



Lösungen zur Funktionalanalysis

38. Sei H ein Hilbertraum und $A: H \rightarrow H$ eine lineare Abbildung. Zeige:

- (a) Gilt $(Ax|y) = (x|Ay)$ für alle $x, y \in H$, so ist A stetig. (2)

Tipp: Verwende den Satz vom abgeschlossenen Graphen.

Lösung: Sei (x_n) eine Folge in H mit $x_n \rightarrow x$ und $Ax_n \rightarrow y$. Aus der Stetigkeit des Skalarprodukts folgt

$$(y|z) \leftarrow (Ax_n|z) = (x_n|Az) \rightarrow (x|Az) = (Ax|z)$$

für alle $z \in H$, also $(Ax - y|z) = 0$. Speziell für $z = Ax - y$ zeigt dies $\|Ax - y\|^2 = 0$, also $Ax = y$. Damit ist nachgerechnet, dass der Operator A abgeschlossen ist. Nach dem Satz vom abgeschlossenen Graphen ist A stetig.

- (b) Sind A und B in $\mathcal{L}(H)$, so ist $(AB)^* = B^*A^*$. (1)

Lösung: Für alle $x, y \in H$ gilt

$$(x|(AB)^*y) = (ABx|y) = (Bx|A^*y) = (x|B^*A^*y).$$

Mit dem üblichen Argument zeigt dies $(AB)^*y = B^*A^*y$ für jedes $y \in H$, also $(AB)^* = B^*A^*$.

- (c) Die Abbildung A ist genau dann invertierbar, wenn A^* invertierbar ist. In diesem Fall gilt $(A^*)^{-1} = (A^{-1})^*$. (2)

Lösung: Sei A invertierbar. Offenbar ist $I^* = I$. Mit dem letzten Aufgabenteil zeigt dies

$$(A^{-1})^*A^* = (AA^{-1})^* = I^* = I \text{ und } A^*(A^{-1})^* = (A^{-1}A)^* = I^* = I.$$

Also ist $(A^{-1})^* \in \mathcal{L}(H)$ die Umkehrfunktion von A^* , was nach Definition bedeutet, dass A^* invertierbar ist mit $(A^*)^{-1} = (A^{-1})^*$.

Sei nun A^* invertierbar. Dann ist nach dem eben Gezeigten auch $(A^*)^* = A$ invertierbar.

- (d) Ist $\mathbb{K} = \mathbb{C}$ und A stetig, so gilt $\sigma(A) = \text{conj}(\sigma(A^*))$, wobei $\text{conj}(C) = \{\bar{z} : z \in C\}$. (1)

Lösung: Nach Definition liegt $\lambda \in \mathbb{C}$ genau dann in $\rho(A)$, wenn $\lambda I - A$ invertierbar ist. Dies ist nach dem letzten Aufgabenteil genau dann der Fall, wenn die Adjungierte $(\lambda I - A)^* = \bar{\lambda}I - A^*$ invertierbar ist, also wenn $\bar{\lambda}$ in $\rho(A^*)$ liegt. Hier wurden die Rechenregeln $(A + B)^* = A^* + B^*$ und $(\lambda A)^* = \bar{\lambda}A^*$ verwendet. Umgekehrt ist also $\lambda \in \sigma(A)$ äquivalent zu $\bar{\lambda} \in \sigma(A^*)$. Dies war die Behauptung.

- (e) Für den Linksshift $Lx = (x_{n+1})_{n \in \mathbb{N}}$ auf ℓ^2 gilt $\sigma_p(L) \neq \text{conj}(\sigma_p(L^*))$. (2)

Hinweis: Wie in der Vorlesung bezeichnet $\sigma_p(A) := \{\lambda \in \mathbb{C} | \exists x \neq 0 : Ax = \lambda x\}$ die Menge der Eigenwerte von A .

Lösung: Für alle x und y aus ℓ^2 gilt mit dem Rechtsshift $R \in \mathcal{L}(\ell^2)$, der durch $Rx := (0, x_1, x_2, \dots)$ definiert ist,

$$(Lx|y) = \sum_{n=1}^{\infty} x_{n+1}\bar{y}_n = \sum_{n=2}^{\infty} x_n\bar{y}_{n-1} = (x|Ry).$$

Also ist $L^* = R$. Es ist leicht zu sehen, dass R injektiv ist, also 0 nicht in $\sigma_p(R)$ liegt. Zudem ist $Le_1 = 0$, also $0 \in \sigma_p(L)$. Folglich ist $\sigma_p(L) \neq \text{conj}(\sigma_p(R))$.

- (f) Ist $\mathbb{K} = \mathbb{C}$, A ein stetiger Operator und $W(A) := \{(Ax|x) : \|x\| = 1\} \subset \mathbb{R}$, so ist A selbstadjungiert. (2)

Tipp: Zeige $(Az|z) = (z|Az)$ für $z \in H$ und wähle $z = x + y$ und $z = x + iy$.

Lösung: Für $u \in H$ mit $\|u\| = 1$ ist nach Voraussetzung $(Au|u) \in \mathbb{R}$. Für beliebiges $z \in H$ mit $z \neq 0$ folgt mit $\alpha := \|z\|$ und $u := \frac{z}{\alpha}$, dass $z = \alpha u$ gilt. Daher ist $(Az|z) = \alpha^2 (Au|u) \in \mathbb{R}$. Für $z = 0$ ist ebenfalls $(Az|z) \in \mathbb{R}$. Insgesamt folgt für beliebiges $z \in H$ aus dieser Überlegung $(Az|z) = \overline{(z|Az)} = (z|Az)$.

Man kann nachrechnen, dass die komplexe Polarisationsgleichung auch für nicht-symmetrische Formen richtig bleibt. Das zeigt, dass auf einem komplexen Prähilbertraum eine Sesquilinearform durch ihre Werte auf der Diagonalen eindeutig bestimmt ist. Da die Formen $a(x, y) = (Ax|y)$ und $b(x, y) = (x|Ay)$ wie soeben gezeigt für $x = y$ übereinstimmen, folgt also $a = b$, also $(Ax|y) = (x|Ay)$ für alle $x, y \in H$. Also ist A selbstadjungiert und die Aussage bewiesen.

Die im Tipp angedeutete Lösung verfährt direkter: Setzt man nun für vorgegebenes x und y aus H den Wert $z = x + y$ in $(Az|z) = (z|Az)$ ein, so erhält man

$$\begin{aligned} (Ax|x) + (Ax|y) + (Ay|x) + (Ay|y) &= (A(x+y)|x+y) = (x+y|A(x+y)) \\ &= (x|Ax) + (x|Ay) + (y|Ax) + (y|Ay). \end{aligned}$$

Dies zeigt $(Ax|y) + (Ay|x) = (x|Ay) + (y|Ax)$. Analog ergibt sich für $z = x + iy$

$$\begin{aligned} (Ax|x) - i(Ax|y) + i(Ay|x) + (Ay|y) &= (A(x+iy)|x+iy) = (x+iy|A(x+iy)) \\ &= (x|Ax) - i(x|Ay) + i(y|Ax) + (y|Ay). \end{aligned}$$

Dies zeigt $(Ax|y) - (Ay|x) = (x|Ay) - (y|Ax)$. Addiert man die beiden vereinfachten Gleichungen, erhält man $2(Ax|y) = 2(x|Ay)$. Weil x und y beliebig war, ist $A^* = A$ bewiesen.

- (g) Ist $\mathbb{K} = \mathbb{C}$, A stetig und $(Ax|x) = 0$ für alle $x \in H$, so folgt $A = 0$. (2)

Tipp: Verwende die Polarisationsgleichung.

Lösung: Aus dem letzten Aufgabenteil folgt $A^* = A$. Definiere $a(x, y) := (Ax|y)$. Offenbar ist a eine Sesquilinearform. Wegen

$$a(y, x) = (Ay|x) = (y|Ax) = \overline{(Ax|y)} = \overline{a(x, y)},$$

ist a symmetrisch. Die Sesquilinearform $b(x, y) := 0$ ist ebenfalls symmetrisch, und es gilt $a(x, x) = b(x, x)$ für alle $x \in H$. Aufgabe 25(b) zeigt $a(x, y) = b(x, y) = 0$ für alle $x, y \in H$. Insbesondere ist $a(x, Ax) = \|Ax\|^2 = 0$ und damit $Ax = 0$ für alle $x \in H$. Dies zeigt $A = 0$.

- 39.** Sei H ein Hilbertraum und $P: H \rightarrow H$ ein linearer Operator mit der Eigenschaft $P^2 = P$. Sei $U := \text{Rg } P$. Zeige:

- (a) Ist P stetig und gilt $(x - Px|Py) = 0$ für alle $x, y \in H$, so ist U abgeschlossen und P die orthogonale Projektion auf U . (2)

Lösung: Ist P stetig, so ist $U = \text{Kern}(I - P)$ abgeschlossen. Ist $x \in H$ und $z \in U$, so ist nach Voraussetzung $Px \in U$ und

$$\text{Re}(x - Px|z - Px) = \text{Re}(x - Px|P(z - x)) = 0 \leq 0,$$

also nach der Charakterisierung aus der Vorlesung Px das Proximum von x in U . Daher ist P die orthogonale Projektion auf U .

- (b) Gilt $(Px|y) = (x|Py)$ für alle $x, y \in H$, so ist U abgeschlossen und $P = P_U$ die orthogonale Projektion auf U . (3)

Lösung: Nach Aufgabenteil 38 (a) ist P stetig. Aus der Voraussetzung folgt

$$(x - Px|Py) = (P(x - Px)|y) = ((P - P^2)x|y) = 0$$

für alle $x, y \in H$. Aus dem ersten Aufgabenteil folgt nun die Behauptung.

- (c) Ist P stetig mit Operatornorm $\|P\| \leq 1$, so ist U abgeschlossen und $P = P_U$ die orthogonale Projektion auf U . (3)

Tipp: Benutze die Identität $\lambda Py = P(x - Px + \lambda Py)$ und betrachte zuletzt den Grenzwert $\lambda \rightarrow \pm\infty$.

Lösung: Seien $x, y \in H$. Aus der Identität im Tipp ergibt sich

$$\|\lambda Py\|^2 \leq \|x - Px + \lambda Py\|^2 = \|x - Px\|^2 + 2\operatorname{Re}(x - Px|\lambda Py) + \|\lambda Py\|^2.$$

Für $\lambda \in \mathbb{R}$ folgt also $-2\lambda \operatorname{Re}(x - Px|Py) \leq \|x - Px\|^2$. Dies ist nur für den Fall $\operatorname{Re}(x - Px|Py) = 0$ möglich, wie der Grenzübergang $\lambda \rightarrow \pm\infty$ zeigt. Weil dies für jedes $y \in H$ richtig ist, ergibt sich auch $\operatorname{Re}(x - Px|iPy) = \operatorname{Im}(x - Px|Py) = 0$. Insgesamt ist also $(x - Px|Py) = 0$ für alle $x, y \in H$ gezeigt, woraus nach dem ersten Aufgabenteil die Behauptung folgt.

40. Zu $m = (m_n) \in \ell^\infty$ sei $A_m: \ell^2 \rightarrow \ell^2$ der durch $Ax = (m_n x_n)_{n \in \mathbb{N}}$ gegebene Multiplikationsoperator. Man kann wie in Aufgabe 15 zeigen, dass A wohldefiniert und stetig ist und dass $\|A\| = \|m\|_\infty$ gilt. Sei $M := \{m_n : n \in \mathbb{N}\}$. Zeige:

- (a) $\sigma_p(A_m) = M$. (2)

Lösung: Ist $\lambda \in M$, also $\lambda = m_{n_0}$, so gilt $Ae_{n_0} = m_{n_0}e_{n_0} = \lambda e_{n_0}$. Damit ist λ ein Eigenwert, also $M \subset \sigma_p(A_m)$.

Sei nun umgekehrt $\lambda \in \sigma_p(A_m)$ mit einem Eigenvektor $x \in \ell^2$, $x \neq 0$, also $A_m x = \lambda x$. Sei $n_0 \in \mathbb{N}$ ein Index mit $x_{n_0} \neq 0$. Dann gilt insbesondere

$$m_{n_0} x_{n_0} = (A_m x)_{n_0} = (\lambda x)_{n_0} = \lambda x_{n_0}.$$

Hieraus folgt $\lambda = m_{n_0} \in M$. Also ist $\sigma_p(A_m) \subset M$.

- (b) $\sigma(A_m) = \overline{M}$. (2)

Lösung: Wegen $M = \sigma_p(A_m) \subset \sigma(A_m)$ ergibt sich aus der Abgeschlossenheit von $\sigma(A_m)$ die Inklusion $\overline{M} \subset \sigma(A_m)$.

Sei nun $\lambda \notin \overline{M}$. Dann ist $\varrho := \operatorname{dist}(\lambda, \overline{M}) > 0$. Daher liegt die Folge \tilde{m} definiert durch $\tilde{m}_n := \frac{1}{\lambda - m_n}$ in ℓ^∞ ; genauer ist $\|\tilde{m}\|_\infty = \frac{1}{\varrho}$. Also ist $B := A_{\tilde{m}}$ ein Operator in $\mathcal{L}(\ell^2)$. Es ist leicht zu sehen, dass $B(\lambda - A_m) = (\lambda - A_m)B = I$ gilt. Also ist $\lambda - A_m$ invertierbar, was $\lambda \notin \sigma(A_m)$ bedeutet. Dies zeigt $\sigma(A_m) \subset \overline{M}$.

- (c) $A_m^* = A_{\overline{m}}$ mit $\overline{m} := (\overline{m_n})_{n \in \mathbb{N}}$. (1)

Lösung: Seien $x, y \in \ell^2$. Dann ist

$$(A_m x|y) = \sum_{n=1}^{\infty} m_n x_n \overline{y_n} = \sum_{n=1}^{\infty} x_n \overline{(\overline{m_n} y_n)} = (x|A_{\overline{m}} y).$$

- (d) A_m ist genau dann selbstadjungiert, wenn m eine reelle Folge ist. (1)

Lösung: Ist m reell, so ist $\overline{m} = m$ und daher $A_m^* = A_{\overline{m}} = A_m$. Ist umgekehrt m nicht reell, also $m_{n_0} \notin \mathbb{R}$ für ein $n_0 \in \mathbb{N}$, so ist $A_m^* e_{n_0} = \overline{m_{n_0}} e_{n_0} \neq m_{n_0} e_{n_0} = A_m e_{n_0}$, also $A_m^* \neq A_m$.

41. In der Vorlesung wurde gezeigt, dass $\sigma(A)$ für jeden Operator $A: \ell^2 \rightarrow \ell^2$ eine kompakte Menge ist und für selbstadjungiertes A sogar $\sigma(A) \subset \mathbb{R}$ gilt. Zeige die Umkehrung: Ist

$K \subset \mathbb{C}$ eine nicht-leere kompakte Menge, so gibt es einen stetigen linearen Operator $A: \ell^2 \rightarrow \ell^2$ mit $\sigma(A) = K$. Ist $K \subset \mathbb{R}$, so kann man A sogar selbstadjungiert wählen. (4)

Lösung: Sei $K \subset \mathbb{C}$ vorgegeben. Wähle eine höchstens abzählbare, dichte Teilmenge M von K . Dazu kann man beispielsweise so vorgehen, dass man zu den Überdeckungen $K \subset \bigcup_{x \in K} B(x, \frac{1}{n})$ jeweils eine endliche Teilüberdeckung mit Kugeln $B(x_{nk}, \frac{1}{n})$ wählt. Offenbar ist dann $M := \{x_{nk}\} \subset K$ höchstens abzählbar. Zu $y \in K$ und $\varepsilon > 0$ kann man nun $n \in \mathbb{N}$ mit $\frac{1}{n} < \varepsilon$ wählen und dann eine Kugel mit $x_{nk} \in M$, $y \in B(x_{nk}, \frac{1}{n})$. Dann ist $x_{nk} \in B(y, \varepsilon)$. Dies zeigt $\overline{M} = K$.

Sei nun $m := (m_n) \in \ell^\infty$ eine Abzählung von M , bei der Elemente auch mehrfach auftreten dürfen. Nach der vorigen Aufgabe ist $\sigma(A_m) = \overline{M} = K$. Ist sogar $K \subset \mathbb{R}$, so ist m eine reelle Folge und A_m nach dem oben gezeigten selbstadjungiert. Also leistet A_m das Gewünschte.

42. Sei H ein Hilbertraum und $A \in \mathcal{L}(H)$. Zeige:

(a) $\text{Kern } A = (\text{Rg } A^*)^\perp$ und $\text{Kern } A^* = (\text{Rg } A)^\perp$. (2)

Lösung: Sei $x \in \text{Kern } A$. Für $y \in \text{Rg } A^*$ gibt es $v \in H$ mit $y = A^*v$. Es folgt $(x|y) = (x|A^*v) = (Ax|v) = 0$. Also ist $x \in (\text{Rg } A^*)^\perp$.

Sei nun umgekehrt $x \in (\text{Rg } A^*)^\perp$. Dann gilt $(Ax|y) = (x|A^*y) = 0$ für jedes $y \in H$. Speziell für $y = Ax$ folgt daraus $Ax = 0$, also $x \in \text{Kern } A$.

Die zweite Identität folgt aus der ersten, indem man für A den Operator A^* einsetzt und $(A^*)^* = A$ verwendet.

(b) $\overline{\text{Rg } A} = (\text{Kern } A^*)^\perp$ und $\overline{\text{Rg } A^*} = (\text{Kern } A)^\perp$. (2)

Lösung: Nach dem ersten Aufgabenteil und mit Aufgabe 35 (a) ergibt sich

$$(\text{Kern } A^*)^\perp = ((\text{Rg } A)^\perp)^\perp = \overline{\text{Rg } A}.$$

Die zweite Identität folgt aus der ersten, indem man für A den Operator A^* einsetzt und $(A^*)^* = A$ verwendet.

43. Zeige:

(a) Sei $X = \mathbb{K}^N$ und seien $P, Q \in \mathcal{L}(X)$ Projektionen mit $\|P - Q\| < 1$. Zeige, dass dann $\dim(\text{Rg } P) = \dim(\text{Rg } Q)$ gilt! (4)

Tipp: Argumentiere, dass es im Fall $\dim(\text{Rg } P) > \dim(\text{Rg } Q)$ einen Vektor $x \neq 0$ in $\text{Rg } P \cap \text{Kern } Q$ gibt und schlussfolgere, dass dann $\|P - Q\| \geq 1$ gilt.

Lösung: Sei $\dim(\text{Rg } P) \neq \dim(\text{Rg } Q)$. Weil die Aussage in P und Q symmetrisch ist, dürfen wir $\dim(\text{Rg } P) > \dim(\text{Rg } Q)$ annehmen. Nach der Dimensionsformel ist $\dim(\text{Rg } Q) = N - \dim(\text{Kern } Q)$, also $\dim(\text{Rg } P) + \dim(\text{Kern } Q) > N$. Also kann die Summe $\text{Rg } P + \text{Kern } Q \subset \mathbb{K}^N$ nicht direkt sein, da sonst

$$\dim(\text{Rg } P \oplus \text{Kern } Q) = \dim(\text{Rg } P) + \dim(\text{Kern } Q) > N$$

gelten würde. Folglich ist $\text{Rg } P \cap \text{Kern } Q \neq \{0\}$. Es gibt also $x \in \text{Rg } P \cap \text{Kern } Q$ mit $\|x\| = 1$. Nun gilt $\|P - Q\| \geq \|Px - Qx\| = \|x\| = 1$. Damit ist die Behauptung gezeigt.

Der Beweis benutzt übrigens keine besonderen Eigenschaften der Norm, gilt also in allen endlich-dimensionalen normierten Räumen.

(b) Bleibt die Aussage des ersten Aufgabenteils auch für beliebige Banachräume richtig? Falls nein: Gilt sie in unendlich-dimensionalen Hilberträumen? (2)

Lösung: Sei X ein beliebiger normierter Raum und seien P und Q stetige Projektionen in X mit $\dim(\text{Rg } P) \neq \dim(\text{Rg } Q)$. Betrachte den abgeschlossenen Teilraum

$U := \text{Rg } P + \text{Rg } Q$ und die Einschränkungen $P_0 := P|_U$ und $Q_0 := Q|_U$. Offenbar sind P_0 und Q_0 stetige Projektionen auf U mit $\text{Rg } P = \text{Rg } P_0$, $\text{Rg } Q = \text{Rg } Q_0$ und $\|P_0 - Q_0\| \leq \|P - Q\|$. Wenn U endlich-dimensional ist, zeigt der erste Aufgabenteil $\|P_0 - Q_0\| \geq 1$; daraus folgt $\|P - Q\| \geq 1$ und die Behauptung ist gezeigt.

Ist aber U unendlich-dimensional, so ist das Bild einer der beiden Projektionen P_0 oder Q_0 unendlich-dimensional. Nach Umbezeichnung gilt also $\dim(\text{Rg } P_0) = \infty$ und $\dim(\text{Rg } Q_0) < \infty$. Dann ist

$$\text{codim}_U(\text{Rg } P_0) = \dim(U / \text{Rg } P_0) \leq \dim(\text{Rg } Q_0) < \infty.$$

Zudem ist wegen $U = \text{Kern } Q_0 \oplus \text{Rg } Q_0$

$$\text{codim}_U(\text{Kern } Q_0) = \dim(U / \text{Kern } Q_0) = \dim(\text{Rg } Q_0) < \infty.$$

Daraus folgt

$$\text{codim}_U(\text{Rg } P_0 \cap \text{Kern } Q_0) \leq \text{codim}_U(\text{Rg } P_0) + \text{codim}_U(\text{Kern } Q_0) < \infty.$$

Dies zeigt $\dim(\text{Rg } P_0 \cap \text{Kern } Q_0) = \infty$, insbesondere $\text{Rg } P_0 \cap \text{Kern } Q_0 \neq \{0\}$. Nun kann man wie im Beweis des ersten Teils ein $x \in \text{Rg } P_0 \cap \text{Kern } Q_0$ mit $\|x\| = 1$ wählen und erhält

$$\|P - Q\| \geq \|P_0 - Q_0\| \geq \|P_0 x - Q_0 x\| = \|x\| = 1.$$

Anhang zur Kodimension: Um den letzten Beweis zu verstehen, benötigt man einige Informationen über die Kodimension $\text{codim}_X(U) := \dim(X/U)$ eines Unterraums U in einem Vektorraum X . Es gilt stets $\dim(U) + \text{codim}_X(U) = \dim(X)$, wobei alle auftretenden Größen auch den Wert ∞ annehmen können. Um dies zu beweisen, betrachtet man eine Basis (u_α) von U und eine Basis $(v_\beta + U)$ von X/U und rechnet nach, dass $(u_\alpha) \cup (v_\beta)$ eine Basis von X ist.

Es wurde außerdem verwendet, dass $U + V = X$ auch $\text{codim}_X(U) \leq \dim(V)$ impliziert. Dazu überlegt man sich zuerst, dass für $U \oplus V = X$ wegen $X/U \cong V$ sogar $\text{codim}_X(U) = \dim(V)$ gilt. Im allgemeinen Fall kann man $V = (U \cap V) \oplus W$ schreiben. Dann ist $U \oplus W = X$ und daher $\text{codim}_X(U) = \dim(W) \leq \dim(V)$.

Eine weitere Rechenregel ist $\text{codim}_X(U \cap V) \leq \text{codim}_X(U) + \text{codim}_X(V)$. Für den Beweis schreibt man $U = (U \cap V) \oplus \tilde{U}$, $V = (U \cap V) \oplus \tilde{V}$ und $X = (U + V) \oplus W$. Dann ist $X = (U \cap V) \oplus \tilde{U} \oplus \tilde{V} \oplus W$. Also ergibt sich

$$\begin{aligned} \text{codim}_X(U \cap V) &= \dim((\tilde{U} \oplus \tilde{V}) \oplus W) \leq \dim(\tilde{V} \oplus W) + \dim(\tilde{U} \oplus W) \\ &= \text{codim}_X(U) + \text{codim}_X(V). \end{aligned}$$

Weitere Rechenregeln für die Kodimension wurden nicht verwendet.