

泛函分析与半群

(上册)

[美] E. 希尔 R.S. 菲列浦斯著 吴智泉 王振鵠 刘隆复译

泛函分析与半群

(上 册)

[美] E. 希 尔 著
R. S. 菲列浦斯

吳智泉 王振鵬 劉隆復 譯

上海科学技术出版社

內容 提 要

本书是根据原书 1957 年重版本翻譯的。全书共分五部分：泛函分析，半群的基本性质，半群的高等分析理論，特殊半群与应用，理論的推广。譯本分上、下两册，上册包含一、二两部分，下册为其余三部分和参考文献。

本书上册第一部分闡述現代泛函分析的基本理論，共六章，分別叙述空間的代数性质和拓扑性质，綫性算子，从純量到向量的函数，Banach 代数及其表示理論，算子演算和抽象值全純函数的解析表示。第二部分闡述半群的基本理論，而把高等的、特殊的理論放在后面的三、四部分。这一部分也分六章，其中前两章是属于緒論性的，中間两章讲述单参数半群的基本理論，最后两章討論半群的无穷小母元，整解式和半群的生成。

本书可供高等学校数学系高年级学生、研究生、教师、科研工作人员参考。

FUNCTIONAL ANALYSIS AND SEMI-GROUPS

E. Hille, R. S. Phillips

Amer. Math. Soc., 1957. 2nd. Edit.

泛函分析与半群（上册）

吳智泉 王振鵬 劉隆復 譯

上海科学技术出版社出版 (上海瑞金二路 450 号)
上海市书刊出版业营业許可證出 093 号

上海市印刷六厂印刷 新华书店上海发行所发行

开本 850×1168 1/32 印张 15 4/32 换版字数 397,000
1964年10月第1版 1964年10月第1次印刷 印数 1—5,500

统一书号 13119·591 定价(科六) 2.20 元

修訂版序言

自从 1948 年本书第一版印行至今已經过去七年了。数学界对这部著作所給予的深切关注使作者感到十分高兴；事实上，初版在 1954 年已絕版。1951 年出現了本书的俄文譯本 [Функциональный анализ и полугруппы, Издательство Иностранной Литературы, 1951.]。

1948 年以后半群的分析理論及其应用都有很大的发展。K. Yosida 和 Hille 1948 年各自独立地得到了基本的生成定理并且在一系列重要文章中将其应用到扩散方程。在 Yosida 工作的影响下，从 1949 年起 Hille 利用半群理論对 Cauchy 問題作了新的研究。不久以后，W. Feller 注意到这个新的途徑的可能性，他和他的学生对这个理論做出了很多貢献；我們特別要提到他对扩散方程的奇异边值問題的深刻研究。在线性算子半群一般理論的研究中，另一个早期的数学家是 R. S. Phillips，他填补了 Hille 遺留下来的許多空白处，并以半群代数的表示理論，微扰方法，广义的半群类和共轭半群丰富了这个理論。另外，Hille 于 1948 年建立了 Lie 半群理論的基础。

早在 1952 年本书就有重印的必要，而由于这个理論的新的进展显然也需要扩充和修訂，Hille 邀請 Phillips 合写这个新版本。現在終于呈現在讀者面前了。原书已經完全重写过，主要是由 Phillips 完成的；旧有的結構以及大部分旧有的結果仍然保留，但同时也确实作了非常多的补充。在新版中改动的地方，一部分是关于解釋的，一部分是关于方法和結果的。例如为了合乎时代的精神，代数的工具現在起着重要的作用，在本书中較早地引进；这使我們有可能在第十五和第十六章中建立起更为完善的算子演算和譜論。另一方面，我們并没有用代数方法来代替 Hille 为了这些目的而使用的 Laplace-Stieltjes 变換方法，只是以新的工具作了补充。

第一部分——泛函分析——已予扩充并重新編排过。原来的第四章（从向量到向量的函数），除去为本书的中心內容所必需的部分已被合并到第三章外，其余的都放在本书的末尾。新的第四章包含可易 Banach 代数的 Gelfand 表示理論的論述以及原来第五章（Banach 代数的分析学）的绝大部分和第十二章（关于 Banach 代数的注記）。新的第五章包含旧版第五章的 Banach 代数的算子演算，但已經過修改，此外，它还包含封閉的无界綫性算子的算子演算。Laplace 积分的討論已由第十章移到第六章。現在称为半群的基本性质的第二部分，只包含了原来第二部分前一半的大部分材料，不过，也作了重要的补充：第十和第十一章中关于半群的 Phillips 分类和第十二章中他对于生成問題的解决。新的第三部分——半群的高等分析理論——是以原来的第二部分后一半为基础的。但是除了后两章之外，此处的材料大部分都是新的，它包含 Phillips 对这个理論的主要貢獻（微扰論，共軛半群的理論，算子演算和譜論）。第四部分——特殊半群及其应用——相当于原来的第三部分。此处主要的改变是省略了应用于偏微分方程的討論。这些应用現在已成长得如此惊人，以致需要用专著来加以論述。我們能做到的是在第二十三章中插入了关于抽象 Cauchy 問題的討論。最后，原来的附录已变成标题为理論的推广的第五部分。此处主要的补充是 Hille 关于 Lie 半群理論的研究。

正如通常那样，修訂工作花費了比原計劃較多的劳动和时间，

我們在这里愉快地向那些在修訂版原稿的准备过程中給以帮助的朋友們表示感謝。我們从 R. P. Agnew, A. V. Balakrishnan, J. Brooks, N. Dunford, H. A. Dye, N. Jacobson, S. Kakutani, T. Kato, D. G. Kendall, R. A. Moore, J. Schwartz 和 K. Yosida 那里得到了不少帮助和有价值的建議。对于所有給我們以帮助的朋友們，无论是否提到名字的还是沒有提到名字的，在此均致以衷心的謝意。

Einar Hille, R. S. Phillips

1955 年 9 月

目 录

修訂版序言

說 明

第一部分 泛函分析

第一章 抽象空間	2
1.1 引言	2
1. 拓扑概念	2
1.2 集合	2
1.3 Hausdorff 空間	3
1.4 連續變換	6
1.5 度量空間	9
2. 加性空間	10
1.6 代數系統	10
1.7 加法群	11
1.8 加法群空間	12
3. 線性空間	13
1.9 線性系統	13
1.10 線性空間	15
1.11 部分序線性系統	18
1.12 Banach 空間	19
4. 代數空間	23
1.13 代數	23
1.14 代數空間	25
1.15 Banach 代數	26
第二章 線性變換	28
2.1 引言	28
1. 可加變換	28
2.2 可加變換	28

目 录

2.3 線性變換.....	29
2.4 有界變換.....	29
2.5 次可加泛函.....	30
2. 線性泛函.....	32
2.6 几何概貌.....	32
2.7 線性泛函的擴張.....	35
2.8 共軛空間.....	40
2.9 \mathfrak{X} 的弱拓扑.....	43
2.10 \mathfrak{X}^* 的弱* 拓扑	46
3. 線性變換.....	49
2.11 一般性质	49
2.12 封閉線性變換	56
2.13 緊致線性變換	60
4. 自同态的空間.....	64
2.14 自同态的 Banach 代数.....	64
2.15 强算子拓扑和弱算子拓扑	66
2.16 豫解式和譜	67
第三章 向量值函数	73
3.1 引 言	73
1. 抽象积分	73
3.2 向量值函数的某些性质	73
3.3 Riemann-Stieltjes 积分.....	78
3.4 微积分	84
3.5 可测函数	89
3.6 可数可加集合函数	93
3.7 Lebesgue 积分.....	95
3.8 (B)-积分的其他性质	105
3.9 奇异积分	110
2. 复函数論	114
3.10 全純函数	114
3.11 Cauchy 积分.....	116
3.12 解析延拓	120
3.13 极大值原理	122

3.14 Vitali 定理	128
3.15 多个复变量的向量值函数	131
3. 从向量到向量的解析函数	133
3.16 (G)-可微性	133
3.17 (F)-可微性	137
3.18 解析函数的性质	138
3.19 (L)-解析性	141
第四章 Banach 代数	143
4.1 引 言	143
1. 一般性质	143
4.2 单位元素	143
4.3 正則元素	144
4.4 核	145
4.5 奇异元素	147
4.6 从純量到代数內的函数	148
2. 譜 論	150
4.7 豫解式	150
4.8 豫解式方程	153
4.9 賦范域	155
4.10 拟幂零元	156
4.11 不可去譜奇点	157
4.12 (B [*])-代数的某些性质	159
3. 可易 Banach 代数的理想論	160
4.13 理 想	160
4.14 剩余类代数	162
4.15 表示理論	166
4. Banach 代数 $S(\varphi)$	171
4.16 $S(\varphi)$ 的基本性质	171
4.17 半群的表示	176
4.18 $S(\varphi)$ 中的极大理想	179
5. 可易 (A [*])-代数	184
4.19 可易 (A [*])-代数的表示論	184
4.20 代数 $LA(-\infty, \infty)$	187

4.21 几个 Tauber 型定理	189
6. 可易 (B^*) -代数	192
4.22 可易 (B^*) -代数的表示論	192
4.23 Hilbert 空間上的算子代数	196
第五章 Banach 代数中的分析学	200
5.1 引 言	200
1. 算子演算	200
5.2 全純純量函数的延拓	200
5.3 譜映射定理. 复合函数	209
5.4 指数函数, 对数函数和幂函数	210
5.5 幂等元素	212
5.6 元素的譜分解	216
5.7 緊致線性算子的譜論	219
2. 伪豫解式	224
5.8 第一豫解式方程	224
5.9 伪豫解式的展开定理	232
5.10 第二豫解式方程	239
3. 广义算子演算	243
5.11 封閉算子的算子演算	243
5.12 譜映射定理. 复合函数	249
5.13 封閉算子的譜分解	255
5.14 具有緊致豫解式的算子的譜論	257
第六章 Laplace 积分与二項級數	260
6.1 引 言	260
1. Laplace 变換	261
6.2 Laplace-Stieltjes 积分	261
6.3 反演公式	267
2. 半平面中的全純函数	277
6.4 类 $H_p(\alpha; \mathfrak{X})$	277
6.5 阶关系	280
6.6 利用 Laplace 积分的表示式	282
3. 二項級數	283

6.7 級數的性質	283
6.8 表示與解析延拓	286

第二部分 半群的基本性质

第七章 次可加函数	290
7.1 引言	290
1. 有界性和增长	291
7.2 初等性质	291
7.3 E_1 內的半模和无穷解	293
7.4 有界性	294
7.5 負的次可加函数	297
7.6 增长率	298
2. 連續性和可微性	301
7.7 双值次可加函数的合成	301
7.8 极限函数和連續性	302
7.9 平均連續性	305
7.10 連續模	305
7.11 可微性	306
3. E_n 內的次可加函数	308
7.12 正齐次的次可加函数	308
7.13 有界性和增长	310
第八章 半 模	313
8.1 引言	313
1. 半群	313
8.2 抽象半群	313
8.3 变換半群	315
8.4 例子和說明	316
2. 欧氏半模	319
8.5 关于加法的拓扑	319
8.6 直線上的半模	322
8.7 角形半模	323
3. 双曲半群	331
8.8 双曲正切半群	331

8.9 次运算函数	334
第九章 Banach 代数中的加法定理	337
9.1 緒 論	337
9.2 引 言	339
1. 問題 A	340
9.3 可測性蘊涵連續性	340
9.4 指數解	343
9.5 連續算子群和對數	347
9.6 算子半群	350
2. 問題 B	351
9.7 定義在 Banach 空間上的解	351
3. 問題 C	354
9.8 加法定理	354
9.9 全純解	357
9.10 解的唯一性	361
4. 問題 D	365
9.11 幕級數解	365
第十章 強拓扑下的半群	368
10.1 引 言	368
1. 單參數半群	370
10.2 可測性和連續性	370
10.3 无穷小算子	373
10.4 第一指數公式	379
10.5 在原點的連續性	386
10.6 牛群的基本類	390
10.7 恒等算子的逼近	396
2. 推 广	398
10.8 強拓扑中的問題 B	398
10.9 母元的集合	403
10.10 n 參數半群	406
第十一章 母元和解式	409
11.1 引 言	409
1. 一致的情形	410

11.2 豫解式	410
11.3 豫解式的反演	411
11.4 線性变换的单参数解析群	413
2. 强情形	414
11.5 豫解式	414
11.6 豫解式的反演	424
11.7 特殊性质	428
11.8 指数公式	429
第十二章 半群的生成	431
12.1 引言	431
1. 关于 $\xi > 0$ 强連續的半群的生成	432
12.2 預備知識	432
12.3 (C_0) 类半群	436
12.4 $(1, A)$ 类半群	442
12.5 (A) 类半群	452
2. 关于 $\xi > 0$ 一致連續的半群的生成	458
12.6 $(1, A)_\alpha$ 类半群	458
12.7 $(A)_\alpha$ 类半群	462
12.8 $H(\Phi_1, \Phi_2)$ 类半群	467

第一部分

泛函分析

提要 本书的第一部分是闡述現代泛函分析的基本思想。共有六章：**抽象空間，綫性變換，向量值函數，Banach 代數，Banach 代數中的分析學以及 Laplace 積分與二項級數。**

我們從描述所要討論的空間的代數性和拓扑性質開始，然後進而研究由一個如此的空間到另一空間的綫性算子。我們主要是從事 Banach 空間的研究，但是除了范數拓扑之外也出現其他一些拓扑。抽象函數理論從第三章開始，在這章中我們將研究從純量到向量的函數，從向量到純量的函數，以及從向量到向量的函數。後一題目的補充材料可在本書末尾的第二十六章中找到。Banach 代數是我們的中心論題之一。第四章中的討論引導到具有單位元素的可易(B)-代數的 Gelfand 表示理論，給出了它的某些重要說明。在第五章中建立了我們的另一主要論題——算子演算(運算微積)——的堅實基礎。關於沒有單位元素的不可易(B)-代數的補充材料可在第二十四章中找到。最後，第六章是研究在半平面上全純且滿足適當的有界性條件的抽象值函數的解析表示。這也是以後的討論中的主要工具之一。

第一章 抽象空間

1.1 引言

本章企图对今后所需要的抽象空間理論的基本观念作出简洁的概述。这些材料分放在如下标名的四节之中：**拓扑概念，加性空間，綫性空間和代數空間**。本书中的抽象空間通常是这种或那种类型的拓扑空間，而且都具有一定的代数結構。这是选择标题的根据。正如实际情形那样，全部材料都取之于当代文献，而證明則經常被省略了。需要知道进一步的闡述的讀者可参考各节末尾所援引的文献。

1. 拓 扑 概 念

1.2 集合

設 \mathfrak{S} 是具有元素 x, y, \dots 的抽象集合； X, Y, X_α 是 \mathfrak{S} 的子集。記号 $X \cup Y$ 和 $\bigcup_\alpha X_\alpha$ 表示所指出的子集的并， $X \cap Y$ 和 $\bigcap_\alpha X_\alpha$ 表示所指出的集合的交。如果 $X \cap Y = \emptyset$ (空集)，則 X 和 Y 称为**不交的**。 X 关于 \mathfrak{S} 的余集写成 \tilde{X} 或 $\mathfrak{S} \ominus X$ ；更一般地， X 关于 Y 的余集是 $Y \cap \tilde{X} = Y \ominus X$ 。具有性质 P 的元素 x 全体所組成的集合記为 $[x; P]$ 。性质 P 从上下文已很清楚时这个記号也經常簡写为 $[x]$ ，或者在一串元素的情形簡写为 $\{x_n\}$ 。

称集合 \mathfrak{S} 是**部分有序的**，如果对于某些元素对 x, y ，存在一(次)序关系 $x < y$ (也記作 $y > x$) 滿足

O₁. 对于所有 x , $x < x$ (**反身的**)，

O₂. 如果 $x < y$ 且 $y < z$ ，則 $x = y$ (**常义的**)，

O₃. 如果 $x < y$ 且 $y < z$ ，則 $x < z$ (**傳递的**)。

如果 $x < y$ ，我們說 x 被 y 包含或者 y 包含 x 。如果集合 \mathfrak{S} 的所有的元素对 x, y 之間都有次序的关系，則称 \mathfrak{S} 是**简单有序的**。从一

給定的關於部分有序集的命題，我們顛倒其中的所有序關係就得到對偶命題。應當指出，我們的公設是自對偶的，所以關於部分有序集的任何定理都蘊涵其對偶定理。

在部分有序集 \mathfrak{S} 中，子集 Y 說是以 y_0 作為其上界，如果對所有 $y \in Y$ 都有 $y < y_0$ 。如果 $x > x_0$ 蘊涵 $x_0 > x$ ，則說 x_0 是 \mathfrak{S} 的最大（或極大）元素。下界和最小（或極小）元素的概念可對偶地定義。對於極大元素的存在性，我們有常用的 Max Zorn 極大原理，其形式之一是：

極大原理 如果 \mathfrak{S} 是一個部分有序集，其中每個簡單有序子集都在 \mathfrak{S} 中有上界，則 \mathfrak{S} 至少含有一個極大元素。

極大原理等價於選擇公理；它在抽象集合論的很多部分中都能找到本質性的應用。

對於部分有序集，我們定義子集 Y 的最小上界 (l.u.b.) 為包含於每一其他上界的上界。最大下界 (g.l.b.) 可對偶地定義。由 O_2 ，一給定子集顯然最多只能有一個 l.u.b. 和一個 g.l.b.。格是那樣的部分有序集 \mathfrak{S} ：其任二元素 x, y 都有 l.u.b. $x \wedge y$ 和 g.l.b. $x \wedge y$ 。由歸納法便知格的任何有限子集都有一个 l.u.b. 和一個 g.l.b.，對於給定的子集 X ，如果這些界存在，我們分別以 $\vee [x; x \in X]$ 和 $\wedge [x; x \in X]$ 表示集合 X 的 l.u.b. 和 g.l.b.。

1.3 Hausdorff 空間 我們說點集 \mathfrak{X} 和它的一族子集 Σ 確定了一 Hausdorff 空間，如果

H₁. 對於 \mathfrak{X} 的任二相異元素 x 和 y ，有 Σ 中的不交的集合 N_1 和 N_2 使得 $x \in N_1$ 和 $y \in N_2$ ；

H₂. 對於 Σ 中任意兩個包含同一點 x 的集合 N_1 和 N_2 ，都有 Σ 中的集合 N_3 使 $x \in N_3 \subset N_1 \cap N_2$ 。

子集 $N \in \Sigma$ 稱為 N 中每一 x 的鄰域，而集合族 Σ 稱為 \mathfrak{X} 的鄰域基底（或基底）。關於這些拓撲概念的詳細討論，讀者可參考 Alexandroff-Hopf[1] 或 Kuratowski[1]。

如果集合 G 中的每一點 x 都被 G 中的鄰域所包含，則稱 G 為

开的。如果 \bar{F} 是开的，则说 F 是闭的。一族开集有开的并集，而一族闭集有闭的交集。可数个开集之交称为 G 集合，可数个闭集之并称为 F 集合。

所有开集的集合，或者等价地，所有闭集的集合，是用 \mathfrak{X} 上所定义的拓扑来确定的。于是任一满足下述条件的开集族 Σ' 都可作为 \mathfrak{X} 的决定同一拓扑的邻域基底： \mathfrak{X} 的每一开子集都是 Σ' 中的一族开集的并集。如此的集合族 Σ' 将自动满足 Hausdorff 空间公设 H_1 和 H_2 。由于这个理由，我们称任何包含点 x 的开集为 x 的邻域，记作 $N(x)$ 。一给定点 x 的邻域基底是 x 的一族邻域 $\Sigma'(x)$ ，适合：每个包含 x 的开集也包含某个 $N(x) \in \Sigma'(x)$ 。

对于任一子集 X ， X 的闭包定义为使每一 $N(x)$ 都与 X 有非空交集的所有 x 的集合，记为 \bar{X} 。等价地， \bar{X} 是所有包含 X 的闭集的交。易见闭包运算满足下述条件：

$$C_1. \quad \overline{X \cup Y} = \bar{X} \cup \bar{Y},$$

$$C_2. \quad \overline{\bar{X}} = \bar{X},$$

$C_3. \quad \bar{X} = X$ ，如果 X 是空集或是一单点集。由此导出 $X \subset \bar{X}$ 。又， $X = \bar{X}$ 在且仅在 X 是闭集时成立。

注 一集合 \mathfrak{X} 連同一定义在所有子集上且满足条件 C_1 , C_2 和 C_3 的闭包运算称为拓扑空间。翻译成基底的术语，这意味着拓扑空间满足条件 H_2 以及分离公理 H_1 的减弱的形式，即

$H'_1.$ 对于 \mathfrak{X} 的任二相异元素 x 和 y ，都有集合 $N \in \Sigma$ ，使得 $x \in N$ 且 $y \notin N$ 。

我们以后总也不需要比 Hausdorff 空间更广的拓扑空间。

如果拓扑空间的每一点都有可数基，则我们说这个拓扑空间满足第一可数公理。如果整个空间有一可数基，则说空间满足第二可数公理。

称点 x_0 为集合 X 的极限点，如果 $x_0 \in \overline{X \ominus x_0}$ ，或者等价地，如果每一 $N(x_0)$ 都含有 X 中的异于 x_0 的点。 X 的极限点的集合 X' 称为 X 的导集； $\bar{X} = X \cup X'$ ，从而 $X' \subset X$ 时 X 是闭的。如果 $X' \supset X$ ，则说 X 是自密的；如果 $X' = X$ ，则说 X 是完备的。

如果 $\bar{X} = \mathfrak{X}$, 則說 X 在 \mathfrak{X} 中稠密; 如果 $Y \subset \overline{X \cap Y}$, 則說 X 在 Y 中稠密。如果有一可數集在 X 中稠密, 則說 X 是可分的。特別地, 如果有一可數集在 \mathfrak{X} 中稠密, 則說 \mathfrak{X} 是可分空間。如果 \mathfrak{X} 滿足第二可數公理, 則它一定可分。

所有含于 X 中的開集的并集是 X 的內核, 記為 $\text{Int}(X)$ 。如果 $x \in \text{Int}(X)$, 則 x 是 X 的內點。 X 的邊界是 X 的閉包與 \bar{X} 的閉包之交。如果 $\text{Int}(\bar{X}) = \emptyset$, 則說 X 是無處稠密的(或处处稀疏的)。如果 X 是可數個在 \mathfrak{X} 中無處稠密的子集的并集, 則說 X 是 \mathfrak{X} 中的第一綱集; 否則說 X 是第二綱的。如果 X 是第二綱的, 則 $\text{Int}(\bar{X})$ 非空。

如果 X_0 是 \mathfrak{X} 的子集, 則在 X_0 中可利用所有的集合 $N_0 = N \cap X_0$ (其中 $N \in \Sigma$) 所組成的鄰域基底 Σ_0 引入相對拓扑。顯然, 在這個拓扑之下, 子集 $Y \subset X_0$ 的相對閉包就是 $\bar{Y} \cap X_0$ 。

如果一拓扑空間不是兩個不交非空開集之并, 則說它是連通的。在連通空間中仅有空集和全空間是既開又閉的集合(開閉集, clopen)。稱 \mathfrak{X} 的子集 X_0 為連通的, 如果它不是 X_0 的兩個不交非空相對開子集之并。集合的分支(或分量)是不包含于任何更大的連通子集中的連通子集。集合 X 的每個點確定唯一的包含它的分支, 而 X 是其分支之并。

集合族 $[A_\alpha]$ 稱為集合 X 的複蓋, 如果集合 X 的每一點至少是一集合 A_α 的內點。如果每個複蓋 X 的開集族 $[G_\alpha]$ 都含有也複蓋 X 的有限子族, 則說集合 X 具有 Borel 性質。如果集合族 $[B_\alpha]$ 的每個有限子族都有非空的交集, 則說 $[B_\alpha]$ 具有有限交性質。

如果子集 X 具有 Borel 性質, 則稱 X 為緊致的。特別地, 如果 \mathfrak{X} 具有 Borel 性質, 則稱 \mathfrak{X} 為緊致空間。利用取余集的方法容易證明: X 緊致當且僅當 X 的每個具有有限交性質的相對閉子集族有非空的交集。Hausdorff 空間的緊致子集一定是閉的, 而且緊致集的每個閉子集也是緊致的。如果一子集之閉包緊致, 則此子集稱為條件緊致的。一空間稱為局部緊致的, 如果空間的每一點都有一條件緊致鄰域。一局部緊致空間可用適當增添另一點的