

ОБ АСИМПТОТИЧЕСКОЙ УСТОЙЧИВОСТИ И НЕУСТОЙЧИВОСТИ
ОТНОСИТЕЛЬНО ЧАСТИ ПЕРЕМЕННЫХ

А. С. Озиранер

(Москва)

Устанавливается аналогия между некоторыми свойствами функций Ляпунова и равномерной сходимостью функциональных рядов и последовательностей, удовлетворяющих условиям теоремы Дини. Для автономных систем известные теоремы об асимптотической устойчивости и неустойчивости относительно части переменных, основанные на использовании функции Ляпунова со знакопостоянной производной, обобщаются в направлении ослабления условий на множество, на котором обращается в нуль производная от функции Ляпунова. Рассматривается устойчивость относительно части переменных по линейному приближению.

1. Рассмотрим систему дифференциальных уравнений возмущенного движения

$$(1.1) \quad \dot{x} = X(t, x) \quad (X(t, 0) \equiv 0)$$

в которой $x = (y_1, \dots, y_m, z_1, \dots, z_p)$ — вещественный n -вектор, $m > 0$, $p \geq 0$, $n = m + p$. Предположим, что

а) правые части системы (1.1) в области

$$(1.2) \quad t \geq 0, \quad \|y\| \leq H > 0, \quad 0 \leq \|z\| < \infty$$

непрерывны и удовлетворяют условиям единственности решения;

б) решения системы (1.1) z -продолжимы, т. е. любое решение $x(t)$ определено при всех $t \geq 0$, для которых $\|y(t)\| \leq H$.

Пусть $x = x(t; t_0, x_0)$ — решение системы (1.1), определенное начальными условиями $x(t_0; t_0, x_0) = x_0$ (здесь приняты обозначения обзорной статьи [1]).

Определение. Движение $x = 0$ называется асимптотически y -устойчивым равномерно по x_0 , если оно y -устойчиво и для каждого $t_0 \geq 0$ существует такое $\delta(t_0) > 0$, что

$$(1.3) \quad \|y(t; t_0, x_0)\| \xrightarrow[\|x_0\| \leq \delta(t_0)]{} 0 \quad \text{при } t \rightarrow \infty$$

т. е. для любого $\varepsilon > 0$ найдется $T(\varepsilon, t_0) > 0$, при котором из $\|x_0\| \leq \delta$ следует $\|y(t; t_0, x_0)\| < \varepsilon$ для всех $t \geq t_0 + T$.

Замечание. В отличие от определения, принятого в [2], число $\delta(t_0)$ может зависеть от t_0 .

В работе [3] доказана общая теорема об асимптотической y -устойчивости. Оказывается, что условия этой теоремы гарантируют равномерность по x_0 .

Теорема 1. Если непрерывная функция $V(t, x)$ такова, что

$$(1.4) \quad V(t, x) \geq a(\|y\|) \quad (a(0) = 0)$$

где $a(r)$ — непрерывная монотонно возрастающая на $[0, H]$ функция, и для любого $t_0 \geq 0$ существует $\delta(t_0) > 0$ такое, что из $\|x_0\| \leq \delta$ следует $V(t, x(t; t_0, x_0)) \downarrow 0^1$ при $t \rightarrow \infty$, то движение $x = 0$ асимптотически у-устойчиво равномерно по x_0 .

Доказательство. Движение $x = 0$ асимптотически у-устойчиво [3]. Покажем, что

$$(1.5) \quad V(t, x(t; t_0, x_0)) \xrightarrow[\|x_0\| \leq \delta(t_0)]{} 0 \quad \text{при } t \rightarrow \infty$$

По условию, для любых $\varepsilon > 0$, $t_0 \geq 0$ и x_0 с $\|x_0\| \leq \delta(t_0)$ найдется $T(\varepsilon, t_0, x_0) > 0$, при котором $V(t_0 + T, x(t_0 + T; t_0, x_0)) < \varepsilon$. В силу непрерывности функции V и непрерывной зависимости решения от начальных условий существует такая окрестность $O(x_0)$ точки x_0 , что

$$(1.6) \quad V(t_0 + T, x(t_0 + T; t_0, x_0')) < \varepsilon \quad \text{при } x_0' \in O(x_0)$$

Ввиду монотонного убывания функции V из (1.6) следует

$$V(t, x(t; t_0, x_0')) < \varepsilon \quad \text{при } t \geq t_0 + T(\varepsilon, t_0, x_0), \quad x_0' \in O(x_0)$$

Компактная область $\|x_0\| \leq \delta$ оказывается покрытой системой окрестностей $\{O(x_0)\}$, из которой можно выделить конечное подпокрытие O_1, \dots, O_s с соответствующими числами T_1, \dots, T_s . Положим $T(\varepsilon, t_0) = \max\{T_1, \dots, T_s\}$. Тогда $V(t, x(t; t_0, x_0)) < \varepsilon$ для всех $t \geq t_0 + T(\varepsilon, t_0)$, если только $\|x_0\| \leq \delta(t_0)$, что и доказывает (1.5). Из (1.5), согласно (1.4), вытекает (1.3). Теорема доказана.

Замечания. 1) Аналогичные рассуждения могут применяться [4] к системам с бесконечным числом степеней свободы.

2) Теорема 1 устанавливает аналогию между некоторыми свойствами функций Ляпунова и равномерной сходимостью функциональных рядов и последовательностей, удовлетворяющих условиям теоремы Дини [5].

Следствие 1 [6]. Если система (1.1) ω -периодична по t , а ее правые части в окрестности точки $x = 0$ удовлетворяют условию Липшица по x , и выполнены условия теоремы 1, то движение $x = 0$ асимптотически у-устойчиво равномерно по $\{t_0, x_0\}$.

Действительно, по теореме 1 существует такое $\delta(0) = \delta_0 > 0$, что

$$\|y(t; 0, x_0)\| \xrightarrow[\|x_0\| \leq \delta_0]{} 0 \quad \text{при } t \rightarrow \infty$$

Но тогда движение $x = 0$ асимптотически у-устойчиво равномерно по $\{t_0, x_0\}$ из области $t_0 \geq 0, \|x_0\| \leq \lambda$, где $\lambda > 0$ таково, что $\|x(\omega; \tau, x_0)\| \leq \delta_0$, если $\tau \in [0, \omega], \|x_0\| \leq \lambda$.

¹ Запись $V \downarrow 0$ означает « V стремится к нулю, монотонно убывая (в широком смысле)».

Таким образом, в теореме 1 работы [6] можно отказаться от требования ω -периодичности по t функции V .]

Аналогичные дополнения справедливы для теорем [4,7].

Следствие 2 [4]. Если функция $V(t, x)$ удовлетворяет неравенству (1.4), ее производная $V'(t, x) \leq -W(t, x)$, причем $W(t, x) \geq b(\|y\|)$ ($b(r)$ — функция типа $a(r)$), а $W' \leq 0$, то движение $x = 0$ асимптотически y -устойчиво равномерно по x_0 . Если, кроме того, система (1.1) ω -периодична по t , то асимптотическая y -устойчивость равномерна по $\{t_0, x_0\}$.

Следствие 3 [7]. Если функция $V(t, x)$ удовлетворяет неравенству (1.4), $V' \leq 0$, и для любого $\eta > 0$ из $V(\tau, x) \geq \eta$, $\|y\| \leq H$ следует $V'(\tau, x) \leq -m_\eta(\tau)$, причем

$$\int_0^{\infty} m_\eta(\tau) d\tau = +\infty$$

то движение $x = 0$ асимптотически y -устойчиво равномерно по x_0 . Если, кроме того, система (1.1) ω -периодична по t , то асимптотическая y -устойчивость равномерна по $\{t_0, x_0\}$.

Доказательство. Если выполнены условия следствия 2 (следствия 3), то, как показано в [4] (в [7]), для любого $t_0 \geq 0$ существует $\delta(t_0) > 0$ такое, что из $\|x_0\| \leq \delta$ следует

$$W(t, x(t; t_0, x_0)) \downarrow 0 \quad (V(t, x(t; t_0, x_0)) \downarrow 0) \text{ при } t \rightarrow \infty.$$

Поэтому применимы теорема 1 и следствие 1, что и завершает доказательство¹.

2. Рассматривается автономная система

$$(2.1) \quad \dot{x} = X(x)$$

В работах [3,8] для системы (2.1) предложены критерии асимптотической y -устойчивости и y -неустойчивости, использующие функции $V(x)$ со знакопостоянной производной V' при некоторых требованиях к множеству $M = \{x: V'(x) = 0\}$. Эти условия на множество M можно несколько ослабить.

Теорема 2 [3,8]. Предположим, что каждое решение системы (2.1), начинающееся в некоторой окрестности точки $x = 0$, ограничено, и пусть функция $V(x)$ такова, что $V(x) \geq a(\|y\|)$, а ее [производная в силу системы (2.1)

$$(2.2) \quad V'(x) = 0 \text{ при } x \in M, \quad V'(x) < 0 \text{ при } x \in \bar{M}$$

¹ *Дополнение при корректуре.* Недавно автору стала известна работа [14], опубликованная после того, как настоящая статья была сдана в печать. Оказалось, что в следствии 2 условия на функцию V можно несколько ослабить, заменив неравенство (1.4) требованием ограниченности снизу функции V . При этом доказательство [4] того, что $W(t, x(t; t_0, x_0)) \downarrow 0$ при $t \rightarrow \infty$, сохраняется.

Обозначим $M_1 = \{x: V(x) > 0\}$, $M_0 = M_1 \cap M$. Если множество M_0 не содержит целых траекторий¹ при $t \in [0, \infty)$, то движение $x = 0$ асимптотически y -устойчиво равномерно по $\{t_0, x_0\}$.

Доказательство. В силу y -устойчивости движения $x = 0$ для любого $\varepsilon \in (0, H)$ существует $\delta(\varepsilon) > 0$ такое, что из $\|x_0\| \leq \delta$ следует $\|y(t; 0, x_0)\| < \varepsilon$ при всех $t \geq 0$. Покажем, что из $\|x_0\| \leq \delta$ вытекает $V(x(t; 0, x_0)) \downarrow 0$ при $t \rightarrow \infty$. Ввиду $V \leq 0$ существует $\lim V(x(t; 0, x_0)) = V_* \geq 0$ при $t \rightarrow \infty$. Если $V_* > 0$, то

$$(2.3) \quad V(x(t; 0, x_0)) \geq V_* > 0 \quad \text{при } t \geq 0$$

В силу ограниченности решения, для некоторой последовательности $t_k \rightarrow \infty$ будет $x(t_k; 0, x_0) \rightarrow x_*$, причем по непрерывности $V(x_*) = V_*$. Если допустить, что $V(x(t; 0, x_*)) \equiv V_* > 0$ при $t \geq 0$, то $V(x(t; 0, x_*)) \equiv 0$, и, следовательно, $x(t; 0, x_*) \in M_1 \cap M = M_0$, что противоречит условию. Поэтому при некотором $T > 0$ будет $V(x(T; 0, x_*)) < V_*$. В силу непрерывной зависимости решения от начальных условий и непрерывности функции V для числа $T > 0$ существует такое N , что при всех $k > N$

$$(2.4) \quad V(x(T; 0, x(t_k; 0, x_0))) < V_*$$

Используя групповое свойство автономных систем

$$x(T; 0, x(t_k; 0, x_0)) = x(T + t_k; 0, x_0)$$

из (2.4) получаем $V(x(T + t_k; 0, x_0)) < V_*$, что противоречит неравенству (2.3). Следовательно, $V_* = 0$, откуда по теореме 1 вытекает требуемый результат.

Пример [4, 6]. Рассмотрим автономную механическую систему

$$(2.5) \quad \frac{d}{dt} \frac{\partial T}{\partial \dot{q}_i} - \frac{\partial T}{\partial q_i} = - \frac{\partial U}{\partial q_i} + \sum_{j=1}^n g_{ij} \dot{q}_j - \frac{\partial f}{\partial \dot{q}_i} \quad (i = 1, \dots, n; g_{ij} = -g_{ji})$$

Взяв в качестве функции Ляпунова полную энергию $H = T + U$ системы, получим

$$(2.6) \quad \dot{H} = -2f$$

Предположим, что

- 1) система (2.5) имеет частное решение $q = \dot{q} = 0$ (положение равновесия);
- 2) потенциальная энергия $U(q_1, \dots, q_n)$ определено-положительна относительно q_1, \dots, q_m ($m < n$), а диссипативная функция $f(q_1, \dots, q_n)$ — определено-положительная относительно всех скоростей квадратичная форма;
- 3) из каких-либо механических соображений известно [6], что координаты q_{m+1}, \dots, q_n в возмущенном движении ограничены;
- 4) в множестве $U(q) > 0$ нет положений равновесия.

Учитывая (2.6), на основании теоремы 2 заключаем, что положение равновесия $q = \dot{q} = 0$ асимптотически устойчиво относительно $q_1, \dots, q_m, \dot{q}_1, \dots, \dot{q}_n$ равномерно по $\{t_0, q_0, \dot{q}_0\}$.

¹ В отличие от теоремы [3, 8] в данном случае лишь часть множества $M \setminus \{x = 0\}$ не должна содержать целые траектории.

В этом примере соответствующая теорема [3, 8] не применима: множество $H = 0$ может содержать целые траектории, отличные от $q = q' = 0$, так как положение равновесия $q = q' = 0$, вообще говоря, не изолировано.

Теорема 2 перестает быть верной, если отказаться от требования ограниченности решений, что показывает пример системы

$$y' = -\frac{y}{1+z^2}, \quad z' = z$$

Общее решение которой, не ограниченное по z , имеет вид

$$y = y_0 \exp \left[-\int_0^t \frac{d\tau}{1+z_0^2 \exp(2\tau)} \right], \quad z = z_0 \exp(t)$$

Решение $y = z = 0$ не является асимптотически y -устойчивым, так как при $z_0 \neq 0$

$$\int_0^{\infty} \frac{d\tau}{1+z_0^2 \exp(2\tau)} < +\infty$$

Однако функция $2V = y^2$ удовлетворяет условиям теоремы 2. Действительно, множество $M = \{(y, z) : V = 0\}$ есть ось $y = 0$. При $y \neq 0$ имеем $V > 0$. Поэтому пересечение $M \cap \{(y, z) : V > 0\}$ пусто и, следовательно, не содержит целых траекторий.

Теорема 3 [8]. Предположим, что: 1) каждое решение системы (2.1), начинающееся в некоторой окрестности точки $x = 0$, z -ограничено; 2) функция $V(x)$ такова, что $V(0) = 0$ и в любой окрестности начала координат существуют точки x , для которых $V(x) < 0$; 3) производная V' удовлетворяет условию (2.2).

Обозначим $M_1 = \{x : V(x) < 0\}$, а $M_0 = M_1 \cap M$. Если M_0 не содержит целых траекторий при $t \in [0, \infty)$, то движение $x = 0$ y -неустойчиво.

Доказательство. Допустим противное и выберем x_0 из условий $V(x_0) < 0$, $\|y(t; 0, x_0)\| < H$ при $t \geq 0$. Тогда

$$(2.7) \quad V(x(t; 0, x_0)) \leq V(x_0) < 0$$

и, следовательно, $\|x(t; 0, x_0)\| \geq \eta > 0$. Множество Γ^+ ω -предельных точек решения $x(t; 0, x_0)$ не пусто (в силу ограниченности решений) и инвариантно [9], причем $\Gamma^+ \subset M$ [10, 11]; в силу (2.7) $\Gamma^+ \subset M_1$. Итак, $\Gamma^+ \subset M_0 = M_1 \cap M$. Следовательно, множество M_0 содержит траекторию, что невозможно. Теорема доказана.

Теорема 4 [8]. Пусть выполнены условия 1) — 3) теоремы 3, а также 4) $V(0, z) \geq 0$ для любого z ; 5) множество $\{x : y = 0\}$ инвариантно.

Обозначим $M_1 = \{x : V(x) < 0\}$, $M_0 = M_1 \cap (M \setminus \{x : y = 0\})$. Если M_0 не содержит целых траекторий при $t \in [0, \infty)$, то движение $x = 0$ y -неустойчиво.

Доказательство. Допустим противное и выберем x_0 , как и при доказательстве теоремы 3. Множество Γ^+ не пусто. Пусть

$$\lim_{n \rightarrow \infty} x(t_n; 0, x_0) = x_* \in \Gamma^+$$

Если $\lim_{t \rightarrow \infty} \|y(t; 0, x_0)\| = 0$ при $t \rightarrow \infty$, то $y_* = 0$ и, переходя к пределу в неравенствах

$$\lim_{t \rightarrow \infty} V(x(t; 0, x_0)) \leq V(x_0) < 0$$

получим $0 \leq V(0, z_*) < V(x_0)$, что невозможно. Следовательно, $\|y(t_n; 0, x_0)\| \geq \eta > 0$ для некоторой последовательности $t_n \rightarrow \infty$, и можно считать $y_* \neq 0$. Согласно 5), $\|y(t; 0, x_*)\| \neq 0$ при всех $t \geq 0$, откуда в силу инвариантности Γ^+ и свойств $\Gamma^+ \subset M$ и $\Gamma^+ \subset M_1$ следует $x(t; 0, x_*) \in M_1 \cap (M \setminus \{x: y = 0\})$ при любом $t \geq 0$, что невозможно. Теорема доказана.

3. Рассмотрим линейную систему

$$(3.1) \quad x' = Lx$$

где L — постоянная матрица. Известна следующая теорема.

Теорема А¹. Для того, чтобы решение $x = 0$ системы (3.1) было асимптотически устойчивым по m переменным y_1, \dots, y_m ², необходимо и достаточно, чтобы система (3.1) имела вид

$$(3.2) \quad y' = Ay, \quad z' = By + Cz$$

(A, B и C — матрицы соответствующих порядков), а корни уравнения $\det(A - \lambda E) = 0$ имели отрицательные действительные части.

Рассмотрим возмущенную систему

$$(3.3) \quad y' = Ay + f(t, y, z), \quad z' = By + Cz + g(t, y, z)$$

Теорема 5. Если $\operatorname{Re} \lambda_j(A) < 0$ и в области (1.2)

$$(3.4) \quad \|f(t, y, z)\| \leq h \|y\|$$

где h — достаточно малая постоянная, то движение $x = 0$ системы (3.3) экспоненциально-асимптотически y -устойчиво равномерно по $\{t_0, y_0\}$ в целом по z_0 , т. е.

$$\|y(t; t_0, x_0)\| \leq M \|y_0\| \exp[-\alpha(t - t_0)]$$

$$(M > 0, \alpha > 0 - \text{const}, 0 \leq \|z_0\| < \infty)$$

Доказательство. По условию $\operatorname{Re} \lambda_j(A) < 0$, поэтому, согласно теореме Ляпунова, уравнение $\operatorname{grad} V(y) \cdot Ay = -\|y\|^2$ имеет однозначное решение в виде определенно-положительной квадратичной формы $V(y)$. Ее производная в силу (3.3)

$$V'(t, y, z) = -\|y\|^2 + \operatorname{grad} V(y) \cdot f(t, y, z)$$

При достаточно малом h имеем [12] $V' \leq -\beta V$ ($\beta = \text{const} > 0$), откуда и вытекает требуемый результат.

Замечание. Согласно (3.4), $f(t, 0, z) \equiv 0$, поэтому условие [13] $Y(t, 0, z) \equiv 0$ здесь выполнено.

Условие (3.4) легко проверяется, если пространство R_z компактно. Однако оно является весьма жестким, если рассматривается неограничен-

¹ Peiffer K. La méthode direct de Liapounoff appliquée à l'étude de la stabilité partielle (Dissertation). Université Catholique de Louvain, Faculté des sciences, 1968.

² По смыслу теоремы здесь предполагается, что решение $x = 0$ не является асимптотически устойчивым по большему, чем m , числу переменных.

ная область (1.2). Это неудобство устраняется, если заранее известна z -ограниченность решений.

Напомним [7], что решения системы (3.3) называются z -ограниченными равномерно по $\{t_0, x_0\}$, если для любого компакта $K \subset R_x$ существует постоянная $N(K)$ такая, что из $t_0 \geq 0, x_0 \in K$ следует

$$(3.5) \quad \|z(t; t_0, x_0)\| \leq N \quad \text{при} \quad t \geq t_0$$

Критерий такой ограниченности дан в [7].

Теорема 6. Если выполнено условие (3.5), где $K = \{x: \|x\| \leq \delta\}$ с достаточно малым $\delta > 0, \operatorname{Re} \lambda_j(A) < 0$ и

$$(3.6) \quad \|f(t, y, z)\| \leq h \|y\| \quad \text{при} \quad t \geq 0, \|z\| \leq N$$

($h = \operatorname{const} > 0$ — достаточно мало), то движение $x = 0$ системы (3.3) экспоненциально-асимптотически y -устойчиво.

Доказательство. Выбрав функцию $V(y)$, как и при доказательстве теоремы 5, для решений $x(t; t_0, x_0)$ с $\|x_0\| \leq \delta$ при достаточно малом h получим ($\beta = \operatorname{const} > 0$)

$$\frac{d}{dt} V(y(t; t_0, x_0)) = V'(t, x(t; t_0, x_0)) \leq -\beta \|y(t; t_0, x_0)\|^2$$

откуда вытекает требуемый результат.

Условие (3.6) выполняется для широкого класса функций, например, для многочленов (сумма конечная)

$$f_j(t, y, z) = \sum a_{i_1 \dots i_m k_1 \dots k_p}^{(j)} y_1^{i_1} \dots y_m^{i_m} z_1^{k_1} \dots z_p^{k_p}$$

с $i_1 + \dots + i_m \geq 2$, непрерывными и ограниченными коэффициентами a .

Автор благодарит В. В. Румянцеву за внимание к работе.

Поступила 14 XI 1972

ЛИТЕРАТУРА

1. Озиранер А. С., Румянцев В. В. Метод функций Ляпунова в задаче об устойчивости движения относительно части переменных. ПММ, 1972, т. 36, вып. 2.
2. Красовский Н. Н. Некоторые задачи теории устойчивости движения. М., Физматгиз, 1959.
3. Румянцев В. В. Об асимптотической устойчивости и неустойчивости движения по отношению к части переменных. ПММ, 1971, т. 35, вып. 1.
4. Озиранер А. С. Об устойчивости положений равновесия твердого тела с полостью, содержащей жидкость. ПММ, 1972, т. 36, вып. 5.
5. Фихтенгольц Г. М. Курс дифференциального и интегрального исчисления, т. 2. М., «Наука», 1966.
6. Озиранер А. С. Об асимптотической устойчивости относительно части переменных. Вестн. МГУ. Сер. матем., механ., 1972, № 1.
7. Озиранер А. С. О некоторых теоремах второго метода Ляпунова. ПММ, 1972, т. 36, вып. 3.
8. Risito C. Sulla stabilità asintotica parziale. Ann. di Math. pura ed appl., 1970, Ser. 4, vol. 84, p. 279—292.
9. Немыцкий В. В., Степанов В. В. Качественная теория дифференциальных уравнений. М.—Л., Гостехиздат, 1949.
10. Ла-Салль Ж., Лефшец С. Исследование устойчивости прямым методом Ляпунова. М., «Мир», 1964.
11. Барбашин Е. А. Введение в теорию устойчивости. М., «Наука», 1967.
12. Малкин И. Г. Теория устойчивости движения. М., «Наука», 1966.
13. Озиранер А. С. К вопросу об устойчивости движения относительно части переменных. Вестн. МГУ. Сер. матем., механ., 1971, № 1.
14. Salvadori L. Sul problema della stabilità asiwtotica. Meccanica. J. of Italian Association of Theor. and Appl. Mec., 1972, vol 7, № 4.