

В. Э. ЛЯНЦЕ

НЕКОТОРЫЕ СВОЙСТВА ИДЕМПОТЕНТНЫХ ОПЕРАТОРОВ

Линейный оператор J называется идемпотентным, если $J^2 = J$. Каждому самосопряженному оператору A в гильбертовом пространстве H соответствует разложение единицы $\{E(\sigma)\}$, представляющее собой некоторое семейство самосопряженных идемпотентных операторов $E(\sigma)$, т. е. операторов ортогонального проектирования. Если оператор A не является самосопряженным, то соответствующее ему разложение единицы, коль оно существует, не будет уже, вообще говоря, состоять из самосопряженных идемпотентных операторов, т. е., проекции не будут ортогональными. В настоящей статье изучаются некоторые свойства общих (неортогональных) идемпотентных операторов в комплексном гильбертовом пространстве. В частности, устанавливается связь между J и J^* и их областями значений, а также выводятся формулы, выражающие норму идемпотентного оператора через „углы наклона“ соответствующих многообразий.

1. Напомним некоторые характеристики взаимного расположения многообразий в гильбертовом пространстве (см. [1]).

1.1 Пусть M линейное многообразие в гильбертовом пространстве H . Обозначим через P_M оператор ортогонального проектирования на M , а через

$$\text{dis}(x, M) = \sqrt{\|x\|^2 - \|P_M x\|^2} \quad (1)$$

расстояние вектора x до многообразия M . Раствором пары линейных многообразий M_1 и M_2 в H называется (см. [1]) число

$$\Theta(M_1, M_2) = \max(\varrho_1, \varrho_2), \quad (2)$$

где

$$\begin{aligned} \varrho_1 &= \sup [\text{dis}(x, M_2) \mid x \in M_1, \|x\| = 1], \\ \varrho_2 &= \sup [\text{dis}(x, M_1) \mid x \in M_2, \|x\| = 1], \end{aligned} \quad (3)$$

Всегда $0 \leq \Theta(M_1, M_2) \leq 1$, причем, если $\Theta(M_1, M_2) < 1$, то многообразия M_1, M_2 имеют одинаковую размерность.

1.2 Пара линейных многообразий M_1 и M_2 называется правильной, если единственным вектором, принадлежащим к одному из них и ортогональным ко второму, является нулевой вектор. Для обозначения того, что пара многообразий M_1 и M_2 правильная, будем писать $(M_1, M_2) = 1$. В [1] доказано, что если $(M_1, M_2) = 1$, то $\varrho_1 = \varrho_2$ (см. [3]) и, следовательно,

$$\Theta(M_1, M_2) = \varrho_1 = \varrho_2. \quad (4)$$

Угол $\varphi^{(m)}$, определяемый соотношениями

$$0 \leq \varphi^{(m)} \leq \frac{\pi}{2}, \quad \sin \varphi^{(m)} = \Theta(M_1, M_2), \quad (5)$$

называется максимальным углом наклона многообразий M_1, M_2 .

1.3. Пусть M и N произвольная пара линейных многообразий в H , вообще говоря, неправильная. Минимальный угол наклона этих многообразий $\psi^{(m)}$ определяется с помощью соотношений

$$0 \leq \psi^{(m)} \leq \frac{\pi}{2} \quad \cos \psi^{(m)} = \sup \{ |(x, y)| \mid x \in M, y \in N, \|x\| = \|y\| = 1 \} \quad (6)$$

1.4. Пусть M_1 и M_2 — правильная пара многообразий, $(M_1, M_2) = 1$, а N_1 — ортогональное дополнение M_2 в H , $H = M_2(\oplus)N_1$. Обозначим через $\varphi^{(m)}$ минимальный угол наклона M_1 и N_1 . Тогда

$$\varphi^{(m)} + \psi^{(m)} = \frac{\pi}{2} \quad (7)$$

Доказательство. Пусть $x = x_\varepsilon \in M_1$, $\|x\| = 1$ и

$$\varrho(x, M_2) = \sqrt{1 - \|P_{M_2} x\|^2} \leq \sin \varphi^{(m)} - \varepsilon.$$

Положим

$$y = y_\varepsilon = (x - P_{M_2} x) \cdot \|x - P_{M_2} x\|^{-1}.$$

Как показывает несложное вычисление

$$(x, y) = \sqrt{1 - \|P_{M_2} x\|^2} \leq \sin \varphi^{(m)} - \varepsilon,$$

а поскольку $P_{M_2} y = 0$ и, следовательно, $y \in N_1$ и $\|y\| = 1$, то в силу (6)

$$\cos \psi^{(m)} \leq \sin \varphi^{(m)} - \varepsilon$$

или, так как $\varepsilon > 0$ произвольно, то

$$\cos \psi^{(m)} \leq \sin \varphi^{(m)} - \varepsilon.$$

Докажем теперь обратное неравенство. Пусть $x = x_\varepsilon \in M_1$, $y = y_\varepsilon \in N_1$, $\|x\| = \|y\| = 1$, и

$$(x, y) < \cos \varphi^{(m)} - \varepsilon;$$

(умножая один из векторов x или y на число вида e^{ia} , a — действительно, всегда можно добиться того, чтобы скалярное произведение (x, y) было действительным и ≥ 0 без изменения его абсолютного значения). Положим

$$z = z_\varepsilon = (x - P_{M_2} x) (1 - \|P_{M_2} x\|^2)^{-\frac{1}{2}}. \quad (8)$$

Пусть $\lambda = (1 - \|P_{M_2} x\|^2)^{\frac{1}{2}} = (x, z)$. Из (8) находим $x = \lambda z + P_{M_2} x$. Принимая во внимание, что $P_{M_2} y = 0$, ибо $y \in N_1$, найдем

$$(x, y) = (\lambda z + P_{M_2} x, y) = \lambda (z, y) = (x, z)(z, y),$$

Следовательно,

$$(x, y) \leq (x, z) \cdot \|z\| \cdot \|y\| = (x, z)$$

и, таким образом,

$$\sqrt{1 - \|P_{M_2} x\|^2} = (x, z) \leq \cos \psi^{(m)} - \varepsilon.$$

Отсюда

$$\sin \varphi^{(m)} \leq \cos \psi^{(m)}.$$

В силу условий $0 \leq \varphi^{(m)} \leq \frac{\pi}{2}$, $0 \leq \cos \varphi^{(m)} \leq \frac{\pi}{2}$ равенство (7) доказано.

1.5. Для того, чтобы прямая сумма непересекающихся подпространств M_1 и N_1 гильбертова пространства H была полным пространством, $\overline{M_1 + N_1} = M_1 + N_1$, необходимо и достаточно, чтобы минимальный угол наклона $\psi^{(m)}$ подпространств M_1 и N_1 был больше нуля, $\psi^{(m)} > 0$.

Это предложение сформулировано без доказательства в [1]. Ввиду того, что оно в дальнейшем существенно используется, ради полноты изложения приведем его доказательство.

Достаточность. Предположим, что $\varphi^{(m)} > 0$. Пусть $z = x + y$, где $x \in M_1$, $y \in N_1$. Полагая $\cos \gamma = |(x, y)| / \|x\| \cdot \|y\|$, имеем $\cos \gamma < \cos \psi^{(m)}$. Если $(x, y) = |(x, y)| e^{i\delta}$, то как показывает несложное вычисление

$$\|z\|^2 = (\|x\| + \|y\| \cos \gamma \cos \delta)^2 + \|y\|^2 (1 - \cos^2 \gamma \cos^2 \delta)$$

и, следовательно,

$$\|z\|^2 \leq (\|x\| + \|y\| \cos \gamma \cos \delta)^2 + \|y\|^2 (1 - \cos^2 \psi^{(m)}). \quad (9)$$

Из (9) сразу вытекает полнота прямой суммы $M_1 + N_1$. В самом деле, если векторы $z_n = x_n + y_n$, $x_n \in M_1$, $y_n \in N_1$, $n = 1, 2, \dots$ образуют фундаментальную последовательность, то в силу (9) $x_n \rightarrow x$, $y_n \rightarrow y$, $n \rightarrow \infty$, а так как по условию M_1 и N_1 замкнутые подпространства, то $x \in M_1$, $y \in N_1$, так что $\lim z_n = z = x + y \in M_1 + N_1$.

Необходимость. Предположим, что прямая сума $M_1 + N_1$ есть полное пространство H_1 . Обозначим через M_2 ортогональное дополнение N_1 в H_1 , $H_1 = M_2 (\oplus) N_1$. Проверим, что $(M_1, M_2) = 1$. Пусть $x \in M_1$ и x ортогонально к M_2 . Тогда $x \in N_1$, а так как M_1 и N_1 не пересекаются, то $x = 0$. Наоборот, пусть $x \in M_2$ и x ортогонально к M_1 . Тогда x ортогонально к N_1 и, следовательно, x ортогонально к $M_1 + N_1 = H_1$. Так как $x \in H_1$, то $x = 0$. Итак, $(M_1, M_2) = 1$. Проверим, далее, что $P_{M_2} M_1 = M_2$. Пусть $x \in M_2$. Представим x в виде $x = x_1 + y_1$, где $x_1 \in M_1$, $y_1 \in N_1$. Вследствие того, что $P_{M_2} y_1 = 0$, то $P_{M_2} x_1 = x$. Таким образом, действительно $P_{M_2} x_1 M_1 = M_2$. Отображение P_{M_2} пространства M_1 на M_2 является взаимно однозначным. Действительно, если $x \in M_1$ и $P_{M_2} x = 0$, то $x \in N_1$, а так как пространства M_1 и N_1 не пересекаются, то $x = 0$. Так как взаимно однозначное отображение P_{M_2} пространства M_1 на полное пространство M_2 непрерывно, то обратное отображение тоже непрерывно (см. [4]). Следовательно, существует такое $\mu > 0$, что для всех $x \in M_1$ $\|P_{M_2} x\| \geq \mu \|x\|$ очевидно, если $\varphi^{(m)}$ максимальный угол наклона M_1 и M_2 , то $\sin \varphi^{(m)} \leq \sqrt{1 - \mu^2} < 1$ и $\varphi^{(m)} < \frac{\pi}{2}$. Поэтому, в силу предложения 2.4 $\psi^{(m)} > 0$, что и требовалось доказать.

2. Выясним связь между ограниченным оператором J его областью значения $M = JN$ и областью значений $M^* = J^*N$ сопряженного ему оператора J^* .

2.1. Для того, чтобы подпространства M и M^* служили областями значений ограниченных идемпотентных операторов J и J^* необходимо и достаточно, чтобы пара подпространств M и M^* была правильной, $(M, M^*) = 1$ и чтобы максимальный угол наклона $\varphi^{(M)}$ этих подпространств был меньше $\frac{\pi}{2}$, $\varphi^{(M)} < \frac{\pi}{2}$.¹ Пусть $N = N(\ominus)M^*$, а $N^* = N(\ominus)M$. Тогда $(I - J)N = N$, $(I - J^*)N = N^*$.

Операторы J и J^* определяются подпространствами M и M^* однозначно.

Доказательство. Пусть J ограниченный идемпотентный оператор. Положим $M = JN$, $M^* = J^*N$. Если для некоторого $x_0 \in M^*$ условие $(x, x_0) = 0$ выполняется для всех $x \in M$, то $(y, x_0) = 0$ для всех $y \in N$, ибо так как $x_0 = J^*x_0$, то $(y, x_0) = (y, J^*x_0) = 0$ и следовательно $x_0 = 0$. Аналогично, если $x_0 \in M$ и $(x, x_0) = 0$ для всех $x \in M^*$, то $x_0 = 0$. Таким образом, доказано, что $(M, M^*) = 1$. Положим $N = (I - J)N$. Если $(x_0, x) = 0$ для всех $x \in M^*$, то $(Jx_0, y) = (x_0, J^*y) = 0$ для всех $y \in N^*$ и $Jx_0 = 0$, и таким образом $x_0 \in N$. Наоборот, если $x_0 \in N$, а $x_1 \in M^*$, то $(x_0, x_1) = (x_0, J^*x_1) = (Jx_0, x_1) = (0, x_1)$, т. е. x_0 ортогонально к M^* . Итак, N совпадает с ортогональным дополнением M^* , $N = M^*(\oplus)N$. Аналогично доказывается, что $N = M(\oplus)N^*$, где $N^* = (I - J^*)N$. Ввиду того, что прямая сумма $M + N = JN = (I - J)N = N$ есть полное пространство, на основании 1.5 можно утверждать, что минимальный угол наклона $\psi^{(M)}$ подпространств M и N больше нуля или, в силу 1.4, что максимально угол наклона $\varphi^{(M)}$ подпространств M и M^* меньше $\frac{\pi}{2}$, $\Theta(M, M^*) < 1$.

Пусть идемпотентные операторы J_1 и J_1^* имеют те же области значений M и M^* , что и операторы J и J^* . Имеем $J = (J^*)^* = (J_1^* J^*) = J J_1 = J_1$, т. е., $J = J_1$ и $J^* = J_1^*$. Таким образом, в подпространстве M и M^* определяют оператор J , а поэтому и J^* , однозначно.

Предположим, наконец, что $(M, M^*) = 1$ а $\Theta(M, M^*) < 1$. Пусть по-прежнему $N = N(\ominus)M^*$, $N^* = N(\ominus)M$. Подпространства M и N не пересекаются. В самом деле, если $x_0 \in M$ и $x_0 \in N$, то x_0 ортогонально к M^* , а так как $(M, M^*) = 1$, то $x_0 = 0$.

Аналогично проверяем, что подпространства M^* и N^* не пересекаются. Образует прямые суммы $M + N = N_1$ и $M^* + N^* = N_2$. Так N_1, N_2 как $\Theta(M, M^*) < 1$, то, в силу 1.4, минимальный угол $\psi^{(M)}$ между M и N , равный минимальному углу между M^* и N^* , больше нуля и, в силу 1.5, прямые суммы N_1 и N_2 являются замкнутыми подпространствами. Проверим, что $N_1 = N_2 = N$. Очевидно, достаточно убедиться, что N_1 и N_2 плотно в N . Пусть $(x, x_0) = 0$ для всех $x \in N_1$. Тогда x_0 ортогонально к N и, следовательно, $x_0 \in M^*$, а так как x_0 ортогонально к M и $(M, M^*) = 1$, то $x_0 = 0$. Таким образом $N_1 = N$ и, вследствие того, что N_1 замкнуто, то $N_1 = N$. Точно также $N_2 = N$. Разложениям в прямые суммы $N = M + N$ и $N = M^* + N^*$ соответствуют идемпотентные операторы J и J' такие что $JN = M$, $(I - J)N = N$, $J'N = M^*$, $(I - J')N = N^*$. Проверим, что $J' = J^*$. Принимая во внимание, что для

¹ т. е. раствор $\Theta(M, M^*)$ был меньше единицы.

любых $x, y \in H$ будет $(Jx, (I - J')y) = 0$ и $((I - J)x, J'y) = 0$, имеем $(Jx, y) = (Jx, J'y) + ((I - J)x, J'y) = (x, J'y)$. Наконец, оператор J ограничен, ибо он замкнут, так как $J = J'^*$ и задан на всем H .

2.2 Пусть J ограниченный идемпотентный оператор в гильбертовом пространстве H . Положим $M = JH$, $M^* = J^*H$

Тогда

$$\|J\| = (1 - \Theta^2)^{-\frac{1}{2}} = \sec \varphi^{(M)},$$

где $\Theta = \Theta(M, M^*)$ раствор подпространств M и M^* , а $\varphi^{(M)}$ их максимальный угол наклона.

Доказательство. Заметим, прежде всего, что $J = JP_{M^*}$, где P_{M^*} оператор ортогонального проектирования на M^* . Действительно, для любых $x, y \in H$ имеет $(JP_{M^*}x, y) = (x, P_{M^*}J^*y) = (Jx, y)$. Принимая во внимание, что $JP_{M^*} = J$ и что $\|P_{M^*}x\| \leq \|x\|$, приходим к выводу, что

$$\|J\| = \sup [\|Jx\| \mid x \in M^*, \|x\| = 1]. \quad (10)$$

Заметим далее, что если $x \in M^*$, то x является ортогональной проекцией Jx на M^*

$$P_{M^*}Jx = x \quad (x \in M^*). \quad (11)$$

Действительно, $(P_{M^*}Jx, y) = (x, J^*P_{M^*}y) = (x, P_{M^*}y) = (P_{M^*}x, y) = (x, y)$ для любых $x \in M^*$ и $y \in H$. Следовательно, если $x \in M^*$, то $(x, Jx - x) = 0$ и $\|Jx\|^2 = \|x\|^2 + \|Jx - x\|^2 = \|x\|^2 + \|Jx\|^2 \cdot \left\| \frac{Jx}{\|Jx\|} - \frac{x}{\|Jx\|} \right\|^2$, что

может быть переписано в виде $\|Jx\|^2 = \|x\|^2 + \|Jx\|^2 \left[\text{dis} \left(\frac{Jx}{\|Jx\|}, M^* \right) \right]^2$,

где $\text{dis} \left(\frac{Jx}{\|Jx\|}, M^* \right)$ расстояние вектора $\frac{Jx}{\|Jx\|}$ до подпространства M^* .

Таким образом, если $x \in M^*$ и $\|x\| = 1$, то

$$\|Jx\| = \left[1 - \varrho^2 \left(\frac{Jx}{\|Jx\|}, M^* \right) \right]^{-1/2}$$

и

$$\sup \|Jx\| = \left[1 - \sup \varrho^2 \left(\frac{Jx}{\|Jx\|}, M^* \right) \right]^{-1/2}.$$

В силу (10), (4) и (5) для завершения доказательства остается лишь проверить, что любой элемент $z \in M$, удовлетворяющий условию $\|z\| = 1$, имеет вид $\frac{Jx}{\|Jx\|}$, где $x \in M^*$. Но это очевидно, ибо вообще $JM^* = M$. Действительно, так как $JP_{M^*} = J$, то $JM^* = JP_{M^*}M^* = JP_{M^*}H = JH = M$.

2.3 Пусть J ограниченный идемпотентный оператор в гильбертовом пространстве H . Положим $M = JH$, $N = (I - J)H$.

Тогда

$$\|J\| = \text{cosec } \psi^{(M)},$$

где $\psi^{(M)}$ минимальный угол между подпространствами M и N ,
Это предложение вытекает из 2.2 и 1.4,

2.4. Для любого ограниченного идемпотентного оператора J в гильбертовом пространстве H

$$\|I - J\| = \|J\|.$$

Это очевидное следствие предложения 2.3.

2.5. Для того, чтобы ограниченный идемпотентный оператор J в гильбертовом пространстве H был самосопряженным, т. е. служил оператором ортогонального проектирования, необходимо и достаточно, чтобы $\|J\| = 1$.

Действительно, если $\|J\| = 1$, то, в силу 2.3, $\psi^{(m)} = \frac{\pi}{2}$ и подпространства $M = JH$ и $N = (I - J)H$ взаимно ортогональны так, что $H = M \oplus N$.

3. На основании изложенного выше весьма просто рассмотреть вопрос о монотонных последовательностях идемпотентных операторов.

3.1. Пусть $\{J_n\}$ — такая последовательность идемпотентных операторов в гильбертовом пространстве H , для которой $J_\mu J_\nu = J_\lambda$, где $\lambda = \min(\mu, \nu)$ и $\|J_n\| \leq c < \infty$ при $n = 1, 2, \dots$. Тогда эта последовательность сильно сходится к ограниченному идемпотентному оператору J .

Доказательство. Положим $M_n = J_n H$, $M_n^* = J_n^* H$ $n = 1, 2, \dots$, $M_0 = \bigcup_{n=1}^{\infty} M_n$, $M = \overline{M_0}$, $M_0^* = \bigcup_{n=1}^{\infty} M_n^*$, $M^* = \overline{M_0^*}$. Убедимся в первую очередь, в том, что $(M, M^*) = 1$. Пусть $x_0^* \in M^*$ и $(x, x_0^*) = 0$ для всех $x \in M$. Очевидно, $J_n^* x_0^* = 0$ при $n = 1, 2, \dots$ ибо для всех $y \in M$, $J_n y \in M$ и $(y, J_n^* x_0^*) = (J_n y, x_0^*) = 0$. Представим x_0^* в виде $x_0^* = \lim J_n^* x_n^*$. Имеем

$$\begin{aligned} \|J_n^* x_n^*\| &= \|J_n^* x_n^* - J_n^{*2} x_n^*\| \leq \|J_n^*\| \cdot \|x_0^* - J_n^* x_n^*\| \leq \\ &\leq c \|x_0^* - J_n^* x_n^*\| \rightarrow 0, (n \rightarrow \infty). \end{aligned}$$

Поэтому $x_0^* = \lim J_n^* x_n^* = 0$. Аналогично убеждаемся, что $x_0 = 0$, если $x_0 \in M$ и $(x_0, x^*) = 0$. Убедимся теперь в том, что $\Theta = \Theta(M, M^*) \leq (1 - c^{-2})^{1/2} < 1$.

Пусть $x \in M$ и $\|x\| = 1$. Представим x в виде $x = \lim x_n$, где $x_n \in M_n$ и $\|x_n\| = 1$. Очевидно, $\varphi(x, M^*) = \lim \varphi(x_n, M^*)$. Но так как $M_n^* \subset M^*$, то $\varphi(x_n, M^*) \leq \varphi(x_n, M_n^*) \leq \Theta_n$, где $\Theta_n = \Theta(M_n, M_n^*)$. Однако, в силу 2.2 и условия $\|J_n\| \leq c$, выполняется неравенство $\Theta_n \leq (1 - c^{-2})^{1/2}$. Поэтому $\varphi(x, M^*) \leq (1 - c^{-2})^{1/2}$ и $\Theta < 1$.

Так как $(M, M^*) = 1$, $\Theta(M, M^*) < 1$, то в силу 2.1 подпространства M и M^* определяют единственный идемпотентный оператор J такой, что $JH = M$, $J^*H = M^*$. При этом, $\|J\| = (1 - \Theta^2)^{-1/2} \leq c$. Остается проверить, что $J = \lim J_n$. С этой целью заметим, прежде всего, что

$$JJ_n = J_n J = J_n, n = 1, 2, \dots \quad (11)$$

Это вытекает из того, что $M_n \subset M$ и $M_n^* \subset M^*$. Пусть x произвольный вектор. Представим Jx в виде $Jx = \lim_{n \rightarrow \infty} J_n x_n$. Принимая во внимание (11), найдем $Jx = \lim_{n \rightarrow \infty} J_n x + \lim_{n \rightarrow \infty} J_n (J_n x_n - Jx)$. Так как $\|J_n\| < c$, то $\lim_{n \rightarrow \infty} J_n J (J_n x_n - Jx) = 0$ и $Jx = \lim_{n \rightarrow \infty} J_n x$, что и требовалось доказать.

ЛИТЕРАТУРА

1. М. Г. Крейн, М. А. Красносельский, Д. П. Мильман. О дефектных числах линейных операторов в банаховом пространстве и о некоторых геометрических вопросах. Сборник трудов института математики АН УССР № 11, Киев, 1948.

2. М. Г. Крейн и М. А. Красносельский. Основные теоремы о расширении эрмитовых операторов. Успехи матем. наук, т. III, вып. 3 (19), (1947).

3. Н. И. Ахиезер и И. М. Глазман. Теория линейных операторов. Гостехиздат, М.—Л., 1950.

4. С. С. Банах. Курс функціонального аналізу. «Радянська школа», Київ, 1948.
