微分方程式と特殊函数

 ${\bf Twitter: @FugaciousShade}$

最終更新日:2021年9月12日

目次

第1部 常微分方程式	2
第1章 実領域における線型常微分方程式	3
1.1 ノルム	
1.1.1 実線型空間上のノルム	
1.2 Lipschitz 条件	
1.3 Picard の逐次近似法	
参考文献	11
記法	
 C:複素数全体	A := B : A を A = B によって定義する
 ℝ: 実数全体	• \mathcal{O}, o : Landau 記号
 Z:整数全体 	 (ⁿ_k): 二項係数
• N:非負整数全体	・ δ_{ij} :Kronecker の delta 記号
• $\operatorname{Re}(z)$:複素数 z の実部	• det:行列式
• $\operatorname{Im}(z)$:複素数 z の虚部	• $\mathrm{Mat}(m,n,S)$: S 上の (m,n) 行列全体
z*:複素数 z の複素共役	$ullet$ tA :行列 A の転置行列
• A^{\dagger} :作用素 A の Hermite 共役(随伴)	• ∀:全称記号
作用素	• 3:存在記号

第1部 常微分方程式

第1章

実領域における線型常微分方程式

この章では主に [高野] を参考にして,実領域における線型常微分方程式の一般論について述べる。

1.1 ノルム

ノルムに関する以下の定義や命題は [野村] に拠る。

定義 1.1 (ノルム). V を $\mathbb R$ または $\mathbb C$ 上の線型空間とする。 $|\cdot|$ を実数または複素数の絶対値とする。関数 $\|\cdot\|:V\to\mathbb R$ が以下の条件を満たすとき, $\|x\|$ を x のノルムという:

- (i) (正値性) $\forall x \in V, ||x|| \ge 0$
- (ii) (一意性) $\forall x \in V$, $\left[\|x\| = 0 \iff x = 0 \right]$
- (iii) (同次性) $\forall k \in \mathbb{C}, \ \forall x \in V, \ ||kx|| = |k|||x||$
- (iv) (三角不等式) $\forall x, \forall y \in V, \|x + y\| \le \|x\| + \|y\|$

ノルムの定義された線型空間をノルム空間という。

命題 1.2 (三角不等式). ノルムは次の性質も満たす:

$$(1.1) \forall x, \forall y \in V, |||x|| - ||y||| \le ||x - y||.$$

Proof. まず, $||x|| = ||(x-y) + y|| \le ||x-y|| + ||y||$ から $||x|| - ||y|| \le ||x-y||$ が従う。同様に

$$(1.2) ||y|| = ||(y-x) + x|| \le ||(-1)(x-y)|| + ||x|| = |-1|||x-y|| + ||x|| = ||x-y|| + ||x||$$

なので、 $\|y\|-\|x\|\leq \|x-y\|$ である。また、絶対値の特徴付け $|a|=\max\{a,-a\}$ を用いると、 $\max\{\|x\|-\|y\|,\|y\|-\|x\|\}=\|\|x\|-\|y\|\|\leq \|x-y\|$ である。これらにより、 $\|\|x\|-\|y\|\|\leq \|x-y\|$ が成立する。

系 1.3. 命題 1.2 において, $y \mapsto -y$ として, 元の三角不等式と併せれば,

が従う。

命題 1.4 (ノルムの連続性). ノルムは連続関数である。

Proof. 示すべきことは以下の通り:

(1.4)

$$(\exists x, \forall y \in V, \ \forall \varepsilon \in \mathbb{R}, \ \left[\varepsilon > 0 \implies \left(\exists \delta \in \mathbb{R}; \ \left[\delta > 0 \ \land \ (\|x - y\| < \delta \implies |\|x\| - \|y\|| < \varepsilon)\right]\right)\right].$$

実際, $\delta \coloneqq \varepsilon$ と取れば、命題 1.2 により、 $|||x|| - ||y||| \le ||x-y|| < \delta = \varepsilon$ であるから、ノルムは連続関数である。

定義 1.5 (ノルムの同値性). 以下が成立するとき, V 上の 2 つのノルム $\|\cdot\|$, $\|\cdot\|_1$ が同値であるという:

$$(1.5) \hspace{1cm} \exists m, \exists M \in \mathbb{R}; \hspace{0.1cm} \Big[0 < m \leq M \hspace{0.1cm} \wedge \hspace{0.1cm} (\forall x \in V, \hspace{0.1cm} m \|x\|_1 \leq \|x\| \leq M \|x\|_1) \Big].$$

命題 1.6. ノルムの同値性は同値関係である。

Proof. ノルム $\|\cdot\|$, $\|\cdot\|$, が同値であることを $\|\cdot\|$ ~ $\|\cdot\|$, と記すことにする。すなわち、

- $(1.6) \|\cdot\|\sim\|\cdot\|_1 : \stackrel{\mathrm{def}}{\Longleftrightarrow} \exists m, \exists M \in \mathbb{R}; \ \left[0 < m \leq M \ \land \ (\forall x \in V, \ m\|x\|_1 \leq \|x\| \leq M\|x\|_1)\right].$ このとき関係 \sim が反射律、対称律、推移律を満たすことを示す。
 - (反射律) 任意の $\|\cdot\|$ に対し, $\|\cdot\|\sim\|\cdot\|$ が成立することを示す。実際, m=M=1 とすれば,

$$(1.7) 0 < m = 1 \le M = 1 \land (\forall x \in V, 1 \cdot ||x|| \le ||x|| \le 1 \cdot ||x||)$$

であるから成立。

(対称律) ||·|| ~ ||·||, すなわち

$$(1.8) \qquad \exists m, \exists M \in \mathbb{R}; \ \left[0 < m \leq M \ \land \ (\forall x \in V, \ m \|x\|_1 \leq \|x\| \leq M \|x\|_1) \right]$$

のとき, $\|\cdot\|_1 \sim \|\cdot\|$ が成立することを示す。後半の不等式を書き直すと, $\frac{1}{M}\|x\| \leq \|x\|_1 \leq \frac{1}{m}\|x\|$ であり, $0 < m \leq M$ であるから $0 < \frac{1}{M} \leq \frac{1}{m}$ であり, $m' \coloneqq \frac{1}{M}$, $M' \coloneqq \frac{1}{m}$ と取れば確かに $\|\cdot\|_1 \sim \|\cdot\|$ の成立が判る。

• (推移律) 3 つのノルム $\|\cdot\|$, $\|\cdot\|_1$, $\|\cdot\|_2$ に対し, $\|\cdot\| \sim \|\cdot\|_1$ と $\|\cdot\|_1$ $\sim \|\cdot\|_2$ のとき, $\|\cdot\| \sim \|\cdot\|_2$ が成立することを示す。仮定から,

$$(1.9) \exists m_1, \exists M_2 \in \mathbb{R}; \ \left[0 < m_1 \le M_2 \land (\forall x \in V, \ m_1 \|x\|_1 \le \|x\| \le M_1 \|x\|_1) \right],$$

$$(1.10) \exists m_2, \exists M_2 \in \mathbb{R}; \ \left[0 < m_2 \le M_2 \land (\forall x \in V, \ m_2 ||x||_2 \le ||x||_1 \le M_2 ||x||_2) \right]$$

の両方が成立しているから, $\|x\| \le M_1 \|x\|_1 \le M_1 M_2 \|x\|_2$ 及び, $\|x\| \ge m_1 \|x\|_1 \ge m_1 m_2 \|x\|_2$ より, $m_1 m_2 \|x\|_2 \le \|x\| \le M_1 M_2 \|x\|_2$ が従う。これより, $m \coloneqq m_1 m_2$, $M \coloneqq M_1 M_2$ と取れば $0 < m_1 m_2 \le M_1 M_2$ も成立するので $\|\cdot\| \sim \|\cdot\|_2$ である。

以上により、ノルムの同値性は同値関係である。

定理 1.7. 線型空間 V が有限次元であれば、V 上の任意の 2 つのノルムは同値である。

 $Proof.\ V$ を有限次元線型空間とし, $n \coloneqq \dim V$ とする。V の基底として, $\{e_k\}_{0 \le k \le n-1}$ を取り固定する。V の元 x を, $x = \sum_{k=0}^{n-1} x_k e_k$ と表したときの成分 $\{x_k\}_{0 \le k \le n-1}$ を用いて,

(1.11)
$$\|\cdot\|\colon V \to \mathbb{R}; \ x \mapsto \|x\| \coloneqq \max_{0 < k < n-1} \{|x_k|\}$$

と定めると ||・|| はノルムになる。以下 ||・|| がノルムであることを確かめる:

- (i) (正値性) どの k についても $0 \le |x_k|$ であり, $||x|| = \max_{x} \{|x_k|\} \ge 0$ であるから成立。
- (ii) (一意性) x=0 のとき,どの k についても $x_k=0$ であるから $\|x\|=\max_k\{|x_k|\}=0$ である。また, $\|x\|=0$ のとき,任意の k に対し,絶対値の非負性から $0\leq |x_k|$ であって, $|x_k|\leq x=0$ であるから $|x_k|=0$ である。これより x=0 となる。
- (iii) (同次性) 絶対値の非負性と同次性から, $\|cx\| = \max_k \{|cx|\} = |c| \cdot \max_k \{|x_k|\} = |c| ||x||$ が 従う。
- (iv) (三角不等式) 絶対値の三角不等式から,各 k に対して $|x_k + y_k| \le |x_k| + |y_k|$ であるから 最大値に関してもこの不等号が成り立つので $||x + y|| \le ||x|| + ||y||$ が従う。

以上により式 (1.11) で定められた ||・|| はノルムである。

次に,V 上の勝手なノルム $\|\cdot\|_1$ を取ってきたときに,式 (1.11) で定義した $\|\cdot\|_1$ と $\|\cdot\|$ が同値になってしまうことを示す。V のコンパクト集合 S を $S \coloneqq \{y \in V ; \|y\| = 1\}$ によって定め,関数 $f\colon S \to \mathbb{R}$ を $f(y) \coloneqq \|y\|_1$ と定める。f の連続性(命題 1.4)と S がコンパクト集合であることから,f の値域には最小元 m と最大元 M が存在する。S 上で $y \neq 0$ であり,ノルムの正値性から $0 < m \le M$ である。特に, $\|y\| = 1$ ならば $y \in S$ であり,m,M の定義から $m \le f(y) \le M$ 及び $f(y) = \|y\|_1$ なので $m \le \|x\|_1 \le M$ が従う。ここで,V 上の一般の $x \neq 0$ に対して $y \coloneqq x/\|x\|$ とすると $\|y\| = \|x/\|x\|\| = \|x\|/\|x\| = 1$ より $y \in S$ であるから $f(y) = \|x/\|x\|\|_1 = \|x\|_1/\|x\|$ であって, $m \le \|x\|_1/\|x\| \le M$ より $m\|x\| \le \|x\|_1 \le M\|x\|$ である。x = 0 についても $\|0\| = \|0\|_1 = 0$ であって, $m\|0\|_1 \le \|0\| \le M\|0\|_1$ は成立するので, $\|\cdot\|_1$ と $\|\cdot\|$ は同値である。

有限次元線型空間 V 上で与えられた任意の 2 つのノルム $\|\cdot\|_1$, $\|\cdot\|_2$ はそれぞれ式 (1.11) で定義された $\|\cdot\|$ と同値であり,ノルムの同値は同値関係(命題 1.6)なので, $\|\cdot\|_1$ と $\|\cdot\|_2$ も同値である。

1.1.1 実線型空間上のノルム

上ではノルムに関して,一般的な形でやや抽象的に述べた。以降では [高野] に基づいて,常微分方程式を実際に扱う際に有用なノルムを具体的に扱う。ここでは有限次元実線型空間 \mathbb{R}^n 上のノルムの例を挙げる。以下では, $x=(x_0,x_1,\ldots,x_{n-1})$ の各成分を実数とし, $|\cdot|$ を実数の絶対値とする。

例 1.8 (Euclid ノルム). 原点からの標準的な距離:

(1.12)
$$||x||_2 := \left(\sum_{k=0}^{n-1} |x_k|^2\right)^{\frac{1}{2}}$$

はノルムである。

例 1.9 (一様ノルム). 定理 1.7 の証明において式 (1.11) で定義された $\|\cdot\|$ はノルムである。後述 するように,p ノルムにおいて $p \to \infty$ の極限で再現されることから,これを $\|\cdot\|_\infty$ と書いて ∞ ノルムとも呼ぶ。

定義 1.10 $(p / N \Delta)$. $p を 1 以上の実数とする。このとき, <math>x o p / N \Delta ||x||_p を,$

(1.13)
$$||x||_p := \left(\sum_{k=0}^{n-1} |x_k|^p\right)^{\frac{1}{p}}$$

で定める。

問 1.1. p ノルムがノルムの条件(定義 1.1)を満たしていることを確かめよ。

1 ノルムのことを絶対値ノルムと呼び、絶対値ノルムによって定まる距離を Manhattan 距離と呼ぶ。2 ノルムは Euclid ノルムに一致する。

命題 1.11. $p \to \infty$ の極限で p ノルム $\|\cdot\|_p$ は例 1.9 の一様ノルム $\|\cdot\|_\infty$ に一致する。

 $Proof.\ x_M$ は x の成分の x_0,x_1,\ldots,x_{n-1} のうち絶対値が最大のものであるとする。このとき, $|x_M|=\|x\|_\infty$ と書ける。定義より,

(1.14)
$$||x||_p = \left(\sum_{k=0}^{n-1} |x_k|^p\right)^{\frac{1}{p}}, \quad ||x||_{\infty} = \max_{0 \le k \le n-1} \{|x_k|\} = |x_M|$$

であるから、示すべきことは、

$$\left(\sum_{k=0}^{n-1} |x_k|^p\right)^{\frac{1}{p}} \longrightarrow |x_M| \quad (p \to \infty)$$

である。まず、 $1 のとき、<math>\|x\|_{\infty} \le \|x\|_{p}$ であることを確かめる。これは、

$$(1.16) 0 \le |x_M|^p \le \sum_{k=0}^{n-1} |x_k|^p$$

であることと,0 < p のとき, $t \in [0, \infty)$ において $f(t) = t^{\frac{1}{p}}$ が狭義単調増加であること,0 以上 (n-1) 以下の任意の整数 k について $|x_k| \ge 0$ であることから,

$$(|x_M|^p)^{\frac{1}{p}} = |x_M| \le \left(\sum_{k=0}^{n-1} |x_k|^p\right)^{\frac{1}{p}}$$

より成立。また、0以上 (n-1) 以下の任意の整数 k について $0 \le |x_k| \le |x_M|$ であり、

(1.18)
$$0 \le \sum_{k=0}^{n-1} |x_k|^p \le \sum_{k=0}^{n-1} |x_M|^p = n|x_M|^p$$

が成立する。更に、n は固定された正整数であるから

$$(1.19) n^{\frac{1}{p}} \longrightarrow n^0 = 1 (p \to \infty)$$

である。

これらのことから,

$$(1.20) 0 \le \left(\sum_{k=0}^{n-1} |x_k|^p\right)^{\frac{1}{p}} - |x_M| \le (n|x_M|^p)^{\frac{1}{p}} - |x_M| \le \left(n^{\frac{1}{p}} - 1\right)|x_M| \longrightarrow 0 (p \to \infty)$$

が従い、はさみうちの原理から、

(1.21)
$$\left(\sum_{k=0}^{n-1} |x_k|^p\right)^{\frac{1}{p}} \longrightarrow |x_M| \quad (p \to \infty)$$

であり、これは式 (1.15) の成立を意味している。

以降、有限次元線型空間のノルムは例 1.9 の一様ノルムであるとする。

命題 1.12. I を \mathbb{R} 上の閉区間であるとする。 $f \colon I \to \mathbb{R}^n$ を連続なベクトル値関数とするとき、

(1.22)
$$\left\| \int_{I} dt \, f(t) \right\| \leq \int_{I} dt \, \|f(t)\|$$

が成立する。

Proof. I 上可積分な q と絶対値に関する以下の不等式:

$$\left| \int_{I} dt \, g(t) \right| \le \int_{I} dt \, |g(t)|$$

を用いる。

(1.24)
$$\forall j \in \mathbb{N}, \ \forall t \in I, \ \left[0 \le j \le n-1 \implies f_j(t) \le |f_j(t)| \le \|f(t)\|\right]$$
 であるから、

$$(1.25) \forall j \in \mathbb{N}, \left[0 \le j \le n - 1 \implies \int_{I} dt \, f_{j}(t) \le \int_{I} dt \, |f_{j}(t)| \le \int_{I} dt \, ||f(t)|| \right]$$

である。ここで、式 (1.23) の不等式から、

$$\left| \int_{I} dt \, f_{j}(t) \right| \leq \int_{I} dt \, |f_{j}(t)| \leq \int_{I} dt \, ||f(t)||$$

であるから,

(1.27)
$$\left\| \int_{I} dt \, f(t) \right\| = \max_{0 \le j \le n-1} \left\{ \left| \int_{I} dt \, f_{j}(t) \right| \right\} \le \int_{I} dt \, \|f(t)\|$$

が成立する。

定義 1.13 (作用素ノルム). 線型作用素 $A: \mathbb{R}^n \to \mathbb{R}^n$ に対して、||A|| を、

(1.28)
$$||A|| \coloneqq \sup_{\|x\|=1} \{||Ax||\}$$

で定める。

以降, A を線型作用素とし、その (j,k) 成分を a_{ik} と書く。

命題 1.14.

(1.29)
$$||A|| = \max_{0 \le j \le n-1} \left\{ \sum_{k=0}^{n-1} |a_{jk}| \right\}$$

Proof. $\|x\|=1$ のとき,x の各成分の絶対値は 1 以下である。このとき,Ax の第 j 成分 $(Ax)_j$ に関して,

$$\left| (Ax)_j \right| = \left| \sum_{k=0}^{n-1} a_{jk} x_k \right| \le \sum_{k=0}^{n-1} |a_{jk}| |x_k| \le \sum_{k=0}^{n-1} |a_{jk}|$$

となり、1つ目の等号成立は、

$$(1.31) \ \left[\forall k \in \mathbb{N}, \ (0 \le k \le n-1 \ \Rightarrow \ a_{jk}x_k \ge 0) \right] \lor \left[\forall k \in \mathbb{N}, \ (0 \le k \le n-1 \ \Rightarrow \ a_{jk}x_k \le 0) \right]$$

のとき、すなわち $a_{jk}x_k$ が全て同符号のときである。2 つ目の等号成立は、x の各成分の絶対値が 1 に等しい場合であり、この 2 つの条件は同時に満たすことができる。実際、各 k について、 $a_{jk} \ge 0$ なら $x_k = 1$ 、 $a_{jk} < 0$ なら $x_k = -1$ と定めれば、いずれの等号も成立する。これより、

(1.32)
$$||A|| = \max_{0 \le j \le n-1} \left\{ \sum_{k=0}^{n-1} |a_{jk}| \right\}$$

である。

命題 1.15.

$$(1.33) \qquad \forall x \in \mathbb{R}^n, \ ||Ax|| \le ||A|| ||x||$$

Proof. 各 k について $|x_k| \le ||x||$ であるから, Ax の第 j 成分について,

$$\left| (Ax)_j \right| = \left| \sum_{k=0}^{n-1} a_{jk} x_k \right| \le \sum_{k=0}^{n-1} |a_{jk}| |x_k| \le \left(\sum_{k=0}^{n-1} |a_{jk}| \right) \cdot ||x||$$

が成立して,

$$(1.35) \qquad \forall x \in \mathbb{R}^n, \ \|Ax\| \le \|A\| \|x\|$$

が従う。

命題 1.16. A, B を \mathbb{R}^n から \mathbb{R}^n への任意の線型作用素とする。このとき、

$$||A + B|| \le ||A|| + ||B||, \ ||AB|| \le ||A|| ||B||$$

が成立する。

Proof. $A, B \circ (j,k)$ 成分をそれぞれ a_{jk}, b_{jk} とする。まず、

(1.37)
$$\sum_{k=0}^{n-1} |a_{jk} + b_{jk}| \le \sum_{k=0}^{n-1} |a_{jk}| + \sum_{k=0}^{n-1} |b_{jk}|$$

であるから.

(1.38)
$$\max_{0 \le j \le n-1} \left\{ \sum_{k=0}^{n-1} |a_{jk} + b_{jk}| \right\} \le \max_{0 \le j \le n-1} \left\{ \sum_{k=0}^{n-1} |a_{jk}| \right\} + \max_{0 \le j \le n-1} \left\{ \sum_{k=0}^{n-1} |b_{jk}| \right\}$$

であり、 $||A+B|| \le ||A|| + ||B||$ である。 次に、m は、

(1.39)
$$\forall \ell, \ \left[0 \le \ell \le n - 1 \implies \sum_{k=0}^{n-1} |b_{\ell k}| \le \sum_{k=0}^{n-1} |b_{mk}| \right]$$

を満たす, すなわち ||B|| を与える行の添字とする。このとき, (1.40)

$$\sum_{k=0}^{n-1} \left| \sum_{\ell=0}^{n-1} a_{j\ell} b_{\ell k} \right| \leq \sum_{k=0}^{n-1} \left(\sum_{\ell=0}^{n-1} |a_{j\ell}| |b_{\ell k}| \right) = \sum_{\ell=0}^{n-1} \left(|a_{j\ell}| \sum_{k=0}^{n-1} |b_{\ell k}| \right) \leq \left(\sum_{\ell=0}^{n-1} |a_{j\ell}| \right) \left(\sum_{k=0}^{n-1} |b_{mk}| \right)$$

より,

$$(1.41) \qquad \max_{0 \le j \le n-1} \left\{ \sum_{k=0}^{n-1} \left| \sum_{\ell=0}^{n-1} a_{j\ell} b_{\ell k} \right| \right\} \le \max_{0 \le j \le n-1} \left\{ \sum_{\ell=0}^{n-1} |a_{j\ell}| \right\} \cdot \max_{0 \le m \le n-1} \left\{ \sum_{k=0}^{n-1} |b_{mk}| \right\}$$

が従うので、 $||AB|| \le ||A|| ||B||$ である。

命題 1.17. 定義 1.13 で定義した ||A|| はノルムである。

Proof. 及び、命題 1.16 定義 1.1 の 4 条件を順に確かめる。

- (i) (正値性) 命題 1.14 から、各項にある絶対値は非負なので、||A|| > 0 である。
- (ii) (一意性) 命題 1.14 から, $\|A\|=0$ だとすれば,絶対値の非負性から,どの j に関しても $\sum_{k=0}^{n-1}|a_{jk}|=0$ であり,これが成立するためには全ての (j,k) に関して $A_{jk}=0$ でなければならず.このとき A=O(零行列)である。
- (iii) (同次性) 命題 1.14 から,

(iv) (三角不等式) 命題 1.16 から直ちに従う。

問 1.2. \mathbb{R}^n のベクトル x のノルムは例 1.9 で述べた一様ノルムとし, \mathbb{R}^n 上の線型作用素 A のノルムは定義 1.13 で与えられた作用素ノルムであるとする。n=3 のとき,

(1.43)
$$x = \begin{pmatrix} -1\\3\\-4 \end{pmatrix}, \ A = \begin{pmatrix} 1 & -1 & 4\\2 & -2 & 3\\-2 & -3 & 0 \end{pmatrix}$$

とする。このとき、||x|| と ||A|| を計算せよ。

問 1.3. \mathbb{R}^n のベクトルに対して一様ノルムではなく,例 1.8 で導入した Euclid ノルムを用いた場合,定義 1.13 で定義される $\|A\|$ はどのような性質を持つだろうか。例えば, \mathbb{R}^2 上の一般的な線型作用素の作用素ノルムを,その成分を用いて具体的に表わせ。(関連:スペクトルノルム)

1.2 Lipschitz 条件

1.3 Picard の逐次近似法

参考文献

[高野] 朝倉 復刊セレクション 新数学講座『常微分方程式』高野 恭一, 朝倉書店 (1994年)

[原岡] すうがくの風景 7『超幾何関数』原岡 喜重, 朝倉書店 (2002年)

[小松] 復刊 近代数学講座 5『特殊函数』小松 勇作, 朝倉書店 (2004年)

[野村]『球面調和函数と群の表現』野村 隆昭, 日本評論社 (2018年)