



HAL
open science

De Toda à KdV

Dario Bambusi, Thomas Kappeler, Thierry Paul

► **To cite this version:**

| Dario Bambusi, Thomas Kappeler, Thierry Paul. De Toda à KdV. 2009. hal-00358604

HAL Id: hal-00358604

<https://hal.science/hal-00358604>

Preprint submitted on 3 Feb 2009

HAL is a multi-disciplinary open access archive for the deposit and dissemination of scientific research documents, whether they are published or not. The documents may come from teaching and research institutions in France or abroad, or from public or private research centers.

L'archive ouverte pluridisciplinaire **HAL**, est destinée au dépôt et à la diffusion de documents scientifiques de niveau recherche, publiés ou non, émanant des établissements d'enseignement et de recherche français ou étrangers, des laboratoires publics ou privés.

De Toda à KdV

D. Bambusi*, T. Kappeler† et T. Paul‡

Résumé

On considère la limite à grand nombre de particules d'un système hamiltonien de type "Toda périodique" pour une famille de conditions initiales proches de la solution d'équilibre. On montre que, dans la formulation de paire de Lax, les deux bords des spectres des matrices de Jacobi des conditions initiales sont déterminés, à une erreur près, par ceux de deux opérateurs de Hill, associés à la famille de conditions initiales considérées. On en déduit que les spectres des matrices de Jacobi, lors de l'évolution limite donnée par KdV, restent constants à une erreur près que nous estimons. Enfin on montre que les actions du système Toda, convenablement renormalisées, tendent vers celles des deux équations de KdV.

1 Introduction et résultats

Le système de Toda périodique à N degrés de liberté est un système hamiltonien où N particules se meuvent sur le cercle réelle en interagissant avec un potentiel "plus proche voisin" du type $e^{q_i - q_{i+1}}$ introduit dans [7]. Il est bien connu, [4], que, par un changement (non symplectique) de coordonnées, ce système peut se mettre sous la forme de "Lax" $\dot{L} = [B, L]$, où, après doublement de la dimension,

$$L := \begin{pmatrix} b_0 & a_0 & 0 & \dots & a_{2N-1} \\ a_0 & b_1 & a_1 & \dots & 0 \\ 0 & a_1 & b_2 & \dots & 0 \\ 0 & \dots & \dots & \dots & a_{2N-2} \\ a_{2N-1} & \dots & \dots & a_{2N-2} & b_{2N-1} \end{pmatrix}, \quad (1)$$

$$B = \begin{pmatrix} 0 & a_0 & 0 & \dots & -a_{2N-1} \\ -a_0 & 0 & a_1 & \dots & 0 \\ 0 & -a_1 & 0 & \dots & 0 \\ 0 & \dots & \dots & \dots & a_{2N-2} \\ a_{2N-1} & \dots & \dots & -a_{2N-2} & 0 \end{pmatrix}, \quad (2)$$

et $a_i, b_i \in \mathbb{R}$ satisfont $a_{i+N} = a_i$, $b_{i+N} = b_i$. Nous allons considérer des coefficients obtenus par discrétisation de fonctions lisses : $a_i = 1 + \epsilon^2 \alpha(\frac{i}{N})$ et $b_i = \epsilon^2 \beta(\frac{i}{N})$, $\alpha, \beta \in C^\infty(\mathbb{T})$ avec

*Dipartimento di Matematica, Università degli Studi di Milano, Via Saldini 50, 20133 Milano, Italy, Dario.Bambusi@unimi.it

†Institut fuer Mathematik, Universitaet Zuerich, Winterthurerstrasse 190, CH-8057 Zuerich, tk@math.unizh.ch

‡CNRS et Département de Mathématiques et Applications UMR 8553 École Normale Supérieure, 45, rue d'Ulm, F 75730 Paris cedex 05, paul@dma.ens.fr

$|\epsilon| \ll 1$, une situation proche de la solution d'équilibre $a_i = 1$, $b_i = 0$, $i = 0, \dots, 2N - 1$. De telles limites ont été étudiées par plusieurs auteurs (voir e.g. [7]) dans des cas spéciaux ; la nouveauté pour le cas général traité ici est que, pour étudier cette limite, on a besoin de *deux* opérateurs de Hill - voir aussi [2] et [8] où se manifeste ce phénomène dans l'étude de la dynamique limite.

Rappelons que, si l'on considère l'opérateur de Schrödinger $H = -\frac{d^2}{dx^2} + u$ sur le cercle, alors l'équation de Kortevg-de Vries

$$\partial_t u - 6u\partial_x u + \partial_x^3 u = 0 \quad (3)$$

possède la forme de Lax :

$$\dot{H} = [B, H] \quad \text{où} \quad B = -4\partial_x^3 + 6u\partial_x + 3u_x. \quad (4)$$

Définissons $L_N = L_N^{\alpha, \beta}$, donnée par (1) avec $a_i = 1 + \epsilon^2 \alpha(\frac{i}{N})$, $b_i = \epsilon^2 \beta(\frac{i}{N})$ et $\epsilon = \frac{1}{2N}$. Il est bien connu que les valeurs propres λ_i^N , $0 \leq i \leq 2N - 1$ de L_N sont toutes réelles et vérifient

$$\lambda_0^N < \lambda_1^N \leq \lambda_2^N < \dots < \lambda_{2N-3}^N \leq \lambda_{2N-2}^N < \lambda_{2N-1}^N. \quad (5)$$

En particulier, pour $\alpha = \beta = 0$ (solution d'équilibre), le spectre de $L_N^{0,0}$ est donné par :

$$\lambda_0 = -2, \quad \lambda_{2l-1} = \lambda_{2l} = -2 \cos \frac{l\pi}{N}, \quad l = 1, \dots, N-1, \quad \lambda_{2N-1} = 2. \quad (6)$$

Le cœur de nos résultats est le Théorème suivant.

Théorème 1.1 *Soit L_N la matrice $L_N^{\alpha, \beta}$ avec $\alpha, \beta \in C^\infty(\mathbb{T})$, $\int_{\mathbb{T}} \alpha(x) dx = \int_{\mathbb{T}} \beta(x) dx = 0$ et soit $M_N = [N^{\frac{1}{4}}]$. Alors le spectre de L_N est constitué de $2N$ nombres réels $(\lambda_i^N)_{i=0, \dots, 2N-1}$ qui satisfont, pour tout $\delta > 0$, uniformément par rapport à $j = 0, \dots, 2N - 1$ et α, β dans tout ensemble borné de $C^\infty(\mathbb{T})$,*

$$\lambda_j^N = -2 + \frac{1}{4N^2} \lambda_j^- + O(N^{-3+\delta}), \quad j = 0, \dots, 2M_N \quad (7)$$

$$\lambda_{2l-1}^N, \lambda_{2l}^N = -2 \cos \frac{l\pi}{N} + O(N^{-3+\delta}), \quad l = M_N + 1, \dots, N - 1 - M_N \quad (8)$$

$$\lambda_{2N-1-j}^N = 2 - \frac{1}{4N^2} \lambda_j^+ + O(N^{-3+\delta}), \quad j = 0, \dots, 2M_N \quad (9)$$

où $(\lambda_i^\pm)_{i=0, \dots, 2M_N}$ sont les $2M_N + 1$ premières valeurs propres des opérateurs de Hill :

$$H_\pm = -\frac{d^2}{dx^2} - 2\alpha(x) \mp \beta(x). \quad (10)$$

Corollaire 1.2 *Soient $\alpha_t = -(u_t^- + u_t^+)/4$ et $\beta_t = (u_t^- - u_t^+)/2$ obtenues en faisant évoluer les conditions initiales $u^+ = -2\alpha - \beta$ et $u^- = -2\alpha + \beta$ par l'équation de KdV. Soit $L_N^t = L_N^{\alpha_t, \beta_t}$ donnée par (1) et soit $\{\lambda_j^N(L_N^t)\}_{j=0, \dots, 2N-1}$ son spectre (qui est conservé par la dynamique de Toda). Alors, pour tout $\delta > 0$ et uniformément en temps :*

$$\lambda_j^N(L_N^t) - \lambda_j^N(L_N^0) = O(N^{-3+\delta}). \quad (11)$$

Le deuxième résultat concerne l'asymptotisme à grand N des actions de Toda. Rappelons, [5], que, pour $1 \leq n \leq N - 1$, la n ème action d'une matrice de Jacobi L_N vérifie la formule

$$I_n^N = \frac{1}{\pi} \int_{\lambda_{2n-1}^N}^{\lambda_{2n}^N} \operatorname{arcosh} \left((-1)^{N-n} \frac{\Delta^N(\lambda)}{2} \right) d\lambda, \quad (12)$$

où $\Delta^N(\lambda)$ est le discriminant de L_N . On a une formule similaire pour les actions I_n^\pm des deux opérateurs de Hill H_\pm définis par (10) ; voir (18) plus bas.

Théorème 1.3 *Pour tout $n \geq 1$,*

$$8N^2 I_n^N \rightarrow I_n^- \quad \text{et} \quad 8N^2 I_{N-n}^N \rightarrow I_n^+ \quad \text{quand } N \rightarrow \infty.$$

D'une façon analogue, on obtient le comportement asymptotique à grand N des fréquences du système de Toda [1].

2 Quelques éléments de preuve

2.1 Lax et Töplitz

L'idée principale de la preuve du Théorème 1.1 consiste à considérer la matrice de Jacobi L_N comme la matrice dans une base canonique d'un opérateur de Töplitz pour la quantification du tore $\mathbb{T}^2 = \mathbb{R}^2/\mathbb{Z}^2$ avec une constante de Planck $\hbar = \frac{1}{4\pi N} = \frac{\epsilon}{2\pi}$. Cette identification a été proposée par Bloch et al [3] pour étudier la limite à grand N du système de Toda périodique. Nous allons, dans cet article, nous placer dans ce formalisme pour étudier le spectre de $L_N^{\alpha,\beta}$.

Pour cela on considère l'espace de Hilbert de dimension $2N$, \mathcal{H}_{2N} , généré par les fonctions *Theta* définies par :

$$\Theta_j(z = x + iy) := (4N)^{1/4} e^{-\pi j^2/2N} \sum_{n \in \mathbb{Z}} e^{-\pi(2Nn^2 + 2jn)} e^{2\pi iz(j+2Nn)}, \quad (13)$$

$$j = 0, \dots, 2N - 1.$$

Le produit scalaire $\langle \cdot, \cdot \rangle$ est celui de $L^2([0, 1] \times [0, 1], e^{-4\pi Ny^2} dx dy)$, de manière à ce que $\{\Theta_j\}_{j=0, \dots, 2N-1}$ soit une base orthonormée de \mathcal{H}_{2N} . La matrice $L_N^{\alpha,\beta}$ est la matrice, dans la base $\{\Theta_{2N-1}, \dots, \Theta_0\}$, d'un opérateur de Töplitz $T_N^{\alpha,\beta}$ de symbole principal (voir [3])

$$\epsilon^2 \beta(x) + 2(1 + \epsilon^2 \alpha(x)) \cos 2\pi y.$$

Il est donc élémentaire de constater que les vecteurs $\psi^k \in \mathcal{H}_{2N}$, $k = 0, \dots, 2N - 1$, définis par :

$$\psi^k(z) = \frac{1}{(2N)^{1/2}} \sum_{j=0}^{2N-1} e^{\pi i \frac{kj}{N}} \Theta_j(z) \quad (14)$$

sont vecteurs propres de l'opérateur $T_N^{0,0}$ dans \mathcal{H}_{2N} , de valeurs propres correspondantes données par (6). On remarque que

$$\psi^k(z) = (4N)^{-1/4} \int_0^1 \rho(z, k/2N + is) e^{-2\pi N s^2} ds,$$

où $\rho(z, \bar{z}') := \sum_{j=0}^{2N-1} \Theta_j(z) \overline{\Theta_j(z')}$.

2.2 Quasimodes

Dans l'idée de [6] nous allons construire des quasimodes de $T_N^{\alpha,\beta}$ comme superpositions pondérées d'états cohérents $\rho(z, k/2N + is)$ et nous verrons que l'équation de KdV va apparaître comme *équation de transport*.

Définissons, pour $\mu \in C^\infty(\mathbb{T})$, $\mu(x) = \sum_{k \in \mathbb{Z}} \mu_k e^{2\pi i k x}$,

$$\psi_\mu^k(z) = (4N)^{-1/4} \int_0^1 \rho(z, k/2N + is) \mu(s) e^{-2\pi N s^2} ds. \quad (15)$$

Le résultat suivant, conséquence du calcul symbolique "à la Töplitz" mais que l'on peut obtenir ici par un calcul direct, est le cœur de la preuve :

Théorème 2.1 *Pour tout $\mu, \mu' \in C^\infty(\mathbb{T})$ arbitraire,*

$$\langle \psi_\mu^k, \psi_{\mu'}^{k'} \rangle = \sum_{l \in \mathbb{Z}} \bar{\mu}_l \mu'_{l-k+k'} e^{-\pi l^2/2N} e^{-\pi(l-k+k')^2/2N}.$$

$$\text{En particulier} \quad \|\psi_\mu^k\|^2 = \sum_{l \in \mathbb{Z}} |\mu_l|^2 e^{-\pi l^2/N} \sim \|\mu\|_{L^2(\mathbb{T})}^2 \text{ quand } N \rightarrow +\infty.$$

De plus, si $T_N^{\alpha,\beta}$ est l'opérateur dont la matrice sur la base $\{\Theta_{2N-1}, \dots, \Theta_0\}$ est $L_N^{\alpha,\beta}$ et $\epsilon = 1/2N$,

$$T_N^{\alpha,\beta} \psi_\mu^k = \psi_{\mu^k}^k + O(\epsilon^3) \quad (16)$$

avec

$$\mu^k(x) = \left(-2 \cos(2\pi k \epsilon - i\epsilon \frac{d}{dx}) + \epsilon^2 \left(-2\alpha(x) \cos(2\pi k \epsilon - i\epsilon \frac{d}{dx}) + \beta(x) \right) \right) \mu(x).$$

On voit donc que ψ_μ^k sera un quasimode de $T_N^{\alpha,\beta}$ à l'ordre ϵ^3 si μ est lui-même un quasimode de l'opérateur

$$-2 \cos(2\pi k \epsilon - i\epsilon \frac{d}{dx}) + \epsilon^2 \left(-2\alpha(x) \cos(2\pi k \epsilon - i\epsilon \frac{d}{dx}) + \beta(x) \right).$$

Plusieurs comportements sont à envisager :

- milieu du spectre : pour $l = M_N + 1, \dots, N - 1 - M_N$ on a, pour les valeurs propres distinctes de $L_N^{0,0}$, toutes de multiplicité deux,

$$|\cos \pi(l+1)\epsilon - \cos \pi l \epsilon| \sim 4\pi(2M_N + 1)\epsilon^2 \geq \epsilon^{7/4} > \epsilon^2 \text{ quand } \epsilon \rightarrow 0,$$

et donc la théorie des perturbations (avec dégénérescence) s'applique. On montre facilement que la condition de moyenne nulle de α, β donne une correction au premier ordre qui est en fait d'ordre ϵ^∞ .

- les bords du spectre, pour $0 \leq k \leq 2M_N$ et $2N - 1 - 2M_N \leq k \leq 2N - 1$.

L'équation aux valeurs propres

$$\left(-2 \cos(2\pi k \epsilon - i\epsilon \frac{d}{dx}) + \epsilon^2 \left(-2\alpha(x) \cos(2\pi k \epsilon - i\epsilon \frac{d}{dx}) + \beta(x) \right) \right) \mu(x) = \lambda \mu(x)$$

devient, avec l'ansatz $\mu(x) = e^{-2i\pi kx}\nu_k(x)$ (resp. $e^{-2i\pi(k-N)x}\nu_k(x)$) pour k proche de 0 (resp. $2N-1$),

$$\epsilon^2 \left(-\frac{d^2}{dx^2} - 2\alpha(x) \pm \beta(x) \right) \nu_k = (2 \pm \lambda_k^N) \nu_k + O(\epsilon^3)$$

suivant le bord considéré. On reconnaît là les deux opérateurs de Hill H_{\pm} . Un argument de comptage montre qu'on obtient bien ainsi tout le spectre de $L_N^{\alpha,\beta}$, les phénomènes de dégénérescence étant responsables du terme supplémentaire en N^δ et la valeur de $M_N = [N^{1/4}]$ assurant l'uniformité de la transition entre les trois parties du spectre. Le Corollaire 1.2 se démontre grâce à l'uniformité des estimations semiclassiques par rapport aux normes *sup* des dérivées de symboles, et au fait que les normes *sup* restent bornés uniformément en temps lors de l'évolution par KdV [1].

2.3 Intégrabilité

La preuve du Théorème 1.3 repose sur le fait que l'on puisse écrire les discriminants $\Delta^N(\lambda)$ de la matrice de Jacobi L_N et ceux, $\Delta^\pm(\lambda)$, de H_\pm comme :

$$\Delta^N(\lambda)^2 - 4 = \prod_{j=0}^{2N-1} (\lambda_j^N - \lambda) \quad \text{et} \quad \Delta^\pm(\lambda)^2 - 4 = 4 \prod_{j \geq 0} \frac{\lambda_j^\pm - \lambda}{\pi_j^2},$$

$$\pi_j := \pi[(j+1)/2] \quad (j \geq 1), \quad \pi_0 = 1.$$

Soit $[\Lambda_1, \Lambda_2]$ un intervalle compact de \mathbb{R} avec $\Lambda_1 \leq 0 < \Lambda_2$. Le Théorème 1.3 est alors une conséquence du

Théorème 2.2 *Uniformément pour $\Lambda_1 \leq \lambda \leq \Lambda_2$,*

$$\lim_{N \rightarrow \infty} (-1)^N \Delta^N(-2 + \epsilon^2 \lambda) = \Delta^-(\lambda) \quad \text{et} \quad \lim_{N \rightarrow \infty} \Delta^N(2 - \epsilon^2 \lambda) = \Delta^+(\lambda), \quad (17)$$

et de la formule (12) pour les actions de Toda, ainsi que la formule suivante pour les variables actions I_n^\pm de H_\pm :

$$I_n^\pm = \frac{2}{\pi} \int_{\lambda_{2n-1}^\pm}^{\lambda_{2n}^\pm} \operatorname{arcosh} \left((-1)^n \frac{\Delta^\pm(\lambda)}{2} \right) d\lambda. \quad (18)$$

Références

- [1] D. Bambusi, T. Kappeler et T. Paul, en préparation.
- [2] D. Bambusi et A. Ponso, On metastability in FPU, *Comm. Math. Phys.* 264 (2006) 539–561.
- [3] A. Bloch, F. Golse, T. Paul et A. Uribe, Dispersionless Toda and Toeplitz operators, *Duke Math. J.* 117 (2003) 157-196.
- [4] H. Flaschka, The Toda lattice I. Existence of integrals, *Phys. Rev. B* 9 (1974) 1924-1925.
- [5] A. Henrici et T. Kappeler, Global Birkhoff coordinates for the periodic Toda lattice, *Nonlinearity* 21 (2008) 2731-2758.
- [6] T. Paul et A. Uribe, A construction of quasimodes using coherent states, *Ann. H. Poincaré Phys. Théo.* 59 (4) (1993) 357-382.

- [7] M. Toda, Theory of nonlinear lattices, 2d. edition, Springer Series on Solid-State Sciences 20, Springer (1989).
- [8] C. Wayne et G. Schneider, Counter-propagating waves on fluid surfaces and the continuum limit of the Fermi-Pasta-Ulam model, in International Conference on Differential Equations (Berlin 1999), World Sci. Publ. (2000) 390–404.