

目次

0.1	Picard の逐次近似法	2
-----	-------------------------	---

この章では、実領域における常微分方程式の解の存在性と一意性に関する命題を扱う。参考文献は [\[?\]takano](#) である。

まず、記号や用語の準備をする。以下では t を実数とし、 $x = (x^0, x^1, \dots, x^{n-1})$ を \mathbb{R}^n の元とする。 E を $\mathbb{R} \times \mathbb{R}^n$ の部分集合とし、

$$f: E \rightarrow \mathbb{R}^n; (t, x) \mapsto f(t, x) = (f^0(t, x), f^1(t, x), \dots, f^{n-1}(t, x)) \quad (0.1)$$

を既知関数とする。以降、

$$\frac{dx}{dt} = f(t, x) \quad (0.2)$$

で表される微分方程式を扱う。成分毎に書けば、

$$\frac{dx^j}{dt} = f^j(t, x^0, x^1, \dots, x^{n-1}), \quad (0 \leq j \leq n-1) \quad (0.3)$$

である。

定義 0.1. I を \mathbb{R} 上の区間とする。 $x = x(t)$ が区間 I における式 (0.2) の解であるとは、
 $\text{equ:ODE_R-微分方程式 (ベクトル表記)}$

$$\forall j \in \mathbf{N}_n, \forall t \in I, \frac{dx^j(t)}{dt} = f^j(t, x^0(t), x^1(t), \dots, x^{n-1}(t)) \quad (0.4)$$

が成立することである。但し、区間 I に有限の上界や下界が存在する場合、区間の端での微分は片側微分係数で定める。また、 $(a, b) \in E$ としたとき、条件式 $x(a) = b$ のことを初期条件といい、これを満たす解を、点 (a, b) を通る解であるという。

以下では、初期条件も含め、

$$\frac{dx}{dt} = f(t, x), \quad x(a) = b \quad (0.5)$$

を満たす解に関して考察する。

0.1 Picard の逐次近似法

の不等式

定理 0.2 (Grönwall-Bellman の不等式). $a < a'$ とし, $I := [a, a']$ とする。関数 $X: I \rightarrow \mathbb{R}$ は I 上で連続とする, また, 関数 $c, L: I \rightarrow \mathbb{R}$ は I 上連続かつ非負であるとする。

$$\forall t \in I, 0 \leq X(t) \leq c(t) + \int_a^t ds L(s)X(s) \quad (0.6)$$

が成り立つとき,

$$\forall t \in I, 0 \leq X(t) \leq c(t) + \int_a^t ds c(s)L(s) \exp\left(\int_s^t du L(u)\right) \quad (0.7)$$

が成立する。

Proof. $y: I \rightarrow \mathbb{R}$ を,

$$y(t) := \int_a^t ds L(s)X(s) \quad (0.8)$$

と定めると,

$$0 \leq X(t) \leq c(t) + y(t) \quad (0.9)$$

となる。微積分学の基本定理により,

$$\frac{dy(t)}{dt} = L(t)X(t) \quad (0.10)$$

である。 $L(t)$ は I 上で非負であるから, 式 (0.6) に $L(t)$ を掛けることで

$$\forall t \in I, \frac{dy(t)}{dt} - L(t)y(t) \leq L(t)c(t) \quad (0.11)$$

が得られる。ここで, 両辺に $\exp(-\int_a^t du L(u)) (> 0)$ を掛けると, I 上の任意の t に対し,

$$\exp\left(-\int_a^t du L(u)\right) \frac{dy(t)}{dt} - L(t) \exp\left(-\int_a^t du L(u)\right) y(t) \leq L(t)c(t) \exp\left(-\int_a^t du L(u)\right) \quad (0.12)$$

が得られる。この式の左辺は,

$$\frac{d}{dt} \left[\exp\left(-\int_a^t du L(u)\right) y(t) \right] = \exp\left(-\int_a^t du L(u)\right) \frac{dy(t)}{dt} - L(t) \exp\left(-\int_a^t du L(u)\right) y(t) \quad (0.13)$$

\wtrf@n

\wtrf@n

\wtrf@n

equ:ODE_R-Grönwall-Bellman の不等式-仮定

と書けるから,

$$\forall t \in I, \frac{d}{dt} \left[\exp \left(- \int_a^t du L(u) \right) y(t) \right] \leq L(t) c(t) \exp \left(- \int_a^t du L(u) \right) \quad (0.14)$$

が成立する。この式の両辺を a から t まで定積分することを考える。左辺について, 定義から $y(a) = 0$ であることに注意すると,

$$\int_a^t ds \frac{d}{ds} \left[\exp \left(- \int_a^s du L(u) \right) y(s) \right] \quad (0.15)$$

$$= \left[\exp \left(- \int_a^s du L(u) \right) y(s) \right]_a^t = \exp \left(- \int_a^t du L(u) \right) y(t) \quad (0.16)$$

となる。右辺は,

$$\int_a^t ds L(s) c(s) \exp \left(- \int_a^s du L(u) \right) \quad (0.17)$$

であるから,

$$\exp \left(- \int_a^t du L(u) \right) y(t) \leq \int_a^t ds L(s) c(s) \exp \left(- \int_a^s du L(u) \right) \quad (0.18)$$

が得られる。この式の両辺に $\exp \left(\int_a^t du L(u) \right) (> 0)$ を掛ける。左辺は $y(t)$ になり, 右辺は,

$$\exp \left(\int_a^t du L(u) \right) \int_a^t ds L(s) c(s) \exp \left(- \int_a^s du L(u) \right) \quad (0.19)$$

$$= \int_a^t ds L(s) c(s) \exp \left(\int_s^t du L(u) \right) \quad (0.20)$$

となる。ここで, 指数法則と

$$\int_a^t du L(u) - \int_a^s du L(u) = \int_a^t du L(u) + \int_s^a du L(u) = \int_s^t du L(u) \quad (0.21)$$

を用いた。

これらにより,

$$y(t) \leq \int_a^t ds L(s) c(s) \exp \left(\int_s^t du L(u) \right) \quad (0.22)$$

が導かれ, 式 [\(0.9\)](#) と併せると, equ:ODE_R-Gronwall-Bellman の不等式-y の評価式

$$0 \leq X(t) \leq c(t) + y(t) \leq c(t) + \int_a^t ds c(s) L(s) \exp \left(\int_s^t du L(u) \right) \quad (0.23)$$

が従い, これは式 [\(0.7\)](#) の成立を意味する。 equ:ODE_R-Gronwall-Bellman の不等式

□

系 0.3. 定理 0.2 において, c, L を単なる非負定数とすると,

$$\forall t \in I, 0 \leq X(t) \leq c + L \int_a^t ds X(s) \quad (0.24)$$

が成立するとき,

$$\forall t \in I, 0 \leq X(t) \leq ce^{(t-a)L} \quad (0.25)$$

が成り立つ。

Proof. 式 (0.7) の右辺の積分は,

$$\int_a^t ds cL \exp\left(\int_s^t du L\right) = cL \int_a^t ds e^{(s-t)L} = cLe^{-tL} \cdot \left[-\frac{e^{-sL}}{L}\right]_a^t \quad (0.26)$$

$$= -ce^{tL}(e^{-tL} - e^{-aL}) = -c + ce^{(t-a)L} \quad (0.27)$$

となるから, 式 (0.7) より,

$$\forall t \in I, 0 \leq X(t) \leq c + (-c + ce^{(t-a)L}) = ce^{(t-a)L} \quad (0.28)$$

が従う。 \square

定理 0.2 から得られた系 0.3 は, 後述する定理 0.4 の証明において, Picard の逐次近似法によって構成した解が唯一の解であることを示す際に有用である。

定理 0.4 (Picard の定理). r, ρ を正数とする. $f(t, x)$ が $\mathbb{R} \times \mathbb{R}^n$ 上の有界閉領域

$$E := \{(t, x) \in \mathbb{R} \times \mathbb{R}^n; |t - a| \leq r, \|x - b\| \leq \rho\} \quad (0.29)$$

上で Lipschitz 連続^{*1}であるとする。

$$M := \max_{(t,x) \in E} \{\|f(t, x)\|\}, \quad r' := \min\left\{r, \frac{\rho}{M}\right\} \quad (0.30)$$

としたとき, 式 (0.5) を満たす解が区間 $I' := [a - r', a + r']$ において一意的存在する。

Proof. 式 (0.5) を満たすことと,

$$x(t) = b + \int_a^t ds f(s, x(s)) \quad (0.31)$$

は同値である。実際, 式 (0.31) を満たす $x = x(t)$ の第 j 成分は, 微積分学の基本定理により,

$$\frac{dx^j(t)}{dt} = \frac{d}{dt} \left(b^j + \int_a^t ds f^j(s, x(s)) \right) = f^j(t, x(t)) \quad (0.32)$$

^{*1} 定義??参照

を満たし,

$$x^j(a) = b^j + \int_a^a ds f^j(s, x(s)) = b^j \quad (0.33)$$

も満たす。ベクトルでまとめて表せば式 (0.5) を満たすことに他ならない。

証明の流れは以下の通りである。区間 I' 上で式 (0.31) の解を Picard の逐次近似法によって構成する。そして, 構成した解が唯一の解であることを定理 0.2 から得られた系 0.3 の不等式を用いて示す。

□