

В. А. АВАКЯН

ЗАДАЧА ШТУРМА-ЛИУВИЛЛЯ СО СПЕКТРАЛЬНЫМ
 ПАРАМЕТРОМ λ В ГРАНИЧНОМ УСЛОВИИ

1°. Введение. В настоящей работе изучается асимптотическое поведение собственных значений (с. з.) для краевой задачи

$$l[y(x)] = -y''(x) + q(x)y(x) = \lambda y(x), \quad (1)$$

$$y(0) - \theta(\lambda)y'(0) = 0,^*$$

$$y(x) \in L_2(0, +\infty), \quad (2)$$

где $\theta(\lambda)$ — некоторая мероморфная функция, отличная от бесконечной константы.

Случай, когда краевое условие не зависит от λ , при некоторых условиях на регулярность потенциала $q(x)$ в бесконечности, впервые был изучен Э. Ч. Титчмаршем (см. [1], стр. 161). Далее, при более слабых условиях на $q(x)$ формула распределения с.з. была получена Б. М. Левитаном (см. [2], стр. 584—587), а случай дифференциальных операторов произвольного четного порядка рассмотрен А. Г. Костюченко в [3]. В работе И. Вальтера [8] доказывается разложимость по собственным функциям краевой задачи (1), (2) в случае, когда

да $\theta(\lambda) = \frac{1}{\lambda}$ и интервал конечен. Более сложен вопрос о распределе-

нии с.з., когда граничные условия зависят от λ . При линейной зависимости граничных условий от λ этот вопрос для эллиптических краевых задач был решен А. Н. Кожевниковым (см., например, [4]).

Чтобы исследовать распределение с.з. задачи (1), (2) наложим следующие условия на потенциал $q(x)$ и функцию $\theta(\lambda)$:

1°. $|q(x) - q(\xi)| \leq c_1 |x - \xi| q^2(\xi)$, при $|x - \xi| \leq 1$, где $\alpha < \frac{3}{2}$.

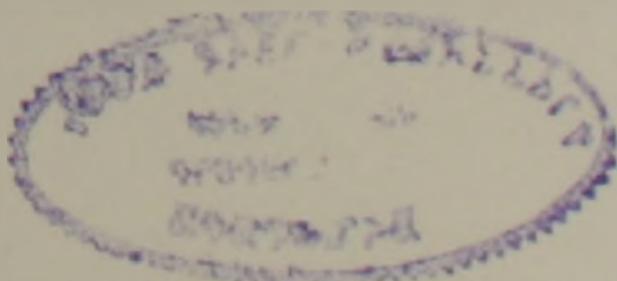
2°. $|q(x)| \leq c_2 \exp [c_0 |x - \xi| q^{1/\alpha}(\xi)]$, при $|x - \xi| > 1$, где $c_0 < 1$.

3°. В области $|\xi - y| \leq 1$ выполняется неравенство

$$c' q(y) \leq q(\xi) \leq c'' q(y).$$

4°. $q(x)$ — вещественная непрерывная функция, удовлетворяющая неравенству $q(x) > cx^{2+\varepsilon}$, где $\varepsilon > 0$ — любое число.

* Если для какого-либо λ $\theta(\lambda) = \infty$, то условие (2) заменяется следующим: $y'(0) = 0$.



5°. Пусть функция $q(x)$ монотонно возрастает, имеет первую и вторую производные и вогнута. Тогда $q'(x) > 0$, $q''(x) > 0$.

Далее, пусть выполняется еще условие

$$q(x) q''(x) < c_3 |q'(x)|^3,$$

где c_3 — некоторое конечное число, отличное от нуля.

6°. Функция $\theta(\lambda)$ имеет вид

$$\theta(\lambda) = \sum_1^{\infty} \frac{\rho_k}{\alpha_k - \lambda}, \quad (3)$$

где ρ_k — комплексные числа, удовлетворяющие условию $\sum_1^{\infty} |\rho_k| < \infty$, а

α_k лежат (за исключением быть может конечного числа) в сколь угодно малом угле комплексной плоскости и $\sum_1^{\infty} \frac{1}{|\alpha_k|}$ сходится. При этом

предполагается, что вершина угла находится в начале координат, а положительная полуось является его биссектрисой.

2°. Операторная трактовка задачи (1), (2). В этом пункте мы покажем, что задача (1), (2) эквивалентна задаче на собственные значения некоторого линейного оператора в более широком гильбертовом пространстве.

Введем пространство \mathbf{H} (см. [5], стр. 24)

$$\mathbf{H} = L_2(0, +\infty) \oplus l_2. \quad (4)$$

Далее определим оператор \mathbf{L} в \mathbf{H} с областью определения $D_{\mathbf{L}}$. Вектор $Y = \{y(x), y_1, y_2, \dots, y_k, \dots\}$ принадлежит $D_{\mathbf{L}}$ в том и только в том случае, когда существуют первая и вторая производные функции $y(x)$ и вместе с $l[y(x)]$ принадлежат $L_2(0, +\infty)$, а компонента $Y^{\wedge} = \{y_1, y_2, \dots, y_k, \dots\} \in l_2$ удовлетворяет условию

$$\sum_1^{\infty} y_k = y(0) \text{ и } \sum_1^{\infty} |\alpha_k y_k| < \infty,$$

здесь $y(0)$ — значение первой компоненты вектора Y в точке 0.

Покажем, что $D_{\mathbf{L}}$ всюду плотна в \mathbf{H} . Пусть $H = \{h(x), h_1, h_2, \dots, h_k, \dots\} \in \mathbf{H}$ и ортогонален $D_{\mathbf{L}}$. В частности, H ортогонален вектору $Y_1 = \{y(x), 0, 0, \dots, 0, y(0), 0, \dots\}$, так как Y_1 принадлежит $D_{\mathbf{L}}$. Следовательно, принимая во внимание (4), получаем равенство

$$\langle H, Y_1 \rangle = [h(x), y(x)]_L + y(0) \cdot h_1 = 0,$$

где $\langle \cdot \rangle$ — скалярное произведение в \mathbf{H} . Известно (см. [6]), что пара $\{y(x), y(0)\}$ всюду плотна в $L_2(0, +\infty) \oplus \mathbb{C}$ и поэтому из верхнего равенства следует, что $h(x) = h_1 = 0$. Аналогично можно показать, что остальные компоненты вектора H также равны нулю.

Доказательство. Пусть Y — некоторый с.в. оператора L , отвечающий с.з. λ_0 , т. е. $LY = \lambda_0 Y$. Тогда из формулы (5) следуют равенства

$$\left. \begin{aligned} l[y(x)] &= \lambda_0 y(x) \\ \alpha_1 y_1 - \rho_1 y'(0) &= \lambda_0 y_1 \\ \alpha_2 y_2 - \rho_2 y'(0) &= \lambda_0 y_2 \\ \alpha_k y_k - \rho_k y'(0) &= \lambda_0 y_k \end{aligned} \right\} \quad (8)$$

Первое из равенств (8) показывает, что $y(x)$ удовлетворяет уравнению (1) при $\lambda = \lambda_0$. Для того чтобы показать, что $y(x)$ удовлетворяет при $\lambda = \lambda_0$ и граничному условию (2), заметим, что из остальных равенств (8) следуют соотношения:

$$y_k = \frac{\rho_k}{\alpha_k - \lambda_0} y'(0), \quad k = 1, 2, \dots$$

Теперь, принимая во внимание определение D_L , из этих равенств вытекает выполнимость краевого условия (2). Таким образом, мы показали, что первая компонента с.в. оператора L с с.з. λ_0 является с.ф. задачи (1), (2) с тем же с.з.

Обратно, пусть $y(x)$ — с.ф. задачи (1), (2) с с.з. λ_0 . Обозначим через

$$y_k = \frac{\rho_k}{\alpha_k - \lambda_0} y'(0), \quad k = 1, 2, \dots \quad (9)$$

Так как $y(x)$ удовлетворяет граничному условию (2) при $\lambda = \lambda_0$, то ясно, что $\sum_1^{\infty} y_k = y(0)$. Следовательно, вектор $y = \|y(x), y_1, y_2, \dots, y_k, \dots\|$ принадлежит области определения оператора L . Заметим также, что сходимость ряда $\sum_1^{\infty} |\alpha_k y_k|$ сразу следует из соотношений (9), учитывая, что λ_0 — фиксированное число, не равное α_k ($k = 1, 2, \dots$)** и $\sum_1^{\infty} |\rho_k| < \infty$. Следовательно, вектор Y принадлежит D_L и, как легко видеть, выполняется равенство $LY = \lambda_0 Y$. Тем самым, доказательство леммы окончено.

Отметим, что из определения D_L следует, что область значений оператора L состоит из таких векторов пространства H , у которых первая компонента принадлежит $L_2(0, +\infty)$, а вторая — l_1 .

Теперь рассмотрим задачу:

* Здесь y_k ($k = 1, 2, \dots$) определяются из соотношений (9), а $y(x)$ — с.ф. задачи (1), (2).

** См. сноску на стр. 91.

$$L Y - \lambda Y = F, \quad (10)$$

где $Y = \{y(x), Y^\lambda\} \in D_L$, а $F = \{f(x), F^\lambda\}$, $f(x) \in L_2(0, +\infty)$ и $\sum_1^\infty |f_k| < \infty$.

Решение задачи (10) будем искать в виде суммы решений двух других задач, которые мы введем в следующем пункте.

3°. Операторы R и T . Обозначим через R оператор в $L_2(0, +\infty)$, соответствующий задаче

$$\left. \begin{aligned} l[z(x)] - \lambda z(x) &= g(x) \\ z(0) &= 0 \end{aligned} \right\}, \quad (11)$$

где $g(x) \in L_2(0, +\infty)$.

Известно (см. например, [2], часть V, гл. XII или [3]), что при выполнении условий 1°–4° R — полуограниченный снизу самосопряженный оператор с дискретным спектром. Более того, при $\lambda < 0$ достаточно больших резольвента $(R - \lambda I)^{-1}$ — ядерный оператор. Не нарушая общности можно считать, что $q(x) \geq 1$, тогда спектр оператора R будет лежать только на положительной полуоси. Таким образом, при условиях 1°–5° имеет место (см. [2], стр. 585) следующая формула следов:

$$\text{sp}(R - iI)^{-1} = \int_0^\infty \frac{dN(t, R)}{t - \lambda}, \quad (12)$$

где

$$N(\lambda, R) = \sum_{\lambda_j(R) < \lambda} 1 \sim \frac{1}{2\pi} \int_{q(x) < \lambda} \sqrt{\lambda - q(x)} dx \text{ при } \lambda \rightarrow \infty. \quad (13)$$

Теперь рассмотрим задачу

$$\left. \begin{aligned} l[v(x)] &= 0 \\ (T - \lambda I) V^\lambda &= A^\lambda \end{aligned} \right\}, \quad (14)$$

где T — оператор в l_2 с областью определения D_T , состоящий из векторов $Y^\lambda = [v_1, v_2, \dots, v_k, \dots] \in l_2$ таких, что

$$\sum_1^\infty v_k = v(0) \text{ и } \sum_1^\infty |x_k v_k| < \infty.$$

Здесь $v(0)$ — значение в нуле решения уравнения $l[v(x)] = 0$. Оператор T на $Y^\lambda \in D_T$, аналогично оператору L , определяется по формуле

$$T V^\lambda = [x_1 v_1 - \rho_1 v'(0), x_2 v_2 - \rho_2 v'(0), \dots, x_k v_k - \rho_k v'(0), \dots].$$

Ясно, что T — линейный замкнутый оператор в пространстве l_2 с областью определения D_T , всюду плотной в l_2 , и с областью значений,

состоящей из таких векторов $A^\lambda = \{a_1, a_2, \dots, a_k, \dots\}$, что $\sum_1^\infty |a_k| < \infty$.

Обозначим через T_k ($k = 1, 2, \dots$) одномерные операторы, действующие на k -ой компоненте вектора V^λ следующим образом:

$$T_k v_k = a_k v_k - \rho_k v'(0), \quad k = 1, 2, \dots$$

Следовательно, для некоторой регулярной точки λ^* резольвента оператора T будет задаваться формулой

$$(T - \lambda I)^{-1} = \{(T_1 - \lambda I)^{-1}, (T_2 - \lambda I)^{-1}, \dots, (T_k - \lambda I)^{-1}, \dots\}. \quad (15)$$

Теперь отметим, что любое решение уравнения $l[v(x)] = 0$ имеет вид $v(x) = C \psi(x)$, где $\psi(x)$ — фиксированное решение, удовлетворяющее условию $\psi(0) = 1$, а C — некоторая константа. Обозначим через $\Omega_{(T-\lambda I)^{-1}}$ оператор, который каждому вектору A^λ из области значений оператора $(T-\lambda I)^{-1}$ сопоставляет число $v(0)$. Тогда, принимая во внимание равенство**

$$C = v(0) = \sum_1^{\infty} (T_k - \lambda I)_{a_k}^{-1},$$

где

$$(T_k - \lambda I)_{a_k}^{-1} = v_k = \frac{\rho_k}{a_k - \lambda} C \psi'(0) + \frac{a_k}{a_k - \lambda},$$

получим следующую формулу для оператора $\Omega_{(T-\lambda I)^{-1}}$:

$$\Omega_{(T-\lambda I)^{-1}} A^\lambda = \frac{\sum_1^{\infty} \frac{a_k}{a_k - \lambda}}{1 - \psi'(0)}. \quad (16)$$

Окончательно из формулы (16) вытекает, что решение задачи (14) задается вектором $V = [v(x), V^\lambda]$, где

$$v(x) = \Omega_{(T-\lambda I)^{-1}} A^\lambda \times \psi(x), \quad (17)$$

а

$$v_k = (T_k - \lambda I)_{a_k}^{-1} = \frac{\rho_k}{a_k - \lambda} \Omega_{(T-\lambda I)^{-1}} A^\lambda \times \psi'(0) + \frac{a_k}{a_k - \lambda}, \quad k = 1, 2, \dots \quad (18)$$

Отметим также, что формулы (15) и (18) вместе задают резольвенту оператора T .

В дальнейшем нам понадобятся оценки операторов $(R - \lambda I)^{-1}$, $(T - \lambda I)^{-1}$ и $\Omega_{(T-\lambda I)^{-1}}$ при достаточно больших $|\lambda|$ вне любого сколь угодно малого угла, содержащего положительную полуось в качестве биссектрисы.

* В дальнейшем мы увидим, что спектр оператора T дискретный, отсюда и будет следовать существование регулярной точки λ .

** Оно следует из формулы (15) и из определения оператора T .

Оценим сначала функцию $\theta(\lambda)$. Для любого $\varepsilon > 0$ обозначим через Φ_ε угол на комплексной λ -плоскости, задаваемый неравенством $|\arg \lambda| < \varepsilon$. Докажем, что для произвольного $\varepsilon > 0$ вне угла Φ_ε и при достаточно больших $|\lambda|$ имеет место оценка сверху:

$$|\theta(\lambda)| \leq \frac{C}{|\lambda|},$$

где C — некоторая положительная константа.

Из условия b° следует, что для $\frac{\varepsilon}{2}$ можно подобрать такое $N_1 > 0$, что все α_k с номерами ($k = N_1 + 1, N_2 + 2, \dots$) будут лежать внутри угла $|\arg \lambda| < \frac{\varepsilon}{2}$. А так как $\sum_1^\infty |\rho_k|$ сходится, то найдется и

$N_2 > 0$ такое, что $\sum_{N_1+1}^\infty |\rho_k| < \sin \frac{\varepsilon}{4}$. Пусть теперь $N = \max\{N_1, N_2\}$,

тогда

$$|\theta(\lambda)| \leq \frac{1}{|\lambda|} \left\{ \sum_1^N \frac{|\rho_k|}{\left| \frac{\alpha_k}{|\lambda|} - e^{i \arg \lambda} \right|} + \sum_{N+1}^\infty \frac{|\rho_k|}{\left| \frac{\alpha_k}{|\lambda|} - e^{i \arg \lambda} \right|} \right\} = \frac{1}{|\lambda|} (M_1 + M_2). \quad (19)$$

Из выбора N для M_2 следует оценка

$$M_2 \leq \frac{1}{\inf_k \left| \frac{\alpha_k}{|\lambda|} - e^{i \arg \lambda} \right|} \sum_{N+1}^\infty |\rho_k| \leq \frac{1}{\sin \frac{\varepsilon}{4}} \sum_{N+1}^\infty |\rho_k| < 1.$$

С другой стороны, при $|\lambda|$ достаточно больших M_2 будет меньше или равно некоторой константе. Соединяя оценки для M_1 и M_2 , получаем нужную нам оценку сверху.

Чтобы получить для $\theta(\lambda)$ оценку снизу, напишем следующее неравенство:

$$|\theta(\lambda)| \geq \left| \left| \sum_1^N \frac{\rho_k}{\alpha_k - \lambda} - \left| \sum_{N+1}^\infty \frac{\rho_k}{\alpha_k - \lambda} \right| \right| = |Q_1 - Q_2|, \quad (20)$$

где N определяется условиями: $\sum_{N_1+1}^\infty |\rho_k| < \varepsilon \sin \frac{\varepsilon}{4}$ и $N = \max\{N_1, N_2\}$.

Оценивая Q_2 так же как и M_2 , получим

$$Q_2 \leq \frac{1}{|\lambda|} \sum_{N+1}^\infty \frac{|\rho_k|}{\left| \frac{\alpha_k}{|\lambda|} - e^{i \arg \lambda} \right|} \leq \frac{1}{|\lambda|} \frac{1}{\inf_k \left| \frac{\alpha_k}{|\lambda|} - e^{i \arg \lambda} \right|} \sum_{N+1}^\infty |\rho_k| < \frac{\varepsilon}{|\lambda|}.$$

А из представления Q_1 следует, что для любого $C' > \varepsilon$ всегда найдется такое $C'' > 0$, что при $|\lambda| > C''$ будем иметь неравенство:

$$Q_1 > \frac{C'}{|\lambda|}.$$

Поэтому (20) можно продолжить следующим образом:

$$|Q(\lambda)| \geq |Q_1 - Q_2| \geq \frac{C'}{|\lambda|} - \frac{\varepsilon}{|\lambda|} = \frac{C_2}{|\lambda|},$$

где $C_2 = C' - \varepsilon$. Из этой оценки, принимая во внимание еще оценку сверху, получим, что при больших $|\lambda|$ и для любого сколь угодно малого $\varepsilon > 0$, вне угла Φ_1 выполняется оценка

$$|Q(\lambda)| = O\left(\frac{1}{|\lambda|}\right). \quad (21)$$

Далее, чтобы оценить резольвенту самосопряженного оператора R , заметим, что из интегрального представления (учитывая приведенные в пункте 3 некоторые результаты) следует аналогичное (3) представление для $(R - \lambda I)^{-1}$

$$(R - \lambda I)^{-1} = \sum_1^{\infty} \frac{\Delta_k}{\lambda_k - \lambda},$$

где $\lambda_k \geq 0$ — собственные значения оператора R , а $\Delta_k \geq 0$ — скачки спектральной функции. Поэтому дословно повторяя рассуждения, примененные при получении (21), можно показать, что вне любого сколь угодно малого угла Φ_2 и при достаточно больших $|\lambda|$ имеет место оценка

$$\|(R - \lambda I)^{-1}\| = O\left(\frac{1}{|\lambda|}\right). \quad (22)$$

А для оценки оператора $\mathcal{Q}_{(T-\lambda I)^{-1}}$ нужно воспользоваться формулой (16) и оценкой (21). Тогда при достаточно больших $|\lambda|$ и для любого сколь угодно малого $\varepsilon > 0$ вне угла Φ_1 можно написать равенство

$$\mathcal{Q}_{(T-\lambda I)^{-1}} \mathbf{A}^\lambda = \sum_1^{\infty} \frac{a_k}{a_k - \lambda} \left[I + O\left(\frac{1}{|\lambda|}\right) \right]. \quad (23)$$

Но так как выражение $\sum_1^{\infty} \frac{a_k}{a_k - \lambda}$ можно оценить аналогично $\theta(\lambda)$, то из (23) сразу получим оценку

$$\|\mathcal{Q}_{(T-\lambda I)^{-1}\| = O\left(\frac{1}{|\lambda|}\right). \quad (24)$$

Заметим, что при $\lambda < 0$ достаточно больших из представления (23) также вытекает ядерность оператора $\mathcal{Q}_{(T-\lambda I)^{-1}$. Действительно, обозначим через T_{a_k} ($k=1, 2, \dots$) оператор умножения k -ой компоненты вектора на число a_k . Тогда формула (23) перепишется так:

$$\mathcal{Q}_{(T-\lambda I)^{-1}} \mathbf{A}^\lambda = \left[I + O\left(\frac{1}{|\lambda|}\right) \right] \sum_1^{\infty} (T_{a_k} - \lambda I)^{-1},$$

откуда, учитывая аддитивность и непрерывность операции взятия следа, получим

$$\begin{aligned} \text{Sp } \Omega_{(T-\lambda I)^{-1}} &= \sum_1^{\infty} \text{Sp} \left\{ \left\| I + O\left(\frac{1}{-\lambda}\right) \right\| (T_{\alpha_k} - \lambda I)^{-1} \right\} \leq \\ &\leq C \sum_1^{\infty} \|(T_{\alpha_k} - \lambda I)^{-1}\|_1, \end{aligned}$$

где $\|\cdot\|_1$ — ядерная норма (см. [7], стр. 135). Теперь, принимая во внимание, что $\frac{1}{|\alpha_k - i|}$ ($k = 1, 2, \dots$) являются S -числами оператора $(T_{\alpha_k} - \lambda I)^{-1}$, из верхнего неравенства вытекает, что $\Omega_{(T-\lambda I)^{-1}}$ — ядерный оператор при $\lambda < 0$ достаточно больших*.

Далее заметим, что из формул (18) и (23) следует, что оператор $(T - \lambda I)^{-1}$ при $\lambda < 0$ достаточно больших допускает представление

$$(T - \lambda I)^{-1} = (T_{\alpha} - \lambda I)^{-1} \left\| I + O\left(\frac{1}{-\lambda}\right) \right\|, \quad (25)$$

где $T_{\alpha} = \{T_{\alpha_1}, T_{\alpha_2}, \dots, T_{\alpha_k}, \dots\}$.

Из определения матричного следа (см. [7], стр. 125) и из представления (25) легко вывести, что при $\lambda < 0$ достаточно больших оператор $(T - \lambda I)^{-1}$ — ядерный**.

4°. Построение резольвенты оператора L . Вернемся к задаче (10). Ее решение будем искать в виде суммы

$$Y = Z + V,$$

где $Z = \{z(x), 0, 0, \dots, 0, \dots\}$ и $V = \{v(x), v_1, v_2, \dots, v_k, \dots\}$.

Здесь $z(x)$ и V соответственно решения задач (11) и (14). Подставив Y в (10), получим равенства***:

$$\begin{cases} f(x) = g(x) - \lambda v(x) \\ F^{\lambda} = A^{\lambda} - K_p \gamma_1 z(x) \end{cases}$$

где $K_p \gamma_1 z(x) = \{\rho_1 z'(0), \rho_2 z'(0), \dots, \rho_k z'(0), \dots\}$.

С помощью введенных в пункте 3° операторов эти равенства можно переписать в виде

$$\begin{cases} f(x) = g(x) - \lambda \Omega_{(T-\lambda I)^{-1}} A^{\lambda} \times \psi(x) \\ F^{\lambda} = A^{\lambda} - K_p \gamma_1 (R - \lambda I)^{-1} g(x) \end{cases} \quad (26)$$

Чтобы решить систему (26) относительно $g(x)$ и A^{λ} , подставим выражение $g(x)$ из первого уравнения во второе, получим

$$F^{\lambda} = A^{\lambda} - K_p \gamma_1 (R - \lambda I)^{-1} f(x) - K_p \gamma_1 (R - \lambda I)^{-1} \Omega_{(T-\lambda I)^{-1}} A^{\lambda} \times \psi(x).$$

* Сходимость ряда $\sum_1^{\infty} \frac{1}{\alpha_k - \lambda}$ вытекает из условия б°, в силу следствия из леммы 2 (см. п. 5).

** См. предельное соотношение (31).

*** Легко видеть, что D_R и D_T входят в D_L .

Отсюда, учитывая ограниченность операторов K_p , γ_1 и оценки (22), (24), можно показать, что при достаточно больших $|\lambda|$ и вне угла Φ , имеет место представление

$$F^\lambda = A^\lambda - O\left(\frac{1}{|\lambda|}\right) f(x) - O\left(\frac{1}{|\lambda|}\right) A^\lambda.$$

Следовательно

$$A^\lambda = F^\lambda + O\left(\frac{1}{|\lambda|}\right) \{f(x), F^\lambda\}. \quad (27)$$

С помощью подстановки (27) в первое уравнение системы (26) находим $g(x)$:

$$g(x) = f(x) + \lambda \Omega_{(T-\lambda I)^{-1}} \times \psi(x) + O\left(\frac{1}{|\lambda|}\right) \{f(x), F^\lambda\}. \quad (28)$$

Соединяя (27) и (28), можно написать матричное равенство

$$\begin{pmatrix} g(x) \\ A^\lambda \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} I & \lambda \psi(x) \times \Omega_{(T-\lambda I)^{-1}} \\ 0 & I \end{pmatrix} \begin{pmatrix} f(x) \\ F^\lambda \end{pmatrix} + O\left(\frac{1}{|\lambda|}\right) \begin{pmatrix} f(x) \\ F^\lambda \end{pmatrix}. \quad (29)$$

С другой стороны, из того, что решение задачи (10) представлялось в виде суммы решений задач (11) и (14) вытекает, что

$$\begin{pmatrix} y(x) \\ Y^\lambda \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} (R-\lambda I)^{-1} & \psi(x) \times \Omega_{(T-\lambda I)^{-1}} \\ 0 & (T-\lambda I)^{-1} \end{pmatrix} \begin{pmatrix} g(x) \\ A^\lambda \end{pmatrix}.$$

Окончательно, принимая во внимание (29), из этого равенства следует, что резольвента оператора L допускает представление

$$\begin{aligned} & (L-\lambda I)^{-1} \begin{pmatrix} f(x) \\ F^\lambda \end{pmatrix} = \\ & = \begin{pmatrix} (R-\lambda I)^{-1} & (R-\lambda I)^{-1} \lambda \psi(x) \times \Omega_{(T-\lambda I)^{-1}} + \psi(x) \times \Omega_{(T-\lambda I)^{-1}} \\ 0 & (T-\lambda I)^{-1} \end{pmatrix} \times \\ & \times \begin{pmatrix} f(x) \\ F^\lambda \end{pmatrix} + O\left(\frac{1}{|\lambda|}\right) \begin{pmatrix} (R-\lambda I)^{-1} & \psi(x) \times \Omega_{(T-\lambda I)^{-1}} \\ 0 & (T-\lambda I)^{-1} \end{pmatrix}, \end{aligned} \quad (30)$$

при достаточно больших $|\lambda|$ и вне любого угла Φ .

5°. Некоторые вспомогательные леммы.

Лемма 2. Пусть $\{\nu_k\}_{k=1}^{\infty}$ — произвольные комплексные числа, удовлетворяющие условию: для любого $\varepsilon > 0$ все ν_k ($k=1, 2, \dots$) (кроме, быть может, конечного числа) лежат в угле Φ . Тогда имеет место предельное соотношение

$$\lim_{\substack{\lambda \rightarrow -\infty \\ \operatorname{Im} \lambda = 0}} \left\{ \frac{\sum_1^{\infty} \frac{1}{\nu_k - \lambda}}{\sum_1^{\infty} \frac{1}{|\nu_k| - \lambda}} \right\} = 1. \quad (31)$$

Доказательство. Из условия леммы следует, что для любого $\varepsilon > 0$ можно выбрать такое $N = N_\varepsilon > 0$, что все ν_k , $k = N, N+1, \dots$ лежат в угле $|\arg \nu| < \varepsilon$. Тогда

$$\left| \frac{v_k - i}{|v_k| - \lambda} - 1 \right| = \left| \frac{|v_k| \cos \frac{\varphi_k}{2} + i |v_k| \sin \frac{\varphi_k}{2} - |v_k|}{|v_k| - \lambda} \right| \ll$$

$$\leq \frac{|v_k| \left| \cos \frac{\varphi_k}{2} - 1 \right|}{|v_k| - \lambda} + \frac{|v_k| \sin \frac{\varphi_k}{2}}{|v_k| - \lambda},$$

где $\varphi_k = \arg v_k$ и по условию леммы $\varphi_k \rightarrow 0$ при $k \rightarrow \infty$. Известно, что для достаточно малого $\varepsilon > 0$ имеют место оценки

$$\left| \cos \frac{\varphi_k}{2} \right| = 1 + O\left(\left|\frac{\varphi_k}{2}\right|^2\right) \text{ и } \left| \sin \frac{\varphi_k}{2} \right| = \left|\frac{\varphi_k}{2}\right| + O\left(\left|\frac{\varphi_k}{2}\right|^3\right).$$

Поэтому из верхнего неравенства вытекает, что

$$\left| \frac{1}{v_k - \lambda} / \frac{1}{|v_k| - \lambda} - 1 \right| < \varepsilon.$$

Тогда при $\lambda < 0$ выполняется оценка

$$\left| \left\{ \sum_{k=N}^{\infty} \frac{1}{v_k - \lambda} / \sum_{k=N}^{\infty} \frac{1}{|v_k| - \lambda} \right\} - 1 \right| < \varepsilon. \quad (32)$$

При получении (32) мы воспользовались следующим неравенством: если для положительных чисел a_k и комплексных чисел b_k ($k=1, 2, \dots, n$) выполняются неравенства $\left| \frac{b_k}{a_k} \right| < \varepsilon$ ($k=1, 2, \dots, n$) для произвольного n , то

$$\left| \sum_{k=1}^n \frac{b_k}{a_k} \right| < \varepsilon.$$

С другой стороны, найдется такое C_1 , что при $-\lambda > C_1$ будем иметь

$$\left| \left\{ \sum_{k=1}^{N-1} \frac{1}{v_k - \lambda} / \sum_{k=1}^{N-1} \frac{1}{|v_k| - \lambda} \right\} - 1 \right| < \varepsilon.$$

Следовательно, при $-\lambda > C_1$ неравенство (32) будет иметь место и при замене N на 1. Лемма доказана.

Заметим, что используя неравенство

$$|v_k| \cos \varphi_k - \lambda - |v_k| \sin \varphi_k \leq |v_k - i| \leq |v_k| \cos \varphi_k - \lambda + |v_k| \sin \varphi_k,$$

где i и $\varphi_k = \arg v_k$, совершенно аналогично можно показать, что при выполнении условий леммы 2 имеет место предельное соотношение

$$\lim_{\substack{\lambda \rightarrow -\infty \\ \operatorname{Im} \lambda = 0}} \left\{ \sum_1^{\infty} \frac{1}{|v_k| - \lambda} / \sum_1^{\infty} \frac{1}{|v_k| - \lambda} \right\} = 1. \quad (33)$$

Легко доказать следующее утверждение.

Лемма 3. Пусть $H = H_1 \oplus H_2$ — прямая сумма гильбертовых пространств H_1 и H_2 . Рассмотрим в H матрицу от операторов

$$F = \begin{pmatrix} A & B \\ 0 & C \end{pmatrix},$$

где A и C — операторы, соответственно, в H_1 и H_2 , а B — из H_2 в H_1 . Тогда оператор F — ядерный в том и только в том случае, когда A , B и C ядерные. При этом имеет место равенство следов

$$\text{Sp } F = \text{Sp } A + \text{Sp } C.$$

Лемма 4. (см. [7], стр. 122). Если оператор $A \in \sigma_p$ ($p > 0$), то

$$\sum_{k=1}^{\infty} |\lambda_k(A)|^p \leq (\|A\|_p)^p,$$

знак равенства имеет место в том и только в том случае, когда оператор A нормален.

Из этой леммы, в частности, следует, что если $A \in \sigma_1$ и все его собственные числа неотрицательны, то

$$\text{Sp } A = \|A\|_1.$$

Наконец, нам понадобится также (см. [7], стр. 342)

Лемма 5. (Б. И. Коренблюм). Пусть $\varphi(t)$ и $\psi(t)$ ($0 \leq t < \infty$) — неубывающие функции, для которых при некоторых $p (> 0)$ конечны интегралы

$$\Phi(\lambda) = \int_0^{\infty} \frac{d\varphi(t)}{(t-\lambda)^p},$$

($\lambda \leq 0$)

$$\Psi(\lambda) = \int_0^{\infty} \frac{d\psi(t)}{(t-\lambda)^p}$$

и

$$\lim_{\lambda \rightarrow -\infty} \frac{\Psi(\lambda)}{\Phi(\lambda)} = 1.$$

Если при этом $\varphi(t) \rightarrow \infty$ при $t \rightarrow \infty$ и существует такая положительная константа $\gamma < p$, что для достаточно больших $t < S$

$$\frac{\varphi(S)}{\varphi(t)} \leq \left(\frac{S}{t}\right)^{\gamma},$$

то также

$$\lim_{t \rightarrow \infty} \frac{\psi(t)}{\varphi(t)} = 1.$$

6°. Окончательные результаты. Из представления (30) следует, что спектр оператора L дискретен, т. е. состоит только из с.з. При этом все, кроме, быть может, конечного числа, с.з. лежат в любом сколь угодно малом угле Φ_1 . Отсюда, в силу леммы 1, следует дискретность спектра задачи (1), (2).

Далее, учитывая ядерность операторов $(R - \lambda I)^{-1}$, $(T - \lambda I)^{-1}$ и $\psi(x) \times \mathcal{Q}_{(T - \lambda I)^{-1}}$ при $\lambda < 0$ достаточно больших, с помощью леммы 3 из того же представления (30) можно вывести равенство

$$\operatorname{Sp} (L - \lambda I)^{-1} = \{ \operatorname{Sp} (R - \lambda I)^{-1} + \operatorname{Sp} (T - \lambda I)^{-1} \} + \operatorname{Sp} \left\{ O \left(\frac{1}{-\lambda} \right) \times \right. \\ \left. \times [(R - \lambda I)^{-1} + (T - \lambda I)^{-1}] \right\}. \quad (34)$$

С помощью ядерной нормы второй член верхнего равенства оценивается следующим образом:

$$\operatorname{Sp} \left\{ O \left(\frac{1}{-\lambda} \right) [(R - \lambda I)^{-1} + (T - \lambda I)^{-1}] \right\} \leq \left\| O \left(\frac{1}{-\lambda} \right) \right\| \times \\ \times \{ \| (R - \lambda I)^{-1} \|_1 + \| (T - \lambda I)^{-1} \|_1 \}. \quad (35)$$

Заметим, что из результатов, приведенных в пункте 3, следует, что оператор R удовлетворяет условиям следствия из леммы 4. Поэтому имеет место равенство

$$\operatorname{Sp} (R - \lambda I)^{-1} = \| (R - \lambda I)^{-1} \|_1 \quad (36)$$

при больших $\lambda < 0$.

С другой стороны, так как $\operatorname{Sp} (T_0 - \lambda I)^{-1} = \sum_1^{\infty} \frac{1}{x_k - \lambda}$ и x_k ($k = 1, 2, \dots$) удовлетворяют условиям леммы 2, то учитывая соотношения (31) и (33) из представления (25) можно вывести, что при $\lambda < 0$ достаточно больших имеют место неравенства

$$\operatorname{Sp} (T - \lambda I)^{-1} \leq \| (T - \lambda I)^{-1} \|_1 \leq C' \| (T_0 - \lambda I)^{-1} \|_1 = C' \sum_1^{\infty} \frac{1}{|x_k - \lambda|} < \\ \leq C'' \operatorname{Sp} (T_0 - \lambda I)^{-1}. \quad (37)$$

Теперь, учитывая (36) и (37), из неравенства (35) получаем, что

$$\operatorname{Sp} \left\{ O \left(\frac{1}{-\lambda} \right) [(R - \lambda I)^{-1} + (T - \lambda I)^{-1}] \right\} \leq O \left(\frac{1}{-\lambda} \right) \times \\ \times \{ \operatorname{Sp} (R - \lambda I)^{-1} + \operatorname{Sp} (T_0 - \lambda I)^{-1} \}. \quad (38)$$

Далее, принимая во внимание равенство

$$\operatorname{Sp} (T - \lambda I)^{-1} = \operatorname{Sp} (T_0 - \lambda I)^{-1} + \operatorname{Sp} \left[O \left(\frac{1}{-\lambda} \right) (T_0 - \lambda I)^{-1} \right],$$

которое имеет место в силу представления (25), из (34) с помощью неравенства (38) получаем следующий результат.

Лемма 6. При выполнении условий 1°–4° и 6° имеет место предельное соотношение

$$\lim_{\substack{\lambda \rightarrow -\infty \\ \operatorname{Im} \lambda = 0}} \{ \operatorname{Sp} (L - \lambda I)^{-1} / \operatorname{Sp} (R - \lambda I)^{-1} + \operatorname{Sp} (T_0 - \lambda I)^{-1} \} = 1.$$

Теперь сформулируем основной результат работы.

Теорема 1. При выполнении условий 1°–6° спектр задачи (1), (2) дискретен и (быть может, за исключением конечного чис-

ла) лежит в сколь угодно малом угле, а формула распределения собственных значений $N(\lambda)$ имеет асимптотику

$$N(\lambda) \sim \frac{1}{2\pi} \int_{q(x) < \lambda} \sqrt{\lambda - q(x)} dx + N_0(\lambda), \quad (39)$$

где $N(\lambda) = \sum_{|\lambda_j| < \lambda} 1$, λ_j — с.з. задачи (1), (2), а $N_0(\lambda) = \sum_{|\alpha_j| < \lambda} 1$, α_j — полюсы функции $\theta(\lambda)$.

Доказательство. Из леммы 2 вытекает формула

$$\text{Sp}(T_\lambda - iI)^{-1} \sim \int_0^\infty \frac{dN_0(t)}{t - \lambda} \quad (40)$$

при $\lambda < 0$ достаточно больших.

А так как

$$\int_0^\infty \frac{dN(L, t)}{t - \lambda} = \sum_j \frac{1}{|\lambda_j(L)| - \lambda},$$

то из леммы 6, принимая во внимание (12), (40) и лемму 2, получим

$$\lim_{\substack{\lambda \rightarrow -\infty \\ \text{Im } \lambda = 0}} \left\{ \int_0^\infty \frac{dN(L, t)}{t - \lambda} / \int_0^\infty \frac{d[N(R, t) + N_0(t)]}{t - \lambda} \right\} = 1. \quad (41)$$

Далее предположим, что $N_0(t)$ удовлетворяет следующему тауберовому условию (см. [7], стр. 343): существует такая неубывающая функция $\varphi(t)$ ($0 \leq t < \infty$), что выполняются условия:

- 1) $\varphi(t) \rightarrow \infty$ при $t \rightarrow \infty$;
- 2) при некотором $\gamma < 0$ для достаточно больших $t < s$ выполняется неравенство

$$\frac{\varphi(s)}{\varphi(t)} \leq \left(\frac{s}{t}\right)^\gamma;$$

$$3) \lim_{t \rightarrow \infty} \frac{N_0(t)}{\varphi(t)} = 1.$$

Тогда из соотношения (41) с помощью леммы 5 будет следовать, что

$$N(L, t) \sim N(R, t) + N_0(t).$$

Отсюда, учитывая формулу (13) и лемму 1, получаем (39).

Теорема доказана.

Замечание 1. На самом деле вместо условия 4 можно было потребовать просто, чтобы $q(x) \geq cx^2$. В этом случае резольвенту можно оценить, используя параболическое уравнение

$$\frac{\partial u}{\partial t} = \frac{\partial^2 u}{\partial t^2} + \gamma u.$$

Замечание 2. В условии 6° вместо $\sum_1^{\infty} \frac{1}{|x_n|} < \infty$ можно было потребовать, чтобы сходилась сумма $\sum_1^{\infty} \frac{1}{|x_n|^p}$, где $p > 0$ — любое целое число. Тогда вместо оператора $(L - \lambda I)^{-1}$ нужно рассмотреть оператор $(L - \lambda I)^{-p}$.

В заключение автор приносит глубокую благодарность А. Г. Костюченко за постановку задачи и внимание при выполнении работы.

Московский государственный университет
им. М. В. Ломоносова

Поступила 17.II.1977

Վ. Հ. ԱՎԱԿԻԱՆ. Շտուրմ-Լիուվիլի խնդիրը λ սպեկտրայի պարամետրով եզրային պայմանի մեջ (ամփոփում)

Այս աշխատությունում դիտարկվում է Շտուրմ-Լիուվիլի խնդիրը դրական կիսաառանցիկ վրա. ենթադրվում է, որ սպեկտրայի պարամետրը մտնում է նաև եզրային պայմանի մեջ: Այսպես $y(0) - \theta(\lambda) y'(0) = 0$ որտեղ $\theta(\lambda)$ -ն ինչ-որ մերոմորֆ ֆունկցիա է, որը բավարարում է 6° պայմանին:

Ցույց է տրված, որ երբ $q(x)$ պոտենցիալը և $\theta(\lambda)$ ֆունկցիան բավարարում են 1°-5° պայմաններին, (1), (2) խնդիրը ունի միայն դիսկրետ սպեկտր և սեփական արժեքների բաշխման ֆունկցիան տրվում է հետևյալ բանաձևով:

$$N(\lambda) = \sum_{\lambda_j < \lambda} 1 \sim \frac{1}{2\pi} \int_{q(x) < \lambda} \sqrt{\lambda - q(x)} dx + N_0(\lambda), \text{ երբ } \lambda \rightarrow +\infty:$$

V. A. AVAKIAN. *The Sturm-Liouville problem with spectral parameter in the boundary condition (summary)*

The paper deals with the Sturm-Liouville problem on the positive semi-axis. It is assumed that the spectral parameter also enters into the boundary condition, namely $y(0) - \theta(\lambda) y'(0) = 0$, where $\theta(\lambda)$ is some meromorphic function, which satisfies condition 6°. Under conditions 1°-5° on potential $q(x)$ and the function $\theta(\lambda)$ it is proved that the (1), (2) problem has purely discrete spectrum and the eigenvalue distribution function is given by formula

$$N(\lambda) = \sum_{\lambda_j < \lambda} 1 \sim \frac{1}{2\pi} \int_{q(x) < \lambda} \sqrt{\lambda - q(x)} dx + N_0(\lambda), \text{ when } \lambda \rightarrow +\infty.$$

Л И Т Е Р А Т У Р А

1. Э. Ч. Титчмарш. Разложение по собственным функциям, связанное с дифференциальными уравнениями второго порядка, т. 1, М., ИИЛ, 1960.
2. Б. М. Левитан, И. С. Сарисян. Введение в спектральную теорию. М., Изд. "Наука", 1970.
3. А. Г. Костюченко. Докторская диссертация, МГУ, 1966.
4. А. Н. Кожанников. Об асимптотике собственных значений эллиптической краевой задачи с λ в уравнении и в граничном условии, УМН, 31, вып. 4 (190), 1976, 265-266.

5. Н. И. Ахиезер, И. М. Глязман. Теория линейных операторов в гильбертовом пространстве, М., Изд. „Наука“, 1966.
6. J. Odhnoff. Operators generated by differential problems with eigenvalue parameter in equation and boundary condition, Medd. Lunds Univ. Matem. Sem., 1959, 1–80.
7. И. Ц. Гохберг, М. Г. Крейн. Введение в теорию линейных несамопрямых операторов, М., Изд. „Наука“, 1965.
8. J. Walter. Regular Eigenvalue problems with Eigenvalue parameter in the boundary condition, Math. Z., 1, 33, № 4, 1973, 301–312.