

СУЩЕСТВЕННО НЕУСТОЙЧИВЫЕ РЕШЕНИЯ РАЗНОСТНЫХ УРАВНЕНИЙ

We study the essential instability of solutions of linear and nonlinear difference equations.

Вивчається істотна нестійкість розв'язків лінійних і нелінійних різницевих рівнянь.

В данной статье уточняется и изучается введенное в [1] понятие существенно неустойчивого решения разностного уравнения

$$x(n+1) = F(n, x(n)), \quad n \geq 0, \quad (1)$$

где $F(n, \cdot)$, $n \geq 0$, — действующие в бесконечномерном банаховом пространстве E отображения. Приводятся необходимые и достаточные условия существенной неустойчивости и существенной экспоненциальной неустойчивости решений рассматриваемого уравнения с линейным постоянным отображением F и доказывается устойчивость существенной неустойчивости решений этого уравнения к компактным и близким к компактным возмущениям. Основную роль в исследованиях играют существенно аппроксимативный спектр линейного оператора и меры некомпактности.

1. Определения существенно неустойчивых решений уравнения (1). Рассмотрим отображение

$$\operatorname{sgn} x = \begin{cases} \|x\|^{-1} x, & \text{если } x \in E \setminus \{0\}; \\ 0, & \text{если } x = 0. \end{cases}$$

Каждому множеству $D \subset E$ поставим в соответствие множество

$$\operatorname{sgn} D = \{ \operatorname{sgn} x : x \in D \},$$

а каждой последовательности $\{y_m\} \subset E$ — число

$$\chi\{y_m\} = \lim_{n \rightarrow \infty} \inf_{k > l \geq n} \| \operatorname{sgn} y_k - \operatorname{sgn} y_l \|.$$

Ограниченную последовательность $\{y_m\} \subset E$ назовем *существенно расходящейся*, если она не содержит сходящихся подпоследовательностей. Очевидно, что ограниченная последовательность $\{y_m\} \subset E$ является существенно расходящейся тогда и только тогда, когда

$$\chi\{y_m\} > 0 \quad \text{и} \quad \lim_{m \rightarrow \infty} \|y_m\| > 0.$$

Обозначим через $y(n, b)$ решение $y(n)$ уравнения (1), удовлетворяющее начальному условию $y = b$, $b \in E$, а через $y(n, B)$, где $B \subset E$, — множество $\{y(n, b) : b \in B\}$.

Определение 1. Решение $x(n)$ разностного уравнения (1) называется *существенно неустойчивым*, если для некоторых чисел $\varepsilon_1 > 0$, $\varepsilon_2 > 0$ и каждого числа $\delta \in (0, \varepsilon_1)$ найдутся число $n(\delta) \in \mathbb{N}$ и последовательность $\{a_m\} \subset E$, для которой $\sup_{m \geq 1} \|x(0) - a_m\| \leq \delta$, такие, что для решений $y(n, a_m)$, $m \geq 1$, уравнения (1) выполняются соотношения $\|x(n(\delta)) - y(n(\delta), a_m)\| \geq \varepsilon_1$ для всех $m \geq 1$ (решение $x(n)$ неустойчиво) и $\chi\{x(n(\delta)) - y(n(\delta), a_m)\} \geq \varepsilon_2$ (последовательность $\{x(n(\delta)) - y(n(\delta), a_m)\}$ существенно расходится).

Очевидно, что уравнение (1) может иметь существенно неустойчивые реше-

ния только в случае $\dim E = \infty$ и не каждое неустойчивое решение является существенно неустойчивым.

Дадим другое определение существенно неустойчивого решения уравнения (1). Для этого напомним определение меры некомпактности.

Пусть Ω — произвольное ограниченное подмножество пространства E и $\text{diam } \Omega$ — диаметр множества Ω , определенный равенством

$$\text{diam } \Omega = \sup \{ \|x - y\| : x, y \in \Omega \}.$$

Для рассмотренного множества Ω мерой некомпактности называется число $\alpha(\Omega) = \inf \{ d > 0 : \text{существует конечное число подмножеств } \Omega_1, \dots, \Omega_n \text{ в } E \text{ таких, что } \text{diam } \Omega_i \leq d \text{ и } \Omega \subset \bigcup_{i=1}^n \Omega_i \}$ (см. [2; 3, с. 321]).

Для множества Ω и произвольного элемента $a \in E$ обозначим через $a + \Omega$ множество $\{a + \omega : \omega \in \Omega\}$. Рассмотрим также следующие расстояния между точкой $a \in E$ и множеством Ω :

$$\text{dist}(a, \Omega) = \inf_{\omega \in \Omega} \|a - \omega\|,$$

$$\text{Dist}(a, \Omega) = \sup_{\omega \in \Omega} \|a - \omega\|.$$

Определение 2. Решение $x(n)$ разностного уравнения (1) называется существенно неустойчивым, если для некоторых чисел $\varepsilon_1 > 0$, $\varepsilon_2 > 0$ и каждого числа $\delta \in (0, \varepsilon_1)$ найдутся число $n(\delta) \in \mathbb{N}$ и ограниченное множество $B \subset E$, для которого $\text{Dist}(x(0), B) \leq \delta$, такие, что $\text{dist}(x(n(\delta)), y(n(\delta), B)) \geq \varepsilon_1$ и $\alpha(\text{sgn}(-x(n(\delta)) + y(n(\delta), B))) \geq \varepsilon_2$.

Приведенные определения существенно неустойчивых решений эквивалентны в силу следующего утверждения.

Лемма 1. Для каждой последовательности $\{y_m\} \subset E$ имеет место равенство

$$\chi\{y_m\} = \alpha(\text{sgn}\{y_m : m \geq 1\}).$$

Утверждение леммы вытекает из определений величин $\chi\{y_m\}$ и $\alpha(\Omega)$.

2. Существенно аппроксимативный спектр линейного непрерывного оператора. Исследования существенно неустойчивых решений уравнения (1) основываются на понятии существенно аппроксимативного спектра линейного непрерывного оператора.

Напомним, что аппроксимативным спектром оператора $A \in L(E)$ называется множество $\sigma_a(A)$, состоящее из точек $\lambda \in \sigma(A)$ ($\sigma(A)$ — спектр оператора A), для каждой из которых существует последовательность $\{x_n\} \subset E$, не стремящаяся к нулю и для которой $\lim_{n \rightarrow \infty} \|(A - \lambda I)x_n\| = 0$, где I — единичный оператор.

Существенно аппроксимативным спектром оператора $A \in L(E)$ назовем множество $\sigma_{\text{ess}, a}(A)$, состоящее из точек $\lambda \in \sigma_a(A)$, для каждой из которых существует существенно расходящаяся последовательность $\{x_n\} \subset E$ и для которой $\lim_{n \rightarrow \infty} \|(A - \lambda I)x_n\| = 0$.

Из определения $\sigma_{\text{ess}, a}(A)$ и теоремы 5, приведенной в [4], вытекает следующее утверждение.

Теорема 1. Все предельные точки множества $\sigma_a(A)$ принадлежат $\sigma_{\text{ess}, a}(A)$.

Введенный существенно аппроксимативный спектр оператора $A \in L(E)$ не совпадает с близким по названию существенным аппроксимативно точечным

спектром $\sigma_{ea}(A)$ оператора A , рассмотренным в [5, 6] и определенным равенством

$$\sigma_{ea}(A) = \bigcap_{K \in \mathcal{K}(E)} \sigma_a(A + K),$$

где $\mathcal{K}(E)$ — идеал вполне непрерывных операторов $K \in L(E)$.

Несовпадение спектров $\sigma_{ess,a}(A)$ и $\sigma_{ea}(A)$ вытекает из того, что $\sigma_{ea}(A)$ содержит и такие точки $\lambda \in C$, для которых $\text{Im}(A - \lambda I) = \overline{\text{Im}(A - \lambda I)}$ и $0 \leq \leq \text{def}(A - \lambda I) < \text{nul}(A - \lambda I) < \infty$ [5, 6], а эти точки, очевидно, не принадлежат $\sigma_{ess,a}(A)$.

Следующие утверждения раскрывают свойства существенно аппроксимативного спектра оператора, которые потребуются при исследовании существенно неустойчивых решений уравнения (1).

Теорема 2. $\lambda \in \sigma_{ess,a}(A)$ тогда и только тогда, когда найдется ограниченное множество $B \subset E$ такое, что $\alpha(B) > 0$ и $\alpha((A - \lambda I)B) = 0$.

Доказательство. Необходимость утверждения следует из определения спектра $\sigma_{ess,a}(A)$. Для доказательства достаточности предположим, что $\alpha(B) > 0$ и $\alpha((A - \lambda I)B) = 0$ для некоторого ограниченного множества $B \subset E$. Рассмотрим произвольную существенно расходящуюся последовательность $\{b_m\} \subset B$. Вследствие относительной компактности множества $\{(A - \lambda I)b_m : m \geq 1\}$ найдется подпоследовательность $\{b_{m_k}\}$ (она будет существенно расходящейся) такая, что последовательность $\{(A - \lambda I)b_{m_k}\}$ будет сходящейся. Тогда для существенно расходящейся последовательности $\{\Delta b_{m_k}\}$, где $\Delta b_{m_k} = b_{m_{k+1}} - b_{m_k}$, будет выполняться соотношение $\lim_{k \rightarrow \infty} (A - \lambda I)\Delta b_{m_k} = 0$, т. е. $\lambda \in \sigma_{ess,a}(A)$. Теорема доказана.

Теорема 3. $\lambda \in \sigma_{ess,a}(A)$ тогда и только тогда, когда $\text{nul}(A - \lambda I) = \infty$ или $\text{Im}(A - \lambda I) \neq \overline{\text{Im}(A - \lambda I)}$.

Доказательство. Пусть $\text{nul}(A - \lambda I) < \infty$ и $\text{Im}(A - \lambda I) = \overline{\text{Im}(A - \lambda I)}$. В пространстве E существует подпространство E_1 , дополнительное для $\text{Ker}(A - \lambda I)$ [7]: $E = E_1 \oplus \text{Ker}(A - \lambda I)$. Пусть P_1 и P_2 — проекторы, соответствующие E_1 и $\text{Ker}(A - \lambda I)$, а D — сужение на E_1 оператора $A - \lambda I$. Тогда оператор $D: E_1 \rightarrow \text{Im}(A - \lambda I)$ имеет непрерывный обратный на основании теоремы Банаха об обратном операторе [7]. В силу $\text{nul}(A - \lambda I) < \infty$ для каждого ограниченного множества $B \subset E$, для которого $\alpha(B) > 0$, будет выполняться аналогичное соотношение $\alpha(P_1 B) > 0$. Поэтому $\alpha(DP_1 B) > 0$ вследствие обратимости D , т. е. $\alpha((A - \lambda I)B) > 0$. Тогда на основании теоремы 2 $\lambda \notin \sigma_{ess,a}(A)$.

Необходимость доказана.

Докажем достаточность. Если $\text{nul}(A - \lambda I) = \infty$, то, очевидно, что для множества $B = \{x \in \text{Ker}(A - \lambda I) : \|x\| = 1\}$ выполняются соотношения $\alpha(B) > 0$, $(A - \lambda I)B = \{0\}$. Тогда согласно теореме 2 $\lambda \in \sigma_{ess,a}(A)$. Если же $\text{Im}(A - \lambda I) \neq \overline{\text{Im}(A - \lambda I)}$ и $\text{nul}(A - \lambda I) < \infty$, то найдется дополнительное для $\text{Ker}(A - \lambda I)$ подпространство $E_1 \subset E$, для которого $\inf_{x \in E_1, \|x\|=1} \|(A - \lambda I)x\| = 0$ (заметим, что $E_1 \cap \text{Ker}(A - \lambda I) = \{0\}$). Следовательно, найдется существенно расходящаяся последовательность $\{x_n\} \subset E_1$, для которой $\lim_{n \rightarrow \infty} \|(A - \lambda I)x_n\| = 0$, т. е. $\lambda \in \sigma_{ess,a}(A)$.

Теорема 3 доказана.

Теорема 4. Для произвольных $\lambda \in \sigma_{ess,a}(A)$ и относительно компактного

множества \mathcal{K} вполне непрерывных операторов $K \in L(E)$ найдется существенно расходящаяся последовательность $\{x_n\}$, для которой

$$\lim_{n \rightarrow \infty} (\| (A - \lambda I)x_n \| + \sup_{K \in \mathcal{K}} \| Kx_n \|) = 0.$$

Доказательство. Пусть $\{y_n\}$ — существенно расходящаяся последовательность, для которой $\lim_{n \rightarrow \infty} (A - \lambda I)y_n = 0$. В силу относительной компактности множества \mathcal{K} и полной непрерывности элементов этого множества найдется такая подпоследовательность $\{y_{n_l}\}$, что последовательность $\{Ky_{n_l}\}$ будет сходящейся для каждого $K \in \mathcal{K}$. Тогда $\lim_{l \rightarrow \infty} K\Delta y_{n_l} = 0$ для всех $K \in \mathcal{K}$, где $\Delta y_{n_l} = y_{n_l+1} - y_{n_l}$, и $\lim_{l \rightarrow \infty} \sup_{K \in \mathcal{K}} \|K\Delta y_{n_l}\| = 0$ на основании относительной компактности множества \mathcal{K} . Поскольку $\lim_{l \rightarrow \infty} (A - \lambda I)\Delta y_{n_l} = 0$ и последовательность $\{\Delta y_{n_l}\}$, как и исходная последовательность $\{y_n\}$, является существенно расходящейся, в чем нетрудно убедиться, то утверждение теоремы 4 доказано.

Заметим, что в случае $\dim E = \infty$ для каждого $A \in L(E)$ спектр $\sigma_{ess, a}(A)$ — непустое компактное множество и для произвольной локально голоморфной на $\sigma(A)$ функции $f(z)$ имеет место равенство

$$\sigma_{ess, a}(f(A)) = f(\sigma_{ess, a}(A)).$$

Эти утверждения являются непосредственными аналогами таких же утверждений для других версий существенного спектра (см., например, [3, 8–10]).

3. Условия существенной неустойчивости решений уравнения (1) в случае $F(n, \cdot) \equiv \text{const} \in L(E)$. Будем считать, что уравнение (1) имеет вид

$$x(n+1) = Ax(n), \quad n \geq 0, \quad (2)$$

где $A \in L(E)$.

Для этого уравнения существенная неустойчивость всех решений равносильна существенной неустойчивости нулевого решения уравнения.

Введем в рассмотрение число

$$r_{ess, a}(A) = \sup \{ |\lambda| : \lambda \in \sigma_{ess, a}(A) \},$$

которое будем называть существенно аппроксимативным спектральным радиусом оператора A .

Теорема 5. Для того чтобы нулевое решение уравнения (2) было существенно неустойчивым, необходимо, чтобы

$$r_{ess, a}(A) \geq 1, \quad (3)$$

и достаточно, чтобы

$$r_{ess, a}(A) > 1. \quad (4)$$

Доказательство теоремы основывается на следующих утверждениях.

Лемма 2. Пусть λ — изолированная точка спектра $\sigma(A)$, для которой $\text{mul}(A - \lambda I) < \infty$ и $\text{Im}(A - \lambda I) = \overline{\text{Im}(A - \lambda I)}$, и Γ — такая положительно ориентированная окружность достаточно малого радиуса, что никакая другая точка, кроме λ , из $\sigma(A)$ не лежит на или внутри Γ . Тогда оператор

$$P_\lambda = \frac{1}{2\pi i} \int_{\Gamma} (zI - A)^{-1} dz$$

является оператором конечного ранга.

Доказательство. Пусть E_1 — дополнительное для $\text{Ker}(A - \lambda I)$ подпространство пространства E и $d = \inf_{x \in E_1, \|x\|=1} \|(A - \lambda I)x\|$. В силу условий леммы $d > 0$.

Предположим, что корневое подпространство

$$M_\lambda(a) = \bigcup_{r=1}^{\infty} \text{Ker}((\lambda I - A)^k)$$

является бесконечномерным. Тогда для каждого $m > 1$ найдется такой вектор a_m , что векторы $a_{m-1} = (A - \lambda I)a_m$, $a_{m-2} = (A - \lambda I)^2 a_m, \dots, a_1 = (A - \lambda I)^{m-1} a_m$ будут ненулевыми, $\|a_1\| = 1$ и $(A - \lambda I)a_1 = 0$. Очевидно, что

$$\|a_k\| \leq d^{-k+1} \quad \text{для всех } k = \overline{1, m}.$$

Рассмотрим произвольное число $q > 3$. Тогда

$$\begin{aligned} & \frac{q}{d}(A - \lambda I) \left(a_1 + \frac{d}{q} a_2 + \frac{d^2}{q^2} a_3 + \dots + \frac{d^{m-1}}{q^{m-1}} a_m \right) - \\ & - \left(a_1 + \frac{d}{q} a_2 + \frac{d^2}{q^2} a_3 + \dots + \frac{d^{m-1}}{q^{m-1}} a_m \right) = \frac{d^{m-1}}{q^{m-1}} a_m, \\ & \left\| \frac{d^{m-1}}{q^{m-1}} a_m \right\| \leq \frac{1}{q^{m-1}} < \frac{1}{3^{m-1}} \end{aligned}$$

и

$$\left\| a_1 + \frac{d}{q} a_2 + \frac{d^2}{q^2} a_3 + \dots + \frac{d^{m-1}}{q^{m-1}} a_m \right\| > \frac{1}{2}.$$

Поэтому $1 \in \sigma_a\left(\frac{q}{d}(A - \lambda I)\right)$ в силу произвольности $m > 1$ и, следовательно, $\lambda + d/q \in \sigma_a(A)$, а в силу произвольности $q > 3$ число λ является предельной точкой спектра $\sigma_a(A) \subset \sigma(A)$, что противоречит условию леммы об изолированности точки λ .

Итак, предположение, что $\dim M_\lambda(A) = \infty$, ложно. Следовательно, $\dim M_\lambda(A) < \infty$. Отсюда и из условий леммы вытекает, что λ не является точкой существенного спектра Браудера $\sigma_{\text{ess}}(A)$ оператора A [3]. Тогда на основании теоремы Д 3.3 (см. [3, с. 317]) оператор P_λ является оператором конечного ранга.

Лемма 3. Пусть $\lambda \in \sigma_{\text{ess}, a}(A) \setminus \{0\}$ и $\{a_m\}$ — такая существенно расходящаяся последовательность нормированных векторов $a_m \in E$ ($m \geq 1$), что $\lim_{m \rightarrow \infty} \|(A - \lambda I)a_m\| = 0$. Тогда

$$\alpha(\text{sgn} \{A^n a_m : m \geq 1\}) = \alpha(\{a_m : m \geq 1\})$$

для всех $n \in \mathbb{N}$.

Доказательство. Из равенства

$$A^n - \lambda^n I = (A^{n-1} + \lambda A^{n-2} + \lambda^2 A^{n-3} + \dots + \lambda^{n-1} I)(A - \lambda I), \quad n \geq 2,$$

и условий леммы вытекает, что

$$\lim_{m \rightarrow \infty} \|(A^n - \lambda^n I)a_m\| = 0$$

для всех $n \in N$. Поэтому множества $\{(A^n - \lambda^n I)a_m : m \geq 1\}$, $n \in N$, относительно компактны и, следовательно,

$$\alpha(\operatorname{sgn} \{A^n a_m : m \geq 1\}) = \alpha(\operatorname{sgn} \{\lambda^n a_m : m \geq 1\}), \quad n \in N.$$

А так как $\operatorname{sgn} \{\lambda^n a_m : m \geq 1\} = e^{i n \varphi} \{a_m : m \geq 1\}$, где $\varphi = \arg \lambda$, и $|e^{i n \varphi}| = 1$, то

$$\alpha(\operatorname{sgn} \{\lambda^n a_m : m \geq 1\}) = \alpha(\{a_m : m \geq 1\}), \quad n \in N,$$

т. е. справедливо утверждение леммы.

Лемма 4. Пусть U_n, V_n , $n \geq 1$, — произвольные элементы из $L(E)$ и S — произвольное непустое множество нормированных векторов из E , для которых $\operatorname{dist}(0, U_n S) > 0$ для всех $n \geq 1$ и

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \frac{\operatorname{Dist}(0, V_n S)}{\operatorname{dist}(0, U_n S)} = 0.$$

Тогда

$$\lim_{n \rightarrow \infty} (\alpha(\operatorname{sgn}((U_n + V_n)S)) - \alpha(\operatorname{sgn}(U_n S))) = 0.$$

Утверждение леммы вытекает из определения и свойств меры некомпактности (см. [2, с. 6–8]).

Доказательство теоремы 5. Предположим, что выполняется соотношение (4). Покажем, что нулевое решение уравнения (2) существенно неустойчиво.

Пусть $\lambda \in \sigma_{\text{ess}, a}(A)$, $|\lambda| = r_{\text{ess}, a}(A)$ и $\{a_m\}$ — существенно расходящаяся последовательность нормированных векторов $a_m \in E$, $m \geq 1$, для которой

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \|(A - \lambda I)a_m\| = 0. \quad (5)$$

Пусть $\varepsilon > 1$ — произвольное число и n_0 — такое натуральное число, что

$$|\lambda^{n_0}| > \varepsilon.$$

Из (5) следует, что $\lim_{m \rightarrow \infty} \|(A^{n_0} - \lambda^{n_0} I)a_m\| = 0$. Не ограничивая общности, можно считать, что

$$\|(A^{n_0} - \lambda^{n_0} I)a_m\| < |\lambda^{n_0}| - \varepsilon \quad \text{для всех } m \geq 1.$$

Тогда для решений $x(n, a_m) = A^n a_m$, $m \geq 1$, уравнения (2) будут выполняться неравенства

$$\|x(n_0, a_m)\| > \varepsilon, \quad m \geq 1,$$

т. е. в силу произвольности $\varepsilon > 1$ нулевое решение уравнения (2) неустойчиво.

Согласно леммам 1 и 3 и выбору последовательности $\{a_m\}$

$$\chi\{x(n, a_m)\} = \chi\{a_m\} > 0$$

для всех $n > 0$. Поэтому нулевое решение уравнения (2) существенно неустойчиво.

Обратно. Пусть нулевое решение уравнения (2) существенно неустойчиво, т. е. найдутся последовательность $\{a_m\}$ нормированных векторов $a_m \in E$, $m \geq 1$, и последовательность $\{n_k\}$ натуральных чисел n_k , $k \geq 1$, для которых

$$\lim_{k \rightarrow \infty} \inf_{m \geq 1} \|A^{nk} a_m\| = \infty \quad (6)$$

и

$$\inf_{k \geq 1} \chi\{A^{nk} a_m\} > 0. \quad (7)$$

Покажем, что имеет место соотношение (3).

Предположим, что (3) не выполняется, т. е.

$$r_{ess, a}(A) < 1.$$

Тогда для каждого числа $r > r_{ess, a}(A)$ множество $\sigma(A) \cap \{\lambda \in C : |\lambda| \geq r\}$ конечно или пусто на основании теоремы 1 и, следовательно, для некоторого числа $q \in (r_{ess, a}(A), 1)$ выполняется соотношение

$$\sigma(A) \cap \{\lambda \in C : |\lambda| = q\} = \emptyset.$$

Рассмотрим части σ_1 и σ_2 спектра $\sigma(A)$:

$$\sigma_1 = \{\lambda \in \sigma(A) : |\lambda| < q\},$$

$$\sigma_2 = \{\lambda \in \sigma(A) : |\lambda| > q\}$$

и соответствующие им проекционные операторы P_1 и P_2 (далее убедимся, что $\sigma_2 \neq \emptyset$).

Решения $x(n, a) = A^n a$, $a \in E$, уравнения (2) представим в виде

$$x(n, a) = A^n P_1 a + A^n P_2 a, \quad n \geq 0.$$

Поскольку

$$A^n P_1 = \frac{1}{2\pi i} \int_{|z|=q} z^n (zI - A)^{-1} dz, \quad n \geq 0,$$

и, следовательно,

$$\|A^n P_1\| \leq M q^{n+1}, \quad n \geq 0,$$

где $M = \max_{|z|=q} \|(zI - A)^{-1}\|$, то

$$\lim_{n \rightarrow +\infty} \|A^n P_1\| = 0. \quad (8)$$

Отсюда вытекает, что $\sigma_2 \neq \emptyset$ (если $\sigma_2 = \emptyset$, то тогда $P_1 = I$ и согласно (8) нулевое решение уравнения (2) асимптотически устойчиво).

В силу теоремы 3 для всех точек $\lambda \in \sigma_2$ выполняются соотношения

$$\text{nul}(A - \lambda I) < \infty$$

и

$$\text{Im}(A - \lambda I) = \overline{\text{Im}(A - \lambda I)}.$$

Поэтому на основании леммы 2 и конечности множества σ_2 подпространство $X = P_2 E$ конечномерно. А так как $A^n P_2 E \subset X$ для каждого $n \in N$, то

$$\alpha\{A^n P_2 a_m : m \geq 1\} = 0 \quad \forall n \in N. \quad (9)$$

В силу (6), (8) и (9) на основании леммы 4 получаем

$$\lim_{k \rightarrow \infty} \alpha(\text{sgn}\{A^{nk} P_1 a_m + A^{nk} P_2 a_m : m \geq 1\}) = 0.$$

Это соотношение согласно лемме 1 противоречит соотношению (7).

Итак, предположение о том, что в случае существенно неустойчивого нулевого решения уравнения (2) выполняется соотношение $r_{ess, d}(A) < 1$, ложно.

Теорема 5 доказана.

4. Условия существенной экспоненциальной неустойчивости решений уравнения (2). Нулевое решение разностного уравнения (2) назовем *существенно экспоненциально неустойчивым*, если найдутся числа $M > 0$, $q > 1$, последовательность $\{a_m\}$ нормированных векторов $a_m \in E$, $m \geq 1$, и отображение $p: N \rightarrow N$ такие, что для решений $x(n, a_m)$, $m \geq 1$, уравнения (8) будут выполняться соотношения

$$\|x(n, a_m)\| \geq Mq^n, \quad n \in N, \quad m \geq p(n), \quad (10)$$

$$\inf_{n \geq 1} \chi\{x(n, a_m)\} > 0. \quad (11)$$

Теорема 6. Нулевое решение уравнения (2) существенно экспоненциально неустойчиво тогда и только тогда, когда

$$r_{ess, a}(A) > 1. \quad (12)$$

Доказательство. Пусть выполняется соотношение (12). Рассмотрим произвольное число $\lambda \in \sigma_{ess, d}(A) \cap \{z: |z| = r_{ess, d}(A)\}$ и последовательность $\{b_m\}$ нормированных векторов $b_m \in E$, $m \geq 1$, для которых $\lim_{m \rightarrow \infty} (Ab_m - \lambda b_m) = 0$. Тогда $\lim_{m \rightarrow \infty} (A^n b_m - \lambda^n b_m) = 0$ для всех $n \in N$. На основании последнего соотношения и того, что $|\lambda| > 1$, найдутся подпоследовательность $\{a_m\}$ последовательности $\{b_m\}$ и отображение $p: N \rightarrow N$ такие, что

$$\|A^n a_m\| \geq \frac{1}{2} |\lambda|^n, \quad n \in N, \quad m \geq p(n).$$

Отсюда и из соотношения

$$\chi\{A^n a_m\} = \chi\{a_m\} > 0, \quad n \geq 1,$$

вытекающего из существенной расходимости последовательности $\{b_m\}$, а также из лемм 1 и 3 следует выполнение соотношений (10) (при $M = 1/2$) и (11) для решений

$$x(n, a_m) = A^n a_m, \quad m \geq 1,$$

уравнения (2).

Итак, неравенство (12) обеспечивает существенную экспоненциальную неустойчивость нулевого решения уравнения (2).

Обратно. Пусть нулевое решение уравнения (2) существенно экспоненциально неустойчиво. Тогда найдутся числа $M > 0$, $q > 1$, отображение $p: N \rightarrow N$ и последовательность $\{a_m\}$ нормированных векторов $a_m \in E$, $m \geq 1$ такие, что

$$\|A^n a_m\| \geq Mq^n, \quad n \in N, \quad m \geq p(n), \quad (13)$$

$$\inf_{n \geq 1} \chi\{A^n a_m\} > 0. \quad (14)$$

Тогда согласно теореме 5 $r_{ess, a}(A) \geq 1$.

Предположим, что

$$r_{ess, a}(A) = 1. \quad (15)$$

Из известного соотношения

$$r(A) = \lim_{n \rightarrow +\infty} \sqrt[n]{\|A^n\|}$$

для спектрального радиуса оператора A [2] и соотношения (13) вытекает, что $r(A) \geq q > 1$. Отсюда, из теорем 1 и 3 вытекает, что точки λ непустого множества $\sigma(A) \cap \{x \in C: |z| > 1\}$ удовлетворяют соотношениям

$$\text{nul}(A - \lambda I) < \infty, \quad (16)$$

$$\text{Im}(A - \lambda I) = \overline{\text{Im}(A - \lambda I)} \quad (17)$$

и являются изолированными точками. Это позволяет рассмотреть число $r \in (1, q)$, для которого

$$\{x \in C: |z| = r\} \cap \sigma(A) = \emptyset,$$

и непустые множества

$$\sigma_1 = \sigma(A) \cap \{x \in C: |z| < r\},$$

r

$$\sigma_2 = \sigma(A) \cap \{x \in C: |z| > r\}.$$

Пусть P_1 и P_2 — проекционные операторы, соответствующие частям σ_1 и σ_2 . Поскольку σ_2 — конечное множество, то в силу (16), (17) и леммы 2 проектор $P_2 = \sum_{\lambda \in \sigma_2} P_\lambda$ является оператором конечного ранга. Поэтому

$$\alpha(\text{sgn}\{A^n P_2 a_m: m \geq 1\}) = 0, \quad n \in N. \quad (18)$$

Нетрудно проверить, что для некоторого числа $M_1 > 0$ выполняется неравенство

$$\|A^n P_1\| \leq M_1 r^n, \quad n \in N. \quad (19)$$

(см. доказательство теоремы 5).

Согласно (13) выполняется неравенство

$$\|A^n P_2\| \geq M q^n - M_1 r^n, \quad n \in N, \quad m \geq p(n). \quad (20)$$

Учитывая оценки (19), (20), то что $q > r$, соотношение (18) и лемму 4, приходим к выводу, что

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \alpha(\text{sgn}\{A^n a_m: m \geq 1\}) = 0.$$

Это соотношение на основании леммы 1 противоречит (14).

Следовательно, предположение, что выполняется соотношение (15), ложно.

Теорема 6 доказана.

5. Достаточные условия существенной неустойчивости решений нелинейных разностных уравнений. Предположим, что разностное уравнение (1) принимает вид

$$x(n+1) = Ax(n) + G(n, x(n)), \quad n \geq 0, \quad (21)$$

где $G(n, \cdot): E \rightarrow E$, $n \geq 0$, — нелинейные операторы и $A \in L(E)$.

В теории таких уравнений важное место занимает вопрос о неустойчивости решений, когда $r(A) > 1$ и

$$\sup_{n \geq 0} \|G(n, x)\| = o(\|x\|) \quad \text{при } x \rightarrow 0. \quad (22)$$

В этом случае нулевое решение может быть как неустойчивым, так и асимптотически устойчивым [11–14].

С помощью существенно аппроксимативного спектра можно сравнительно легко получить условия неустойчивости нулевого решения уравнения (21) и в случае невыполнения соотношения (22).

Обозначим через $\mathcal{K}(E)$ идеал вполне непрерывных операторов $K \in L(E)$.

Теорема 7. Пусть:

$$1) r_{ess, \alpha}(A) > 1;$$

$$2) \|G(n, x)\| \leq \varphi(\|K_n x\|), \text{ если } n \geq 0, \|x\| \leq r,$$

где $r > 0$, $K_n \in \mathcal{K}(E)$, $n \geq 0$, и $\varphi(t)$ — определенная на $[0, +\infty)$ функция, для которой $\lim_{t \rightarrow 0} \varphi(t) = \varphi(0) = 0$.

Тогда нулевое решение уравнения (21) существенно неустойчиво.

Доказательство. Пусть λ — такая точка из $\sigma_{ess, \alpha}(A)$, что $|\lambda| > 1$, и ε — произвольное число из интервала $(0, r|\lambda|^{-1})$. Рассмотрим натуральное число $n(\varepsilon)$, для которого

$$\varepsilon |\lambda|^{n(\varepsilon)} \leq r < \varepsilon |\lambda|^{n(\varepsilon)+1}. \quad (23)$$

Согласно теореме 4 найдется существенно расходящаяся последовательность $\{y_m\}$ нормированных векторов $y_m \in E$, $m \geq 1$, такая, что

$$\lim_{m \rightarrow \infty} \|A y_m - \lambda y_m\| = 0 \quad (24)$$

и

$$\lim_{m \rightarrow \infty} \max_{0 \leq p \leq n(\varepsilon)} \varphi(\|K_p y_m\|) = 0. \quad (25)$$

Рассмотрим уравнение (21), где $x(0) = \varepsilon y_m$. Решение этого уравнения обозначим через $x(n, \varepsilon y_m)$. Заметим, что

$$x(1, \varepsilon y_m) = A \varepsilon y_m + G(0, \varepsilon y_m).$$

Согласно условию 2 теоремы и соотношению (25)

$$\lim_{m \rightarrow \infty} G(0, \varepsilon y_m) = 0,$$

а согласно (24)

$$\lim_{m \rightarrow \infty} \|A \varepsilon y_m - \lambda \varepsilon y_m\| = 0.$$

Поэтому

$$\lim_{m \rightarrow \infty} \|x(1, \varepsilon y_m) - \lambda \varepsilon y_m\| = 0.$$

Далее заметим, что если

$$\lim_{m \rightarrow \infty} \|x(p, \varepsilon y_m) - \lambda^p \varepsilon y_m\| = 0 \quad (26)$$

для некоторого натурального числа $p \geq 1$ и

$$|\lambda^p \varepsilon| < r, \quad (27)$$

то

$$\lim_{m \rightarrow \infty} \|x(p+1, \varepsilon y_m) - \lambda^{p+1} \varepsilon y_m\| = 0. \quad (28)$$

Действительно,

$$x(p+1, \varepsilon y_m) = A x(p, \varepsilon y_m) + G(p, x(p, \varepsilon y_m)).$$

Поскольку на основании (24), (26) и (25)

$$\lim_{m \rightarrow \infty} \|Ax(p, \varepsilon y_m) - \lambda^{p+1} \varepsilon y_m\| = 0,$$

$$\lim_{m \rightarrow \infty} \varphi(\|K_p x(p, \varepsilon y_m)\|) = 0$$

и для всех достаточно больших m

$$\|x(p+1, \varepsilon y_m) - \lambda^{p+1} \varepsilon y_m\| \leq \|Ax(p, \varepsilon y_m) - \lambda^{p+1} \varepsilon y_m\| +$$

$$+ \|G(p, x(p, \varepsilon y_m))\| \leq \|Ax(p, \varepsilon y_m) - \lambda^{p+1} \varepsilon y_m\| + \varphi(\|K_p x(p, \varepsilon y_m)\|),$$

то соотношения (26) и (27) обеспечивают выполнение соотношения (28).

Итак, согласно (23) и проведенным рассуждениям

$$\lim_{m \rightarrow \infty} \|x(p, \varepsilon y_m) - \lambda^p \varepsilon y_m\| = 0 \quad (29)$$

для всех $p = \overline{n(\varepsilon)}$. Отсюда следует неустойчивость нулевого решения уравнения (21). Действительно, согласно (29) найдется число m_0 такое, что

$$\|x(n(\varepsilon), \varepsilon y_{m_0}) - \lambda^{n(\varepsilon)} \varepsilon y_{m_0}\| < r|\lambda|^{-2}.$$

Тогда

$$\|x(n(\varepsilon), \varepsilon y_{m_0})\| > r|\lambda|^{-1} - r|\lambda|^{-2} = r(|\lambda| - 1)|\lambda|^{-2} > 0.$$

А так как число $\varepsilon \in (0, r|\lambda|^{-1})$ выбрано произвольным образом, то неустойчивость нулевого решения уравнения (21) доказана.

Из соотношения (29) на основании лемм 1 и 3 вытекает, что

$$\chi\{x(n(\varepsilon), \varepsilon y_m)\} = \chi\{y_m\} > 0$$

(это соотношение имеет место для всех $\varepsilon \in (0, r|\lambda|^{-1})$). Поэтому нулевое решение уравнения (21) существенно неустойчиво. Теорема 7 доказана.

Заметим, что операторы $G(n, \cdot)$, $n \geq 0$, удовлетворяющие условию 2 теоремы 7, могут не быть вполне непрерывными. Примером таких операторов являются операторы

$$G(n, x) = \gamma(\|K_n x\|) \operatorname{sgn} x, \quad n \geq 0,$$

где $\gamma: [0, +\infty) \rightarrow (-\infty, \infty)$ — непрерывное в точке 0 отображение, для которого $\gamma(0) = 0$, и $K_n \in \mathcal{K}(E)$, $n \geq 0$.

6. Применение теоремы 7 к дифференциально-разностным уравнениям.

Пусть $C(S, C)$ — пространство непрерывных на множестве S функций $x = x(s)$ со значениями в C , \mathcal{F} — множество функций $F = F(s) \in C(C, C)$, для каждой из которых $F(0) = 0$, $C^1[0, 1)$ — банахово пространство функций $z = z(s) \in C([0, 1), C)$, для которых $z'(s) \in C([0, 1), C)$, с нормой

$$\|z\|_{C^1} = \max\left\{\sup_{0 \leq s < 1} |z(s)|, \sup_{0 < s < 1} |z'(s)|, |z'(0)|\right\}$$

и \mathcal{D} — множество определенных на $[0, +\infty)$ функций $z = z(s)$ со значениями в C , сужение каждой из которых на $[1, +\infty)$ является элементом пространства $C([1, +\infty), C)$, а сужение функции $z_n = z(n+s)$ на $[0, 1)$ является элементом пространства $C^1[0, 1)$ для каждого $n \in \{0\} \cup \mathbb{N}$.

Рассмотрим дифференциально-разностное уравнение

$$x'(t) + ax'(t-1) + bx(t) + cx(t-1) = F \left(\int_{t-2}^{t-1} h(\tau)x(\tau)d\tau \right), \quad t \geq 2, \quad (30)$$

где $a, b, c \in C$, $F \in \mathcal{F}$ и $h \in C([0, +\infty), C)$. Здесь под $x'(t)$ при $t \in N$ понимается $x'(t+0) = \lim_{\delta \rightarrow +0} \delta^{-1}(x(t+\delta) - x(t))$.

Под решением уравнения (30) понимаем любую функцию $z = z(t) \in \mathcal{D}$, которая превращает это уравнение в тождество, если $x(t)$ заменить на $z(t)$.

Предположим, что в (30) коэффициенты a , b и c являются такими, что характеристическое уравнение

$$p(1 + ae^{-p}) + b + ce^{-p} = 0 \quad (31)$$

соответствующего линейного дифференциально-разностного уравнения

$$y'(t) + ay'(t-1) + by(t) + cy(t-1) = 0$$

имеет бесконечное число решений p_k , $k \in N$, для которых

$$\inf_{k \in N} \operatorname{Re} p_k > 0. \quad (32)$$

Тогда нулевое решение уравнения (30) при $F = 0$ неустойчиво, множество $\{p_k : k \in N\}$ не содержит конечных предельных точек [15, с.198] и найдется такое число $\gamma > 0$, что на множестве $\{p \in C : \operatorname{Re} p \geq \gamma\}$ уравнение (31) не имеет решений [16, с.446–453].

Заметим, что соотношение (32) выполняется, если, например, $a = -e$ [16, с.454]. Тогда $p_k = 1 + i2k\pi + o(1)$.

Покажем, что нельзя подобрать такие $F \in \mathcal{F}$ и $h \in C([0, +\infty), C)$, чтобы нулевое решение уравнения (30) было устойчивым.

Для доказательства этого утверждения каждому решению $x = x(t)$ уравнения (30) поставим в соответствие последовательность $\{x_n(s)\}_{n \geq 0}$ элементов пространства $C^1[0, 1)$, которые определены равенством

$$x_n(s) = x(n+s), \quad (33)$$

где $n \in \{0\} \cup N$ и $s \in [0, 1)$. Очевидно, что

$$x_n(0) = x_{n-1}(1-0), \quad n \in N \setminus \{1\}. \quad (34)$$

Тогда согласно (30)

$$\begin{aligned} x'_n(s) + ax'_{n-1}(s) + bx_n(s) + cx_{n-1}(s) &= \\ &= F \left(\int_0^s h(n-1+\tau)x_{n-1}(\tau)d\tau + \int_s^1 h(n-2+\tau)x_{n-2}(\tau)d\tau \right) \end{aligned}$$

для всех $n \geq 2$ и $s \in [0, 1)$. Отсюда на основании (34) получаем

$$\begin{aligned} x_n(s) - x_{n-1}(1-0) + a(x_{n-1}(s) - x_{n-1}(0)) + b \int_0^s x_n(\tau)d\tau + c \int_0^s x_{n-1}(\tau)d\tau &= \\ = \int_0^s F \left(\int_0^{s_1} h(n-1+\tau)x_{n-1}(\tau)d\tau + \int_{s_1}^1 h(n-2+\tau)x_{n-2}(\tau)d\tau \right) ds_1 \end{aligned} \quad (35)$$

для всех $n \geq 2$ и $s \in [0, 1)$.

Рассмотрим операторы $A_1, B_1 \in L(C^1[0, 1])$ и $G(n, \cdot, \cdot): C^1[0, 1] \times C^1[0, 1] \rightarrow C^1[0, 1]$, определенные равенствами

$$(A_1 x)(s) = x(1-0) - a(x(s) - x(0)) - c \int_0^s x(\tau) d\tau,$$

$$(B_1 x)(s) = b \int_0^s x(\tau) d\tau,$$

$$(G_1(n, x, y))(s) = \int_0^s F \left(\int_0^{s_1} h(n-1+\tau)x(\tau) d\tau + \int_{s_1}^1 h(n-2+\tau)y(\tau) d\tau \right) ds_1,$$

где $x, y \in C^1[0, 1]$. С помощью этих операторов разностное уравнение (35) можно представить в виде

$$(I + B_1)x_n = A_1 x_{n-1} + G_1(n, x_{n-1}, x_{n-2}), \quad n \geq 2, \quad (36)$$

где I — единичный оператор. Поскольку оператор B_1 является квазинильпотентным [7, с. 196], так как

$$|(B_1^m x)(s)| \leq \frac{s^m}{m!} \|x\|_{C^1}, \quad m \in N, \quad s \in [0, 1],$$

то оператор $I + B_1$ имеет непрерывный обратный $(I + B_1)^{-1}$. Следовательно, уравнение (36) можно представить в виде

$$x_n = (I + B_1)^{-1} A_1 x_{n-1} + (I + B_1)^{-1} G_1(n, x_{n-1}, x_{n-2}), \quad n \geq 2. \quad (37)$$

Определим операторы $A \in L(C^1[0, 1] \times C^1[0, 1])$ и $G(n, \cdot): C^1[0, 1] \times C^1[0, 1] \rightarrow C^1[0, 1] \times C^1[0, 1]$ равенствами

$$A(x, y) = ((I + B_1)^{-1} A_1 x, x),$$

$$G(n, (x, y)) = ((I + B_1)^{-1} G_1(n, x, y), 0),$$

где $x, y \in C^1[0, 1]$. Тогда согласно (37)

$$(x_n, x_{n-1}) = A(x_{n-1}, x_{n-2}) + G(n, (x_{n-1}, x_{n-2})), \quad n \geq 2. \quad (38)$$

Итак, если $x = x(t)$ — решение дифференциально-разностного уравнения (30), то последовательность $\{(x_n, x_{n-1})\}_{n \geq 1}$, где $x_n = x_n(s)$ и $x_{n-1} = x_{n-1}(s)$ — элементы пространства $C^1[0, 1]$, определенные равенством (33), удовлетворяет разностному уравнению (38). Наоборот, если последовательность $\{(x_n, x_{n-1})\}_{n \geq 1}$ удовлетворяет уравнению (38), т. е. последовательность $\{x_n\}_{n \geq 0}$ удовлетворяет уравнению (35), то функция $x = x(t)$, определенная равенством (33) при $n \geq 0$ и $s \in [0, 1]$, является решением уравнения (30).

К уравнению (38) применима теорема 7.

Действительно, $r_{\text{ess}, \alpha}(A) > 1$ на основании соотношения (32), включения $\{p_k: k \in N\} \subset \{p: \text{Re } p < \gamma\}$ и того, что для оператора A точки e^{pk} , $k \in N$, являются собственными значениями, а из соответствующей последовательности собственных векторов $(e^{pk s}, e^{pk(s-1)})$, $k \in N$, можно выделить существенно расходящуюся подпоследовательность (последнее можно осуществить, так как

$|\lim_{k \rightarrow \infty} \text{Im } p_k| = +\infty$). Следовательно, выполняется условие 1 теоремы 7, а также выполняется условие 2 этой же теоремы, поскольку

$$\|G(n, (x, y))\|_{C^1 \times C^1} \leq \| (I + B_1)^{-1} \|_{L(C^1)} \varphi \left(\sup_{0 \leq s < 1} \left| \int_0^s h(n-1+\tau)x(\tau) d\tau + \int_s^1 h(n-2+\tau)y(\tau) d\tau \right| \right)$$

для всех $x = x(s), y = y(s) \in C^1[0, 1]$, где $\varphi(t) = \max_{0 \leq x \leq t} |F(x)|$, и оператор $K_n: C^1[0, 1] \times C^1[0, 1] \rightarrow C^1[0, 1] \times C^1[0, 1]$, определенный равенством

$$(K_n(x, y))(s) = \left(\int_0^s h(n-1+\tau)x(\tau) d\tau + \int_s^1 h(n-2+\tau)y(\tau) d\tau, 0 \right)$$

является вполне непрерывным на основании теоремы Арцела [17, с. 106]. Поэтому согласно теореме 7 нулевое решение уравнения (38) существенно неустойчиво для произвольных $F \in \mathcal{F}$ и $h \in C([0, +\infty), C)$.

Следовательно, нельзя подобрать такие $F \in \mathcal{F}$ и $h \in C([0, +\infty), C)$, чтобы нулевое решение дифференциально-разностного уравнения (30) было устойчивым.

1. Слюсарчук В. Ю. Істотно нестійкі розв'язки різницевих рівнянь // Допов. НАН України. – 1996. – № 7. – С. 9–12.
2. Ахмеров Р. Р., Каменский М. И., Потапов А. С., Родкина А. Е., Садовский Б. Н. Меры некомпактности и уплотняющие операторы. – Новосибирск: Наука, 1986. – 266 с.
3. Клемент Ф., Хейманс Х., Ангенент С., ван Дуйн К., де Пахтер Б. Однопараметрические полугруппы. – М.: Мир, 1992. – 352 с.
4. Слюсарчук В. Е. Теоремы о неустойчивости систем по линейному приближению // Укр. мат. журн. – 1996. – 48, № 8. – С. 1104–1113.
5. Rakočević V. On the subset of M. Scheckter's essential spectrum // Mat. Vesnik. – 1981. – 5, № 4. – P. 389–391.
6. Rakočević V. On the essential approximate point spektrum. II // Ibid. – 1984. – 36, № 1. – P. 89–97.
7. Като Т. Теория возмущений линейных операторов. – М.: Мир, 1972. – 740 с.
8. Данфорд Н., Шварц Дж. Т. Линейные операторы. Спектральная теория. – М.: Мир, 1966. – Т. 2. – 1063 с.
9. Рид М., Саймон Б. Методы современной математической физики. Функциональный анализ. – М.: Мир, 1977. – Т. 1. – 358 с.
10. Еровенко В. А. Спектральные и фредгольмовы свойства линейных операторов в банаховых пространствах: Дис. ... д-ра физ.-мат. наук. – Минск, 1995. – 183 с.
11. Слюсарчук В. Е. Разностные уравнения в функциональных пространствах // Дополнение II монографии Д. И. Мартынюка „Лекции по качественной теории разностных уравнений”. – Киев: Наук. думка, 1972. – С. 197–222.
12. Слюсарчук В. Е. Новые теоремы о неустойчивости разностных систем по первому приближению // Дифференц. уравнения. – 1983. – 19, № 5. – С. 906–908.
13. Слюсарчук В. Е. К неустойчивости разностных уравнений по первому приближению // Там же. – 1986. – 22, № 4. – С. 722–723.
14. Слюсарчук В. Е. К неустойчивости автономных систем по линейному приближению // Асимптотические методы и их применение в задачах математической физики. – Киев: Ин-т математики АН УССР, 1990. – С. 112–114.
15. Маркушевич А. И. Краткий курс теории аналитических функций. – М.: Наука, 1966. – 388 с.
16. Беллман Р., Кук К. Дифференциально-разностные уравнения. – М.: Мир, 1967. – 548 с.
17. Колмогоров А. Н., Фомин С. В. Элементы теории функций и функционального анализа. – М.: Наука, 1968. – 496 с.

Получено 07.04.97,
после доработки – 14.04.99