

**К ВОПРОСУ О КЛАССАХ ЕДИНСТВЕННОСТИ РЕШЕНИЯ
ЗАДАЧИ КОШИ ДЛЯ ОБЩИХ ЛИНЕЙНЫХ УРАВНЕНИЙ
В ЧАСТНЫХ ПРОИЗВОДНЫХ**

П. Е. Левин

Рассматриваются классы единственности и неединственности решений нормального типа по t задачи Коши:

$$P(D_x, D_t)u(x, t) = 0, \quad (1)$$

$$D_t^k u(x, 0) = 0, \quad k = 0, 1, \dots, m-1, \quad t \geq 0, \quad -\infty < x < \infty, \quad (2)$$

где $P(s, \lambda) = \sum_{k=0}^m P_k(s) \lambda^k$ — многочлен с постоянными коэффициентами порядка N по s и m по λ ; $P_m(s) \neq 0$.

В [1] проведена классификация уравнений вида (1) и получены условия того, что решение $u(x, t)$ задачи (1) — (2), удовлетворяющее оценке

$$|D_x^k u(x, t)| \leq C \exp\{\beta t\} G(x), \quad (3)$$

$$k = 0, 1, \dots, N-1; \quad -\infty < x < +\infty; \quad t \geq 0; \quad \beta > 0,$$

есть тождественный нуль. Однако для некоторых уравнений вида (1) полученные в [1] условия оставляют «зазор» между классами единственности и неединственности решения задачи Коши. Целью настоящей статьи является ликвидация этого пробела. Пусть

$$s_k(\lambda) = \sum_{j=0}^{\infty} a_{kj} \lambda^{\gamma_{kj}} = a_{k0} \lambda^{\gamma_{k0}} (1 + o(1)),$$

$$k = 1, \dots, N; \quad \gamma_{k0} > \gamma_{k1} > \dots > \gamma_{kj} > \dots; \quad o(1) \rightarrow 0, \quad |\lambda| \rightarrow \infty$$

разложение корней полинома $P(s, \lambda)$ в окрестности бесконечно удаленной точки [2]. Мы будем рассматривать те уравнения, для которых выполнены условия

$$P_m(s) \neq \text{const}, \quad P_m(0) \neq 0, \quad \min_{k: \gamma_{k0}=0} |\operatorname{Re} a_{k0}| = a > 0. \quad (4)$$

Преобразование Лапласа по t нашего решения является аналитической в некоторой правой полуплоскости функцией $y(x, \lambda)$, удовлетворяющей в силу (1) — (2) уравнению

$$P(D_x, \lambda) y(x, \lambda) = 0 \quad (5)$$

и в силу (3) — оценке

$$|D_x^k y(x, \lambda)| \leq C_1 G(x), \quad (6)$$

$$k = 0, 1, \dots, N-1; \quad -\infty < x < +\infty; \quad \operatorname{Re} \lambda \geq \sigma_0 > 0.$$

Из теоремы единственности преобразования Лапласа следует, что задача (1) — (2) в классе (3) имеет нетривиальное решение $u(x, t)$ тогда и только

тогда, когда уравнение (5) имеет в классе (6) нетривиальное решение $y(x, \lambda)$. Функции $y_k(x, \lambda) = Q_k(x) \exp\{s_k(\lambda)x\}$, где $Q_k(x)$ — полиномы, степень которых меньше кратности корня $s_k(\lambda)$ образуют фундаментальную систему решений уравнения (5) и значит,

$$y(x, \lambda) = \sum_{k=1}^N C_k(\lambda) y_k(x, \lambda). \quad (7)$$

Дифференцируя (7) $N - 1$ раз по x , мы получаем систему уравнений для определения $C_k(\lambda)$, используя (6) и вид функций $y_k(x, \lambda)$, получаем, как и в [1], оценку:

$$|C_k(\lambda)| \leq C|\lambda|^{M_1}(1+|x|)^{M_2} G(x) \exp\{-\operatorname{Re} s_k(\lambda)x\}, \quad (8)$$

$$k = 1, \dots, N; M_1 > 0, M_2 > 0; -\infty < x < \infty; \operatorname{Re} \lambda \geq \sigma_0.$$

Для тех корней $s_k(\lambda)$ полинома $P(s, \lambda)$, у которых $\gamma_{k0} = 0$, $|\operatorname{Re} a_{k0}| = a$, вводим следующие величины:

$$\delta = \max \gamma_{ki}; g_k(\lambda) = \operatorname{sign} \operatorname{Re} a_{k0} \cdot \operatorname{Re}[s_k(\lambda) - a_{k0}], \quad (9)$$

$$D_k = \{\lambda : g_k(\lambda) > 0\}; \varphi_0 = \operatorname{sign} \operatorname{Re} a_{k0}.$$

Возможны три случая:

I. $\delta < 0$; для всех $g_k(\lambda)$ справедливо $\sup_{\lambda \in D_k} \operatorname{Re} \lambda = \infty$.

II. $\delta < 0$; существует k , такое что $g_k(\lambda) \leq 0$, $\operatorname{Re} \lambda \geq \sigma_0 > 0$.

III. $\delta = 0$; что соответствует наличию корня

$$s_k(\lambda) = a_{k0}, |\operatorname{Re} a_{k0}| = a.$$

Каждое рассматриваемое уравнение (1) относится к одному (и только к одному) из этих типов.

Теорема 1. Для единственности решения задачи Коши в случае I в классе:

$$|D_x^k u(x, t)| \leq C \exp\{\beta t + \alpha|x|\} \quad (10)$$

$$k = 0, 1, \dots, N-1; \beta > 0; t \geq 0; -\infty < x < \infty$$

необходимо и достаточно, чтобы $\alpha \leq a$.

Доказательство. Пусть $\alpha \leq a$. Используя (8) и (10), получаем

$$|C_k(\lambda)| \leq C|\lambda|^{M_1}(1+|x|)^{M_2} \exp\{-\operatorname{Re} s_k(\lambda)x + \alpha|x|\}. \quad (8')$$

Выбрав $\operatorname{sign} x = \operatorname{sign} \operatorname{Re} s_k(\lambda)$, используя (4), в случаях, когда либо $\gamma_{k0} > 0$, либо $\gamma_{k0} = 0$, $|\operatorname{Re} a_{k0}| > a$, получим в достаточно далекой правой полуплоскости (за исключением, быть может, конечного числа как угодно узких секторов) оценку: $|\operatorname{Re} s_k(\lambda)| > a + \varepsilon$, где $\varepsilon > 0$, т. е.

$$|C_k(\lambda)| \leq C|\lambda|^{M_1}(1+|x|)^{M_2} \exp\{-\varepsilon|x|\}$$

(в силу $\alpha \leq a$). Устремив $|x| \rightarrow \infty$, получаем, что $C_k(\lambda) \equiv 0$. Пусть $\gamma_{k0} = 0$, $|\operatorname{Re} a_{k0}| = a$. Возьмем $\operatorname{sign} x = \operatorname{sign} \operatorname{Re} a_{k0}$ (в достаточно далекой правой полуплоскости $\operatorname{sign} \operatorname{Re} s_k(\lambda) = \operatorname{sign} \operatorname{Re} a_{k0}$). Тогда получим

$$|C_k(\lambda)| \leq C|\lambda|^{M_1}(1+|x|)^{M_2} \exp\{-|\operatorname{Re} s_k(\lambda)||x| + \alpha|x|\} \leq \\ \leq C|\lambda|^{M_1}(1+|x|)^{M_2} \exp\{-|\alpha + g_k(\lambda)||x| + \alpha|x|\} \leq C|\lambda|^{M_1}(1+|x|)^{M_2} \exp\{-g_k(\lambda)x\}.$$

Отсюда, устремив $|x| \rightarrow \infty$, получим при $\lambda \in D_k$ $C_k(\lambda) = 0$. Но D_k в силу непрерывности $g_k(\lambda)$ и предположения 1 имеет конечную точку сгущения в любой как угодно далекой правой полуплоскости, следовательно,

$C_k(\lambda) \equiv 0$, $k = 1, \dots, N$. Следовательно, $y(x, \lambda) \equiv 0$, а поэтому и $u(x, t) \equiv 0$.

В случае $\alpha > a$ наличие нетривиального решения задачи (1) — (2) в классе (10) показано в [1].

Теорема 2. Для единственности решения задачи Коши (1) — (2) в случаях II или III в классе (10) необходимо и достаточно, чтобы $\alpha < a$.

Доказательство. Достаточность утверждения этой теоремы была показана в [1], так как класс (10) с $\alpha < a$ совпадает с классом единственности теоремы 2 из [1].

Необходимость. Пусть $\alpha > a$. В случае II при некотором k

$$\gamma_{k0} = 0, |\operatorname{Re} a_{k0}| = a, g_k(\lambda) \leq 0 (\operatorname{Re} \lambda \geq \sigma_0).$$

Рассмотрим $y(x, \lambda) = \exp \{ s_k(\lambda) x \}$. Тогда, используя вытекающую из (4) ограниченность $|s_k(\lambda)|$, получим

$$\begin{aligned} |D_x^j y(x, \lambda)| &\leq |s_k(\lambda)|^j \exp \{ \operatorname{Re} s_k(\lambda) |x| \} \leq \\ &\leq C \exp \{ |a + g_k(\lambda)| |x| \} \leq C \exp \{ \alpha |x| \}, \end{aligned}$$

где $\alpha \geq a$. Тогда $z(x, \lambda) = \lambda^{-2} y(x, \lambda)$ также является решением уравнения (5), удовлетворяющим условию

$$|D_x^j z(x, \lambda)| \leq C \exp \{ \alpha |x| \}, j = 0, 1, \dots, N-1,$$

с $\alpha > a$ и $u(x, t) = L^{-1} z(x, \lambda)$ дает нетривиальное решение задачи (1) — (2), удовлетворяющее (10) с $\alpha > a$.

В случае III существует корень $s_j(\lambda) = a_{j0}$; $|\operatorname{Re} a_{j0}| = a$ и $u(x, t) = L^{-1} z(x, \lambda)$, где $z(x, \lambda) = \lambda^{-2} \exp \{ s_j(\lambda) x \}$, дает нетривиальное решение задачи (1) — (2) в классе (10) с $\alpha > a$.

Теоремы 1 и 2 исчерпывают вопрос о классах единственности и неединственности решения задачи (1) — (2) для рассматриваемых уравнений в классе (10). Однако при этом остается открытым вопрос о единственности решения задачи (1) — (2) в классе (3), если функция $G(x)$ не имеет вид $\exp \{ \alpha |x| \}$, например, в классе с $G(x) = \exp \{ [a + f(|x|)] |x| \}$, $f(|x|) \xrightarrow{|x| \rightarrow \infty} 0$. Исследованию этого вопроса посвящены теоремы 3 и 4.

Теорема 3. Для единственности решения задачи Коши (1) — (2) в случае I в классе:

$$|D_x^k u(x, t)| \leq C \exp \{ \beta t + [a + f(|x|)] |x| \} \quad (11)$$

$$k = 0, \dots, N-1; \beta > 0; t \geq 0; -\infty < x < \infty,$$

где $f(|x|) > 0$, непрерывная функция, необходимо и достаточно, чтобы

$$\inf_{|x| > 0} f(|x|) = 0.$$

Доказательство достаточности проводится аналогично доказательству достаточности теоремы 1 с той лишь разницей, что $|x|$ устремляем к ∞ не произвольно, а по последовательности, минимизирующей функцию $f(|x|)$. Если же $\inf f(|x|) > 0$, то существует решение $u(x, t)$, $u(x, t) \not\equiv 0$, задачи (1) — (2), удовлетворяющее (11), что следует из теоремы 1.

Перейдем к рассмотрению случая II. Будет использоваться следующая

Лемма. Пусть в (4): $\gamma_{k0} = 0$, $|\operatorname{Re} a_{k0}| = a$, $g_k(\lambda) \leq 0$ при $\operatorname{Re} \lambda > \sigma_0 > 0$. Тогда существуют такие $\delta_1 > 0$, $\delta_2 > 0$ и $\alpha_k \leq \gamma_{k1} < 0$, что

$$g_k(\lambda) \leq -\delta_1 |\lambda|^{\alpha_k}; \operatorname{Re} \lambda \geq \sigma_0 > 0 \quad (12)$$

и либо при $\tau > \tau_0 > 0$, либо при $\tau < -\tau_0 < 0$

$$|g_k(\sigma_0 + i\tau)| \leq \delta_2 |\tau|^{\alpha_k}. \quad (13)$$

Доказательство. По определению $g_k(\lambda)$ имеем

$$g_k(\lambda) = \sum_{j=1}^{\infty} |a_{kj}| \cdot |\lambda|^{\gamma_{kj}} \cdot c_{kj}(\lambda), \quad (14)$$

где $c_{kj}(\lambda) = \cos(\arg a_{kj} - |\gamma_{kj}| \arg \lambda) \cdot \varphi_0$. Из условия $g_k(\lambda) \leq 0$ нетрудно получить, что $c_{k1}(\lambda) = -|c_{k1}(\lambda)|$. Могут представиться две возможности:

а) $|c_{k1}(\lambda)| \geq m_1 > 0$ при $|\arg \lambda| < \frac{\pi}{2}$; б) $c_{k1}(\lambda) \rightarrow 0$ либо при $\arg \lambda \rightarrow -\frac{\pi}{2}$, либо при $\arg \lambda \rightarrow \frac{\pi}{2}$. В случае а) очевидно, что

$$g_k(\lambda) \leq -|a_{k1}(\lambda)| \frac{m_1}{2} |\lambda|^{\gamma_{k1}} \quad (15)$$

и тем самым имеет место (12) и (13) с $\alpha_k = \gamma_{k1}$. В случае б) для определенности положим $c_{k1}(\lambda) \rightarrow 0$ при $\arg \lambda \rightarrow \frac{\pi}{2}$. Тогда

$$|c_{k1}(\lambda)| = \sin \left[|\gamma_{k1}| \left(\frac{\pi}{2} - \arg \lambda \right) \right]. \quad (16)$$

Пусть далее $c_{kj}(\lambda) \rightarrow 0$ при $\arg \lambda \rightarrow \frac{\pi}{2}$, $j = 2, \dots, n-1$, но $|c_{kn}(\lambda)| \geq m_n > 0$ при $\arg \lambda \rightarrow \frac{\pi}{2}$. Тогда при $j = 2, \dots, n-1$ снова $|c_{kj}(\lambda)| = \sin \times \left[|\gamma_{kj}| \left(\frac{\pi}{2} - \arg \lambda \right) \right]$, и если $\lambda \in \Gamma = \left\{ \lambda : \operatorname{Re} \lambda \geq \sigma_0 > 0; \frac{\pi}{2} - \epsilon < \arg \lambda < \frac{\pi}{2} \right\}$, ϵ — достаточно малое, получим $|c_{kj}(\lambda)| \leq c |c_{k1}(\lambda)|$. Возвращаясь к (14) и учитывая, что $\gamma_{kj} < \gamma_{k1} < 0$ ($j > 1$), получим при $\lambda \in \Gamma$

$$g_k(\lambda) \leq -\frac{1}{2} |a_{k1}| |\lambda|^{\gamma_{k1}} |c_{k1}(\lambda)| + c_{kn}(\lambda) |\lambda|^{\gamma_{kn}} (1 + o(1)). \quad (17)$$

Из (16) вытекает оценка $|c_{k1}(\lambda)| \geq \frac{1}{\pi} |\gamma_{k1}| \sigma_0 |\lambda|^{-1}$ при $\lambda \in \Gamma$. Рассмотрим теперь два случая: $\gamma_{kn} \leq \gamma_{k1} - 1$; $\gamma_{kn} > \gamma_{k1} - 1$. В первом случае имеем из (17) при $\lambda \in \Gamma$

$$g_k(\lambda) \leq -\delta_1 |\lambda|^{\gamma_{k1}-1}; \quad 0 < \delta_1 < \frac{|a_{k1}| |\gamma_{k1}| \sigma_0}{2\pi} = |a_{kn}|. \quad (18)$$

Во втором случае при фиксированном σ ($\sigma \geq \sigma_0$) имеет место соотношение $g_k(\sigma + i\tau) = c_{kn}(\sigma + i\tau) |a_{kn}| |\tau|^{\gamma_{kn}} (1 + o(1))$, при $|\tau| \rightarrow \infty$, откуда следует, что $c_{kn}(\sigma + i\tau) < 0$ при достаточно больших значениях $|\tau|$. Отсюда в силу выбора n $c_{kn}(\lambda) = -|c_{kn}(\lambda)|$, возвращаясь к (17) и учитывая оценку $|c_{k1}(\lambda)|$, получим

$$g_k(\lambda) \leq -|a_{kn}| \frac{m_n}{2} |\lambda|^{\gamma_{kn}}, \quad \lambda \in \Gamma. \quad (19)$$

Если $c_{kj}(\lambda) \rightarrow 0$ при $\arg \lambda \rightarrow \frac{\pi}{2}$ и всех $j \geq 1$, то, поскольку в силу [2] при достаточно больших j $\gamma_{kj} \leq \gamma_{k1} - 1$, имеем, как и в случае $\gamma_{kn} \leq \gamma_{k1} - 1$, оценку (18). Оценки, аналогичные (18) или (19), имеют место и при

$$\lambda \in \tilde{\Gamma} = \left\{ \lambda : \operatorname{Re} \lambda \geq \sigma_0 > 0; -\frac{\pi}{2} < \arg \lambda < -\frac{\pi}{2} + \epsilon \right\},$$

если $c_{k_1}(\lambda) \rightarrow 0$ при $\arg \lambda \rightarrow -\frac{\pi}{2}$. Наконец, в области $-\frac{\pi}{2} < \arg \lambda < -\frac{\pi}{2} + \epsilon$ справедлива оценка вида (15). Объединяя (15), (18), (19) приходим к (12).

Рассматривая $c_{k_1}(\sigma_0 + i\tau)$ при $|\tau| \rightarrow \infty$ и проводя аналогичные рассуждения, получим (13).

Заметим, что в процессе доказательства леммы получены формулы:

в случае а) $\alpha_k = \gamma_{k_1}$;

в случае б) $\alpha_k = \max[\gamma_{k_1} - 1, \gamma_{k_n}]$.

В силу условия $\delta < 0$ имеем $\alpha_k < 0$.

Обозначим $l = -\frac{1}{\max_k \alpha_k}$.

Теорема 4. Для единственности решения задачи Коши (1) — (2) в случае II в классе

$$|D_x^k u(x, t)| \leq C \exp\{\beta t + \alpha|x|\} - \int_0^{|x|} H(t) dt, \quad (20)$$

$$k = 0, \dots, N-1; \quad t \geq 0; \quad -\infty < x < \infty; \quad \beta > 0,$$

где $H(x) > 0$, непрерывная, монотонно стремящаяся (при $x \rightarrow \infty$) к нулю функция, необходимо и достаточно, чтобы

$$\int_0^\infty [H(x)]^{1+l} dx = \infty. \quad (21)$$

Доказательство. Так как класс (20) содержится в классе (10) с $\alpha = a$, то точно так же, как и при доказательстве достаточности теоремы 1, полагая

$$Lu(x, t) = y(x, \lambda) = \sum_{k=1}^N C_k(\lambda) y_k(x, \lambda),$$

заключаем, что в случаях $\gamma_{k_0} > 0; \gamma_{k_0} = 0, |\operatorname{Re} a_{k_0}| > a; \gamma_{k_0} = 0, |\operatorname{Re} a_{k_0}| = a$, $\sup_{\lambda \in D_k} \operatorname{Re} \lambda = \infty, C_k(\lambda) \equiv 0$.

Нам остается рассмотреть случай, когда $\gamma_{k_0} = 0, |\operatorname{Re} a_{k_0}| = a, g_k(\lambda) < 0$. Из (8) имеем

$$\begin{aligned} |C_k(\lambda)| &\leq C_1 |\lambda|^{M_1} (1 + |x|)^{M_2} \exp\{-\operatorname{Re} s_k(\lambda)x + a|x| - \int_0^{|x|} H(t) dt\} \leq \\ &\leq C_1 |\lambda|^{M_1} (1 + |x|)^{M_2} \exp\{|\operatorname{g}_k(\lambda)| |x| - \int_0^{|x|} H(t) dt\}, \end{aligned}$$

поскольку $|\operatorname{Re} s_k(\lambda)| = a + g_k(\lambda); g_k(\lambda) = -|\operatorname{g}_k(\lambda)|$. Введем голоморфную и ограниченную в полуплоскости $\operatorname{Re} \lambda \geq \sigma_0 > 0$ функцию

$$f_k(\lambda) = \frac{C_k(\lambda)}{\lambda^{M_1}}$$

и оценим ее на той полувертикали $\sigma_0 + i\tau$, где выполнено (13),

$$|f_k(\sigma_0 + i\tau)| \leq C_2 \exp\{\delta_3 |\tau|^{\alpha_k} |x| - \int_0^{|x|} H(t) dt\}, \quad \delta_3 > \delta_2.$$

Выберем $|x| = x(\tau)$, где $H[x(\tau)] = \delta_4 |\tau|^{-\frac{1}{l}}$, $\delta_4 > \delta_3$. Тогда, учитывая, что $a_k \leq -\frac{1}{l}$, получаем

$$\begin{aligned} |f_k(\sigma_0 + i\tau)| &\leq C \exp\{\delta_3 |\tau|^{-\frac{1}{l}} x(\tau) - \delta_4 |\tau|^{-\frac{1}{l}} x(\tau)\} \leq \\ &\leq C \exp\{-\varepsilon_1 |\tau|^{-\frac{1}{l}} x(\tau)\}; \quad \varepsilon_1 > 0. \end{aligned}$$

Интегрируя по частям и используя (21), получим

$$\int_{-\infty}^{\infty} \tau^{-\frac{1}{l}-2} x(\tau) d\tau = \infty.$$

В силу критерия Карлемана [3] $f_k(\lambda) \equiv 0$. Значит и $C_k(\lambda) \equiv 0$, $k = 1, \dots, N$, что и требовалось доказать.

Необходимость. Допустим (21) не выполнено. В силу леммы существует $s_k(\lambda)$ такое, что

$$\gamma_{k0} = 0, \quad |\operatorname{Re} a_{k0}| = a, \quad g_k(\lambda) \leq -\delta_1 |\lambda|^{-\frac{1}{l}}.$$

Обозначим $y(x, \lambda) = \exp\{s_k(\lambda)x\}$,

$$f(\lambda) = \sup_{1 \leq i \leq N-1} |D_x^i y(x, \lambda)| \exp\{-a|x| + \int_0^{|x|} H(t) dt\}, \quad -\infty < x < +\infty.$$

Используя (12) и оценку $|s_k(\lambda)| \leq C_s$; $\operatorname{Re} \lambda \geq \sigma_0$, получим

$$\begin{aligned} f(\lambda) &\leq C_s \exp\{-\delta_1 r^{-\frac{1}{l}} x(r) + \int_0^{x(r)} H(t) dt\} \leq \\ &\leq C_s \exp\{\int_0^{x(r)} H(t) dt\}, \end{aligned}$$

где $|\lambda| = r$; $H[x(r)] = \delta_1 r^{-\frac{1}{l}}$.

Рассмотрим $f(r) = \int_0^{x(r)} H(t) dt$. Меняя пределы интегрирования и используя сходимость интеграла в (21), мы получаем

$$\int_r^\infty \frac{f(r)}{r^2} dr < \infty.$$

Но тогда существует [см. 3] голоморфная в некоторой правой полуплоскости функция $F(\lambda) \neq 0$ такая, что

$$|F(\lambda)f(\lambda)| \leq C_4 < \infty; \quad \operatorname{Re} \lambda \geq \sigma_0 > 0.$$

Функция $z(x, \lambda) = F(\lambda)y(x, \lambda)$ является решением уравнения (4), и так как

$$|D_x^i z(x, \lambda)| \leq C \exp\{a|x| - \int_0^{|x|} H(t) dt\},$$

$$J = 0, 1, \dots, N-1; \quad -\infty < x < \infty; \quad \operatorname{Re} \lambda \geq \sigma_0 > 0,$$

то $u(x, t) = L^{-1}[\lambda^{-2} z(x, \lambda)]$ является нетривиальным решением задачи (1) — (2) в классе (20), если интеграл в левой части (21) сходится. Теорема доказана.

В заключение автор выражает благодарность своему научному руководителю В. М. Борок.

ЛИТЕРАТУРА

1. В. М. Борок. ДАН СССР, т. 177, № 4, 1967, 759—762.
2. Н. Г. Чеботарев. Теория алгебраических функций. М.—Л., 1948.
3. С. Мандельбройт. Примыкающие ряды. Регуляризация последовательностей. Применения. ИЛ, М., 1955.

Поступила 14 декабря 1968 г.
