

Построение энергетической функции для трёхмерных каскадов с двумерным растягивающимся аттрактором

В. З. Гринес, М. К. Носкова, О. В. Починка

В настоящей работе устанавливается существование энергетической функции структурно устойчивых диффеоморфизмов замкнутых трёхмерных многообразий, неблуждающее множество которых содержит двумерный растягивающийся аттрактор.

Библиография: 24 названия. *УДК:* 517.938. *MSC2010:* 37D20. *Ключевые слова и фразы:* энергетическая функция, *DA*-диффеоморфизм, структурная устойчивость.

ПОСВЯЩЕНИЕ

Авторы посвящают эту работу Юлию Сергеевичу Ильяшенко, который является для нас примером замечательного руководителя научной школы. Он внимательно следит за каждым из своих учеников, умело напутствует и направляет их по жизни. Нам посчастливилось окунуться в добрую атмосферу этой школы. По сей день нас связывают не только полезные взаимно обогащающие научные контакты, но и искренне дружеские отношения. С огромной благодарностью вспоминаются выступления на семинаре у Юлия Сергеевича в МГУ, его желание понять и донести до аудитории результаты докладчика. Когда имелась возможность, он всегда посещал наши доклады на конференциях и семинарах, подбадривал своими меткими замечаниями. Хочется надеяться, что и впредь наши научные и жизненные пути будут иметь множественные пересечения.

ВВЕДЕНИЕ И ФОРМУЛИРОВКА РЕЗУЛЬТАТОВ

В силу тесной взаимосвязи между динамической системой и её *функцией Ляпунова* (непрерывной функцией, не возрастающей вдоль траекторий системы), качественное поведение системы во многом определяется структурой её функции Ляпунова. Особенно сильно этот эффект проявляется в случае, когда система обладает *энергетической функцией*, то есть гладкой функцией

© В. З. Гринес, М. К. Носкова, О. В. Починка, 2015

Работа выполнена при финансовой поддержке Российского фонда фундаментальных исследований (гранты 13-01-12452-офи-м, 15-01-03687-а) и Российского научного фонда (грант 14-41-00044). В данной научной работе использованы результаты проекта «Динамические системы и их приложения», выполненного в рамках Программы фундаментальных исследований НИУ ВШЭ в 2015 г.

Ляпунова, множество критических точек которой совпадает с цепно рекуррентным множеством системы. Кроме того, функция — объект много более удобный для изучения, чем однопараметрическое семейство отображений многообразия, поэтому естественно встаёт вопрос о существовании энергетической функции у динамической системы. Наличие функции Ляпунова у любой динамической системы доказано К. Конли [3] в 1978 г., этот факт был назван позже фундаментальной теоремой динамических систем (см., например, [20, теорема 1.1, с. 404]). Существование энергетической функции у любого потока следует из работы В. Вильсона и Дж. Йорке [24]. Каскады даже с регулярной динамикой не обладают в общем случае энергетической функцией. Такие примеры построены в работе Д. Пикстона [14], а также В. З. Гринеса, Ф. Лауденбаха, О. В. Починки [6], в последней также найдены достаточные условия существования энергетической функции Морса для трёхмерных каскадов Морса — Смейла. Тем более удивительным является факт наличия энергетической функции у некоторых дискретных динамических систем с хаотическим поведением, доказанный в настоящей работе.

Более детально. Пусть $f \in \text{Diff}^1(M)$ — C^1 -гладкий диффеоморфизм замкнутого n -мерного ($n \geq 2$) многообразия M , снабжённого некоторой римановой метрикой d . Множество $\Lambda \subset M$, инвариантное относительно f , называется *гиперболическим*, если ограничение $T_\Lambda M$ касательного расслоения TM многообразия M на Λ можно представить в виде суммы Уитни $E_\Lambda^s \oplus E_\Lambda^u$ df -инвариантных подрасслоений E_Λ^s, E_Λ^u ($\dim E_x^s + \dim E_x^u = n, x \in \Lambda$) и существуют такие константы $C_s > 0, C_u > 0, 0 < \lambda < 1$, что

$$\begin{aligned} \|df^m(v)\| &\leq C_s \lambda^m \|v\| \quad \text{для } v \in E_\Lambda^s, \\ \|df^{-m}(v)\| &\leq C_u \lambda^m \|v\| \quad \text{для } v \in E_\Lambda^u, m > 0. \end{aligned}$$

Гиперболическая структура порождает существование так называемых *устойчивых* и *неустойчивых* многообразий, которые объединяют точки с одинаковым асимптотическим поведением при положительных и отрицательных соответственно итерациях [10, 22]. Для любой точки $x \in \Lambda$ существует инъективная иммерсия $J_x^s: \mathbb{R}^s \rightarrow M$, образ которой $W_x^s = J_x^s(\mathbb{R}^s)$ называется *устойчивым многообразием точки x* , такая что выполняются следующие свойства:

- (1) $T_x W_x^s = E_\Lambda^s$;
- (2) точки $x, y \in M$ принадлежат одному многообразию $W^s(x)$ тогда и только тогда, когда $d(f^n(x), f^n(y)) \rightarrow 0$ при $n \rightarrow \infty$;
- (3) $f(W_x^s) = W_{f(x)}^s$;
- (4) если $x, y \in \Lambda$, то либо $W_x^s = W_y^s$, либо $W_x^s \cap W_y^s = \emptyset$;
- (5) если точки $x, y \in \Lambda$ близки на M , то W_x^s, W_y^s C^1 -близки на компактных множествах.

Неустойчивое многообразие W_x^u точки $x \in \Lambda$ определяется как устойчивое многообразие относительно диффеоморфизма f^{-1} . Неустойчивые многообразия

обладают аналогичными свойствами. С учётом свойства (3) устойчивые и неустойчивые многообразия называются *инвариантными многообразиями*.

Точка $x \in M$ называется *неблуждающей*, если для любой её окрестности $U(x)$ и любого натурального числа N найдётся $n_0 \in \mathbb{Z}$, $|n_0| \geq N$, такое что $f^{n_0}(x) \in U(x)$. Множество неблуждающих точек диффеоморфизма f будем обозначать через $NW(f)$. Диффеоморфизм f удовлетворяет аксиоме A (или, что то же самое, является A -диффеоморфизмом), если множество $NW(f)$ гиперболическое и периодические точки всюду плотны в $NW(f)$.

Смейл [23] доказал следующее утверждение, известное как *теорема о спектральном разложении*. Пусть диффеоморфизм $f \in \text{Diff}^1(M)$ удовлетворяет аксиоме A . Тогда множество $NW(f)$ представляется в виде конечного объединения попарно непересекающихся замкнутых инвариантных множеств $\Lambda_1, \dots, \Lambda_k$, называемых *базисными множествами*, каждое из которых содержит всюду плотную орбиту. При этом объёмлющее многообразие M можно представить следующим образом:

$$M = \bigcup_{i=1}^k W_{\Lambda_i}^s = \bigcup_{i=1}^k W_{\Lambda_i}^u,$$

где

$$W_{\Lambda_i}^s = \bigcup_{x \in \Lambda_i} W_x^s \quad \text{и} \quad W_{\Lambda_i}^u = \bigcup_{x \in \Lambda_i} W_x^u.$$

Базисное множество называется *нетривиальным*, если оно не является периодической орбитой (в частности, не является неподвижной точкой).

В силу транзитивности f на каждом базисном множестве Λ_i , ограничения расслоений $E_{\Lambda_i}^s, E_{\Lambda_i}^u$ на Λ_i имеют постоянную размерность во всех точках $x \in \Lambda_i$.

Компактное f -инвариантное множество $A \subset M$ называется *аттрактором* диффеоморфизма f , если оно имеет такую компактную окрестность U_A , что $f(U_A) \subset \text{int } U_A$ и $A = \bigcap_{k \geq 0} f^k(U_A)$. *Репеллер* определяется как аттрактор для f^{-1} .

В силу [16], базисное множество Λ диффеоморфизма f является аттрактором (репеллером) тогда и только тогда, когда $\Lambda = \bigcup_{x \in \Lambda} W_x^u$ ($\Lambda = \bigcup_{x \in \Lambda} W_x^s$).

Аттрактор Λ A -диффеоморфизма f называется *растягивающимся аттрактором*, если топологическая размерность $\dim \Lambda$ равна размерности неустойчивого многообразия W_x^u , $x \in \Lambda$. Репеллер диффеоморфизма f называется *сжимающимся*, если он является растягивающимся аттрактором для f^{-1} .

Два диффеоморфизма $f, g \in \text{Diff}^1(M)$ называются *топологически сопряжёнными*, если существует гомеоморфизм $\varphi: M \rightarrow M$ такой, что $\varphi \circ f = g \circ \varphi$. Диффеоморфизм $f \in \text{Diff}^1(M)$ называется *структурно устойчивым*, если существует такая его окрестность $U(f) \subset \text{Diff}^1(M)$, что любой диффеоморфизм $g \in U(f)$ сопряжён f . Если потребовать, чтобы сопрягающий гомеоморфизм был близок к тождественному в C^0 -топологии, то получим определение *грубого* диффеоморфизма. Теперь известно, что понятия «грубости» и «структурной устойчивости» эквивалентны, хотя доказательство этого факта весьма

нетривиально (см. обзор [1], где обсуждаются различные определения и соответствующие результаты).

При формулировке условий структурной устойчивости большую роль играет условие, которое называют сильным условием трансверсальности. Пусть $W_1, W_2 \subset M$ — два иммерсированных многообразия, имеющих непустое пересечение. По определению, W_1, W_2 пересекаются трансверсально, если для любой точки $x \in W_1 \cap W_2$ касательное пространство $T_x M$ порождается касательными подпространствами $T_x W_1$ и $T_x W_2$. В частности, если W_1, W_2 пересекаются трансверсально, то $\dim T_x W_1 + \dim T_x W_2 \geq \dim T_x M$.

Говорят, что A -диффеоморфизм удовлетворяет сильному условию трансверсальности, если для любых точек $x, y \in NW(f)$ многообразия W_x^s, W_y^u имеют только трансверсальные пересечения. Известно [11, 19], что диффеоморфизм структурно устойчив тогда и только тогда, когда он является A -диффеоморфизмом и удовлетворяет сильному условию трансверсальности. Необходимость доказал Мане [11], достаточность — Робинсон [19].

В настоящей работе рассматривается класс G структурно устойчивых диффеоморфизмов на 3-многообразии $f: M \rightarrow M$, неблуждающее множество которых содержит двумерный растягивающийся аттрактор Ω . В этом случае (см. предложение 1) многообразии M диффеоморфно трёхмерному тору и аттрактор Ω — единственное нетривиальное базисное множество диффеоморфизма f . Главным результатом настоящей работы является следующий факт.

Теорема 1. *Для любого диффеоморфизма $f \in G$ существует энергетическая функция, являющаяся функцией Морса вне базисного множества Ω .*

§ 1. ДИНАМИЧЕСКИЕ СВОЙСТВА ДИФФЕОМОРФИЗМОВ КЛАССА G

В этом разделе мы изложим необходимую для доказательства теоремы 1 информацию о динамике диффеоморфизма $f \in G$, следуя работе [7]. Заметим, что все результаты работы [7] сформулированы для многообразия размерности $n \geq 3$ и случая, когда Ω является ориентируемым базисным множеством¹. Однако в работе [25] доказано, что в случае нечётного n базисное множество Ω является ориентируемым. Поэтому везде ниже, формулируя выжимку результатов работы [7] для случая $n = 3$, мы не требуем от Ω дополнительно быть ориентируемым.

Пусть $f \in G$ и Ω — двумерный растягивающийся аттрактор диффеоморфизма f . Тогда $\dim W_x^s = 1$ для любой точки $x \in \Omega$, что позволяет ввести обозначение $(z, y)^s$ ($[z, y]^s$) для открытой (замкнутой) дуги устойчивого многообразия W_x^s , ограниченной точками $y, z \in W_x^s$.

¹Базисное множество Λ называется ориентируемым, если для любой точки $x \in \Lambda$ и любых фиксированных чисел $\alpha > 0, \beta > 0$ индекс пересечения $W_\alpha^s(x) \cap W_\beta^u(x)$ во всех точках пересечения один и тот же (+1, либо -1). В противном случае базисное множество Λ называется неориентируемым (см., например, [9, с. 622]).

Множество $W_x^s \setminus x$ состоит из двух компонент связности. Хотя бы одна из этих компонент имеет непустое пересечение с множеством Ω . Точка $x \in \Omega$ называется *s-граничной*, если одна из компонент связности множества $W_x^s \setminus x$ не пересекается с Ω , будем обозначать такую компоненту через $W_x^{s\emptyset}$. Множество Γ_Ω граничных точек множества Ω не пусто и состоит из конечного числа периодических точек, которые разбиваются на *ассоциированные пары* (p, q) точек одинакового периода так, что 2-связка $B_{pq} = W_p^u \cup W_q^u$ является достижимой изнутри границей² компоненты связности множества $M \setminus \Omega$.

Для каждой пары (p, q) ассоциированных граничных точек множества Ω построим так называемую *характеристическую сферу*.

Пусть B_{pq} — 2-связка аттрактора Ω , состоящая из двух неустойчивых многообразий W_p^u и W_q^u ассоциированных граничных точек p и q соответственно, и m_{pq} — период точек p, q . Тогда для любой точки $x \in W_p^u \setminus p$ существует единственная такая точка $y \in (W_q^u \cap W_x^s)$, что дуга $(x, y)^s$ не пересекается с множеством Ω . Определим отображение

$$\xi_{pq}: B_{pq} \setminus \{p, q\} \rightarrow B_{pq} \setminus \{p, q\},$$

положив $\xi_{pq}(x) = y$ и $\xi_{pq}(y) = x$. Тогда

$$\xi_{pq}(W_p^u \setminus p) = W_q^u \setminus q \quad \text{и} \quad \xi_{pq}(W_q^u \setminus q) = W_p^u \setminus p,$$

т. е. отображение ξ_{pq} переводит друг в друга проколотые неустойчивые многообразия 2-связки и является инволюцией ($\xi_{pq}^2 = \text{id}$). В силу теоремы о непрерывной зависимости инвариантных многообразий на компактных множествах отображение ξ_{pq} является гомеоморфизмом.

Ограничение $f^{m_{pq}}|_{W_p^u}$ имеет ровно одну гиперболическую отталкивающую неподвижную точку p , поэтому существует такой гладкий замкнутый 2-диск $D_p \subset W_p^u$, что $p \in D_p \subset \text{int}(f^{m_{pq}}(D_p))$. Тогда множество $C_{pq} = \bigcup_{x \in \partial D_p} (x, \xi_{pq}(x))^s$ гомеоморфно замкнутому двумерному цилиндру $\mathbb{S}^1 \times [0, 1]$. Множество C_{pq} называют *связывающим цилиндром*. Окружность $\xi_{pq}(\partial D_p)$ ограничивает в W_q^u двумерный 2-диск D_q такой, что $q \in D_q \subset \text{int}(f^{m_{pq}}(D_q))$. Множество $S_{pq} = D_p \cup C_{pq} \cup D_q$ гомеоморфно двумерной сфере, которую называют *характеристической сферой*, соответствующей связке B_{pq} (см. рис. 1).

Положим $T(f) = NW(f) \setminus \Omega$ и основные динамические свойства диффеоморфизма $f \in G$ сформулируем в виде предложения (см. рис. 2 для лучшего понимания).

Предложение 1. Пусть $f: M \rightarrow M$ — диффеоморфизм из класса G . Тогда имеют место следующие факты:

²Пусть $G \subset M$ — открытое множество с границей ∂G ($\partial G = \text{cl}(G) \setminus \text{int}(G)$). Подмножество $\delta G \subset \partial G$ называется *достижимой изнутри границей* области G , если для любой точки $x \in \delta G$ найдётся открытая дуга, полностью лежащая в G и такая, что x является одной из её концевых точек.

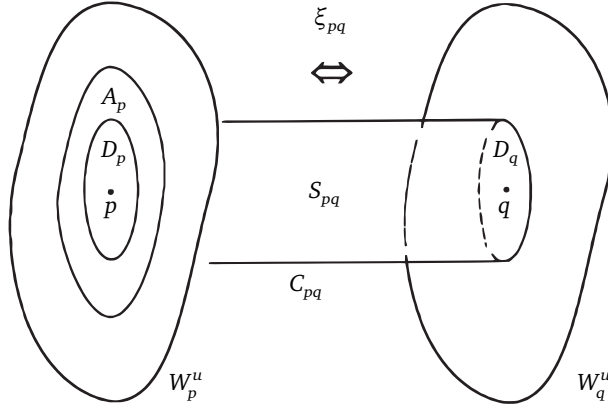
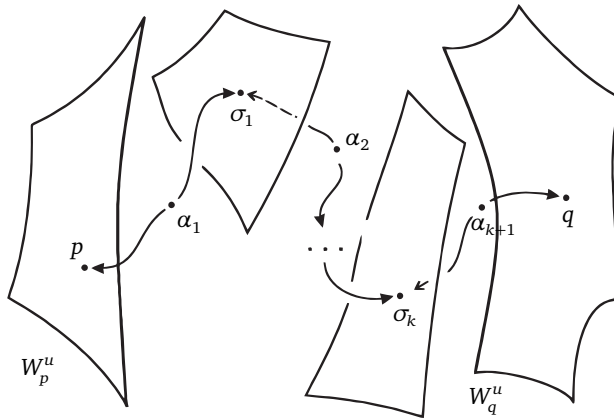


Рис. 1. ХАРАКТЕРИСТИЧЕСКАЯ СФЕРА

Рис. 2. Дуга l_{pq}

- (1) объемлющее многообразие M гомеоморфно трёхмерному тору \mathbb{T}^3 [7, теорема 5.1];
- (2) каждая характеристическая сфера S_{pq} ограничивает 3-шар Q_{pq} такой, что $T(f) \subset \bigcup_{(p,q) \in \Gamma_\Omega} Q_{pq}$ [7, теорема 5.1];
- (3) для каждой ассоциированной пары (p, q) граничных точек существует натуральное число k_{pq} такое, что $T(f) \cap Q_{pq}$ состоит из k_{pq} периодических источников $\alpha_1, \dots, \alpha_{k_{pq}}$ и $k_{pq} - 1$ седловых периодических точек $\sigma_1, \dots, \sigma_{k_{pq}-1}$, чередующихся на простой дуге [7, следствие 5.2]

$$l_{pq} = W_p^{s\emptyset} \cup \bigcup_{i=1}^{k_{pq}-1} W_{\sigma_i}^s \cup \bigcup_{i=1}^k W_{\alpha_i}^s \cup W_q^{s\emptyset};$$

- (4) пересечение $W_{\sigma_i}^u \cap Q_{pq}$, $i = 1, \dots, k_{pq} - 1$, состоит в точности из одного двумерного диска [7, теорема 4.1].

§ 2. СУЩЕСТВОВАНИЕ ЭНЕРГЕТИЧЕСКОЙ ФУНКЦИИ В БАССЕЙНЕ ОДНОМЕРНОГО АТТРАКТОРА ГРАДИЕНТНО-ПОДОБНОГО 3-ДИФФЕОМОРФИЗМА

В этом разделе мы приводим результаты работы [5] и книги [8], касающиеся критерия существования энергетической функции в бассейне одномерного аттрактора градиентно-подобного 3-диффеоморфизма.

В 1978 г. К. Конли [3] доказал существование функции Ляпунова для любого потока (каскада), заданного на гладком замкнутом ориентируемом n -многообразии N , то есть непрерывной функции, которая строго убывает вдоль орбит вне цепно рекуррентного множества и постоянна на компонентах этого множества. Для диффеоморфизмов Морса — Смейла³ цепно рекуррентное множество совпадает с множеством периодических орбит, так что в этом случае представляется естественным искать функцию Ляпунова в классе функций Морса. В 1977 г. Д. Пикстон [14] определил функцию Ляпунова для диффеоморфизма Морса — Смейла $g: N \rightarrow N$ как функцию Морса $\varphi: N \rightarrow \mathbb{R}$, такую что $\varphi(g(x)) < \varphi(x)$, если x — блуждающая точка, и $\varphi(g(x)) = \varphi(x)$, если x — периодическая точка. Такая функция может быть построена, в частности, с помощью перехода к надстройке над заданным диффеоморфизмом Морса — Смейла и дальнейшим применением результатов работы К. Мейера [12], построившего энергетическую функцию Морса — Ботта для произвольного потока Морса — Смейла.

Если φ — это функция Ляпунова для диффеоморфизма Морса — Смейла $g: N \rightarrow N$, то любая периодическая точка β является максимумом ограничения φ на неустойчивое многообразие W_β^u и минимумом ограничения φ на устойчивое многообразие W_β^s . Если эти экстремумы являются невырожденными, то инвариантные многообразия точки β трансверсальны всем регулярным множествам уровня φ в некоторой окрестности U_β точки β . Функция Ляпунова $\varphi: N \rightarrow \mathbb{R}$ для диффеоморфизма Морса — Смейла $f: N \rightarrow N$ называется *функцией Морса — Ляпунова*, если любая периодическая точка β является невырожденным максимумом (минимумом) ограничения φ на неустойчивое (устойчивое) многообразие W_β^u (W_β^s).

Среди функций Ляпунова для диффеоморфизма Морса — Смейла g функции Морса — Ляпунова образуют открытое всюду плотное в C^∞ -топологии множество.

Если β — критическая точка функции Морса $\varphi: N \rightarrow \mathbb{R}$, то, согласно лемме Морса (см., например, [13]), в некоторой окрестности $V(\beta)$ точки β существует локальная система координат x_1, \dots, x_n , называемая *координатами*

³ Диффеоморфизм $g: N \rightarrow N$ называется *диффеоморфизмом Морса — Смейла*, если его неблуждающее множество $NW(g)$ состоит из конечного числа гиперболических периодических точек ($NW(g) = \text{Per}(g)$), инвариантные многообразия которых пересекаются трансверсально.

Морса, такая что $x_j(p) = 0$ для каждого $j = \overline{1, n}$ и φ имеет вид

$$\varphi(x) = \varphi(\beta) - x_1^2 - \dots - x_b^2 + x_{b+1}^2 + \dots + x_n^2,$$

где b — индекс⁴ точки β . Если φ — функция Ляпунова для диффеоморфизма Морса — Смейла $f: N \rightarrow N$, то, в силу [14], для любой периодической точки $\beta \in \text{Per}(g)$ выполняется равенство $b = \dim W_\beta^u$.

Если φ — функция Ляпунова для диффеоморфизма Морса — Смейла g , то любая периодическая точка диффеоморфизма g является критической точкой функции φ . Обратное, вообще говоря, неверно: функция Ляпунова может иметь критические точки, которые не являются периодическими точками для g . Д. Пикстон [14] определил *энергетическую функцию* для диффеоморфизма Морса — Смейла g как функцию Морса — Ляпунова φ , множество критических точек которой совпадает с множеством периодических точек диффеоморфизма g . Он доказал, что любой диффеоморфизм Морса — Смейла, заданный на поверхности, обладает энергетической функцией, однако существует пример диффеоморфизма Морса — Смейла на трёхмерной сфере \mathbb{S}^3 , не имеющего энергетической функции. В работе В. З. Гринеса, Ф. Лауденбаха, О. В. Починки [4] доказано, что функция Ляпунова в примере Пикстона имеет не менее шести критических точек.

Напомним, что диффеоморфизм Морса — Смейла $g: N \rightarrow N$ называется *градиентно-подобным*, если для любой пары периодических точек β, γ ($\beta \neq \gamma$) из условия $W_\beta^u \cap W_\gamma^s \neq \emptyset$ следует, что $\dim W_\beta^s < \dim W_\gamma^s$. Следующее определение выделяет для градиентно-подобных диффеоморфизмов класс функций Морса — Ляпунова с дополнительными свойствами, аналогичными свойствам функций, введённых С. Смейлом [21] для градиентно-подобных векторных полей.

Функция Морса — Ляпунова φ для градиентно-подобного диффеоморфизма g называется *самоиндексирующейся энергетической функцией*, если выполняются следующие условия:

- 1) множество критических точек функции φ совпадает с множеством $\text{Per}(g)$ периодических точек диффеоморфизма g ;
- 2) $\varphi(\beta) = \dim W_\beta^u$ для любой точки $\beta \in \text{Per}(g)$.

Заметим, что понятие функции Ляпунова корректно определено на любом g -инвариантном подмножестве многообразия N .

Следующие рассуждения относятся только к трёхмерным многообразиям.

Пусть $g: N \rightarrow N$ — градиентно-подобный диффеоморфизм, Σ^+ (Ω^+) — подмножество множества всех седловых точек с одномерными неустойчивыми инвариантными многообразиями (стоковых точек) и множество $A^+ = W_{\Sigma^+}^u \cup \Omega^+$ является замкнутым и g -инвариантным. Тогда A^+ является аттрактором диффеоморфизма g . Множество $W_{A^+}^s = \bigcup_{\beta^+ \in (\Sigma^+ \cup \Omega^+)} W_{\beta^+}^s$ является g -инвариантным

⁴ Индексом критической точки β называется число отрицательных собственных значений матрицы $\frac{\partial^2 \varphi}{\partial x_i \partial x_j}(\beta)$.

и называется *бассейном одномерного аттрактора* A^+ . Обозначим через c^+ число компонент связности аттрактора A^+ , через r^+ — число седловых точек и через s^+ — число стоковых точек в A^+ . Положим $\delta(A^+) = c^+ + r^+ - s^+$. Аттрактор A^+ называется *тесно вложенным*, если он обладает окрестностью P^+ со следующими свойствами:

- 1) $g(P^+) \subset \text{int } P^+$;
- 2) P^+ является дизъюнктивным объединением c^+ ручечных тел⁵, сумма родов которых равен $\delta(A^+)$;
- 3) для любой седловой точки $\sigma^+ \in \Sigma^+$ пересечение $W_{\sigma^+}^s \cap P^+$ состоит из одного двумерного диска.

Предложение 2. Самоиндексирующаяся энергетическая функция φ_{A^+} диффеоморфизма g существует в бассейне $W_{A^+}^s$ аттрактора A^+ тогда и только тогда, когда он является тесно вложенным.

Тесно вложенный репеллер A^- градиентно-подобного диффеоморфизма $g: N \rightarrow N$ и его бассейн определяются как тесно вложенный аттрактор A^+ и его бассейн для диффеоморфизма g^{-1} . При этом функция $\varphi_{A^-}(x) = 3 - \varphi_{A^+}(x)$ будет самоиндексирующейся функцией диффеоморфизма g в бассейне репеллера A^- .

В упомянутом примере Пикстона неблуждающее множество $g: \mathbb{S}^3 \rightarrow \mathbb{S}^3$ состоит в точности из четырёх неподвижных точек: одного источника α , двух стоков ω_1, ω_2 , одного седла σ . Одномерный аттрактор A^+ этого диффеоморфизма совпадает с замыканием устойчивого многообразия седла σ и $\delta(A^+) = 0$. При этом любой трёхмерный шар, содержащий аттрактор A^+ в своей внутренности, пересекает W_{σ}^s не менее чем по трём компонентам связности (см. рис. 3). Таким образом, аттрактор A^+ не является тесно вложенным и, в силу предложения 2, в бассейне одномерного аттрактора Пикстона не существует энергетической функции.

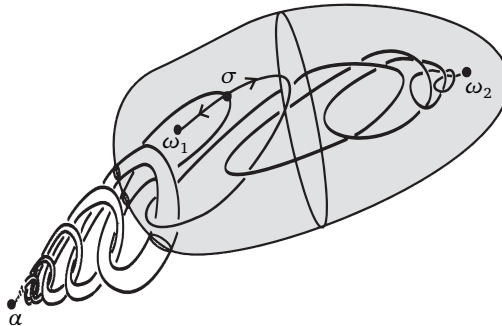


Рис. 3. ПРИМЕР ПИКСТОНА

⁵ Ручечным телом рода $\delta \geq 0$ называется компактное трёхмерное многообразие с краем, полученное из 3-шара попарным отождествлением 2δ двумерных попарно не пересекающихся дисков на границе шара посредством меняющего ориентацию отображения.

§ 3. ПОСТРОЕНИЕ ЭНЕРГЕТИЧЕСКОЙ ФУНКЦИИ ДЛЯ ДИФФЕОМОРФИЗМОВ ИЗ КЛАССА G

Доказательство основной теоремы базируется на предложениях 1 и 2. Разобьём построение энергетической функции для $f \in G$ на шаги, в которых будем использовать обозначения предыдущих разделов.

Шаг 1. Пусть (p, q) — пара ассоциированных граничных точек периода m_{pq} базисного множества Ω . Положим

$$A_{pq}^- = \bigcup_{j=0}^{m_{pq}-1} f^j \left(\bigcup_{i=1}^{k_{pq}-1} W_{\sigma_i}^s \cup \bigcup_{i=1}^{k_{pq}-1} W_{\alpha_i}^s \right).$$

По построению множество A_{pq}^- является репеллером диффеоморфизма f и $\delta(A_{pq}^-) = 0$. Покажем, что он является тесно вложенным. Для этого достаточно показать, что существует 3-шар P_{pq}^- такой, что $f^{-m_{pq}}(P_{pq}^-) \subset \text{int } P_{pq}^-$ и пересечение $P_{pq}^- \cap W_{\sigma_j}^u$ состоит в точности из одного двумерного диска для каждого седла σ_j , $j \in \{1, \dots, k_{pq} - 1\}$.

В силу предложения 1, 3-шар Q_{pq} пересекает двумерное неустойчивое многообразие седла σ_j , $j \in \{1, \dots, k_{pq} - 1\}$, в точности по одному двумерному диску. Искомый 3-шар P_{pq}^- получается из Q_{pq} вдавливанием внутрь дисков D_p, D_q и сглаживанием углов (см. рис. 4).

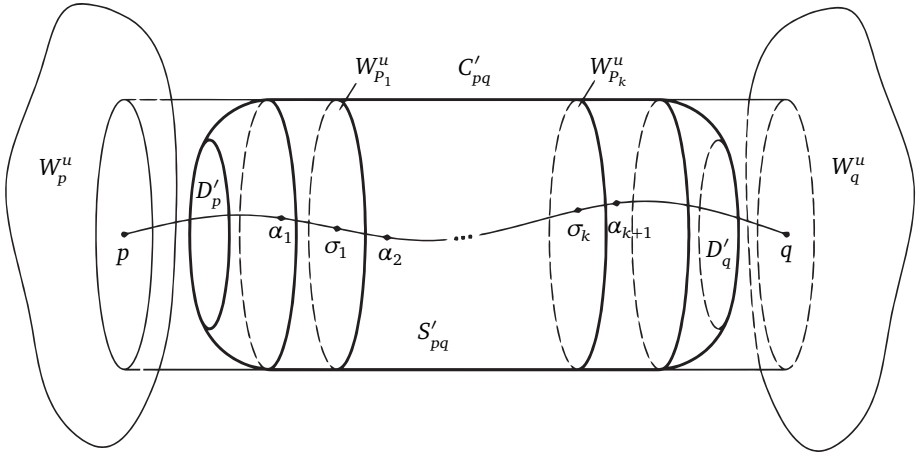


Рис. 4. Окрестность P_{pq}^-

В силу предложения 2, в бассейне $W_{A_{pq}^-}^u$ репеллера A_{pq}^- существует самоиндексирующаяся энергетическая функция $\varphi_{A_{pq}^-}$ диффеоморфизма f . Положим

$$b_{pq} = \inf \{ \varphi_{A_{pq}^-}(z), z \in W_{A_{pq}^-}^u \}.$$

Определим функцию $g_{pq} : (b_{pq}, 3] \rightarrow (0, 3]$ следующим образом: если $b_{pq} > -\infty$, то положим

$$g_{pq}(x) = 2 \frac{(2-b_{pq})(3-x)}{x-b_{pq}} \cdot 3 \frac{(3-b_{pq})(x-2)}{x-b_{pq}},$$

а если $b_{pq} = -\infty$, то положим

$$g_{pq}(x) = 2^{3-x} 3^{x-2}.$$

По построению функция g_{pq} является бесконечно гладкой и имеет положительную производную, при этом $g_{pq}(2) = 2$, $g_{pq}(3) = 3$ и $\lim_{x \rightarrow b_{pq}} g_{pq}(x) = 0$. Рассмотрим суперпозицию $\varphi_{pq} = g_{pq} \varphi_{A_{pq}^-}$. Поскольку $\text{grad } \varphi_{pq} = g'_{pq} \cdot \text{grad } \varphi_{A_{pq}^-}$ и гессианы $\Delta \varphi_{pq}$ и $\Delta \varphi_{A_{pq}^-}$ связаны соотношением

$$\Delta \varphi_{pq} = g''_{pq} \cdot (\text{grad } \varphi_{A_{pq}^-}) \cdot (\text{grad } \varphi_{A_{pq}^-})^T + g'_{pq} \cdot \Delta \varphi_{A_{pq}^-},$$

функция φ_{pq} является энергетической функцией Морса для f в бассейне $W_{A_{pq}^-}^u$.

Положим

$$A^- = \bigcup_{(p,q) \subset \Gamma_\Omega} A_{pq}^-, \quad W_{A^-}^u = \bigcup_{(p,q) \subset \Gamma_\Omega} W_{A_{pq}^-}^u$$

и обозначим через φ_{A^-} функцию, составленную из функций φ_{pq} , $(p, q) \subset \Gamma_\Omega$. Определим на многообразии M функцию φ формулой

$$\varphi(z) = \begin{cases} \varphi_{A^-}(z), & \text{если } z \in W_{A^-}^u; \\ 0, & \text{если } z \in \Omega. \end{cases}$$

Шаг 2. Пусть d — риманова метрика на многообразии M , а расстояние между множествами определяется как инфимум расстояний между элементами этих множеств, то есть

$$\forall X, Y \subset M \quad d(X, Y) = \inf\{d(x, y) : x \in X, y \in Y\}.$$

Для $c \in (0, 3]$ положим

$$\alpha(c) = \min\{1, d^2(\varphi^{-1}(c), \Omega)\} \quad \text{и} \quad \beta(c) = \max\left\{1, \max_{x \in \varphi^{-1}([c, 3])} |\text{grad } \varphi(x)|\right\}.$$

По построению функции $\alpha(c)$ и $\beta(c)$ являются непрерывными, причём $\alpha(c)$ — неубывающая на $(0, 3]$ и существует такое значение $c^* \in (0, 3]$, что $\alpha(c)$ монотонно возрастает на $(0, c^*]$, а $\beta(c)$ — невозрастающая. Тогда функция $\alpha(c)/\beta(c)$ является неубывающей на полуинтервале $(0, 3]$ и $\lim_{c \rightarrow 0} \alpha(c)/\beta(c) = 0$.

В шаге 3 мы построим C^2 -гладкую функцию $g : [0, 3] \rightarrow [0, 3]$ такую, что

- а) $g'(c) > 0$ для любого $c \in (0, 3]$;
- б) $g(c) \leq \alpha(c)/\beta(c)$ для любого $c \in (0, 1/2]$;
- в) $g'(c) \leq \alpha(c)/\beta(c)$ для любого $c \in (0, 1/2]$;
- г) $g(2) = 2$ и $g(3) = 3$.

Покажем, что суперпозиция $\psi = g\varphi$ является искомой энергетической функцией.

Поскольку $\text{grad } \psi = g' \cdot \text{grad } \varphi$ и гессианы $\Delta \psi$ и $\Delta \varphi$ связаны соотношением

$$\Delta \psi = g'' \cdot (\text{grad } \varphi) \cdot (\text{grad } \varphi)^T + g' \cdot \Delta \varphi,$$

то функция ψ является энергетической функцией Морса для f на множестве $M \setminus \Omega$. Покажем, что функция ψ является гладкой на M .

Так как на множестве $M \setminus \Omega$ функция ψ является гладкой по построению, нам осталось показать, что функция ψ — гладкая на множестве Ω .

Рассмотрим произвольную точку $a \in \Omega$ и локальную карту (U_a, h_a) , где $h_a: U_a \rightarrow \mathbb{R}^3$ — диффеоморфизм, отображающий некоторую окрестность⁶ U_a точки a в \mathbb{R}^3 , причём точка a переходит в точку $O(0, 0, 0)$. Сначала покажем дифференцируемость. Если функция $\psi_a = \psi(h_a^{-1}(x))$ дифференцируема в точке O , то функция ψ дифференцируема в точке a . При этом функция ψ_a дифференцируема в точке O и имеет частные производные, равные нулю в этой точке тогда и только тогда, когда

$$\lim_{s \rightarrow O} \frac{\psi_a(s)}{\rho(s, O)} = 0,$$

где $s(x, y, z) \in \mathbb{R}^3$ и ρ — евклидова метрика в \mathbb{R}^3 , определённая формулой

$$\rho(s_1, s_2) = \sqrt{(x_1 - x_2)^2 + (y_1 - y_2)^2 + (z_1 - z_2)^2}$$

для $s_1(x_1, y_1, z_1), s_2(x_2, y_2, z_2) \in \mathbb{R}^3$. Проверка равенства

$$\lim_{s \rightarrow O} \frac{\psi_a(s)}{\rho(s, O)} = 0$$

и завершит доказательство дифференцируемости.

Введём на \mathbb{R}^3 метрику d_a следующим образом:

$$d_a(s_1, s_2) = d(h_a^{-1}(s_1), h_a^{-1}(s_2)) \quad \text{для } s_1, s_2 \in \mathbb{R}^3.$$

В силу [18] (лекция 15), метрики ρ и d_a эквивалентны в некоторой компактной окрестности $U(O)$ точки O , то есть существуют константы $0 < c_1 \leq c_2$, такие что

$$\forall s_1, s_2 \in U(O) \quad c_1 d_a(s_1, s_2) \leq \rho(s_1, s_2) \leq c_2 d_a(s_1, s_2).$$

Для $s \in U(O)$ положим $w = h_a^{-1}(s)$ и $c = \varphi(h_a^{-1}(s)) = \varphi(w)$. Тогда

$$\begin{aligned} \lim_{s \rightarrow O} \frac{\psi_a(s)}{\rho(s, O)} &= \lim_{s \rightarrow O} \frac{\psi(h_a^{-1}(s))}{c_1 d(h_a^{-1}(s), a)} = \lim_{w \rightarrow a} \frac{\psi(w)}{c_1 d(w, a)} = \lim_{w \rightarrow a} \frac{g(\varphi(w))}{c_1 d(w, a)} = \\ &= \lim_{w \rightarrow a} \frac{g(c)}{c_1 d(w, a)} < \lim_{w \rightarrow a} \frac{\alpha(c)}{\beta(c) c_1 d(w, a)} \leq \lim_{w \rightarrow a} \frac{d^2(w, a)}{c_1 d(w, a)} = \lim_{w \rightarrow a} \frac{d(w, a)}{c_1} = 0. \end{aligned}$$

Теперь покажем, что частные производные $(\psi_a)'_x, (\psi_a)'_y, (\psi_a)'_z$ непрерывны в точке O , то есть

$$\lim_{s \rightarrow O} (\psi_a)'_x(s) = 0, \quad \lim_{s \rightarrow O} (\psi_a)'_y(s) = 0 \quad \text{и} \quad \lim_{s \rightarrow O} (\psi_a)'_z(s) = 0,$$

⁶Окрестность выберем таким образом, чтобы для всех $x \in U_a$ выполнялось $\varphi(x) < 1/2$.

что эквивалентно $\lim_{s \rightarrow O} |\text{grad } \psi_\alpha(s)| = 0$. Обозначим через $J_{h_\alpha^{-1}}$ якобиан отображения h_α^{-1} , через $\|J_{h_\alpha^{-1}}\|$ — его норму, подчинённую евклидовой норме вектора в \mathbb{R}^3 , и через B — такую константу, что $\|J_{h_\alpha^{-1}}(s)\| \leq B$ для всех точек s в некоторой окрестности точки O . Тогда

$$\begin{aligned} \lim_{s \rightarrow O} |\text{grad } \psi_\alpha(s)| &= \lim_{s \rightarrow O} |J_{h_\alpha^{-1}}(s) \cdot g'(c) \cdot \text{grad } \varphi(w)| \leq \\ &\leq \lim_{s \rightarrow O} \|J_{h_\alpha^{-1}}(s)\| \cdot |g'(c)| \cdot |\text{grad } \varphi(w)| \leq \lim_{s \rightarrow O} B \cdot \frac{\alpha(c)}{\beta(c)} \cdot |\text{grad } \varphi(w)| \leq \\ &\leq \lim_{w \rightarrow a} B \cdot \frac{d^2(w, a)}{|\text{grad } \varphi(w)|} \cdot |\text{grad } \varphi(w)| = \lim_{w \rightarrow a} B \cdot d^2(w, a) = 0. \end{aligned}$$

Шаг 3. Построение функции g . Положим $\gamma(c) = \alpha(c)/\beta(c)$. По построению γ является положительной неубывающей на полуинтервале $(0, 3]$ функцией и $\lim_{c \rightarrow 0} \alpha(c)/\beta(c) = 0$.

Построим такую C^2 -гладкую функцию $g: [0, 3] \rightarrow [0, 3]$, что

- а) $g'(c) > 0$ для любого $c \in (0, 3]$;
- б) $g(c) \leq \gamma(c)$ для любого $c \in (0, 1/2]$;
- в) $g'(c) \leq \gamma(c)$ для любого $c \in (0, 1/2]$;
- г) $g(2) = 2$ и $g(3) = 3$.

Возьмём открытое покрытие полуинтервала $(0, 3]$ множествами

$$\begin{aligned} U_1 &= \{x \in \mathbb{R}: 1 < x \leq 3\}, \quad U_2 = \left\{x \in \mathbb{R}: \frac{1}{2} < x \leq 3\right\}, \\ U_3 &= \left\{x \in \mathbb{R}: \frac{1}{4} < x \leq 3\right\}, \quad U_i = \left\{x \in \mathbb{R}: \frac{1}{2^{i-1}} < x < \frac{1}{2^{i-5}}\right\}, \quad i = 4, 5, \dots, \end{aligned}$$

и следующее локально конечное разбиение единицы⁷, подчинённое этому покрытию:

$$\begin{aligned} \sigma_2(x) &= \begin{cases} \exp\left\{\frac{(x-2)^4}{(x-1)(x-3)}\right\}, & \text{если } x \in (1, 3); \\ 0, & \text{если } x \notin (1, 3); \end{cases} \\ \sigma_1(x) &= \begin{cases} 1 - \sigma_2(x), & \text{если } x \in (2, 3]; \\ 0, & \text{если } x \notin (2, 3]; \end{cases} \end{aligned}$$

⁷ Пусть дано открытое покрытие топологического пространства M открытыми множествами U_α . Разбиением единицы, подчинённым покрытию $\{U_\alpha\}$, называется набор гладких функций $\sigma_\gamma: M \rightarrow \mathbb{R}$, обладающих следующими свойствами:

- для всех γ $\text{Supp}(\sigma_\gamma) \subset U_\alpha$ для некоторого α (где $\text{Supp}(\sigma_\gamma)$ — замыкание множества, на котором функция отлична от нуля);
- $0 \leq \sigma_\gamma \leq 1$ на M ;
- $\forall x \in M$ имеем $\sum_\gamma \sigma_\gamma(x) = 1$.

Если для любой точки $x \in M$ существует такая окрестность W_x , что пересечение $W \cap \text{Supp}(\sigma_\gamma)$ непусто не более чем для конечного числа индексов γ , то такое разбиение единицы называется локально конечным.

$$\forall i = 4, 6, \dots \quad \sigma_i(x) = \begin{cases} \exp \left\{ \frac{\left(x - \frac{1}{2^{i-3}}\right)^4}{\left(x - \frac{1}{2^{i-2}}\right)\left(x - \frac{1}{2^{i-4}}\right)} \right\}, & \text{если } x \in \left(\frac{1}{2^{i-2}}, \frac{1}{2^{i-4}}\right); \\ 0, & \text{если } x \notin \left(\frac{1}{2^{i-2}}, \frac{1}{2^{i-4}}\right); \end{cases}$$

$$\forall i = 3, 5, \dots \quad \sigma_i(x) = \begin{cases} 1 - \sigma_{i-1}(x), & \text{если } x \in \left[\frac{1}{2^{i-3}}, \frac{1}{2^{i-4}}\right); \\ 1 - \sigma_{i+1}(x), & \text{если } x \in \left(\frac{1}{2^{i-2}}, \frac{1}{2^{i-3}}\right); \\ 0, & \text{если } x \notin \left(\frac{1}{2^{i-2}}, \frac{1}{2^{i-4}}\right). \end{cases}$$

Положим $\varepsilon_i = \gamma(1/2^{i-2})$ для всех $i = 3, 4, 5, \dots$ Пусть

$$c_2 = \int_0^2 \left(\sum_{i=2}^{\infty} \varepsilon_i \sigma_i(x) \right) dx, \quad c_3 = \int_0^2 \left(\sum_{i=3}^{\infty} \varepsilon_i \sigma_i(x) \right) dx,$$

$$\varepsilon_1 = \frac{3 - c_2}{\int_2^3 \sigma_1(x) dx} \quad \text{и} \quad \varepsilon_2 = \frac{2 - c_3}{\int_1^2 \sigma_2(x) dx}.$$

Определим функцию g формулой

$$g(c) = \begin{cases} \int_0^c \left(\sum_{i=1}^{\infty} \varepsilon_i \sigma_i(x) \right) dx, & \text{если } c \in (0, 3]; \\ 0, & \text{если } c = 0, \end{cases}$$

и покажем, что она является искомой, проверив условия а)–г).

а) Поскольку

$$g'(c) = \sum_{i=i^*}^{\infty} \varepsilon_i \sigma_i(c),$$

получаем, что $g'(c) > 0$ для любого $c \in (0, 3]$.

б) Последовательность $\{\varepsilon_i\}$ невозрастающая по построению. Заметим, что для любого $c \in (0, 1/2)$ существует единственный номер i^* , такой что

$$c \in \left(\frac{1}{2^{i^*-2}}, \frac{1}{2^{i^*-3}} \right].$$

Тогда $\sigma_{i^*}(c) \neq 0$ и $\sigma_i(c) = 0$ для всех $i \notin \{i^*, i^* + 1\}$. Из выбора параметров ε_i получаем цепочку неравенств

$$g(c) = \int_0^c \left(\sum_{i=1}^{\infty} \varepsilon_i \sigma_i(x) \right) dx = \int_0^c \left(\sum_{i=i^*}^{\infty} \varepsilon_i \sigma_i(x) \right) dx < \int_0^c \left(\sum_{i=i^*}^{\infty} \varepsilon_i \sigma_i(x) \right) dx =$$

$$\begin{aligned}
&= \varepsilon_{i^*} \int_0^c \left(\sum_{i=i^*}^{\infty} \sigma_i(x) \right) dx < \varepsilon_{i^*} \int_0^c \left(\sum_{i=1}^{\infty} \sigma_i(x) \right) dx = \\
&= \varepsilon_{i^*} \int_0^c 1 dx = \varepsilon_{i^*} c < \varepsilon_{i^*} = \gamma \left(\frac{1}{2^{i^*-2}} \right) < \gamma(c).
\end{aligned}$$

в) Для $g'(c)$ справедлива следующая оценка:

$$g'(c) = \sum_{i=i^*}^{\infty} \varepsilon_i \sigma_i(c) < \varepsilon_{i^*} \sum_{i=i^*}^{\infty} \sigma_i(c) = \varepsilon_{i^*} < \gamma(c).$$

г) Из выбора $\varepsilon_1, \varepsilon_2$ следует, что $g(2) = 2$ и $g(3) = 3$.

Благодарности. Авторы выражают огромную признательность В. В. Чистякову за чрезвычайно полезные обсуждения.

СПИСОК ЛИТЕРАТУРЫ

- [1] Аносов Д. В. Грубые системы // Тр. МИАН СССР. 1985. Т. 169. С. 59–93.
- [2] Artin E., Fox R. Some wild cells and spheres in three-dimensional space // Ann. Math. 1948. Vol. 49. P. 979–990.
- [3] Conley C. Isolated invariant sets and the Morse index. Providence, RI: AMS, 1978. (CBMS Regional Conference Series in Math.; Vol. 38).
- [4] Гринес В. З., Лауденбах Ф., Починка О. Квази-энергетическая функция для диффеоморфизмов с дикими сепаратрисами // Матем. заметки. 2009. Т. 86, вып. 2. С. 175–183.
- [5] Grines V., Laudenbach F., Pochinka O. Self-indexing function for Morse — Smale diffeomorphisms on 3-manifolds // Mosc. Math. J. 2009. № 4. P. 801–821.
- [6] Гринес В. З., Лауденбах Ф., Починка О. В. Динамически упорядоченная энергетическая функция для диффеоморфизмов Морса — Смейла на 3-многообразиях // Тр. МИАН. 2012. Т. 278. С. 34–48.
- [7] Гринес В. З., Жужома Е. В. Структурно устойчивые диффеоморфизмы с базисными множествами коразмерности один // Известия РАН. Сер. матем. 2002. Т. 66, № 2. С. 3–66.
- [8] Гринес В. З., Починка О. В. Введение в топологическую классификацию каскадов на многообразиях размерности два и три. М. — Ижевск: РХД, 2011.
- [9] Grines V., Zhuzhoma E. On structurally stable diffeomorphisms with codimension one expanding attractors // Trans. AMS. 2005. Vol. 357, № 2. P. 617–667.
- [10] Hirsch M., Pugh C., Shub M. Invariant manifolds. Berlin — New York: Springer-Verlag, 1977. (Lecture Notes in Math.; Vol. 583).
- [11] Mañé R. A proof of C^1 stability conjecture // Publ. Math. IHES. 1988. Vol. 66. P. 161–210.
- [12] Meyer K. R. Energy functions for Morse — Smale systems // Amer. J. Math. 1968. Vol. 90. P. 1031–1040.
- [13] Милнор Дж. Теория Морса. М.: Мир, 1965.
- [14] Pixton D. Wild unstable manifolds // Topology. 1977. Vol. 16, № 2. P. 167–172.
- [15] Плькин Р. В. О топологии базисных множеств диффеоморфизмов Смейла // Матем. сб. 1971. Т. 84, № 2. С. 301–312.
- [16] Плькин Р. В. Источники и стоки A -диффеоморфизмов поверхностей // Матем. сб. 1974. Т. 23. С. 223–253.
- [17] Plykin R. V. Hyperbolic attractors of codimension one // Topology (Leningrad, 1982). Berlin: Springer, 1984. (Lecture Notes in Math.; Vol. 1060). P. 348–354.

- [18] *Постников М. М.* Лекции по геометрии. Семестр V. Риманова геометрия. М.: Факториал, 1998.
- [19] *Robinson C.* Structural stability of C^1 diffeomorphisms // J. Diff. Equat. 1976. Vol. 22, № 1. P. 28–73.
- [20] *Robinson C.* Dynamical systems: stability, symbolic dynamics and chaos. Boca Raton, FL: CRC Press, 1999. (Studies in Advanced Math.).
- [21] *Smale S.* On gradient dynamical systems // Ann. Math. (2). 1961. Vol. 74. P. 199–206.
- [22] *Smale S.* Stable manifolds for differential equations and diffeomorphisms // Ann. Scuola Norm. Pisa. 1963. Vol. 17. P. 97–116.
- [23] *Смейл С.* Дифференцируемые динамические системы // УМН. 1970. Т. 25, вып. 1(151). С. 113–185.
- [24] *Wilson F. Wesley Jr., Yorke James A.* Lyapunov functions and isolating blocks // J. Diff. Equat. 1973. Vol. 13. P. 106–123.
- [25] *Жужома Е. В., Медведев В. С.* О неориентируемых двумерных базисных множествах на 3-многообразиях // Матем. сб. 2002. Т. 193(6). С. 83–104.

Вячеслав Зигмундович Гринес
ННГУ им. Н. И. Лобачевского, кафедра
численного и функционального анализа
НИУ ВШЭ, кафедра
фундаментальной математики
E-mail: vgrines@yandex.ru

Представлено в редакцию 03.01.2015/13.03.2015

Марина Константиновна Носкова
ННГУ им. Н. И. Лобачевского, кафедра
численного и функционального анализа
E-mail: mknoskova@yandex.ru

Ольга Витальевна Починка
НИУ ВШЭ, кафедра
фундаментальной математики
E-mail: olga-pochinka@yandex.ru