3 Equações diferenciais

3.1 Forma geral das equações diferenciais

Uma **equação diferencial ordinária** —ou de forma abreviada, EDO— de ordem n é uma relação entre uma função y(x) e as suas derivadas y', y'', ..., $y^{(n)}$. Por exemplo, uma possível equação diferencial ordinária de terceira ordem é:

$$3x^2y''' + \frac{y}{2y'} = xy'' \tag{3.1}$$

Neste caso, é possível também escrever a equação mostrando explicitamente a expressão que define a derivada de terceira ordem:

$$y''' = \frac{y''}{3x} - \frac{y}{6x^2y'} \tag{3.2}$$

É conveniente usar uma notação que permite ver a equação duma forma mais geral: a função y será denotada por y_1 , y_2 será a primeira derivada y' e y_3 a segunda derivada y''. A equação diferencial é então:

$$y_3' = \frac{y_3}{3x} - \frac{y_1}{6x^2y_2} \tag{3.3}$$

que define a derivada de y_2 em relação a (x, y_1, y_2, y_3) . Para resolver este problema é necessário resolver simultaneamente as equações que definem as derivadas de y_1 e y_2 . Ou seja, a equação original (3.1), de terceira ordem, foi transformada no sistema de 3 equações:

$$y_1' = y_2 (3.4)$$

$$y_2' = y_3 \tag{3.5}$$

$$y_3' = \frac{y_3}{3x} - \frac{y_1}{6x^2y_2} \tag{3.6}$$

Esta forma de escrever a equação diferencial tem também a vantagem de poder ser escrita de forma mais compacta; define-se o vetor,

$$\vec{y} = (y_1, y_2, y_3) \tag{3.7}$$

e o sistema de 3 equações diferenciais é equivalente a uma única equação diferencial vetorial:

$$\frac{\mathrm{d}\vec{y}}{\mathrm{d}x} = \vec{f}(x, \vec{y}) \tag{3.8}$$

onde a derivada do vetor \vec{y} é outro vetor obtido derivando cada uma das suas componentes,

$$\frac{d\vec{y}}{dx} = (y_1', y_2', y_3') \tag{3.9}$$

e as três componentes da função vetorial $\vec{f}(x, \vec{y})$ são, neste caso,

$$\vec{f}(x, \vec{y}) = \left(y_2, y_3, \frac{y_3}{3x} - \frac{y_1}{6x^2y_2}\right) \tag{3.10}$$

Assim sendo, para resolver equações diferencias ordinárias como, por exemplo, a equação (3.1), basta saber resolver equações de primeira ordem com a forma geral

$$\frac{\mathrm{d}y}{\mathrm{d}x} = f(x, y) \tag{3.11}$$

e generalizar o método ao caso em que y e f são vetores com várias componentes.

3.2 Equações diferenciais de primeira ordem

A forma geral das EDO de primeira ordem é

$$y' = f(x, y) \tag{3.12}$$

A função y(x) é chamada variável dependente e x é a variável independente. Uma solução da EDO, num intervalo $[x_0, x_n]$, é qualquer função y de x que verifica a equação.

Existem em geral muitas soluções, por exemplo, a figura 3.1 mostra 7 possíveis soluções da equação y'=(x-1)(x-3)-y. Em cada ponto de cada uma das curvas, o declive tem o mesmo valor obtido substituindo as coordenadas do ponto na expressão (x-1)(x-3)-y. As diferentes soluções não se cruzam nunca, porque em cada ponto existe apenas um valor (x-1)(x-3)-y e cada ponto (x,y) pertence unicamente a uma das soluções da equação diferencial.

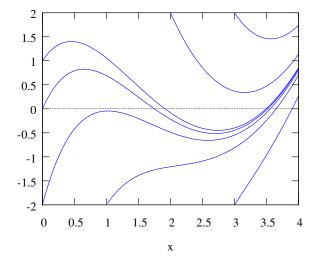


Figura 3.1: Soluções da equação diferencial y' = (x-1)(x-3) - y.

Se for dado um valor inicial y_0 para a função y no ponto inicial x_0 , existe uma única solução y(x), que é a curva tal que $y(x_0) = y_0$ e com declive igual a (x-1)(x-3) - y(x) em qualquer valor de x.

Os métodos de resolução numérica consistem em calcular o valor da variável dependente y numa sequência discreta de pontos $\{x_0, x_1, x_2, \ldots, x_n\}$, usando alguma aproximação. O resultado obtido aplicando um determinado método será o conjunto de pontos $\{(x_0, y_0), (x_1, y_1), \ldots, (x_n, y_n)\}$, que aproximam o gráfico da função y(x). Nos métodos que usam incrementos constantes, o intervalo $[x_0, x_n]$ divide-se em n subintervalos de comprimento $h = (x_n - x_0)/n$, de forma que cada valor na sequência $\{x_i\}$ é igual ao valor anterior mais h:

$$\{x_0, x_1 = x_0 + h, x_2 = x_0 + 2h, \dots, x_n = x_0 + nh\}$$
 (3.13)

Por exemplo, a figura 3.2 mostra a solução da equação diferencial y' = f(x,y) com f = (x-1)(x-3) - y e condição inicial y(0) = 1, no intervalo $0 \le x \le 4$. Os cinco pontos sobre a curva são a aproximação da função usando apenas 5 pontos com abcissas 0, 1, 2, 3 e 4.

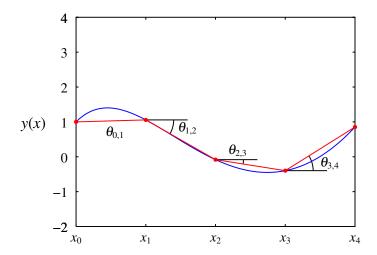


Figura 3.2: Uma solução da equação y' = (x-1)(x-3) - y, e aproximação com 5 pontos.

Cada ângulo $\theta_{i,j}$ na figura é a inclinação segmento entre os pontos (x_i, y_i) e $(x_{i,j}, y_{i,j})$. A tangente do ângulo $\theta_{i,j}$ (declive médio) é igual ao valor médio de f(x,y) no intervalo $[x_i, x_j]$. A partir das coordenadas (x_i, y_i) de um dos pontos, o declive médio $\bar{f}_{i,i+1}$ permite calcular as coordenadas do ponto seguinte:

$$x_{i+1} = x_i + h$$
 $y_{i+1} = y_i + h\bar{f}_{i,i+1}$ (3.14)

Usando estas **relações de recorrência** de forma iterativa, consegue-se obter as coordenadas de todos os pontos (x_i, y_i) , começando com os valores iniciais dados (x_0, y_0) .

Se os declives médios $\bar{f}_{i,j}$ pudessem ser calculados de forma exata, os resultados obtidos seriam exatos. No entanto, para calcular o valor médio de f(x,y) num intervalo seria

necessário conhecer a função y(x), mas quando se usam métodos numéricos é porque não existem métodos para encontrar a expressão analítica dessa função. Os diferentes métodos numéricos que existem para resolver equações diferenciais correspondem a diferentes esquemas para estimar o valor médio aproximado da função f(x,y) em cada intervalo.

3.2.1 Método de Euler

No método de Euler admite-se que $\bar{f}_{i,i+1} \approx f(x_i,y_i)$. Ou seja, o valor médio de f em cada intervalo é aproximado pelo valor de $f(x_i,y_i)$ no ponto inicial do intervalo. Realizando os cálculos no Maxima para o caso considerado acima, em que f(x,y) = (x-1)(x-3) - y e com condição inicial y(0) = 1, pode usar-se uma lista p para armazenar as coordenadas dos pontos; inicia-se a lista com o ponto inicial e define-se a função f(x,y) dada:

```
(%i1) p: [[0,1]]$
(%i2) f(x,y) := (x-1)*(x-3)-y$
```

Os quatro pontos seguintes na sequência são acrescentados usando um ciclo e usando as relações de recorrência (3.14) com h = 1:

O gráfico na figura 3.3 mostra o resultado obtido (segmentos de reta e pontos), comparandoo com a solução exata (curva contínua). Observa-se que a solução obtida com o método de Euler não é uma aproximação muito boa. No entanto, reduzindo o valor dos incrementos em x de h=1 para um valor menor, deverá ser possível obter uma aproximação melhor. É conveniente reduzir gradualmente o valor de h e comparar as soluções com as obtidas com valores maiores de h; se a solução obtida não variar significativamente quando h é reduzido, essa solução deverá ser uma boa aproximação da solução verdadeira.

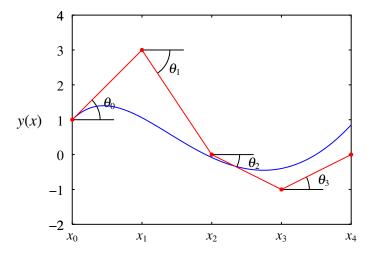


Figura 3.3: Método de Euler.

Exemplo 3.1

A carga armazenada num condensador ligado a uma pilha e a uma resistência é uma função Q que depende do tempo t e verifica a seguinte equação diferencial

$$\frac{\mathrm{d}Q}{\mathrm{d}t} = 1.25 - Q$$

No instante inicial, t = 0, a carga no condensador é nula. Usando o método de Euler, encontre uma sequência que aproxime Q(t) no intervalo $0 \le t \le 6$.

Resolução. Neste caso, a função f que define a derivada não depende da variável independente t. Os valores iniciais e a função que define a derivada são:

```
(%i5) p: [[0,0]]$
(%i6) f(Q) := 1.25 - Q$
```

Começando com incrementos de tempo h = 0.1, são necessárias 60 iterações para terminar em t = 6.

```
(%i7) for i thru 60 do
          ([t0,Q0]: last(p),
           p: endcons ([t0 + 0.1, Q0 + 0.1*f(Q0)], p))$
```

O último ponto na lista *p* é:

```
(%i8) last(p);
(%o8) [5.9999999999995, 1.247753737125107]
```

Convém repetir o processo, com um valor menor de h, por exemplo 0.01 e comparar o novo resultado com o resultado anterior:

A pesar de que o resultado final coincide em 4 algarismos significativos nos dois casos, convém comparar as duas sequências completas. As duas soluções obtidas com h=0.1 e h=0.01 estão armazenadas nas listas p e q e podem ser representadas num gráfico. A figura 3.4 mostra que a discrepância entre as duas soluções obtidas não é muito grande, concluindose que a solução com h=0.01 deverá estar já bastante próxima da solução verdadeira. O gráfico foi obtido usando o seguinte comando

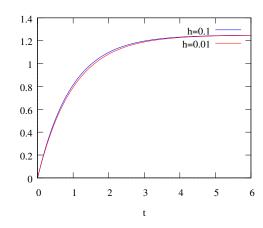


Figura 3.4: Soluções pelo método de Euler.

3.2.2 Método de Euler melhorado

A maior discrepância entre a sequência de pontos que aproximam a solução exata y(x) na figura 3.2 e a sequência obtida usando o método de Euler, apresentada na figura 3.3, é no segundo ponto, (x_1, y_1) . O valor médio do declive no primeiro intervalo, que era aproximadamente igual a zero, no método de Euler foi substituído por 2, que é o declive no ponto inicial (x_0, y_0) . A figura 3.2 mostra que mantendo um valor fixo $y = y_0 = 1$, o declive f(x,y) muda de um valor positivo em $x_0 = 0$ para um valor negativo em $x_1 = 1$. Se o valor do declive médio fosse aproximado pela média entre esses dois declives, o resultado seria muito melhor.

O método de Euler melhorado consiste em admitir que o declive médio $\bar{f}_{i,i+1}$ é igual à média entre os declives no ponto inicial (x_i, y_i) e no ponto final (x_{i+1}, y_{i+1}) :

$$\bar{f}_{i,i+1} \approx \frac{f(x_i, y_i) + f(x_{i+1}, y_{i+1})}{2}$$
(3.15)

O problema com esta equação é que para poder calcular $f(x_{i+1}, y_{i+1})$ seria necessário saber o valor de y_{i+1} , mas esse valor é desconhecido enquanto a solução da equação não for conhecida. É possível fazer uma estimativa inicial do valor que y_{i+1} poderá ter e a seguir melhorar essa estimativa. Uma primeira estimativa muito rudimentar consiste em dizer que y_{i+1} é igual a y_i . Com essa abordagem, a resolução da mesma equação y' = (x-1)(x-3) - y considerada na secção anterior, com valor inicial y(0) = 1 e com 5 pontos no intervalo $0 \le x \le 4$, pode ser feita assim: começa-se por iniciar a lista de pontos e definir a função para o declive

```
(%i13) p: [[0,1]]$
(%i14) f(x,y) := (x-1)*(x-3)-y$
```

Foi necessário definir novamente a função f(x,y), pois a definição que foi inserida na secção anterior foi logo substituída pela função f(Q) do exemplo 3.1. Basta repetir as 4 iterações mas usando agora a expressão (3.15) nas relações de recorrência (3.14)

A figura 3.5 mostra a sequência de pontos obtida, juntamente com a solução exata (curva contínua na figura). O resultado é muito melhor que o resultado obtido com o método de Euler. Este resultado pode ser melhorado se a estimativa inicial $y_{i+1} = y_i$ for melhorada com o resultado obtido a partir dessa estimativa rudimentar, como se explica a seguir.

A partir do valor inicial y_0 , começa-se por fazer a primeira estimativa do valor de y_1 , usando $y_{1,0} = y_0$, como nos cálculos acima, e calcula-se $y_{1,1} = y_0 + h f(x_0, y_{1,0})$. Esse

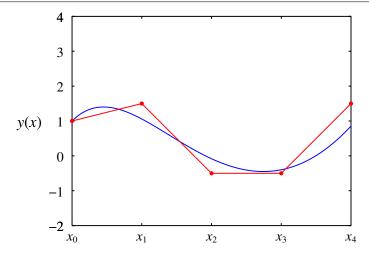


Figura 3.5: Solução exata e solução obtida com o método usado em (%i15).

valor estará mais próximo do valor real de y_1 do que a estimativa inicial $y_{1,0}$; assim sendo, espera-se que a sequência $y_{1,n} = y_0 + h f(x_0, y_{1,n-1})$ converja para um valor mais próximo do valor real y_1 . Calculam-se alguns termos dessa sequência, até $|y_{1,n} - y_{1,n-1}|$ ser menor que uma precisão desejada. Nesse momento usa-se $y_1 = y_{1,n}$ como valor inicial para o seguinte intervalo e o processo repete-se iterativamente em todo o intervalo de x. No caso do problema resolvido acima, com precisão de 0.0001, o método pode ser implementado assim:

A função f foi definida novamente, usando-se o comando float, para evitar obterr fracções com numeradores e denominadores muito grandes; nos exemplos anteriores foram feitos menos cálculos e, por isso, não produziram frações com números grandes. O resultado (figura 3.6) mostra que a solução obtida é muito melhor do que nas figuras 3.3 e 3.5, em relação à solução real.

A pesar de se ter usado uma precisão de 0.0001, não se pode garantir que a solução obtida esteja dentro dessa precisão em relação á solução real, já que a equação 3.15 é apenas uma aproximação e não o valor médio real da derivada. A aproximação pode ser melhorada se em vez de se fazer a média do declive em dois pontos, o declive fosse calculado em

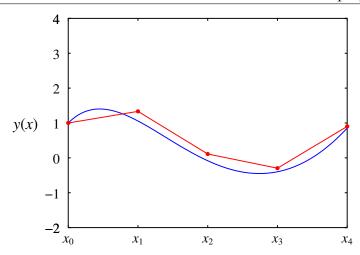


Figura 3.6: Solução exata e solução obtida com o método de Euler melhorado.

outros pontos nessa vizinhança e fosse feita uma média com diferentes pesos que podem ser definidos de forma a minimizar o erro. Existem muitos métodos diferentes que usam esse esquema; o mais popular é o que será descrito na seguinte secção.

3.2.3 Método de Runge-Kutta de quarta ordem

Neste método o valor médio do declive $\bar{f}_{i,i+1}$ obtém-se a partir da média dos declives em 4 pontos diferentes, com pesos diferentes (figura 3.7).

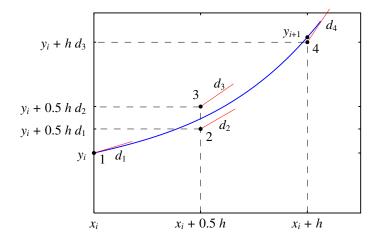


Figura 3.7: Os declives usados no método de Runge-Kutta.

Começa-se por calcular o declive no ponto inicial do intervalo, tal como no método de Euler:

$$d_1 = f(x_i, y_i) (3.16)$$

a seguir, realiza-se um deslocamento na direção desse declive, avançando-se uma distância

h/2 no eixo das abcissas, até um ponto 2 (ver figura 3.7). Nesse ponto 2, calcula-se um segundo valor do declive

$$d_2 = f(x_i + h/2, y_i + (h/2)d_1)$$
(3.17)

Esse novo valor do declive é usado novamente, para realizar outro deslocamento a partir do ponto inicial, avançando h/2 na direção do eixo das abcissas, até um outro ponto 3, onde é calculado um terceiro valor do declive

$$d_3 = f(x_i + h/2, y_i + (h/2)d_2)$$
(3.18)

seguindo a direção desse declive d_3 , realiza-se um terceiro deslocamento, a partir do ponto inicial, desta vez avançando uma distância h no sentido do eixo das abcissas, para chegar até um ponto 4, onde se calcula um quarto valor do declive

$$d_4 = f(x_i + h, y_i + h d_3) (3.19)$$

Pode mostrar-se que para minimizar o erro cometido, o valor médio do declive deve ser aproximado pela seguinte combinação linear dos quatro declives calculados:

$$\bar{f}_{i,i+1} \approx \frac{1}{6} (d_1 + 2d_2 + 2d_3 + d_4)$$
 (3.20)

no exemplo da figura 3.7, esse valor médio da derivada desloca o ponto inicial até o ponto 4, que está bastante próximo da solução exata da equação.

Para aplicar este método à mesma equação y' = (x-1)(x-3) - y considerada nas secções anteriores, com valor inicial y(0) = 1 e com 5 pontos no intervalo $0 \le x \le 4$, inicia-se a lista de pontos e define-se a função para o declive:

```
(%i21) p: [[0,1]]$
(%i22) h: 1$
```

Neste caso foi dado explicitamente o valor do comprimento dos intervalos, para que as expressões seguintes sejam mais claras.

A seguir realizam-se as 4 iterações necessárias para chegar até o ponto x = 4. Em cada iteração calculam-se os quatro declives d_1 , d_2 , d_3 e d_4 e a média com os pesos usados neste método.

A figura 3.8 mostra a sequência de pontos obtida, juntamente com a solução exata (curva contínua na figura). O resultado é bastante bom, a pesar do valor tão elevado que foi usado para os incrementos da variável x. No caso da equação diferencial resolvida neste exemplo, existem métodos analíticos que permitem encontrar a expressão para a curva contínua que foi apresentada na figura; nos casos em que não é possível encontrar a solução analítica, o método de Runge-Kutta de quarta ordem é uma boa opção para encontrar uma boa aproximação numérica.

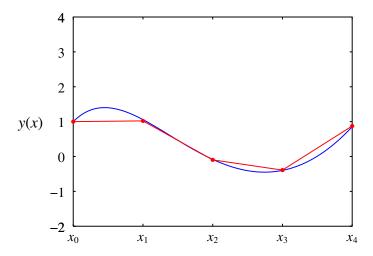


Figura 3.8: Solução exata e solução obtida com o método de Runge-Kutta.

Já existe uma função rk predefinida no Maxima, que executa o método de Runge-Kutta de quarta ordem. No exemplo acima, bastava indicar a expressão de f(x,y), o nome que identifica a variável independente, o seu valor inicial e o intervalo em que se quer obter a solução, incluindo o valor dos incrementos h. Nomeadamente, a mesma lista obtida com os comandos (%i17) até (%i21) podia ser obtida com um único comando:

```
(%i25) rk ((x-1)*(x-3)-y, y, 1, [x,0,4,1]);
(%o25) [[0.0, 1.0], [1.0, 1.02083333333333],
[2.0, - .09635416666666652], [3.0, - .3902994791666666],
[4.0, .8744710286458335]]
```

3.3 Sistemas de equações diferenciais

Os métodos descritos nas secções anteriores podem ser generalizados facilmente a um sistema de várias equações, quando sejam conhecidas condições iniciais para todas as variáveis. Tal como se explica no inicio do capítulo, basta admitir que y é um vetor e que f é uma função vetorial.

Exemplo 3.2

Usando o método de Runge-Kutta de quarta ordem, encontre a solução do seguinte sistema de equações diferenciais:

$$\begin{cases} \frac{\mathrm{d}x}{\mathrm{d}t} = 4 - x^2 - 4y^2\\ \frac{\mathrm{d}y}{\mathrm{d}t} = y^2 - x^2 + 1 \end{cases}$$

no intervalo, $0 \le t \le 4$, com condições iniciais $x_0 = -1.25$ e $y_0 = 0.75$, em $t_0 = 0$.

Resolução. A variável independente é t e a variável dependente é o vetor $\vec{r}=(x,y)$, que no Maxima é representado como uma lista com duas partes, [x, y]. A expressão \vec{f} que define as derivadas das variáveis dependentes também será uma lista com duas partes, $[4-x^2-4y^2, y^2-x^2+1]$, mas é mais conveniente (para poder generalizar ao caso de n variáveis) representá-la em função das componentes da lista r:

```
(\%i26) f(t,r) := [4-r[1]^2-4*r[2]^2, r[2]^2-r[1]^2+1]$
```

foi dada também a variável independente t como argumento da função, a pesar de que neste caso \vec{f} não depende de t, para que os comandos usados a seguir possam ser reutilizados em casos mais gerais.

Com as condições iniciais $t_0 = 0$ e $\vec{r}_0 = (-1.25, 0.75)$ cria-se a lista onde serão inseridos os resultados das iterações

```
(\%i27) p: [[0,-1.25,0.75]]$
```

Observe-se que a lista inicial [0,-1.25,0.75] e todas as outras listas que serão acrescentadas, incluem a variável independente t e o vetor dependente \vec{r} . Para extrair apenas a variável independente t usa-se o comando first, que extrai o primeiro elemento de uma lista e para extrair o vector \vec{r} usa-se o comando rest, que produz uma nova lista excluindo o primeiro elemento da lista original; isto é, rest([0, -1.25, 0.75]) produz [-1.25, 0.75].

Usando incrementos h = 0.02 para a variável independente, será necessário realizar 200 iterações para terminar em t = 4.

```
(%i28) h: 0.02$
(%i29) for i thru 200 do
          (ti: first (last(p)),
          ri: rest (last(p)),
          d1: f (ti, ri),
          d2: f (ti+h/2, ri+(h/2)*d1),
          d3: f (ti+h/2, ri+(h/2)*d2),
          d4: f (ti+h, ri+h*d3),
          p: endcons (cons (ti+h, ri+h*(d1+2*d2+2*d3+d4)/6), p))$
```

O comando cons é semelhante a endcons, mas insere um elemento no início de uma lista, em vez de no fim. Neste caso cons foi usado para inserir o valor de t na lista [x, y],

produzindo a lista [t, x, y], que foi logo inserida no fima da lista p dos resultados. O último ponto na solução obtida é:

```
(%i30) last (p);
(%o30) [4.00000000000003, 1.232365393486131, - .7493152366008236]
O comando rk também pode ser usado para obter o mesmo resultado:
```

```
(%i31) p:rk([4-x^2-4*y^2,y^2-x^2+1],[x,y],[-1.25,0.75],[t,0,4,h])$
```

Para imprimir os resultados é conveniente usar o comando printf. Esse comando aceita um formato que diz como devem ser imprimidos os dados. Neste exemplo, usando o formato " \sim { \sim f \sim f \sim f \sim conseguem-se imprimir os 3 elementos t, x e y de cada iteração numa linha separada, separados por uma vírgula e um espaço. Os dois símbolos \sim { e \sim } usam-se para delimitar um formato que deve ser aplicado recursivamente a todos os elementos de uma lista, neste caso a lista p. Dentro desses símbolos, o formato " \sim f \sim f \sim f \sim determina que o formato " \sim f \sim f \sim determina que o formato " \sim f \sim f \sim e a seguir se insira um fim de linha (símbolo \sim f). O símbolo \sim f é usado para escrever números de vírgula flutuante e o símbolo \sim nidica que o que vem a seguir só será escrito se não se tiver chegado ao último elemento; ou seja, só será escrita uma vírgula após t_i e t_i , mas não após t_i .

Para imprimir unicamente os 9 resultados para t = 0, 0.5, ..., 4, extraem-se unicamente esses elementos da lista p, usando o comando makelist:

```
(%i32) printf(true,"~{~f~^, ~}~%~}", makelist(p[25*i+1],i,0,8))$
0.0, -1.25, 0.75
0.5, -1.1773384444565893, 0.8294212227394446
1.0, -1.5811924578377141, 0.818421880110717
1.5, -1.5173593339612323, 0.037780513984502606
2.0, -0.0005587219405601279, 0.06781851774672519
2.5, 1.4685416405394016, 0.14800909710023502
3.0, 1.6981292199163442, -0.7368848754678627
3.5, 1.188041502209304, -0.8582807863663763
4.0, 1.232365393486131, -0.7493152366008236
```

Finalmente, pode ser conveniente gravar esses resultados num ficheiro. Por exemplo, os programas de folha de cálculo conseguem ler dados como estão apresentados acima, dentro de ficheiros do tipo CSV (*Comma Separated Values*). Para gravar o que é apresentado no ecrã num ficheiro, usa-se o comando with_stdout

```
(%i33) with_stdout ("resultados.csv",
    printf(true,"~{~f~^, ~}~%~}", makelist(p[25*i+1],i,0,8)))$
```

Os resultados ficam gravados no ficheiro resultados.csv.