

ÜBER EINE DIFFERENTIALUNGLEICHUNG m -TER ORDNUNG IM KOMPLEXEN

ERWIN MUES UND RAY REDHEFFER¹

Herrn Professor Ernst Straus zum Gedächtnis gewidmet

Let L defined by $(Lf)(z) = p_m z^m f^{(m)}(z) + \dots + p_1 z f'(z) + p_0 f(z)$ be an Euler-type differential operator with positive coefficients p_j and let A_0 denote the class of functions analytic in $|z| < 1$ which satisfy $f(0) = 0$. For example, the function $g(z) = cz$ belongs to A_0 , if c is a constant. Clearly $(Lg)(z) = cz(p_1 + p_0)$ and hence, if $|(Lg)(z)| \leq 1$ for $|z| < 1$, we must have $|g(z)| \leq 1/\lambda$ for $|z| < 1$, where $\lambda = p_0 + p_1$. Here it is shown that the same result holds for all $f \in A_0$, provided $p_0 \leq 2p_2$, and that the latter condition is sharp. Our result solves, in sharpened and generalized form, a problem that has been open since 1978. An important aid in the proof is a recent theorem of Brown and Hewitt, which improves a well-known criterion of Vietoris for positivity of certain trigonometric sums.

1. Einleitung. Es sei A der Raum der in $|z| < 1$ holomorphen Funktionen und A_0 die Unterklasse von Funktionen $f \in A$ derart, dass $f(0) = 0$ ist. Ausgangspunkt für diese Arbeit ist das folgende von S. Miller in [1] formulierte

Problem. Es sei $f \in A_0$, $m \in \mathbb{N}$, und für $|z| < 1$

$$|z^m f^{(m)}(z) + z^{m-1} f^{(m-1)}(z) + \dots + z f'(z) + f(z)| < 1.$$

Folgt daraus $|f(z)| < 1$ für $|z| < 1$?

Der Fall $m = 1$ ist trivial, und der Fall $m = 2$ ist in einer Arbeit von Miller und Mocanu [3] enthalten. Hier verallgemeinern wir das Problem auf Ungleichungen der Form

$$|p_m z^m f^{(m)}(z) + p_{m-1} z^{m-1} f^{(m-1)}(z) + \dots + p_1 z f'(z) + p_0 f(z)| < 1$$

mit positiven Parametern p_j , $j = 0, \dots, m$, und geben auf verschiedenen Wegen hinreichende Bedingungen für das Bestehen der Ungleichung $|f(z)| < 1/\lambda_1$ mit $\lambda_1 = p_0 + p_1$ an. Offenbar ist dieses Ergebnis optimal,

¹z.Zt. als Gastprofessor an der Universität Karlsruhe mit Unterstützung der Deutschen Forschungsgemeinschaft.

da $f(z) = z/\lambda_1$ zur Klasse A_0 gehört. Im Falle $p_j = 1$ erhält man $|f(z)| < 1/2$. Das zeigt, dass die Antwort auf die oben gestellte Frage positive ausfällt und dass $1/2$ (anstatt 1) die korrekte Schranke für $|f|$ ist. Bei $m = 2$ ergibt unser Ergebnis eine Verstärkung und Verallgemeinerung eines Satzes in [3].

2. Ergebnisse. Für $m \in \mathbf{N}$ und $p_j \in \mathbf{R}$ definieren wir einen Operator $L: A \rightarrow A$ bzw. $L: A_0 \rightarrow A_0$ durch

$$(1) \quad (Lf)(z) = p_m z^m f^{(m)}(z) + \cdots + p_1 z f'(z) + p_0 f(z).$$

Der folgende Satz wird bewiesen:

Satz 1. Für $j = 0, 1, \dots, m$ sei $p_j > 0$, sei $\lambda_1 = p_0 + p_1$, sei $f \in A_0$, und falls $m \geq 3$ sei weiter $p_0 \leq 2p_2$. Dann gilt

$$|(Lf)(z)| < 1 \quad \text{für } |z| < 1 \Rightarrow \lambda_1 |f(z)| < 1 \quad \text{für } |z| < 1.$$

Im Falle $p_j > 0$, die hier vorausgesetzt wird, würde man natürlich erwarten, dass die Funktion $f(z) = z/\lambda_1$ sozuzagen massgebend ist und die richtige Schranke für $f \in A_0$ bestimmt. Nach Satz 1 ist das zwar für $m \leq 2$ richtig, aber nach Satz 2 stimmt es für $m \geq 3$ im allgemeinen nicht:

Satz 2. Es sei $m \geq 3$ und p_j für $j \neq 3$ seien gegebene positive Zahlen. Gilt die Behauptung von Satz 1 für beliebig grosses p_3 , so ist $p_0 \leq 2p_2$.

3. Der Fall $m \leq 2$. Wir benutzen den folgenden

HILFSSATZ 1 [3]. Es sei f holomorph für $|z| < 1$, $f(z) = \sum_{n=p}^{\infty} a_n z^n$, $p \geq 1$. Es sei $0 < r_0 < 1$ und $z_0 = r_0 e^{i\theta_0}$ ein Punkt mit $|f(z_0)| = \max_{|z|=r_0} |f(z)|$. Dann ist

$$\omega = z_0 \frac{f'(z_0)}{f(z_0)} \text{ reell und } \geq P, \quad \operatorname{Re} \left(z_0 \frac{f''(z_0)}{f'(z_0)} \right) \geq \omega - 1.$$

Aus der Voraussetzung von Satz 1 im Falle $m = 2$ folgt mit dem Schwarzschen Lemma für $z = z_0$

$$\left| p_2 z_0 \frac{f''(z_0)}{f'(z_0)} z_0 \frac{f'(z_0)}{f(z_0)} + p_1 z_0 \frac{f'(z_0)}{f(z_0)} + p_0 \right| \leq \frac{|z_0|}{|f(z_0)|},$$

also wegen $\operatorname{Re}(Z) \leq |Z|$ mit Hilfssatz 1

$$p_2(\omega - 1)\omega + p_1\omega + p_0 \leq \frac{|z_0|}{|f(z_0)|}.$$

Aus $\omega \geq 1$ folgt die Behauptung von Satz 1. Der Fall $m = 1$ ist noch einfacher; man setze $p_2 = 0$.

4. Zusammengang mit einer Kosinusreihe. Im folgenden sei

$$(2) \quad R^k(n) = n(n-1) \cdots (n-k+1), \quad k = 1, \dots, n, n \in \mathbf{N}.$$

Bei gegebenem $p_0, p_1, \dots, p_m \in \mathbf{R}$ sei weiter $\lambda_n = \lambda_n(p_0, p_1, \dots, p_m)$ definiert durch

$$(3) \quad \lambda_n = p_m R^m(n) + p_{m-1} R^{m-1}(n) + \cdots + p_1 R^1(n) + p_0, \quad n \in \mathbf{N}.$$

Man beachte, dass die Funktionen $f_n(z) = z^n, n \in \mathbf{N}$, Eigenfunktionen von L mit den Eigenwerten λ_n sind, d.h.

$$(4) \quad Lz^n = \lambda_n z^n, \quad n \in \mathbf{N}.$$

Für $f(z) = \sum_{n=p}^{\infty} a_n z^n \in A$ ist dann

$$(Lf)(z) = \sum_{n=p}^{\infty} \lambda_n a_n z^n, \quad |z| < 1.$$

Unser Ziel ist, Bedingungen für die p_0, p_1, \dots, p_m aufzustellen, so dass aus

$$(5) \quad f \in A, \quad |(Lf)(z)| \leq |z|^p \quad \text{für } |z| < 1$$

die Abschätzung

$$(6) \quad |f(z)| \leq \frac{|z|^p}{\lambda_p} \quad \text{für } |z| < 1$$

folgt. Wir werden uns dabei im wesentlichen auf den Fall $p = 1$ beschränken.

HILFSSATZ 2. *Es sei $p \in \mathbf{N}, \lambda_n \in \mathbf{R}, \lambda_n \neq 0$ für $n \in \mathbf{N}$, und*

$$(7) \quad \frac{1}{\lambda_p} + 2 \sum_{n=1}^{\infty} \frac{\cos n\theta}{\lambda_{n+p}} \geq 0 \quad \text{für } 0 \leq \theta \leq 2\pi.$$

Dann gilt (5) \Rightarrow (6).

Im folgenden Beweis von Hilfssatz 2 setzen wir ohne Beschränkung der Allgemeinheit voraus, dass alle auftretenden Reihen absolut konvergent sind. Es sei für $0 \leq \theta \leq 2\pi$

$$F(\theta) = f(e^{i\theta}) = \sum_{n=p}^{\infty} a_n e^{in\theta},$$

$$G(\theta) = (Lf)(e^{i\theta}) = \sum_{n=p}^{\infty} \lambda_n a_n e^{in\theta},$$

wobei $a_0 = a_1 = \dots = a_{p-1} = 0$ aus der Voraussetzung $\lambda_n \neq 0$ folgt. Dann ist

$$a_n = \frac{1}{2\pi\lambda_n} \int_0^{2\pi} G(\theta) e^{-in\theta} d\theta$$

und daher

$$F(\theta) = \frac{1}{2\pi} \int_0^{2\pi} H(\varphi) G(\theta - \varphi) d\varphi,$$

wobei

$$H(\varphi) = \sum_{n=p}^{\infty} \frac{e^{in\varphi}}{\lambda_n}$$

ist. F lässt sich auch schreiben als

$$(8) \quad F(\theta) = \frac{1}{2\pi} \int_0^{2\pi} H(\varphi) e^{-ip\varphi} e^{ip\varphi} G(\theta - \varphi) d\varphi.$$

Da

$$\int_0^{2\pi} e^{in\varphi} e^{ip\varphi} G(\theta - \varphi) d\varphi = 0 \quad \text{für } n = -1, -2, -3, \dots$$

ist, kann man zu $H(\varphi) e^{-ip\varphi}$ in (8) eine beliebige Funktion $I(\varphi)$ der Form

$$I(\varphi) = \sum_{n=1}^{\infty} c_n e^{-in\varphi}$$

addieren. Bezeichnet man die Klasse solcher Funktionen I mit J , so erhält man aus (8), wenn man die Voraussetzung $|G(\theta)| \leq 1$ beachtet,

$$|F(\theta)| \leq \inf_{I \in J} \frac{1}{2\pi} \int_0^{2\pi} |H(\varphi) e^{-ip\varphi} + I(\varphi)| d\varphi.$$

Wir wählen $c_n = 1/\lambda_{n+p}$, $n \in \mathbb{N}$, und erhalten mit dieser Funktion I

$$|F(\theta)| \leq \frac{1}{2\pi} \int_0^{2\pi} \left| \frac{1}{\lambda_p} + \sum_{n=1}^{\infty} \frac{2 \cos n\varphi}{\lambda_{n+p}} \right| d\varphi.$$

Da die in den Betragsstrichen stehende Kosinusreihe nach Voraussetzung nichtnegativ ist, folgt

$$|F(\theta)| \leq \frac{1}{\lambda_p},$$

und das war die Behauptung.

Wir merken noch an: Wenn über die λ_n ausser $\lambda_n \neq 0$ nichts vorausgesetzt wird, dann erhält man bei der Wahl $I(\varphi) \equiv 0$

$$|f(z)| \leq |z|^p \left(\sum_{n=p}^{\infty} \frac{1}{|\lambda_n|^2} \right)^{1/2}.$$

Hier brauchen die p_j nicht mehr reell zu sein, und auch die Voraussetzung $|(Lf)(z)| \leq |z|^p$ lässt sich abschwächen.

5. Hinreichende Bedingungen im Falle $m \geq 3$. Um explizite über die p_j formulierte hinreichende Bedingungen für die Positivität der Kosinusreihe

$$\frac{1}{\lambda_p} + \sum_{n=1}^{\infty} \frac{2 \cos n\theta}{\lambda_{n+p}}$$

zu bekommen, wenden wir das folgende Kriterium von Brown und Hewitt an:

HILFSSATZ 3 [2]. Ist $a_0 \geq a_1 \geq a_2 \geq \dots \geq 0$ mit $a_0 > 0$ und

$$a_{2k} \leq \frac{2k}{2k+1} a_{2k-1}, \quad k = 1, 2, 3, \dots$$

so ist für $n \in \mathbf{N}$, $0 \leq \theta < \pi$,

$$a_0 + a_1 \cos \theta + a_2 \cos 2\theta + \dots + a_n \cos n\theta > 0.$$

Dieses Ergebnis verschärft einen Satz von Vietoris [5], wobei die vorige Bedingung durch die stärkere Bedingung

$$a_{2k} \leq \frac{2k-1}{2k} a_{2k-1}$$

ersetzt ist. In der erste Fassung dieser Arbeit haben wir den Satz von Vietoris benutzt, aber dieser hat den Nachteil, dass ausser $p_0 \leq 2p_2$ noch $p_1 \leq 6p_3$ für den Beweis von Satz 1 erforderlich ist.

Um (7) mit Hilfssatz 3 im Falle $p = 1$ nachzuweisen, genügt es zu zeigen, dass ausser $\lambda_n > 0$ noch

$$(9) \quad 2\lambda_1 \leq \lambda_2, \quad \lambda_n \leq \lambda_{n+1} \quad (n \geq 2)$$

und

$$(10) \quad (n+1)\lambda_n \leq n\lambda_{n+1}, \quad n = 2, 4, 6, \dots$$

gilt. Aus

$$\lambda_1 = p_0 + p_1, \quad \lambda_2 = p_0 + 2p_1 + 2p_2$$

folgt, dass die erste Ungleichung (9) mit $p_0 \leq 2p_2$ gleichbedeutend ist, und diese ist in der Voraussetzung von Satz 1 gegeben. Die zweite Ungleichung (9) folgt aus der Monotonie von $R^k(n)$ als Funktion von n , da $p_k \geq 0$ ist. Sie folgt auch aus (10) die, wie wir jetzt sehen, für alle $n \geq 1$ gültig ist.

Wird $R^k(n)$ für $k > n$ durch 0 ersetzt, so ist (10) mit

$$(n+1)(p_0 + p_1 R^1(n) + p_2 R^2(n) + \dots) \\ \leq n(p_0 + p_1 R^1(n+1) + p_2 R^2(n+1) + \dots)$$

äquivalent. Mit dieser Verabredung ist für $n, k \geq 1$

$$(n+1)R^k(n) = (n-k+1)R^k(n+1)$$

Daher ist für $k \geq 3$

$$(n+1)p_k R^k(n) = (n-k+1)p_k R^k(n+1) \leq np_k R^k(n+1)$$

und wir müssen nur die Glieder in p_0, p_1, p_2 betrachten.

Die erwünschte Ungleichung gilt, wenn

$$p_0 \leq p_2(nR^2(n+1) - (n+1)R^2(n)) = p_2n(n+1)$$

ist, und das ist wegen $p_0 \leq 2p_2$ für $n \geq 1$ richtig. Zusammenfassend haben wir den folgenden:

HILFSSATZ 4. *Es sei $m \geq 3$ und $p_j > 0$ für $j = 0, 1, \dots, m$. Weiter gelte*

$$(11) \quad p_0 \leq 2p_2.$$

Die λ_n seien für $n \geq 1$ durch (3) gegeben. Dann ist

$$(12) \quad \frac{1}{\lambda_1} + \sum_{n=1}^{\infty} \frac{2 \cos n\theta}{\lambda_{n+1}} \geq 0, \quad 0 \leq \theta \leq 2\pi.$$

Satz 1 folgt offenbar aus Hilfssatz 2 und Hilfssatz 4.

6. Eine notwendige Bedingung. Anstatt mit p_j zu arbeiten, setzen wir für den Augenblick

$$L\left(\sum_{j=1}^{\infty} a_j z^j\right) = \sum_{j=1}^n \lambda_j a_j z^j,$$

wobei die linksstehende Reihe zur Klasse A_0 gehört und die λ_j reell sind. Der Operator L wird also durch die Folge $\{\lambda_j\}, j = 0, 1, \dots, n$, bestimmt.

HILFSSATZ 5. *Es seien λ_j für $j = 1, 2, \dots, n$ positiv mit λ_1 und λ_2 festgelegt, und es gelte für jedes Polynom f*

$$(13) \quad |(Lf)(z)| \leq |z| \text{ für } |z| \leq 1 \Rightarrow |f(z)| \leq \frac{|z|}{\lambda_1} \text{ für } |z| \leq 1.$$

Dabei seien $\lambda_3, \lambda_4, \dots, \lambda_n$ beliebig; insbesondere sei erlaubt, dass diese λ_j beliebig gross sein dürfen. Dann ist $\lambda_2 \geq \sqrt{2}\lambda_1$ im Falle $n = 3$ und $\lambda_2 \geq 2\lambda_1$, wenn sowohl n als auch die λ_j für $j \geq 3$ beliebig gross sein dürfen.

Zum Beweis setzen wir $\lambda = \lambda_2/\lambda_1$ und

$$f(z) = \frac{c_1}{\lambda_1}z + \frac{c_2}{\lambda_1}z^2 + \eta_3z^3 + \dots + \eta_nz^n.$$

Die Bedingung (13) führt auf

$$\begin{aligned} |c_1 + \lambda c_2z + \lambda_3\eta_3z^2 + \dots + \lambda_n\eta_nz^{n-1}| &\leq 1 \\ \Rightarrow |c_1 + c_2z + \lambda_1\eta_3z^2 + \dots + \lambda_1\eta_nz^{n-1}| &\leq 1, \end{aligned}$$

wobei beide Ungleichungen für $|z| \leq 1$ zu verstehen sind. Wegen des Maximumprinzips jedoch genügt es, statt dessen die Ungleichungen nur für $|z| = 1$ zu verlangen.

Wir setzen $\lambda_j\eta_j = c_j$ für $j \geq 3$ und erhalten bei $\eta_j \rightarrow 0, \lambda_j \rightarrow \infty$,

$$\sup_{|z|=1} |c_1 + \lambda c_2z + c_3z^2 + \dots + c_nz^{n-1}| \leq 1 \Rightarrow |c_1| + |c_2| \leq 1.$$

Diese Bedingung ergibt insbesondere

$$|c_1| + |c_2| = 1 \Rightarrow \sup_{|z|=1} |c_1 + \lambda c_2z + c_3z^2 + \dots + c_nz^{n-1}| \geq 1.$$

Für $0 < t < 1$ wählen wir nun $c_1 = 1 - t, c_2 = t, c_j = a_{j-1}t$ ($j \geq 3$) und erhalten

$$\sup_{|z|=1} |1 - t + t(\lambda z + a_2z^2 + \dots + a_{n-1}z^{n-1})|^2 \geq 1.$$

Hier ist das linksstehende Quadrat gleich

$$1 - 2t + 2t \operatorname{Re}(\lambda z + a_2z^2 + \dots + a_{n-1}z^{n-1}) + O(t^2),$$

und bei $t \rightarrow 0 +$ ergibt sich die notwendige Bedingung

$$(14) \quad \sup_{|z|=1} \operatorname{Re}(\lambda z + a_2z^2 + \dots + a_{n-1}z^{n-1}) \geq 1.$$

Der Fall $n = 3$.

Wir wählen $a_2 = -1/2$ und erhalten

$$\sup_{|z|=1} \operatorname{Re}(2\lambda z - z^2) \geq 2.$$

Mit $z = e^{i\theta}$ und $x = \cos \theta$ ergibt sich

$$\sup_{|x| \leq 1} 2(\lambda x - x^2) \geq 1,$$

woraus $\lambda \geq \sqrt{2}$ unmittelbar folgt.

Der Fall n beliebig

Wir nehmen $a_j \in \mathbf{R}$,

$$g_n(\theta) = \lambda \cos \theta + a_2 \cos 2\theta + \cdots + a_{n-1} \cos(n-1)\theta$$

und merken an, dass $\sup g_n(\theta) \geq 1$ für alle a_j und alle $n \geq 3$ aus (14) folgt. Im Falle $\lambda < 2$, was jetzt vorausgesetzt, wird, wird ein Gegenbeispiel konstruiert. Zu diesem Zwecke sei $c > 0$ klein und

$$h(\theta) = \begin{cases} 1, & 0 \leq \theta \leq \pi - c \\ \frac{c - \pi}{c}, & \pi - c < \theta \leq \pi. \end{cases}$$

Dann ist

$$h(\theta) \leq 1, \quad \int_0^\pi h(\theta) d\theta = 0, \quad \int_0^\pi h(\theta) \cos \theta d\theta = \pi \frac{\sin c}{c}.$$

Da $\lambda < 2$ ist, gilt bei kleinem $c > 0$

$$(15) \quad h(\theta) \leq 1, \quad \int_0^\pi h(\theta) d\theta = 0, \quad \frac{2}{\pi} \int_0^\pi h(\theta) \cos \theta d\theta > \lambda.$$

Wir wählen $c > 0$ so, dass (15) gilt, und finden dann eine glatte Approximation $g(\theta) \doteq h(\theta)$ derart, dass

$$\sup g(\theta) < 1, \quad \int_0^\pi g(\theta) d\theta = 0, \quad \frac{2}{\pi} \int_0^\pi g(\theta) \cos \theta d\theta = \lambda$$

ist. (Das geschieht wie folgt: Zuerst finden wir eine glatte Funktion h , für die (15) gilt. Dann setzen wir $g = \kappa h$ mit einer passenden Konstante κ , $0 < \kappa < 1$.) Wird nun

$$a_j = \frac{2}{\pi} \int_0^\pi g(\theta) \cos j\theta d\theta \quad (j = 2, 3, \dots, n-1)$$

gesetzt, so ist $g_n(\theta) \rightarrow g(\theta)$ gleichmässig auf $[0, \pi]$. Daraus folgt $\sup g_n(\theta) < 1$ für grosses n , also ein Widerspruch.

9. Beweis von Satz 2. Sind p_j für $j \neq 3$ festgelegt dann ist λ_j eine Funktion von p_3 allein, $\lambda_j = \lambda_j(p_3)$. Aus $p_j > 0$ folgt

$$\lambda_j(p_3) \geq p_3 R^3(j) = p_3 j(j-1)(j-2), \quad j \geq 3$$

und daraus folgt $\lambda_j(p_3) \rightarrow \infty$ für $p_3 \rightarrow \infty, j \geq 3$. Im Beweis von Hilfssatz 5 war diese Bedingung die einzige notwendige; die Tatsache, dass die λ_j nicht unabhängig gegen ∞ streben spielt keine Rolle. Daher folgt $\lambda_2 \geq 2\lambda_1$ aus der Voraussetzung von Satz 2, und dies ist mit $p_0 \leq 2p_2$ äquivalent. Der Fall $n = 3$ in Hilfsatz 5 bezieht sich auf Polynome f von Grad 3 in Satz 1, und der Fall $n \rightarrow \infty$ bezieht sich auf Polynome von Grad $n \rightarrow \infty$.

8. Schlussbemerkung. Im Falle $m \geq 3$, $p_j = 1$ kann man durch eine leichte Abschätzung direkt zeigen, dass die Kosinusreihe in Hilfsatz 2 positiv ist. Daraus gewinnt man eine Lösung zum Miller-Mocanu Problem (mit der verbesserten Konstante $1/2$) die durchaus kurz und elementar ist. Der Fall $p_j = 1$ lässt sich auch durch den Satz von Young [6] erledigen. Diese und weitere Ergebnisse über das hier behandelte Thema sind vom ersten Verfasser, Universität Hannover zu erhalten.

LITERATUR

- [1] D. A., Brannan and J. G. Clunie (eds.), *Aspects of Contemporary Complex Analysis* (Proceedings of an instructional conference organized by the London Math. Soc. at the University of Durham). Academic Press, 1980, p. 61.
- [2] Gavin Brown and Edwin Hewitt, *A class of positive trigonometric sums*, Math. Ann., **268** (1984), 91–122.
- [3] S. Miller and P. Mocanu, *Second order differential inequalities in the complex plane*, J. Math. Anal. Appl., **65** (1978), 289–305.
- [4] I. Schur, *Über Potenzreihen, die im Innern des Einheitskreises beschränkt sind*, J. reine u. angew. Math., **148** (1918), 122–145.
- [5] L. Vietoris, *Über das Vorzeichen gewisser trigonometrischer Summen*, Sitzungsber. Österr. Akad. Wiss., **167** (1958), 125–135.
- [6] A. Zygmund, *Trigonometric Series*. Vol. 1, Cambridge, 1959, p. 183.

Received November 17, 1983 and in revised form August 19, 1984.

INSTITUT FÜR MATHEMATIK
 DER UNIVERSITÄT HANNOVER
 WELFENGARTEN 1
 D-3000 HANNOVER
 W. GERMANY

AND

UNIVERSITY OF CALIFORNIA
 LOS ANGELES, CALIFORNIA 90024
 USA

