

# Sistemas lineales de ecuaciones diferenciales

---

Juan-Miguel Gracia

---

# Índice

- 1 **Sistemas lineales**
- 2 **Búsqueda de una solución especial**
- 3 **Valores y vectores propios**
- 4 **Aplicación a sistemas**
- 5 **Problema de C.I.**

## Sistemas de ecuaciones diferenciales lineales

Si  $x_1(t)$ ,  $x_2(t)$ ,  $x_3(t)$  son tres funciones reales de la variable real  $t$ , la función vectorial  $\mathbf{x}(t)$  viene dada por

$$\mathbf{x}(t) := \begin{pmatrix} x_1(t) \\ x_2(t) \\ x_3(t) \end{pmatrix}.$$

Por definición,  $\mathbf{x}(t)$  es derivable en  $t$  si

$$x_1(t), x_2(t), x_3(t)$$

son derivables en  $t$ .

$$\mathbf{x}'(t) := \begin{pmatrix} x_1'(t) \\ x_2'(t) \\ x_3'(t) \end{pmatrix},$$

donde  $\mathbf{x}'(t)$  es la derivada de  $\mathbf{x}$  en  $t$ .

## Ejemplo

Si  $x_1(t) = t^2, x_2(t) = \cos t, x_3(t) = \exp(t^2)$  entonces

$$\mathbf{x}(t) = \begin{pmatrix} t^2 \\ \cos t \\ \exp(t^2) \end{pmatrix}$$

es derivable y

$$\mathbf{x}'(t) = \begin{pmatrix} 2t \\ -\operatorname{sen} t \\ 2t \exp(t^2) \end{pmatrix}.$$

## Sistema de ecuaciones lineales, en general

$$\begin{cases} x_1'(t) = a_{11}x_1(t) + a_{12}x_2(t) + a_{13}x_3(t), \\ x_2'(t) = a_{21}x_1(t) + a_{22}x_2(t) + a_{23}x_3(t), \\ x_3'(t) = a_{31}x_1(t) + a_{32}x_2(t) + a_{33}x_3(t). \end{cases} \quad (1)$$

Aquí,  $a_{ij}$  ( $i, j = 1, 2, 3$ ) son números reales dados y  $x_1(t), x_2(t), x_3(t)$  son las funciones incógnitas. Denotando  $\mathbf{A} := (a_{ij})$ , podemos escribir el sistema (1) así

$$\begin{pmatrix} x_1'(t) \\ x_2'(t) \\ x_3'(t) \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} a_{11} & a_{12} & a_{13} \\ a_{21} & a_{22} & a_{23} \\ a_{31} & a_{32} & a_{33} \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x_1(t) \\ x_2(t) \\ x_3(t) \end{pmatrix}.$$

## Sistema de ecuaciones lineales, en general

El sistema se escribe de forma resumida así:

$$\mathbf{x}'(t) = \mathbf{Ax}(t). \quad (2)$$

Este es un sistema de ecuaciones diferenciales lineales de primer orden homogéneo de coeficientes constantes. Si no hay dudas, en (2) podemos omitir la  $t$ :

$$\mathbf{x}' = \mathbf{Ax}. \quad (3)$$

## Búsqueda de una solución especial, 1

Debe quedar claro que  $\mathbf{x}$  depende de  $t$ , pero  $\mathbf{A}$  no depende:  $\mathbf{A}$  es constante. Resolveremos el sistema (2) **bajo ciertas restricciones, muy generales**. En primer lugar, (Euler) tratamos de ver si existen soluciones de la forma

$$\mathbf{x}(t) = e^{\lambda_0 t} \mathbf{c}$$

donde  $\lambda_0$  es un *número* y  $\mathbf{c}$  un *vector columna* distinto de

$$\mathbf{0} = \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix}.$$

Suponemos que el vector

$$\mathbf{c} = \begin{pmatrix} c_1 \\ c_2 \\ c_3 \end{pmatrix} \text{ es constante.}$$

## Búsqueda de una solución especial, 2

Por la definición de derivada de una función vectorial se observa que

$$\mathbf{x}'(t) = \lambda_0 e^{\lambda_0 t} \mathbf{c} \quad (4)$$

Por otro lado,

$$\mathbf{Ax}(t) = \mathbf{A}e^{\lambda_0 t} \mathbf{c} = e^{\lambda_0 t} \mathbf{Ac} \quad (5)$$

Como  $\mathbf{x}'(t) = \mathbf{Ax}(t)$ , de (4) y (5) se sigue que

$$e^{\lambda_0 t} \lambda_0 \mathbf{c} = e^{\lambda_0 t} \mathbf{Ac} \quad (6)$$

Dividiendo ambos miembros de (6) por  $e^{\lambda_0 t}$ ,

$$\lambda_0 \mathbf{c} = \mathbf{Ac}$$

o bien

$$\boxed{\mathbf{Ac} = \lambda_0 \mathbf{c}} \quad (7)$$

Así pues, (7) es una condición necesaria para que la función  $e^{\lambda_0 t} \mathbf{c}$  sea una solución de (1). Es fácil ver que (7) es también una condición suficiente.

## Búsqueda de una solución especial, 3

Resumiendo:

### Proposición 1

La función vectorial  $e^{\lambda_0 t} \mathbf{c}$  es una solución del sistema diferencial lineal  $\mathbf{x}' = \mathbf{A}\mathbf{x}$  si y sólo si el número  $\lambda_0$  y el vector columna  $\mathbf{c}$  satisfacen la ecuación algebraica

$$\mathbf{A}\mathbf{c} = \lambda_0 \mathbf{c}.$$

**Nota.-** La función nula  $\mathbf{x}(t) \equiv \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix}$  es solución de (1), pero esta solución no

interesa. Por ello, al buscar una solución de la forma  $e^{\lambda_0 t} \mathbf{c}$  tratamos de encontrar un vector  $\mathbf{c} \neq \mathbf{0}$ . Para encontrar esta solución debemos buscar un número  $\lambda_0$  y un vector columna  $\mathbf{c} \neq \mathbf{0}$  tales que  $\mathbf{A}\mathbf{c} = \lambda_0 \mathbf{c}$ . Esta ecuación es equivalente a  $\mathbf{A}\mathbf{c} = \lambda_0 \mathbf{I}\mathbf{c}$ , siendo  $\mathbf{I}$  la matriz unidad de orden 3:

$$\mathbf{I} = \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \end{pmatrix}.$$

## Búsqueda de una solución especial, 5

La ecuación

$$\mathbf{A}\mathbf{c} = \lambda_0 \mathbf{I}\mathbf{c}$$

es equivalente a

$$(\lambda_0 \mathbf{I} - \mathbf{A})\mathbf{c} = \mathbf{0}$$

Si  $\mathbf{c}$  ha de ser distinto de cero, entonces necesariamente el determinante

$$|\lambda_0 \mathbf{I} - \mathbf{A}|$$

tiene que ser igual a 0. Una posible manera de hallar el  $\lambda_0$  que buscamos es construir el polinomio en  $\lambda$

$$|\lambda \mathbf{I} - \mathbf{A}| \tag{8}$$

## Búsqueda de una solución especial, 6

y resolver la ecuación en la incógnita  $\lambda$

$$|\lambda \mathbf{I} - \mathbf{A}| = 0. \quad (9)$$

A continuación si  $\lambda_0$  es una raíz de esta ecuación, se resuelve el sistema homogéneo indeterminado

$$(\lambda_0 \mathbf{I} - \mathbf{A}) \begin{pmatrix} c_1 \\ c_2 \\ c_3 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix} \quad (10)$$

en las incógnitas  $c_1, c_2, c_3$ . Una solución  $\mathbf{c} = \begin{pmatrix} c_1 \\ c_2 \\ c_3 \end{pmatrix}$  de (10) con no todas las componentes  $c_1, c_2, c_3$  nulas, proporciona uno de los vectores buscados.

## Valores y vectores propios

**Definiciones.-** Dada una matriz cuadrada  $\mathbf{A}$  de orden 3 se dice que el número  $\lambda_0$  es un *valor propio* de  $\mathbf{A}$  si existe un vector columna tridimensional  $\mathbf{c}$  no nulo t.q.

$$\mathbf{A}\mathbf{c} = \lambda_0 \mathbf{c}.$$

El vector  $\mathbf{c}$  se llama *vector propio* de  $\mathbf{A}$  asociado al valor propio  $\lambda_0$ .

### Otras terminologías equivalentes

$\lambda_0$	$\mathbf{c}$
valor propio	vector propio
autovalor	autovector
valor característico	vector característico
<i>eigenvalue</i>	<i>eigenvector</i>

## Ejemplo de cálculo de un valor y un vector propio, 1

Sea la matriz

$$\mathbf{A} = \begin{pmatrix} 1 & -1 & 4 \\ 3 & 2 & -1 \\ 2 & 1 & -1 \end{pmatrix} \quad (11)$$

Vamos a hallar un valor propio y un vector propio asociado. Es preciso resolver la ecuación en  $\lambda$

$$|\lambda \mathbf{I} - \mathbf{A}| = \begin{vmatrix} \lambda - 1 & 1 & -4 \\ -3 & \lambda - 2 & 1 \\ -2 & -1 & \lambda + 1 \end{vmatrix} = \lambda^3 - 2\lambda^2 - 5\lambda + 6 = 0 \quad (12)$$

## Ejemplo de cálculo de un valor y un vector propio, 2

Por la regla de Ruffini  encontramos que  $\lambda_0 = 1$  es una raíz de (12):

$$1^3 - 2 \cdot 1^2 - 5 \cdot 1 + 6 = 1 - 2 - 5 + 6 = 0$$

Para encontrar un vector propio  $\mathbf{c} = \begin{pmatrix} c_1 \\ c_2 \\ c_3 \end{pmatrix}$  asociado a este  $\lambda_0 = 1$ ,

resolvemos el sistema homogéneo de ecuaciones lineales

$$(\lambda_0 \mathbf{I} - \mathbf{A}) \mathbf{c} = \begin{pmatrix} 0 & 1 & -4 \\ -3 & -1 & 1 \\ -2 & -1 & 2 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} c_1 \\ c_2 \\ c_3 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 0 \\ 0 \\ 0 \end{pmatrix}$$

## Ejemplo de cálculo de un valor y un vector propio, 3

Escribimos este sistema en la forma

$$\begin{cases} c_2 - 4c_3 = 0 \\ -3c_1 - c_2 + c_3 = 0 \\ -2c_1 - c_2 + 2c_3 = 0 \end{cases}$$

Como  $\begin{vmatrix} 0 & 1 \\ -3 & -1 \end{vmatrix} \neq 0$ , tachamos la última ecuación:

$$\begin{cases} c_2 - 4c_3 = 0 \\ -3c_1 - c_2 + c_3 = 0. \end{cases}$$

## Ejemplo de cálculo de un valor y un vector propio, 4

Este sistema es equivalente al anterior. Pasamos  $c_3$  al segundo miembro

$$\begin{cases} c_2 = 4c_3 \\ -3c_1 - c_2 = -c_3 \end{cases}$$

Damos a  $c_3$  un valor arbitrario; por ejemplo,  $c_3 = 1$  :

$$\begin{cases} c_2 = 4 \\ -3c_1 - c_2 = -1 \end{cases} \implies c_2 = 4 ;$$

$$-3c_1 = c_2 - 1 = 4 - 1 = 3 \implies c_1 = -1$$

Así pues, un vector propio asociado a  $\lambda_0 = 1$  es

$$\mathbf{c} = \begin{pmatrix} -1 \\ 4 \\ 1 \end{pmatrix}$$

## Ejemplo de aplicación a los sistemas

Por lo tanto,

$$\mathbf{x}(t) = e^t \begin{pmatrix} -1 \\ 4 \\ 1 \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} -e^t \\ 4e^t \\ e^t \end{pmatrix}$$

es una solución del sistema diferencial lineal homogéneo

$$\begin{pmatrix} x_1'(t) \\ x_2'(t) \\ x_3'(t) \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1 & -1 & 4 \\ 3 & 2 & -1 \\ 2 & 1 & -1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x_1(t) \\ x_2(t) \\ x_3(t) \end{pmatrix}.$$

Hemos terminado el ejemplo.

## Problema de condiciones iniciales

Sea ahora un  $\mathbf{x}^0$  un vector columna dado de 3 componentes:

$$\mathbf{x}^0 = \begin{pmatrix} x_1^0 \\ x_2^0 \\ x_3^0 \end{pmatrix}.$$

Consideremos el problema de hallar la solución  $\mathbf{x}(t)$  del sistema diferencial lineal  $\mathbf{x}'(t) = \mathbf{A}\mathbf{x}(t)$  que satisface la *condición inicial*  $\mathbf{x}(0) = \mathbf{x}^0$ :

$$(P_0) \begin{cases} \mathbf{x}'(t) = \mathbf{A}\mathbf{x}(t) \\ \mathbf{x}(0) = \mathbf{x}^0 \end{cases}$$

La solución de problema  $(P_0)$  *no* es necesariamente de la forma  $e^{\lambda_0 t} \mathbf{c}$ .

## Hipótesis Suplementaria

Supondremos desde ahora que la matriz de tercer orden  $\mathbf{A}$ , tiene tres valores propios distintos. Dicho de otro modo, supondremos que la ecuación en  $\lambda$

$$|\lambda \mathbf{I} - \mathbf{A}| = 0$$

tiene sus tres raíces simples. Con esta hipótesis daremos un método de resolución. El problema  $(P_0)$  tiene una solución única. No daremos la demostración de esta afirmación última aquí. Sean  $\lambda_1, \lambda_2, \lambda_3$  los valores propios de la matriz  $\mathbf{A}$ . Estamos suponiendo que son tres números distintos. Sean  $\mathbf{c}_1, \mathbf{c}_2, \mathbf{c}_3$  vectores propios de  $\mathbf{A}$  asociados a  $\lambda_1, \lambda_2, \lambda_3$ , respectivamente.

### Teorema 2

*Si los tres valores propios de  $\mathbf{A}$  son distintos, entonces los vectores propios  $\mathbf{c}_1, \mathbf{c}_2, \mathbf{c}_3$  son linealmente independientes.*

**Sin demostración.**

## Solución del problema ( $P_0$ )

Expresemos  $\mathbf{x}^0$  como combinación lineal de los vectores propios  $\mathbf{c}_1, \mathbf{c}_2, \mathbf{c}_3$ :

$$\mathbf{x}^0 = \alpha_1 \mathbf{c}_1 + \alpha_2 \mathbf{c}_2 + \alpha_3 \mathbf{c}_3.$$

Tal combinación existe y es única pues  $\{\mathbf{c}_1, \mathbf{c}_2, \mathbf{c}_3\}$  es una base del espacio formado por todos los vectores columna  $3 \times 1$ . La solución de ( $P_0$ ) viene dada por la fórmula

$$\mathbf{x}(t) = \alpha_1 e^{\lambda_1 t} \mathbf{c}_1 + \alpha_2 e^{\lambda_2 t} \mathbf{c}_2 + \alpha_3 e^{\lambda_3 t} \mathbf{c}_3.$$

## Solución del problema ( $P_0$ )

**Demostración:** Derivemos,

$$\mathbf{x}'(t) = \alpha_1 e^{\lambda_1 t} \lambda_1 \mathbf{c}_1 + \alpha_2 e^{\lambda_2 t} \lambda_2 \mathbf{c}_2 + \alpha_3 e^{\lambda_3 t} \lambda_3 \mathbf{c}_3;$$

pero  $\lambda_i \mathbf{c}_i = \mathbf{A} \mathbf{c}_i$ , para  $i = 1, 2, 3$ . Por consiguiente,

$$\begin{aligned} \mathbf{x}'(t) &= \alpha_1 e^{\lambda_1 t} \mathbf{A} \mathbf{c}_1 + \alpha_2 e^{\lambda_2 t} \mathbf{A} \mathbf{c}_2 + \alpha_3 e^{\lambda_3 t} \mathbf{A} \mathbf{c}_3 \\ &= \mathbf{A} \left( \alpha_1 e^{\lambda_1 t} \mathbf{c}_1 + \alpha_2 e^{\lambda_2 t} \mathbf{c}_2 + \alpha_3 e^{\lambda_3 t} \mathbf{c}_3 \right) = \mathbf{A} \mathbf{x}(t). \end{aligned}$$

Además,

$$\mathbf{x}(0) = \alpha_1 e^{\lambda_1 \cdot 0} \mathbf{c}_1 + \alpha_2 e^{\lambda_2 \cdot 0} \mathbf{c}_2 + \alpha_3 e^{\lambda_3 \cdot 0} \mathbf{c}_3 =$$

$$\alpha_1 \mathbf{c}_1 + \alpha_2 \mathbf{c}_2 + \alpha_3 \mathbf{c}_3 = \mathbf{x}^0.$$

□

## Ejemplo de problema de condiciones iniciales

Resolver el problema de condición inicial

$$\begin{cases} \mathbf{x}'(t) = \mathbf{A}\mathbf{x}(t) \\ \mathbf{x}(0) = \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \\ -1 \end{pmatrix} \end{cases}$$

con

$$\mathbf{A} := \begin{pmatrix} 1 & -1 & 4 \\ 3 & 2 & -1 \\ 2 & 1 & -1 \end{pmatrix}.$$

## Solución, 1

La matriz  $\mathbf{A}$  es la matriz de un ejemplo anterior. Allí calculamos uno de valores propios de  $\mathbf{A}$  :  $\lambda_1 = 1$ . Hallemos los dos que faltan  $\lambda_2, \lambda_3$ .

Utilizando la regla de Ruffini:

$$|\lambda \mathbf{I} - \mathbf{A}| = \begin{vmatrix} \lambda - 1 & 1 & -4 \\ -3 & \lambda - 2 & 1 \\ -2 & -1 & \lambda + 1 \end{vmatrix} = \lambda^3 - 2\lambda^2 - 5\lambda + 6 = 0$$

$$\begin{array}{c|cccc} & 1 & -2 & -5 & 6 \\ 3 & & 3 & 3 & -6 \\ \hline & 1 & 1 & -2 & 0 \end{array} \implies \lambda_2 = 3 \text{ es una raíz.}$$

## Solución, 2

$$\begin{array}{c|cccc} & 1 & -2 & -5 & 6 \\ -2 & & -2 & 8 & -6 \\ \hline & 1 & -4 & 3 & 0 \end{array} \implies \lambda_3 = -2 \text{ es una raíz.}$$

## Solución, 3

$$\begin{array}{c|cccc} & 1 & -2 & -5 & 6 \\ 1 & & 1 & -1 & -6 \\ \hline & 1 & -1 & -6 & 0 \end{array} \implies \lambda_1 = 1 \text{ es una raíz. } \leftarrow$$

## Solución, 4

Como las *tres* raíces del polinomio característico de  $\mathbf{A}$ ,  $|\lambda \mathbf{I} - \mathbf{A}|$ , son *simples* (y  $\mathbf{A}$  es de orden 3) estamos bajo las condiciones de la *Hipótesis Suplementaria*. Por lo tanto, podemos aplicar el método de resolución dado a este sistema diferencial lineal.

Calculamos un vector propio  $\mathbf{c}_1, \mathbf{c}_2, \mathbf{c}_3$  asociado a cada uno de los valores propios  $\lambda_1, \lambda_2, \lambda_3$ , respectivamente:

$$\mathbf{c}_1 = \begin{pmatrix} -1 \\ 4 \\ 1 \end{pmatrix}, \quad \mathbf{c}_2 = \begin{pmatrix} 1 \\ 2 \\ 1 \end{pmatrix}, \quad \mathbf{c}_3 = \begin{pmatrix} -1 \\ 1 \\ 1 \end{pmatrix}.$$

## Solución, 5

Ahora busquemos la expresión del vector inicial  $\mathbf{x}^0$  como combinación lineal de  $\mathbf{c}_1, \mathbf{c}_2, \mathbf{c}_3$ :

$$\mathbf{x}^0 = \alpha_1 \mathbf{c}_1 + \alpha_2 \mathbf{c}_2 + \alpha_3 \mathbf{c}_3,$$

$$\begin{pmatrix} 1 \\ 0 \\ -1 \end{pmatrix} = \alpha_1 \begin{pmatrix} -1 \\ 4 \\ 1 \end{pmatrix} + \alpha_2 \begin{pmatrix} 1 \\ 2 \\ 1 \end{pmatrix} + \alpha_3 \begin{pmatrix} -1 \\ 1 \\ 1 \end{pmatrix};$$

esto nos conduce a resolver el sistema de ecuaciones lineales

$$\begin{cases} -\alpha_1 + \alpha_2 - \alpha_3 = 1, \\ 4\alpha_1 + 2\alpha_2 + \alpha_3 = 0, \\ \alpha_1 + \alpha_2 + \alpha_3 = -1, \end{cases}$$

cuya solución es  $(\alpha_1, \alpha_2, \alpha_3) = (1/3, 0, -4/3)$ .

## Solución, 6

En consecuencia, la solución del problema de condiciones iniciales es

$$\begin{aligned}\mathbf{x}(t) &= \begin{pmatrix} x_1(t) \\ x_2(t) \\ x_3(t) \end{pmatrix} = \frac{1}{3}e^t \begin{pmatrix} -1 \\ 4 \\ 1 \end{pmatrix} - \frac{4}{3}e^{-2t} \begin{pmatrix} -1 \\ 1 \\ 1 \end{pmatrix} \\ &= \begin{pmatrix} -\frac{e^t}{3} + \frac{4e^{-2t}}{3} \\ \frac{4e^t}{3} - \frac{4e^{-2t}}{3} \\ \frac{e^t}{3} - \frac{4e^{-2t}}{3} \end{pmatrix} = \frac{1}{3} \begin{pmatrix} -e^t + 4e^{-2t} \\ 4(e^t - e^{-2t}) \\ e^t - 4e^{-2t} \end{pmatrix}.\end{aligned}$$

## Ejercicios

**Ejercicio 1.-** Resolver el problema de condiciones iniciales

$$\begin{cases} \mathbf{x}'(t) = \begin{pmatrix} 1 & 12 \\ 3 & 1 \end{pmatrix} \mathbf{x}(t) \\ \mathbf{x}(0) = \begin{pmatrix} 0 \\ 1 \end{pmatrix}. \end{cases}$$

**Solución.-**

$$\mathbf{x}(t) = \begin{pmatrix} x_1(t) \\ x_2(t) \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} e^{7t} - e^{-5t} \\ (e^{7t} + e^{-5t})/2 \end{pmatrix}.$$

## Ejercicios

**Ejercicio 2.-** Hallar la solución del problema de condiciones iniciales

$$\begin{cases} \begin{pmatrix} x_1'(t) \\ x_2'(t) \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1 & -3 \\ -2 & 2 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} x_1(t) \\ x_2(t) \end{pmatrix} \\ \begin{pmatrix} x_1(0) \\ x_2(0) \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 0 \\ 5 \end{pmatrix}. \end{cases}$$

**Solución.-**

$$\begin{pmatrix} x_1(t) \\ x_2(t) \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} -3e^{4t} + 3e^{-t} \\ 3e^{4t} + 2e^{-t} \end{pmatrix}.$$

## Ejercicios

**Ejercicio 3.-** Hallar la solución del problema de condiciones iniciales

$$\left\{ \begin{array}{l} \left\{ \begin{array}{l} x_1'(t) = x_1(t) - 3x_2(t) + 2x_3(t) \\ x_2'(t) = \quad \quad - x_2(t) \\ x_3'(t) = \quad \quad - x_2(t) - 2x_3(t) \end{array} \right. \\ \left\{ \begin{array}{l} x_1(0) = -2 \\ x_2(0) = 0 \\ x_3(0) = 3. \end{array} \right. \end{array} \right.$$