Review

Thm. (Cauchy-Picard)设f(x, y)在矩形

$$D = \{(x, y) : |x - x_0| \le a, |y - y_0| \le b\}$$

中连续,并且关于变元 y 满足 Lipschitz 条件,则

存在正数 h, 使得一阶常微分方程的初值问题

$$y'(x) = f(x, y), y(x_0) = y_0$$

在[$x_0 - h, x_0 + h$]上存在唯一的解. 其中,

$$h = \min\{a, b/\mathbf{M}\}, |f(x, y)| \le \mathbf{M}, \forall (x, y) \in D.$$

•解的存在唯一性定理的几何解释

Thm.设p(x),q(x)在区间I上连续, $x_0 \in I$,则对任意 $y_0 \in \mathbb{R}$,一阶线性常微分方程的初值问题

$$\begin{cases} y'(x) = p(x)y + q(x) \\ y(x_0) = y_0 \end{cases}$$

在整个区间/上存在唯一解.

Thm. 设函数 $a_k(t)(k=1,2,\cdots,n)$ 和f(t)都在区间I上连续, $t_0 \in I$,则对任意实数 $\xi_k(k=0,1,\cdots,n-1)$,定解问题

$$\begin{cases} x^{(n)} + a_1(t)x^{(n-1)} + \dots + a_{n-1}(t)x' + a_n(t)x = f(t) \\ x(t_0) = \xi_0, x'(t_0) = \xi_1, \dots, x^{(n-1)}(t_0) = \xi_{n-1} \end{cases}$$

在区间I上存在唯一解x(t).

§ 2. 一阶ODE的初等解法

Leibnitz曾经专门从事利用变量替换的办法来解决一阶微分方程的求解问题,而Euler则试图利用积分因子的办法统一处理这一问题.但实践证明,单纯采用一种方法各有其不便和困难.因此必须对具体问题具体分析.

有初等解法的微分方程是很有限的,例如形式上很简

单的Riccati方程 $\frac{dy}{dx} = p(x)y^2 + q(x)y + r(x)$ 一般就没有

初等解法.法国数学家Liouville在1841年证明了这一事实, 这就促使人们寻求别的方法来研究微分方程的求解问题.

目的与要求

- ●熟悉各种类型方程的解法,正确而又敏捷地判断 一个给定的方程属于何种类型,从而循法求解.
- •学习解题技巧,总结经验,培养机智与灵活性.
- ●善于根据方程的特点,引进适宜的变换,将方程化 为能求解的新类型.

1.变量分离方程 ------形如 $\frac{dy}{dx} = f(x)g(y)$

$$\frac{\mathrm{d}y}{g(y)} = f(x)\mathrm{d}x, \quad \int \frac{\mathrm{d}y}{g(y)} = \int f(x)\mathrm{d}x + c.$$

此外, 若g(c) = 0, 方程还有常数解 y = c.

Question. 若 f, g' 连续,是否存在这样的解,s.t.

$$y(x_0) = c, y \neq c, g(c) = 0$$
?

不存在! 由解的存在唯一性定理可证.

Ex. 求解初值问题
$$\frac{dy}{dx} = y^2 \cos x$$
, $y(0) = 1$.

解:分离变量, 得 $\frac{1}{y^2}$ dy = cos xdx.

两边积分,得
$$-\frac{1}{y} = \sin x + c$$
. 通解为 $y = -\frac{1}{\sin x + c}$.

令x = 0, y = 1得c = -1.故所求特解为 $y = 1/(1 - \sin x)$.

此外,方程还有解y = 0,但不满足初值条件.□

2.可化为变量分离方程的类型

1)齐次方程
$$\frac{\mathrm{d}y}{\mathrm{d}x} = g\left(\frac{y}{x}\right)$$

$$u + x \frac{\mathrm{d}u}{\mathrm{d}x} = g(u)$$

$$\frac{\mathrm{d}u}{\mathrm{d}x} = \frac{g(u) - u}{x}$$

例:
$$\frac{\mathrm{d}y}{\mathrm{d}x} = \frac{y}{x} + \tan\frac{y}{x}$$
.

解: 令
$$u = \frac{y}{x}$$
,代入原方程得 $x \frac{\mathrm{d}u}{\mathrm{d}x} = \tan u$.

分离变量得
$$\frac{\cos u du}{\sin u} = \frac{dx}{x}.$$

两边积分得 $\ln |\sin u| = \ln |x| + c_1$. $\sin u = cx, c = \pm e^{c_1} \neq 0$.

此外,方程还有解 $\sin u = 0$. 故通解中允许c = 0.

原方程的通解为 $\sin \frac{y}{x} = cx, c \in \mathbb{R}$.

2)形如
$$\frac{dy}{dx} = \frac{a_1x + b_1y + c_1}{a_2x + b_2y + c_2}$$
的方程

Case1.
$$c_1 = c_2 = 0$$

$$\frac{dy}{dx} = \frac{a_1 x + b_1 y}{a_2 x + b_2 y} = \frac{a_1 + b_1 \frac{y}{x}}{a_2 + b_2 \frac{y}{x}} = g\left(\frac{y}{x}\right)$$

Case 2.
$$\begin{vmatrix} a_1 & a_2 \\ b_1 & b_2 \end{vmatrix} = 0, \exists \mathbb{P} \frac{a_1}{a_2} = \frac{b_1}{b_2} = k$$

$$\frac{dy}{dx} = \frac{k(a_2x + b_2y) + c_1}{a_2x + b_2y + c_2} = f(a_2x + b_2y)$$

令
$$u = a_2 x + b_2 y$$
,则方程化为 $\frac{\mathrm{d}u}{\mathrm{d}x} = a_2 + b_2 f(u)$.

Case3.
$$\begin{vmatrix} a_1 & a_2 \\ b_1 & b_2 \end{vmatrix} \neq 0$$
且 $c_1^2 + c_2^2 \neq 0$

两直线
$$\begin{cases} a_1 x + b_1 y + c_1 = 0 \\ a_2 x + b_2 y + c_2 = 0 \end{cases}$$
相交于一点 $(\alpha, \beta) \neq (0, 0)$

$$\lim_{\alpha_1} \begin{cases} a_1(x-\alpha) + b_1(y-\beta) = 0 \\ a_2(x-\alpha) + b_2(y-\beta) = 0 \end{cases}$$

令
$$X = x - \alpha, Y = y - \beta, 则$$

$$\frac{\mathrm{d}Y}{\mathrm{d}X} = \frac{a_1 X + b_1 Y}{a_2 X + b_2 Y} = g\left(\frac{Y}{X}\right)$$

例:
$$\frac{\mathrm{d}y}{\mathrm{d}x} = \frac{x - y + 1}{x + y - 3}$$

分离变量得 $\frac{\mathrm{d}X}{X} = \frac{1+u}{1-2u-u^2} \,\mathrm{d}u$

两边积分得 $\ln X^2 = -\ln |u^2 + 2u - 1| + c_1,$ $X^2(u^2 + 2u - 1) = c, c = \pm e^{c_1} \neq 0.$

此外,容易验证 $u^2 + 2u - 1 = 0$,也是(*)的解.故通解中c可取任意常数.代回原变量得原方程的通解

$$y^2 + 2xy - x^2 - 6y - 2x = c, c \in \mathbb{R}$$
.

3.一阶隐方程

$$1)y = f(x, y')$$

$$2)x = f(y, y')$$

$$3)F(x, y') = 0$$

$$4)F(y,y')=0$$

$$1)y = f(x, y')$$
(微分法)

$$\diamondsuit p = y', 则$$
 $y = f(x, p)$

$$y = f(x, p)$$

两边对x求导,得到关于p'(x), p, x的方程.

若求得其通解

$$p = u(x, c),$$

则原方程的通解为

$$y = f(x, u(x, c)).$$

例:
$$x(y')^2 - 2yy' + 9x = 0$$

解:
$$\diamondsuit p = y', 则$$

$$y = \frac{9x}{2p} + \frac{xp}{2} \tag{*}$$

两边对x求导,得

$$\left(\frac{1}{2} - \frac{9}{2p^2}\right) \left(p - x\frac{\mathrm{d}p}{\mathrm{d}x}\right) = 0 \quad (**)$$

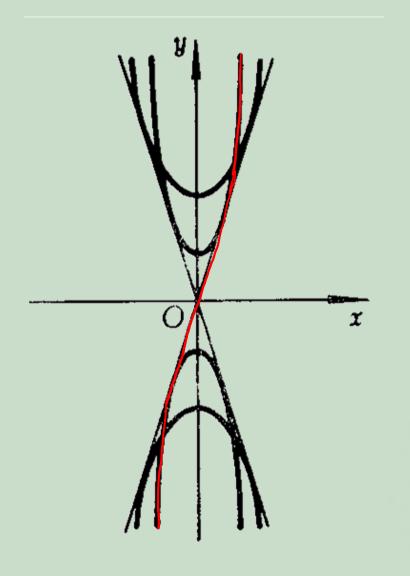
它蕴含

$$\frac{\mathrm{d}p}{\mathrm{d}x} = \frac{p}{x} \qquad \text{if} \quad p^2 = 9$$

由此得(**)的通解 p = cx和两个特解p = 3, p = -3.

代入(*) 得原方程的特解 y = 3x, y = -3x, 及通解

$$y = \frac{9x}{2p} + \frac{xp}{2} = \frac{9}{2c} + \frac{c}{2}x^2, \quad 0 \neq c \in \mathbb{R}.\square$$



$$y = \frac{9}{2c} + \frac{c}{2}x^2,$$

$$y = 3x,$$

$$y = -3x,$$

包络

拼接各种特解

$$(2)x = f(y, y')$$
(微分法)

$$\diamondsuit p = y', 则$$

$$x = f(y, p)$$

两边对y求微分,得到关于p'(y),y,p的方程.

若求得其通解

$$p = u(y,c),$$

则原方程的通解为

$$x = f(y, u(y, c)).$$

$$3)F(x,y') = 0(参数法)$$

因此原方程有通解

$$\begin{cases} x = g(t) \\ y = \int h(t)g'(t)dt + C, \quad C \in \mathbb{R}. \end{cases}$$

4)F(y,y') = 0(参数法) 处理方法同 3)

例:
$$y^2 + \left(\frac{dy}{dx}\right)^2 = 1$$

解: 设 $y = \cos t$, $p = \frac{dy}{dx} = \sin t$, $(-\infty < t < \infty)$.则
$$dx = \frac{1}{p} dy = \frac{1}{\sin t} d\cos t = -dt \qquad (*)$$

因此, $x = -t + c$, $y = \cos t$.

消去t,得原方程通解 $y = \cos(c-x), c \in \mathbb{R}$. 此外,原方程还有两个特解 $y = \pm 1$.

Remark:此方程满足初值条件y(0) = 1的解不唯一,为 y = 1或 $y = \cos x$.是否与解的存在唯一性定理矛盾?

4.恰当方程

例: $y \cos x dx + \sin x dy = 0$

解: 视y = y(x),则

 $yd \sin x + \sin xdy = 0.$

 $d(y\sin x) = 0.$

通解为: $y \sin x = C, C \in \mathbb{R}$.□

Remark.

$$y dx + x dy = d(xy)$$

$$\frac{y dx - x dy}{y^2} = d\left(\frac{x}{y}\right)$$

$$\frac{y dx - x dy}{xy} = d\left(\ln\left|\frac{x}{y}\right|\right)$$

$$\frac{y dx - x dy}{x^2 + y^2} = d\left(\arctan\frac{x}{y}\right)$$

$$\frac{y dx - x dy}{x^2 + y^2} = d\left(\arctan\frac{x}{y}\right)$$

Remark. 分项组合.

$$\text{ is } \left(\cos x + \frac{1}{y}\right) dx + \left(\frac{1}{y} - \frac{x}{y^2}\right) dy = 0$$

解: 把方程分项组合, 得 $\cos x dx + \frac{1}{y} dy + \frac{y dx - x dy}{y^2} = 0$.

$$\exists x + d \ln |y| + d \left(\frac{x}{y}\right) = 0,$$

$$d\left(\sin x + \ln\left|y\right| + \frac{x}{y}\right) = 0.$$

于是方程的通解为 $\sin x + \ln |y| + \frac{x}{y} = c, c \in \mathbb{R}$.

5.积分因子

例:
$$(x+y)dx + (y-x)dy = 0$$

解: 原方程等价于 (xdx + ydy) + (ydx - xdy) = 0.

同乘(积分因子)
$$\frac{1}{x^2 + y^2}$$
, 得 $\frac{xdx + ydy}{x^2 + y^2} + \frac{ydx - xdy}{x^2 + y^2} = 0$.

$$\frac{1}{2}d\ln(x^2+y^2) + d\arctan\frac{x}{y} = 0.$$

原方程的通解为
$$\frac{1}{2}\ln(x^2+y^2) + \arctan\frac{x}{y} = C, C \in \mathbb{R}$$
.□

Remark: 先分组, 再找公共的积分因子, 往往能简化计算.

例:
$$(3x^3 + y)dx + (2x^2y - x)dy = 0$$

解: 分组得
$$(3x^3dx + 2x^2ydy) + (ydx - xdy) = 0.$$

第二组有积分因子
$$\frac{1}{x^2}$$
, $\frac{1}{y^2}$, $\frac{1}{x^2+y^2}$. 如果同时照顾到第

一组,则 $\frac{1}{x^2}$ 是两组公共的积分因子,从而

$$(3xdx + 2ydy) + \frac{ydx - xdy}{x^2} = 0.$$

$$d\left(\frac{3}{2}x^2 + y^2\right) - d\left(\frac{y}{x}\right) = 0.$$

于是原方程的通积分为
$$\frac{3}{2}x^2 + y^2 - \frac{y}{x} = C, C \in \mathbb{R}.\square$$

6.常数变易法

$$y' = p(x)y + q(x) \tag{1}$$

用分离变量法求得 y' = p(x)y 的解为 $y(x) = Ce^{\int p(x)dx}$

$$y(x) = C(x)e^{\int p(x)dx},$$

$$C'(x)e^{\int p(x)\mathrm{d}x} = q(x).$$

因此(1)的通解为
$$y = e^{\int p(x)dx} \left(\int q(x)e^{\int -p(x)dx} dx + C \right)$$
.□

Remark.本质上是变量替换 $C(x) = y(x)e^{-\int p(x)dx}$.

Remark.积分因子法求解 y' = p(x)y + q(x) 更直接.

例: ydx + (y - x)dy = 0

解法一: 将方程改写为 ydx - xdy = -ydy.

左端有积分因子 $\frac{1}{y^2}$, $\frac{1}{x^2}$, $\frac{1}{xy}$, $\frac{1}{x^2 \pm y^2}$,但考虑到右端只与

y有关,故取 $\mu = \frac{1}{y^2}$. 方程两边同乘 $\frac{1}{y^2}$,得

$$\frac{y dx - x dy}{y^2} + \frac{dy}{y} = 0.$$

因而原方程的通解为此外方程有特解

$$\frac{x}{y} + \ln|y| = c, c \in \mathbb{R}.$$

$$y \equiv 0.$$

解法二: 将方程改写为 $\frac{dy}{dx} = \frac{y}{x-y}$, 这是齐次方程.

通解为
$$-\frac{1}{u}-\ln|u|=\ln|x|-c,c\in\mathbb{R}.$$

代回原来的变量即得

此外方程有特解

$$\frac{x}{y} + \ln|y| = c, c \in \mathbb{R}.$$

$$y \equiv 0$$
.

解法三(常数变易法): 将方程改写为 $\frac{dx}{dy} = \frac{x}{y} - 1$.

齐次方程 $\frac{\mathrm{d}x}{\mathrm{d}y} = \frac{x}{y}$ 的通解为x = cy.

设非齐次方程 $\frac{dx}{dy} = \frac{x}{y} - 1$ 的通解为x = c(y)y,代入得

$$c'(y)y + c(y) = c(y) - 1, \quad c'(y) = \frac{-1}{y},$$

 $c(y) = -\ln|y| + c, \quad c \in \mathbb{R}.$

故原方程的通解为 $x = y(-\ln|y|+c), c \in \mathbb{R}$. 此外方程有特解 $y \equiv 0.\square$

7.Bernoulli 方程
$$\frac{dy}{dx} = p(x)y + q(x)y^n, n \neq 0, 1$$

方程两边同乘y⁻ⁿ,得

$$y^{-n} \frac{\mathrm{d}y}{\mathrm{d}x} = p(x)y^{1-n} + q(x),$$

令
$$z = y^{1-n}$$
,则
$$\frac{\mathrm{d}z}{\mathrm{d}x} = (1-n)p(x)z + (1-n)q(x),$$

这是关于z的一阶线性ODE,求出z,从而得y.

例:
$$\frac{\mathrm{d}y}{\mathrm{d}x} = 6\frac{y}{x} - xy^2$$

$$\frac{\mathrm{d}z}{\mathrm{d}x} = \frac{\mathrm{d}(y^{-1})}{\mathrm{d}x} = -\frac{1}{y^2} \frac{\mathrm{d}y}{\mathrm{d}x}.$$

$$\frac{\mathrm{d}z}{\mathrm{d}x} = -\frac{6}{x}z + x.$$

这是线性方程, 其通解为
$$z = \frac{c}{x^6} + \frac{x^2}{8}, c \in \mathbb{R}.$$

$$\frac{1}{y} = \frac{c}{x^6} + \frac{x^2}{8}, c \in \mathbb{R}.$$

此外, y = 0 也是原方程的解.□

8.Riccati 方程
$$\frac{dy}{dx} = p(x)y^2 + q(x)y + r(x)$$

若我们有办法找到Riccati方程的一个特解 $\varphi(x)$,则经过变换 $y = z + \varphi(x)$ 后,方程就变为Bernoulli方程,因而可解.事实上,将 $y = z + \varphi(x)$ 带入方程,得 $z' + \varphi' = pz^2 + 2p\varphi z + p\varphi^2(x) + qz + q\varphi + r$.由于 $\varphi' = p\varphi^2(x) + q\varphi + r$,我们得到z的Bernoulli方程 $z' = pz^2 + (2p\varphi + q)z$.

求出z,即得Riccati方程的通解 $y = z + \varphi(x)$.

找Riccati方程的特解时,通常尝试指数函数,幂函数,三角函数,常数函数等简单函数.

例: $y' + y^2 - 2y\sin x = \cos x - \sin^2 x$

解: 方程有特解 $y = \sin x$. 令 $y = z + \sin x$,代入方程,得

$$z' + z^2 = 0.$$

 $z=\frac{1}{\cdots},c\in\mathbb{R},$ 或 z=0.解得 x+c

于是原方程的通解为 $y = \sin x + \frac{1}{----}, c \in \mathbb{R}$.

$$y = \sin x + \frac{1}{x+c}, c \in \mathbb{R}.$$

另有特解 $y = \sin x$.□

9.变量替换法

例*:
$$\frac{dy}{dx} + \frac{1 + xy^3}{1 + x^3y} = 0$$

解:
$$\diamondsuit u = x + y, v = xy$$
,则

$$\frac{\mathrm{d}u}{\mathrm{d}v} = \frac{\mathrm{d}x + \mathrm{d}y}{x\mathrm{d}y + y\mathrm{d}x} = \frac{1 + \frac{\mathrm{d}y}{\mathrm{d}x}}{y + x\frac{\mathrm{d}y}{\mathrm{d}x}} = \frac{uv}{v^2 - 1}$$

$$\frac{2du}{u} = \frac{2vdv}{v^2 - 1} = \frac{d(v^2 - 1)}{v^2 - 1}, \quad u^2 = c(v^2 - 1), c \neq 0.$$

此外, u=0也是解. 故原方程的通解为

$$(x+y)^2 = c(x^2y^2 - 1), c \in \mathbb{R}.\square$$

例:
$$x''(t) + x(t) = 0$$

解: $\Rightarrow y(t) = -x'(t)$,则原方程化为方程组 $\begin{cases} x' = -y \\ y' = x \end{cases}$
 $\Rightarrow x = r(t)\cos\theta(t), y = r(t)\sin\theta(t)$.则

$$\begin{cases} r'\cos\theta - r\theta'\sin\theta = -r\sin\theta \\ r'\sin\theta + r\theta'\cos\theta = r\cos\theta \end{cases}$$
 (1)

$$\begin{cases} r'\sin\theta + r\theta'\cos\theta = r\cos\theta \\ (2) \end{cases}$$
 (2)

$$(1) \times \cos\theta + (2)\sin\theta, \end{cases}$$
 $r' = 0$,

$$(2) \times \cos\theta - (1)\sin\theta, \end{cases}$$
 $r\theta' = r$.
王是 $r = c \neq 0$, $\theta = t + c$, \vec{r} , $r = 0$, $\theta = c$.

于是,
$$r = c_1 \neq 0$$
, $\theta = t + c_2$, 或 $r = 0$, $\theta = c$. 故原方程的通解为 $x = c_1 \cos(t + c_2)$, c_1 , $c_2 \in \mathbb{R}$, 也即 $x = c_1 \cos t + c_2 \sin t$, c_1 , $c_2 \in \mathbb{R}$.

10.综合例题

例.
$$f \in C^1[0, +\infty)$$
, $\lim_{x \to +\infty} (f(x) + f'(x)) = 0$, 求 $\lim_{x \to +\infty} f(x)$.

$$\lim_{x \to +\infty} g(x) = 0, \, \text{If } f(x) = e^{-x} (c + \int_0^x g(t)e^t dt).$$

由L'Hosptial法则

THOSPITAL
$$f(x) = \lim_{x \to +\infty} \frac{c + \int_0^x g(t)e^t dt}{e^x} = \lim_{x \to +\infty} \frac{g(x)e^x}{e^x}$$

$$= \lim_{x \to +\infty} g(x) = 0.$$

解法二:

$$\lim_{x \to +\infty} f(x) = \lim_{x \to +\infty} \frac{e^x f(x)}{e^x} = \lim_{x \to +\infty} \frac{e^x (f(x) + f'(x))}{e^x} = 0.$$

例:设f(x),g(x)和y(x)为[a,b]上的连续函数,f(x) > 0,且

$$y(x) \le g(x) + \int_{a}^{x} f(t)y(t)dt, \quad \forall x \in [a,b]. \tag{1}$$

证明:
$$y(x) \le g(x) + \int_a^x f(t)g(t)e^{\int_t^x f(s)ds}dt, \forall x \in [a,b].$$

再由(1)及f(x) > 0得, $h'(x) \le f(x)g(x) + f(x)h(x)$.即 $h'(x) - f(x)h(x) \le f(x)g(x).$

两边同乘非负函数 $e^{\int_a^{\Lambda} - f(s) ds}$,得

$$\left(h(x)e^{\int_a^x -f(s)\mathrm{d}s}\right)' \le f(x)g(x)e^{\int_a^x -f(s)\mathrm{d}s}.$$

$$\left(h(t)e^{\int_a^t -f(s)ds}\right)' \leq f(t)g(t)e^{\int_a^t -f(s)ds}.$$

两边在[a,x]上积分,并利用h(a) = 0,得

$$h(x)e^{\int_a^x -f(s)ds} \le \int_a^x f(t)g(t)e^{\int_a^t -f(s)ds}dt,$$

$$\exists \mathbb{I} \qquad h(x) \leq \int_{a}^{x} f(t)g(t)e^{\int_{t}^{x} f(s)ds}dt.$$

于是
$$y(x) \le g(t) + h(t)$$

$$\leq g(t) + \int_{a}^{x} f(t)g(t)e^{\int_{t}^{x} f(s)ds}dt.$$

例. (Gronwall不等式) 已知 $\alpha(t) \ge 0$ 及u(t)在[t_0, t_1]上连续, C, K为非负实数,且

$$u(t) \le C + \int_{t_0}^t \left[\alpha(s)u(s) + K\right] ds, \quad \forall t \in [t_0, t_1].$$

证明:
$$u(t) \leq [C + K(t - t_0)]e^{\int_{t_0}^t \alpha(s) ds}$$
, $\forall t \in [t_0, t_1]$.

Hint: Let
$$h(t) = C + \int_{t_0}^t \left[\alpha(s)u(s) + K \right] ds$$
, then
$$h'(t) = \alpha(t)u(t) + K \le \alpha(t)h(t) + K.$$

作业: 习题7.2

No. 1 (10), 2 (4),

3 (1, 2, 7, 12, 13, 14)

补充题(不交):

1.
$$(3x^2 + 6xy^2)dx + (6x^2y + 4y^3)dy = 0$$

2. $(e^x + 3y^2)dx + 2xydy = 0$
3. $x(4ydx + 2xdy) + y^3(3ydx + 5xdy) = 0$
4. $(y - 1 - xy)dx + xdy = 0$
5. $y' = (x - 1)y^2 + (1 - 2x)y + x$
6. $x^2y' + (xy - 2)^2 = 0$
7. $y^2(xdx + ydy) + x(ydx - xdy) = 0$
 $(\rlap{\mbox{$\not E$}} \vec{\mbox{$\not E$$

答案:

1.
$$x^3 + y^4 + 3x^2y^2 = C$$
;

2.
$$(x^2-2x+2)e^x + x^3y^2 = C$$
;

3.
$$x^4y^2 + x^3y^5 = C$$
;

4.
$$(xy+1)e^{-x} = C$$
;

5.
$$y = \frac{1}{x + Ce^x} + 1, y = 1;$$

6.
$$y = \frac{1}{x} + \frac{3x^2}{x^3 + C}, y = \frac{1}{x};$$

7.
$$1 + \frac{1}{y} + \frac{C}{\sqrt{x^2 + y^2}} = 0, y = 0.$$