

文章编号: 1000-0887(2001) 03_0314_07

一种通用的复模态矩阵摄动法^{*}

刘济科, 徐伟华, 蔡承武

(中山大学 应用力学与工程系, 广州 510275)

(黄小清推荐)

摘要: 对于非自伴随系统, 提出了一种通用的复模态矩阵摄动法。该法能同时适用于孤立特征值、重特征值及密集(相近)特征值三种复特征值情况。由复特征子空间缩聚技术求解低阶摄动项, 高阶摄动项则由逐次逼近过程求得。三个计算实例表明, 该通用方法合理可靠, 精度高。

关键词: 摄动法; 复模态; 重特征值; 密集特征值

中图分类号: O324; TH113.1 文献标识码: A

引 言

自伴随系统的矩阵摄动法现已基本成熟^[1]。但在自然科学及工程实际中, 存在大量的非自伴随系统, 如气动弹性稳定性问题, 任意阻尼系统, 陀螺系统等。两类系统的主要区别有两方面。一方面, 非自伴随系统不能由对称矩阵描述, 因此在绝大多数情况下, 系统的特征解是复数。另一方面, 为使非自伴随系统的运动方程解耦, 常需要引入状态空间, 求解左右特征值问题。由于这两方面的因素, 非自伴随系统的摄动分析尚处于发展阶段。对孤立复特征值情况, Courant 和 Hilbert 首先研究了一般矩阵的摄动问题^[2]。Meirovitch 和 Ryland 分别研究了陀螺系统^[3]及小阻尼陀螺系统^[4]的矩阵摄动法。刘济科等进一步讨论了这一问题^[5]。对重特征值情况, 刘满和陈塑寰首先提出了一种摄动法^[6]。徐伟华和刘济科对该法进行了改进^[7]。但对密集复特征值情况, 尚未见到公开发表的文献。为此, 本文提出一种能同时适用于三种复特征值情况的复模态矩阵摄动法。

1 基本方程

n 自由度非自伴随系统的运动方程用矩阵可以表示成

$$M\ddot{q} + (C + G) \dot{q} + (K + H) q = 0, \quad (1)$$

其中, M, C, K 分别是 $n \times n$ 阶对称质量阵, 阻尼阵和刚度阵; G, H 分别是 $n \times n$ 阶反对称陀螺阵和循环阵, q 是 n 维广义坐标向量。

引入 $\varphi = \dot{q}$ 可将(1)式改写成

$$K_0 x = M_0 \dot{x}, \quad (2)$$

其中 $x = [\varphi^T, q^T]^T$ 是 $2n$ 维状态变量, 且

* 收稿日期: 1999_06_04; 修订日期: 2000_10_20

作者简介: 刘济科(1967—), 男, 湖北天门人, 教授, 博士。

$$K_0 = \begin{bmatrix} -(C+G) & -(K+H) \\ I & 0 \end{bmatrix}, M_0 = \begin{bmatrix} M & 0 \\ 0 & I \end{bmatrix}, \quad (3a)$$

或者

$$K_0 = \begin{bmatrix} M & 0 \\ 0 & -(K+H) \end{bmatrix}, M_0 = \begin{bmatrix} 0 & M \\ M & C+G \end{bmatrix}. \quad (3b)$$

是 $2n \times 2n$ 阶非对称矩阵, I 是单位阵.

原(未摄动)系统(2)的右左特征值问题分别是

$$K_0 x_{i0} = \lambda_0 M_0 x_{i0}, \quad (4a)$$

$$K_0^T y_{i0} = \lambda_0 M_0^T y_{i0}, \quad (i = 1, 2, \dots, 2n) \quad (4b)$$

其中 $\lambda_0, x_{i0}, y_{i0}$ 分别是特征值, 右特征量和左特征向量. $2n$ 个特征值可以表示成 $\lambda_{01} < \lambda_{02} < \dots < \lambda_{0k} \cong \dots \cong \lambda_{0k+1} < \dots < \lambda_{0n}$, 这意味着原系统具有 $(k-j+1)$ 个重或密集特征值. 这里的特征值是按其模进行比较的, 当且仅当两特征值的实部及虚部都(近似)相等时, 它们才(近似)相等.

左右特征向量满足双正交关系, 因此可范化成

$$y_{i0}^T M_0 x_{j0} = \delta_{ij} \quad (i, j = 1, 2, \dots, 2n) \quad (5)$$

其中, δ_j 是 Kronecker 函数.

显然, (5) 式不能唯一确定 x_{i0}, y_{i0} , 为此需要补充另一个条件. 不失一般性, 本文选取能保证特征向量共轭的范化条件.

$$x_{i0}^T x_{i0} = 1 \quad (i = 1, 2, \dots, 2n) \quad (6)$$

系统参数的改变将使(2)式中的 K_0, M_0 发生相应的变化, 由于这些变化通常较小, 故可表示为: $K = K_0 + \varepsilon K_1, M = M_0 + \varepsilon M_1$, 其中 $\varepsilon K_1, \varepsilon M_1$ 是相应的改变量, 是一阶小量, ε 是小参数. 于是, 摄动系统的特征值问题可表示成

$$(K_0 + \varepsilon K_1) x_i = \lambda_i (M_0 + \varepsilon M_1) x_i \quad (i = 1, 2, \dots, 2n), \quad (7a)$$

$$(K_0 + \varepsilon K_1)^T y_i = \lambda_i (M_0 + \varepsilon M_1)^T y_i \quad (i = 1, 2, \dots, 2n). \quad (7b)$$

相应的范化条件及双正交条件是

$$x_i^T x_i = 1, \quad (8a)$$

$$y_i^T (M_0 + \varepsilon M_1) x_j = \delta_{ij} \quad (i, j = 1, 2, \dots, 2n), \quad (8b)$$

这里, λ, x_i, y_i 分别是摄动系统的特征值, 右左特征向量.

2 特征子空间缩聚

选取相应于重或密集特征值的特征向量张成两个复子空间, 即 $S = [x_{j0}, \dots, x_{k0}], R = [y_{j0}, \dots, y_{k0}]$, 由(5)式可得

$$R^T M_0 S = I. \quad (9)$$

将 x_i, y_i 分别对 S, R 进行正交分解

$$x_i = S p_i + \delta x_i, \quad (10a)$$

$$y_i = R q_i + \delta y_i, \quad (10b)$$

$$\delta x_i \perp S p_i, \quad (10c)$$

$$\delta y_i \perp R q_i. \quad (10d)$$

其中 p_i, q_i 是 $(k-j+1)$ 维向量, $\delta x_i, \delta y_i$ 是一阶 $2n$ 维向量 ($i = j, j+1, \dots, k$). 为节省篇幅,

除非特别说明, 以下均省去“ $i = j, j + 1, \dots, k$ ”。

(10a), (10b) 式代入(7a), (7b) 式, 利用(10c), (10d) 式, 忽略二阶项, 根据变分原理可得两个 $(k - j + 1)$ 阶的缩聚特征值问题

$$\mathbf{K}p_i = \mu_i \mathbf{M}p_i, \quad (11a)$$

$$\mathbf{K}^T q_i = \mu_i \mathbf{M}^T q_i. \quad (11b)$$

其中 $\mathbf{K} = \mathbf{R}^T(\mathbf{K}_0 + \varepsilon \mathbf{K}_1) \mathbf{S}$, $\mathbf{M} = \mathbf{R}^T(\mathbf{M}_0 + \varepsilon \mathbf{M}_1) \mathbf{S}$, μ_i 是 λ 的一阶近似。

(10a), (10b) 式代入(8a), (8b) 式, 利用(5), (6) 式可得

$$p_i^T \mathbf{S}^T \mathbf{S} p_i = \mathbf{1}, \quad (12a)$$

$$q_i^T \mathbf{M} p_i = \mathbf{1}. \quad (12b)$$

它们分别是相应于(11a), (11b) 式的范化条件。

求解(11), (12) 式, 可得 $(k - j + 1)$ 组特征解: μ_i, p_i, q_i , 也即求得了 λ, x_i, y_i 的低阶摄动项。由于原系统与摄动系统的特征子空间的夹角一般不大, 所以 $\mathbf{S}p_i, \mathbf{R}q_i$ 只有一阶误差, 根据 Rayleigh 商的性质, μ_i 只有二阶误差。

3 高阶摄动

为求高阶摄动项, 考虑到 $\mu_i, \mathbf{S}p_i, \mathbf{R}q_i$ 的精度, 可将摄动解表示为

$$\lambda = \mu_i + \varepsilon^2 \lambda_2 + \varepsilon^3 \lambda_3 \dots, \quad (13a)$$

$$x_i = \mathbf{S}p_i + \varepsilon x_{i1} + \varepsilon^2 x_{i2} \dots, \quad (13b)$$

$$y_i = \mathbf{R}q_i + \varepsilon y_{i1} + \varepsilon^2 y_{i2} \dots \quad (13c)$$

比较(13b), (13c) 式与(10a), (10b) 式, 并利用(10c), (10d) 式, 可得

$$x_{im} \perp \mathbf{S}p_i, \quad (m = 1, 2, \dots). \quad (14a)$$

$$y_{im} \perp \mathbf{R}q_i, \quad (14b)$$

(13a), (13b) 式代入(7a) 式, 忽略四阶项, 可将所得方程分解成

$$[(\mathbf{K}_0 + \varepsilon \mathbf{K}_1) - \mu_i (\mathbf{M}_0 + \varepsilon \mathbf{M}_1)] \mathbf{S}p_i + \varepsilon (\mathbf{K}_0 - \mu_i \mathbf{M}_0) x_{i1} = \mathbf{0}, \quad (15a)$$

$$(\mathbf{K}_1 - \mu_i \mathbf{M}_1) x_{i1} - \lambda_2 \mathbf{M}_0 \mathbf{S}p_i + (\mathbf{K}_0 - \mu_i \mathbf{M}_0) x_{i2} = \mathbf{0}, \quad (15b)$$

$$(\mathbf{K}_1 - \mu_i \mathbf{M}_1) x_{i2} - \lambda_3 \mathbf{M}_0 \mathbf{S}p_i + (\mathbf{K}_0 - \mu_i \mathbf{M}_0) x_{i3} - \lambda_2 (\mathbf{M}_0 x_{i1} + \mathbf{M}_1 \mathbf{S}p_i) = \mathbf{0}. \quad (15c)$$

利用(14a) 式, 将 x_{i1}, x_{i2} 用原右特征向量展开

$$x_{i1} = \sum_{l=1, l \neq j \sim k}^{2n} c_{il1} x_{l0}, \quad (16a)$$

$$x_{i2} = \sum_{l=1, l \neq j \sim k}^{2n} c_{il2} x_{l0}, \quad (16b)$$

其中 c_{il1}, c_{il2} 是待定复系数。

将(16a) 代入(15a), (16b) 代入(15b), 用 y_{l0}^T 前乘所得的两个方程, 并利用(5), (14a) 及(14b) 式, 可求得

$$c_{il1} = \frac{y_{l0}^T (\mathbf{K}_1 - \mu_i \mathbf{M}_1) \mathbf{S}p_i}{\mu_i - \lambda_0}, \quad (17a)$$

$$c_{il2} = \frac{y_{l0}^T (\mathbf{K}_1 - \mu_i \mathbf{M}_1) x_{i1}}{\mu_i - \lambda_0}, \quad (l \neq j \sim k), \quad (17b)$$

进而得到

$$x_{i1} = \sum_{l=1, l \neq j \sim k}^{2n} \frac{y_{l0}^T (K_1 - \mu_i M_1) S p_i}{\mu_i - \lambda_0} x_{l0}, \quad (18a)$$

$$x_{i2} = \sum_{l=1, l \neq j \sim k}^{2n} \frac{y_{l0}^T (K_1 - \mu_i M_1) x_{i1}}{\mu_i - \lambda_0} x_{l0}^* \quad (18b)$$

(16b) 代入(15b), 用 $(Rq_i)^T$ 前乘所得方程, 并利用(5), (9) 式, 得

$$\lambda_2 = \frac{q_i^T R^T (K_1 - \mu_i M_1)}{q_i^T p_i} x_{i1}^* \quad (19)$$

由(15c), (5) 及(9) 式, 即可推得

$$\lambda_3 = \frac{q_i^T R^T [(K_1 - \mu_i M_1) x_{i2} - \lambda_2 M_1 S p_i]}{q_i^T p_i} \quad (20)$$

为求 y_{i1} , y_{i2} , 先将它们用原左特征向量展开

$$y_{i1} = \sum_{l=1, l \neq j \sim k}^{2n} d_{il1} y_{l0}, \quad (21a)$$

$$y_{i2} = \sum_{l=1, l \neq j \sim k}^{2n} d_{il2} y_{l0}^* \quad (21b)$$

仿上述推导过程, 可求得 d_{il1} , d_{il2} , 于是得到

$$y_{i1} = \sum_{l=1, l \neq j \sim k}^{2n} \frac{(Rq_i)^T (K_1 - \mu_i M_1) x_{l0}}{\mu_i - \lambda_0} y_{l0}, \quad (22a)$$

$$y_{i2} = \sum_{l=1, l \neq j \sim k}^{2n} \frac{y_{l1}^T (K_1 - \mu_i M_1) x_{l0}}{\mu_i - \lambda_0} y_{l0}^* \quad (22b)$$

至此, (13) 式中的所有未知项已全部求得. 更高阶摄动项的推导在此从略.

对孤立特征值情况, 即当 $i \neq j \sim k$ 时, 该方法也完全适用. 事实上, 仅需选取 $S = x_{l0}$, $R = y_{l0} (l \neq j \sim k)$, 按以上推导即可求得相应于孤立特征值的摄动解. 因此, 本文方法是一种通用的复模态矩阵摄动法.

4 算 例

算例 1 考虑一个二维系统

$$M_0 = I, \quad \varepsilon M_1 = \mathbf{0},$$

$$K_0 = \begin{bmatrix} -0.5 & -2 \\ 1 & 0 \end{bmatrix}, \quad \varepsilon K_1 = \begin{bmatrix} -0.1 & -0.1 \\ 0 & 0 \end{bmatrix}$$

其两个特征值是 $-0.25 \pm 1.39194i$, 属孤立特征值情况. 按本文方法求得的一阶及二阶摄动解列在表 1 中. 表中同时列出了精确解, 以供比较.

算例 2 考虑一个四维系统

$$M_0 = I, \quad \varepsilon M_1 = \mathbf{0},$$

$$K_0 = \begin{bmatrix} -0.5 & -2 & 0 & 0 \\ 1 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & -0.5 & -2 \\ 0 & 0 & 1 & 0 \end{bmatrix}, \quad \varepsilon K_1 = \begin{bmatrix} -0.1 & -0.1 & 0.1 & 0.1 \\ 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0.1 & 0.1 & -0.1 & -0.1 \\ 0 & 0 & 0 & 0 \end{bmatrix}.$$

其四个特征值是 $-0.25 \pm 1.39194i$, $-0.25 \pm 1.39194i$, 有两对重特征值. 按本文方法求得的一阶及二阶摄动解列在表 2 中.

算例 3 考虑另一个四维系统

$$M_0 = I, \mathcal{E}M_1 = \mathbf{0},$$

$$K_0 = \begin{bmatrix} -0.5 & -2 & 0 & 0 \\ 1 & 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & -0.5 & -1.95 \\ 0 & 0 & 1 & 0 \end{bmatrix}, \mathcal{E}K_1 = \begin{bmatrix} -0.1 & -0.1 & 0.1 & 0.1 \\ 0 & 0 & 0 & 0 \\ 0.1 & 0.1 & -0.1 & -0.1 \\ 0 & 0 & 0 & 0 \end{bmatrix}.$$

其四个特征值是 $-0.25 \pm 1.37386i$, $-0.25 \pm 1.39194i$, 有两对密集特征值。按本文方法求得的一阶及二阶摄动解列在表 3 中。

表 1 摄动系统的特征解(算例 1, 孤立特征值情况)

λ_i	x_i	y_i	
精确解	$-0.3 \pm 1.41874i$	$-1.27710 \pm 0.212127i$ $0.325653 \pm 0.831888i$	$-0.367609 \pm 0.143905i$ $0.093738 \pm 0.564347i$
本文方法 (一阶)	$-0.3 \pm 1.41888i$	$-1.27675 \pm 0.211397i$ $0.324725 \pm 0.831166i$	$-0.368018 \pm 0.143915i$ $0.093197 \pm 0.564805i$
本文方法 (二阶)	$-0.3 \pm 1.41873i$	$-1.27714 \pm 0.212168i$ $0.325701 \pm 0.831955i$	$-0.367581 \pm 0.143913i$ $0.093742 \pm 0.564313i$

表 2 摄动系统的特征解(算例 2, 重特征值情况)

	λ_i	x_i	y_i
精确解	$-0.25 \pm 1.39194i$	$0.933924 \pm 0.149042i$	$0.253558 \pm 0.088542i$
		$-0.220469 \pm 0.631353i$	$-0.059856 \pm 0.375073i$
		$0.933924 \pm 0.149042i$	$0.253558 \pm 0.088542i$
	$-0.35 \pm 1.44135i$	$-0.220469 \pm 0.631353i$	$-0.059856 \pm 0.375073i$
		$0.877270 \pm 0.148977i$	$0.265565 \pm 0.114298i$
		$-0.237170 \pm 0.551051i$	$-0.071795 \pm 0.422777i$
本文方法 (一阶)	$-0.25 \pm 1.39194i$	$0.933923 \pm 0.149042i$	$0.253558 \pm 0.088542i$
		$-0.220469 \pm 0.631352i$	$-0.059856 \pm 0.375073i$
		$0.933923 \pm 0.149042i$	$0.253558 \pm 0.088542i$
	$-0.35 \pm 1.44582i$	$-0.220469 \pm 0.631352i$	$-0.059856 \pm 0.375073i$
		$0.876602 \pm 0.147178i$	$0.266653 \pm 0.114316i$
		$-0.234806 \pm 0.549459i$	$-0.070214 \pm 0.423945i$
本文方法 (二阶)	$-0.25 \pm 1.39194i$	$0.933924 \pm 0.149042i$	$0.253558 \pm 0.088542i$
		$-0.220469 \pm 0.631353i$	$-0.059856 \pm 0.375073i$
		$0.933924 \pm 0.149042i$	$0.253558 \pm 0.088542i$
	$-0.35 \pm 1.44128i$	$-0.220469 \pm 0.631353i$	$-0.059856 \pm 0.375073i$
		$0.877427 \pm 0.149196i$	$0.265417 \pm 0.114347i$
		$-0.237431 \pm 0.551355i$	$-0.071833 \pm 0.422595i$
		$-0.877427 \pm 0.149196i$	$-0.265417 \pm 0.114347i$
		$0.237431 \pm 0.551355i$	$0.071833 \pm 0.422595i$

表 3 摄动系统的特征解(算例 3, 密集特征值情况)

	λ_i	x_i	y_i
精确解	$-0.250632 \pm 1.38259i$	$0.913181 \ 0.0803633i$ $-0.1721981 \ 0.629272i$ $0.964000i \ 0.223263i$ $-0.2787181 \ 0.646719i$	$0.236470 \pm 0.104737i$ $-0.0890446 \pm 0.0763812i$ $0.268515 \pm 0.0763812i$ $0.0354399 \pm 0.387456i$
	$-0.349368 \pm 1.43295i$	$0.899409i \ 0.219374i$ $-0.2889481 \ 0.557216i$ $-0.862511 \pm 0.0816673i$ $0.192314 \pm 0.555025i$	$0.281848 \pm 0.100950i$ $-0.0482799 \pm 0.442329i$ $-0.247365 \pm 0.131551i$ $-0.0983236 \ 0.397527i$
本文方法 (一阶)	$-0.250607 \pm 1.38257i$	$0.910886 \ 0.0826870i$ $-0.1735271 \ 0.627381i$ $0.965843i \ 0.220841i$ $-0.2772501 \ 0.648328i$	$0.236210 \pm 0.103850i$ $-0.0838723 \pm 0.355309i$ $0.268628 \pm 0.0772321i$ $0.0365827 \pm 0.387826i$
	$-0.349393 \pm 1.43747i$	$0.900624i \ 0.215212i$ $-0.2851551 \ 0.557233i$ $-0.859489 \pm 0.0819419i$ $0.191048 \pm 0.551479i$	$0.283097 \pm 0.101792i$ $-0.0487903 \pm 0.443921i$ $-0.248197 \pm 0.130695i$ $-0.0955933 \ 0.398117i$
本文方法 (二阶)	$-0.250632 \pm 1.38258i$	$0.910858 \ 0.0828235i$ $-0.1734411 \ 0.627347i$ $0.965816i \ 0.220718i$ $-0.2773411 \ 0.648322i$	$0.236251 \pm 0.103865i$ $-0.0838567 \pm 0.355273i$ $0.268600 \pm 0.0772278i$ $-0.0361607 \pm 0.387882i$
	$-0.349531 \pm 1.43287i$	$0.901353i \ 0.217575i$ $-0.2880291 \ 0.559033i$ $-0.860474 \pm 0.0837879i$ $0.193639 \pm 0.553563i$	$0.281822 \pm 0.101921i$ $-0.0505734 \pm 0.442540i$ $-0.246941 \pm 0.130629i$ $-0.0970995 \ 0.396719i$

5 结 论

从表 1, 2 及 3 中的结果可以看到, 在三种特征值情况下, 本文方法求得的一阶摄动解与精确解比较已具有足够的精度, 二阶摄动解基本上等于精确解。因此, 本文方法是一种有效的分析复模态摄动问题的通用方法。

[参 考 文 献]

- [1] CHEN Jing_yu, LIU Ji_ke, ZHAO Ling_cheng. An improved perturbation method for free vibration analysis[J]. Journal of Sound and Vibration, 1995, **180**(3): 519—523.
- [2] Courant R, Hilbert D. Methods of Mathematical Physics [M]. Vol. 1. New York: Interscience, 1953, 343—348.
- [3] Meirovitch L, Ryland G. Response of lightly damped gyroscopic systems[J]. Journal of Sound and Vibration, 1979, **67**(1): 1—19.
- [4] Meirovitch L, Ryland G. A perturbation technique for gyroscopic systems with small internal and external damping[J]. Journal of Sound and Vibration, 1985, **100**(3): 393—408.
- [5] 刘济科, 张宪民, 孟光. 对复模态矩阵摄动法的补充[J]. 航空动力学报, 1996, **11**(1): 97—99.
- [6] 刘满, 陈塑寰. 复模态矩阵摄动法[J]. 吉林工业大学学报, 1986, **16**(3): 1—9.

- [7] 徐伟华, 刘济科. 阻尼系统振动分析的复模态矩阵摄动法[J]. 中山大学学报(自然科学版), 1998, 37(4): 50—54.

A Universal Matrix Perturbation Technique for Complex Modes

LIU Ji_ke, XU Wei_hua, CAI Cheng_wu

(Department of Mechanics, Zhongshan University, Guangzhou 510275, P R China)

Abstract: A universal matrix perturbation technique for complex modes is presented. This technique is applicable to all the three cases of complex eigenvalues: distinct, repeated and closely spaced eigenvalues. The lower order perturbation formulas are obtained by performing two complex eigensubspace condensations, and the higher order perturbation formulas are derived by successive approximation process. Three illustrative examples are given to verify the proposed method and satisfactory results are observed.

Key words: perturbation method; complex modes; repeated eigenvalues; closely spaced eigenvalues