



# Math-Net.Ru

Общероссийский математический портал

П. М. Тишин,  
Критерий устойчивости частных индексов  
круговой матрицы-функции,  
*Матем. заметки*, 1988, том 44, вы-  
пуск 4, 536–545

<https://www.mathnet.ru/mzm4243>

Использование Общероссийского математического портала  
Math-Net.Ru подразумевает, что вы прочитали и согласны  
с пользовательским соглашением

<https://www.mathnet.ru/rus/agreement>

Параметры загрузки:

IP: 18.97.9.170

22 мая 2025 г., 16:20:12



## КРИТЕРИЙ УСТОЙЧИВОСТИ ЧАСТНЫХ ИНДЕКСОВ КРУГОВОЙ МАТРИЦЫ-ФУНКЦИИ

П. М. Тишин

Пусть  $\Gamma$  — ляпуновский контур, разбивающий плоскость комплексного переменного  $z$  на внутреннюю область  $D_+$ , содержащую нулевую точку, и внешнюю  $D_-$ , — содержащую бесконечно удаленную точку. Канонической факторизацией [1],  $H$ -непрерывной и неособой на контуре  $\Gamma$  матрицы-функции  $G(t)$ , называется представление ее в виде

$$G(t) = \chi_+(t) \Lambda(t) \chi_-(t),$$

где  $\Lambda(t) = \text{diag}(t^{\kappa_1}, \dots, t^{\kappa_n})$ , а  $\chi_{\pm}(t)$  — аналитические в  $D_{\pm}$  матрицы-функции. Целые числа  $\kappa_1, \dots, \kappa_n$  (называемые *частными индексами матрицы-функции  $G(t)$* ) определяются однозначно.

В [2, 3] впервые были получены необходимые и достаточные условия устойчивости частных индексов произвольной матрицы-функции. Нахождению эффективно проверяемых условий, при которых частные индексы устойчивы, посвящены [4—8]. Особое внимание было уделено также нахождению условий равенства нулю частных индексов матриц, принадлежащих специальным классам. В частности, в [9] И. М. Спитковским и А. М. Николаичуком найден критерий равенства нулю частных индексов эрмитовых матриц 2-го порядка. Г. Пуассон [10] и Рабиндранатан [11] получили условия равенства нулю частных индексов унитарных матриц. Оба результата заключаются в том, что должны существовать некоторые мероморфные (аналитические) функции, удовлетворяющие специальным условиям.



где число  $l$  ищется из условия  $k_l \geq k \geq k_{l+1}$ , а коэффициенты матрицы  $A_{ij}$  размеров  $\{k_j - 1 \times k - 1\}$  ( $i = \overline{1, n-1}$ ,  $j = \overline{1, i-1}$ ) и матриц  $A_{nj}$  ( $j = \overline{1, n-1}$ ) размеров  $\{k_j - 1 \times k\}$  определяются соответственно по формулам:

$$a_{i_1 j_1}^{ij} = \frac{1}{2\pi i} \int_{\Gamma} Q_{ij}(t) t^{-k_j + i_1 - j_1 - 1} dt$$

$$(i_1 = \overline{1, k_j - 1}, \quad j_1 = \overline{1, k - 1}),$$

$$a_{i_1 j_1}^{nj} = \frac{1}{2\pi i} \int_{\Gamma} Q_{nj}(t) t^{-k_j + i_1 - j_1} dt$$

$$(i_1 = \overline{1, k_j - 1}, \quad j_1 = \overline{1, k}).$$

Тогда оказывается справедливой следующая

**ТЕОРЕМА 1.** Частные индексы произвольной треугольной матрицы  $n$ -го порядка вида (1) равны между собой тогда и только тогда, когда для постоянной матрицы  $A$ , определяемой по формуле (2), справедливо равенство

$$\sum_{i=1}^{n-1} k_i = \text{rang } A + n - 1. \quad (3)$$

**Необходимость.** Для доказательства необходимости достаточно показать, что при выполнении условия (3), для матрицы  $\Delta(t)$  справедливо следующее представление:

$$\Delta(t) = [P_+(t)]^{-1} \Lambda(t) P_-(t), \quad (4)$$

где  $\Lambda(t) = \text{diag}(t^k, \dots, t^k)$ ,  $P_+(t)$  — полиномиальная матрица с определителем, равным единице, а  $P_-(t)$  — аналитическая в  $D_-$  матрица-функция. Представление (4) эквивалентно выполнению равенств

$$t^{-k} [t^k P_{ij}^+(t) + \sum_{m=j+1}^n Q_{mj}(t) P_{im}(t)] = P_{ij}^-(t),$$

$$t^{-k} P_{in}^+(t) = P_{in}^-(t) \quad (i = \overline{1, n}, \quad j = \overline{1, n-1}), \quad (5)$$

где через  $P_{ij}^{\pm}(t)$  обозначены элементы матриц  $P_{\pm}(t)$ .

Отсюда видно, что

$$\text{ord}_{z=\infty} P_{in}^+(z) z^{-k} = 0, \quad \text{ord}_{z=\infty} P_{ij}^+(z) z^{-k} > 0$$

$$(i = \overline{1, n}, \quad j = \overline{1, n-1}).$$

Поэтому полиномы, удовлетворяющие условию (5), мож-

но искать в следующем виде

$$P_{in}^+(t) = \sum_{m=0}^k P_{in}^m t^m, \quad P_{ij}^+(t) = \sum_{m=0}^{k-1} P_{ij}^m t^m \\ (i = \overline{1, n}, \quad j = \overline{1, n-1}).$$

Подставляя эти выражения в (5), и приравнявая нулю коэффициенты при положительных степенях, стоящих слева рациональных функций, получим для определения  $\{P_{ij}^m\}_{m=0}^k$  систему линейных алгебраических уравнений

$$Ax = b, \quad (6)$$

в которой матрица коэффициентов (размеров  $\{nk - n + 1 \times nk - n + 1\}$ ) определяется формулой (2),  $b$  — линейная комбинация  $\{P_{ij}^0\}_{i,j=1}^n$ , а

$$x = (P_{i_1}^{k-1}, \dots, P_{i_1}^1, P_{i_2}^{k-1}, \dots, P_{i_2}^1, \dots, P_{i_n}^k, \dots, P_{i_n}^1).$$

В силу условия (3) матрица  $A$  неособая, а поэтому в случае, когда  $b \neq 0$ , система (6) имеет нетривиальное решение. Для доказательства нужно еще показать, что  $P_{im}^0$  ( $i = \overline{1, n}, m = \overline{1, n}$ ) можно выбрать таким образом, чтобы  $\det P(t) = 1$ .

В самом деле, при выполнении условий (3) для матрицы  $P(t)$  справедливо представление

$$P(t) = P_0(t) \prod_{i=1}^l \Delta_i(t),$$

где  $\Delta_{2m}(t)$  — верхняя треугольная матрица, на диагонали которой стоят единицы, а  $\Delta_{2m+1}(t)$  — нижняя треугольная полиномиальная матрица с аналогичными диагональными элементами.  $P_0(t) = \{P_{ij}^0\}_{i,j=1}^n$ , а  $l$  — некоторое целое число. Следовательно,  $\det P(t) = \det P_0(t)$ . Отсюда вытекает, что выбирая матрицу  $P_0(t)$  так, чтобы  $\det P_0 = 1$ , получим, что  $\det P(t) = 1$ . Кроме того, при таком выборе матрицы  $P_0(t)$  система (6) имеет  $n$  нетривиальных решений.

**Достаточность.** Докажем теперь, что если условие теоремы 1 не выполняется, то частные индексы треугольной матрицы  $\Delta(t)$  не могут равняться между собой. В самом деле, пусть частные индексы матрицы  $\Delta(t)$  устойчивы, тогда справедливо разложение (4), а значит, система (6) имеет нетривиальное решение. Поэтому, если

показать, что при выполнении условия

$$\text{rang } A < \sum_{i=1}^{n-1} k_i - n + 1, \quad (7)$$

система (6) не имеет нетривиального решения, то можно считать теорему 1 доказанной. Если положить  $P_0(t) = I$ , то  $b \neq 0$ , а следовательно, при выполнении условия (7) решение  $x \neq 0$  не существует. А поскольку каноническая факторизация матрицы  $\Delta(t)$  определяется с точностью до произвольной постоянной матрицы с определителем, отличным от нуля, то такое свойство справедливо и для любой матрицы  $P_0(t)$ , удовлетворяющей условию  $\det P_0(t) = 1$ .

Теорема 1 доказана.

Рассмотрим теперь круговую матрицу-функцию  $G(t) = \{g_{ij}(t)\}_{i,j=1}^n$ , когда контур  $\Gamma$  является единичной окружностью.

Коэффициенты произвольной круговой матрицы  $G(t)$  можно определить через конечный набор вспомогательных функций  $\{g_{ki}^{(j)}(t)\}$ ,  $g_{j,2n-j+1}^{(j-1)}(t) \neq 0$ ,  $t \in \Gamma$ . Причем эти функции можно найти по формулам

$$g_{ki}^{(j)}(t) = g_{ki}^{(j-1)}(t) - \frac{g_{k,2n-j+1}^{(j-1)}(t)}{g_{j,2n-j+1}^{(j-1)}(t)} g_{ij}^{(j-1)}(t), \quad t \in \Gamma,$$

$$g_{ki}^{(0)}(t) = g_{ki}(t)$$

$$(j = \overline{1, n-1}, \quad i = \overline{1, 2n-j}, \quad k = \overline{j+1, n}).$$

Предположим сначала выполнение следующих условий:

$$\text{а) } g_{ij}^{(j-1)}(t) \quad (i = \overline{2, n-1}, \quad j = \overline{i+1, 2n-i}),$$

$$g_{1j}(t) [g_{1,2n}(t)]^{-1} \quad (j = \overline{2, 2n-1})$$

— рациональные функции.

б) Существуют такие мероморфные в  $D_+$  функции  $\psi_j^+$ , что выполняются условия

$$|g_{j,j}^{(j-1)}(t) - \psi_j^+(t) g_{j,2n-j+1}^{(j-1)}(t)| = 1 \quad (j = \overline{1, n}, \quad t \in \Gamma).$$

Тогда можно показать, что имеет место факторизация

$$G(t) = \chi_+(t) \mathcal{L}(t) \overline{[\chi_+(t)]}^{-1}, \quad (8)$$

где  $\chi_+(t)$  — аналитическая, неособая в  $D_+$  матрица-функция, а  $\mathcal{L}(t)$  — треугольная круговая матрица-функция, коэффициенты которой ищутся эффективно.

Функции  $l_{ij}(t)$  ( $i = \overline{1, 2n}$ ,  $j = \overline{i+1, 2n}$ ) при этом находятся с помощью выражений

$$l_{j-1, j}(t) = i [\overline{h_{j-1}}]^{-1} [\overline{h_j}]^{-1} \rho_{j-1, j}(t),$$

$$l_{ij}(t) =$$

$$= [\overline{h_i} \overline{h_j}]^{-1} \left[ \sum_{k=i+1}^{j-1} \left(-\frac{1}{2}\right)^{j-i-1} |h_k|^{-2} \rho_{ik}(t) \rho_{kj}(t) + i \rho_{ij}(t) \right],$$

где  $l_{ii} = h_i [\overline{h_i}]^{-1}$ , а  $\rho_{ij}(t)$  — произвольные  $H$ -непрерывные действительнoзначные функции на  $\Gamma$ . Доказательство этого факта очевидно, но громоздко, поэтому мы его опускаем.

Определим теперь для данной круговой треугольной матрицы  $\mathcal{L}(t)$  конечную последовательность аналитических в  $D_+$  функций по следующему правилу:

$$\begin{aligned} \Phi_{ij}^+(t) = P_+ \left\{ \sum_{k=i+1}^{j-1} \frac{t^{-k_i}}{\overline{h_i(t)} \overline{h_k(t)}} \left[ \left(-\frac{1}{2}\right)^{k-i-1} \cdot \right. \right. \\ \left. \cdot \sum_{m=i+1}^{k-1} \frac{\rho_{im}(t) \rho_{mk}(t)}{|h_m(t)|^2} + i \rho_{ik}(t) \right] \frac{\overline{\chi_k^+(t)}}{\chi_j^+(t)} + \\ \left. + \frac{t^{-k_i} \overline{\chi_j^+(t)}}{\overline{h_j(t)} \overline{h_i(t)} \chi_i^+(t)} \left[ \sum_{k=i+1}^{j-1} \left(-\frac{1}{2}\right)^{j-i-1} \frac{\rho_{ik}(t) \rho_{kj}(t)}{|h_k|^2} + i \rho_{ij}(t) \right] \right\}, \end{aligned}$$

где

$$\begin{aligned} \Phi_{j-1, j}^+(t) = P_+ \{ i t^{-k_j} \rho_{j-1, j}(t) |\chi_j^+(t)|^2, \\ k_j = \text{ind}_{\Gamma} \{h_j / \overline{h_j}\}, \\ \chi_j^+(t) = \exp \left\{ \frac{1}{2} (P_+ + \mathbf{C}P_-) \ln \left( t^{-k_j} \frac{h_j}{\overline{h_j}} \right) \right\}. \end{aligned}$$

Пусть  $k_1 \leq k_2 \leq \dots \leq k_{2n}$ . Найдем числа  $g_{ij}^l$  по формулам

$$g_{ij}^l = \frac{1}{2\pi i} \int_{\Gamma} \left[ \tau^{k_i} \Phi_{ij}^+(\tau) + \sum_{m=i+1}^{j-1} R_{im}(\tau) \Phi_{mj}^+(\tau) \tau^{k_m} \right] \frac{d\tau}{\tau^l}, \quad (9)$$

где  $R_{ij} = Q_{ij} - \sum_{m=i+1}^{j-1} t^{k_m} R_{im} \Phi_{mj}^+$ ,  $Q_{ij} = \sum_{l=k_i+1}^{k_j-1} g_{ij}^l t^l$ , а числа  $\gamma_i$  — по формуле

$$\gamma_i = k_i - k_{2n}.$$

Тогда определяя матрицу  $A$  соотношением (2), получим следующее утверждение.

**ЛЕММА 1.** Пусть дана круговая матрица  $G(t)$ , удовлетворяющая условиям а) и б) и  $\text{ind}_\Gamma \{\det G(t)\} = 0$ . Тогда для устойчивости частных индексов матрицы-функции  $G(t)$ , необходимо и достаточно, чтобы

$$\sum_{i=1}^{2n-1} \gamma_i = \text{rang } A + 2n - 1. \quad (10)$$

Доказательство основано на формулах, полученных во второй части [12].

Сформулируем теперь критерий равенства нулю частных индексов произвольной круговой матрицы.

**ТЕОРЕМА 2.** Пусть дана произвольная круговая матрица  $G(t)$ , в которой функции  $g_{ij}^{(j-1)}(t)$  принадлежат классу  $h_\alpha(\Gamma)^1$  и  $\text{ind}_\Gamma \{\det G(t)\} = 0$ . Тогда для того, чтобы частные индексы матрицы-функции  $G(t)$  равнялись нулю, необходимо и достаточно, чтобы одновременно выполнялись два условия:

1) существуют такие рациональные функции  $R_{ij}(t)$ , что

$$\|g_{ij}^{(j-1)}(t) - R_{ij}(t)\|_{H_\alpha} < \delta(\Gamma, n) \|\chi_R^+\|_{H_\alpha}^{-1} \|\chi_R^-\|_{H_\alpha}^{-1} A^{-1};$$

2) ранг  $\rho$  постоянной матрицы, которая соответствует круговой матрице  $G_R(t) = [X_R^+(t)]^{-1} [X_R^-(t)]^{-1}$ , полученной из круговой матрицы  $G(t)$  заменой [функций  $g_{ij}^{(j-1)}(t)$ ] на  $R_{ij}(t)$ , равен  $\rho = \sum_{i=1}^{2n-1} \gamma_i - 2n + 1$ .

**Н е о б х о д и м о с т ь.** Покажем, что при равенстве нулю частных индексов круговой матрицы  $G(t)$ , существуют рациональные функции  $R_{ij}(t)$ , удовлетворяющие условиям 1) и 2). В самом деле, если частные индексы матрицы  $G(t)$  устойчивы, то существует такое  $\delta(\Gamma, n)$ , что для всех матриц, удовлетворяющих условию  $\|G(t) - B(t)\| < \delta(\Gamma, n)$ , частные индексы матрицы  $B(t)$  также равны нулю. Выберем теперь  $\varepsilon > 0$  следующим образом  $A\varepsilon < \delta(\Gamma, n)$ .

Тогда при выполнении условия

$$\|g_{ij}^{(j-1)}(t) - R_{ij}(t)\|_{H_\alpha} < \varepsilon, \quad (11)$$

норма матрицы  $G(t) - G_R(t)$  меньше  $\varepsilon A$ . Этого можно до-

<sup>1)</sup> Класс таких функций изучался, в частности, в [13].



биться, так как функции  $g_{ij}^{(j-1)}(t)$  аппроксимируются рациональными с любой степенью точности по норме пространства гельдеровских функций. А значит, частные индексы матрицы равны нулю, т. е. в силу результатов леммы 1 выполняется условие 2).

Возьмем теперь последовательность рациональных функций  $\{R_{ij}^n\}$ , сходящихся по норме пространства  $H_\alpha$  к  $g_{ij}^{(j-1)}(t)$ . Тогда, начиная с некоторого номера, для всех членов последовательности выполняется условие (11), и кроме того частные индексы матриц  $G_{R^n} = [X_{R^n}^+]^{-1} [X_{R^n}^-]^{-1}$  равны нулю. Следовательно, существуют пределы факторизационных множителей, и они соответственно равны  $X^+$  и  $X^-$ , где  $G = [X^+]^{-1} [X^-]^{-1}$  [14]. Это значит, что для любого  $\varepsilon_1 > 0$  существует такое  $N$ , что при  $n > N$ :

$$\begin{aligned} \|X_{R^n}^\pm - X^\pm\|_{H_\alpha} &< \varepsilon_1, \\ \|[X_{R^n}^\pm]^{-1} - [X^\pm]^{-1}\|_{H_\alpha} &< \varepsilon_1. \end{aligned}$$

Следовательно,

$$\begin{aligned} \|X^\pm\|_{H_\alpha} - \varepsilon_1 &< \|X_{R^n}^\pm\|_{H_\alpha} < \|X^\pm\|_{H_\alpha} + \varepsilon_1, \\ \|[X_{R^n}^+]^{-1} [X_{R^n}^-]^{-1}\|_{H_\alpha} &> \|[X^+]^{-1} [X^-]^{-1}\|_{H_\alpha} - \varepsilon_1. \end{aligned}$$

Если теперь  $\varepsilon > 0$ , выбрать дополнительно так, чтобы выполнялось неравенство

$$0 < \varepsilon < \frac{\delta(\Gamma, n)}{A \|X^+\|_{H_\alpha} \|X^-\|_{H_\alpha}},$$

а  $\varepsilon_1$  искать из условия

$$\begin{aligned} 0 < \varepsilon_1 &< \\ &< \sqrt{\frac{(\|X^+\|_{H_\alpha} + \|X^-\|_{H_\alpha})^2}{4} + \frac{\delta(\Gamma, n)}{\varepsilon A} - \|X^+\|_{H_\alpha} \|X^-\|_{H_\alpha} -} \\ &\quad - \frac{1}{2} (\|X^+\|_{H_\alpha} + \|X^-\|_{H_\alpha}), \quad (12) \end{aligned}$$

то кроме условия 2) выполняется также и условие 1). Следовательно, если выбрать  $\varepsilon > 0$  из условия

$$\varepsilon < \min \left\{ \frac{\delta(\Gamma, n)}{A \|X^+\|_{H_\alpha} \|X^-\|_{H_\alpha}}, \frac{\delta(\Gamma, n)}{A} \right\},$$

а  $\varepsilon_1$  выбрать из условия (12), то для всех функций после-

довательности  $\{R_{ij}^n(t)\}$ , удовлетворяющих условию

$$\|g_{ij}^{(j-1)}(t) - R_{ij}^n(t)\|_{H_\alpha} < \min(\varepsilon, \varepsilon_1),$$

выполняется условие теоремы.

**Д о с т а т о ч н о с т ь.** Пусть теперь выполняются условия 1) и 2), покажем, что при этом частные индексы круговой матрицы  $G(t)$  равны нулю. В самом деле, если выполняется условие 2), то частные индексы матрицы  $G_R = [X_R^+]^{-1} [X_R^-]^{-1}$  равны нулю.

Рассмотрим матрицу  $M = X_R^+ G X_R^-$ . Тогда

$$\begin{aligned} \|I - M\|_{H_\alpha} &= \|I - X_R^+ G X_R^-\|_{H_\alpha} \leq \\ &\leq \|X_R^+\|_{H_\alpha} \|X_R^-\|_{H_\alpha} \|G_R - G\|_{H_\alpha} \leq \\ &\leq A \|X_R^+\|_{H_\alpha} \|X_R^-\|_{H_\alpha} \max_{i,j} \|g_{ij}^{(j-1)}(t) - R_{ij}(t)\|_{H_\alpha} < \delta(\Gamma, n). \end{aligned}$$

Таким образом, частные индексы матрицы-функции  $M(t)$  равны нулю, откуда следует, что и частные индексы матрицы  $G(t)$  равны нулю. Теорема 2 доказана.

Поступило  
03.03.86

#### СПИСОК ЦИТИРОВАННОЙ ЛИТЕРАТУРЫ

- [1] В е к у а Н. П. Системы сингулярных интегральных уравнений. М.: Наука, 1970.
- [2] Г о х б е р г И. Ц., К р е й н М. Г. Об устойчивой системе частных индексов задачи Гильберта для нескольких неизвестных функций // ДАН СССР. 1985. Т. 119. № 5. С. 854—857.
- [3] Б о я р с к и й Б. В. Об устойчивости задачи Гильберта для голоморфного вектора // Сообщ. АН ГССР. 1958. Т. 21, вып. 4. С. 391—398.
- [4] С п и т к о в с к и й И. М. Устойчивость частных индексов краевой задачи Римана со строго невырожденной матрицей // ДАН СССР. 1974. Т. 218, № 1. С. 46—49.
- [5] С п и т к о в с к и й И. М. Некоторые оценки для частных индексов измеримых матриц-функций // Мат. сб. 1980. Т. 111, вып. 2. С. 227—248.
- [6] С п и т к о в с к и й И. М. О факторизации матриц-функций, хаусдорфово множество которых расположено внутри угла // Сообщ. АН ГССР. 1977. Т. 86, вып. 3. С. 561—564.
- [7] К р у п н и к Н. Я., Н я г а В. И. О сингулярных интегральных операторах в случае негладкого контура // Математические исследования. 1975. Т. 10, вып. 1. С. 144—164.
- [8] К р у п н и к Н. Я. О сингулярных интегральных операторах с матричными коэффициентами // Спектральные свойства операторов. Кишинев: Штиница, 1977. С. 93—100.

- [9] С п и т к о в с к и й И. М., Н и к о л а й ч у к А. М. Факторизация эрмитовых матриц-функций и ее приложения к граничным задачам // Укр. мат. журн. 1975. Т. 27, № 6. С. 767—779.
- [10] P o u s s o n H. R. Systems of Toeplitz operators on  $H^2$  // Trans. Amer. Math. Soc. 1968. V. 133, № 2. P. 527—536.
- [11] R a b i n d r a n a t h a n M. On the inversion of Toeplitz operators // J. Math. and. Mech. 1969. V. 19, № 3. P. 195—206.
- [12] Н и к о л а й ч у к А. М. Некоторые оценки для частных индексов краевой задачи Римана // Укр. мат. журн. 1971. Т. 23, № 6. С. 793—798.
- [13] K r o t o v V. G. Note on the convergence of Fourier series in the spaces  $\Lambda_w^p$  // Acta Scien. Math. 1979. V. 44, № 3. P. 335—338.
- [14] Ш у б и н М. А. Факторизация зависящих от параметра матриц-функций в нормированных кольцах и связанные с ней вопросы теории нетеровых операторов // Мат. сб. 1967. Т. 73, вып. 4. С. 610—629.