

7 - Il Teorema di Separazione

≡ Definizione: Sub-additività, Positiva omogeneità

Sia E uno spazio vettoriale.

Una funzione $f : E \rightarrow \mathbb{R}$ si dice:

- **sub-additiva**, quando $f(\mathbf{x} + \mathbf{y}) \leq f(\mathbf{x}) + f(\mathbf{y})$ per ogni $\mathbf{x}, \mathbf{y} \in E$;
- **positivamente omogenea**, quando $f(\lambda \mathbf{x}) = \lambda f(\mathbf{x})$ per ogni $\mathbf{x} \in E$ e per ogni $\lambda \geq 0$.

📄 Lemma 7.1: Lemma di estensione

Sia E uno spazio vettoriale.

Sia $F \subseteq E$ un sottospazio vettoriale.

Sia $\mathbf{x}_0 \in E \setminus F$.

Sia $G = \text{span}(F \cup \{\mathbf{x}_0\})$.

Sia $\varphi : F \rightarrow \mathbb{R}$ un funzionale lineare.

Sia $f : G \rightarrow \mathbb{R}$ una funzione sub-additiva e positivamente omogenea.

Si supponga che $\varphi(\mathbf{x}) \leq f(\mathbf{x})$ per ogni $\mathbf{x} \in F$.

Allora, esiste $\psi : G \rightarrow \mathbb{R}$ funzionale lineare tale che $\psi|_F = \varphi$ e $\psi(\mathbf{x}) \leq f(\mathbf{x})$ per ogni $\mathbf{x} \in G$.

🔍 Osservazioni preliminari

1. Siano $A, B \subseteq \mathbb{R}$ due insiemi separati, con $a \leq b$ per ogni $a \in A$ e per ogni $b \in B$.
Allora, $\sup(A) \leq \inf(B)$.

2. Si ha $G = F + \text{span}(\mathbf{x}_0) = \{\mathbf{u} + \lambda \mathbf{x}_0 \mid \mathbf{u} \in F, \lambda \in \mathbb{R}\}$, e tale scrittura è unica in quanto $F \cap \text{span}(\mathbf{x}_0) = \{\mathbf{0}\}$.

3. Siano $\mathbf{u}, \mathbf{v} \in G$, e siano $h, k \in \mathbb{R}$.

Sia $\mathbf{u} = \mathbf{x}_u + \lambda_u \mathbf{x}_0$ e $\mathbf{v} = \mathbf{x}_v + \lambda_v \mathbf{x}_0$; tali scritture sono uniche per l'osservazione preliminare 2.

Si ha $h\mathbf{u} + k\mathbf{v} = \underbrace{h\mathbf{x}_u + k\mathbf{x}_v}_{\in F} + \underbrace{(h\lambda_u + k\lambda_v)\mathbf{x}_0}_{\in \mathbb{R}}$, da cui segue

$\mathbf{x}_{h\mathbf{u}+k\mathbf{v}} = h\mathbf{x}_u + k\mathbf{x}_v$ e $\lambda_{h\mathbf{u}+k\mathbf{v}} = h\lambda_u + k\lambda_v$, sempre per unicità della scrittura degli elementi di G data dall'osservazione preliminare 2.

Dimostrazione

Siano $\mathbf{x}, \mathbf{y} \in F$.

Per le proprietà di φ ed f , si ha

$$\begin{aligned} \varphi(\mathbf{x}) + \varphi(\mathbf{y}) &= \varphi(\mathbf{x} + \mathbf{y}) && \text{Linearità di } \varphi \\ &\leq f(\mathbf{x} + \mathbf{y}) && \text{Poiché } \mathbf{x} + \mathbf{y} \in F \text{ e } f \text{ maggiora } \varphi \text{ in } F \\ &= f((\mathbf{x} - \mathbf{x}_0) + (\mathbf{x}_0 + \mathbf{y})) \leq f(\mathbf{x} - \mathbf{x}_0) + f(\mathbf{x}_0 + \mathbf{y}) && \text{Per subadditività di } f \end{aligned}$$

Dal primo e dall'ultimo membro della catena di disuguaglianze segue allora che

$$\varphi(\mathbf{y}) - f(\mathbf{x}_0 + \mathbf{y}) \leq f(\mathbf{x} - \mathbf{x}_0) - \varphi(\mathbf{x}) \text{ per ogni } \mathbf{x}, \mathbf{y} \in F.$$

Ciò significa che gli insiemi $A = \{\varphi(\mathbf{y}) - f(\mathbf{x}_0 + \mathbf{y}) \mid \mathbf{y} \in F\}$ e $B = \{f(\mathbf{x} - \mathbf{x}_0) - \varphi(\mathbf{x}) \mid \mathbf{x} \in F\}$ sono separati; in particolare, si ha $\sup(A) \leq \inf(B)$ per l'osservazione preliminare 1.

Sia $r \in \mathbb{R}$ tale che $\sup(A) \leq r \leq \inf(B)$.

Sia $\mathbf{u} \in G$; si ha $\mathbf{u} = \mathbf{x}_u + \lambda_u \mathbf{x}_0$ per unici $\mathbf{x}_u \in F$ e $\lambda_u \in \mathbb{R}$, per l'osservazione preliminare 2.

Si definisca allora $\psi : G \rightarrow \mathbb{R}$ definita ponendo $\psi(\mathbf{u}) = \varphi(\mathbf{x}_{\mathbf{u}}) - \lambda_{\mathbf{u}}r$ per ogni $\mathbf{u} \in G$.

Si provi che ψ soddisfa le proprietà espresse nella tesi.

Vale $\psi|_F = \varphi$; infatti, per ogni $\mathbf{u} \in F$ si ha $\mathbf{u} = \mathbf{u} + 0\mathbf{x}_0$, dunque $\mathbf{x}_{\mathbf{u}} = \mathbf{u}$ e $\lambda_{\mathbf{u}} = 0$ per unicità della scrittura degli elementi di G .

ψ è un funzionale lineare; infatti, per ogni $\mathbf{u}, \mathbf{v} \in G$ e per ogni $h, k \in \mathbb{R}$, si ha $\mathbf{x}_{h\mathbf{u}+k\mathbf{v}} = h\mathbf{x}_{\mathbf{u}} + k\mathbf{x}_{\mathbf{v}}$ e $\lambda_{h\mathbf{u}+k\mathbf{v}} = h\lambda_{\mathbf{u}} + k\lambda_{\mathbf{v}}$ per l'osservazione preliminare 3.

Allora, $\psi(h\mathbf{u} + k\mathbf{v}) = \varphi(h\mathbf{x}_{\mathbf{u}} + k\mathbf{x}_{\mathbf{v}}) - (h\lambda_{\mathbf{u}} + k\lambda_{\mathbf{v}})r$; sfruttando la linearità di φ si ottiene $\psi(h\mathbf{u} + k\mathbf{v}) = h(\varphi(\mathbf{x}_{\mathbf{u}}) - \lambda_{\mathbf{u}}r) + k(\varphi(\mathbf{x}_{\mathbf{v}}) - \lambda_{\mathbf{v}}r) = h\psi(\mathbf{u}) + k\psi(\mathbf{v})$, che mostra la linearità di ψ .

Resta da provare che $\psi(\mathbf{u}) \leq f(\mathbf{u})$ per ogni $\mathbf{u} \in G$

Sia dunque $\mathbf{u} \in G$.

Si può supporre $\mathbf{u} \notin F$ senza perdere di generalità, in quanto se $\mathbf{u} \in F$ si ha $\psi(\mathbf{u}) = \varphi(\mathbf{u}) \leq f(\mathbf{u})$ in quanto $\psi|_F = \varphi$ e f migliora φ in F .

Sia quindi $\mathbf{u} \in G \setminus F$; si ha $\mathbf{u} = \mathbf{x}_{\mathbf{u}} + \lambda_{\mathbf{u}}\mathbf{x}_0$, per unici $\mathbf{x}_{\mathbf{u}} \in F$ e $\lambda_{\mathbf{u}}$.

Essendo $\mathbf{u} \notin F$, si ha $\lambda_{\mathbf{u}} \neq 0$.

Si supponga $\lambda_{\mathbf{u}} > 0$.

Si consideri $\frac{\mathbf{x}_{\mathbf{u}}}{\lambda_{\mathbf{u}}} \in F$; si ha

$$\varphi\left(\frac{\mathbf{x}_{\mathbf{u}}}{\lambda_{\mathbf{u}}}\right) - f\left(\mathbf{x}_0 + \frac{\mathbf{x}_{\mathbf{u}}}{\lambda_{\mathbf{u}}}\right) \leq r \quad \text{Essendo } r \text{ maggiorante dell'insieme } A \text{ ed essendo } \frac{\mathbf{x}_{\mathbf{u}}}{\lambda_{\mathbf{u}}} \in F$$

$$\implies \varphi(\mathbf{x}_{\mathbf{u}}) - f(\lambda_{\mathbf{u}}\mathbf{x}_0 + \mathbf{x}_{\mathbf{u}}) \leq \lambda_{\mathbf{u}}r \quad \text{Moltiplicando per } \lambda_{\mathbf{u}} \text{ ambo i membri, sfruttando la linearità di } \varphi \text{ e la positiva omogeneità di } f, \text{ essendo } \lambda_{\mathbf{u}} > 0 \text{ nel caso in esame}$$

$$\implies \varphi(\mathbf{x}_{\mathbf{u}}) - \lambda_{\mathbf{u}}r \leq f(\lambda_{\mathbf{u}}\mathbf{x}_0 + \mathbf{x}_{\mathbf{u}})$$

$$\implies \psi(\mathbf{u}) \leq f(\mathbf{u}) \quad \text{Per scrittura di } \mathbf{u} \text{ e per definizione di } \psi$$

Si supponga ora $\lambda_{\mathbf{u}} < 0$.

Si consideri $\frac{\mathbf{x}_{\mathbf{u}}}{-\lambda_{\mathbf{u}}} \in F$; si ha

$$r \leq f\left(\frac{\mathbf{x}_u}{-\lambda_u} - \mathbf{x}_0\right) - \varphi\left(\frac{\mathbf{x}_u}{-\lambda_u}\right) \quad \text{Essendo } r \text{ minorante dell'insieme } B \text{ ed essendo } \frac{\mathbf{x}_u}{-\lambda_u} \in F$$

$$\implies -\lambda_u r \leq f(\mathbf{x}_u + \lambda_u \mathbf{x}_0) - \varphi(\mathbf{x}_u) \quad \text{Moltiplicando per } -\lambda_u \text{ ambo i membri, sfruttando la linearità di } \varphi \text{ e la}$$

positiva omogeneità di f , essendo $-\lambda_u > 0$ nel caso in esame

$$\implies \varphi(\mathbf{x}_u) - \lambda_u r \leq f(\mathbf{x}_u + \lambda_u \mathbf{x}_0)$$

$$\implies \psi(\mathbf{u}) \leq f(\mathbf{u}) \quad \text{Per scrittura di } \mathbf{u} \text{ e per definizione di } \psi$$

■

Teorema 7.2: Teorema di Hahn-Banach

Sia E uno spazio vettoriale.

Sia $F \subseteq E$ un sottospazio vettoriale di E

Sia $\varphi : F \rightarrow \mathbb{R}$ un funzionale lineare.

Sia $f : E \rightarrow \mathbb{R}$ una funzione sub-additiva e positivamente omogenea.

Si supponga che $\varphi(\mathbf{x}) \leq f(\mathbf{x})$ per ogni $\mathbf{x} \in F$.

Allora, esiste $\psi : E \rightarrow \mathbb{R}$ funzionale lineare tale che $\psi|_F = \varphi$ e $\psi(\mathbf{x}) \leq f(\mathbf{x})$ per ogni $x \in E$.

Dimostrazione

Si consideri il seguente insieme:

$$\mathcal{S} = \left\{ (G, \eta) \mid \begin{array}{l} G \subseteq E \text{ sottospazio vettoriale di } E, \\ \eta : G \rightarrow \mathbb{R} \text{ funzionale lineare : } \eta|_F = \varphi \quad \wedge \quad \forall \mathbf{x} \in G, \eta(\mathbf{x}) \leq f(\mathbf{x}) \end{array} \right\}$$

.

Si introduca su tale insieme la relazione d'ordine \preceq definita ponendo

$(G_1, \eta_1) \preceq (G_2, \eta_2)$ quando $G_1 \subseteq G_2$ e $\eta_2|_{G_1} = \eta_1$.

Si provi che l'insieme ordinato (\mathcal{S}, \preceq) ammette un elemento massimale, tramite il lemma di Zorn.
Intanto, $\mathcal{S} \neq \emptyset$ in quanto $(F, \varphi) \in \mathcal{S}$.

Sia $\mathcal{C} = \{(G_i, \eta_i)\}_{i \in \mathcal{I}} \subseteq \mathcal{S}$ una catena in \mathcal{S} ; si mostri che essa ammette maggiorante in \mathcal{S} .

Sia $G = \bigcup_{i \in \mathcal{I}} G_i$, e si definisca $\eta : G \rightarrow \mathbb{R}$ ponendo, per ogni $\mathbf{u} \in G$, $\eta(\mathbf{u}) = \eta_i(\mathbf{u})$, con $i \in \mathcal{I}$ tale che $\mathbf{u} \in G_i$.

Si mostri che $(G, \eta) \in \mathcal{S}$.

Q Osservazione preliminare

Si osserva intanto che, per ogni $\mathbf{u}, \mathbf{v} \in G$, esiste $i \in \mathcal{I}$ tale che $\mathbf{u}, \mathbf{v} \in G_i$.

Infatti, essendo $\mathbf{u}, \mathbf{v} \in G$ si ha $\mathbf{u} \in G_{i_1}$ e $\mathbf{v} \in G_{i_2}$ per qualche $i_1, i_2 \in \mathcal{I}$.

Essendo $\{(G_i, \eta_i)\}_{i \in \mathcal{I}}$ una catena, essa è totalmente ordinata rispetto a \preceq , per cui si ha $G_{i_1} \subseteq G_{i_2}$ oppure $G_{i_2} \subseteq G_{i_1}$, da cui seguono rispettivamente $\mathbf{u} + \mathbf{v} \in G_{i_1}$ oppure $\mathbf{u} + \mathbf{v} \in G_{i_2}$.

Fatta questa osservazione, si proceda con la dimostrazione.

Per quanto concerne G si ha evidentemente $G \subseteq E$;

G è un sottospazio vettoriale di E . Infatti, fissati $\mathbf{u}, \mathbf{v} \in G$, sia $i \in \mathcal{I}$ per cui $\mathbf{u}, \mathbf{v} \in G_i$, che esiste per l'osservazione preliminare; ne viene che $\mathbf{u} + \mathbf{v} \in G_i \subseteq G$ essendo G_i uno spazio vettoriale.

Per quanto concerne η , essa è intanto ben definita.

Infatti, sia $\mathbf{u} \in G$, e siano $i_1, i_2 \in \mathcal{I}$ tali che $\mathbf{u} \in G_{i_1}$ e $\mathbf{u} \in G_{i_2}$;

essendo $\{(G_i, \eta_i)\}_{i \in \mathcal{I}}$ una catena, essa è totalmente ordinata rispetto a \preceq , per cui si ha $G_{i_1} \subseteq G_{i_2}$ e $\eta_{i_2}|_{G_{i_1}} = \eta_{i_1}$, oppure $G_{i_2} \subseteq G_{i_1}$ e $\eta_{i_1}|_{G_{i_2}} = \eta_{i_2}$.

In entrambi i casi, si ha allora che $\eta_{i_1}(\mathbf{u}) = \eta_{i_2}(\mathbf{u})$.

η è un funzionale lineare.

Siano infatti $\mathbf{u}, \mathbf{v} \in G$, e siano $\lambda, \mu \in \mathbb{R}$;

sia $i \in \mathcal{I}$ per cui $\mathbf{u}, \mathbf{v} \in G_i$, che esiste per l'osservazione preliminare.

Allora, $\lambda \mathbf{u} + \mu \mathbf{v} \in G_i$; si ha allora

$$\eta(\lambda \mathbf{u} + \mu \mathbf{v}) = \eta_i(\lambda \mathbf{u} + \mu \mathbf{v}) \quad \text{Essendo } \lambda \mathbf{u} + \mu \mathbf{v} \in G_i$$

$$= \lambda \eta_i(\mathbf{u}) + \mu \eta_i(\mathbf{v}) \quad \text{Essendo } \eta_i \text{ lineare}$$

$$= \lambda \eta(\mathbf{u}) + \mu \eta(\mathbf{v}) \quad \text{Essendo } \mathbf{u}, \mathbf{v} \in G_i$$

La proprietà $\eta|_F = \varphi$ è immediata;

essa segue infatti dal fatto che, fissato $\mathbf{u} \in F$ e fissato un qualunque $i \in \mathcal{I}$, si ha $\eta(\mathbf{u}) = \eta_i(\mathbf{u}) = \varphi(\mathbf{u})$, per definizione di η essendo $F \subseteq G_i$ per costruzione, e per costruzione di η_i .

Altrettanto immediata risulta la disuguaglianza $\eta(\mathbf{x}) \leq f(\mathbf{x})$ per ogni $\mathbf{x} \in G$.

Infatti, fissato $\mathbf{x} \in G$ e fissato $i \in \mathcal{I}$ tale che $\mathbf{x} \in G_i$, si ha $\eta(\mathbf{x}) = \eta_i(\mathbf{x}) \leq f(\mathbf{x})$ per definizione di η e per costruzione di η_i .

Dunque, $(G, \eta) \in \mathcal{S}$, per cui le ipotesi del lemma di Zorn sono verificate.

Allora, \mathcal{S} ammette un elemento massimale (H, ψ) .

Per concludere la dimostrazione, resta da provare che $H = E$; fatto questo, la tesi è acquisita dal momento che ψ soddisfa le proprietà da essa richieste per definizione di \mathcal{S} .

Si proceda per assurdo, supponendo quindi $H \subsetneq E$; esiste quindi $\mathbf{x}_0 \in E \setminus H$.

Allora, per il [Lemma 7.1], posto $\tilde{H} = \text{span}(H, \mathbf{x}_0)$ si ha che esiste $\tilde{\psi} : \tilde{H} \rightarrow \mathbb{R}$ funzionale lineare tale che $\tilde{\psi}|_H = \psi$ e $\tilde{\psi}(\mathbf{x}) \leq f(\mathbf{x})$ per ogni $\mathbf{x} \in \tilde{H}$.

Ma allora, da ciò seguirebbe che $(\tilde{H}, \tilde{\psi}) \in \mathcal{S}$ e che $(\tilde{H}, \tilde{\psi}) \succ (H, \psi)$, contro la massimalità di (H, ψ) .

Dunque, $H = E$.

■

