

**ОДИН ВАРІАНТ ПРОЕКЦІЙНО-ІТЕРАТИВНОГО МЕТОДУ
ДЛЯ СИСТЕМ ЛІНІЙНИХ ДИФЕРЕНЦІАЛЬНИХ РІВНЯНЬ
ІЗ ЗАПІЗНЕННЯМ НЕЙТРАЛЬНОГО ТИПУ
ТА ОБМЕЖЕННЯМИ***

В. А. Ферук

Ин-т математики НАН України

Україна, 01601, Київ 4, вул. Терещенківська, 3

In this paper, conditions of consistency for systems of linear differential equations with constant delay of neutral type and restrictions are established. The projection-iterative method for such problems is substantiated.

Установлені умови сумісності для систем лінійних диференціальних рівнянь з постійним запаздыванием нейтрального типу и обмеженнями. Обосновано применение к таким задачам проекционно-итеративного метода.

Функціонально-диференціальні рівняння та їх системи є математичними моделями різноманітних фізичних процесів. Широта застосувань стала поштовхом до інтенсивного розвитку теорії таких рівнянь у останні півстоліття [1 – 4]. Окремим напрямком досліджень є встановлення умов сумісності та обґрунтування наближених методів розв'язання функціонально-диференціальних рівнянь при умові накладання на їх розв'язки додаткових обмежень. Зокрема, у [5, 6] за допомогою підходу, уперше запропонованого в [7], та методики роботи [8] проведено дослідження систем диференціальних рівнянь із запізненням та обмеженнями. В даній роботі згаданий вище підхід застосовано до вивчення аналогічних питань для систем лінійних диференціальних рівнянь із запізненням нейтрального типу та додатковими умовами.

1. Об'єкт дослідження. Розглянемо задачу

$$\frac{d}{dt}x(t) + N(t)\frac{d}{dt}x(t - \Delta) + L(t)x(t) + M(t)x(t - \Delta) = f(t), \quad t \in [a, b], \quad (1)$$

$$x(t) = \varphi(t), \quad \frac{d}{dt}x(t) = \psi(t), \quad t \in [a - \Delta, a), \quad x(a) = \varphi(a), \quad (2)$$

$$\int_a^b S(t)x(t)dt = \alpha, \quad (3)$$

*Частково підтримано грантом Президії НАН України для молодих учених (№ 0105U005666).

у якій $\Delta > 0$ – сталим запізненням, $N(t)$, $L(t)$, $M(t)$ та $S(t)$ – матриці розмірностей $m \times m$, $m \times m$, $m \times m$ та $l \times m$ відповідно, елементи яких сумовні з квадратом на відрізку $[a, b]$, причому $N(t) \neq 0$ на $[a, b]$, $f \in L_2([a, b], \mathbb{R}^m)$, $\varphi \in C([a - \Delta, a], \mathbb{R}^m)$ та $\psi \in C([a - \Delta, a], \mathbb{R}^m)$, $\alpha \in \mathbb{R}^l$.

Задачу (1)–(3) вважатимемо сумісною, якщо існує вектор-функція $x \in W_2^1([a, b], \mathbb{R}^m)$, яка майже скрізь задовольняє рівняння (1), умову (2) та обмеження (3). Якщо ж такої вектор-функції не існує, то задача (1)–(3) є несумісною. За наявності умов (3) ($l > 0$), взагалі кажучи, остання ситуація є типовою.

Метою даної статті є встановлення умов сумісності задачі (1)–(3) та обґрунтування застосування до неї одного із варіантів проекційно-ітеративного методу.

2. Зведення системи функціонально-диференціальних рівнянь з обмеженнями до крайової задачі для системи звичайних диференціальних рівнянь з обмеженнями. Задачу (1)–(3) можна звести до крайової задачі для системи звичайних диференціальних рівнянь з обмеженнями. Такий крок дає змогу застосувати при дослідженні поставленої задачі методики, розроблені для звичайних диференціальних рівнянь. Зокрема, встановлення умов сумісності задачі (1)–(3) та обґрунтування застосування до неї різних наближених методів можна проводити методом інтегральних рівнянь.

Отже, припустимо, не зменшуючи загальності, що $b = a + N\Delta$. Розглядаючи, дотримуючись методики із [5], систему рівнянь (1) на кожному інтервалі (τ_i, τ_{i+1}) , вводячи заміну $t = cs + \tau_i$, де $\tau_i = a + (i - 1)\Delta$, $i = \overline{0, N}$, $c = \Delta/T$, $s \in [0, T]$, та враховуючи неперервність вектор-функції $x(t)$ у точках τ_i , $i = \overline{2, N - 1}$, отримуємо крайову задачу для системи диференціальних рівнянь порядку mN

$$Q(s) \frac{dz}{ds} + P(s)z(s) = q(s), \quad z(0) = \gamma + Dz(T), \quad (4)$$

з обмеженнями

$$\int_0^T V(s)z(s)ds = \alpha, \quad (5)$$

в якій

$$z(s) = \text{col}(z_1(s) \ z_2(s) \ \dots \ z_N(s)), \quad q(s) = \text{col}(q_1(s) \ q_2(s) \ \dots \ q_N(s)),$$

$$Q(s) = \begin{pmatrix} I & O & \dots & O & O \\ N_2(s) & I & \dots & O & O \\ \dots & \dots & \dots & \dots & \dots \\ O & O & \dots & N_N(s) & I \end{pmatrix}, \quad D = \begin{pmatrix} O & O & \dots & O & O \\ I & O & \dots & O & O \\ \dots & \dots & \dots & \dots & \dots \\ O & O & \dots & I & O \end{pmatrix},$$

$$P(s) = \begin{pmatrix} L_1(s) & O & \dots & O & O \\ M_2(s) & L_2(s) & \dots & O & O \\ \dots & \dots & \dots & \dots & \dots \\ O & O & \dots & M_N(s) & L_N(s) \end{pmatrix}, \quad (6)$$

$$\gamma = \text{col}(\varphi(a) \ 0 \ \dots \ 0), \quad V(s) = \text{col}(S_1(s) \ S_2(s) \ \dots \ S_N(s)),$$

I — одинична матриця в \mathbb{R}^m ,

$$z_i(s) = x(cs + \tau_i), \quad L_i(s) = cL(cs + \tau_i),$$

$$M_i(s) = cM(cs + \tau_i), \quad S_i(s) = cS(cs + \tau_i), \quad i = \overline{1, N},$$

$$q_1(s) = cf(cs + \tau_1) - M_1(s)\varphi(cs + \tau_0) - N_1(s)\psi(cs + \tau_0),$$

$$q_i(s) = cf(cs + \tau_i), \quad N_i(s) = N(cs + \tau_i), \quad i = \overline{2, N}.$$

3. Умови сумісності. Задача (1)–(3) є перевизначеною. Тому одним із перших та найважливіших питань, що постають при її дослідженні, є питання сумісності. Як зазначено у п. 1, розглядувана задача, взагалі кажучи, несумісна, і, отже, виникає потреба у відшуванні умов, за яких вона матиме розв'язок. Встановимо деякі із таких умов.

Важливу роль у подальшому дослідженні відіграватиме задача

$$Q(s)\frac{dz}{ds} + H(s)z(s) = y(s) + E(s)\lambda, \quad s \in (0, T), \quad (7)$$

$$z(0) = \gamma + Dz(T), \quad \int_0^T V(s)z(s)ds = \alpha, \quad (8)$$

у якій $H(s)$ — неперервна при $s \in [0, T]$ ($mN \times mN$)-матриця, $E(s)$ — ($mN \times l$)-матриця із сумовними з квадратом на $[0, T]$ елементами. Тут вектор-функція $y \in L_2([0, T], \mathbb{R}^{mN})$ є заданою, а вектор-функцію $z \in W_2^1([0, T], \mathbb{R}^{mN})$ та вектор $\lambda \in \mathbb{R}^l$ потрібно визначити.

Припустимо, що задача (7), (8) має єдиний розв'язок при довільній вектор-функції $y \in L_2([0, T], \mathbb{R}^{mN})$, що зображується формулами

$$z(s) = h(s) + \int_0^T G(s, \xi)y(\xi)d\xi, \quad \hat{u}(s) = E(s)\lambda = r(s) - \int_0^T R(s, \xi)y(\xi)d\xi, \quad (9)$$

і справджуються рівності

$$\int_0^T G(s, \xi)E(\xi)d\xi = O, \quad E(s) - \int_0^T R(s, \xi)E(\xi)d\xi = O. \quad (10)$$

Наведене вище припущення ґрунтується на результатах роботи [5] (лема 2) і на тому факті, що за умови $N(t) \neq 0$ на $[a, b]$ ($mN \times mN$)-матриця $Q(s)$ має обернену матрицю $Q^{-1}(s)$,

$$Q^{-1}(s) = \begin{pmatrix} I & O & \dots & O & O \\ n_{21}(s) & I & \dots & O & O \\ \dots & \dots & \dots & \dots & \dots \\ n_{N1}(s) & n_{N2}(s) & \dots & n_{NN-1}(s) & I \end{pmatrix},$$

де

$$n_{ij}(t) = (-1)^{i-j} \prod_{k=j}^{i-1} N_k(s), \quad j < i.$$

Введемо у розгляд оператор

$$(\Pi y)(s) := \int_0^T \Pi(s, \xi) y(\xi) d\xi, \quad (11)$$

де

$$\Pi(s, \xi) = E(s) \Delta^{-1} E^*(\xi), \quad \Delta = \int_0^T E^*(s) E(s) ds. \quad (12)$$

Оператор Π ортогонально проектує простір $L_2([0, T], \mathbb{R}^{mN})$ на його підпростір $U_{mN}([0, T], \mathbb{R}^{mN})$, породжений лінійно незалежними стовпцями матриці $E(s)$.

Введемо нову вектор-функцію

$$\widehat{y}(s) = y(s) - \int_0^T \Pi(s, \xi) y(\xi) d\xi, \quad (13)$$

яка, як випливає із властивостей (10) та позначень (11), (12), задовольняє співвідношення

$$\int_0^T G(s, \xi) y(\xi) d\xi = \int_0^T G(s, \xi) \widehat{y}(\xi) d\xi \quad \forall y \in L_2([0, T], \mathbb{R}^{mN}). \quad (14)$$

За умови однозначної розв'язності задачі (7), (8), задачу (4), (5), а отже і задачу (1)–(3), можна звести до деякої системи інтегральних рівнянь. Для цього запишемо задачу (4), (5) у вигляді задачі (7), (8), поклавши в ній

$$y(s) = q(s) + [H(s) - P(s)]z(s) - E(s)\lambda. \quad (15)$$

Підставивши зображення (9) у (15), отримаємо

$$y(s) = p(s) + \int_0^T [R(s, \xi) + K(s, \xi)]y(\xi)d\xi, \quad (16)$$

де

$$p(s) = q(s) - r(s) + [H(s) - P(s)]h(s), \quad K(s, \xi) = [H(s) - P(s)]G(s, \xi). \quad (17)$$

Використовуючи властивість (14), зображення (13) та враховуючи, що [5]

$$R(s, \xi) - \int_0^T \Pi(s, \tau)R(\tau, \xi)d\tau = 0,$$

інтегральне рівняння (16) можна трактувати як систему рівнянь

$$y(s) = p(s) + \int_0^T R(s, \xi)y(\xi)d\xi + \int_0^T K(s, \xi)\hat{y}(\xi)d\xi, \quad (18)$$

$$\hat{y}(s) = g(s) + \int_0^T L(s, \xi)\hat{y}(\xi)d\xi, \quad (19)$$

у якій

$$g(s) = p(s) - \int_0^T \Pi(s, \xi)p(\xi)d\xi, \quad L(s, \xi) = K(s, \xi) - \int_0^T \Pi(s, \tau)K(\tau, \xi)d\tau. \quad (20)$$

Питання сумісності задачі (1)–(3) тісно пов'язане з питанням розв'язуваності системи (18), (19).

Проаналізувавши схему доведення теореми 1 із [9], можна переконатися у справедливості наступного твердження.

Теорема. *Якщо задача (7), (8) має єдиний розв'язок, то задача (1)–(3) сумісна тоді і тільки тоді, коли виконується умова*

$$\sigma + \int_0^T \Gamma(\xi)\hat{y}(\xi)d\xi = 0, \quad (21)$$

де

$$\sigma = \int_0^T V(s)p(s)ds = 0, \quad \Gamma(\xi) = \int_0^T V(s)K(s, \xi)ds = 0,$$

$\hat{y} \in L_2([0, T], \mathbb{R}^{mN})$ — розв'язок системи (19).

Зауважимо, що крім умови (21) існують інші, рівносильні їй, умови сумісності задачі (1)–(3). Наведемо деякі з них.

Для цього спершу, скориставшись властивістю (10), зазначимо, що

$$\int_0^T [R(s, \xi) + K(s, \xi)] \hat{u}(\xi) d\xi = \hat{u}(s) \quad \forall \hat{u} \in U_{mN}([0, T], \mathbb{R}^{mN}), \quad (22)$$

тобто одиниця є власним значенням інтегрального рівняння (16). Згідно з теорією лінійних інтегральних рівнянь, рівняння (16), а отже і задача (1)–(3), матиме розв'язок тоді і тільки тоді, коли виконуватиметься умова

$$\int_0^T p(s) \eta(s) ds = 0, \quad (23)$$

де $\eta \in L_2([0, T], \mathbb{R}^{mN})$ — довільний розв'язок рівняння, спряженого до рівняння (22), тобто

$$\eta(s) = \int_0^T [R^*(s, \xi) + K^*(s, \xi)] \eta(\xi) d\xi.$$

Зауваження. Умова (21), умова [5]

$$\int_0^T R(s, \xi) y(\xi) d\xi = r(s),$$

де $y \in L_2([0, T], \mathbb{R}^{mN})$ — розв'язок системи

$$y(s) = p(s) + r(s) + \int_0^T K(s, \xi) y(\xi) d\xi, \quad (24)$$

та умова (23) є рівносильними.

4. Проекційно-ітеративний метод. Умови сумісності, наведені у попередньому пункті, дозволяють зробити висновок про існування розв'язку задачі (1)–(3). Однак у деяких випадках цієї інформації не достатньо і постає питання відшукування розв'язку поставленої задачі в явному вигляді або наближено.

Одними з наближених методів розв'язання задачі (1)–(3) є методи проекційно-ітеративного типу. Нижче наведено обґрунтування застосування до задачі (1)–(3) одного із

таких методів [10]. Суть методу стосовно задачі (1)–(3) полягає у тому, що послідовні наближення $x_k(t)$ визначаються із задачі

$$\frac{d}{dt}x_k(t) + N(t)\frac{d}{dt}x_k(t - \Delta) + A(t)x_k(t) + B(t)x_k(t - \Delta) = v_k(t) + \Phi(t)\lambda_k, \quad t \in [a, b], \quad (25)$$

$$x_k(t) = \varphi(t), \quad \frac{d}{dt}x_k(t) = \psi(t), \quad t \in [a - \Delta, a), \quad x_k(a) = \varphi(a), \quad (26)$$

$$\int_a^b S(t)x_k(t)dt = \alpha, \quad (27)$$

де

$$v_k(t) = f(t) + [A(t) - L(t)]u_k(t) + [B(t) - M(t)]u_k(t - \Delta), \quad (28)$$

вектор-функція $u_k(t)$ має вигляд

$$u_k(t) = x_{k-1}(t) + W(t)\mu_k, \quad (29)$$

а невідомий вектор $\mu_k \in \mathbb{R}^\nu$ визначається з умови

$$\int_a^b \Psi(t) \left(\frac{du_k}{dt} + N(t)\frac{d}{dt}u_k(t - \Delta) + L(t)u_k(t) + M(t)u_k(t - \Delta) - f(t) \right) dt = 0. \quad (30)$$

Тут $A(t)$ та $B(t)$ — неперервні при $t \in [a, b]$ ($m \times m$)-матриці, $\Phi(t)$ та $\Psi(t)$ — матриці із сумовними з квадратом на $[a, b]$ елементами розмірності $m \times l$ та $\nu \times m$ відповідно. Стовпці матриці $\Phi(t)$ та рядки матриці $\Psi(t)$ є лінійно незалежними. Матриця $W(t)$, що фігурує у зображенні (29), визначається із задачі

$$\frac{d}{dt}W(t) + N(t)\frac{d}{dt}W(t - \Delta) + A(t)W(t) + B(t)W(t - \Delta) = D(t), \quad t \in [a, b], \quad (31)$$

$$W(t) = O, \quad \frac{d}{dt}W(t) = O, \quad t \in [a - \Delta, a), \quad W(a) = O, \quad (32)$$

$$\int_a^b S(t)W(t)dt = 0, \quad (33)$$

де $D(t)$ — ($m \times \nu$)-матриця із сумовними з квадратом на $[a, b]$ елементами, стовпці якої лінійно незалежні.

У задачі (25)–(27) вектор-функція $v_k \in L_2([a, b], \mathbb{R}^m)$ є заданою, а вектор-функція $x_k \in W_2^1([a, b], \mathbb{R}^m)$ та вектор $\lambda_k \in \mathbb{R}^l$ — шуканими.

Початкове наближення $x_0(t)$ визначаємо із задачі (25)–(27) при $k = 0$ і заданій вектор-функції $v_0 \in L_2([a, b], \mathbb{R}^m)$.

Зауважимо, що за наближення до точного розв'язку задачі (1)–(3) можна вважати як вектор-функцію $x_k(t)$, так і $u_k(t)$.

Окремим випадком методу (25)–(33) є ітераційний метод (не містить умови (30) та $W(t) = 0$), а вектор-функція $u_1(t)$ збігається із наближенням, побудованим за проекційним методом.

Встановимо умови збіжності запропонованого методу. Для цього покажемо, що згаданий вище метод можна звести до проекційно-ітеративного методу для системи інтегральних рівнянь (24). Справді, таким самим способом, як при зведенні задачі (1)–(3) до задачі (4), (5), алгоритм (25)–(33) можна переписати у вигляді

$$Q(s) \frac{dz_k}{ds} + H(s)z_k(s) = y_k(s) + E(s)\lambda_k, \quad (34)$$

$$z_k(0) = \gamma + Dz_k(T), \quad \int_0^T V(s)z_k(s)ds = \alpha, \quad (35)$$

$$y_k = q(s) + [H(s) - P(s)]w_k(s), \quad (36)$$

$$w_k(s) = z_{k-1}(s) + K(s)\mu_k, \quad (37)$$

$$\int_0^T Z(s) \left(Q(s) \frac{dw_k}{ds} + P(s)w_k(s) - q(s) \right) ds = 0, \quad (38)$$

де матриця $K(s)$ розмірності $mN \times \nu$ визначається із задачі

$$Q(s) \frac{dK}{ds} + H(s)K(s) = C(s), \quad s \in (0, T), \quad (39)$$

$$K(0) = DK(T), \quad \int_0^T V(s)K(s)ds = 0. \quad (40)$$

Тут матриці $Q(s)$, $H(s)$, D , $V(s)$, $P(s)$, вектор γ та вектор-функція $q(s)$ мають вигляд (6) і

$$z_k(s) = \text{col} \left(z_1^k(s) \ z_2^k(s) \ \dots \ z_N^k(s) \right), \quad w_k(s) = \text{col} \left(w_1^k(s) \ w_2^k(s) \ \dots \ w_N^k(s) \right),$$

$$z_i^k(s) = x_k(cs + \tau_i), \quad w_i^k(s) = u_k(cs + \tau_i), \quad i = \overline{1, N},$$

$$y_k(s) = \text{col} \left(y_1^k(s) \ y_2^k(s) \ \dots \ y_N^k(s) \right),$$

$$y_1^k(s) = cv_k(cs + \tau_1) - B_1(s)\varphi(cs + \tau_0) - N_1(s)\psi(cs + \tau_0),$$

$$y_i^k(s) = cv_k(cs + \tau_i), \quad i = \overline{2, N},$$

$$E(s) = \text{col} (E_1(s) \ E_2(s) \ \dots \ E_N(s)), \quad K(s) = \text{col} (K_1(s) \ K_2(s) \ \dots \ K_N(s)),$$

$$Z(s) = (\Psi_1(s) \ \Psi_2(s) \ \dots \ \Psi_N(s)), \quad C(s) = \text{col} (C_1(s) \ C_2(s) \ \dots \ C_N(s)),$$

$$E_i(s) = c\Phi(cs + \tau_i), \quad K_i(s) = cW(cs + \tau_i),$$

$$\Psi_i(s) = c\Psi(cs + \tau_i), \quad C_i(s) = cD(cs + \tau_i), \quad i = \overline{1, N}.$$

Згідно з викладеним у попередньому пункті, задача (34), (35) має єдиний розв'язок

$$z_k(s) = h(s) + \int_0^T G(s, \xi) y_k(\xi) d\xi. \quad (41)$$

Якщо тепер підставити зображення (41), замінивши в ньому індекс k на $k-1$, у співвідношення (37) та скористатись тим, що матриця $K(s)$ є розв'язком задачі (39), (40), тобто її можна подати у вигляді

$$K(s) = \int_0^T G(s, \xi) C(\xi) d\xi,$$

то матимемо

$$w_k(s) = h(s) + \int_0^T G(s, \xi) [y_{k-1}(\xi) + C(\xi)\mu_k] d\xi. \quad (42)$$

Підставивши (42) у (36) та виконавши нескладні перетворення, отримаємо проекційно-ітеративний метод для системи інтегральних рівнянь (24):

$$y_k(s) = p(s) + r(s) + \int_0^T K(s, \xi) v_k(\xi) d\xi, \quad (43)$$

$$v_k(s) = y_{k-1}(s) + C(s)\mu_k, \quad (44)$$

$$\int_0^T Z(s)[y_k(s) - v_k(s)]ds = 0. \quad (45)$$

Отже, питання встановлення умов збіжності методу (25) – (33) звелось до відповідного питання для проекційно-ітеративного методу (43) – (45) для системи інтегральних рівнянь (24). Умови ж збіжності останнього є відомими [10].

Таким чином, у результаті проведених в даній статті досліджень:

1) встановлено умови сумісності систем лінійних диференціальних рівнянь із сталим запізненням нейтрального типу та обмеженнями;

2) обґрунтовано проекційно-ітеративний метод побудови наближених розв'язків таких задач.

Отримані результати можуть бути основою для аналогічних досліджень для систем квазілінійних диференціальних рівнянь із запізненням нейтрального типу та обмеженнями і можуть бути перенесені на випадок змінного запізнення та більш складних додаткових умов.

1. *Мышкис А. Д.* Линейные дифференциальные уравнения с запаздывающим аргументом. — М.: Наука, 1972. — 352 с.
2. *Хейл Дж. К.* Теория функционально-дифференциальных уравнений. — М.: Мир, 1983. — 431 с.
3. *Азбелев Н. В., Максимов В. П., Рахматулина Л. Ф.* Введение в теорию функционально-дифференциальных уравнений. — М.: Наука, 1991. — 280 с.
4. *Бойчук А. А., Журавлев В. Ф., Самойленко А. М.* Обобщенно-обратные операторы и нетеровы краевые задачи. — Киев: Ин-т математики НАН Украины, 1995. — 319 с.
5. *Лучка А. Ю., Ферук В. А.* Проекційно-ітеративний метод для систем диференціальних рівнянь із загалюванням та обмеженнями // Нелінійні коливання. — 2003. — 6, № 2. — С. 206–232.
6. *Лучка А. Ю., Ферук В. А.* Модифікований проекційно-ітеративний метод для систем квазілінійних диференціальних рівнянь із запізненням та обмеженням // Там же. — 2004. — 7, № 2. — С. 188–207.
7. *Лучка А. Ю.* Крайова задача для диференціальних рівнянь з імпульсною дією і побудова її розв'язку проекційним методом // Допов. НАН України. — 1993. — № 8. — С. 11–16.
8. *Лучка А. Ю.* Проекційно-ітеративний метод для диференціальних рівнянь з обмеженнями // Нелінійні коливання. — 2002. — 5, № 4. — С. 465–488.
9. *Лучка А. Ю.* Интегральные уравнения с ограничениями и методы их решения // Кибернетика и системный анализ. — 1996. — № 3. — С. 82–96.
10. *Лучка А. Ю.* Проекционно-итеративные методы. — Киев: Наук. думка, 1993. — 288 с.

Одержано 19.07.2006