

Fixpunktsätze in uniformen Räumen

Herrn JOSEF LENSE zum 70. Geburtstag am 28. Oktober 1960 gewidmet

Von

RUDOLF ALBRECHT und GUIDO KARRER

Die vorliegende Arbeit schließt an Untersuchungen von L. KANTOROVITCH [1], J. WEISSINGER [2] und J. SCHRÖDER [3] an und gibt eine abstrakte Verallgemeinerung gewisser Fixpunktsätze über kontrahierende Abbildungen im Rahmen der Theorie der uniformen Räume. An Stelle der in [3] angegebenen Definition „verallgemeinerter Abstände“ wird eine andere eingeführt, die Räume mit einem solchen Abstandsbegriff als Spezialfälle von uniformen Räumen ausweist.

1. Hilfssätze

Sei E ein topologischer Raum, f eine Abbildung von E in E . Ferner sei \mathfrak{B} eine (eigentliche) Filterbasis auf E (bezüglich der Ordnung \leq , die durch die mengentheoretische Inklusion \subseteq gegeben ist) und es sei für eine beliebige Filterbasis \mathfrak{C} auf E mit $\text{Fi } \mathfrak{C}$ der durch \mathfrak{C} erzeugte Filter, mit $L_{\mathfrak{C}}$ die Menge der Limes von \mathfrak{C} , mit $A_{\mathfrak{C}}$ die Menge der Berührungspunkte von \mathfrak{C} bezeichnet. Schließlich soll für beliebiges $x \in E$ der Umgebungsfiler von x mit \mathfrak{U}_x bezeichnet werden. Wir nehmen an, daß $L_{\mathfrak{B}} \neq \emptyset$ ist.

LEMMA 1. *Ist f stetig auf $L_{\mathfrak{B}}$ und $\text{Fi } \mathfrak{B}$ feiner als $\text{Fi } f(\mathfrak{B})$, dann ist $f(L_{\mathfrak{B}}) \subseteq L_{\mathfrak{B}}$.*

BEWEIS. f stetig auf $L_{\mathfrak{B}}$ heißt: Für beliebiges $x \in L_{\mathfrak{B}}$ ist $\mathfrak{U}_{f(x)} \subseteq \text{Fi } f(\mathfrak{U}_x)$. Da x Limes von \mathfrak{B} ist, gilt $\mathfrak{U}_x \subseteq \text{Fi } \mathfrak{B}$. Deshalb ist $\mathfrak{U}_{f(x)} \subseteq \text{Fi } f(\mathfrak{U}_x) \subseteq \text{Fi } f(\mathfrak{B})$. Damit hat man, weil $f(x)$ Limes von $\mathfrak{U}_{f(x)}$ ist, $f(x) \in L_{f(\mathfrak{B})}$ für jedes $x \in L_{\mathfrak{B}}$. Also gilt

$$(1.1) \quad f(L_{\mathfrak{B}}) \subseteq L_{f(\mathfrak{B})}.$$

Nun ist $\text{Fi } f(\mathfrak{B}) \subseteq \text{Fi } \mathfrak{B}$, also auch $L_{f(\mathfrak{B})} \subseteq L_{\mathfrak{B}}$. Mit (1.1) folgt daher $f(L_{\mathfrak{B}}) \subseteq L_{\mathfrak{B}}$.

LEMMA 2. *Ist f stetig auf $A_{\mathfrak{B}}$ und $\text{Fi } \mathfrak{B}$ gröber als $\text{Fi } f(\mathfrak{B})$, dann ist $f(A_{\mathfrak{B}}) \subseteq A_{\mathfrak{B}}$.*

BEWEIS. f stetig auf $A_{\mathfrak{B}}$ heißt: Für beliebiges $x \in A_{\mathfrak{B}}$ ist $\mathfrak{U}_{f(x)} \subseteq \text{Fi } f(\mathfrak{U}_x)$. Sei $x \in A_{\mathfrak{B}}$. Dann existiert ein Filter \mathfrak{F} , so daß $\text{Fi } \mathfrak{B} \subseteq \mathfrak{F}$ und $\mathfrak{U}_x \subseteq \mathfrak{F}$ [4, Chap. I, p. 49]. Deshalb ist $\text{Fi } f(\mathfrak{B}) \subseteq \text{Fi } f(\mathfrak{F})$ und $\text{Fi } (\mathfrak{U}_x) \subseteq \text{Fi } f(\mathfrak{F})$. Mit Obigem gilt $\mathfrak{U}_{f(x)} \subseteq \text{Fi } f(\mathfrak{F})$. Es folgt $L_{f(\mathfrak{F})} \subseteq A_{f(\mathfrak{F})} \subseteq A_{f(\mathfrak{B})}$ und $f(x) \in A_{f(\mathfrak{B})}$ für jedes $x \in A_{\mathfrak{B}}$. Also ist

$$(1.2) \quad f(A_{\mathfrak{B}}) \subseteq A_{f(\mathfrak{B})}.$$

Nun gilt $\text{Fi } \mathfrak{B} \subseteq \text{Fi } f(\mathfrak{B})$, also ist $A_{f(\mathfrak{B})} \subseteq A_{\mathfrak{B}}$. Mit (1.2) folgt deshalb $f(A_{\mathfrak{B}}) \subseteq A_{\mathfrak{B}}$.

BEMERKUNGEN. 1. Ist E separiert, dann ist $L_{\mathfrak{B}} = A_{\mathfrak{B}} = \{x\}$ [4, Chap. I, p. 49]. Ist also \mathfrak{B} mit $f(\mathfrak{B})$ vergleichbar, dann ist $x = f(x)$. 2. Ist E ein uniformer Raum, dann ist $L_{\mathfrak{B}} = A_{\mathfrak{B}}$ [4, Chap. II, p. 146, 148].

2. Fixpunktsätze für Abbildungen eines uniformen Raumes in sich

Sei E eine Menge, \mathfrak{B} eine Filterbasis auf $E \times E$, die ein Fundamentalsystem von Umgebungen einer uniformen Struktur auf E ist. Wir betrachten den hierdurch gegebenen uniformen Raum und bezeichnen ihn wieder mit E .

SATZ 1. Sei f eine Abbildung von E in E ; $M \subseteq E$, $M \neq \emptyset$; $M_n = \bigcup_{\substack{l \in N \\ l \geq n}} f^l(M)$,

$N = \{1, 2, 3, \dots\}$, $n \in N$; ferner sei X die Menge der Limes von $\{M_n\}_{n \in N}$ und f stetig auf X . Dann gilt (a) $f(X) \subseteq X$; (b) falls E separiert ist, $f(X) = X$ und X enthält höchstens ein Element.

BEWEIS. $\{M_n\}_{n \in N}$ ist eine Basis des Elementarfilters von $\{f^n(M)\}_{n \in N}$. Ist $X = \emptyset$, dann ist $f(X) = X$. Sei $X \neq \emptyset$. Nach Voraussetzung ist f stetig auf X . Ferner ist $\text{Fi}\{M_n\}_{n \in N}$ ebenso fein wie $\text{Fi}\{f^n(M)\}_{n \in N}$, denn $f(\{M_n\}_{n \in N}) = \{M_{n+1}\}_{n \in N}$. Also ist nach Lemma 1 $f(X) \subseteq X$. (b) ist trivial.

BEMERKUNG. Statt Lemma 1 kann auch Lemma 2 zum Beweise benützt werden.

SATZ 2. Sei E separiert und f eine Abbildung von E in E . Für jede Wahl von $B \in \mathfrak{B}$, $y \in E$, $z \in E$ existiere ein $n \in N$, so daß $\{f^n(y), f^n(z)\} \times \{f^n(y), f^n(z)\} \subseteq B$. Dann hat f auf E höchstens einen Fixpunkt.

BEWEIS. Sei $y = f(y)$, $z = f(z)$, $y \neq z$. Dann existiert ein $B \in \mathfrak{B}$, so daß $(y, z) \notin B$, da E separiert. Dies steht im Widerspruch zur Voraussetzung, daß es ein n gibt, so daß $\{f^n(y), f^n(z)\} \times \{f^n(y), f^n(z)\} \subseteq B$ ist, weil dann $(y, z) \in B$ wäre.

SATZ 3. Sei E separiert und vollständig, f eine Abbildung von E in E . Für jede Wahl von $B \in \mathfrak{B}$ und für ein $z \in E$ existiere ein $n \in N$, so daß $\{f^n(y), f^n(z)\} \times \{f^n(y), f^n(z)\} \subseteq B$ für beliebiges $y \in E$ gilt. Dann existiert $x = \lim_{n \rightarrow \infty} f^n(z)$. Ist f stetig im Punkte x , so ist $x = f(x)$.

BEWEIS. $\left\{ \bigcup_{\substack{l \in N \\ l \geq n}} f^l(z) \right\}_{n \in N}$ ist Basis eines Cauchy-Filters. Denn sei B' ein beliebiges Element von \mathfrak{B} und $B \circ B \subseteq B'$. Dann ist für beliebiges ganzzahliges $\varrho \geq 0$ $\{f^{n+\varrho}(z), f^n(z)\} \times \{f^{n+\varrho}(z), f^n(z)\} \subseteq B$. Folglich ist für beliebige ganzzahlige $\varrho \geq 0$ und $\sigma \geq 0$ $(f^{n+\varrho}(z), f^n(z)) \in B$ und $(f^n(z), f^{n+\sigma}(z)) \in B$, also $(f^{n+\varrho}(z), f^{n+\sigma}(z)) \in B'$. Damit gilt $\bigcup_{\substack{l \in N \\ l \geq n}} f^l(z) \times \bigcup_{\substack{l \in N \\ l \geq n}} f^l(z) \subseteq B'$. Wegen der Vollständigkeit von E ist $\left\{ \bigcup_{\substack{l \in N \\ l \geq n}} f^l(z) \right\}_{n \in N}$ konvergent. Da E separiert ist, existiert nur ein Limes. Für diesen schreiben wir $x = \lim_{n \rightarrow \infty} f^n(z)$. Ist f stetig im Punkte x , so ist $x = f(x)$ nach Satz 1.

3. Erzeugung einer uniformen Struktur mittels verallgemeinerter Abstände

In Anwendungen werden uniforme Strukturen mittels des gewöhnlichen oder eines „verallgemeinerten“ Abstands begriffes erzeugt. Sei H eine Menge $\{\varrho, \sigma, \tau, \dots\}$ von Elementen $\varrho, \sigma, \tau, \dots$. Auf H sei ein assoziatives, kommutatives inneres Kompositionsgesetz $(\varrho, \sigma) \rightarrow \varrho + \sigma$ erklärt für beliebiges $\varrho \in H$, $\sigma \in H$. In H existiere ein neutrales Element o . Ferner sei H geordnet durch

eine Relation \leq^1). Schließlich gelte

H1: o sei kleinstes Element von H , $H' = H - \{o\}$ sei links filternd;

H2: zu beliebigem $\varrho \in H'$ existiere $\varrho' \in H'$, so daß $2\varrho' \leq \varrho$;

H3: für beliebige Elemente ϱ, σ, τ aus H folge aus $\varrho \leq \sigma$ daß $\varrho + \tau \leq \sigma + \tau$ ist.

Aus H3 folgt: Ist $\mu \leq \sigma$, $\varrho \leq \tau$ dann ist $\mu + \varrho \leq \sigma + \tau$. Aus H2 und H3 folgt $\varrho' \leq 2\varrho' \leq \varrho$.

Sei E eine Menge $\{x, y, z, \dots\}$ von Elementen x, y, z, \dots und d eine Abbildung von $E \times E$ in H , so daß für beliebige Elemente x, y, z aus E gilt

D1: $d(x, x) = o$;

D2: $d(x, y) = d(y, x)$;

D3: $d(x, y) \leq d(x, z) + d(z, y)$.

Wir setzen für beliebiges $\varrho \in H'$ $B_\varrho = d^{-1}(\{\sigma \mid \sigma \in H, \sigma \leq \varrho\})$. Dann ist $\{B_\varrho\}_{\varrho \in H'}$ ein Fundamentalsystem von Umgebungen einer uniformen Struktur auf E .

Beweis. Für beliebiges $\varrho \in H'$ ist $\Delta \subseteq B_\varrho$ wegen D1. Aus H1 folgt, daß es zu beliebigem $\varrho \in H'$, $\varrho' \in H'$ ein $\varrho'' \in H'$ gibt, so daß $\varrho'' \leq \varrho$ und $\varrho'' \leq \varrho'$. Ferner gilt: Ist $\sigma \leq \tau$, $\sigma \in H'$, so ist $B_\sigma \subseteq B_\tau$. Somit ist $\{B_\varrho\}_{\varrho \in H'}$ eine Filterbasis. Wegen D2 ist $B_\varrho = B_\varrho^{-1}$. Sei schließlich ϱ ein beliebiges Element aus H' . Nach H2 existiert $\varrho' \in H'$, so daß $2\varrho' \leq \varrho$, und nach H3 ist $\varrho' \leq \varrho$. Infolge D3 ist $B_{\varrho'} \subseteq B_{2\varrho'} \subseteq B_\varrho$.

Sei f eine Abbildung von E in E und $z \in E$. Wir betrachten die Filterbasis

$$\left\{ \bigcup_{\substack{l \in N \\ l \geq n}} f^l(z) \right\}_{n \in N}$$

und setzen $z_l = f^l(z)$, $l \in N$. Diese Filterbasis ist nur dann

konvergent, falls sie „beliebig kleine“ Mengen enthält, das heißt, zu beliebig gewähltem $\varrho \in H'$ existiert $n \in N$, so daß

$$(3.1) \quad d(z_k, z_l) \leq \varrho \quad \text{ist für beliebiges } k \geq n \text{ und } l \geq n.$$

(3.1) ist erfüllt, falls

$$(3.2) \quad \sum_{i=k}^m d(z_{i+1}, z_i) \leq \varrho \quad \text{ist für beliebiges } m \text{ und } k, m \geq k \geq n.$$

Denn sei in (3.1) $l = k + r$, $r > 0$. Dann ist $d(z_k, z_{k+r}) \leq d(z_k, z_{k+1}) + d(z_{k+1}, z_{k+r})$ infolge D3. Wegen H3 erhält man unter Berücksichtigung von (3.2)

$$d(z_k, z_{k+r}) \leq \sum_{i=k}^{k+r-1} d(z_i, z_{i+1}) \leq \varrho.$$

4. Majorantenmethode. Fehlerabschätzung

Wir nehmen nun an, daß jedes Element von H regulär sei. Dann besitzt H eine Symmetrisierung $\bar{H} = \{\varrho, \sigma, \tau, \dots; -\varrho, -\sigma, -\tau, \dots\}$. \bar{H} ist eine Gruppe. Mittels der Ordnung auf H wird in natürlicher Weise eine Ordnung

1) H braucht nicht vollständig geordnet zu sein.

auf \bar{H} erhalten, indem wir dann und nur dann $-\sigma \leq -\rho$ setzen, wenn $\rho \leq \sigma$, $\rho \in H$, $\sigma \in H$ ist und Transitivität verlangen. Ferner gelte

$\bar{H}3$: Für beliebige Elemente ρ, σ, τ aus \bar{H} folge aus $\rho \leq \sigma$, daß $\rho + \tau \leq \sigma + \tau$ ist.

Daraus folgt: Ist $\sigma + \tau = \rho$, $\rho \leq \sigma$, dann ist $\tau \leq \rho$. Ist $\sigma = 2\rho$, dann ist $\sigma = \rho$. Ist $\mu \leq \sigma$, $\rho \leq \tau$, dann ist $\mu + \rho \leq \sigma + \tau$.

Auf \bar{H} sei ein äußeres Kompositionsgesetz $(M, \rho) \rightarrow M\rho$, $M\rho \in \bar{H}$, mit dem Operatorenbereich $\Omega = \{M, N, \dots\}$ erklärt. Innere Kompositionsgesetze auf Ω seien durch $(M+N)\rho = M\rho + N\rho$, $(MN)\rho = M(N\rho)$ gegeben für beliebiges $M \in \Omega$, $N \in \Omega$, und $\rho \in \bar{H}$. Für die Operatoren aus Ω gelte ferner für beliebiges $M \in \Omega$, $\sigma \in \bar{H}$, $\rho \in \bar{H}$

Ω_1 : falls $\sigma \leq \rho$, dann sei $\sigma \leq M\rho$,

Ω_2 : falls $\sigma \leq \rho$, dann sei $M\sigma \leq M\rho$.

Sind die Operatoren aus Ω additiv, so ist $M0 = 0$ und $\Omega 1$ folgt aus $\Omega 2$. Ferner ist dann $M(-\rho) = -M\rho$.

Sei f eine Abbildung von E in E und $E' \subseteq E$. Für ein $n \in \mathbb{N}$ existiere ein $M \in \Omega$, so daß für beliebiges $x \in E'$ und für beliebiges $y \in E'$ $d(f^n(x), f^n(y)) \leq M d(x, y)$ ist. Dann sagen wir, „ f^n ist auf E' M -beschränkt“. Für $z \in E$ setzen wir ferner $z_i = f^i(z)$, $i \in \mathbb{N}$. Es gelten dann folgende hinreichende Kriterien für die Gültigkeit von (3.1):

1. Für ein $z \in E$ und jedes $n \in \mathbb{N}$ sei f^n auf $\{z, z_1, z_2, z_3, \dots\}$ M_n -beschränkt. Existiert für beliebiges festes $\rho' \in H'$ ein $n \in \mathbb{N}$, so daß $M_n d(z, z_r) \leq \rho'$ ist für beliebiges $r > 0$, so gilt (3.1).

BEWEIS. Zu beliebigem $\rho \in H'$ existiert $\rho' \in H'$, so daß $2\rho' \leq \rho$ ist. Ferner gilt $d(z_n, z_{n+r}) \leq M_n d(z, z_r) \leq \rho'$. Für $k \geq n$ und $l \geq n$ ist dann $d(z_k, z_l) \leq d(z_k, z_n) + d(z_n, z_l) \leq 2\rho' \leq \rho$.

2. Sei f auf den Mengen $\{z_{i+1}, z_i\}$, $i \in \mathbb{N}$, M -beschränkt. Für beliebiges $\rho \in H'$ existiere ein $n \in \mathbb{N}$, so daß für jedes $r \geq 0$ $\sum_{j=0}^r M^j d(z_{n+1}, z_n) \leq \rho$ ist, wobei M^0 den Identitätsoperator bedeute. Dann gilt (3.2) und damit (3.1).

BEWEIS. $\sum_{i=k}^m d(z_{i+1}, z_i) \leq \sum_{i=n}^m d(z_{i+1}, z_i) \leq \sum_{j=0}^{m-n} M^j d(z_{n+1}, z_n) \leq \rho$.

Ferner gelten folgende Fehlerabschätzungen:

1. Sei $x = f(x)$, $z \in E$ und f^n auf $\{x, z\}$ M_n -beschränkt für jedes $n \in \mathbb{N}$. Dann ist $d(x, z_n) \leq M_n d(x, z)$ eine Abschätzung des Abstandes der n -ten Iterierten $f^n(z)$ vom Punkte x . Abschätzungen dieser Art dienen in der Praxis zur Kennzeichnung des Konvergenzverhaltens (z. B. lineare Konvergenz, quadratische Konvergenz).

2. Sei $k \in \mathbb{N}$ eine feste Zahl, $m > n > k$, f^l auf $\{z_{k+1}, z_k\}$ M_l -beschränkt für jedes $l \geq n - k$ und x Limes der Filterbasis $\left\{ \bigcup_{\substack{i \in \mathbb{N} \\ i \geq n}} f^i(z) \right\}_{n \in \mathbb{N}}$. Dann ist $d(x, z_n) \leq d(x, z_m) + \sum_{l=n-k}^{m-k-1} M_l d(z_{k+1}, z_k)$.

BEWEIS.

$$d(x, z_n) \leq d(x, z_m) + d(z_m, z_n) \quad \text{und} \quad d(z_m, z_n) \leq \sum_{i=n}^{m-1} d(z_{i+1}, z_i) \leq \sum_{l=n-k}^{m-k-1} M_l d(z_{k+1}, z_k).$$

Abschätzungen dieser Art werden in der Praxis häufig benützt, falls z.B. H das Intervall $[0, \infty)$, E ein metrischer Raum, Ω eine Menge von nichtnegativen reellen Zahlen ist, $\lim_{m \rightarrow \infty} d(x, z_m) = 0$ ist und die Reihe $\sum_{l=n-k}^{\infty} M_l$ konvergiert.

Auf der Majorantenmethode beruht

SATZ 4. Sei f eine Abbildung von E in E und f^l auf E M_l -beschränkt für jedes $l \in \mathbb{N}$. Es existiere ein Operator $M \in \Omega$ und zu beliebig gewählten $\varrho \in H'$, $y \in E$, $z \in E$ ein $s \in \mathbb{N}$, so daß für jedes $m \geq s$ $o \leq M d(y, z) - \sum_{l=1}^m M_l d(y, z) \leq \varrho$ ist. Dann ist $\{\bigcup_{l \geq j} f^l(z)\}_{j \in \mathbb{N}}$ Basis eines Cauchy-Filters und

$$\{f^{s+1}(y), f^{s+1}(z)\} \times \{f^{s+1}(y), f^{s+1}(z)\} \subseteq B_{2\varrho}.$$

BEWEIS. $\{\bigcup_{l \geq j} f^l(z)\}_{j \in \mathbb{N}}$ ist genau dann Basis eines Cauchy-Filters, wenn (3.1) gilt. Sei ϱ^* ein beliebiges Element aus H' , $2\varrho \leq \varrho^*$, $2\varrho' \leq \varrho$ nach $H2$, und $r \in \mathbb{N}$. Wir nehmen das zu ϱ' , z_{r+1} , z_r gehörige $s \in \mathbb{N}$. Es ist $d(z_{j+1}, z_j) \leq M_{j-r} d(z_{r+1}, z_r)$ für $j > r$. Aus $D3$ folgt $d(z_{s+r+k+1}, z_{s+r+1}) \leq \sum_{j=s+r+1}^{s+r+k} d(z_{j+1}, z_j) \leq \sum_{j=s+1}^{s+k} M_j d(z_{r+1}, z_r)$ für beliebiges $k > 0$. Ferner gilt $M d(z_{r+1}, z_r) - \sum_{j=1}^s M_j d(z_{r+1}, z_r) \leq \varrho'$ und $-M d(z_{r+1}, z_r) + \sum_{j=1}^{s+k} M_j d(z_{r+1}, z_r) \leq \varrho'$, also nach $H3$ $\sum_{j=s+1}^{s+k} M_j d(z_{r+1}, z_r) \leq 2\varrho'$. Daraus folgt $d(z_{s+r+k+1}, z_{s+r+1}) \leq 2\varrho' \leq \varrho$. Ebenso gilt dann für beliebiges $l > 0$ $d(z_{s+r+l+1}, z_{s+r+l+1}) \leq 2\varrho' \leq \varrho$. Damit folgt aus $D3$ $d(z_{s+r+k+1}, z_{s+r+l+1}) \leq 2\varrho \leq \varrho^*$. Somit gilt (3.1) mit $n = s + r + 2$. — Schließlich ist $M_{s+1} d(y, z) \leq 2\varrho$, also $d(f^{s+1}(y), f^{s+1}(z)) \leq M_{s+1} d(y, z) \leq 2\varrho$.

Ist H das Intervall $[0, \infty)$, E ein vollständiger, metrischer Raum, Ω eine Menge von nichtnegativen reellen Zahlen, so ergibt Satz 4 mit den Sätzen 1 und 2 einen Existenz- und Eindeutigkeitsatz für Fixpunkte, der anscheinend erstmals von J. WEISSINGER [2] formuliert wurde. Die in Satz 1 geforderte Stetigkeit folgt dabei aus der Dehnungsbeschränktheit.

Literatur

- [1] KANTOROVITCH, L.: The method of successive approximation for functional equations. Acta Mathematica Uppsala 71, 63–97 (1939).
- [2] WEISSINGER, J.: Zur Theorie und Anwendung des Iterationsverfahrens. Math. Nachr. 8, 193–212 (1952).
- [3] SCHRÖDER, J.: Das Iterationsverfahren bei allgemeinerem Abstandsbegriff. Math. Z. 66, 111–116 (1956).
- [4] BOURBAKI, N.: Topologie générale. Deuxième édition. Paris 1951.

München, Mathematisches Institut der Technischen Hochschule

Ann Arbor, University of Michigan, Dept. of Mathematics

(Eingegangen am 5. März 1960)