

Noyaux de la chaleur et estimations mixtes $L^p - L^q$ optimales : le cas non autonome

Matthias HIEBER ^a, Sylvie MONNIAUX ^b

^a Mathematisches Institut 1, Universität Karlsruhe, Englerstr. 2, 76128 Karlsruhe, Allemagne
Courriel : matthias.hieber@math.uni-karlsruhe.de

^b Laboratoire de mathématiques fondamentales et appliquées, faculté des sciences de Saint-Jérôme, case
Cour A, 13397 Marseille cedex 20, France
Courriel : sylvie.monniaux@math.u-3mrs.fr

(Reçu et accepté le 1^{er} décembre 1998)

Résumé. On considère le problème non autonome $u'(t) + A(t)u(t) = f(t)$, $u(0) = 0$, où $-A(t)$ engendre pour chaque $t \in [0, T]$, un semi-groupe holomorphe borné sur $L^2(\Omega)$. On démontre des estimations a priori $L^p - L^q$ optimales pour la solution de l'équation précédente à condition que les semi-groupes T_t soient associés à des noyaux vérifiant des estimations gaussiennes et que les opérateurs $\{A(t), t \in [0, T]\}$ remplissent une condition de commutateur de type Acquistapace-Terreni. © Académie des Sciences/Elsevier, Paris

Heat kernel and maximal $L^p - L^q$ estimates: the non-autonomous case

Abstract. Consider the non-autonomous initial value problem $u'(t) + A(t)u(t) = f(t)$, $u(0) = 0$, where $-A(t)$ is for each $t \in [0, T]$, the generator of a bounded analytic semigroup on $L^2(\Omega)$. We prove maximal $L^p - L^q$ a priori estimates for the solution of the above equation provided the semigroups T_t are associated to kernels which satisfies an upper Gaussian bound and $\{A(t), t \in [0, T]\}$ fulfills a Acquistapace-Terreni commutator condition. © Académie des Sciences/Elsevier, Paris

Abridged English Version

Let $T > 0$ be fixed and $f : [0, T] \rightarrow X$ be a function with values in some Banach space X . In this Note, we investigate so-called maximal regularity properties of solutions of non-autonomous initial value problems of the form:

$$\begin{aligned} u'(t) + A(t)u(t) &= f(t), \quad t \in [0, T], \\ u(0) &= 0, \end{aligned} \tag{1}$$

where for each $t \in [0, T]$, $-A(t)$ is the generator of a bounded analytic semigroup on X . Given $p \in (1, \infty)$, we say that there is maximal L^p -regularity for (1) and write $A \in \text{MR}(p, X)$ if for all

Note présentée par Haïm BRÉZIS.

$f \in L^p(0, T; X)$, there exists a unique $u \in W^{1,p}(0, T; X)$ with $A(\cdot)u(\cdot) \in L^p(0, T; X)$ verifying (1) in the sense of $L^p(0, T; X)$.

Choosing in particular $X = L^q(\Omega)$, $1 < q < \infty$, the property of maximal L^p -regularity implies a priori estimates for the solution of (1) of the form:

$$\int_0^T \|u'(\tau)\|_q^p d\tau + \int_0^T \|A(\tau)u(\tau)\|_q^p d\tau \leq C \int_0^T \|f(\tau)\|_q^p d\tau, \tag{2}$$

which are of particular interest when dealing with quasilinear problems (see [2]). In case the domains $D(A(t))$ of $A(t)$ are independent of $t \in [0, T]$, results on maximal L^p -regularity for the non-autonomous case (1) may be easily derived from the corresponding results for the autonomous equation. In the following, we allow the domains $D(A(t))$ to vary with t .

Recently, it was shown in [7] that (2) holds in the case $A(t) = A$, $t \in [0, T]$, provided the semigroup generated by $-A$ is associated to a kernel which satisfies a Gaussian (or more general a Poisson) bound. It is the aim of this Note to present a result which extends the result in [7] to the non-autonomous case. When dealing, for example, with second order differential equations in divergence form subject to co-normal boundary conditions, the domains $D(A(t))$ of the associated realization $A(t)$ in $L^q(\Omega)$ vary with t and the commutator conditions of Acquistapace–Terreni will be of central importance.

For $\theta \in (0, \pi]$, we denote by Σ_θ the sector $\{z \in \mathbb{C} \setminus \{0\}; |\arg z| < \theta\}$. We consider a family of linear operators $\{A(t), t \in [0, T]\}$ in X satisfying the following two assumptions:

- (A1) there exists $\theta \in (0, \frac{\pi}{2})$ such that $\sigma(A(t)) \subset \Sigma_\theta$ for all $t \in [0, T]$, and for all $\varphi \in (\theta, \pi)$, there exists $M_\varphi > 0$ such that

$$\|(\lambda - A(t))^{-1}\|_{\mathcal{L}(X)} \leq \frac{M_\varphi}{1 + |\lambda|}, \quad t \in [0, T], \lambda \in \mathbb{C} \setminus \Sigma_\varphi.$$

The condition (A1) implies that the operators $-A(t)$ ($t \in [0, T]$) generate uniformly bounded analytic C_0 -semigroups on X .

- (A2) There exist $\alpha, \beta \in [0, 1]$, $\alpha < \beta$, $\omega \in (\theta, \frac{\pi}{2})$, $c > 0$ such that

$$\|A(t)(\lambda - A(t))^{-1}(A(t)^{-1} - A(s)^{-1})\|_{\mathcal{L}(X)} \leq c \frac{|t - s|^\beta}{(1 + |\lambda|)^{1-\alpha}},$$

$$s, t \in [0, T], \lambda \in \mathbb{C} \setminus \Sigma_\omega.$$

We remark that Condition (A2) was introduced and investigated by Acquistapace–Terreni [1] in order to study (1).

Using pseudo-differential operators techniques and general results on singular integrals (see [8]), we can prove the following theorem (see [5]).

THEOREM 1. – Assume that $\{A(t), t \in [0, T]\}$ satisfies (A1) and (A2) in a Banach space X .

- (a) Suppose that there exists $p \in (1, \infty)$ such that $\{A(t), t \in [0, T]\}$ belongs to $\text{MR}(p, X)$. Then $\{A(t), t \in [0, T]\}$ belongs to the class $\text{MR}(q, X)$ for all $q \in (1, \infty)$.
- (b) Let X be a Hilbert space, $p \in (1, \infty)$. Then $\{A(t), t \in [0, T]\}$ belongs to the class $\text{MR}(p, X)$.

Let now \mathcal{M} be a measurable subset of a space of homogeneous type (Ω, m, d) which satisfies the doubling property (see [9]). Consider $\{A(t), t \in [0, T]\}$ in $X_2 = L^2(\mathcal{M}, m)$ satisfying (A1). Suppose that the semigroups T_t generated by $-A(t)$ ($t \in [0, T]$) are represented by

$$(T_t(\sigma)f)(x) = (e^{-\sigma A(t)}f)(x) = \int_{\mathcal{M}} k_t(\sigma, x, y)f(y) dm(y) \quad m\text{-a.a. } x \in \mathcal{M},$$

for all $f \in X_2$, where $k_t(\sigma, \cdot, \cdot)$ is bounded and measurable on $\mathcal{M} \times \mathcal{M}$. Assume that the kernels satisfy a uniform estimate of the following type:

- (K) there exist a constant $n > 0$ and a bounded decreasing function g defined on $(0, \infty)$ satisfying $\lim_{r \rightarrow \infty} r^{2\ell + \gamma} g(r) = 0$ (for some $\gamma > 0$ and $\ell > 0$), such that

$$|k_t(\sigma, x, y)| \leq \min \left(\frac{1}{m(B(x, \sigma^{\frac{1}{n}}))}, \frac{1}{m(B(y, \sigma^{\frac{1}{n}}))} \right) g \left(\frac{d(x, y)}{\sigma^{\frac{1}{n}}} \right)$$

holds for all $t \in [0, T]$, $\sigma > 0$, and for m-a.a. $x, y \in \mathcal{M}$, where $B(x, r) := \{y \in \Omega; d(x, y) < r\}$.

The condition (K) implies that the semigroups $\{T_t, t \in [0, T]\}$ act consistently also on $X_q := L^q(\mathcal{M}, m)$ for $1 \leq q \leq \infty$. We denote their generators by $-A_q(t)$. We consider the following commutator conditions:

- (C) for $q = 1$ and $q = \infty$, there exists $\omega_q \in (\theta, \frac{\pi}{2})$, $\alpha_q, \beta_q \in [0, 1]$, $\alpha_q < \beta_q$ and a constant $c_q > 0$ such that

$$\|(\lambda - A_q(t))^{-1} - (\lambda - A_q(s))^{-1}\|_{\mathcal{L}(X_q)} \leq \frac{c_q |t - s|^{\beta_q}}{(1 + |\lambda|)^{1 - \alpha_q}}$$

for all $\lambda \in \mathbb{C} \setminus \Sigma_{\omega_q}$ and $s, t \in [0, T]$.

The main result of this Note is the following theorem.

THEOREM 2. – Assume that $\{A(t), t \in [0, T]\}$ in X_2 satisfies (A1) and (K). Suppose that $\{A_q(t), t \in [0, T]\}$ satisfies (A2) on X_q for all $q \in (1, \infty)$ and (C) for $q = 1$ and $q = \infty$. Let $1 < p, q < \infty$. Then $\{A(t), t \in [0, T]\}$ belongs to the class $MR(p, X_q)$. In particular, (2) holds.

Sketch of the proof of Theorem 2. – The assertions of Theorem 1 imply that in order to prove Theorem 2 it suffices to show that the operator S_1 given by

$$(S_1 f)(t) = \int_0^t A_1(t) T_t^{(1)}(t - s) f(s) ds, \quad t \in [0, T],$$

and its adjoint are of weak type $(1, 1)$. In order to do so consider the Calderón–Zygmund decomposition of an L^1 -function f on the product space $(0, T) \times \Omega$ in $f = g + \sum_i b_i$. The idea of the proof is to introduce “smoothing operators” Q_i such that on one hand $Q_i b_i$ fulfills a Harnack-type inequality and on the other hand that (A2) allows to estimate $(1 - Q_i) b_i$.

1. Présentation du problème

Soient $T > 0$ fixé et $f : [0, T] \rightarrow X$ une fonction à valeurs dans un espace de Banach X . Dans cette Note, nous étudions les propriétés de régularité maximale de problèmes non autonomes du type :

$$\begin{aligned} u'(t) + A(t)u(t) &= f(t), \quad t \in [0, T], \\ u(0) &= 0, \end{aligned} \tag{1}$$

où pour chaque $t \in [0, T]$, $-A(t)$ est le générateur d’un semi-groupe holomorphe borné sur X . Étant donné $p \in (1, \infty)$, on dit qu’il y a *régularité maximale* L^p pour (1) et on écrit $A \in MR(p, X)$ si

pour tout $f \in L^p(0, T; X)$, il existe une unique $u \in W^{1,p}(0, T; X)$ telle que $A(\cdot)u(\cdot) \in L^p(0, T; X)$ vérifiant (1) au sens de $L^p(0, T; X)$. Même dans le cas où $A(t) = A$ ($t \in [0, T]$), la question de la régularité maximale L^p , ainsi que formulée par Haïm Brézis, reste ouverte dans sa généralité.

Si on choisit, en particulier, $X = L^q(\Omega)$, $1 < q < \infty$, la propriété de régularité maximale L^p implique des estimations a priori pour la solution de (1) de la forme :

$$\int_0^T \|u'(\tau)\|_q^p d\tau + \int_0^T \|A(\tau)u(\tau)\|_q^p d\tau \leq C \int_0^T \|f(\tau)\|_q^p d\tau. \quad (2)$$

Ces estimations sont d'un intérêt particulier lorsqu'on s'intéresse à des problèmes quasi-linéaires (voir [2]). Dans le cas où les domaines $D(A(t))$ de $A(t)$ sont indépendants de $t \in [0, T]$, des résultats de régularité maximale L^p pour le problème non autonome (1) se déduisent aisément des résultats correspondants pour l'équation autonome. Dans la suite, nous considérons des opérateurs dont les domaines $D(A(t))$ peuvent varier avec $t \in [0, T]$.

Récemment, il a été montré dans [7] que l'on a effectivement les estimations a priori (2) dans le cas où $A(t) = A$, $t \in [0, T]$, à condition que le semi-groupe engendré par $-A$ soit associé à un noyau satisfaisant des estimations gaussiennes, ou plus généralement des estimations de Poisson. Lorsque l'on s'intéresse, par exemple, à des équations aux dérivées partielles en forme divergence avec des conditions aux limites co-normales, les domaines $D(A(t))$ des réalisations $A(t)$ associées dans $L^q(\Omega)$ varient avec t et la condition de commutateur d'Acquistapace–Terreni joue un rôle primordial pour étudier (1).

2. Cas hilbertien et indépendance par rapport à p

Pour $\theta \in (0, \pi]$, on note par Σ_θ le secteur $\{z \in \mathbb{C} \setminus \{0\}; |\arg z| < \theta\}$. On considère une famille d'opérateurs $\{A(t), t \in [0, T]\}$ vérifiant les deux conditions suivantes :

- (A1) il existe $\theta \in (0, \frac{\pi}{2})$ tel que $\sigma(A(t)) \subset \Sigma_\theta$ pour tout $t \in [0, T]$ et, pour tout $\varphi \in (\theta, \pi)$, il existe $M_\varphi > 0$ telle que

$$\|(\lambda - A(t))^{-1}\|_{\mathcal{L}(X)} \leq \frac{M_\varphi}{1 + |\lambda|}, \quad t \in [0, T], \lambda \in \mathbb{C} \setminus \Sigma_\varphi.$$

- (A2) Il existe $\alpha, \beta \in [0, 1]$, $\alpha < \beta$, $\omega \in (\theta, \frac{\pi}{2})$, $c > 0$ tels que

$$\|A(t)(\lambda - A(t))^{-1}(A(t)^{-1} - A(s)^{-1})\|_{\mathcal{L}(X)} \leq c \frac{|t - s|^\beta}{(1 + |\lambda|)^{1-\alpha}},$$

$$s, t \in [0, T], \lambda \in \mathbb{C} \setminus \Sigma_\omega.$$

Ces deux conditions ont été introduites et exploitées par Acquistapace–Terreni [1] dans le but d'étudier (1) et de construire une famille d'évolution associée à la famille d'opérateurs $\{A(t), t \in [0, T]\}$. La condition (A1) implique que les opérateurs $-A(t)$ ($t \in [0, T]$) engendrent des semi-groupes fortement continus, holomorphes uniformément bornés $\{T_t(\sigma) = e^{-\sigma A(t)}, \sigma \geq 0\}$ sur X . Nous obtenons alors le théorème suivant (voir [5]) :

THÉORÈME 1. – Soient X un espace de Banach, $T > 0$ et $\{A(t), t \in [0, T]\}$ une famille d'opérateurs vérifiant les deux conditions (A1) et (A2).

- (a) On suppose qu'il existe un $p \in (1, \infty)$ tel que la famille $\{A(t), t \in [0, T]\}$ soit dans la classe $\text{MR}(p, X)$. Alors $\{A(t), t \in [0, T]\}$ est dans la classe $\text{MR}(q, X)$ pour tout $q \in (1, \infty)$.
 (b) Soit X un espace de Hilbert, $p \in (1, \infty)$. Alors $\{A(t), t \in [0, T]\}$ est dans la classe $\text{MR}(p, X)$.

3. Cas d'opérateurs engendrant des semi-groupes à noyaux de la chaleur

On considère maintenant le cas d'un espace de type homogène (Ω, m, d) satisfaisant la propriété de doublement (voir [9]). Soit \mathcal{M} un sous-ensemble mesurable de Ω . On considère $\{A(t), t \in [0, T]\}$ une famille d'opérateurs linéaires sur $X_2 := L^2(\mathcal{M}, m)$. On suppose que $\{A(t), t \in [0, T]\}$ vérifie la condition (A1) dans X_2 . On suppose de plus que les semi-groupes T_t engendrés par $-A(t)$ ($t \in [0, T]$) sur X_2 sont donnés par des noyaux k_t de la façon suivante :

$$(T_t(\sigma)f)(x) = (e^{-(t-s)A(s)}f)(x) = \int_{\mathcal{M}} k_t(\sigma, x, y)f(y) \, dm(y) \quad \text{m-p.t. } x \in \mathcal{M},$$

pour tout $f \in X_2$, où $k_t(\sigma, \cdot, \cdot)$ ($\sigma > 0, t \in [0, T]$) sont des fonctions mesurables bornées sur $\mathcal{M} \times \mathcal{M}$, qui vérifient une estimation uniforme du type suivant :

- (K) il existe une constante $n > 0$ et une fonction décroissante bornée g définie sur $(0, \infty)$ vérifiant $\lim_{r \rightarrow \infty} r^{2\ell + \gamma} g(r) = 0$ (pour un $\gamma > 0$, et $\ell > 0$ étant lié à la croissance du volume des boules de Ω ; voir par exemple [9] pour plus de détails) telles que

$$|k_t(\sigma, x, y)| \leq \min \left(\frac{1}{m(B(x, \sigma^{\frac{1}{n}}))}, \frac{1}{m(B(y, \sigma^{\frac{1}{n}}))} \right) g \left(\frac{d(x, y)}{\sigma^{\frac{1}{n}}} \right)$$

pour $t \in [0, T]$, $\sigma > 0$, et pour m-p.t. $x, y \in \mathcal{M}$, où $B(x, r) := \{y \in \Omega; d(x, y) < r\}$.

La condition (K) implique que pour tout $q \in [1, \infty]$, il existe des semi-groupes $\{T_t^{(q)}, t \in [0, T]\}$ compatibles sur les espaces $X_q := L^q(\mathcal{M}, m)$ et tels que $T_t^{(2)} = T_t$ pour tout $t \in [0, T]$. On note par $-A_q(t)$ le générateur de $T_t^{(q)}$. On suppose que la condition suivante est vérifiée.

- (C) Pour $q = 1$ et $q = \infty$, il existe $\alpha_q, \beta_q \in [0, 1]$, $\alpha_q < \beta_q$, $\omega_q \in (\theta, \frac{\pi}{2})$, $c_q > 0$ tels que

$$\|(\lambda - A_q(t))^{-1} - (\lambda - A_q(s))^{-1}\|_{\mathcal{L}(X_q)} \leq c_q \frac{|t - s|^{\beta_q}}{(1 + |\lambda|)^{1 - \alpha_q}},$$

$s, t \in [0, T]$, $\lambda \in \mathbb{C} \setminus \Sigma_{\omega_q}$.

Sous ces hypothèses, nous pouvons énoncer le résultat principal de cette Note :

THÉORÈME 2. – Soit $\{A(t), t \in [0, T]\}$ dans X_2 une famille d'opérateurs qui vérifie (A1) et (K). On suppose que $\{A_q(t), t \in [0, T]\}$ vérifie (A2) sur X_q pour tout $q \in (1, \infty)$, et (C) pour $q = 1$ et $q = \infty$. Alors $A \in \text{MR}(p, X_q)$ pour tout $p \in (1, \infty)$ et tout $q \in (1, \infty)$. En particulier, l'estimation (2) est satisfaite.

Idée de la démonstration du théorème 2. – On peut montrer que sous les conditions (A1) et (A2) sur X_q , $A_q \in \text{MR}(p, X_q)$ si et seulement si l'opérateur S_q , donné par :

$$(S_q f)(t) = \int_0^t A_q(s) T_s^{(q)}(t - s) f(s) ds, \quad t \in [0, T],$$

est borné sur $L^p(0, T; X_q)$. Remarquons que S_q est défini par une intégrale singulière. Soit $q \in (1, \infty)$ fixé pour l'instant. D'après le théorème 1 (a), on sait qu'il suffit de montrer que S_q est borné sur $L^p(0, T; X_q)$ pour un $p \in (1, \infty)$. On va montrer que c'est le cas pour $p = q$, soit donc que S_q est borné sur l'espace $L^q(0, T; X_q) = L^q((0, T) \times \mathcal{M}, \lambda \otimes m)$, où λ est la mesure de Lebesgue sur \mathbb{R} . D'après le théorème 1 (b), on sait que ceci est vérifié pour $q = 2$. La stratégie est donc la suivante :

on montre d'abord que S_1 est du type $(1, 1)$ faible, ainsi que S'_∞ (l'opérateur dual de S_∞). Par interpolation, on obtient ensuite le résultat escompté.

Montrer que S_1 est du type $(1, 1)$ faible revient à montrer qu'il existe une constante $C > 0$ telle que pour toute fonction $f \in L^1((0, T) \times \mathcal{M}, \lambda \otimes m)$, on ait

$$\sup_{r>0} \{r (\lambda \otimes m)(\{(t, x) \in (0, T) \times \mathcal{M}; |S_1 f(t, x)| > r\})\} \leq C \|f\|_1.$$

Pour ce faire, on remarque d'abord que S_1 est du type $(1, 1)$ faible sur $(0, T) \times \mathcal{M}$ si et seulement si l'opérateur R_1 défini par $R_1 f := 1_{(0, T) \times \mathcal{M}} S(1_{(0, T) \times \mathcal{M}} f)$, $f \in L^1((0, T) \times \Omega, \lambda \otimes m)$, est du type $(1, 1)$ faible sur $(0, T) \times \Omega$. Comme $(0, T) \times \Omega$ est un espace de type homogène, on peut appliquer à toute fonction $f \in L^1((0, T) \times \Omega, \lambda \otimes m)$ une décomposition de Calderón–Zygmund (voir [9]), pour tout $r > 0$, en une « bonne » (« good ») partie g et une « mauvaise » (« bad ») partie b . Il est facile de voir que $(\lambda \otimes m)(\{(t, x) \in (0, T) \times \mathcal{M}; |R_1 g(t, x)| > r\})$ est borné par $c \frac{\|f\|_1}{r}$ pour une constante $c > 0$. Il s'agit ensuite de majorer $(\lambda \otimes m)(\{(t, x) \in (0, T) \times \mathcal{M}; |R_1 b(t, x)| > r\})$. En exploitant les conditions (A2) sur X_2 et (C) pour $q = 1$, on peut se ramener à une situation semblable à celle du cas autonome (i.e. $A(t) = A$ pour tout $t \in [0, T]$). C'est la condition (K) sur les noyaux k_t ($t \in [0, T]$) et les propriétés qu'implique cette estimation sur les dérivées partielles de k_t (voir [4]) qui permettent alors de conclure, comme dans le cas autonome [7], [3].

Pour montrer que S'_∞ est du type $(1, 1)$ faible, on procède de la même manière que pour S_1 . L'opérateur S'_∞ a une forme un peu différente de celle de S_1 : on s'y ramène en utilisant les conditions (A2) sur X_2 et (C) pour $q = \infty$. Ensuite, on peut appliquer les méthodes décrites plus haut pour obtenir le résultat annoncé.

Pour plus de détails, on pourra se référer à [6]. □

Références bibliographiques

- [1] Acquistapace P., Terreni B., A unified approach to abstract linear nonautonomous parabolic equations, Rend. Sem. Mat. Univ. Padova 78 (1987) 47–107.
- [2] Clément P., Li S., Abstract parabolic quasilinear equations and application to a groundwater flow problem, Adv. Math. Sci. Appl. 3 (1993/94) 17–32.
- [3] Coulhon T., Duong X.T., Maximal regularity and kernel bounds: observations on a theorem by Hieber and Prüss, Prépublications de l'Université de Cergy-Pontoise n° 14/97, 1997.
- [4] Duong X.T., Robinson D.W., Semigroup kernels, Poisson bounds, and holomorphic functional calculus, J. Funct. Anal. 142 (1996) 89–128.
- [5] Hieber M., Monniaux S., Pseudo-differential operators and maximal regularity results for non-autonomous parabolic equations, Proc. Amer. Math. Soc. (1999) (to appear).
- [6] Hieber M., Monniaux S., Heat-kernels and maximal $L^p - L^q$ -estimates: the non-autonomous case, Preprint, 1998.
- [7] Hieber M., Prüss J., Heat kernels and maximal $L^p - L^q$ estimates for parabolic evolution equations, Commun. Partial Differ. Eq. 22 (1997) 1647–1669.
- [8] Rubio de Francia J.L., Ruiz F.J., Torrea J.L., Calderón-Zygmund theory for operator-valued kernels, Adv. Math. 62 (1986) 7–48.
- [9] Stein E.M., Harmonic Analysis, Princeton University Press, 1993.