

一类 $2n$ 次 Kolmogorov 系统的极限环*

The Limit Cycle of a Class of $2n$ -degree Kolmogorov's System

张理, 黄文韬

ZHANG Li, HUANG Wen-tao

(桂林电子工业学院计算科学与数学系, 广西桂林 541004)

(Department of Computational Science and Mathematics, Guilin University of Electronic Technology, Guilin, Guangxi, 541004, China)

摘要:研究一类 $2n$ 次 Kolmogorov 系统 $\begin{cases} \frac{dx}{dt} = x(a_0 - a_1x + a_3x^3 - a_4x^4 + a_5xy^{2n-1}), \\ \frac{dy}{dt} = y(b_1x^{2n} - b_2), \end{cases}$ 极限环的存在性问题. 主要讨论 $a_5 > 0$ 和 $a_5 < 0$ 两种情形. 当 $a_5 > 0$ 时, 系统在第一象限内不存在极限环; 当 $a_5 < 0$ 时, 得到了平衡点的稳定性态, 系统无闭轨的充分条件以及在第一象限内存在稳定极限环的条件.

关键词:Kolmogorov 系统 极限环 闭轨**中图法分类号:**O175.1 **文献标识码:**A **文章编号:**1005-9164(2006)03-0180-04**Abstract:** The problem about the existence of a limit cycle of a class of $2n$ -degree Kolmogorov's system
$$\begin{cases} \frac{dx}{dt} = x(a_0 - a_1x + a_3x^3 - a_4x^4 + a_5xy^{2n-1}), \\ \frac{dy}{dt} = y(b_1x^{2n} - b_2), \end{cases}$$
 is studied, and the system is discussed mainly when $a_5 > 0$ and $a_5 < 0$, respectively. A system has not limit cycles in the first quadrant when $a_5 > 0$. The stability of equilibrium, the sufficient conditions of nonexistence of closed orbits and the conditions of existence of a stable limit cycles of the system in the first quadrant are obtained when $a_5 < 0$.
Key words:Kolmogorov's system, limit cycle, closed orbit

关于两种群相互作用的一般模型

$$\begin{cases} \frac{dx}{dt} = xF_1(x, y), \\ \frac{dy}{dt} = yF_2(x, y), \end{cases} \quad (1)$$

称之为 Kolmogorov 生态系统模型, 它描述的是两种群之间的捕食与被捕食作用、相互竞争作用以及互惠共存作用, 其中 x, y 分别表示两种群的密度, 根据生态学意义它们在区域 $G = \{(x, y) | x \geq 0, y \geq 0\}$ 中变动, 对 $F_1(x, y), F_2(x, y)$ 均为二次多项式的系统已有

大量的研究^[1~3]. 文献[4,5]分别讨论了一类 n 次和 $n+1$ 次 Kolmogorov 系统极限环的存在性问题, 其中 $F_1(x, y)$ 是 n 次和 $n+1$ 次多项式, 而 $F_2(x, y)$ 只是二次和三次多项式. 考虑一类 $2n$ 次 Kolmogorov 系统

$$\begin{cases} \frac{dx}{dt} = x(a_0 - a_1x + a_3x^3 - a_4x^4 + a_5xy^{2n-1}), \\ \frac{dy}{dt} = y(b_1x^{2n} - b_2), \end{cases} \quad (2)$$

其中 $a_0, b_1, b_2 > 0, a_1, a_3, a_4, a_5$ 不定号, 且 $\frac{a_1}{a_0} = \frac{a_4}{a_3}, a_3a_5 \neq 0, n \geq 3, n \in N$, 它们各代表一定的生态学意义^[1]. 本文主要在区域 G 上讨论系统(2)平衡点的性质以及在第一象限内极限环的存在性.

收稿日期: 2005-11-15

修回日期: 2006-03-16

作者简介: 张理(1980-), 男, 安徽安庆人, 桂林电子工业学院计算科学与数学系硕士研究生, 主要从事微分方程定性理论方面的研究。

* 广西科学基金(0575092)资助。

1 $a_5 > 0$ 的情形

作变换

$$x = (\frac{b_2}{b_1})^{\frac{1}{2n}} \bar{x}, y = (\frac{a_0}{a_5})^{\frac{1}{2n-1}} (\frac{b_1}{b_2})^{\frac{1}{2n(2n-1)}} \bar{y}, t = \frac{1}{a_0} \bar{t},$$

那么系统(2)的轨线走向不变,仍记 $\bar{x}, \bar{y}, \bar{t}$ 为 x, y, t , 则系统(2)可化为等价系统

$$\begin{cases} \frac{dx}{dt} = x(1 - A_1x + A_3x^3 - A_4x^4 + xy^{2n-1}) \triangleq \\ P_1(x, y), \\ \frac{dy}{dt} = yA_0(x^{2n} - 1) \triangleq Q_1(x, y), \end{cases} \quad (3)$$

$$\text{其中 } A_0 = \frac{b_2}{a_0} > 0, A_1 = \frac{a_1}{a_0} \sqrt[n]{\frac{b_2}{b_1}}, A_3 = \frac{a_3}{a_0} \sqrt[2n]{(\frac{b_2}{b_1})^3},$$

$$A_4 = \frac{a_4}{a_0} \sqrt[2n]{(\frac{b_2}{b_1})^4}, A_1, A_3, A_4 \text{ 不定号, 易知 } A_1A_3 = A_4.$$

$$\text{记 } \lambda = 1 - A_1 + A_3 - A_4, x_1 = 1/A_1, x_2 =$$

$-\sqrt[3]{1/A_3}$, 若 $\lambda \geq 0$ 时, 系统(3)在 G 内除平衡点 $(0, 0), A(x_1, 0), B(x_2, 0)$ 外再无其它的平衡点, 故在第一象限内不存在极限环. 若 $\lambda < 0$, 则系统(3)在 G 上有 4 个平衡点 $O(0, 0), A(x_1, 0), B(x_2, 0), C(1, y_1)$ (其中 $y_1 = \sqrt[2n-1]{-\lambda} > 0$).

定理 1.1 (I) 平衡点 $O(0, 0)$ 是系统(3)的鞍点; 当 $\lambda < 0$ 时, 平衡点 $C(1, y_1)$ 是系统(3)的鞍点.

(II) 当 $(1 + A_0)A_1^{2n} \neq A_0 - A_3A_1^{2n-3}$ 时, 若 $A_1 > 1$, 则平衡点 $A(x_1, 0)$ 是系统(4)的鞍点或稳定结点; 若 $0 < A_1 < 1$, 则平衡点 $A(x_1, 0)$ 是系统(4)的鞍点或不稳定结点.

(III) 当 $A_0 - 3A_1 \sqrt[3]{A_3^{2n-1}} \neq (3 + A_0) \sqrt[3]{A_3^{2n}}$ 时, 若 $A_3 < -1$, 则平衡点 $B(x_2, 0)$ 是系统(4)的鞍点或稳定结点; 若 $-1 < A_3 < 0$, 则平衡点 $B(x_2, 0)$ 是系统(4)的鞍点或不稳定结点.

证明 由系统(3)知

$$\begin{aligned} \frac{\partial P_1(x, y)}{\partial x} &= 1 - 2A_1x + 4A_3x^3 - 5A_4x^4 + \\ &2xy^{2n-1}, \frac{\partial P_1(x, y)}{\partial y} = (2n-1)x^2y^{2n-2}, \frac{\partial Q_1(x, y)}{\partial x} = \\ &2nA_0yx^{2n-1}, \frac{\partial Q_1(x, y)}{\partial y} = A_0(x^{2n} - 1). \end{aligned}$$

$$\text{令 } p_1(x, y) = \frac{\partial P_1(x, y)}{\partial x} + \frac{\partial Q_1(x, y)}{\partial y},$$

$$q_1(x, y) = \frac{\partial P_1(x, y)}{\partial x} \cdot \frac{\partial Q_1(x, y)}{\partial y} - \frac{\partial Q_1(x, y)}{\partial x} \cdot \frac{\partial P_1(x, y)}{\partial y}.$$

(I) 因为 $q_1(0, 0) = -A_0 < 0$, 所以平衡点 $O(0, 0)$ 是鞍点. 又 $q_1(1, y_1) = 2n(2n-1)A_0\lambda$, 故 $\lambda < 0$ 时, 平衡点 $C(1, y_1)$ 是系统(3)的鞍点.

$$\begin{aligned} (\text{II}) \quad q(x_1, 0) &= -A_0(1 + A_3x_1^3)(x_1^{2n} - 1), \\ p(x_1, 0) &= -(1 + A_3x_1^3) + A_0(x_1^{2n} - 1). \end{aligned}$$

当 $A_1 > 1$ 时, ①若 $A_3 > -A_1^3$, 即 $1 + A_3x_1^3 > 0$, 则 $q(x_1, 0) < 0$, 故平衡点 A 为鞍点; ②若 $A_3 < -A_1^3$, 又 $(1 + A_0)A_1^{2n} \neq A_0 - A_3A_1^{2n-3}$, 则 $q(x_1, 0) > 0$, $P(x_1, 0) < 0, \Delta = p^2(x_1, 0) - 4q(x_1, 0) > 0$, 故平衡点 A 为稳定的结点. 同理当 $0 < A_1 < 1$ 时, 则平衡点 A 为鞍点或不稳定结点. 即结论(II)成立.

(III) 在平衡点 $B(x_2, 0)$ 处有

$$q_1(x_2, 0) = 3A_0(-1 + A_1x_2)(x_2^{2n} - 1), p_1(x_2, 0) = 3(-1 + A_1x_2) + A_0(x_2^{2n} - 1), \text{ 当 } A_3 < -1 \text{ 时,}$$

①若 $A_3 + A_1^3 > 0$, 则 $q(x_2, 0) < 0$, 故平衡点 B 为鞍点; ②若 $A_3 + A_1^3 > 0$, 则有 $q_1(x_2, 0) > 0, p_1(x_2, 0) > 0, \Delta = p_1^2(x_2, 0) - 4q_1(x_2, 0) > 0$, 则平衡点 B 是稳定的结点; 同理可以证明当 $-1 < A_3 < 0$ 时, 则平衡点 B 是鞍点或不稳定结点. 证毕.

由定理1.1知, 系统(3)在第一象限内不存在极限环.

2 $a_5 < 0$ 的情形

作变换

$$x = (\frac{b_2}{b_1})^{\frac{1}{2n}} \bar{x}, y = (-\frac{a_0}{a_5})^{\frac{1}{2n-1}} (\frac{b_1}{b_2})^{\frac{1}{2n(2n-1)}} \bar{y}, t = \frac{1}{a_0} \bar{t},$$

仍记 $\bar{x}, \bar{y}, \bar{t}$ 为 x, y, t , 则系统(2)化为等价系统

$$\begin{cases} \frac{dx}{dt} = x(1 - A_1x + A_3x^3 - A_4x^4 - xy^{2n-1}) \triangleq \\ P(x, y), \\ \frac{dy}{dt} = yA_0(x^{2n} - 1) \triangleq Q(x, y), \end{cases} \quad (4)$$

$$\begin{aligned} \text{其中 } A_0 &= \frac{b_2}{a_0} > 0, A_1 = \frac{a_1}{a_0} \sqrt[n]{\frac{b_2}{b_1}}, A_3 = \frac{a_3}{a_0} \sqrt[2n]{(\frac{b_2}{b_1})^3}, \\ A_4 &= \frac{a_4}{a_0} \sqrt[2n]{(\frac{b_2}{b_1})^4}, A_1, A_3, A_4 \text{ 符号不定, 容易看出 } A_1A_3 = A_4. \end{aligned}$$

2.1 平衡点的性态

记 $\lambda = 1 - A_1 + A_3 - A_4, x_1 = 1/A_1, x_2 = -\sqrt[3]{1/A_3}, h = -1 + 2A_3 - 3A_4$, 若 $\lambda \leq 0$ 时, 系统(4)在 G 内只有平衡点 $(0, 0), A(x_1, 0), B(x_2, 0)$, 故在第一象限内系统(4)不存在极限环. 因而讨论系统(4)的极限环, 只需考虑 $\lambda > 0$ 的情形, 当 $\lambda > 0$ 时系统(4)在 G 上有 4 个平衡点 $O(0, 0), A(x_1, 0), B(x_2, 0), C(1, y_2)$ (其中 $y_2 = \sqrt[2n-1]{\lambda} > 0$).

定理 2.1 (I) 平衡点 $O(0, 0)$ 是系统(4)的鞍点.

(Ⅱ) 当 $\lambda > 0$ 时, 若 $h > 0$, 则平衡点 $C(1, y_2)$ 为系统(4)的不稳定的焦点或结点; 若 $h < 0$, 则平衡点 $C(1, y_2)$ 为系统(4)的稳定的焦点或结点.

(Ⅲ) 当 $(1 + A_0)A_1^{2n} \neq A_0 - A_3A_1^{2n-3}$ 时, 若 $A_1 > 1$, 则平衡点 $A(x_1, 0)$ 是系统(4)的鞍点或稳定结点; 若 $0 < A_1 < 1$, 则平衡点 $A(x_1, 0)$ 是系统(4)的鞍点或不稳定结点.

(Ⅳ) 当 $A_0 - 3A_1\sqrt[3]{A_3^{2n-1}} \neq (3 + A_0)\sqrt[3]{A_3^{2n}}$ 时, 若 $A_3 < -1$, 则平衡点 $B(x_2, 0)$ 是系统(4)的鞍点或稳定结点; 若 $-1 < A_3 < 0$, 则平衡点 $B(x_2, 0)$ 是系统(4)的鞍点或不稳定结点.

证明 令

$$p(x, y) = \frac{\partial P(x, y)}{\partial x} + \frac{\partial Q(x, y)}{\partial y}, q(x, y) = \frac{\partial P(x, y)}{\partial x} \cdot \frac{\partial Q(x, y)}{\partial y} - \frac{\partial Q(x, y)}{\partial x} \cdot \frac{\partial P(x, y)}{\partial y}.$$

由系统(4)知

$$q(0, 0) = -A_0 < 0, q(1, y_2) = 2n(2n-1)A_0\lambda > 0, p(1, y_2) = -1 + 2A_3 - 3A_4 = h,$$

因此平衡点 $O(0, 0)$ 是系统(4)的鞍点, 即(I)成立. 当 $h < 0$ 时, 正平衡点 C 为稳定的焦点或结点; 当 $h > 0$ 时, 正平衡点 C 为不稳定的焦点或结点, 这时(Ⅱ)成立.

由定理 1.1 可知(Ⅲ)和(Ⅳ)成立.

2.2 闭轨线的不存在性

定理 2.2 如果 $0 < A_1 < 1, 0 < A_3 < 4A_1^3$ 且 $h < 0$, 那么系统(4)在 G 内无闭轨.

证明 假设系统(4)在 G 内存在闭轨 L , 则闭轨必存在于带状区域 $E = \{(x, y) | 0 \leq x \leq x_1, y \geq 0\}$ 内. 不妨设 L 是距离平衡点 $C(1, y_2)$ 最近的一条闭轨线, T 是 L 的周期, 则系统(4)沿 L 的发散量积分为

$$\oint_L \text{div}(P, Q) dt = \int_0^T \left(\frac{\partial P}{\partial x} + \frac{\partial Q}{\partial y} \right) dt = - \int_0^T x(4A_4x^3 - 3A_3x^2 + A_1) dt - \int_0^T xy^{2n-1} dt.$$

记 $H(x) = 4A_4x^3 - 3A_3x^2 + A_1$, 则 $H'(x) = 12A_4x^2 - 6A_3x$, 令 $H'(x) = 0$, 得 $x = x^* = \frac{1}{2A_1}$, 于是 $\min_{0 \leq x \leq x'} H(x) = \min\{H(0), H(x_1), H(x^*)\}$,

$$H(x^*) = -\frac{A_3 - 4A_1^3}{4A_1^2} > 0, H(0) = A_1 > 0,$$

$H(x_1) = \frac{A_1^3 + A_3}{A_1^2} > 0$, 故 $H(x) > 0$, 从而发散量积

分 $\oint_L \text{div}(P, Q) dt < 0$, 由极限环指数理论^[6] 知 L 是稳定的极限环, 于是平衡点 $C(1, y_2)$ 是不稳定的, 但若 $0 < A_1 < 1, 0 < A_3 < 4A_1^3$, 则 $\lambda > 0$, 又 $h < 0$, 从

定理 2.1 中可知平衡点 $C(1, y_2)$ 是稳定的, 矛盾, 因此定理得证.

2.3 极限环的存在性

定理 2.3 如果 $0 < A_1 < 1, A_3 > 0$ 且 $h > 0$, 那么系统(4)在第一象限内围绕 $C(1, y_2)$ 至少存在一个稳定的极限环.

证明 由定理 2.1 知, 当 $0 < A_1 < 1, A_3 > 0$ 且 $h < 0$ 时, $\lambda > 0$, C 是不稳定的指标为 +1 的非中心平衡点, 这时 $x_1 = \frac{1}{A_1} > 1$, 平衡点 C 位于 $x = x_1$ 左侧.

作直线 $L_1: x - x_1 = 0$, 因为

$$\frac{dL_1}{dt}|_{(4)} = \frac{dx}{dt}|_{L_1=0} = -x_1^2y^{2n-1} < 0,$$

当 $y > 0$ 时, 系统(4)的轨线通过直线 L_1 时, 在上半平面 ($y > 0$) 是定号的(由外向内穿入), 即直线 L_1 在上半平面是系统(4)的无切直线.

作直线 $L_2: x + \ln y - k = 0$, 因为

$$\frac{dL_2}{dt}|_{(4)} = \left(\frac{dx}{dt} + \frac{1}{y} \frac{dy}{dt} \right)|_{L_2=0} = x - A_1x^2 + A_3x^4 - A_4x^5 - x^2e^{(2n-1)(k-x)} + A_0(x^{2n} - 1),$$

令 $\zeta(x) = x + \frac{1}{2n-1} \ln \left[\frac{1}{x} - \frac{A_0}{x^2} - A_1 + A_3x^2 - A_4x^3 + A_0x^{2(n-1)} \right]$, M 表示 $\zeta(x)$ 上确界, 取 $k > \max\{M, \lambda + 1\}$, 则 $\frac{dL_2}{dt}|_{(4)} < 0$, 即系统(4)的轨线通过直线 L_2 时是定号的(由上而下穿入), 直线 L_2 是系统(4)的无切直线.

而直线 $L_3: x = 0$ 与 $L_4: y = 0$ 是系统(4)的积分直线, 所以 L_1, L_2, L_3 和 L_4 所围成区域构成一个 Poincare-Bendixson 环域, 在此环域内除了 C 点外再无其它的平衡点, 且 C 点不稳定, 根据环域理论^[7] 可知系统(4)在第一象限围绕点 $C(1, y_2)$ 至少存在一个稳定的极限环.

定理 2.4 如果 $A_1 < 0, A_3 > 0$ 且 $(3 - 2n)^4 A_3 < 256n(n-2)^3 A_1^3$, 那么系统(4)在第一象限内围绕 $C(1, y_2)$ 至多存在一个稳定的极限环.

证明 作变换

$$z = x - 1, w = y - \sqrt[2n-1]{\lambda},$$

系统(4)变为

$$\begin{cases} \frac{dz}{dt} = (z+1)[1 - A_1(z+1) + A_3(z+1)^3 - A_4(z+1)^4 - (z+1)(w + \sqrt[2n-1]{\lambda})^{2n-1}], \\ \frac{dw}{dt} = A_0(w + \sqrt[2n-1]{\lambda})[(z+1)^{2n} - 1]. \end{cases} \quad (5)$$

再作变换

$$z = u, w = \sqrt[2n-1]{\lambda}(e^v - 1), \tau = (u+1)^2 t,$$

