

Zusammenfassung Numerik von PDEs

© Tim Baumann, <http://timbaumann.info/uni-spicker>

Def. Sei $\Omega \subseteq \mathbb{R}^n$ offen. Eine DGL der Form

$$F(x, u, Du, \dots, D^k u) = 0$$

heißt **partielle DGL/PDE** der Ordnung $k \geq 1$, wobei

$$F : \Omega \times \mathbb{R} \times \mathbb{R}^n \times \dots \times \mathbb{R}^{n^k} \rightarrow \mathbb{R}$$

eine gegebene Funktion und $u : \Omega \rightarrow \mathbb{R}$ gesucht ist.

Def (Klassifikation von PDEs).

- Die PDE heißt **linear**, wenn sie die Form

$$\sum_{|\alpha| \leq k} a_\alpha(x) D^\alpha u = f(x)$$

mit Funktionen $a_\alpha, f : \Omega \rightarrow \mathbb{R}$ besitzt.

- Die PDE heißt **semilinear**, wenn sie die Form

$$\sum_{|\alpha| = k} a_\alpha(x) D^\alpha u + a_0(x, u, Du, \dots, D^{k-1} u) = 0$$

besitzt, wobei $a_\alpha : \Omega \rightarrow \mathbb{R}$ und $a_0 : \Omega \times \mathbb{R} \times \mathbb{R}^n \times \dots \times \mathbb{R}^{n^k} \rightarrow \mathbb{R}$ gegeben sind.

- Die PDE heißt **quasilinear**, wenn sie die Form

$$\sum_{|\alpha| = k} a_\alpha(x, u, Du, \dots, D^{k-1} u) D^\alpha u + a_0(x, u, Du, \dots, D^{k-1} u) = 0$$

hat, wobei $a_\alpha, a_0 : \Omega \times \mathbb{R} \times \mathbb{R}^n \times \dots \times \mathbb{R}^{n^k}$ gegeben sind.

- Die PDE heißt **nichtlinear**, falls die Ableitungen der höchsten Ordnung nicht linear vorkommen.

Def. Sei $\Omega \subseteq \mathbb{R}^n$ offen und $F : \Omega \times \mathbb{R} \times \mathbb{R}^n \times \mathbb{R}^{n \times n} \rightarrow \mathbb{R}$ eine gegebene Funktion. Eine PDE der Form

$$F(x, u, \partial_{x_1} u, \dots, \partial_{x_n} u, \partial_{x_1} \partial_{x_1} u, \dots, \partial_{x_1} \partial_{x_n} u, \dots, \partial_{x_n} \partial_{x_n} u) = 0$$

heißt **PDE zweiter Ordnung**.

Notation. $p_i := \partial_{x_i} u$, $p_{ij} := \partial_{x_i x_j}^2 u$

$$M(x) := \begin{pmatrix} \frac{\partial F}{\partial p_{11}} & \dots & \frac{\partial F}{\partial p_{1n}} \\ \vdots & & \vdots \\ \frac{\partial F}{\partial p_{n1}} & \dots & \frac{\partial F}{\partial p_{nn}} \end{pmatrix} = M(x)^T.$$

Def (Typeneinteilung für PDEs der 2. Ordnung).

Obige PDE zweiter Ordnung heißt

- elliptisch** in x , falls die Matrix $M(x)$ positiv o. definit ist.
- parabolisch** in x , falls genau ein EW von $M(x)$ gleich null ist und alle anderen dasselbe Vorzeichen haben.
- hyperbolisch** in x , falls genau ein EW ein anderes Vorzeichen als die anderen EWE hat.

Lösungstheorie elliptischer PDEs

Def. Sei $\Omega \subset \mathbb{R}^n$ offen, zusammenhängend und beschränkt.

- $\mathcal{C}(\overline{\Omega}, \mathbb{R}^m) := \{u : \overline{\Omega} \rightarrow \mathbb{R}^m \mid u \text{ stetig}\}$, $\mathcal{C}(\overline{\Omega}) := \mathcal{C}(\overline{\Omega}, \mathbb{R})$, mit Norm

$$\|u\|_{\mathcal{C}(\overline{\Omega}, \mathbb{R}^m)} = \sup_{x \in \overline{\Omega}} \|u(x)\|. \quad (\text{Supremumsnorm})$$

- $\mathcal{C}^k(\overline{\Omega}, \mathbb{R}^m)$, $k \in \mathbb{N}$ ist der Raum aller auf Ω k -mal stetig diff'baren Funktionen $u : \Omega \rightarrow \mathbb{R}^m$, die zusammen mit ihren Ableitungen bis zur Ordnung k stetig auf $\overline{\Omega}$ fortgesetzt werden können.

$$\|u\|_{\mathcal{C}^k(\overline{\Omega}, \mathbb{R}^m)} = \sum_{|\alpha| \leq k} \|D^\alpha u\|_{\mathcal{C}(\overline{\Omega}, \mathbb{R}^m)}$$

- Sei $\alpha \in [0, 1)$. $\mathcal{C}^{0, \alpha}(\overline{\Omega}, \mathbb{R}^m) = \{u \in \mathcal{C}(\overline{\Omega}, \mathbb{R}^m) \mid H_\alpha(u, \overline{\Omega}) < \infty\}$ mit

$$H_\alpha(u, \overline{\Omega}) := \sup_{x, y \in \overline{\Omega}, x \neq y} \frac{\|u(x) - u(y)\|}{\|x - y\|^\alpha} \quad (\text{Hölder-Koeffizient})$$

heißt **Raum der glm. Hölder-stetigen Fktn** zum Exponent α . Der Hölder-Koeffizient ist dabei eine Seminorm auf $\mathcal{C}^{0, \alpha}(\overline{\Omega}, \mathbb{R}^m)$.

- $\mathcal{C}^{k, \alpha}(\overline{\Omega}, \mathbb{R}^m) := \{u \in \mathcal{C}^k(\overline{\Omega}, \mathbb{R}^m) \mid \forall |\gamma| = k : D^\gamma u \in \mathcal{C}^{0, \alpha}(\overline{\Omega}, \mathbb{R}^m)\}$ heißt **Hölder-Raum**. Eine Norm ist gegeben durch

$$\|u\|_{\mathcal{C}^{k, \alpha}(\overline{\Omega}, \mathbb{R}^m)} := \|u\|_{\mathcal{C}^k(\overline{\Omega}, \mathbb{R}^m)} + \sum_{|\gamma| = k} H_\alpha(D^\gamma u, \overline{\Omega}).$$

Bem. • Jede Hölder-stetige Funktion ist gleichmäßig stetig.

- $\mathcal{C}^{0, 1}(\overline{\Omega}, \mathbb{R}^m)$ heißt **Raum der Lipschitz-stetigen Funktionen**.
- \mathcal{C} , \mathcal{C}^k und $\mathcal{C}^{k, \alpha}$ sind Banach-Räume mit den jeweiligen Normen.

Def. Sei $\Omega \subset \mathbb{R}^n$ offen, zusammenhängend und beschränkt.

Das Gebiet Ω gehört zur **Klasse $\mathcal{C}^{k, \alpha}$** , wenn in jedem Punkt $x \in \partial\Omega$ eine Umgebung in $\partial\Omega$ existiert, die sich in einem geeigneten Koordinatensystem als ein Graph einer Funktion aus $\mathcal{C}^{k, \alpha}$ darstellen lässt und Ω lokal immer auf einer Seite von $\partial\Omega$ liegt.

Satz (Gauß'scher Integralsatz). Sei $\Omega \subset \mathbb{R}^n$ ein Lipschitz-Gebiet und $u \in \mathcal{C}(\overline{\Omega}, \mathbb{R}^n) \cap \mathcal{C}^1(\Omega, \mathbb{R}^n)$. Dann gilt

$$\int_\Omega \operatorname{div} u \, dx = \int_\Omega \sum_{i=1}^n \frac{\partial u_i}{\partial x_i} \, dx = \int_{\partial\Omega} \sum_{i=1}^n u_i \nu_i \, d\rho(x) = \int_{\partial\Omega} u \cdot \nu \, d\rho(x),$$

wobei ν der äußere Normalenvektor an den Rand von Ω ist.

Problem. Wir betrachten das Randwertproblem

$$(\text{RWP}) \quad \begin{cases} \mathcal{L}u = f & \text{in } \Omega & (\text{PDE}) \\ \mathcal{R}u = g & \text{auf } \partial\Omega & (\text{Randbedingung}) \end{cases}$$

wobei \mathcal{L} der lineare Differentialoperator

$$\mathcal{L}u = - \sum_{i,j=1}^n a_{ij}(x) \frac{\partial^2 u}{\partial x_i \partial x_j} + \sum_{i=1}^n b_i(x) \frac{\partial u}{\partial x_i} + c(x)u$$

mit Fktn $a_{ij}, b_i, c, f : \Omega \rightarrow \mathbb{R}$, $g : \partial\Omega \rightarrow \mathbb{R}$ ist, sodass $A(x) := (a_{ij}(x))$ symmetrisch ist. Als Randbedingung (RB) verlangen wir:

$$\begin{array}{lll} \text{Dirichlet-RB:} & u & = g \quad \text{auf } \partial\Omega, \\ \text{Neumann-RB:} & (A(x)\nabla u) \cdot \nu & = g \quad \text{auf } \partial\Omega \text{ oder} \\ \text{Robin-RB:} & (A(x)\nabla u) \cdot \nu + \delta u & = g \quad \text{auf } \partial\Omega. \end{array}$$

Bem. Man kann auch auf verschiedenen Teilstücken des Randes verschiedene Bedingungen stellen.

Bem. Falls die Funktionen a_{ij} differenzierbar sind, so kann \mathcal{L} in **Divergenzform** geschrieben werden:

$$\begin{aligned} \mathcal{L}u &= - \sum_{i,j=1}^n \frac{\partial}{\partial x_j} \left(a_{ij}(x) \frac{\partial u}{\partial x_i} \right) + \sum_{i=1}^n \underbrace{\left(\left(\sum_{j=1}^n \frac{\partial}{\partial x_j} a_{ij}(x) \right) + b_i(x) \right)}_{\tilde{b}(x) :=} \frac{\partial u}{\partial x_i} + c(x)u \\ &= - \operatorname{div}(A(x)\nabla u) + \tilde{b}(x) \cdot \nabla u + c(x)u \end{aligned}$$

Voraussetzung. Wir nehmen im Folgenden an:

- \mathcal{L} ist **gleichmäßig elliptisch**, d. h.

$$\exists \lambda_0 > 0 : \forall \xi \in \mathbb{R}^n : \forall x \in \Omega : \xi^T A(x) \xi \geq \lambda_0 \|\xi\|^2$$

Dabei heißt λ_0 **Elliptizitätskonstante**.

- $a_{ij}, b_i, c, f \in \mathcal{C}(\overline{\Omega})$, $g \in \mathcal{C}(\partial\Omega)$

Bem. $\mathcal{L} = f$ ist elliptisch auf $\Omega \iff A(x) > 0$ (spd) für alle $x \in \Omega$

Def. Eine Fkt $u \in \mathcal{C}^2(\Omega) \cap \mathcal{C}(\overline{\Omega})$ heißt **klassische Lsg** vom (RWP) mit $\mathcal{R}u := u$, wenn die beiden Gleichungen in (RWP) in jedem Punkt von Ω bzw. des Randes $\partial\Omega$ erfüllt sind.

Satz (Maximumsprinzip). Sei $\Omega \subset \mathbb{R}^n$ offen, zshgd u. beschränkt. Sei $u \in \mathcal{C}^2(\omega) \cap \mathcal{C}(\overline{\Omega})$ eine Lösung vom (RWP), $f \leq 0$ in Ω und $c \equiv 0$. Dann nimmt u sein Maximum auf dem Rand $\partial\Omega$ an, d. h.

$$\sup_{x \in \overline{\Omega}} u(x) = \sup_{x \in \partial\Omega} u(x) = \sup_{x \in \partial\Omega} g(x)$$

Kor. Sei $c \geq 0$ und $f \leq 0$. Dann gilt $\sup_{x \in \overline{\Omega}} u(x) \leq \max\{\sup_{x \in \partial\Omega} u(x), 0\}$.

Kor (Vergleichsprinzip). Für $u_1, u_2 \in \mathcal{C}^2(\Omega) \cap \mathcal{C}(\overline{\Omega})$ und $c \geq 0$ gelte $\mathcal{L}u_1 \leq \mathcal{L}u_2$ in Ω und $u_1 \leq u_2$ auf $\partial\Omega$. Dann gilt $u_1 \leq u_2$ auf $\overline{\Omega}$.

Kor (Eindeutigkeit). Sei $c \geq 0$. Dann hat (RWP) höchstens eine Lösung $u \in \mathcal{C}^2(\Omega) \cap \mathcal{C}(\overline{\Omega})$.

Satz. Sei Ω ein beschr. Lipschitz-Gebiet, $a_{ij}, b_i, c, f \in \mathcal{C}(\overline{\Omega})$, $c \geq 0$, $g \in \mathcal{C}(\partial\Omega)$. Dann besitzt (RWP) genau eine Lsg $u \in \mathcal{C}^2(\Omega) \cap \mathcal{C}(\overline{\Omega})$.

Achtung. Es muss aber nicht $u \in \mathcal{C}^2(\overline{\Omega})$ gelten!

Differenzenverfahren

Verfahren (DV). Am Beispiel des Poisson-Problems

$$(RWP_1) \quad \begin{cases} -\Delta u = f & \text{in } \Omega = (0, 1) \\ u(0) = g_0, u(1) = g_1 & \text{auf } \partial\Omega \end{cases}$$

Wir führen folgende Schritte durch:

1. Diskretisierung: Wähle $n \in \mathbb{N}$, setze $h := \frac{1}{n}$ und

$$\begin{aligned} \Omega_h &:= \{x_i := ih \mid i = 1, \dots, n-1\} & (\text{innere Gitterpunkte}) \\ \partial\Omega_h &:= \{x_0 = 0, x_n = 1\} & (\text{Randpunkte}) \end{aligned}$$

2. Approx. der Ableitungen durch Differenzenquotienten (DQ)

$$\begin{aligned} u'(x_i) &\approx \frac{1}{h} (u(x_i + h) - u(x_i)) & (\text{Vorwärts-DQ}) \\ u'(x_i) &\approx \frac{1}{h} (u(x_i) - u(x_i - h)) & (\text{Rückwärts-DQ}) \\ u'(x_i) &\approx \frac{1}{2h} (u(x_i + h) - u(x_i - h)) & (\text{zentraler DQ}) \end{aligned}$$

Für die zweite Ableitung ergibt sich

$$\begin{aligned} u''(x_i) &= (u'(x_i))' \approx \frac{1}{h} (u'(x_i + h) - u'(x_i)) \approx \\ &\approx \frac{1}{h} \cdot \left(\frac{1}{h} (u(x_i + h) - u(x_i)) - \frac{1}{h} (u(x_i) - u(x_i - h)) \right) \\ &= \frac{1}{h^2} (u(x_i + h) - 2 \cdot u(x_i) + u(x_i - h)) =: \Delta_h u \end{aligned}$$

Dabei heißt Δ_h der diskrete eindim. Laplace-Operator. Das diskretisierte Randwertproblem ist nun

$$(RWP_1)_h \quad \begin{cases} -\Delta_h u_h = f & \text{in } \Omega_h, \\ u_h(0) = g_0, u_h(1) = g_1 & \text{auf } \partial\Omega_h. \end{cases}$$

3. Aufstellen des linearen Gleichungssystems

$$\begin{aligned} \frac{1}{h^2} (2u_h(x_1) - u_h(x_2)) &= f(x_1) + \frac{g_0}{h^2} & (i=1) \\ \frac{1}{h^2} (-u_h(x_{i-1}) + u_h(x_i) - u_h(x_{i+1})) &= f(x_i) & (i=2, \dots, n-2) \\ \frac{1}{h^2} (-u_h(x_{n-2}) + 2u_h(x_{n-1})) &= f(x_{n-1}) + \frac{g_1}{h^2} & (i=n-1) \end{aligned}$$

Als lineares Gleichungssystem: $-\tilde{\Delta}_h \tilde{u}_h = \tilde{f}_h$ mit

$$-\tilde{\Delta}_h = \frac{1}{h^2} \begin{pmatrix} 2 & -1 & & & 0 \\ -1 & 2 & -1 & & \\ & -1 & 2 & -1 & \\ & & \ddots & \ddots & \ddots \\ 0 & & & -1 & 2 & -1 \\ & & & & -1 & 2 \end{pmatrix} \in \mathbb{R}^{(n-1) \times (n-1)},$$

$$\tilde{u}_h = \begin{pmatrix} u_h(x_1) \\ \vdots \\ u_h(x_{n-1}) \end{pmatrix}, \quad \tilde{f}_h = \begin{pmatrix} f(x_1) + \frac{g_0}{h^2} \\ f(x_2) \\ \vdots \\ f(x_{n-2}) \\ f(x_{n-1}) + \frac{g_1}{h^2} \end{pmatrix}$$

Ziel. Herausfinden, was die Lösung u_h von $(RWP)_h$ (die man durch Lösen von (LGS) erhält) mit der Lösung u zum ursprünglichen Problem (RWP) zu tun hat. Ist etwa u_h die Einschränkung von u , oder zumindest annäherungsweise? Wenn ja, wie klein muss man h wählen, damit die Approximation gut wird?

$$\begin{aligned} (RWP) \quad & \begin{cases} -\mathcal{L}u = f & \text{in } \Omega, \\ u = g & \text{auf } \partial\Omega \end{cases} \\ (RWP)_h \quad & \begin{cases} -\mathcal{L}_h u = f_h & \text{in } \Omega_h, \\ u_h = g_h & \text{auf } \partial\Omega_h \end{cases} \\ (LGS) \quad & \tilde{\mathcal{L}}_h \tilde{u}_h = \tilde{f}_h \end{aligned}$$

Notation. $U_h := \{\Omega_h \rightarrow \mathbb{R}\}$, $R_h : \mathcal{C}(\bar{\Omega}) \rightarrow U_h$, $u \mapsto u|_{\Omega_h}$

Def. Das Differenzenverfahren $(RWP)_h$ heißt

- **konvergent** von der Ordnung p , falls $C > 0$, $h_0 > 0$ existieren, sodass für die Lösung u von (RWP) und die Lösung u_h von $(RWP)_h$ gilt:
$$\|u_h - R_h u\|_h \leq Ch^p \quad \text{für alle } 0 < h \leq h_0,$$
wobei $\|\cdot\|_h$ eine Norm zu U_h ist, wie z. B. $\|u_h\|_h := \max_{x \in \Omega_h} |u_h(x)|$.
- **konsistent** von der Ordnung p , falls
$$\|\mathcal{L}_h R_h u - R_h \mathcal{L} u\|_h \leq ch^p \|u\|_{\mathcal{C}^{p+2}(\bar{\Omega})} \quad \forall u \in \mathcal{C}^{p+2}(\bar{\Omega}).$$
- **stabil**, falls \tilde{L}_h invertierbar ist und ein $h_0 > 0$ existiert mit

$$\sup_{0 < h \leq h_0} \|\tilde{\mathcal{L}}_h^{-1}\|_h < \infty, \quad \text{wobei } \|\tilde{\mathcal{L}}_h^{-1}\|_h := \sup_{f \neq 0} \frac{\|\tilde{\mathcal{L}}_h^{-1} f\|_h}{\|f\|_h}.$$

Bem. Die ind. Matrixnorm ist $\|\tilde{\mathcal{L}}_h^{-1}\|_h = \|\tilde{\mathcal{L}}_h^{-1}\|_\infty = \max_{1 \leq i \leq n} \sum_{j=1}^n |l_{ij}|$.

Satz. Ist das DV $(RWP)_h$ konsistent und stabil, so auch konvergent. Genauer gilt: Ist $(RWP)_h$ stabil und konsistent von der Ordnung p und $u \in \mathcal{C}^{p+2}(\bar{\Omega})$, dann ist $(RWP)_h$ konvergent von der Ordnung p .

Beweis. Setze $w_h := u_h - R_h u$. Für $x \in \partial\Omega_h$ gilt dann $w_h(x) = 0$ und für $x \in \Omega_h$ gilt

$$\begin{aligned} \tilde{\mathcal{L}}_h w_h(x) &= \mathcal{L}_h w_h(x) = \mathcal{L}_h u_h(x) - \mathcal{L}_h R_h u(x) \\ &= f_h(x) - \mathcal{L}_h R_h u(x) = R_h f(x) - \mathcal{L}_h R_h u(x) \\ &= R_h \mathcal{L} u(x) - \mathcal{L}_h R_h u(x) \end{aligned}$$

Somit gilt $w_h = \tilde{\mathcal{L}}_h^{-1} (R_h \mathcal{L} u - \mathcal{L}_h R_h u)$ in Ω_h , also

$$\begin{aligned} \|w_h\|_h &= \|\tilde{\mathcal{L}}_h^{-1} (R_h \mathcal{L} u - \mathcal{L}_h R_h u)\| \leq \|\tilde{\mathcal{L}}_h^{-1}\|_h \cdot \|R_h \mathcal{L} u - \mathcal{L}_h R_h u\|_h \\ &\leq c_1 \cdot c_2 \cdot h^p \cdot \|u\|_{\mathcal{C}^{p+2}(\bar{\Omega})} \leq Ch^p \quad \text{für } 0 < h \leq h_0. \end{aligned} \quad \square$$

Lem. Das DV $(RWP_1)_h$ ist konsistent von der Ordnung 2. Es gilt

$$\|\Delta_h R_h u - R_h \Delta u\|_h \leq \frac{1}{12} \|u\|_{\mathcal{C}^4(\bar{\Omega})} h^2 \quad \forall u \in \mathcal{C}^4(\bar{\Omega}).$$

Bem. Um zu zeigen, dass $(RWP_1)_h$ konvergent ist, müssen wir noch zeigen, dass $\tilde{L}_h = -\tilde{\Delta}_h$ invertierbar ist und $\sup_{0 < h \leq h_0} \|\tilde{\Delta}_h\| < \infty$.

Def. Eine Matrix $A = (a_{ij}) \in \mathbb{R}^{n \times n}$ heißt **M-Matrix**, falls
a) $a_{ii} > 0$ für $i = 1, \dots, n$, b) $a_{ij} \leq 0$ für $i \neq j$, $i, j = 1, \dots, n$,
c) A invertierbar ist und d) für $A^{-1} =: B = (b_{ij})$ gilt $b_{ij} \geq 0$.

Lem. Erfülle $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ die Bedingungen a) und b). Zerlege $A = D + L + R$ in eine Diagonalmatrix und strikte untere/obere Dreiecksmatrizen. Dann ist A genau dann eine M-Matrix wenn

$$\rho(D^{-1}(L + R)) < 1.$$

Bem. Es gilt folgende Monotonie-Eigenschaft für M-Matrizen:

$$x \leq y \implies A^{-1}x \leq A^{-1}y.$$

Def. Eine Matrix $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ heißt **reduzibel** (oder zerlegbar), wenn es eine Permutationsmatrix $P \in \mathbb{R}^{n \times n}$ gibt, sodass

$$PAP^T = \begin{pmatrix} A_{11} & A_{12} \\ 0 & A_{22} \end{pmatrix} \quad \text{mit } A_{11} \in \mathbb{R}^{k \times k}, 0 < k < n.$$

Lem (Gerschgorin). Alle EWe einer Matrix $A = (a_{ij}) \in \mathbb{C}^{n \times n}$ liegen in der Menge

$$\bigcup_{i=1}^n \overline{B_{r_i}(a_{ii})} \quad \text{mit } r_i := \sum_{j=1}^n |a_{ij}|.$$

Falls A irreduzibel ist, so liegen sie sogar in

$$\left(\bigcup_{i=1}^n B_{r_i}(a_{ii}) \right) \cup \left(\bigcap_{i=1}^n \partial B_{r_i}(a_{ii}) \right)$$

Def. Sei $A = (a_{ij}) \in \mathbb{R}^{n \times n}$ eine Matrix.

- A heißt **schwach diagonaldominant**, falls

$$\sum_{\substack{j=1 \\ j \neq i}}^n |a_{ij}| \leq |a_{ii}| \quad \text{für } i = 1, \dots, n$$

und ein i_0 existiert, sodass die Ungleichung strikt ist.

- A heißt **diagonaldominant**, falls

$$\sum_{\substack{j=1 \\ j \neq i}}^n |a_{ij}| < |a_{ii}| \quad \text{für } i = 1, \dots, n$$

- A heißt **irreduzibel diagonaldominant**, falls A irreduzibel und schwach diagonaldominant ist.

Lem. Sei $A = (a_{ij}) \in \mathbb{R}^{n \times n}$ eine Matrix mit $a_{ii} > 0$, $i = 1, \dots, n$ und $a_{ij} \leq 0$, $i, j = 1, \dots, n$, $i \neq j$, die diagonaldominant oder irreduzibel diagonaldominant ist. Dann ist A eine M-Matrix.

Bem. $-\tilde{\Delta}_h$ ist irreduzibel diagonaldominant, also eine M-Matrix.

Lem. Sei A eine irreduzible M-Matrix. Dann gilt $A^{-1} > 0$.

Lem. Sei $A \in \mathbb{R}^{n \times n}$ eine M-Matrix und es existiere ein Vektor v , sodass $(Av)_j \geq 1$, $j = 1, \dots, n$. Dann gilt $\|A^{-1}\|_\infty \leq \|v\|_\infty$.

Lem. $\|\tilde{\Delta}_h^{-1}\|_\infty \leq \frac{1}{8}$

Satz. Das DV $(RWP_1)_h$ ist konvergent von der Ordnung 2, falls die Lösung von (RWP_1) zu $\mathcal{C}^4([0, 1])$ gehört. Es gilt die Abschätzung

$$\|u_h - R_h u\|_\infty \leq \frac{h^2}{96} \|u\|_{\mathcal{C}^4([0, 1])}.$$

Problem. Wir betrachten nun

$$(RWP_2) \quad \begin{cases} -\Delta u &= f & \text{in } \Omega = (0, 1) \times (0, 1) \\ u &= g & \text{auf } \partial\Omega \end{cases}$$

1. Diskretisierung: Setze $h := \frac{1}{n}$, $n \in \mathbb{N}$ und

$$\Omega_h := \{(x, y) \in \Omega \mid x = ih, y = jh, i, j = 1, \dots, n-1\}$$

$$\partial\Omega_h := \{(x, y) \in \partial\Omega \mid x = ih, y = jh, i, j = 1, \dots, n-1\}$$

2. Approximation der Ableitungen

$$-\Delta u(x, y) = -\frac{\partial^2 u}{\partial x^2}(x, y) - \frac{\partial^2 u}{\partial y^2}(x, y)$$

$$\approx -\frac{u(x+h, y) - 2u(x, y) + u(x-h, y)}{h^2} - \frac{u(x, y+h) - 2u(x, y) + u(x, y-h)}{h^2}$$

$$= -\frac{u(x+h, y) + u(x-h, y) - 4u(x, y) + u(x, y+h) + u(x, y-h)}{h^2} =: -\Delta_h u$$

Dabei hat der diskrete Laplace-Operator Δ_h die Form eines Differenzensterns. Gesucht ist die Lsg $u_h : \Omega_h \cup \partial\Omega_h \rightarrow \mathbb{R}$ von

$$(\text{RWP}_2)_h \begin{cases} -\Delta_h u_h &= f_h & \text{in } \Omega_h \\ u_h &= g & \text{auf } \partial\Omega_h. \end{cases}$$

3. Aufstellen des linearen Gleichungssystems $-\tilde{\Delta}_h \tilde{u}_h = f_h$:

$$\tilde{u}_h = \begin{pmatrix} u_{11} \\ u_{12} \\ \vdots \\ u_{n-1, n-2} \\ u_{n-1, n-1} \end{pmatrix} \in \mathbb{R}^{(n-1)^2},$$

$$-\tilde{\Delta}_h = \frac{1}{h^2} \begin{pmatrix} A & -I & & 0 \\ -I & A & -I & \\ & \ddots & \ddots & \ddots \\ 0 & & -I & A & -I \\ & & & -I & A \end{pmatrix} \in \mathbb{R}^{(n-1)^2 \times (n-1)^2},$$

$$A = \begin{pmatrix} 4 & -1 & & 0 \\ -1 & 4 & -1 & \\ & \ddots & \ddots & \ddots \\ & & -1 & 4 & -1 \\ 0 & & & -1 & 4 \end{pmatrix} \in \mathbb{R}^{n-1 \times n-1}$$

Lem. Das DV $(\text{RWP}_2)_h$ ist konsistent von der Ordnung 2. Es gilt

$$\|\Delta_h R_h u - R_h \Delta u\|_h \leq \frac{1}{6} \|u\|_{C^2(\bar{\Omega})} h^2.$$

Lem. Das DV $(\text{RWP}_2)_h$ ist stabil. Es gilt $\|\tilde{\Delta}_h^{-1}\|_\infty \leq 1/8$.

Satz. Das DV $(\text{RWP}_2)_h$ ist konvergent von der Ordnung 2, falls die Lösung von (RWP_2) zu $C^4(\bar{\Omega})$ gehört. Es gilt

$$\|u_h - R_h u\|_h \leq 1/48 \|u\|$$

Bem. Durch die Einbeziehung weiterer Gitterpunkte zur Approximation des Differentialoperators lässt sich die Konvergenzordnung erhöhen:

$$-\Delta_h^{(9)} u(x, y) = \frac{1}{12h^2} (u(x-2h, y) - 16u(x-h, y) + 30u(x, y) - 16u(x+h, y) + u(x+2h, y) + u(x, y-2h) - 16u(x, y-h) + 30u(x, y) - 16u(x, y+h) + u(x, y+2h)) \approx -\Delta u(x, y)$$

Damit erreicht man die Konsistenzordnung 4.

Situation. Sei $\Omega \subset \mathbb{R}^2$ beschränkt.

Def. • $\Omega_h := \{x, y \in \Omega \mid x/h, y/h \in \mathbb{Z}\}$ heißen **innere Gitterpunkte**.

- Ein Punkt $z_R \in \partial\Omega$ heißt **Randgitterpunkt** (notiert $z_R \in \partial\Omega_h$), falls es einen inneren Gitterpunkt $z \in \Omega_h$ gibt, sodass $z_R = r + \alpha h e_1$ oder $z_R = z + \alpha h e_2$ mit $|\alpha| \leq 1$. Die Nachbarn $N(x, y)$ eines Punktes (x, y) sind $(x + s_r h, y)$, $(x - s_l h, y)$, $(x, y + s_o h)$, $(x, y - s_u h)$, falls $s_r, s_l, s_o, s_u \in (0, 1]$ und die Verbindungsstrecken zu (x, y) in Ω liegen.
- Ein Punkt $(x, y) \in \Omega_h$ heißt **randnah**, falls (x, y) die Nachbarn $(x - s_l h, y)$, $(x + s_r h, y)$, $(x, y - s_u h)$, $(x, y + s_o h)$ hat mit mindestens einem $s_i < 1$. Ansonsten heißt (x, y) **randfern**.

Notation. Wir haben eine Einteilung $\Omega_h = \Omega_h^{\text{rn}} \sqcup \Omega_h^{\text{rf}}$ der Gitterpunkte in randnahe und randferne Punkte.



Lem (Dividierte Differenzen von Newton).

Für $u \in C^3([x_l, x_r])$, $x \in (x_l, x_r)$ gilt

$$u''(x) = \frac{2}{x_r - x_l} \left(\frac{u(x_r) - u(x)}{x_r - x} - \frac{u(x) - u(x_l)}{x - x_l} \right) + \mathcal{O}(x_r - x_l)$$

$$= \frac{2}{x_r - x_l} \left(\frac{1}{x_r - x} u(x_r) + \frac{1}{x - x_l} u(x_l) \right) - \frac{2}{(x_r - x)(x - x_l)} u(x)$$

Verfahren (Shortley-Weller-Diskretisierung).

Dadurch inspiriert approximieren wir den Laplace-Operator durch

$$\mathcal{D}_h u(x, y) = \frac{1}{h^2} \left(\frac{2u(x - s_l h, y)}{s_l(s_r + s_l)} + \frac{2u(x + s_r h, y)}{s_r(s_r + s_l)} + \frac{2u(x, y - s_u h)}{s_u(s_o + s_u)} + \frac{2u(x, y + s_o h)}{s_o(s_o + s_u)} - \left(\frac{2}{s_l s_r} + \frac{2}{s_o s_u} \right) u(x, y) \right)$$

wobei $x_r - x = s_r h$, $x - x_l = s_l h$, $y_o - y = s_o h$, $y - y_u = s_u h$. Wir betrachten nun

$$(\text{RWP}_2)'_h \begin{cases} -\mathcal{D}_h u_h &= f_h & \text{in } \Omega_h \\ u_h &= g & \text{auf } \partial\Omega_h \end{cases}$$

$$(\text{LGS}_2)' \begin{cases} -\tilde{\mathcal{D}}_h \tilde{u}_h &= \tilde{f}_h \\ \tilde{f}_h &= f_h + g_h \end{cases}$$

$$\text{mit } g_h(x, y) = \frac{1}{h^2} \sum_{(x_N, y_N) \in N(x, y) \cap \partial\Omega_h} S_{x_N, y_N} g(x_N, y_N)$$

wobei

$$S_{x_N, y_N} := \begin{cases} 2/s_l(s_l + s_r) & \text{falls } (x_N, y_N) = (x - s_l h, y), \\ 2/s_r(s_l + s_r) & \text{falls } (x_N, y_N) = (x + s_r h, y), \\ 2/s_o(s_o + s_u) & \text{falls } (x_N, y_N) = (x, y + s_o h), \\ 2/s_u(s_o + s_u) & \text{falls } (x_N, y_N) = (x, y - s_u h), \end{cases}$$

$$-\tilde{\mathcal{D}}_h = (d_{ij}) \quad \text{mit} \quad d_{ii} = 1/h^2 \left(\frac{2}{s_{il}s_{ir}} + \frac{2}{s_{iu}s_{io}} \right) \quad \text{und}$$

$$d_{ij} = 1/h^2 \begin{cases} -2/s_{il}(s_{il} + s_{ir}) & \text{falls } j \text{ der linke Nachbar von } i \text{ ist,} \\ -2/s_{ir}(s_{il} + s_{ir}) & \text{falls } j \text{ der rechte Nachbar von } i \text{ ist,} \\ -2/s_{iu}(s_{iu} + s_{io}) & \text{falls } j \text{ der untere Nachbar von } i \text{ ist,} \\ -2/s_{io}(s_{iu} + s_{io}) & \text{falls } j \text{ der obere Nachbar von } i \text{ ist.} \end{cases}$$

Lem. • Die Matrix $-\tilde{\mathcal{D}}_h$ ist eine M-Matrix.

- Sei $\Omega \subset \mathbb{R}^2$ beschränkt und gehöre zu dem Streifen $(x_0, x_0 + d) \times \mathbb{R}$ oder $\mathbb{R} \times (y_0, y_0 + d)$. Dann gilt $\|\tilde{\mathcal{D}}_h^{-1}\| \leq d^2/8$.

Bem. Das DV $(\text{RWP}_2)'_h$ hat in den randnahen Punkten nur die Konsistenzordnung 1. Dennoch gilt:

Satz. Sei $\Omega \subset \mathbb{R}^3$ beschränkt und Teilmenge des Streifens $(x_0, x_0 + d) \times \mathbb{R}$ oder $\mathbb{R} \times (y_0, y_0 + d)$. Dann ist das Verfahren $(\text{RWP}_2)'_h$ konvergent von der Ordnung 2. Es gilt

$$\|u_h - R_h u\|_h \leq (1/3h^3 + d^2/48h^2) \|u\|_{C^4(\bar{\Omega})}.$$

Idee. Bestimme den Wert von u bei randnahen Punkten (x, y) durch lineare Interpolation:

- $u(x, y) \approx \frac{s_r}{s_r + s_l} u(x - s_l h, y) + \frac{s_l}{s_r + s_l} u(x + s_r h, y)$
- $u(x, y) \approx \frac{s_o}{s_u + s_o} u(x, y - s_u h) + \frac{s_u}{s_u + s_o} u(x, y + s_o h)$

$$(\text{RWP}_2)''_h \begin{cases} -\mathcal{D}_h u &= f_h & \text{in } \Omega_h \\ u_h &= g & \text{auf } \partial\Omega_h \end{cases}$$

$$(\text{LGS}_2)'' - \tilde{\mathcal{D}}_h \tilde{u}_h = \tilde{f}_h$$

Lem. Dieses Verfahren besitzt Konsistenzordnung (und somit Konvergenzordnung) 2.

Problem. Wir betrachten nun

$$(\text{RWP}_3) \begin{cases} -\mathcal{L}u &= f & \text{in } \Omega = (0, 1) \times (0, 1) \\ u &= g & \text{auf } \partial\Omega \end{cases}$$

mit

$$-\mathcal{L}u = -(a_{11}(x, y)u_{xx} + 2a_{12}(x, y)u_{xy} + a_{22}(x, y)u_{yy}) + b_1(x, y)u_x + b_2(x, y)u_y + c(x, y)u$$

wobei $c(x, y) \leq 0$, $\xi^T A(x, y) \xi \geq \lambda_0 \|\xi\|^2$, $\lambda_0 > 0$ und

$$A(x, y) = \begin{pmatrix} a_{11}(x, y) & a_{12}(x, y) \\ a_{21}(x, y) & a_{22}(x, y) \end{pmatrix}$$

Verfahren. 1. Diskretisierung: $h = 1/n$, Ω_h , $\partial\Omega_h$ wie früher.

2. Approximation:

$$u_x(x, y) \approx \frac{u(x+h, y) - u(x-h, y)}{2h}, \quad u_y(x, y) \approx \dots$$

$$u_{xx}(x, y) \approx \frac{u(x+h, y) - 2u(x, y) + u(x-h, y)}{h^2}, \quad u_{yy}(x, y) \approx \dots$$

Für die Approx. von u_{xy} haben wir mehrere Möglichkeiten:
Wir könnten etwa den zentralen DQ in x - und y -Richtung verwenden und erhalten

$$u_{xy}(x, y) \approx \frac{1}{4h^2} (u(x+h, y+h) - u(x+h, y-h) - u(x-h, y+h) + u(x-h, y-h))$$

Diese Annäherung hat allerdings den Nachteil, dass sie zu keiner M-Matrix führt. Stattdessen nehmen wir

$$u_{xy}(x, y) \approx \frac{1}{2h^2} \begin{pmatrix} 0 & -1 & 1 \\ -1 & 2 & -1 \\ 1 & -1 & 0 \end{pmatrix} \quad \frac{1}{2h^2} \begin{pmatrix} -1 & 1 & 0 \\ 1 & -2 & 1 \\ 0 & 1 & -1 \end{pmatrix}$$

für $a_{12} \geq 0$ für $a_{12} < 0$.

Wir fassen diese Approx. in folgendem 7-Stern zusammen:

$$-\mathcal{L}_h u := \frac{1}{h^2} \begin{pmatrix} a_{12}^- & |a_{12}| - a_{22} & a_{12}^+ \\ |a_{12}| - a_{11} & 2(a_{11} + a_{22} - |a_{12}|) & |a_{12}| - a_{11} \\ -a_{12}^+ & |a_{12}| - a_{22} & a_{12} \end{pmatrix}$$

$$+ \frac{1}{h} \begin{pmatrix} -b_2 & & \\ -b_1 & 0 & b_1 \\ b_2 & & \end{pmatrix} + \begin{pmatrix} c \\ & & \end{pmatrix}$$

Dabei ist $a_{ij}^+ := \max(a_{ij}, 0)$ und $a_{ij}^- := \min(a_{ij}, 0)$.

$$(\text{RWP}_3)_h \quad \begin{cases} -\mathcal{L}_h u_h &= f_h & \text{in } \Omega_h \\ u_h &= g & \text{auf } \partial\Omega_h \end{cases}$$

$$(\text{LGS}_3) \quad -\tilde{\mathcal{L}}_h \tilde{u}_h = \tilde{f}_h$$

Satz. Sei $|a_{12}| \leq \min(a_{11}, a_{22})$, $c \geq 0$ in Ω , \mathcal{L} gleichmäßig elliptisch. Falls $a_{ii} > |a_{12}| + \frac{h}{2}|b_i|$ für $i = 1, 2$ in Ω und $u \in \mathcal{C}^4(\bar{\Omega})$, so ist das DV $(\text{RWP}_3)_h$ konvergent von der Ordnung 2.

Problem. $\begin{cases} u_t(x, t) - \Delta_x u(x, t) = f(x, t) & \text{in } \Omega = (0, 1) \times (0, T) \\ u(x, 0) = g(x) & \text{für } x \in (0, 1) \\ u(0, t) = g_0(t) & \text{für } t \in [0, T] \\ u(1, t) = g_1(t) & \text{für } t \in [0, T] \end{cases}$

(RWP_4)

Verfahren. 1. Diskretisierung mit n Raum- und m Zeitschritten:

$$x_i = ih, \quad h = 1/n, \quad t_k = k\tau, \quad \tau = T/m, \quad u(x_i, t_k) \approx u_i^k$$

2. Approximation der Ableitungen:

$$u_{xx}(x, t) \approx \frac{1}{h^2} (u(x-h, t) - 2u(x, t) + u(x+h, t)) =: \Delta_h u(x, t)$$

Wir wollen nun eine Lösung von

$$\begin{cases} \dot{u}_h(t) - \tilde{\Delta}_h u_h(t) &= f_h(t) \\ u_h(0) &= g_h \end{cases}$$

für alle Zeiten t mit

$$u_h(t) = \begin{pmatrix} u_h(h, t) \\ u_h(2h, t) \\ \vdots \\ u_h(1-h, t) \end{pmatrix}, \quad f_h(t) = \begin{pmatrix} f(h, t) + \frac{1}{h^2} g_0(t) \\ f(2h, t) \\ \vdots \\ f(1-h, t) + \frac{1}{h^2} g_1(t) \end{pmatrix}$$

berechnen. Dazu verwenden wir ein Einschrittverfahren, wie das expl./impl. Gauß-Verfahren oder das Crank-Nicolson-Verfahren:

$$(\text{EEV}) \quad \begin{cases} \frac{1}{\tau}(u_i^{k+1} - u_i^k) - \tilde{\Delta}_h u_i^k &= f_i^k \\ u_i^0 &= g_h \end{cases}$$

$$(\text{IEV}) \quad \begin{cases} \frac{1}{\tau}(u_i^{k+1} - u_i^k) - \tilde{\Delta}_h u_i^{k+1} &= f_i^{k+1} \\ u_i^0 &= g_h \end{cases}$$

$$(\text{CNV}) \quad \begin{cases} \frac{1}{\tau}(u_i^{k+1} - u_i^k) - \frac{1}{2}\tilde{\Delta}_h(u_i^k + u_i^{k+1}) &= f(x_i, t_k + \frac{\tau}{2}) \\ u_i^0 &= g_h \end{cases}$$

Lem. Sei $f(x, -) \in \mathcal{C}^1([0, T])$ für alle $x \in [0, 1]$.

Dann gilt für die Approximation von (RWP_4) :

- Die Verfahren (EEV) und (IEV) besitzen einen Konsistenzfehler von $\mathcal{O}(h^2 + \tau)$, falls $u \in \mathcal{C}^4([0, 1] \times [0, T])$
- Das Verfahren (CNV) besitzt einen Konsistenzfehler von $\mathcal{O}(h^2 + \tau^2)$, falls $u \in \mathcal{C}^4([0, 1] \times [0, T])$.

Lem. Es gelte $2\tau \leq h^2$ für (EEV). Die Verfahren (EEV), (IEV) und (CNV) sind stabil.

Problem. Wellengleichung

$$\begin{cases} \partial_{tt} u - c^2 \partial_{xx} u = f(x, t) & \text{in } \Omega = (0, 1) \times [0, T] \\ u(0, t) = g_0(t), u(1, t) = g_1(t) & \text{für } t \in [0, T] \\ u(x, 0) = q_0(x), u_t(x, 0) = q_1(x) & \text{für } x \in (0, 1) \end{cases}$$

Verfahren. 1. Diskretisierung: $x_i = ih$, $h = \frac{1}{n}$, $t_k = k\tau$, $\tau = \frac{T}{m}$

2. Approximation:

$$\partial_{xx} u(x_i, t_k) \approx \frac{1}{h^2} (u(x_{i-1}, t_k) - 2u(x_i, t_k) + u(x_{i+1}, t_k))$$

$$\partial_{tt} u(x_i, t_k) \approx \frac{1}{\tau^2} (u(x_i, t_{k-1}) - 2u(x_i, t_k) + u(x_i, t_{k+1}))$$

$$\partial_t u(x_i, 0) \approx \frac{1}{2\tau} (u(x_i, t_1) - u(x_i, t_{-1}))$$

Wir erhalten das lineare Gleichungssystem

$$\begin{cases} \frac{1}{\tau^2}(u_i^{k-1} - 2u_i^k + u_i^{k+1}) - \frac{c^2}{h^2}(U_{i-1}^k - 2u_i^k + u_{i+1}^k) = f_i^k \\ \text{für } i = 1, \dots, n-1 \text{ und } k = 0, \dots, m. \\ u_0^k = g_0^k = g_0(t_k), \quad u_n^k = g_1^k = g_1(t_k), \\ u_i^0 = q_{0,i} = q_0(x_i), \quad \frac{1}{2\tau}(u_i^1 - u_i^{-1}) = q_{1,i} = q_1(x_i) \end{cases}$$

Bem. Das Differenzenverfahren ...

☺ ... ist einfach in der Herleitung und Implementierung.

☺ ... besitzt eine gute Konvergenz (z. B. Ordnung 2) bei genügend glatter Lösung.

☹ ... ermöglicht Adaptivität bzw. unregelm. Gitter nur schwer.

Schwache Lsgstheorie für elliptische DGLn

Def. Der **L^p -Raum** ist für $1 \leq p < \infty$ definiert durch

$$L^p(\Omega) := \{v : \Omega \rightarrow \mathbb{R} \mid \|v\|_p < \infty\} \quad \text{mit} \quad \|v\|_p := \left(\int_{\Omega} |v(x)|^p dx \right)^{1/p},$$

für $p = \infty$ durch

$$L^\infty(\Omega) := \{v : \Omega \rightarrow \mathbb{R} \mid \|v\|_\infty < \infty\} \quad \text{mit} \quad \|v\|_\infty := \operatorname{ess\,sup}_{x \in \Omega} |v(x)|.$$

Bem. ($L^p(\Omega), \|\cdot\|_p$) ist ein Banachraum, für $p = 2$ sogar ein

Hilbertraum mit Skalarprodukt $\langle u, v \rangle_{L^2(\Omega)} := \int_{\Omega} u(x)v(x) dx$.

Satz (Höldersche Ungleichung). Sei $u \in L^p(\Omega)$ und $v \in L^q(\Omega)$ mit $1 \leq p, q, r < \infty$ und $1/p + 1/q = 1/r$. Dann ist $uv \in L^r(\Omega)$ mit

$$\|uv\|_r \leq \|u\|_p \cdot \|v\|_q.$$

Def. Die Menge aller k -mal stetig differenzierbaren Funktionen auf Ω mit **kompaktem Träger** ist

$$\mathcal{C}_0^k(\Omega) := \{\varphi \in \mathcal{C}^k(\Omega) \mid \operatorname{supp}(\varphi) := \overline{\{x \in \Omega \mid \varphi(x) \neq 0\}} \text{ ist kompakt}\}.$$

Def. $\mathcal{D}(\Omega) := \mathcal{C}_0^\infty(\Omega)$ heißt Raum der **Testfunktionen** in Ω .

Lem (Partielle Integration). Für $u, v \in \mathcal{C}^1(\overline{\Omega})$ gilt

$$\int_{\Omega} v(x) \mathcal{D}_i u(x) dx = \int_{\Omega} v(x) u(x) \eta_i(x) dx - \int_{\Omega} \mathcal{D}_i v(x) u(x) dx.$$

Für $u \in \mathcal{C}^k(\overline{\Omega})$, $\varphi \in \mathcal{C}_0^k(\Omega)$ und $\alpha = (\alpha_1, \dots, \alpha_n)$, $|\alpha| \leq k$ gilt

$$\int_{\Omega} \varphi(x) \mathcal{D}^\alpha u(x) dx = (-1)^{|\alpha|} \int_{\Omega} \mathcal{D}^\alpha \varphi(x) u(x) dx.$$

Def. $L_{\text{loc}}^1(\Omega) := \{v : \Omega \rightarrow \mathbb{R} \mid v|_K \in L^1(K) \text{ für jedes } K \subset \subset \Omega\}$ heißt Raum der **lokal integrierbaren Funktionen**.

Def. Sei $u \in L_{\text{loc}}^1(\Omega)$ und $\alpha \in \mathbb{N}^n$. Eine Funktion $v \in L_{\text{loc}}^1(\Omega)$ heißt **schwache (partielle) Ableitung** von u der Ordnung α (oder die Ableitung von u im distributionellen Sinn), wenn

$$\int_{\Omega} \mathcal{D}^\alpha \varphi(x) dx = (-1)^{|\alpha|} \int_{\Omega} v(x) d\varphi(x) \quad \text{für alle } \varphi \in \mathcal{D}(\Omega).$$

Bem. Ist eine Funktion im klassischen Sinne diff'bar, so auch im schwachen mit derselben Ableitung.

Lem (Fundamentallemma der Variationsrechnung).

Sei $u \in L_{\text{loc}}^1$ und $\int_{\Omega} u(x) \varphi(x) dx = 0$ für alle $\varphi \in \mathcal{D}(\Omega)$.

Dann gilt $u(x) = 0$ für fast alle $x \in \Omega$.

Kor. Die schwache Ableitung ist eindeutig bestimmt, d. h. sind $v, w \in L_{\text{loc}}^1(\Omega)$ schwache Ableitungen von u , so gilt $v = w$ f. ü. in Ω .

Bsp. Die schw. Abl. von $u(x) = |x|$ ist $v(x) = \mathbb{1}_{(0,\infty)} - \mathbb{1}_{(-\infty,0)}$.

Lem. • $\mathcal{D}^\alpha(u + \lambda v) = \mathcal{D}^\alpha u + \lambda \mathcal{D}^\alpha v$ • $\mathcal{D}^{\alpha+\beta} u = \mathcal{D}^\alpha(\mathcal{D}^\beta u)$

Def. Der **Sobolev-Raum** für $1 \leq p < \infty$ ist

$$W^{k,p}(\Omega) = \left\{ u \in L^p(\Omega) \mid \begin{array}{l} \forall \alpha \in \mathbb{N}^n \text{ mit } |\alpha| \leq k : \\ \exists \text{ schwache Ableitung } \mathcal{D}^\alpha u \in L^p(\Omega) \end{array} \right\}$$

$$\|u\|_{k,p} := \left(\sum_{|\alpha| \leq k} \|\mathcal{D}^\alpha u\|_p^p \right)^{1/p}.$$

Notation. $H^k(\Omega) := W^{k,2}(\Omega)$

Satz. ($W^{k,p}(\Omega), \|\cdot\|_{k,p}$) ist ein Banachraum.

Bem. • Auf $H^k(\Omega)$ wird durch

$$\langle u, v \rangle_{H^k(\Omega)} := \int_{\Omega} \sum_{|\alpha| \leq k} \mathcal{D}^\alpha u \mathcal{D}^\alpha v dx$$

ein Skalarprodukt definiert, das die Norm $\|\cdot\|_{k,2}$ induziert.

• ($H^k(\Omega), \langle \cdot, \cdot \rangle_{H^k(\Omega)}$) ist ein Hilbertraum.

Satz („ $H = W^\infty$ “). $W^{k,p}(\Omega) \cap \mathcal{C}^\infty(\Omega)$ liegt dicht in $W^{k,p}(\Omega)$, d. h.

$$\overline{W^{k,p}(\Omega) \cap \mathcal{C}^\infty(\Omega)}^{\|\cdot\|_{k,p}} = W^{k,p}(\Omega).$$

Def. $W_0^{k,p}(\Omega) := \overline{\mathcal{D}(\Omega)}^{\|\cdot\|_{k,p}}$, $H_0^1(\Omega) := W_0^{1,2}(\Omega)$

Satz. Sei Ω ein beschränktes \mathcal{C}^1 -Gebiet und $1 \leq p < \infty$. Dann existiert eine lineare stetige Abbildung $\tau : W^{1,p}(\Omega) \rightarrow L^p(\partial\Omega)$, sodass für alle $u \in W^{1,p}(\Omega) \cap \mathcal{C}(\overline{\Omega})$ gilt: $\tau(u) = u|_{\partial\Omega}$.

Def. Die Abbildung τ heißt **Spuroperator**, $\tau(u)$ heißt die **Spur** von $u \in W^{1,p}(\Omega)$ auf $\partial\Omega$.

Satz. Sei Ω ein beschränktes \mathcal{C}^1 -Gebiet. Dann gilt

$$W_0^{1,p}(\Omega) = \{v \in W^{1,p}(\Omega) \mid \tau(v) = 0\}.$$

Def. Sei $(U, \|\cdot\|_U)$ ein Banachraum.

Der **Dualraum** von U ist $(U', \|\cdot\|_{U'})$ mit

$$U' := \{\text{lineare, stetige Abbildungen } \psi : U \rightarrow \mathbb{R}\}$$

$$\|\psi\|_{U'} := \sup_{u \in U \setminus \{0\}} \frac{|\psi(u)|}{\|u\|_U}.$$

Bsp. Gelte $1/p + 1/q = 1$ mit $p, q \in (0, \infty)$ Die Abbildung

$$j : L^q(\Omega) \rightarrow (L^p(\Omega))', \quad f \mapsto (g \mapsto \int_{\Omega} f(x)g(x) dx)$$

ist ein isometrischer Isomorphismus.

Notation. $\langle \psi, u \rangle_{U', U} := \psi(u)$ für $\psi \in U'$, $u \in U$.

Satz (Riesz'scher Darstellungssatz).

Sei $(H, \langle \cdot, \cdot \rangle_H)$ ein Hilbertraum. Dann ist

$$j : H \rightarrow H', \quad \psi \mapsto (\phi \mapsto \langle \psi, \phi \rangle_H)$$

ein isometrischer Isomorphismus.

Def. $W^{-1,q} := (W_0^{1,p}(\Omega))'$, $H^{-1}(\Omega) := (H_0^1(\Omega))'$.

Situation. Sei $\Omega \subset \mathbb{R}^d$ beschränkt. Wir betrachten nun wieder

$$(\text{RWP}_1) \quad \begin{cases} \mathcal{L}u &= f & \text{in } \Omega \\ u &= 0 & \text{auf } \partial\Omega \end{cases}$$

$$\begin{aligned} \text{mit} \quad \mathcal{L}u &= - \sum_{i=1}^d \mathcal{D}_i \left(\sum_{j=1}^d a_{ij}(x) \mathcal{D}_j u \right) + \sum_{i=1}^d b_i(x) \mathcal{D}_i u + c(x)u \\ &= - \operatorname{div}(A(x) \mathcal{D}u) + b(x) \cdot \mathcal{D}u + c(x)u. \end{aligned}$$

Sei u eine Lsg von (RWP_1) und $\phi \in \mathcal{D}(\Omega)$. Dann gilt

$$\begin{aligned} \int_{\Omega} f(x) \phi(x) dx &= \int_{\Omega} \mathcal{L}u \phi dx \\ &= - \int_{\Omega} \operatorname{div}(A(x) \mathcal{D}u(x)) \phi(x) dx + \int_{\Omega} (b(x) \cdot \mathcal{D}u(x) + c(x)u(x)) \cdot \phi(x) dx \\ &= \int_{\Omega} A(x) \mathcal{D}u(x) \cdot \mathcal{D}\phi(x) dx + \int_{\Omega} (b(x) \cdot \mathcal{D}u(x) + c(x)u(x)) \cdot \phi(x) dx \end{aligned}$$

Def. Die Funktion $u \in H_0^1(\Omega)$ heißt **schwache Lösung** von (RWP_1) , wenn u folgende Variationsgleichung erfüllt:

$$\begin{aligned} \int_{\Omega} A(x) \mathcal{D}u(x) \cdot \mathcal{D}\phi(x) + b(x) \cdot \mathcal{D}u(x) \phi(x) + c(x)u(x) \phi(x) dx \\ = \int_{\Omega} f(x) \phi(x) dx \quad \text{für alle } \phi \in H_0^1(\Omega). \end{aligned} \quad (\text{VGL}_1)$$

Problem (Allgemeines Variationsproblem).

Seien Abb. $B : H_0^1(\Omega) \times H_0^1(\Omega) \rightarrow \mathbb{R}$ und $l : H_0^1(\Omega) \rightarrow \mathbb{R}$ gegeben. Gesucht: $u \in H_0^1(\Omega)$, sodass $B(u, \phi) = l(\phi)$ für alle $\phi \in H_0^1(\Omega)$.

Bem. Im obigen Setting ist $l(\phi) := \int_{\Omega} f(x) \phi(x) dx$,

$$B(u, \phi) := \int_{\Omega} A(x) \mathcal{D}u(x) \cdot \mathcal{D}\phi(x) + b(x) \cdot \mathcal{D}u(x) \phi(x) + c(x)u(x) \phi(x) dx$$

Def. Sei X ein Banachraum. Eine Abb. $B : X \times X \rightarrow X$ heißt

- **positiv**, falls $B(u, u) > 0$ für alle $u \in X \setminus \{0\}$,
- **stark positiv** (oder **koerziv**), falls $\lambda > 0$ existiert, sodass

$$\forall u \in X : B(u, u) \geq \lambda \|u\|_X^2,$$

- **beschränkt**, falls ein $\mu > 0$ existiert, sodass

$$\forall u, \phi \in X : |B(u, \phi)| \leq \mu \|u\|_X \|\phi\|_X.$$

Lem. • Die Abbildung B in $(\text{VGL}_1)'$ ist bilinear und beschränkt.

- Die Abbildung l in $(\text{VGL}_1)'$ linear und stetig.

Satz. Sei Ω ein beschr. Lipschitz-Gebiet. Dann ist jede klassische Lsg $u \in \mathcal{C}^2 \cap \mathcal{C}^1(\partial\Omega)$ von (RWP_1) eine schwache Lsg von $(\text{VGL}_1)'$.

Satz (Lax-Milgram). Sei H ein Hilbertraum, $B : H \times H \rightarrow \mathbb{R}$ eine beschränkte, koerzitive Bilinearform. Dann gibt es für jedes $l \in H'$ eine eindeutige Lösung $u \in H$ von $\forall \phi \in H : B(u, \phi) = l(\phi)$. Es gilt $\|u\|_H \leq 1/\lambda \|l\|_{H'}$

Lem (Poincaré-Ungleichung). Sei $\Omega \subset \mathbb{R}^d$ beschränkt. Dann existiert eine Konstante $C > 0$, sodass

$$\|u\|_{L^2(\Omega)} \leq C \|\nabla u\|_{L^2(\Omega, \mathbb{R}^d)} = C \left(\int_{\Omega} \sum_i |\mathcal{D}_i u|^2 dx \right)^{1/2} \quad \forall u \in H_0^1(\Omega)$$

Kor. Mit $C_1 := (1 + C^2)^{-1/2}$ und $C_2 := 1$ gilt f. a. $u \in H_0^1(\Omega)$

$$C_1 \|u\|_{H^1(\Omega)} \leq \|\nabla u\|_{L^2(\Omega, \mathbb{R}^d)} \leq C_2 \|u\|_{H^1(\Omega)}.$$

Lem. Falls $b(x) = 0$ und $c(x) \geq 0$ in Ω , so ist B in (VGL_1) koerziv.

Satz. Sei $\Omega \subset \mathbb{R}^d$ beschränkt und sei $\mathcal{L}u = -\text{div}(A(x)\mathcal{D}u) + c(x)u$ glm. elliptisch, $c(x) \geq 0$ in Ω , $a_{ij}, c_j \in L^\infty(\Omega)$, $f \in L^2(\Omega)$. Dann besitzt (VGL_1) eine eindeutige Lösung $u \in H_0^1(\Omega)$. Außerdem existiert ein $\hat{C} > 0$, sodass $\|u\|_{H^1(\Omega)} \leq \hat{C} \|f\|_{L^2(\Omega)}$.

Bemn. • Sei $f \in H^{-1}(\Omega)$. Eine Fktn $u \in H_0^1(\Omega)$ heißt schw. Lsg von (RWP_1) , falls $B(u, \phi) = \langle f, \phi \rangle_{H^{-1}(\Omega), H_0^1(\Omega)} \quad \forall \phi \in H_0^1(\Omega)$.

Gelte $b = 0$, $c \geq 0$, glm. Elliptizität, $c, a_{ij} \in L^\infty(\Omega)$.

Dann ex. nach Lax-Milgram genau ein $u \in H_0^1(\Omega)$ mit

$$B(u, \phi) = \langle f, \phi \rangle_{H^{-1}(\Omega), H_0^1(\Omega)} \quad \text{für alle } \phi.$$

- Es existiert ein $\mu_0 > 0$, sodass für alle $\mu > \mu_0$ das RWP

$$(\text{RWP}) \quad \begin{cases} \mathcal{L}u + \mu u &= f & \text{in } \Omega \\ u &= 0 & \text{auf } \partial\Omega \end{cases}$$

für alle $f \in H^{-1}(\Omega)$ eine eindeutige Lsg $u \in H_0^1(\Omega)$ besitzt.

Problem. Wir untersuchen nun das inhomogene Randwertproblem

$$(\text{RWP}_2) \quad \begin{cases} \mathcal{L}u &= f & \text{in } \Omega, \\ u &= g & \text{auf } \partial\Omega \end{cases}$$

Angenommen, $g : \partial\Omega \rightarrow \mathbb{R}$ besitzt eine Fortsetzung $\tilde{g} : \bar{\Omega} \rightarrow \mathbb{R}$ mit $\tilde{g}|_{\partial\Omega} = g$. Dann ist $u \in \mathcal{C}^2(\Omega) \cap \mathcal{C}(\bar{\Omega})$ genau dann eine Lösung von (RWP_2) , wenn $v := u - \tilde{g} \in \mathcal{C}^2(\Omega) \cap \mathcal{C}(\bar{\Omega})$ eine Lösung von

$$(\text{RWP}_2)', \quad \begin{cases} \mathcal{L}v &= f - \mathcal{L}\tilde{g} & \text{in } \Omega, \\ v &= 0 & \text{auf } \partial\Omega \end{cases}$$

ist. Schwache Formulierung von $(\text{RWP}_2)'$: Ges. ist $v \in H_0^1(\Omega)$ mit

$$\begin{aligned} & \int_{\Omega} (A(x)\mathcal{D}v(x) \cdot \mathcal{D}\phi(x) + b(x) \cdot \mathcal{D}v(x)\phi(x) + c(x)v(x)\phi(x)) dx \\ &= \int_{\Omega} f \cdot \phi dx + \int_{\Omega} (A(x)\mathcal{D}\tilde{g} \cdot \mathcal{D}\phi + b \cdot \mathcal{D}\tilde{g}\phi + c\tilde{g}\phi) dx \quad \forall \phi \in H_0^1(\Omega). \end{aligned}$$

Voraussetzungen: $a_{ij}, b_i, c \in L^\infty(\Omega)$, $f \in L^2(\Omega)$, $\tilde{g} \in \mathcal{C}(\bar{\Omega}) \cap H^1(\Omega)$.

Gesucht ist also ein $u \in U := \{w \in H^1(\Omega) \mid \tau(w) = g\}$ mit

$$\underbrace{\int_{\Omega} A(x)\mathcal{D}u \cdot \mathcal{D}\phi + b\mathcal{D}u\phi + cu\phi dx}_{B(u, \phi) :=} = \underbrace{\int_{\Omega} f\phi dx}_{l(\phi) :=} \quad \forall \phi \in H_0^1(\Omega). \quad (\text{VGL}_2)$$

Satz. Sei $B : H_0^1(\Omega) \times H_0^1(\Omega) \rightarrow \mathbb{R}$ beschränkt und koerziv. Dann besitzt (VGL_2) genau dann eine eindeutige Lösung $u \in U$, wenn ein $u_0 \in H^1(\Omega)$ existiert, sodass $\tau(u_0) = g$.

Problem. Wir betrachten nun die Randbedingung

$$(\text{RWP}_3) \quad \begin{cases} \mathcal{L}u &= f & \text{in } \Omega, \\ A(x)\mathcal{D}u \cdot \nu + \mu u &= g & \text{auf } \partial\Omega \end{cases}$$

Falls $u \in \mathcal{C}^2(\Omega) \cap \mathcal{C}(\bar{\Omega})$ ein Lösung ist und $\phi \in \mathcal{C}^\infty(\bar{\Omega})$, so gilt

$$\begin{aligned} \int_{\Omega} f\phi dx &= - \int_{\Omega} \text{div}(A(x)\mathcal{D}u)\phi + b\mathcal{D}u\phi + cu\phi dx \\ &= - \int_{\partial\Omega} A(x)\mathcal{D}u \cdot \nu \phi ds + \int_{\Omega} A(x)\mathcal{D}u\mathcal{D}\phi dx + \int_{\Omega} b(x)\mathcal{D}u\phi dx + \int_{\Omega} cu\phi dx. \end{aligned}$$

Aus der Randbedingung bekommen wir

$$\int_{\partial\Omega} A(x)\mathcal{D}u \cdot \nu \phi ds + \mu \int_{\partial\Omega} u\phi ds = \int_{\partial\Omega} g\phi ds.$$

Zusammengesetzt erhalten wir die Variationsgleichung

$$\mu \int_{\partial\Omega} u\phi ds + \int_{\Omega} A(x)\mathcal{D}u\mathcal{D}\phi + b(x) \cdot \mathcal{D}u\phi + c(x)u\phi dx = \int_{\Omega} f\phi dx + \int_{\partial\Omega} g\phi ds.$$

Wegen Dichtheit gilt diese Gleichung nicht nur für $\phi \in \mathcal{C}^\infty(\bar{\Omega})$ sondern allgemeiner für $\phi \in H^1(\Omega)$.

Def. Sei $\mu \in \mathbb{R}$, $f \in L^2(\Omega)$, $g \in L^2(\partial\Omega)$. Eine Fktn $u \in H^1(\Omega)$ heißt **schwache Lösung** von (RWP_3) , falls sie folgende Gleichung erfüllt:

$$\mu \int_{\partial\Omega} u\phi ds + \int_{\Omega} A\mathcal{D}u\mathcal{O}\phi + b\mathcal{D}u\phi + cu\phi dx = \int_{\Omega} f\phi dx + \int_{\partial\Omega} g\phi ds \quad \forall \phi \in H^1(\Omega)$$

Gegeben: Hilbertraum H , $B : H \times H \rightarrow \mathbb{R}$ eine beschränkte, koerzive Bilinearform, $l : H \rightarrow \mathbb{R}$ linear, stetig.

Gesucht: ist $u \in H$ mit $\forall \phi \in H : B(u, \phi) = l(\phi)$ (VGL).

Idee: Seien $U_n \subset H$ ein normierter Raum mit $\dim(U_n) = d_n < \infty$, $B_n : U_n \times U_n \rightarrow \mathbb{R}$ eine beschränkte, koerzive Bilinearform, $l_n \in U_n'$.

Gesucht ist $u_n \in U_n$ mit $\forall \phi \in U_n : B(u_n, \phi) = l_n(\phi)$ (VGL)_n

Fragen: Wie wählt man U_n , B_n und l_n so, dass $u_n \xrightarrow{n \rightarrow \infty} u$, wobei u die Lösung von (VGL) ist? Wie berechnet man die Lösung u_n von (VGL)_n?

Def. Die Approximation von (VGL) mittels (VGL)_n mit $U_n \subset H$ und $B_n = B|_{U_n \times U_n}$ heißt **konforme Approximation** von (VGL). Eine solche Methode wird als **Verfahren von Ritz** bezeichnet.

Sei $\{w_1, \dots, w_{d_n}\}$ eine Basis von U_n und sei u_n eine Lösung von (VGL)_n.

$$u_n = \sum_{i=1}^{d_n} \gamma_i w_i$$

$$B_n(u_n, \phi) = \sum_{i=1}^{d_n} \gamma_i B(w_i, \phi)$$

$$\sum_{j=1}^{d_n} \gamma_j B(w_j, w_i) = l(w_i) \quad \text{für } i = 1, \dots, d_n$$

$$\hat{B}\gamma = \hat{l} \quad \text{mit } \hat{B} = (B_{ij}) \quad \text{mit } B_{ij} = B(w_j, w_i), \\ \hat{l} = (l_n(w_1), \dots, l_n(w_{d_n}))^T \quad (\text{Galerkin-Gleichung})$$

Satz. Für die Lösungen u_n der konformen Approximation (VGL)_n und die Lösung u von (VGL) gilt

$$\|u_n - u\|_H \leq c \left(\inf_{v \in U_n} \|u - v\|_H + \|l_n - l\|_{U_n'} \right)$$

Folgerung. Es genügt, U_n und l_n so zu wählen, dass

- $\forall u \in H : \inf_{v_n \in U_n} \|u - v_n\|_H \xrightarrow{n \rightarrow \infty} 0$ und
- $\|l_n - l\|_{U_n'} \xrightarrow{n \rightarrow \infty} 0$.

Wahl von U_n :

- Eigenfunktionen: $\mathcal{L}w_j = \lambda_j w_j$

Bsp.

$$\begin{cases} -u_{xx} &= f & \text{in } \Omega = (0, 1) \\ u(u) &= u(1) = 0 \end{cases}$$

Die Eigenfunktionen sind $w_j(x) = \sin(\pi j x)$ für $j > 0$. Wir setzen $U_n = \text{span}\{w_j \mid j = 1, \dots, n\}$.

3) $0 = x_0 < x_1 < \dots < x_n < x_{n+1} = 1$ $h = 1/(n+1)$, $x_i = ih$. $U_n = \{v \in \mathcal{C}(0, 1) \mid v|_{[x_{i-1}, x_i]} \in \mathbb{P}_1[X], i = 1, \dots, n+1, v(0) = v(1) = 0\}$

Hutfunktionen:

$$w_j(x) = \begin{cases} \frac{x-x_{j-1}}{h} & \text{falls } x \in (x_{j-1}, x_j] \\ \frac{x_{j+1}-x}{h} & \text{falls } x \in [x_j, x_{j+1}) \\ 0 & \text{sonst.} \end{cases}$$

$$\hat{B} = \frac{1}{h} \begin{pmatrix} 2 & -1 & & & 0 \\ -1 & 2 & -1 & & \\ & -1 & 2 & -1 & \\ & & \ddots & \ddots & \ddots \\ 0 & & & -1 & 2 & -1 \\ & & & & -1 & 2 \end{pmatrix}, \quad l_n(w_j) = hf(x_j)$$

Wenn wir also die Hutfunktionen als Basisfunktionen wählen, so erhalten wir das finite-Differenzen-Verfahren.

Methode der finiten Elementen

$$(VGL) \quad \left\{ \begin{array}{lcl} B(u, \phi) & = & l(\phi) \quad \forall \phi \in H \\ u & \in & H \end{array} \right.$$

$$(VGL)_n \quad \left\{ \begin{array}{lcl} B_n(u_n, \phi) & = & l_n(\phi) \quad \forall \phi \in U_n \subset H \\ u_n & \in & U_n \end{array} \right.$$

Idee. Wähle als Ansatzfunktionen zur Approximation von (VGL) mittels (VGL)_n eine Zusammensetzung von auf endlich vielen Teilstücken von Ω definierten Funktionen.

Bem. Als Teilgebiete verwendet man in ℝ¹ regelmäßige Teilintervalle, in ℝ² Dreiecke oder Rechtecke und in ℝ³ Tetraeder. Als lokale Ansatzfunktionen über den Teilgebieten verwenden wir Polynome. Globale Ansatzfktn über Ω sind lokale Ansatzfktn mit best. Glattheitsbedingungen am Rand der Teilgebiete.

Def. Ein **finites Element** in ℝ^d ist ein Tripel (K, P, Σ) mit

- K ⊂ ℝ^d ist kompakt, ∂K ist Lipschitz-stetig,
- P ist ein endlichdimensionaler linearer Raum von Funktionen $p \in C^s(K, \mathbb{R})$
- Σ = {b₁, ..., b_m} mit b_j ∈ (C^s(K, ℝ))' ist **P-unisolvent**, d. h.
 $\forall \alpha \in \mathbb{R}^m : \exists! p \in P : b_j(p) = \alpha_j, \quad j = 1, \dots, m$

Bemn. • Sei Σ = {b₁, ..., b_m} P-unisolvent. Dann sind b₁, ..., b_m linear unabhängig.

- Sei p_j ∈ P so gewählt, dass b_i(p_j) = δ_{ij}. Dann ist {p₁, ..., p_m} eine Basis von P.
- Sei {p₁, ..., p_m} eine Basis von P und seien b_i ∈ (C^s(K, ℝ))' mit b_i(p_j) = δ_{ij}, i, j = 1, ..., m. Dann ist {b₁, ..., b_m} P-unisolvent.

Def. Seien a₁, ..., a_{d+1} ∈ ℝ^d. Dann heißt

$$K = \{x = \sum_{j=1}^{d+1} \mu_j a_j \mid 0 \leq \mu_j \leq 1, j = 1, \dots, d+1, \mu_1 + \dots + \mu_{d+1} = 1\} \subset \mathbb{R}^d$$

ein **d-Simplex** mit Ecken a₁, ..., a_{d+1}. Dabei heißen μ₁, ..., μ_{d+1} baryzentrische Koordinaten von x. Der d-Simplex K heißt **nicht entartet**, falls a₁, ..., a_{d+1} affin unabhängig sind.