

一阶拟线性可对称化偏微分 方程组解的存在性

秦 铁 虎

(复旦大学数学研究所)

引 言

Hahn-Goldberg^[2] 讨论了一阶拟线性正对称组解的存在性. 谷超豪老师在文[4]中研究了情况更为复杂的一阶拟线性正对称组的边值问题.

本文的目的是利用类似的考虑, 将 Friedrichs 和 Lax^[1] 关于一阶线性可对称化组的一个结果推广到拟线性的情况. Friedrichs 和 Lax^[1] 证明, $\mathbf{R}^n$ 中的一阶线性组

$$\sum_{i=1}^n a_i(x) \frac{\partial u}{\partial x_i} + b(x)u + \lambda u = f(x).$$

若其主象征 $\sqrt{-1} \sum_{i=1}^n a_i(x) \xi_i$ 是可对称化的, 即存在对称化子 $r(x, \xi)$, 且 $r(x, \xi)$ 的对称部分为正, 则当 λ 充分大时, 上一阶组存在唯一强解. 本文中, 我们证明, 在一些适当的假设下, 这个结论对一阶拟线性组亦是正确的.

在 $\mathbf{R}^n$ 中考虑如下的一阶拟线性组

$$\sum_{i=1}^n a_i(x, u) \frac{\partial u}{\partial x_i} + \lambda u = f(x, u). \quad (1)$$

其中 u 是 k 个分量的未知函数向量, $f(x, y)$ 是向量函数, $a_i(x, y)$ 是 $k \times k$ 矩阵函数, 它们均定义在 $\mathbf{R}^n \times V$ 中, 其中 V 是 $\mathbf{R}^k$ 中原点的某邻域. λ 是实数. 假设方程组(1)的主象征是可对称化的, 则在一些关于方程组系数和右端项光滑性假设下, 我们给出了方程组(1)的解的一个存在唯一性定理.

§ 1. 关于拟微分算子的一些定义与引理

定义 1 对任实数 m , 以 S^m 表满足以下要求的 $C^\infty(\mathbf{R}^n \times \mathbf{R}^n)$ 函数 (或矩阵函数) $a(x; \xi)$ 的集合: 对任意重指标 $\alpha = (\alpha_1, \dots, \alpha_n)$, $\beta = (\beta_1, \dots, \beta_n)$, 存在常数 $C_{\alpha, \beta}$ 使

$$|\partial_x^\alpha \partial_\xi^\beta a(x; \xi)| \leq C_{\alpha, \beta} (1 + |\xi|)^{m - |\beta|}, \quad (x, \xi) \in \mathbf{R}^n \times \mathbf{R}^n. \quad (1.1)$$

其中 $\partial_x^\alpha = \left(\frac{\partial}{\partial x_1}\right)^{\alpha_1} \dots \left(\frac{\partial}{\partial x_n}\right)^{\alpha_n}$, $\partial_\xi^\beta = \left(\frac{\partial}{\partial \xi_1}\right)^{\beta_1} \dots \left(\frac{\partial}{\partial \xi_n}\right)^{\beta_n}$. $|\beta| = \beta_1 + \dots + \beta_n$.

对 $a(x; \xi)$, 定义其半范 $|a|_{l_1, l_2}$ 如下

$$|a|_{l_1, l_2} = \max_{\substack{|\alpha| \leq l_1 \\ |\beta| \leq l_2}} \sup_{(x, \xi) \in \mathbf{R}^n \times \mathbf{R}^n} (|\partial_x^\alpha \partial_\xi^\beta a(x, \xi)| (1 + |\xi|)^{-m + |\beta|}). \quad (1.2)$$

本文 1980 年 6 月 10 日收到, 1980 年 12 月 13 日修改.

定义 2 设 $a(x; \xi) \in S^m$, 对 $u \in S^1$, 定义算子 $a(x; D)$ 如下

$$a(x; D)u = \frac{1}{(2\pi)^n} \int e^{ix \cdot \xi} a(x; \xi) \hat{u}(\xi) d\xi, \quad (1.3)$$

其中 $\hat{u}(\xi)$ 表 $u(x)$ 的 Fourier 变换. 称 $a(x; D)$ 是以 $a(x; \xi)$ 为象征的拟微分算子.

不难验证, $a(x; D)$ 是 $S \rightarrow S$ 的连续映照. 且若我们定义 $a(x; D)$ 的形式共轭为满足如下条件的算子 $a^*(x; D)$

$$(a(x; D)u, v) = (u, a^*(x; D)v), \quad \forall u, v \in S,$$

其中 $(\cdot, \cdot)$ 表通常的 L_2 内积, 则

$$a^*(x; D)u = \frac{1}{(2\pi)^n} \int e^{ix \cdot \xi} \int e^{-ix_1 \cdot \xi} \bar{a}(x_1; \xi) u(x_1) dx_1 d\xi.$$

其中 $\bar{a}(x; \xi)$ 表 $a(x; \xi)$ 的共轭转置.

定义 3 设 $a(x, y; \xi)$ 关于 $(x, y, \xi) \in \mathbf{R}^n \times V \times \mathbf{R}^n$ 是无穷次可微函数, 若还满足以下要求 (1.4), 我们说 $a(x, y; \xi) \in S_y^m$: 对任意重指标 α, β, γ , 存在常数 $C_{\alpha, \beta, \gamma}$ 使

$$|\partial_x^\alpha \partial_y^\beta \partial_\xi^\gamma a(x, y; \xi)| \leq C_{\alpha, \beta, \gamma} (1 + |\xi|)^{m - |\gamma|}. \quad (1.4)$$

对一切 $(x, y, \xi) \in \mathbf{R}^n \times V \times \mathbf{R}^n$ 成立.

引理 1.1 (i) 设 $a(x; \xi) \in S^m$, 则对任非负整数 k , $a(x; D)$ 可唯一地延拓为 $H_{l_2+m} \rightarrow H_k$ 的有界算子, 且

$$\|a(x; D)u\|_k \leq \text{const} \|a\|_{N_0+k, l_2} \|u\|_{k+m}.$$

其中 const 是只依赖于 m, k 的常数, l_2 是某正数, $N_0 = n + 2$. H_k 表示通常的 Соболев 空间, $\|\cdot\|_k$ 表示 Соболев 空间的模.

(ii) 设 $a(x; \xi) \in S^m$, 定义 $\bar{a}_j(x; \xi) \in S^{m-j}$ 如下

$$\bar{a}_j(x; \xi) = \sum_{|\alpha|=j} \frac{1}{\alpha!} \partial_x^\alpha (-i\partial_\xi)^\alpha \bar{a}(x; \xi).$$

则对任整数 $k_1, k_2 \geq 0$, $N > m + n + k_1 + 2k_2$, 有

$$\left\| (a^*(x; D) - \sum_{j=0}^{N-1} \bar{a}_j(x; D))u \right\|_{k_1} \leq \text{const} \|a\|_{N+k_1+2k_2, l_2} \|u\|_{-2k_2}.$$

其中 $a^*(x; D)$ 是 $a(x; D)$ 的形式共轭.

(iii) 设 $a_1(x; \xi) \in S^{m_1}$, $a_2(x; \xi) \in S^{m_2}$, 定义 $r_j(x; \xi) \in S^{m_1+m_2-j}$ 如下

$$r_j(x; \xi) = \sum_{|\alpha|=j} \frac{1}{\alpha!} ((-i\partial_\xi)^\alpha a_1(x; \xi)) \partial_x^\alpha a_2(x; \xi).$$

则对任整数 $k_1, k_2 \geq 0$ 有

$$\begin{aligned} & \left\| (a_1(x; D)a_2(x; D) - \sum_{j=0}^{N-1} r_j(x; D))u \right\|_{k_1} \\ & \leq \text{const} \|a_1\|_{n+2+k_1, l_2} \|a_2\|_{N, l_2} \|u\|_{-2k_2}. \end{aligned}$$

其中 $N > (n + m_2 + k'_1 + 2k_2)$, $k'_1 = \max\{k_1 + m_1, 0\}$, $N_2 = \max\{2N + k_1 + 2k_2 - 1, 2N + n + k_1, N + k'_1 + 2k_2\}$.

(ii), (iii) 中的 const 与 l_2 意义与 (i) 中的类似. 本节下面出现的 const , l_2 意义均如此, 不再说明.

1) 这里 S 表通常的急减函数类.

证 见 Kumano-go^[7]. [7] 中未给出 (iii) 中的系数估计. 但严格地按照 [7] 中的证法, 这个估计是不难得到的.

引理 1.2 设 $a(x; \xi) \in S^m$, $m=0, 1$, 则

$$\|a(x; D)u\|_{-m} \leq \text{const} \|a\|_{3n+4, l_2} \|u\|_0.$$

证 当 $m=0$ 时, 在引理 1.1(i) 中命 $m=0, k=0$ 即得. 现设 $m=1$, 在引理 1.1(iii) 中, 取 $a_1(x; \xi) = \Lambda^{-1}(\xi) = (1 + |\xi|^2)^{-\frac{1}{2}}$, $a_2(x; \xi) = a(x; \xi)$. 则 $m_1 = -1, m_2 = 1$. 取 $k_1 = k_2 = 0$, 则 $k'_1 = 0, n + m_2 + k'_1 + 2k_2 = n + 1$. 故可取 $N = n + 2$. 由引理 1.1(iii)

$$\left\| (\Lambda^{-1}(D)a(x; D) - \sum_{j=0}^{N-1} r_j(x; D)u) \right\|_0 \leq \text{const} \|a\|_{N, l_2} \|u\|_0. \quad (1.5)$$

其中 $r_j(x; \xi) = \sum_{|\alpha|=j} \frac{1}{\alpha!} (-i\partial_\xi)^\alpha \Lambda^{-1}(\xi) \partial_x^\alpha a(x; \xi) \in S^0, j=0, 1, \dots, N-1$.

$N_2 = 2N + n = 3n + 4$, 由引理 1.1(i)

$$\begin{aligned} \|r_j(x; D)u\|_0 &\leq \text{const} \|r_j\|_{n+2, l_2} \|u\|_0 \\ &\leq \text{const} \|a\|_{n+2+j, l_2} \|u\|_0 \leq \text{const} \|a\|_{n+N+1, l_2} \|u\|_0. \end{aligned}$$

联合上式与 (1.5) 式, 即得引理.

引理 1.3 设 $a(x; \xi) \in S^m, m=0, 1, \bar{a}(x; \xi)$ 是其共轭转置, $a^*(x; D)$ 表示 $a(x; D)$ 的形式共轭, 则

$$\|(a^*(x; D) - \bar{a}(x; D))u\|_0 \leq \text{const} \|a\|_{2n+5, l_2} \|u\|_{m-1}.$$

证 记

$$\bar{a}_j(x; \xi) = \sum_{|\alpha|=j} \frac{1}{\alpha!} \partial_x^\alpha (-i\partial_\xi)^\alpha \bar{a}(x; \xi).$$

则

$$\bar{a}_j(x; \xi) \in S^{m-j}.$$

在引理 1.1(ii) 中, 取 $k_1=0, k_2=1$, 则 $m+n+k_1+2k_2=m+n+2$, 取 $N=n+4$, 则

$$\begin{aligned} \left\| (a^*(x; D) - \sum_{j=0}^{N-1} \bar{a}_j(x; D))u \right\|_0 &\leq \text{const} \|a\|_{n+6, l_2} \|u\|_{-2} \\ &\leq \text{const} \|a\|_{n+6, l_2} \|u\|_{m-1}. \end{aligned} \quad (1.6)$$

又由引理 1.1(i) 对 $1 \leq j \leq N-1 = n+3$, 有

$$\|\bar{a}_j(x; D)u\|_0 \leq \text{const} \|\bar{a}_j\|_{n+2, l_2} \|u\|_{m-1} \leq \text{const} \|a\|_{2n+5, l_2} \|u\|_{m-1}.$$

连同 (1.6) 式, 即得引理.

引理 1.4 设 $p(x; \xi) \in S^0, d(x; \xi) = p(x; \xi) \bar{p}(x; \xi)$, 则

$$\|(d(x; D) - p(x; D)p^*(x; D))u\|_0 \leq \text{const} \|p\|_{n+2, l_2} \|\bar{p}\|_{3n+6, l_2} \|u\|_{-1}.$$

证

$$\begin{aligned} \|(d(x; D) - p(x; D)p^*(x; D))u\|_0 &\leq \|(d(x; D) - p(x; D)\bar{p}(x; D))u\|_0 \\ &\quad + \|p(x; D)(\bar{p}(x; D) - p^*(x; D))u\|_0. \end{aligned} \quad (1.7)$$

由引理 1.1(i) 与引理 1.3 有

$$\begin{aligned} \|p(x; D)(\bar{p}(x; D) - p^*(x; D))u\|_0 &\leq \text{const} \|p\|_{n+2, l_2} \|(\bar{p}(x; D) - p^*(x; D))u\|_0 \\ &\leq \text{const} \|p\|_{n+2, l_2} \|p\|_{2n+5, l_2} \|u\|_{-1}. \end{aligned} \quad (1.8)$$

令

$$d_j(x; \xi) = \sum_{|\alpha|=j} \frac{1}{\alpha!} ((-i\partial_\xi)^\alpha p(x; \xi)) \partial_x^\alpha \bar{p}(x; \xi).$$

则 $d_0(x; \xi) = d(x; \xi)$. 在引理 1.1(iii) 中, 取 $a_1 = p, a_2 = \bar{p}$, 则 $m_1 = m_2 = 0$. 取 $k_1 = 0$,

$k_2=1$, 则 $k'_1=0$, $n+m_2+k'_1+2k_2=n+2$, 取 $N=n+3$, $N_2=3n+6$, 则有

$$\begin{aligned} \left\| (p(x; D)p^*(x; D) - \sum_{j=0}^{N-1} d_j(x; D))u \right\|_0 &\leq \text{const} |p|_{n+2, l_2} |\bar{p}|_{3n+6, l_2} \|u\|_{-2} \\ &\leq \text{const} |p|_{n+2, l_2} |\bar{p}|_{3n+6, l_2} \|u\|_{-1}. \end{aligned} \quad (1.9)$$

由引理 1.1(i), 对 $1 \leq j \leq N-1$,

$$\begin{aligned} \|d_j(x; D)u\|_0 &\leq \text{const} |d_j|_{n+2, l_2} \|u\|_{-j} \leq \text{const} |p|_{n+2, l_2} |\bar{p}|_{n+2+j, l_2} \|u\|_{-1} \\ &\leq \text{const} |p|_{n+2, l_2} |\bar{p}|_{2n+4, l_2} \|u\|_{-1}. \end{aligned} \quad (1.10)$$

由(1.7)–(1.10)即得引理.

引理 1.5 设 $a(x; \xi) \in S^1$, $r(x; \xi) \in S^0$, 且

$$r(x; \xi)a(x; \xi) = \bar{a}(x; \xi)\bar{r}(x; \xi).$$

则 $\|(r(x; D)a(x; D) - a^*(x; D)r^*(x; D))u\|_0 \leq \text{const} |r|_{2n+5, l_2} |a|_{3n+4, l_2} \|u\|_0$.

证 记

$$p(x; \xi) = r(x; \xi)a(x; \xi).$$

则

$$\begin{aligned} \|(r(x; D)a(x; D) - a^*(x; D)r^*(x; D))u\|_0 &\leq \|(r(x; D)a(x; D) - p(x; D))u\|_0 \\ &\quad + \|(p(x; D) - p^*(x; D))u\|_0 + \|(p^*(x; D) - a^*(x; D)r^*(x; D))u\|_0. \end{aligned} \quad (1.11)$$

在引理 1.1(iii)中, 取 $a_1=r(x; \xi)$, $a_2=a(x; \xi)$, 则 $m_1=0$, $m_2=1$. 令

$$p_j(x; \xi) = \sum_{|\alpha| \geq j} \frac{1}{\alpha!} ((-i\partial_\xi)^\alpha r(x; \xi)) \partial_x^\alpha a(x; \xi),$$

有 $p_0(x; \xi) = p(x; \xi)$. 取 $k_1=k_2=0$, 则 $k'_1=0$, 取 $N=n+2$, 于是 $N_2=3n+4$. 我们有

$$\left\| (r(x; D)a(x; D) - \sum_{j=0}^{N-1} p_j(x; D))u \right\|_0 \leq \text{const} |r|_{n+2, l_2} |a|_{3n+4, l_2} \|u\|_0. \quad (1.12)$$

又对 $1 \leq j \leq N-1$, 由引理 1.1(i)

$$\begin{aligned} \|p_j(x; D)u\|_0 &\leq \text{const} |p_j|_{n+2, l_2} \|u\|_{1-j} \leq \text{const} |r|_{n+2, l_2} |a|_{n+2+j, l_2} \|u\|_0 \\ &\leq \text{const} |r|_{n+2, l_2} |a|_{2n+3, l_2} \|u\|_0. \end{aligned} \quad (1.13)$$

由(1.12)与(1.13)有

$$\|(r(x; D)a(x; D) - p(x; D))u\|_0 \leq \text{const} |r|_{n+2, l_2} |a|_{3n+4, l_2} \|u\|_0. \quad (1.14)$$

又因 $p^*(x; D) - a^*(x; D)r^*(x; D) = (p(x; D) - r(x; D)a(x; D))^*$.

所以由(1.14)有

$$\|(p^*(x; D) - a^*(x; D)r^*(x; D))u\|_0 \leq \text{const} |r|_{n+2, l_2} |a|_{3n+4, l_2} \|u\|_0. \quad (1.15)$$

又由引理 1.3 知

$$\begin{aligned} \|(p(x; D) - p^*(x; D))u\|_0 &\leq \text{const} |p|_{2n+5, l_2} \|u\|_0 \\ &\leq \text{const} |r|_{2n+5, l_2} |a|_{2n+5, l_2} \|u\|_0. \end{aligned} \quad (1.16)$$

综合(1.11), (1.14), (1.15), (1.16)即有引理.

现在我们可以精确地叙述关于拟线性组(1)的系数的假设

(I) 系数 $a_i(x, y)$ 是 $(x, y) \in \mathbf{R}^n \times V$ 的无穷次可微函数, 其本身及其关于 x, y 的各阶导数在 $\mathbf{R}^n \times V$ 上有界. 此时显然

$$a(x, y; \xi) = \sqrt{-1} \sum_{i=1}^n a_i(x, y) \xi_i \in S_y^1.$$

(II) 存在非异阵 $r(x, y; \xi) \in S_y^0$, 使

$$r(x, y; \xi) a(x, y; \xi) = \bar{a}(x, y; \xi) \bar{r}(x, y; \xi). \quad (1.17)$$

$$\operatorname{Re} r(x, y; \xi) \geq k > 0. \quad (1.18)$$

$\forall (x, y, \xi) \in \mathbf{R}^n \times V \times \mathbf{R}^n$ 成立, 其中 k 是某常数.

下面我们总假定拟线性组 (1) 满足条件 (I), (II).

§ 2. 线性方程组的高阶能量不等式

象通常处理非线性方程时那样, 代替拟线性组 (1), 我们先考虑如下的线性组

$$Lu = \sum_{i=1}^n a_i(x, w(x)) \frac{\partial u}{\partial x_i} + \lambda u = f(x, w(x)). \quad (2.1)$$

其中 $w \in H_s^3$, 这里 $H_s^3 = \{w \in C_0^\infty(\mathbf{R}^n); \|w\|_s \leq \delta\}$. $s > \frac{7}{2}n + 6$, δ 是某正数, 取得使由 $w \in H_s^3$, 可推得 $\forall x \in \mathbf{R}^n$, 有 $w(x) \in V$.

下面我们要将方程组 (2.1) 作为一个拟微分算子进行讨论, 因此有必要考察以 $a(x, w(x), \xi)$ 为象征的拟微分算子. 为此我们证明

引理 2.1 设 $a(x, y; \xi) \in S_y^m$, $w \in H_s^3$, 则

$$a(x, w(x); \xi) \in S^m.$$

且

$$|\alpha|_{3n+6, 1} \leq \text{const}.$$

其中 const 与 $w \in H_s^3$ 的选取无关, 本节下面的 const 均如此, 不再说明.

证 因 $s > \frac{7}{2}n + 6$, 故当 $w \in H_s^3$ 时, 由 Соболев 嵌入定理知

$$|\partial_x^\alpha w(x)| \leq \text{const } \delta, \quad |\alpha| \leq 3n + 6.$$

根据 S^m 类象征的定义与半范的定义 (1.2) 即得本引理.

由引理 2.1 知, 相应于引理 1.2, 1.3, 1.4, 1.5 我们有

引理 2.2 设 $a(x, y; \xi) \in S_y^m$, $m = 0, 1$, 以 A 表示以 $a(x, w(x), \xi)$ 为象征的拟微分算子, $w \in H_s^3$, 则

$$\|Au\|_{-m} \leq \text{const} \|u\|_0.$$

引理 2.3 设 $a(x, y; \xi) \in S_y^m$, $m = 0, 1$, 以 $A, \bar{A}$ 分别表示以 $a(x, w(x); \xi), \bar{a}(x, w(x); \xi)$ 为象征的拟微分算子, $w \in H_s^3$. 则

$$\|(A^* - \bar{A})u\|_0 \leq \text{const} \|u\|_{m-1}.$$

其中 A^* 表 A 的形式共轭.

引理 2.4 设 $p(x, y; \xi) \in S_y^0$, 以 P, D 分别表示以 $p(x, w(x); \xi), p(x, w(x); \xi) \bar{p}(x, w(x); \xi)$ 为象征的拟微分算子, $w \in H_s^3$. 则

$$\|(D - P \cdot P^*)u\|_0 \leq \text{const} \|u\|_{-1}.$$

引理 2.5 设 $a(x, y; \xi) \in S_y^1$, $r(x, y; \xi) \in S_y^0$, 且

$$r(x, y; \xi) a(x, y; \xi) = \bar{a}(x, y; \xi) \bar{r}(x, y; \xi), \quad \forall (x, y, \xi) \in \mathbf{R}^n \times V \times \mathbf{R}^n.$$

分别以 A, R 表示以 $a(x, w(x); \xi)$ 和 $r(x, w(x); \xi)$ 为象征的拟微分算子. 则

$$\|(RA - A^* R^*)u\|_0 \leq \text{const} \|u\|_0.$$

其中 A^*, R^* 分别表示 A, R 的形式共轭.

下面我们着手对线性组(2.1)建立对 $w \in H_s^3$ 一致成立的 s 阶能量不等式.

以 ∂_x^α , $|\alpha| \leq s$ 作用于方程组(2.1)的两端. 我们有

$$\sum_{i=1}^n a_i(x, w(x)) \frac{\partial}{\partial x_i} (\partial_x^\alpha u) + \lambda (\partial_x^\alpha u) + \Phi^{(\alpha)}(x, w, u) = \partial_x^\alpha f(x, w(x)). \quad (2.2)$$

其中

$$\Phi^{(\alpha)}(x, w, u) = \sum_{i=1}^n [\partial_x^\alpha (a_i(x, w(x)) u_{x_i}) - a_i(x, w(x)) \partial_x^\alpha u_{x_i}]. \quad (2.3)$$

令 $\partial_x^\alpha u = U$, 则(2.2)可写为

$$L^{(\alpha)} U = \sqrt{-1} AU + \lambda U + \Phi^{(\alpha)}(x, w, u) = \partial_x^\alpha f(x, w(x)). \quad (2.4)_\alpha$$

其中

$$A = \frac{1}{\sqrt{-1}} \sum_{i=1}^n a_i(x, w(x)) \partial / \partial x_i.$$

引理 2.6

$$\|\Phi^{(\alpha)}(x, w, u)\|_0 \leq \text{const} \|u\|_s.$$

证

$$\Phi^{(\alpha)} = \sum_{i=1}^n \sum_{\substack{\lambda+\mu=\alpha \\ \lambda \geq 0}} C_{\lambda, \mu} \partial_x^\lambda a_i(x, w(x)) \partial_x^\mu u_{x_i}. \quad (2.5)$$

但

$$\partial_x^\lambda a_i(x, w(x)) = \sum_{\substack{0 \leq \rho \leq \lambda \\ 0 < \gamma < \lambda - \rho}} C_{\rho, \gamma} a_{i, x, y}^{\rho, \gamma} (\partial_x w)^{\gamma_1} \dots (\partial_x^\lambda w)^{\gamma_n}. \quad (2.6)$$

其中

$$\gamma_1 + \gamma_2 + \dots + \gamma_n = \gamma.$$

$$\gamma_1 + 2\gamma_2 + \dots + \lambda \gamma_n = \lambda - \rho.$$

$$a_{i, x, y}^{\rho, \gamma} = \partial_x^\rho \partial_y^\gamma a_i(x, y).$$

利用 $a_i(x, y)$ 关于 x, y 的导数的有界性有

$$|a_{i, x, y}^{\rho, \gamma}| \leq \text{const}. \quad (2.7)$$

再由 $|\mu| \leq |\alpha| - 1$ 有

$$\|a_{i, x, y}^{\lambda, 0} \cdot \partial_x^\mu u_{x_i}\|_0 \leq \text{const} \|\partial_x^\mu u_{x_i}\|_0 \leq \text{const} \|u\|_s. \quad (2.8)$$

对于 $(\partial_x w)^{\gamma_1} \dots (\partial_x^\lambda w)^{\gamma_n}$, 设 $\gamma_1, \dots, \gamma_n$ 中最后一个不为 0 者为 γ_n . 若 $|\gamma_n| \leq s/2$, 则

$$|\partial_x w|, |\partial_x^2 w|, \dots, |\partial_x^{\gamma_n} w| \leq \text{const} \|w\|_s \leq \text{const} \delta.$$

若 $|\gamma_n| > s/2$, 则定有 $|\gamma_n| = 1$, 且其他使 $\gamma_l \neq 0$ 的 l , 均有 $|\gamma_l| < s/2$, 且 $|\mu| < s/2$. 故

$$|\partial_x^l w| \leq \text{const} \|w\|_s \leq \text{const} \delta. \quad (2.9)$$

$$|\partial_x^\mu u_{x_i}| \leq \text{const} \|u\|_s. \quad (2.10)$$

这样由(2.7), (2.9), (2.10)得

$$\begin{aligned} \|a_{i, x, y}^{\rho, \gamma} (\partial_x w)^{\gamma_1} \dots (\partial_x^\lambda w)^{\gamma_n} \cdot \partial_x^\mu u_{x_i}\|_0 &\leq \text{const} \|u\|_s \|\partial_x^{\gamma_n} w\|_0 \\ &\leq \text{const} \|u\|_s \|w\|_s \leq \text{const} \|u\|_s. \end{aligned} \quad (2.11)$$

由(2.5), (2.6), (2.8), (2.11)即得引理 2.6.

定理 1 设拟线性组(1)的系数满足 § 1 中的假设(I), (II), $s > \frac{7}{2}n + 6$, $w \in H_s^3$, 则对线性组(2.1)存在与 w 无关的 λ_0 和常数 const . 使 $\lambda \geq \lambda_0$ 时成立如下能量不等式

$$\|u\|_s \leq \frac{\text{const}}{\lambda} \|Lu\|_s, \quad u \in S. \quad (2.12)$$

证 由对 $r(x, y; \xi)$ 的假设(1.18), 可设

$$\frac{1}{2}(r(x, y; \xi) + \bar{r}(x, y; \xi)) = p(x, y; \xi) \bar{p}(x, y; \xi) + k_1.$$

其中 $k_1 > 0$ 是某常数. 以 $R, \bar{R}, P$ 和 D 分别表示以 $r(x, w(x); \xi), \bar{r}(x, w(x); \xi), p(x, w(x); \xi)$, 和 $\bar{p}(x, w(x); \xi)$ 为象征的拟微分算子, 则

$$\frac{1}{2}(R + \bar{R}) = D + k_1.$$

这样

$$\frac{1}{2}(R + R^*) = P \cdot P^* + k_1 + (D - P \cdot P^*) + \frac{1}{2}(R^* - \bar{R}). \quad (2.13)$$

由引理 2.3, 2.4 知

$$\begin{aligned} \|(R^* - \bar{R})u\|_0 &\leq \text{const}\|u\|_{-1}, \\ \|(D - P \cdot P^*)u\|_0 &\leq \text{const}\|u\|_{-1}. \end{aligned}$$

这样 (2.13) 式可写为

$$\frac{1}{2}(R + R^*) = P \cdot P^* + k_1 - N,$$

其中 N 是满足如下条件的算子

$$\|Nu\|_0 \leq \text{const}\|u\|_{-1}. \quad (2.14)$$

故

$$\text{Re}(R + N) = P \cdot P^* + k_1. \quad (2.15)$$

这样

$$\begin{aligned} \text{Re}((R + N)L^{(\alpha)}U, U) &= \text{Re}(iRAU, U) + \text{Re}(R\Phi^{(\alpha)}, U) \\ &\quad + \text{Re}(iNAU, U) + \text{Re}(N\Phi^{(\alpha)}, U) + \lambda \text{Re}((R + N)U, U). \end{aligned} \quad (2.16)$$

由引理 2.5

$$|\text{Re}(iRAU, U)| \leq \text{const}\|U\|_0^2. \quad (2.17)$$

由引理 2.2 和引理 2.6 知

$$\begin{aligned} |\text{Re}(R\Phi^{(\alpha)}, U)| &\leq \|R\Phi^{(\alpha)}\|_0 \|U\|_0 \leq \text{const}\|\Phi^{(\alpha)}\|_0 \|U\|_0 \\ &\leq \text{const}\|u\|_s \|U\|_0 \leq \text{const}\|u\|_s^2. \end{aligned} \quad (2.18)$$

同样由 (2.14) 和引理 2.6 有

$$|\text{Re}(N\Phi^{(\alpha)}, U)| \leq \text{const}\|u\|_s^2. \quad (2.19)$$

又由 (2.14) 和引理 2.2 有

$$\begin{aligned} |\text{Re}(iNAU, U)| &\leq \|NAU\|_0 \|U\|_0 \\ &\leq \text{const}\|AU\|_{-1} \|U\|_0 \leq \text{const}\|U\|_0^2. \end{aligned} \quad (2.20)$$

由 (2.15) 有

$$\lambda \text{Re}((R + N)U, U) \geq \lambda k_1 \|U\|_0^2. \quad (2.21)$$

综合 (2.16) — (2.21) 式得

$$\text{Re}((R + N)L^{(\alpha)}U, U) \geq \lambda k_1 \|U\|_0^2 - \text{const}\|u\|_s^2.$$

对上式左端利用 Schwarz 不等式. 再利用引理 2.2 和 (2.14) 式估计 $\|(R + N)L^{(\alpha)}U\|_0$, 并注意 $\|U\|_0 \leq \|u\|_s$, $L^{(\alpha)}U = \partial_x^\alpha f(x, w(x))$ 即可得到

$$\|\partial_x^\alpha f(x, w(x))\|_0 \|u\|_s \geq \lambda k_1 \|\partial_x^\alpha u\|_0^2 - \text{const}\|u\|_s^2. \quad (2.22)_\alpha$$

将 (2.22) _{α} 对一切 $|\alpha| \leq s$ 求和, 即得

$$\|f(x, w(x))\|_s \|u\|_s \geq \lambda k_1 \|u\|_s^2 - \text{const}\|u\|_s^2.$$

取 λ 充分大, 调节常数 const, 即可得

$$\|u\|_s \leq \frac{\text{const}}{\lambda} \|f(x, w(x))\|_s.$$

此即我们要证的能量不等式(2.12).

推论 设定理1的假设满足, $\lambda \geq \lambda_0$. 又 u 是线性组(2.1)的 H_s 强解, 即 u 是 L_2 强解且 $u \in H_s$, 则仍有

$$\|u\|_s \leq \frac{\text{const}}{\lambda} \|Lu\|_s.$$

证 对所有 $|\alpha| \leq s$, 将相应的(2.4) $_{\alpha}$ 式放在一起, 即为原线性组(2.1)的 s 阶延拓组. 记该延拓组为

$$\mathcal{L}W = F. \quad (2.23)$$

其中 $F = (f, \partial_x f, \dots, \partial_x^s f)$, 则由能量不等式(2.12)知 $\lambda \geq \lambda_0$, 对 s 阶延拓组(2.23)有

$$\|W\|_0 \leq \frac{\text{const}}{\lambda} \|F\|_0. \quad (2.24)$$

设 $u \in H_s$ 是方程组(2.1)的强解, 由[5]知, $W = (u, \partial_x u, \dots, \partial_x^s u)$ 是 s 阶延拓组(2.23)的强解. 由(2.24)知

$$\|u\|_s \leq \frac{\text{const}}{\lambda} \|f\|_s.$$

§3. 线性方程组高阶可微分解的存在性

在这一节里, 我们证明, 线性方程组(2.1)在 $\lambda \geq \lambda_0$ 时, 对任何 $f(x, w(x)) \in H_s$, $w \in H_s^1$, 有高阶可微分解 $u \in H_s$ 存在.

引理 3.1 对固定的 $w \in H_s^1$, 在 λ 充分大时, 线性方程组(2.1)的形式共轭有能量不等式

$$\|v\|_s \leq C_w \|L^*v\|_s, \quad v \in S. \quad (3.1)$$

其中常数 C_w 可以依赖于 $w \in H_s^1$.

证

$$L^*v = -\sum_{i=1}^n \frac{\partial}{\partial x_i} (\bar{a}_i(x, w(x))v) + \lambda v.$$

它亦是一个线性可对称化算子. 满足§1中假设(I), (II)的对称化子为 $r^{-1}(x, w(x))$. 记

$$L_0^*v = -\sum_{i=1}^n \frac{\partial}{\partial x_i} (\bar{a}_i(x, w(x))v).$$

则

$$\Lambda^{-s}L^*v = [\Lambda^{-s}, L_0^*]v + L_0^*\Lambda^{-s}v + \lambda\Lambda^{-s}v.$$

即

$$L^*\Lambda^{-s}v = \Lambda^{-s}L^*v - [\Lambda^{-s}, L_0^*]v.$$

由0阶能量不等式知 λ 充分大时有

$$\|\Lambda^{-s}v\|_0 \leq \frac{\text{const}}{\lambda} (\|\Lambda^{-s}L^*v\|_0 + \|[\Lambda^{-s}, L_0^*]v\|_0). \quad (3.2)$$

$[\Lambda^{-s}, L_0^*]$ 是一个 s 阶拟微分算子. 因而由引理1.1(i)知

$$\|[\Lambda^{-s}, L_0^*]v\|_0 \leq \text{const}\|v\|_{-s}. \quad (3.3)$$

取 λ 充分大, 由(3.2), (3.3)使有能量不等式(3.1).

由于能量不等式(3.1)成立, 那么利用标准的泛函表示方法与强弱解一致性定理(见[6])得

引理 3.2 对固定的 $w \in H_s^0$, λ 充分大时, 线性方程组 (2.1) 有强解 $u \in H_s$ 存在.

这样我们就可以得到线性方程组 (2.1) 在 $\lambda \geq \lambda_0$ 时强解 $u \in H_s$ 存在的定理

定理 2 设定理 1 的假设满足. 若 $f(x, w(x)) \in H_s$, $w \in H_s^0$, 则当 $\lambda \geq \lambda_0$ 时线性方程组 (2.1) 存在强解 $u \in H_s$.

证 记

$$Lu \equiv L_0 u + \lambda u.$$

其中

$$L_0 = \sum_{i=1}^n a_i(x, w(x)) \frac{\partial}{\partial x_i}.$$

记 $[\lambda_0, \infty)$ 中使 $Lu = f(x, w(x))$ 有 H_s 强解的 λ 的全体为 Δ . 往证 $\Delta = [\lambda_0, \infty)$.

1) Δ 非空 由引理 3.2 知, λ 充分大时 $Lu = f(x, w(x))$ 存在 H_s 强解, 所以 Δ 非空.

2) 若 $\bar{\lambda} \in \Delta$, 则存在不依赖 $\bar{\lambda}$ 的 ε_0 , 使当 $|\varepsilon| < \varepsilon_0$ 时, $\bar{\lambda} + \varepsilon \in \Delta$.

事实上, 记 $\lambda = \bar{\lambda} + \varepsilon$, 则方程组

$$Lu \equiv L_0 u + \lambda u = f(x, w)$$

可写为

$$(L_0 u + \bar{\lambda} u) = f(x, w) - \varepsilon u.$$

我们用迭代法求其解. 任取 $u_0 \in H_s$. 若已求得 $u_n \in H_s$, 因 $\bar{\lambda} \in \Delta$, 由方程组

$$L_0 u + \bar{\lambda} u = f(x, w) - \varepsilon u_n. \quad (3.4)$$

求得其强解 $u_{n+1} \in H_s$. 下证 $\{u_n\}$ 在 H_s 中收敛于某 $u \in H_s$. 因此 $u_{n+1} - u_n$ 是方程组

$$L_0 u + \bar{\lambda} u = \varepsilon(u_{n-1} - u_n)$$

的 H_s 强解. 由定理 1 的推论知

$$\|u_{n+1} - u_n\|_s \leq \frac{\text{const}}{\bar{\lambda}} \|\varepsilon(u_{n-1} - u_n)\|_s \leq \frac{|\varepsilon| \text{const}}{\lambda_0} \|u_n - u_{n-1}\|_s.$$

取 $\varepsilon_0 = \lambda_0 / \text{const}$, 则当 $|\varepsilon| < \varepsilon_0$ 时, $\frac{|\varepsilon| \text{const}}{\lambda_0} < 1$. 故得 $\{u_n\}$ 是 H_s 中的收敛序列. 设其

极限为 $u \in H_s$. 由 (3.4) 式知 u 是方程组

$$L_0 u + (\bar{\lambda} + \varepsilon)u = f(x, w)$$

的强解. 所以 $\lambda = \bar{\lambda} + \varepsilon \in \Delta$.

综合 1), 2) 知, $\Delta = [\lambda_0, \infty)$. 定理 2 得证.

§ 4. 拟线性组解的存在唯一性

由定理 2 知, 当 $\lambda \geq \lambda_0$ 时, 对任 $w \in H_s^0$, 只要 $f(x, w(x)) \in H_s$, 线性组 (2.1) 就有唯一强解 $u \in H_s$. 这就定义了一个算子

$$\Phi: H_s^0 \rightarrow H_s$$

且成立不等式

$$\|\Phi(w)\|_s \leq \frac{\text{const}}{\lambda} \|f(x, w)\|_s. \quad (4.1)$$

为使对任 $w \in H_s^0$, 当 λ 充分大时 (λ 多大不依赖于 $w \in H_s^0$ 的选取) 均有 $\|\Phi(w)\|_s \leq \delta$. 对右端项要加一些要求.

引理 4.1 设方程组 (2.1) 满足定理 1 的假设, 右端项 $f(x, y)$ 满足以下条件

$$f(x, 0) \in H_s. \quad (4.2)$$

$$\sup_{\substack{(x,y) \in \mathbb{R}^n \times V \\ |\alpha|+|\beta| \leq s+1}} |\partial_x^\alpha \partial_y^\beta f(x, y)| \leq \text{const.} \quad (4.3)$$

则存在 λ_1 , 使当 $\lambda \geq \lambda_1$ 时, $\forall w \in H_s^\delta$, 均有

$$\|\Phi(w)\|_s \leq \delta. \quad (4.4)$$

证 将 $f(x, w(x))$ 表为

$$f(x, w) = f(x, 0) + \int_0^1 f_y(x, \tau w) \cdot w d\tau.$$

这里 f_y 实际上是 $f(x, y)$ 关于 y 的偏导数所组成的矩阵. 由上式我们有

$$\|f(x, w)\|_s \leq \|f(x, 0)\|_s + \int_0^1 \|f_y(x, \tau w) \cdot w\|_s d\tau.$$

现来考察 $f_y(x, \tau w) \cdot w$, 它关于 x 的任何 $|\alpha| \leq s$ 阶导数为下列项的线性组合

$$\partial_x^\alpha f_y(x, \tau w(x)) \cdot \partial_x^\nu w(x), \quad |\nu| + |\mu| = |\alpha|.$$

而 $\partial_x^\alpha f_y(x, \tau w(x))$ 的元素是如下项的线性组合

$$\tau^\gamma \tilde{\partial}_x^\rho \partial_y^\gamma f_y(x, \tau w) (\partial_x w)^{\gamma_1} \cdots (\partial_x w)^{\gamma_r}.$$

这里 $\tilde{\partial}_x$ 表示仅对 $f_y(x, y)$ 中的 x 求导. 其中 $\gamma_1 + \cdots + \gamma_r = \nu - \rho$. 由条件 (4.3) 并注意 $|\tau| \leq 1$, 有

$$|\tau^\gamma \tilde{\partial}_x^\rho \partial_y^\gamma f_y(x, \tau w)| \leq \text{const.}$$

利用类似于引理 2.6 证明中的讨论, 不难得到

$$\|\tau^\gamma \tilde{\partial}_x^\rho \partial_y^\gamma f_y(x, \tau w) (\partial_x w)^{\gamma_1} \cdots (\partial_x w)^{\gamma_r} \cdot \partial_x^\alpha w(x)\|_0 \leq \text{const} \|w\|_s \leq \text{const}.$$

这样便有 $\int_0^1 \|f_y(x, \tau w) \cdot w\|_s d\tau \leq \text{const}.$

所以

$$\|f(x, w(x))\|_s \leq \text{const.} \quad (4.5)$$

这说明 $\forall w \in H_s^\delta$, 均有 $f(x, w(x)) \in H_s$. 而且其 H_s 模有与 $w \in H_s^\delta$ 无关的上界. 由定理 2 知, 当 $\lambda \geq \lambda_0$ 时存在方程组 (2.1) 的唯一强解 $u \in H_s$. 此即 $\Phi(w)$. 并且 (4.1) 式成立. 记 C 为 (4.1) 与 (4.5) 式右端 const 之积. 取 $\lambda_1 = \max \{\lambda_0, C/\delta\}$, 即满足引理要求.

引理 4.2 设引理 4.1 的假设满足, 则存在 $\lambda_2 \geq \lambda_1$, 使当 $\lambda \geq \lambda_2$ 时

$$\|\Phi(w_1) - \Phi(w_2)\|_0 \leq q \|w_1 - w_2\|_0, \quad \forall w_1, w_2 \in H_s^\delta, \quad (4.6)$$

其中 $0 < q < 1$.

证 在 $\lambda \geq \lambda_1$ 时, 设

$$u_1 = \Phi(w_1), \quad u_2 = \Phi(w_2).$$

则

$$\begin{aligned} & \sum a_i(x, w_1) \frac{\partial}{\partial x_i} (u_1 - u_2) + \lambda (u_1 - u_2) \\ &= f(x, w_1) - f(x, w_2) - \sum (a_i(x, w_1) - a_i(x, w_2)) \frac{\partial u_2}{\partial x_i}. \end{aligned}$$

由 0 阶能量不等式有

$$\begin{aligned} \|u_1 - u_2\|_0 &\leq \frac{\text{const}}{\lambda} \|f(x, w_1) - f(x, w_2)\|_0 \\ &\quad + \frac{\text{const}}{\lambda} \left\| \sum (a_i(x, w_1) - a_i(x, w_2)) \frac{\partial u_2}{\partial x_i} \right\|_0. \end{aligned}$$

对上式右端利用中值定理进行估计, 考虑到假设(4.3)与引理 4.1, 立即可得

$$\|u_1 - u_2\|_0 \leq \frac{\text{const}}{\lambda} \|w_1 - w_2\|_0.$$

因而引理成立.

算子 Φ 定义在 H_s^0 上. 为能利用压缩映象原理, 就要将 Φ 延拓到 H_s^0 的闭包上. 以 $\bar{H}_s^0$ 表示 H_s^0 在 H_s 中的闭包, 即

$$\bar{H}_s^0 = \{w \in H_s; \|w\|_s \leq \delta\}.$$

为能在 H_0 中用压缩映象原理, 还需要下引理:

引理 4.3 $\bar{H}_s^0$ 在 H_0 中是闭的.

这个引理的证明见 [2]. 而实际上, 它是 Banach-Saks 定理的简单推论.

定理 3 设拟线性组 (1) 满足 § 1 中的假设 (I), (II). $s > \frac{7}{2}n + 6$. $f(x, y)$ 满足引理 4.1 中的假设 (4.2), (4.3). 则当 λ 充分大时, 方程组 (1) 在 $\bar{H}_s^0$ 中有唯一解.

证 当 $\lambda \geq \lambda_2$ 时, 由引理 4.2, 算子

$$\Phi: H_s^0 \rightarrow H_s^0$$

按 H_0 模连续. 由引理 4.3, $\bar{H}_s^0$ 在 H_0 中闭. 象 [4] 中那样, 将 Φ 连续延拓到 $\bar{H}_s^0$ 上. 延拓后的算子仍记为 Φ , 则由引理 4.1, 4.2 知, Φ 为 $\bar{H}_s^0$ 到 $\bar{H}_s^0$ 自身的映照, 而且是压缩映照.

不难说明, $\forall w \in \bar{H}_s^0$, $\Phi(w)$ 是方程组 (2.1) 相应于 w 的强解. 由压缩映象原理, Φ 在 $\bar{H}_s^0$ 中有不动点 u :

$$\Phi(u) = u.$$

u 显然是拟线性组 (1) 的解. 唯一性可由常规办法得到.

本文是在谷超豪教授指导下完成的, 并得到陈恕行付教授许多帮助, 在此表示衷心的感谢.

注 1 若象 Friedrichs 和 Lax^[1] 最初关于线性方程所作的那样, 要求方程组 (1) 的系数在某集外为常数, 则利用 [3] 中的关于拟微分算子的估计, 只要 $s > \frac{3}{2}n + 2$ 即可.

注 2 本文的方法适用于一阶拟线性可对称化双曲组的局部 Cauchy 问题的讨论.

参 考 文 献

- [1] Friedrichs, K. O. and Lax, P. D., Boundary value problems for first order operators. *Comm. Pure Appl. Math.*, (1965), 355—388.
- [2] Hahn-Goldberg, Generalized linear and quasilinear accretive systems of partial differential equation., *Comm. in P. D. E.*, 2(2), (1977), 109—164.
- [3] Kohn, J. J. and Nirenberg, L., An algebra of pseudo-differential operators, *Comm. Pure Appl. Math.*, (1965), 269—305.
- [4] 谷超豪, 拟线性正对称方程组的边值问题及其对混合型方程的应用, *数学学报*, 21(1978), 119—129.
- [5] 谷超豪, 正对称型偏微分方程组的可微分解, *数学学报*, 14(1964), 503—516.
- [6] Friedrichs, K. O., The identity of weak and strong extensions of differential Operators, *Trans. Amer. Math. Soc.*, 55: 1 (1944), 132—151.
- [7] Kumano-go, H., Remarks on pseudo-differential operators, *J. Math. Soc. Japan*, 21: 3(1969).

ON THE EXISTENCE OF SOLUTIONS FOR FIRST ORDER QUASILINEAR-SYMMETRIZABLE SYSTEMS OF PARTIAL DIFFERENTIAL EQUATIONS

QIN TIEHU

(Research Institute of Mathematics, Fudan University)

ABSTRACT

In this paper we study the first order quasilinear symmetrizable system of partial differential equations

$$\sum_{i=1}^n a_i(x, u) \frac{\partial u}{\partial x_i} + \lambda u = f(x, u), \quad (1)$$

where $a_i(x, y)$ are $k \times k$ matrices.

Before stating the main results, we give the following definition:

Definition. If m is a real number, we denote by S_y^m the set of all $\alpha(x, y, \xi) \in C^\infty(\mathbf{R}^n \times V \times \mathbf{R}^n)$, where V is some neighbourhood of the origin in $\mathbf{R}^k$, such that for all multiindices α, β, γ we have with a constant $C_{\alpha, \beta, \gamma}$

$$|\partial_x^\alpha \partial_y^\beta \partial_\xi^\gamma \alpha(x, y, \xi)| \leq C_{\alpha, \beta, \gamma} (1 + |\xi|)^{m - |\gamma|}. \quad \forall (x, y, \xi) \in \mathbf{R}^n \times V \times \mathbf{R}^n.$$

On the system (1) we assume:

$$(I) \quad \alpha(x, y, \xi) = \sqrt{-1} \sum_{i=1}^n a_i(x, y) \xi_i \in S_y^1$$

(II) There is a non-singular $k \times k$ matrix $r(x, y, \xi) \in S_y^0$ with the following properties

$$r(x, y, \xi) \alpha(x, y, \xi) = \bar{\alpha}(x, y, \xi) \bar{r}(x, y, \xi), \quad \operatorname{Re} r(x, y, \xi) \geq p, \\ \forall (x, y, \xi) \in \mathbf{R}^n \times V \times \mathbf{R}^n,$$

where p is some positive number.

Under the preceding conditions we prove following main Theorem

Theorem. If $f(x, y)$ satisfies the following conditions

$$f(x, 0) \in H_s,$$

$$\sup_{\substack{(x, y) \in \mathbf{R}^n \times V \\ |\alpha| + |\beta| \leq s+1}} |\partial_x^\alpha \partial_y^\beta f(x, y)| \leq \text{const.},$$

then there exists a unique solution in $\bar{H}_s^0$ for the quasilinear system (1) when λ is sufficiently large, where $\bar{H}_s^0 = \{w \in H_s, \|w\|_s \leq \delta\}$, $s > \frac{7}{2}n + 6$.