读 Terence Tao 的调和分析 Notes(MATH 247A) 所作笔记

Notes taken by 89hao 2020 年 4 月 11 日

目录

1	Lecture Notes 1 FOR 247A		
	1.1	什么是调和分析	1
	1.2	建立不等式的方法	2
	1.3	一些简单但是重要的结论	5
	1.4	Lorentz Spaces	5
	1.5	Real Interpolation	10

1 Lecture Notes 1 FOR 247A

1.1 什么是调和分析

第一份讲义介绍了这份讲义 (总共 6 个 note) 讲述的内容:

实变量调和分析理论 (theory of real-variable harmonic analysis) 以及研究该 理论的基本工具

a. 什么是调和分析?

关于某个定义域或者类似对象 (测度,分布,定义域的子集,或者从一个定义域到另一个定义域的映射) 上的函数的定量 (quantitative) 研究.

b. 典型的例子?

例如一个从某个 Banach 函数空间 V 到另一个空间 W 的算子 T, 这个算子并非定义在全空间 V 上而是定义在它的一个稠密子集上. 考虑这样一个定性 (qualitative) 问题: 能否将 T 连续拓展到整个空间 V 上? 实际上若 T 是线性的, 如果我们能够建立

$$||Tf||_W \le C||f||_V$$

这样一种定量关系,那么就可以作一个唯一连续延拓.这里就是把一个定性问题转化成了一个定量问题来研究,这个定量问题就是调和分析中的一个典型问题.

从这个典型的例子可以知道:不等式在调和分析中有着非常重要的地位,甚至是核心的地位(就我目前读这个讲义的感觉).在介绍一些不等式的建立时,Tao在脚注中说了一句非常经典的话,来自于他自身的经验:

Algebra draws its power from modularity, abstraction and identities; analysis draws its power from robustness, physical intuition and estimates.

1.2 建立不等式的方法

对于 $1 \le p \le \infty$, 有下述三角不等式成立

Triangle inequality

$$||f + g||_p \le ||f||_p + ||g||_p. \tag{1}$$

证明这个不等式的时候, 我们会用到一些处理不等式的一般技巧.

- a. 根据 f 和 g 在不等式两边的齐次性 (对称性的一种), 可以设 $\|f\|_p = 1 \theta, \|g\|_p = \theta, \ 0 < \theta < 1(\theta = 0)$ 和 1 的情形是平凡的).
- b. 再将 f 和 g 的范数归一化, 设 $F = \frac{f}{1-\theta}, G = \frac{g}{\theta}$. 则不等式转化为

$$||(1-\theta)F + \theta G||_p \le 1,$$

其中 $||F||_p = 1$, $||G||_p = 1$.

c. 根据 $z \mapsto |z|^p$ 在 $p \ge 1$ 时的凸性可知

$$|(1-\theta)F(x) + \theta G(x)|^p \le (1-\theta)|F(x)|^p + \theta|G(x)|^p.$$

对上式积分即可.

概括起来就是,根据不等式的对称性,把不等式的选取范围缩小,限定在尽可能小的子集内,实际就是空间中的商作用.如有必要,对函数进行归一化.简化后的不等式往往更容易处理,在几何上有一些直观的特性(在这里就是凸性).

Hölder's inequality

$$||fg||_r \le ||f||_p ||g||_q,\tag{2}$$

其中 $0 < p,q,r \le \infty, \frac{1}{r} = \frac{1}{p} + \frac{1}{q}$.

这里除了总的齐次性之外,每个函数各自单独也有齐次性 (separate homogeneity symmetry),所以可以直接设 $\|f\|_p = \|g\|_q = 1$. 令 $F := |f|^p$, $G := |g|^q$, $\theta = \frac{r}{a}$, 则原不等式化为

$$\int_X F^{1-\theta} G^{\theta} \le 1, \not \exists \psi \int_X F = \int_X G = 1.$$

这里再次利用 ln x 的凸性可得逐点估计:

$$F^{1-\theta}G^{\theta} \le (1-\theta)F(x) + \theta G(x).$$

对上式进行积分即可.

Log-convexity of L^p norms

$$||f||_r \le ||f||_p^{1-\theta} ||f||_q^{\theta},$$
 (3)

其中 0 .

用类似的方法证明这个不等式的时候, 需要注意到该不等式有关于 f 和 μ 的 齐次对称性, 从而可以设 $||f||_p = ||f||_q = 1$. 当然这个不等式可以由 Hölder 不等式简单推导得到 (实际上这两个不等式是等价的).

讲义还给出了 log-convexity 的一个不常见的证明, 这个证明没有用到任何的逐点凸性估计 (pointwise convexity estimate), 而是用到了"分治-合并"策略 ("divide and conquer" strategy) 以及非常优雅 (并且相当无赖) 的"张量幂技巧"("tensor power trick"). 仍然假设 $||f||_p = ||f||_q = 1$, 我们将函数 f 分成宽广平坦函数和窄高函数

$$f = f1_{|f| \le 1} + f1_{|f| > 1}.$$

进而

$$||f||_r^r = \int_{|f| \le 1} |f|^r + \int_{|f| > 1} |f|^r.$$

当 $|f| \le 1$ 的时候, 由 r > p 可得 $|f|^r \le |f|^p$; 当 |f| > 1 的时候, 由 r < q 可得 $|f|^r \le |f|^q$. 从而

$$||f||_r^r \le \int_X |f|^p + \int_X |f|^q = 2.$$

下面就是张量幂技巧的使用: 设 M 为一个正整数, 用测度空间 $(X^M, \mathcal{B}^{\oplus M}, \mu^{\oplus M})$ 代替 (X, \mathcal{B}, μ) , 用函数 $f^{\oplus M}: X^M \to \mathbb{C}$ 代替函数 f, 其中

$$f^{\oplus M}(x_1, x_2, \cdots, x_M) := f(x_1)f(x_2)\cdots f(x_M).$$

易知

$$||f^{\oplus M}||_{L^p(X^M)} = ||f||_{L^p(X)}^M = 1;$$

$$||f^{\oplus M}||_{L^q(X^M)} = ||f||_{L^q(X)}^M = 1;$$

$$||f^{\oplus M}||_{L^r(X^M)} = ||f||_{L^r(X)}^M.$$

再次利用前面的论证, 这次是应用到函数 $f^{\oplus M}$ 上, 得到

$$||f^{\oplus M}||_{L^r(X^M}^r \le 2.$$

进而

$$||f||_{L^r(X)}^r \le 2^{1/M}.$$

令 $M \to \infty$, 我们就得到了 $||f||_r \le 1$.

1.3 一些简单但是重要的结论

1. 设 $\mu(X) < \infty, f$ 是 X 上的函数, 则更高的 L^p 范数控制更低的范数:

$$||f||_p \le ||f||_q \mu(X)^{\frac{1}{p} - \frac{1}{q}},$$
 (4)

其中 0 .

 $2. l^p$ 和与 L^p 和的可交换性:

$$\left\| \left(\sum_{n} |f_{n}|^{p} \right)^{1/p} \right\| = \left(\sum_{n} \|f\|_{L^{p}}^{p} \right)^{1/p}. \tag{5}$$

3. 对任意 $0 < p, q < \infty$:

$$|||f|^p||_{L^q} = ||f||_{L^{pq}}^p.$$
(6)

1.4 Lorentz Spaces

考虑 weak L^p 和 $\|\cdot\|_{L^p}$:

$$||f||_{L^{p,\infty}} = ||\lambda\mu \left(\{|f| \ge \lambda\}\right)^{1/p} ||_{L^{\infty}(\mathbb{R}^{+}, \frac{d\lambda}{\lambda})} ||f||_{L^{p}} = p^{1/p} ||\lambda\mu \left(\{|f| \ge \lambda\}\right)^{1/p} ||_{L^{p}(\mathbb{R}^{+}, \frac{d\lambda}{\lambda})}.$$

由这两个式子可以让我们推广出一个新的拟范数 Lorentz norm $L^{p,q}(X,\mu),0 :$

$$\|f\|_{L^{p,q}(X,\mu)}:=p^{1/q}\|\lambda\mu\left(\left\{|f|\geq\lambda\right\}\right)^{1/p}\|_{L^q(\mathbb{R}^+,\frac{\mathrm{d}\lambda}{\lambda})}.$$

除了 $L^{\infty,\infty}=L^{\infty}$ 这一特殊情况, Lorentz norms 中 p 都不会取 ∞ . 对于 q 来说, 按照重要程度依次递减, 只会用到 $q=p,q=\infty,q=1,q=2$. 可以通过简单的计算知对于一个高 H 宽 W 的函数, 它的 $L^{p,q}$ norm 是 $(p/q)^{\frac{1}{q}}HW^{\frac{1}{p}}$, 其中 0 .

定义 1.1.

- a. 如果一个支撑为 E 的函数 f, 几乎处处满足 $|f(x)| \le H$ 并且 $\mu(E) \le W$, 则称 f 是一个高 H 宽 W 的 sub-step function.(因此 $|f| \le H1_E$.)
- b. 如果函数 f 满足几乎处处 $|f(x)| \sim H$, 以及 $\mu(E) \sim W$, 则称 f 是一个高 H 宽 W 的 quasi-step function .(因此 $|f| \sim H1_E$.)

注 1.1. 一个高 1 宽 W 的 sub-step function 按照二进制展开, 总能分解成真正的 step functions 的和:

$$f = \sum_{k=1}^{\infty} 2^{-k} f_k,$$

其中 f_k 是高 1 宽 H 的 step functions. 因此, 上述定义的两个函数类型都可以由 step function 逼近.

定理 1.1 (Characterisation of $L^{p,q}$ **).** 设 f 为一个函数, $0 , 设 <math>0 < A < \infty$. 那么下述 5 个在相差一个常数的情况下是等价的:

- a. $||f||_{L^{p,q}} \lesssim_{p,q} A$.
- b. 存在一个分解 $f = \sum_{m \in \mathbb{Z}} f_m$, 其中 f_m 是支撑互不相交, 高 2^m 宽 $0 < W_m < \infty$ 的 quasi-step function, 并且

$$||2^m W_m^{1/p}||_{l_m^q(\mathbb{Z})} \lesssim_{p,q} A.$$
 (7)

这里 l_m^q 中的下标 m 是表示 l^q norm 针对的变量.

c. 存在一个逐点界 $|f| \leq \sum_{m \in \mathbb{Z}} 2^m 1_{E_m}, E_m$ 满足

$$||2^m \mu(E_m)^{1/p}||_{l_m^q(\mathbb{Z})} \lesssim_{p,q} A.$$
 (8)

d. 存在一个分解 $f = \sum_{n \in \mathbb{Z}} f_n$, 其中 f_n 是支撑互不相交, 高 $0 < H_n < \infty$ 宽 2^n 的 quasi-step function, H_n 关于 n 单调不增, 在 f_n 的支撑上有 $H_{n+1} \le |f_n| \le H_n$, 以及

$$||H_n 2^{n/p}||_{l_n^q(\mathbb{Z})} \lesssim_{p,q} A. \tag{9}$$

e. 一个逐点界 $|f| \leq \sum_{n \in \mathbb{Z}} H_n 1_{E_n}$, E_n 满足 $\mu(E_n) \lesssim_{p,q} 2^n$ 并且 (9) 式成立.

证明: 由齐次对称性可设 $A = 1.(b) \Rightarrow (c)$ 和 $(d) \Rightarrow (e)$ 式显然的. 下面说明 $(a) \Rightarrow (b)$.

设

$$f_m := f 1_{2^{m-1} < |f| \le 2^m},$$

$$W_m := \mu \left(\left\{ 2^{m-1} < |f| \le 2^m \right\} \right).$$

这种分解方式被称为 "vertically dyadic layer cake decomposition". 可以验证

$$2^m W_m^{1/p} \lesssim_{p,q} \|\lambda \mu \left(\left\{|f| > \lambda\right\}\right)^{1/p} \|_{L^q\left(\left[2^{m-2}, 2^{m-1}\right], \frac{\mathrm{d}\lambda}{\lambda}\right)}$$

然后再对上式进行 l^q 求和即可.

类似地, 为了得到 $(a) \Rightarrow (d)$, 定义

$$H_n := \inf \left\{ \lambda : \mu \left(\left\{ |f| > \lambda \right\} \right) \le 2^{n-1} \right\},\,$$

注意到这是一个关于 n 的单调不增序列, 当 $n \to \infty$ 时会趋于 0. 再定义

$$f_n := f1_{H_n > |f| > H_{n+1}}.$$

该分解被称为 "horizontally dyadic layer cake decomposition". 唯一需要验证的就是 (9) 式. 下述的估计方式被称为 "telescoping estimate":

$$H_{n}2^{n/p} = (H_{n}^{q}2^{nq/p})^{1/q}$$

$$= \left(\sum_{k=0}^{\infty} (H_{n+k}^{q} - H_{n+k+1}^{q}) 2^{nq/p}\right)^{1/q}$$

$$\lesssim_{p,q} \left(\sum_{k=0}^{\infty} 2^{-kq/p} \|\lambda 2^{(n+k)/p}\|_{L^{q}([H_{n+k+1}, H_{n+k}], \frac{d\lambda}{\lambda})}^{1/q}\right)^{1/q}$$

$$\lesssim_{p,q} \left(\sum_{k=0}^{\infty} 2^{-kq/p} \|\lambda \mu \left(\{|f| \ge \lambda\}\right)^{1/p} \|_{L^{q}([H_{n+k+1}, H_{n+k}])}^{q}\right)^{1/q}.$$

同样对上式进行 l^q 求和即可 (这里处理的是 $q < \infty$ 的情形, 对于 $q = \infty$ 的情形 可以用类似的处理方法).

为了完成等价性的证明, 还要验证 $(c) \Rightarrow (a)$ 和 $(d) \Rightarrow (a)$. 首先假设 (c) 成立, 易知

$$\mu(\{|f| > 2^m\}) \le \sum_{k=0}^{\infty} \mu(E_{m+k})$$

从而有

$$\|\lambda\mu\left(\{|f| \geq \lambda\}\right)^{1/p}\|_{L^q((2^m, 2^{m+1}], \frac{\mathrm{d}\lambda}{\lambda}} \lesssim_{p,q} 2^m \left(\sum_{k=0}^{\infty} \mu\left(E_{m+k}\right)\right)^{1/p}.$$

对上式进行 lq 求和之后, 我们只需要证明

$$\|2^m \left(\sum_{k=0}^{\infty} \mu\left(E_{m+k}\right)\right)^{1/p} \|_{l_m^{q/p}} \lesssim_{p,q} 1.$$

上式可改写为

$$\| \sum_{k=0}^{\infty} 2^{pm} \mu \left(E_{m+k} \right) \|_{l_{m}^{q/p}} \lesssim_{p,q} 1.$$

但是依据假设我们有

$$\|2^{pm}\mu(E_m)\|_{l_m^{q/p}} \lesssim_{p,q} 1$$

所以通过对m 平移k 可得

$$\|2^{pm}\mu(E_{m+k})\|_{l_m^{q/p}} \lesssim_{p,q} 2^{-kp}.$$

再进行求和以及三角不等式即可.

现在假设 (d) 成立. 对于任意的 $\lambda > 0$ 我们有

$$\mu\left(\left\{|f|>\lambda\right\}\right) \lesssim_{p,q} \sup\left\{2^n: H'_n \geq \lambda\right\}$$

其中 H'_n 是

$$H'_n := \sum_{k=0}^{\infty} H_{n+k}.$$

实际上, 如果对某个 n 有 $\mu(\{|f|>\lambda\})>2^{n-1}$, 那么易知 $H_n\geq\lambda$ 从而 $H'_n\geq\lambda$. 通过对下标 n 的平移和三角不等式可得 H'_n 有着和 (??) 式中 H_n 一样的限制, 因此

$$||H'_n 2^{n/p}||_{l_n^q(\mathbb{Z})} \lesssim_{p,q} 1.$$

这里以 $q < \infty$ 的情形为例:

$$\|\lambda\mu\left(\{|f| \ge \lambda\}\right)^{1/p}\|_{L^{q}(\mathbb{R}^{+}, \frac{\mathrm{d}\lambda}{\lambda}}^{q} \lesssim_{p,q} \int_{0}^{\infty} \lambda^{q-1} \sup\left\{2^{nq/p} : H'_{n} \ge \lambda\right\} \mathrm{d}\lambda$$

$$\lesssim_{p,q} \sum_{n} \int_{0}^{\infty} \lambda^{q-1} 2^{nq/p} 1_{H'_{n} \ge \lambda} \mathrm{d}\lambda$$

$$\sim_{p,q} \sum_{n} 2^{nq/p} (H'_{n})^{q}$$

$$\lesssim 1.$$

这个定理说明, 如果一个函数 f 可以写成 $\sum_n f_n$, 其中 f_n 为高 H_n 宽 W_n 的 quasi-step function, 并且只要其中一个变化得足够块, 那么就有

$$\|\sum_{n} f_n\|_{L^{p,q}} \sim_{p,q} \|H_n W_n^{1/p}\|_{l_n^q}.$$

该定理的一个简单推论就是 Lorentz spaces 上的 Hölder 不等式.

定理 1.2 (Hölder inequality in Lorentz spaces). 设 $0 < p_1, p_2, p < \infty, 0 < q_1, q_2, q \leq \infty$, 并且满足 $\frac{1}{p} = \frac{1}{p_1} + \frac{1}{p_2}$ 和 $\frac{1}{q} = \frac{1}{q_1} + \frac{1}{q_2}$,则有

$$||fg||_{L^{p,q}} \lesssim_{p_1,p_2,q_1,q_2} ||f||_{L^{p_1,q_1}} ||g||_{L^{p_2,q_2}},$$

前提是不等式右边有意义.

还有两个类似于 Riesz 表示定理的结论如下, 在证明 Marcinkiewicz 插值定理的时候会被用到.

定理 1.3 (Dual formulation of weak L^p). 设 $1 , 对任意 <math>L^{p,\infty}(X, d\mu)$ 中的函数 f 都有

$$||f||_{L^{p,\infty}(X,d\mu)} \sim_p \sup \left\{ \mu(E)^{-1/p'} | \int_X f 1_E d\mu | : 0 < \mu(E) < \infty \right\}.$$
 (10)

定理 1.4 (Dual characterisation of $L^{p,q}$ **).** 设 $1 , 对任意 <math>f \in L^{p,q}$ 都有

$$||f||_{L^{p,q}} \sim_{p,q} \sup \left\{ |\int_X f\overline{g} d\mu| : ||g||_{L^{p',q'}} \le 1 \right\}.$$
 (11)

1.5 Real Interpolation

这里开始讨论线性算子. 首先我们需要定义一些概念.

定义 1.2. 设 $0 < p, q \le \infty$, T 是 sublinear operator, 则有如下定义

a. $T \in strong-type(p,q)$ (或者就简单地称为 type(p,q)), 如果其满足

$$||Tf||_{L^q(Y)} \lesssim_{T,p,q} ||f||_{L^p(X)},$$

其中 $f \in L^p$ 中的任意函数, 或者是 L^p 的一个稠密子集中的任意函数.

b. 若 $q < \infty$, 称 T 是 weak-type (p,q), 如果其满足

$$||Tf||_{L^{q,\infty}(Y)} \lesssim_{T,p,q} ||f||_{L^p(X)}.$$
 (12)

c. 设 f 是任意的高 H 宽 W 的 sub-step function, 则称 T 是 restricted strong-type (p,q), 如果其满足

$$||Tf||_{L^q(Y)} \lesssim_{T,p,q} HW^{1/p}.$$
 (13)

特别地, 我们有

$$||T1_E||_{L^q(Y)} \lesssim_{T,p,q} \mu(E)^{1/p}.$$
 (14)

d. 若 $q < \infty$, f 是任意的高 H 宽 W 的 sub-step function, 则称 T 是 restricted weak-type (p,q), 如果其满足

$$||Tf||_{L^{q,\infty}(Y)} \lesssim_{T,p,q} HW^{1/p}. \tag{15}$$

特别地, 我们有

$$||T1_E||_{L^{q,\infty}(Y)} \lesssim_{T,p,q} \mu(E)^{1/p}.$$
 (16)

在许多应用中, 我们需要的往往是 strong-type bounds. 在这里我们会用 real interpolation method 来从 weak-type 甚至是 restricted weak-type 得到 strong-type bounds.

首先我们假设

$$\langle |Tf|, |g| \rangle := \int_{V} |Tf||g| d\nu$$
 (17)

是 well-defined 的, 其中 f, g 是拥有有限测度支撑的简单函数 (simple functions). 现在我们来看一个 indicator function 的例子 $\langle |T1_E|, 1_F \rangle$, 其中 $E \subset X, F \subset Y$ 都具有限测度. 假设 T 有 strong-type (p, q) bound, 0 , 也就是

$$||Tf||_{L^q(Y)} \lesssim_{p,q} A ||f||_{L^p(X)}.$$

那么就有

$$||T1_E||_{L^q(Y)} \lesssim_{p,q} A\mu(E)^{1/p},$$

从而由 Hölder 不等式可得

$$\langle |T1_E|, 1_F \rangle \lesssim_{p,q} \mu(E)^{1/p} \nu(F)^{1/q'}.$$
 (18)

实际上, strong-type 这个限制过于强了, 只要是 restricted strong-type 就能得出上面的结论.

如果 q > 1, 我们还可以把条件放宽到 restricted weak-type:

性质 1.1. 设 0 0. 设 T 是使得 (17) 式良定义的 sublinear operator. 则下面两个在相差一个隐含常数的情况下是等价的:

• T 是 restricted weak-type (p,q), A > 0, 并满足

$$||Tf||_{L^{q,\infty}} \lesssim_{p,q} AHW^{1/p},\tag{19}$$

其中 f 是任意高 H 宽 W 的 sub-step function.

• 对于任意的 $E \subset X, F \subset Y$ 且测度有限的可测集, 我们有限制

$$\langle |T1_E|, 1_F \rangle \lesssim_{p,q} A\mu(E)^{1/p} \nu(F)^{1/q'}.$$

这个性质的证明需要用到(10)式,以及注 1.1.

推论 1.5 (Baby real interpolation). 设 T 是使得 (17) 式有意义的 sublinear operator, $0 < p_0, p_1 \le \infty, 1 < q_0, q_1 \le \infty, A_0, A_1 > 0$. T 是具有常数 A_i 的 restricted weak-type $(p_i, q_i), i = 0, 1$. 则 T 也是具有常数 A_{θ} 的 restricted weak-type $(p_{\theta}, q_{\theta}, q_$

$$\frac{1}{p_{\theta}} := \frac{1-\theta}{p_0} + \frac{\theta}{p_1}; \quad \frac{1}{q_{\theta}} := \frac{1-\theta}{q_0} + \frac{\theta}{q_1}; \quad A_{\theta} := A_0^{1-\theta} A_1^{\theta}.$$

上面推论的证明实际上就是由 $X \lesssim Y_0$ 和 $X \lesssim Y_1$ 可以推出 $X \lesssim Y_\theta = Y_0^{1-\theta}Y_1^\theta, 0 \le \theta \le 1$.

定理 1.6 (Marcinkiewicz interpolation theorem). 设 T 是一个 sublinear operator 而且 (17) 式是 well-defined 的. 设 $0 < p_0, p_1 \le \infty, 0 < q_0, q_1 \le \infty$ 以及 $A_0, A_1 > 0$. 定义

$$\frac{1}{p_{\theta}} := \frac{1-\theta}{p_0} + \frac{\theta}{p_1}; \quad \frac{1}{q_{\theta}} := \frac{1-\theta}{q_0} + \frac{\theta}{q_1}; \quad A_{\theta} := A_0^{1-\theta} A_1^{\theta}.$$

设 T 是一个 bound 为 A_i 的 restricted weak-type $(p_i, q_i), i = 0, 1$. 假设 $p_0 \neq p_1, q_0 \neq p_1$. 那么对于 $0 < \theta < 1$ 以及 $1 \leq r \leq \infty$,我们有

$$||Tf||_{L^{q_{\theta},r}(Y)} \lesssim_{p_0,p_1,q_0,q_1,r} A_{\theta} ||f||_{L^{p_{\theta},r}(X)},$$

其中 f 是任意拥有有限支撑的简单函数. 特别地, 如果 $q_{\theta} \geq p_{\theta}$, 那么 T 是一个具有常数 $bound\ O_{p_0,p_1,q_1,\theta}(A_{\theta})$ 的 $strong-type\ (p_{\theta},q_{\theta})$.