

Спектр и резольвентное множество линейного непрерывного оператора в гильбертовом пространстве $A : H \mapsto H$.

Пусть $A : H \mapsto H$ — линейный и непрерывный оператор. Тожественный оператор $I : H \mapsto H$ ($If = f \forall f \in H$). Далее $\forall \lambda \in \mathbb{C} A_\lambda = A - \lambda I$. Резольвентное множество

$$\rho(A) = \{\lambda \in \mathbb{C} \mid \exists (A_\lambda)^{-1} : H \mapsto H\}$$

где $(A_\lambda)^{-1}$ — линейный и непрерывный и по теореме Банаха об обратном операторе

$$\rho(A) = \{\lambda \in \mathbb{C} \mid \ker A_\lambda = 0, \text{Im } A_\lambda = H\}$$

Тогда $\sigma(A) = \mathbb{C} \setminus \rho(A)$ — спектр,

$$\sigma(A) = \left\{ \lambda \in \mathbb{C} \mid \begin{cases} \ker A_\lambda \neq 0 \\ \ker A_\lambda = 0 \\ \text{Im } A_\lambda \neq H \end{cases} \right\}$$

Точечный спектр оператора A ; это $\lambda \in \sigma_p(A) = \{\lambda \in \mathbb{C} \mid \ker A_\lambda \neq 0\}$ называют собственными значениями A . Непрерывный спектр в свою очередь

$$\sigma_C(A) = \left\{ \lambda \in \mathbb{C} \mid \begin{cases} \ker A_\lambda = 0 \\ \text{Im } A_\lambda \neq H \end{cases} \right\}$$

Очевидно $\sigma(A) = \sigma_p(A) \cup \sigma_C(A)$. Резольвента $R_A(\lambda) = (I - \lambda A)^{-1} : H \mapsto H$, также используется определение $\forall \lambda \neq 0: \frac{1}{\lambda} \in \rho(A) \rightarrow \frac{1}{\lambda}(A - \frac{I}{\lambda})^{-1} = -\frac{1}{\lambda}(A_\lambda)^{-1}$

Теорема 1. Пусть $A : H \mapsto H$ — линейный и непрерывный, тогда

1. $\forall \lambda \in \mathbb{C}$ такой, что $|\lambda| > \|A\| \Rightarrow \lambda \in \rho(A)$. При этом $(A_\lambda)^{-1} = -\sum_{n=0}^{\infty} \frac{A^n}{\lambda^{n+1}}$, причём ряд сходится по операторной норме.
2. $\rho(A)$ — открыто в \mathbb{C} (очевидно следует, что спектр — замкнутое множество, а так же $\sigma(A) \subset \{\lambda \in \mathbb{C} \mid |\lambda| \leq \|A\|\}$, поэтому спектр — компакт).
3. Функция от $\lambda (A_\lambda)^{-1}$ непрерывна на $\rho(A)$ по операторной норме
4. $\forall \lambda \in \rho(A) \exists \lim_{\text{по операторной норме}} \frac{(A_{\lambda+\Delta\lambda})^{-1} - (A_\lambda)^{-1}}{\Delta\lambda} = ((A_\lambda)^{-1})^2$

Доказательство.

1. $|\lambda| > \|A\|$, то

$$A_\lambda = -\lambda(I - \frac{A}{\lambda})$$

где $\frac{A}{\lambda}$ обозначим T , $\|T\| = \frac{\|A\|}{|\lambda|} < 1$ По теореме Неймана \exists оператор непрерывный в H

$$(A_\lambda)^{-1} = -\frac{1}{\lambda}(I - \frac{A}{\lambda})^{-1} = -\sum_{n=0}^{\infty} \frac{A^n}{\lambda^{n+1}}$$

ряд сходится по операторной норме.

2. Так как существует $\exists(A_\lambda)^{-1}$ линейный и непрерывный. $\forall \lambda \in \rho(A)$ рассмотрим

$$A_{\lambda+\Delta\lambda} = A_\lambda - \Delta\lambda I = A_\lambda(I - \Delta\lambda(A_\lambda)^{-1})$$

. Обозначим $T = \Delta\lambda(A_\lambda)^{-1}$, тогда

$$\exists \Delta\lambda: \|T\| = |\Delta\lambda| \|(A_\lambda)^{-1}\| < 1$$

Тогда

$$\Delta\lambda < \frac{1}{\|(A_\lambda)^{-1}\|}$$

следовательно $\exists(A_{\lambda+\Delta\lambda})^{-1} : H \mapsto H$ линейный и непрерывный, следовательно $\lambda + \Delta\lambda \in \rho(A)$.

3. $\lambda \in \rho(A): \lambda \rightarrow (A_\lambda)^{-1}$. Рассмотрим

$$(A_{\lambda+\Delta\lambda})^{-1} - (A_\lambda)^{-1} = (I - \Delta\lambda(A_\lambda)^{-1})(A_\lambda)^{-1} - (A_\lambda)^{-1}$$

раскладываем по Нейману

$$(A_{\lambda+\Delta\lambda})^{-1} - (A_\lambda)^{-1} = \sum_{n=1}^{\infty} (\Delta\lambda)^n ((A_\lambda)^{-1})^{n+1}$$

Учтём, что $\|((A_\lambda)^{-1})^{n+1}\| \leq \|(A_\lambda)^{-1}\|^{n+1}$. Отсюда

$$\|(A_{\lambda+\Delta\lambda})^{-1} - (A_\lambda)^{-1}\| \leq \sum_{n=1}^{\infty} |\Delta\lambda|^n \|((A_\lambda)^{-1})^{n+1}\| \leq |\Delta\lambda| \frac{\|(A_\lambda)^{-1}\|^2}{1 - |\Delta\lambda| \|(A_\lambda)^{-1}\|}$$

где $|\Delta\lambda| \frac{\|(A_\lambda)^{-1}\|^2}{1 - |\Delta\lambda| \|(A_\lambda)^{-1}\|} \rightarrow 0$ $\Delta\lambda \rightarrow 0$. Следовательно непрерывен по операторной норме

4. $\lambda \in \rho(A)$ $|\Delta\lambda| < \frac{1}{\|(A_\lambda)^{-1}\|}$, тогда получим тождество Гильберта

$$(A_{\lambda+\Delta\lambda})^{-1} - (A_\lambda)^{-1} = (A_\lambda)^{-1}(A_\lambda - A_{\lambda+\Delta\lambda})(A_{\lambda+\Delta\lambda})^{-1}$$

где очевидным образом $A_\lambda - A_{\lambda+\Delta\lambda} = \Delta\lambda I$. По этому

$$(A_{\lambda+\Delta\lambda})^{-1} - (A_\lambda)^{-1} = \Delta\lambda(A_\lambda)^{-1}(A_{\lambda+\Delta\lambda})^{-1}$$

Рассмотрим теперь предел

$$\begin{aligned} \lim_{\Delta\lambda \rightarrow 0 \text{ по операторной норме}} \frac{(A_{\lambda+\Delta\lambda})^{-1} - (A_\lambda)^{-1}}{\Delta\lambda} &= \\ &= \lim_{\Delta\lambda \rightarrow 0 \text{ по операторной норме}} (A_\lambda)^{-1}(A_{\lambda+\Delta\lambda})^{-1} \end{aligned}$$

А по п.3 $(A_{\lambda+\Delta\lambda})^{-1} \rightarrow (A_\lambda)^{-1}$ поэтому

$$\lim_{\Delta\lambda \rightarrow 0 \text{ по операторной норме}} \frac{(A_{\lambda+\Delta\lambda})^{-1} - (A_\lambda)^{-1}}{\Delta\lambda} = (A_\lambda)^{-1}(A_\lambda)^{-1}$$

Следствие 1. $\sigma(A) \neq \emptyset$, иначе говоря спектр — непустой компакт в \mathbb{C} . Определим спектральный радиус $r(A) = \max |\lambda|$. Тогда $r(A) = \lim_{n \rightarrow \infty} \sqrt[n]{\|A^n\|} \leq \|A\|$.

Доказательство. 1) Если вдруг спектр пуст $\sigma(A) = \emptyset$, тогда $\forall f, g \in H \quad \forall \lambda \in \rho(A) = \mathbb{C}$. Рассмотрим $F(\lambda) = ((A_\lambda)^{-1}f, g)$ при $|\lambda| > \|A\|$

$$F(\lambda) = ((A_\lambda)^{-1}f, g) = (-\sum_{n=0}^{\infty} \frac{A^n f}{\lambda^{n+1}}, g)$$

где сумма сходится в H , а скалярное произведение непрерывно H .

$$F(\lambda) = -\sum_{n=0}^{\infty} \frac{(A^n f, g)}{\lambda^{n+1}} = O\left(\frac{1}{\lambda}\right) \quad \lambda \rightarrow \infty$$

но в силу п. 4 $F(\lambda)$ регулярная. Действительно, $\forall \lambda \in \mathbb{C}, \forall \Delta \lambda \neq 0$

$$\lim_{\Delta \lambda \rightarrow 0} \frac{F(\lambda + \Delta \lambda) - F(\lambda)}{\Delta \lambda} = \lim_{\Delta \lambda \rightarrow 0} \left(\frac{(A_{\lambda + \Delta \lambda})^{-1}f - (A_\lambda)^{-1}f}{\Delta \lambda}, g \right)$$

где первая компонента скалярного произведения сходится по операторной норме к $((A_\lambda)^{-1})^2 f$. По определению $F'(\lambda) = \lim_{\Delta \lambda \rightarrow 0} \dots = (((A_\lambda)^{-1})^2 f, g)$ — непрерывно в \mathbb{C} . Следовательно $F(\lambda)$ — целая функция, далее $F(\lambda) \rightarrow 0 \quad \lambda \rightarrow \infty$, тогда по теореме Лиувилля из ТФКП $F(\lambda) \equiv 0$, следовательно $\ker(A_\lambda)^{-1} = H$, с другой стороны $\ker(A_\lambda)^{-1} = 0$ так как $(A_\lambda)^{-1}$ имеет обратный A_λ на H , следовательно $H = 0$, получили противоречие.

2) По определению $r(A) = \max_{\lambda \in \sigma(A)} |\lambda|$ существует в \mathbb{R} . **Шаг 1.** Докажем $\forall \lambda \in \sigma(A) \Rightarrow \lambda^n \in \sigma(A^n)$. Если вдруг это не так, тогда $\lambda^n \in \rho(A^n) \Rightarrow \exists ((A^n)_{\lambda^n})^{-1} : H \mapsto H$ линейный непрерывный оператор. Обозначим его B . Тогда

$$(A^n - \lambda^n I) = (A - \lambda I)(A^{n-1} + \lambda A^{n-2} + \dots + \lambda^{n-2} A + \lambda^{n-1} I)$$

Обозначим скобку как $C : H \mapsto H$.

$$B = C(A - \lambda I)$$

Также

$$A^n - \lambda^n I = A_\lambda C$$

следовательно

$$(A^n - \lambda^n I)B = I = A_\lambda C B \Rightarrow \text{Im } A_\lambda = H$$

Далее

$$A_\lambda C B f = f \in H \quad \forall f \in H$$

Следовательно

$$A^n - \lambda^n I = C A_\lambda$$

тогда

$$B(A^n - \lambda^n I) = I = B C A_\lambda \Rightarrow \ker A_\lambda = 0$$

Пусть $f \in \ker A_\lambda \Rightarrow f = BCA_\lambda f = BC(0) = 0$. Из $\text{Im } A_\lambda = H$ и $\ker A_\lambda = 0$ следует по определению, что $\lambda \in \rho(A)$. Получили противоречие условию, что λ в спектре. Отсюда $|\lambda^n| \leq \|A^n\|$ так как $\rho(A^n) \supset \{\mu \in \mathbb{C} \mid |\mu| > \|A^n\|\}$. Очевидно тогда, что $|\lambda| \leq \sqrt[n]{\|A^n\|}$. Следовательно

$$|\lambda| \leq \varliminf \sqrt[n]{\|A^n\|} \Rightarrow r(A) \leq \varliminf \sqrt[n]{\|A^n\|}$$

. **Шаг 2.** Утверждаем, что $\overline{\varliminf \sqrt[n]{\|A^n\|}} \leq r(A)$. Для $\forall f, g \in H$ рассмотрим

$$F(\lambda) = ((A_\lambda)^{-1}f, g)$$

$F(\lambda) \rightarrow 0, \lambda \rightarrow \infty$, регулярная во внешности круга $|\lambda| < r(A)$. $|\lambda| > r(A) \Rightarrow \lambda \in \rho(A)$. Так как $|\lambda| > \|A\| \geq r(A)$, то по теореме Неймана

$$F(\lambda) = - \sum_0^\infty \frac{(A^n f, g)}{\lambda^{n+1}}$$

С другой стороны

$$F(\lambda) = \sum_0^\infty \frac{c_n}{\lambda^{n+1}} \quad |\lambda| > r(A)$$

\Rightarrow по теореме единственности разложения в ряд Лорана $c_n = -(A^n f, g) \forall n \in \mathbb{N} \cup \{0\}$. Таким образом $\forall |\lambda| > r(A)$ получаем $\frac{A^n f, g}{\lambda^n}$ — член сходящегося ряда, следовательно

$$\frac{(A^n f, g)}{\lambda^n} \rightarrow 0 \quad n \rightarrow \infty$$

что равносильно $\forall g \in H (g, \frac{A^n f}{\lambda^n}) \rightarrow 0, n \rightarrow \infty$. $\Phi_n : H \rightarrow \mathbb{C}$ линейный и непрерывный оператор, где $\Phi_n(g) = \frac{A^n f}{\lambda^n}$. Норма оператора $\|\Phi_n\| = \frac{\|A^n f\|}{|\lambda^n|}$ сходится к 0 поточечно на H . Отсюда по теореме Банаха-Штейнгаусса $\|\Phi_n\|$ — ограниченная числа последовательность. $\forall f \in H \exists M_f > 0: \|\frac{A^n f}{\lambda^n}\| \leq M_f \Rightarrow \{\frac{A^n}{\lambda^n}\}$ — поточечно сходящаяся на H ограниченная последовательность операторов, следовательно по теореме Банаха-Штейнгаусса $\|\frac{A^n}{\lambda^n}\|$ ограниченная числовая последовательность. Следовательно $\exists M > 0: \|\frac{A^n}{\lambda^n}\| \leq M \Rightarrow \forall |\lambda| > r(A) \sqrt[n]{\|A^n\|} \leq \sqrt[n]{M}|\lambda|$. $\varliminf_{n \rightarrow \infty} \sqrt[n]{\|A^n\|} \leq |\lambda| \rightarrow r(A) + 0$. Получаем $\overline{\varliminf \sqrt[n]{\|A^n\|}} \leq r(A) \leq \varliminf \sqrt[n]{\|A^n\|}$, что и требовалось доказать.

Определение 1. $A : H \mapsto H$ линейно непрерывный оператор, то $A^* : H \mapsto H$ называется сопряжённым к A (эрмитов оператор), если $(Af, g) = (f, A^*g) \forall f, g \in H$.

Утверждение 2. $\forall A : H \mapsto H$ линейный непрерывный оператор $\exists! A^* = T : (Af, g) = (f, Tg) \forall f, g \in H$ и $\|T\| = \|A\|$.

Доказательство. $\forall g \in H$ рассмотрим $f \in H f \rightarrow (Af, g) = \Phi_g(f)$. $\Phi_g : H \rightarrow \mathbb{C}$ линейный и непрерывный. Тогда по теореме Риса-Фреше $\exists! h \in H : \Phi_g(f) = (f, h) \Rightarrow \exists! T : H \mapsto H : \forall g \in H Tg = h_g$ и

$$(Af, g) = (f, h_g) = (f, Tg)$$

Далее

$$\begin{aligned} (Af, \alpha_1 g_1 + \alpha_2 g_2) &= (f, T(\alpha_1 g_1 + \alpha_2 g_2)) = \\ &= \overline{\alpha_1} (Af, g_1) + \overline{\alpha_2} (Af, g_2) = \\ &= (f, \alpha_1 Tg_1) + (f, \alpha_2 Tg_2) \quad \forall f \in H \end{aligned}$$

Следовательно $T(\alpha_1 g_1 + \alpha_2 g_2) = \alpha_1 T(g_1) + \alpha_2 T(g_2)$, T — линейный оператор.

$$\|Tg\| = \sup_{\|f\|=1} |(f, Tg)| = \sup_{\|f\|=1} |(Af, g)| \leq \sup_{\|f\|=1} \|Af\| \|g\| \leq \|A\| \|g\|$$

С другой стороны

$$\|Af\| = \sup_{\|g\|=1} |(Af, g)| = \sup_{\|g\|=1} |(f, Tg)| \leq \sup_{\|g\|=1} \|f\| \|Tg\| \leq \|f\| \|T\|$$

. Получаем, что T — линейный и непрерывный оператор и $\|T\| = \|A\|$.

Упражнение 1. $A^{**} = A \forall A : H \mapsto H$.

Теорема 3 (Фредгольма). Пусть $A : H \mapsto H$ линейный и непрерывный оператор. Тогда $\ker A = (\operatorname{Im} A^*)^\perp$ и $(\operatorname{Im} A)^\perp = \ker A^*$.

Доказательство. Пусть $f \in \ker A \Leftrightarrow Af = 0 \Leftrightarrow \forall g \in H (Af, g) = 0 \Leftrightarrow (f, A^*g) = 0$.
 $\forall h \in \operatorname{Im} A^* (f, h) = 0 \Leftrightarrow f \in (\operatorname{Im} A^*)^\perp$. Второе утверждение доказывается аналогично.

Утверждение 4. $L \subset H$ — подпространство, тогда $L \subseteq L^{\perp\perp} = \overline{L}$.