

Alois Apfelbeck

Elementární důkaz existence charakteristických hodnot pro symetrické Fredholmovy integrální rovnice 2. druhu

Časopis pro pěstování matematiky, Vol. 87 (1962), No. 3, 367--374

Persistent URL: <http://dml.cz/dmlcz/117433>

Terms of use:

© Institute of Mathematics AS CR, 1962

Institute of Mathematics of the Academy of Sciences of the Czech Republic provides access to digitized documents strictly for personal use. Each copy of any part of this document must contain these *Terms of use*.



This paper has been digitized, optimized for electronic delivery and stamped with digital signature within the project *DML-CZ: The Czech Digital Mathematics Library* <http://project.dml.cz>

ELEMENTÁRNÍ DŮKAZ
EXISTENCE CHARAKTERISTICKÝCH HODNOT PRO SYMETRICKÉ
FREDHOLMOVY INTEGRÁLNÍ ROVNICE 2. DRUHU

ALOIS APFELBECK, Praha

(Došlo dne 30. června 1961)

Metody důkazu existence charakteristických hodnot pro okrajové úlohy v teorii diferenciálních rovnic, užitá v [1] a [2], lze užít i na symetrické Fredholmovy integrální rovnice 2. druhu.

Všechny funkce v tomto pojednání jsou omezené komplexní funkce reálných proměnných; $\langle a, b \rangle$ je omezený uzavřený interval a Riemannovy integrály $\int_a^b K(x, y) dy$, $\int_a^b K(x, y) dx$, $\int_a^b \int_a^b K(x, y) dx dy$, $\int_a^b \varphi(x) dx$, $\int_a^b \psi(x) dx$ existují (tedy existují mj. i integrály $\int_a^b |\varphi(x)|^2 dx$, $\int_a^b \int_a^b |K(x, y)|^2 dx dy$ apod.). Integrální rovnice

$$(1) \quad \varphi(x) - \lambda \int_a^b K(x, y) \varphi(y) dy = f(x)$$

se nazývá Fredholmova rovnice 2. druhu. Zde jsou $f(x)$ a jádro $K(x, y)$ dané funkce. Rovnici nazýváme symetrickou, je-li

$$(2) \quad K(x, y) = \overline{K(y, x)}.$$

Charakteristickou hodnotou jádra $K(x, y)$ rozumíme takové číslo λ_0 (obecně komplexní), pro něž má homogenní rovnice

$$(3) \quad \varphi_0(x) - \lambda_0 \int_a^b K(x, y) \varphi_0(y) dy = 0$$

netriviální řešení $\varphi_0(x)$. Toto řešení pak nazýváme charakteristickou funkcí jádra $K(x, y)$. Ze vztahu (3) je zřejmé, že $\lambda = 0$ nemůže být charakteristickou hodnotou.

Z obecné teorie Fredholmových rovnic ([3], kap. I) je známá věta:

Není-li λ charakteristická hodnota jádra $K(x, y)$, má rovnice (1) právě jedno řešení

$$\varphi(x, \lambda) = f(x) + \lambda \int_a^b \Gamma(x, y, \lambda) f(y) dy,$$

kde $\Gamma(x, y, \lambda)$ je tzv. Fredholmova resolventa. Tato resolventa je v celé komplexní λ -rovině meromorfní funkce a jejími póly jsou charakteristické hodnoty jádra $K(x, y)$.

Dále je známo ([3], kap. II, § 12), že všechny charakteristické hodnoty symetrického jádra jsou reálné.

Konečně uijeme věty ([3], kap. II, § 13), že množina charakteristických hodnot druhého iterovaného jádra $K_2(x, y) = \int_a^b K(x, t) K(t, y) dt$ je totožná s množinou čtverců charakteristických hodnot jádra $K(x, y)$.

V této práci je podán elementární důkaz věty 3, kap. II, § 12 učebnice [3]:

Nechť $K(x, y) = \overline{K(y, x)}$, $\int_a^b \int_a^b |K(x, y)|^2 dx dy = C^2 > 0$. Potom v absolutní hodnotě nejmenší charakteristická hodnota λ_0 jádra $K(x, y)$ je dána vztahem

$$(4) \quad \frac{1}{|\lambda_0|} = \max_{\varphi} |K[\varphi]|,$$

kde

$$(5) \quad K[\varphi] = \int_a^b \int_a^b K(x, y) \varphi(x) \overline{\varphi(y)} dx dy,$$

přičemž φ probíhá množinou všech funkcí integrovatelných v intervalu $\langle a, b \rangle$, které vyhovují podmínce

$$(6) \quad \int_a^b |\varphi(x)|^2 dx = 1.$$

Výraz $|K[\varphi]|$ nabývá uvedeného maxima, je-li $\varphi(x) = \overline{\varphi_0(x)}$, kde $\varphi_0(x)$ je charakteristická funkce odpovídající charakteristické hodnotě λ_0 a normovaná vztahem (6).

Než přikročíme k důkazu této věty, dokážeme dvě pomocné věty.

Pomocná věta 1. Budiž $f(x, y)$ reálná funkce omezená a integrovatelná v oboru $a \leq x, y \leq b$ a nechť

$$\int_a^b \int_a^b (f(x, y))^2 dx dy = C^2 > 0.$$

Potom existuje obdélník $\alpha_1 \leq x \leq \beta_1, \alpha_2 \leq y \leq \beta_2$, který je částí čtverce $a \leq x, y \leq b$, takový, že

$$\int_{\alpha_1}^{\beta_1} \int_{\alpha_2}^{\beta_2} f(x, y) dx dy \neq 0,$$

přičemž je buďto $\beta_1 < \alpha_2$ nebo $\beta_2 < \alpha_1$.

Důkaz. Nejprve ukážeme, že existuje obdélník $\alpha'_1 \leq x \leq \beta'_1, \alpha'_2 \leq y \leq \beta'_2$, který je částí čtverce $a \leq x, y \leq b$, tak, že pro všechny body (x, y) tohoto obdélníka platí

$$|f(x, y)| > \frac{C}{2(b-a)} > 0.$$

Kdyby totiž v každém, libovolně zvoleném obdélníku ležel bod (x, y) , v němž je

$$|f(x, y)| \leq \frac{C}{2(b-a)},$$

bylo by

$$(f(x, y))^2 \leq \frac{C^2}{4(b-a)^2}$$

a každý dolní součet by byl nejvýše roven $\frac{1}{4}C^2$, takže dolní integrál funkce $(f(x, y))^2$ ve čtverci $a \leq x, y \leq b$ by nepřevyšoval $\frac{1}{4}C^2$. Na druhé straně je společná hodnota dolního a horního integrálu rovna

$$\int_a^b \int_a^b (f(x, y))^2 dx dy = C^2,$$

čímž docházíme ke sporu.

Předpokládejme nyní, že v každém obdélníku $\alpha_1 \leq x \leq \beta_1, \alpha_2 \leq y \leq \beta_2$, který je částí obdélníku $\alpha'_1 \leq x \leq \beta'_1, \alpha'_2 \leq y \leq \beta'_2$, jsou jak body, ve kterých je

$$f(x, y) > \frac{C}{2(b-a)},$$

tak i body, v nichž je

$$f(x, y) < -\frac{C}{2(b-a)}.$$

To však znamená, že v tomto obdélníku je horní integrál alespoň

$$\frac{C}{2(b-a)} (\beta_1 - \alpha_1) (\beta_2 - \alpha_2)$$

a dolní integrál nejvýše

$$-\frac{C}{2(b-a)} (\beta_1 - \alpha_1) (\beta_2 - \alpha_2),$$

tj. funkce $f(x, y)$ nemůže být zde (a tudíž ani ve čtverci $a \leq x, y \leq b$) integrabilní, což je proti předpokladu věty.

Existuje tedy obdélník, ve kterém funkce $f(x, y)$ nemění znamení a vyhovuje nerovnosti

$$|f(x, y)| > \frac{C}{2(b-a)}.$$

To však zřejmě platí i pro každý obdélník, který je částí tohoto obdélníka, čímž lze splnit i jednu z nerovností $\beta_1 < \alpha_2$ nebo $\beta_2 < \alpha_1$. Bude pak pro $f(x, y) > 0$ (resp. < 0)

$$\int_{\alpha_1}^{\beta_1} \int_{\alpha_2}^{\beta_2} f(x, y) dx dy > 0 \quad (\text{resp. } < 0), \quad \text{c. b. d.}$$

Pomocná věta 2. Budiž $K(x, y)$ omezená komplexní funkce reálných proměnných x, y integrabilní ve čtverci $a \leq x, y \leq b$ a nechť $K(x, y) = \overline{K(y, x)}$. Nechť konečně

$$\int_a^b \int_a^b |K(x, y)|^2 dx dy = C^2 > 0.$$

Potom existuje funkce $\psi(x)$ omezená a integrabilní v $\langle a, b \rangle$ tak, že

$$\int_a^b \int_a^b K(x, y) \psi(x) \bar{\psi}(y) dx dy = 0. *$$

Důkaz. Položme $K(x, y) = A(x, y) + iB(x, y)$. Zřejmě je $A(x, y) = A(y, x)$ a $B(x, y) = -B(y, x)$ a alespoň jeden z integrálů

$$\int_a^b \int_a^b A^2(x, y) dx dy = C_1^2 \quad \int_a^b \int_a^b B^2(x, y) dx dy = C_2^2$$

je kladný.

Nechť tvrzení věty není správné. Potom pro každou funkci $\psi(x)$ omezenou a integrabilní v $\langle a, b \rangle$ bude

$$(7) \quad K[\psi] = \int_a^b \int_a^b K(x, y) \psi(x) \bar{\psi}(y) dx dy = 0.$$

Zvolme dva libovolné disjunktní intervaly $\langle \alpha_1, \beta_1 \rangle$ a $\langle \alpha_2, \beta_2 \rangle$, které jsou oba částmi intervalu $\langle a, b \rangle$, a položme

$$\psi(x) = \begin{cases} m_1, & \text{pro } x \in \langle \alpha_1, \beta_1 \rangle, \\ m_2, & \text{pro } x \in \langle \alpha_2, \beta_2 \rangle, \\ 0 & \text{pro všechna ostatní } x \in \langle a, b \rangle, \end{cases}$$

kde m_1 a m_2 jsou libovolné komplexní konstanty. Po dosazení do (7) dostaneme

$$|m_1|^2 \int_{\alpha_1}^{\beta_1} \int_{\alpha_1}^{\beta_1} K(x, y) dx dy + m_1 \bar{m}_2 \int_{\alpha_1}^{\beta_1} \left(\int_{\alpha_2}^{\beta_2} K(x, y) dy \right) dx + \\ + \bar{m}_1 m_2 \int_{\alpha_2}^{\beta_2} \left(\int_{\alpha_1}^{\beta_1} K(x, y) dx \right) dy + |m_2|^2 \int_{\alpha_2}^{\beta_2} \int_{\alpha_2}^{\beta_2} K(x, y) dx dy = 0,$$

což je vzhledem k libovůli m_1 a m_2 možné pouze tehdy, je-li

$$\int_{\alpha_1}^{\beta_1} \int_{\alpha_1}^{\beta_1} K(x, y) dx dy = \int_{\alpha_2}^{\beta_2} \int_{\alpha_2}^{\beta_2} K(x, y) dx dy = 0,$$

$$m_1 \bar{m}_2 \int_{\alpha_1}^{\beta_1} \left(\int_{\alpha_2}^{\beta_2} K(x, y) dy \right) dx + \bar{m}_1 m_2 \int_{\alpha_2}^{\beta_2} \left(\int_{\alpha_1}^{\beta_1} K(x, y) dx \right) dy = 0.$$

Vzhledem k symetričnosti jádra lze poslední vztah přepsat ve tvaru

$$\int_{\alpha_1}^{\beta_1} \left(\int_{\alpha_2}^{\beta_2} [m_1 \bar{m}_2 K(x, y) + \bar{m}_1 m_2 \overline{K(x, y)}] dy \right) dx = 0,$$

$$\int_{\alpha_1}^{\beta_1} \left\{ \int_{\alpha_2}^{\beta_2} [(m_1 \bar{m}_2 + \bar{m}_2 m_1) A(x, y) + i(m_1 \bar{m}_2 - \bar{m}_1 m_2) B(x, y)] dy \right\} dx = 0.$$

*) Pro Lebesgueův integrál je tato věta dokázána v závěrečné části učebnice [4].

Je-li nyní $C_1 > 0$, zvolíme $m_1 = m_2 = 1$ a máme $\int_{\alpha_1}^{\beta_1} (\int_{\alpha_2}^{\beta_2} A(x, y) dy) dx = 0$; je-li $C_1 = 0$, je $C_2 > 0$ a volbou $m_1 = 1$, $m_2 = i$ dostaneme $\int_{\alpha_1}^{\beta_1} (\int_{\alpha_2}^{\beta_2} B(x, y) dy) dx = 0$. V obou případech docházíme ke sporu s pomocnou větou 1, takže vztah (7) nemůže být splněn pro libovolnou funkci $\psi(x)$, což jsme chtěli dokázat.

Přístupme nyní k důkazu hlavní věty tohoto pojednání. Množina $K[\psi]$ s vedlejší podmínkou (6) je omezená. Dvojným užitím Schwarzovy nerovnosti totiž dostaneme

$$\begin{aligned} 0 &\leq |K[\varphi]|^2 = \left| \int_a^b \int_a^b K(x, y) \varphi(x) \bar{\varphi}(y) dx dy \right|^2 \leq \\ &\leq \int_a^b |\varphi(x)|^2 dx \cdot \int_a^b \left| \int_a^b K(x, y) \bar{\varphi}(y) dy \right|^2 dx = \int_a^b \left| \int_a^b K(x, y) \bar{\varphi}(y) dy \right|^2 dx \leq \\ &\leq \int_a^b \left(\int_a^b |K(x, y)|^2 dy \cdot \int_a^b |\varphi(y)|^2 dy \right) dx = \int_a^b \int_a^b |K(x, y)|^2 dx dy = C^2. \end{aligned}$$

Známe-li kteroukoli charakteristickou hodnotu λ_0 , můžeme k ní sestrojít odpovídající charakteristickou funkci $\varphi_0(x)$ normovanou vztahem (6). Vynásobíme-li pak rovnost (3) výrazem $\bar{\varphi}_0(x)$, dostaneme po integraci podle x

$$(8) \quad \lambda_0 \int_a^b \int_a^b K(x, y) \bar{\varphi}_0(x) \varphi_0(y) dx dy = 1.$$

Předpokládejme nyní, že jádro $K(x, y)$ je pozitivně semidefinitní, tj. že pro libovolnou integrovatelnou funkci $\varphi(x)$ platí

$$(9) \quad K[\varphi] \geq 0.$$

Podle pomocné věty 2 existuje funkce $\psi(x)$, kterou můžeme normovat vztahem (6), pro níž platí $K[\psi] > 0$. Položme

$$(10) \quad \frac{1}{A} = K[\psi],$$

$$(11) \quad g(x) = \psi(x) - A \int_a^b K(x, y) \psi(y) dy.$$

Nyní mohou nastat dva případy:

1. $g(x) \equiv 0$; potom A je charakteristická hodnota a $\psi(x)$ jí odpovídající charakteristická funkce. Pro nejmenší charakteristickou hodnotu λ_0 pak zřejmě bude

$$(12) \quad 0 < \lambda_0 \leq A.$$

2. $g(x) \not\equiv 0$; předpokládejme, že v intervalu $\langle 0, A \rangle$ neleží žádná charakteristická hodnota. Potom rovnice

$$(13) \quad \varphi(x, \lambda) - \lambda \int_a^b K(x, y) \varphi(y, \lambda) dy = g(x)$$

má pro každé λ z tohoto intervalu právě jedno řešení

$$\varphi(x, \lambda) = g(x) + \lambda \int_a^b \Gamma(x, y, \lambda) g(y) dy,$$

kteřé je v něm spojitou funkcí parametru λ . Odtud a ze vztahů (13) a (11) plyne speciálně

$$(14) \quad \varphi(x, 0) = g(x), \quad \varphi(x, A) = \psi(x).$$

Položme dále

$$(15) \quad h(\lambda) = \frac{1}{2} \int_a^b [\varphi(x, \lambda) \bar{g}(x) + \bar{\varphi}(x, \lambda) g(x)] dx.$$

Funkce $h(\lambda)$ je spojitá v intervalu $\langle 0, A \rangle$; kromě toho je $h(0) = \int_a^b |g(x)|^2 dx \geq 0$ a podle (14), (11), (2) a (10) platí

$$\begin{aligned} h(A) &= \frac{1}{2} \int_a^b (\psi(x) \bar{g}(x) + \bar{\psi}(x) g(x)) dx = \frac{1}{2} \int_a^b \{2|\psi(x)|^2 - A \int_a^b K(x, y) \bar{\psi}(x) \psi(y) dy - \\ &- A \int_a^b \overline{K(x, y)} \psi(x) \bar{\psi}(y) dy\} dx = 1 - A \int_a^b \int_a^b K(x, y) \bar{\psi}(x) \psi(y) dx dy = 0. \end{aligned}$$

Užijeme-li postupně vztahů (13) a (2), dostaneme dále

$$\begin{aligned} h(\lambda') - h(\lambda) &= \frac{1}{2} \int_a^b \left\{ \varphi(x, \lambda') \left[\bar{\varphi}(x, \lambda) - \lambda \int_a^b \overline{K(x, y)} \bar{\varphi}(y, \lambda) dy \right] + \right. \\ &+ \bar{\varphi}(x, \lambda') \left[\varphi(x, \lambda) - \lambda \int_a^b K(x, y) \varphi(y, \lambda) dy \right] - \\ &- \varphi(x, \lambda) \left[\varphi(x, \lambda') - \lambda' \int_a^b \overline{K(x, y)} \bar{\varphi}(y, \lambda') dy \right] - \\ &\left. - \bar{\varphi}(x, \lambda) \left[\varphi(x, \lambda') - \lambda' \int_a^b K(x, y) \varphi(y, \lambda') dy \right] \right\} dx = \\ &= \frac{\lambda' - \lambda}{2} \int_a^b \int_a^b K(x, y) \left[\bar{\varphi}(x, \lambda) \varphi(y, \lambda') + \bar{\varphi}(x, \lambda') \varphi(y, \lambda) \right] dx dy, \end{aligned}$$

z čehož

$$h'(\lambda) = \frac{dh}{d\lambda} = \lim_{\lambda' \rightarrow \lambda} \frac{h(\lambda') - h(\lambda)}{\lambda' - \lambda} = \int_a^b \int_a^b K(x, y) \bar{\varphi}(x, \lambda) \varphi(y, \lambda) dx dy.$$

Podle (9) je tedy vždy $h'(\lambda) \geq 0$ a podle (14) a (10) $h'_-(A) = 1/A > 0$. Poněvadž je $h(0) \geq 0$, bude v celém intervalu $\langle 0, A \rangle$ $h(\lambda) \geq 0$. Z nerovnosti $h'_-(A) > 0$ však plyne, že existuje číslo $\delta > 0$ tak, že pro $A - \delta < \lambda < A$ bude $h(\lambda) < h(A) = 0$, což je spor. Předpoklad, že v intervalu $\langle 0, A \rangle$ není žádná charakteristická hodnota, je tedy nesprávný, takže pro nejmenší charakteristickou hodnotu λ_0 platí opět vztah (12).

Je tedy vždy

$$(16) \quad \frac{1}{\lambda_0} \geq K[\bar{\psi}]$$

pro jakoukoliv funkci $\psi(x)$, pro niž je $K[\bar{\psi}] > 0$. (Vztah (16) bude ovšem samozřejmě

splněn i pro $K[\bar{\psi}] = 0$.) Z toho plyne $1/\lambda_0 \geq \sup_{\varphi} K[\varphi]$. Avšak k charakteristické hodnotě λ_0 můžeme sestrojít normovanou charakteristickou funkci $\varphi_0(x)$ a podle (8) bude $\lambda_0 K[\bar{\varphi}_0] = 1$, takže $1/\lambda_0 = \max_{\varphi} K[\varphi]$. Tím je věta dokázána pro pozitivně semidefinitní jádro.

Abychom větu dokázali pro libovolné jádro $K(x, y)$, budeme aplikovat tento výsledek na druhé iterované jádro $K_2(x, y) = \int_a^b K(x, t) K(t, y) dt$. Pro libovolnou normovanou integrabilní funkci $\varphi(x)$ platí

$$(17) \quad \int_a^b \int_a^b K_2(x, y) \varphi(x) \bar{\varphi}(y) dx dy \geq \left| \int_a^b \int_a^b K(x, y) \varphi(x) \bar{\varphi}(y) dx dy \right|^2.$$

Je totiž

$$\begin{aligned} & \int_a^b \int_a^b K_2(x, y) \varphi(x) \bar{\varphi}(y) dx dy = \\ & = \int_a^b \int_a^b \int_a^b K(x, t) K(t, y) \varphi(x) \bar{\varphi}(y) dx dy dt = \int_a^b \left| \int_a^b K(x, t) \varphi(x) dx \right|^2 dt \end{aligned}$$

a podle Schwarzovy nerovnosti máme dále

$$\begin{aligned} \left| \int_a^b \int_a^b K(x, y) \varphi(x) \bar{\varphi}(y) dx dy \right|^2 & \leq \int_a^b |\varphi(y)|^2 dy \cdot \int_a^b \left| \int_a^b K(x, y) \varphi(x) dx \right|^2 dy = \\ & = \int_a^b \left| \int_a^b K(x, t) \varphi(x) dx \right|^2 dt. \end{aligned}$$

Druhé iterované jádro je tedy pozitivně semidefinitní; poněvadž podle pomocné věty 2 existuje funkce $\psi(x)$, pro níž je $K[\psi] \neq 0$, máme vzhledem k (17) splněny všechny předpoklady k užití dokázaného výsledku na toto iterované jádro.

Pro nejmenší charakteristickou hodnotu λ_0 (v absolutní hodnotě) jádra $K(x, y)$ tedy platí

$$\frac{1}{\lambda_0^2} = \max_{\varphi} \int_a^b \int_a^b K_2(x, y) \varphi(x) \bar{\varphi}(y) dx dy \geq \int_a^b \int_a^b K_2(x, y) \varphi(x) \bar{\varphi}(y) dx dy \geq |K[\varphi]|^2,$$

tj.

$$\frac{1}{|\lambda_0|} \geq |K[\varphi]|$$

a

$$\frac{1}{|\lambda_0|} \geq \sup_{\varphi} |K[\varphi]|.$$

Poněvadž však k této charakteristické hodnotě λ_0 existuje charakteristická funkce $\varphi_0(x)$, bude podle (8) $\lambda_0 K[\bar{\varphi}_0] = 1$, takže

$$\frac{1}{|\lambda_0|} = \max_{\varphi} |K[\varphi]|,$$

čímž je věta úplně dokázána.

Literatura

- [1] *A. Apfelbeck*: Mathematische Theorie der Torsions- u. Biegungsschwingungen anisotroper Stäbe. Čech. matem. žurnal 7 (82), 1957, str. 274—411.
- [2] *L. Collatz*: Eigenwertaufgaben mit technischen Anwendungen. Leipzig 1949.
- [3] *S. G. Michlin*: Integrální rovnice. Přírodovědecké vydavatelství, Praha 1952.
- [4] *И. Г. Петровский*: Лекции по теории интегральных уравнений. Москва-Ленинград 1951.

Резюме

ЭЛЕМЕНТАРНОЕ ДОКАЗАТЕЛЬСТВО СУЩЕСТВОВАНИЯ ХАРАКТЕРИСТИЧЕСКИХ ЗНАЧЕНИЙ ДЛЯ СИММЕТРИЧЕСКОГО ИНТЕГРАЛЬНОГО УРАВНЕНИЯ ФРЕДГОЛЬМА ВТОРОГО РОДА

АЛОИС АПФЕЛЬБЕК (Alois Apfelbeck), Прага

В работе дается элементарное доказательство существования характеристических значений для симметрических интегральных уравнений Фредгольма второго рода. Центр тяжести доказательства заключается в построении функции (15) и в исследовании ее основных свойств.

Zusammenfassung

ELEMENTARER BEWEIS DER EXISTENZ VON EIGENWERTEN FÜR SYMMETRISCHE FREDHOLMSCHE INTEGRALGLEICHUNGEN ZWEITER ART

ALOIS APFELBECK, Praha

In der Arbeit ist ein elementarer Beweis der Existenz von Eigenwerten für Fredholmsche Integralgleichungen zweiter Art angegeben. Der Hauptgedanke des Beweises beruht auf der Konstruktion der Funktion (15) und der Ermittlung ihrer Grundeigenschaften.