

НАИЛУЧШЕЕ ПРИБЛИЖЕНИЕ ЛИНЕЙНЫХ ОПЕРАТОРОВ^{*)}

1. Постановка задачи. Пусть X и Y — банаховы пространства, U — линейный (вообще говоря, неограниченный) оператор из X в Y с областью определения $D_U \subset X$ и K — некоторый класс элементов из X , содержащийся в D_U .

Многие задачи теории приближений сводятся к изучению уклонения U от фиксированного (как правило, ограниченного) линейного оператора S из X в Y на заданном классе K , т.е. к исследованию величины

$$R(U, S; K) = \sup_{x \in K} \|Ux - Sx\|_Y. \quad (1)$$

Сюда относится, в частности, задача оценки погрешности различных формул численного дифференцирования для тех или иных классов функций K ; см., например, [1]. Полученные в этом направлении результаты показывают, что даже неограниченные операторы могут хорошо приближаться ограниченными операторами на достаточно узких и надлежащим образом нормированных классах K .

В настоящей работе рассматривается задача о наилучшем приближении оператора U всевозможными линейными операторами S с нормой, не превосходящей числа $N > 0$, на заданном классе K : найти

$$E_N(U; K) = \inf_{\|S\| \leq N} R(U, S; K) = \inf_{\|S\| \leq N} \sup_{x \in K} \|Ux - Sx\|_Y, \quad (2)$$

где $\|S\|$ есть норма S , как оператора из X в Y .

Эта задача нетривиальна лишь в том случае, если $\|U\| > N$ и существует линейный оператор S , $\|S\| \leq N$, для которого $R(U, S; K) < \infty$. Здесь возникает обычный для теории приближений вопрос исследования поведения наилучших приближений как функции от N , а также вопросы существования, единственности, характеристических свойств и построения наилучшего оператора S^* .

Один из наиболее важных частных случаев задачи (2) состоит в том, что класс K определяется при помощи некоторого линейного оператора. Пусть Z есть банахово пространство и V — линейный (вообще говоря, неограниченный) оператор из X в Z с областью определения $D_V \subset X$ и притом такой, что $D_V \subset D_U$. Тогда полагаем

$$K = \{x \in X : \|Vx\|_Z \leq 1\}$$

и вместо $E_N(U; K)$ будем писать

$$E_N(U, V) = \inf_{\|S\| \leq N} \sup_{\|Vx\|_Z \leq 1} \|Ux - Sx\|_Y. \quad (3)$$

Ясно, что если для оператора S

$$\sup_{\|Vx\| \leq 1} \|Ux - Sx\| < \infty,$$

то $Sx = Ux$ для всех $x \in D_V$, для которых Vx обращается в нуль, т.е. S интерполирует U на ядре оператора V . В такой форме задача тесно связана с изучением свойств пары операторов (U, V) , в частности с неравенствами между нормами производных (см. [2]).

^{*)} Матем. заметки. 1967. Т. 1, вып. 2. С. 137–148.

Некоторые результаты этой работы докладывались на Всесоюзной конференции по вычислительной математике в Москве в январе 1965 г., а также формулировались в сообщении В.В. Арестова на Международном конгрессе математиков в Москве (см. [3]).

2. Оценка $E_n(U; K)$ снизу. Положим

$$\Phi(M) = \Phi(M; U; K) = \sup_{\substack{x \in K \\ \|x\| \leq M}} \|Ux\| \quad (M \geq 0). \quad (4)$$

Эта характеристика тесно связана с наилучшими приближениями $E_N(U; K)$. Покажем, что $E_N(U; K)$ можно оценить снизу через функцию $\Phi(M)$.

Имеем для любого $N \geq 0$

$$\begin{aligned} E_N(U; K) &= \inf_{\|S\| \leq N} \sup_{x \in K} \|Ux - Sx\| \geq \\ &\geq \inf_{\|S\| \leq N} \sup_{x \in K} \{\|Ux\| - \|Sx\|\} \geq \sup_{x \in K} \{\|Ux\| - N\|x\|\}. \end{aligned}$$

Поэтому для любых $M \geq 0$ и $N \geq 0$

$$E_N(U; K) \geq \sup_{\substack{x \in K \\ \|x\| \leq M}} \{\|Ux\| - N\|x\|\} \geq \Phi(M) - NM. \quad (5)$$

Отсюда вытекает, что

$$E_N(U; K) \geq \sup_{M \geq 0} \{\Phi(M) - NM\}, \quad (6)$$

$$\Phi(M) \leq \inf_{N \geq 0} \{E_N(U; K) + NM\}. \quad (7)$$

Пусть, в частности,

$$\Phi(u) \geq \varphi(u) \quad (u \geq 0),$$

где действительная функция $\varphi(u)$ определена и непрерывна на $[0, +\infty)$ и удовлетворяет условиям $\varphi(0) = 0$, $\varphi(u) \uparrow$, $\varphi'(u) \downarrow$. Тогда для любого $M \geq 0$ имеем

$$E_N(U; K) \geq \varphi(M) - NM.$$

Правая часть этого неравенства максимальна при $\varphi'(M) = N$. Отсюда следует, что

$$E_{\varphi'(M)}(U; K) \geq \varphi(M) - M\varphi'(M) \quad (M > 0). \quad (8)$$

В ряде случаев неравенство (5) на самом деле обращается в равенство. Например, это имеет место, если найдутся элемент $x^* \in K$ и линейный оператор S^* такие, что

$$\begin{aligned} \|x^*\| &= M, \quad \|Ux^*\| = \Phi(M), \quad \|S^*\| = N (= \Phi'(M)), \\ \|S^*x^*\| &= NM, \quad \|Ux^* - S^*x^*\| = \Phi(M) - NM. \end{aligned} \quad (9)$$

В излагаемых ниже примерах наилучший оператор S^* был найден исходя из этих условий.

Пусть

$$\varphi(u) = C u^{\alpha/(1+\alpha)} \quad (\alpha > 0).$$

Проведя элементарный подсчет, убеждаемся, что

$$\Phi(M) \geq C M^{\alpha/(1+\alpha)} \quad (M > 0) \Rightarrow E_N(U; K) \geq B N^{-\alpha} \quad (N > 0), \quad (10)$$

$$E_N(U; K) = B N^{-\alpha} \quad (N > 0) \Rightarrow \Phi(M) \leq C M^{\alpha/(1+\alpha)} \quad (M > 0), \quad (11)$$

где B и C связаны соотношением

$$B = \frac{\alpha^\alpha}{(1+\alpha)^{1+\alpha}} C^{1+\alpha}. \quad (12)$$

3. Простейший пример. Пусть X есть пространство непрерывных функций $C[-a, a]$ ($0 < a \leq \infty$), Y — числовая прямая, $\omega(\delta)$ ($0 \leq \delta < 2a$) — вогнутый модуль непрерывности, $H[\omega]$ — класс непрерывных функций, для которых $\omega(\delta, x) \leq \omega(\delta)$ ($0 \leq \delta < 2a$),

$$K = C[-a, a] \cap H[\omega],$$

U — линейный (вообще говоря, неограниченный) функционал вида

$$Ux = \int_0^a (x(t) - x(-t)) f(t) dt, \quad (13)$$

где $f(t) \geq 0$ ($0 \leq t < a$) и для любого $h \in (0, a)$

$$\int_0^h \omega(2t) f(t) dt < \infty \quad \text{и} \quad \int_h^a f(t) dt < \infty. \quad (14)$$

ТЕОРЕМА 1. *Справедливо равенство*

$$E_N(U; K) = \int_0^h \omega(2t) f(t) dt, \quad (15)$$

где

$$N = 2 \int_h^a f(t) dt \quad (0 < h < a). \quad (16)$$

Доказательство. Положим $2M = \omega(2h)$ и подсчитаем $\Phi(M)$. Имеем

$$\begin{aligned} \Phi(M) &\leq \sup_{\|x\| \leq M} \int_h^a (x(t) - x(-t)) f(t) dt + \sup_{x \in H[\omega]} \int_0^h (x(t) - x(-t)) f(t) dt \leq \\ &\leq \omega(2h) \int_h^a f(t) dt + \int_0^h \omega(2t) f(t) dt. \end{aligned}$$

Так как соответствующая экстремальная функция

$$\begin{aligned} x(t) &= \omega(2t)/2 \quad (0 \leq t \leq h), \\ x(t) &= \omega(2h)/2 \quad (h \leq t \leq a), \\ x(-t) &= -x(t) \end{aligned}$$

принадлежит классу $H[\omega]$ и удовлетворяет условию $\|x\| = M$, то

$$\Phi(M) = \int_0^h \omega(2t) f(t) dt + \omega(2h) \int_h^a f(t) dt.$$

Далее, положим

$$N = 2 \int_h^a f(t) dt$$

и оценим $E_N(U; K)$ снизу. Имеем в силу (5)

$$E_N(U; K) \geq \Phi(M) - NM = \int_0^h \omega(2t) f(t) dt. \quad (17)$$

Переходим к оценке $E_N(U; K)$ сверху. Для этого положим

$$S^* x = \int_h^a (x(t) - x(-t)) f(t) dt.$$

Имеем

$$\begin{aligned} \|S^*\| &= 2 \int_h^a f(t) dt = N, \\ Ux - S^* x &= \int_0^h (x(t) - x(-t)) f(t) dt, \\ \sup_{x \in H[\omega]} |Ux - S^* x| &= \int_0^h \omega(2t) f(t) dt, \end{aligned}$$

откуда

$$E_N(U; K) \leq \int_0^h \omega(2t) f(t) dt. \quad (18)$$

Сопоставляя (17) и (18), выводим (15) для

$$N = 2 \int_h^a f(t) dt,$$

и теорема доказана.

Из доказательства видно, что эта теорема остается справедливой и в том случае, когда под K понимается весь класс $H[\omega]$.

4. Наилучшее приближение операторов дифференцирования. Пусть I есть действительная прямая или полупрямая $[0, +\infty)$, $X = Y = C(I)$ — пространство непрерывных функций, определенных на I , K_n — класс функций, для которых $(n-1)$ -я производная $x^{(n-1)}(t)$ имеет производные числа, не превосходящие 1, и $U = D^k$ — оператор дифференцирования k -го порядка ($1 \leq k < n$).

Рассмотрим следующий частный случай задачи (3): найти

$$E_N(k, n)_{C(I)} = \inf_{\|S\| \leq N} \sup_{\substack{x \in X \\ x \in K_n}} \|x^{(k)} - Sx\|_{C(I)} \quad (1 \leq k < n; N > 0). \quad (19)$$

Наряду с этой задачей естественно рассмотреть задачу о нахождении величины

$$E_N(D^k; K_n)_{C(I)} = \inf_{\|S\| \leq N} \sup_{x \in K_n} \|x^{(k)} - Sx\|_{C(I)}, \quad (20)$$

где S — линейный оператор, определенный на объединении $C(I)$ и K_n и ограниченный как оператор из $C(I)$ в $C(I)$. Ясно, что

$$E_N(k, n)_{C(I)} \leq E_N(D^k; K_n)_{C(I)}. \quad (21)$$

Во всех случаях, когда сосчитаны обе эти характеристики, они совпадают.

ТЕОРЕМА 2. Для любых $k = 1, 2, \dots, n-1; n = 2, 3, \dots$ справедливы равенства

$$\begin{aligned} E_N(k, n)_{C(I)} &= C_{k,n}(I) N^{-(n-k)/k}, \\ E_N(D^k; K_n)_{C(I)} &= C'_{k,n}(I) N^{-(n-k)/k} \quad (N > 0). \end{aligned} \quad (22)$$

Доказательство. Воспользуемся тем, что класс K_n переходит в себя при

замене $x(t)$ на $r^{-n} x(rt)$, а норма не меняется при замене t на $rt = u$. Получаем

$$\begin{aligned} \sup_{x \in K_n} \|x^{(k)}(t) - Sx(t)\| &= \sup_{x \in K_n} \|r^{k-n} x^{(k)}(rt) - r^{-n} Sx(rt)\| = \\ &= r^{k-n} \sup_{x \in K_n} \|x^{(k)}(rt) - r^{-k} Sx(rt)\| = r^{k-n} \sup_{x \in K_n} \|x^{(k)}(u) - r^{-k} S_1 x(u)\|, \end{aligned}$$

и если S пробегает всевозможные линейные операторы с нормой $\leq N$, то и S_1 пробегает все такие операторы. Поэтому

$$\begin{aligned} E_N(D^k; K_n)_{C(I)} &= \inf_{\|S\| \leq N} \sup_{x \in K_n} \|x^{(k)}(t) - Sx(t)\| = \\ &= r^{k-n} \inf_{\|S_1\| \leq N} \sup_{x \in K_n} \|x^{(k)}(u) - r^{-k} S_1 x(u)\| = \\ &= r^{k-n} \inf_{\|S_2\| \leq r^{-k} N} \sup_{x \in K_n} \|x^{(k)}(u) - S_2 x(u)\| = r^{k-n} E_{r^{-k} N}(D^k; K_n)_{C(I)}. \end{aligned}$$

Таким образом,

$$E_N(D^k; K_n)_{C(I)} = r^{k-n} E_{r^{-k} N}(D^k; K_n)_{C(I)},$$

откуда, полагая $r^k = N$, получаем

$$E_N(D^k; K_n)_{C(I)} = C'_{k,n}(I) N^{-(n-k)/k} \quad (N > 0).$$

В точности так же устанавливается, что

$$E_N(k, n)_{C(I)} = C_{k,n}(I) N^{-(n-k)/k} \quad (N > 0),$$

и теорема доказана.

Отметим, что аналогичное предложение справедливо для пространств $L_p(I)$ ($p \geq 1$), а также для классов $K_{n-1+\alpha}$, характеризующихся тем, что

$$\|x^{(n-1)}(t+h) - x^{(n-1)}(t)\| \leq h^\alpha \quad (0 < \alpha \leq 1, h \geq 0).$$

Доказательство не меняется.

Теорема 2 ничего не говорит о значениях констант $C_{n,k}(I)$. В общем случае для них могут быть получены оценки снизу. А.Н. Колмогоров [4] доказал, что

$$\Phi(M; D^k; K_n)_{C(-\infty, +\infty)} = \sup_{\|x\| \leq M, \|x^{(n)}\| \leq 1} \|x^{(k)}\|_{C(-\infty, +\infty)} = K_{k,n} M^{(n-k)/n}, \quad (23)$$

и нашел значения соответствующих констант $K_{k,n}$ для всех $k = 1, 2, \dots, n-1$ и всех $n = 2, 3, \dots$. Отсюда и из (10) непосредственно вытекает, что

$$C_{k,n}^k(-\infty, +\infty) \geq \left(\frac{k}{n}\right)^k \left(1 - \frac{k}{n}\right)^{n-k} K_{k,n}^n. \quad (24)$$

В частности,

$$C_{1,2}(-\infty, +\infty) \geq 1/2, \quad C_{1,3}(-\infty, +\infty) \geq 1/6, \quad C_{2,3}(-\infty, +\infty) \geq 2/3. \quad (25)$$

Я предполагаю, что неравенство (24) всегда обращается в равенство.

Далее, очевидно, всегда

$$C_{k,n}[0, +\infty) \geq C_{k,n}(-\infty, +\infty).$$

Кроме того, как известно (см. [2]),

$$\begin{aligned} \Phi(M; D; K_2)_{C[0, +\infty)} &\geq 2M, \\ \Phi(M; D; K_3)_{C[0, +\infty)} &\geq 3^{5/3} M^{2/3}/2, \\ \Phi(M; D^2; K_3)_{C[0, +\infty)} &\geq 2 \cdot 3^{1/3} M^{1/3}, \end{aligned}$$

откуда, как и выше,

$$C_{1,2}[0, +\infty) \geq 1, \quad C_{1,3}[0, +\infty) \geq 9/2, \quad C_{2,3}[0, +\infty) \geq 4\sqrt{2}/3. \quad (26)$$

Для оценки $C'_{k,n}(I)$ сверху следует построить достаточно хороший приближающий оператор S . Например, полагая

$$Sx = S_{k,n}x = h^{-k} \sum_{k=0}^{n-1} a_k x(t + kh),$$

где коэффициенты подобраны так, чтобы

$$x^{(k)} - Sx = h^{-k} \int_0^{nh} \varkappa(u, h) x^{(n)}(t+u) du,$$

убеждаемся, что

$$C'_{k,n}(I) < \infty \quad (k = 1, 2, \dots, n-1; n = 2, 3, \dots).$$

Для $n = 2$ и $n = 3$ я нашел соответствующие наилучшие операторы $S^* = S_{k,n}^*(N; I)$. Все они имеют конечноразностный характер.

ТЕОРЕМА 3. Пусть $X = Y = C[0, +\infty)$, $\omega(\delta)$ ($0 \leq \delta < \infty$) — произвольный модуль непрерывности и $H'[\omega]$ — класс функций, для которых $\omega(\delta, x') \leq \omega(\delta)$ ($0 \leq \delta < \infty$). Тогда

$$E_N(D; H'[\omega])_{C[0, +\infty)} = \frac{N}{2} \int_0^{2/N} \omega(t) dt \quad (N > 0). \quad (27)$$

Доказательство. Положим

$$M = \frac{1}{2} \int_0^h (\omega(h) - \omega(t)) dt \quad (h > 0)$$

и рассмотрим функцию

$$\begin{aligned} x_0(t) &= \int_0^t (\omega(h) - \omega(u)) du - M \quad (0 \leq t \leq h), \\ x_0(t) &= M \quad (t \geq h). \end{aligned}$$

Для этой функции имеем

$$\begin{aligned} \|x_0\| &\leq M, \quad x'_0(t) = \omega(h) - \omega(t) \quad (0 \leq t \leq h), \\ x'_0(t) &= 0 \quad (t \geq h). \end{aligned}$$

Отсюда $x_0 \in H'[\omega]$ и $\|x'_0\| = \omega(h)$. Поэтому

$$\Phi(M; D; H'[\omega]) \geq \|x'_0\| = \omega(h). \quad (28)$$

Далее, положим $N = 2/h$ и воспользуемся неравенством (5). Учитывая оценку (28), выводим, что

$$\begin{aligned} E_N(D; H'[\omega])_{C[0, +\infty)} &\geq \omega(h) - \frac{1}{h} \int_0^h (\omega(h) - \omega(t)) dt = \\ &= \frac{1}{h} \int_0^h \omega(t) dt = \frac{N}{2} \int_0^{2/N} \omega(t) dt. \quad (29) \end{aligned}$$

С другой стороны, полагая

$$S^*x = \frac{1}{h}(x(t+h) - x(t)),$$

убеждаемся, что

$$\|S^*\| = \frac{2}{h} = N \quad \text{и} \quad x' - S^*x = \frac{1}{h} \int_0^h (x'(t) - x'(t+u)) du,$$

откуда

$$E_N(D; H'[\omega])_{C[0,+\infty)} \leq \sup_{x \in H'[\omega]} \|x' - S^*x\| \leq \frac{1}{h} \int_0^h \omega(t) dt = \frac{N}{2} \int_0^{2/N} \omega(t) dt. \quad (30)$$

Сравнивая (29) и (30), находим, что

$$E_N(D; H'[\omega])_{C[0,+\infty)} = \frac{N}{2} \int_0^{2/N} \omega(t) dt \quad (N > 0),$$

и теорема доказана.

СЛЕДСТВИЕ. При тех же предположениях

$$\Phi\left(\frac{1}{2} \int_0^h (\omega(h) - \omega(u)) du\right) = \omega(h) \quad (h > 0). \quad (31)$$

В самом деле, оценка $\Phi(M)$ снизу дается неравенством (28), а оценка сверху вытекает из (5) и (29).

В частности, если $\omega(\delta) = \delta$, то класс $H'[\omega]$ обращается в класс K_2 . Поэтому справедливо равенство

$$E_N(D; K_2)_{C[0,+\infty)} = 1/N \quad (N > 0), \quad (32)$$

а отсюда с учетом (21) и (26) непосредственно следует, что

$$E_N(1, 2)_{C[0,+\infty)} = 1/N \quad (N > 0). \quad (33)$$

Совершенно аналогично в случае $X = Y = C(-\infty, +\infty)$, полагая

$$S^*x = \frac{1}{2h}(x(t+h) - x(t-h)),$$

убеждаемся, что

$$E_N(D; H'[\omega])_{C(-\infty,+\infty)} = N \int_0^{1/N} \omega(t) dt \quad (N > 0) \quad (34)$$

$$\Phi\left(\int_0^h (\omega(h) - \omega(u)) du\right) = \omega(h) \quad (h > 0). \quad (35)$$

В частности,

$$E_N(1, 2)_{C(-\infty,+\infty)} = E_N(D; K_2)_{C(-\infty,+\infty)} = 1/(2N) \quad (N > 0). \quad (36)$$

Для случая $n = 3$, $I = [0, +\infty)$ ограниченные операторы, наилучшим образом приближающие x' и x'' , имеют вид (см. [2])

$$S_{1,3}x = \frac{1}{6h}(-8x(t) + 9x(t+h) - x(t+3h)),$$

$$S_{2,3}x = \frac{1}{3h^2}(2x(t) - 3x(t+h) + x(t+3h)).$$

Они обладают следующими свойствами:

$$\|S_{1,3}\| = \frac{3}{h}, \quad \|x' - S_{1,3}x\| = \frac{1}{12h} \left\| 9 \int_0^h (h-u)^2 x'''(t+u) du - \int_0^{3h} (3h-u)^2 x'''(t+u) du \right\| \leq \frac{h^2}{2} \|x'''\|,$$

$$\|S_{2,3}\| = \frac{2}{h^2}, \quad \|x'' - S_{2,3}x\| = \frac{1}{6h^2} \left\| 3 \int_0^h (h-u)^2 x'''(t+u) du - \int_0^{3h} (3h-u)^2 x'''(t+u) du \right\| \leq \frac{4h}{3} \|x'''\|.$$

Отсюда

$$E_N(D; K_3)_{C[0,+\infty)} \leq \frac{9}{2N^2}, \quad E_N(D^2; K_3)_{C[0,+\infty)} \leq \frac{4\sqrt{2}}{3\sqrt{N}}.$$

Эти оценки в соединении с (26) показывают, что

$$E_N(1, 3)_{C[0,+\infty)} = E_N(D; K_3)_{C[0,+\infty)} = \frac{9}{2N^2}, \quad (37)$$

$$E_N(2, 3)_{C[0,+\infty)} = E_N(D^2; K_3)_{C[0,+\infty)} = \frac{4\sqrt{2}}{3\sqrt{N}}. \quad (38)$$

Точно так же в случае $n = 3$, $I = (-\infty, +\infty)$ имеем

$$S_{1,3}x = \frac{1}{2h}(x(t+h) - x(t-h)),$$

$$S_{2,3}x = \frac{1}{h^2}(x(t+h) - 2x(t) + x(t-h)),$$

откуда, аналогично,

$$\|S_{1,3}\| = \frac{1}{h}, \quad \|x' - S_{1,3}x\| \leq \frac{h^2}{6} \|x'''\|,$$

$$\|S_{2,3}\| = \frac{4}{h^2}, \quad \|x'' - S_{2,3}x\| \leq \frac{h}{3} \|x'''\|.$$

Учитывая оценки (25), выводим отсюда, что

$$E_N(1, 3)_{C(-\infty,+\infty)} = E_N(D; K_3)_{C(-\infty,+\infty)} = \frac{1}{6N^2}, \quad (39)$$

$$E_N(2, 3)_{C(-\infty,+\infty)} = E_N(D^2; K_3)_{C(-\infty,+\infty)} = \frac{2}{3\sqrt{N}}. \quad (40)$$

СПИСОК ЛИТЕРАТУРЫ

1. *Sard A.* Linear approximation // Math. Surveys. Providence. 1963. № 9.
2. *Стечкин С.Б.* Неравенства между нормами производных произвольной функции // Acta Scient. Math. 1965. V. 26. P. 225–230.
3. *Арестов В.В.* Наилучшие приближения операторов дифференцирования // ИСМ: Тезисы кратких научных сообщений. Секция 4. — М., 1966. — С. 31–32.
4. *Колмогоров А.Н.* О неравенствах между верхними гранями последовательных производных произвольной функции на бесконечном интервале // Уч. зап. МГУ. Математика. 1939. Т. 30, кн. 3. С. 3–16.