

УДК 513.88

ОБ ОДНОЙ ЗАДАЧЕ ФУНКЦИОНАЛЬНОГО АНАЛИЗА,
СВЯЗАННОЙ С ОБЩЕЙ ТЕОРИЕЙ ЛИНЕЙНЫХ СИСТЕМ

С.И. Хданов

Ряд задач общей теории линейных систем, таких, как, например, задача существования оптимального (в некотором смысле) управления, сводится к проблеме отыскания такого элемента x из заданного множества \mathcal{O} , на котором некоторый определенный на \mathcal{O} функционал f получает экстремальное значение [1]. Она всегда разрешима, если \mathcal{O} компактно в некоторой топологии t , а функционал f непрерывен.

В связи с этим большое значение имеет задача получения различных критериев компактности множеств. Отметим, что наличие в топологическом векторном пространстве нескольких критериев компактности дает возможность в каждом конкретном случае выбрать наиболее удобный для использования.

Мы приведем два критерия компактности множеств в топологических векторных полупорядоченных пространствах (терминология полупорядоченных пространств взята из [2] и [3]). Первый критерий справедлив в пространствах, в которых топология определенным образом связана с топологией в булевой алгебре проекторов, второй критерий относится к полупорядоченным пространствам, наделенным слабой топологией.

Пусть X - векторное пространство, $[V]$ - фильтр в X , обладающий свойством:^{*}

$$(*) \quad \forall V \in [V], \exists V' \in [V]: V' + V' \subset V.$$

*) Ниже через $[V]$ обозначаем базис фильтра $[V]$.

Пусть E - некоторое множество линейных эндоморфизмов над X ; $[W]$ - фильтр в E .

ОПРЕДЕЛЕНИЕ 1. Фильтр $[G] \subset X$ назовем согласованным с $[W]$, если

1. $PG \subset [G]$, $\forall P \in E$ и $\forall G \in [G]$;
2. $\forall x \in X$ и $\forall G \in [G]$ $\exists W_G^x \subset [W]$ такое, что $Px \in G$, $\forall P \in W_G^x$.

ОПРЕДЕЛЕНИЕ 2. Множество $\mathcal{O} \subset X$ назовем $[V]$ -предкомпактным, если для любого $V \in [V]$ найдется конечное множество $\{x_i\}$, $i=1, 2, \dots, n$, такое, что $\forall x \in \mathcal{O} \exists x'_i \in \{x_i\}: x - x'_i \in V$.

ОПРЕДЕЛЕНИЕ 3. Множество $\mathcal{O} \subset X$ назовем $([V], [W])$ -ограниченным, если $\forall V \in [V]$, $\exists W_V \in [W]$ такое, что $Px \in V$, $\forall P \in W_V$ и $\forall x \in \mathcal{O}$.

Пусть фильтр $[V]$ согласован с $[W]$. Имеет место

ПРЕДЛОЖЕНИЕ 1. Если множество $\mathcal{O} \subset X$ является $[W]$ -предкомпактным, то оно $([V], [W])$ -ограничено.

ДОКАЗАТЕЛЬСТВО. Пусть $V \in [V]$ - произвольное множество. В силу $[V]$ -предкомпактности и свойства $(*)$, найдется конечное множество $\{x_i\}$, $i=1, 2, \dots, n$, и $V' \in [V]$ такие, что для любого $x \in \mathcal{O} \exists x'_i \in \{x_i\}: x - x'_i \in V'$. Так как фильтр $[V]$ согласован с $[W]$, то найдется конечное число множеств $W_i \in [W]$, $i=1, 2, \dots, n$, таких, что $Px_i \in V' \forall P \in W_i$, $x_i \in \{x_i\}$, $i=1, 2, \dots, n$. Из того, что $[W]$ - фильтр, следует существование множества $W_0 \in [W]$ такого, что $W_0 \subset W_i$, $i=1, 2, \dots, n$. Тогда $Px_i \in V'$, $\forall P \in W_0$, $x_i \in \{x_i\}$, $i=1, 2, \dots, n$.

Пусть $P \in W_0$. Для всех $x \in \mathcal{O}$, $x'_i \in \{x_i\}$,

$$Px = Px - Px'_i + Px'_i = P(x - x'_i) + Px'_i.$$

Так как $P(x - x'_i) \in V$ (по определению согласованности фильтра $[V]$ с $[W]$), $Px'_i \in V'$, то $Px \in V$. Таким образом, для $V \in [V]$ нашлось множество $W_0 \in [W]$ такое, что $Px \in V$, $\forall x \in \mathcal{O}$, $\forall P \in W_0$. Следовательно, множество \mathcal{O} $([V], [W])$ -ограничено.

не является $([\mathbb{V}], [\mathbb{W}])$ -ограниченной. Найдется $x \in \{x_\alpha\}$ и множество $V' \in [\mathbb{V}]$ такое, что любой окрестности нуля $W \in [\mathbb{W}]$ $e \circ |x - \hat{x}| \in V \forall e \in W$. Это противоречит $[\mathbb{W}]$ -согласованности фильтра $[\mathbb{V}]$.

Достаточность. Пусть $\{x_\alpha\}$ - сеть, $([\mathbb{V}], [\mathbb{W}])$ -ограниченная и (\mathcal{Z}) -сходящаяся к \hat{x} . По определению, существует $\bar{x} \in X_{\max}$ такой, что некоторая подсеть $\{x_{\alpha_\beta}\}$ сходится к \hat{x} с регулятором $\bar{x} : \forall \varepsilon > 0 \exists \beta_\varepsilon : |\hat{x}_{\alpha_\beta}| \leq \varepsilon \cdot \bar{x} \forall \beta \geq \beta_\varepsilon, \{\hat{x}_{\alpha_\beta}\} = \{\hat{x} - x_{\alpha_\beta}\}$.

Пусть V - произвольное множество, принадлежащее фильтру $[\mathbb{V}]$. По $(*)$ -свойству, $\exists V' \in [\mathbb{V}]$ такое, что $V + V' \subseteq V$. В силу $([\mathbb{V}], [\mathbb{W}])$ -ограниченности сети $\{x_\alpha\}$ найдется окрестность нуля $W_{V'}$ топологии t_B такая, что

$$e \circ |\hat{x}_\alpha| \in V' \quad (1)$$

для всех $e \in W_{V'}$ и всех α .

Рассмотрим характеристику элемента $\bar{x} : e_\lambda^{\bar{x}} = \{e \in B(X), e \circ \bar{x} < \lambda e; (x_\alpha - e) \circ \lambda(x_\alpha - e)\}$. Отметим, что $\sup e_\lambda^{\bar{x}} = x_0$. Так как $e_\lambda^{\bar{x}} \leq x_0 \forall \lambda$, то $x_0 - e_\lambda^{\bar{x}} \in B(X)$ и $x_0 - e_\lambda^{\bar{x}} \xrightarrow{\lambda \rightarrow \infty} \theta$ при $\lambda \rightarrow \infty$. Из свойства топологии t_B следует, что для любой окрестности нуля W топологии t_B найдется λ_W такое, что

$$x_0 - e_\lambda^{\bar{x}} \in W, \quad (2)$$

$$\forall \lambda \geq \lambda_W.$$

Пусть за эту окрестность принята $W_{V'}$. По определению характеристики, $e_{\lambda_W}^{\bar{x}} \circ \bar{x} < \lambda_W \cdot e_{\lambda_W}^{\bar{x}}$ и для любого $\varepsilon > 0$ $\varepsilon \cdot e_{\lambda_W}^{\bar{x}} \circ \bar{x} < \varepsilon \cdot \lambda_W \cdot e_{\lambda_W}^{\bar{x}}$. Так как в K -пространстве умножение на положительный элемент сохраняет неравенства, то, возвращаясь к подсети $\{\hat{x}_{\alpha_\beta}\}$, имеем:

$$e_\lambda^{\bar{x}} \circ |\hat{x}_{\alpha_\beta}| \leq \varepsilon \cdot e_{\lambda_W}^{\bar{x}} \circ \bar{x} < \varepsilon \cdot \lambda_W \cdot e_{\lambda_W}^{\bar{x}}, \quad \forall \beta \geq \beta_\varepsilon.$$

По $(***)$ -свойству, найдется $\varepsilon'' > 0$ такой, что

$$\varepsilon' \cdot \lambda_W \cdot e_{\lambda_W}^{\bar{x}} \in V', \quad \forall \varepsilon' \leq \varepsilon''. \quad (3)$$

Тогда, в силу (2) -выпуклости множества V' и из (3), следует

$$e_{\lambda_W}^{\bar{x}} \circ |\hat{x}_{\alpha_\beta}| \in V', \quad \forall \beta \geq \beta_{\varepsilon''}. \quad (4)$$

Любой элемент $|x| \in X$ можно представить в виде $|x| = e \circ |x| + (x_0 - e) \circ |x|$. Следовательно, для любого элемента подсети $\{x_{\alpha_\beta}\}$

$$|\hat{x}_{\alpha\beta}| = e_{\lambda_{\alpha\beta}}^{\bar{x}} \circ |\hat{x}_{\alpha\beta}| + (x_0 - e_{\lambda_{\alpha\beta}}^{\bar{x}}) \circ |\hat{x}_{\alpha\beta}|.$$

В силу (2) и (1), $(x_0 - e_{\lambda_{\alpha\beta}}^{\bar{x}}) \circ |\hat{x}_{\alpha\beta}| \in V' \quad \forall \beta$. Используя (4) и (*) -свойство фильтра $[V]$, имеем

$$|\hat{x} - x_{\alpha\beta}| = |\hat{x}_{\alpha\beta}| = e_{\lambda_{\alpha\beta}}^{\bar{x}} \circ |\hat{x}_{\alpha\beta}| + (x_0 - e_{\lambda_{\alpha\beta}}^{\bar{x}}) \circ |\hat{x}_{\alpha\beta}| \in V' + V' \subset V$$

для всех $\beta \geq \beta_{\varepsilon}$. Таким образом, подсеть $\{x_{\alpha\beta}\}$ Φ -сходится к \hat{x} относительно $[V]$.

Мы установили следующий факт: для сети $\{x_{\alpha}\}$, $([V], [W])$ -ограниченной и (3)-сходящейся к \hat{x} , найдется подсеть $\{x_{\alpha\beta}\}$, Φ -сходящаяся к \hat{x} относительно $[V]$.

Предположим, что сеть $\{x_{\alpha}\}$ не является Φ -сходящейся к \hat{x} относительно $[V]$. Тогда существует подсеть $\{x_{\alpha\gamma}\}$ и множество $V \in [V]$ такое, что $\forall \gamma$

$$\hat{x} - x_{\alpha\gamma} \notin V. \quad (5)$$

Так как $\{x_{\alpha\gamma}\}$ (3)-сходится к \hat{x} и $([V], [W])$ -ограничена, для нее существует подсеть $\{x_{\alpha\gamma\beta}\}$, Φ -сходящаяся к \hat{x} , что противоречит (5). Таким образом, $\{x_{\alpha}\}$ Φ -сходится к \hat{x} относительно $[V]$. Предложение доказано.

Пусть в X введена хаусдорфова локально-выпуклая топология t_x , фильтр $[V]$ окрестности нуля которой является $[W]$ -согласованным и удовлетворяет условиям (***) и (****); за элемент \hat{x} примем θ ; Φ -сходимость сети $\{x_{\alpha}\}$ к \hat{x} относительно $[V]$ есть сходимость к θ в топологии t_x .

ПРЕДЛОЖЕНИЕ 3. Для того, чтобы множество $\mathcal{O} \subset X$ было компактным в топологии t_x , необходимо и достаточно, чтобы \mathcal{O} было компактным относительно (3)-сходимости и $([V], [W])$ -ограниченным.

ДОКАЗАТЕЛЬСТВО. Необходимость. Пусть \mathcal{O} компактно в топологии t_x . Тогда оно (по свойству (****)) является компактным относительно (3)-сходимости. Далее, \mathcal{O} предкомпактно в топологии t_x (т.е. $[V]$ -предкомпактно) и, по предложению 1, $([V], [W])$ -ограничено.

Достаточность условий немедленно следует из предложения 2.

Пусть (Ω, μ) - пространство с положительной непрерывной конечной мерой, $X \sim L_p(\Omega, \mu)$, $1 \leq p < \infty$, $X_{\max} \sim S(\Omega, \mu)$ -

пространство μ -измеримых функций; в $S(\Omega, \mu)$ сходимость с регулятором совпадает с (0)-сходимостью, а (3)-сходимость есть сходимость по мере ([2], стр. 186, 178, 80).

Тогда понятия ($[V], [W]$)-ограниченного множества и множества, имеющего равномерно абсолютно непрерывные нормы ([5], стр. 13) совпадают (t_B -топология, определяемая на $B(X)$ мерой μ). Следовательно, предложение 3 является обобщением критерия компактности множеств для $L_p(\Omega, \mu), 1 < p < \infty$, ([5], стр. 14).

Пусть $X - K$ -линеал с достаточным числом вполне линейных функционалов, X^X -пространство вполне линейных функционалов над X . Пространства X и X^X образуют дуальную пару, отделимую по X^X . Мы будем рассматривать $\sigma(X, X^X)$ -компактность множеств в X , предполагая, что концы положительных элементов $X_+ \subset X$ замкнуты в $\sigma(X, X^X)$ -топологии.

ПРЕДЛОЖЕНИЕ 4. Пусть $\mathcal{O} \subset X$ (0)-выпуклое множество, компактное в какой-либо топологии t , согласующейся с двойственностью между X и X^X . Тогда для любой сети $\{x_\alpha^X\} \subset X^X$, $x_\alpha^X \xrightarrow{(0)} \theta, \langle x_\alpha^X, |x| \rangle \rightarrow 0$ равномерно относительно $x \in \mathcal{O}$.

ДОКАЗАТЕЛЬСТВО. Предположим сначала, что $\mathcal{O} \subset X_+$. Для любой сети $\{x_\alpha^X\} \subset X_+^X, x_\alpha^X \neq \theta$, определим функции $f_\alpha(x) = \langle x_\alpha^X, x \rangle$. Тогда для любого $x \in \mathcal{O}$ $f_\alpha(x) \downarrow 0$. По теореме Дини ([6], стр. 314) $\forall \varepsilon > 0, \exists \alpha_\varepsilon: f_\alpha(x) \leq \varepsilon, \forall x \in \mathcal{O}, \forall \alpha \geq \alpha_\varepsilon$, т.е. сходимость равномерная.

Пусть $\mathcal{O} \subset X$ -произвольное (0)-выпуклое t -компактное множество, $\{x_\alpha^X\} \subset X^X$ -произвольная сеть, (0)-сходящаяся к θ , т.е. $|x_\alpha^X| \leq \tilde{x}_\alpha^X \downarrow \theta$.

Так как топология t согласуется с двойственностью и $\sigma(X, X^X)$ -замкнутое множество X_+ является выпуклым, то оно t -замкнуто ([7], стр. 55). Следовательно, $\mathcal{O} \cap X_+$ также t -замкнуто и t -компактно.

В силу (0)-выпуклости \mathcal{O} для любого $x \in \mathcal{O}$ $|x| \in \mathcal{O} \cap X_+$. Тогда $\langle x_\alpha^X, |x| \rangle \leq \langle \tilde{x}_\alpha^X, |x| \rangle \leq \varepsilon, \forall x \in \mathcal{O}$ при $\alpha \geq \alpha_\varepsilon$ (по доказанному). Следовательно, сходимость равномерная. Предложение доказано.

Пусть $X - K$ -пространство, рефлексивное по Накано^{ж)}.

ПРЕДЛОЖЕНИЕ 5. Пусть $\mathcal{O} \subset X$ - множество, ограниченное в $\sigma(X, X^X)$ - топологии и такое, что для любой сети $\{x_\alpha^x\} \subset X^x$, $x_\alpha^x \xrightarrow{(0)} \theta$, $\langle |x_\alpha^x|, |x| \rangle \rightarrow 0$ равномерно относительно $x \in \mathcal{O}$. Тогда множество \mathcal{O} относительно компактно в $\sigma(X, X^X)$ - топологии.

ДОКАЗАТЕЛЬСТВО. Пусть \mathfrak{A} - оператор естественного вложения^{жж)} X^x в $(X^X)^*$. Тогда замыкание $\overline{\mathfrak{A}\mathcal{O}}$ в топологии $\sigma((X^X)^*, X^X)$ является $\sigma((X^X)^*, X^X)$ -компактным. Покажем, что для любого $\hat{x} \in \overline{\mathfrak{A}\mathcal{O}}$ найдется такой $x \in X$, что $\mathfrak{A}x = \hat{x}$.

Пусть $\hat{x} \in \overline{\mathfrak{A}\mathcal{O}}$, $\{x_\alpha^x\} \subset X^x$, $x_\alpha^x \rightarrow \theta$. Для любого $\varepsilon > 0$ и α' найдется $x(\varepsilon, \alpha') \in \mathcal{O}$ такой, что $\langle |x - \mathfrak{A}x(\varepsilon, \alpha')|, x_\alpha^x \rangle \leq \varepsilon$. Тогда $\forall \alpha \geq \alpha_\varepsilon$, $(\alpha_\varepsilon: \langle |x_\alpha^x|, |x| \rangle \leq \varepsilon \quad \forall x \in \mathcal{O})$,

$$\langle |\hat{x}, x_\alpha^x| \rangle \leq \langle |\hat{x} - \mathfrak{A}x(\varepsilon, \alpha)|, x_\alpha^x \rangle + \langle |\mathfrak{A}x(\varepsilon, \alpha), x_\alpha^x| \rangle \leq \langle |\hat{x} - \mathfrak{A}x(\varepsilon, \alpha)|, x_\alpha^x \rangle + \langle |x_\alpha^x|, |x(\varepsilon, \alpha)| \rangle \leq 2\varepsilon.$$

Таким образом, $\langle |\hat{x}, x_\alpha^x| \rangle \leq 2\varepsilon$. В силу произвольности ε и сети $\{x_\alpha^x\} \subset X^x$, (0)-сходящейся к нулю, заключаем, что \hat{x} есть вполне линейный функционал над X^x , т.е. $\exists x \in X$, такое, что $\mathfrak{A}x = \hat{x}$. Следовательно, существует множество $\mathcal{O}' \subset X$ такое, что $\mathfrak{A}\mathcal{O}' = \overline{\mathfrak{A}\mathcal{O}}$ и ясно, что $\overline{\mathcal{O}} \subset \mathcal{O}'$ ($\overline{\mathcal{O}}$ - замыкание \mathcal{O} в $\sigma(X, X^X)$ -топологии). По доказанному, \mathcal{O}' является относительно $\sigma(X, X^X)$ -компактным (т.к. $\sigma((X^X)^*, X^X)$ и $\sigma(X, X^X)$ совпадают на X). Следовательно, \mathcal{O} относительно $\sigma(X, X^X)$ компактно. Предложение доказано.

Из предложения 4 и предложения 5 вытекает следующий критерий относительной $\sigma(X, X^X)$ -компактности (0)-выпуклых множеств в K -пространствах, рефлексивных по Накано.

Для того, чтобы множество $\mathcal{O} \subset X$ было относительно компактным в $\sigma(X, X^X)$ -топологии, необходимо и достаточно выполнения следующих условий:

ж) Напомним [2], что рефлексивность по Накано означает совпадение X с пространством вполне линейных функционалов над X^x .

жж) Здесь через $(X^X)^*$ обозначено алгебраическое сопряженное к X^X пространство.

- 1) \mathcal{O} ограничено в $\sigma(X, X^*)$ -топологии;
- 2) для любой сети $\{x_\alpha\} \subset X^*$, $x_\alpha \xrightarrow{\mathcal{O}} \theta$, $\langle |x_\alpha|, |x| \rangle \rightarrow 0$ равномерно относительно $x \in \mathcal{O}$.

Л и т е р а т у р а

1. ПОРТЕР У. Современные основания общей теории систем. М., "Наука", 1971.
2. ВУЛИХ Б.З. Введение в теорию полуупорядоченных пространств. М., Физматгиз, 1961.
3. КАНТОРОВИЧ Л.В., ВУЛИХ Б.З., ПИНСКЕР А.Г. Функциональный анализ в полуупорядоченных пространствах. М.-Л., Гостехиздат, 1950.
4. ЭДВАРДС Р. Функциональный анализ. М., "Мир", 1969.
5. КРАСНОСЕЛЬСКИЙ М.А., ЗАБРЕЙКО П.П., ПУСТЫЛЬНИК Е.И., СОБОЛЕВСКИЙ П.Е. Интегральные операторы в пространствах суммируемых функций. М., "Наука", 1966.
6. КЕЛЛИ Дж. Общая топология. М., "Наука", 1968.
7. РОБЕРТСОН А.П., РОБЕРТСОН В.Дж. Топологические векторные пространства. М., "Мир", 1967.

Поступила в ред.-изд. отд.
20. XI, 1971 г.