

$$u_H = u_{xx}$$

$$u = f$$

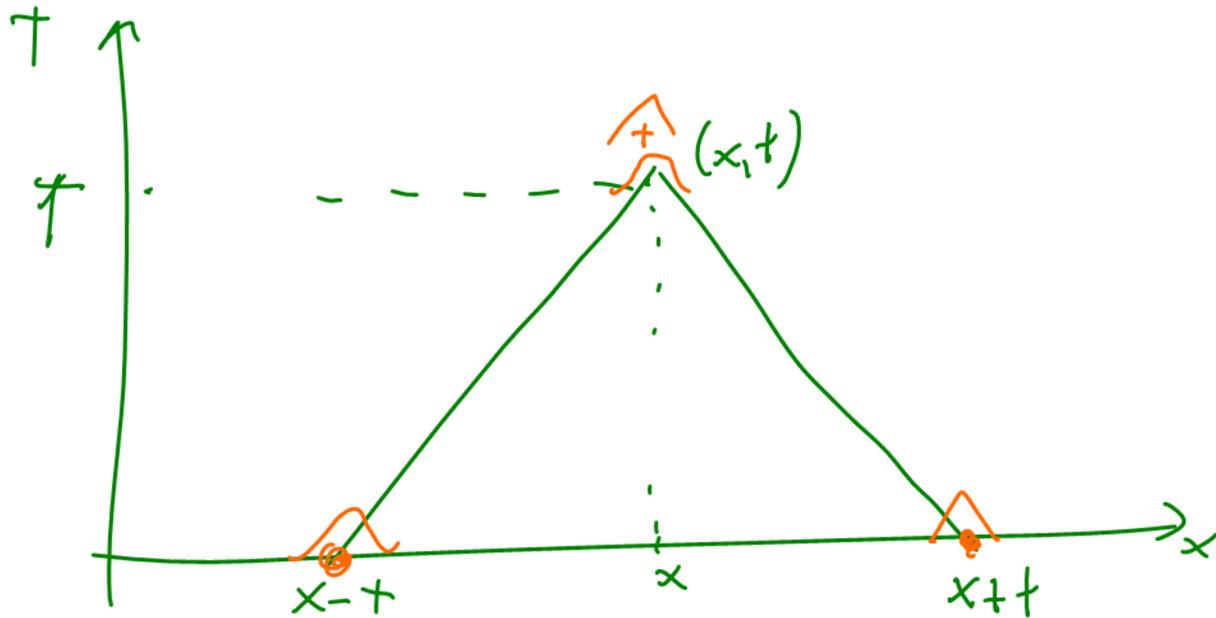
$$u = 0$$

$$R_x (0, \infty)$$

$$R_x \{t=0\}$$

$$R_x \{t=0\}$$

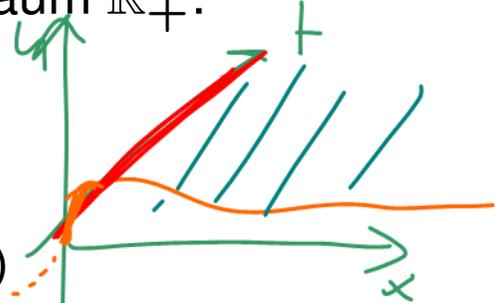
$$u(x,t) = \frac{1}{2} (f(x+t) + f(x-t))$$



Die Reflektionsmethode für den Halbraum $\mathbb{R}_+ = \{x > 0\}$:

Wir betrachten das Anfangsrandwertproblem auf dem Halbraum \mathbb{R}_+ :

$$\begin{cases} u_{tt} - u_{xx} = 0 & \text{in } \mathbb{R}_+ \times (0, \infty) \\ u = g, u_t = h & \text{auf } \mathbb{R}_+ \times \{t = 0\} \\ u = 0 & \text{auf } \{x = 0\} \times (0, \infty) \end{cases}$$



mit vorgegebenen Funktionen g und h mit $g(0) = h(0) = 0$.

Idee:

Erweitere das Halbraumproblem auf ein Ganzraumproblem und verwende die Formel von d' Alembert.

Definiere eine Funktion $\tilde{u}(x, t)$ für $x \in \mathbb{R}$ und $t \geq 0$ durch

$$\tilde{u}(x, t) := \begin{cases} u(x, t) & (x \geq 0, t \geq 0) \\ -u(-x, t) & (x \leq 0, t \geq 0) \end{cases}$$

Analog werden die gegebenen Anfangsdaten **reflektiert**:

$$\tilde{g}(x) := \begin{cases} g(x) & (x \geq 0) \\ -g(-x) & (x \leq 0) \end{cases}$$

$$\tilde{h}(x) := \begin{cases} h(x) & (x \geq 0) \\ -h(-x) & (x \leq 0) \end{cases}$$

Damit erhalten wir für die Funktion \tilde{u} das **Anfangswertproblem**

$$\begin{cases} \tilde{u}_{tt} - \tilde{u}_{xx} = 0 & \text{in } \mathbb{R} \times (0, \infty) \\ \tilde{u} = \tilde{g}, \tilde{u}_t = \tilde{h} & \text{auf } \mathbb{R} \times \{t = 0\} \end{cases}$$

und nach der Lösungsformel nach d'Alembert gilt

$$\tilde{u}(x, t) = \frac{1}{2} (\tilde{g}(x+t) + \tilde{g}(x-t)) + \frac{1}{2} \int_{x-t}^{x+t} \tilde{h}(y) dy$$

$$\tilde{u}(0, t) = \frac{1}{2} (\tilde{g}(t) + \tilde{g}(-t)) + \frac{1}{2} \int_{-t}^t \tilde{h}(y) dy = 0$$

$\underbrace{\tilde{g}(t)}_{-\tilde{g}(-t)} + \underbrace{\tilde{g}(-t)}_{\tilde{g}(t)} = 0$

$$\tilde{u}(-x, t) = \frac{1}{2} (\tilde{g}(-x+t) + \tilde{g}(-x-t)) + \frac{1}{2} \int_{-x-t}^{-x+t} \tilde{h}(y) dy =$$

$$\underbrace{-g(x-t)} \quad \underbrace{-g(x+t)} \quad - \frac{1}{2} \int_{x-t}^{x+t} h(y) dy = -u(x,t) \quad \text{Umgekehrte Fkt.}$$

Analog werden die gegebenen Anfangsdaten **reflektiert**:

$$\tilde{g}(x) := \begin{cases} g(x) & (x \geq 0) \\ -g(-x) & (x \leq 0) \end{cases}$$

$$\tilde{h}(x) := \begin{cases} h(x) & (x \geq 0) \\ -h(-x) & (x \leq 0) \end{cases}$$

Damit erhalten wir für die Funktion \tilde{u} das **Anfangswertproblem**

$$\begin{cases} \tilde{u}_{tt} - \tilde{u}_{xx} = 0 & \text{in } \mathbb{R} \times (0, \infty) \\ \tilde{u} = \tilde{g}, \tilde{u}_t = \tilde{h} & \text{auf } \mathbb{R} \times \{t = 0\} \end{cases}$$

und nach der Lösungsformel nach d'Alembert gilt

$$\tilde{u}(x,t) = \frac{1}{2} (\tilde{g}(x+t) + \tilde{g}(x-t)) + \frac{1}{2} \int_{x-t}^{x+t} \tilde{h}(y) dy$$

$$\tilde{u}(0,t) = \frac{1}{2} (\underbrace{\tilde{g}(t)}_{-\tilde{g}(t+t)} + \tilde{g}(-t)) + \frac{1}{2} \int_{-t}^t \tilde{h}(y) dy = 0$$

Für $x \geq 0$ haben wir gerade die Lösung des Ausgangsproblems, i.e.

$$u(x, t) = \tilde{u}(x, t)$$

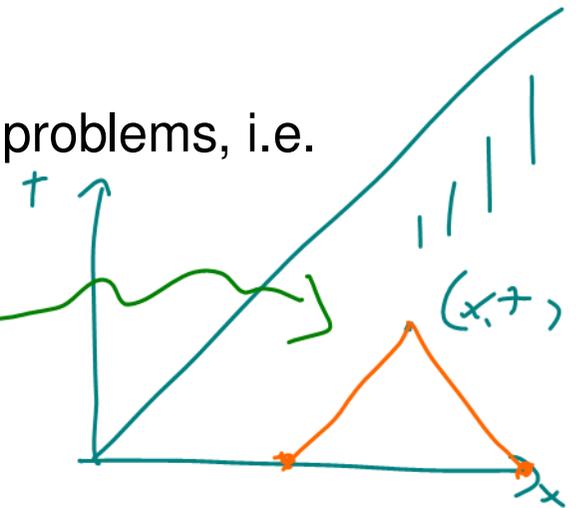
Fallunterscheidung:

1) Ist $x \geq t \geq 0$, so folgt $x - t \geq 0$ und daher

$$\begin{aligned}
 u(x, t) &= \frac{1}{2} (\underbrace{\tilde{g}(x+t)}_{>0} + \underbrace{\tilde{g}(x-t)}_{>0}) + \frac{1}{2} \int_{\underbrace{x-t}_{>0}}^{x+t} \tilde{h}(y) dy \\
 &= \frac{1}{2} (g(x+t) + g(x-t)) + \frac{1}{2} \int_{x-t}^{x+t} h(y) dy
 \end{aligned}$$

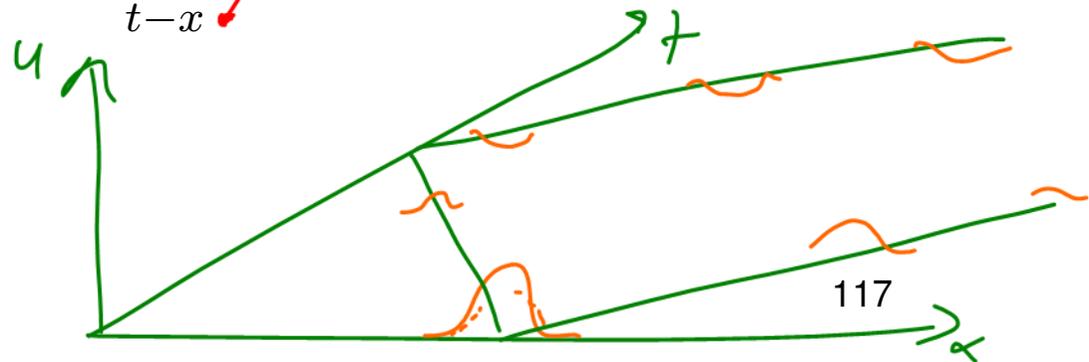
denn für positive Argumente stimmen die Funktionen g und \tilde{g} beziehungsweise h und \tilde{h} überein.

$x-t \geq 0$ Regel im Integral



2) Ist $0 \leq x \leq t$, so folgt $x - t \leq 0$ und daher

$$\begin{aligned}
 u(x, t) &= \frac{1}{2} (\underbrace{\tilde{g}(x+t)}_{>0} + \underbrace{\tilde{g}(x-t)}_{<0}) + \frac{1}{2} \int_{x-t}^{x+t} \tilde{h}(y) dy \\
 &= \frac{1}{2} (g(x+t) - g(-(x-t))) + \frac{1}{2} \int_{x-t}^0 \tilde{h}(y) dy + \frac{1}{2} \int_0^{x+t} \tilde{h}(y) dy \\
 &= \frac{1}{2} (g(x+t) - g(t-x)) - \frac{1}{2} \int_0^{t-x} h(y) dy + \frac{1}{2} \int_0^{x+t} h(y) dy \\
 &= \frac{1}{2} (g(x+t) - g(t-x)) + \frac{1}{2} \int_{t-x}^{x+t} h(y) dy
 \end{aligned}$$



Gesamtlösung:

Wir erhalten also als Lösung des Ausgangsproblems

$$u(x, t) = \begin{cases} \frac{1}{2} (g(x+t) + g(x-t)) + \frac{1}{2} \int_{x-t}^{x+t} h(y) dy & x \geq t \geq 0 \\ \frac{1}{2} (g(x+t) - g(t-x)) + \frac{1}{2} \int_{-x+t}^{x+t} h(y) dy & 0 \leq x \leq t \end{cases}$$

Beispiel:

Die Lösung des ARWP

$$\begin{cases} u_{tt} - u_{xx} = 0 & \text{in } \mathbb{R}_+ \times (0, \infty) \\ u = 0, u_t = \sin x & \text{auf } \mathbb{R}_+ \times \{t = 0\} \\ u = 0 & \text{auf } \{x = 0\} \times (0, \infty) \end{cases}$$

lautet

$$u(x, t) = \frac{1}{2} (\cos(x-t) - \cos(x+t))$$

6.2 Lösungen der Wellengleichung durch sphärische Mittelung

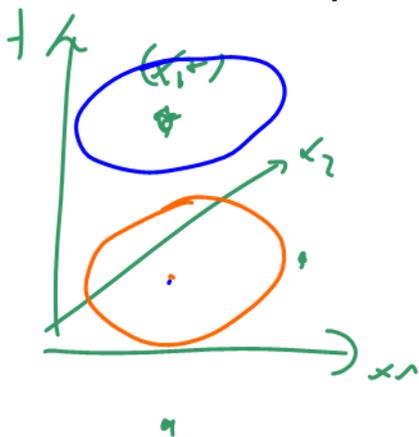
Wir betrachten nun den höherdimensionalen Fall $n \geq 2$ und suchen eine Lösung für das Anfangswertproblem

$$\begin{cases} u_{tt} - \Delta u = 0 & \text{in } \mathbb{R}^n \times [0, \infty) \\ u = g, u_t = h & \text{auf } \mathbb{R}^n \times \{t = 0\} \end{cases}$$

Idee:

Leite durch geeignete **sphärische Mittelungen** eine vereinfachte Differentialgleichung ab, die dann eine explizite Lösungsformel für die höherdimensionale Wellengleichung liefert.

Für $x \in \mathbb{R}^n$, $t > 0$ und $r > 0$ definieren wir den **Mittelwert** von $u(x, t)$ über die Sphäre $\partial B(x, r)$,



$$U(x; r, t) := \int_{\partial B(x, r)} u(y, t) dS(y) \xrightarrow{r \rightarrow 0} u(x, t)$$

Weiter sei

$$\begin{cases} G(x; r) := \int_{\partial B(x, r)} g(y) dS(y) \xrightarrow{r \rightarrow 0} g(x) \\ H(x; r) := \int_{\partial B(x, r)} h(y) dS(y) \xrightarrow{r \rightarrow 0} h(x) \end{cases}$$

Satz:

Sei $x \in \mathbb{R}^n$ fest und u eine Lösung der obenstehenden Wellengleichung. Dann löst $U(x; r, t)$ die **Euler–Poisson–Darboux Gleichung**

$$\begin{cases} U_{tt} - U_{rr} - \frac{n-1}{r} U_r = 0 & \text{in } \mathbb{R}_+ \times (0, \infty) \\ U = G, U_t = H & \text{auf } \mathbb{R}_+ \times \{t = 0\} \end{cases}$$

Beweis:

$$U = g \neq 0 \text{ i.A. } r=0$$

Einer früheren Beobachtung folgend (siehe Seite 71 des Skripts) gilt:

$$U_r(x; r, t) = \frac{r}{n} \int_{B(x, r)} \Delta u(y, t) dy$$

$= \dots$

Beweis: (Fortsetzung)

Da u eine Lösung der Wellengleichung ist, folgt

$$U_r(x; r, t) = \frac{r}{n} \int_{B(x,r)} u_{tt}(y, t) dy$$

und damit

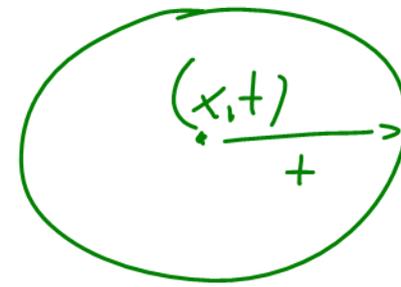
$$r^{n-1}U_r = \frac{1}{n\alpha(n)} \int_{B(x,r)} u_{tt} dy$$

Daraus folgt aber

$$(r^{n-1}U_r)_r = \frac{1}{n\alpha(n)} \int_{\partial B(x,r)} u_{tt} dS = r^{n-1} \int_{\partial B(x,r)} u_{tt} dS = r^{n-1}U_{tt}$$

Fassen wir dieses Ergebnis zusammen, so löst U in der Tat die Gleichung

$$U_{tt} - U_{rr} - \frac{n-1}{r}U_r = 0$$



Die Kirchhoffsche Formel für $n = 3$:

Die Lösung des Anfangswertproblems für die Wellengleichung lautet:

$$u(x, t) = \int_{\partial B(x, t)} (th(y) + g(y) + Dg(y) \cdot (y - x)) dS(y) \quad (x \in \mathbb{R}^3, t > 0)$$

Herleitung über die Euler–Poisson–Darboux Gleichung:

Wir definieren

$$\tilde{U} := rU$$

$$\tilde{G} := rG, \quad \tilde{H} := rH$$

Dann gilt

$$\tilde{U}_{tt} = rU_{tt} = r \left(U_{rr} + \overset{=3-1}{\frac{2}{r}} U_r \right) = rU_{rr} + 2U_r = (U + rU_r)_r = \tilde{U}_{rr} = (rU)_r$$

$$\tilde{U}(r=0) = r U(r=0) = 0$$

Also löst \tilde{U} das Anfangswertproblem

Halbraum:

$$\begin{cases} \tilde{U}_{tt} - \tilde{U}_{rr} = 0 & \text{in } \mathbb{R}_+ \times (0, \infty) \\ \tilde{U} = \tilde{G}, \tilde{U}_t = \tilde{H} & \text{auf } \mathbb{R}_+ \times \{t = 0\} \\ \tilde{U} = 0 & \text{auf } \{r = 0\} \times \{t = 0\} \end{cases}$$

Mit der Lösungsformel für das Halbraumproblem folgt für $0 \leq r \leq t$ die Darstellung

$$\tilde{U}(x; r, t) = \frac{1}{2} [\tilde{G}(r+t) - \tilde{G}(t-r)] + \frac{1}{2} \int_{-r+t}^{r+t} \tilde{H}(y) dy$$

Da $U(x; r, t)$ aus $u(x, t)$ durch spärliche Mittelung entsteht, gilt

$$u(x, t) = \lim_{r \rightarrow 0} U(x; r, t) = \lim_{r \rightarrow 0} \frac{\tilde{U}(x; r, t)}{r}$$

Mit der Definition von \tilde{U} ergibt sich

$$\begin{aligned}
 u(x, t) &= \lim_{r \rightarrow 0} \frac{\tilde{U}(x; r, t)}{r} \\
 &= \lim_{r \rightarrow 0} \left(\frac{\tilde{G}(r+t) - \tilde{G}(t-r)}{2r} + \frac{1}{2r} \int_{-r+t}^{r+t} \tilde{H}(y) dy \right) \\
 &= \tilde{G}'(t) + \tilde{H}(t) \quad \leftarrow \text{Handwritten note: } = (tG(x; t))' + tH(x; t)
 \end{aligned}$$

Verwendet man die Definitionen von G und H , so erhält man

$$\begin{aligned}
 u(x, t) &= \frac{\partial}{\partial t} (tG(x; t)) + tH(x; t) \\
 &= \frac{\partial}{\partial t} \left(t \int_{\partial B(x, t)} g dS \right) + t \int_{\partial B(x, t)} h dS
 \end{aligned}$$

Nun gilt

$$\int_{\partial B(x,t)} g(y) dS(y) = \int_{\partial B(0,1)} g(x + tz) dS(z)$$

und damit

$$\begin{aligned} \frac{\partial}{\partial t} \left(\int_{\partial B(x,t)} g dS \right) &= \int_{\partial B(0,1)} Dg(x + tz) \cdot z dS(z) \\ &= \int_{\partial B(x,t)} Dg(y) \cdot \left(\frac{y - x}{t} \right) dS(y) \end{aligned}$$

Setzen wir dies in dies in die letzte Gleichung auf der vorgehenden Seite ein, so erhalten

$$\begin{aligned} u(x, t) &= \int_{\partial B(x,t)} t Dg(y) \cdot \left(\frac{y - x}{t} \right) dS(y) + \int_{\partial B(x,t)} g(y) dS(y) \\ &\quad + \int_{\partial B(x,t)} t h dS(y) \end{aligned}$$

und dies ist gerade – nach Umsortierung – die **Kirchhoffsche Formel**.

Die Poissonsche Formel für $n = 2$:

Die Lösung des Anfangswertproblems für die Wellengleichung lautet:

$$u(x, t) = \frac{1}{2} \int_{B(x, t)} \frac{tg(y) + t^2h(y) + tDg(y) \cdot (y - x)}{(t^2 - |y - x|^2)^{1/2}} dy$$

für $x \in \mathbb{R}^2$ und $t > 0$.

Um diese Lösungsdarstellung abzuleiten, betrachtet man das dreidimensionale Anfangswertproblem und nimmt zusätzlich an, dass die Lösung nicht von der dritten Ortskoordinate x_3 abhängt.

Bemerkung:

Nach einem zur Herleitung der Kirchhoffschen Formel analogen Prinzip, i.e. Verwendung der EPD Gleichung und geeignete Definition von \tilde{U} , lassen sich Lösungsformeln für das Anfangswertproblem der Wellengleichung im \mathbb{R}^n ableiten.

8.1 Die Methode der Finiten-Differenzen

Wir beschränken uns auf **eindimensionale** Probleme und die folgenden Anfangs- und Anfangsrandwertprobleme

1) Cauchy-Probleme für **skalare Erhaltungsgleichungen**, also

$$\begin{cases} u_t + f(u)_x = 0 & \text{in } \mathbb{R} \times (0, \infty) \\ u = u_0 & \text{auf } \mathbb{R} \times \{t = 0\} \end{cases}$$

2) Randwertprobleme für die **Poissongleichung**, also

$$\begin{cases} -u_{xx} = f(x) & : 0 < x < 1, 0 < t \leq T \\ u(0) = u(1) = 0 \end{cases}$$

3) Anfangsrandwertprobleme für die **Wärmeleitungsgleichung**, also

$$\begin{cases} u_t - u_{xx} = f(x, t) & : 0 < x < 1, 0 < t \leq T \\ u(x, 0) = g(x) & : 0 \leq x \leq 1 \\ u(0, t) = u(1, t) = 0 & : 0 \leq t \leq T \end{cases}$$

4)

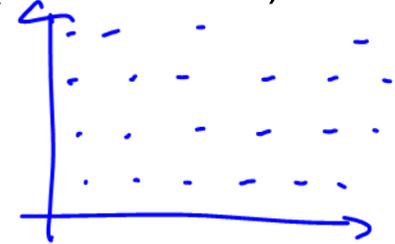
$$\begin{aligned} u_t &= v \\ u_x &= w \\ v_t &= w_x \\ v_x &= w_t \end{aligned}$$
$$\begin{pmatrix} v \\ w \end{pmatrix}_t = \begin{pmatrix} 0 & 1 \\ 1 & 0 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} v \\ w \end{pmatrix}_x$$

Idee bei Finiten–Differenzen:

Approximiere die exakte Lösung **nur** an diskreten Punkten (**dem Gitter**):

$$u(x_i, t_j) \approx U(x_i, t_j) =: U_{ij}$$

mit den diskreten Punkten



$$x_i := i \cdot h, \quad i \in \mathcal{Z}_x, \quad t_j := j \cdot k, \quad j \in \mathcal{Z}_t$$

und den **Orts– und Zeitschrittweiten** h und k . Die Indexmengen \mathcal{Z}_x und \mathcal{Z}_t sind dabei endliche oder unendliche Teilmengen von \mathcal{Z} .

Beispiel: Für die Wärmeleitungsgleichung auf $[0, 1] \times [0, T]$ setzen wir

$$x_i := i \cdot h, \quad i = 0, \dots, n$$

$$t_j := j \cdot k, \quad j = 0, \dots, m$$

mit den Orts– und Zeitschrittweiten

$$h := \frac{1}{n}, \quad k := \frac{T}{m}$$

Zur Berechnung der diskreten Werte U_i^j benötigen wir die Approximation von Ableitungen:

Beispiel:

Wir approximieren die Ableitung $u_x(x, t)$ an der Stelle $(x, t) = (x_i, t_j)$:

1) Zentrale Differenzen

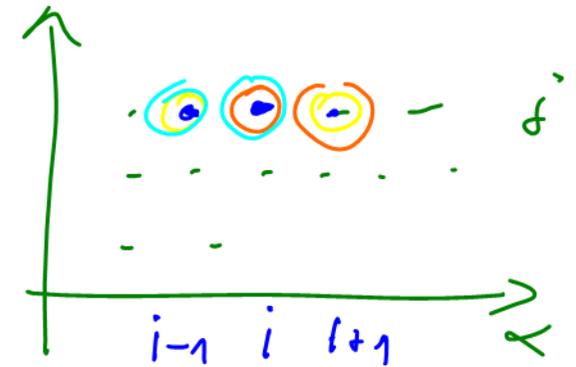
$$u_x(x_i, t_j) \approx \frac{U_{i+1}^j - U_{i-1}^j}{2h}$$

2) Vorwärtsdifferenz

$$u_x(x_i, t_j) \approx \frac{U_{i+1}^j - U_i^j}{h}$$

3) Rückwärtsdifferenz

$$u_x(x_i, t_j) \approx \frac{U_i^j - U_{i-1}^j}{h}$$



Approximationsgüte von Finiten-Differenzen

Sei $u(x, t)$ eine hinreichend oft differenzierbare Funktion und (x_i, t_j) ein fester Punkt eines Gitters mit Orts- und Zeitschrittweite h und k .

Mittels einer Taylorentwicklung um (x_i, t_j) erhalten wir

$$\begin{aligned}u(x_{i+1}, t_j) &= u(x_i, t_j) + u_x(x_i, t_j) \underbrace{(x_{i+1} - x_i)}_{=h} + \\ &\quad \frac{1}{2} u_{xx}(x_i, t_j) \underbrace{(x_{i+1} - x_i)^2}_{=h^2} + \frac{1}{6} u_{xxx}(x_i, t_j) \underbrace{(x_{i+1} - x_i)^3}_{=h^3} + \dots \\ u(x_{i-1}, t_j) &= u(x_i, t_j) + u_x(x_i, t_j) \underbrace{(x_{i-1} - x_i)}_{=-h} + \\ &\quad \frac{1}{2} u_{xx}(x_i, t_j) \underbrace{(x_{i-1} - x_i)^2}_{=h^2} + \frac{1}{6} u_{xxx}(x_i, t_j) \underbrace{(x_{i-1} - x_i)^3}_{=-h^3} + \dots\end{aligned}$$

Wir erhalten damit

1) bei **Zentralen Differenzen**

$$\left| u_x(x_i, t_j) - \frac{u(x_{i+1}, t_j) - u(x_{i-1}, t_j)}{2h} \right| = O(h^2)$$

⇒ Approximation **zweiter** Ordnung in h .

2) bei **Vorwärtsdifferenzen**

$$\left| u_x(x_i, t_j) - \frac{u(x_{i+1}, t_j) - u(x_i, t_j)}{h} \right| = O(h)$$

⇒ Approximation **erster** Ordnung in h .

3) bei **Rückwärtsdifferenzen**

$$\left| u_x(x_i, t_j) - \frac{u(x_i, t_j) - u(x_{i-1}, t_j)}{h} \right| = O(h)$$

⇒ Approximation **erster** Ordnung in h .

Finite-Differenzen für skalare Erhaltungsgleichungen

Wir betrachten das Cauchy-Problem

$$\frac{U_i^{j+1} - U_i^j}{k}$$

$$\begin{cases} u_t + f(u)_x = 0 & \text{in } \mathbb{R} \times (0, \infty) \\ u = u_0 & \text{auf } \mathbb{R} \times \{t = 0\} \end{cases}$$

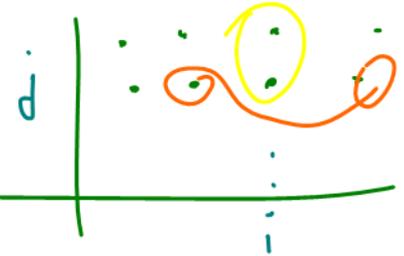
$$\frac{f(U_{i+1}^j) - f(U_{i-1}^j)}{2h}$$

Mit den Notationen von oben ist ein numerisches Verfahren mit Hilfe von Finiten-Differenzen gegeben durch

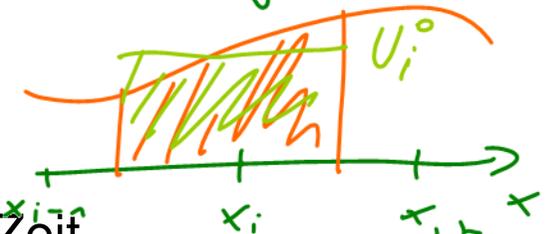
$$U_i^{j+1} = U_i^j - \frac{k}{2h} (f(U_{i+1}^j) - f(U_{i-1}^j))$$

mit den Anfangsbedingungen

$$U_i^0 = \frac{1}{h} \int_{x_i-h/2}^{x_i+h/2} u_0(x) dx$$



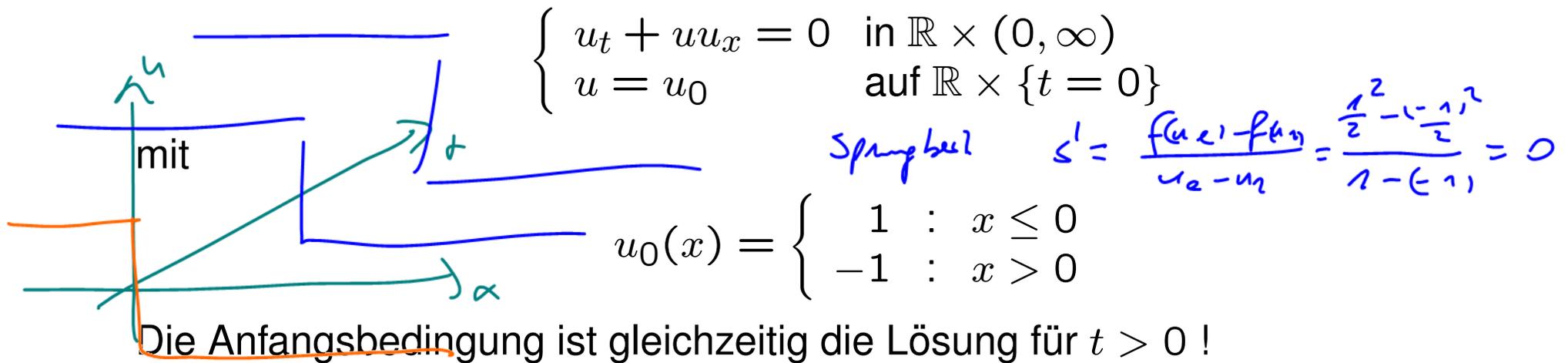
U_i^0 sind punkt weise gegeben



Also: Zentrale Differenz im Ort, Vorwärtsdifferenz in der Zeit.

Beispiel: Wir betrachten das Problem

$$u u_x = \left(\frac{u^2}{2} \right)_x \quad f(u) = \frac{u^2}{2}$$



$$U_i^{j+1} = U_i^j - \frac{k}{2h} \left(\frac{(U_{i+1}^j)^2}{2} - \frac{(U_{i-1}^j)^2}{2} \right)$$

$$U_i^0 = \begin{cases} 1 & : i < 0 \\ 0 & : i = 0 \\ -1 & : i > 0 \end{cases}$$

Fazit: Funktioniert nicht, Verfahren ist **instabil**

Beispiel: Wir betrachten die lineare Advektionsgleichung

$$\begin{cases} u_t + u_x = 0 & \text{in } \mathbb{R} \times (0, \infty) \\ u = u_0 & \text{auf } \mathbb{R} \times \{t = 0\} \end{cases}$$

$$u(x,t) = u_0(x-t)$$

Zentrale Differenzen im Ort:

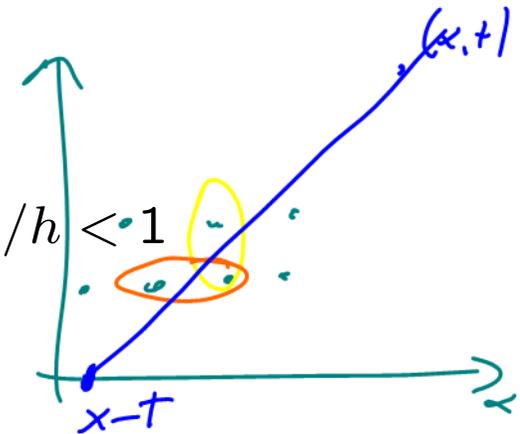
CLAWPACK

$$U_i^{j+1} = U_i^j - \frac{k}{2h} (U_{i+1}^j - U_{i-1}^j)$$

Funktioniert selbst bei einer linearen Gleichung nicht!

Upwind-Verfahren: funktioniert unter der CFL-Bedingung $k/h < 1$

$$U_i^{j+1} = U_i^j - \frac{k}{h} (U_i^j - U_{i-1}^j)$$



Lax-Friedrichs-Verfahren: funktioniert wie das Upwind-Verfahren

$$U_i^{j+1} = \frac{U_{i+1}^j + U_{i-1}^j}{2} - \frac{k}{2h} (U_{i+1}^j - U_{i-1}^j)$$

$$u_t \sim \frac{u_i^{j+1} - \frac{u_{i+1}^j + u_{i-1}^j}{2}}{h}$$

