

# Advection d'un scalaire et caractéristiques

Objectif : exposer la résolution de l'équation aux dérivées partielles

$$\frac{\partial \rho}{\partial t} + c(\rho, x, t) \frac{\partial \rho}{\partial x} = f(\rho, x, t)$$

Première étape pour la méthode des caractéristiques

- 1 Dérivée le long de courbes
- 2 Résolution générale de l'équation d'advection
- 3 Résolution de cas particuliers

# 1 Dérivée le long de courbes

On définit ici la dérivée d'un champ  $\rho(x, t)$  le long d'une courbe  $\mathcal{L}$  du plan  $(x, t)$  d'équation  $x = x_{\mathcal{L}}(t)$ .

Difficultés de notations :  $\rho^{(L)}(a, t) = \rho[x_{\mathcal{L}}(t), t]$  avec  $a = x_{\mathcal{L}}(0)$ ,  
 $\left(\frac{d\rho}{dt}\right)_{\mathcal{L}} = \frac{\partial\rho}{\partial t}^{(L)} = \frac{\partial\rho}{\partial t} + c_{\mathcal{L}} \frac{\partial\rho}{\partial x}$  avec  $c_{\mathcal{L}} = \left(\frac{dx}{dt}\right)_{\mathcal{L}} = \dot{x}_{\mathcal{L}}$ , etc...

Famille de courbes  $\mathcal{L}_a$  paramétrée par  $a$ , et analogie avec la dérivée particulière d'un mouvement 1D

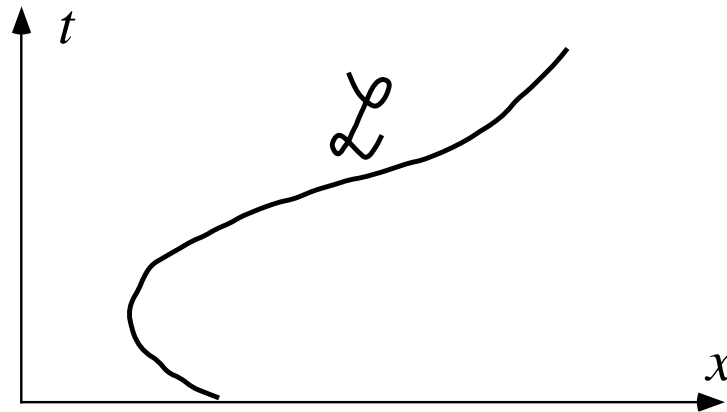
## 1.1 Courbe à vitesse bornée

## 1.2 Dérivée d'un champ le long d'une courbe

## 1.3 Famille de courbes à vitesses bornées

## 1.4 Représentation lagrangienne pour le mouvement 1D

## 1.1 Courbe à vitesse bornée



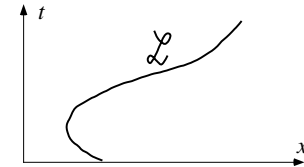
Courbe  $\mathcal{L}$  “à vitesse bornée” d’équation :  $x = x_{\mathcal{L}}(t)$

On définit sa “vitesse” par l’inverse de la pente dans le plan  $(x, t)$  :

$$\left(\frac{dx}{dt}\right)_{\mathcal{L}}(t) = \dot{x}_{\mathcal{L}}(t) \quad \text{ou encore} \quad c_{\mathcal{L}}(t) = \dot{x}_{\mathcal{L}}(t) .$$

Tant que la vitesse reste bornée, cette pente ne s’annule pas.

## 1.2 Dérivée d'un champ le long d'une courbe



On appelle “dérivée de  $\rho$  le long de  $\mathcal{L}$ ” la quantité

$$\left(\frac{d\rho}{dt}\right)_{\mathcal{L}}(t) = \left[\frac{\partial}{\partial t} + c_{\mathcal{L}}(t) \frac{\partial}{\partial x}\right] \rho[x_{\mathcal{L}}(t), t]$$

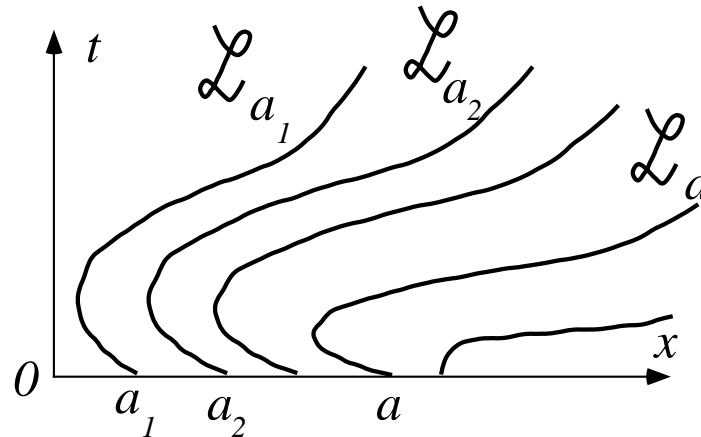
avec  $c_{\mathcal{L}}(t) = \dot{x}_{\mathcal{L}}(t)$ .

En notant  $\rho_{\mathcal{L}}(t) = \rho[x_{\mathcal{L}}(t), t]$ , on a :

$$\left(\frac{d\rho}{dt}\right)_{\mathcal{L}} = \dot{\rho}_{\mathcal{L}}$$

NB : la notation  $\left(\frac{d}{dt}\right)_{\mathcal{L}}$  coïncide avec la précédente notation

### 1.3 Famille de courbes à vitesses bornées



Les fonctions  $x_{\mathcal{L}_a}(t)$  décrivant les courbes  $\mathcal{L}_a$  définissent  $X(a, t)$  par

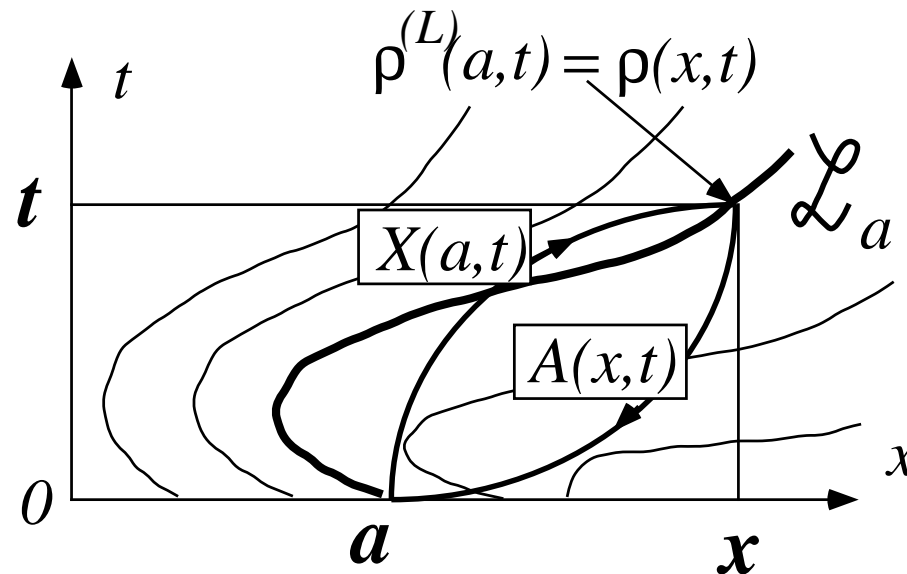
$$x_{\mathcal{L}_a}(t) = X(a, t) .$$

“Mouvement 1D” de trajectoires  $\mathcal{L}_a$  avec  $c_{\mathcal{L}_a} = \left(\frac{dx}{dt}\right)_{\mathcal{L}_a} = \frac{\partial X}{\partial t}(a, t)$ .

Lorsque les courbes  $\mathcal{L}_a$  ne se coupent pas, mouvement inverse :

$$a = A(x, t)$$

## 1.4 Représentation lagrangienne pour le mouvement 1D



Étant donné un champ  $\rho(x, t)$  on peut définir  $\rho^{(L)}(a, t)$  par

$$\rho^{(L)}(a, t) = \rho_{\mathcal{L}_a}(t) = \rho[X(a, t), t] \iff \rho(x, t) = \rho^{(L)}[A(x, t), t] .$$

Représentation eulérienne  $\rho(x, t)$  et dérivée particulaire  $\left(\frac{d\rho}{dt}\right)_{\mathcal{L}_a}$

## 2 Résolution générale de l'équation d'advection

On montre ici que la résolution de l'équation d'advection se ramène à la résolution d'un système d'équations différentielles ordinaires.

Ce système définit une famille de courbes  $\mathcal{C}$  que l'on nomme “courbes caractéristiques”. Dans le cas particulier où  $f = 0$ , la quantité  $\rho$  est invariante le long de ces courbes (invariant de Riemann).

**2.1 Construction des solutions avec une famille de courbes**

**2.2 Méthode des caractéristiques**

**2.3 Point de vue du changement de variable**

**2.4 Point de vue du système dynamique**

## 2.1 Construction des solutions avec une famille de courbes

Équation aux dérivées partielles (EDP)

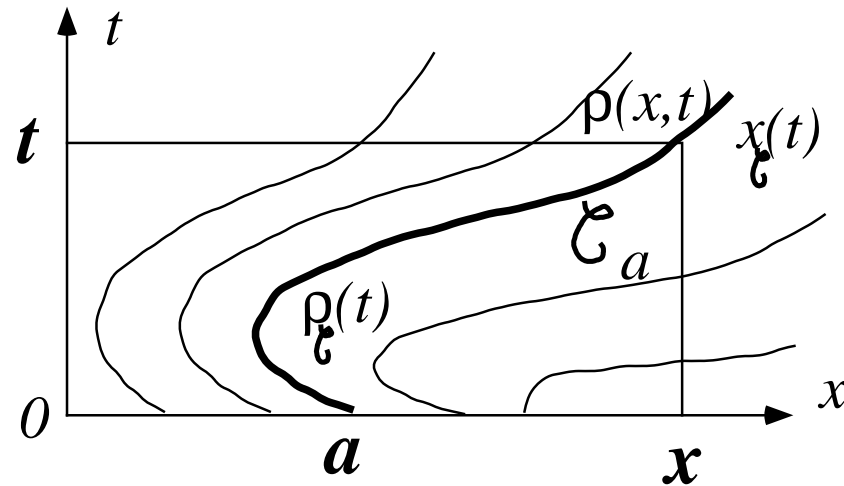
$$\frac{\partial \rho}{\partial t} + c(\rho, x, t) \frac{\partial \rho}{\partial x} = f(\rho, x, t) .$$

Système d'équations différentielles ordinaires (EDO) :

$$\begin{cases} \dot{x}_c(t) &= c(\rho_c, x_c, t) \\ \dot{\rho}_c(t) &= f(\rho_c, x_c, t) \end{cases} \iff \begin{cases} \left(\frac{dx}{dt}\right)_c &= c(\rho, x, t) \\ \left(\frac{d\rho}{dt}\right)_c &= f(\rho, x, t) \end{cases}$$

Résolution de l'équation d'advection par la recherche d'une famille de courbes  $\mathcal{C}$  d'équations  $x = x_c(t)$  et d'une famille de fonctions  $\rho_c(t)$





Solutions  $[x_{C_a}(t), \rho_{C_a}(t)]$  et courbes  $C_a$  solutions de l'ODE.

Le mouvement 1D défini par la famille  $C_a$  permet de définir :

$$\rho(x, t) = \rho^{(L)} [A(x, t), t] = \rho_{C_{A(x,t)}}(t) .$$

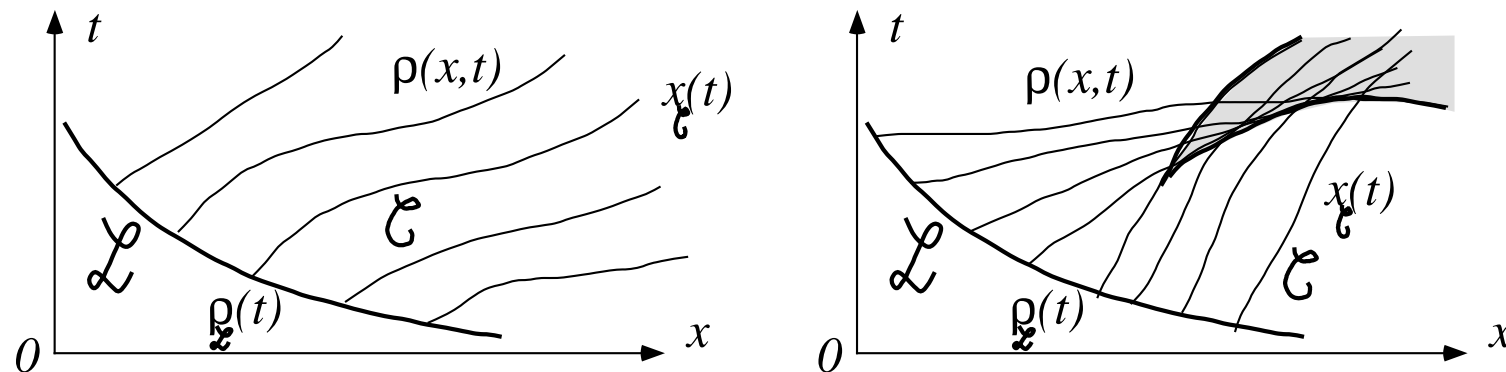
qui est alors solution de l'équation d'advection (EDP) :

$$\left( \frac{d\rho}{dt} \right)_c (x, t) = \frac{\partial \rho}{\partial t} (x, t) + c[\rho(x, t), x, t] \frac{\partial \rho}{\partial x} (x, t) = f(\rho, x, t)$$

## 2.2 Méthode des caractéristiques

Condition initiale de l'EDP :  $\rho(x, 0) = \rho_0(x)$

Condition initiale des EDO :  $x(0) = a$  et  $\rho(0) = \rho_0(a)$



Solutions EDP et EDOs équivalentes dans la région du plan  $(x, t)$  où les courbes caractéristiques ne se coupent pas.

C.I. plus générale de l'EDP :  $\rho(x, t) = \rho_{\mathcal{L}}(t)$  connu sur une courbe  $\mathcal{L}$

Les courbes caractéristiques “propagent” l’information dans le plan

## 2.3 Point de vue du changement de variable

Passage de  $(x, t)$  à  $(a, \tau)$  à l'aide des relations

$$\begin{cases} da &= dx - c[\rho(x, t), x, t] dt \\ d\tau &= dt \end{cases} \implies \begin{cases} \frac{\partial A}{\partial x}(x, t) &= 1 \\ \frac{\partial A}{\partial t}(x, t) &= -c[\rho(x, t), x, t] \end{cases}$$

qui conduisent à des relations de la forme

$$\begin{cases} a &= A(x, t) \\ \tau &= t \end{cases} \quad \text{ou bien} \quad \begin{cases} x &= X(a, \tau) \\ t &= \tau \end{cases}$$

Opérateurs  $(\frac{\partial}{\partial x}, \frac{\partial}{\partial t})$  en fonction de  $(\frac{\partial}{\partial a}, \frac{\partial}{\partial \tau})$  en transposant

$$\begin{pmatrix} da \\ d\tau \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1 & -c \\ 0 & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} dx \\ dt \end{pmatrix} \iff \begin{pmatrix} \frac{\partial}{\partial x} \\ \frac{\partial}{\partial t} \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ -c & 1 \end{pmatrix} \begin{pmatrix} \frac{\partial}{\partial a} \\ \frac{\partial}{\partial \tau} \end{pmatrix} .$$

En notant  $\rho^{(L)}(a, \tau)$  l'expression du champ  $\rho(x, t)$

$$\left( \frac{\partial}{\partial t} + c \frac{\partial}{\partial x} \right) \rho = f(\rho, x, t) \iff \frac{\partial \rho^{(L)}}{\partial \tau}(a, \tau) = f \left[ \rho^{(L)}(a, \tau), X(a, \tau), \tau \right]$$

On peut exprimer le changement de variable sous la forme

$$\begin{cases} dx &= da + c d\tau \\ dt &= d\tau \end{cases} \implies \begin{cases} \frac{\partial X}{\partial a}(a, \tau) &= 1 \\ \frac{\partial X}{\partial \tau}(a, \tau) &= c \left[ \rho^{(L)}(a, \tau), X(a, \tau), \tau \right] \end{cases}$$

On a donc ramené l'EDP au système d'EDO :

$$\begin{cases} \frac{\partial X}{\partial \tau}(a, \tau) &= c \left[ \rho^{(L)}(a, \tau), X(a, \tau), \tau \right] \\ \frac{\partial \rho^{(L)}}{\partial \tau}(a, \tau) &= f \left[ \rho^{(L)}(a, \tau), X(a, \tau), \tau \right] \end{cases}$$

De manière condensée et avec des abus de notations :

$$\left( \frac{d\rho}{dt} \right)_c = f(\rho, x, t) \quad \text{sur la courbe } \mathcal{C} \text{ d'équation } \frac{dx}{dt} = c(\rho, x, t) .$$

## 2.4 Point de vue du système dynamique

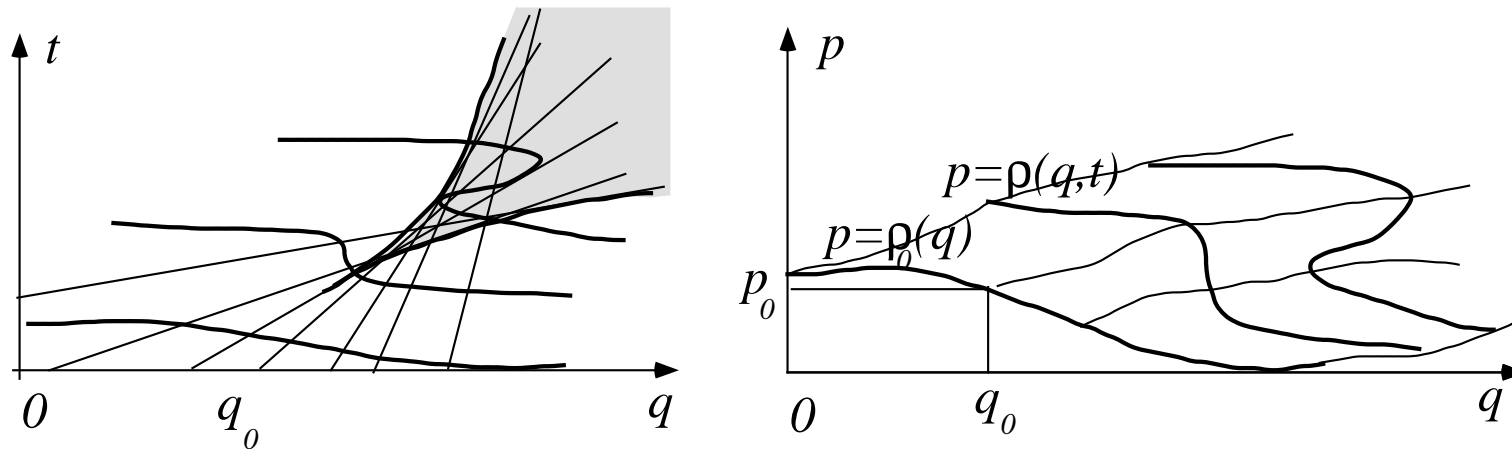
La méthode des caractéristiques conduit à la résolution des EDO :

$$\begin{cases} \dot{q} &= c(p, q, t) \\ \dot{p} &= f(p, q, t) \end{cases}$$

en notant  $q = x$  et  $p = \rho$ .

- *Conditions initiales* :  $[q(0), p(0)] = (q_0, p_0)$ .
- *Espace des phase* : plan  $(q, p)$ .
- *Trajectoires* : solutions  $[q(t), p(t)]$ .
- *Champ de vitesse* : vecteur  $(c, f)$ .

EDP  $\frac{\partial \rho}{\partial t} + c \frac{\partial \rho}{\partial x} = f$  avec la condition initiale  $\rho(x, 0) = \rho_0(x)$  :  
trajectoires  $[q(t), p(t)]$  issues des conditions initiales  
décrivant la courbe  $p_0 = \rho_0(q_0)$



- À  $t$  donné, la solution  $\rho(x, t) = P_t(x)$  est une courbe  $p = P_t(q)$ .
- Lorsque les caractéristiques se coupent  $P_t$  n'est plus univaluée.
- L'équation d'advection scalaire cesse alors d'être valide.
- Sur le plan de la physique, il faut spécifier des “relations de saut”.
- Sur le plan des mathématiques, la résolution des EDO est un moyen de prolonger la résolution de l'EDP au-delà du choc.

### 3 Résolution de cas particuliers

Équation d'advection  $\frac{\partial \rho}{\partial t} + c(\rho, x, t) \frac{\partial \rho}{\partial x} = f(\rho, x, t)$  équivalente à

$$\begin{cases} \dot{q} = c(p, q, t) \\ \dot{p} = f(p, q, t) \end{cases} \iff \begin{cases} \dot{x} = c(\rho, x, t) \\ \dot{\rho} = f(\rho, x, t) \end{cases}$$

avec les conditions initiales  $(q_0, p_0)$  telles que  $p_0 = \rho_0(q_0)$

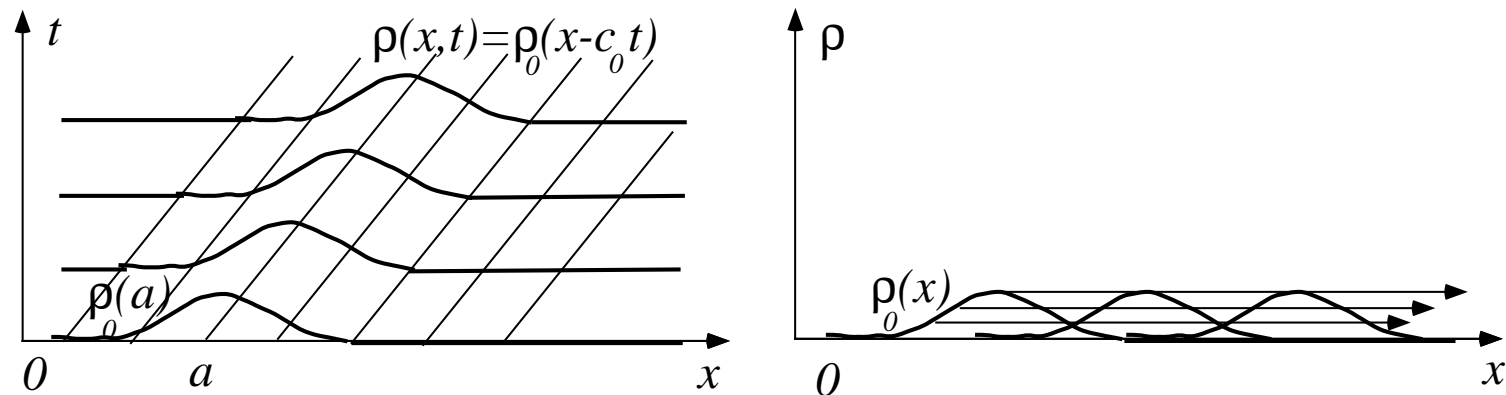
	$c_0$	$c(x)$	$c(\rho)$	$c(\rho, x, t)$
0	3.1	3.2	3.3	
$f(\rho, x, t)$	3.1	3.2		

**3.1 Cas particulier  $c = c_0$**

**3.2 Cas particulier  $c = c(x)$**

**3.3 Cas particulier  $c = c(\rho)$  et  $f = 0$**

### 3.1 Cas particulier $c = c_0$



$$\frac{\partial \rho}{\partial t} + c_0 \frac{\partial \rho}{\partial x} = f(\rho, x, t) \iff \begin{cases} \dot{x} = c_0 \\ \dot{\rho} = f(\rho, x, t) \end{cases}$$

avec les conditions initiales  $[x(0), \rho(0)] = [a, \rho_0(a)]$ . On en déduit

$$x = X(a, t) = a + c_0 t \quad \text{et} \quad \dot{\rho} = f[\rho(t), a + c_0 t, t].$$

Les caractéristiques  $\mathcal{C}_a$  sont donc des droites parallèles de pente  $1/c_0$



**Dans le cas particulier  $f = 0$  :**  $\frac{\partial \rho}{\partial t} + c_0 \frac{\partial \rho}{\partial x} = 0$

La quantité  $\rho$  est invariante le long de ces droites caractéristiques :

$$\rho^{(L)}(a, t) = \rho_{c_a}(t) = \rho_0(a)$$

Comme  $x = X(a, t) = a + c_0 t$ , on a  $\rho(x, t) = \rho_0(x - c_0 t)$

La quantité invariante  $\rho$  est appelée “invariant de Riemann”.

**Dans le cas général  $f \neq 0$  :**  $\frac{\partial \rho}{\partial t} + c_0 \frac{\partial \rho}{\partial x} = f(\rho, x, t)$

La solution est  $\rho(x, t) = \rho^{(L)}(x - c_0 t, t)$  où  $\rho^{(L)}(a, t) = \rho_{c_a}(t)$  est obtenu en résolvant l'équation différentielle ordinaire

$$\dot{\rho} = f[\rho(t), a + c_0 t, t] .$$

Sauf dans des cas particuliers, la solution est calculé par une méthode numérique (par exemple avec un schéma de Runge-Kutta)

La quantité  $\rho_{c_a}(t)$  est appelée “fonction de Riemann”.

### 3.2 Cas particulier $c = c(x)$

$$\frac{\partial \rho}{\partial t} + c(x) \frac{\partial \rho}{\partial x} = f(\rho, x, t) \iff \begin{cases} \dot{x} = c(x) \\ \dot{\rho} = f(\rho, x, t) \end{cases}$$

avec les conditions initiales  $[x(0), \rho(0)] = [a, \rho_0(a)]$ .

Si la fonction  $c(x)$  ne s'annule pas et l'on peut définir la fonction

$$\Theta(x) = \int_{x_*}^x \frac{1}{c(s)} ds$$

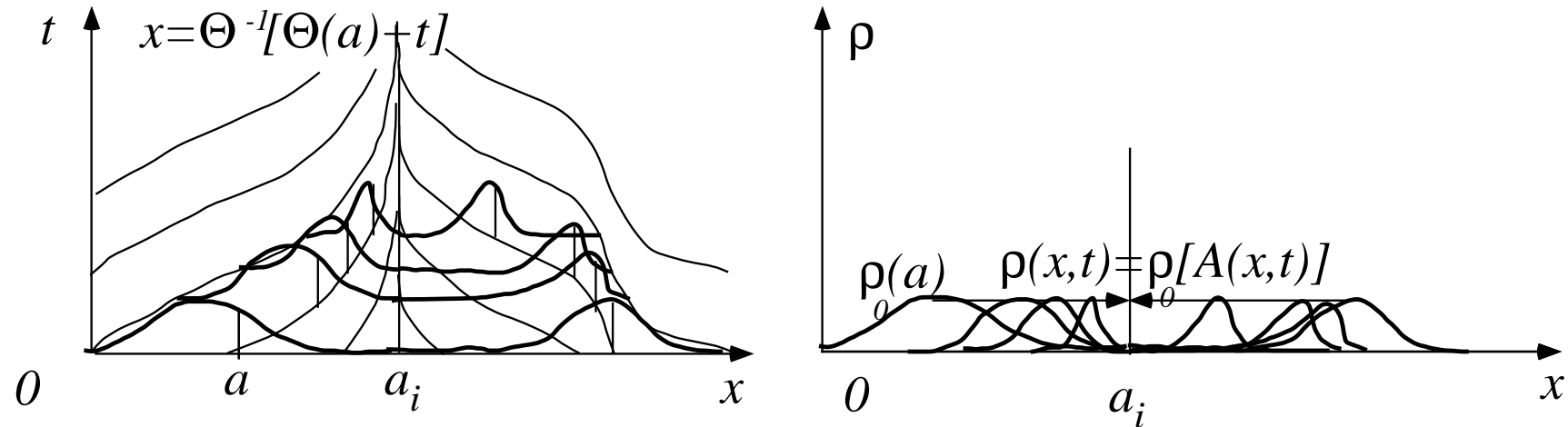
Le système d'EDO admet alors les solutions

$$\Theta[x(t)] - \Theta(a) = t \iff x(t) = \Theta^{-1} [\Theta(a) + t] ,$$

où  $\Theta^{-1}$  est l'inverse de la fonction  $\Theta$ .

Les caractéristiques définissent donc le mouvement 1D :

$$X(a, t) = \Theta^{-1} [\Theta(a) + t]$$



$$X(a, t) = \Theta^{-1} [\Theta(a) + t] \quad \Longleftrightarrow \quad A(x, t) = \Theta^{-1} [\Theta(x) - t] .$$

On remarque que les courbes caractéristique  $\mathcal{C}_a$  sont parallèles dans le plan  $(x, t)$  et se déduisent les unes des autres par des translation en temps.

$$\text{En effet :} \quad \Theta [x_2(t)] - \Theta [x_1(t)] = \Theta(a_2) - \Theta(a_1)$$

### Cas particulier $f = 0$ :

La quantité  $\rho$  est invariante le long des caractéristiques (invariant de Riemann) et la solution s'écrit

$$\rho(x, t) = \rho_0[A(x, t)] = \rho_0 \{ \Theta^{-1} [\Theta(x) - t] \}.$$

### Cas général $f \neq 0$ :

on a  $\rho(x, t) = \rho^{(L)}[A(x, t), t]$  où  $\rho^{(L)}(a, t) = \rho_{C_a}(t)$  (fonction de Riemann) est obtenu en résolvant l'équation :

$$\dot{\rho} = f[\rho(t), X(a, t), t]$$

avec  $X(a, t) = \Theta^{-1} [\Theta(a) + t]$ . La résolution de cette équation, comme le calcul et l'inversion de la fonction  $\Theta(x)$ , nécessitent, la plupart du temps, le recours à des méthodes numériques.

### 3.3 Cas particulier $c = c(\rho)$ et $f = 0$

$$\frac{\partial \rho}{\partial t} + c(\rho) \frac{\partial \rho}{\partial x} = 0 \iff \begin{cases} \dot{x} = c(\rho) \\ \dot{\rho} = 0 \end{cases}$$

avec les conditions initiales  $[x(0), \rho(0)] = [a, \rho_0(a)]$ .

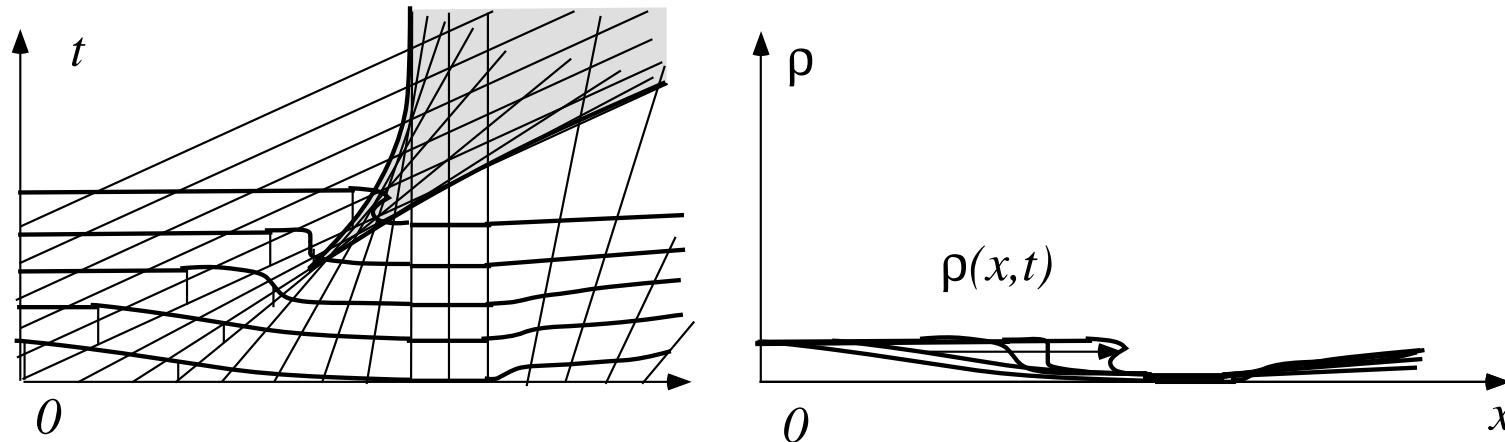
La quantité  $\rho$  est constante (invariant de Riemann) et égale à  $\rho_0(a)$

Les caractéristiques sont des droites d'équation

$$x(t) = X(a, t) = a + c[\rho_0(a)] t .$$

Le mouvement 1D inverse  $A(x, t)$  s'obtient en résolvant l'équation implicite

$$x = A(x, t) + c \{ \rho_0 [A(x, t)] \} .$$



Dans la région du plan  $(x, t)$  où les droites caractéristiques ne se coupent pas, cette équation implicite admet une solution unique. La solution de l'équation d'advection s'écrit alors  $\rho(x, t) = \rho_0[A(x, t)]$ .

Dans la région du plan  $(x, t)$  où les droites caractéristiques se coupent  
 Il n'est pas possible de définir une solution  $\rho(x, t)$  monovaluée.

La dynamique doit être décrite par une relation de saut venant  
**compléter** la modélisation continue de l'équation d'advection.

# Conclusion

L'équation d'advection (EDP)

$$\frac{\partial \rho}{\partial t}(x, t) + c[\rho(x, t), x, t] \frac{\partial \rho}{\partial x}(x, t) = f[\rho(x, t), x, t]$$

se ramène à la résolution du système dynamique (EDOs)

$$\begin{cases} \dot{x} = c(\rho, x, t) \\ \dot{\rho} = f(\rho, x, t) \end{cases} \iff \begin{cases} \dot{q} = c(p, q, t) \\ \dot{p} = f(p, q, t) \end{cases}$$

Condition initiale EDP :  $\rho(x, 0) = \rho_0(x)$  ou  $\rho_{\mathcal{L}}(s)$  connu sur  $\mathcal{L}$

Conditions initiales EDO :  $[x(0), \rho(0)] = [a, \rho_0(a)]$  ou, le long de  $\mathcal{L}$

En effet :  $\left(\frac{d\rho}{dt}\right)_C(t) = f[\rho, x_C(t), t]$  le long des courbes caractéristiques  $\mathcal{C}$  d'équation  $x = x_C(t)$  et définies par  $\dot{x} = c(\rho, x, t)$ .

On peut généraliser au cas du système d'équations d'advection

$$\frac{\partial \rho_i}{\partial t} + c_i(\underline{\rho}, x, t) \frac{\partial \rho_i}{\partial x} = f_i(\underline{\rho}, x, t) \quad \text{pour } i = 1, \dots, N$$

où  $\underline{\rho} \in \mathbb{R}^N$  est un vecteur  $\underline{\rho} = (\rho_1, \rho_2, \dots, \rho_N)$  à  $N$  composantes.

$N$  familles de courbes caractéristiques  $\mathcal{C}_i$  pour  $i = 1, \dots, N$  propagent  $N$  conditions à partir d'une ou plusieurs courbes  $\mathcal{L}$ .

Résolution du système dynamique à  $2N$  degrés de liberté

$$\begin{cases} \dot{x}_i = c_i(\underline{\rho}, x_i, t) \\ \dot{\rho}_i = f_i(\underline{\rho}, x_i, t) \end{cases} \quad \text{pour } i = 1, \dots, N \quad .$$

La méthode des caractéristiques pour résoudre un système équations aux dérivées partielles en  $(x, t)$  consiste à essayer de combiner les équations pour les mettre sous forme advective. Lorsque cela est possible, on dit que le système est hyperbolique.



## FORMULAIRE

### DÉRIVÉE LE LONG DE COURBES

Dérivée d'un champ le long d'une courbe :

$$\begin{aligned} \left( \frac{dx}{dt} \right)_{\mathcal{L}}(t) &= \dot{x}_{\mathcal{L}}(t) = c_{\mathcal{L}}(t) \\ \text{et} \quad \left( \frac{d\rho}{dt} \right)_{\mathcal{L}}(t) &= \left[ \frac{\partial}{\partial t} + c_{\mathcal{L}}(t) \frac{\partial}{\partial x} \right] \rho [x_{\mathcal{L}}(t), t] \end{aligned}$$

Famille de courbes  $x_{\mathcal{L}_a}(t) = X(a, t)$  et mouvement 1D :

$$\rho^{(L)}(a, t) = \rho_{\mathcal{L}_a}(t) = \rho [X(a, t), t] \iff \rho(x, t) = \rho^{(L)} [A(x, t), t]$$

# RÉSOLUTION DE L'ÉQUATION D'ADVECTION

Équation d'advection :

$$\frac{\partial \rho}{\partial t} + c(\rho, x, t) \frac{\partial \rho}{\partial x} = f(\rho, x, t) \quad \text{avec} \quad \rho(x, 0) = \rho_0(x)$$

Système dynamique équivalent :

$$\begin{cases} \left( \frac{dx}{dt} \right)_c = c(\rho, x, t) \\ \left( \frac{d\rho}{dt} \right)_c = f(\rho, x, t) \end{cases} \quad \text{avec} \quad [x(0), \rho(0)] = [a, \rho_0(a)]$$

Changement de variable :

$$\begin{cases} da = dx - c dt \\ d\tau = dt \end{cases} \iff \begin{cases} a = A(x, t) \\ \tau = t \end{cases} \iff \begin{cases} \frac{\partial}{\partial x} = \frac{\partial}{\partial a} \\ \frac{\partial}{\partial t} = -c \frac{\partial}{\partial a} + \frac{\partial}{\partial \tau} \end{cases}$$

Résumé de la méthode des caractéristiques :

$$\frac{d\rho}{dt} = f(\rho, x, t) \quad \text{sur la courbe } \mathcal{C} \text{ d'équation} \quad \frac{dx}{dt} = c(\rho, x, t).$$

# CAS PARTICULIERS DE RÉOLUTION DE $\frac{\partial \rho}{\partial t} + c \frac{\partial \rho}{\partial x} = f$

**Cas**  $c = c_0$

$$\left( \frac{d\rho}{dt} \right)_c = f(\rho, a + c_0 t, t) \quad \text{sur la droite } \mathcal{C} \text{ d'équation } x = a + c_0 t .$$

**Cas**  $c = c(x)$

$$\left( \frac{d\rho}{dt} \right)_c = f[\rho, X(a, t), t] \quad \text{sur la courbe } \mathcal{C} \text{ d'équation } x = X(a, t)$$

$$\text{avec } X(a, t) = \Theta^{-1} [\Theta(a) + t] \quad \text{et} \quad \Theta(x) = \int_{x_*}^x \frac{1}{c(s)} ds$$

**Cas**  $c = c(\rho)$  et  $f = 0$

$$\rho(x, t) = \rho_0(a) \quad \text{sur la droite } \mathcal{C} \text{ d'équation } x = a + \rho_0(a) t .$$