

有限元方法 2025 秋冬作业四

曾申昊 3220100701 *

电子科学与技术 2202, 浙江大学

更新时间: 2025 年 10 月 30 日

1. Sobolev 空间和弱导数的相关性质

(a) 取 $\phi \in C_c^\infty(-1, 1)$, 根据定义有

$$\begin{aligned}\int_{-1}^1 u(x)\phi'(x)dx &= \int_{-1}^0 (1+x)\phi'(x)dx + \int_0^1 (1-x)\phi'(x)dx \\ &= (1+x)\phi(x)\Big|_{-1}^0 - \int_{-1}^0 1 \cdot \phi(x)dx + (1-x)\phi(x)\Big|_0^1 - \int_0^1 (-1) \cdot \phi(x)dx \\ &= -\int_{-1}^1 u'(x)\phi(x)dx\end{aligned}\quad (1)$$

其中定义弱导数 $u'(x) = \begin{cases} 1, & x \in (-1, 0) \\ -1, & x \in (0, 1) \end{cases}$ 。

(b) 取 $\phi \in C_c^\infty(-1, 1)$, 根据定义有

$$\begin{aligned}\int_{-1}^1 u''(x)\phi(x)dx &= -\int_{-1}^1 u'(x)\phi'(x)dx \\ &= -\int_{-1}^0 1 \cdot \phi'(x)dx - \int_0^1 (-1) \cdot \phi'(x)dx \\ &= -\phi(x)\Big|_{-1}^0 + \phi(x)\Big|_0^1 \\ &= -2\phi(0)\end{aligned}\quad (2)$$

利用反证法, 现在假设 $u'' \in L^1(-1, 1)$, 取 $\phi_n \in C_c^\infty(-1, 1)$ 满足 $\phi_n(0) = 1$, 支集在 $[-\frac{1}{n}, \frac{1}{n}]$ 上, 且 $|\phi_n| \leq 1$, 则有

$$\int_{-1}^1 u''(x)\phi_n(x)dx = -2\phi_n(0) = -2 \quad (3)$$

另一方面, 根据积分的绝对连续性, 有

$$\begin{aligned}\left| \int_{-1}^1 u''(x)\phi_n(x)dx \right| &\leq \int_{-1}^1 |u''(x)| |\phi_n(x)| dx \\ &\leq \int_{[-\frac{1}{n}, \frac{1}{n}]} |u''(x)| dx \rightarrow 0\end{aligned}\quad (4)$$

当 $n \rightarrow \infty$ 时产生矛盾, 因此 $u'' \notin L^1(-1, 1)$ 。

* 邮箱: 3097714673@qq.com 或 3220100701@zju.edu.cn

(c) 证明下面二者定义等价:

$$\begin{cases} v(x) = v(0) + \int_0^x v'(t)dt \\ \int_0^1 (v'(t))^2 dt < \infty \\ v'(x) = \lim_{h \rightarrow 0} \frac{v(x+h) - v(x)}{h} \end{cases} \iff \begin{cases} \int_0^1 (v(t))^2 dt < \infty \\ \int_0^1 (v'(t))^2 dt < \infty \\ \int_0^1 v'(t)\phi(t)dt = - \int_0^1 v(t)\phi'(t)dt \end{cases} \quad (5)$$

• “ \Rightarrow ”

根据 Minkowski 不等式和 Cauchy-Schwarz 不等式, 有

$$\begin{aligned} \|v(x)\|_{L^2(0,1)} &\leq \|v(x) - v(0)\|_{L^2(0,1)} + \|v(0)\|_{L^2(0,1)} \\ &= \left(\int_0^1 \left(\int_0^t v'(s)ds \right)^2 dt \right)^{\frac{1}{2}} + |v(0)| \\ &\leq \left(\int_0^1 \left[\int_0^t (v'(s))^2 ds \cdot \int_0^t 1^2 ds \right] dt \right)^{\frac{1}{2}} + |v(0)| \\ &\leq \left(\int_0^1 C_0 t dt \right)^{\frac{1}{2}} + |v(0)| \\ &\leq \sqrt{\frac{C_0}{2}} + |v(0)| < \infty \end{aligned} \quad (6)$$

另一方面, 经典导数 $v'(x)$ 自然满足弱导数定义。

• “ \Leftarrow ”

令 $u(x) = \int_0^x v'(t)dt$, 则 $u(x) \in AC[0, 1]$ 且 $u'(x) \stackrel{a.e.}{=} v'(x)$ 。令 $w(x) = u(x) - v(x)$, 计算 $w(x)$ 的弱导数有

$$\begin{aligned} \int_0^1 w(x)\phi'(x)dx &= \int_0^1 (u(x) - v(x))\phi'(x)dx \\ &= \int_0^1 u(x)\phi'(x)dx - \int_0^1 v(x)\phi'(x)dx \\ &= - \int_0^1 u'(x)\phi(x)dx + \int_0^1 v'(x)\phi(x)dx \\ &= 0 \end{aligned} \quad (7)$$

由于 $\phi(x)$ 的任意性可得, $w'(x) \stackrel{a.e.}{=} 0$, 即 $w(x) \stackrel{a.e.}{=} C$ 。因此有 $w(x) \in AC[0, 1]$, 故 $v(x) = u(x) - w(x)$ 也是绝对连续函数, 其经典导数几乎处处存在。

2. 二维区域 Ω 上的向量场

(a) • “ \Rightarrow ”

由 $\varepsilon(\vec{u}) = O$ 可得

$$\begin{cases} \partial_1 u_1 + \partial_1 u_1 = 0, \\ \partial_2 u_2 + \partial_2 u_2 = 0, \\ \partial_1 u_2 + \partial_2 u_1 = 0. \end{cases} \quad (8)$$

由前两个方程可得 $u_1 = f(y)$ 且 $u_2 = g(x)$, 将其代入第三个方程可得

$$\frac{dg(x)}{dx} + \frac{df(y)}{dy} = 0. \quad (9)$$

根据 x 和 y 的独立性可令

$$\frac{dg(x)}{dx} = a \quad \frac{df(y)}{dy} = -a \quad (10)$$

其中 a 为常数。由此可得

$$\begin{cases} u_1(x, y) = -ay + b, \\ u_2(x, y) = ax + c, \end{cases} \quad (11)$$

其中 b, c 为常数。

• “ \Leftarrow ”

将 $\vec{u}(x, y) = (-ay + b, ax + c)$ 代入 $\varepsilon(\vec{u})_{ij}$ 的定义可得

$$\begin{cases} \varepsilon(\vec{u})_{11} = \frac{1}{2}(\partial_1 u_1 + \partial_1 u_1) = 0, \\ \varepsilon(\vec{u})_{22} = \frac{1}{2}(\partial_2 u_2 + \partial_2 u_2) = 0, \\ \varepsilon(\vec{u})_{12} = \varepsilon(\vec{u})_{21} = \frac{1}{2}(\partial_1 u_2 + \partial_2 u_1) = \frac{1}{2}(a - a) = 0. \end{cases} \quad (12)$$

由此可知 $\varepsilon(\vec{u}) = O$.

(b) • 预紧集合定义

(E, d) 是一个 Banach 空间, $S \subset E$ 被称为是一个预紧集合, 如果满足对 $\forall \varepsilon > 0$, S 能被有限个半径为 ε 的开球覆盖。

• 紧算子定义

一个算子 $T: E \rightarrow F$, 其中 E, F 均为 Banach 空间, 被称为是紧算子的, 如果作用于 E 中的单位球得到的像集是预紧的。

(c) 类似讲义中 Poincaré 不等式的证明过程。假设 Korn 不等式不成立, 则存在 $\{\vec{u}_n\} \subset H_0^1(\Omega)$ 满足

$$\|\vec{u}_n\|_{L^2(\Omega)} \geq n \|\varepsilon(\vec{u}_n)\|_{L^2(\Omega)}. \quad (13)$$

单位化 \vec{u}_n , 令 $\vec{v}_n = \frac{\vec{u}_n}{\|\vec{u}_n\|_{L^2(\Omega)}}$, 则有

$$\|\varepsilon(\vec{v}_n)\|_{L^2(\Omega)} \leq \frac{1}{n} \quad (14)$$

由此可得 \vec{v}_n 是 $H_0^1(\Omega)$ 中的有界序列, 也是 $L^2(\Omega)$ 中的预紧集合。因此存在子列 $\{\vec{v}_{n_k}\}$ 使得

$$\|\vec{v}_{n_k} - \vec{v}\|_{L^2(\Omega)} \rightarrow 0 \quad (15)$$

$$\|\vec{v}_{n_k} - \vec{w}\|_{H^1(\Omega)} \rightarrow 0 \quad (16)$$

并且可知 $v \stackrel{a.e.}{=} w$ 。取 $n \rightarrow \infty$ 后可以得到 $\varepsilon(\vec{v}) = O$, 由 (a) 小问可知

$$\begin{cases} v_1(x, y) = -ay + b, \\ v_2(x, y) = ax + c, \end{cases} \quad (17)$$

由于 $\vec{v} \in H_0^1(\Omega)$, 所以 $a = b = c = 0$, 即 $\vec{v} = O$ 。这与 $\|\vec{v}\|_{L^2(\Omega)} = 1$ 矛盾。

3. 三角形 T 上 Lagrange 插值的误差估计

(a) 写出基于 T 的顶点的一次 Lagrange 插值

$$I_T u = \sum_{i=1}^3 u(\mathbf{a}_i) \phi_i \quad (18)$$

利用多点 Taylor 展开式, 有

$$u(\mathbf{a}_i) = u(\mathbf{x}) + \nabla u(\mathbf{x}) \cdot (\mathbf{a}_i - \mathbf{x}) + \int_0^1 (\mathbf{a}_i - \mathbf{x})^T \nabla^2 u(\mathbf{x} + t(\mathbf{a}_i - \mathbf{x})) (\mathbf{a}_i - \mathbf{x}) (1-t) dt \quad (19)$$

将其代入 $I_T u$ 可得

$$\begin{aligned} I_T u &= \sum_{i=1}^3 u(\mathbf{a}_i) \phi_i \\ &= \sum_{i=1}^3 \left(u(\mathbf{x}) + \nabla u(\mathbf{x}) \cdot (\mathbf{a}_i - \mathbf{x}) + \int_0^1 (\mathbf{a}_i - \mathbf{x})^T \nabla^2 u(\mathbf{x} + t(\mathbf{a}_i - \mathbf{x})) (\mathbf{a}_i - \mathbf{x}) (1-t) dt \right) \phi_i \\ &= u(\mathbf{x}) \sum_{i=1}^3 \phi_i + \nabla u(\mathbf{x}) \cdot \sum_{i=1}^3 (\mathbf{a}_i - \mathbf{x}) \phi_i + \sum_{i=1}^3 \phi_i \left(\int_0^1 (\mathbf{a}_i - \mathbf{x})^T \nabla^2 u(\mathbf{x} + t(\mathbf{a}_i - \mathbf{x})) (\mathbf{a}_i - \mathbf{x}) (1-t) dt \right) \\ &= u(\mathbf{x}) + \sum_{i=1}^3 \phi_i \left(\int_0^1 (\mathbf{a}_i - \mathbf{x})^T \nabla^2 u(\mathbf{x} + t(\mathbf{a}_i - \mathbf{x})) (\mathbf{a}_i - \mathbf{x}) (1-t) dt \right) \end{aligned} \quad (20)$$

- 证明 $\|u - I_T u\|_{L^p(T)} \leq C_1 h_T^2 |u|_{W^{2,p}(T)}$

$$\begin{aligned} \|u - I_T u\|_{L^p(T)} &= \left\| \sum_{i=1}^3 \phi_i \left(\int_0^1 (\mathbf{a}_i - \mathbf{x})^T \nabla^2 u(\mathbf{x} + t(\mathbf{a}_i - \mathbf{x})) (\mathbf{a}_i - \mathbf{x}) (1-t) dt \right) \right\|_{L^p(T)} \\ &\leq \left\| \sum_{i=1}^3 \left(\int_0^1 (\mathbf{a}_i - \mathbf{x})^T \nabla^2 u(\mathbf{x} + t(\mathbf{a}_i - \mathbf{x})) (\mathbf{a}_i - \mathbf{x}) (1-t) dt \right) \right\|_{L^p(T)} \\ &\leq h_T^2 \sum_{i=1}^3 \left(\int_0^1 \|\nabla^2 u(\mathbf{x} + t(\mathbf{a}_i - \mathbf{x}))\|_{L^p(T)} (1-t) dt \right) \end{aligned} \quad (21)$$

对 $L^p(T)$ 进行估计

$$\begin{aligned} \|\nabla^2 u(\mathbf{x} + t(\mathbf{a}_i - \mathbf{x}))\|_{L^p(T)} &= \left(\int_T (\nabla^2 u(\mathbf{x} + t(\mathbf{a}_i - \mathbf{x})))^p d\mathbf{x} \right)^{\frac{1}{p}} \\ &= \left(\int_T (\nabla^2 u(\mathbf{z}))^p (1-t)^{-2} d\mathbf{z} \right)^{\frac{1}{p}} \\ &= (1-t)^{-\frac{2}{p}} \left(\int_T (\nabla^2 u(\mathbf{z}))^p d\mathbf{z} \right)^{\frac{1}{p}} \end{aligned} \quad (22)$$

将式 (22) 代入式 (21) 可得

$$\begin{aligned} \|u - I_T u\|_{L^p(T)} &\leq 3h_T^2 \left(\int_0^1 (1-t)^{1-\frac{2}{p}} dt \right) |u|_{W^{2,p}(T)} \\ &= C_1 h_T^2 |u|_{W^{2,p}(T)} \end{aligned} \quad (23)$$

- 证明 $|u - I_T u|_{W^{1,p}(T)} \leq C_2 h_T |u|_{W^{2,p}(T)}$

$$\begin{aligned} \nabla I_T u - \nabla u &= \nabla \left(\sum_{i=1}^3 \phi_i \left(\int_0^1 (\mathbf{a}_i - \mathbf{x})^T \nabla^2 u(\mathbf{x} + t(\mathbf{a}_i - \mathbf{x})) (\mathbf{a}_i - \mathbf{x}) (1-t) dt \right) \right) \\ &= \sum_{i=1}^3 \nabla \phi_i \left(\int_0^1 (\mathbf{a}_i - \mathbf{x})^T \nabla^2 u(\mathbf{x} + t(\mathbf{a}_i - \mathbf{x})) (\mathbf{a}_i - \mathbf{x}) (1-t) dt \right) \\ &\quad + \sum_{i=1}^3 \phi_i \nabla \left(\int_0^1 (\mathbf{a}_i - \mathbf{x})^T \nabla^2 u(\mathbf{x} + t(\mathbf{a}_i - \mathbf{x})) (\mathbf{a}_i - \mathbf{x}) (1-t) dt \right) \\ &= \sum_{i=1}^3 \nabla \phi_i \left(\int_0^1 (\mathbf{a}_i - \mathbf{x})^T \nabla^2 u(\mathbf{x} + t(\mathbf{a}_i - \mathbf{x})) (\mathbf{a}_i - \mathbf{x}) (1-t) dt \right) \end{aligned} \quad (24)$$

$$\begin{aligned}
|u - I_T u|_{W^{1,p}(T)} &= \left\| \left(\sum_{i=1}^3 \nabla \phi_i \left(\int_0^1 (\mathbf{a}_i - \mathbf{x})^T \nabla^2 u(\mathbf{x} + t(\mathbf{a}_i - \mathbf{x})) (\mathbf{a}_i - \mathbf{x}) (1-t) dt \right) \right) \right\|_{L^p(T)} \\
&= \sum_{i=1}^3 \frac{1}{d_i} \left(\int_0^1 \|\nabla^2 u(\mathbf{x} + t(\mathbf{a}_i - \mathbf{x}))\|_{L^p(T)} (1-t) dt \right) \\
&\leq \frac{3h_T}{\min\{d_1, d_2, d_3\}} h_T \left(\int_0^1 (1-t)^{1-\frac{2}{p}} dt \right) |u|_{W^{2,p}(T)} \\
&= C_2 h_T |u|_{W^{2,p}(T)}
\end{aligned} \tag{25}$$

(b) C_1 的一个明确上界为

$$\begin{aligned}
C_1 &= 3 \int_0^1 (1-t)^{1-\frac{2}{p}} dt \\
&= \frac{3}{2-\frac{2}{p}}
\end{aligned} \tag{26}$$

当 $\frac{h_T}{\min\{d_1, d_2, d_3\}}$ 较大时, 也就是三角形 T 较为扁平时, C_2 较大; 反之当 $\frac{h_T}{\min\{d_1, d_2, d_3\}}$ 较小时, 也就是三角形 T 较为匀称, 即接近等边三角形时, C_2 较小。

(c) • 证明 $\|u - I_T u\|_{L^2(T)} \leq C_3 h_T^3 |u|_{H^3(T)}$

根据 Bramble-Hilbert 定理有

$$\|\hat{u} - \hat{I}_T \hat{u}\|_{L^2(\hat{T})} \leq \tilde{C}_1 |\hat{u}|_{H^3(\hat{T})} \tag{27}$$

其中 \hat{T} 代表仿射变换后的参考三角形。根据仿射变换的性质, 有

$$\begin{aligned}
\|u - I_T u\|_{L^2(T)} &= |\det(B)|^{\frac{1}{2}} \|\hat{u} - \hat{I}_T \hat{u}\|_{L^2(\hat{T})} \\
&\leq \tilde{C}_1 |\det(B)|^{\frac{1}{2}} |\hat{u}|_{H^3(\hat{T})} \\
&\leq \tilde{C}_1 |\det(B)|^{\frac{1}{2}} \tilde{C}_2 \|B\|^3 |\det(B)|^{-\frac{1}{2}} |u|_{H^3(T)} \\
&\leq \tilde{C}_1 \tilde{C}_2 \tilde{C}_3 h_T^3 |u|_{H^3(T)}
\end{aligned} \tag{28}$$

最后一个不等式是因为三角形 T 是形状规则的, 故存在常数 \tilde{C}_3 使得 $\|B\| \leq \tilde{C}_3 h_T$ 。令 $C_3 = \tilde{C}_1 \tilde{C}_2 \tilde{C}_3$ 即证毕。

• 证明 $|u - I_T u|_{H^1(T)} \leq C_4 h_T^2 |u|_{H^3(T)}$

根据讲义中的 **Lemma 1.2** 和 **Lemma 1.3** 有

$$\begin{aligned}
|v - I_T v|_{H^1(T)} &\leq |\det(B)|^{\frac{1}{2}} \|B^{-1}\| \|\widehat{v - I_T v}\|_{H^1(\hat{T})} \\
&= |\det(B)|^{\frac{1}{2}} \|B^{-1}\| \|\hat{v} - I_{\hat{T}} \hat{v}\|_{H^1(\hat{T})} \\
&= |\det(B)|^{\frac{1}{2}} \|B^{-1}\| \|\hat{v} - p - I_{\hat{T}}(\hat{v} - p)\|_{H^1(\hat{T})} \\
&\leq \tilde{C}_4 |\det(B)|^{\frac{1}{2}} \|B^{-1}\| \|\hat{v} - p\|_{H^3(\hat{T})}
\end{aligned} \tag{29}$$

根据 $p \in \mathcal{P}_m$ 的任意性, 有

$$\begin{aligned}
|v - I_T v|_{H^1(T)} &\leq \tilde{C}_4 |\det(B)|^{\frac{1}{2}} \|B^{-1}\| \|\hat{v}\|_{H^3(\hat{T})} \\
&\leq \tilde{C}_4 \|B^{-1}\| \|B\|^3 |v|_{H^3(T)} \\
&\leq \tilde{C}_4 \left(\frac{h_{\hat{T}}}{\rho_T} \right) h_T^2 |v|_{H^3(T)}.
\end{aligned} \tag{30}$$

令 $C_4 = \tilde{C}_4 \frac{h_{\hat{T}}}{\rho_T}$ 即证毕。

4. \mathbb{R}^2 上的空间 $H^k(\mathbb{R}^2)$ 的相关不等式

(a) 根据讲义的定义有 $\hat{u}(\omega) = (\mathcal{F}u)(\omega) = \int_{\mathbb{R}^n} u(x)e^{-2\pi i\omega \cdot x} dx$ 由此可得

$$\begin{cases} \|u(x)\|_{H^1(\mathbb{R}^2)} = \|\nabla u(x)\|_{L^2(\mathbb{R}^2)} = 2\pi \|\omega \hat{u}(\omega)\|_{L^2(\mathbb{R}^2)} \\ \|u(x)\|_{H^2(\mathbb{R}^2)} = \|\nabla^2 u(x)\|_{L^2(\mathbb{R}^2)} = 4\pi^2 \|\omega^2 \hat{u}(\omega)\|_{L^2(\mathbb{R}^2)} \end{cases} \quad (31)$$

$$\begin{cases} \|u(x)\|_{L^2(\mathbb{R}^2)} = \|\hat{u}(\omega)\|_{L^2(\mathbb{R}^2)} \\ \|u(x)\|_{H^1(\mathbb{R}^2)} = (\|\hat{u}(\omega)\|_{L^2(\mathbb{R}^2)}^2 + \|2\pi\omega \hat{u}(\omega)\|_{L^2(\mathbb{R}^2)}^2)^{\frac{1}{2}} \\ \|u(x)\|_{H^2(\mathbb{R}^2)} = (\|\hat{u}(\omega)\|_{L^2(\mathbb{R}^2)}^2 + 2\|2\pi\omega \hat{u}(\omega)\|_{L^2(\mathbb{R}^2)}^2 + \|4\pi^2\omega^2 \hat{u}(\omega)\|_{L^2(\mathbb{R}^2)}^2)^{\frac{1}{2}} \end{cases} \quad (32)$$

(b) 根据 $\|u\|_{H^2(\mathbb{R}^2)}$ 的定义

$$\begin{aligned} \|u(x)\|_{H^2(\mathbb{R}^2)} &= (\|\hat{u}(\omega)\|_{L^2(\mathbb{R}^2)}^2 + 2\|2\pi\omega \hat{u}(\omega)\|_{L^2(\mathbb{R}^2)}^2 + \|4\pi^2\omega^2 \hat{u}(\omega)\|_{L^2(\mathbb{R}^2)}^2)^{\frac{1}{2}} \\ &= \left(\int_{\mathbb{R}^2} (1 + 4\pi^2\omega^2)^2 \hat{u}^2(\omega) d\omega \right)^{\frac{1}{2}} \\ &= \|(1 + 4\pi^2\omega^2) \hat{u}(\omega)\|_{L^2(\mathbb{R}^2)} \\ &\leq \|\hat{u}(\omega)\|_{L^2(\mathbb{R}^2)} + \|4\pi^2\omega^2 \hat{u}(\omega)\|_{L^2(\mathbb{R}^2)} \\ &= \|u(x)\|_{L^2(\mathbb{R}^2)} + \|u(x)\|_{H^2(\mathbb{R}^2)} \end{aligned} \quad (33)$$

(c) 根据 Fourier 逆变换有

$$\begin{aligned} |u(x)| &= \left| \int_{\mathbb{R}^2} \hat{u}(\omega) e^{2\pi i\omega \cdot x} d\omega \right| \\ &\leq \int_{\mathbb{R}^2} |\hat{u}(\omega)| d\omega \\ &\leq \left(\int_{\mathbb{R}^2} (1 + 4\pi^2\omega^2)^{-2} d\omega \right)^{\frac{1}{2}} \cdot \left(\int_{\mathbb{R}^2} (1 + 4\pi^2\omega^2)^2 \hat{u}^2(\omega) d\omega \right)^{\frac{1}{2}} \\ &= C \|u(x)\|_{H^2(\mathbb{R}^2)} \end{aligned} \quad (34)$$

两边取最大值可得

$$\|u(x)\|_{L^\infty(\mathbb{R}^2)} \leq C \|u(x)\|_{H^2(\mathbb{R}^2)} \quad (35)$$