

NOTE SUR UN GENRE D'EXTENSIONS
DU THÉORÈME DE CONTRACTION DE BANACH

par
ANDREI NEY

(Cluj)

En 1962 a paru une note de E. RAKOTCH [8], dont le but essentiel est d'étendre le bien connu théorème de contraction de BANACH [1], dans un espace métrique complet (E, ρ) remplaçant le facteur numérique de contraction α ($0 < \alpha < 1$), dans

$$(1) \quad \rho(Ax', Ax'') \leq \alpha \rho(x', x'') \quad (x', x'' \in E, x' \neq x'')$$

par un facteur fonctionnel, noté $\alpha(\rho(x', x''))$, dépendant de la distance des points $x', x'' \in E$, et prenant ses valeurs dans l'intervalle $[0, 1[$ en décroissant si ρ décroît (l'opérateur A applique E dans E , comme on le sait bien).

En 1965 a paru un article de A. NEY [6], dans lequel nous remplaçons dans l'inégalité (1) de Banach, le facteur numérique α par un facteur fonctionnel noté $\alpha(x', x'')$, dépendant directement des points $x', x'' \in E$, étant soumis au commencement à la seule condition d'être non-négatif et supérieurement borné, puis qu'il prenne ses valeurs dans l'intervalle $[0, 1[$. On remarque, que $\alpha(x', x'')$ représente toujours une borne supérieure du „taux d'écart des images” : $\frac{\rho(Ax', Ax'')}{\rho(x', x'')}$ (c'est-à-dire la différence divisée de A sur les noeuds x', x'' distincts). Nous reproduisons notre

THÉORÈME 1. Soit A un opérateur qui applique l'espace métrique complet (E, ρ) , dans lui-même, pour chaque couple d'éléments $x', x'' \in E$ ($x' \neq x''$), étant valable l'inégalité

$$(2) \quad \rho(Ax', Ax'') \leq \alpha(x', x'') \rho(x', x''),$$

où α est une fonctionnelle appliquant $E^2 \setminus \{(x, x) \mid x \in E\}$ dans $[0, a[$, $a \in R_+$. Si pour la suite $\{\alpha(x_n, x_{n+1}); n = 0, 1, \dots\}$ correspondant à la suite $x_0, x_1, \dots, x_n, \dots$ obtenue à l'aide de la récurrence

$$(3) \quad x_{n+1} = Ax_n \quad (n = 0, 1, \dots; x_0 \in E)$$

a lieu — pour chaque n — l'inégalité

$$(4) \quad c_n - c_{n+1} \alpha(x_n, x_{n+1}) \geq \mu \alpha(x_n, x_{n+1}),$$

où (c_n) est une suite de nombres strictement positifs et μ est une constante strictement positive, alors existe $\lim_{n \rightarrow \infty} x_n = x^* \in E$ et x^* est un point fixe de A . (Si pour un certain $n = n_0$ on avait $\alpha(x_{n_0}, x_{n_0+1}) = 0$, alors le point fixe serait $x^* = x_{n_0+1}$). Si en particulier $a = 1$, donc $0 \leq \alpha(x', x'') < 1$ — (c'est le cas de la „contraction faible”) — et (4) ayant toujours lieu, alors le point fixe est unique et il est indépendant de l'élément initial x_0 . L'approximation de x^* par x_n est donnée par

$$(5) \quad \rho(x_n, x^*) \leq \frac{\rho(x_0, x_1)}{\mu} \left(c_{n-1} \prod_{k=1}^{n-1} \alpha(x_{k-1}, x_k) - b \right),$$

où

$$(5') \quad b = \lim_{n \rightarrow \infty} c_n \prod_{k=1}^n \alpha(x_{k-1}, x_k).$$

Quelques ans plus tard, ont été publiés des travaux de même genre, qui partent dans leurs démonstrations en essence de la même idée que [6]. Citons-les: 1967 — N. GHEORGHIU [2], 1968 — ȘT. NICZKY [7], 1969 — G. GOLDNER [3]. Nous considérons utile de donner du relief à cette modeste idée, de telle façon qu'elle nous serve aussi pour pousser plus loin le théorème de contraction, jusqu'à des conditions nécessaires et suffisantes pour l'existence d'un point fixe. Des applications immédiates seront aussi présentées.

Rappelons, que dans la démonstration universellement connue du théorème de Banach on part de l'inégalité généralisée du triangle

$$(6) \quad \rho(x_n, x_m) \leq \sum_{k=n}^{m-1} \rho(x_k, x_{k+1}) \quad (n, m \in N, m > n),$$

puis, du fait que le terme général de la série $\sum \rho(x_k, x_{k+1})$ est majoré par le terme général de la série géométrique convergente $\sum \alpha^k \rho(x_0, x_1)$, résulte que la suite (x_m) est une suite Cauchy.

Dans le cas envisagé par (2) il peut arriver que la série $\sum \rho(x_k, x_{k+1})$ — si elle est convergente — converge si lentement, que sa convergence ne peut pas être mise en évidence par la comparaison avec une série géométrique (dont le quotient α satisfait $0 < \alpha < 1$). Dans ce cas il faut étudier directement la série $\sum \rho(x_k, x_{k+1})$, pour en établir la nature. Dans les conditions de l'inégalité (2) la série en cause a la forme analytique développée

$$(7) \quad \rho(x_0, x_1) \sum_{(n)} \prod_{k=1}^n \alpha(x_{k-1}, x_k); \text{ et on note } u_n = \prod_{k=1}^n \alpha(x_{k-1}, x_k).$$

La condition (4) n'est pas autre chose, que l'application du critérium de convergence de Kummer à la série à termes positifs $\sum u_n$. La „série des produits finis” telle que (7), est essentielle dans les extensions du théorème de Banach et elle est mise en oeuvre par les auteurs cités, [2], [7], [3], sous une forme adaptée pour leurs besoins. (Remarquons encore, qu'une représentation analytique du thème général d'une série à termes positifs et convergente, quelconque, moyennant le produit fini, est donnée déjà dans [5]).

Application 1. Nous mettrons dans une nouvelle lumière le rôle du célèbre rapport de d'Alembert, $\frac{u_{n+1}}{u_n}$, pour une série numérique, réelle ou complexe, à termes non-nuls. Considérons la suite (s_n) des sommes partielles d'une telle série $\sum u_n$. On conçoit l'opérateur séquentiel \mathfrak{S} , qui fait correspondre au terme s_n , le terme suivant, s_{n+1} , donc $s_{n+1} = \mathfrak{S} s_n$ ($n \in N$). L'égalité triviale

$$|s_{n+1} - s_n| = \left| \frac{u_{n+1}}{u_n} \right| \cdot |s_n - s_{n-1}| \quad (n = 2, 3, \dots)$$

peut être transcrite dans l'espace métrique \mathfrak{C} , à l'aide de l'opérateur séquentiel ci-dessus introduit

$$(8) \quad \rho(\mathfrak{S} s_n, \mathfrak{S} s_{n-1}) = \left| \frac{u_{n+1}}{u_n} \right| \rho(s_n, s_{n-1}) \quad (n = 2, 3, \dots)$$

et le rôle de $\left| \frac{u_{n+1}}{u_n} \right|$ ¹⁾ apparaît tout de suite, comme un „taux d'écart des images”. Dans le cas des séries numériques à termes non-nuls, pour lesquelles $\left| \frac{u_{n+1}}{u_n} \right| < \alpha < 1$, l'opérateur séquentiel \mathfrak{S} est une contraction, et existe $\lim_{n \rightarrow \infty} s_n = s \in \mathfrak{C}$, donc $\sum u_n$ converge. On mentionne, que l'alternative

¹⁾ Bien entendu, ici $\alpha(s_n, s_{n-1}) = \left| \frac{\mathfrak{S} s_n - s_n}{s_n - s_{n-1}} \right| = \left| \frac{u_{n+1}}{u_n} \right|$.

de convergence du critérium de d'Alembert est un cas particulier du théorème classique de Banach, qui lui-même est obtenu comme un cas particulier de notre théorème 1, en faisant dans (4) $c_n = 1$ ($n \in N$); en effet, dans ce cas il résulte de (4) l'inégalité

$$\alpha(x_n, x_{n+1}) \leq \frac{1}{1+\mu} = \alpha < 1 \quad (n \in N).$$

Application 2. Dans [6] nous avons donné un exemple où la suite $\{\alpha(x_n, x_{n+1}); n=0, 1, 2, \dots\}$ peut surpasser l'unité, mais, dans les conditions bien précisées dans [4], cette suite a deux points d'accumulation, l'un α' ($0 < \alpha' < 1$) et l'autre α'' ($1 < \alpha'' < +\infty$), tellement que $\alpha'\alpha'' < 1$. Alors, l'opérateur A aura — en concordance avec le théorème 1 — un point fixe.

Application 3. Soit la relation de récurrence

$$(9) \quad z_{n+2} = \frac{2(n+1)}{n+2} z_{n+1} - \frac{n}{n+2} z_n \quad (n \in N)$$

donnée dans le plan complexe \mathbb{C} . Quelle est la nature d'une suite engendrée par (9), étant donnés les éléments initiaux $z_1, z_2 \in \mathbb{C}$, mais $z_2 \neq z_1$? On voit facilement, que (9) peut être mise sous la forme

$$z_{n+2} - z_{n+1} = \frac{n}{n+2} (z_{n+1} - z_n), \text{ d'où } |z_{n+2} - z_{n+1}| = \frac{n}{n+2} |z_{n+1} - z_n|$$

et d'ici, avec une autre notation — moyennant l'opérateur séquentiel \mathbb{S} , rencontré dans l'exemple 1 — on obtient

$$\rho(\mathbb{S}z_{n+1}, \mathbb{S}z_n) = \frac{n}{n+2} \rho(z_{n+1}, z_n).$$

Dans ce cas particulier de la contraction faible relativisée à une trajectoire, le rôle de $\alpha(z_n, z_{n+1})$ est joué par une fonction dépendant directement de n , c'est-à-dire $\alpha(z_n, z_{n+1}) = \frac{n}{n+2} < 1$ ($n \in N$), et l'inégalité non stricte, (4), est satisfaite comme égalité, avec $c_n = n$ et $\mu = 1$, indépendamment de z_1 et de $z_2 \neq z_1$, donc chaque trajectoire $z_1 z_2 \dots z_n \dots$ nous conduit au même point fixe, c'est-à-dire (9) engendre seulement des suites (z_n) convergentes dans \mathbb{C} .

Observation 1. De l'inégalité, (6) on peut tirer la conclusion, que la suite (x_n) est une suite Cauchy, si la série $\sum \rho(x_k, x_{k+1})$ converge; mais du seul fait, que la série $\sum \rho(x_k, x_{k+1})$ diverge, on ne peut rien dire à l'égard du caractère de (x_n) d'être ou non une suite Cauchy. Pour que

la convergence de la série $\sum \rho(x_k, x_{k+1})$ soit étroitement liée au caractère de (x_n) d'être une suite Cauchy, — il est suffisant qu'on se trouve dans un tel espace métrique ou bien sur une telle trajectoire d'un espace métrique, que la distance jouisse de la propriété de „sous-additivité modérée”, c'est-à-dire: qu'il existe une constante K_0 , tel que

$$(10) \quad \rho(x_n, x_m) \leq \sum_{k=n}^{m-1} \rho(x_k, x_{k+1}) \leq K_0 \rho(x_n, x_m) \quad (n, m \in N, \forall m > n)$$

(l'idée en est, que „la ligne polygonale $\overline{x_n x_{n+1} \dots x_m}$ ” ne soit beaucoup plus longue que la „segment $x_n x_m$ ”). Dans ce contexte sera possible d'énoncer une condition nécessaire et suffisante pour l'existence d'un point fixe. On envisage, tout d'abord, un tel espace.

Un cône à norme modérément sous-additive. Soit $\mathcal{U}^{(v)}$ un espace unitaire v -dimensionnel, dont $(e_k)_{k=1}^v$ est une base orthonormale; alors un élément quelconque, $x \in \mathcal{U}^{(v)}$, aura comme représentation unique $x = \sum_{k=1}^v \lambda_k e_k$ où $\lambda_k \in R$. Soit \mathcal{K} le cône des éléments ayant pour représentation

$$(11) \quad x = \sum_{k=1}^v \lambda_k e_k; \lambda_k > 0 \quad (k = 1, 2, \dots, v).$$

Bien entendu $\|x\| = \sqrt{\sum_{k=1}^v \lambda_k^2} < \sum_{k=1}^v \lambda_k$. Définissons aussi les „cosinus-directeurs” α_k ($k = 1, \dots, v$), par

$$(12) \quad \alpha_k = \frac{\lambda_k}{\sqrt{\sum_{k=1}^v \lambda_k^2}} \quad (k = 1, \dots, v); \text{ évidemment } \sum_1^v \alpha_k^2 = 1.$$

On aura

$$(13) \quad \sum_{k=1}^v \|\lambda_k e_k\| = \sum_{k=1}^v \lambda_k = \sum_{k=1}^v \alpha_k \sqrt{\sum_1^v \lambda_k^2} = \left(\sum_{k=1}^v \alpha_k \right) \cdot \|x\| = \\ = \left(\sum_{k=1}^v \alpha_k \right) \cdot \left\| \sum_{k=1}^v \lambda_k e_k \right\|.$$

On pose la question: quelle est la valeur maxima que $\sum_{k=1}^v \alpha_k$ peut atteindre? Dans ce but on utilise la méthode des multiplicateurs de Lagrange:

$$\Phi(\alpha_1, \dots, \alpha_v, \mu) = \sum_{k=1}^v \alpha_k + \mu \left(\sum_{k=1}^v \alpha_k^2 - 1 \right), \text{ avec } \alpha_k > 0 \quad (k = 1, \dots, v),$$

d'où le système classique pour annuler les dérivées partielles :

$$(14) \quad \begin{cases} \Phi'_{\alpha_k} = 1 + 2\mu\alpha_k = 0 & (k = 1, \dots, \nu) \\ \Phi'_\mu = \sum_1^\nu \alpha_k^2 - 1 = 0. \end{cases}$$

On en tire : $\alpha_k = -\frac{1}{2\mu}$, $\mu = -\frac{1}{2\alpha_k}$, d'où $\mu < 0$; puis $\sum_1^\nu \alpha_k^2 = \sum_1^\nu \frac{1}{4\mu^2} = 1$,

d'où $\frac{\nu}{4\mu^2} = 1$ et ainsi $\mu = -\frac{\sqrt{\nu}}{2}$ et $\alpha_k = \frac{1}{\sqrt{\nu}}$, donc $\max \sum_{k=1}^\nu \alpha_k = \frac{\nu}{\sqrt{\nu}} = \sqrt{\nu}$.

Ce résultat introduit dans (13), donne

$$(15) \quad \sum_{k=1}^\nu \|\lambda_k e_k\| \leq \sqrt{\nu} \left\| \sum_{k=1}^\nu \lambda_k e_k \right\|,$$

ce qui exprime la relation d'ordre entre la norme d'un élément x du cône \mathfrak{K} et la somme des normes de ses composantes. On considère n éléments quelconques de \mathfrak{K} , n nombre naturel arbitraire :

$$\{x^{(i)} \in \mathfrak{K}, i = 1, \dots, n\}, \text{ pour lesquels } x^{(i)} = \sum_{k=1}^\nu \lambda_k^{(i)} e_k \quad (\lambda_k^{(i)} > 0)$$

et leur somme est $x = \sum_{i=1}^n x^{(i)}$. On aura

$$(16) \quad x = \sum_{i=1}^n x^{(i)} = \sum_{i=1}^n \sum_{k=1}^\nu \lambda_k^{(i)} e_k = \sum_{k=1}^\nu \left[\sum_{i=1}^n \lambda_k^{(i)} \right] e_k = \sum_{k=1}^\nu \Lambda_k e_k,$$

où on a noté $\Lambda_k = \sum_{i=1}^n \lambda_k^{(i)}$ (Λ_k étant la composante d'ordre k de x , dans $\mathfrak{U}^{(\nu)}$), et on aura bien entendu $\Lambda_k > 0$ ($k = 1, \dots, \nu$). Conformément à (15),

$$\sum_{k=1}^\nu \|\Lambda_k e_k\| \leq \sqrt{\nu} \left\| \sum_{k=1}^\nu \Lambda_k e_k \right\|,$$

et en continuant — toujours par minoration — on obtient

$$\begin{aligned} \sqrt{\nu} \left\| \sum_{k=1}^\nu \Lambda_k e_k \right\| &\geq \sum_{k=1}^\nu \|\Lambda_k e_k\| = \sum_{k=1}^\nu \Lambda_k = \sum_{k=1}^\nu \sum_{i=1}^n \lambda_k^{(i)} = \\ &= \sum_{i=1}^n \sum_{k=1}^\nu \lambda_k^{(i)} = \sum_{i=1}^n \|\lambda_k^{(i)} e_k\| \geq \sum_{i=1}^n \left\| \sum_{k=1}^\nu \lambda_k^{(i)} e_k \right\| = \sum_{i=1}^n \|x^{(i)}\|, \end{aligned}$$

d'où — vu aussi (16) —

$$(17) \quad \sum_{i=1}^n \|x^{(i)}\| \leq \sqrt{\nu} \left\| \sum_{k=1}^\nu \Lambda_k e_k \right\| = \sqrt{\nu} \left\| \sum_{i=1}^n x^{(i)} \right\|.$$

Ainsi, on peut dire, que la somme des normes d'un nombre fini et quelconque, n , d'éléments du cône \mathfrak{K} , ne dépasse pas la norme de cette somme multipliée par $\sqrt{\nu}$; ça veut dire que dans \mathfrak{K} la norme est modérément sous-additive. Comme conséquence, on peut énoncer le

THORÈME 2. Si A applique l'espace unitaire ν -dimensionnel $U^{(\nu)}$ (complet) dans lui-même, A satisfaisant à l'inégalité (2), alors l'inégalité (4) est suffisante pour que A ait un point fixe dans $U^{(\nu)}$. Si la suite engendrée par (3) est telle, que pour ses termes : soit toutes les différences de la forme $x_k - x_{k+1}$, soit celles de la forme $x_{k+1} - x_k$ (pour $k = 0, 1, \dots$) fassent part du cône \mathfrak{K} (et ainsi la distance $\rho(x_k, x_{k+1}) = \|x_k - x_{k+1}\|$, se soumet à la sous-additivité modérée car dans \mathfrak{K} la norme s'y soumet) alors l'inégalité (4) est aussi nécessaire²⁾ pour qu'on aboutisse à un point fixe $x^* \in U^{(\nu)}$, par la trajectoire (x_n) .

Application 4. Soit (x_n) une suite de nombres réels; pour qu'elle soit (non-strictement) convexe respectivement concave il faut et il suffit qu'elle satisfasse à

$$(18) \quad \begin{cases} a) & x_{n+1} \leq \lambda_n x_n + (1 - \lambda_n) x_{n+2} & (n \in N) \\ \text{respectivement à} \\ b) & x_{n+1} \geq \lambda_n x_n + (1 - \lambda_n) x_{n+2} & (n \in N), \end{cases}$$

où (λ_n) est une suite prenant ses valeurs dans $]0, 1[$, d'ailleurs complètement arbitraire. Dans ces conditions, les relations de récurrence

$$(19) \quad \begin{cases} a) & x_{n+2} \geq \frac{1}{1 - \lambda_n} x_{n+1} - \frac{\lambda_n}{1 - \lambda_n} x_n & (n \in N) \\ \text{respectivement} \\ b) & x_{n+2} \leq \frac{1}{1 - \lambda_n} x_{n+1} - \frac{\lambda_n}{1 - \lambda_n} x_n & (n \in N), \end{cases}$$

²⁾ On rappelle que le critérium de Kummer exprime une condition nécessaire et suffisante pour la convergence d'une série à termes positifs, [5].

engendrent des suites (x_n) convexes respectivement concaves, suivant qu'on est dans le cas (19-a) respectivement (19-b), dès que l'on a donné deux termes initiaux distincts $x_1, x_2 \in R$; on mentionne que x_n et x_{n+1} ($n \in N$) étant connus, on peut choisir x_{n+2} en respectant tout-de-même l'inégalité en cause. Dans le cas de la convexité, (a), nous intéresseront les suites lesquelles satisferont à partir d'un indice n_0 l'inégalité $x_n \geq x_{n+1}$, tandis que dans le cas de la concavité, (b), les suites pour lesquelles aura lieu $x_n \leq x_{n+1}$ si $n > n_0$. Dans ces deux cas, les formules (19) deviendront — après une légère transformation —

$$(20) \quad \begin{cases} a) & x_{n+1} - x_{n+2} \leq \frac{\lambda_n}{1 - \lambda_n} (x_n - x_{n+1}) \text{ et } x_n \geq x_{n+1} \text{ (} n > n_0 \text{)} \\ & \text{respectivement} \\ b) & x_{n+2} - x_{n+1} \leq \frac{\lambda_n}{1 - \lambda_n} (x_{n+1} - x_n) \text{ et } x_n \leq x_{n+1} \text{ (} n > n_0 \text{)}. \end{cases}$$

Une fois ces suites étant engendrées, on conçoit l'opérateur séquentiel \mathbb{S} tel que $x_{n+1} = \mathbb{S} x_n$ ($n > n_0$); avec la distance habituelle dans R^1 , le système (20) prend la forme, aussi dans le cas de (20-a) que dans celui de (20-b)

$$(21) \quad \rho(\mathbb{S} x_n, \mathbb{S} x_{n+1}) \leq \frac{\lambda_n}{1 - \lambda_n} \rho(x_n, x_{n+1}) \quad (n > n_0).$$

Les suites (x_n) étant monotones, la distance est strictement additive sur la trajectoire $x_1 x_2 \dots x_n \dots$ (donc elle est bien modérément sous-additive). Alors :

une condition nécessaire et suffisante pour qu'une suite convexe et monotônément décroissante à partir d'un indice n_0 , engendrée par (19-a), — respectivement, pour qu'une suite concave et monotônément croissante à partir d'un indice n_0 , engendrée par (19-b) soit convergente, est — conformément à (4) —

$$(22) \quad c_n - c_{n+1} \frac{\lambda_n}{1 - \lambda_n} \geq \mu \frac{\lambda_n}{1 - \lambda_n} \quad (n < n_0).$$

Puisque, le critérium de Kummer a aussi une forme égalité (avec la constante $\mu = 1$) voir [5] et aussi note²⁾, la condition nécessaire et suffisante peut être mise sous la forme équivalente à (22), notamment

$$(23) \quad c'_n \frac{1 - \lambda_n}{\lambda_n} - c'_{n+1} = 1, \quad c'_n > 0 \quad (n > n_0).$$

De (23) on peut obtenir

$$(24) \quad \lambda_n = \frac{c'_n}{1 + c'_n + c'_{n+1}}, \quad c'_n > 0 \quad (n > n_0);$$

cette formule (24) est une représentation analytique de la suite (λ_n) figurant dans (19), pour que ces récursions engendrent des suites (x_n) , convergentes dans les conditions de convexité (concavité) et de monotonie, précisées plus haut.

BIBLIOGRAPHIE

- [1] Banach, S., *Sur les opérations dans les ensembles abstraits et leurs applications aux équations intégrales*. Fundamenta Math. **3**, 133—181 (1922).
- [2] Gheorghiu, N., *Teorema contractiilor în spații uniforme*. Studii și Cerc. Mat. Acad. R.S. Romania, **19**, 119—122 (1967).
- [3] Goldner, G., *On successive approximation for set valued mappings*. Proc. Conf. Constructive Theory of Functions. Budapest, 189—193 (1969).
- [4] Ney, A., *Extinderea domeniului de aplicabilitate al criteriului de convergență al lui d'Alembert*. Gaz. Mat. Fiz. București. Seria A. **12**, 709—712 (1958).
- [5] — *Contributions à l'étude de la rapidité de convergence des séries à termes positifs*. Mathematica (Cluj), **4** (27), 77—105 (1962).
- [6] — *O extindere a teoremei de contractie a lui Banach în spații metrice*. Studia Univ. „Babeș-Bolyai” Ser. Math.-Phys. 41—46 (1965).
- [7] Niczky, Șt., *Asupra unor teoreme de punct fix în spații uniforme complete*. Analele Ști. Univ. „Al. I. Cuza” Iași Sect. I. Matematică. **2**, 391—397 (1968).
- [8] Rakoč, E., *A note on contractive mappings*. Proc. Amer. Math. Soc. **13**, 459—465 (1962).

Reçu, le 13. XII. 1973.

Universitatea „Babeș-Bolyai” din Cluj
Facultatea de Matematică-Mecanică
Catedra de analiză