

# Lista 9 de Análise Funcional - Doutorado 2018

Professor Marcos Leandro

2 de Julho de 2018

1. Prove que o operador  $T : \ell^p \rightarrow \ell^p, 1 \leq p < \infty$ , definido por

$$T(\xi_1, \xi_2, \xi_3, \dots) := \left( \xi_1, \frac{\xi_2}{2}, \frac{\xi_3}{3}, \dots \right) \quad (1)$$

é um operador compacto.

**Solution:** Mostraremos que  $T$  é limite de operadores compactos em  $\mathcal{L}(\ell^p)$ . Como sabemos que  $\mathcal{K}(\ell^p)$  é fechado em  $\mathcal{L}(\ell^p)$ , teremos que  $T \in \mathcal{K}(\ell^p)$ .

Para cada  $n \in \mathbb{N}$ , ponha

$$T_n : \ell^p \longrightarrow \ell^p \\ (\xi_1, \xi_2, \dots) \longmapsto \left( \xi_1, \frac{\xi_2}{2}, \dots, \frac{\xi_n}{n}, 0, 0, \dots \right).$$

Claramente  $T_n$  é linear, contínuo ( $\|T_n(\xi)\|_p \leq \|\xi\|_p$ ), e como sua imagem é gerada pelos vetores canônicos  $e_1, \dots, e_n$ , segue que tem posto finito. Portanto,

$$\{T_n\}_{n \in \mathbb{N}} \subset \mathcal{K}(\ell^p).$$

Ademais,

$$\begin{aligned} \|(T_n - T)\xi\|_p^p &= \sum_{j \geq n+1} \frac{1}{j^p} |\xi_j|^p \\ &\leq \frac{1}{(n+1)^p} \sum_{j=n+1} |\xi_j|^p \\ &\leq \frac{1}{(n+1)^p} \|\xi\|_p^p \\ \therefore \|T_n - T\|_{\mathcal{L}(\ell^p)} &\leq \frac{1}{n+1}, \end{aligned}$$

o que nos dá  $T = T_n - (T_n - T) \in \mathcal{L}(\ell^p)$  e que  $T_n \xrightarrow{n \rightarrow \infty} T$  em  $\mathcal{L}(\ell^p)$ .

**Observação:** Note que uma simples adaptação da prova acima mostra que se  $\{\lambda_n\}_{n \in \mathbb{N}}$  é uma sequência de escalares que converge para zero, então o operador  $T : \ell^p \rightarrow \ell^p$  dado por

$$T(\xi_1, \xi_2, \xi_3, \dots) = (\lambda_1 \xi_1, \lambda_2 \xi_2, \lambda_3 \xi_3, \dots)$$

é compacto.

2. Sejam  $E$  e  $F$  espaços normados e  $T \in \mathcal{L}(E, F)$  um operador de posto finito. Prove que  $T$  é compacto.

**Solution:** Seja  $(x_n)$  uma sequência limitada em  $E$ . Por hipótese,  $T \in \mathcal{L}(E, F)$ , segue que  $(T(x_n))$  é limitada. Como  $T$  possui posto finito, por definição, têm-se que  $\dim(T(E)) < \infty$ . Como em espaços de dimensão finita toda sequência limitada possui subsequência convergente,

segue que, a sequência  $(T(x_n))$  possui subsequência convergente. Pelo critério de compacidade (Veja Kreyszig, pg.407) segue que  $T$  é compacta.

**Critério de Compacidade:** Sejam  $E$  e  $F$  espaços normados,  $T : E \rightarrow F$  um operador linear. Então  $T$  é compacto, se e somente se, a imagem por  $T$  de qualquer sequência limitada  $(x_n)$  em  $E$  sobre  $F$  é uma sequência  $T(x_n)$  que possui subsequência convergente.

3. Sejam  $H$  um espaço de Hilbert separável,  $(e_n)_{n=1}^{\infty}$  uma base ortonormal e  $P_N : H \rightarrow H$  definido por

$$P_N(u) := \sum_{n=1}^N (u, e_n) e_n.$$

Calcule  $\lim_{N \rightarrow \infty} P_N(u)$  e prove que o operador obtido por este limite não é compacto. Isso contradiz o fato de  $\mathcal{K}(H)$  ser um subespaço fechado de  $\mathcal{L}(H)$ .

**Solution:** Temos que

$$P_N(u) = \sum_{n=1}^N (u, e_n) e_n$$

é uma soma que considera finitas entradas não nulas de  $u$ , para cada  $u \in H$ . Assim,

$$\lim_{N \rightarrow \infty} P_N(u) = \lim_{N \rightarrow \infty} \sum_{n=1}^N (u, e_n) e_n = \sum_{n=1}^{\infty} (u, e_n) e_n = u,$$

onde a última igualdade segue do Corolário 5.10 (Brezis). Assim, vemos que o operador obtido por este limite é o operador identidade,

$$Id(u) = \lim_{N \rightarrow \infty} P_N(u) = u, \quad \forall u \in H.$$

Mostremos que este operador não é compacto. De fato, a bola unitária fechada

$$B_H = \{x \in H; \|x\| \leq 1\}$$

é limitada. Como  $(e_n)_{n=1}^{\infty}$  é base para  $H$ , vemos que  $\dim H = \infty$ . Então, pelo Teorema de Riesz (ver Brezis),  $B_H$  não pode ser compacta. Logo,

$$Id(B_H) = B_H = \overline{B_H},$$

o que mostra que  $Id(B_H)$  não é relativamente compacto.

**Observação:** Os operadores  $P_N$  convergem pontualmente para o operador identidade, mas não convergem uniformemente. Isso mostra que a convergência uniforme é fundamental para que o operador limite seja um operador compacto, como garante o Teorema 6.1 (Brezis).

**Corolário 5.10:** Seja  $(e_n)$  uma base ortonormal. Então para todo  $u \in H$ , nós temos

$$u = \sum_{k=1}^{\infty} (u, e_k) e_k,$$

isto é,

$$u = \lim_{n \rightarrow \infty} \sum_{k=1}^n (u, e_k) e_k$$

e

$$\|u\|^2 = \sum_{k=1}^{\infty} |(u, e_k)|^2.$$

**Teorema de Riesz:** Seja  $E$  um espaço vetorial normado com  $B_E$  compacta. Então  $E$  tem dimensão finita.

**Teorema 6.1:** O conjunto  $\mathcal{K}(E, F)$  é um subespaço linear fechado de  $\mathcal{L}(E, F)$  (na topologia associada à norma  $\|\cdot\|_{\mathcal{L}(E, F)}$ ).

4. Prove que os seguintes operadores são compactos:

- (i)  $T : C([a, b]) \rightarrow C([a, b])$  e  $K : C([a, b]^2) \rightarrow \mathbb{R}$ ;
- (ii)  $T : L^2([a, b]) \rightarrow L^2([a, b])$  e  $K : C([a, b]^2) \rightarrow \mathbb{R}$ ;
- (ii)  $T : L^2([a, b]) \rightarrow L^2([a, b])$  e  $K : L^2([a, b]^2) \rightarrow \mathbb{R}$ .

Onde

$$(Tu)(t) := \int_a^b K(t, s)u(s)ds.$$

**Solution:** Para solução do item (i), utilizaremos o seguinte Teorema

**Teorema (Ascoli-Arzelà)** Seja  $K$  um espaço métrico e  $\Xi$  um subconjunto limitado de  $C(K)$ . Assuma que  $\Xi$  é uniformemente equicontínuo, isto é,

$$\forall \varepsilon > 0 \exists \delta > 0 ; d(x, y) < \delta \Rightarrow |f(x) - f(y)| < \varepsilon \quad \forall f \in \Xi$$

Então o fecho de  $\Xi$  em  $C(K)$  é compacto.

**Solução do item (i):** Denote por  $Q = [a, b] \times [a, b]$ . Como  $K$  é uma função de duas variáveis contínua, temos que  $M := \max_{(t,s) \in Q} |K(t, s)| < \infty$ . Logo,  $\|T(u)\|_\infty \leq M(b-a)\|u\|_\infty$ , ou seja,  $\|T\| \leq M(b-a)$  e, portanto, o operador  $T$  é limitado.

Agora, para  $u \in B[0, 1] = \{f : [a, b] \rightarrow \mathbb{R} \in C([a, b]); \|f\|_\infty \leq 1\}$ , vale  $\|T(u)\|_\infty \leq M(b-a)$ . Assim, para bola fechada de raio 1 em  $C[a, b]$ , temos que a imagem por  $T$  é limitada. Basta portanto mostrarmos que  $T(B[0, 1])$  é equicontínuo, pois, nesse caso obtemos que o operador  $T$  é compacto pelo teorema de Ascole. Dito isso, observe que  $K$  sendo uniformemente contínuo (pois  $K$  é contínuo em um compacto), temos que, dado  $\varepsilon > 0$  existe  $\delta > 0$  tal que  $|K(t, s) - K(r, s)| < \varepsilon$  se  $|t - r| < \delta$  (independente de  $s$ ). Assim, se  $u \in B[0, 1]$  e  $|t - s| < \delta$ ,

$$|(Tu)(t) - (Tu)(r)| \leq \int_a^b |K(t, s) - K(r, s)| |u(s)| ds \leq \varepsilon(b-a)\|u\|_\infty \leq \varepsilon(b-a)$$

Logo,  $T(B[0, 1])$  é equicontínuo. Portanto, pelo Teorema de Ascoli-Arzelá,  $T$  é compacto.

**Solução do item (ii):** Denote por  $Q = [a, b] \times [a, b]$ . Como  $K$  é uma função de duas variáveis contínua, temos que  $M := \max_{(t,s) \in Q} |K(t, s)| < \infty$ . Além disso, sendo  $K$  contínua, temos que, fixando  $t \in [a, b]$  a função  $s \mapsto K(t, s)$  é um elemento de  $L^2[a, b]$ . Agora, para todo  $t \in [a, b]$  tem-se

$$|(Tu)(t)| \leq \int_a^b |K(t, s)| |u(s)| ds \stackrel{\text{Holder}}{\leq} \left( \int_a^b |K(t, s)|^2 ds \right)^{\frac{1}{2}} \|u\|_2 \leq M\sqrt{(b-a)}\|u\|_2$$

Disso, obtemos que o operador  $T$  é contínuo. Além disso, se  $u \in B[0, 1] = \{f : [a, b] \rightarrow \mathbb{R} \in L^2[a, b]; \|f\|_2 \leq 1\}$ , temos que  $\|T(u)\|_\infty \leq M\sqrt{(b-a)}$ . Logo  $T(B[0, 1])$  é limitada. Agora veremos que  $T(B[0, 1])$  é equicontínuo. Observe que  $K$  sendo uniformemente contínuo (pois  $K$  é contínuo em um compacto), temos que, dado  $\varepsilon > 0$  existe  $\delta > 0$  tal que  $|K(t, s) - K(r, s)| < \varepsilon$  se  $|t - r| < \delta$  (independente de  $s$ ). Assim, se  $u \in B[0, 1]$  e  $|t - s| < \delta$ , então

$$|(Tu)(t) - (Tu)(r)| \leq \|K(t, s) - K(r, s)\|_2 \|u\|_2 \leq \varepsilon\sqrt{(b-a)}$$

Logo, pelo Teorema de Ascoli-Arzelá, temos que  $T(B[0, 1])$  é precompacto em  $C[a, b]$ . Agora, temos que mostrar que  $T(B[0, 1])$  é precompacto em  $L^2[a, b]$ .

Observe que a inclusão  $I : (C[a, b], \|\cdot\|_\infty) \rightarrow (L^2[a, b], \|\cdot\|_2)$  é contínua. Assim, um conjunto precompacto em  $C[a, b]$  é precompacto em  $L^2[a, b]$ . De fato, considere  $A \subset C[a, b]$  precompacto, logo  $\bar{A}$  é compacto, e pela continuidade de  $I$ , temos que  $I(\bar{A})$  é compacto em  $L^2[a, b]$ . Em

particular,  $I(\overline{A})$  é fechado em  $L^2[a, b]$ . Como  $I(A) \subset I(\overline{A})$ , segue-se que  $\overline{I(A)} \subset I(\overline{A})$  e portanto  $I(\overline{A})$  é compacto.

Assim, temos que  $T(B[0, 1])$  é um conjunto precompacto em  $L^2[a, b]$  e isso conclui que  $T$  é compacto.

**Solução do item (iii):** Denote por  $Q = [a, b] \times [a, b]$ . Como  $K \in L^2(Q)$  e o conjunto das funções contínuas em  $Q$  é denso em  $L^2(Q)$ , existe uma sequência  $K_n : Q \rightarrow \mathbb{R}$  de funções contínuas de modo que  $\|K - K_n\|_{L^2(Q)} \rightarrow 0$ . Assim, definindo  $T_n : L^2[a, b] \rightarrow L^2[a, b]$ , por

$$(T_n u)(t) = \int_a^b K_n(t, s)u(s)ds$$

e usando estimativas como acima, obtemos

$$\|T_n u - T u\|_2 \leq \|K_n - K\|_{L^2(Q)} \|u\|_2$$

e logo

$$\|T_n - T\| \leq \|K_n - K\|_{L^2(Q)}$$

o qual se anula para  $n \rightarrow \infty$ . Pelo item (ii), temos que cada  $T_n$  é um operador compacto e como  $T$  é um operador linear contínuo, temos pelo (Teorema 6.1 Brezis) que  $T$  é compacto.

5. Sejam  $E$  e  $F$  espaços normados. Prove que  $T \in \mathcal{K}(E, F)$  se, e somente se,  $T^* \in \mathcal{K}(F^*, E^*)$ .

**Solution:**

$\Rightarrow$ ) Suponhamos que  $T \in \mathcal{K}(E, F)$ . Sabemos que  $T^* \in \mathcal{K}(F^*, E^*)$  se, e só se,  $(T^* f_n) \subset F^*$  possui subsequência convergente para toda  $(f_n) \subset F^*$  limitada.

Assim, seja  $(f_n) \subset F^*$  tal que  $\|f_n\| \leq 1, \forall n \in \mathbb{N}$ . Vamos denotar o compacto  $\overline{T(B_E)} = K$ . Seja  $H \subset C(K)$ , definida por

$$H = \phi : K \rightarrow \mathbb{R}; \phi_n(y) = F_n(y), \forall n \in \mathbb{N}$$

Vamos mostrar que  $\overline{H}$  é compacto.

a)  $H$  é equicontínuo: de fato, para quaisquer  $x, y \in K$  tal que  $\|x - y\| < \varepsilon$ , temos que

$$|\phi_n(x) - \phi_n(y)| = |f_n(x) - f_n(y)| = |f_n(x - y)| \leq \|f_n\| \|x - y\| < \varepsilon, \forall \phi_n \in H.$$

b)  $H$  é limitado: de fato,  $\forall x \in K$ , temos

$$|\phi_n(x)| = |f_n(x)| \leq \|f_n\| \|x\| \leq \|x\|.$$

Como  $x \in \overline{T(B_E)}$ , que é compacto, temos que  $\exists M > 0$  tal que  $\|x\| \leq M, \forall x \in \overline{T(B_E)}$ . Portanto,  $|\phi_n(x)| \leq M, \forall x \in K, \forall \phi_n \in H$ .

Assim, pelo teorema de Ascoli-Arzelà,  $\overline{H}$  é compacto. Logo, existe  $(\phi_{n_j}) \subset (\phi_n)$  e  $\phi \in \overline{H}$  tal que  $\|\phi_{n_j} - \phi\|_\infty \rightarrow 0$  se  $j \rightarrow \infty$ , isto é, particularmente para  $x = Tu$ ,

$$\sup_{u \in B_E} |f_{n_j}(Tu) - \phi(x)| \rightarrow 0,$$

pois  $T(B_E) \subset K$ .

Logo,  $(\phi_{n_j})$  é convergente e, assim, é de Cauchy. Daí,

$$\sup_{u \in B_E} |f_{n_j}(Tu) - f_{n_i}(Tu)| \rightarrow 0,$$

ou seja,

$$\|T^* f_{n_j} - T^* f_{n_i}\|_{E^*} = \sup_{u \in B_E} |T^* f_{n_j}(u) - T^* f_{n_i}(u)| \rightarrow 0.$$

Logo,  $(T^* f_{n_j})$  é de Cauchy em  $E^*$  e, assim  $(T^* f_{n_j})$  é convergente (pois  $E^*$  é Banach). Portanto, concluímos que  $T^* \in \mathcal{K}(F^*, E^*)$ .

$\Leftarrow$ ) Reciprocamente, suponhamos que  $T^* \in \mathcal{K}(F^*, E^*)$  e mostremos que  $T \in \mathcal{K}(E, F)$ . Pelo que já vimos,  $T^{**} \in \mathcal{K}(E^{**}, F^{**})$ .

**Afirmção:**  $T^{**}(J_E(B_E)) = J_F(T(B_E))$

De fato,  $\forall y \in F^*$  e  $x \in B_E$ , vale que

$$\langle T^{**}(J_E x), y \rangle = \langle J_E x, T^* y \rangle = \langle T^* y, x \rangle = \langle y, T x \rangle = \langle J_F(T x), y \rangle$$

Logo, na bola  $B_E$ , temos  $T^{**} J_E = J_F T$ , e a afirmação está demonstrada.

Pela afirmação, temos que  $J_F(T(B_E)) = T^{**}(J_E(B_E)) \subset \overline{T^{**}(B_{E^{**}})}$ . Como  $T^{**}$  é compacto, então  $\overline{T^{**}(B_{E^{**}})}$  é compacto em  $F^{**}$ . Assim,  $J_F(T(B_E)) \subset \overline{T^{**}(B_{E^{**}})}$  é compacto em  $F^{**}$ , pois é um fechado contido em um compacto.

Além disso, como  $J_F : F \rightarrow J_F(F) \subset F^{**}$  é um isomorfismo isométrico, então  $J_F(F)$  é fechado em  $F^{**}$ . Assim,  $J_F(F) = \overline{J_F(F)}$ . Dessa forma, temos que  $\overline{J_F(T(B_E))} \subset \overline{J_F(F)} = J_F(F)$ . Logo faz sentido aplicar a inversa  $J_F^{-1} : J_F(F) \rightarrow F$ . Assim, temos que  $\overline{T(B_E)} \subset \overline{J_F^{-1}(J_F(T(B_E)))}$ .

Como  $J_F^{-1}(\overline{J_F(T(B_E))})$  é compacto, obtemos que  $\overline{T(B_E)} \subset J_F^{-1}(\overline{J_F(T(B_E))}) = J_F^{-1}(\overline{J_F(T(B_E))})$  é compacto, pois é um conjunto fechado contido em um compacto.

Portanto,  $T \in \mathcal{K}(E, F)$ , e o resultado está demonstrado.

6. Sejam  $E$  e  $F$  espaços normados,  $T \in \mathcal{K}(E, F)$  e  $x_n \rightharpoonup x$  em  $E$ . Prove que  $T x_n \rightarrow T x$  em  $F$ .

**Solution:**

Pelo exercício 3 da lista 5 podemos afirmar que

$$T x_n \rightharpoonup T x.$$

Tendo isso, suponhamos, por contradição, que  $(T(x_n))_{n=1}^{\infty}$  não converge forte para  $T(x)$ , ou seja, que existem  $\epsilon > 0$  e uma subsequência  $(T(x_{n_k}))_{k=1}^{\infty}$ , tais que

$$\|T(x_{n_k}) - T(x)\| \geq \epsilon, \quad \forall k. \quad (2)$$

Como  $x_{n_k} \rightharpoonup x$  segue que  $(x_{n_k})$  é limitada, e portanto, pela compacidade de  $T$ ,  $(T(x_{n_k}))$  admite subsequência  $T(x_{n_{k_j}})$  convergente, digamos

$$T(x_{n_{k_j}}) \longrightarrow y \in F.$$

Por maior razão  $T(x_{n_{k_j}}) \rightharpoonup y$  e, como a topologia fraca é Hausdorff, concluímos que  $T(x) = y$ . Então  $T(x_{n_{k_j}}) \longrightarrow T(x)$ , o que contradiz (2).

7. Seja  $T$  o operador definido em (1) com  $p = 2$ . Dado  $\eta \in \ell^2$ , use a alternativa de Fredholm para discutir sobre a solução do problema

$$(I - T)\xi = \eta.$$

**Solution:** No que se segue, fazemos a convenção de que

$$\zeta(n) = \zeta_n$$

para todo  $\zeta \in \ell^2$  e todo  $n \in \mathbb{N}$ .

Seja  $T : \ell^2 \rightarrow \ell^2$  dada por

$$T\zeta = (\zeta_n/n)$$

para todo  $\zeta \in l^2$ . Como sabemos de exercícios anteriores,  $T$  é um operador linear contínuo, compacto e auto-adjunto em  $l^2$ . Veremos agora que todos os auto-valores deste operador pertencem ao conjunto  $\{1/n : n \in \mathbb{N}\}$ . Com efeito, se  $\zeta \in l^2$  e  $\lambda \in \mathbb{K}$  são tais que  $T\zeta = \lambda\zeta$ , ocorre  $((\lambda - 1/n)\zeta_n) = 0 \in l^2$ . De duas, uma:

1.  $\exists n \in \mathbb{N}$  tal que  $\lambda - 1/n = 0$ ; segue que  $\lambda - 1/m \neq 0$  (e portanto, que  $\zeta_m = 0$ ) para todo  $m \neq n$ . Note que  $N(\lambda I - T) = \mathbb{K}e_n$  e assim, que

$$\begin{aligned} R(\lambda I - T) &= \frac{R(\lambda I - T^*)}{R(\lambda I - T^*)} \quad (T \text{ é auto-adjunto}) \\ &= \frac{R(\lambda I - T^*)}{R(\lambda I - T^*)} \quad (\text{Alternativa de Fredholm}) \\ &= R(\lambda I - T^*)^{\perp\perp} \quad (\text{Propriedade do operador } \perp) \\ &= N(\lambda I - T)^{\perp} \quad (\text{Alternativa de Fredholm}) \\ &= (\mathbb{K}e_n)^{\perp} \\ &= \{\zeta \in l^2 : \zeta_n = 0\} \quad (\lambda = 1/n) \end{aligned}$$

de onde podemos concluir que, dado  $\eta \in l^2$ , o problema  $(1/nI - T)\zeta = \eta$  admite solução  $\zeta \in l^2$  se, e apenas se,  $\eta_n = 0$ , qualquer que seja  $n \in \mathbb{N}$ .

2.  $\nexists n \in \mathbb{N}$  tal que  $\lambda - 1/n = 0$ ; segue que  $\zeta_n = 0$  para todo  $n \in \mathbb{N}$  e assim, que  $N(\lambda I - T) = \{0\}$ . Da alternativa de Fredholm temos que  $R(\lambda I - T) = l^2$  e portanto, dado  $\eta \in l^2$ , sempre existe um (único)  $\zeta \in l^2$  de modo que  $(\lambda I - T)\zeta = \eta$ .

Com isto concluimos o exercício.

8. Seja  $H$  um espaço de Hilbert, e  $T$  um operador compacto,  $\lambda \in \mathbb{R} - \{0\}$ . Mostre que:

1. As equações

$$(1) \quad u - \lambda Au = w$$

$$(2) \quad v - \lambda A^*v = z$$

têm únicas soluções  $u, v \in H$  para cada  $w, z \in H$  ou ambas as equações

$$(3) \quad \phi - \lambda A\phi = 0$$

$$(4) \quad \psi - \lambda A^*\psi = 0$$

possuem soluções não nulas, onde o número de soluções linearmente independentes é finito e mesmo para ambas as equações.

2. a equação (1) tem pelo menos uma solução se, e somente se,  $w$  é ortogonal a todas as soluções de (4).
3. a equação (2) tem pelo menos uma solução se, e somente se,  $z$  é ortogonal a todas as soluções de (3).

**Solution:**

- 1) Suponha que as equações (1) e (2) não possuam soluções únicas para algum  $w, z \in H$ . Logo, vão existir  $u_1, u_2$  e  $v_1, v_2$  soluções das equações (1) e (2), tais que  $u_1 \neq u_2$  e  $v_1 \neq v_2$ . Defina  $u = u_1 + u_2$  e  $v = v_1 + v_2$ , isso implica que  $u, v \neq 0$  seriam soluções não nulas de (3) e (4). Além disso, pelo Teorema Alternativa de Fredholm segue que  $\dim[\text{Ker}(I - \lambda A)] < \infty$  e  $\dim[\text{Ker}(I - \lambda A)] = \dim[\text{Ker}(I - \lambda A^*)]$ , isto é, ambos os espaços admitem uma base ortogonal finita. Sendo assim, o número de soluções L.I é finito para ambas as equações.

- 2) Pelo Alternativa de Fredholm segue que  $Im(I - \lambda A)$  é fechado e  $Im(I - \lambda A) = Ker(I - \lambda A^*)^\perp$ , logo (1) admite solução  $u \in H \iff w \in Im(I - \lambda A) \iff w \in Ker(I - \lambda A^*)^\perp \iff \langle w, v \rangle = 0, \forall v \in Ker(I - \lambda A^*)$ , isto é,  $w$  é ortogonal a toda solução de (4).
- 3) Sabemos que  $A$  é operador compacto  $\iff$  o seu dual  $A^*$  também o for. Além disso, temos também que  $(A^*)^* = A$ . Usando novamente Alternativa de Fredholm segue que  $Im(I - \lambda A^*)$  é fechado e  $Im(I - \lambda A^*) = Ker(I - \lambda A^{**})^\perp = Ker(I - \lambda A)^\perp$ . Diante disto, suponha  $v$  solução de (2), então,  $z \in Im(I - \lambda A^*) \iff z \in Ker(I - \lambda A^{**})^\perp \iff z \in Ker(I - \lambda A)^\perp \iff \langle z, \phi \rangle = 0 \forall \phi \in Ker(I - \lambda A)$ , ou seja,  $z$  é ortogonal a toda solução de (3)

9. Sejam  $E$  e  $F$  dois espaços de Banach e  $T \in K(E, F)$ . Assuma  $dim E = \infty$ . Prove que existe uma sequência  $(u_n) \in E$  tal que  $\|u_n\|_E = 1$  e  $\|Tu_n\|_F \rightarrow 0$ .

**Solution:** Suponha, por absurdo, que  $\|Tu_n\|_F \not\rightarrow 0$ . Então existe algum  $\varepsilon > 0$  tal que

$$\|Tu\|_F > \varepsilon \forall u \in E$$

Ou seja,

$$\|Tu\|_F > \varepsilon \|u\| \forall u \in E.$$

Portanto  $Im(T)$  é fechado. Considere o operador

$$T_0 : E \rightarrow Im(T) \text{ definido por } T_0 = T.$$

$T_0$  é claramente um operador linear contínuo bijetor, onde  $E$  e  $Im(T)$  são espaços de Banach (obs.  $Im(T)$  é um subespaço fechado do espaço de Banach  $F$ ). Logo pelo corolário do Teorema da Aplicação aberta,

$$T_0^{-1} \in \mathcal{L}(Im(T), E).$$

Por outro lado,  $T_0 \in K(E, Im(T))$ . Portanto  $B_E$  é compacto e  $dim E < \infty$ . O que contradiz a hipótese de  $dim E = \infty$ .

**Colorário do Teorema da Aplicação Aberta.** Sejam  $E$  e  $F$  dois espaços de Banach e  $T : E \rightarrow F$  um operador linear contínuo operador que é bijetor. Então  $T^{-1}$  é também contínuo.

10. Seja  $1 \leq p < \infty$ . Mostre que  $l^p \subset c_0$  com injeção contínua. A injeção é compacta?

**Solution:**

- 1) Seja  $x \in l^p$ . Temos que

$$\sum_{n=1}^{\infty} |x_n|^p < \infty.$$

Assim  $x_n \rightarrow 0$  quando  $n \rightarrow \infty$ . Além disso,

$$\|x\|_{c_0} = \sup_n |x_n| \leq \left( \sum_{n=1}^{\infty} |x_n|^p \right)^{1/p} = \|x\|_{l^p}.$$

- 2) A injeção não é compacta. De fato, seja  $(x^n)$  uma sequência em  $l^p$  definida por

$$x_k^n = \begin{cases} 1 & \text{se } n \geq k; \\ 0 & \text{se } n < k. \end{cases}$$

Temos que  $\|x^n\|_{l^p} = 1$  para todo  $n$ , portanto  $(x^n)$  é uma sequência limitada de  $l^p$ . Nenhuma subsequência de  $(x^n)$  pode ser uma sequência de Cauchy de  $c_0$  pois para todo  $n \neq m$ ,

$$\|x^n - x^m\|_{c_0} = 1.$$

Logo, pela proposição abaixo, a injeção  $i : l^p \rightarrow c_0$  não é compacta.

**Proposição.** Sejam  $E$  e  $F$  espaços normados. As seguintes afirmações são equivalentes para um operador linear  $T : E \rightarrow F$ .

- $T$  é compacto.
- $\overline{T(A)}$  é compacto em  $F$  para todo limitado  $A$  em  $E$ .
- Para toda sequência limitada  $(x^n)$  em  $E$ , a sequência  $(T(x^n))$  tem subsequência convergente em  $F$ .

11. Sejam  $E$  e  $F$  dois espaços de Banach, e seja  $T \in K(E, F)$ . Assuma que a  $Im(T)$  é fechada.

- Prove que  $T$  é um operador de posto finito.
- Assuma também que  $dim N(T) < \infty$ . Prove que  $dim E < \infty$ .

**Solution:**

- Pelo Teorema da Aplicação Aberta, existe uma constante  $c$  tal que  $B_{Im(T)} \subset cT(B_E)$ .  
Segue que

$$\overline{B_{Im(T)}} = B_{Im(T)} \subset \overline{cT(B_E)}$$

Como  $T$  é compacto,  $\overline{T(B_E)}$  é compacto. Pelo fato de todo subconjunto fechado de um espaço métrico compacto ser compacto, segue que a bola unitária da  $Im(T)$  é compacta. Portanto  $dim Im(T) < \infty$ .

**Teorema da Aplicação Aberta:** Sejam  $E$  e  $F$  dois espaços de Banach e  $T : E \rightarrow F$  um operador linear contínuo sobrejetor. Então existe uma constante  $c > 0$  tal que

$$B_F(0, c) \subset T_{B_E(0,1)}$$

- Tome  $E_0$  sendo o complemento de  $N(T)$ . Então  $T_0 = T|_{E_0}$  é bijetora de  $E_0$  em  $ImT$ .  
Assim  $dim E_0 = dim ImT < \infty \Rightarrow dim E = dim E_0 + N(T) < \infty$ .