

Лекція 4

Характеристичні числа ермітового неперервного ядра

[1, стор. 304 - 306]

Теорема 1 (Про існування характеристичного числа у ермітового неперервного ядра). Для будь-якого ермітового неперервного ядра, що не дорівнює тотожно нулю існує принаймні одне характеристичне число і найменше з них за модулем λ_1

задовольняє варіаційному принципу
$$\frac{1}{|\lambda_1|} = \sup_{f \in L_2(G)} \frac{\|K f\|_{L_2(G)}}{\|f\|_{L_2(G)}} \quad (3.2).$$

Доведення:

Серед усіх $f \in L_2$ оберемо такі, що $\|f\|_{L_2(G)} = 1$. Позначимо $v = \sup_{\substack{f \in L_2(G) \\ \|f\|_{L_2}=1}} \|K f\|_{L_2(G)}$.

Оскільки $\|K f\|_{L_2(G)} \leq M V \|f\|_{L_2(G)} \leq M V$, то $0 \leq v \leq M V$.

Згідно до визначення точної верхньої межі, $\exists \{f_k\}_{k=1}^{\infty} \subset L_2(G)$,

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \|K f_k\|_{L_2(G)} = v.$$

$$\text{Оцінимо } \|K^2 f\|_{L_2(G)} = \|K(K f)\|_{L_2(G)} = \left\| K \left(\frac{K f}{\|K f\|} \right) \right\|_{L_2(G)} \|K f\|_{L_2(G)} \leq v \|K f\|_{L_2(G)} \leq v^2.$$

Покажемо, що $K^2 f_k - v^2 f_k \rightarrow 0$ в середньому квадратичному. Тобто

$$\|K^2 f_k - v^2 f_k\|_{L_2(G)}^2 \xrightarrow{k \rightarrow \infty} 0.$$

Дійсно:

$$\begin{aligned} \|K^2 f_k - v^2 f_k\|_{L_2(G)}^2 &= (K^2 f_k - v^2 f_k, K^2 f_k - v^2 f_k)_{L_2(G)} = \|K^2 f_k\|_{L_2(G)}^2 + v^4 - v^2 (K^2 f_k, f_k) - \\ &\quad - v^2 (f_k, K^2 f_k) = \|K^2 f_k\|_{L_2(G)}^2 + v^4 - 2v^2 \|K f_k\|_{L_2(G)}^2 \leq v^2 (v^2 - \|K f_k\|_{L_2(G)}^2) \xrightarrow{k \rightarrow \infty} 0 \end{aligned}$$

Розглянемо послідовність $\{K f_k\} = \{\varphi_k\}$, яка є компактною в рівномірній метриці.

Звідси підпоследовність $\{\varphi_{k_i}\}_{i=1,\infty}$ збіжна в $C(\overline{G})$, тобто $\exists \varphi \in C(\overline{G})$, така що

$$\|\varphi_{k_i} - \varphi\|_{C(\overline{G})} \xrightarrow{i \rightarrow \infty} 0.$$

Покажемо, що $K^2 \varphi - v^2 \varphi = 0$ в кожній точці, тобто $\|K^2 \varphi - v^2 \varphi\|_{C(\overline{G})} = 0$.

$$\begin{aligned} \|K^2 \varphi - v^2 \varphi\|_{C(\overline{G})} &= \|K^2 \varphi - v^2 \varphi + K^2 \varphi_{k_i} - K^2 \varphi_{k_i} + v^2 \varphi_{k_i} - v^2 \varphi_{k_i}\|_{C(\overline{G})} \leq \\ &\leq \|K^2 \varphi - K^2 \varphi_{k_i}\|_{C(\overline{G})} + \|K^2 \varphi_{k_i} - v^2 \varphi_{k_i}\|_{C(\overline{G})} + \|v^2 \varphi_{k_i} - v^2 \varphi\|_{C(\overline{G})} \leq \\ &\leq (MV)^2 \|\varphi_{k_i} - \varphi\|_{C(\overline{G})} + v^2 \|\varphi_{k_i} - \varphi\|_{C(\overline{G})} + M\sqrt{V} \|K^2 f_{k_i} - v^2 f_{k_i}\|_{L_2(G)} \rightarrow 0 + 0 + 0 \end{aligned}$$

Таким чином має місце рівність $K^2 \varphi - v^2 \varphi = 0$ (3.3).

Отже маємо: $(K + E v)(K - E v)\varphi = 0$. Ця рівність може мати місце у двох випадках:

1) $(K - E v)\varphi \equiv 0$. Тоді $\varphi = \frac{1}{v} K \varphi$, а отже φ - власна функція, $\frac{1}{v}$ - характеристичне

число оператора K .

2) $(K - E v)\varphi \equiv \Phi \neq 0$. Тоді $(K + E v)\Phi \equiv 0$. Тоді $\Phi = -\frac{1}{v} K \Phi$, а отже Φ - власна

функція, $-\frac{1}{v}$ - характеристичне число оператора K .

Залишилось довести, що це характеристичне число є мінімальним за модулем.

Припустимо супротивне:

Нехай $\exists \lambda_0 : |\lambda_0| < |\lambda_1|$, тоді $\frac{1}{|\lambda_1|} = \sup_{f \in L_2(G)} \frac{\|K f\|}{\|f\|} \geq \frac{\|K \varphi_0\|}{\|\varphi_0\|} = \frac{1}{|\lambda_0|} \Rightarrow |\lambda_0| \geq |\lambda_1|$.

Зауваження

Доведена теорема є вірною і для ермітових полярних ядер [1, стор. 307 - 308].

Звідси безпосередньо впливають такі властивості характеристичних чисел та власних функцій ермітового ядра:

1. Множина характеристичних чисел ермітового неперервного ядра не порожня, є підмножиною множини дійсних чисел і не має скінчених граничних точок.

2. Кратність будь-якого характеристичного числа скінчена.

3. Власні функції можна вибрати так, що вони утворюють ортонормовану систему. Тобто $\{\varphi_k\}_{k=1,2,\dots}$ такі що $(\varphi_k, \varphi_i)_{L_2(G)} = \delta_{ki}$.

(Зокрема достатньо провести процес ортогоналізації Гілберта - Шмідта для будь-якої системи лінійно незалежних власних функцій, і пронормувати отриману систему).

§4. Теорема Гілберта - Шмідта та її наслідки

Білінійне розвинення ермітового неперервного ядра

[1, стор. 308 - 310]

Нехай $K(x, y) \in C(\overline{G} \times \overline{G})$ ермітове неперервне ядро, $|\lambda_i| \leq |\lambda_{i+1}|, i = 1, 2, \dots$ його характеристичні числа і $\{\varphi_i\}, i = 1, \infty$ ортонормована система власних функцій, що відповідають власним числам.

Розглянемо послідовність ермітових неперервних ядер:

$$K^{(p)}(x, y) = K(x, y) - \sum_{i=1}^p \frac{\overline{\varphi_i(y)} \varphi_i(x)}{\lambda_i}, p = 1, 2, \dots \quad (4.1).$$

$$K^{(p)}(x, y) = (K^{(p)})^*(x, y) \in C(\overline{G} \times \overline{G})$$

Дослідимо властивості операторів (4.1).

Покажемо, що будь-яке характеристичне число $\lambda_j, j > p + 1$ та відповідна йому власна функція φ_j є характеристичним числом і власною функцією ядра $K^{(p)}(x, y)$.

$$\mathbf{K}^{(p)} \varphi_j = \mathbf{K} \varphi_j - \sum_{i=1}^p \frac{\varphi_i(x)}{\lambda_i} (\varphi_i, \varphi_j) = \mathbf{K} \varphi_j = \frac{1}{\lambda_j} \varphi_j \quad (4.2).$$

Нехай λ_0, φ_0 - характеристичне число та відповідна власна функція $K^{(p)}(x, y)$, тобто $\lambda_0 \mathbf{K}^{(p)} \varphi_0 = \varphi_0$. Покажемо що, $(\varphi_0, \varphi_j) = 0$ для $j = \overline{1, p}$.

$$\varphi_0 = \lambda_0 \mathbf{K} \varphi_0 - \lambda_0 \sum_{i=1}^p \frac{\varphi_i}{\lambda_i} (\varphi_0, \varphi_i),$$

$$(\varphi_0, \varphi_j) = \lambda_0 (\mathbf{K} \varphi_0, \varphi_j) - \lambda_0 \sum_{i=1}^p \frac{(\varphi_0, \varphi_i)(\varphi_i, \varphi_j)}{\lambda_i} = \frac{\lambda_0}{\lambda_j} (\varphi_0, \varphi_j) - \frac{\lambda_0}{\lambda_j} (\varphi_0, \varphi_j) = 0.$$

Отже λ_0, φ_0 відповідно характеристичне число і власна функція ядра $K(x, y)$.

Таким чином φ_0 - ортогональна до усіх власних функцій $\varphi_1, \varphi_2, \dots, \varphi_p$, таким чином, λ_0 співпадає з одним із характеристичних чисел $\lambda_{p+1}, \lambda_{p+2}, \dots$ тобто $\varphi_0 = \varphi_k$ для деякого $k \geq p+1$.

Отже у ядра $K^{(p)}(x, y)$ множина власних функцій і характеристичних чисел вичерпується множиною власних функцій і характеристичних чисел ядра $K(x, y)$ починаючи з номера $p+1$.

Враховуючи, що λ_{p+1} найменше за модулем характерне число ядра $K^p(x, y)$,

має місце нерівність

$$\frac{\|\mathbf{K}^{(p)} f\|_{L_2(G)}}{\|f\|_{L_2(G)}} \leq \frac{1}{|\lambda_{p+1}|}.$$

Для ядра, що має скінчену кількість характеристичних чисел, очевидно, має

місце рівність $K^{(N)}(x, y) = K(x, y) - \sum_{i=1}^N \frac{\varphi_i(x) \overline{\varphi_i(y)}}{\lambda_i} \equiv 0$.

Тобто будь-яке ермітове ядро зі скінченною кількістю характеристичних чисел є

виродженим і представляється у вигляді $K(x, y) = \sum_{i=1}^N \frac{\varphi_i(x) \overline{\varphi_i(y)}}{\lambda_i}$.

Враховуючи теорему про існування характеристичних чисел у ермітового оператора можемо записати:

$$\|K^{(p)} f\|_{L_2(G)} = \left\| K f - \sum_{i=1}^p \frac{(f, \varphi_i)}{\lambda_i} \varphi_i \right\|_{L_2(G)} \leq \frac{\|f\|_{L_2(G)}}{|\lambda_{p+1}|} \xrightarrow{p \rightarrow \infty} 0 \quad (4.3).$$

Тобто можна вважати, що ермітове ядро в розумінні (4.3) наближається наступним білінійним рядом:

$$K(x, y) \sim \sum_{i=1}^{\infty} \frac{\varphi_i(x) \overline{\varphi_i(y)}}{\lambda_i} \quad (4.4).$$

Для виродженого ядра маємо його представлення у вигляді

$$K(x, y) = \sum_{i=1}^N \frac{\varphi_i(x) \overline{\varphi_i(y)}}{\lambda_i} \quad (4.5).$$

Ряд Фур'є функції із $L_2(G)$

Розглянемо довільну функцію $f \in L_2(G)$ і деяку ортонормовану систему

функцій $\{u_i\}_{i=1,+\infty}$, $(u_i, u_j) = \delta_{ij}$.

Рядом Фур'є функції f із $L_2(G)$ називається ряд

$$\sum_{i=1}^{\infty} (f, u_i) u_i \sim f \quad (4.6),$$

(f, u_i) - називається коефіцієнтом Фур'є.

$\forall f \in L_2(G)$ виконується нерівність Бесселя :

$$\forall N \quad \sum_{i=1}^N |(f, u_i)|^2 \leq \|f\|_{L_2(G)}^2 \quad (4.7).$$

Нерівність Бесселя гарантує збіжність ряду Фур'є в середньоквадратичному, але не обов'язково до функції f .

Означення Ортонормована система функцій $\{u_i\}_{i=1,+\infty}$ з $L_2(G)$ називається повною (замкненою), якщо ряд Фур'є для будь – якої функції $f \in L_2(G)$ по цій системі функцій збігається до цієї функції в просторі $L_2(G)$.

Теорема 2 (Критерій замкненості ортонормованої системи функцій) Для того щоб система функцій $\{u_i\}_{i=1,+\infty}$ була повною в $L_2(G)$ необхідно і достатньо, щоб для будь-якої функції $f \in L_2(G)$ виконувалось *рівність* Парсеваля – Стеклова

$$\sum_{i=1}^{\infty} |(f, u_i)|^2 = \|f\|_{L_2(G)}^2 \quad (4.8).$$

Теорема Гілберта – Шмідта

[1, стор. 310 - 312]

Функція $f(x)$ називається *джерелувато - зображуваною* через ермітове неперервне ядро $K(x, y) = K^*(x, y)$, $K \in C(G \times G)$, якщо існує функція $h(x) \in L_2(G)$ така, що $f(x) = \int_G K(x, y) h(y) dy$ (4.9).

Теорема 3 (Гільберта – Шмідта) Довільна джерелувато - зображувана функція f розкладається в абсолютно і рівномірно збіжний ряд Фур'є за системою власних функцій ермітового неперервного ядра $K(x, y)$.

Доведення: Обчислимо коефіцієнти Фур'є $(f, \varphi_i) = (Kh, \varphi_i) = (h, K\varphi_i) = \frac{(h, \varphi_i)}{\lambda_i}$.

Отже ряд Фур'є функції f має вигляд $f \sim \sum_{i=1}^{\infty} \frac{(h, \varphi_i)}{\lambda_i} \varphi_i$ (4.10).

Якщо власних чисел скінчена кількість, то з (4.5) випливає, що

$f(x) = \sum_{i=1}^N \frac{(h, \varphi_i)}{\lambda_i} \varphi_i(x)$, якщо ж власних чисел злічена кількість, то з (4.3) випливає

співвідношення:

$$\left\| f - \sum_{i=1}^p \frac{(h, \varphi_i)}{\lambda_i} \varphi_i \right\|_{L_2(G)} = \left\| Kh - \sum_{i=1}^p \frac{(h, \varphi_i)}{\lambda_i} \varphi_i \right\|_{L_2(G)} \xrightarrow{p \rightarrow \infty} 0, \quad h \in L_2(G).$$

Покажемо, що формулу (4.4) можна розглядати як розвинення ядра $K(x, y)$ в

ряд Фур'є по системі власних функцій $\varphi_i(x)$. Перевіримо це обчислюючи коефіцієнт

$$\text{Фур'є} \left(K(\cdot, y), \varphi_i \right)_{L_2(G)} = \int_G K(x, y) \overline{\varphi_i(x)} dx = \int_G \overline{K(y, x) \varphi_i(x)} dx = \frac{\overline{\varphi_i(y)}}{\lambda_i}. \text{ Доведемо}$$

рівномірну збіжність ряду Фур'є (4.10) за критерієм Коші і покажемо, що при

$n, m \rightarrow \infty$, відрізок ряду прямує до нуля. За нерівністю Коші - Буняківського маємо:

$$\left| \sum_{i=n}^m \frac{(h, \varphi_i)}{\lambda_i} \varphi_i \right| \leq \sum_{i=n}^m |(h, \varphi_i)| \frac{|\varphi_i|}{|\lambda_i|} \leq \left(\sum_{i=n}^m |(h, \varphi_i)|^2 \right)^{1/2} \left(\sum_{i=n}^m \frac{|\varphi_i|^2}{\lambda_i^2} \right)^{1/2}.$$

$$\sum_{i=n}^m |(h, \varphi_i)|^2 \leq \|h\|_{L_2(G)}^2, \text{ тобто ряд збігається, а вказана сума прямує до 0 при}$$

$$n, m \rightarrow \infty.$$

$$\sum_{i=n}^m \frac{|\varphi_i(y)|^2}{\lambda_i^2} \leq \int_G |K(x, y)|^2 dx \leq M^2 V, \text{ тобто ряд збігається.}$$

$$\text{Отже} \left(\sum_{i=n}^m |(h, \varphi_i)|^2 \right)^{1/2} \left(\sum_{i=n}^m \frac{|\varphi_i|^2}{\lambda_i^2} \right)^{1/2} \xrightarrow{n, m \rightarrow \infty} 0$$

$$\text{а отже} \sum_{i=1}^{\infty} \frac{(h, \varphi_i)}{\lambda_i} \varphi_i \text{ збігається абсолютно і рівномірно.}$$

Наслідок 1 Довільне повторне ядро для ермітового неперервного ядра $K(x, y)$ розкладається в білінійний ряд по системі власних функцій ермітового

неперервного ядра, який збігається абсолютно і рівномірно. $K_{(p)}(x, y) = \sum_{i=1}^{\infty} \frac{\varphi_i(x) \overline{\varphi_i(y)}}{\lambda_i^p},$

$$p = 2, 3, \dots \text{ де коефіцієнти Фур'є } \frac{\overline{\varphi_i(y)}}{\lambda_i^p}.$$

$$\text{Повторне ядро } K_{(p)}(x, y) = \int_G K(x, \xi) K_{p-1}(\xi, y) d\xi \text{ є джерелувато-зображувана}$$

функція і таким чином для цього має місце теорема Гільберта – Шмідта.

Доведемо деякі важливі нерівності:

$$\begin{aligned}
K_{(2)}(x, x) &= \int_G K(x, \xi) K(\xi, x) d\xi = \\
&= \int_G K(x, \xi) \overline{K(x, \xi)} d\xi = \int_G |K(x, \xi)|^2 d\xi = \sum_{i=1}^{\infty} \frac{|\varphi_i(x)|^2}{\lambda_i^2}
\end{aligned} \quad (4.11).$$

Рівність (4.11) випливає з наслідку 1. Проінтегруємо (4.11), отримаємо

$$\iint_{G \times G} |K(x, y)|^2 dx dy = \sum_{i=1}^{\infty} \frac{1}{\lambda_i^2} \quad (4.12).$$

Теорема 4 (Про збіжність білінійного ряду для ермітового неперервного ядра) Ермітове

неперервне ядро $K(x, y)$ розкладається в білінійний ряд $K(x, y) = \sum_{i=1}^{\infty} \frac{\varphi_i(x) \overline{\varphi_i(y)}}{\lambda_i}$ по

своїх власних функціях, і цей ряд збігаються в нормі $L_2(G)$ по аргументу x

$$\text{рівномірно для кожного } y \in \overline{G}, \text{ тобто } \left\| K(x, y) - \sum_{i=1}^p \frac{\varphi_i(x) \overline{\varphi_i(y)}}{\lambda_i} \right\|_{L_2(x \in G)} \xrightarrow[p \rightarrow \infty]{y \in \overline{G}} 0.$$

Доведення:

$$\left\| K(x, y) - \sum_{i=1}^p \frac{\varphi_i(x) \overline{\varphi_i(y)}}{\lambda_i} \right\|_{L_2(x \in G)}^2 = \int_G |K(x, y)|^2 dx - \sum_{i=1}^p \frac{|\varphi_i(y)|^2}{\lambda_i^2} \xrightarrow[p \rightarrow \infty]{y \in \overline{G}} 0$$

Додатково інтегруючи по аргументу $y \in G$ отримаємо збіжність білінійного ряду (4.4)

в середньоквадратичному.

$$\iint_G \left(K(x, y) - \sum_{i=1}^p \frac{\varphi_i(x) \overline{\varphi_i(y)}}{\lambda_i} \right)^2 dx dy \xrightarrow[p \rightarrow \infty]{} 0 \quad (4.13).$$

Формула Шмідта для розв'язання інтегральних рівнянь з ермітовим неперервним ядром

[1, стор. 315 - 317]

Розглянемо інтегральне рівняння Фредгольма 2 роду $\varphi = \lambda K \varphi + f$, з

ермітовим неперервним ядром $K(x, y) = K^*(x, y)$ (4.14)

$\varphi_1, \dots, \varphi_p, \dots$
 $\lambda_1, \dots, \lambda_p, \dots$ - множина характеристичних чисел та - ортонормована система

власних функцій ядра.

Розкладемо розв'язок рівняння φ по системі власних функцій ядра $K(x, y)$.

$$\varphi = \lambda \sum_{i=1}^{\infty} (K\varphi, \varphi_i) \varphi_i + f = \lambda \sum_{i=1}^{\infty} (\varphi, K\varphi_i) \varphi_i + f = \lambda \sum_{i=1}^{\infty} \frac{(\varphi, \varphi_i)}{\lambda_i} \varphi_i + f, \text{ обчислимо}$$

$$\text{коефіцієнти Фур'є } (\varphi, \varphi_k) = \lambda \sum_{i=1}^{\infty} \frac{(\varphi, \varphi_i)}{\lambda_i} (\varphi_i, \varphi_k) + (f, \varphi_k) = \lambda \frac{(\varphi, \varphi_k)}{\lambda_k} + (f, \varphi_k)$$

$$\text{Отже, } (\varphi, \varphi_k) \left(1 - \frac{\lambda}{\lambda_k}\right) = (f, \varphi_k), \text{ тому } (\varphi, \varphi_k) = (f, \varphi_k) \frac{\lambda_k}{\lambda_k - \lambda}, k = 1, 2, \dots$$

Таким чином має місце формулу Шмідта:

$$\varphi(x) = \lambda \sum_{i=1}^{\infty} \frac{(f, \varphi_i)}{\lambda_i - \lambda} \varphi_i(x) + f(x) \quad (4.15).$$

Розглянемо усі можливі значення λ :

1. Якщо $\lambda \neq \{\lambda_i\}_{i=1, \infty}$, тоді існує єдиний розв'язок для довільного вільного члена

f і цей розв'язок представляється за формулою (4.15).

2. Якщо $\lambda = \lambda_k = \lambda_{k+1} = \dots = \lambda_{k+q-1}$ - співпадає з одним з характеристичних чисел

кратності q , та при цьому виконанні умови ортогональності

$$(f, \varphi_k) = (f, \varphi_{k+1}) = \dots = (f, \varphi_{k+q-1}) = 0 \text{ тоді розв'язок існує (не єдиний), і}$$

$$\text{представляється у вигляді, } \varphi(x) = \lambda_k \sum_{\substack{i=1 \\ \lambda_i \neq \lambda_k}}^{\infty} \frac{(f, \varphi_i)}{\lambda_i - \lambda_k} \varphi_i(x) + f(x) + \sum_{j=k}^{k+q-1} c_j \varphi_j(x), \quad (4.16),$$

c_j - довільні константи.

Якщо $\exists j: (f, \varphi_j) \neq 0, k \leq j \leq k+q-1$ тоді розв'язків не існує.

Приклад: Знайти ті значення параметрів a, b для яких інтегральне рівняння

$$\varphi(x) = \lambda \int_{-1}^1 \left(xy - \frac{1}{3}\right) \varphi(y) dy + ax^2 - bx + 1 \text{ має розв'язок для будь-якого}$$

значення λ .

Розв'язок: Знайдемо характеристичні числа та власні функції спряженого рівняння (ядро ермітове).

$$\varphi(x) = \lambda x \int_{-1}^1 y \varphi(y) dy - \frac{\lambda}{3} \int_{-1}^1 \varphi(y) dy = \lambda x c_1 - \frac{\lambda}{3} c_2$$

$$c_1 = \int_{-1}^1 y \varphi(y) dy = \int_{-1}^1 y \left(\lambda y c_1 - \frac{\lambda}{3} c_2 \right) dy = \frac{2}{3} \lambda c_1$$

$$c_2 = \int_{-1}^1 \varphi(y) dy = \int_{-1}^1 \left(\lambda y c_1 - \frac{\lambda}{3} c_2 \right) dy = -\frac{2}{3} \lambda c_2$$

$$D(\lambda) = \begin{vmatrix} 1 - \frac{2}{3}\lambda & 0 \\ 0 & 1 + \frac{2}{3}\lambda \end{vmatrix} = 0.$$

$$\lambda_1 = \frac{3}{2}, \lambda_2 = -\frac{3}{2}$$

$$\varphi_1(x) = x, \varphi_2(x) = 1.$$

Умови ортогональності:

$$\int_{-1}^1 (ax^2 - bx + 1)x dx = -\frac{2}{3}b = 0$$

$$\int_{-1}^1 (ax^2 - bx + 1) dx = \frac{2}{3}a + 2 = 0$$

$$a = -3, b = 0$$

Словник термінів

	характеристичне число	characteristic number
	неперервне ядро	continuous kernel
	компактна послідовність	compact sequence
	кратність	multiplicity
	білінійний ряд	bilinear series
	джерелувато – зображувана функція	sourcewise- representation function
	Рівномірно збіжний ряд	uniformly convergent series