Kansai Univ.

証明は，割と簡単

まず　$\boldsymbol{x}_s(t) = \boldsymbol{x}_h(t) + \boldsymbol{x}_p(t)$　が

非斉次形方程式　$\boldsymbol{x}' = A(t)\boldsymbol{x} + \boldsymbol{b}(t)$　の解であることを確かめる

右辺に $\boldsymbol{x}_s(t) = \boldsymbol{x}_h(t) + \boldsymbol{x}_p(t)$ を代入

$$\begin{aligned} &A(t)\boldsymbol{x}_s(t) + b(t) \\ &= A(t)\left(\boldsymbol{x}_h(t) + \boldsymbol{x}_p(t)\right) + b(t) \\ &= \left(A(t)\boldsymbol{x}_h(t)\right) + \left(A(t)\boldsymbol{x}_p(t) + b(t)\right) \\ &= (\boldsymbol{x}_h(t))' + (\boldsymbol{x}_p(t))' \quad = (\boldsymbol{x}_s(t))' \end{aligned}$$

斉次形　非斉次形　（左辺）

本当に一般解か？
どんな初期値に対する特殊解でも表せるか？

A. Asano, Kansai Univ.

証明は，割と簡単

どんな初期値に対する特殊解でも表せるか？

非斉次形方程式 $\boldsymbol{x}' = A(t)\boldsymbol{x} + \boldsymbol{b}(t)$ の一般解 $\boldsymbol{x}_s(t)$ について

任意の初期値 $\boldsymbol{x}_s(t_0) = \boldsymbol{x}_0$ を考える

このとき，
対応する斉次形方程式 $\boldsymbol{x}' = A(t)\boldsymbol{x}$ の一般解 $\boldsymbol{x}_h(t)$ について

初期値を $\boldsymbol{x}_h(t_0) = \boldsymbol{x}_0 - \boldsymbol{x}_p(t_0)$ にとれば

$$\begin{aligned} \boldsymbol{x}_s(t_0) &= \boldsymbol{x}_h(t_0) + \boldsymbol{x}_p(t_0) \\ &= (\boldsymbol{x}_0 - \boldsymbol{x}_p(t_0)) + \boldsymbol{x}_p(t_0) \\ &= \boldsymbol{x}_0 \end{aligned}$$

だから，これで
非斉次形方程式の解で
初期値を $\boldsymbol{x}_s(t_0) = \boldsymbol{x}_0$
としたことになっている

この斉次形方程式は一意だから，
斉次形方程式でこの初期値の
特殊解はひとつ

非斉次形方程式の特殊解もひとつ

A. Asano, Kansai Univ.

例題🤔

A. Asano, Kansai Univ.

非斉次形 2 階線形微分方程式

前回のは $x'' + ax' + bx = 0$

定数係数の斉次方程式

今回は $x''+ax'+bx = R(t)$

［非斉次］tの式

結論は

これを見つけるには
右辺の形に注目

非斉次形の一般解 ＝

非斉次形の特殊解なにかひとつ（何でもいい）

＋ 対応する斉次形の一般解

A.Asano, Kansai Univ.

例題

$x'' + 2x' - 3x = 3t^2 + 3t - 2$ の一般解を求めよ。

特殊解を，$x = at^2 + bt + c$ と見当をつける

これを元の方程式に代入して整理すると

$$-(3a+3)t^2 + (4a-3b-3)t + (2a+2b-3c+2) = 0$$

これが t に関係なくなりたつから

$$\begin{cases} 3a+3 & = 0 \\ 4a-3b-3 & = 0 \\ 2a+2b-3c+2 & = 0 \end{cases}$$

これを解くと

$$a = -1,\ b = -\frac{7}{3},\ c = -\frac{14}{9}$$

非斉次形の方程式の特殊解（のひとつ）は $x = -t^2 - \frac{7}{3}t - \frac{14}{9}$

A.Asano, Kansai Univ.

例題

$x'' + 2x' - 3x = 3t^2 + 3t - 2$ の一般解を求めよ。

非斉次形の特殊解（のひとつ）は $x = -t^2 - \frac{7}{3}t - \frac{14}{9}$

対応する斉次形の方程式は $x'' + 2x' - 3x = 0$

特性方程式は $\lambda^2 + 2\lambda - 3 = 0$　その解は $\lambda = 1, -3$

異なる 2 つの実数解なので，斉次形方程式の一般解は

$x = C_1 e^t + C_2 e^{-3t}$

以上から，与えられた非斉次形方程式の一般解は

$$x = C_1 e^t + C_2 e^{-3t} - t^2 - \frac{7}{3}t - \frac{14}{9}$$

A.Asano, Kansai Univ.

例題

$x'' + 2x' - 3x = e^{2t}$ の一般解を求めよ。

特殊解を，$x = ae^{2t}$ と見当をつける

これを元の方程式に代入して整理すると

$$4ae^{2t} + 2 \cdot 2ae^{2t} - 3ae^{2t} = e^{2t}$$
$$5ae^{2t} = e^{2t}$$

これが t に関係なく
なりたつから $a = \frac{1}{5}$

非斉次形の方程式の特殊解（のひとつ）は $x = \frac{1}{5}e^{2t}$

対応する斉次形の方程式は $x'' + 2x' - 3x = 0$

一般解は $x = C_1 e^t + C_2 e^{-3t}$

以上から，非斉次形方程式の一般解は $x = C_1 e^t + C_2 e^{-3t} + \frac{1}{5}e^{2t}$

A.Asano, Kansai Univ.

例題

$x''+2x'-3x=2\cos t$ の一般解を求めよ。

特殊解を，$x=A\cos t+B\sin t$ と見当をつける

これを元の方程式に代入して整理すると

$(2A+2B-2)\cos t+(-2A+2B)\sin t=0$ 　　cos, sinは独立

$$\begin{cases} -4A+2B-2 &=0 \\ -2A-4B &=0 \end{cases} \qquad A=-\frac{2}{5},\ B=\frac{1}{5}$$

非斉次形の方程式の特殊解（のひとつ）は $x=-\frac{2}{5}\cos t+\frac{1}{5}\sin t$

対応する斉次形の方程式は $x''+2x'-3x=0$

一般解は $x=C_1e^t+C_2e^{-3t}$

以上から，非斉次形方程式の一般解は

$$x=C_1e^t+C_2e^{-3t}-\frac{2}{5}\cos t+\frac{1}{5}\sin t$$

関数の１次独立とWronskian🤔

関数の１次独立とWronskian

関数 $x_1(t)$ と $x_2(t)$ 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なら，$C_1=C_2=0$

ところで　$C_1x_1(t)+C_2x_2(t)=0$ を t で微分すると
$C_1x_1'(t)+C_2x_2'(t)=0$

まとめて行列で書くと $\begin{pmatrix} x_1(t) & x_2(t) \\ x_1'(t) & x_2'(t) \end{pmatrix}\begin{pmatrix} C_1 \\ C_2 \end{pmatrix}=\begin{pmatrix} 0 \\ 0 \end{pmatrix}$

解が $C_1=C_2=0$ だけになるのは，この行列に逆行列が存在する時　つまり $\begin{vmatrix} x_1(t) & x_2(t) \\ x_1'(t) & x_2'(t) \end{vmatrix} \neq 0$

Wronskianという

今日のまとめ

定数係数・非斉次形の
２階線形微分方程式　$x''+ax'+bx=R(t)$

これを見つけるには
右辺の形に注目

非斉次形の一般解 ＝
非斉次形の特殊解なにかひとつ（何でもいい）
＋ 対応する斉次形の一般解
$x''+ax'+bx=0$