

ПРО ОБМЕЖЕНІ РОЗВ'ЯЗКИ ОДНОГО РІЗНИЦЕВОГО РІВНЯННЯ ДРУГОГО ПОРЯДКУ

М. Ф. Городній, В. П. Кравець

Київ. нац. ун-т ім. Т. Шевченка

вул. Володимирська, 64, Київ, 01033, Україна

e-mail: gorodnii@univ.kiev.ua,

toriiawik@ukr.net

We study the problem of existence of a unique solution bounded on \mathbb{Z} of a linear second-order difference equation with a jump of the operator coefficient in a finite-dimensional Banach space.

Досліджується питання про існування єдиного обмеженого на \mathbb{Z} розв'язку лінійного різницевого рівняння зі стрибком операторного коефіцієнта у скінченновимірному банаховому просторі.

Нехай X — m -вимірний комплексний банахів простір з нормою $\|\cdot\|$ і нульовим елементом $\bar{0}$; I, O — одиничний та нульовий оператори в X ; A, B — фіксовані лінійні оператори в X .

Розглянемо різницеве рівняння

$$x_{n+1} - 2x_n + x_{n-1} = F_n x_n + y_n, \quad n \in \mathbb{Z}, \quad (1)$$

у якому $\{y_n, n \in \mathbb{Z}\}$ — задана, а $\{x_n, n \in \mathbb{Z}\}$ — шукана послідовності елементів простору X , $F_n = A$, $n \geq 1$, $F_n = B$, $n \leq 0$.

Мета цієї статті — отримати необхідні та достатні умови для операторів A, B , за яких виконується така умова.

Умова обмеженості. Для довільної обмеженої в X послідовності $\{y_n, n \in \mathbb{Z}\}$ рівняння (1) має єдиний обмежений розв'язок $\{x_n, n \in \mathbb{Z}\}$ у просторі X .

Аналогічне питання для різницевого рівняння першого порядку зі стрибком операторного коефіцієнта досліджено в [1]. Випадок, коли матриці операторів A, B зводяться до діагонального вигляду, розглянуто в [2]. Про різницеві рівняння другого порядку зі сталими операторними коефіцієнтами та їх застосування — див. [3, с. 17; 4] та наведені там посилання.

Допоміжні твердження. Покладемо

$$X^2 = \left\{ \bar{x} = \begin{pmatrix} x^{(1)} \\ x^{(2)} \end{pmatrix} \mid x^{(1)}, x^{(2)} \in X \right\}.$$

Тоді X^2 — $2m$ -вимірний комплексний банахів простір із покоординатним додаванням і множенням на скаляр та нормою

$$\|\bar{x}\|_* = \|x^{(1)}\| + \|x^{(2)}\|, \quad \bar{x} = \begin{pmatrix} x^{(1)} \\ x^{(2)} \end{pmatrix} \in X^2.$$

Якщо E, F, G, H — лінійні оператори в X , то, як і для випадку числових матриць,

$T = \begin{pmatrix} E & F \\ G & H \end{pmatrix}$ задає лінійний оператор в X^2 за правилом

$$T\bar{x} = \begin{pmatrix} Ex^{(1)} + Fx^{(2)} \\ Gx^{(1)} + Hx^{(2)} \end{pmatrix}, \quad \bar{x} = \begin{pmatrix} x^{(1)} \\ x^{(2)} \end{pmatrix} \in X^2.$$

Нехай

$$T_A = \begin{pmatrix} A + 2I & -I \\ I & O \end{pmatrix}, \quad T_B = \begin{pmatrix} B + 2I & -I \\ I & O \end{pmatrix},$$

$\sigma(T_A)$ — набір власних чисел оператора T_A , $S = \{z \in \mathbb{C} \mid |z| = 1\}$.

У подальшому використовуються такі твердження.

Лема 1. Для оператора T_A існує обернений оператор

$$T_A^{-1} = \begin{pmatrix} O & I \\ -I & A + 2I \end{pmatrix}.$$

Лема 2. Число $\lambda \neq 0$ є власним числом T_A , якому відповідає власний вектор $\begin{pmatrix} \lambda v \\ v \end{pmatrix}$, тоді і тільки тоді, коли $\lambda + \frac{1}{\lambda} - 2$ є власним числом A , якому відповідає власний вектор v .

Лема 3. Якщо $\lambda \in \sigma(T_A)$ і йому відповідає власний вектор $\begin{pmatrix} \lambda v \\ v \end{pmatrix}$, то $\lambda \neq 0$, $\frac{1}{\lambda} \in \sigma(T_A)$ і йому відповідає власний вектор $\begin{pmatrix} v \\ \lambda v \end{pmatrix}$.

Лема 4. $\sigma(T_A) \cap S = \emptyset$ тоді і тільки тоді, коли $\sigma(A) \cap [-4; 0] = \emptyset$.

Лема 5. Рівняння $\lambda + \frac{1}{\lambda} - 2 = \mu$ має при заданому $\mu \in \mathbb{C}$ два корені, один із яких лежить усередині кола S , а інший зовні S , тоді і тільки тоді, коли $\mu \notin [-4; 0]$.

Доведення лем 1–5 тривіальні і тут не наводяться.

Лема 6. Якщо μ — власне число оператора A , якому відповідає клітина Жордана порядку p , і $\lambda + \frac{1}{\lambda} - 2 = \mu$, то власним числом λ , $\frac{1}{\lambda}$ оператора T_A відповідають клітини Жордана порядку, не меншого за p .

Доведення. Із умов леми випливає (див., наприклад [5] (§ 19)), що в X існує такий набір лінійно незалежних векторів e_1, e_2, \dots, e_p , що

$$(A - \mu I)e_1 = \bar{0}, \quad (A - \mu I)e_k = e_{k-1}, \quad 2 \leq k \leq p. \quad (2)$$

Внаслідок леми 2 $(T_A - \lambda E)\bar{v}_1 = \tilde{0}$, де E — одиничний оператор в X^2 ,

$$\tilde{0} = \begin{pmatrix} \bar{0} \\ \bar{0} \end{pmatrix}, \quad \bar{v}_1 = \begin{pmatrix} v_1^{(1)} \\ v_2^{(1)} \end{pmatrix},$$

$v_1^{(1)} = \lambda e_1$, $v_2^{(1)} = e_1$. Знайдемо такі вектори \bar{v}_k , $2 \leq k \leq p$, що

$$\forall 1 \leq k \leq p-1: (T_A - \lambda E)\bar{v}_{k+1} = \bar{v}_k. \quad (3)$$

Оскільки при фіксованому $1 \leq k \leq p-1$ рівність (3) покоординатно записується у вигляді

$$(A - \mu I)v_1^{(k+1)} = v_1^{(k)} - \frac{1}{\lambda} v_2^{(k)},$$

$$v_1^{(k+1)} - \lambda v_2^{(k+1)} = v_2^{(k)},$$

маємо

$$(A - \mu I)v_1^{(k+1)} = v_1^{(k)} - \frac{1}{\lambda^2} v_1^{(k)} + \frac{1}{\lambda^3} v_1^{(k-1)} - \dots + \frac{(-1)^k}{\lambda^{k+1}} v_1^{(1)}, \quad (4)$$

$$v_2^{(k+1)} = \frac{1}{\lambda} v_1^{(k+1)} - \frac{1}{\lambda^2} v_1^{(k)} + \dots + \frac{(-1)^k}{\lambda^{k+1}} v_1^{(1)}. \quad (5)$$

Зокрема, при $k = 1$ рівність (4) записується у вигляді

$$(A - \mu I)v_1^{(2)} = v_1^{(1)} - \frac{1}{\lambda^2} v_1^{(1)} = \left(1 - \frac{1}{\lambda^2}\right) \lambda e_1,$$

а отже, з урахуванням (2) можна покласти

$$v_1^{(2)} = \lambda \left(1 - \frac{1}{\lambda^2}\right) e_2. \quad (6)$$

При цьому з (5) матимемо

$$v_2^{(2)} = \frac{1}{\lambda} v_1^{(2)} - \frac{1}{\lambda^2} v_1^{(1)} = \left(1 - \frac{1}{\lambda^2}\right) e_2 - \frac{1}{\lambda} e_1. \quad (7)$$

Отже, шуканий вектор \bar{v}_2 існує, і його координати є лінійними комбінаціями векторів e_1, e_2 .

Оскільки при фіксованому $2 \leq k \leq p-1$ у правій частині (4) матимемо лінійну комбінацію векторів e_1, e_2, \dots, e_k , вектори \bar{v}_{k+1} послідовно визначаються за допомогою співвідношень (4), (5) для $k = 3, 4, \dots, p-1$. Тому внаслідок рівностей (3) оператор T_A має клітину Жордана порядку, не меншого за p .

Відзначимо, що внаслідок співвідношень (4)–(7) для всіх допустимих k

$$v_2^{(k+1)} = \left(1 - \frac{1}{\lambda^2}\right)^k e_{k+1} + h_k(\lambda; e_1, e_2, \dots, e_k), \quad (8)$$

де $h_k(\lambda; e_1, e_2, \dots, e_k)$ — деяка лінійна комбінація базисних векторів e_1, e_2, \dots, e_k .

Щодо власного числа $\frac{1}{\lambda}$ міркування аналогічні.

Лему 6 доведено.

Позначимо через $J(\mu, p)$ клітину Жордана порядку p з числом μ на головній діагоналі.

Лема 7. Нехай $\sigma(A) \cap [-4; 0] = \emptyset$. Тоді кожній клітині Жордана $J(\mu, p)$ матриці оператора A відповідають дві клітини Жордана $J(\lambda, p)$, $J\left(\frac{1}{\lambda}, p\right)$ матриці оператора T_A , де

$$\mu = \lambda + \frac{1}{\lambda} - 2.$$

Доведення. З лем 2, 3, 6 випливає, що коли матриця оператора A має клітину Жордана $J(\mu, p)$ і $\mu = \lambda + \frac{1}{\lambda} - 2$, то матриця оператора T_A має клітини Жордана $J(\lambda, q_1)$, $J\left(\frac{1}{\lambda}, q_2\right)$, де $q_1 \geq p$, $q_2 \geq p$. Якщо, від супротивного, для деякої $J(\mu, p)$ $q_1 > p$ або $q_2 > p$, то внаслідок скінченновимірності простору X твердження лем 6 не може виконуватися для кожної з клітин Жордана матриці оператора T_A .

Лему 7 доведено.

Наслідок 1. Якщо $\sigma(A) \cap [-4; 0] = \emptyset$, то підпростори $X_-^2(A)$, $X_+^2(A)$ мають розмірності m , а також жорданова нормальна форма матриці оператора T_A містить пари клітин Жордана, вказаних у лемі 7.

Лема 8. Для того щоб умова обмеженості виконувалася для рівняння (1), необхідно і достатньо, щоб ця умова виконувалася у просторі X^2 для різницевого рівняння

$$\bar{x}_{n+1} = G_n \bar{x}_n + \bar{y}_n, \quad n \in \mathbb{Z}, \quad (9)$$

в якому $G_n = T_A$, $n \geq 1$, $G_n = T_B$, $n \leq 0$.

Доведення леми 8 стандартне, і у даній статті не наводиться.

Нехай T — такий лінійний оператор в X^2 , що $\sigma(T) \cap S = \emptyset$. Визначимо простори $X_-^2(T)$, $X_+^2(T)$ за таким правилом. Якщо $\sigma(T)$ лежить усередині кола S , то $X_-^2(T) = X^2$, $X_+^2(T) = \{\bar{0}\}$. Якщо $\sigma(T)$ лежить зовні S , то $X_-^2(T) = \{\bar{0}\}$, $X_+^2(T) = X^2$. Якщо ж $\sigma(T)$ має непорожні перетини з множинами $S_- = \{z \in \mathbb{C} \mid |z| < 1\}$ і $S_+ = \{z \in \mathbb{C} \mid |z| > 1\}$, то зафіксуємо такий базис $\bar{e}_1, \bar{e}_2, \dots, \bar{e}_k, \bar{f}_{k+1}, \bar{f}_{k+2}, \dots, \bar{f}_{2m}$ у просторі X^2 , в якому матриця оператора T має жорданову нормальну форму, причому $\bar{e}_1, \bar{e}_2, \dots, \bar{e}_k$ відповідають клітини Жордана з власними числами із S_- , а $\bar{f}_{k+1}, \bar{f}_{k+2}, \dots, \bar{f}_{2m}$ — клітини Жордана з власними числами із S_+ . Тоді $X_-^2(T)$, $X_+^2(T)$ — лінійні оболонки векторів $\bar{e}_1, \bar{e}_2, \dots, \bar{e}_k$ та $\bar{f}_{k+1}, \bar{f}_{k+2}, \dots, \bar{f}_{2m}$ відповідно.

Внаслідок теореми 1 роботи [1] справджується таке твердження.

Теорема 1. Для різницевого рівняння (9) умова обмеженості виконується тоді і тільки тоді, коли виконуються такі умови:

(i) $\sigma(T_A) \cap S = \emptyset$, $\sigma(T_B) \cap S = \emptyset$;

(ii) $X^2 = X_-^2(T_A) + X_+^2(T_B)$, тобто X^2 є прямою сумою $X_-^2(T_A)$ та $X_+^2(T_B)$.

Основний результат. Перевірка умови (ii) теореми 1 є нетривіальною задачею, розв'язання якої потребує, взагалі кажучи, громіздких обчислень. Наступна теорема, яка є основним результатом цієї статті, містить достатні умови на оператори A , B , при виконанні яких справджується імплікація (i) \Rightarrow (ii) для умов теореми 1.

Теорема 2. Нехай виконується умова (i) теореми 1, а також матриці операторів A , B мають жорданову нормальну форму в одному і тому ж базисі e_1, e_2, \dots, e_m (тут також суттєвий однаковий порядок базисних векторів для A і B). Тоді виконується умова (ii) теореми 1.

Доведення. Розглянемо випадок, коли матриця оператора A має дві клітини Жордана порядків p_1 , p_2 , $p_1 + p_2 = m$, а матриця B — три клітини порядків q_1 , $q_2 = 1$, q_3 , $q_1 + 1 + q_3 = m$, причому $p_1 > q_1 + 1$. У загальному випадку міркування аналогічні.

Нехай μ_1 , μ_2 та z_1 , z_2 , z_3 — власні числа операторів A , B , які відповідають їхнім клітинам Жордана. Тоді

$$\begin{aligned} (A - \mu_1 I)e_1 &= \bar{0}, & (A - \mu_1 I)e_k &= e_{k-1}, & 2 \leq k \leq p_1; \\ (A - \mu_2 I)e_{p_1+1} &= \bar{0}, & (A - \mu_2 I)e_k &= e_{k-1}, & p_1 + 2 \leq k \leq m; \\ (B - z_1 I)e_1 &= \bar{0}, & (B - z_1 I)e_k &= e_{k-1}, & 2 \leq k \leq q_1; \\ & & (B - z_2 I)e_{q_1+1} &= \bar{0}; \\ (B - z_3 I)e_{q_1+2} &= \bar{0}, & (B - z_3 I)e_k &= e_{k-1}, & q_1 + 3 \leq k \leq m. \end{aligned}$$

Зафіксуємо такі числа λ_k , $k = 1, 2$, ν_k , $k = 1, 2, 3$, що для кожного k $|\lambda_k| < 1$, $\mu_k = \lambda_k + \frac{1}{\lambda_k} - 2$, $|\nu_k| < 1$, $z_k = \nu_k + \frac{1}{\nu_k} - 2$.

Скористаємося лемами 6, 7 і виберемо в X^2 вектори $\bar{v}_1 = \bar{v}_1(e_1), \dots, \bar{v}_{p_1} = \bar{v}_{p_1}(e_1)$, $\bar{v}_{p_1+1} = \bar{v}_{p_1+1}(e_{p_1+1}), \dots, \bar{v}_{p_1+p_2} = \bar{v}_{p_1+p_2}(e_{p_1+1})$, які задають клітини Жордана оператора

T_A , що відповідають власним числам λ_1, λ_2 і будуються за формулами (4), (5) за власним вектором e_1 і приєднаними векторами e_2, \dots, e_{p_1} та власним вектором e_{p_1+1} і приєднаними векторами $e_{p_1+2}, \dots, e_{p_1+p_2}$ оператора A , а також вектори $\bar{w}_1 = \bar{w}_1(e_1), \dots, \bar{w}_{q_1} = \bar{w}_{q_1}(e_1), \bar{w}_{q_1+1} = \bar{w}_{q_1+1}(e_{q_1+1}), \bar{w}_{q_1+2} = \bar{w}_{q_1+2}(e_{q_1+2}), \dots, \bar{w}_{q_1+1+q_3} = \bar{w}_{q_1+1+q_3}(e_{q_1+2})$, які аналогічно задають клітини Жордана оператора T_B , що відповідають власним числам $\frac{1}{\nu_1}, \frac{1}{\nu_2}, \frac{1}{\nu_3}$.

Внаслідок леми 7 простори $X_-^2(T_A), X_+^2(T_B)$, m -вимірні і є лінійними оболонками векторів $\bar{v}_1, \dots, \bar{v}_{p_1+p_2}$ і $\bar{w}_1, \dots, \bar{w}_{q_1+1+q_3}$ відповідно.

Отже, для виконання умови (ii) теореми 1 досить перевірити, що рівність

$$\begin{aligned} \sum_{k=1}^{p_1} \delta_k \bar{v}_k(e_1) + \sum_{k=p_1+1}^m \delta_k \bar{v}_k(e_{p_1+1}) = \\ = \sum_{k=1}^{q_1} \sigma_k \bar{w}_k(e_1) + \sigma_{q_1+1} \bar{w}_{q_1+1}(e_{q_1+1}) + \sum_{k=q_1+2}^m \sigma_k \bar{w}_k(e_{q_1+2}) \end{aligned} \quad (10)$$

виконується тільки при $\delta_1 = \dots = \delta_m = \sigma_1 = \dots = \sigma_m = 0$.

Відзначимо, що для довільних $i = 1, 2, j = 1, 2, 3$

$$T_A - \lambda_i E = T_B - \frac{1}{\nu_j} E + \begin{pmatrix} A - B + T_{i,j} & 0 \\ 0 & T_{i,j} \end{pmatrix}, \quad (11)$$

де $T_{i,j} = \left(\frac{1}{\nu_j} - \lambda_i \right) I$. Подіємо на (10) оператором $(T_A - \lambda_2 E)$. З урахуванням (11) і властивостей приєднаних векторів для других координат отриманої рівності буде виконуватися співвідношення

$$\begin{aligned} \delta_1 (\lambda_1 - \lambda_2) v_2^{(1)}(e_1) + \sum_{k=2}^{p_1} \delta_k \left(v_2^{(k-1)}(e_1) + (\lambda_1 - \lambda_2) v_2^{(k)}(e_1) \right) + \sum_{k=p_1+2}^m \delta_k v_2^{(k-1)}(e_{p_1+1}) = \\ = \sigma_1 \left(\frac{1}{\nu_1} - \lambda_2 \right) w_2^{(1)}(e_1) + \sum_{k=2}^{q_1} \sigma_k \left(w_2^{(k-1)}(e_1) + \left(\frac{1}{\nu_1} - \lambda_2 \right) w_2^{(k)}(e_1) \right) + \\ + \sigma_{q_1+1} \left(\frac{1}{\nu_2} - \lambda_2 \right) w_2^{(q_1+1)}(e_{q_1+1}) + \sigma_{q_1+2} \left(\frac{1}{\nu_3} - \lambda_2 \right) w_2^{(q_1+2)}(e_{q_1+2}) + \\ + \sum_{k=q_2+3}^m \sigma_k \left(w_2^{(k-1)}(e_{q_1+2}) + \left(\frac{1}{\nu_3} - \lambda_2 \right) w_2^{(k)}(e_{q_1+2}) \right). \end{aligned} \quad (12)$$

Внаслідок (8) у рівності (12) вектор e_m зустрічається тільки у виразі для $w_2^{(m)}(e_{q_1+2})$.

Отже, з лінійної незалежності e_1, e_2, \dots, e_m випливає, що $\sigma_m = 0$. Після цього, повернувшись до (10), робимо висновок, що й $\delta_m = 0$.

Таким чином, в обох частинах (10) залишаються суми $m - 1$ доданків. Далі міркуємо аналогічно. Подіями на (10) спочатку p_2 разів оператором $T_A - \lambda_2 E$, а потім p_1 разів оператором $T_A - \lambda_1 E$, послідовно отримуємо $\sigma_m = \delta_m = 0, \sigma_{m-1} = \delta_{m-1} = 0, \dots, \sigma_1 = \delta_1 = 0$.

Теорему 2 доведено.

Наступний приклад показує, що коли матриці операторів A, B мають жорданову нормальну форму в одному й тому ж базисі, але з різним порядком базисних векторів, то твердження теореми 2 може не виконуватися.

Приклад 1. Нехай $X = \mathbb{C}^2$, $e_1 = \begin{pmatrix} 1 \\ 0 \end{pmatrix}$, $e_2 = \begin{pmatrix} 0 \\ 1 \end{pmatrix}$. Розглянемо такі оператори A , B , що $(A - \mu I)e_1 = \bar{0}$, $(A - \mu I)e_2 = e_1$, $(B - zI)e_2 = \bar{0}$, $(B - zI)e_1 = e_2$ для деяких μ, z з множини $\mathbb{R} \setminus [0, 4]$. Нехай λ, ν — такі числа, що $|\lambda| < 1$, $|\nu| < 1$, $\mu = \lambda + \frac{1}{\lambda} - 2$, $z = \nu + \frac{1}{\nu} - 2$. Тоді, з урахуванням співвідношень (6), (7), $X_-^2(T_A)$, $X_+^2(T_B)$ є відповідно лінійними оболонками

$$\text{векторів } \begin{pmatrix} \lambda \\ 0 \\ 1 \\ 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 \\ \lambda \left(1 - \frac{1}{\lambda^2}\right) \\ -\frac{1}{\lambda} \\ 1 - \frac{1}{\lambda^2} \end{pmatrix} \text{ та } \begin{pmatrix} 0 \\ \frac{1}{\nu} \\ 0 \\ 1 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} \frac{1}{\nu} (1 - \nu^2) \\ 0 \\ 1 - \nu^2 \\ -\nu \end{pmatrix}.$$

Перевіримо, що при деяких λ, μ , які задовольняють вказані вище умови, ці чотири вектори лінійно залежні, а отже, умова (ii) не виконується. Справді,

$$\begin{vmatrix} \lambda & 0 & 0 & \frac{1}{\nu} (1 - \nu^2) \\ 0 & \lambda \left(1 - \frac{1}{\lambda^2}\right) & \frac{1}{\nu} & 0 \\ 1 & -\frac{1}{\lambda} & 0 & 1 - \nu^2 \\ 0 & 1 - \frac{1}{\lambda^2} & 1 & -\nu \end{vmatrix} = -1 - \left(\lambda - \frac{1}{\nu}\right)^2 \left(1 - \frac{1}{\lambda^2}\right) (1 - \nu^2).$$

Покладемо $\nu = \frac{1}{3}$ і розглянемо функцію $F: (0; 1] \rightarrow \mathbb{R}$, яка діє за правилом $F(\lambda) = -1 - \frac{8}{9}(\lambda - 3)^2 \left(1 - \frac{1}{\lambda^2}\right)$. Оскільки функція F неперервна на $(0; 1]$, $F(1) = -1$, $\lim_{\lambda \rightarrow 0^+} F(\lambda) = +\infty$, знайдеться таке $\lambda_0 \in (0, 1)$, що $F(\lambda_0) = 0$. Тому при $\nu = \frac{1}{3}$, $\lambda = \lambda_0$ умова (ii) не виконується.

Література

1. *Городній М. Ф., Гончар І. В.* Про обмежені розв'язки різницевого рівняння зі змінним операторним коефіцієнтом // Доп. НАН України. – 2016. – № 12. – С. 12–16.
2. *Городній М. Ф., Кравець В. П.* Обмежені розв'язки різницевого рівняння другого порядку зі стрибком операторного коефіцієнта // Доп. НАН України. – 2019. – № 2. – С. 12–16.
3. *Дороговцев А. Я.* Периодические и стационарные режимы бесконечномерных детерминированных и стохастических динамических систем. – Київ: Вища шк., 1992. – 319 с.
4. *Кабанцова Л. Ю.* Линейные разностные уравнения второго порядка в банаховом пространстве и расщепление операторов // Изв. Саратов. ун-та. Нов. сер. Сер. Математика. Механика. Информатика. – 2017. – 17, вып. 3. – С. 285–293.
5. *Гельфанд И. М.* Лекции по линейной алгебре. – М.: Наука, 1971. – 272 с.

Одержано 26.03.2019