

А. М. Самойленко, К. Кенжебаев, В. Н. Лаптинский

О некоторых итерационных методах отыскания периодических решений неавтономных систем дифференциальных уравнений

В этой работе развиваются некоторые вопросы предложенных в [1, 2] и развитых в [3] численно-аналитических методов исследования периодических решений дифференциальных уравнений.

Рассмотрим уравнение

$$dx/dt = f(t, x), \quad x \in R^n, \quad (1)$$

предполагая, что ω -периодическая по t вектор-функция $f(t, x)$ непрерывна по t, x и имеет достаточное количество производных по x , непрерывных по t, x в некоторой области

$$D = \{t, x: -\infty < t < +\infty, \|x\| < \rho\}.$$

Лемма. Пусть $\varphi(t, x)$ — произвольная вектор-функция, непрерывная по $t, x \in D_1 \subset D$ вместе со своей производной $\partial\varphi(t, x)/\partial x$, и пусть

$$\det \left[E - \int_{t_0}^t (\partial\varphi(\tau, x)/\partial x) d\tau \right] \neq 0 \quad \forall t, x \in D_1 \quad (2)$$

(E — единичная матрица, $D_1 = \{t, x: |t - t_0| \leq a, \|x - x_0\| \leq \rho_1 < \rho\}$, $\|x_0\| < \rho, a > 0$).

Тогда задача Коши для (1) с условием $x(t_0) = x_0$ эквивалентна уравнению

$$x(t) = x_0 + \int_{t_0}^t \varphi(\tau, x(\tau)) d\tau + \int_{t_0}^t \left\{ f(\tau, x(\tau)) - \varphi(\tau, x(\tau)) - \int_{t_0}^{\tau} [\partial\varphi(\sigma, x(\sigma))/\partial x] f(\sigma, x(\sigma)) d\sigma \right\} d\tau. \quad (3)$$

Доказательство. Если $x(t; t_0, x_0)$ — решение уравнения (1), то $x(t) = x_0 + \int_{t_0}^t f(\tau, x(\tau)) d\tau$. Согласно [2],

$$\int_{t_0}^t \varphi(\tau, x(\tau)) d\tau = \int_{t_0}^t \varphi(\tau, x(t)) d\tau - \int_{t_0}^t d\tau \int_{t_0}^{\tau} (\partial\varphi(\sigma, x(\sigma))/\partial x) (dx(\tau)/d\tau) d\sigma. \quad (4)$$

Теперь нетрудно получить (3), если учесть, что $dx(\tau)/d\tau = f(\tau, x(\tau))$.

Пусть $x(t)$ — непрерывно дифференцируемое решение уравнения (3). Очевидно, что $x(t_0) = x_0$.

Дифференцируя по t обе части (3), получим

$$dx(t)/dt = \int_{t_0}^t (\partial\varphi(\tau, x(t))/\partial x) d\tau (dx(t)/dt) + f(t, x(t)) - \int_{t_0}^t (\partial\varphi(\tau, x(t))/\partial x) \times \\ \times d\tau f(t, x(t)).$$

Отсюда, используя условие (2), имеем $dx(t)/dt = f(t, x(t))$, т. е. решение уравнения (3) есть решение соответствующей задачи Коши для (1).

Замечание 1. Пусть $\|\partial\varphi(t, x)/\partial x\| \leq K = \text{const} \quad \forall t, x \in D_1$. Тогда $\left\| \int_{t_0}^t (\partial\varphi(\tau, x)/\partial x) d\tau \right\| \leq K|t - t_0|$. В этом случае обратимость матрицы $E - \int_{t_0}^t (\partial\varphi(\tau, x)/\partial x) d\tau$ будет обеспечена условием $Ka < 1$.

Следствие 1. Пусть $\varphi(t, x)$ — решение уравнения

$$\varphi(t, x) = - \int_{t_0}^t (\partial\varphi(\tau, x)/\partial x) d\tau f(t, x) + f(t, x). \quad (5)$$

Тогда решение $x(t; t_0, x_0)$ уравнения (1) представимо в виде

$$x(t) = x_0 + \int_{t_0}^t \varphi(\tau, x(t)) d\tau.$$

Легко видеть, что выражение $x - \int_{t_0}^t \varphi(\tau, x) d\tau = x_0$ — интеграл уравнения (1). Ясно также, что заменой

$$x - \int_{t_0}^t \varphi(\tau, x) d\tau = y \quad (6)$$

уравнение (5) сводится к следующей задаче Коши:

$$\partial y / \partial t + \partial y / \partial x f(t, x) = 0, \quad (7)$$

$$y(t_0, x) = x. \quad (8)$$

Уравнение (7) можно записать в виде $\partial y / \partial t + \sum_{k=1}^n \partial y / \partial x_k f_k(t, x) = 0$, где

f_k — компоненты вектора f .

Задачу Коши для уравнений в частных производных (линейных и нелинейных) с непрерывными по t и аналитическими по x коэффициентами с помощью абстрактных методов исследовали многие авторы (см. [4]). Конструктивным методом в [5] получены коэффициентные оценки решения и области его существования (в линейном случае).

Если $f(t, x)$ аналитична по x в области D , то решение уравнения (5) можно строить классическим методом итераций

$$\varphi_k(t, x) = - \int_{t_0}^t (\partial\varphi_{k-1}(\tau, x)/\partial x) d\tau f(t, x) + f(t, x), \quad (9)$$

где $k = 1, 2, \dots$, $\varphi_0 \equiv 0$.

Этот алгоритм соответствует следующему алгоритму построения решения задачи (7), (8): $y_k(t, x) = x - \int_{t_0}^t (\partial y_{k-1}(\tau, x)/\partial x) f(\tau, x) d\tau$, где $y_0 = x$, причем $y_i(t, x) = x - \int_{t_0}^t \varphi_i(\tau, x) d\tau$, $i = 0, 1, 2, \dots$. Обоснование этого итерационного метода для линейных уравнений общего вида дано в [4].

Воспользовавшись приближениями $\varphi_m(t, x)$, $\varphi_{m+1}(t, x)$, из (3) получим

$$x(t) = x_0 + \int_{t_0}^t \varphi_m(\tau, x(t)) d\tau + \int_{t_0}^t \delta\varphi_m(\tau, x(\tau)) d\tau, \quad (10)$$

где $\delta\varphi_m(\tau, x) = \varphi_{m+1}(\tau, x) - \varphi_m(\tau, x)$, $m = 0, 1, 2, \dots$.

З а м е ч а н и е 2. Получим функцию $\varphi(t, x)$ из уравнения $\varphi(t, x) = - \int_{t_0}^t (\partial\varphi(\tau, x)/\partial x) d\tau f_0(t, x) + f_0(t, x)$, где $f_0(t, x) = f(t, x) - f(t, 0)$, тогда

$$x(t) = x_0 + \int_{t_0}^t \varphi(\tau, x(\tau)) d\tau + \int_{t_0}^t \left[E - \int_{t_0}^{\tau} (\partial\varphi(\sigma, x(\sigma))/\partial x) d\sigma \right] f(\tau, 0) d\tau.$$

С л е д с т в и е 2. Пусть вектор-функция $\psi(t, x)$ — решение задачи (7), (8), причем $\det(\partial\psi(t, x)/\partial x) \neq 0 \forall t, x \in D_1$.

Тогда задача Коши для дифференциального уравнения $dx/dt = f(t, x) + g(t, x)$ эквивалентна интегральному уравнению

$$\psi(t, x(t)) = x_0 + \int_{t_0}^t (\partial\psi(\tau, x(\tau))/\partial x) g(\tau, x(\tau)) d\tau.$$

Полученные результаты могут быть применены к исследованию задачи об ω -периодических решениях уравнения (1).

С этой целью рассмотрим следующие уравнения:

$$\varphi(t, x) = - \int_0^t (\partial\varphi(\tau, x)/\partial x) d\tau f(t, x) + f(t, x),$$

$$\psi(t, x) = - \int_{\omega}^t (\partial\psi(\tau, x)/\partial x) d\tau f(t, x) + f(t, x).$$

Пусть $\varphi_m(t, x)$, $\psi_k(t, x)$ — приближенные решения этих уравнений, построенные по итерационной схеме (9). Используя (10), запишем

$$x(t) = x(0) + \int_0^t \varphi_m(\tau, x(\tau)) d\tau + \int_0^t \delta\varphi_m(\tau, x(\tau)) d\tau,$$

$$x(t) = x(\omega) + \int_{\omega}^t \psi_k(\tau, x(\tau)) d\tau + \int_{\omega}^t \delta\psi_k(\tau, x(\tau)) d\tau.$$

Введем в рассмотрение функциональную матрицу

$$H_{mk}(t, x) = \int_0^t (\partial\varphi_m(\tau, x(\tau))/\partial x) d\tau + \int_t^{\omega} (\partial\psi_k(\tau, x(\tau))/\partial x) d\tau.$$

Т е о р е м а. Пусть для некоторых натуральных чисел m, k выполнено условие

$$\det H_{mk}(t, x) \neq 0, \quad t \in [0, \omega], \quad \|x\| \leq r < \rho.$$

Тогда задача об ω -периодических решениях уравнения (1) эквивалентна интегральному уравнению

$$\int_0^t \varphi_m(\tau, x(\tau)) d\tau + \int_t^{\omega} \psi_k(\tau, x(\tau)) d\tau = - \int_0^t \delta\varphi_m(\tau, x(\tau)) d\tau - \int_t^{\omega} \delta\psi_k(\tau, x(\tau)) d\tau. \quad (11)$$

Д о к а з а т е л ь с т в о. Так как возможность сведения ω -периодической краевой задачи для (1) к уравнению (11) фактически показана, осталось показать только обратный переход.

Пусть $x(t)$, $\|x(t)\| \leq r$, — непрерывно дифференцируемое решение уравнения (11). Рассматривая (11) как тождество и дифференцируя по t обе его части, получим в результате несложных выкладок $H_{mk}(t, x(t)) \times \times dx(t)/dt = H_{mk}(t, x(t)) f(t, x(t))$. Так как $\det H_{mk}(t, x) \neq 0$, то $dx(t)/dt = f(t, x(t))$.

Покажем, что $x(\omega) = x(0)$. Для этого в правой части (11) заменим $f(\tau, x(\tau))$ на $dx(\tau)/d\tau$, а затем с помощью тождества (4), примененного пооче-

редно к функциям $\varphi_m(t, x)$, $\psi_k(t, x)$, придем к равенству $\int_0^{\omega} f(\tau, x(\tau)) d\tau = 0$;

следовательно, $x(\omega) = x(0)$.

З а м е ч а н и е 3. При $k = m = 1$ уравнение (11) принимает вид (см. [3])

$$\int_0^{\omega} f(\tau, x(\tau)) d\tau = \int_0^t d\tau \int_0^{\tau} \frac{\partial f(\sigma, x(\tau))}{\partial x} f(\tau, x(\tau)) d\sigma - \\ - \int_t^{\omega} d\tau \int_{\tau}^{\omega} \frac{\partial f(\sigma, x(\tau))}{\partial x} f(\tau, x(\tau)) d\sigma.$$

Приведем способ задания функций $\varphi(t, x)$, заключающийся (см. [3]) в применении операции усреднения по явно входящему времени. Он состоит в рассмотрении уравнения

$$\varphi(t, x) = - \int_0^t \frac{\partial \varphi(\tau, x)}{\partial x} d\tau f(t, x) + f(t, x) + \overline{\int_0^t \frac{\partial \varphi(\tau, x)}{\partial x} d\tau f(t, x) - \overline{f(t, x)}}, \quad (12)$$

которое с помощью замены (6) преобразуется к виду

$$\partial y(t, x) / \partial t = - (\partial y(t, x) / \partial x) f(t, x) + \overline{(\partial y(t, x) / \partial x) f(t, x)}, \quad (13)$$

причем $y(0, x) = x$. Здесь и всюду ниже черта сверху означает усреднение по явно входящему аргументу t .

Вместо уравнения (12) можно взять (см. замечание 2) следующее:

$$\varphi(t, x) = - \int_0^t \frac{\partial \varphi(\tau, x)}{\partial x} d\tau f_0(t, x) + f_0(t, x) + \overline{\int_0^t \frac{\partial \varphi(\tau, x)}{\partial x} d\tau f_0(t, x) - \overline{f_0(t, x)}}. \quad (14)$$

Способ учета интегральных средних по периоду является типичным для теории колебаний (см. [2, 6—8]) и вызван необходимостью исключения вековых членов при построении периодических решений.

Уравнение (12) можно формально решать следующим методом итераций.

$$\varphi_k(t, x) = - \int_0^t \frac{\partial \varphi_{k-1}(\tau, x)}{\partial x} d\tau f(t, x) + f(t, x) + \overline{\int_0^t \frac{\partial \varphi_{k-1}(\tau, x)}{\partial x} d\tau f(t, x) - \overline{f(t, x)}}, \quad (15)$$

где $k = 1, 2, \dots$, $\varphi_0 \equiv 0$.

Очевидно, все $\varphi_k(t, x)$ — ω -периодические по t . Выбор функций $\varphi_k(t, x)$ таким способом позволяет расширить класс интегральных уравнений, эквивалентных задаче об ω -периодических решениях уравнения (1).

Если функция $\varphi(t, x)$ — решение уравнения (12), то определяющее уравнение ω -периодических решений уравнения (1) формально приводится к виду

$$\int_0^{\omega} d\tau \int_0^{\omega} \left[E - \int_0^s (\partial \varphi(\sigma, x(\tau)) / \partial x) d\sigma \right] f(s, x(\tau)) ds = 0,$$

или с учетом (6)

$$\int_0^{\omega} d\tau \int_0^{\omega} (\partial y(s, x(\tau)) / \partial x) f(s, x(\tau)) ds = 0. \quad (16)$$

Если в уравнении (1) $f(t, x) \equiv A(t)x + p(t)$, то функцию $y(t, x)$ ищем в виде $y(t, x) = \Phi(t)x + g(t)$. Тогда из (13) получим

$$d\Phi(t)/dt = -\Phi(t)A(t) + \overline{\Phi(t)A(t)}, \quad dg(t)/dt = -\Phi(t)p(t) + \overline{\Phi(t)p(t)}, \quad (17)$$

где $\Phi(0) = E$, $g(0) = 0$. Уравнение (16) в этом случае примет вид

$$W \int_0^{\omega} x(\tau) d\tau + \int_0^{\omega} \Phi(\tau) p(\tau) d\tau = 0,$$

где $W = \overline{\Phi(t)A(t)}$.

Если в качестве $\varphi(t, x)$ взять решение уравнения (14), преобразованного с помощью (6) к виду

$$\partial y(t, x)/\partial t = -(\partial y(t, x)/\partial x) f_0(t, x) + \overline{(\partial y(t, x)/\partial x) f_0(t, x)}, \quad (18)$$

где $y(0, x) = x$, то определяющее уравнение приводится к виду

$$\int_0^{\omega} \overline{(\partial y(s, x(\tau))/\partial x) f_0(s, x(\tau))} d\tau + \int_0^{\omega} (\partial y(\tau, x(\tau))/\partial x) f(\tau, 0) d\tau = 0.$$

В линейном случае решение уравнения (18) ищем в виде $y(t, x) = \Phi(t)x$, причем $\Phi(t)$ находим из уравнения (17).

Определяющее уравнение снова приводится к виду

$$W \int_0^{\omega} x(\tau) d\tau + \int_0^{\omega} \Phi(\tau) p(\tau) d\tau = 0.$$

Так как матрица $\Phi(t)$ в общем случае не допускает представления в конечном виде, то целесообразно использовать ее приближения, построенные по схеме (см. [3])

$$\Phi_k(t) = E - \int_0^t [\Phi_{k-1}(\tau)A(\tau) - \overline{\Phi_{k-1}(\tau)A(\tau)}] d\tau,$$

где $k = 1, 2, \dots$, $\Phi_0 \equiv 0$. Выбор функций $\Phi_k(t)$, таким образом, вытекает из результатов работы [2].

Покажем, что методика, изложенная в [2], позволяет получить усредненные уравнения асимптотического метода Крылова — Боголюбова — Митропольского [6, 7]. Для этого рассмотрим уравнение $dx/dt = \varepsilon f(t, x)$ с параметром ε и выведем уравнения первого и второго приближений.

Для нахождения уравнения первого приближения введем в (3) функцию $\varphi_1(t, x)$, найденную из (15) при $k = 1$. Получим

$$x(t) = x(0) + \varepsilon \psi_1(t, x(t)) - \varepsilon^2 \int_0^t \frac{\partial \psi_1(\tau, x(\tau))}{\partial x} f(\tau, x(\tau)) d\tau + \varepsilon \int_0^t \overline{f(\sigma, x(\tau))} d\sigma, \quad (19)$$

где $\psi_1(t, x(t)) = \int_0^t \varphi_1(\tau, x(t)) d\tau$.

Вводя замену переменных

$$x - \varepsilon \psi_1(t, x) = y \quad (20)$$

и учитывая, что $f(\sigma, x) = f(\sigma, y + \varepsilon \psi_1) = f(\sigma, y) + \varepsilon (\partial f(\sigma, y)/\partial y) \psi_1 + \varepsilon^2, \dots$,

из (19) получим $y(t) = y(0) + \varepsilon \int_0^t \overline{f(\sigma, y(\tau))} d\sigma + \varepsilon^2 \dots$, откуда следует уравнение

первого приближения $dy/dt = \overline{f(\tau, y)}$, причем функция $\psi_1(t, x)$ выбрана так, что $y(0) = x(0)$.

В отличие от [6] формула (20) дает замену новых пространственных переменных через старые.

Для вывода уравнения второго приближения поступаем следующим образом. Так как $\partial f(\sigma, y)/\partial y = \partial f(\sigma, x)/\partial x + \varepsilon \dots$, то

$$x(t) = x(0) + \varepsilon \psi_1(t, x(t)) - \varepsilon^2 \int_0^t (\partial \psi_1(\tau, x(\tau))/\partial x) f(\tau, x(\tau)) d\tau + \\ + \varepsilon^2 \int_0^t (\overline{\partial f(\sigma, x(\tau))/\partial x}) \psi_1(\tau, x(\tau)) d\tau + \varepsilon \int_0^t \overline{f(\sigma, y(\tau))} d\tau + \varepsilon^3 \dots \quad (21)$$

Обозначив выражение $\partial \psi_1(\tau, x(\tau))/\partial x f(\tau, x(\tau)) - \overline{\partial f(\sigma, x(\tau))/\partial x} \psi_1(\tau, x(\tau))$ через $g_1(\tau, x(\tau))$, запишем на основании тождества (4)

$$\int_0^t g_1(\tau, x(\tau)) d\tau = \int_0^t [g_1(\tau, x(\tau)) - \overline{g_1(\sigma, x(\tau))}] d\tau + \int_0^t \overline{g_1(\sigma, x(\tau))} d\tau = \\ = \int_0^t [g_1(\tau, x(t)) - \overline{g_1(\sigma, x(t))}] d\tau - \varepsilon \int_0^t d\tau \int_0^\tau \frac{\partial [g_1(\sigma, x(\tau)) - \overline{g_1(\sigma, x(\tau))}]}{\partial x} \times \\ \times f(\tau, x(\tau)) d\sigma + \int_0^t \overline{g_1(\sigma, x(\tau))} d\tau.$$

Далее с помощью замены $x - \varepsilon \psi_1(t, x) + \varepsilon^2 \psi_2(t, x) = y$, где $\psi_2(t, x) = \int_0^t [g_1(\tau, x(t)) - \overline{g_1(\sigma, x(t))}] d\tau$, из (21) получим

$$y(t) = y(0) + \varepsilon^2 \int_0^t (\overline{\partial f(\sigma, y(\tau)/\partial y}) \psi_1(\sigma, y(\tau)) d\tau - \\ - \varepsilon^2 \int_0^t (\partial \psi_1(\sigma, y(\tau))/\partial y) f(\sigma, y(\tau)) d\tau + \varepsilon \int_0^t \overline{f(\sigma, y(\tau))} d\tau + \varepsilon^3 \dots$$

Отсюда находим уравнение второго приближения

$$dy/dt = \overline{f(\tau, y)} + \varepsilon^2 \left[\frac{\overline{\partial f(\tau, y)}}{\partial y} \psi_1(\tau, y) - \overline{\frac{\partial \psi_1(\tau, y)}{\partial y} f(\tau, y)} \right].$$

Легко видеть, что замену переменных $x - \varepsilon \psi_1(t, x) + \dots = y$, осуществляющую переход к усредненным уравнениям, можно строить в виде ряда по степеням ε из уравнения $\partial y/\partial t + \varepsilon (\partial y/\partial x) f(t, x) = \sum_{k=1}^{\infty} \varepsilon^k P_k(y)$. Вектор-функции $\psi_k(t, x)$, $P_k(y)$ последовательно находятся из последней формулы с учетом периодичности $y(t, x, \varepsilon)$.

В линейном случае из нашей методики следует алгоритм построения показательной матрицы, отличный от метода, изложенного в [9].

В заключение отметим, что поскольку выражение $y - \int_0^t f(\tau, y) d\tau = x_0$ — интеграл уравнения

$$dy/dt = \left(E - \int_0^t (\partial f(\tau, y)/\partial y) d\tau \right)^{-1} f(t, y), \quad y(0) = x_0,$$

то уравнение (1) запишем в виде

$$dx/dt = \left(E - \int_0^t (\partial f(\tau, x)/\partial x) d\tau \right)^{-1} f(t, x) - \\ - \left(E - \int_0^t (\partial f(\tau, x)/\partial x) d\tau \right)^{-1} \int_0^t (\partial f(\tau, x)/\partial x) d\tau f(t, x).$$

Далее, опираясь на следствие 2 доказанной леммы, получим эквивалентное интегральное уравнение

$$x(t) - \int_0^t f(\tau, x(\tau)) d\tau = x_0 - \int_0^t d\tau \int_0^\tau (\partial f(\sigma, x(\tau))/\partial x) f(\tau, x(\tau)) d\sigma.$$

Итак, мы пришли к методу интегрирования уравнения (1), заключающемуся в последовательном применении преобразований вида $u - \int_0^t \varphi(\tau, u) d\tau = v$. Этим способом можно выводить также усредненные уравнения.

1. *Самойленко А. М., Ронто Н. И.* Численно-аналитические методы исследования периодических решений.— Киев : Вища школа, 1976.— 179 с.
2. *Самойленко А. М.* Об одном случае непрерывной зависимости решений дифференциальных уравнений от параметра.— Укр. мат. журн., 1962, 14, № 3, с. 289—298.
3. *Лаптинский В. Н.* Об одном итерационном методе в теории нелинейных колебаний.— Весті АН БССР. Сер. фіз.-мат. наук, 1980, № 2, с. 6—12.
4. *Аграчев А. А., Вахрамеев С. А.* Хронологические ряды и теорема Коши—Ковалевской.— Итоги науки и техники. Сер. Математика. Проблемы геометрии / ВИНТИ, 1981, 12, с. 165—189.
5. *Жестков С. В.* Об одном конструктивном алгоритме решения задачи Коши для линейных уравнений в частных производных первого порядка.— Весті АН БССР. Сер. фіз.-мат. наук, 1980, № 6, с. 49—51.
6. *Боголюбов Н. Н., Митропольский Ю. А.* Асимптотические методы в теории нелинейных колебаний.— М. : Наука, 1974.— 504 с.
7. *Волосов В. М., Моргунов Б. И.* Метод осреднения в теории нелинейных колебательных систем.— М. : Изд-во МГУ, 1971.—508 с.
8. *Хейл Дж.* Колебания в нелинейных системах.— М. : Мир, 1966.— 231 с.
9. *Еругин Н. П.* Линейные системы обыкновенных дифференциальных уравнений.— Минск: Наука и техника, 1963.— 272 с.
10. *Боголюбов Н. Н., Митропольский Ю. А., Самойленко А. М.* Метод ускоренной сходимости в нелинейной механике.— Киев : Наукова думка, 1969.— 247 с.
11. *Мозер Ю.* Быстро сходящийся метод итераций и нелинейные дифференциальные уравнения.— Успехи мат. наук, 23, № 4, 1968, с. 179—238.

Киев. гос. ун-т

Поступила в редакцию— 21.03.83