

УДК 517.9

©2012. А. А. Бондарь

ПАРАМЕТРИЗАЦИЯ ПОДМНОГООБРАЗИЯ КОМПАКТНЫХ ОПЕРАТОРОВ С ФИКСИРОВАННОЙ СТРУКТУРОЙ ЖОРДАНОВЫХ БЛОКОВ

С помощью специального локального диффеоморфизма описано подмногообразие компактных операторов с фиксированной структурой жордановых блоков выделенных собственных значений. Также предъявлены формулы некоторых специальных однопараметрических возмущений данной жордановой структуры.

Ключевые слова: многообразие компактных операторов, жорданова форма.

1. Введение. В работе [1] В.И. Арнольд впервые рассмотрел многообразие вещественных симметричных матриц с фиксированными кратностями выбранных собственных значений. Он нашел формулу его коразмерности, которая зависит только от кратностей выбранных собственных значений и не зависит от размерности объемлющего пространства. Эти результаты были обобщены для случая компактных вещественных самосопряженных операторов в работе [2], где введен локальный диффеоморфизм, распрямляющий многообразие Арнольда. Дальнейшее изучение свойств многообразия Арнольда и локального диффеоморфизма осуществлено Я.М. Дымарским [3], [4]. В работе [5] автором было дано неявное задание подмногообразия компактных операторов с фиксированной структурой жордановых блоков выделенных ненулевых собственных значений. Здесь предложена параметризация этого подмногообразия, полученная при помощи специального диффеоморфизма. Параметризация имеет определенные преимущества перед неявным заданием. В настоящей работе с ее помощью дается описание некоторых специальных однопараметрических возмущений данной жордановой структуры.

2. Обозначения и определения. Пусть X – банахово пространство над полем \mathbb{C} , а L_c – банахово пространство компактных операторов, действующих в X . Пусть $J \in L_c$ фиксированный компактный оператор со спектром σ и ненулевое собственное значение $\lambda \in \sigma$ фиксировано. Пусть P_λ есть проекционный оператор Рисса, отвечающий λ , а $P_{\sigma \setminus \lambda}$ – проекционный оператор Рисса, отвечающий $\sigma \setminus \lambda$. Пространство $X = X^{(1)} \oplus X^{(2)}$, где $X^{(1)} = P_\lambda(X)$ – инвариантное подпространство, отвечающее собственному значению λ , а $X^{(2)} = P_{\sigma \setminus \lambda}(X)$ – инвариантное подпространство, отвечающее остальной части спектра σ . Разложение пространства X порождает разложение пространства операторов: $L_c = L_c^{11} \oplus L_c^{12} \oplus L_c^{21} \oplus L_c^{22}$. Произвольный оператор $B \in L_c$ при этом имеет блочное представление

$$B = \begin{bmatrix} B_{1,1} & B_{1,2} \\ B_{2,1} & B_{2,2} \end{bmatrix}. \quad (1)$$

Автор признателен Я.М. Дымарскому за постановку проблемы и постоянную поддержку.

В частности, в каноническом базисе подпространства $X^{(1)}$ оператор J имеет блочно-диагональный вид

$$J = \begin{bmatrix} J(\lambda) & 0 \\ 0 & A_{2,2} \end{bmatrix},$$

где $J(\lambda)$ есть прямая сумма жордановых блоков, отвечающих собственному значению λ .

Пусть алгебраическая кратность λ равняется m , а геометрическая кратность равняется s , тогда конечномерный оператор $B_{1,1}$ имеет порядок m и блочное представление

$$B_{1,1} = [B_{ij}]_{i,j=1}^s, \quad (2)$$

которое порождено жордановой структурой $J(\lambda)$.

В дальнейшем мы будем отождествлять операторы в $X^{(1)}$ и матрицы порядка m . Матричное пространство L_c^{11} мы наделяем эрмитовой структурой с помощью скалярного произведения $(A, B) = \text{Trace}(A \cdot B^*)$, где B^* – матрица, полученная из B транспонированием и комплексным сопряжением.

Обозначим через $\bar{k} := \{k_1, \dots, k_s\}$ вектор, чьи компоненты являются размерами жордановых блоков в $J(\lambda)$ ($k_1 \geq k_2 \geq \dots \geq k_s$, $\sum k_i = m$). Через $N_\varepsilon(J) \subset L_c$ обозначим ε -окрестность оператора J . Мы изучаем подмножество $L_c(J, \varepsilon, \lambda, \bar{k})$ компактных операторов $A \in N_\varepsilon(J)$, имеющих в окрестности λ единственное собственное значение λ' , которому отвечают жордановы блоки $J(A, \lambda')$ той же структуры, что и $J(\lambda)$.

Пусть $Orb(A)$ – орбита произвольной фиксированной матрицы $A \in L_c^{11}$ под действием группы $GL(m, \mathbb{C})$ всех невырожденных матриц порядка m . Рассмотрим специальное семейство матриц $A = J(\lambda) + F$, отличающихся от исходной жордановой тем, что в некоторых местах вместо нулей стоят голоморфные функции параметров, обращающиеся в нуль при нулевых значениях параметров.

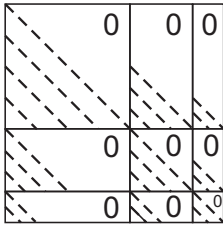


Рис. 1. Нормальная форма

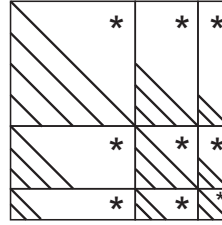


Рис. 2. Матрица из касательного пространства

При этом блочная (см. (2)) матрица F имеет вид, описанный на рис. 1: каждый пунктирный отрезок означает ряд одинаковых чисел, а в незаполненных местах подразумеваются нули. Множество всех матриц на рис. 1 образует линейное подпространство $L_k^{11} \subset L_c^{11}$ размерности $d = k_1 + 3k_2 + \dots + (2s - 1)k_s$. Это подпространство ортогонально и трансверсально орбите $Orb(J(\lambda))$ [6]. Далее нам понадобится касательное пространство $T_{J(\lambda)}Orb$ к орбите $J(\lambda)$, состоящее из матриц вида $[C, J(\lambda)] := C \cdot J(\lambda) - J(\lambda) \cdot C$ [6]. Мы утверждаем, что произвольная матрица

$S \in T_{J(\lambda)}Orb$ имеет вид, описанный на рис. 2: сумма элементов на указанных отрезках равна нулю, все остальные элементы (*) являются произвольными. Во-первых, очевидно, что подпространство таких матриц имеет коразмерность d в пространстве L_c^{11} . Во-вторых, вышеуказанные матрицы ортогональны матрицам из подпространства L_k^{11} . Остается вспомнить, что подпространство L_k^{11} является ортогональным и трансверсальным к орбите $Orb(J(\lambda))$.

Таким образом, L_c^{11} является прямой суммой ортогональных подпространств: $L_c^{11} = L_k^{11} \oplus T_{J(\lambda)}Orb$; произвольная матрица $B_{1,1} \in L_c^{11}$ единственным образом представима в виде

$$B_{1,1} = F(B_{1,1}) + S(B_{1,1}), \quad (3)$$

где $F : L_c^{11} \rightarrow L_k^{11}$, $S : L_c^{11} \rightarrow T_{J(\lambda)}Orb$ ортогональные проекторы.

Разложения (1) и (3) порождают проекторы

$$\widehat{F}, \widehat{S} : L_c \rightarrow L_c,$$

$$\widehat{F}(B) := \begin{bmatrix} F(B_{1,1}) & 0 \\ 0 & B_{2,2} \end{bmatrix}, \quad \widehat{S}(B) := \begin{bmatrix} S(B_{1,1}) & B_{1,2} \\ B_{2,1} & 0 \end{bmatrix}.$$

3. Основные теоремы. Для исследования многообразия операторов рассмотрим отображение малой окрестности нуля

$$\Psi : L_c \supset N(0) \rightarrow L_c, \quad \Psi(B) := \left(I + (\widehat{S}(B))^T \right) \left(J + \widehat{F}(B) \right) \left(I + (\widehat{S}(B))^T \right)^{-1}. \quad (4)$$

Теорема 1. *Справедливы следующие утверждения:*

1. $\Psi(0) = J$.
2. Операторы $J + \widehat{F}(B)$ и $\Psi(B)$ подобны.
3. Отображение Ψ инвариантно относительно подпространств L_c^{11} и L_c^{22} .
4. Отображение Ψ голоморфно в нуле.
5. Отображение Ψ является диффеоморфизмом некоторой малой окрестности $N(0)$ на шаровую окрестность $N_\varepsilon(J)$ достаточно малого радиуса ε .
6. Сужение отображения Ψ на подпространство L_c^{11} локально отображает касательное пространство $T_{J(\lambda)}Orb$ на $Orb(J(\lambda))$.

Доказательство. Первое, второе и третье утверждения следуют непосредственно из формулы (4).

Под голоморфностью отображения Ψ мы понимаем определение из [7]. Голоморфность Ψ следует из линейности отображений \widehat{S} и \widehat{F} и формулы (4).

Чтобы доказать пятое утверждение, найдем производную $D\Psi(0)$ в точке $0 \in L_c$ и докажем, что она является линейным изоморфизмом. С этой целью разложим $(I + (\widehat{S}(B))^T)^{-1}$ в ряд и выделим линейную часть:

$$\begin{aligned}\Psi(B) &= (I + (\widehat{S}(B))^T)(J + \widehat{F}(B))(I + (\widehat{S}(B))^T)^{-1} = \\ &= (I + (\widehat{S}(B))^T)(J + \widehat{F}(B))(I - (\widehat{S}(B))^T + ((\widehat{S}(B))^T)^2 - \dots) = \\ &= J + \widehat{F}(B) + (\widehat{S}(B))^T \cdot J - J \cdot (\widehat{S}(B))^T + o(B),\end{aligned}$$

где $o(B)$ – бесконечно малая второго порядка. Поэтому

$$\begin{aligned}D\Psi(0)B &= \widehat{F}(B) + [(\widehat{S}(B))^T, J] = \\ &= \begin{pmatrix} F(B_{1,1}) + [(S(B_{1,1}))^T, J(\lambda)] & B_{2,1}^T \cdot A_{2,2} - J(\lambda) \cdot B_{2,1}^T \\ A_{2,2} \cdot B_{1,2}^T - B_{1,2}^T \cdot J(\lambda) & B_{2,2} \end{pmatrix}.\end{aligned}\quad (5)$$

Покажем, что $D\Psi(0)$ является биекцией. Для этого необходимо и достаточно, чтобы уравнение

$$D\Psi(0)B = C \quad (6)$$

имело единственное решение B при любых $C \in L_c$. Уравнение (6) равносильно системе операторных уравнений:

$$\begin{cases} F(B_{1,1}) + [(S(B_{1,1}))^T, J(\lambda)] = C_{1,1}, \\ B_{2,2} = C_{2,2}, \\ B_{2,1}^T \cdot A_{2,2} - J(\lambda) \cdot B_{2,1}^T = C_{1,2}, \\ A_{2,2} \cdot B_{1,2}^T - B_{1,2}^T \cdot J(\lambda) = C_{2,1}. \end{cases}$$

Заметим, что уравнения независимы и каждое содержит в качестве неизвестного один из блоков разложения (1). Последние два уравнения являются уравнениями типа Сильвестра. Поскольку λ не является собственным значением оператора $A_{2,2}$, то указанные уравнения имеют единственные решения $B_{2,1}, B_{1,2}$ при любых $C_{1,2}, C_{2,1}$ [8]. Остается показать, что первое уравнение системы имеет единственное решение. Уравнение

$$F(B_{1,1}) + [(S(B_{1,1}))^T, J(\lambda)] = C_{1,1}$$

будет иметь единственное решение при любых $C_{1,1}$, тогда и только тогда, когда соответствующее однородное уравнение

$$F(B_{1,1}) + [(S(B_{1,1}))^T, J(\lambda)] = 0 \quad (7)$$

будет иметь только тривиальное решение $B_{1,1} = 0$. Поскольку

$$F(B_{1,1}) \in L_k^{\mathbf{11}} \perp T_{J(\lambda)} \ni [(S(B_{1,1}))^T, J(\lambda)],$$

то уравнение (7) эквивалентно системе

$$\begin{cases} F(B_{1,1}) = 0 \in L_k^{\mathbf{11}}, \\ [(S(B_{1,1}))^T, J(\lambda)] = 0 \in T_{J(\lambda)} Orb. \end{cases} \quad (8)$$

Локальное пересечение пачки матриц с семейством матриц Арнольда является интервалом

$$L_c^m(\bar{k}, \varepsilon) \cap \{J(\lambda) + L_{\bar{k}}^{11}\} = J(\lambda) + \{(\lambda' - \lambda)I, |\lambda' - \lambda| < \varepsilon\}. \quad (9)$$

Поскольку семейство $\{J(\lambda) + L_{\bar{k}}^{11}\}$ трансверсально орбите $Orb(J(\lambda))$ и размерность подпространства $L_{\bar{k}}^{11}$ равна коразмерности $Orb(J(\lambda))$, то пересечение (9) содержит все матрицы из семейства Арнольда, подобные матрицам из $L_c^m(\bar{k}, \varepsilon)$. Далее применяя проекцию F к прообразу $(\Psi^{11})^{-1}(L_c^m(\bar{k}, \varepsilon))$, мы получим

$$F((\Psi^{11})^{-1}(L_c^m(\bar{k}, \varepsilon))) = \{(\lambda' - \lambda)I\}.$$

Из разложения (3) и утверждения 5 теоремы 1 вытекает, что подмножество $L_c^m(\bar{k}, \varepsilon)$ определяется следующим образом:

$$L_c^m(\bar{k}, \varepsilon) = \Psi^{11}(T^{11} \cap N^{11}(0)), \quad (N^{11}(0) \subset L_c^{11}) \quad (10)$$

и является аналитическим подмногообразием комплексной коразмерности

$$co \dim L_c^m(\bar{k}, \varepsilon) = (k_1 + 3k_2 + 5k_3 + \dots + (2s - 1)k_s) - 1.$$

Производная (5) отображения Ψ переводит матрицу $B_{1,1}$ из касательного пространства $T_0(T^{11}) = T^{11}$ в матрицу

$$D\Psi(0)B_{1,1} = (\lambda' - \lambda)I + [(S(B_{1,1}))^T, J(\lambda)], \quad (11)$$

где $[(S(B_{1,1}))^T, J(\lambda)] \in T_{J(\lambda)}Orb$. Поскольку Ψ является локальным диффеоморфизмом, то касательное пространство

$$T_{J(\lambda)}L_c^m(\bar{k}, \varepsilon) := D\Psi(0)(T^{11}) = \{(\lambda' - \lambda)I\} \oplus T_{J(\lambda)}Orb = T^{11}. \quad (12)$$

Рассмотрение конечномерного случая завершено.

Применим теперь к малому оператору $B \in T \cap N(0)$ отображение Ψ :

$$\begin{aligned} \Psi(B) &= (I + (\widehat{S}(B))^T)(J + \widehat{F}(B))(I + (\widehat{S}(B))^T)^{-1} = \\ &= \left(I + \begin{bmatrix} S(B_{1,1}) & B_{2,1} \\ B_{1,2} & 0 \end{bmatrix}^T \right) \cdot \begin{bmatrix} J(\lambda) + (\lambda' - \lambda)I & 0 \\ 0 & A_{2,2} + B_{2,2} \end{bmatrix} \cdot \\ &\quad \cdot \left(I + \begin{bmatrix} S(B_{1,1}) & B_{2,1} \\ B_{1,2} & 0 \end{bmatrix}^T \right)^{-1}. \end{aligned}$$

Мы видим, что $\Psi(T \cap N(0)) \subset L_c(A, \varepsilon, \lambda, \bar{k})$. При малом возмущении спектры диагональных блоков $J(\lambda) + (\lambda' - \lambda)I$ и $A_{2,2} + B_{2,2}$ не пересекаются. Учитывая, что Ψ локальный диффеоморфизм, и применяя (10), мы получаем утверждения 1 и 2 теоремы.

Из определения (5) отображения $D\Psi(0)$ следует, что

$$\begin{aligned} T_A L_c(A, \varepsilon, \lambda, \bar{k}) &= D\Psi(0)(T) = \\ &= \left\{ \begin{bmatrix} (\lambda' - \lambda)I + [(S(B_{1,1}))^T, J(\lambda)] & B_{2,1}^T \cdot A_{2,2} - J(\lambda) \cdot B_{2,1}^T \\ A_{2,2} \cdot B_{1,2}^T - B_{1,2}^T \cdot J(\lambda) & B_{2,2} \end{bmatrix}, B \in T \right\}. \end{aligned}$$

Из теоремы 1 и равенств (11), (12) мы получаем, что касательное пространство

$$T_A L_c(A, \varepsilon, \lambda, \bar{k}) = T.$$

Наконец, последнее утверждение теоремы непосредственно вытекает из утверждений один и три. \square

Утверждения теоремы легко переформулировать для случая конечного количества отслеживаемых ненулевых собственных значений.

4. Однопараметрические возмущения. В приложениях часто встречаются однопараметрические возмущения (семейства) операторов, которые сохраняют или изменяют специальным образом жорданову структуру исходного оператора. Используя локальный диффеоморфизм Ψ мы можем выписать явно некоторые из этих возмущений.

Обозначим через $T_{\perp} \subset L_c$ линейное подпространство блочных операторов вида (1), где $B_{1,1} \in T_{J(\lambda)} Orb$, а остальные блоки произвольные. Пусть I_m блочный оператор вида (1), где блоки $B_{1,2}, B_{2,1}, B_{2,2}$ нулевые, а блок $B_{1,1}$ – единичная матрица порядка m . Обозначим через $S^{2m-1} \subset \mathbb{C}^m$ сферу (вещественной размерности $2m - 1$) нормированных собственных векторов J , отвечающих собственному значению λ . В частности, $u \in S^{2m-1}$. Пусть $N(u) \subset S^{2m-1}$ малая окрестность u .

Опишем однопараметрические семейства операторов зависящих от малого параметра $t \in \mathbb{C}$, которые сохраняют жорданову структуру выделенного собственного значения.

Теорема 3. *Предположим, что*

$$\begin{aligned} \gamma(t) &\in \mathbb{C}, & \gamma(0) &= 0, \\ B(t) &\in T_{\perp} \subset L_c, & B(0) &= 0 \end{aligned}$$

произвольные аналитические функции. Справедливы следующие утверждения:

1. *При возмущении*

$$C(t) = \Psi(J + \gamma(t) \cdot I_m + B(t)) - J, \quad C(0) = 0$$

оператора J оператор $A(t) := J + C(t)$ имеет собственное значение $\lambda(t) = \lambda + \gamma(t)$, которому отвечают жордановы блоки той же структуры, что и $J(\lambda)$.

2. *Обратно, если аналитическая функция $A(t) \in L_c$ ($A(0) = J$) сохраняет жорданову структуру, отвечающую выделенному собственному значению, то существует единственная пара функций $\gamma(t)$ и $B(t)$, для которых $A(t) \equiv \Psi(J + \gamma(t) \cdot I_m + B(t))$.*

3. Если $w(t) \in N(u) \subset S^{2m-1}$, $(w(0) = u)$ – аналитическая функция, то $u(t) = \left(I + (\widehat{S}(B(t)))^T \right) w(t)$ есть некоторое семейство нормированных собственных векторов оператора $A(t)$, соответствующих собственному значению $\lambda(t)$.

Теперь опишем крайние случаи изменения жордановой структуры при возмущении. Изучим случай “предельного расщепления” жордановой структуры.

Теорема 4. *Предположим, что*

$$\begin{aligned} \gamma_i(t) &\in \mathbb{C}, \quad \gamma_i(0) = 0 \quad (i = 1, \dots, m), \\ \gamma_i(t) &\neq \gamma_j(t) \text{ при } i \neq j \text{ и } t \neq 0 \\ B(t) &\in T_{\perp} \subset L_c, \quad B(0) = 0 \end{aligned}$$

произвольные аналитические функции. Тогда при возмущении

$$C(t) = \Psi \left(J + \left[\begin{array}{ccc|c} \gamma_1(t) & \dots & 0 & 0 \\ \dots & \dots & \dots & 0 \\ 0 & \dots & \gamma_m(t) & 0 \\ \hline & & & 0 \end{array} \right] + B(t) \right) - J$$

оператора J оператор $A(t) := J + C(t)$ имеет m различных простых собственных значений $\lambda_i = \lambda + \gamma_i(t)$, близких λ .

Рассмотрим случай “предельного укрупнения” жордановой структуры.

Теорема 5. *Предположим, что*

$$\begin{aligned} \gamma_i(t) &\in \mathbb{C}, \quad \gamma_i(0) = 0, \quad (i = 0, \dots, s-1), \\ B(t) &\in T_{\perp} \subset L_c, \quad B(0) = 0 \end{aligned}$$

произвольные аналитические функции. Пусть $U(t) \in L_c$ произвольный оператор, у которого элементы на местах $(k_1, k_1 + 1), (k_1 + k_2, k_1 + k_2 + 1), \dots, (\sum_{i=1}^{s-1} k_i, \sum_{i=1}^{s-1} k_i + 1)$ соответственно равняются $\gamma_1(t), \gamma_2(t), \dots, \gamma_{s-1}(t)$, а остальные элементы равны нулю. Тогда при возмущении

$$C(t) = \Psi (J + \gamma_0(t) \cdot I_m + U(t) + B(t)) - J$$

оператора J оператор $A(t) := J + C(t)$ имеет единственное собственное значение $\lambda' := \lambda + \gamma_0(t)$, близкое λ , которому отвечает единственный блок жордана порядка m .

1. Арнольд В.И. Моды и квазимоды // Функци. анализ и его прилож. – 1948. – 6, № 2. – С. 94-101.
2. Fujiwara D., Tanikawa M., Yukita Sh. The spectrum of Laplasian I // Proc. Jap. Acad. Ser. A. – 1978. – 54, № 4. – P. 87-91.
3. Дымарский Я.М. Метод многообразий в теории собственных векторов нелинейных операторов // Современная математика. Фундаментальные направления. – 2007. – Т. 24. – С. 3-159.
4. Dymarskii Ya.M. Local research of manifolds generated by families of self-adjoint operators // Topology. – 2009. – 48. – P. 213-223.
5. Бондарь А.А. Подмногообразия компактных операторов с фиксированными жордановыми клетками // Український математичний вісник. – 2012. – Т. 9, №4. – С. 445-459.

6. Арнольд В.И. О матрицах, зависящих от параметров // Успехи математических наук. – 1971. – 2, №2 (158). – С. 101-114.
7. Бурбаки Н. Дифференцируемые и аналитические многообразия. – М.: Мир, 1975. – 220 с.
8. Далецкий Ю.Л., Крейн М.Г. Устойчивость решений дифференциальных уравнений в банаховом пространстве. – М.: Наука, 1970. – 535 с.
9. Гантмахер Ф.Р. Теория матриц. – М.: Физматлит, 2004. – 560 с.

A. A. Bondar

Parametrization of submanifold of compact operators with fixed Jordan blocks structure.

Using special local diffeomorphism a submanifold of compact operators with the fixed structure of Jordan blocks is described. Also, explicit formulas of some special one-parameter perturbations of Jordan structure are given.

Keywords: *compact operators manifold, Jordan form.*

О. О. Бондар

Параметризація підмноговиду компактних операторів з фіксованою структурою жорданових блоків.

За допомогою спеціального локального дифеоморфізму описано підмноговид компактних операторів з фіксованою структурою жорданових блоків виділених власних значень. Також подано формули деяких спеціальних однопараметричних збурень даної жорданової структури.

Ключові слова: *підмноговид компактних операторів, жорданова форма.*

Луганский национальный ун-т имени Т. Шевченко
a. - bondar@mail.ru

Получено 27.11.11