

О. Д. Нуржанов, А. Т. Алымбаев

Численно-аналитический метод исследования автономных систем интегро-дифференциальных уравнений

1. В работе [1] численно-аналитический метод [2] распространен на автономные системы обыкновенных дифференциальных уравнений.

Данная работа посвящена обобщению этого метода для автономных систем интегро-дифференциальных уравнений вида

$$\frac{dx(t)}{dt} = f\left(x(t), \int_t^{t+\tau} \varphi(t-s, x(s)) ds\right), \quad (1)$$

где x, f — n -мерные векторы, φ — m -мерный вектор; вектор-функции $f(x, u)$, $\varphi(t-s, x)$ предполагаются определенными и непрерывными в области

$$-\infty < t, s < +\infty, x \in \Delta, u \in \Delta_1, \quad (2)$$

Δ, Δ_1 — ограниченные замкнутые области евклидовых пространств, соответственно E_n и E_m ; τ — некоторая фиксированная постоянная.

Заметим, что для неавтономных периодических систем интегродифференциальных уравнений вида (1) численно-аналитический метод применялся в работе [3].

Пусть функции $f(x, u)$ и $\varphi(t-s, x)$ ограничены и удовлетворяют по x и u условию Липшица в области (2) и система уравнений (1) имеет периодическое периода $T = \frac{2\pi}{\omega}$ решение. Через $|x|$ обозначим вектор ω компонентами $|x_i|$, а через $\|x\|$ — норму вектора x , равную $\sum_{i=1}^n |x_i|$.

Так как мы ищем периодическое периода $T = \frac{2\pi}{\omega}$ решение системы уравнений (1), то, не умаляя общности, будем считать, что $0 \leq \tau \leq T$.

Пусть A — постоянная действительная $m \times m$ -мерная матрица такая, что все ее собственные значения имеют простые элементарные делители, являются чисто мнимыми и целые кратные некоторому положительному числу σ . При помощи этой матрицы в системе (1) произведем преобразование переменных

$$\bar{x} = e^{A\theta} \bar{y}, \quad \bar{x} = \bar{y}, \quad \theta = \omega t, \quad (3)$$

где \bar{x} и \bar{y} — m -мерные векторы, имеющие соответственно компоненты x_i, y_i ($i = 1, \dots, m$); $2 \leq m \leq n$, а \bar{x} и \bar{y} — $(n-m)$ -мерные векторы, имеющие

соответственно компоненты x_α, y_α ($\alpha = m + 1, \dots, n$). Тогда исходная система (1) относительно новых переменных имеет вид

$$\frac{dy(\theta)}{d\theta} = \frac{1}{\omega} Y \left(\theta, y(\theta), \frac{1}{\omega} \int_{\theta}^{\theta+\tau\omega} \Psi(\theta, v, y(v)) dv \right), \quad (4)$$

где $y = \text{col}(\bar{y}, \bar{y})$ — n -мерный вектор; а через $Y(\theta, y, v)$ обозначена n -мерная вектор-функция

$$Y(\theta, y, v) = \left\| \begin{array}{l} e^{-A\theta} f^1 \left(e^{A\theta} \bar{y}, \bar{y}, \frac{1}{\omega} \int_{\theta}^{\theta+\tau\omega} \varphi \left(\frac{\theta-v}{\omega}, e^{Av} \bar{y}(v), \bar{y}(v) \right) dv \right) - A\omega \bar{y} \\ f^2 \left(e^{A\theta} \bar{y}, \bar{y}, \frac{1}{\omega} \int_{\theta}^{\theta+\tau\omega} \varphi \left(\frac{\theta-v}{\omega}, e^{Av} \bar{y}(v), \bar{y}(v) \right) dv \right) \end{array} \right\|. \quad (5)$$

В силу непрерывности преобразований (3), области изменения Δ и Δ_1 переменных x и u преобразуются в замкнутые и ограниченные области D и D_1 изменения переменных y и v .

Поскольку по предположению функции $f(x, u)$ и $\varphi(t-s, x)$ ограничены, непрерывны и удовлетворяют условию Липшица, то вектор-функции $Y(\theta, y, v)$ и $\Psi(\theta, v, y)$ также будут удовлетворять этому условию, т. е. имеют место неравенства:

$$|Y(\theta, y, v)| \leq M, \quad |\Psi(\theta, v, y)| \leq N, \quad |Y(\theta, y', v') - Y(\theta, y'', v'')| \leq \\ \leq K_1 |y' - y''| + K_2 |v' - v''|, \quad (6)$$

$$|\Psi(\theta, v, y') - \Psi(\theta, v, y'')| \leq K_3 |y' - y''|, \quad (7)$$

где k_1, k_2 и k_3 — неотрицательные постоянные матрицы в области

$$-\infty < \theta, v < +\infty, \quad y, y', y'' \in D, \quad v, v', v'' \in D_1. \quad (8)$$

Таким образом, вопрос существования и построения периодических по t с периодом $\frac{2\pi}{\omega}$ решений системы интегро-дифференциальных уравнений вида (1) сводится к вопросу существования и построения периодических по θ с периодом 2π решений системы интегро-дифференциальных уравнений (4).

Через D_ω обозначим множество точек $y_0 \in E_n$, содержащихся в D вместе со своей $\frac{\pi}{\omega}$ M -окрестностью. Пусть

$$D_\omega \neq \emptyset. \quad (9)$$

Предположим также, что наибольшее собственное число матрицы $Q = \frac{2\pi}{3\omega} \left[K_1 + \frac{3\tau}{2} K_2 K_3 \right]$ не превышает единицы

$$\lambda_{\max} < 1. \quad (10)$$

Очевидно, что если некоторое значение ω^* удовлетворяет соотношениям (9) и (10), то этим соотношениям удовлетворяет и любое значение $\omega \geq \omega^*$. Через Ω обозначим точную нижнюю границу множества ω , удовлетворяющего соотношениям (9) и (10).

Вектор-функции $Y(\theta, y, v)$ и $\Psi(\theta, v, y)$ явно зависят от θ и периодичны по θ с периодом 2π . Поэтому, если существует преобразование (3) такое, что преобразованная система (4) удовлетворяет условиям (6), (7), (9) и (10) при $\omega > \Omega$, то согласно [2] она является 2π -системой.

Следовательно, последовательность периодических по θ с периодом 2π функций

$$y_m(\theta, y_0, \omega) = y_0 + \frac{1}{\omega} \int_0^\theta \left\{ Y \left(\theta, y_{m-1}(\theta, y_0, \omega), \frac{1}{\omega} \int_0^{\theta+\tau\omega} \Psi(\theta, v, y_{m-1} \times \right. \right. \\ \left. \left. \times (v, y_0, \omega)) dv \right) - \frac{1}{2\pi} \int_0^{2\pi} Y \left(s, y_{m-1}(s, y_0, \omega), \right. \right. \\ \left. \left. \frac{1}{\omega} \int_s^{s+\tau\omega} \Psi(s, v, y_{m-1}(v, y_0, \omega)) dv \right) ds \right\} d\theta, \quad (11)$$

где y_0 — некоторая точка области D_ω , при $m \rightarrow \infty$ сходится равномерно относительно

$$(\theta, y_0, \omega) \in I \times D_\omega \times I_\omega, \quad I = (-\infty, +\infty), \quad I_\omega = (\omega : \omega > \Omega), \quad (12)$$

к функции $y^0(\theta, y_0, \omega)$, определенной в области (12), периодической по θ с периодом 2π . Кроме того, функция $y^0(\theta, y_0, \omega)$ удовлетворяет системе уравнений

$$y(\theta, y_0, \omega) = y_0 + \frac{1}{\omega} \int_0^\theta \left\{ Y \left(\theta, y(\theta, y_0, \omega), \right. \right. \\ \left. \left. \frac{1}{\omega} \int_0^{\theta+\tau\omega} \Psi(\theta, v, y(v, y_0, \omega)) dv \right) - \frac{1}{2\pi} \int_0^{2\pi} Y \left(s, y(s, y_0, \omega), \right. \right. \\ \left. \left. \frac{1}{\omega} \int_s^{s+\tau\omega} \Psi(s, v, y(v, y_0, \omega)) dv \right) ds \right\} d\theta, \quad (13)$$

причем справедлива оценка

$$|y^0(\theta, y_0, \omega) - y_m(\theta, y_0, \omega)| \leq \frac{\pi}{\omega} q_m M, \quad (14)$$

для всех θ, y_0 и ω из области (12), где $q_m = Q^m (E - Q)^{-1}$.

2. Рассмотрим теперь вопрос существования периодических решений $\frac{2\pi}{\omega}$ -системы вида (4). Через D_ω^{n-1} обозначим множество $n-1$ -мерных векторов $y_0^* = (y_{01}, \dots, y_{0n-1})$ таких, что $y_0 = (y_0^*, y_{0n})$ принадлежит D_ω . Обозначим через $\Delta(y_0, \omega)$ вектор-функцию

$$\Delta(y_0, \omega) = \frac{1}{2\pi\omega} \int_0^{2\pi} Y \left(\theta, y^0(\theta, y_0, \omega), \frac{1}{\omega} \int_0^{\theta+\tau\omega} \Psi(\theta, v, y^0(v, y_0, \omega)) \right), \quad (15)$$

где $y^0(\theta, y_0, \omega)$ — предел последовательности периодических функций $y_m(\theta, y_0, \omega)$, определяемых согласно (11). Свойство этой функции определяет следующая лемма.

Лемма. Вектор-функция $\Delta(y_0, \omega)$ определена, непрерывна в области $(y_0, \omega) \in D_\omega \times I_\omega$ и удовлетворяет неравенствам

$$|\Delta(y_0, \omega)| \leq \frac{M}{\omega}, \quad |\Delta(y_0^1, \omega^1) - \Delta(y_0^2, \omega^2)| \leq \bar{K} [E + \bar{K}\pi + \\ + \bar{K}\pi Q_2 (E - Q_2)^{-1}] |y_0^1 - y_0^2| + \frac{M + 2\omega_1 \tau K_2 N}{\omega_1 \omega_2} \times$$

$$\times [E + K\pi + K\pi Q_2 (E - Q_2)^{-1}] |\omega_1 - \omega_2|, \quad (16)$$

$$\text{где } \bar{K} = \frac{K_1 + K_2 K_3 \tau}{\omega_2}, \quad Q_2 = \frac{2\pi}{3\omega_2} \left(K_1 + \frac{3}{2} K_2 K_3 \tau \right).$$

Доказательство этой леммы аналогично доказательству соответствующей леммы из [1].

Из уравнения (13) видно, что всякое его решение, для которого $\Delta(y_0, \omega) = 0$, является периодическим решением системы (4) таким, что $y(0, y_0, \omega) = y_0$.

Поэтому вопрос существования периодического периода 2π решения системы (4) однозначно связан с вопросом существования нулей функции $\Delta(y_0, \omega)$, имеющей вид (15). Но в силу автономности первоначальной системы (1), можем заранее задать одну из компонент вектора $x_0 \in \Delta_\omega$ (см. [1]) и, следовательно, вектора $y_0 \in D_\omega$. Не нарушая общности задачи, предположим, что компонента y_{0n} известна. В n -мерном пространстве рассмотрим непрерывное отображение

$$\Delta: D_\omega^{n-1} \times I_\omega \rightarrow E_n, \quad \Delta(y_0^*, \omega) = \frac{1}{2\pi\omega} \int_0^{2\pi} Y \left(\theta, y^0(\theta, y_0, \omega), \right. \\ \left. \frac{1}{\omega} \int_0^{\theta+\tau\omega} \Psi(\theta, v, y^0(v, y_0, \omega)) dv \right) d\theta. \quad (17)$$

Имеем следующее утверждение.

Теорема 1. Пусть для системы (4), заданной в области

$$-\infty < \theta, v < +\infty, \quad y \in D, \quad v \in D_1, \quad (18)$$

выполняются условия (6), (7), (9) и (10). Кроме того, предположим, что

1) отображение $\Delta_m(y_0^*, \omega)$ имеет изолированную особую точку

$$\Delta_m(\bar{y}_0^*, \bar{\omega}) = 0; \quad (19)$$

2) индекс этой особой точки отличен от нуля;

3) существует замкнутая выпуклая область $D_\omega^{n-1} \times I_\omega^{(1)}$, принадлежащая $D_\omega^{n-1} \times I_\omega$ и имеющая $(\bar{y}_0^*, \bar{\omega})$ единственной особой точкой, такая, что на ее границе $\Gamma_{D_\omega^{n-1} \times I_\omega^{(1)}}^{(1)}$ выполняется неравенство

$$\inf_{(\bar{y}_0^*, \bar{\omega}) \in \Gamma_{D_\omega^{n-1} \times I_\omega^{(1)}}^{(1)}} |\Delta_m(\bar{y}_0^*, \bar{\omega})| \geq \frac{1}{\omega} Q^{m+1} (E - Q)^{-1} M. \quad (20)$$

Тогда система (4) имеет периодическое решение, для которого $y_0 \in D_\omega$.

В общем случае отыскание начальных значений y_0 и неизвестного параметра ω периодических решений 2π -системы следует производить численным методом. Для этого можем использовать свойство вектор-функции $\Delta(y_0, \omega)$, выраженной теоремой.

Теорема 2. Пусть в области (18) задана система (4), удовлетворяющая (6), (7), (9) и (10). Предположим, что существует замкнутая область

$$D_\omega^{n-1} \times I_\omega^{(1)} \cap \{y_n = y_{0n}\} \subset D_\omega \times I_\omega. \quad (21)$$

Тогда, для того, чтобы в этой области существовала точка (y_0^*, ω^*) , для которой $\Delta(y_0^*, \omega^*) = 0$, необходимо, чтобы для всех целых t и любого

$(y'_0, \omega') \in D_{\omega'}^{(1)} \times I_{\omega'}^{(1)} \cap \{y_n = y_{0n}\}$ выполняется неравенство

$$\begin{aligned} |\Delta_m(y'_0, \omega')| \leq & \sup \left\{ \bar{K} [E + \bar{K}\pi + \bar{K}\pi Q_1 (E - Q_1)^{-1}] |y'_0 - y_0| + \right. \\ & + \frac{M + 2\omega\tau K_2 N}{\omega\omega'} \times [E + \bar{K}\pi + \bar{K}\pi Q_1 (E - Q_1)^{-1}] |\omega - \omega'| + \\ & \left. + \frac{1}{\omega'} Q_1^{m+1} (E - Q_1)^{-1} M \right\}, \end{aligned} \quad (22)$$

где $Q_1 = \frac{2\pi}{3\omega'} \left[E + \frac{3\tau}{2} K_2 K_3 \right]$, $\bar{K} = \frac{K_1 + K_2 K_3 \tau}{\omega'}$.

Доказательство этих теорем аналогично доказательству соответствующих теорем в [2].

Задачу нахождения периодических решений некоторого класса автономных систем интегро-дифференциальных уравнений можно свести к определению периодических решений неавтономных систем интегро-дифференциальных уравнений вида (4), в котором применима вышеизложенная теория.

Рассмотрим систему автономных интегро-дифференциальных уравнений

$$\begin{aligned} \frac{dv}{dt} &= g \left(v, \varphi, \psi, \int_t^{t+\tau} P(t-s, v(s), \varphi(s), \psi(s)) ds, \varepsilon \right), \\ \frac{d\varphi}{dt} &= A\varphi + \varepsilon f \left(v, \varphi, \psi, \int_t^{t+\tau} P(t-s, v(s), \varphi(s), \psi(s)) ds, \varepsilon \right), \\ \frac{d\psi}{dt} &= B\psi + \varepsilon h \left(v, \varphi, \psi, \int_t^{t+\tau} P(t-s, v(s), \varphi(s), \psi(s)) ds, \varepsilon \right), \end{aligned} \quad (23)$$

где ε — малый параметр, v и g — m -мерные векторы, φ и f — l -мерные векторы, ψ и h — n -мерные векторы, P — k -мерный вектор, A — $l \times l$ -мерная матрица, для которой каждое решение уравнения $\frac{d\varphi}{dt} = A\varphi$ — периодическое с общим периодом $T_1 = \frac{2\pi}{\nu}$, B — $n \times n$ -мерная матрица такая, что уравнение

$\frac{d\psi}{dt} = B\psi$ не имеет периодических решений кроме $\psi = 0$.

Произведем теперь преобразование переменных

$$v = x, \quad \varphi = e^{\frac{A\omega}{\nu} t} y, \quad \psi = z. \quad (24)$$

В новых переменных система (23) примет вид

$$\begin{aligned} \frac{dx}{dt} &= X \left(t, x, y, z, \int_t^{t+\tau} \Phi(t, s, x(s), y(s), z(s)) ds, \varepsilon \right), \\ \frac{dy}{dt} &= \varepsilon Y \left(t, x, y, z, \int_t^{t+\tau} \Phi(t, s, x(s), y(s), z(s)) ds, \beta, \varepsilon \right), \\ \frac{dz}{dt} &= Bz + \varepsilon Z \left(t, x, y, z, \int_t^{t+\tau} \Phi(t, s, x(s), y(s), z(s)) ds, \varepsilon \right), \end{aligned} \quad (25)$$

где $\omega = \nu + \varepsilon\beta$,

$$\begin{aligned} X &= g\left(x, e^{\frac{A\omega}{\nu}t} y, z, \int_t^{t+\tau} P(t-s, x(s), e^{\frac{A\omega}{\nu}s} y(s), z(s)) ds, \varepsilon\right), \\ Y &= -\frac{\beta}{n} Ay + e^{-\frac{A\omega}{\nu}t} f\left(x, e^{\frac{A\omega}{\nu}t} y, z, \int_t^{t+\tau} P(t-s, x(s), e^{\frac{A\omega}{\nu}s} y(s), z(s)) ds, \varepsilon\right), \\ Z &= h\left(x, e^{\frac{A\omega}{\nu}t} y, z, \int_t^{t+\tau} P(t-s, x(s), e^{\frac{A\omega}{\nu}s} y(s), z(s)) ds, \varepsilon\right). \end{aligned}$$

Имеем следующее утверждение.

Теорема 3. Пусть система (25) при $\varepsilon = 0$ является $\frac{2\pi}{\nu}$ -системой и имеет периодическое по t с периодом $\frac{2\pi}{\nu}$ решение $x = x(t, x_0, y_0, 0)$, $y = y_0$, $z = 0$. Положим

$$\begin{aligned} \bar{X} &= \frac{\nu}{2\pi} \int_0^{2\pi/\nu} X\left(t, x(t, x_0, y_0, 0), y_0, 0, \int_t^{t+\tau} \Phi(t, s, x(s, x_0, y_0, 0), y_0, 0) ds, 0\right) dt, \\ \bar{Y} &= \frac{\nu}{2\pi} \int_0^{2\pi/\nu} Y\left(t, x(t, x_0, y_0, 0), y_0, 0, \int_t^{t+\tau} \Phi(t, s, x(s, x_0, y_0, 0), y_0, 0) ds, \beta_0, 0\right) dt, \\ \bar{Z} &= \frac{\nu}{2\pi} \int_0^{2\pi/\nu} Z\left(t, x(t, x_0, y_0, 0), y_0, 0, \int_t^{t+\tau} \Phi(t, s, x(s, x_0, y_0, 0), y_0, 0) ds, 0\right) dt. \end{aligned}$$

Если существуют векторы $x_0 = (x_{01}, \dots, x_{0m})$, $y_0^* = (y_{01}, \dots, y_{0l-1})$ и скаляр β , такие что

$$\begin{aligned} X\left(t, x(t, x_0, y_0, 0), y_0, 0, \int_t^{t+\tau} \Phi(t, s, x(s, x_0, y_0, 0), y_0, 0) ds, 0\right) &= 0, \\ Y\left(t, x(t, x_0, y_0, 0), y_0, 0, \int_t^{t+\tau} \Phi(t, s, x(s, x_0, y_0, 0), y_0, 0) ds, \beta_0, 0\right) &= 0, \\ \frac{D(\bar{X}, \bar{Y})}{D(x_0, y_0^*, \beta_0^*)} &\neq 0, \end{aligned}$$

тогда при достаточно малых ε система (25) будет $\frac{2\pi}{\omega}$ -системой и имеет периодическое с периодом $\frac{2\pi}{\omega}$ решение $x(t) = x(t, x_0(\varepsilon), y_0(\varepsilon), z_0(\varepsilon), \varepsilon)$, $y(t) = y(t, x_0(\varepsilon), y_0(\varepsilon), z_0(\varepsilon), \varepsilon)$, $z(t) = z(t, x_0(\varepsilon), y_0(\varepsilon), z_0(\varepsilon), \varepsilon)$, такое, что при $\varepsilon = 0$ обращается в решение вырожденной системы.

Доказательство этой теоремы проводится точно так, как и теоремы 3 в работе [1].

В качестве примера рассмотрим уравнение Ван-дер-Поля вида

$$x_1 = x_2, \quad x_2 = -\nu^2 x_1 + \varepsilon(1 - x_1^2)x_2 + \varepsilon \int_t^{t+\frac{\pi}{\omega}} x_2(s) ds, \quad (26)$$

где x_1, x_2 лежит в области $|x_1| \leq a, |x_2| \leq b$, а $\omega = \nu + \varepsilon\beta$.

Преобразованием $x = e^{\frac{A\omega}{v}t} y$ систему (26) приведем к виду

$$\dot{y}_1 = -\frac{\varepsilon}{v} \left\{ \beta x_2 \cos \omega t + \left[v\beta x_1 + (1 - x_1^2) x_2 + \int_t^{t+\frac{\pi}{\omega}} x_2(s) ds \right] \sin \omega t \right\}, \quad (27)$$

$$\dot{y}_2 = \frac{\varepsilon}{v} \left\{ -\beta x_2 \sin \omega t + \left[v\beta x_1 + (1 - x_1^2) x_2 + \int_t^{t+\frac{\pi}{\omega}} x_2(s) ds \right] \cos \omega t \right\},$$

где

$$|y_1| \leq a + \frac{b}{v}, \quad |y_2| \leq a + \frac{b}{v}, \quad (28)$$

причем

$$M = \begin{vmatrix} |\beta|b + v|\beta|a + (1 + a^2)b + \frac{\pi}{\omega}b \\ |\beta|b + v|\beta|a + (1 + a^2)b + \frac{\pi}{\omega}b \end{vmatrix}; \quad N = \begin{vmatrix} 0 \\ b \end{vmatrix},$$

$$K_1 = \begin{vmatrix} v|\beta| + 2ab|\beta| + 1 + a^2 \\ v|\beta| + 2ab|\beta| + 1 + a^2 \end{vmatrix}; \quad K_2 = \begin{vmatrix} 0 & \frac{\varepsilon}{v} \\ 0 & \frac{\varepsilon}{v} \end{vmatrix}; \quad K_3 = \begin{vmatrix} 0 & 1 \\ 0 & 1 \end{vmatrix}.$$

При достаточно малых ε условия (9), (10) всегда выполняются, следовательно, система (27), определенная в области (28), является $\frac{2\pi}{\omega}$ -системой при всех $\omega > 0$.

По схеме, изложенной выше, в первом приближении определяем начальное значение y_{10} и поправку β из системы

$$\begin{aligned} 2y_{20} \left[\beta - \frac{1}{\omega} \right] + y_{10} \left[\frac{y_{10}^2}{4} + \frac{y_{20}^2}{4} - 1 \right] &= 0, \\ 2y_{10} \left[\beta - \frac{1}{\omega} \right] + y_{20} \left[1 - \frac{y_{10}^2}{4} - \frac{y_{20}^2}{4} \right] &= 0. \end{aligned} \quad (29)$$

Считая y_{20} заданным, принимаем $y_{20} = 0$ и получаем из (29), что $y_{20} = 0$, $y_{10} = 2$, $\beta = \frac{1}{v}$, $\omega = v + \frac{\varepsilon}{v}$. Кроме того,

$$\left| \frac{D(\bar{f}_1, \bar{f}_2)}{D(y_{10}, \beta)} \right| = 12.$$

Отсюда следует, что в первом приближении периодическое решение системы (26) имеет вид $x_1 = 2 \cos \left(v + \frac{\varepsilon}{v} \right) t$, $x_2 = -2v \sin \left(v + \frac{\varepsilon}{v} \right) t$.

1. Ле Лыонг Тай. Численно-аналитический метод исследования автономных систем дифференциальных уравнений.— Укр. мат. журн., 1978, 30, № 3, с. 309—317.
2. Самойленко А. М., Ронто Н. И. Численно-аналитические методы исследования периодических решений. К.: Вища школа. 1976. 180 с.

3. Нуржанов О. Д. Численно-аналитический метод исследования нелинейных периодических систем одного класса интегро-дифференциальных уравнений.— Мат. физика, К.: Наук. думка, 1977, вып. 22, с. 22—30.

Киевский
государственный университет

Поступила в редакцию
20.03.1980 г.