

### 55. Über die Rand- und Eigenwertprobleme der linearen elliptischen Differentialgleichungen zweiter Ordnung.

Von Kunihiko KODAIRA.

Physikalisches Institut der Kaiserlichen Universität, Tokyo.

(Comm. by T. TAKAGI, M.I.A., May 12, 1944.)

§ 1. *Vorbereitung*<sup>1)</sup>. In vorliegender Note betrachten wir lineare elliptische Differentialausdrücke  $L(u)$  für die Funktion  $u(x^1, x^2, \dots, x^n)$ , welche als Eulersche Variationsausdrücke aus einem quadratischen Integral:

$$E(u) = \int \left( \sum a_{jk} \frac{\partial u}{\partial x^j} \frac{\partial u}{\partial x^k} + 2u \sum b_j \frac{\partial u}{\partial x^j} + cu^2 \right) dx^1 dx^2 \dots dx^n$$

entstehen, und behandeln die Rand- und Eigenwertprobleme der Differentialausdrücke  $L(u)$  für ein beschränktes offenes Gebiet  $\mathfrak{M}$  des  $(x^1, x^2, \dots, x^n)$ -Raumes nach der Weylschen „Methode der orthogonalen Projektion“<sup>2)</sup>. Dabei sind  $a_{jk}$ ,  $b_j$ ,  $c$  als genügend reguläre, beschränkte Funktionen in  $\mathfrak{M}$  vorausgesetzt<sup>3)</sup>, und es soll eine positive Konstante  $k$  geben, sodass in jeder Stelle von  $\mathfrak{M}$  für beliebige Parameter  $u, u_1, u_2, \dots, u_n$  die Ungleichung:

$$(1.1) \quad \sum a_{jk} u_j u_k + 2u \sum b_j u_j + cu^2 \geq k \sum u_j^2$$

gilt. Es ist zweckmässig,  $\mathfrak{M}$  als eine Riemannsche Mannigfaltigkeit mit der Metrik:  $ds^2 = g_{jk} dx^j dx^k$  aufzufassen, welche mit  $a_{jk}$  mittels der Relation:  $\sqrt{g} g^{jk} = a_{jk}$  verknüpft wird. Dementsprechend setzen wir  $b_j = \sqrt{g} p^j$ ,  $c = \sqrt{g} q$ ; es wird also

$$E(u) = \int (g^{jk} \partial_j u \partial_k u + 2u p^j \partial_j u + qu^2) \sqrt{g} dG,$$

wobei  $\partial_j = \frac{\partial}{\partial x^j}$  und  $dG = dx^1 dx^2 \dots dx^n$  gesetzt wird. Nun führen wir als Hilfsmittel „Skalar-Vektoren“  $\Phi, \Psi, \dots$  mit  $n+1$  Komponenten:

$$\Phi = (\varphi, \varphi_1, \varphi_2, \dots, \varphi_n)$$

ein, und setzen für beliebiges Teilgebiet  $G$  aus  $\mathfrak{M}$

$$(u, v)_G = \int_G uv \sqrt{g} dG,$$

$$(\Phi, \Psi)_G = \int_G (g^{jk} \varphi_j \psi_k + \varphi p^j \psi_j + \psi p^j \varphi_j + q \varphi \psi) \sqrt{g} dG.$$

1) Vgl. R. Courant und D. Hilbert: *Meth. d. Math. Physik II*, Kap. VII.

2) H. Weyl: *Method of orthogonal projections in potential theory*, *Duke Math. Journ.* Vol. 7 (1940), 411-444.

3) Eine Funktion heisst regulär, wenn sie bis zur genügend hohen Ordnung stetig differenzierbar ist. Vgl. J. Hadamard: *Lectures on Cauchy's problem*, pp. 11-12.

Für  $(u, v)_{\mathfrak{M}}$  bzw.  $(\phi, \psi)_{\mathfrak{M}}$  schreiben wir  $(u, v)$  bzw.  $(\phi, \psi)$ , und setzen  $\|u\| = \sqrt{(u, u)}$ ,  $\|\phi\| = \sqrt{(\phi, \phi)}$ . Ferner definieren wir den Operator  $\alpha$  bzw.  $\alpha^*$  durch

$$\alpha u = (u, \partial_1 u, \partial_2 u, \dots, \hat{c}_i u),$$

bzw.

$$\alpha^* \phi = -\frac{1}{\sqrt{g}} \partial_j (\sqrt{g} \phi^j) + p^j (\phi_j - \partial_j \phi) + q^* \phi,$$

wobei

$$q^* = q - \frac{1}{\sqrt{g}} \partial_i (\sqrt{g} p^j)$$

ist. In dieser Schreibweise ist also  $E(u) = (\alpha u, \alpha u)$ . Der Differentialoperator  $L$  lässt sich dann schreiben:

$$(1.2) \quad L = \alpha^* \alpha = -\Delta + q^*, \quad \Delta = \frac{1}{\sqrt{g}} \partial_j \sqrt{g} g^{jk} \partial_k,$$

und es gelten die „Greenschen Formeln“:

$$(1.3) \quad (\phi, \alpha u)_G = (\alpha^* \phi, u)_G + \int_{\Gamma} (\phi^j + p^j \phi) u \sqrt{g} \, do_j,$$

$$(1.4) \quad (v, L(u))_G = (L(v), u)_G + \int_{\Gamma} (v \partial_j u - u \partial_j v) \sqrt{g} \, do^j,$$

wobei  $\Gamma$  die Oberfläche vom Gebiet  $G$  ist und  $do_j$  die Flächenelemente:  $(-1)^{j-1} dx^1 dx^2 \dots dx^{j-1} dx^{j+1} \dots dx^n$  bedeutet.

Im Vorhergehenden ist für  $u, v, \phi, \dots$  natürlich geeignete Regularität vorausgesetzt. Nunmehr lassen wir diese Voraussetzung weg, und betrachten also nach Lebesgue messbaren Funktionen. Es sei  $D(u)$  ein selbst adjungierter Differentialausdruck der Form:  $-\Delta u + hu$ , wobei  $h$  eine in  $\mathfrak{M}$  genügend reguläre Funktion sein soll. Dann gilt das

**Hauptlemma.** *Es sei  $e$  eine in  $\mathfrak{M}$  nach Lebesgue messbare Funktion mit  $(e, e) < +\infty$  und es gelte  $(e, D(\eta)) = 0$  für alle in einem Randstreifen<sup>1)</sup> von  $\mathfrak{M}$  verschwindenden 3-mal stetig differenzierbaren Funktionen  $\eta$ . Dann ist  $e$  in  $\mathfrak{M}$  regulär und genügt der Gleichung  $D(e) = 0$ . Sind ausserdem  $g_{jk}$  und  $h$  regulär analytisch, so ist auch  $e$  regulär analytisch.*

Der Beweis dieses Hauptlemmas soll in § 3 gegeben werden— Nun führen wir die Funktionenräume:

$$\mathfrak{I} = \{u; \|u\| < +\infty\}$$

und

$$\mathfrak{Q} = \{\phi; \|\phi\| < +\infty, \|\varphi\| < +\infty\}$$

ein. ( $\{*\}; E$ ) bezeichnet im allgemeinen die Menge aller  $*$  mit der Eigenschaft  $E$ .)  $\mathfrak{I}$  bildet offenbar einen vollständigen Hilbertschen Raum mit der Metrik  $\|\cdot\|$ ;  $\mathfrak{Q}$  ist aber in der Metrik  $\|\cdot\|$  nicht mmer vollständig. Wir setzen

1) Vgl. Courant u. Hilbert: Meth. d. Math. Physik, S. 481.

$$Q(\phi, \psi) = (\phi, \psi) + (\varphi, \psi);$$

in dieser Metrik  $Q$  wird dann  $\mathfrak{L}$  auch vollständig. Ferner bezeichnen wir den Funktionenraum aller in einem Randstreifen verschwindenden 3-mal stetig differenzierbaren Funktionen mit  $\mathfrak{n}$ . Die Räume  $\mathfrak{Y}$  und  $\mathfrak{D}$ , die in unserer Theorie zentrale Rolle spielen, definieren wir dann folgendermassen

Definition I.  $\mathfrak{Y}$  ist die in  $\mathfrak{L}$  gebildete  $Q$ -abgeschlossene Hülle vom Raum aller  $Y = \alpha\eta$ ,  $\eta \in \mathfrak{n}$ :  $\mathfrak{Y} = Q$ -abg. Hülle von  $\{\alpha\eta; \eta \in \mathfrak{n}\}$ .

Definition II.  $\mathfrak{D}$  ist der Raum aller ersten Komponenten  $y$  von  $Y \in \mathfrak{Y}$ .

Es gilt für jedes  $\eta \in \mathfrak{n}$  die bekannte Ungleichung<sup>1)</sup>

$$\|\eta\| \leq C\|\alpha\eta\|,$$

wobei  $C$  eine von  $\eta$  unabhängige Konstante ist. Jedes  $Y \in \mathfrak{Y}$  genügt also

$$(1.5) \quad \|y\| \leq C\|Y\|,$$

woraus folgt

$$\|Y\|^2 \leq Q(Y, Y) \leq (1 + C^2)\|Y\|^2.$$

In  $\mathfrak{Y}$  ist also die Metrik  $\|\cdot\|$  mit der Metrik  $Q$  äquivalent.  $\mathfrak{Y}$  ist also im Sinne der Metrik  $\|\cdot\|$  auch ein vollständiger Hilbertscher Raum. Andererseits gilt es wegen (1.3) für beliebiges  $\eta \in \mathfrak{n}$  die Gleichung:  $(\eta, \alpha^*\psi) = (\alpha\eta, \psi)$ . Jedes  $Y \in \mathfrak{Y}$  genügt also für beliebiges stetig differenzierbares  $\psi \in \mathfrak{L}$

$$(1.6) \quad (y, \alpha^*\psi) = (Y, \psi).$$

Hieraus folgt, dass jedes  $Y \in \mathfrak{Y}$  durch seine erste Komponente  $y$  eindeutig bestimmt wird. Man kann also für jedes  $Y \in \mathfrak{Y}$

$$(1.7) \quad Y = Ay$$

schreiben. Der so definierte Operator  $A$  ist offenbar ein abgeschlossener linearer Operator, der den überall dichten Teilbereich  $\mathfrak{D}$  aus dem Hilbertschen Raum  $\mathfrak{I}$  auf dem Hilbertschen Raum  $\mathfrak{Y}$  (mit der Metrik  $\|\cdot\|$ ) abbildet.  $A$  ist nichts anderes als die Abschliessung von  $\alpha$ , wenn man  $\alpha$  als nur in  $\mathfrak{n}$  definierten Operator betrachtet. Es gilt wegen (1.5), (1.6)

$$(1.8) \quad \|y\| \leq C\|Ay\|,$$

$$(1.9) \quad (y, \alpha^*\psi) = (Ay, \psi).$$

Die letzte Gleichung (1.9) zeigt, dass der adjungierte Operator  $A^*$  von  $A$  eine Erweiterung von  $\alpha^*$  ist.

Definition III. Man setzt  $H = A^*A$ .

Es gilt dann wegen (1.8)

$$(1.10) \quad \|y\| \leq C\|Ay\| \leq C^2\|Hy\|.$$

---

1) Courant u. Hilbert, S. 484

$H$  ist offenbar ein positiv-definiter selbst adjungierter Operator mit dem in  $I$  überall dichten Definitionsbereich, und eine Erweiterung vom in  $n$  definierten Operator  $L = a^*a$ . Ferner ist die Abbildung  $Ay \rightarrow y$  vom  $\mathfrak{Y}$  in  $I$ , wie nach Rellich gezeigt wird<sup>1)</sup>, vollstetig. Die Abbildung  $Hy \rightarrow y$  muss also wegen (1.10) um so mehr vollstetig sein. Damit ist bewiesen der folgende:

**Satz 1.** *Der Differentialoperator  $L$ , der als nur in  $n$  definierter Operator betrachtet werden soll, besitzt eine positiv-definite selbst adjungierte Erweiterung  $H$ . Die Umkehrung  $Hy \rightarrow y$  von  $H$  ist vollstetig<sup>2)</sup>.*

§ 2. *Rand- und Eigenwertprobleme.* Das Eigenwertproblem ist schon durch den Satz 1 beinahe gelöst. Es gibt nämlich für  $H$  wegen der Vollstetigkeit von  $Hy \rightarrow y$  ein System der Eigenwerte  $\lambda_j$  mit  $\lambda_j \rightarrow +\infty (j \rightarrow \infty)$  und zugehörige Eigenfunktionen  $e_j$ , die zu  $\mathfrak{D}$  gehören und einen vollständigen normierten orthogonalen System aus  $I$  bilden. Für beliebiges  $\eta \in n$  gilt dabei

$$\lambda_j(e_j, \eta) = (He_j, \eta) = (e_j, H\eta) = (e_j, L(\eta)).$$

Setzt man  $D = L - \lambda_j = -\Delta + q^* - \lambda_j$ , dann gilt also  $(e_j, D(\eta)) = 0$ . Nach dem Hauptlemma muss also  $e_j$  in  $\mathfrak{M}$  regulär sein, und  $L(e_j) - \lambda_j e_j = D(e_j) = 0$  genügen. Damit ist bewiesen der

**Satz 2.** *Es gibt für  $L$  ein vollständiges normiertes orthogonales System von Eigenfunktionen  $e_j$ , welche in  $\mathfrak{M}$  regulär sind und zu  $\mathfrak{D}$  gehören. Die zugehörigen Eigenwerte  $\lambda_j$  sind alle positiv, und es gilt:  $\lim_{j \rightarrow \infty} \lambda_j = +\infty$ .*

Das Randwertproblem kann nun folgendermassen formuliert werden:<sup>3)</sup>

**Randwertproblem.** *Es sei eine in  $\mathfrak{M}$  beschränkte, stetig differenzierbare Funktion  $f$  mit  $\|af\| < +\infty$  gegeben. Gesucht ist dann eine in  $\mathfrak{M}$  zweimal stetig differenzierbare Funktion  $\varphi$ , welche in  $\mathfrak{M}$  die Gleichung  $L(\varphi) = 0$  genügt, und für welche  $\varphi - f$  zu  $\mathfrak{D}$  gehört.*

Wegen der Vollständigkeit von  $\mathfrak{Y}$  in Metrik  $\|\cdot\|$ , kann man  $af$  aus  $\mathfrak{X}$  in zweien Teilen zerspalten:  $af = \Phi + Z$ , wobei  $Z \in \mathfrak{Y}$  und  $(\Phi, Y) = 0$  für jedes  $Y \in \mathfrak{Y}$  sein soll. Dann ist die erste Komponente  $\varphi$  von  $\Phi$  gerade die gesuchte Funktion. Denn: Erstens ist es klar, dass  $\varphi - f = -z \in \mathfrak{D}$  ist. Zweitens gilt wegen (1.6) für jedes  $\eta \in n$

$$(\varphi, L(\eta)) = (f, a^*a\eta) - (z, a^*a\eta) = (af, a\eta) - (Z, a\eta) = (\Phi, a\eta) = 0.$$

$\varphi$  ist also nach dem Hauptlemma in  $\mathfrak{M}$  regulär und genügt  $L(\varphi) = 0$ . Um die Eindeutigkeit von  $\varphi$  zu zeigen, sei  $\varphi_1$  eine weitere Lösung vom Randwertproblem; man setze  $\varphi - \varphi_1 = \psi$ . Dann gilt wegen  $\psi \in \mathfrak{D}$   $a\psi \in \mathfrak{Y}$ , also  $(a\psi, a\eta) = (L(\psi), \eta) = 0$  für jedes  $\eta \in n$ . Mithin muss  $\psi = 0$

1) Courant u. Hilbert, S. 489; vgl. auch Rellich: Cött. Nachr. 1930.

2) K. Friedrichs: Spektraltheorie halbbeschränkter Operatoren, I. Math. Ann. Bd. 109 (1934), S. 486.

3) Courant u. Hilbert, S. 483.

sein. Es gilt also der

Satz 3. *Randwertprobleme besitzen eine und nur eine Lösung. Für analytische Differentialgleichung ist die Lösung auch regulär analytisch.*

§ 3. *Beweis des Hauptlemmas.* Für den Fall des analytischen Differentialausdrucks der Form  $\Delta$ , haben wir dieses Hauptlemma in einer vorangehenden Note<sup>1)</sup> bewiesen. Die dabei benutzte Methode wird durch eine kleine Modifikation auch für allgemeinen nicht analytischen Differentialausdruck anwendbar.

Es sei  $e$  ein Element aus  $I$  und es gelte für alle  $\eta \in n$  die Gleichung  $(e, D(\eta))=0$ . Man hat dann zu zeigen, dass  $e$  regulär ist und  $D(e)=0$  gilt.  $D(e)=0$  folgt aber unmittelbar aus  $(e, D(\eta))=0$ , falls  $e$  regulär (mindestens zweimal stetig differenzierbar!) ist. Man hat also nur die Regularität von  $e$  zu beweisen—. Es sei  $r(x, \xi)$  der geodätische Abstand von  $x$  bis  $\xi$  im Sinne der Metrik:  $ds^2 = g_{jk} dx^j dx^k$ , und  $P(x, \xi) = \{r(x, \xi)\}^2$ . Man kann dann nach Hadamard<sup>2)</sup> eine Funktion der Form:

$$u(x, \xi) = P^p U(x, \xi) + (\log P) V(x, \xi), \quad p = -\frac{n-2}{2},$$

mit regulären  $U, V$  mit  $U(\xi, \xi)=1$  so konstruieren, dass  $D(u)$  in  $x$  und  $\xi$  auch regulär ist. Wir wählen dann eine genügend kleine positive Konstante  $\alpha$ , bilden mindestens 4-mal stetig differenzierbaren Funktionen  $II(P), L(P)$  mit

$$II(P) = \begin{cases} P^p & \text{für } r \leq \alpha, \\ 0 & \text{für } r \geq 2\alpha, \end{cases}$$

$$L(P) = \begin{cases} \log P & \text{für } r \leq \alpha, \\ 0 & \text{für } r \geq 2\alpha, \end{cases}$$

und setzen

$$\zeta(x, \xi) = II(P)U + L(P)V.$$

Ferner wählen wir eine positive Konstante  $\beta < \alpha$  und setzen

$$II_\beta(P) = \begin{cases} \frac{1}{2\beta^{2p}} \{n\beta^2 - (n-2)P\} & \text{für } r \leq \beta, \\ II(P) & \text{für } r > \beta, \end{cases}$$

$$L_\beta(P) = \begin{cases} 2 \log \beta - 1 + \frac{P}{\beta^2} & \text{für } r \leq \beta, \\ L(P) & \text{für } r > \beta, \end{cases}$$

$$\eta_\beta(x, \xi) = II_\beta(P)U + L_\beta(P)V.$$

$\eta_\beta(x) = \eta_\beta(x, \xi)$  lässt sich aber durch  $\eta \in n$  so approximieren, dass

1) K. Kodaira: Über die harmonischen Tensorfelder in Riemannschen Mannigfaltigkeiten, in dieser Proc., § 4.

2) J. Hadamard: Lectures on Cauchy's Problem, Book II, Chap. III.

$\|D(\eta) - D(\eta_\beta)\| \rightarrow 0$  wird<sup>1)</sup>. Aus  $(e, D(\eta)) = 0$  folgt also  $(e, D(\eta_\beta)) = 0$ . Setzt man nun

$$\delta(\beta; x, \xi) = D(\eta_\beta) - D(\zeta),$$

so schreibt sich  $(e, D(\eta_\beta)) = 0$  auch in der Gestalt

$$(e, \delta(\beta)) = -(e, D(\zeta)).$$

Für  $r(x, \xi) > \beta$  ist aber  $\delta(\beta; x, \xi) = 0$  und für  $r(x, \xi) < \beta$  gilt

$$\lim_{\beta \rightarrow 0} \beta^n \delta(\beta; x, \xi) = n(n-2) \quad (\text{gleichmässig in } r(x, \xi) < \beta).$$

Hieraus folgt<sup>2)</sup>

$$(3.1) \quad \lim_{\beta \rightarrow 0} \iint (e, \delta(\beta; \cdot, \xi)) - (n-2) \omega e(\xi) \sqrt{g} \, dG_\xi = 0,$$

wobei  $\omega$  den Oberflächeninhalt der  $n$ -dim. Einheitskugel bedeutet. Es ist also

$$e(\xi) = -\frac{1}{(n-2)\omega} (e, D(\zeta(\cdot, \xi))).$$

$D(\zeta)$  ist aber in  $x$  und  $\xi$  regulär.  $e$  muss also auch regulär sein. Im analytischen Fall kann man als  $u$  eine Grundlösung von  $D(u) = 0$  wählen. Für beliebiges Teilgebiet  $G$  aus  $\mathfrak{M}$  mit dem Rand  $\Gamma$  gilt dann

$$e(\xi) = -\frac{1}{(n-2)\omega} \int_{\Gamma} \{e \partial_j u(\cdot, \xi) - u(\cdot, \xi) \partial_j e\} \sqrt{g} \, do^j,$$

falls  $\xi \in G$  ist.  $e$  ist also regulär analytisch. —Damit ist unser Hauptlemma vollständig bewiesen.

Das Hauptlemma lässt sich auf die folgende Form verallgemeinern:

Satz 4. *Es sei  $D = -\Delta + h$  und  $t$  eine in  $\mathfrak{M}$  reguläre Funktion. Genügt dann  $e \in I$  für jedes  $\eta \in n$  der Gleichung  $(e, D(\eta)) = (t, \eta)$ , so ist auch  $e$  in  $\mathfrak{M}$  regulär und es gilt  $D(e) = t$ .*

Beweis. Man definiere  $\eta_\beta$  und  $\zeta$  wie oben. So gilt

$$(e, \delta(\beta)) = (t, \eta_\beta) - (e, D(\zeta)),$$

also folgt wegen (3.1)

$$(n-2)\omega e(\xi) + (e, D(\zeta(\cdot, \xi))) = (t, \zeta(\cdot, \xi)).$$

$(t, \zeta)$  lässt sich aber mit regulären Funktionen  $F, H$  in der Form

$$(t, \zeta(\cdot, \xi)) = \int \{H(P)F(\pi, \xi) + L(P)H(\pi, \xi)\} d\pi^1 d\pi^2 \dots d\pi^n$$

schreiben, wobei  $P = g_{jk}(\xi) \pi^j \pi^k$  ist, wenn man mit  $\pi^j$  die normalen

1) Vgl. K. Kodaira: a. a. O.

2) Vgl. K. Kodaira: a. a. O.

Koordinaten um  $\xi$  bezeichnet.  $(t, \zeta)$  ist also in  $\xi$  regulär,  $e$  muss also auch regulär sein.

Bemerkung. Mit Hilfe dieses letzten Satzes kann man auch die Randwertaufgabe für die nicht homogene Gleichung  $L(\varphi)=t$  lösen: Es sei wieder eine in  $\mathfrak{M}$  beschränkte stetig differenzierbare Funktion  $f$  mit  $\|af\| < +\infty$  gegeben. Man hat dann zu beweisen, dass es eine in  $\mathfrak{M}$  reguläre Funktion  $\varphi$  mit  $L(\varphi)=t$ ,  $\varphi-f \in \mathfrak{D}$  gibt. Es gilt wegen (1.8)

$$|(af, Y) - (t, y)| \leq (\|af\| + C\|t\|) \|Y\|,$$

also ist  $(af, Y) - (t, y)$  eine beschränkte lineare Funktion von  $Y$  aus  $\mathfrak{Y}$ . Es gibt mithin nach dem Riesschen Satz ein  $Z \in \mathfrak{Y}$  mit

$$(3.2) \quad (af, Y) - (t, y) = (Z, Y) \quad \text{für alle } Y \in \mathfrak{Y}^0.$$

Setzt man nun  $\varphi = af - Z$ , so ist  $\varphi$  gerade die gesuchte Funktion. Denn: Erstens ist es klar, dass  $\varphi - f \in \mathfrak{D}$  ist. Zweitens gilt für jedes  $\eta \in \mathfrak{n}$  wegen (3.2)

$$(\varphi, L(\eta)) = (f - z, a^*a\eta) = (af - Z, a\eta) = (t, \eta),$$

also muss  $\varphi$  wegen des obigen Satzes regulär sein und der Gleichung  $L(\varphi)=t$  genügen.

---

1) Dies bedeutet eine Verallgemeinerung der „Methode der orthogonalen Projektion“. Für  $t=0$  ist nämlich  $Z$  die Projektion von  $af$  auf  $\mathfrak{Y}$ .