

Cours 10 : Théorème de Péano, solutions maximales

- Plan:
- 1) Théorème de Cauchy-Péano
 - 2) Solutions maximales
 - 3) Durée de vie
 - 4) Solutions globales

1) Théorème de Cauchy-Péano

Théorème (Cauchy-Péano)

Soit $U \subset \mathbb{R} \times \mathbb{R}^n$ ouvert et $f : U \rightarrow \mathbb{R}^n$ continue. Soit $(t_0, x_0) \in U$, $\eta, \rho, M > 0$ tels que $[t_0 - \eta, t_0 + \eta] \times \bar{B}(x_0, \rho) \subset U$ et :

$$\bullet \|f(t, x)\| \leq M \quad \forall (t, x) \in [t_0 - \eta, t_0 + \eta] \times \bar{B}(x_0, \rho)$$

Alors $\forall \varepsilon < \min(\eta, \frac{\rho}{M})$, sur $[t_0 + \varepsilon, t_0 + \varepsilon]$, le problème de Cauchy $\begin{cases} x'(t) = f(t, x(t)) \\ x(t_0) = x_0 \end{cases}$ admet une solution.

⚠ il n'y a pas forcément unicité (cf exemple cours précédent)

$$\begin{cases} x'(t) = \sqrt{\max(x(t), 0)} \\ x(0) = 0 \end{cases}$$

On utilisera le théorème d'Arzela-Ascoli :

Théorème (Arzela-Ascoli)

Soient $a < b$, $a, b \in \mathbb{R}$ et notons $\mathcal{B}(]a, b[, \mathbb{R}^n) = \{g:]a, b[\rightarrow \mathbb{R}^n \text{ continue}\}$ muni de $\|\cdot\|_\infty$.

Soit $(g_n)_{n \geq 1}$ une suite de $\mathcal{B}(]a, b[, \mathbb{R}^n)$ telle que:

1) $\exists x \in]a, b[$: $(g_n(x))_{n \geq 1}$ est bornée

2) En notant $\omega_g(\delta) = \sup\{\|g(x) - g(y)\| : |x - y| \leq \delta, x, y \in]a, b[\}$

ona $\forall \varepsilon > 0, \exists \delta > 0, \sup_{n \geq 1} \omega_{g_n}(\delta) \leq \varepsilon$

Alors il existe une sous-suite de (g_n) qui converge uniformément

Remarque Pour une fonction g , on a g continue $\Leftrightarrow \omega_g(\delta) \xrightarrow{\delta \rightarrow 0} 0$

Preuve du théorème de Cauchy-Péano Posons $K = [t_0 - \eta, t_0 + \eta] \times \overline{B}(x_0, \rho)$

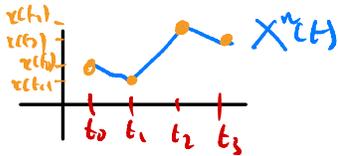
Soit $\varepsilon < \min(\eta, \frac{\rho}{M})$.

On note $t_i = t_0 + i \frac{\varepsilon}{n+1}$ pour $0 \leq i \leq n+1$, subdivision de $[t_0, t_0 + \varepsilon]$ de pas $\frac{\varepsilon}{n+1}$.

On construit des points de \mathbb{R}^n $(x_i)_{0 \leq i \leq n+1}$ par récurrence:

$$x_{i+1} = x_i + \frac{\varepsilon}{n+1} f(t_i, x_i) \text{ pour } 0 \leq i \leq n$$

On définit alors $X_n(t)$ $t_0 \leq t \leq t_0 + \varepsilon$ par interpolation linéaire



① On vérifie que $\forall 0 \leq i \leq n+1, (t_i, x_i) \in K$.

Pour cela, on montre par récurrence que

$$\|x_i - x_0\| \leq \frac{i \varepsilon M}{n+1} \text{ pour } 0 \leq i \leq n+1$$

• Pour $i=0$: ok

• Héredité: si $\|x_i - x_0\| \leq \frac{i \varepsilon M}{n+1}$ pour $i < n$, on a

$$\|x_{i+1} - x_0\| \leq \|x_{i+1} - x_i\| + \|x_i - x_0\| \leq \frac{\varepsilon}{n+1} \underbrace{\|f(t_i, x_i)\|}_{\leq M} + \frac{i \varepsilon M}{n+1} \leq \frac{(i+1) \varepsilon M}{n+1}$$

Ainsi, $\forall 0 \leq i \leq n+1, (t_i, x_i) \in K$.

② Pour $0 \leq r \leq n$ et $t_i < t < t_{i+1}$ on a $X_n'(t) = f(t_i, x_i)$, donc $\|X_n'(t)\| \leq M$.

On en déduit que X_n est M -lipschitzienne sur $[t_0, t_0 + \varepsilon]$.

De plus $X_n(t_0) = x_0$ donc $(X_n(t))_{n \geq 1}$ est bornée.

Par Arzela-Ascoli, quitte à extraire on peut supposer que $X_n \rightarrow X$ uniformément sur $[t_0, t_0 + \varepsilon]$

③ Pour $0 \leq r \leq n$ et $t_i < t < t_{i+1}$ on a

(car $|x_{i+1} - x_i| \leq M \cdot \frac{\varepsilon}{n+1}$)

$$\|X_n'(t) - f(t, X_n(t))\| = |f(t_i, x_i) - f(t, X_n(t))| \leq \omega_f\left(\frac{\varepsilon}{nH} + M \frac{\varepsilon}{nH}\right)$$

$$\text{où } \omega_f(\delta) = \sup_{\substack{(t,x) \in K \\ (u,y) \in K \\ |t-u| + \|x-y\| \leq \delta}} \|f(t,x) - f(u,y)\| \xrightarrow{\delta \rightarrow 0} 0 \quad \text{par continuité de } f \text{ sur } K$$

Par inégalité des accroissements finis on obtient $\forall t_0 \leq t \leq t_0 + \varepsilon$

$$\|X_n(t) - x_0 - \int_{t_0}^t f(u, X_n(u)) du\| \leq \omega_f\left(\frac{(1+M)\varepsilon}{nH}\right) |t - t_0|$$

En passant à la limite lorsque $n \rightarrow \infty$, par convergence uniforme on en déduit que $\forall t_0 \leq t \leq t_0 + \varepsilon$

$$X(t) = x_0 + \int_{t_0}^t f(u, X(u)) du.$$

En dérivant, on obtient une solution sur $[t_0, t_0 + \varepsilon]$. On construit de même une solution sur $[t_0 - \varepsilon, t_0]$ et elles se recollent en une solution sur $[t_0 - \varepsilon, t_0 + \varepsilon]$ car les dérivées à droite et à gauche en t_0 sont $f(t_0, x_0)$.

∞

Nous allons maintenant passer à l'étude de l'intervalle de définition des solutions du problème de Cauchy.

2) Solutions maximales

Soit $U \subset \mathbb{R} \times \mathbb{R}^n$ ouvert et $f : U \rightarrow \mathbb{R}^n$ continue, semi-lipschitzienne

Definition On dit qu'une solution $u : I \rightarrow \mathbb{R}^n$ du problème de Cauchy $x'(t) = f(t, x(t))$ est une solution maximale (ou non prolongeable) si elle n'a pas de prolongement à un intervalle strictement plus grand, c'est-à-dire si elle n'est pas la restriction à I d'une solution définie sur un intervalle $I' \supsetneq I$.

Rappel: une solution du problème de Cauchy $x'(t) = f(t, x(t))$ est une fonction dérivable

$u : I \rightarrow \mathbb{R}^n$ telle que :

(1) I est un intervalle non vide de \mathbb{R} , $x_0 \in I$ et $u(t_0) = x_0$

(2) $\forall t \in I, (t, u(t)) \in U$

(3) $\forall t \in I, u'(t) = f(t, u(t))$

On va démontrer le résultat suivant :

Théorème Pour toute donnée initiale $(t_0, x_0) \in U$, il existe une unique solution $u :]t_-, t_+ [\rightarrow U$ définie sur un intervalle ouvert avec $u(t_0) = x_0$ telle que toute autre solution vérifiant cette condition initiale est une restriction de u à un sous-intervalle de $]t_-, t_+ [$. Cette solution est dite maximale.

Remarque l'intervalle de définition d'une solution maximale est toujours ouvert. Pour $u : I_1 \rightarrow \mathbb{R}^n$ et $v : I_2 \rightarrow \mathbb{R}^n$ deux fonctions telles que $u = v$ dans $I_1 \cap I_2$, leur recollé est la fonction $u \# v : I_1 \cup I_2 \rightarrow \mathbb{R}^n$ définie par

$$u \# v(t) = \begin{cases} u(t) & \text{si } t \in I_1 \\ v(t) & \text{si } t \in I_2 \end{cases}$$

La preuve du théorème repose sur le résultat suivant

Proposition Soient $u: I_1 \rightarrow \mathbb{R}^n$ et $v: I_2 \rightarrow \mathbb{R}^n$ deux solutions du problème de Cauchy de $x'(t) = f(t, x(t))$ définies sur des intervalles ouverts et telles que $u(t_0) = v(t_0)$ pour un certain $t_0 \in I_1 \cap I_2$. Alors:

① $u = v$ sur $I_1 \cap I_2$

② le recollement de u et v est une solution définie sur $I_1 \cup I_2$.

Avant les preuves, donnons un exemple

Exemple: Soit $x'(t) = x(t)^2$ avec $f: \mathbb{R} \times \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$, continue, C^1 , donc semi-lipschitz.
($t, x \mapsto x^2$)

La solution valant x_0 en t_0 est $x(t) = \frac{x_0}{(t_0 - t)x_0 + 1}$. L'intervalle maximal de définition de cette solution est

$$\begin{cases}]t_0 - \frac{1}{x_0}, +\infty[& \text{si } x_0 > 0 \\]-\infty, t_0 - \frac{1}{x_0}[& \text{si } x_0 < 0 \\ \mathbb{R} & \text{si } x_0 = 0 \end{cases}$$

Vérifions par exemple que si $x_0 > 0$, $x(t) = \frac{x_0}{(t_0 - t)x_0 + 1}$ pour $t \in]t_0 - \frac{1}{x_0}, +\infty[$ est maximale.

Par l'absurde, si u est solution sur $]a, +\infty[$ avec $a < t_0 - \frac{1}{x_0}$, alors $x = u$ sur $]t_0 - \frac{1}{x_0}, +\infty[$ d'après la proposition, et par continuité de u en $t_0 - \frac{1}{x_0}$ on obtient $u(t_0 - \frac{1}{x_0}) = \lim_{t \rightarrow t_0 - \frac{1}{x_0}^-} u(t) = \lim_{t \rightarrow t_0 - \frac{1}{x_0}^-} x(t) = \infty$, absurde.

Preuve de la proposition

On montre que l'ensemble $A := \{t \in I_1 \cap I_2 : u(t) = v(t)\} \subset I_1 \cap I_2$ est non vide, ouvert et fermé dans $I_1 \cap I_2$, ce qui implique $A = I_1 \cap I_2$ par connexité.

- $A \neq \emptyset$ car $t_0 \in I_1 \cap I_2$
- A est fermé dans $I_1 \cap I_2$ car $A = \{t \in I_1 \cap I_2 : (u-v)(t) = 0\}$ avec u continue
- Montrons que A est ouvert dans $I_1 \cap I_2$. Soit $t_1 \in A$. Alors $t_1 \in I_1 \cap I_2$ et $u(t_1) = v(t_1) = x_1 \in \mathbb{R}^n$ et $(t_1, x_1) \in U$.

Le problème de Cauchy $\begin{cases} x'(t) = f(t, x(t)) \\ x(t_1) = x_1 \end{cases}$ admet donc par Cauchy-

Lipschitz une unique solution w définie sur un intervalle $[t_1 - \delta, t_1 + \delta]$ avec $\delta > 0$. Donc par unicité $u(t) = w(t) = v(t) \quad \forall t \in [t_1 - \delta, t_1 + \delta]$ et $[t_1 - \delta, t_1 + \delta] \subset A$. Donc A est ouvert dans $I_1 \cap I_2$.

(*) Le fait que le recouvrement de u et v est une solution est laissé en exercice.

∞

Preuve du théorème

Soit I_{\max} l'union de tous les intervalles contenant t_0 sur lesquels le problème de Cauchy $\begin{cases} x'(t) = f(t, x(t)) \\ x(t_0) = x_0 \end{cases}$ admet une solution.

D'après Cauchy-Lipschitz c'est un intervalle ouvert de la forme $I_{\max} =]t_-, t_+[$.
 Pour tout $t \in]t_-, t_+[$, soit $u(t)$ comme la valeur en t de n'importe quelle solution de (*) définie sur $]t_0, t[$. La proposition précédente montre que c'est bien une solution:

- On a bien $u(t_0) = x_0$
- Soit $t \in]t_-, t_+[$. Vérifions que $u'(t) = f(t, u(t))$.

Par définition de $]t_-, t_+[$ il existe une solution v de (*) définie sur un intervalle I contenant t , et donc $u'(t) = f(t, u(t))$.

Par définition de $]t_-, t_+[$ il n'existe pas de solution définie sur un intervalle plus grand.

⚠ Si f est seulement continue (pas semi-lipschitzienne), on n'a plus unicité de la solution maximale

3) Durée de vie

Pour simplifier, on suppose ici $f: U \subset \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}$ définie sur $U = J \times \Omega$
On s'intéresse à l'intervalle de définition d'une solution maximale.

Cet intervalle peut être différent de J (cf exemple $x'(t) = x(t)^2$ où $J = \mathbb{R}$ avec des solutions maximales non définies sur \mathbb{R})

L'idée générale est que si une solution ne peut être prolongée sur tout J , c'est qu'elle s'approche en temps fini du bord de U . Formalisons cela pour t_+ (pour les résultats sont similaires)

Proposition (sortie définitive de tout compact)

Soit $u:]t_-, t_+[\rightarrow \mathbb{R}^n$ une solution maximale de $\begin{cases} x'(t) = f(t, x(t)) \\ x(t_0) = x_0 \end{cases}$
avec $f: J \times \Omega \rightarrow \mathbb{R}^n$ continue semi-lipschitzienne

Si $t_+ < \sup J$, alors pour tout compact $K \subset \Omega$, $\exists T \in]t_-, t_+[$
tel que $u(t) \notin K$ pour tout $t \in]T, t_+[$.

On rencontrera essentiellement les deux situations suivantes:

- $\Omega = \mathbb{R}^n$ et $\|u(t)\| \xrightarrow{t \rightarrow t_+} +\infty$: explosion en temps fini
- $u(t)$ converge vers un point du bord de Ω quand $t \rightarrow t_+$

Preuve Soit $u:]t_-, t_+[\rightarrow \mathbb{R}^n$ une solution maximale (elle n'est pas définie en t_+)
Par l'absurde, soit $t_n \rightarrow t_+$ et $K \subset \Omega$ compact avec $u(t_n) \in K \forall n \geq 1$.

Par compacité, quitte à extraire, on peut supposer que $u(t_n) \rightarrow z_+$ avec $z_+ \in K \subset \Omega$.

En particulier, $(t_n, u(t_n)) \rightarrow (t_+, z_+) \in J \times \Omega$.

Par Cauchy-Lipschitz, $\begin{cases} x'(t) = f(t, x(t)) \\ x(t_+) = x_+ \end{cases}$ admet une solution sur

$]t_+ - \delta, t_+ + \delta[$, avec $\delta > 0$ pouvant être choisi de sorte que pour un voisinage V de $(t_+, x_+) \in J \times \mathbb{R}^n$, toute solution de

$$\begin{cases} x'(t) = f(t, x(t)) \\ x(t_+) = x_+ \end{cases} \text{ avec } (t_+, x_+) \in V$$

est définie sur $]T - \delta, T + \delta[$.

On choisit alors n tel que $(t_n, u(t_n)) \in V$ et tel que $t_n + \delta > t_+$. Soit alors $v:]t_n - \delta, t_n + \delta[\rightarrow \mathbb{R}^n$ la solution du problème de Cauchy

$$\begin{cases} x'(t) = f(t, x(t)) \\ x(t_n) = u(t_n) \end{cases}$$

Le recollent de u et v définit une solution $u \cup v$ sur

$]t_-, t_n + \delta[$ qui contient strictement $]t_-, t_+[$, ce qui est absurde.

∞

4) Solutions globales

Définition Soit $f: J \times \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}^n$ une fonction continue semi-lipschitzienne. On dit qu'une solution maximale $u: I \rightarrow \mathbb{R}^n$ du problème de Cauchy est globale si $I = J$.

Théorème (critère de sous-linéarité)

Soit $f: J \times \mathbb{R}^n \rightarrow \mathbb{R}^n$ continue semi-lipschitzienne. On suppose que $\forall K$ compact $\subset J$, $\exists C_1, C_2 > 0$ tel

$$\forall t \in K, \forall x \in \mathbb{R}^n, \|f(t, x)\| \leq C_1 + C_2 \|x\|$$

Alors toute solution maximale est globale

(les hypothèses sont satisfaites si f est bornée)

On fait appel au Lemme de Gronwall (qui sera utilisé de nombreuses fois):

Lemme de Gronwall Soit $y: [a, b] \rightarrow \mathbb{R}$ continue et $c_0 > 0$.

① Soit $f: [a, b] \rightarrow \mathbb{R}_+$ continue. On suppose que

$$\forall t \in [a, b], y(t) \leq c_0 + \int_a^t f(s) y(s) ds$$

Alors $\forall t \in [a, b], y(t) \leq c_0 \exp\left(\int_a^t f(s) ds\right)$.

② On suppose $\forall t \in [a, b], y(t) \leq c_0 + \int_a^t c ds$. avec $c > 0$.

Alors $\forall t \in [a, b], y(t) \leq c_0 \exp(c(t-a))$.

Preuve ① est une conséquence de ① avec $f \equiv 1$

Pour ①, posons $h(t) = c_0 + \int_a^t f(s) y(s) ds$, de sorte que $h'(t) = f(t) y(t)$

Comme $y(t) \leq h(t)$, on obtient $h'(t) \leq f(t) h(t)$ pour $t \in [a, b]$

Soit alors $H(t) = h(t) \exp\left(-\int_a^t f(s) ds\right)$.

Alors $H'(t) = \exp\left(-\int_a^t f(s) ds\right) (h'(t) - h(t) f(t)) \leq 0$ pour $t \in [a, b]$

Ainsi H est décroissante

Or $H(a) = h(a) = c_0$. Donc $h(t) \leq c_0 \exp\left(\int_a^t f(s) ds\right)$

Comme $y(t) \leq h(t)$, on en déduit le résultat

On applique typiquement ce lemme avec la norme d'une solution (ou différence de deux solutions)

Preuve du théorème

Soit $u:]t_-, t_+[\rightarrow \mathbb{R}^n$ solution maximale du problème de Cauchy. On suppose $t_+ < \sup J$. Alors par le théorème de séparation des compacts on a

$$\|u(t)\| \xrightarrow{t \rightarrow t_+} \infty$$

Mais $[t_0, t_1] \subset J$ est compact, donc par hypothèse $\exists C_1, C_2 > 0$
 $\|f(t, x)\| \leq C_1 + C_2 \|x\| \quad \forall t \in [t_0, t_1], x \in \mathbb{R}^n$

On obtient pour tout $t \in [t_0, t_1]$:

$$\begin{aligned} \|u(t)\| &\leq \|u(t_0)\| + \int_{t_0}^t \|g(s, u(s))\| ds \\ &\leq \|u(t_0)\| + \int_{t_0}^t (C_1 + C_2 \|u(s)\|) ds \end{aligned}$$

$$\leq \underbrace{\|u(t_0)\| + C_1(t_1 - t_0)}_c + C_2 \int_{t_0}^{t_1} \|u(s)\| ds$$

D'après le lemme de Gronwall, on conclut que
 $\|u(t)\| \leq c \exp(C_2(t_1 - t_0)) \quad \forall t \in [t_0, t_1]$

ce qui contredit $\|u(t)\| \xrightarrow[t \rightarrow t_1]{} +\infty$

∞