

En particulier, si T_n est limite d'une suite d'opérateurs de rang fini, alors T est compact.

La réciproque est fautive en général, mais les contre-exemples sont difficiles à construire.

À partir de maintenant on va se concentrer sur le cas des opérateurs compacts $T: H \rightarrow H$, où H est un espace de Hilbert (réel ou complexe, pour le moment) séparable.

Thm: Soit H un Hilbert séparable, et $T \in K(H)$.
Alors il existe une suite d'opérateurs de rang fini $(T_n)_n$ tq $\|T_n - T\| \xrightarrow{n \rightarrow \infty} 0$.

Preuve: Soit $(e_n)_{n \in \mathbb{N}}$ une base hilbertienne de H , et soit $H_n = \text{Vect}(\{e_i\}_{i \leq n})$.

Soit $A_n = \|T|_{H_n}\|$; $(A_n)_{n \in \mathbb{N}}$ est une suite décroissante.

Montrons que (A_n) converge vers 0. Si ce n'est pas le cas, il existe $\varepsilon > 0$ tq pour tout n il existe $x_n \in H_n^+$ avec $\|x_n\| = 1$ et $\|T(x_n)\| \geq \varepsilon$.

Comme $\overline{T(B_\varepsilon)}$ est compact, on peut extraire une sous-suite $(x_{p(n)})_{n \in \mathbb{N}}$ telle que $\|T(x_{p(n)})\| \rightarrow y$, avec $\|y\| \geq \varepsilon$.

Notons P_n la projection orthogonale sur H_n ; pour tout x , $P_n(x) \rightarrow x$.

On a aussi, puisque $\langle x_{p(n)}, e_i \rangle \xrightarrow{n \rightarrow \infty} 0$ pour tout i , que $(x_{p(n)})_n$ converge faiblement vers 0, donc $\langle x_{p(n)}, x \rangle \xrightarrow{n \rightarrow \infty} 0$ pour tout x .

$$\begin{aligned} \text{Pour } z \in H, \text{ on a alors } \langle y, z \rangle &= \lim_{n \rightarrow \infty} \langle T x_{p(n)}, z \rangle \\ &= \lim_{n \rightarrow \infty} \langle x_{p(n)}, T^* z \rangle \\ &= 0. \end{aligned}$$

Donc $y = 0$, ce qui est une contradiction: $\lim_{n \rightarrow \infty} A_n = 0$.

On a $\|T|_{H_n^+}\| = \|T(\text{id} - P_n)\|$, donc $\|T P_n - T\| \xrightarrow{n \rightarrow \infty} 0$.

Puisque P_n est de rang fini, $T P_n$ l'est aussi. \square

Thm: Soit H un espace de Hilbert séparable, et $T \in K(H)$.
Alors $T^* \in K(H)$.

Rge: Ce résultat est vrai dans tout espace de Banach (l'adjoint d'un opérateur compact est un opérateur compact) mais la preuve est assez difficile.

Preuve: Si T_n est de rang fini alors T_n^* aussi (exercice)
et $\|T - T_n\| = \|(T - T_n)^*\| = \|T^* - T_n^*\|$
Donc T^* est limite d'opérateurs de rang fini (donc compact). \square

Thm: Soit $T \in K(H)$

(i) Pour tout $\lambda \neq 0$ $\text{Ker}(T - \lambda I)$ est de dimension finie

(ii) Pour tout $\lambda \neq 0$ $\text{Im}(T - \lambda I)$ est fermé, de codimension finie.
(égale à $\dim(\text{Ker}(T^* - \bar{\lambda}I))$)

Preuve: (i) si $\text{Ker}(T - \lambda I)$ est de dimension infinie, sa boule unité B_λ fermée n'est pas compacte (Riesz).

Donc $T(B_\lambda) = \lambda B_\lambda$ n'est pas compact.

Mais λB_λ est un fermé contenu dans $T(B) = \overline{T(B)}$ n'est pas compact, impossible puisque $T \in K(H)$.

(ii) On a $\overline{\text{Im}(T - \lambda I)} = \text{Ker}((T - \lambda I)^*)^\perp = \text{Ker}(T^* - \bar{\lambda}I)^\perp$.

Comme T^* est compact, $\text{Ker}(T^* - \bar{\lambda}I)$ est de dimension finie;

et $H = \text{Ker}(T^* - \bar{\lambda}I) \oplus \text{Ker}(T^* - \bar{\lambda}I)^\perp = \text{Ker}(T^* - \bar{\lambda}I) \oplus \overline{\text{Im}(T - \lambda I)}$.

Reste à montrer que $\text{Im}(T - \lambda I)$ est fermé.

On a $H = \text{Ker}(T - \lambda I) \oplus \underbrace{\text{Ker}(T - \lambda I)^\perp}_F$; sur F , $T - \lambda I$ est injective.

Plutôt qu'il existe $\delta > 0$ $\forall y \in F$ $\|(T - \lambda I)(y)\| \geq \delta \|y\|$.

Si non, on peut trouver $(y_n)_{n \in \mathbb{N}}$ avec $\begin{cases} \|y_n\| = 1 \\ \|(T - \lambda I)(y_n)\| \rightarrow 0 \end{cases}$

Comme T est compact, on peut trouver une sous-suite $(y_{\varphi(n)})_{n \in \mathbb{N}}$ telle que $T(y_{\varphi(n)}) \xrightarrow{n \rightarrow +\infty} z$.

On a $\lambda y_{\varphi(n)} - T(y_{\varphi(n)}) \rightarrow 0$, donc $\lambda y_{\varphi(n)} \xrightarrow{n \rightarrow +\infty} z$.

De plus $\|y_{\varphi(n)}\| = 1$ pour tout n , donc $\|z\| = \lambda$.

On a donc $z \in F$ (F est fermé); $\|z\| = \lambda$; $Tz = \lambda z$.

Cela contredit la définition de $F = \text{Ker}(T - \lambda I)^\perp$.

Soit maintenant $x_n \in \text{Im}(T - \lambda I)$ qui converge vers $x \in H$.

On peut écrire $x_n = (T - \lambda I)(y_n)$ avec $y_n \in F$ pour tout n .

$\forall n, m$ $\|y_n - y_m\| \leq \frac{1}{\delta} \|(T - \lambda I)(y_n) - (T - \lambda I)(y_m)\|$: $(y_n)_n$ est de Cauchy.

Donc $y_n \xrightarrow{n \rightarrow +\infty} z \in F$, et $(T - \lambda I)(z) = \lim_{n \rightarrow +\infty} (T - \lambda I)(y_n) = \lim_{n \rightarrow +\infty} x_n = x$.

Donc $x \in \text{Im}(T - \lambda I)$, qui est bien fermé par conséquent. \square

Def: Pour $T \in \mathcal{K}(H)$ et $\lambda \in \mathbb{K} (= \mathbb{R} \text{ ou } \mathbb{C})$ on pose,
 Pour $m \in \mathbb{N}$, $H_m^\lambda = \text{Ker}(T - \lambda I)^m$

On a vu que, si $\lambda \neq 0$, alors $H_1^\lambda = \text{Ker}(T - \lambda I)$ est de dimension finie.

De plus $H = H_1^\lambda \oplus (H_1^\lambda)^\perp$, et sur $(H_1^\lambda)^\perp$ $T - \lambda I$ est injective

Donc $\text{Ker}(T - \lambda I) \subseteq H_1^\lambda + (T - \lambda I)|_{(H_1^\lambda)^\perp}^{-1}(H_1^\lambda)$ est de dimension inférieure à $2 \dim(H_1^\lambda)$

Exercice: Pq. $\forall m \in \mathbb{N}$ $\dim(H_m^\lambda) \leq m \dim(H_1^\lambda)$.

En particulier, chaque H_m^λ est de dimension finie.

Thm: Soit $T \in \mathcal{K}(H)$ et $\lambda \in \mathbb{K} \setminus \{0\}$
 Alors $\exists m \forall n \geq m$ $H_n^\lambda = H_m^\lambda$

Preuve: On doit trouver m tq $H_m^\lambda = H_{m+1}^\lambda$.

si un tel m n'existe pas, on peut pour tout $m \geq 1$ trouver $e_m \in H_m^\lambda \cap (H_{m-1}^\lambda)^\perp$, avec $\|e_m\| = 1$.

Pour tout $m \geq 1$ on a $(T - \lambda I)(e_m) \in H_{m-1}^\lambda$, donc

$$T(e_m) = \lambda e_m + y_m \text{ avec } y_m \in H_{m-1}^\lambda$$

$$\text{Si } n > m, T(e_n) - T(e_m) = \lambda e_n + \underbrace{y_n - \lambda e_m - y_m}_{\text{orthogonal à } e_n} \text{ (car } e_m \in H_{n-1}^\lambda)$$

$$\text{Donc } \|T(e_n) - T(e_m)\| \geq \lambda \text{ si } n > m.$$

Ceci contredit la compacité de $\overline{T(B)}$ □

Thm: Soit $T \in \mathcal{K}(H)$ et $\lambda \in \mathbb{K} \setminus \{0\}$. Alors:

(i) λ est valeur propre de T ssi $\bar{\lambda}$ est valeur propre de T^*

$$(ii) \dim(\text{Ker}(T - \lambda I)) = \dim(\text{Ker}(T^* - \bar{\lambda} I)) = \text{codim}(\text{Im}(T - \lambda I))$$

Preuve: Soit $\lambda \neq 0$ une valeur propre de T ; alors $T - \lambda I$ n'est pas injective. Montrons que $T - \lambda I$ n'est pas non plus surjective.

Pour cela, considérons $H_\infty^\lambda = \bigcup_{n \in \mathbb{N}} H_n^\lambda$, qui est de dimension finie.

Si $x \in H$ est tel que $(T - \lambda I)(x) \in H_\infty^\lambda$, alors il existe n tq $(T - \lambda I)(x) \in \text{Ker}(T - \lambda I)^n$, donc $x \in \text{Ker}(T - \lambda I)^{n+1} \subseteq H_\infty^\lambda$.

Par conséquent, $(T - \lambda I)^{-1}(H_0^\lambda) \subseteq H_0^\lambda$

13

H_0^λ est de dimension finie, et $(T - \lambda I)|_{H_0^\lambda}$ n'est pas injective, donc pas surjective; il existe donc $y \in H_0^\lambda \setminus \text{Im}(T - \lambda I)|_{H_0^\lambda}$.

Donc $\text{Im}(T - \lambda I) \neq H$; comme $\text{Im}(T - \lambda I)$ est fermé,

$\text{Im}(T - \lambda I)^\perp \neq \{0\}$, donc $\text{Ker}(T^* - \bar{\lambda}I) = \text{Im}(T - \lambda I)^\perp \neq \{0\}$

On conclut que $\bar{\lambda}$ est une valeur propre de T^* .

Par le lemme (ii), notons qu'on sait déjà que

$$\dim(\text{Ker}(T^* - \bar{\lambda}I)) = \text{codim}(\text{Im}(T - \lambda I)).$$

Et $\dim(\text{Im}(T - \lambda I)|_{H_0^\lambda}) + \dim(\text{Ker}(T - \lambda I)) = \dim(H_0^\lambda)$ (formule du rang)

$$\dim(\text{Im}(T - \lambda I) \cap H_0^\lambda) + \dim(\text{Ker}(T - \lambda I)) = \dim(H_0^\lambda)$$

$$\text{Or, } \text{codim}(\text{Im}(T - \lambda I)) \geq \text{codim}(\text{Im}(T - \lambda I) \cap H_0^\lambda) \quad (*)$$

(calculée dans H_0^λ)

Donc $\text{Codim}(\text{Im}(T - \lambda I)) \geq \dim(\text{Ker}(T - \lambda I))$

c.-à.-d. $\dim(\text{Ker}(T^* - \bar{\lambda}I)) \geq \dim(\text{Ker}(T - \lambda I))$

Comme $T = (T^*)^*$, on conclut en appliquant cette inégalité à T^* (qui appartient à $K(H)$) que $\dim(\text{Ker}(T - \lambda I)) = \dim(\text{Ker}(T^* - \bar{\lambda}I))$. \square

Revenons sur l'inégalité (*): Soit F_1, F_2 tels que

$$\begin{aligned} \text{Im}(T - \lambda I) \oplus^\perp F_1 &= H \\ (\text{Im}(T - \lambda I) \cap H_0^\lambda) \oplus^\perp F_2 &= H_0^\lambda \end{aligned}$$

Alors $H / \text{Im}(T - \lambda I) \cong F_1$

Et $H_0^\lambda / \text{Im}(T - \lambda I) \cap H_0^\lambda \cong F_2$.

De plus, $H_0^\lambda / \text{Im}(T - \lambda I) \cap H_0^\lambda$ est un sous-espace de $H / \text{Im}(T - \lambda I)$

Donc $\dim(F_2) \leq \dim(F_1)$, ce qu'affirmait (*).

Au cours de la preuve précédente, nous avons établi un résultat important: l'alternative de Fredholm.

Thm (alternative de Fredholm): Soit $T \in \mathcal{K}(H)$, $\lambda \in \mathbb{K} \setminus \{0\}$.

Les conditions suivantes sont équivalentes:

- (i) $T - \lambda I$ est injective
- (ii) $T - \lambda I$ est surjective
- (iii) $T - \lambda I$ est un isomorphisme.

En particulier, pour $\lambda \neq 0$ et $T \in \mathcal{K}(H)$, $\lambda \in \sigma(T)$ si et seulement si λ est une valeur propre de T .

Preuve: si $T - \lambda I$ n'est pas injective, alors $T^* - \bar{\lambda} I$ non plus.
(résultat précédent). Donc $\text{Ker}(T^* - \bar{\lambda} I) \neq \{0\}$

Donc $\text{Im}(T - \lambda I) = \text{Ker}(T^* - \bar{\lambda} I)^\perp \neq H$: $T - \lambda I$ non surjective.

Si $T - \lambda I$ n'est pas surjective, alors

$$\text{Ker}(T^* - \bar{\lambda} I) = \text{Im}(T - \lambda I)^\perp \neq \{0\}$$

Donc $\text{Ker}(T^* - \bar{\lambda} I) \neq \{0\}$ ^{fermé} $\neq H$: $\bar{\lambda}$ est une valeur propre de T^* ,
par conséquent λ est une valeur propre de T .

Ceci montre que (i) \Leftrightarrow (ii). L'équivalence avec (iii) vient du fait qu'une bijection linéaire continue de H dans H est nécessairement continue d'inverse (puisque H est complet) \square

Thm: Soit $T \in \mathcal{K}(H)$, $\lambda \in \sigma(T) \setminus \{0\}$. Alors il existe un unique sous-espace fermé F de H tel que $\begin{cases} T(F) \subseteq F \\ H = H_0^\lambda \oplus F \end{cases}$
Si m est tel que $H_0^\lambda = H_m^\lambda$, on a $F = \text{Im}(T - \lambda I)^m$.

Attention: la somme directe ci-dessus n'est pas orthogonale en général.

Preuve: Soit F fermé, T -invariant, tel que $H_0^\lambda \oplus F = H$
Alors $T - \lambda I : F \rightarrow F$ est injectif, et $T|_F \in \mathcal{K}(F)$
D'après l'alternative de Fredholm, $T - \lambda I : F \rightarrow F$ est un isomorphisme.

Donc $F \subseteq \text{Im}(T - \lambda I)^m$, pour tout $m \in \mathbb{N}$.

Reste à montrer que, pour m suffisamment grand, on a $H_0^\lambda \oplus \text{Im}(T - \lambda I)^m = H$.

Soit $m \geq 1$ tel que $H_0^\lambda = H_m^\lambda = \text{Ker}(T - \lambda I)^m$.

On a $(T - \lambda I)^m = \underbrace{T^m - m\lambda T^{m-1} + \dots + m(-\lambda)^{m-1}T}_{\in K(H)} + \underbrace{(-\lambda)^m I}_{\neq 0}$

Donc $\text{Im}(T - \lambda I)^m$ est fermé, de codimension égale à $\dim(\text{Ker}(T - \lambda I)^m) = \dim(H_0^\lambda)$

Bien sûr $\text{Im}(T - \lambda I)^m$ est T -stable; pour conclure, il nous reste à établir que $\text{Im}(T - \lambda I)^m \cap H_0^\lambda = \{0\}$

Soit $y \in \text{Im}(T - \lambda I)^m \cap H_0^\lambda$.

Alors il existe x dans H_0^λ tq $y = (T - \lambda I)^m(x) = 0$
(argument déjà vu... si $(T - \lambda I)(x) \in H_0^\lambda$ alors $x \in H_0^\lambda$)

Finalement, puisque H_0^λ et $\text{Im}(T - \lambda I)^m$ sont en somme directe et $\dim(H_0^\lambda) = \text{codim}(\text{Im}(T - \lambda I)^m)$, on conclut que $H_0^\lambda \oplus \text{Im}(T - \lambda I)^m = H$ □

Thm: Soit H un espace de Hilbert séparable, de dimension infinie. Soit $T \in K(H)$.
Alors $\sigma(T)$ a l'une des deux formes suivantes:
(i) $\{0, \lambda_1, \dots, \lambda_n\}$, où $\lambda_1, \dots, \lambda_n$ sont des valeurs propres non nulles, de multiplicité finie
(ii) $\{0\} \cup \{\lambda_n\}_{n \in \mathbb{N}}$ où $\{\lambda_n\}_{n \in \mathbb{N}}$ est une suite de valeurs propres non nulles, toutes de multiplicité finie, qui converge vers 0.

Preuve: Soit λ un élément non nul de $\sigma(T)$ on a $H = H_0^\lambda \oplus F$ avec F fermé, T -invariant
 $T - \lambda I|_F : F \rightarrow F$ est un isomorphisme d'après l'alternative de Fredholm.

Il existe donc $r > 0$ tq pour tout μ avec $|\mu| < r$ $T - \lambda I - \mu I$ induit un isomorphisme de F .

Il suit que, pour tout μ avec $0 < |\mu| < r$, $\lambda + \mu$ n'est pas une valeur propre de F . Donc λ est un point isolé de $\sigma(F)$, qui est compact.

Cela implique qu'une suite convergente de $\sigma(T)$ est stationnaire ou converge vers 0; comme $0 \in \sigma(T)$, le spectre est d'une des deux formes ci-dessus (selon qu'il est fini ou infini) □

Def: $\left\{ \begin{array}{l} T \in \mathcal{L}(H) \text{ est normal si } T^*T = TT^* \\ T \in \mathcal{L}(H) \text{ est autoadjoint si } T^* = T \end{array} \right.$ □

Rq: "Si T est autoadjoint alors T est normal
 . Pour tout T , TT^* et T^*T sont autoadjoints.

Prop: $\left\{ \begin{array}{l} \text{Si } T \in \mathcal{L}(H) \text{ alors } \|T^*T\| = \|T\|^2 \end{array} \right.$

Preuve: $\|T^*T\| \leq \|T^*\| \cdot \|T\| = \|T\|^2$

Soit $x \in H$, $\|x\| \leq 1$. $\|T(x)\|^2 = \langle T(x), T(x) \rangle = \langle T^*T(x), x \rangle$

Donc $\|T(x)\|^2 \leq \|T^*T\| \cdot \|x\|^2 \leq \|T^*T\|$

En passant au sup: $\|T\|^2 \leq \|T^*T\|$ □

Prop: Soit $T \in \mathcal{L}(H)$ à la fois normal et compact.
 Alors T admet un vecteur propre par une valeur propre
 λ tq $|\lambda| = \|T\|$.

Preuve: Soit $U = T^*T$, $\lambda = \|U\| = \|T\|^2$. On suppose $\lambda \neq 0$.
 Notons que U est compact et autoadjoint.

~~Par compacité de U~~

Soit $(x_n)_n$ tq $\|x_n\| \leq 1$ et tq $\|T^*(x_n)\| \rightarrow \|T\|$

On extrait $(x_{\varphi(n)})_n$ tq $T^*(x_{\varphi(n)}) \rightarrow y$ (par compacité de T^*)

On a alors:

$$\|TT^*(x_{\varphi(n)}) - \lambda x_{\varphi(n)}\|^2 = \|TT^*(x_{\varphi(n)})\|^2 + \lambda^2 \|x_{\varphi(n)}\|^2 - 2\lambda \operatorname{Re}(\langle TT^*(x_{\varphi(n)}) | x_{\varphi(n)} \rangle)$$

$$\leq \|TT^*\|^2 + \lambda^2 - 2\lambda \underbrace{\|T^*(x_{\varphi(n)})\|^2}_{\rightarrow \lambda}$$

Donc $TT^*(x_{\varphi(n)}) - \lambda x_{\varphi(n)} \xrightarrow{n \rightarrow +\infty} 0$.

Donc $\lambda x_{\varphi(n)} \xrightarrow{n \rightarrow +\infty} T(y)$

Puis $\lambda y = \lim_{n \rightarrow +\infty} T^*(\lambda x_{\varphi(n)}) = T^*T(y)$.

De plus $\|y\| = \|T\| \neq 0$: y est un vecteur propre de T^*T
 pour la valeur propre $\lambda = \|T\|^2$.

Soit $F = \text{Ker}(T^*T - \lambda I)$ de dimension finie > 1
(par compacité de T^*T)

T et T^* commutent avec T^*T , donc stabilisent F .

Par conséquent $T|_F$ est un opérateur normal de l'espace
de dimension finie F , et $T^*T|_F = \lambda \text{id}_F$ d'où $\|T|_F\|^2 = \lambda$

Par le théorème spectral à dimension finie, $T|_F$
admet une valeur propre μ avec $|\mu| = \|T|_F\| = \sqrt{\lambda} = \|T\|$ \square

Théorème spectral pour les opérateurs normaux compacts:

Soit T un opérateur normal compact. Alors il existe une base hilbertienne $(e_n)_{n \in I}$ formée de vecteurs propres de T .

(I fini si $\dim(H) < \infty$, $I = \mathbb{N}$ sinon)

Preuve: On suppose H de dimension infinie, sinon le résultat est déjà connu.

Pour $\lambda \in \sigma(T)$, notons H_λ le sous-espace propre associé à λ .

Si $x \in H_\lambda$ on a $T(T^*(x)) \stackrel{T \text{ normal}}{=} T^*T(x) = \lambda T^*(x) : T^*(x) \in H_\lambda$.

Donc T^* stabilise H_λ ; sur H_λ on a $T(x) = \lambda x$ et $T^*(x) = \bar{\lambda} x$.

Si $\lambda \neq \mu$ sont deux éléments de $\sigma(T)$, on a pour $x \in H_\lambda, y \in H_\mu$:

$$\lambda \langle x, y \rangle = \langle \lambda x, y \rangle = \langle T(x), y \rangle = \langle x, T^*y \rangle = \langle x, \bar{\mu} y \rangle = \bar{\mu} \langle x, y \rangle$$

Donc $\langle x, y \rangle = 0$: les espaces propres sont deux à deux orthogonaux.

~~Soit~~ ~~Soit~~

$\sigma(T)$ est au plus dénombrable; pour $\lambda \neq 0$ H_λ est de dimension finie.
(de vecteurs propres!)

Fixons $(f_i^\lambda)_{i \in I_\lambda}$ une base hilbertienne de chaque H_λ

(si $\lambda \neq 0$ I_λ est fini, si jamais $0 \in \sigma(T)$ I_0 peut être infini dénombrable)

En réunissant tous les $(f_i^\lambda)_{\substack{\lambda \in \sigma(T) \\ i \in I_\lambda}}$ on obtient une famille dénombrable, qu'on peut énumérer sous la forme $(e_n)_{n \in \mathbb{N}}$, qui forme une base hilbertienne de l'espace vectoriel fermé engendré par les H_λ ; chaque e_n est un vecteur propre de T .

Il nous reste à justifier que $F = \text{Vect}(\{H_\lambda : \lambda \in \sigma(T)\})$ est dense.

Si ce n'est pas le cas, F^\perp est un sous-espace vectoriel de H , non trivial.

Comme F^\perp est T^\perp -stable et T est normal, F^\perp est T -stable et T^* -stable.

$$\text{Si } \begin{cases} x \in F^\perp \\ y \in F^\perp \end{cases} \text{ on a } \begin{cases} \langle x, Ty \rangle = \langle T^*x, y \rangle = 0 \\ \langle x, T^*y \rangle = \langle Tx, y \rangle = 0 \end{cases}$$

Donc T induit un opérateur normal compact de F^\perp , et y admet donc une valeur propre, ce qui est absurde puisque F contient tous les vecteurs propres de T . Donc $F = H$. □