

DA と Dynamical Model

竹田航太

2023 年 4 月 13 日

目次

1	はじめに	1
1.1	これまでの流れ	2
1.2	準備	2
2	基本の仮定	3
3	Lorenz63	4
4	Lorenz96	6
5	Notations	7
6	2 次元 Navier-Stokes	7
7	3 次元正則化 Navier-Stokes	9
付録 A	Gronwall の不等式	11

1 はじめに

データ同化を数学的に扱う際のモデルの解析について整理する．まずは気象で用いられる方程式に絞る．データ同化の文脈において求められるモデルの解析は well-posed 性に加えて, global attractor の存在や初期誤差の発達レートの評価である．無限次元力学系の理論 [1] に基づく．また, [2] のように, Lyapunov 関数を用いた評価・解析も基本的である．

1.1 これまでの流れ

[3, Hayden 2011] は Lorenz63(L63) と 2 次元 Navier-Stokes(2dNS) に対して解の存在から誤差発達までの結果を示した. [4, Law 2016] は Lorenz96(L96) に対する同様の解析を行なった. どちらも対象の方程式を以下のような形の Hilbert 空間上の ODE として表現した.

$$\frac{du}{dt} + \mathcal{A}u + \mathcal{B}(u, u) = f.$$

[5, Kelly 2014] は \mathcal{A}, \mathcal{B} に条件を設けて一般的な形で誤差発達について議論した.

1.2 準備

Hilbert 空間 $(\mathcal{H}, \langle \cdot, \cdot \rangle, |\cdot|)$ を考える.

Definition 1.1 (自励系 ODE と力学系). 自励系^{*1}の ODE を考える.

$$\frac{du}{dt} = f(u), \quad u(0) = u_0.$$

この ODE が任意の $u_0 \in \mathcal{H}$ に対して, 時間大域的な一意解 $u \in C^1(\mathbb{R}_{\geq 0}; \mathcal{H})$ を持つとき, 1 パラメータ半群 $\Psi: \mathbb{R}_{\geq 0} \times \mathcal{H} \rightarrow \mathcal{H}$ が

$$\Psi(t, u_0) = u(t)$$

で定義できる. $\Psi_t(\cdot) = \Psi(t, \cdot)$ と書き, 元の ODE や 1 パラメータ半群を力学系と呼ぶ.

Definition 1.2. $B \subset \mathcal{H}$ が半群 Ψ_t について *forward invariant* であるとは

$$\Psi_t(B) \subset B, \quad \forall t \geq 0$$

が成り立つことを言う.

Definition 1.3. 半群 $(\Psi_t)_{t \geq 0}$ の *attractor* とは以下を満たす集合 $\mathcal{A} \subset \mathcal{H}$.

$$(1) \Psi_t \mathcal{A} = \mathcal{A}.$$

$$(2) \text{ある近傍 } U \text{ が存在し, } \forall u_0 \in U \text{ で } d(\Psi_t u_0, \mathcal{A}) \rightarrow 0 \quad (t \rightarrow \infty).$$

また, *attractor* \mathcal{A} がコンパクトであり, 任意の有界集合 B に対して, B の点を一様に *attract* するとき, \mathcal{A} は *global attractor* と呼ばれる.

Definition 1.4 (absorbing set). 力学系 $\Psi: \mathbb{R}_{\geq 0} \times \mathcal{V} \rightarrow \mathcal{V}$ が有界な *absorbing set* \mathfrak{B}_{abs} を持つとは, 任意の $R > 0$ に対して, ある $T = T(R) > 0$ が存在して

$$\Psi_t(B(0, R)) \subset \mathfrak{B}_{abs}, \quad \forall t \geq T$$

^{*1} 速度ベクトル場が時間に依存しない.

が成り立つことを言う。

Theorem 1.5. 半群 $(\Psi_t)_{t \geq 0}$ が十分大きな t で一様コンパクト^{*2}、つまり、任意の有界集合 B に対して、ある $T = T(B) > 0$ が存在し $\cup_{t \geq T} \Psi_t B$ が \mathcal{H} で相対コンパクト、とする。また、開集合 $U \subset \mathcal{H}$ とその上での *absorbing set* \mathfrak{B}_{abs} が存在するとする。このとき、*global attractor* を

$$\mathcal{A} = \cap_{T \geq 0} \overline{\cup_{t \geq T} \Psi_t(\mathfrak{B}_{abs})} \quad (1.1)$$

で定めることができ、 U で包含関係について極大となる。

Proof. Theorem 1.1 of [1]. □

Remark 1.6. Ψ_t に関する一様コンパクト性の条件は V での有界な *absorbing set* の存在と V の H への埋め込みがコンパクトであれば満たされる。

Remark 1.7. 有界な *absorbing set* の存在は以下の形の *a priori estimate* が得られるとわかる。

$$|u(t)|^2 \leq e^{-\alpha t} |u_0|^2 + R^2(1 - e^{-\alpha t})$$

ただし、 $\alpha, R > 0$ は u_0 によらない定数。これより、任意の $R_1 \geq R$ について、 $|u_0| \leq R_1$ のとき、

$$|u(t)|^2 \leq e^{-\alpha t} R_1^2 + R^2(1 - e^{-\alpha t}) = R^2 + (R_1^2 - R^2)e^{-\alpha t} \leq R_1^2$$

となるので、 H における閉球 $B_H(0, R_1)$ は *forward invariant* である。また、 $R_1 > R$ について、 $B_H(0, R_1)$ は H で *absorbing set* になることもわかる。

2 基本の仮定

状態空間として Hilbert 空間 $(\mathcal{H}, |\cdot|)$ を考える。

Assumption 2.1. Banach 空間 $(\mathcal{V}, \|\cdot\|)$ を \mathcal{H} に連続的に埋め込めるとする^{*3}。以下の形の力学系を仮定する。

$$\frac{du}{dt} + \mathcal{A}u + \mathcal{B}(u, u) = f, \quad u(0) = u_0. \quad (2.1)$$

ただし、 $\mathcal{A} : \mathcal{H} \rightarrow \mathcal{H}$ は非有界線形作用素で、ある $\lambda > 0$ が存在して以下が成り立つ。

$$\langle \mathcal{A}u, u \rangle \geq \lambda \|u\|^2, \quad \forall u \in \mathcal{D}(\mathcal{A}). \quad (2.2)$$

^{*2} 証明には、ある T で Ψ_T がコンパクトという条件で十分。

^{*3} $\exists C > 0$, s.t. $|u| \leq C\|u\|, \forall u \in V$.

さらに、双線形形式 $\mathcal{B} : \mathcal{V} \times \mathcal{V} \rightarrow \mathcal{H}$ は以下を満たし、

$$B(u, v) = B(v, u), \quad \forall u, v \in \mathcal{V}, \quad (2.3)$$

$$\langle B(u, u), u \rangle = 0, \quad \forall u \in \mathcal{V}, \quad (2.4)$$

ある $c > 0$ が存在して、以下が成り立つとする。

$$|\langle B(u, v), v \rangle| \leq c \|u\| \|v\| \|v\|, \quad \forall u, v \in \mathcal{V}. \quad (2.5)$$

また、任意の $u(0) \in \mathcal{H}$ に対して、(2.1) は一意な弱解を持つとし、 \mathcal{H} に拡張可能な 1-パラメータ半群 $\Psi_t : \mathcal{V} \rightarrow \mathcal{V}$ を生成するとする。さらに、*global attractor* $\mathcal{A} \subset \mathcal{V}$ が存在し、ある $R > 0$ が存在して任意の $u_0 \in \mathcal{A}$ に対して $\sup_{t \geq 0} |u(t)| \leq R$ が成り立つとする。

Remark 2.2. 空間の包含関係は $\mathcal{D}(\mathcal{A}) \subset \mathcal{V} \subset \mathcal{H} \subset \mathcal{V}'$ 。

Remark 2.3. *Lorenz63*, 96, トーラス上 2 次元 *Navier-Stokes* はこの仮定を満たす。

Remark 2.4. 有限次元の場合は *global attractor* の存在は他の仮定から導かれる。

Remark 2.5. *global attractor* と有界性の証明には、*Remark 1.7* の *a priori estimate* を示せば良い。

Lemma 2.6 (初期値連続性/誤差発達 [5]). *Assumption 2.1* を仮定すると、ある $\beta \in \mathbb{R}$ が存在して以下が成り立つ。

$$|\Psi_h(v_0) - \Psi_h(w_0)| \leq e^{\beta h} |v_0 - w_0|, \quad \forall v_0 \in \mathcal{A}, h > 0, w_0 \in \mathcal{H}. \quad (2.6)$$

Proof. [5] □

Remark 2.7. 初期値は片方だけが *global attractor* \mathcal{A} に入っているという条件だけが課せられている。これはデータ同化において、信号 $u_t \in \mathcal{A}$ の推定値 \hat{u}_t が \mathcal{A} に入っているとは限らない場合を想定している。

3 Lorenz63

$\sigma, b, r \in \mathbb{R}$ に対して、 $r + a$ シフトした *Lorenz63* を考える。

$$\begin{aligned} \frac{dx}{dt} &= \sigma(y - x), \\ \frac{dy}{dt} &= -\sigma x - y - xz, \\ \frac{dz}{dt} &= xy - bz - b(r + \sigma). \end{aligned}$$

これは $\mathcal{H} = \mathcal{V} = \mathbb{R}^3$ として, $u = (x, y, z)^\top$ に対して, (2.1) を用いて以下のように書ける.

$$\mathcal{A} = \begin{bmatrix} \sigma & -\sigma & 0 \\ \sigma & 1 & 0 \\ 0 & 0 & b \end{bmatrix}, f = \begin{bmatrix} 0 \\ 0 \\ -b(r + \sigma) \end{bmatrix},$$

$$\mathcal{B}(u, \tilde{u}) = \frac{1}{2} \begin{bmatrix} 0 \\ x\tilde{z} + z\tilde{x} \\ -(x\tilde{y} + y\tilde{x}) \end{bmatrix}.$$

以下, $\sigma > 0, b > 1, r > 0$ とする. ($\sigma = 10, b = 8/3, r = 28$ はこれを満たす.)

Lemma 3.1. $\forall u, \tilde{u} \in \mathbb{R}^3$ で以下が成り立つ.

- (1) $\langle \mathcal{A}u, u \rangle \geq |u|^2$.
- (2) $\langle \mathcal{B}(u, u), u \rangle = 0$.
- (3) $\mathcal{B}(u, \tilde{u}) = \mathcal{B}(\tilde{u}, u)$.
- (4) $|\mathcal{B}(u, \tilde{u})| \leq 2^{-1}|u||\tilde{u}|$.

Proof. $\langle \mathcal{A}u, u \rangle = \sigma x^2 + y^2 + bz^2 \geq |u|^2$, $(y^2 + \tilde{y}^2)(z^2 + \tilde{z}^2) \geq (y\tilde{y} + z\tilde{z})$. □

Lemma 3.2. $K = \frac{b^2(r+\sigma)^2}{4(b-1)}$ とおく.

- (1) $\forall u_0 \in \mathbb{R}^3$ に対して, 全ての $t > 0$ で定義された一意な解 $u \in C^1(\mathbb{R}_{\geq 0}; \mathbb{R}^3)$ が存在し, 以下が成り立つ.

$$\limsup_{t \rightarrow \infty} |u(t)|^2 \leq K.$$

- (2) absorbing set $\mathfrak{B}_{abs} = B(0, K^{1/2})$ は forward invariant, つまり以下が成り立つ.

$$\Psi_t(\mathfrak{B}_{abs}) \subset \mathfrak{B}_{abs}, \quad \forall t \geq 0$$

- (3) global attractor \mathcal{A} を (1.1) で定めると, $\forall u_0 \in \mathcal{A}$ で, 以下が成り立つ.

$$|u(t)|^2 \leq K, \quad \forall t \geq 0.$$

Proof. [3] 解の存在は速度ベクトル場の局所リプシッツ性から従う. $\langle \mathcal{A}u + \mathcal{B}(u, u) - f, u \rangle \leq K - |u|^2$ を示す. Gronwall の不等式から従う. □

Theorem 3.3. $\beta = 2(K^{1/2} - 1)$ とおく. $\forall v_0 \in \mathcal{A}, w_0 \in \mathbb{R}^3, t > 0$ で以下が成り立つ.

$$|v(t) - w(t)| \leq e^{\beta t} |v_0 - w_0|.$$

Proof. β の存在は, [5] からわかる. 具体的な β は [3] を見よ. □

4 Lorenz96

$J \in \mathbb{N}$ に対して, J 変数の Lorenz96 モデルは 1 次元周期境界の領域を J 点格子で離散化した以下のような力学系. $u = (u_1, \dots, u_J)^\top \in \mathbb{R}^J$,

$$\begin{aligned} \frac{du_j}{dt} &= u_{j-1}(u_{j+1} - u_{j-2}) - u_j + F, \quad \text{for } j = 1, 2, \dots, J, \\ u_0 &= u_J, \quad u_{J+1} = u_1, \quad u_{-1} = u_{J-1}. \end{aligned}$$

$F \in \mathbb{R}$ は外力パラメータ.

$\mathcal{H} = \mathcal{V} = \mathbb{R}^J$ として, (2.1) の形で以下のように書ける.

$$\begin{aligned} \mathcal{A} &= I, f = \begin{bmatrix} F \\ \vdots \\ F \end{bmatrix}, \\ \mathcal{B}(u, \tilde{u}) &= \frac{1}{2} \begin{bmatrix} \tilde{u}_2 u_J + u_2 \tilde{u}_J - \tilde{u}_J u_{J-1} - u_J \tilde{u}_{J-1} \\ \vdots \\ \tilde{u}_{j-1} u_{j+1} + u_{j-1} \tilde{u}_{j+1} - \tilde{u}_{j-2} u_{j-1} - u_{j-2} \tilde{u}_{j-1} \\ \vdots \\ \tilde{u}_{J-1} u_1 + u_{J-1} \tilde{u}_1 - \tilde{u}_{J-2} u_{J-1} - u_{J-2} \tilde{u}_{J-1} \end{bmatrix}. \end{aligned}$$

Lemma 4.1. $\forall u, \tilde{u} \in \mathbb{R}^J$ に対して, 以下が成り立つ.

- (1) $\langle \mathcal{A}u, u \rangle = |u|^2$.
- (2) $\langle \mathcal{B}(u, u), u \rangle$.
- (3) $\mathcal{B}(u, \tilde{u}) = \mathcal{B}(\tilde{u}, u)$.
- (4) $|\mathcal{B}(u, \tilde{u})| \leq 2|u||\tilde{u}|$.
- (5) $2 \langle \mathcal{B}(u, \tilde{u}), u \rangle = \langle \mathcal{B}(u, u), \tilde{u} \rangle$.

Lemma 4.2. $K = 2JF^2$ とおく.

- (1) $\forall u_0 \in \mathbb{R}^J$ に対して, 全ての $t > 0$ で定義された一意な解 $u \in C^1(\mathbb{R}_{\geq 0}; \mathbb{R}^J)$ が存在し, 以下が成り立つ.

$$\limsup_{t \rightarrow \infty} |u(t)|^2 \leq K.$$

- (2) absorbing set $\mathfrak{B}_{abs} = B(0, K^{1/2})$ は forward invariant, つまり以下が成り立つ.

$$\Psi_t(\mathfrak{B}_{abs}) \subset \mathfrak{B}_{abs}, \quad \forall t \geq 0$$

- (3) global attractor \mathcal{A} を (1.1) で定めると, $\forall u_0 \in \mathcal{A}$ で, 以下が成り立つ.

$$|u(t)|^2 \leq K, \quad \forall t \geq 0.$$

Proof. [4] □

Theorem 4.3. $\beta = 2(K^{1/2} - 1)$ とする. $\forall v_0 \in \mathcal{A}, w_0 \in \mathbb{R}^J, t > 0$ で以下が成り立つ.

$$|v(t) - w(t)| \leq e^{\beta t} |v_0 - w_0|.$$

Proof. β の存在は, [5] からわかる. 具体的な β は [4] を見よ. □

5 Notations

[6, 7, 3]. $\Omega = [0, L]^n$ ($n = 2, 3$) とおく.

(1) 可積分関数の空間 X に対して

$$\dot{X} = \{\varphi \in X \mid \int_{\Omega} \varphi(x) dx = 0\}$$

と書く.

(2) $\mathcal{V} = \{\varphi \mid \varphi \text{ は } \Omega \text{ 上の三角多項式}, \nabla \cdot \varphi = 0, \int_{\Omega} \varphi dx = 0\}$ とし,

$$\mathcal{H} = \overline{\mathcal{V}}^{L^2}, \mathcal{V} = \overline{\mathcal{V}}^{H^1}$$

とする. $\mathcal{H}^\perp = \{\nabla p \mid p \in H^1(\Omega)\}$ が成り立つ.

(3) Leray-Helmholtz 射影と呼ばれる L^2 直交射影 $P_\sigma : \dot{L}^2(\Omega)^n \rightarrow \mathcal{H}$ を用いて, Stokes 作用素

$$A = -P_\sigma \Delta, \quad D(A) = (H^2(\Omega))^n \cap \mathcal{V}$$

を定める ($n = 2, 3$). 周期境界条件の場合には, $A = -\Delta|_{D(A)}$ となり, 自己共役正作用素となる. さらに, A^{-1} がコンパクトとなる. このため, 固有値の列 $0 < \lambda_1 \leq \lambda_2, \dots, \lambda_j \rightarrow \infty$ と \mathcal{H} で正規直交な $(w_j)_{j \in \mathbb{N}} \subset D(A)$ が存在し, $Aw_j = \lambda_j w_j$ が成り立つ.

(4) L^2 内積とノルムをそれぞれ $\langle \cdot, \cdot \rangle, |\cdot|$ と書く. Poincaré の不等式からある $c > 0$ が存在し

$$\begin{aligned} c|Aw| &\leq \|w\|_{H^2} \leq c^{-1}|Aw|, \quad \forall w \in D(A), \\ c|A^{1/2}w| &\leq \|w\|_{H^1} \leq c^{-1}|A^{1/2}w|, \quad \forall w \in V \end{aligned}$$

が成り立ち, $V = D(A^{1/2})$ もわかる. $((\cdot, \cdot)) = \langle A^{1/2} \cdot, A^{1/2} \cdot \rangle, \|\cdot\| = |A^{1/2} \cdot|$ と書くとそれぞれ \mathcal{V} の内積とノルムになる.

6 2次元 Navier-Stokes

$L > 0$, $\Omega = [0, L]^2$ 上の 2 次元 Navier-Stokes 方程式を \mathcal{H} で考える.

$$\frac{\partial u}{\partial t} - \nu \Delta u + (u \cdot \nabla)u + \frac{1}{\rho_1} \nabla p = f.$$

$\mathcal{A} = A$ とする.

次に双線形形式 $B : \mathcal{V} \times \mathcal{V} \rightarrow \mathcal{H}$ を

$$B(u, v) = P_\sigma[(u \cdot \nabla)v]$$

で与え, 対称な双線形形式 $\mathcal{B} : \mathcal{V} \times \mathcal{V} \rightarrow \mathcal{H}$ を

$$\mathcal{B}(u, v) = \frac{1}{2}[B(u, v) + B(v, u)] \quad (6.1)$$

で定める.

2次元 Navier-Stokes 方程式は次のように表せる.

$$\frac{du}{dt} + \nu \mathcal{A}u + \mathcal{B}(u, u) = f, \quad (6.2)$$

ただし, 外力は $f \in \mathcal{H}$ とする^{*4}.

解の存在は Theorem 2.1 in [1, p.108].

Theorem 6.1. $u_0, f \in \mathcal{H}$ とする. このとき, (6.2) の一意な解が存在し以下を満たす.

$$u \in C([0, T]; \mathcal{H}) \cap L^2([0, T]; \mathcal{V}), \quad \forall T > 0,$$

$\frac{du}{dt} \in L^2([0, T]; \mathcal{H})$ であり, $\mathcal{H} \ni u_0 \mapsto u(t) \in D(A)$ は連続^{*5}. さらに, $u_0 \in \mathcal{V}$ のとき

$$u \in C([0, T]; \mathcal{V}) \cap L^2([0, T]; D(A)), \quad \forall T > 0$$

が成り立つ.

Lemma 6.2 (A について).

$$\langle \mathcal{A}u, u \rangle \geq \lambda_1 \|u\|^2, \quad \forall u \in \mathcal{V} \quad (6.3)$$

が成り立つ.

Lemma 6.3 (\mathcal{B} の評価). 任意の $u, v \in \mathcal{V}$ について以下が成り立つ.

- (1) $\mathcal{B}(u, v) = \mathcal{B}(v, u)$.
- (2) $\langle \mathcal{B}(u, u), u \rangle = 0$.
- (3) $|\langle \mathcal{B}(u, v), v \rangle| \leq \exists c \|u\| \|v\| |v|$.

ただし, $c > 0$ は \mathcal{B} にのみ依存.

Proof. まず, [3] から B について以下が成り立つ.

^{*4} もしくは f の勾配部分 $f - P_\sigma f$ を圧力勾配 ∇p に加えて $P_\sigma f$ を改めて f とおく.

^{*5} 半群 $\Psi_t : \mathcal{H} \ni u_0 \mapsto u(t) \in D(A)$ が定義できる.

- i) $\langle B(u, v), v \rangle = 0, \quad \forall u, v \in \mathcal{V}.$
- ii) $\langle B(u, v), w \rangle = \langle B(u, w), v \rangle, \quad \forall u, v, w \in \mathcal{V}.$
- iii) $|\langle B(u, v), w \rangle| \leq \exists c|u|^{1/2}\|u\|^{1/2}\|v\|\|w\|^{1/2}\|w\|^{1/2}, \quad \forall u, v, w \in \mathcal{V}.$

(1), (2) は明らか.

$$\begin{aligned} |\langle B(u, v), v \rangle| &\leq \frac{1}{2} [|\langle B(u, v), v \rangle| + |\langle B(v, u), v \rangle|] \leq 0 + \frac{c}{2} |v|^{1/2} \|v\|^{1/2} \|u\| |v|^{1/2} \|v\|^{1/2} \\ &= \frac{c}{2} \|u\| \|v\| |v|. \end{aligned}$$

2 つ目の不等式では i) と iii) を用いた. □

Lemma 6.4. 以下の *a priori estimate* が成り立つ.

$$|u(t)|^2 \leq |u_0|^2 e^{-\nu\lambda_1 t} + \frac{|f|^2}{\nu^2 \lambda_1^2} (1 - e^{-\nu\lambda_1 t}). \quad (6.4)$$

また, ある $\rho_1 > 0$ が存在して $\mathcal{B}_1 = B_{\mathcal{V}}(0, \rho_1)$ は \mathcal{V} での有界な absorbing set であるので, Ψ_t の \mathcal{H} での一様コンパクト性が従う. これより, global attractor の存在もわかる.

Lemma 6.5 ([3]). $K = \frac{|f|^2}{\nu^2 \lambda_1}$ とする. *global attractor* \mathcal{A} を (1.1) で定めると, $\forall u_0 \in \mathcal{A}$ で, 以下が成り立つ.

$$\|u(t)\|^2 \leq K, \quad \forall t \geq 0.$$

以上から \mathbb{T}^2 上 Navier-Stokes 方程式は基本の仮定を満たすので \mathcal{H} のノルム (L^2 ノルム $|\cdot|$) に対して, Lemma 2.6 の結果が従う. [3] は \mathcal{V} のノルム ($\|\cdot\|$) に対して同様の評価をしている.

Theorem 6.6. $\forall v_0 \in \mathcal{A}, w_0 \in \mathcal{V}$ を初期値とする $[0, T]$ での (6.2) の解をそれぞれ $v(t), w(t)$ と書く. ある無次元の定数 C_1 と $\beta = C_1 \nu^{-5/3} \lambda_1^{-1/3} K^{4/3}$ に対し, $t \in [0, T]$ で以下が成り立つ.

$$\|v(t) - w(t)\| \leq e^{\beta t} \|v_0 - w_0\|.$$

7 3次元正則化 Navier-Stokes

$L > 0$ とし周期境界の $\Omega = [0, L]^3$ 上 3 次元 Camassa-Holm (Navier-Stokes- α) 方程式は

$$\begin{aligned} \frac{\partial}{\partial t} (\alpha_0^2 u - \alpha_1^2 \Delta u) - \nu (\alpha_0^2 u - \alpha_1^2 \Delta u) - u \times (\nabla \times (\alpha_0^2 u - \alpha_1^2 \Delta u)) + \frac{1}{\rho_1} \nabla p &= f, \\ \nabla \cdot u &= 0, \\ u(x, 0) &= u_0(x). \end{aligned}$$

ただし, $\frac{p}{\rho_1} = \frac{\pi}{\rho_0} + \alpha_0^2 |u|^2 - \alpha_1^2 (u \cdot \Delta u)$ は修正圧力であり, 圧力 π , 粘性係数 $\nu > 0$, 密度 $\rho_0 > 0$, f は外力を表す. $\alpha_0 > 0$ と $\alpha_1 \geq 0$ はスケールパラメータであり $\alpha_0 = 1$, $\alpha_1 = 0$ のとき, 3 次

元 Navier-Stokes 方程式に一致する． f は時間に依存しないと仮定する．また， $\int_{\Omega} u dx = 0$ となるように， $\int_{\Omega} u_0 dx = \int_{\Omega} f dx = 0$ を仮定する．

また， $((\cdot, \cdot))$ を \mathcal{V} に制限すると $\alpha_1 > 0$ のとき以下の H^1 内積と同値になる．

$$[u, v] = \alpha_0^2 \langle u, v \rangle + \alpha_1^2 ((u, v)), \quad u, v \in \mathcal{V}.$$

次に双線形形式 $B : \mathcal{V} \times \mathcal{V} \rightarrow \mathcal{H}$ を

$$B(u, v) = P_{\sigma}[(u \cdot \nabla)v], \quad u, v \in V$$

で与え， $B(u)v = B(u, v)$, $u, v \in \mathcal{V}$ とおく．さらに，

$$\tilde{B}(u, v) = -P_{\sigma}(u \times (\nabla \times v)), \quad u, v \in V$$

3 次元 Camassa-Holm 方程式は ODE として以下のように表せる．

$$\frac{d}{dt}(\alpha_0^2 u + \alpha_1^2 Au) + \nu A(\alpha_0^2 u + \alpha_1^2 Au) + \tilde{B}(u, \alpha_0^2 u + \alpha_1^2 Au) = f, \quad (7.1)$$

$$u(0) = u_0, \quad (7.2)$$

ただし， $f \in \mathcal{H}$ を仮定する．

Lemma 7.1 ([7]). (1) $\langle B(u, v), w \rangle = -\langle B(u, w), v \rangle$.

(2) $\tilde{B}(u, v) = (B(v) - B^*(v))u$, $\forall u, v \in V$.

Definition 7.2 (Regular solution). $f \in \mathcal{H}$, $T > 0$ とする． $u \in C([0, T]; \mathcal{V}) \cap L^2([0, T]; D(A))$, $\frac{du}{dt} \in L^2([0, T]; \mathcal{H})$ が以下を満たすとき (7.1) の *regular solution* と呼ばれる．

$$\begin{aligned} & \left\langle \frac{d}{dt}(\alpha_0^2 u + \alpha_1^2 Au), w \right\rangle_{D(A)'} + \nu \langle A(\alpha_0^2 u + \alpha_1^2 Au), w \rangle_{D(A)'} \\ & + \langle \tilde{B}(u, \alpha_0^2 u + \alpha_1^2 Au), w \rangle_{D(A)'} = \langle f, w \rangle, \end{aligned}$$

$\forall w \in D(A)$, a.e. $t \in [0, T]$.

Theorem 7.3 ([7]). $f \in \mathcal{H}$, $u_0 \in \mathcal{V}$ とする．任意の $T > 0$ に対して，(7.1) の *regular solution* u が一意に存在し，以下を満たす．

(1) $u \in L_{loc}^{\infty}((0, T]; H^3(\Omega))$.

(2) $\nu, \alpha_0, \alpha_1, f$ にのみ依存する定数 R_k ($k = 0, 1, 2, 3$) が存在し，

$$\limsup_{t \rightarrow \infty} (\alpha_0^2 |A^{k/2} u|^2 + \alpha_1^2 |A^{\frac{k+1}{2}} u|^2) = R_k^2$$

が成り立つ．

Corollary 7.4. (7.1) の解 u に対して, $\Psi_t u_0 = u(t)$ とおくと Ψ_t はコンパクトな半群となる. また, $\mathfrak{B}_{abs} = \{u \in \mathcal{V} \mid \|u\| \leq \frac{R_0}{\alpha_1}\}$ とおくと, V での *absorbing set* となる. (1.1) で \mathcal{A} を定めるとコンパクトとなる.

Theorem 7.5. $f \in \mathcal{H}$, $T > 0$ とする. $v_0 \in \mathcal{A}$, $w_0 \in \mathcal{V}$ を初期値とする (7.1) の $[0, T)$ での解をそれぞれ $v(t), w(t)$ と書き, $\delta u(t) = v(t) - w(t)$ とおく. ある $\beta \in \mathbb{R}$ が存在し, $t \in [0, T)$ で以下が成り立つ.

$$(\alpha_0^2 |\delta u(t)|^2 + \alpha_1^2 \|\delta u(t)\|^2) \leq e^{\beta t} (\alpha_0^2 |\delta u(0)|^2 + \alpha_1^2 \|\delta u(0)\|^2).$$

Proof. [7] の p.20 にある regular solution の一意性の議論から従う. □

Remark 7.6. 初期値の条件 $w_0 \in \mathcal{V}$ に注意.

付録 A Gronwall の不等式

Lemma 付録 A.1. $a, b, u_0 \in \mathbb{R}$ に対して, $u \in C^1(\mathbb{R}_{\geq 0}; \mathbb{R})$ が

$$\frac{du}{dt} \leq au + b, u(0) = u_0$$

を満たすとする. このとき, 以下が成り立つ.

$$u(t) \leq e^{at} u_0 + \frac{b}{a} (e^{at} - 1).$$

参考文献

- [1] Roger Temam. *Infinite-Dimensional Dynamical Systems in Mechanics and Physics*. Springer New York, NY, 1997.
- [2] Xin T Tong, Andrew J Majda, and David Kelly. Nonlinear stability and ergodicity of ensemble based kalman filters. *Nonlinearity*, 29(2):657, jan 2016.
- [3] Kevin Hayden, Eric Olson, and Edriss S. Titi. Discrete data assimilation in the lorenz and 2d navier-stokes equations. *PHYSICA D-NONLINEAR PHENOMENA*, 240(18):1416–1425, SEP 1 2011.
- [4] K. J. H. Law, D. Sanz-Alonso, A. Shukla, and A. M. Stuart. Filter accuracy for the lorenz 96 model: Fixed versus adaptive observation operators. *PHYSICA D-NONLINEAR PHENOMENA*, 325:1–13, JUN 15 2016.
- [5] D. T. B. Kelly, K. J. H. Law, and A. M. Stuart. Well-posedness and accuracy of the ensemble kalman filter in discrete and continuous time. *NONLINEARITY*, 27(10):2579–2603, OCT 2014.

- [6] P. Constantin and C. Foias. *Navier-Stokes Equations*. Chicago Lectures in Mathematics. University of Chicago Press, 1988.
- [7] C. Foias, D. D. Holm, and E. S. Titi. The three dimensional viscous camassa-holm equations, and their relation to the navier-stokes equations and turbulence theory. *Journal of Dynamics and Differential Equations*, 14(1), 2001.
- [8] Andrew J. Majda and John Harlim. *Filtering Complex Turbulent Systems*. Cambridge University Press, 2012.
- [9] K. J. H. Law, A. M. Stuart, and K. C. Zygalakis. *Data Assimilation: A Mathematical Introduction*. Springer, 2015.
- [10] Kody Law, Abhishek Shukla, and Andrew Stuart. Analysis of the 3dvar filter for the partially observed lorenz’63 model. *DISCRETE AND CONTINUOUS DYNAMICAL SYSTEMS*, 34(3, SI):1061–1078, MAR 2014.
- [11] Don A Jones and Edriss S Titi. On the number of determining nodes for the 2d navier-stokes equations. *Journal of Mathematical Analysis and Applications*, 168(1):72–88, 1992.