

1 Спектральная теорема. Функциональное исчисление

Теорема 1 (Теорема об отображении спектра). Пусть $A \in B(X)$, X — банахово пространство. $p(t) = \sum_{k=0}^n a_k t^k$. Тогда $\sigma(p(A)) = p(\sigma(A)) = \{\lambda = p(z) : z \in \sigma(A)\}$.

Доказательство. Пусть

$$p(t) - \lambda = a_n(t - z_1) \cdot (t - z_n), \quad \text{тогда} \quad p(A) - \lambda = a_n(A - z_1 I) \cdot \dots \cdot (A - z_n I).$$

Считаем, что $a_n \neq 0$.

1) Пусть $\lambda \in \sigma(p(A))$. Левая часть последнего равенства необратима. Следовательно, необратима правая часть. Значит существует i : $A - z_i I$ необратим, т.е. $z_i \in \sigma(A)$ и $\lambda = p(z_i)$. Доказали \subset .

2) Пусть $\lambda \in p(\sigma(A))$, т.е. $\exists z \in \sigma(A) : \lambda = p(z)$. В силу разложения $z = z_i$ для какого-то i . Оператор $A - z_i I$ необратим. Если $z_i \in \sigma_p(A)$, то ставим $A - z_i I$ на первое место (самое правое в произведении). Так можно сделать так как все операторы $A - z_k I$ перестановочны. Тогда у оператора $p(A) - \lambda I$ есть собственный вектор, т.е. $\lambda \in \sigma(p(A))$. Если же $\sigma_p(A) = \{\emptyset\}$, то образ оператора $A - z_i I$ не совпадает со всем пространством X . Ставим тогда оператор $A - z_i I$ на последнее место (самое левое в произведении) и убеждаемся, что и $\text{Im}(p(A) - \lambda I) \neq X$. \square

Теорема 2 (Голоморфное исчисление).

Теорема 3 (Непрерывное исчисление). Пусть H — гильбертово пространство $A = A^* \in B(H)$, $\sigma(A) \in [a; b]$. Тогда существует единственный гомоморфизм $\varphi : C[a; b] \rightarrow B(H)$ (на самом деле первичен гомоморфизм $\varphi : C(\sigma(A)) \rightarrow B(H)$), обладающий свойствами:

- 1) $\varphi(1) = I$;
- 2) $\varphi(x) = A$;
- 3) $\varphi(f + g) = \varphi(f) + \varphi(g)$; $\varphi(f \cdot g) = \varphi(f) \cdot \varphi(g)$;
- 4) φ — линейный непрерывный оператор из $C(\sigma(A))$ в $B(H)$, т.е. если $f_n \rightrightarrows f$, то $\varphi(f_n) \rightarrow \varphi(f)$ в $B(H)$. Этот гомоморфизм также обладает свойствами:
- 5) $\|\varphi(f)\| = \max_{t \in \sigma(A)} |f(t)|$ (усиление свойства 4));
- 6) $\forall B: AB = BA \Rightarrow \varphi(A)B = B\varphi(A)$;
- 7) $\varphi(\bar{f}) = (\varphi(f))^*$.

Доказательство. Свойство 3) — это всего лишь свойство гомоморфизма. Свойства 1) и 2) однозначно определяют φ на многочленах: $\varphi(\sum_{k=0}^n a_k t^k) = \sum_{k=0}^n a_k A^k$.

По теореме Вейерштрасса строим последовательность многочленов $\{p_n\}_{n=1}^{\infty} : \|f - p_n\|_{C(\sigma(A))} \rightarrow 0$.

Рассмотрим последовательность операторов $\{p_n(A)\}_{n=1}^{\infty}$. Если все коэффициенты всех многочленов вещественны, то $(p_n(A))^* = p_n(A)^*$ (иначе $(p_n(A))^* = \overline{p_n(A)}$). Рассмотрим сначала первый случай (последовательность многочленов с действительными коэффициентами). На основе теоремы 1 получаем:

$$\|p_n(A) - p_m(A)\| = \|(p_n - p_m)(A)\| = \max_{\lambda \in \sigma((p_n - p_m)(A))} |\lambda| = \max_{\lambda \in \sigma(A)} \|p_n(\lambda) - p_m(\lambda)\| \rightarrow 0, \quad m, n \rightarrow \infty.$$

Следовательно последовательность $\{p_n(A)\}_{n=1}^{\infty}$ фундаментальна в $B(H)$. Определим

$$f(A) := \lim_{n \rightarrow \infty} p_n(A).$$

Если взять другую последовательность многочленов $\{q_n\}_{n=1}^{\infty} : \|f - q_n\|_{C(\sigma(A))} \rightarrow 0$, то рассмотрев последовательность $p_1, q_1, \dots, p_n, q_n, \dots$, получим что и последовательность $p_1(A), q_1(A), \dots, p_n(A), q_n(A), \dots$ фундаментальна в $B(H)$, т.е. $f(A)$ не зависит от выбора последовательности многочленов.

Второй случай (последовательность многочленов с не вещественными коэффициентами).

$\|p_n(A)\|^2 = \|(p_n(A))^* \cdot p_n(A)\| = \|\overline{p_n} p_n(A)\| = \| |p_n|^2(A) \|^2$. Все многочлены $|p_n|^2$ имеют действительные коэффициенты и мы свели задачу к случаю 1). Последовательность $\{p_n(A)\}_{n=1}^{\infty}$ фундаментальна в $B(H)$.

В итоге определили φ на произвольной функции $f \in C(\sigma(A))$ и доказали свойство 4).

Свойство 5) $\|\varphi(f)\| = \|f(A)\| = \lim_{n \rightarrow \infty} \|p_n(A)\| = \lim_{n \rightarrow \infty} \max_{t \in \sigma(A)} |p_n(t)| = \|f\|_{C(\sigma(A))}$

Свойства 6) и 7) также следуют из предельных переходов и очевидного выполнения этих свойств для многочленов. \square

Теорема 4 (Борелевское исчисление). Пусть H — гильбертово пространство $A = A^* \in B(H)$, $\sigma(A) \in [a; b]$. $\mathcal{B}[a; b]$ — пространство ограниченных борелевских функций (норма: $\|f\|_{\mathcal{B}[a; b]} = \sup_{[a; b]} |f(t)|$). Тогда существует единственный гомоморфизм $\varphi : \mathcal{B}[a; b] \rightarrow B(H)$ (на самом деле первичен гомоморфизм $\varphi : \mathcal{B}(\sigma(A)) \rightarrow B(H)$), обладающий свойствами:

- 1) $\varphi(1) = I$;
- 2) $\varphi(x) = A$;
- 3) $\varphi(f + g) = \varphi(f) + \varphi(g)$; $\varphi(f \cdot g) = \varphi(f) \cdot \varphi(g)$;

4) Если $\|f_n\|_{\mathcal{B}(\sigma(A))} \leq C$ и $f_n(x) \rightarrow f(x)$ в каждой точке $x \in \sigma(A)$, то $\varphi(f_n) \xrightarrow{s} \varphi(f)$ в $B(H)$.

Этот гомоморфизм также обладает свойствами:

5) $\|\varphi(f)\|_{\mathcal{B}(\sigma(A))} = \max_{t \in \sigma(A)} |f(t)|$ (усиление свойства 4));

6) $\forall B: AB = BA \Rightarrow \varphi(A)B = B\varphi(A)$;

7) $\varphi(\bar{f}) = (\varphi(f))^*$.

Доказательство. Зафиксируем $x, y \in H$ и построим отображение

$$C[a; b;] \rightarrow \mathbb{C} \quad f \mapsto (f(A)x, y); \quad |(f(A)x, y)| \leq \|f\|_{C[a; b]} \|x\| \|y\|.$$

Получили линейный непрерывный функционал на $C[a; b]$. Следовательно, $\exists g \in BV_0[a; b]$

$$(f(A)x, y) = \int_a^b f(t) dg(t).$$

Функция g зависит от выбранных элементов x и y : $g = g_{x, y}$.

Замечание 1. Функция ограниченной вариации g порождает комплекснозначную меру $\mu_g: \mu_g([\alpha; \beta]) = g(\beta) - g(\alpha)$, которая есть линейная комбинация четырех неотрицательных мер. Так как

$$(x, y) = \frac{1}{4}((x + y, x + y) - (x - y, x - y) + i((x + iy, x + iy) - (x - iy, x - iy))),$$

то

$$\mu_{g_{x, y}} = \frac{1}{4}((\mu_{g_{x+y}} - \mu_{g_{x-y}}) + i(\mu_{g_{x+iy}} - \mu_{g_{x-iy}})).$$

Здесь $g_v := g_{v, v}$.

Пусть теперь $f \in \mathcal{B}[a; b]$. Рассмотрим $\int_a^b f(t) dg(t)$ — полуторалинейная форма от x и y (линейная по x и полуторалинейная по y) и

$$\left| \int_a^b f(t) dg(t) \right| \leq \|f\|_{\mathcal{B}[a; b]} |dg| \leq \|f\|_{\mathcal{B}[a; b]} \|x\| \|y\|.$$

Заметим, что справедливо неравенство $\text{Var}_a^b g \leq \|x\| \cdot \|y\|$. Для проверки этого факта строим последовательность функций f_n , $|f_n(x)| \leq 1$, $f_n(t) \rightarrow \text{sgn } g(t)$: $\left| \int_a^b f_n(t) dg(t) \right| \rightarrow \int_a^b |dg| = \text{Var}_a^b g$.

Следовательно, существует ограниченный оператор B ($\|B\| \leq \|f\|_{\mathcal{B}[a; b]}$) такой, что

$$\int_a^b f(t) dg(t) = (Bx, y).$$

Существование оператора B : форма $\overline{\int_a^b f(t) dg(t)}$ — линейный по y ограниченный функционал. Следовательно, существует $z \in H$: $\overline{\int_a^b f(t) dg(t)} = (y, z) = \overline{(z, y)} = \overline{(Bx, y)}$, z линейно зависит от x . Положим $z = Bx$.

Определим

$$f(A) := B.$$

Сходимость Если $f_n \in \mathcal{B}[a; b]$, $\|f_n\|_{\mathcal{B}} \leq C$, $f_n(x) \rightarrow f(x) \in \mathcal{B}[a; b]$, то по теореме Лебега

$$\int_a^b f_n(t) dg(t) \rightarrow \int_a^b f(t) dg(t),$$

следовательно $f_n(A) \rightarrow f(A)$. Из слабой сходимости в силу самосопряженности оператора A следует сильная сходимость:

$$\|f_n - f\|^2(A) \rightarrow 0 \Leftrightarrow ((f_n - f)(A))^*(f_n - f)(A) \rightarrow 0 \Rightarrow ((f_n - f)(A))^*(f_n - f)(A)x, x \rightarrow 0 \Leftrightarrow \|(f_n - f)(A)x\|^2 \rightarrow 0.$$

□

2 Спектральная теорема. Спектральная функция. Интегральное представление $f(A)$.

Проекторнозначные меры Пусть \mathcal{B} — σ -алгебра борелевских множеств на отрезке $[a; b]$, где $\sigma(A) \subset [a; b]$. Отображение $E: \mathcal{B} \rightarrow B(H)$ со свойствами ($\Omega \in \mathcal{B}$):

- 1) $E_{\Omega_1 \sqcup \Omega_2} = E_{\Omega_1} + E_{\Omega_2}$;
- 2) $E_{\Omega_1 \cap \Omega_2} = E_{\Omega_1} \cdot E_{\Omega_2}$;

$$3) (E_\Omega)^* = E_\Omega;$$

$$4) \Omega_n \rightarrow \Omega \text{ (т.е. } \chi_{\Omega_n}(t) \rightarrow \chi_\Omega(t) \text{ в каждой точке } t) \Rightarrow E_{\Omega_n} \xrightarrow{s} E_\Omega$$

называют проекторнозначной мерой.

Свойство 1) \Rightarrow аддитивность.

Свойство 2) $\Rightarrow E_\Omega = (E_\Omega)^2$. Вместе со свойством 3) получаем, что E — ортогональный проектор.

Обозначения: $E_\lambda = E_{(-\infty; \lambda)}$, $E_{[\alpha; \beta]} = E_\beta - E_\alpha$,

По E_λ можно строить интегралы; $T := \{t_k\}_{k=0}^n$, $\Xi := \{\xi_k\}_{k=1}^n$, $\xi_k \in [t_{k-1}; t_k]$.

а) Римана $S(T, \Xi, f) := \sum_{k=1}^n f(\xi_k) E_{[t_{k-1}, t_k]} \rightarrow \int_a^b f(t) dE_t$. Интеграл заведомо существует для $f \in C[a; b]$

б) Лебега $S_n(f) := \sum_{k \in \mathbb{Z}} \frac{k}{2^n} E_{\{t: \frac{k-1}{2^n} \leq f(t) < \frac{k}{2^n}\}} \rightarrow \int_{[a; b]} f(t) dE_t$. Интеграл заведомо существует для $f \in \mathcal{B}[a; b]$.

Сходимость интегральных сумм — равномерная.

Теорема 5 (Интегральное представление). $A = A^* \in B(H)$, $f \in \mathcal{B}[a; b]$ ($\sigma(A) \subset [a; b]$). Тогда $f(A) = \int_a^b f(t) dE_t$.

Доказательство. Положим

$$E_\Omega := \chi_\Omega(A).$$

Проверим, будет ли E_Ω проекторнозначной мерой.

Свойство 1) следует из свойств гомоморфизма. Так как $\chi^2(t) = \chi(t)$ и χ — действительная функция, то E_Ω — ортопроектор (это свойства 2) и 3)). Свойство 4) следует из теоремы о функциональном исчислении.

Представление функции от оператора.

1) Для характеристической функции борелевского множества Ω представление

$$\chi_\Omega(A) = \int_a^b \chi_\Omega(t) dE_t$$

следует из определения интеграла и определения семейства E_t .

2) Из пункта 1) получаем представление $f(A)$ для простых функций f .

3) Для произвольной ограниченной борелевской функции представление получается предельным переходом и применением теоремы Лебега о предельном переходе: $f_n(t) \rightarrow f(t)$. \square

Явное вычисление E_λ для конкретных операторов

1) $H = \mathbb{C}^n$, $A = A^*$.

Так как $A = A^*$, то существует ортонормированный базис, в котором матрица оператора имеет вид $\text{diag}\{\lambda_1, \dots, \lambda_n\}$. Действие оператора в этом базисе задается формулой

$$Ax = \sum_{k=1}^n \lambda_k \underbrace{(x, e_k)}_{\text{проектор на собственное подпространство}} e_k = \sum_{k=1}^n \lambda_k P_k = \int_{\sigma(A)} \lambda dE_\lambda,$$

откуда получаем, что при достаточно малом ε (такие, что окрестности собственных значений не пересекаются) $E_{[\lambda_k - \varepsilon; \lambda_k + \varepsilon]} x = (x, e_k) e_k$ (при условии однократности λ_k ; — иначе просуммировать по всем собственным векторам для этого λ_k).

2) $H = L_2[a; b]$, $(Af)(x) = \varphi(x)f(x)$, φ — действительная непрерывная строго монотонная функция (пусть $\varphi \uparrow$).

Так как $\sigma(A) = [\varphi(a); \varphi(b)]$, то E_λ надо определить при $\lambda \in [\varphi(a); \varphi(b)]$.

Пусть $\lambda: \varphi(a) < \lambda < \varphi(b)$. Из определения функции $\chi_{[\varphi(a); \lambda]}(t)$ следует, что

$$\chi_{[\varphi(a); \lambda]}(A) = \begin{cases} I, & \text{если } t < \lambda \\ O, & \text{если } t \geq \lambda, \end{cases}$$

т.е. это проектор, действие которого после замены переменных $x = \varphi^{-1}(t)$, задается формулой

$$\chi_{[\varphi(a); \lambda]}(A)f(x) = \chi_{[a; \varphi^{-1}(\lambda)]}(x)f(x).$$

3 Спектральная теорема. Унитарная эквивалентность самосопряженного оператора оператору умножения на функцию

Определение. Циклический вектор. Вектор x называется циклическим для оператора A , если $\langle x, Ax, A^2x, \dots \rangle^\perp = 0$.

Оператор с циклическим вектором называют еще *оператором с простым спектром*.

Теорема 6. H — сепарабельное гильбертово пространство, $A = A^* \in B(H)$ — оператор с циклическим вектором. $\sigma(A) \in [a; b]$. Тогда существует мера μ и $U: H \rightarrow L_2([a; b], \mu)$ — унитарный изоморфизм пространств, что $UA = MU$, где $Mf(t) = tf(t)$.

Доказательство. Пусть h — циклический вектор. Определим меру μ : $\mu([\alpha; \beta]) = (E_{[\alpha; \beta]}h, h)$

Строим изоморфизм: $U : h \mapsto 1, U : Ah \mapsto t, \dots U : A^n h \mapsto t^n$.

В силу циклическости вектора h вектора $\sum_{k=0}^n A^k h$ всюду плотны в H , многочлены $U(\sum_{k=0}^n A^k h) = \sum_{k=0}^n t^k$ всюду плотны в $L_2([a; b]; \mu)$.

Изометричность U

$$(UA^k h, UA^n h)_{L_2} = \int_{[a; b]} t^{k+n} d\mu$$

$$(A^k h, A^n h)_H = (A^{k+n} h, h)_H = \int_{\sigma(A)} \lambda^{k+n} (dE_\lambda h, h) = \int_{[a; b]} \lambda^{k+n} d\mu.$$

Далее продолжаем U как изометричный оператор со всего H на все $L_2([a; b], \mu)$ (т.е. унитарный оператор). \square

Теорема 7. H — сепарабельное гильбертово пространство, $A = A^* \in B(H)$ — оператор без циклического вектора. $\sigma(A) \subset [a; b]$. Тогда существует разложения пространства в прямую сумму подпространств $H = \bigoplus_{n=1}^N H_n$ ($N \leq \infty$), в каждом из которых у оператора $A|_{H_n}$ есть циклический вектор, существуют меры μ_n ($n \leq N$) и $U : \bigoplus_{n=1}^N H_n \rightarrow \bigoplus_{n=1}^N L_2([a; b], \mu_n)$ — унитарный изоморфизм пространств, что $UA|_{H_n} = M_n U$, где $M_n f(t) = tf(t)$ в $L_2([a; b], \mu_n)$.

Доказательство. Рассмотрим семейство \mathcal{S} , состоящее из сумм попарно ортогональных инвариантных для A замкнутых подпространств $E \in H$ ($AE \subset E$), таких что в каждом из слагаемых A имеет циклический вектор.

Это семейство частично упорядочено по включению. Каждая возрастающая последовательность из \mathcal{S} ограничена сверху (объединением элементов последовательности), следовательно в \mathcal{S} есть максимальный элемент, который имеет вид $\bigoplus_{n=1}^N H_n$ ($N \in \mathbb{N}$ или $N = \infty$ — счетное множество, H_n — взаимно ортогональные инвариантные подпространства, в каждом из которых есть циклический вектор). При этом $H = \bigoplus_{n=1}^N H_n$.

Действительно, если бы существовал вектор $x \neq 0, x \perp H_n \forall n$, то $\langle x, Ax, \dots, A^k x, \dots \rangle$ было бы ортогонально $\bigoplus_{n=1}^N H_n$ (если подпространство инвариантно для $A = A^*$, то его ортогональное дополнение тоже инвариантно для A), инвариантно для A и x в нем циклический. Это противоречит существованию максимального элемента в \mathcal{S} . По теореме 1 в каждом пространстве H_n оператор A подобен оператору умножения на независимую переменную в $L_2([a; b], \mu_n)$. \square

Теорема 8 (Следствие теоремы 2). H — сепарабельное гильбертово пространство, $A = A^* \in B(H)$ — оператор без циклического вектора. $\sigma(A) \subset [a; b]$. Тогда существуют такие мера μ , унитарный изоморфизм $U : H \rightarrow L_2(\mathbb{R}, \mu)$ и вещественная функция $\varphi \in L_\infty(\mathbb{R})$, что $UA = UA_\varphi$, где оператор A_φ есть оператор умножения на функцию φ в $L_2(\mathbb{R})$. Другими словами, оператор A подобен оператору умножения на функцию.

Доказательство. Для определенности возьмем в качестве $[a; b]$ отрезок $[-\|A\|; \|A\|]$.

Определим проекторы $P_n : H \rightarrow H_n$. Тогда для любого вектора $x \in H$ справедливо представление $x = \sum P_n x$. Иначе $y := x - \sum P_n x \perp \bigoplus_{n=1}^N H_n$ и $y \notin \langle \bigoplus_{n=1}^N H_n \rangle$.

В каждом H_n у $A|_{H_n}$ есть циклический вектор. Найдем борелевскую меру μ_n на $\sigma(A) \subset [a; b] =: \Delta_0$ такую, что $A|_{H_n}$ унитарно эквивалентен оператору умножения на t в $L_2([a; b], \mu_n)$.

Перенесем μ_n на $\Delta_n = \Delta_0 + 3n\|A\| = [(3n-1)\|A\|; (3n+1)\|A\|]$, обозначим полученную меру ν_n . Оператор $A|_{H_n}$ унитарно эквивалентен оператору умножения на $t - 3n\|A\|$ в $L_2(\Delta_n, \nu_n)$.

Определим $\mu := \sum_{n=1}^N 2^{-n} \nu_n$, $\varphi(t) := t - 3n\|A\|$ при $t \in \sigma(A) + 3n\|A\|$. Пусть U_n — унитарный оператор $H_n \rightarrow L_2(\Delta_n, \nu_n)$, такой что $U_n A|_{H_n} = (t - 3n\|A\|)U_n$. Вне компактов $\sigma(A) + 3n\|A\|$ доопределим φ каким-либо значением из $\sigma(A)$.

Зададим в $L_2(\mathbb{R}, \mu)$ оператор A_φ умножения на φ .

Осталось задать унитарный оператор $U : H \rightarrow L_2(\mathbb{R}, \mu)$. Для произвольного вектора x обозначим x_n его проекцию на H_n .

Определим

$$Ux := U \sum_{n=1}^N x_n = \sum_{n=1}^N 2^{n/2} U_n x_n$$

Ряд сходится, ибо носители функций $2^{n/2} U_n x_n$ лежат в Δ_n , которые не пересекаются, а функция интегрируется по мере $2^{-n} \nu_n$. Проверим:

$$\|Ux\|_{L_2}^2 = \sum_{n=1}^N 2^{-n} 2^n \|U_n x_n\|_{L_2(\Delta_n, \nu_n)}^2 = \sum_{n=1}^N \|x_n\|_{H_n}^2 = \|x\|^2 \quad \text{— унитарность.}$$

$$A_\varphi Ux = \sum_{n=1}^N \varphi 2^{n/2} U_n x_n = \sum_{n=1}^N 2^{n/2} U_n A x_n = UA x$$

\square

Теорема 9 (Без доказательства). Для любого самосопряженного оператора $A \in B(H)$ в сепарабельном гильбертовом пространстве H существует такая борелевская мера μ и такая конечная или счетная упорядоченная по вложенности последовательность множеств σ_k , $\sigma_1 = \sigma(A)$, что оператор A унитарно эквивалентен ортогональной сумме операторов умножения на t в пространствах $L_2(\sigma_k, \mu)$.

Полная система унитарных инвариантов самосопряженного оператора A

Определение. Эквивалентность мер. $\mu_1 \sim \mu_2$, если запас множеств меры нуль по каждой мере один и тот же.

Инварианты:

1. Тип меры: $\mu_1 \sim \mu_2$.
2. Функция кратности n_A : $\sigma_1 := \sigma(A)$, $\sigma_j \subset \sigma(A)$ $j = 1, 2, \dots$ — последовательность невозрастающих множеств $\sigma_j \supset \sigma_{j+1}$. Определим $n_A(t) = 0$ вне $\sigma(A)$; $n_A(t) = j$ при $t \in \sigma_j \setminus \sigma_{j+1}$, $j = 1, 2, \dots$

Пример. $(Af)(x) = \frac{3}{4}x^2 + \frac{1}{4}x$ в $L_2[-1; 1]$. $\sigma_1 = \sigma(A) = [-\frac{1}{48}; 1]$; $\sigma_2 = [-\frac{1}{48}; \frac{1}{2}]$. $n_A(t) = 2$ при $t \in [0; \frac{1}{2}]$; $n_A(t) = 1$ при $t \in (\frac{1}{2}; 1]$.