

## ОБ УСТОЙЧИВОСТИ НЕЛИНЕЙНЫХ УРАВНЕНИЙ НЕЙТРАЛЬНОГО ТИПА ПЕРВОГО ПОРЯДКА

В. Б. Колмановский, В. Р. Носов

(Москва)

Установлены достаточные условия устойчивости тривиальных решений нелинейных уравнений нейтрального типа первого порядка с произвольным (конечным или бесконечным) запаздыванием.

1. Рассматриваются условия устойчивости тривиальных решений уравнений вида

$$x'(t) = - \int_0^{\infty} x(t-s) dK_0(s) + \sum_{n=1}^{\infty} a_n x'(t-h_n) + \quad (1.1)$$

$$+ \int_0^{\infty} x'(t-s) \lambda(s) ds + b(t, x(t+\tau)), \quad t > 0$$

Вопрос об устойчивости решений некоторых уравнений вида (1.1) исследовался в ряде работ. В статье [1] получены условия устойчивости решений этих уравнений при  $b(t, x(t+\tau)) \equiv 0$ ,  $\lambda(s) \equiv 0$ ,  $a_n \equiv 0$ . В работах [2, 3] для уравнений запаздывающего типа при  $a_n \equiv 0$ ,  $\lambda(s) \equiv 0$  получены достаточные условия устойчивости путем построения функционалов Ляпунова.

Применение второго метода Ляпунова к уравнениям нейтрального типа приводит к специфическим трудностям, связанным с зависимостью правых частей этих уравнений от производной решений. В [4] сформулированы общие теоремы второго метода Ляпунова для уравнений вида

$$x'(t) = f(t, x(t-\tau(t)), \quad x'(t-\tau(t))$$

В данной работе найдены условия устойчивости тривиальных решений уравнений (1.1) при помощи метода функционалов Ляпунова, развитого для систем с запаздыванием Н. Н. Красовским [5].

Отметим, однако, что построенные ниже функционалы не являются функционалами Ляпунова в строгом смысле слова, поскольку они лишь знакопостоянны, а не знакоопределенны. Применение таких знакопостоянных функционалов, позволяющее обойти отмеченные выше трудности, присущие уравнениям нейтрального типа, сводит исследование вопроса об устойчивости уравнения (1.1) к решению двух вспомогательных задач.

Первая — построение неотрицательного функционала с определенно-отрицательной производной вдоль траекторий системы (1.1).

Вторая — исследование на устойчивость решения  $x(t) \equiv 0$  следующего неравенства:

$$\left| x(t) - \sum_{n=1}^{\infty} a_n x(t - h_n) - \int_0^{\infty} x(t - s) \lambda(s) ds \right| \leq c_0 \quad (1.2)$$

Здесь и в дальнейшем  $c_i$  означают некоторые положительные постоянные.

Заметим еще, что ряд особенностей рассматриваемой задачи связан с тем, что отклонения аргумента могут быть бесконечными.

2. Ниже предполагается, что коэффициенты уравнения (1.1) удовлетворяют следующим требованиям.

Ядро  $K_0(s)$  имеет ограниченное изменение на полуоси  $[0, \infty)$  и соответствующий интеграл в (1.1) понимается в смысле Стильтьеса. Функция  $\lambda(s)$  ограничена и интегрируема по Риману на  $[0, \infty]$ .

Наконец, все постоянные

$$h_n \geq 0, \quad |a_1| + |a_2| + \dots + |a_n| + \dots < \infty$$

Обозначим

$$K_1(s) = \int_0^s \lambda(s_1) ds_1 + \sum_{h_n \leq s} a_n, \quad K_1(0) = 0$$

где суммирование распространяется на те значения  $n$ , для которых  $h_n \leq s$ , и положим

$$\sum_{n=1}^{\infty} a_n y(-h_n) + \int_0^{\infty} y(-s) \lambda(s) ds = \int_0^{\infty} y(-s) dK_1(s) \quad (2.1)$$

для любой ограниченной и интегрируемой по Риману функции  $y(s)$ ,  $s \leq 0$ . Подчеркнем, что символ в правой части (2.1) не есть, вообще говоря, интеграл Стильтьеса, так как при сделанных предположениях относительно  $y(s)$  этот интеграл может и не существовать.

Обозначим через  $Q$  прямое произведение полуоси  $[0, \infty)$  и пространства  $C(-\infty, 0]$  непрерывных ограниченных на полуоси  $(-\infty, 0]$  функций  $\varphi(\tau)$  аргумента  $\tau$ , меняющегося в пределах  $-\infty < \tau \leq 0$ .

Метрика в  $Q$  определяется формулой

$$\rho((t_1, \varphi_1), (t_2, \varphi_2)) = |t_1 - t_2| + \sup_{\tau \leq 0} |\varphi_1(\tau) - \varphi_2(\tau)|$$

$$\varphi_1, \varphi_2 \in C(-\infty, 0], \quad t_1, t_2 \geq 0$$

Функционал  $b(t, \varphi(\tau))$  определен и непрерывен на пространстве  $Q$  и удовлетворяет для любых  $\varphi, \psi \in C(-\infty, 0]$  условиям

$$b(t, 0) \equiv 0, \quad |b(t, \varphi) - b(t, \psi)|^2 \leq \int_0^{\infty} |\varphi(-s) - \psi(-s)|^2 dK_2(s) \quad (2.2)$$

где функция  $K_2(s)$  монотонно не убывает. Положим

$$\alpha_{ij} = \int_0^{\infty} s^i |dK_j(s)| \quad (i = 0, 1, \dots, j = 0, 1, 2, 3, 4)$$

Ниже постоянно предполагается, что

$$\alpha_{00} < \infty, \quad \alpha_{01} < 1, \quad \alpha_{02} < \infty \quad (2.3)$$

Решение  $x(t)$  уравнения (1.1) при  $t > 0$  определяется начальными условиями

$$x(t) = \varphi(t), \quad x'(t) = \psi(t), \quad t \leq 0 \quad (2.4)$$

В дальнейшем ограничимся лишь начальными данными, удовлетворяющими требованиям А):

$\varphi(t)$ ,  $t \leq 0$  — непрерывная ограниченная функция,  $\psi(t)$  — функция ограниченная на  $(-\infty, 0]$ ,

интегрируемая по Риману на каждом конечном интервале и  $\psi(t) = \varphi'(t)$  почти всюду.

Иногда, чтобы подчеркнуть зависимость решения  $x(t)$  задачи (1.1), (2.4) от начальных условий, будем обозначать его символом  $x(t, \varphi, \psi)$ . При сделанных предположениях (2.2) — (2.4) при помощи метода последовательных приближений (аналогично доказательству теоремы 2 из [6]) легко доказать существование и единственность функции  $x'(t)$ , ограниченной и интегрируемой по Риману на каждом конечном интервале, равной  $\psi(t)$  при  $t \leq 0$  и такой, что функции

$$x'(t), \quad x(t) = \varphi(0) + \int_0^t x'(s) ds$$

будут решением задачи (1.1), (2.4).

3. *Определение 1.* Тривиальное решение уравнения (1.1) назовем

1) устойчивым, если для любого  $\varepsilon > 0$  найдется такое  $\delta(\varepsilon) > 0$ , что при всех  $t \geq 0$   $|x(\varphi, \psi, t)| < \varepsilon$ , как только выполнены условия А) и

$$\|\varphi\| = \sup |\varphi(\tau)| < \delta(\varepsilon) \quad (\tau \leq 0)$$

2) асимптотически устойчивым, если оно устойчиво и

$$\lim_{t \rightarrow \infty} x(\varphi, \psi, t) = 0$$

Докажем теперь простую лемму об устойчивости тривиального решения неравенства (1.2), необходимую в дальнейшем.

*Лемма 1.* Пусть функция  $x(t) = \varphi(t)$  при  $t \leq 0$  ( $\varphi(t) \in C(-\infty, 0]$ ), а при  $t > 0$  удовлетворяет неравенству (1.2), и пусть выполнено условие (2.3). Тогда справедлива оценка

$$|x(t)| (1 - \alpha_{01}) \leq c_0 + \alpha_{01} \|\varphi\|, \quad t \geq 0$$

*Доказательство.* Введем функцию

$$\rho(t) = \max |x(s)|, \quad 0 \leq s \leq t$$

Из (1.2) следует соотношение

$$|x(t)| \leq c_0 + \alpha_{01} (\rho(t) + \|\varphi\|)$$

Отсюда вытекает, что

$$\rho(t) (1 - \alpha_{01}) \leq c_0 + \alpha_{01} \|\varphi\|$$

Лемма 1 доказана.

Положим для любой  $\varphi(\tau) \in C(-\infty, 0]$  (3.1)

$$Z(\varphi(\tau)) = \varphi(0) - \sum_{n=1}^{\infty} a_n \varphi(-h_n) - \int_0^{\infty} \varphi(-s) \lambda(s) ds = \varphi(0) - \int_0^{\infty} \varphi(-s) dK_1(s)$$

*Теорема 1.* Тривиальное решение уравнения (1.1) асимптотически устойчиво, если выполнены условия (2.2), (2.3) и существует функционал

$$V(\varphi(\tau)) = W(\varphi(\tau)) + Z^2(\varphi(\tau)) \quad (3.2)$$

определенный на пространстве  $Q$ , удовлетворяющий локальному условию Липшица (т. е. для любого  $N$  существует такое  $m_N$ , что  $|V(\varphi(\tau)) - V(\psi(\tau))| \leq m_N \|\varphi - \psi\|$  при  $\|\varphi(\tau)\| \leq N, \|\psi(\tau)\| \leq N$ ), причем

$$0 \leq W(\varphi(\tau)) \leq \omega_1(\|\varphi\|) \quad (3.3)$$

а производная функционала (3.2), вычисленная вдоль траекторий системы (1.1), существует и удовлетворяет неравенству

$$\frac{dV(x(t+\tau))}{dt} \leq -\omega_2(|x(t)|) \quad (3.4)$$

для почти всех  $t \geq 0$  (по мере Лебега). В оценках (3.3) и (3.4) функции  $\omega_i(r)$  непрерывны и  $\omega_i(0) = 0, \omega_i(r) > 0$  при  $r > 0$ ,

*Доказательство.* На основании (3.1) — (3.3) получим, что

$$V(\varphi(\tau)) \leq \omega_1(\|\varphi\|) + (1 + \alpha_{01})^2 \|\varphi\|^2 \quad (3.5)$$

Далее, из локального условия Липшица и отмеченной выше ограниченности производной  $x'(t)$  решения  $x(t)$  на каждом конечном интервале следует, что функционал  $V(x(t+\tau))$  как функция  $t$  будет абсолютно непрерывен. Значит, для любых неотрицательных  $t_1, t_2$

$$V(x(t_2+\tau)) - V(x(t_1+\tau)) = \int_{t_1}^{t_2} \frac{dV(x(t+\tau))}{dt} dt$$

Поэтому в силу (3.2) — (3.4)

$$Z^2(x(t+\tau)) \leq V(x(t+\tau)) \leq V(\varphi(\tau))$$

Отсюда и из (3.5), используя лемму 1, убеждаемся в справедливости соотношения

$$|x(t)| \leq \frac{1}{1 - \alpha_{01}} [(\omega_1(\|\varphi\|) + (1 + \alpha_{01})^2 \|\varphi\|^2)^{1/2} + \alpha_{01} \|\varphi\|]$$

Таким образом, устойчивость тривиального решения уравнения (1.1) установлена.

Для доказательства асимптотической устойчивости достаточно заметить, что для всякого ограниченного решения  $x(t)$  задачи (1.1), (2.4) модуль  $|x'(t)|$  в силу леммы 1 также ограничен, а затем повторить рассуждения Н. Н. Красовского ([5], стр. 181).

Теорема 1 доказана.

*4. Теорема 2.* Пусть выполнены условия (2.3) и ядро  $K_0(s)$  имеет в нуле скачок величины  $a > 0$ , причем

$$a(1 - \alpha_{01}) > (1 + \alpha_{01}) \left( \int_{+0}^{\infty} |dK_0(s)| + \sqrt{\alpha_{02}} \right) \quad (4.1)$$

$$\alpha_{12} + \alpha_{11} + \alpha_{10} < \infty$$

Тогда тривиальное решение уравнения (1.1) асимптотически устойчиво.

*Доказательство.* Достаточно показать, что требования теоремы 2 позволяют построить функционал, удовлетворяющий условиям теоремы 1. Предположим вначале, что  $\alpha_{02} = 0$  (это означает, что  $b(t, \varphi(\tau)) \equiv 0$ ) и рассмотрим функционал

$$V_0(x(t+\tau)) = Z^2(x(t+\tau)) + \alpha_{00} \int_0^\infty |dK_1(s)| \int_{t-s}^t x^2(s_1) ds_1 + \\ + (1 + \alpha_{01}) \int_{+0}^\infty |dK_0(s)| \int_{t-s}^t x^2(s_1) ds_1 \quad (4.2)$$

Справедливость оценок (3.3) следует из неравенства

$$\int_0^\infty |dK_i(s)| \int_{t-s}^t x^2(s_1) ds_1 \leq \alpha_{1i} \|x(t+\tau)\|^2 \quad (i=0,1) \quad (4.3)$$

Вычислим производную функционала (4.2) вдоль траекторий системы (1.1). Так как при почти всех  $t \geq 0$

$$Z'(x(t+\tau)) = x'(t) - \int_0^\infty x'(t-s) dK_1(s) = \\ = -ax(t) - \int_{+0}^\infty x(t-s) dK_0(s) + b(t, x(t+\tau))$$

то

$$\frac{dV_0(x(t+\tau))}{dt} = -2Z(x(t+\tau)) [ax(t) + \\ + \int_{+0}^\infty x(t-s) dK_0(s) + b(t, x(t+\tau))] - \alpha_{00} \int_0^\infty x^2(t-s) |dK_1(s)| - \\ - (1 + \alpha_{01}) \int_{+0}^\infty x^2(t-s) |dK_0(s)| + x^2(t) [\alpha_{00} \alpha_{01} + (1 + \alpha_{01}) \int_{+0}^\infty |dK_0(s)|]$$

Отсюда, используя (2.2), (2.3) и неравенство Коши — Буняковского, получаем, что при почти всех  $t > 0$

$$\frac{dV_0(x(t+\tau))}{dt} \leq 2x^2(t) \left[ -a + \alpha_{01} + \int_{+0}^\infty |dK_0(s)| (1 + \alpha_{01}) \right]$$

Значит, функционал (4.2) удовлетворяет требованиям теоремы 1. Тем самым справедливость теоремы 2 установлена для случая  $\alpha_{02} = 0$ . Если же  $\alpha_{02} > 0$ , то достаточно рассмотреть функционал

$$V(x(t+\tau)) = V_0(x(t+\tau)) + \frac{1}{\sqrt{\alpha_{02}}} \int_0^\infty |dK_1(s)| \int_{t-s}^t x^2(s_1) ds_1 + \\ + \left( \alpha_{01} \sqrt{\alpha_{02}} + \frac{1}{\sqrt{\alpha_{02}}} \right) \int_0^\infty dK_2(s) \int_{t-s}^t x^2(t_1) dt_1 \quad (4.4)$$

Как и выше, нетрудно убедиться, что функционал (4.4) удовлетворяет неравенствам (3.3), а для его производной справедлива оценка

$$\frac{dV(x(t+\tau))}{dt} \leq 2x^2(t) \left[ -a(1 - \alpha_{01}) + (1 + \alpha_{01}) \left( \int_{+0}^\infty |dK_0(s)| + \sqrt{\alpha_{02}} \right) \right]$$

Теорема 2 доказана.

5. *Лемма 2.* Пусть выполнены требования (2.2), (2.3), и условие  $\alpha_{01} + \alpha_{10} < 1$ . Тогда утверждение теоремы 1 остается в силе, если существует функционал, удовлетворяющий (3.3), (3.4), вида

$$V[\varphi(\tau)] = Z_1^2(\varphi(\tau)) + W[\varphi(\tau)] \quad (5.1)$$

где

$$Z_1(\varphi(\tau)) = \varphi(0) - \int_0^\infty \varphi(-s) dK_1(s) - \int_0^\infty dK_0(s) \int_{-s}^0 \varphi(t_1) dt_1 \quad (5.2)$$

Доказательство этой леммы получается дословным повторением доказательства теоремы 1.

*Теорема 3.* Пусть выполнены условия (2.2), (2.3), причем

$$\alpha_{10} + \alpha_{01} < 1$$

$$\beta = \int_0^\infty dK_0(s) > \alpha_{02}^{1/2} \frac{1 + \alpha_{10} + \alpha_{01}}{1 - \alpha_{10} - \alpha_{01}}$$

$$\alpha_{20} + \alpha_{11} + \alpha_{12} < \infty$$

Тогда тривиальное решение уравнения (1.1) асимптотически устойчиво.

*Доказательство.* Предположим вначале, что  $\alpha_{02} > 0$ , и введем в рассмотрение функционал

$$\begin{aligned} V[x(t+\tau)] = & Z_1^2(x(t+\tau)) + (\beta + \alpha_{02}^{1/2}) \int_0^\infty |dK_1(s)| \int_{t-s}^t x^2(t_1) dt_1 + \\ & + (1 + \alpha_{10} + \alpha_{01}) \alpha_{02}^{-1/2} \int_0^\infty dK_2(s) \int_{t-s}^t x^2(t_1) dt_1 + (\beta + \alpha_{02}^{1/2}) \int_0^\infty |dK_0(s)| \int_{t-s}^t dt_1 \int_{t_1}^t x^2(t_2) dt_2 \end{aligned} \quad (5.3)$$

где  $Z_1(x(t+\tau))$  определено формулой (5.2). Из (4.3) и условий теоремы 3 вытекает, что функционал (5.3) удовлетворяет оценкам

$$Z_1^2(x(t+\tau)) \leq V[x(t+\tau)] \leq C_1 \|x(t+\tau)\|^2$$

При почти всех  $t > 0$  производная (5.4)

$$Z_1'(x(t+\tau)) = -\beta x(t) + b(t, x(t+\tau))$$

и кроме того на основании (2.2), (2.3) имеют место оценки

$$\begin{aligned} 2b(t, x(t+\tau)) \int_0^\infty dK_0(s) \int_{t-s}^t x(t_1) dt_1 & \leq \\ & \leq \alpha_{10} \alpha_{01}^{-1/2} \int_0^\infty x^2(t-s) dK_2(s) + \alpha_{02}^{1/2} \int_0^\infty |dK_0(s)| \int_{t-s}^t x^2(t_1) dt_1 \\ 2\beta x(t) \int_0^\infty dK_0(s) \int_{t-s}^t x(t_1) dt_1 & \leq \beta x^2(t) \alpha_{00} + \beta \int_0^\infty |dK_0(s)| \int_{t-s}^t x^2(t_1) dt_1 \end{aligned}$$

Поэтому нетрудно вычислить, что при почти всех  $t > 0$

$$\frac{dV[x(t+\tau)]}{dt} \leq 2x^2(t) [-\beta(1 - \alpha_{01} - \alpha_{10}) + \alpha_{02}^{1/2}(1 + \alpha_{10} + \alpha_{01})]$$

Отсюда и из (5.4) на основании леммы 2 при  $\alpha_{02} > 0$  вытекает справедливость теоремы 3 в этом случае.

Для доказательства теоремы 3 при  $\alpha_{02} = 0$  нужно использовать функционал (5.3), в котором отсутствует третий член, и  $\alpha_{02}$  в остальных слагаемых положено равным нулю.

**Замечание 1.** Если  $\lambda(s) \equiv 0$ ,  $a_n \equiv 0$ , то теоремы 2, 3 переходят в соответствующие результаты работы [3].

**Замечание 2.** Модифицируя функционал (5.3), можно получить иные условия устойчивости уравнения (1.1). Приведем некоторые из них. Воспользуемся тем, что произвольная функция  $K_0(s)$  с ограниченным изменением представима в виде разности  $K_0(s) = K_3(s) - K_4(s)$  двух монотонно неубывающих ограниченных функций. При этом к функционалу (5.3), в котором  $K_0(s)$  заменено на  $K_3(s)$ ,  $\beta$  на  $\alpha_{03}$  и  $\alpha_{10}$  на  $\alpha_{13}$ , достаточно добавить выражение

$$(1 + \alpha_{01} + \alpha_{13}) \int_0^{\infty} dK_4(s) \int_{t-s}^t x^2(t_1) dt_1 + \\ + \alpha_{04} \int_0^{\infty} |dK_1(s)| \int_{t-1}^t x^2(t_1) dt_1 + \alpha_{04} \int_0^{\infty} dK_3(s) \int_{t-s}^t dt_1 \int_{t_1}^t x(t_2) dt_2$$

При помощи этого нового функционала может быть установлена **Теорема 4.** Пусть выполнены условия (2.2), (2.3) и

$$\alpha_{01} + \alpha_{13} < 1 \\ \alpha_{03} > [\alpha_{04} + \alpha_{02}^{1/2}] \frac{1 + \alpha_{01} + \alpha_{13}}{1 - \alpha_{01} - \alpha_{13}} \\ \alpha_{11} + \alpha_{12} + \alpha_{14} + \alpha_{23} < \infty$$

Тогда тривиальное решение уравнения (1.1) асимптотически устойчиво.

**Пример.** Рассмотрим уравнение

$$x'(t) = -r_1 \int_0^{\infty} x(t-s) e^{-s} ds + r_2 x'(t-h) \quad (t > 0) \quad (5.5)$$

где  $r_1, r_2, h \geq 0$  — некоторые постоянные. По теореме 3 тривиальное решение уравнения (5.5) асимптотически устойчиво, если выполнены условия

$$r_1 > 0, |r_2| + r_1 < 1$$

**6.** Незначительно изменяя построенные при доказательстве теорем 2—4 функционалы (4.2), (5.3), можно получить условия устойчивости тривиальных решений уравнений

$$x'(t) = - \int_0^{\infty} x(t-s) d_s R_0(t, s) + \sum_{n=1}^{\infty} a_n(t) x'(t-h_n(t)) + \\ + \int_0^{\infty} x'(t-s) \lambda(t, s) ds + b(t, x(t+\tau)) \quad (6.1)$$

Поскольку при этом получаются очень громоздкие функционалы, ограничимся рассмотрением лишь простейших случаев, из которых, однако, легко понять, какие изменения нужно внести в функционалы (4.2), (5.3), чтобы рассмотреть более общие уравнения вида (6.1). Найдем условия устойчивости тривиального решения уравнения

$$x'(t) = -b(t) x(t-h) + cx'(t-h), \quad t > 0 \quad (6.2)$$

Решение уравнения (6.2) при  $t > 0$  определяется начальными условиями (2.4), а устойчивость понимается в смысле определения 1. Функция  $b(t)$  предполагается непрерывной и неотрицательной. С помощью функционала

$$V[x(t-s)] = \left[ x(t) - cx(t-h) - \int_{t-h}^t b(s+h)x(s)ds \right]^2 + \\ + |c| \int_{t-h}^t b(s+2h)x^2(s)ds + \int_{t-h}^t b(t_1+2h)dt_1 \int_{t_1}^t b(t_2+h)x^2(t_2)dt_2$$

аналогично доказательству теоремы 3 нетрудно найти, что тривиальное решение уравнения (6.2) асимптотически устойчиво, если выполнены условия

$$\sup_{t \geq 0} \left\{ |c| + \int_{t-h}^t b(s+h)ds \right\} < 1 \\ \sup_{t \geq 0} \left\{ -2b(t+h) + |c|[b(t+h) + b(t+2h)] + \right. \\ \left. + b(t+h) \int_{t-h}^t [b(s+h) + b(s+2h)]ds \right\} < 0$$

Поступила 27 III 1969

#### ЛИТЕРАТУРА

1. Колмановский В. Б., Хасьминский Р. З. Об устойчивости линейных систем с запаздыванием. Изв. вузов, Математика, 1966, № 4.
2. Колмановский В. Б. О применении метода Ляпунова к линейным системам с запаздыванием. ПММ, 1967, т. 31, вып. 5.
3. Колмановский В. Б. Об устойчивости стохастических систем с запаздыванием. Проблемы передачи информации, 1969, т. 5, № 4.
4. Мисник А. Ф., Носов В. Р. К вопросу об устойчивости дифференциально-разностных уравнений нейтрального типа. В кн: Сб. научн. работ аспирантов, М., Ун-т дружбы народов им. Патриса Лумумбы. Фак. физ.-матем. и естеств. н. 1968, вып. 1, стр. 43—45.
5. Красовский Н. Н. Некоторые задачи теории устойчивости движения. М., Физматгиз, 1959.
6. Зверкин А. М. Теоремы существования и единственности для уравнений с отклоняющимся аргументом в критическом случае. Тр. сем. по теории дифф. уравнений с отклоняющимся аргументом. М., Ун-т дружбы народов, им. Патриса Лумумбы, 1962, т. 1.