

# Il teorema di Cauchy-Kowalevski e alcune sue conseguenze

Candidato: Alessandro Pedone,  
Relatore: Prof. Maurizio Grasselli

Politecnico di Milano

24 settembre 2024

# Indice

1 Introduzione

2 Nozioni e strumenti

3 Versione invariante

4 Esempi

5 Versioni alternative

6 Applicazioni

# Sofya Vasilyevna Kovalevskaya (1850-1891)

Diamo per nota la figura storica di Augustin-Louis Cauchy.  
Kowalevski è stata:

- una matematica russa allieva di Weierstrass
- la **prima donna** a conseguire un dottorato (3 tesi risalenti al 1874) e a ottenere una cattedra in Europa (in matematica)

Esistono diverse sue **rappresentazioni artistiche** sia in letteratura che nel cinema. Le più rilevanti sono:

- Una biografia accurata: *Little Sparrow: A Portrait of Sophia Kovalevsky* (1983), Don H. Kennedy
- Un racconto breve: *Too Much Happiness* (2009), Alice Munro

# Il problema

- Cerchiamo delle condizioni che garantiscano l'esistenza di una soluzione analitica di un sistema di EDP con condizioni di Cauchy.
- Se la soluzione esiste, è unica?
- Se esiste un'unica soluzione, essa dipende con continuità dal dato iniziale? (*buona positura secondo Hadamard*)
- Ragioniamo su alcune ulteriori conseguenze.

# Classificazione EDP

---

---

Lineare	$\sum_{ \alpha  \leq k} a_\alpha D^\alpha u = f$
---------	--

---

Quasi-lineare	$\sum_{ \alpha =k} a_\alpha(x, D^\beta u) D^\alpha u + a_0(x, D^\beta u) = f,$ $ \beta  < k$
---------------	--

---

Non-lineare	$F(x, D^\alpha u) = 0, \quad  \alpha  \leq k$
-------------	---

---

In forma normale	$D_t^k u = G(x, t, D_x^\alpha D_t^j u), \quad  \alpha  + j \leq k, \quad j < k$
------------------	---

---

---

# Nozioni e strumenti essenziali

- Superfici caratteristiche
- Metodo delle caratteristiche
- Problemi di Cauchy
- Serie di potenze

# Superfici caratteristiche

$L$  operatore differenziale lineare.

## Definizione 2.1

Chiamiamo forma caratteristica di  $L$

$$\chi_L(x, \xi) = \sum_{|\alpha|=k} a_\alpha(x) \xi^\alpha \quad \text{con} \quad x, \xi \in \mathbb{R}^n$$

## Definizione 2.2

Chiamiamo varietà caratteristica di  $L$  in  $x$  l'insieme

$$\text{char}_x(L) = \{\xi \neq 0 : \chi_L(x, \xi) = 0\}$$



## Definizione 2.3

$\Gamma$  è una superficie caratteristica per  $L$  in  $x$  se  $\nu(x) \in \text{char}_x(L)$ .

## Osservazione

Caso di operatore del 1° ordine:  $A = (a_1, \dots, a_n)$  tangente a  $\Gamma$ .  
Utile per generalizzazioni successive.

# Significato

- Se  $\xi \in \text{char}_x(L)$   $L$  non è “propriamente” di ordine  $k$  in  $x$  nella direzione  $\xi$ .
- Assegnate su  $\Gamma$  le derivate  $D_{\nu}^i u$  ( $i < k$ ) di una soluzione  $u$ , se  $\Gamma$  non è caratteristica è possibile calcolare tutte le sue derivate parziali su  $\Gamma$ .

# Operatori quasi-lineari 1° ordine

- $\gamma : \mathbb{R}^{n-1} \rightarrow \mathbb{R}^n$ ,  $\gamma = \gamma(s)$  parametrizzazione locale di  $\Gamma$
- $u = \phi$  su  $\Gamma$  dato di Cauchy

## Definizione 2.4

$\Gamma$  si dice non caratteristica in  $x_0 = \gamma(s_0)$  se

$$\det \left[ \underbrace{\begin{array}{ccc} D_{s_1} \gamma_1 & \cdots & D_{s_{n-1}} \gamma_1 \\ \vdots & & \vdots \\ D_{s_1} \gamma_n & \cdots & D_{s_{n-1}} \gamma_n \end{array}}_{\text{span del piano tangente}} \mid \begin{array}{c} a_1(\gamma, \phi(\gamma)) \\ \vdots \\ a_n(\gamma, \phi(\gamma)) \end{array} \right] (s_0) \neq 0$$

# Metodo delle caratteristiche

I problemi seguenti sono **equivalenti**.

$$\text{EDP : } \begin{cases} \sum a_j(x, u) D_{x_j} u = b(x, u) \\ u = \phi \text{ su } \Gamma \end{cases} \quad (1)$$

$$\text{EDO : } \begin{cases} D_t x = A(x, y)^1 \\ D_t y = b(x, y) \\ x(0) = x_0 \\ y(0) = \phi(x_0) \quad \forall x_0 \in \Gamma \end{cases} \quad (2)$$

dove  $y = u(x)$  e  $A(x, y) = [a_1(x, y), \dots, a_n(x, y)]$ .

---

<sup>1</sup>le soluzioni  $x$  vengono dette *curve caratteristiche*

## Teorema 2.1

Ipotesi		Problema (1)
		$a_j, b, \phi, \Gamma \in C^1$
		$\Gamma$ non caratteristica
Tesi		$\exists!$ soluzione $C^1$ in un intorno di $\Gamma$

La dimostrazione si svolge sfruttando il teorema di esistenza e unicità locale per EDO.

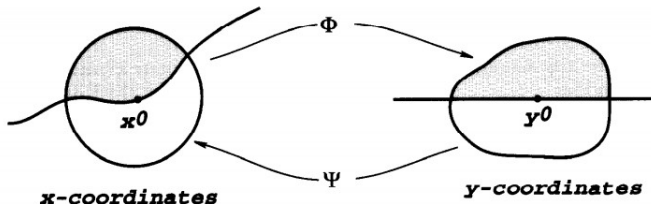
# Problema di Cauchy generale

$$\begin{cases} F^*(x, D^\alpha u^*) = 0 & |\alpha| \leq k, F^* \text{ almeno } C^1 \\ D_\nu^j u^* = \phi_j^* & \text{su } \Gamma^* \text{ per } j < k \end{cases}$$

# Mappatura in $t = 0$

Detta  $\gamma^*$  la parametrizzazione locale di  $\Gamma^*$ , applichiamo

$$\Phi(x) = [x_1 \quad \cdots \quad x_{n-1} \mid x_n - \gamma^*(x_1, \dots, x_{n-1})]$$



L. C. Evans, *Partial Differential Equations*

- 1 Selezioniamo una variabile privilegiata e chiamiamola “tempo”:

$$t \leftarrow x_n$$

$$x \leftarrow (x_1, \dots, x_{n-1})$$

- 2 Chiamiamo  $\Gamma_0 = \{t = 0\}$ .
- 3 Indichiamo le derivate nel modo seguente:  $D_x^\alpha D_t^j u$ .
- 4 Otteniamo il problema ( $u^* = u(\Phi)$ ):

$$\begin{cases} F(x, t, D_x^\alpha D_t^j u) = 0 & |\alpha| + j \leq k \\ D_t^j u(x, 0) = \phi_j(x) & \text{per } j < k \end{cases}$$



# Superfici non caratteristiche in generale

## Definizione 2.5

$\Gamma^*$  (o  $\Gamma_0$ ) è non caratteristica se l'equazione su  $\Gamma_0$  può essere riscritta in **forma normale** rispetto a  $t$ .

## Osservazione

Si dimostra che è coerente con le definizioni precedenti.

## Osservazione

- Caso lineare  $\rightarrow$  condizione sui coefficienti.
- Caso non-lineare  $\rightarrow$  validità ipotesi teorema del Dini su  $F$ .

# Metodo dei maggioranti

## Definizione 2.6

Chiamiamo funzione maggiorante

$$\mathcal{M}_{Cr}(x) = \frac{Cr}{r - (x_1 + \dots + x_n)}$$

## Osservazione

Per il teorema multinomiale se  $|x| < r/n$  si ha che

$$\frac{Cr}{r - (x_1 + \dots + x_n)} = C \sum_{\alpha} \frac{|\alpha|!}{\alpha! r^{|\alpha|}} x^{\alpha}$$

## Teorema 2.2 (utilità del maggiorante)

$$\left\{ \begin{array}{l} g_\alpha \geq |f_\alpha| \\ \sum g_\alpha x^\alpha \text{ ha raggio di conv. } R \end{array} \right. \implies \sum f_\alpha x^\alpha \text{ ha raggio almeno } R$$

In questo caso si scrive:  $\sum g_\alpha x^\alpha \gg \sum f_\alpha x^\alpha$ .

## Teorema 2.3 (costruzione del maggiorante)

$\sum f_\alpha x^\alpha$  ha raggio  $R \implies \exists r < R, C > 0$  tali che

$$|f_\alpha| \leq C \frac{1}{r^{|\alpha|}} \leq C \frac{|\alpha|!}{\alpha! r^{|\alpha|}}$$

# Schema dell'approccio

Seguendo l'ordine cronologico dei risultati procediamo per **generalizzazioni progressive**:

- 1 EDO
- 2 EDP quasi-lineari
- 3 EDP in forma normale

# EDO

## Teorema 3.1

Ipotesi

$A \subseteq \mathbb{C}, B \subseteq \mathbb{C}^n$  aperti

$\Omega \subseteq A$  aperto connesso

$f : A \times B \rightarrow \mathbb{C}^n$  olomorfa

Pb: 
$$\begin{cases} y' = f(x, y) & \forall x \in \Omega \\ y(x_0) = y_0 \end{cases}$$

Tesi

localmente esiste un'unica soluzione olomorfa

# Stima del raggio

## Teorema 3.2

Ipotesi		Ipotesi del teorema precedente
		$\exists \overline{B_a(x_0)} \subseteq A, \overline{B_b(y_0)} \subseteq B$
		$M = \max_{B_a(x_0), B_b(y_0)}  f $
Tesi		La soluzione converge almeno con raggio
		$\tilde{r} = a \left[ 1 - \exp \left( -\frac{b}{aM(n+1)} \right) \right]$

# EDP quasi-lineari

## Teorema 3.3

Ipotesi	$A_i, B$ analitici
Pb:	$\begin{cases} D_t y = \sum_{i=1}^{n-1} A_i(x, y) D_{x_i} y + B(x, y) \\ y = 0 \quad \text{su } \Gamma_0 \end{cases}$
Tesi	$\exists! y(x, t) : \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}^m$ sol. analitica in intorno dell'origine



# Dimostrazione

- 1 ipotizziamo  $y_h = \sum c_{\alpha j}^h x^\alpha t^j$
- 2 inserendo le serie di  $y$ ,  $A_j$ ,  $B$  si ottiene che:

$$c_{\alpha j}^h = Q_{\alpha j}^h(\text{coeff. delle serie di } A_i, B)$$

$Q$  polinomio a coefficienti non negativi

- 3  $\tilde{A}_i \gg A_i, \tilde{B} \gg B \implies \tilde{y} \gg y$  grazie a  $Q$
- 4 si scelgono  $\tilde{A}_i, \tilde{B}$  in modo da poter calcolare esplicitamente  $\tilde{y}$  analitica con il metodo delle caratteristiche

# Sistema maggiorante

Come sappiamo già fare, maggioriamo le serie con

$$\mathcal{M}_{Cr}(x, y) \gg A_i(x, y), B(x, y)$$

e risolviamo il problema:

$$\begin{cases} D_t \tilde{y}_h = \mathcal{M}_{Cr}(x, \tilde{y}) \left[ \sum_{i,j} D_{x_j} \tilde{y}_i + 1 \right] \\ \tilde{y}_h = 0 \quad \text{su } \Gamma_0 \end{cases}$$

con  $h = 1, \dots, m$ .

# Soluzione maggiorante

Il sistema precedente ha come soluzione:

$$\tilde{y}_h(x, t) = u(x_1 + \cdots + x_n, t) \quad \forall h$$

con

$$u(s, t) = \frac{r - s - \sqrt{(r - s)^2 - 2tCr mn}}{mn}$$

di cui possiamo studiare il raggio di convergenza.

# Stima del raggio di convergenza

## Teorema 3.4

La soluzione del teorema 3.3 converge con raggio almeno

$$\tilde{r} = \frac{1}{n-1} \frac{r}{8Cmn} \text{ con } C \geq \frac{1}{2}$$

Osserviamone l'andamento rispetto a  $r$ , sapendo che:

$$r < \min\{\text{raggi di conv. dei coefficienti } a_{ml}^i, b_m\}$$

$$C \geq \max \left\{ \begin{array}{l} \max_{i,m,l,\alpha} |(a_{ml}^i)_\alpha r^{|\alpha|}| \\ \max_{m,\alpha} |(b_m)_\alpha r^{|\alpha|}| \end{array} \right\}$$

# EDP in forma normale

## Teorema 3.5

I due problemi seguenti sono equivalenti

$$\text{non-lineare : } \begin{cases} D_t^k u = G(x, t, D_x^\alpha D_t^j u) & |\alpha| + j \leq k, j < k \\ D_t^j u = \phi_j & \text{su } \Gamma_0, j < k \end{cases}$$

$$\text{quasi-lineare : } \begin{cases} D_t y = \sum_{i=1}^{n-1} A_i(x, y) D_{x_i} y + B(x, y) \\ y = 0 & \text{su } \Gamma_0 \end{cases}$$

# Dimostrazione

**1** Si costruisce il sistema in modo tale che  $y_{\alpha j} = D_x^\alpha D_t^j u$

Le matrici  $A_i$  e  $B$  saranno quindi ricavabili dalle espressioni:

$$D_t y_{\alpha j} = y_{\alpha(j+1)} \quad |\alpha| + j < k$$

$$D_t y_{\alpha j} = D_{x_l} y_{(\alpha - e_l)(j+1)} \quad |\alpha| + j = k, j < k$$

$$\begin{aligned} D_t y_{0k} = & D_t G + \sum_{|\alpha|+j < k} D_{y_{\alpha j}} G y_{\alpha(j+1)} \\ & + \sum_{|\alpha|+j=k, j < k} D_{y_{\alpha j}} G D_{x_l} y_{(\alpha - e_l)(j+1)} \end{aligned}$$

dove  $l(\alpha) = \min\{l : \alpha_l \neq 0\}$ .

I dati di Cauchy saranno invece:

$$y_{\alpha j}(x, 0) = D_x^\alpha \phi_j(x) \quad j < k$$

$$y_{0k}(x, 0) = G(x, 0, D_x^\alpha \phi_j(x)) \quad |\alpha| + j \leq k, j < k$$

- 2 Si annulla la condizione di Cauchy ridefinendo  $y(x, t) \leftarrow y(x, t) - \phi(x)$
- 3 Si rimuove  $t$ , aggiungendo la variabile  $y^0 = t$  con una relativa equazione

# Versione "olomorfa"

Come nel caso delle EDO tutto si estende in modo **immediato**  
al caso complesso assumendo i dati olomorfi.



# Esempi

Rispondiamo ora alle domande con tre esempi:

- es. di Lewy: è necessario richiedere che i dati siano analitici
- es. di Kowalevski: è necessario richiedere che la superficie non sia caratteristica
- es. di Hadamard: il problema potrebbe non essere ben posto

# Esempio di Lewy

## Definizione 4.1

$$\mathcal{L} = D_x + iD_y - 2i(x + iy)D_t$$

è detto operatore di Lewy.

## Teorema 4.1

Ipotesi		$f$ funzione continua a valori reali che dipende solo da $t$
		$u \in C^1 : \mathcal{L}u = f$ in un intorno dell'origine
Tesi		$f$ analitica in un intorno di $t = 0$

La dimostrazione si svolge sfruttando il principio di riflessione di Schwarz.

L'enunciato precedente può essere generalizzato nel modo seguente:

### Teorema 4.2

Ipotesi

$A \subseteq \mathbb{R}^3$  aperto

$\exists F \in C^\infty(\mathbb{R}^3, \mathbb{R}) : \nexists u \in C^1(A, \mathbb{R})$

Tesi

tale che  $\begin{cases} \mathcal{L}u = F \text{ in } A \\ u_x, u_y, u_t \text{ soddisfano} \\ \text{la condizione di Hölder} \end{cases}$

# Esempio di Kowalevski

Ragionando per assurdo si dimostra che il seguente problema **non** ammette soluzioni analitiche in un intorno dell'origine.

$$\begin{cases} u_t - u_{xx} = 0 \\ u(x, 0) = \frac{1}{1+x^2} \quad \forall x \in \mathbb{R} \end{cases}$$

## Osservazione

La superficie è caratteristica!

# Esempio di Hadamard

Il problema

$$\begin{cases} u_{xx} + u_{yy} = 0 \\ u(x, 0) = 0 \\ u_y(x, 0) = n \sin(nx) e^{-\sqrt{n}} \text{ con } n \in \mathbb{N} \end{cases}$$

ha come soluzione

$$u_n(x, y) = \sin(nx) \underbrace{\sinh(ny) e^{-\sqrt{n}}}_{\xrightarrow{n \rightarrow \infty} \infty}.$$

# Versioni alternative

Versione astratta  
(*classi di Ovsyannikov*)



Versione classica  
(*simile a esistenza e unicità locale per EDO*)



Versione invariante  
(*superfici non caratteristiche*)

# Versione classica

## Teorema 5.1

Ipotesi	$\overline{\mathcal{O}}_0 \subseteq \mathcal{O}_1 \subseteq \mathbb{C}^n$ aperti connessi limitati $A_j, f, y_0$ olomorfi in $z$ $A_j, f$ continui in $t$
	Pb: $\begin{cases} D_t y = \sum A_j(z, t) D_{z_j} y + A_0(z, t) y + f(z, t) \\ y(z, 0) = y_0(z) \end{cases}$
Tesi	$\exists \delta \in (0, T) : \exists ! y$ sol. per $ t  < T$ – olomorfa in $z$ – $C^1$ in $t$



# Conseguenze

Le conseguenze di questo teorema si osservano in vari campi, tra cui i principali sono:

- teoria delle equazioni differenziali
- fisica matematica
- geometria differenziale
- teoria economica

Impatto sulla teoria delle equazioni differenziali:

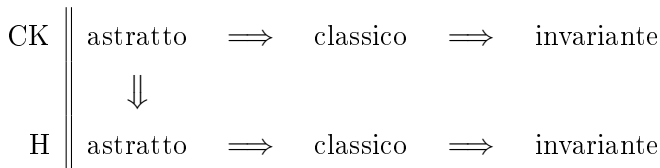
- confutare la congettura di Weierstrass
- teorema di Holmgren
- ricerca di condizioni necessarie e/o sufficienti per l'esistenza di soluzioni locali di Treves e Nirenberg
- teoria degli operatori differenziali lineari di Hörmander

# Teorema di Holmgren

Risultato di **unicità** delle soluzioni per EDP lineari.

## Osservazione

Il teorema di Cauchy-Kowalevski non esclude l'esistenza di altre soluzioni che non sono analitiche!



# Versione astratta

Una qualsiasi equazione lineare può essere ridotta a un **sistema del 1° ordine**. Ci concentriamo su questo caso.

## Teorema 6.1

Ipotesi

$\mathcal{O}_0 = \{z \in \mathbb{C}^n : |z| < r_0\}$  con  $r_0 > 0$

$A_j$  analitici in  $x$  e continui in  $t$

$y$  distribuzione su  $(\mathcal{O}_0 \cap \mathbb{R}^n) \times (-T, T)$  tale che

$-K \subseteq \mathcal{O}_0 \cap \mathbb{R}^n$  compatto:  $y = 0$  in  $\mathcal{O}_0 \cap \mathbb{R}^n \setminus K$

$$-\begin{cases} D_t y = \sum A_j(x, t) D_{x_j} y + A_0(x, t) y \\ y = 0 \text{ per } t < 0 \end{cases}$$

Tesi

$y = 0$  in  $(\mathcal{O}_0 \cap \mathbb{R}^n) \times (-T, T)$



# Versione classica

## Teorema 6.2

Ipotesi	$\Omega \subseteq \mathbb{R}^n$ aperto
	$A_j$ analitici in $x$ e continui in $t$
Tesi	$y \in C^1(\Omega \times (-T, T))$ tale che
	$\begin{cases} D_t y = \sum A_j(x, t) D_{x_j} y + A_0(x, t) y \\ y = 0 \text{ per } t = 0 \end{cases}$
Tesi	$y = 0$ in un intorno di $\Omega \times \{0\}$

# Dimostrazione

È un'applicazione della versione astratta alla funzione

$$\tilde{y}(x, t) = H(t) y(x, t),$$

la quale soddisfa sempre un sistema della stessa tipologia.

# Teorema di Cartan-Kähler

Un teorema molto importante in geometria differenziale:

- sull'integrabilità di **sistemi differenziali esterni** (*exterior differential systems*)
- si dimostra utilizzando il teorema di Cauchy-Kowalevski
- ha applicazioni al campo economico (I. Ekeland, P.A. Chiappori)



Ekeland riassume con queste parole il paper scritto nel 1999 insieme a Chiappori:

*Questo articolo risolve un problema di base nella teoria economica, che era rimasto aperto per **trent'anni**, ovvero la caratterizzazione delle funzioni di domanda di mercato. Il metodo di dimostrazione consiste nel ridurre il problema a un sistema di equazioni differenziali alle derivate parziali non lineari, per il quale si cercano soluzioni convesse. Questo viene riscritto come un sistema differenziale esterno e viene risolto mediante il teorema di Cartan-Kähler, insieme ad alcune manipolazioni algebriche per ottenere la **convessità**.*

Nonostante le ricerche iniziali

- fossero di natura teorica
- rivelarono una maggiore complessità rispetto alle aspettative di Cauchy e Weierstrass

questo teorema ha avuto conseguenze rilevanti sulla comprensione della complicata natura delle soluzioni delle EDP.

*Era una vita – gli costava dirlo, come ebbe ad ammettere, perché si era sempre guardato dagli eccessivi entusiasmi –, era una vita che aspettava di veder entrare nel suo studio un allievo del genere. Un allievo in grado di lanciargli una sfida assoluta, di non seguire soltanto il percorso spericolato della sua mente, ma se possibile di spiccare un volo più alto.*

— Alice Munro, *Too Much Happiness*