

# Inverse Coefficient Problems for a Parabolic Equation\*

Cui'e Xiao<sup>1</sup>, Youjun Xu<sup>2</sup>

<sup>1</sup>Department of Mathematics and Computation Sciences, Hunan City University, Yiyang

<sup>2</sup>College of Mathematic and Physics, University of South, Hengyang

Email: xiaocuie@163.com

Received: Mar. 26th, 2011; revised: Apr. 30th, 2011; accepted: May 5th, 2011.

**Abstract:** This paper is devoted to a class of inverse coefficient problems for a Parabolic Equation, We obtain an existence and uniqueness theorem of weak solutions. Using the theories of Schauder Fixed-Point Theorem, an existence theorem is established for the inverse coefficient problems solutions.

**Keywords:** Parabolic Equation; Inverse Coefficient Problems; Weak Solution; Existence; Uniqueness

## 抛物型方程的反系数问题研究\*

肖翠娥<sup>1</sup>, 许友军<sup>2</sup>

<sup>1</sup>湖南城市学院数学与计算科学系, 益阳

<sup>2</sup>南华大学数理学院, 衡阳

Email: xiaocuie@163.com

收稿日期: 2011年3月26日; 修回日期: 2011年4月30日; 录用日期: 2011年5月5日

**摘要:** 研究了一类抛物型方程的反系数问题, 利用变分方法获得了方程弱解的存在性与唯一性, 利用 Schauder 不动点定理得到了反系数问题解的存在性。

**关键词:** 抛物型方程; 反系数问题; 弱解; 存在性; 唯一性

### 1. 方程及基本假设

热传导方程是抛物型方程的典型代表, 有源函数的热传导方程是传热分析中最重要的一类方程, 研究方程弱解的存在性与唯一性以及研究未知系数解的存在性, 无论在理论研究还是在生产实际中都有非常重要的意义。主要讨论抛物型方程弱解问题, 以及仅依赖于空间变量的主系数反问题, 讨论未知系数解  $\{u(t, x), a(x)\}$  的存在性。关于此类方程反系数问题的研究已有一些理论成果, 具体可参见[1-7]。

设  $Q_T = [0, T] \times [0, l]$ , 考虑如下抛物型方程:

$$u_t - (a(x)u_x)_x - (b(x)u)_x + d(t, x)u = f(t, x) \quad (1)$$

其初始条件为

$$u(0, x) = 0, x \in [0, l] \quad (2)$$

边界条件

$$\begin{cases} u(t, 0) = u(t, l) = 0, t \in [0, T] \\ a(0)u_x(t, 0) = 0 \end{cases} \quad (3)$$

附加条件

$$\int_0^T u(t, x)\chi(t)dt = \varphi(x), x \in [0, l]. \quad (4)$$

假设(1)~(4)中出现的函数, 满足下列条件:

(A)  $0 \leq \chi_1 \leq \chi(t) \leq \chi_2, -\chi^* \leq \chi'(t) \leq -\chi^{**} < 0, t \in [0, T];$

(B)  $b(x) \in C([0, l]), |b(x)| \leq K_b, x \in [0, l];$

(C)  $d(t, x) \in C(Q_T), 0 < d_1 \leq d(t, x) \leq d_2, (t, x) \in Q_T;$

(D)  $f \in C(Q_T), 0 \leq f_1 \leq f(t, x) \leq f_2, (t, x) \in Q_T;$

(E)  $\varphi(x) \in C([0, l]), \varphi(0) = \varphi(l) = 0, \varphi(x) \geq 0, -\varphi_2 \leq \varphi'(x) \leq -\varphi_1 < 0, |\varphi(x)| \leq \varphi^*, x \in [0, l],$

这里  $\varphi_1, \varphi_2, \varphi^*, \chi_2, f_2 = \text{const} > 0,$

$\chi_1, \chi^*, \chi^{**}, f_1, K_b, d_1, d_2 = \text{const} \geq 0,$

\*基金项目: 湖南省教育厅科研基金资助项目(09C852); 湖南省科学技术厅科技计划资助项目(2011FJ6029)。

此外, 设  $F(x, T) = \int_0^T \int_0^x f(t, y) \chi(t) dy dt$ ,

$$K_\chi = \max\{\chi^*, \chi^{**}\} \quad F_1(T) = \inf_{x \in [0, l]} F(x, T),$$

$$F_2(T) = \sup_{x \in [0, l]} F(x, T),$$

$$M(\delta) = \{a(x) \in C([0, l]) : a(x) \geq \delta > 0\},$$

$$M(\delta_1, \delta_2) = \{a(x) \in C([0, l]) : 0 < \delta_1 \leq a(x) \leq \delta_2\}.$$

## 2. 正问题弱解的存在性与唯一性

**定理 1** 设  $a(x) \in M(\delta_1)$ , 若条件(B)~(D)满足, 则正问题(1)~(4)存在唯一广义解  $u \in W_p^{1,1}(Q_T)$ ,  $p > 2$ , 且存在正数  $M$ , 使得:

$$\|u\|_{C([0, T], L^2[0, l])} \leq C \|f\|_{L^2(Q_T)} = M \text{ 成立.} \quad (5)$$

**证明:** 正问题存在性与唯一性证明可参见[8,9]。下证有界性估计。

只证明  $d(t, x)$  有充分大的正下界  $d_1$  情形, 否则作变换  $u = e^{rt} v$ , 其中,  $r$  充分大。

方程(1)左右两边乘以  $u(t, x)$  并且从 0 到  $t$  这里  $0 < t \leq T$ , 以及 0 到  $l$  积分,

$$\begin{aligned} & \int_0^t \int_0^l (u_t - (a(x)u_x)_x - (b(x)u)_x + d(s, x)u) u dx ds \\ &= \int_0^t \int_0^l f u dx ds \end{aligned}$$

分部积分可得:

$$\begin{aligned} & \int_0^t \frac{u^2}{2} \Big|_{(t,x)} dx + \int_0^t \int_0^l a(x) u_x^2 dx ds + \int_0^t \int_0^l b(x) u u_x dx ds \\ &+ \int_0^t \int_0^l d(s, x) u^2 dx ds = \int_0^t \int_0^l f u dx ds \end{aligned}$$

由 Young 不等式及条件(B)

$$\left| \int_0^t \int_0^l b(x) u u_x dx ds \right| \leq \frac{\delta_1}{2} \int_0^t \int_0^l u_x^2 dx ds + \frac{K_b^2}{2\delta_1} \int_0^t \int_0^l u^2 dx ds,$$

从而

结合(2)~(4)、条件(E), 我们有

$$a(x) = \frac{1}{-\varphi'(x)} \left[ -\int_0^T \int_0^x u_t \chi(t) dy dt - \int_0^T \int_0^x d(t, y) \chi(t) u dy dt + b(x) \varphi(x) + F(x, T) \right]$$

从而

$$a(x) = \frac{1}{-\varphi'(x)} \left[ \int_0^T \int_0^x u \chi'(t) dy dt - \int_0^T \int_0^x d(t, y) \chi(t) u dy dt + b(x) \varphi(x) - \chi(T) \int_0^x u(T, y) dy + F(x, T) \right]. \quad (7)$$

在集  $M(\delta_1, \delta_2)$  上, 引进算子  $B: M(\delta_1, \delta_2) \rightarrow C([0, l])$

$$B(a) := \frac{1}{-\varphi'(x)} \left[ \int_0^T \int_0^x u \chi'(t) dy dt - \int_0^T \int_0^x d(t, y) \chi(t) u dy dt + b(x) \varphi(x) - \chi(T) \int_0^x u(T, y) dy + F(x, T) \right], \quad (8)$$

$$\int_0^t \int_0^l b(x) u u_x dx ds \geq -\frac{\delta_1}{2} \int_0^t \int_0^l u_x^2 dx ds - \frac{K_b^2}{2\delta_1} \int_0^t \int_0^l u^2 dx ds.$$

由已知条件, 方程左边有

$$\begin{aligned} & \int_0^t \frac{u^2}{2} \Big|_{(t,x)} dx + \int_0^t \int_0^l a(x) u_x^2 dx ds + \int_0^t \int_0^l b(x) u u_x dx ds \\ &+ \int_0^t \int_0^l d(t, x) u^2 dx ds \\ &\geq \int_0^t \frac{u^2}{2} \Big|_{(t,x)} dx + \frac{\delta_1}{2} \int_0^t \int_0^l u_x^2 dx ds \\ &+ (d_1 - \frac{K_b^2}{2\delta_1}) \int_0^t \int_0^l u^2 dx ds \end{aligned}$$

而方程右边有

$$\int_0^t \int_0^l f u dx ds \leq C \int_0^T \int_0^l f^2 dx ds + \frac{d_1}{2} \int_0^t \int_0^l u^2 dx ds,$$

因此,

$$\begin{aligned} & \int_0^t \frac{u^2}{2} \Big|_{(t,x)} dx + \frac{\delta_1}{2} \int_0^t \int_0^l u_x^2 dx ds \\ &\leq C \int_0^T \int_0^l f^2 dx ds + \left( \frac{K_b^2}{2\delta_1} - \frac{d_1}{2} \right) \int_0^t \int_0^l u^2 dx ds \end{aligned}$$

从而, 由 Gronwall 不等式可得

$$\begin{aligned} & \int_0^t u^2(t, x) dx + \int_0^t \int_0^l u_x^2 dx ds \\ &+ \int_0^t \int_0^l u^2 dx ds \leq M, \quad \forall t \in [0, T] \end{aligned} \quad (6)$$

定理证毕。

## 3. 反系数问题解的存在性

我们的目标是寻找未知函数  $a(x)$ , 假设  $a(x) \in M(\delta)$  是任意的, 在方程(1)左右两边乘以  $\chi(t)$  并且从 0 到  $T$  以及 0 到  $x$  积分,

$$\begin{aligned} & \int_0^T \int_0^x (u_t - (a(y)u_y)_y - (b(y)u)_y + d(t, y)u) \chi(t) dy dt \\ &= \int_0^T \int_0^x f(t, y) \chi(t) dy dt \end{aligned}$$

这里  $u(t, x)$  是正问题(1)~(4)与系数  $a(x)$  相对应的解。因此, 关系式(7)可改写成算子方程

$$a = B(a)。 \tag{9}$$

**定理 2** 若条件(A)~(E)满足, 则  $\{u(t, x), a(x)\}$  是问题(1)~(4)的广义解, 当且仅当  $\{u(t, x), a(x)\}$  满足关系式(1)~(4), (9)。

$$-\tilde{\varphi}' \tilde{a}(x) = \left[ \int_0^T \int_0^x \tilde{u} \chi'(t) dy dt - \int_0^T \int_0^x d(t, y) \chi(t) \tilde{u} dy dt + b(x) \tilde{\varphi}(x) - \chi(T) \int_0^x \tilde{u}(T, y) dy + F(x, T) \right]。 \tag{10}$$

另一方面,  $\tilde{a}(x)$  满足(9), 考虑算子  $B$  的定义, 则有

$$-\varphi' B(\tilde{a})(x) = -\varphi' \tilde{a}(x) = \left[ \int_0^T \int_0^x \tilde{u} \chi'(t) dy dt - \int_0^T \int_0^x d(t, y) \chi(t) \tilde{u} dy dt + b(x) \varphi(x) - \chi(T) \int_0^x \tilde{u}(T, y) dy + F(x, T) \right]。 \tag{11}$$

上面两式相减, 在  $[0, l]$  上有

$$(\tilde{\varphi} - \varphi)' = \frac{b(x)}{\tilde{a}(x)} (\tilde{\varphi} - \varphi)。$$

因为,  $\tilde{\varphi}(0) = \varphi(0)$ , 从而可推出在  $[0, l]$  上  $\tilde{\varphi} = \varphi$ 。因此,  $(\tilde{u}(t, x), \tilde{a}(x))$  是问题(1)~(4)的广义解, 定理证毕。

**定理 3** 若条件(A)~(E)成立, 且假设

$$0 < F_1(T) - K_b \varphi^* - (TIM)^{\frac{1}{2}} (K_\chi + d_2 \chi_2) - \chi_2 (IM)^{\frac{1}{2}},$$

则一定存在正数  $a_1, a_2$ , 使得  $0 < a_1 \leq B(a) \leq a_2$ 。

**证明:** 根据(8)式, 我们有

$$\begin{aligned} -\varphi'(x) B(a)(x) &= \int_0^T \int_0^x u \chi'(t) dy dt \\ &\quad - \int_0^T \int_0^x d(t, y) \chi(t) u dy dt + b(x) \varphi(x) \\ &\quad - \chi(T) \int_0^x u(T, y) dy + F(x, T) \end{aligned} \tag{12}$$

利用已知条件(A)~(E)有

$$\begin{aligned} -\varphi'(x) B(a)(x) &\leq (Tl)^{\frac{1}{2}} (K_\chi + d_2 \chi_2) \left( \int_0^T \int_0^x u^2 dy dt \right)^{\frac{1}{2}} \\ &\quad + K_b \varphi^* + \chi_2 l^{\frac{1}{2}} \left( \int_0^x u^2(T, y) dy \right)^{\frac{1}{2}} + F_2(T), \end{aligned}$$

从而有

$$\begin{aligned} \varphi_1 B(a)(x) &\leq (Tl)^{\frac{1}{2}} (K_\chi + d_2 \chi_2) \left( \int_0^T \int_0^x u^2 dy dt \right)^{\frac{1}{2}} \\ &\quad + K_b \varphi^* + \chi_2 l^{\frac{1}{2}} \left( \int_0^x u^2(T, y) dy \right)^{\frac{1}{2}} + F_2(T) \end{aligned}$$

利用估计式(6), 进一步可得

$$\begin{aligned} \varphi_1 B(a) &\leq F_2(T) + K_b \varphi^* \\ &\quad + (TIM)^{\frac{1}{2}} (K_\chi + d_2 \chi_2) + \chi_2 (IM)^{\frac{1}{2}}, \end{aligned}$$

**证明:** 必要性在(9)关系式导出过程中已证。下证充分性:

令  $\tilde{a}(x) \in M(\delta_1, \delta_2)$  是方程(9)的解,  $\tilde{u}(t, x)$  是相应于  $\tilde{a}(x)$  正问题(1)~(4)的解, 设

$$\tilde{\varphi}(x) = \int_0^T \tilde{u}(t, x) \chi(t) dt, \quad x \in [0, l],$$

则

取

$$a_2 = \varphi_1^{-1} \left( F_2(T) + K_b \varphi^* + (TIM)^{\frac{1}{2}} (K_\chi + d_2 \chi_2) + \chi_2 (IM)^{\frac{1}{2}} \right),$$

有  $\varphi_1 B(a) \leq \varphi_1 a_2$ ,

从而

$$B(a) \leq a_2。 \tag{13}$$

类似(12)的推导, 利用已知条件, 由(12)可得

$$\begin{aligned} \varphi_2 B(a)(x) &\geq -(Tl)^{\frac{1}{2}} (|\chi^*| + d_2 \chi_2) \left( \int_0^T \int_0^x u^2 dy dt \right)^{\frac{1}{2}} \\ &\quad - K_b \varphi^* - \chi_2 l^{\frac{1}{2}} \left( \int_0^x u^2(T, x) dy \right)^{\frac{1}{2}} + F_1(T), \end{aligned}$$

从而

$$\begin{aligned} \varphi_2 B(a) &\geq F_1(T) - K_b \varphi^* \\ &\quad - (TIM)^{\frac{1}{2}} (K_\chi + d_2 \chi_2) - \chi_2 (IM)^{\frac{1}{2}} \end{aligned} \tag{14}$$

取

$$a_1 = \varphi_2^{-1} \left( F_1(T) - K_b \varphi^* - (TIM)^{\frac{1}{2}} (K_\chi + d_2 \chi_2) - \chi_2 (IM)^{\frac{1}{2}} \right),$$

由(14)及定理假设, 有

$$B(a) \geq a_1 > 0。 \tag{15}$$

定理证毕。

**定理 4** 若条件(B)~(C)成立, 则算子

$B: M(a_1, a_2) \rightarrow C([0, l])$  是连续映射。

**证明** 令  $a^{(1)}(x), a^{(2)}(x) \in M(a_1, a_2)$ , 其相应的广义解为  $u^{(1)}(t, x), u^{(2)}(t, x)$ 。

令  $v(t, x) = u^{(1)}(t, x) - u^{(2)}(t, x)$ ,

$\hat{a}(x) = a^{(1)}(x) - a^{(2)}(x)$ , 则  $v(0, x) = 0, x \in [0, l]$ ,

$$\begin{aligned} & \left(u^{(1)} - u^{(2)}\right)_t - \left(a^{(1)}(x)u_x^{(1)} - a^{(2)}(x)u_x^{(2)}\right)_x \\ & - \left(b(x)(u^{(1)} - u^{(2)})\right)_x \\ & + d(t, x)(u^{(1)} - u^{(2)}) = 0, \end{aligned}$$

即

$$\begin{aligned} & v_t - \left(a^{(1)}(x)v_x\right)_x - \left(b(x)v\right)_x \\ & + d(t, x)v = \left(\hat{a}(x)u_x^{(2)}\right)_x. \end{aligned}$$

上式两边积分可得

$$\begin{aligned} & \int_0^t \int_0^l \left(v_s - \left(a^{(1)}(x)v_x\right)_x - \left(b(x)v\right)_x + d(s, x)v\right) v dx ds \\ & = \int_0^t \int_0^l \left(\hat{a}(x)u_x^{(2)}\right)_x v dx ds. \end{aligned}$$

再分部积分后, 有

$$\begin{aligned} & \int_0^t \frac{v^2}{2} \Big|_{(t,x)} dx + \int_0^t \int_0^l a^{(1)}(x)v_x^2 dx ds \\ & + \int_0^t \int_0^l d(s, x)v^2 dx ds \\ & + \int_0^t \int_0^l b(x)v v_x dx ds \\ & = - \int_0^t \int_0^l \hat{a}(x)u_x^{(2)}v_x dx ds. \end{aligned} \quad (16)$$

由 Young 不等式及条件(B)

$$\begin{aligned} & \left| \int_0^t \int_0^l b(x)v v_x dx dt \right| \leq \frac{a_1}{2} \int_0^t \int_0^l v_x^2 dx dt \\ & + \frac{K_b^2}{2a_1} \int_0^t \int_0^l v^2 dx dt \end{aligned} \quad (17)$$

再根据算子  $B$  的定义,

$$\begin{aligned} & \left| B(a^{(1)}) - B(a^{(2)}) \right| = \left| \frac{1}{-\varphi'(x)} \int_0^T \int_0^x (u^{(1)} - u^{(2)}) \chi'(t) dy dt - \int_0^T \int_0^x d(t, x) \chi(t) (u^{(1)} - u^{(2)}) dy dt \right| \\ & + \left| -\chi(T) \int_0^x (u^{(1)}(T, y) - u^{(2)}(T, y)) dy \right| \\ & \leq C \left[ \int_0^T \int_0^x (u^{(1)} - u^{(2)}) dy dt + \int_0^x |u^{(1)}(T, y) - u^{(2)}(T, y)| dy \right] \leq C \left[ \int_0^T \int_0^x v^2 dy dt + \int_0^x v^2(T, y) dy \right] \end{aligned}$$

结合式(18), Gronwall 不等式以及  $v(0, x) = 0, x \in [0, l]$  可知:

$$\text{当 } \|a^{(1)} - a^{(2)}\|_{C([0,l])} \rightarrow 0 \text{ 时,}$$

$$\text{有 } \|B(a^{(1)}) - B(a^{(2)})\|_{C([0,l])} \rightarrow 0.$$

定理证毕。

**定理 5** 若条件(A)~(E)成立, 则存在  $a(x) \in M(a_1, a_2)$ , 使得  $B(a) = a$ 。

**证明:** 假设  $a(x) \in M(a_1, a_2)$ ,  $u(t, x)$  为  $a(x)$  所对应

结合条件(C), 并利用(17), 则(16)左边满足不等式:

$$\begin{aligned} & \int_0^t \frac{v^2}{2} \Big|_{(t,x)} dx + \int_0^t \int_0^l a^{(1)}(x)v_x^2 dx ds \\ & + \int_0^t \int_0^l d(s, x)v^2 dx ds + \int_0^t \int_0^l b(x)v v_x dx ds \\ & \geq \int_0^t \frac{v^2}{2} \Big|_{(t,x)} dx + \frac{a_1}{2} \int_0^t \int_0^l v_x^2 dx ds \\ & + \left( d_1 - \frac{K_b^2}{2a_1} \right) \int_0^t \int_0^l v^2 dx ds. \end{aligned}$$

而(16)右边满足不等式:

$$\begin{aligned} & - \int_0^t \int_0^l \hat{a}(x)u_x^{(2)}v_x dx ds \leq \left| \int_0^t \int_0^l \hat{a}(x)u_x^{(2)}v_x dx ds \right| \\ & \leq C \int_0^T \int_0^l \left| \hat{a}(x)u_x^{(2)} \right|^2 dx dt \\ & + \frac{a_1}{4} \int_0^t \int_0^l |v_x|^2 dx ds \\ & \leq C \left\| \hat{a}(x) \right\|_{C([0,l])}^2 \int_0^T \int_0^l |u_x^{(2)}|^2 dx dt \\ & + \frac{a_1}{4} \int_0^t \int_0^l |v_x|^2 dx ds \end{aligned}$$

因此

$$\begin{aligned} & \int_0^t \frac{v^2}{2} \Big|_{(t,x)} dx + \frac{a_1}{4} \int_0^t \int_0^l v_x^2 dx dt \\ & + \left( d_1 - \frac{K_b^2}{2a_1} \right) \int_0^t \int_0^l v^2 dx dt \\ & \leq C \left\| \hat{a}(x) \right\|_{C([0,l])}^2 \int_0^T \int_0^l |u_x^{(2)}|^2 dx dt \end{aligned} \quad (18)$$

的正问题的解。由前面讨论知  $u(x, t) \in W_p^{1,1}(Q_T)$ , 又因为  $p > 2$ , 由嵌入定理<sup>[10]</sup>可知

$$u(t, x) \in C^{0,\alpha}(Q_T), \quad 0 < \alpha < 1 - \frac{2}{p}.$$

由定理 2~定理 4,  $B: M(a_1, a_2) \rightarrow M(a_1, a_2)$  是到自身的连续映射。又因为  $C^{0,\alpha}(Q_T)$  紧嵌入到  $C(Q_T)$ , 由  $B$  算子的定义可知  $B$  是由  $M(a_1, a_2)$  映到自身的全连续算子。从而由 Schauder 不动点定理可知则存在  $a(x) \in M(a_1, a_2)$ , 使得  $B(a) = a$ 。定理证毕。

## 参考文献 (References)

- [1] V. L. Kamynin, A. B. Kostin. Two inverse problems of finding a coefficient in a parabolic equation. *Differential Equations*, 2010, 46(3): 375-386.
- [2] V. L. kamynin. On the inverse of determining the leading coefficient in parabolic equations. *Matematicheskie Zimetki*, 2008, 84(1): 48-58.
- [3] Z.-C. Deng, L. Yang, J.-N. Yu, and G.-W. Luo. Identifying the radiative coefficient of an evolutionary type heat conduction equation by optimization method. *Journal of Mathematical Analysis and Applications*, 2010, 362(1): 210-223.
- [4] A. I. Prilepko, D. S. Tkachenko. Well-posedness of the inverse source problem for parabolic systems. *Differential Equations*, 2004, 40(11): 1619-1626.
- [5] Z. H. Liu. Identification of parameters in semilinear parabolic equations. *Acta Mathematica Scientia*, 1999, 19(2): 175-180.
- [6] A. G. Fatullayev, S. Cula. An iterative procedure for determining an unknown spacewise-dependent coefficient in a parabolic equation. *Applied Mathematics Letters*, 2009, 22(7): 1033-1037.
- [7] W. H. Yu. *Inverse problems in partial differential equations*. Tianjin: Nankai University, 1989.
- [8] 王术. *Sobolev 空间与偏微分方程引论*[M]. 北京: 科学出版社, 2009: 210-214.
- [9] 伍卓群, 尹景学, 王春朋. *椭圆与抛物型方程引论*[M]. 北京: 科学出版社, 2003.
- [10] E. Zeidler. *Nonlinear functional analysis and its applications II A/B*. New York: Springer, 1990.