

# Extremalpunkte von Mengen von Matrizen mit vorgegebener Randverteilung

Diplomarbeit  
von  
Peter Philip

Betreut von  
Prof. Dr. Ehrhard Behrends

Fachbereich Mathematik und Informatik  
Freie Universität Berlin  
6. Dezember 1996



# Inhaltsverzeichnis

<b>0</b>	<b>Einleitung</b>	<b>2</b>
<b>1</b>	<b>Grundlagen</b>	<b>4</b>
1.1	Definition von konvex und extremal . . . . .	4
1.2	Einige Begriffe aus der Graphentheorie . . . . .	5
1.3	Maßtheoretische Grundlagen . . . . .	7
1.4	Maßtheoretische Charakterisierung der Extrempunkte . . . . .	9
<b>2</b>	<b>Doppelt stochastische Matrizen</b>	<b>14</b>
2.1	Definition und erste Eigenschaften . . . . .	14
2.2	Anwendung der maßtheoretischen Charakterisierung der Extrempunkte . . . . .	24
2.3	Wurzelbäume und $\epsilon$ -Doppelbäume . . . . .	31
2.4	Graphentheoretische Charakterisierung . . . . .	35
2.5	Charakterisierungen der Extrempunkte für endliche Randsysteme	52
2.6	Exponierte Punkte . . . . .	67
<b>3</b>	<b>Kardinalitätsbetrachtungen</b>	<b>74</b>
3.1	Allgemeines . . . . .	74
3.2	Der Fall $2 \times \omega$ . . . . .	77
<b>A</b>	<b>Quelltexte implementierter Algorithmen</b>	<b>86</b>
A.1	Mathematica-Implementation eines Algorithmus zur Bestimmung extremaler Matrizen im endlichen Fall . . . . .	86
A.2	Mathematica-Implementation eines Algorithmus zur Bestimmung von $\#E(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ im $2 \times n$ Fall . . . . .	88

# Kapitel 0

## Einleitung

Das Thema dieser Arbeit „Extremalpunkte von Mengen von Matrizen mit vorgegebener Randverteilung“ hat folgende Vorgeschichte: Im Sommer 1995 beschäftigten sich Herr Prof. Dr. Ehrhard Behrends und Herr Ulrich Voll mit dem Problemkreis „optimaler Couplings“. Dabei wird ein Paar  $(X, Y)$  von meßbaren Abbildungen

$$(0.1) \quad X, Y : \Omega \longrightarrow \{1, \dots, n\}$$

auf einem Wahrscheinlichkeitsraum  $\Omega$  als Coupling bezeichnet, falls  $P_X = \mu$  und  $P_Y = \nu$ , wobei  $\mu = (\mu_1, \dots, \mu_n)$  und  $\nu = (\nu_1, \dots, \nu_n)$  gegebene Wahrscheinlichkeitsmaße auf  $\{1, \dots, n\}$  sind. Man kann zeigen, daß dann immer

$$(0.2) \quad P\{X \neq Y\} \geq \frac{1}{2} \sum_{i=1}^n |\mu_i - \nu_i|$$

gilt.  $(X, Y)$  wird als optimales Coupling bezeichnet, falls in (0.2) Gleichheit gilt. Die Aufgabe, ein optimales Coupling zu finden, ist also identisch mit dem Problem,  $(X, Y)$  so zu bestimmen, daß  $P\{X \neq Y\}$  minimiert wird, das heißt, daß  $P\{X = Y\}$  maximiert wird. Anders ausgedrückt, geht es darum, ein Maß  $M$  auf  $\{1, \dots, n\} \times \{1, \dots, n\}$  zu finden, so daß die Randverteilungen  $\mu$  und  $\nu$  sind (die Menge solcher Maße wird mit  $\mathcal{D}(\mu, \nu)$  bezeichnet) und  $\sum_{i=1}^n M(i, i)$  maximiert wird. Aufgrund der speziellen Gestalt der Menge  $\mathcal{D}(\mu, \nu)$  genügt es dazu,  $\sum_{i=1}^n M(i, i)$  auf den Extremalpunkten von  $\mathcal{D}(\mu, \nu)$  zu maximieren.

Somit war das Interesse an der Kenntnis der Extremalpunkte von Mengen von Maßen mit vorgegebener Randverteilung geweckt. Einige Literaturrecherchen ergaben, daß das Problem der Charakterisierung solcher Extremalpunkt mengen seit der Arbeit von BIRKHOFF 1946 (siehe [1]) in einer Vielzahl von Arbeiten untersucht worden ist und es viele gelöste und ungelöste Probleme zu diesem Thema gibt. Von den Untersuchungsmethoden her, ist dabei zwischen den Fällen diskreter Maße und den Fällen kontinuierlicher Maße zu unterscheiden. Während seit

der Arbeit von GRZAŚLEWICZ 1987 (siehe [4]) eine Charakterisierung der Extrempunkte im diskreten Fall existiert, ist das Problem im kontinuierlichen Fall noch weitgehend ungelöst (die von LINDENSTRAUSS gegebene Charakterisierung (siehe [8] und Abschnitt 1.4) erweist sich nicht als sehr hilfreich, wenn man für ein vorgegebenes Maß entscheiden möchte, ob es extremal ist oder nicht).

In dieser Arbeit (respektive in Kapitel 2) werden die bekannten Charakterisierungen im diskreten Fall (traditionell werden dabei Produktmaße mit Matrizen identifiziert) zusammengestellt und in einigen Fällen verallgemeinert und ergänzt (zum Beispiel werden auch überabzählbare diskrete Maßräume betrachtet). Dabei wird zunächst in Abschnitt 2.2 der Satz von LINDENSTRAUSS auf diskrete Maße angewendet. In Abschnitt 2.4 werden dann die Charakterisierungen aus [4] zusammengestellt, wobei hier konsequent die Sprache der Graphentheorie verwendet wird (neu sind die Sätze 2.4.3 und 2.4.23). In Abschnitt 2.6 werden einige Aspekte des scheinbar sehr schwierigen Problems exponierter Punkte von Mengen von Matrizen mit vorgegebener Randverteilung betrachtet.

Am leichtesten ist die Charakterisierung der Extrempunkte erwartungsgemäß für endliche diskrete Maße. Dieser Fall wird in Abschnitt 2.5 behandelt. Man kennt in diesem Fall sogar einen Algorithmus, der die Extrempunkte erzeugt (siehe Abschnitt A.1 für eine Implementation).

In Kapitel 3 wird in verschiedenen Fällen die Kardinalität der Extrempunkt-mengen bestimmt. Schon im endlichen Fall gibt es hier noch viele offene Fragen. Zum Beispiel scheint es bisher keinen Algorithmus zu geben, der die Anzahl der Extrempunkte berechnet, ohne sie alle explizit zu bestimmen. Für den  $2 \times n$ -Fall ist es gelungen, einen solchen Algorithmus zu finden (siehe Definition 3.2.1, Satz 3.2.3 und A.2). Allerdings muß für diesen Algorithmus das sogenannte „Knapsack-Problem“ gelöst werden, von dem bekannt ist, daß es NP-vollständig ist (siehe zum Beispiel [3, S. 247]).

Als Ausblick sei erwähnt, daß eine Fortführung der Arbeit in verschiedene Richtungen interessant erscheint. Zum einen stellt sich die Frage, wie sich die Theorie verändert, wenn die Maße nicht länger reellwertig sind (man könnte sich vorstellen, Werte in einem Banachraum zuzulassen, auf dem ein spitzer Kegel eine Ordnungsstruktur liefert). In der anderen Richtung kann man Produktmaße mit vorgegebener Randverteilung mit mehr als zwei Komponenten betrachten. Schließlich bleibt noch das weite Feld kontinuierlicher Maße.

An dieser Stelle möchte ich Herrn Prof. Dr. Ehrhard Behrends für die Betreuung dieser Arbeit danken, sowie für viele hilfreiche Anregungen und Gespräche. Ebenso gilt mein Dank den Mitgliedern der „Montagsarbeitsgruppe“, die ebenfalls gute Anregungen für meine Arbeit lieferten.

# Kapitel 1

## Grundlagen

### 1.1 Definition von konvex und extremal

**Definition 1.1.1.** Eine Teilmenge  $M$  eines reellen Vektorraums heißt *konvex* genau dann, wenn

$$(1.1) \quad \forall_{x,y \in M} \forall_{0 \leq \alpha \leq 1} \alpha x + (1 - \alpha)y \in M.$$

**Definition 1.1.2.** Sei  $M$  eine konvexe Menge gemäß Definition 1.1.1 und  $x \in M$ . Man nennt  $x$  einen *Extremalpunkt* von  $M$  genau dann, wenn

$$(1.2) \quad \forall_{x_1, x_2 \in M} \forall_{0 < \alpha < 1} (x = \alpha x_1 + (1 - \alpha)x_2 \Rightarrow x = x_1 = x_2).$$

Die Menge der Extremalpunkte von  $M$  bezeichne mit  $E(M)$ .

Es ist manchmal nützlich zu wissen, daß es für konvexes  $M$  und einen als Konvexkombination  $x = \alpha x_1 + (1 - \alpha)x_2$  gegebenen Punkt  $x \in M$  mit  $x_1, x_2 \in M$  und  $\alpha \in ]0, 1[$  immer Punkte  $\tilde{x}_1, \tilde{x}_2 \in M$  gibt, so daß  $x = \frac{1}{2}x_1 + \frac{1}{2}x_2$ . Es gilt das folgende Lemma:

**Lemma 1.1.3.** Sei  $M$  eine konvexe Menge und  $x \in M$ . Dann ist

$$(1.3) \quad x \in E(M) \Leftrightarrow \forall_{x_1, x_2 \in M} \left( x = \frac{1}{2}x_1 + \frac{1}{2}x_2 \Rightarrow x = x_1 = x_2 \right).$$

*Beweis.* Der „ $\Rightarrow$ “-Teil folgt, indem man in (1.2)  $\alpha = \frac{1}{2}$  setzt. Bleibt „ $\Leftarrow$ “ zu zeigen. Angenommen es gibt  $x_1, x_2 \in M$  und  $0 < \alpha < 1$ , so daß  $x = \alpha x_1 + (1 - \alpha)x_2$ . Indem man zur Not die Indizes von  $x_1$  und  $x_2$  vertauscht, kann man  $\alpha \geq \frac{1}{2}$  annehmen. Setze

$$y_1 = x_1 \quad \text{und} \quad y_2 = \frac{2\alpha - 1}{\alpha}x + \left(1 - \frac{2\alpha - 1}{\alpha}\right)x_2.$$

Im Intervall  $[\frac{1}{2}, 1]$  ist  $\frac{2\alpha-1}{\alpha}$  streng monoton steigend (die Ableitung ist  $\frac{1}{\alpha^2}$ ), und die Randwerte sind 0 für  $\alpha = \frac{1}{2}$  beziehungsweise 1 für  $\alpha = 1$ . Also ist  $0 \leq \frac{2\alpha-1}{\alpha} \leq 1$  für  $\frac{1}{2} \leq \alpha \leq 1$ . Da  $M$  konvex ist, folgt  $y_2 \in M$ . Nun erhält man, wie gewünscht,  $x$  als Konvexkombination von  $y_1$  und  $y_2$ :

$$\begin{aligned} \frac{1}{2}y_1 + \frac{1}{2}y_2 &= \frac{1}{2}x_1 + \frac{1}{2} \left( \frac{2\alpha-1}{\alpha}(\alpha x_1 + (1-\alpha)x_2) + \left(1 - \frac{2\alpha-1}{\alpha}\right)x_2 \right) \\ &= \alpha x_1 + (1-\alpha)x_2 \left( \frac{1}{2\alpha} + \frac{2\alpha-1}{2\alpha} \right) = \alpha x_1 + (1-\alpha)x_2 = x. \end{aligned}$$

Nach Voraussetzung ist damit  $x = y_1 = y_2$ , das heißt  $x = x_1$ . Daraus folgt dann auch  $x = x_2$ . ■

**Bemerkung 1.1.4.** Sind  $M, \tilde{M}$  konvexe Mengen und  $L : M \rightarrow \tilde{M}$  eine affine, bijektive Abbildung, so ist  $L(E(M)) = E(\tilde{M})$ .

## 1.2 Einige Begriffe aus der Graphentheorie

**Definition 1.2.1.** Ein *Graph*  $G = (V, E)$  ist ein Paar aus einer Menge  $V = V(G)$  von *Ecken* (Vertices) und einer Menge  $E = E(G) \subseteq \binom{V}{2}$  von *Kanten* (Edges).  $\binom{V}{2}$  ist die Menge der zweielementigen Teilmengen von  $V$ . Ein *gewichteter Graph*  $G = (V, E, w)$  ist ein Graph  $(V, E)$  zusammen mit einer *Gewichtsfunktion*  $w : E \rightarrow \mathbb{R}$ .

**Definition 1.2.2.** Ein Graph  $G' = (V', E')$  ist ein *Sub- oder Teilgraph* eines Graphen  $G = (V, E)$  genau dann, wenn  $V' \subseteq V$  und  $E' \subseteq E$ . In diesem Fall schreibe  $G' \leq G$  (im Fall gewichteter Graphen  $G = (V, E, w)$  beziehungsweise  $G' = (V', E', w')$  wird zusätzlich verlangt, daß  $w' = w|_{E'}$ ). Ist  $U \subseteq V$ , so heißt  $G|_U := (U, E \cap \binom{U}{2})$  der von  $U$  *induzierte Teilgraph* von  $G$  (beziehungsweise  $G|_U := (U, E \cap \binom{U}{2}, w|_{E \cap \binom{U}{2}})$  im gewichteten Fall).

**Definition 1.2.3.** Seien  $G = (V, E)$ ,  $G' = (V', E')$ ,  $\hat{G} = (\hat{V}, \hat{E})$  Graphen, so daß  $\hat{G} \leq G$ ,  $V' \cap V = \emptyset$ ,  $E' \cap E = \emptyset$ .

(a) Definiere  $G - \hat{V} := G|_{V \setminus \hat{V}}$ ,  $G - \hat{E} := (V, E \setminus \hat{E})$ ,  $G - \hat{G} := G - \hat{E} - \hat{V}$  (im Fall eines gewichteten Graphen  $G = (V, E, w)$  erfolgen die Definitionen genauso, nur daß dann  $G - \hat{E} := (V, E \setminus \hat{E}, w|_{E \setminus \hat{E}})$ . Für  $\hat{V} = \{v\}$  können die Mengenklammern auch weggelassen werden, das heißt, man schreibt  $G - v$  für  $G - \{v\}$ .

(b) Definiere  $G + G' := (V \dot{\cup} V', E \dot{\cup} E')$ ,  $G +_v V' := (V \dot{\cup} V', E)$ ,  
 $G +_e E' := (V \cup \bigcup_{e \in E'} e, E \dot{\cup} E')$  (im Fall gewichteter Gra-  
 phen  $G = (V, E, w)$ ,  $G' = (V', E', w')$  definiere entspre-  
 chend  $G + G' := (V \dot{\cup} V', E \dot{\cup} E', w_+)$ ,  $G +_v V' := (V \dot{\cup} V', E, w)$ ,

$$G +_e E' := (V \cup \bigcup_{e \in E'} e, E \dot{\cup} E', w_+), \quad \text{wobei} \quad w_+ : E \dot{\cup} E' \longrightarrow \mathbb{R},$$

$$w_+(e) := \begin{cases} w(e) & \text{für } e \in E, \\ w'(e) & \text{für } e \in E'. \end{cases}$$

**Definition 1.2.4.** Sei  $G = (V, E)$  ein Graph. Jeder Ecke  $v \in V$  wird ihr *Grad*  $d_G(v)$  zugeordnet. Es ist  $d_G(v) := \#\{e \in E : v \in e\}$ . Wenn es aus dem Zusammenhang klar ist, welcher Graph gemeint ist, so schreibt man auch  $d(v)$  statt  $d_G(v)$ .

**Definition 1.2.5.** Sei  $G = (V, E)$  ein Graph. Ein *Kantenzug*  $K$  ist eine Abbildung  $K : A \longrightarrow V$ , wobei  $A$  ein (möglicherweise unendlicher) Abschnitt von  $\mathbb{Z}$  ist, und für  $i, i+1 \in A$  ist  $\{v_i, v_{i+1}\} \in E$ .  $l(K) := \#A$  ist die Länge des Kantenzuges. Ist  $A = (i_0, i_0+1, \dots, i_0+k)$  endlich und  $v_{i_0} = v_{i_0+k}$ , so heißt  $K$  ein *geschlossener Kantenzug*, ansonsten ein *offener Kantenzug*. Ein injektiver Kantenzug heißt ein *Weg*. Seien  $u, v \in V$ . Ein *uv-Weg* ist ein endlicher Weg  $W : (i_0, i_0+1, \dots, i_0+k) \longrightarrow V$  mit  $W(i_0) = u$  und  $W(i_0+k) = v$ . Häufig wird ein Kantenzug  $K$  mit seinem Bild identifiziert (z.B.  $K = (v_0, \dots, v_k)$ ) oder auch mit dem von seinem Bild induzierten Teilgraphen (z.B.  $K = (V(K), E(K))$ ).

**Definition 1.2.6.** Sei  $G = (V, E)$  ein Graph. Der *Abstand* zweier Ecken  $u, v \in V$  ist definiert durch  $d_G(u, v) = d(u, v) := \inf\{l(W) : W \text{ ist ein } uv\text{-Weg}\}$ . Die *Zusammenhangskomponente* einer Ecke  $v \in V$  ist  $\text{Zhk}_G(v) = \text{Zhk}(v) := \{u \in V : d(u, v) < \infty\}$ . Oft wird auch der von  $\text{Zhk}(v)$  induzierte Teilgraph mit  $\text{Zhk}(v)$  identifiziert.

**Bemerkung 1.2.7.** Sei  $G = (V, E)$  ein Graph. Durch

$$v \sim w \iff w \in \text{Zhk}(v)$$

wird eine Äquivalenzrelation auf  $V$  definiert.

**Definition 1.2.8.** Sei  $G = (V, E)$  ein Graph. Die induzierten Graphen der Äquivalenzklassen der in Bemerkung 1.2.7 definierten Relation heißen *Zusammenhangskomponenten* von  $G$ . Die Menge der Zusammenhangskomponenten von  $G$  werde mit  $\text{Zhk}(G)$  bezeichnet.  $G$  heißt *zusammenhängend* genau dann, wenn  $\#\text{Zhk}(G) = 1$ .

**Definition 1.2.9.** Sei  $G = (V, E)$  ein Graph. Ein *Kreis* ist ein geschlossener Kantenzug  $C = (v_{i_0}, \dots, v_{i_0+k})$  mit  $l(C) \geq 3$ , so daß  $(v_{i_1}, \dots, v_{i_0+k})$  ein Weg ist. Enthält  $G$  keinen Kreis, so heißt  $G$  *kreisfrei*. Dann wird  $G$  auch als *Wald* bezeichnet. Ist  $G$  außerdem zusammenhängend, so heißt  $G$  ein *Baum*.

**Lemma 1.2.10.** Sei  $G = (V, E)$  ein Graph.  $G$  ist genau dann ein Wald, wenn alle Zusammenhangskomponenten von  $G$  Bäume sind.



*Beweis.* „ $\Rightarrow$ “: Gäbe es einen Kreis  $C$  in einer Zusammenhangskomponente von  $G$ , so wäre  $C$  auch ein Kreis in  $G$ , das heißt  $G$  wäre kein Wald. „ $\Leftarrow$ “: Hat  $G$  einen Kreis  $C$ , so liegen alle zu  $C$  gehörenden Ecken in der selben Zusammenhangskomponente, welche also kein Baum sein kann. ■

**Lemma 1.2.11.** Sei  $G = (V, E)$  ein Baum. Für  $u, v \in V$  gibt es genau einen  $uv$ -Weg in  $G$ .

*Beweis.* Für  $u = v$  ist nichts zu zeigen. Sei also  $u \neq v$ . Da  $G$  zusammenhängend ist, gibt es einen  $uv$ -Weg. Angenommen es gibt zwei verschiedene  $uv$ -Wege  $W_1 = (u_1, \dots, u_k)$ ,  $W_2 = (v_1, \dots, v_l)$ ,  $u_1 = v_1 = u$ ,  $u_k = v_l = v$  (siehe Abbildung 1.1). Sei  $i_0 := \min\{i : u_i \notin W_2\}$ ,  $i_1 := \min\{i > i_0 : u_i \in W_2\}$ . Dann gibt es  $1 \leq j_0 < j_1 \leq l$ , so daß  $(v_{j_0}, \dots, v_{j_1})$  ein  $u_{i_0-1}u_{i_1}$ -Weg ist. Nun ist  $K := (u_{i_0}, \dots, u_{i_1} = v_{j_1}, \dots, v_{j_0} = u_{i_0-1}, u_{i_0})$  ein Kreis, das heißt,  $G$  ist kein Baum. ■

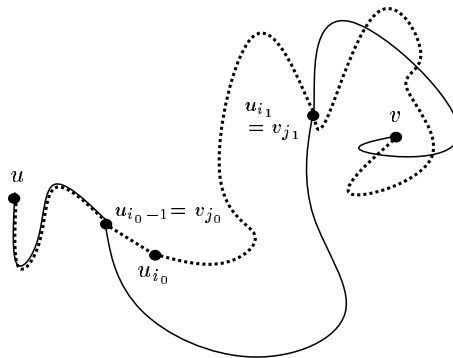


Abbildung 1.1: Zum Beweis von Lemma 1.2.11

**Definition 1.2.12.** Ein Graph  $G = (V, E)$  heißt *bipartit* genau dann, wenn

$$V = S \dot{\cup} T, \text{ und } \forall_{e \in E} \exists_{s, t \in e} (s \in S \text{ und } t \in T).$$

### 1.3 Maßtheoretische Grundlagen

**Definition 1.3.1.**  $(I_1, \mathcal{E}_1, m_1), (I_2, \mathcal{E}_2, m_2)$  seien Maßräume (Maße sind immer nichtnegativ, ansonsten heißen sie signierte Maße). Weiter sei  $\mathcal{E} = \mathcal{E}_1 \otimes \mathcal{E}_2$  die Produkt- $\sigma$ -Algebra von  $\mathcal{E}_1$  und  $\mathcal{E}_2$ . Ein Maß  $\mu$  auf  $(I_1 \times I_2, \mathcal{E})$  heißt *doppelt sto-*

*chastisch*<sup>1</sup> bezüglich  $m_1, m_2$  genau dann, wenn

$$(1.4) \quad \forall_{A_1 \in \mathcal{E}_1} \mu(A_1 \times I_2) = m_1(A_1) \quad \text{und} \quad \forall_{A_2 \in \mathcal{E}_2} \mu(I_1 \times A_2) = m_2(A_2).$$

Mit  $\mathcal{D}(m_1, m_2)$  (gelegentlich auch mit  $\mathcal{D}(= m_1, = m_2)$ ) bezeichne die Menge aller doppelt stochastischen Maße bezüglich  $m_1, m_2$ . Man sagt auch,  $\mu \in \mathcal{D}(m_1, m_2)$  hat die *Randverteilungen*  $m_1, m_2$ .

Ein Maß  $\mu$  auf  $(I_1 \times I_2, \mathcal{E})$  heißt *doppelt substochastisch*<sup>2</sup> bezüglich  $m_1, m_2$  genau dann, wenn

$$(1.5) \quad \forall_{A_1 \in \mathcal{E}_1} \mu(A_1 \times I_2) \leq m_1(A_1) \quad \text{und} \quad \forall_{A_2 \in \mathcal{E}_2} \mu(I_1 \times A_2) \leq m_2(A_2).$$

Mit  $\mathcal{D}(\leq m_1, \leq m_2)$  bezeichne die Menge aller doppelt substochastischen Maße bezüglich  $m_1, m_2$ .

**Bemerkung 1.3.2.** Gegeben Maßräume  $(I_1, \mathcal{E}_1, m_1)$ ,  $(I_2, \mathcal{E}_2, m_2)$  und  $\mu \in \mathcal{D}(m_1, m_2)$ , so gilt wegen (1.4), daß

$$(1.6) \quad \mu(I_1 \times I_2) = m_1(I_1) = m_2(I_2).$$

Insbesondere gilt

$$(1.7) \quad \mathcal{D}(m_1, m_2) \neq \emptyset \quad \Rightarrow \quad m_1(I_1) = m_2(I_2).$$

**Bemerkung 1.3.3.** Für Maßräume  $(I_1, \mathcal{E}_1, m_1)$ ,  $(I_2, \mathcal{E}_2, m_2)$  sind  $\mathcal{D}(m_1, m_2)$  und  $\mathcal{D}(\leq m_1, \leq m_2)$  konvexe Mengen.

Eines der Hauptanliegen der folgenden Kapitel wird sein, die Mengen der Extrempunkte  $E(\mathcal{D}(m_1, m_2))$  und  $E(\mathcal{D}(\leq m_1, \leq m_2))$  zu untersuchen.

**Definition 1.3.4.** Ein Maßraum  $(I, m) := (I, \mathcal{E}, m)$  heißt *diskret* genau dann, wenn  $\mathcal{E} = 2^I$ ,  $\forall_{i \in I} m(i) < \infty$ ,  $\forall_{A \in \mathcal{E}} m(A) = \sum_{i \in A} m(i)$ , mit der Konvention, daß Summen über überabzählbar viele positive Elemente unendlich sind.  $\#_{nt} I := \#\{i \in I : m(i) > 0\}$  bezeichne die Kardinalität der „nichttrivialen“ Punkte in  $I$ .

**Beispiel 1.3.5.** Seien  $(I_1, m_1)$ ,  $(I_2, m_2)$  diskrete Maßräume, so daß  $\#I_1, \#I_2 \leq \omega$ , und  $m_1(I_1) = m_2(I_2) < \infty$ .  $\#I_1, \#I_2 \leq \omega$  stellt hier keine

<sup>1</sup>Obwohl die Bezeichnung „stochastisch“ eigentlich nur für Wahrscheinlichkeitsmaße zulässig ist, soll sie GRZAŚLEWICZ folgend (siehe [4]) hier und im folgenden in etwas allgemeinerem Sinne verwendet werden.

<sup>2</sup>Die Bemerkung der vorhergehenden Fußnote gilt hier entsprechend.

wirkliche Einschränkung dar, da bei endlichem Maß höchstens abzählbar viele Elemente positives Maß haben können. In diesem Fall hat man

$$(1.8) \quad L_1(m_1) = \left\{ f \in \mathbb{R}^{I_1} : \sum_{i \in I_1} |f(i)| m_1(i) < \infty \right\}$$

und

$$(1.9) \quad L_1(m_2) = \left\{ f \in \mathbb{R}^{I_2} : \sum_{j \in I_2} |f(j)| m_2(j) < \infty \right\}.$$

Die Elemente von  $L_1(m_1)$  beziehungsweise  $L_1(m_2)$  sind also reelle Familien, indiziert mit Elementen aus  $I_1$  beziehungsweise  $I_2$ . Dabei werden, wie üblich, Familien, die fast überall gleich sind (das heißt sich nur an Stellen  $i$  beziehungsweise  $j$  mit  $m_1(i) = 0$  beziehungsweise  $m_2(j) = 0$  unterscheiden), als äquivalent angesehen. Entsprechend bekommt man für  $\mu \in \mathcal{D}(m_1, m_2)$

$$(1.10) \quad L_1(\mu) = \left\{ f \in \mathbb{R}^{I_1 \times I_2} : \sum_{(i,j) \in I_1 \times I_2} |f(i,j)| \mu(i,j) < \infty \right\}.$$

Die Elemente von  $L_1(\mu)$  kann man auffassen als (möglicherweise unendliche) reelle Matrizen mit  $\#I_1$  Zeilen und  $\#I_2$  Spalten. Dann ergibt sich für  $\mathcal{F} := L_1(m_1) + L_1(m_2)$ :

$$(1.11) \quad \mathcal{F} = \left\{ M \in L_1(\mu) : \begin{array}{l} \exists_{a \in L_1(m_1)} \exists_{b \in L_1(m_2)} \\ \forall_{\substack{(i,j) \in I_1 \times I_2 \\ \text{mit } \mu(i,j) > 0}} m_{i,j} = a_i + b_j \end{array} \right\}.$$

## 1.4 Maßtheoretische Charakterisierung der Extremalpunkte

Satz 1.4.1 gibt eine erste Charakterisierung der Extremalpunkte. Der Satz und sein Beweis gehen zurück auf eine Arbeit von LINDENSTRAUSS (siehe [8]).

**Satz 1.4.1.** Seien  $(I_1, \mathcal{E}_1, m_1)$ ,  $(I_2, \mathcal{E}_2, m_2)$  Maßräume mit endlichen Maßen  $m_1, m_2$  und sei  $\mu \in \mathcal{D}(m_1, m_2)$ .

Dann ist  $\mu \in E(\mathcal{D}(m_1, m_2))$  genau dann, wenn  $\overline{L_1(m_1) + L_1(m_2)} = L_1(\mu)$ , das heißt, wenn  $\mathcal{F} := \{h \in L_1(\mu) : h(x, y) = f(x) + g(y), f \in L_1(m_1), g \in L_1(m_2)\}$  in  $(L_1(\mu), \|\cdot\|_1)$  dicht ist.

*Beweis.* Der Beweis wird in drei Schritte unterteilt. Es sei  $\mathcal{E} = \mathcal{E}_1 \otimes \mathcal{E}_2$ .

*Behauptung 1.*  $\mu \notin \mathbf{E}(\mathcal{D}(m_1, m_2))$  genau dann, wenn es ein endliches signiertes Maß  $\nu \neq 0$  auf  $(I_1 \times I_2, \mathcal{E})$  gibt, so daß

$$(1.12) \quad \begin{aligned} \forall_{S \in \mathcal{E}} |\nu|(S) \leq \mu(S) \quad \text{und} \quad \forall_{A \in \mathcal{E}_1} \nu(A \times I_2) = 0 \quad \text{und} \\ \forall_{B \in \mathcal{E}_2} \nu(I_1 \times B) = 0. \end{aligned}$$

*Beweis.* „ $\Rightarrow$ “: Angenommen, es gibt  $\mu \neq \mu_1, \mu_2 \in \mathcal{D}(m_1, m_2)$ , so daß  $\mu = \frac{1}{2}\mu_1 + \frac{1}{2}\mu_2$ . Nun setze  $\nu = \frac{1}{2}\mu_1 - \frac{1}{2}\mu_2$ .  $\mu_1$  und  $\mu_2$  sind endliche Maße (wegen  $\mu_1, \mu_2 \in \mathcal{D}(m_1, m_2)$  und Bemerkung 1.3.2). Also ist  $\nu$  ein endliches signiertes Maß. Für  $S \in \mathcal{E}$ , gilt

$$(1.13) \quad |\nu|(S) \leq \frac{1}{2}\mu_1(S) + \frac{1}{2}\mu_2(S) = \mu(S).$$

Ist  $A \in \mathcal{E}_1$ , so gilt

$$(1.14) \quad \nu(A \times I_2) = \frac{1}{2}\mu_1(A \times I_2) - \frac{1}{2}\mu_2(A \times I_2) = \frac{1}{2}m_1(A) - \frac{1}{2}m_1(A) = 0.$$

Analog folgt  $\nu(I_1 \times B) = 0$  für  $B \in \mathcal{E}_2$ .

„ $\Leftarrow$ “: Habe also  $\nu$  die in der Behauptung verlangten Eigenschaften. Es gilt

$$(1.15) \quad \mu = \frac{1}{2}(\mu + \nu) + \frac{1}{2}(\mu - \nu).$$

$\mu \neq \mu \pm \nu$ , da  $\nu \neq 0$ . Weiterhin ist  $\mu \pm \nu \in \mathcal{D}(m_1, m_2)$ :

Aus  $|\nu| \leq \mu$  folgt  $\mu \pm \nu \geq 0$ . Sei nun  $A \in \mathcal{E}_1$  und  $B \in \mathcal{E}_2$ . Dann gilt

$$(1.16) \quad \begin{aligned} (\mu \pm \nu)(A \times I_2) &= \mu(A \times I_2) = m_1(A), \\ (\mu \pm \nu)(I_1 \times B) &= \mu(I_1 \times B) = m_2(B). \end{aligned}$$

▲

*Behauptung 2.*  $\mu \notin \mathbf{E}(\mathcal{D}(m_1, m_2))$  genau dann, wenn es eine Funktion  $0 \neq F \in L_\infty(\mu)$  gibt, so daß  $\|F\|_\infty \leq 1$  und

$$(1.17) \quad \forall_{f \in L_1(m_1)} \forall_{g \in L_1(m_2)} \int_{I_1 \times I_2} (f(x) + g(y))F(x, y) d\mu = 0.$$

$\|\cdot\|_\infty$  bezeichnet dabei die essentielle Supremumsnorm.

*Beweis.* „ $\Leftarrow$ “: Sei  $F \in L_\infty(\mu)$  gegeben, so daß  $0 \neq F$ ,  $\|F\|_\infty \leq 1$  und (1.17) gilt. Für  $S \in \mathcal{E}$ , definiere

$$(1.18) \quad \nu(S) = \int_S F(x, y) d\mu.$$

Wegen  $\|F\|_\infty > 0$ , folgt  $\nu \neq 0$ . Da  $\mu$  endlich ist und  $F \in L_\infty(\mu)$ , ist  $\int_S F d\mu$  definiert und endlich. Also ist  $\nu$  ein signiertes Maß auf  $(I_1 \times I_2, \mathcal{E})$ . Sei nun  $A \in \mathcal{E}_1$  und  $B \in \mathcal{E}_2$ . Dann ist

$$(1.19) \quad \nu(A \times I_2) = \int_{I_1 \times I_2} 1_A(x) F(x, y) d\mu = 0$$

und

$$(1.20) \quad \nu(I_1 \times B) = \int_{I_1 \times I_2} 1_B(y) F(x, y) d\mu = 0$$

wegen (1.17). Außerdem ist für  $S \in \mathcal{E}$ ,

$$(1.21) \quad |\nu|S = \int_S |F| d\mu \leq \int_S d\mu = \mu(S),$$

da  $\|F\|_\infty \leq 1$ .  $\mu \notin \mathbf{E}(\mathcal{D}(m_1, m_2))$  folgt nun wegen Behauptung 1.

„ $\Rightarrow$ “: Nun sei also  $\mu \notin \mathbf{E}(\mathcal{D}(m_1, m_2))$ .  $\nu$  sei das durch Behauptung 1 gegebene signierte Maß auf  $(I_1 \times I_2, \mathcal{E})$ . Da  $|\nu| = \nu^+ + \nu^- \leq \mu$  ist, folgt  $\nu^+, \nu^- \leq \mu$ . Das Radon-Nikodym-Theorem (siehe zum Beispiel [12, S. 121ff]) liefert nun eine Funktion  $F: I_1 \times I_2 \rightarrow \mathbb{R}$ ,  $F \in L_1(\mu)$ , so daß

$$(1.22) \quad \forall_{S \in \mathcal{E}} \nu S = \int_S F d\mu$$

und für alle  $S \in \mathcal{E}$

$$(1.23) \quad \int_S |F| d\mu = |\nu|S \leq \mu(S) = \int_S d\mu.$$

Daraus folgt  $\|F\|_\infty \leq 1$ , das heißt insbesondere ist  $F \in L_\infty(\mu)$ .

Seien  $\phi: I_1 \rightarrow \mathbb{R}$ ,  $\psi: I_2 \rightarrow \mathbb{R}$  Treppenfunktionen (simple functions: Definition siehe zum Beispiel [11, S. 260]). Wegen (1.12) folgt

$$(1.24) \quad \int_{I_1 \times I_2} \phi(x) F(x, y) d\mu = 0 \quad \text{und} \quad \int_{I_1 \times I_2} \psi(y) F(x, y) d\mu = 0,$$

das heißt

$$(1.25) \quad \begin{aligned} \int_{I_1 \times I_2} (\phi F)^+(x, y) d\mu &= \int_{I_1 \times I_2} (\phi F)^-(x, y) d\mu \quad \text{und} \\ \int_{I_1 \times I_2} (\psi F)^+(x, y) d\mu &= \int_{I_1 \times I_2} (\psi F)^-(x, y) d\mu. \end{aligned}$$

Die folgenden Funktionenlimes bedeuten punktweise Konvergenz. Es seien gegeben  $f \in L_1(m_1)$ ,  $g \in L_1(m_2)$ . Dann gibt es Treppenfunktionen  $\phi_n^+, \phi_n^-: I_1 \rightarrow \mathbb{R}$ , und  $\psi_n^+, \psi_n^-: I_2 \rightarrow \mathbb{R}$ , so daß

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \phi_n^+ = f^+, \quad \lim_{n \rightarrow \infty} \phi_n^- = f^- \quad \text{und} \quad \lim_{n \rightarrow \infty} \psi_n^+ = g^+, \quad \lim_{n \rightarrow \infty} \psi_n^- = g^-,$$

$$\forall_{n \in \mathbb{N}} \quad 0 \leq \phi_n^+ \leq f^+, \quad 0 \leq \phi_n^- \leq f^-, \quad 0 \leq \psi_n^+ \leq g^+, \quad 0 \leq \psi_n^- \leq g^-.$$

Es folgt

$$\lim_{n \rightarrow \infty} (\phi_n^+ - \phi_n^-) = f, \quad \lim_{n \rightarrow \infty} (\phi_n^+ - \phi_n^-)F = fF,$$

und

$$\lim_{n \rightarrow \infty} (\psi_n^+ - \psi_n^-) = g, \quad \lim_{n \rightarrow \infty} (\psi_n^+ - \psi_n^-)F = gF.$$

Dabei gilt außerdem

$$|(\phi_n^+ - \phi_n^-)F| \leq (|\phi_n^+| + |\phi_n^-|)|F| \leq (f^+ + f^-)|F|$$

und

$$|(\psi_n^+ - \psi_n^-)F| \leq (|\psi_n^+| + |\psi_n^-|)|F| \leq (g^+ + g^-)|F|.$$

Da  $(f^+ + f^-)|F|$ ,  $(g^+ + g^-)|F| \in L_1(\mu)$ , kann das Lebesguesche Konvergenztheorem (siehe zum Beispiel [11, S. 267]) angewendet werden, und man bekommt

$$(1.26) \quad \begin{aligned} \int_{I_1 \times I_2} fF \, d\mu &= \lim_{n \rightarrow \infty} \int_{I_1 \times I_2} (\phi_n^+ - \phi_n^-)F \, d\mu = 0 \quad \text{und} \\ \int_{I_1 \times I_2} gF \, d\mu &= \lim_{n \rightarrow \infty} \int_{I_1 \times I_2} (\psi_n^+ - \psi_n^-)F \, d\mu = 0 \end{aligned}$$

wegen (1.24). Durch (1.26) ist der Beweis von „ $\Rightarrow$ “ und damit auch der Beweis von Behauptung 2 vollständig.  $\blacktriangle$

Der letzte Schritt im Beweis des Satzes ist die folgende Behauptung 3.

*Behauptung 3.*  $\mu \notin \mathbf{E}(\mathcal{D}(m_1, m_2)) \Leftrightarrow \mathcal{F} \subseteq L_1(\mu)$  ist nicht dicht in  $L_1(\mu)$ .

*Beweis.* Nach dem Darstellungssatz von Riesz, ist  $L_1(\mu)^*$  isometrisch isomorph zu  $L_\infty(\mu)$ .

„ $\Rightarrow$ “: Sei  $F \in L_\infty(\mu)$  die durch Behauptung 2 gegebene Funktion. Das zugehörige Funktional in  $L_1(\mu)^*$  bezeichne wieder mit  $F$ . Wegen (1.17) gilt für dieses Funktional  $F$ , daß  $\forall_{h \in \mathcal{F}} F(h) = 0$ . Wäre  $L_1(\mu)$  gleich dem Abschluß von  $\mathcal{F}$ , so würde die Stetigkeit von  $F$  implizieren, daß  $\forall_{h \in L_1(\mu)} F(h) = 0$ , das heißt  $F = 0$  im Widerspruch zu  $F \neq 0$  in Behauptung 2.

„ $\Leftarrow$ “: Angenommen  $\mathcal{F}$  ist nicht dicht in  $L_1(\mu)$ . Es gibt also  $h_0 \in L_1 \setminus \overline{\mathcal{F}}$ , das heißt

$$\exists_{\delta > 0} \forall_{h \in \mathcal{F}} \|h - h_0\|_1 \geq \delta.$$

Da  $\mathcal{F}$  ein linearer Unterraum von  $L_1(\mu)$  ist, gibt es nach Proposition 7 in [11, S. 226] (eine Anwendung des Satzes von Hahn-Banach) ein  $F \in L_1(\mu)^*$ , so daß  $\|F\|_\infty \leq 1$ ,  $F|_{\mathcal{F}} = 0$ ,  $F(h_0) = \delta$ , also insbesondere  $F \neq 0$ . Die zugehörige Funktion  $F \in L_\infty(\mu)$  erfüllt (1.17) und wegen Behauptung 2 ist daher  $\mu \notin \mathbf{E}(\mathcal{D}(m_1, m_2))$ .  $\blacktriangle$

Damit ist Satz 1.4.1 bewiesen.  $\blacksquare$

# Kapitel 2

## Doppelt stochastische Matrizen

### 2.1 Definition und erste Eigenschaften

Sind die Maßräume in Definition 1.3.1 diskret, so entsprechen die Mengen der doppelt (sub-)stochastischen Maße gerade den Mengen der doppelt (sub-)stochastischen (möglicherweise doppelt unendlichen) Matrizen. Während in der Literatur meistens Randverteilungen auf den natürlichen Zahlen und deren Teilmengen betrachtet werden, sollen im folgenden diskrete Verteilungen auf beliebigen Mengen zugelassen werden. Dadurch wird herausgestellt, daß die Ordnungsstruktur der natürlichen Zahlen für die meisten Ergebnisse ohne Bedeutung ist.

**Definition 2.1.1.** Seien  $I_1, I_2, K$  Mengen. Mit  $\mathcal{M}_K(I_1, I_2) := K^{I_1 \times I_2}$  bezeichne die Menge aller Matrizen, indiziert mit Elementen aus  $I_1 \times I_2$  und Koeffizienten in  $K$  (im folgenden wird praktisch immer  $K = \mathbb{R}$  oder  $K = \mathbb{R}_0^+$  gelten). Die Elemente von  $I_1$  beziehungsweise  $I_2$  heißen *Zeilenindizes* beziehungsweise *Spaltenindizes*. Die Matrizen haben also  $\#I_1$  viele Zeilen und  $\#I_2$  viele Spalten. Eine Zeile oder Spalte werde als *Linie* bezeichnet.

Matrizen, die in jeder Linie höchstens eine Eins stehen haben und sonst nur Nullen, werden als *Subpermutationsmatrizen* bezeichnet. Die Menge der Subpermutationsmatrizen mit Zeilenindizes aus  $I_1$  und Spaltenindizes aus  $I_2$  bezeichne man mit  $\mathcal{M}_{sp}(I_1, I_2)$ .

Matrizen, die in jeder Zeile genau eine Eins stehen haben und sonst nur Nullen, werden als *Permutationsmatrizen* bezeichnet. Die Menge der Permutationsmatrizen mit Zeilenindizes aus  $I_1$  und Spaltenindizes aus  $I_2$  bezeichne man mit  $\mathcal{M}_p(I_1, I_2)$ . Gelegentlich wird auch die Bezeichnung  $\mathcal{M}_{sp}(I_1) := \mathcal{M}_{sp}(I_1, I_1)$  beziehungsweise  $\mathcal{M}_p(I_1) := \mathcal{M}_p(I_1, I_1)$  benutzt werden.

In Beispielen werden des öfteren „Doppeldiagonalmatrizen“ auftreten, die jetzt definiert werden sollen.



**Definition 2.1.2.** Es sei  $I_1 = I_2 = (1, 2, \dots)$ .  $P \in \mathcal{M}_{\mathbb{R}}(I_1, I_2)$  heißt eine *Doppeldiagonalmatrix* der Form  $((a_0, a_1, \dots), (b_1, b_2, \dots))$  genau dann, wenn

$$p_{i,j} = \begin{cases} a_0 & \text{für } i = j = 1, \\ a_i & \text{für } j = i + 1, \\ b_j & \text{für } i = j + 1, \\ 0 & \text{sonst,} \end{cases}$$

das heißt

$$P = \begin{pmatrix} a_0 & a_1 & & & \\ b_1 & & a_2 & & \\ & b_2 & & \ddots & \\ & & & & \ddots \end{pmatrix}.$$

Im folgenden werden die von Null verschiedenen Elemente einer Matrix oft eine ausgezeichnete Rolle spielen. In der folgenden Definition 2.1.3 werden daher der Träger einer Matrix definiert und jeder Matrix ein bipartiter Graph zugeordnet, der die Verteilung der von Null verschiedenen Elemente in der Matrix beschreibt.

**Definition 2.1.3.**  $I_1, I_2$  seien Mengen,  $P \in \mathcal{M}_{\mathbb{R}}(I_1, I_2)$ .

(a) Definiere den *Träger*  $\text{supp}(P)$  von  $P$  durch

$$(2.1) \quad \text{supp}(P) := \{(i, j) \in I_1 \times I_2 : p_{i,j} \neq 0\}.$$

(b) Der *gewichtete Graph*  $G(P) = (V, E, w)$  der Matrix  $P$  sei definiert durch

$$(2.2) \quad \begin{aligned} V &:= \{x_i : i \in I_1\} \dot{\cup} \{y_j : j \in I_2\}, \\ E &:= \{x_i, y_j\} : p_{i,j} \neq 0, \\ w : E(G(P)) &\longrightarrow \mathbb{R}, \quad w\{x_i, y_j\} := p_{i,j}. \end{aligned}$$

(c) Definiere die *Trägermatrix*  $S(P) = S = (s_{i,j})_{(i,j) \in I_1 \times I_2}$  durch

$$(2.3) \quad s_{i,j} := \begin{cases} 1 & \text{für } (i, j) \in \text{supp}(P), \\ 0 & \text{sonst.} \end{cases}$$

**Bemerkung 2.1.4.** Für Mengen  $I_1, I_2$  und  $P \in \mathcal{M}_{\mathbb{R}}(I_1, I_2)$  ist nach den Definitionen 1.2.12 und 2.1.3 (b) der Graph  $G(P)$  bipartit.

Manchmal ist es übersichtlicher, eine Matrix nicht direkt, sondern mittels ihres Graphen zu definieren. Daß dies legitim ist, besagt die folgende Bemerkung 2.1.5.

**Bemerkung 2.1.5.** Sind  $I_1, I_2$  Mengen,  $K \subseteq \mathbb{R}$  und  $\mathcal{B}$  die Menge aller bipartiten gewichteten Graphen  $(\{x_i : i \in I_1\} \dot{\cup} \{y_j : j \in I_2\}, E, w)$  mit Gewichtsfunktionen  $w : E \rightarrow K \setminus \{0\}$ , so ist die durch Definition 2.1.3 (b) gegebene Abbildung

$$(2.4) \quad G : \mathcal{M}_K(I_1, I_2) \rightarrow \mathcal{B}, \quad P \mapsto G(P)$$

eine Bijektion.

Gemäß Bemerkung 2.1.5 werde bei gegebenem bipartiten Graphen  $H$  die zugehörige Matrix mit  $G^{-1}(H)$  bezeichnet.

**Lemma 2.1.6.** Seien  $I_1, I_2$  Mengen und  $P \in \mathcal{M}_{\mathbb{R}}(I_1, I_2)$  eine Doppeldiagonalmatrix der Form  $((a_0, a_1, \dots), (b_1, b_2, \dots))$  nach Definition 2.1.2. Dann ist  $G(P)$  ein Wald.

*Beweis.*  $G(P)$  ist ein Subgraph des Kantenzugs  $(\dots, x_3, y_2, x_1, y_1, x_2, y_3, \dots)$  und kann daher keinen Kreis haben. ■

**Definition 2.1.7.** Ein  $\leq$ -Randsystem ist ein 4-Tupel  $\mathcal{I} = (I_1, I_2, r, s)$  aus zwei Mengen  $I_1, I_2$  und nichtnegativen, reellen Familien  $r = (r_i)_{i \in I_1}, s = (s_j)_{j \in I_2}$ . Nenne  $i \in I_1$  ( $j \in I_2$ ) einen *nichttrivialen* Index genau dann, wenn  $r_i > 0$  ( $s_j > 0$ ). Es seien  $I_{1,nt} := \{i \in I_1 : r_i > 0\}$ ,  $I_{2,nt} := \{j \in I_2 : s_j > 0\}$  die Mengen der nichttrivialen Indizes. Ein  $\leq$ -Randsystem heie *Randsystem* genau dann, wenn  $\sum_{i \in I_1} r_i = \sum_{j \in I_2} s_j$ . Mit  $l(r) := \#I_{1,nt}$  beziehungsweise  $l(s) := \#I_{2,nt}$  bezeichne die *Lnge* von  $s$  beziehungsweise  $r$ .  $r, s$  heien *endlich* genau dann, wenn ihre Lnge endlich ist. In diesem Fall nenne auch das  $\leq$ -Randsystem *endlich*. Fr ein  $\leq$ -Randsystem  $\tilde{\mathcal{I}} = (\tilde{I}_1, \tilde{I}_2, \tilde{r}, \tilde{s})$  schreibe  $\tilde{\mathcal{I}} \leq \mathcal{I}$  genau dann, wenn  $\tilde{I}_1 \subseteq I_1, \tilde{I}_2 \subseteq I_2, \tilde{r} = r|_{\tilde{I}_1}, \tilde{s} = s|_{\tilde{I}_2}$ .

**Definition 2.1.8.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein  $\leq$ -Randsystem. Dann werde  $\mathcal{I}$  eine Gruppe  $\mathcal{G}$  zugeordnet durch

$$(2.5) \quad \mathcal{G} = \mathcal{G}(\mathcal{I}) := \langle \{r_i : i \in I_1\} \cup \{s_j : j \in I_2\} \rangle$$

(durch  $\langle M \rangle$  werde die von  $M \subseteq \mathbb{R}$  in  $\mathbb{R}$  erzeugte additive Untergruppe bezeichnet).

**Definition 2.1.9.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein  $\leq$ -Randsystem nach Definition 2.1.7. Eine Matrix  $P \in \mathcal{M}_{\mathbb{R}_0^+}(I_1, I_2)$  heit *doppelt stochastisch*<sup>1</sup> bezglich  $\mathcal{I}$  genau dann, wenn

$$(2.6) \quad \forall_{(i,j) \in I_1 \times I_2} \sum_{k \in I_1} p_{k,j} = s_j \quad \text{und} \quad \sum_{l \in I_2} p_{i,l} = r_i,$$

(das heit insbesondere sind in jeder Linie hchstens abzhlbar viele Elemente von Null verschieden). Die Menge der doppelt stochastischen Matrizen bezglich  $\mathcal{I}$  bezeichne mit  $\mathcal{D}(\mathcal{I})$  (gelegentlich auch mit  $\mathcal{D}(=\mathcal{I})$ ).

<sup>1</sup>Siehe entsprechende Funote zu Definition 1.3.1.

**Definition 2.1.10.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein  $\leq$ -Randsystem. Eine Matrix  $P \in \mathcal{M}_{\mathbb{R}_0^+}(I_1, I_2)$  heißt *doppelt substochastisch*<sup>2</sup> bezüglich  $\mathcal{I}$  genau dann, wenn

$$(2.7) \quad \forall_{(i,j) \in I_1 \times I_2} \sum_{k \in I_1} p_{k,j} \leq s_j \quad \text{und} \quad \sum_{l \in I_2} p_{i,l} \leq r_i.$$

Die Menge der doppelt substochastischen Matrizen bezüglich  $r, s$  bezeichne mit  $\mathcal{D}(\leq \mathcal{I})$ .

**Beispiel 2.1.11.** Seien  $I_1, I_2$  Mengen und  $P \in \mathcal{M}_{\mathbb{R}_0^+}(I_1, I_2)$ . Dann definiere  $\mathcal{I}(P)$  durch  $\mathcal{I}(P) := (I_1, I_2, r, s)$  mit  $\forall_{i \in I_1} r_i := \sum_{j \in I_2} p_{i,j}$  und  $\forall_{j \in I_2} s_j := \sum_{i \in I_1} p_{i,j}$ . Dann ist  $\mathcal{I}$  genau dann ein Randsystem, wenn alle  $r_i, s_j$  endlich sind. In diesem Fall ist  $P \in \mathcal{D}(\mathcal{I}(P))$ .

**Bemerkung 2.1.12.** Für ein  $\leq$ -Randsystem  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  sind  $\mathcal{D}(\mathcal{I})$  und  $\mathcal{D}(\leq \mathcal{I})$  konvexe Mengen.

Wieder werden es die Extrempunktmengen  $E(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$  beziehungsweise  $E(\mathcal{D}(\leq \mathcal{I}))$  sein, die im folgenden von besonderem Interesse sind.

**Lemma 2.1.13.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein  $\leq$ -Randsystem.

(a) Ist  $P \in \mathcal{D}(\leq \mathcal{I})$ , so gilt  $P \notin E(\mathcal{D}(\leq \mathcal{I}))$  genau dann, wenn es eine Matrix  $E \in \mathcal{M}_{\mathbb{R}}(I_1, I_2) \setminus \{0\}$  gibt, so daß

$$(2.8) \quad \forall_{i \in I_1} \left| \sum_{j \in I_2} e_{i,j} \right| \in [0, r_i - \sum_{j \in I_2} p_{i,j}], \quad \forall_{j \in I_2} \left| \sum_{i \in I_1} e_{i,j} \right| \in [0, s_j - \sum_{i \in I_1} p_{i,j}]$$

$$(2.9) \quad \text{und} \quad P \pm E \geq 0.$$

(b) Ist  $P \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$ , so gilt  $P \notin E(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$  genau dann, wenn es eine Matrix  $E \in \mathcal{M}_{\mathbb{R}}(I_1, I_2) \setminus \{0\}$  gibt, deren Linien sich alle zu Null summieren und  $P \pm E \geq 0$ .

*Beweis.* (a) „ $\Leftarrow$ “: Wegen  $E \neq 0$ , ist  $P \pm E \neq P$ , und wegen (2.8) und (2.9) ist  $P \pm E \in \mathcal{D}(\leq \mathcal{I})$ . Die Behauptung folgt nun aus  $\frac{1}{2}(P + E) + \frac{1}{2}(P - E) = P$ . „ $\Rightarrow$ “: Angenommen, es ist  $P = \frac{1}{2}P_1 + \frac{1}{2}P_2$  mit  $P_1, P_2 \in \mathcal{D}(\leq \mathcal{I})$ ,  $P_1, P_2 \neq P$ . Setze  $E := P - P_1 = P_2 - P$ . Dann gilt  $P + E = P_2 \geq 0$  und  $P - E = P_1 \geq 0$ . Also müssen wegen  $P_1, P_2 \in \mathcal{D}(\leq \mathcal{I})$  (2.8) und (2.9) gelten.

(b) folgt genau wie (a), wenn man dort im Beweis die „ $\leq$ “-Zeichen wegläßt und beachtet, daß in diesem Fall (2.8) gerade die Aussage ist, daß sich alle Linien von  $E$  zu Null summieren. ■

<sup>2</sup>Siehe entsprechende Fußnote zu Definition 1.3.1.

**Lemma 2.1.14.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein  $\leq$ -Randsystem.

- (a) Für  $P \in \mathcal{D}(\leq \mathcal{I})$  ist  $P \in \mathbf{E}(\mathcal{D}(\leq \mathcal{I}))$  genau dann, wenn für alle Submatrizen  $Q$  von  $P$  gilt, daß  $Q \in \mathbf{E}(\mathcal{D}(\leq \tilde{\mathcal{I}}))$ . Hierbei ist  $\tilde{\mathcal{I}} := (\tilde{I}_1, \tilde{I}_2, \tilde{r}, \tilde{s})$  mit  $\forall_{i \in \tilde{I}_1} \tilde{r}_i := \sum_{j \in \tilde{I}_2} q_{i,j} + r_i - \sum_{j \in I_2} p_{i,j}$ ,  $\forall_{j \in \tilde{I}_2} \tilde{s}_j := \sum_{i \in \tilde{I}_1} q_{i,j} + s_j - \sum_{i \in I_1} p_{i,j}$  und  $Q \in \mathcal{M}_{\mathbb{R}_0^+}(\tilde{I}_1, \tilde{I}_2)$ .
- (b) Für  $P \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$  ist  $P \in \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$  genau dann, wenn für alle Submatrizen  $Q$  von  $P$  gilt, daß  $Q \in \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}(Q)))$ .

*Beweis.* (a) Zu zeigen ist nur „ $\Rightarrow$ “. Sei also  $P \in \mathbf{E}(\mathcal{D}(\leq \mathcal{I}))$ . Angenommen  $Q = \frac{1}{2}Q^{(1)} + \frac{1}{2}Q^{(2)}$  mit  $Q^{(1)}, Q^{(2)} \in \mathcal{D}(\leq \tilde{\mathcal{I}})$ . Für  $k = 1, 2$  definiere  $P^{(k)} = (p_{i,j}^{(k)})_{(i,j) \in I_1 \times I_2}$  durch

$$(2.10) \quad p_{i,j}^{(k)} := \begin{cases} q_{i,j}^{(k)} & \text{für } (i,j) \in \tilde{I}_1 \times \tilde{I}_2, \\ p_{i,j} & \text{sonst.} \end{cases}$$

Dann ist  $P^{(1)}, P^{(2)} \in \mathcal{D}(\leq \mathcal{I})$  und  $P = \frac{1}{2}P^{(1)} + \frac{1}{2}P^{(2)}$ , das heißt  $P = P^{(1)} = P^{(2)}$ , also auch  $Q^{(1)} = Q^{(2)} = Q$  und damit  $Q \in \mathbf{E}(\mathcal{D}(\leq \tilde{\mathcal{I}}))$ .

Wieder folgt (b) genau wie (a), wenn man dort im Beweis die „ $\leq$ “-Zeichen wegläßt. ■

Der folgende Satz 2.1.15 beschreibt den Zusammenhang der doppelt (sub-)stochastischen Matrizen mit den doppelt (sub-)stochastischen Maßen.

**Satz 2.1.15.**  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  sei ein  $\leq$ -Randsystem,  $(I_1, m_1)$  und  $(I_2, m_2)$  seien diskrete Maße, so daß

$$(2.11) \quad \forall_{(i,j) \in I_1 \times I_2} m_1(i) = r_i \quad \text{und} \quad m_2(j) = s_j.$$

Die Abbildungen

$$h := h_- : \mathcal{D}(m_1, m_2) \longrightarrow \mathcal{D}(\mathcal{I}), \quad (h(\mu))_{i,j} := \mu(i, j) \quad \text{und}$$

$$h_{\leq} : \mathcal{D}(\leq m_1, \leq m_2) \longrightarrow \mathcal{D}(\leq \mathcal{I}), \quad (h_{\leq}(\mu))_{i,j} := \mu(i, j),$$

sind affine Isomorphismen.

*Beweis.* Der Beweis, daß  $h_{\leq}$  und  $h$  wohldefiniert, injektiv, surjektiv und linear sind, macht keinerlei Schwierigkeiten. Daher soll hier nur exemplarisch die Surjektivität von  $h_{\leq}$  gezeigt werden. Für gegebenes  $P \in \mathcal{D}(\leq \mathcal{I})$  definiere ein

diskretes Maß  $\mu$  auf  $I_1 \times I_2$  durch  $\mu(i, j) := p_{i,j}$ . Es ist  $\mu \in \mathcal{D}(\leq m_1, \leq m_2)$ , denn für  $A_1 \subseteq I_1$  ist

$$\mu(A_1 \times I_2) = \sum_{i \in A_1} \sum_{l \in I_2} \mu(i, l) = \sum_{i \in A_1} \sum_{l \in I_2} p_{i,l} \leq \sum_{i \in A_1} r_i = \sum_{i \in A_1} m_1(i) = m_1(A_1).$$

Analog folgt  $\mu(I_1 \times A_2) = m_2(A_2)$  für  $A_2 \subseteq I_2$ . Aus den Definitionen von  $h_{\leq}$  und  $\mu$  liest man unmittelbar ab, daß  $h_{\leq}(\mu) = P$ . Die anderen Verifikationen sind noch einfacher. ■

**Korollar 2.1.16.** Die Voraussetzungen und Bezeichnungen seien wie in Satz 2.1.15.

(a)  $h(\mathbb{E}(\mathcal{D}(m_1, m_2))) = \mathbb{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$  und  
 $h_{\leq}(\mathbb{E}(\mathcal{D}(\leq m_1, \leq m_2))) = \mathbb{E}(\mathcal{D}(\leq \mathcal{I})).$

(b)  $\sum_{i \in I_1} r_i = m_1(I_1)$  und  $\sum_{j \in I_2} s_j = m_2(I_2).$

(c)  $\forall_{P \in \mathcal{D}(\mathcal{I})} \sum_{(i,j) \in I_1 \times I_2} p_{i,j} = \mu(I_1 \times I_2) = \sum_{i \in I_1} r_i = \sum_{j \in I_2} s_j$ , mit  $\mu = h^{-1}(P)$ .

(d)  $\forall_{P \in \mathcal{D}(\leq \mathcal{I})} \sum_{(i,j) \in I_1 \times I_2} p_{i,j} \leq \min \left\{ \sum_{i \in I_1} r_i, \sum_{j \in I_2} s_j \right\} = \min\{m_1(I_1), m_2(I_2)\}.$

(e)  $\mathcal{D}(\mathcal{I}) \neq \emptyset \Rightarrow \sum_{i \in I_1} r_i = \sum_{j \in I_2} s_j$ , das heißt,  $\mathcal{I}$  ist ein Randsystem. ■

Gemäß Satz 2.1.15 und dem ihm folgenden Korollar 2.1.16 werden im folgenden oft diskrete Maße mit Matrizen identifiziert und umgekehrt. Aussagen wie  $\mu \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$  oder  $P \in \mathcal{D}(m_1, m_2)$  sind in diesem Sinne zu interpretieren.

Während es wegen  $0 \in \mathcal{D}(\leq \mathcal{I})$  klar ist, daß  $\mathcal{D}(\leq \mathcal{I})$  und sogar  $\mathbb{E}(\mathcal{D}(\leq \mathcal{I}))$  nicht leer sind, ist das für  $\mathcal{D}(\mathcal{I})$  und  $\mathbb{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$  nicht so unmittelbar einsichtig, und es ist auch nicht für alle Randsysteme richtig (siehe Satz 2.1.18). Im folgenden Beispiel 2.1.17 wird ein Standardelement von  $\mathcal{D}(\mathcal{I})$  für den Fall abzählbarer Randsysteme konstruiert, welches sich sogar als extremal erweisen wird.

**Beispiel 2.1.17.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein Randsystem mit  $\#I_1 = \#I_2 = \omega$  und  $\sum_{i \in I_1} r_i = \sum_{j \in I_2} s_j > 0$  (für „= 0“ ist  $\mathcal{D}(\mathcal{I}) = \{0\}$ ). Indem man Abzählungen von  $I_1, I_2$  wählt, kann man ohne Einschränkung annehmen, daß  $I_1 = I_2 = \mathbb{N}$  (das Standardelement ist damit also von der Wahl der Abzählungen abhängig). Dann werde das Standardelement  $P = P(\mathcal{I})$  von  $\mathcal{D}(\mathcal{I})$  wie folgt definiert:

$$(2.12) \quad p_{i,j} := \min \left\{ r_i - \sum_{l=1}^{j-1} p_{i,l}, s_j - \sum_{k=1}^{i-1} p_{k,j} \right\}.$$

Dadurch werden alle  $p_{i,j}$  rekursiv definiert (kennt man alle  $p_{k,l}$  mit  $k < i$  oder  $l < j$ , so kann man  $p_{i,j}$  berechnen).

*Behauptung 1.*  $P \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$ .

*Beweis.*  $p_{1,1} = \min\{r_1, s_1\} \geq 0$ . Für  $j > 1$  ist

$$r_i - \sum_{l=1}^{j-1} p_{i,l} = \left( r_i - \sum_{l=1}^{j-2} p_{i,l} \right) - p_{i,j-1} \geq 0$$

und für  $i > 1$  ist

$$s_j - \sum_{k=1}^{i-1} p_{k,j} = \left( s_j - \sum_{k=1}^{i-2} p_{k,j} \right) - p_{i-1,k} \geq 0.$$

Also sind alle  $p_{i,j} \geq 0$ .

Nun wird durch vollständige Induktion nach  $i$  gezeigt, daß  $\sum_{l=1}^{\infty} p_{i,l} = r_i$ . Sei  $i \in I_1$  fest. Angenommen, es gibt ein  $l_0$ , so daß  $p_{i,l_0} = r_i - \sum_{l=1}^{l_0-1} p_{i,l}$ . Dann folgt  $\forall_{l>l_0} p_{i,l} = 0$  und

$$\sum_{l=1}^{\infty} p_{i,l} = \sum_{l=1}^{l_0} p_{i,l} = r_i - \sum_{l=1}^{l_0-1} p_{i,l} + \sum_{l=1}^{l_0-1} p_{i,l} = r_i.$$

Angenommen, es gibt kein solches  $l_0$ , das heißt, für alle  $l$  gilt  $p_{i,l} = s_l - \sum_{k=1}^{i-1} p_{k,l}$ . Dann folgt

(2.13)

$$\sum_{l=1}^{\infty} p_{i,l} = \sum_{l=1}^{\infty} s_l - \sum_{l=1}^{\infty} \sum_{k=1}^{i-1} p_{k,l} \stackrel{(*)}{=} \sum_{l=1}^{\infty} s_l - \sum_{k=1}^{i-1} r_k \stackrel{(**)}{=} \sum_{k=1}^{\infty} r_k - \sum_{k=1}^{i-1} r_k = \sum_{k=i}^{\infty} r_k \geq r_i.$$

Ist  $i = 1$ , so ist (2.13) trivialerweise richtig. Für  $i > 1$ , stimmt „ $\stackrel{(*)}{=}$ “ in (2.13) wegen der Induktionsvoraussetzung und „ $\stackrel{(**)}{=}$ “, da  $\mathcal{I}$  ein Randsystem ist. Da alle  $p_{i,j} \geq 0$ , folgt aus (2.12), daß  $\sum_{l=1}^{\infty} p_{i,l} \leq r_i$ . Also folgt  $\sum_{l=1}^{\infty} p_{i,l} = r_i$ . Analog zeigt man durch vollständige Induktion nach  $j$ , daß  $\sum_{k=1}^{\infty} p_{k,j} = s_j$ .  $\blacktriangle$

*Behauptung 2.*  $P \in \mathbb{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ .

*Beweis.* Angenommen, es wäre  $P \notin \mathbb{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ . Dann gäbe es wegen Lemma 2.1.13 (b) eine Matrix  $E \in \mathcal{M}_{\mathbb{R}}(I_1, I_2) \setminus \{0\}$ , deren Linien sich alle zu Null summieren und mit  $P \pm E \geq 0$ .

*Def. 1.* Definiere rekursiv eine Folge von Indizes durch  $\mathcal{P} := ((i_1, j_1), (i_2, j_2), \dots) \subseteq I_1 \times I_2$ , wobei  $i_1 := j_1 := 1$  und für bereits definiertes  $(i_n, j_n)$  sei

$$(2.14) \quad (i_{n+1}, j_{n+1}) = \begin{cases} (i_n + 1, j_n), & \text{falls } \forall_{j>j_n} p_{i_n, j} = 0, \\ (i_n, j_n + 1), & \text{falls } \forall_{i>i_n} p_{i, j_n} = 0, \\ (i_n + 1, j_n + 1), & \text{falls } \forall_{\substack{i>i_n, \\ j>j_n}} p_{i, j} = 0. \end{cases}$$

Wegen (2.12) tritt immer genau eine der Bedingungen in (2.14) ein.

*Def. 2.* Nenne  $(i_n, j_n) \in \mathcal{P}$  Eckpunkt genau dann, wenn  $n > 1$  und  $(i_{n-1} < i_n = i_{n+1}$  oder  $j_{n-1} < j_n = j_{n+1})$ . Die Teilfolge der Eckpunkte von  $\mathcal{P}$  bezeichne mit  $\mathcal{P}_E = ((E_1, F_1), (E_2, F_2), \dots)$ .

*Beh. 2.1.*  $\text{supp}(P) \subseteq \mathcal{P}$ .

*Beweis.* Für  $m, n \in \mathbb{N}$  sei  $T_{m,n} := \{(i, j) \in \text{supp}(P) : i \leq m, j \leq n\}$ . Man zeigt durch vollständige Induktion, daß für alle  $n \in \mathbb{N}$  gilt,  $T_{i_n, j_n} \subseteq \{(i_1, j_1), \dots, (i_n, j_n)\}$ .  $T_{i_1, j_1} = T_{1,1} \subseteq \{(1, 1)\} = \{(i_1, j_1)\}$  per Definition von  $\mathcal{P}$ . Den Induktionsschritt bekommt man, da wegen (2.14)  $T_{i_{n+1}, j_{n+1}} \subseteq T_{i_n, j_n} \cup \{(i_{n+1}, j_{n+1})\}$  (im ersten Fall von (2.14) ist  $p_{i_{n+1}, j} = 0$  für  $j < j_{n+1}$ , im zweiten Fall von (2.14) ist  $p_{i, j_{n+1}} = 0$  für  $i < i_{n+1}$ , im dritten Fall von (2.14) ist  $p_{i, j} = 0$  für  $i < i_{n+1}$  und  $j < j_{n+1}$ ). Nun folgt Beh. 2.1, denn sind  $\tilde{i}, \tilde{j}$  die Suprema der in  $\mathcal{P}$  auftretenden Indizes  $i_n$  beziehungsweise  $j_n$  (eventuell  $\infty$ ), so folgt  $\forall_{\substack{i > \tilde{i} \\ i \in \mathbb{N}}} p_{i, j} = 0$  beziehungsweise  $\forall_{\substack{i \in \mathbb{N} \\ j > \tilde{j}}} p_{i, j} = 0$  und

$$\text{supp}(P) = \bigcup_{m, n=1}^{\infty} T_{m, n} = \bigcup_{n=1}^{\infty} T_{i_n, j_n} \subseteq \mathcal{P}. \quad \triangle$$

Nach (2.14) sind die Elemente der Folge  $\mathcal{P}$  alle verschieden. Wegen  $P \pm E \geq 0$ , folgt aus  $e_{i, j} \neq 0$ , daß  $(i, j) \in \mathcal{P}$ . Da sich Zeilen und Spalten von  $E$  zu Null addieren, gilt sogar

$$e_{i, j} \neq 0 \quad \Rightarrow \quad (i, j) = (E_n, F_n) \in \mathcal{P}_E$$

sowie  $e_{E_{n-1}, F_{n-1}} \neq 0$  und  $e_{E_{n+1}, F_{n+1}} \neq 0$ . Insbesondere hat jedes Element von  $\mathcal{P}_E$  einen Vorgänger und einen Nachfolger. Das steht im Widerspruch dazu, daß  $(E_1, F_1)$  keinen Vorgänger hat. Die Matrix  $E$  kann also keine von Null verschiedenen Elemente besitzen, das heißt, die Annahme  $P \notin \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$  war falsch.  $\blacktriangle$

**Satz 2.1.18.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein  $\leq$ -Randsystem.

(a)  $\mathcal{D}(\leq \mathcal{I})$  und  $\mathbf{E}(\mathcal{D}(\leq \mathcal{I}))$  sind nicht leer.

(b) Ist  $\mathcal{I}$  ein Randsystem, so gilt

$$\mathcal{D}(\mathcal{I}), \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I})) \neq \emptyset \quad \Leftrightarrow \quad \omega \cdot \#I_{1, nt} = \omega \cdot \#I_{2, nt}.$$

(c) Für diskrete Maßräume  $(I_1, m_1), (I_2, m_2)$  gilt

$$\mathcal{D}(m_1, m_2), \mathbf{E}(\mathcal{D}(m_1, m_2)) \neq \emptyset \quad \Leftrightarrow \quad \omega \cdot \#I_{1, nt} = \omega \cdot \#I_{2, nt}.$$

*Beweis.* (a) Es ist  $0 \in \mathbb{E}(\mathcal{D}(\leq \mathcal{I})) \subseteq \mathcal{D}(\leq \mathcal{I})$ .

(b) Setze  $\alpha := \#I_{1,nt}$  und  $\beta := \#I_{2,nt}$ .

„ $\Rightarrow$ “: Angenommen  $\alpha \neq \beta$ . Es sei ohne Beschränkung der Allgemeinheit  $\alpha > \beta > 0$  und  $\alpha > \omega$ . Gibt es dann  $P \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$ , so ist wegen  $\alpha = \#I_{1,nt}$  auch  $\#supp(P) = \alpha$ . Andererseits ist aber  $\#supp(P) \leq \beta\omega < \alpha$ . Daher kann es kein  $P \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$  geben.

„ $\Leftarrow$ “: Für  $\alpha, \beta \leq \omega$  ist in Beispiel 2.1.17 bereits ein  $P(\mathcal{I}) \in \mathbb{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$  konstruiert worden (es ist klar, daß man den Fall „ $< \omega$ “ durch Auffüllen mit Nulllinien auf den Fall „ $= \omega$ “ zurückführen kann). Bleibt der Fall  $\alpha = \beta > \omega$ .

*Behauptung 1.* Es gibt Randsysteme  $(\mathcal{I}_k = (I_{1,k}, I_{2,k}, r^k, s^k))_{k \in \alpha}$ , so daß für alle  $k \in \alpha$ ,  $\mathcal{I}_k \leq \mathcal{I}$ ,  $I_1 = \bigcup_{k \in \alpha} I_{1,k}$ ,  $I_2 = \bigcup_{k \in \alpha} I_{2,k}$ ,  $r^0 = s^0 = 0$ , und für alle  $0 \neq k \in \alpha$  ist  $\#I_{1,k} = \#I_{2,k} = \omega$  sowie  $\sum_{i \in I_{1,k}} r_i = \sum_{j \in I_{2,k}} s_j = \infty$ .

*Beweis.* Für  $n \in \mathbb{N}$  setze

$$(2.15) \quad \begin{aligned} R_n &:= \{i \in I_1 : \frac{1}{n+1} < r_i \leq \frac{1}{n}\}, & R_0 &:= \{i \in I_1 : 1 < r_i\}, \\ S_n &:= \{j \in I_2 : \frac{1}{n+1} < s_j \leq \frac{1}{n}\}, & S_0 &:= \{j \in I_2 : 1 < s_j\}. \end{aligned}$$

Nun werden die endlichen Mengen in  $R_e$  beziehungsweise  $S_e$  und die unendlichen Mengen in  $R_\infty$  beziehungsweise  $S_\infty$  zusammengefaßt:

$$(2.16) \quad \begin{aligned} R_e &:= \{R_n : \#R_n < \infty\}, & S_e &:= \{S_n : \#S_n < \infty\}, \\ R_\infty &:= \{R_n : \#R_n = \infty\}, & S_\infty &:= \{S_n : \#S_n = \infty\}. \end{aligned}$$

Ist  $R_n \in R_\infty$  mit  $\kappa_{R,n} := \#R_n \geq \omega$ , so ist  $R_n$  wegen  $\kappa_{R,n}\omega = \kappa_{R,n}$  eine disjunkte Vereinigung von  $\kappa_{R,n}$  vielen abzählbaren Mengen  $R_{n,k}$ ,  $k \in \kappa_{R,n}$  und genauso, wenn man jeweils  $R$  durch  $S$  ersetzt. Setze

$$(2.17) \quad n_R := \min\{n : R_n \in R_\infty\}, \quad n_S := \min\{n : S_n \in S_\infty\},$$

$$(2.18) \quad \begin{aligned} K_R &:= \{(n, k) : (n, k) \neq (n_R, 0), R_n \in R_\infty, k \in \kappa_{R,n}\}, \\ K_S &:= \{(n, k) : (n, k) \neq (n_S, 0), S_n \in S_\infty, k \in \kappa_{S,n}\}, \end{aligned}$$

$$(2.19) \quad \begin{aligned} I_{1,1} &:= R_{n_R,0} \cup \bigcup_{R_n \in R_e} R_n, & I_{2,1} &:= S_{n_S,0} \cup \bigcup_{S_n \in S_e} S_n, \\ I_{1,0} &:= \{i \in I_1 : r_i = 0\}, & I_{2,0} &:= \{j \in I_2 : s_j = 0\}. \end{aligned}$$

Sei  $\alpha' := \alpha \setminus \{0, 1\}$ . Wegen  $\#K_R = \#K_S = \alpha$ , gibt es Bijektionen  $B_R : \alpha' \rightarrow K_R$ ,  $B_S : \alpha' \rightarrow K_S$ . Für  $k \in \alpha'$  setze  $I_{1,k} := R_{B_R(k)}$ ,  $I_{2,k} := S_{B_S(k)}$ . Wegen (2.15) ist  $I_1 = \bigcup_{k \in \alpha} I_{1,k}$  und  $I_2 = \bigcup_{k \in \alpha} I_{2,k}$  klar. Setzt man noch für  $k \in \alpha$ ,  $r^k := r \upharpoonright_{I_{1,k}}$ ,  $s^k := s \upharpoonright_{I_{2,k}}$ , so ist klar, daß die  $(I_{1,k}, I_{2,k}, r^k, s^k)_{k \in \alpha}$  alle Bedingungen der Behauptung erfüllen.  $\blacktriangle$



Gegeben die Zerlegung aus Behauptung 1, setze für  $k \in \alpha \setminus \{0\}$ :  $P^{(k)} := P(\mathcal{I}_k)$  und dann  $P = (p_{i,j})_{(i,j) \in I_1 \times I_2}$  mit  $p_{i,j} := \begin{cases} p_{i,j}^{(k)} & \text{für } (i,j) \in I_{1,k} \times I_{2,k}, \\ 0 & \text{sonst} \end{cases}$ . Der Beweis von (b) wird vollständig durch die folgende Behauptung 2.

*Behauptung 2.*  $P \in \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ .

*Beweis.* Wäre  $P \notin \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ , so gäbe es nach Lemma 2.1.13 (b)  $0 \neq E \in \mathcal{M}_{\mathbb{R}}(I_1, I_2)$  mit  $P \pm E \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$ . Wähle  $(i_0, j_0)$ , so daß  $e_{i_0, j_0} \neq 0$ . Nach Definition von  $P$  gibt es dann ein  $k$ , so daß  $(i_0, j_0) \in I_{1,k} \times I_{2,k}$ . Nun sei  $E^{(k)} := E|_{I_{1,k} \times I_{2,k}}$ . Dann summieren sich wegen der Definition von  $P$  alle Linien von  $E^{(k)}$  zu Null, das heißt  $P^{(k)} \pm E^{(k)} \in \mathcal{D}(\mathcal{I}_k)$ , was nach Lemma 2.1.13 (b) im Widerspruch zu  $P^{(k)} \in \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}_k))$  steht.  $\blacktriangle$

(c) Folgt aus (b) und Satz 2.1.15.  $\blacksquare$

**Satz 2.1.19.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein  $\leq$ -Randsystem.

(a) Sei  $P \in \mathcal{D}(\leq \mathcal{I})$ . Dann ist  $P \in \mathbf{E}(\mathcal{D}(\leq \mathcal{I}))$  genau dann, wenn für alle abzählbaren  $I_{1,k} \subseteq I_1$ ,  $I_{2,k} \subseteq I_2$  die Submatrix  $P|_{I_{1,k} \times I_{2,k}}$  in  $\mathbf{E}(\mathcal{D}(\leq \mathcal{I}_k))$  liegt. Hierbei sei  $\mathcal{I}_k := (I_{1,k}, I_{2,k}, r^k, s^k)$  mit  $\forall_{i \in I_{1,k}} r_i^k := r_i - \sum_{\nu \in I_2 \setminus I_{2,k}} p_{i,\nu}$ ,  $\forall_{j \in I_{2,k}} s_j^k := s_j - \sum_{\mu \in I_1 \setminus I_{1,k}} p_{\mu,j}$ .

(b) Sei  $P \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$ . Dann ist  $P \in \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$  genau dann, wenn für alle abzählbaren  $I_{1,k} \subseteq I_1$ ,  $I_{2,k} \subseteq I_2$  die Submatrix  $P|_{I_{1,k} \times I_{2,k}}$  in  $\mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}_k))$  liegt. Dabei sei diesmal  $\mathcal{I}_k := \mathcal{I}(P|_{I_{1,k} \times I_{2,k}})$ .

*Beweis.* (a) „ $\Rightarrow$ “ gilt nach Lemma 2.1.14.

„ $\Leftarrow$ “: Zunächst bemerke, daß alle Zusammenhangskomponenten von  $G(P)$  aus höchstens abzählbar vielen Ecken bestehen: Sei  $v \in V(G(P))$ . Dann ist  $\text{Zhk}(v) = \bigcup_{\nu=0}^{\infty} D_{\nu}(v)$ , mit  $D_{\nu}(v) = \{u \in V(G(P)) : d(u, v) = \nu\}$ , und da alle  $u \in V(G(P))$  höchstens abzählbaren Grad haben, sieht man wegen  $D_{\nu+1}(v) \subseteq \{u \in V(G(P)) : \exists_{v \in D_{\nu}(v)} d(u, v) = 1\}$  induktiv, daß alle  $D_{\nu}(v)$  abzählbar sind. Ist  $P \notin \mathbf{E}(\mathcal{D}(\leq \mathcal{I}))$ , so sei  $0 \neq E$  wieder die durch Lemma 2.1.13 gegebene Matrix mit  $P \pm E \in \mathcal{D}(\leq \mathcal{I})$ . Wähle  $(i_0, j_0)$  mit  $e_{i_0, j_0} \neq 0$  und setze für  $x_{i_0} \in V(G(P))$ ,  $Z := \text{Zhk}_{G(P)}(x_{i_0})$ ,  $I_{1,k} := \{i \in I_1 : x_i \in Z\}$ ,  $I_{2,k} := \{j \in I_2 : y_j \in Z\}$ . Wegen der obigen Bemerkung sind  $I_{1,k}$ ,  $I_{2,k}$  abzählbar. Nun setze  $E^{(k)} := E|_{I_{1,k} \times I_{2,k}}$  und  $P^{(k)} := P|_{I_{1,k} \times I_{2,k}}$ . Dann ist nach Definition von  $Z$

$$\forall_{i \in I_{1,k}} \sum_{\nu \in I_{2,k}} e_{i,\nu} = \sum_{\nu \in I_2} e_{i,\nu}, \quad \forall_{j \in I_{2,k}} \sum_{\mu \in I_{1,k}} e_{\mu,j} = \sum_{\mu \in I_1} e_{\mu,j},$$

das heißt, es muß  $P^{(k)} \pm E^{(k)} \in \mathcal{D}(\leq \mathcal{I}_k)$  sein. Also ist  $P^{(k)} \notin \mathbf{E}(\mathcal{D}(\leq \mathcal{I}_k))$ .

(b) folgt analog zu (a), wenn man dort im Beweis die „ $\leq$ “-Zeichen wegläßt und beachtet, daß in diesem Fall das  $\leq$ -Randsystem  $\mathcal{I}_k$  aus (a), dem Randsystem  $\mathcal{I}_k$  aus (b) entspricht. ■

Das Fazit von Satz 2.1.19 ist, daß man sich für die Charakterisierung der Extrempunkte auf abzählbare  $\leq$ -Randsysteme beschränken kann.

## 2.2 Anwendung der maßtheoretischen Charakterisierung der Extrempunkte

Im folgenden soll Satz 1.4.1 auf doppelt stochastische Matrizen angewendet werden. Im Fall endlicher Maße  $m_1, m_2$ , läßt sich die Frage, ob eine Matrix  $P$  extremal ist, auf die Frage zurückführen, ob  $G(P)$  kreisfrei ist (siehe Satz 2.2.6).

**Lemma 2.2.1.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein Randsystem,  $\min\{\#I_1, \#I_2\} < \infty$ ,  $P \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$ , (zu  $P$  gehört nach Satz 2.1.15 ein Maß  $\mu := h^{-1}(P)$ );  $m_1, m_2$  seien wie in Satz 2.1.15). Dann gilt mit den Bezeichnungen von Beispiel 1.3.5

$$\mathcal{F} \text{ ist dicht in } L_1(\mu) \quad \Leftrightarrow \quad \mathcal{F} = L_1(\mu).$$

*Beweis.* Es ist per Definition  $\mathcal{F} = L_1(m_1) + L_1(m_2)$ . Wegen  $\min\{\#I_1, \#I_2\} < \infty$  ist auch  $\min\{\dim L_1(m_1), \dim L_1(m_2)\} < \infty$ . Da weiterhin  $L_1(m_1), L_1(m_2)$  beide abgeschlossen sind, folgt aus Proposition 20.1 in [6], daß auch  $\mathcal{F}$  abgeschlossen ist, und das ist gerade die Behauptung. ■

**Satz 2.2.2.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein endliches Randsystem,  $P \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$ ,  $\mu := h^{-1}(P)$ ,  $m_1, m_2$  seien wie in Satz 2.1.15 und  $\mathcal{F} := L_1(m_1) + L_1(m_2)$ . Dann gilt

$$\mathcal{F} = L_1(\mu) \quad \Leftrightarrow \quad G(P) \text{ ist ein Wald.}$$

*Beweis.* „ $\Rightarrow$ “: Angenommen,  $G(P)$  hat einen Kreis  $K = (x_{i_1}, y_{j_1}, \dots, y_{j_n}, x_{i_1})$  oder  $K = (y_{j_1}, x_{i_1}, \dots, x_{i_n}, y_{j_1})$ . Nun betrachte  $M \in L_1(\mu)$  (siehe Beispiel 1.3.5 für die Bezeichnungen) mit

$$(2.20) \quad m_{i_1 j_1} = m_{i_2 j_1} = m_{i_2 j_2} = \dots = m_{i_n j_n} = 0, \quad m_{i_1 j_n} = 1.$$

Wäre  $M \in \mathcal{F}$ , so gäbe es  $a \in L_1(m_1)$  und  $b \in L_1(m_2)$ , so daß  $\forall_{\substack{(i,j) \in I_1 \times I_2 \\ \text{mit } \mu(i,j) > 0}} m_{i,j} = a_i + b_j$ . Mit  $\alpha := a_{i_1} \in \mathbb{R}$  folgte dann wegen (2.20), daß  $b_{j_1} = \dots = b_{j_n} = -\alpha$  und daher  $a_{i_1} = 1 + \alpha$ , was  $a_{i_1} = \alpha$  widerspricht. Also ist  $M \notin \mathcal{F}$ .

„ $\Leftarrow$ “:  $G(P)$  sei also ein Wald, das heißt, alle Zusammenhangskomponenten von  $G(P)$  sind (wegen  $\#I_1, \#I_2 < \infty$  endliche) Bäume. Wähle aus jeder Zusammenhangskomponente  $Z$  von  $G(P)$ , die mindestens zwei Ecken enthält, eine Ecke  $x_{i_Z}$ . Da  $Z$  ein Baum ist, gibt es nach Lemma 1.2.11 zu  $z_1, z_2 \in V(Z)$  genau einen  $z_1 z_2$ -Weg  $(z_1, \dots, z_2)$  in  $Z$ . Sei nun  $M \in L_1(\mu)$  gegeben. Führe folgende rekursive Konstruktion durch:  $a_{i_Z} := 0$ . Gegeben  $y_j \in V(Z)$  mit  $d(y_j, x_{i_Z}) = n$ , sei  $a_i$  für alle  $x_i \in V(Z)$  mit  $d(x_i, x_{i_Z}) < n$  schon definiert. Zu  $d(y_j, x_{i_Z}) = n$  gehört genau ein  $y_j x_{i_Z}$ -Weg  $(z_1, \dots, z_n)$  der Länge  $n$ ,  $z_1 = x_{i_Z}$ ,  $z_n = y_j$ ,  $z_{n-1} = x_i$  für ein  $i$ . Definiere  $b_j := m_{i,j} - a_i$ . Gegeben  $x_i \in V(Z)$  mit  $d(x_i, x_{i_Z}) = n$ , sei  $b_j$  für alle  $y_j \in V(Z)$  mit  $d(y_j, x_{i_Z}) < n$  schon definiert. Zu  $d(x_i, x_{i_Z}) = n$  gehört genau ein  $x_i x_{i_Z}$ -Weg  $(z_1, \dots, z_n)$  der Länge  $n$ ,  $z_1 = x_{i_Z}$ ,  $z_n = x_i$ ,  $z_{n-1} = y_j$  für ein  $j$ . Definiere  $a_i := m_{i,j} - b_j$ . Damit sind  $a_i, b_j$  für alle  $(i, j) \in \text{supp}(P)$  wohldefiniert (da die verbindenden Wege jeweils eindeutig sind), und es gilt  $m_{i,j} = a_i + b_j$ , denn so wurden die  $a_i, b_j$  ja gerade definiert. Bleibt zu zeigen, daß  $(a_i)_{i \in I_1} \in L_1(m_1)$ ,  $(b_j)_{j \in I_2} \in L_1(m_2)$ , was aber klar ist, da  $(a_i)_{i \in I_1}, (b_j)_{j \in I_2}$  endliche Folgen sind.  $\blacksquare$

Satz 2.2.2 gilt schon dann, wenn nur eine der Mengen  $I_1, I_2$  endlich ist (siehe Korollar 2.2.5). Die folgenden Beispiele zeigen jedoch, daß es, wenn  $I_1, I_2$  beide unendlich sind, vorkommen kann, daß es  $M \in L_1(\mu) \setminus \mathcal{F}$  gibt, obwohl  $G(P)$  ein Wald ist, und zwar sowohl für  $m_1(I_1) = m_2(I_2) = \infty$  (siehe Beispiel 2.2.3 (a)) als auch für  $m_1(I_1) = m_2(I_2) < \infty$  (siehe Beispiel 2.2.3 (b)).

**Beispiel 2.2.3.** Die Bezeichnungen  $(m_1, m_2, a_i, b_j, \dots)$  seien wie in Satz 2.1.15 und Beispiel 1.3.5.

(a) Betrachte das Randsystem  $\mathcal{I} := (\mathbb{N}, \mathbb{N}, r, s)$  mit  $r = s = (1, 1, \dots)$ , das heißt  $m_1(\mathbb{N}) = m_2(\mathbb{N}) = \infty$ . Definiere

$$P := \begin{pmatrix} \frac{1}{2} & \frac{1}{2} & & & \\ \frac{1}{2} & & \frac{1}{2} & & \\ & \frac{1}{2} & & & \\ & & & \ddots & \end{pmatrix}.$$

Dann ist  $P \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$  und  $G(P)$  ist ein Wald nach Lemma 2.1.6. Definiere weiter

$$M := \begin{pmatrix} 0 & 0 & & & \\ 1 & 0 & 0 & & \\ & 0 & 0 & 0 & \\ & & \frac{1}{2} & 0 & 0 \\ & & & 0 & 0 \\ & & & & \frac{1}{4} \\ & & & & & \ddots \end{pmatrix}.$$

Dann ist

$$\sum_{i,j=1}^{\infty} |m_{i,j}| p_{i,j} = \sum_{k=1}^{\infty} \left(\frac{1}{2}\right)^k < \infty,$$

also ist  $M \in L_1(\mu)$ . Ist  $M \in \mathcal{F}$ , so gibt es  $a \in L_1(m_1)$  und  $b \in L_1(m_2)$ , so daß  $\forall_{(i,j) \in I_1 \times I_2}$  mit  $\mu(i,j) > 0$   $m_{i,j} = a_i + b_j$ . Setzt man  $\alpha := b_1 \in \mathbb{R}$ , so folgt  $a_1 = -\alpha$ ,

$b_2 = \alpha$ ,  $a_2 = 1 - \alpha$  und so weiter. Das heißt, durch eine Induktion ergibt sich

$$b = \left( \alpha, \alpha, \alpha - 1, \alpha, \alpha - 1 - \frac{1}{2}, \dots, \alpha, \alpha - \sum_{j=0}^n \left(\frac{1}{2}\right)^j, \dots \right),$$

$$a = \left( -\alpha, -\alpha + 1, -\alpha, -\alpha + 1 + \frac{1}{2}, \dots, -\alpha, -\alpha + \sum_{i=0}^n \left(\frac{1}{2}\right)^i, \dots \right).$$

Wegen  $b \in L_1(m_2)$  ist  $\sum_{j=1}^{\infty} |b_j| s_j < \infty$ . Daraus folgt  $\alpha = 0$  und damit

$$\sum_{j=1}^{\infty} |b_j| s_j = \sum_{j=1}^{\infty} |b_j| \geq \sum_{j=1}^{\infty} 1 = \infty,$$

das heißt, die Annahme  $M \in \mathcal{F}$  führt zum Widerspruch.

- (b)** Betrachte das Randsystem  $\mathcal{I} := (\mathbb{N}, \mathbb{N}, r, s)$  mit  $r = s = \left(\frac{1}{n^2} + \frac{1}{(n+1)^2}\right)_{n \in \mathbb{N}}$ , das heißt  $m_1(\mathbb{N}) = m_2(\mathbb{N}) < \infty$ . Definiere

$$P := \begin{pmatrix} 1 & \frac{1}{4} & & & \\ \frac{1}{4} & \frac{1}{9} & & & \\ & \frac{1}{9} & \frac{1}{9} & & \\ & & & \ddots & \\ & & & & \ddots \end{pmatrix}.$$

Dann ist  $P \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$  und  $G(P)$  ist ein Wald nach Lemma 2.1.6. Definiere weiter

$$M := \begin{pmatrix} 0 & 0 & & & \\ 1 & & 0 & & \\ & 0 & 0 & & \\ & & 1 & 0 & 0 \\ & & & 0 & 0 \\ & & & & 1 \\ & & & & & \ddots \end{pmatrix}.$$

Dann ist

$$\sum_{i,j=1}^{\infty} |m_{i,j}| p_{i,j} < \sum_{k=1}^{\infty} \frac{1}{n^2} < \infty,$$

also ist  $M \in L_1(\mu)$ . Wäre  $M \in \mathcal{F}$ , so gäbe es wiederum  $a \in L_1(m_1)$  und  $b \in L_1(m_2)$ , so daß  $\forall_{\substack{(i,j) \in I_1 \times I_2 \\ \text{mit } \mu(i,j) > 0}} m_{i,j} = a_i + b_j$ . Mit  $\alpha := b_1 \in \mathbb{R}$  würde folgen

$a_1 = -\alpha$ ,  $b_2 = \alpha$ ,  $a_2 = 1 - \alpha$  und so weiter. Das heißt, durch eine Induktion erhielte man

$$b = (\alpha, \alpha, \alpha - 1, \alpha, \alpha - 1 - 1, \dots, \alpha, \alpha - n, \dots),$$

$$a = (-\alpha, -\alpha + 1, -\alpha, -\alpha + 1 + 1, \dots, -\alpha, -\alpha + n, \dots).$$

Daraus würde

$$\begin{aligned} \sum_{i=1}^{\infty} |a_i| r_i &\geq \sum_{i=1}^{\infty} |i - \alpha| \left( \frac{1}{(2i)^2} + \frac{1}{(2i+1)^2} \right) \\ &= \frac{1}{4} \sum_{i=1}^{\infty} |i - \alpha| \left( \frac{1}{i^2} + \frac{4}{(2i+1)^2} \right) \\ &\geq \frac{1}{4} \sum_{i=\lceil \alpha+1 \rceil}^{\infty} \frac{i - \alpha}{i^2} = \frac{1}{4} \sum_{i=\lceil \alpha+1 \rceil}^{\infty} \left( \frac{1}{i} - \frac{\alpha}{i^2} \right) = \infty \end{aligned}$$

folgen, im Widerspruch zu  $a \in L_1(m_1)$ .

**Satz 2.2.4.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein Randsystem,  $\#I_1, \#I_2 \leq \omega$ ; die Endlichkeit einer der Mengen  $I_1, I_2$  beziehungsweise der Maße  $m_1, m_2$  wird nicht länger vorausgesetzt. Sei wieder  $P \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$ ,  $m_1, m_2, \mu := h^{-1}(P)$  wie in Satz 2.1.15 und  $\mathcal{F} := L_1(m_1) + L_1(m_2)$ . Dann gilt

$$\overline{\mathcal{F}} = L_1(\mu) \Leftrightarrow G(P) \text{ ist ein Wald.}$$

*Beweis.* „ $\Rightarrow$ “: Angenommen  $G(P)$  hat einen Kreis. Dann gibt es eine endliche Submatrix  $\tilde{P}$  von  $P$  und ein endliches Randsystem  $\tilde{\mathcal{I}} = (\tilde{I}_1, \tilde{I}_2, \tilde{r}, \tilde{s}) \leq \mathcal{I}$ , so daß  $G(\tilde{P})$  einen Kreis hat und  $\tilde{P} \in \mathcal{D}(\tilde{\mathcal{I}})$ . Setze  $\tilde{\mu} := h^{-1}(\tilde{P})$ . Wegen Lemma 2.2.1 und Satz 2.2.2 gibt es  $\tilde{M} \in L_1(\tilde{\mu}) \setminus \tilde{\mathcal{F}} = L_1(\tilde{\mu}) \setminus \overline{\tilde{\mathcal{F}}}$  (hierbei sind  $\tilde{\mathcal{F}} := L_1(\tilde{m}_1) + L_1(\tilde{m}_2)$ ,  $\tilde{m}_1, \tilde{m}_2$  gemäß Satz 2.1.15). Definiert

man dann  $M = (m_{i,j})_{(i,j) \in I_1 \times I_2}$  mit  $m_{i,j} := \begin{cases} \tilde{m}_{i,j} & \text{für } (i,j) \in \tilde{I}_1 \times \tilde{I}_2, \\ 0 & \text{sonst} \end{cases}$ , so gilt

$$\tilde{M} = M|_{\tilde{I}_1 \times \tilde{I}_2}.$$

*Behauptung 1.*  $M \in L_1(\mu) \setminus \overline{\mathcal{F}}$ .

*Beweis.* Wäre  $(M^{(n)})$  eine Folge in  $L_1(\mu)$ , die in  $L_1(\mu)$  gegen  $M$  konvergiert, so bedeutete dies, daß

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \sum_{(i,j) \in I_1 \times I_2} |m_{i,j}^{(n)} - m_{i,j}| p_{i,j} = 0.$$

Daher hätte man auch

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \sum_{(i,j) \in \tilde{I}_1 \times \tilde{I}_2} |m_{i,j}^{(n)} - m_{i,j}| p_{i,j} = 0,$$

und damit würde  $\tilde{M}^{(n)} := M^{(n)}|_{\tilde{I}_1 \times \tilde{I}_2}$  in  $L_1(\tilde{\mu})$  gegen  $\tilde{M}$  konvergieren, was im Widerspruch zu  $\tilde{M} \in L_1(\tilde{\mu}) \setminus \overline{\tilde{\mathcal{F}}}$  stünde.  $\blacktriangle$

Damit ist „ $\Rightarrow$ “ bewiesen.

„ $\Leftarrow$ “: Angenommen,  $G(P)$  ist ein Wald. Die Idee ist,  $M \in L_1(\mu)$  durch endliche Matrizen zu approximieren. Hier ist es wieder günstig,  $I_1, I_2$  abzuzählen, das heißt ohne Beschränkung der Allgemeinheit anzunehmen, daß  $I_1 = I_2 = \mathbb{N}$ . Dann definiere für  $n \in \mathbb{N}$  Matrizen  $M^{(n)} = (m_{i,j}^{(n)})_{(i,j) \in I_1 \times I_2}$  durch

$$m_{i,j}^{(n)} := \begin{cases} m_{i,j} & \text{für } i \leq n \text{ und } j \leq n, \\ 0 & \text{sonst.} \end{cases}$$

Wegen Satz 2.2.2 ist  $M^{(n)} \in \mathcal{F}$  für alle  $n \in \mathbb{N}$ . Weiterhin folgt aus  $\sum_{(i,j) \in I_1 \times I_2} |m_{i,j}| p_{i,j} < \infty$ , daß

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \|M^{(n)} - M\|_1 = \lim_{n \rightarrow \infty} \sum_{i,j > n} |m_{i,j}| p_{i,j} = 0.$$

Damit ist  $\overline{\mathcal{F}} = L_1(\mu)$  gezeigt.  $\blacksquare$

**Korollar 2.2.5.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein Randsystem,  $\min\{\#I_1, \#I_2\} < \infty$ ,  $P \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$ ,  $\mu := h^{-1}(P)$ ,  $m_1, m_2$  seien wie in Satz 2.1.15 und  $\mathcal{F} := L_1(m_1) + L_1(m_2)$ . Dann gilt

$$\mathcal{F} = L_1(\mu) \Leftrightarrow G(P) \text{ ist ein Wald.}$$

*Beweis.*  $\mathcal{F} = L_1(\mu) \stackrel{(2.2.2)}{\Leftrightarrow} \mathcal{F} \text{ ist dicht in } L_1(\mu) \stackrel{(2.2.4)}{\Leftrightarrow} G(P) \text{ ist ein Wald. } \blacksquare$

**Satz 2.2.6.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein Randsystem mit  $\sum_{i \in I_1} r_i = \sum_{j \in I_2} s_j < \infty$ ,  $P \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$ . Dann gilt

$$P \in \mathbb{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I})) \Leftrightarrow G(P) \text{ ist ein Wald.}$$

*Beweis.* Wegen Satz 1.4.1 und Korollar 2.1.16 gilt  $P \in E(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$  genau dann, wenn  $\mathcal{F}$  in  $L_1(\mu)$  dicht liegt, und das ist nach Satz 2.2.4 genau dann der Fall, wenn  $G(P)$  ein Wald ist. ■

Das folgende Beispiel 2.2.7 zeigt, daß es im Fall  $m_1(I_1) = m_2(I_2) = \infty$  passieren kann, daß  $G(P)$  ein Wald ist, obwohl  $P \notin E(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ . Im Zusammenspiel mit Satz 2.2.4 zeigt das dann auch, daß sich Satz 1.4.1 nicht auf den Fall  $m_1(I_1) = m_2(I_2) = \infty$  verallgemeinern läßt.

**Beispiel 2.2.7.** Betrachte die Doppeldiagonalmatrix

$$(2.21) \quad P := \begin{pmatrix} 1 & 1 & & & \\ 1 & & 1 & & \\ & 1 & & & \\ & & & \ddots & \\ & & & & \ddots \end{pmatrix}.$$

Wegen Lemma 2.1.6 ist  $G(P)$  ein Wald. Für das Randsystem  $\mathcal{I} := (\mathbb{N}, \mathbb{N}, r, s)$  mit  $r = s = (2, 2, \dots)$  ist  $P \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$ . Jedoch ist  $P \notin E(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ , denn mit

$$(2.22) \quad E := \frac{1}{2} \begin{pmatrix} 1 & -1 & & & \\ -1 & & 1 & & \\ & 1 & & -1 & \\ & & -1 & & 1 \\ & & & 1 & \\ & & & & \ddots \end{pmatrix}$$

gilt  $P = \frac{1}{2}(P + E) + \frac{1}{2}(P - E)$  und  $P \pm E \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$ .

Eine weitere Anwendung von Satz 1.4.1 liefert der folgende Satz 2.2.8. Die folgenden Ergebnisse dieses Abschnitts stammen wiederum von LINDENSTRAUSS (siehe [8]).

**Satz 2.2.8.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein endliches Randsystem,  $P \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$ ,  $m_1, m_2$ ,  $\mu := h^{-1}(P)$  wie in Satz 2.1.15,  $\mathcal{F} := L_1(m_1) + L_1(m_2)$ . Dann gilt

$$(2.23) \quad P \in E(\mathcal{D}(\mathcal{I})) \Leftrightarrow \bigvee_{k \in \mathbb{N}} \bigvee_{A_1 \subseteq I_1} \bigvee_{A_2 \subseteq I_2} (\#A_1 = \#A_2 = k \Rightarrow \#\{(i, j) \in A_1 \times A_2 : p_{i,j} > 0\} < 2k).$$

*Beweis.* Für  $k = 1$  ist  $\#A_1 = \#A_2 = 1$ , das heißt  $\#\{(i, j) \in A_1 \times A_2 : p_{i,j} > 0\} \leq 1 < 2$ . Für  $k > \min(\#I_1, \#I_2)$ , kann  $\#A_1 = \#A_2 = k$  nicht erfüllt werden. Demnach ist eigentlich nur zu zeigen:

$P \in \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I})) \Leftrightarrow$

$$(2.24) \quad \forall_{1 < k \leq \min(\#I_1, \#I_2)} \quad \forall_{A_1 \subseteq I_1} \quad \forall_{A_2 \subseteq I_2} (\#A_1 = \#A_2 = k \Rightarrow \#\{(i, j) \in A_1 \times A_2 : p_{i,j} > 0\} < 2k).$$

Für  $\min(\#I_1, \#I_2) = 1$ , besteht  $\mathcal{D}(\mathcal{I})$  nur aus einem Element, welches auch in  $\mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$  liegt, so daß die Aussage des Satzes trivialerweise richtig ist. Ab jetzt sei daher  $\min(\#I_1, \#I_2) \geq 2$ .

„ $\Rightarrow$ “: Angenommen, es gibt  $A_1 \subseteq I_1, A_2 \subseteq I_2$  mit  $\#A_1 = \#A_2 = k$ ,  $1 < k \leq \min(\#I_1, \#I_2)$ , so daß  $p_{i,j} > 0$  für mindestens  $2k$  verschiedene Elemente von  $(i, j) \in A_1 \times A_2$ . Dann wähle eine Menge  $I_{\neq 0} \subseteq A_1 \times A_2$  mit  $\#I_{\neq 0} = 2k$  und  $\forall_{(i,j) \in I_{\neq 0}} p_{i,j} > 0$ . Man betrachte das lineare Gleichungssystem

$$(2.25) \quad a_i + b_j = n_{i,j}$$

in den  $2k$  Unbekannten  $a_i, b_j$  mit  $(i, j) \in I_{\neq 0}$  und beliebigen festen  $n_{i,j} \in \mathbb{R}$ . Es besteht also aus  $2k$  Gleichungen, die zu den gegebenen  $2k$  Elementen  $(i, j) \in I_{\neq 0}$  mit  $p_{i,j} > 0$  gehören. Das zu (2.25) gehörende homogene lineare Gleichungssystem hat die nichttriviale Lösung  $a = (1, \dots, 1), b = (-1, \dots, -1)$ , das heißt, (2.25) ist nicht global lösbar. Es gibt also ein  $N \in L_1(\mu)$  (vergleiche dazu (1.10)), so daß für die gegebenen  $2k$  Elemente mit  $p_{i,j} > 0$

$$(2.26) \quad a_i + b_j = n_{i,j}$$

nicht lösbar ist. Also ist  $N \notin \mathcal{F}$ , das heißt  $L_1(\mu) \neq \mathcal{F}$ . Wegen Lemma 2.2.1 ist also  $\mathcal{F}$  nicht dicht in  $L_1(\mu)$ , das heißt, nach Korollar 2.2.5 und Satz 2.2.6 ist  $P \notin \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ .

„ $\Leftarrow$ “: Vollständige Induktion über  $p + q$  mit  $p := \#I_1, q := \#I_2$ . Für  $p + q = 2$  ist nichts zu zeigen. Es sei ohne Beschränkung der Allgemeinheit  $p \geq q$ . Nun gibt es eine Zeile mit höchstens einem positiven Element, das heißt, es gibt  $(i_0, j_0) \in I_1 \times I_2$ , so daß  $p_{i_0,j} = 0$  für alle  $j \neq j_0$  (ansonsten wäre die Voraussetzung für  $k = \min(\#I_1, \#I_2)$  nicht erfüllt). Setze

$$\tilde{I}_1 := I_1 \setminus \{i_0\}, \tilde{r} := r|_{\tilde{I}_1}, \tilde{s}_j := \begin{cases} s_j - p_{i_0,j_0} & \text{für } j = j_0, \\ s_j & \text{sonst.} \end{cases}$$

Setze  $\tilde{P} := P|_{\tilde{I}_1 \times I_2}$  und  $\tilde{I} := (\tilde{I}_1, I_2, \tilde{r}, \tilde{s})$ . Dann ist  $\tilde{P} \in \mathcal{D}(\tilde{I})$  (wegen der Wahl von  $(i_0, j_0)$  und der Definition von  $\tilde{s}$ ), und  $\tilde{P}$  erfüllt die Bedingung der Voraussetzung (da  $P$  sie erfüllt). Nach Induktionsannahme ist daher  $\tilde{P} \in \mathbf{E}(\mathcal{D}(\tilde{I}))$ . Nun sei  $M \in L_1(\mu)$  gegeben. Sei  $\tilde{M} := M|_{\tilde{I}_1 \times I_2}$ . Da  $\tilde{P} \in \mathbf{E}(\mathcal{D}(\tilde{I}))$  ist, folgt aus Korollar 2.2.5 und Satz 2.2.6, daß  $\tilde{M} \in \tilde{\mathcal{F}}$ . Also gibt es  $\tilde{a} \in L_1(\tilde{m}_1)$  und  $\tilde{b} \in L_1(\tilde{m}_2)$  (hierbei seien  $\tilde{\mathcal{F}}, \tilde{m}_1, \tilde{m}_2$  nach Satz 2.1.15 analog zu  $\mathcal{F}, m_1, m_2$  definiert) mit

$$\forall_{(i,j) \in \text{supp}(\tilde{P})} \tilde{m}_{i,j} = \tilde{a}_i + \tilde{b}_j.$$



Nun definiere  $a, b$  durch

$$a_i := \begin{cases} m_{i_0, j_0} - \tilde{b}_{j_0} & \text{für } i = i_0, \\ \tilde{a}_i & \text{sonst} \end{cases}, \quad b := \tilde{b}.$$

Dann gilt  $a \in L_1(m_1)$ ,  $b \in L_1(m_2)$ , sowie

$$\forall_{(i,j) \in \text{supp}(P)} m_{i,j} = a_i + b_j.$$

Daher ist  $M \in \mathcal{F}$ , und da  $M$  beliebig war, ist  $\mathcal{F} = L_1(\mu)$ . Korollar 2.2.5 und Satz 2.2.6 liefern nun  $P \in E(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ . ■

**Korollar 2.2.9.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein endliches Randsystem. Ist  $P \in E(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ , so hat  $P$  mindestens eine Linie mit höchstens einem positiven Element.

*Beweis.* Hätte jede Linie von  $P$  mindestens zwei positive Elemente, so hätte jede quadratische Submatrix von  $P$  der Dimension  $k = \min\{\#I_1, \#I_2\}$  mindestens  $2k$  positive Elemente, das heißt, wegen Satz 2.2.8 wäre  $P \notin E(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ . ■

**Satz 2.2.10.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein endliches Randsystem mit  $\#I_1 = \#I_2 = n < \infty$ ,  $r = s = (1, \dots, 1)$ . Dann ist  $E(\mathcal{D}(\mathcal{I})) = \mathcal{M}_p(I_1, I_2)$ .

*Beweis.* „ $\supseteq$ “ folgt sofort, da  $\{0, 1\}$  die Menge der Extrempunkte vom Intervall  $[0, 1]$  ist.

„ $\subseteq$ “: Vollständige Induktion nach  $n$ . Für  $n = 1$  ist nichts zu zeigen. Sei nun  $n > 1$  und  $P \in E(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ . Wegen Korollar 2.2.9 hat  $P$  eine Linie, die nur genau eine Eins enthält. Also gibt es je eine Zeile und eine Spalte, die genau eine Eins enthalten. Streicht man in  $P$  diese Zeile und Spalte, so bekommt man eine Matrix  $\tilde{P} \in \mathcal{D}(\tilde{\mathcal{I}})$ , wobei  $\tilde{\mathcal{I}} := (\tilde{I}_1, \tilde{I}_2, \tilde{r}, \tilde{s})$  und  $\tilde{I}_1, \tilde{I}_2, \tilde{r}, \tilde{s}$  jeweils eine um Eins kleinere Kardinalität beziehungsweise Länge haben als  $I_1, I_2, r, s$ .  $\tilde{P} \in E(\mathcal{D}(\tilde{\mathcal{I}}))$ : Gäbe es  $0 < \alpha < 1$ ,  $\tilde{P} \neq \tilde{P}_1, \tilde{P}_2 \in \mathcal{D}(\tilde{\mathcal{I}})$  mit  $\tilde{P} = \alpha \tilde{P}_1 + (1 - \alpha) \tilde{P}_2$ , so könnte man die in  $P$  gestrichene Zeile und Spalte in  $\tilde{P}_1, \tilde{P}_2$  einfügen und erhielte  $P \neq P_1, P_2 \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$  mit  $P = \alpha P_1 + (1 - \alpha) P_2$ . Aus  $\tilde{P} \in E(\mathcal{D}(\tilde{\mathcal{I}}))$  folgt mit der Induktionsvoraussetzung, daß  $\tilde{P} \in \mathcal{M}_p(\tilde{I}_1, \tilde{I}_2)$  und daher  $P \in \mathcal{M}_p(I_1, I_2)$ . ■

Satz 2.2.10 wurde zuerst von BIRKHOFF bewiesen (siehe [1]).

## 2.3 Wurzelbäume und $\epsilon$ -Doppelbäume

Die Mengen  $E(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$  und  $E(\mathcal{D}(\leq \mathcal{I}))$  lassen sich ohne Rückgriff auf die Maßtheorie und Satz 1.4.1 durch Eigenschaften von  $G(P)$  charakterisieren. Der folgende Satz 2.4.3 stammt von GRZAŚLEWICZ (siehe [4]) und stellt eine Verallgemeinerung von Satz 2.2.6 dar. Dazu müssen aber zunächst einige technische Hilfsmittel bereitgestellt werden, was in diesem Kapitel geschehen soll.

**Definition 2.3.1.** Ein *Wurzelbaum* ist ein Tripel  $T = (V, E, q)$ , so daß  $(V, E)$  ein Baum ist und  $q \in V$  (im Fall, daß  $(V, E, w)$  ein gewichteter Baum ist, nenne  $T = (V, E, q, w)$  einen *gewichteten Wurzelbaum*).  $q$  heißt die *Wurzel* des Baumes. Das  $n$ -te *Level* sei  $L_n = L_n(q) = L_n(q, T) := \{v \in V : d(v, q) = n\}$ . Für  $v \in L_n$  definiere  $N^+(v) = N_T^+(v) := \{u \in L_{n+1} : \{u, v\} \in E\}$ , und für  $v \neq q$  definiere  $N^-(v) = N_T^-(v) := \{u \in L_{n-1} : \{u, v\} \in E\}$ . Außerdem sei noch  $E_n = E_n(q) = E_n(q, T) := \{e \in E : \exists_{u \in L_{n-1}} \exists_{v \in L_n} e = \{u, v\}\}$ . Ist  $T' = (V', E', q)$  ein weiterer Wurzelbaum, so schreibe  $T' \leq T$  genau dann, wenn  $(V', E') \leq (V, E)$  (entsprechend ist für  $T' = (V', E', q, w')$ ,  $T' \leq T$  genau dann, wenn  $(V', E', w') \leq (V, E, w)$ ).

**Lemma 2.3.2.** Sei  $T = (V, E, q)$  ein Wurzelbaum.

- (a)  $\forall_{v \in V \setminus \{q\}} \#N^-(v) = 1$  (das Element von  $N^-(v)$  bezeichne mit  $v^-$ ).
- (b)  $\forall_{u, v \in V} (u \neq v \Rightarrow N^+(u) \cap N^+(v) = \emptyset)$ .

*Beweis.* (a) Gäbe es  $u_1, u_2 \in N^-(v)$ ,  $u_1 \neq u_2$ , so gäbe es zwei verschiedene  $qv$ -Wege, nämlich  $(q, \dots, u_1, v)$  und  $(q, \dots, u_2, v)$ . Nach Lemma 1.2.11 wäre also  $T$  kein Baum.

(b) Sind  $u, v$  aus verschiedenen Levels, so ist nichts zu zeigen. Wären  $u, v \in L_n$  und  $x \in N^+(u) \cap N^+(v)$ , so wären  $u, v \in N^-(x)$ , was nach (a) nicht sein kann. ■

**Definition 2.3.3.** Sei  $T = (V, E, q)$  ein Wurzelbaum,  $\epsilon > 0$ . Dann heißt eine Abbildung  $f : E \rightarrow \mathbb{R}_0^+$  ein  $\epsilon$ -*Fluß* auf  $T$  genau dann, wenn

$$(2.27) \quad \sum_{u \in N^+(q)} f\{q, u\} = \epsilon \text{ und } \forall_{v \in V \setminus \{q\}} \sum_{u \in N^+(v)} f\{v, u\} = f\{v^-, v\}.$$

**Lemma 2.3.4.** Sei  $T = (V, E, q)$  ein Wurzelbaum,  $\epsilon > 0$  und  $f$  ein  $\epsilon$ -Fluß auf  $T$ . Dann ist  $\sum_{e \in E} f(e) = \epsilon$ . Insbesondere ist  $\#V = \infty$ .

*Beweis.* Es genügt zu zeigen, daß  $\forall_{n \in \mathbb{N}} \sum_{e \in E_n} f(e) = \epsilon$ . Das wird nun durch Induktion nach  $n$  bewiesen. Der Fall  $n = 1$  steht in (2.27). Sei also  $n > 1$ . Dann folgt

$$(2.28) \quad \begin{aligned} \sum_{e \in E_n} f(e) &= \sum_{\substack{v \in L_{n-1}, \\ u \in L_n}} f\{u, v\} = \sum_{v \in L_{n-1}} \sum_{u \in N^+(v)} f\{u, v\} \stackrel{(2.27)}{=} \sum_{v \in L_{n-1}} f\{v^-, v\} \\ &= \sum_{\substack{v \in L_{n-1}, \\ u \in L_{n-2}}} f\{u, v\} = \sum_{e \in E_{n-1}} f(e) \stackrel{\text{(Induktion)}}{=} \epsilon. \end{aligned}$$

■

**Lemma 2.3.5.** Sei  $\epsilon > 0$  und  $f$  ein  $\epsilon$ -Fluß auf dem gewichteten Wurzelbaum  $T = (V, E, q, w)$ . Dann gibt es für alle  $0 < \delta < \epsilon$  einen gewichteten Wurzelbaum  $T' \leq T$  und einen  $\delta$ -Fluß  $f'$  auf  $T'$ , so daß alle Ecken von  $T'$  endlichen Grad haben und  $f' < f|_{E(T')}$ .

*Beweis. Behauptung 1.* Sei  $I$  eine abzählbare Menge,  $E := (e_i)_{i \in I} \subseteq \mathbb{R}^+$  mit  $\tilde{\epsilon} := \sum_{i \in I} e_i > 0$ . Ist dann  $0 < \tilde{\delta} < \tilde{\epsilon}$ , so gibt es  $I' \subseteq I$  endlich und  $D := (d_i)_{i \in I'} \subseteq \mathbb{R}^+$ , so daß  $\sum_{i \in I'} d_i = \tilde{\delta}$  und  $\forall_{i \in I'} d_i < e_i$ .

*Beweis.* Ist  $I$  endlich, so setze  $I' := I$ ,  $\Delta := \frac{\tilde{\epsilon} - \tilde{\delta}}{\#I}$ ,  $d_i := e_i - \Delta$  für alle  $i \in I'$ . Dann ist  $\sum_{i \in I'} d_i = \tilde{\epsilon} - \#I \frac{\tilde{\epsilon} - \tilde{\delta}}{\#I} = \tilde{\delta}$ . Nun sei  $I$  unendlich. Dann gibt es eine endliche Menge  $I' \subseteq I$ , so daß  $\hat{\epsilon} := \sum_{i \in I'} e_i > \tilde{\delta}$ . Damit befindet man sich wieder im Fall einer endlichen Indexmenge, und da dieser oben schon erledigt wurde, ist alles gezeigt.  $\blacktriangle$

Nun zur Konstruktion von  $T' = (V_{T'}, E_{T'}, q, w|_{E_{T'}}) \leq T$  und  $f' < f|_{E(T')}$ . Und zwar werden dazu Mengen  $L'_n(q) \leq L_n(q)$  und  $E'_n(q) \leq E_n(q)$  definiert. Die Definitionen von  $L'_n(q)$ ,  $E'_n(q)$  erfolgen rekursiv unter Benutzung von Behauptung 1. Im ersten Schritt setze zur Anwendung von Behauptung 1  $I := \{u \in N^+(q) : f\{q, u\} > 0\}$ ,  $E := (f\{q, u\})_{u \in I}$ ,  $\tilde{\delta} := \delta$ ,  $\tilde{\epsilon} := \epsilon$ . Behauptung 1 liefert dann endliches  $I'$  und  $D$ . Setze  $N(q) := I' \subseteq N^+(q)$ ,  $L'_0(q) := \{q\}$ ,  $L'_1(q) := N(q)$ ,  $E'_1(q) := \{\{q, u\} : u \in N(q)\}$ ,  $f'\{q, u\} := d_u$  für alle  $u \in N(q)$ . Dann ist  $\sum_{u \in N(q)} f'\{q, u\} = \delta$  und  $\forall_{u \in N(q)} f'\{q, u\} < f\{q, u\}$ .

Nun sei  $n \geq 1$ , und für alle  $m \leq n$  seien  $L'_m(q) \subseteq L_m(q)$ ,  $E'_m(q) \subseteq E_m(q)$ ,  $f'|_{E'_m(q)} < f|_{E_m(q)}$  bereits konstruiert, so daß  $\forall_{v \in L'_m(q), m \neq 0} v^- \in L'_{m-1}(q)$ .

Sei  $v \in L'_n(q_1)$ . Zur Anwendung von Behauptung 1 setze diesmal  $I := \{u \in N^+(v) : f\{u, v\} > 0\}$ ,  $E := (f\{u, v\})_{u \in I}$ ,  $\tilde{\delta} := f'\{v, v^-\}$ ,  $\tilde{\epsilon} := f\{v, v^-\}$ . Behauptung 1 liefert wieder endliches  $I'$ ,  $D$ . Setze  $N(v) := I' \subseteq N^+(v)$ ,  $f'\{u, v\} := d_u < f\{u, v\}$  für alle  $u \in N(v)$ . Nach Lemma 2.3.2 (b) sind alle  $N(v)$  disjunkt. Setze  $L'_{n+1}(q) := \dot{\bigcup}_{v \in L'_n(q)} N(v)$ ,  $E'_{n+1}(q) := \{\{u, v\} \in E_{n+1}(q) : u \in L'_n(q), v \in L'_{n+1}(q)\}$ . Dann ist  $\sum_{u \in N(v)} f'\{u, v\} = f'\{v, v^-\}$ . Setze noch  $V_{T'} := \dot{\bigcup}_{n=0}^{\infty} L'_n(q)$ ,  $E_{T'} := \dot{\bigcup}_{n=1}^{\infty} E'_n(q)$ . Da  $f'$ , wie schon während der Konstruktion gezeigt, die Bedingung (2.27) erfüllt (mit  $\delta$  statt  $\epsilon$ ), ist  $f'$  ein  $\delta$ -Fluß auf  $T'$ .  $\blacksquare$

**Definition 2.3.6.** Ein *Doppelbaum*  $B = (G, T_1, T_2)$  ist ein Baum  $G = (V, E)$  zusammen mit zwei Wurzelbäumen  $T_1 = (V_{T_1}, E_{T_1}, q_1)$ ,  $T_2 = (V_{T_2}, E_{T_2}, q_2)$ . Dabei soll gelten:  $B = T_1 + T_2 +_\epsilon \{q_1, q_2\}$ . Handelt es sich bei  $G$  um einen gewichteten Graphen  $G = (V, E, w)$ , und gilt  $T_1 = (V_{T_1}, E_{T_1}, q_1, w|_{E_{T_1}})$ ,  $T_2 = (V_{T_2}, E_{T_2}, q_2, w|_{E_{T_2}})$ , so heißt  $B$  ein *gewichteter Doppelbaum*. Ist

$B' = (G', T'_1, T'_2)$  ( $B' = (G', T'_1, T'_2, w')$ ) ein weiterer (gewichteter) Doppelbaum, so schreibe  $B' \leq B$  genau dann, wenn  $G' \leq G$ ,  $T'_1 \leq T_1$  und  $T'_2 \leq T_2$ .

**Definition 2.3.7.** Sei  $B = (G, T_1, T_2)$ ,  $G = (V, E, w)$ ,  $T_1 = (V_{T_1}, E_{T_1}, q_1, w|_{E_{T_1}})$ ,  $T_2 = (V_{T_2}, E_{T_2}, q_2, w|_{E_{T_2}})$  ein gewichteter Doppelbaum und  $\epsilon > 0$ .  $B$  heißt  $\epsilon$ -Doppelbaum genau dann, wenn es  $\epsilon$ -Flüsse  $f_1$  auf  $T_1$  und  $f_2$  auf  $T_2$  gibt, so daß  $f_1 \leq w|_{E_{T_1}}$ ,  $f_2 \leq w|_{E_{T_2}}$  und  $\epsilon \leq w\{q_1, q_2\}$ . Zur Veranschaulichung siehe Abbildung 2.1.

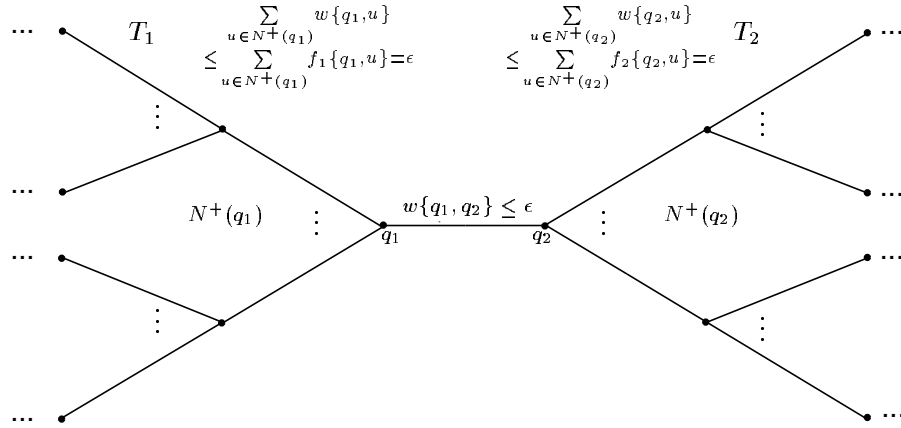


Abbildung 2.1:  $\epsilon$ -Doppelbaum

**Lemma 2.3.8.** Es sei  $B$  ein  $\epsilon$ -Doppelbaum (die Bezeichnungen seien wie in Definition 2.3.7). Dann gibt es für alle  $0 < \delta < \epsilon$  einen  $\delta$ -Doppelbaum  $B' \leq B$ , so daß alle Ecken von  $B'$  endlichen Grad haben.

*Beweis.* Zur Konstruktion von  $B' = (G', T'_1, T'_2)$  wird Lemma 2.3.5 benutzt. Lemma 2.3.5 liefert  $T'_1 = (V_{T'_1}, E_{T'_1}, q_1, w|_{E_{T'_1}}) \leq T_1$  und ein  $\delta$ -Fluß  $f'_1$  auf  $T'_1$ , sowie  $T'_2 = (V_{T'_2}, E_{T'_2}, q_2, w|_{E_{T'_2}}) \leq T_2$  und ein  $\delta$ -Fluß  $f'_2$  auf  $T'_2$ . Sei noch  $V' := V_{T'_1} \dot{\cup} V_{T'_2}$ ,  $E' := E_{T'_1} \dot{\cup} E_{T'_2} \dot{\cup} \{\{q_1, q_2\}\}$ . Da  $f'_1 < f_1|_{E_{T'_1}} \leq w|_{E_{T'_1}}$ ,  $f'_2 < f_2|_{E_{T'_2}} \leq w|_{E_{T'_2}}$  gilt, ist  $B'$  mit  $G' = (V', E', w|_{E'})$  nach Definition 2.3.7 ein  $\delta$ -Doppelbaum, dessen Ecken alle endlichen Grad haben. ■

**Definition 2.3.9.** Sei  $G = (V, E, w)$  ein gewichteter Graph,  $\epsilon > 0$ .  $G$  hat einen  $\epsilon$ -Doppelbaum genau dann, wenn es einen  $\epsilon$ -Doppelbaum  $B = (G', T_1, T_2)$  gibt, so daß  $G' = (V', E', w|_{E'})$  ein Subgraph von  $G$  ist.

**Bemerkung 2.3.10.** Ist  $G$  ein Graph, der einen  $\epsilon$ -Doppelbaum  $B$  hat, so hat  $G$  nach Lemma 2.3.8 für alle  $0 < \delta < \epsilon$  einen  $\delta$ -Doppelbaum  $B' \leq B$ , und alle Ecken von  $B'$  haben endlichen Grad.

## 2.4 Graphentheoretische Charakterisierung der Extremalpunkte

**Lemma 2.4.1.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein Randsystem mit  $\#I_1, \#I_2 \leq \omega$ . Ist  $P \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$  und existiert  $\epsilon > 0$ , so daß  $G := G(P)$  einen  $\epsilon$ -Doppelbaum  $B$  hat, so ist  $P \notin \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ .

*Beweis.* Die Bezeichnungen seien wie in Definition 2.3.7. Nach Lemma 2.1.13 (b) genügt es, eine Matrix  $0 \neq T \in \mathcal{M}_{\mathbb{R}}(I_1, I_2)$  mit  $P \pm T \geq 0$  zu finden, deren Linien sich alle zu Null summieren. Indem man  $q_1, q_2$  notfalls vertauscht, kann man ohne Beschränkung der Allgemeinheit annehmen, daß es  $(i_0, j_0) \in I_1 \times I_2$  gibt, mit  $q_1 = x_{i_0}, q_2 = y_{j_0}$ . Definiere  $T = (t_{i,j})_{(i,j) \in I_1 \times I_2}$  mit

$$(2.29) \quad t_{i,j} := \begin{cases} \epsilon & \text{für } (i,j) = (i_0, j_0), \\ -f_1\{x_i, y_j\} & \text{für } \{x_i, y_j\} \in E_n(T_1), \quad n \text{ ungerade,} \\ f_1\{x_i, y_j\} & \text{für } \{x_i, y_j\} \in E_n(T_1), \quad n \text{ gerade,} \\ -f_2\{x_i, y_j\} & \text{für } \{x_i, y_j\} \in E_n(T_2), \quad n \text{ ungerade,} \\ f_2\{x_i, y_j\} & \text{für } \{x_i, y_j\} \in E_n(T_2), \quad n \text{ gerade,} \\ 0 & \text{sonst.} \end{cases}$$

Wegen  $f_1, f_2 \leq w$  ist  $P \pm T \geq 0$ . Bleibt zu zeigen, daß sich alle Linien von  $T$  zu Null summieren. Sei  $t_{i,j} \neq 0, x_i \in L_{2n}(q_1)$ . Dann gilt für die  $i$ . Zeile:

$$\sum_{j \in I_2} t_{i,j} = - \sum_{y \in N^+(x_i)} f_1\{y, x_i\} + f_1\{x_i^-, x_i\} = 0.$$

Die Fälle  $x_i = q_1, x_i \in L_{2n+1}(q_2)$  und der Fall der  $j$ . Spalte ( $y_j = q_2, y_j \in L_{2n+1}(q_1), y_j \in L_{2n}(q_2)$ ) sind alle völlig analog, das heißt: Daß die Summe über die jeweilige Linie null ist, ergibt sich jeweils aus der Flußbedingung (2.27) für  $f_1$  beziehungsweise  $f_2$ . ■

**Lemma 2.4.2.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein Randsystem. Ist  $P \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$  und hat  $G(P)$  einen Kreis, so ist  $P \notin \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ .

*Beweis.* Sei  $K = (x_{i_1}, y_{j_1}, \dots, x_{i_n}, y_{j_n}, x_{i_1})$  ein Kreis in  $G(P)$ . Dann ist

$$(2.30) \quad \epsilon := \min\{p_{i_1, j_1}, p_{i_2, j_1}, p_{i_2, j_2}, \dots, p_{i_n, j_n}, p_{i_1, j_n}\} > 0.$$

Für  $1 \leq k \leq n-1$  definiere  $t_{i_k, j_k} := \epsilon, t_{i_{k+1}, j_k} := -\epsilon, t_{i_n, j_n} := \epsilon, t_{i_1, j_n} := -\epsilon$ . Dies seien genau die von Null verschiedenen Elemente einer Matrix  $T \in \mathcal{M}_{\mathbb{R}}(I_1, I_2)$ . Dann enthält eine Linie von  $T$  entweder keine von Null verschiedenen Elemente oder genau zwei, nämlich  $+\epsilon$  und  $-\epsilon$ . Daher summieren sich alle Linien von  $T$  zu Null. Nach der Definition von  $\epsilon$  gilt:  $\forall_{(i,j) \in I_1 \times I_2} p_{i,j} \pm t_{i,j} \geq 0$ . Also folgt  $P \pm T \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$  und nach Lemma 2.1.13 ist  $P \notin \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ . ■

**Satz 2.4.3.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein Randsystem mit  $\#I_1, \#I_2 \leq \omega$  und  $P \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$ . Dann gilt  $P \in \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$  genau dann, wenn  $G(P)$  ein Wald ist und für kein  $\epsilon > 0$  einen  $\epsilon$ -Doppelbaum hat.

*Beweis.* „ $\Rightarrow$ “: Wegen Lemma 2.4.2 ist  $G(P)$  ein Wald, wegen Lemma 2.4.1 hat  $G(P)$  für kein  $\epsilon > 0$  einen  $\epsilon$ -Doppelbaum.

„ $\Leftarrow$ “: Sei  $P \notin \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ , das heißt, es gibt nach Lemma 2.1.13 (b) eine Matrix  $T \neq 0$ , so daß sich alle Linien von  $T$  zu Null addieren und  $\bigvee_{(i,j) \in I_1 \times I_2} |t_{i,j}| \leq p_{i,j}$ .

Sei  $|T| := (|t_{i,j}|)_{(i,j) \in I_1 \times I_2}$ ,  $G(|T|) = (V, E, w)$ . Wegen  $|t_{i,j}| \leq p_{i,j}$  ist dann  $(V, E) \leq (V(G(P)), E(G(P)))$ . Hat dann  $G(|T|)$  einen Kreis, so auch  $G(P)$ , und man ist fertig. Angenommen,  $G(|T|)$  ist kreisfrei. Es bleibt zu zeigen, daß es dann  $\epsilon > 0$  gibt, so daß  $G(|T|)$  einen  $\epsilon$ -Doppelbaum  $B$  hat (denn dann hat auch  $G(P)$  einen  $\epsilon$ -Doppelbaum). Da  $T \neq 0$ , gibt es  $i_0 \in I_1$ ,  $j_0 \in I_2$ , so daß  $t_{i_0, j_0} > 0$ . Setze  $\epsilon := t_{i_0, j_0}$ ,  $q_1 := x_{i_0}$ ,  $q_2 := y_{j_0}$ . Damit bekommt man einen Doppelbaum  $B' = (\text{Zhk}_{G(|T|)}(x_{i_0}), T'_1, T'_2)$ ,  $T'_1 = (V_{T'_1}, E_{T'_1}, q_1) := \text{Zhk}_{G(|T|) - \{q_1, q_2\}}(q_1)$ ,  $T'_2 = (V_{T'_2}, E_{T'_2}, q_2) := \text{Zhk}_{G(|T|) - \{q_1, q_2\}}(q_2)$ .

*Behauptung 1.* Sei  $I := \{i_1, i_2, \dots\}$  abzählbar,  $E := (e_i)_{i \in I}$  eine Folge positiver reeller Zahlen, so daß  $a := \sum_{i \in I} e_i < \infty$ . Ist dann  $0 < b \leq a$ , so gibt es eine Folge  $D = (d_i)_{i \in I}$ , so daß  $\bigvee_{i \in I} 0 < d_i \leq e_i$  und  $\sum_{i \in I} d_i = b$ .

*Beweis.* Setze  $k := \frac{a}{b}$  und  $d_i := ke_i$ . ▲

Nun zur Konstruktion von  $B = (G, T_1, T_2) \leq B'$ : Zunächst wird  $T_1 = (V_{T_1}, E_{T_1}, q_1) \leq T'_1$  und ein  $\epsilon$ -Fluß  $f_1$  auf  $T_1$  konstruiert, und zwar werden dazu Mengen  $L_n(q_1) \subseteq L'_n(q_1)$  und  $E_n(q_1) \subseteq E'_n(q_1)$  definiert. Die Definitionen von  $L_n(q_1)$ ,  $E_n(q_1)$  erfolgen rekursiv unter Benutzung von Behauptung 1. Im ersten Schritt setze zur Anwendung von Behauptung 1  $I := \{j \in I_2 : t_{i_0, j} < 0\}$ ,  $E := (|t_{i_0, j}|)_{j \in I}$ ,  $b := \epsilon$ . Behauptung 1 liefert dann  $D$ . Setze  $N(q_1) := \{y_j : j \in I\}$ ,  $L_0(q_1) := \{q_1\}$ ,  $L_1(q_1) := N(q_1)$ ,  $E_1(q_1) := \{\{q_1, y_j\} \in E'_1(q_1) : y_j \in N(q_1)\}$ ,  $f_1\{q_1, y_j\} := d_j$  für alle  $y_j \in N(q_1)$ . Dann ist  $\sum_{y_j \in N(q_1)} f_1\{q_1, y_j\} = \epsilon$  und

$$\bigvee_{y_j \in N(q_1)} f_1\{q_1, y_j\} \leq |t_{i_0, j}| = w\{q_1, y_j\}.$$

Nun sei  $n \geq 1$  ungerade, und für alle  $m \leq n$  seien  $L_m(q_1) \subseteq L'_m(q_1)$ ,  $E_m(q_1) \subseteq E'_m(q_1)$ ,  $f_1|_{E_m(q_1)} \leq w|_{E_m(q_1)}$ , bereits konstruiert, so daß  $\bigvee_{v \in L_m(q_1), m \neq 0} v^- \in L_{m-1}(q_1)$ . Sei  $y_{j_n} \in L_n(q_1)$ ,  $x_{j_n} := y_{j_n}^-$ . Dann ist

$0 < f_1\{x_{j_n}, y_{j_n}\} \leq -t_{i_n, j_n} = w\{x_{j_n}, y_{j_n}\}$ . Zur Anwendung von Behauptung 1 setze diesmal  $I := \{i \in I_1 : t_{i, j_n} > 0\}$ ,  $E := (|t_{i, j_n}|)_{i \in I}$ ,  $b := f_1\{x_{j_n}, y_{j_n}\}$ . Behauptung 1 liefert dann wieder  $D$ . Setze  $N(y_{j_n}) := \{x_i : i \in I\}$ ,  $f_1\{x_i, y_{j_n}\} := d_i$  für alle  $x_i \in N(y_{j_n})$ . Nach Lemma 2.3.2 (b) sind alle  $N(y)$ ,  $y \in L_n(q_1)$  disjunkt. Setze  $L_{n+1}(q_1) := \bigcup_{y \in L_n(q_1)} N(y)$ ,  $E_{n+1}(q_1) := \{\{x, y\} \in E'_{n+1}(q_1) : x \in L_{n+1}(q_1), y \in L_n(q_1)\}$ . Dann ist

$$\forall_{y \in L_n(q_1)} \sum_{x \in N(y)} f_1\{x, y\} = f_1\{y, y^-\}.$$

Für  $n \geq 1$  gerade erfolgen die Definitionen von  $L_{n+1}(q_1)$  und  $E_{n+1}(q_1)$  ganz analog. Setze noch  $V_{T_1} := \dot{\bigcup}_{n=0}^{\infty} L_n(q_1)$ ,  $E_{T_1} := \dot{\bigcup}_{n=1}^{\infty} E_n(q_1)$ . Da  $f_1$ , wie schon während der Konstruktion gezeigt, die Bedingung (2.27) erfüllt, ist  $f_1$  ein  $\epsilon$ -Fluß auf  $T_1$ .

Die Konstruktion von  $T_2$  und  $f_2$  erfolgt genau in der gleichen Weise wie die von  $T_1$  und  $f_1$ . Sei noch  $\hat{V} := V_{T_1} \dot{\cup} V_{T_2}$ ,  $\hat{E} := E_{T_1} \dot{\cup} E_{T_2} \dot{\cup} \{\{q_1, q_2\}\}$ . Dann ist  $B$  mit  $G = (\hat{V}, \hat{E}, w|_{\hat{E}})$  nach Definition 2.3.7 ein  $\epsilon$ -Doppelbaum. ■

**Lemma 2.4.4.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein Randsystem und  $\sum_{i \in I_1} r_i = \sum_{j \in I_2} s_j < \infty$ ,  $P \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$ . Ist dann  $\epsilon > 0$ , so hat  $G(P)$  keinen  $\epsilon$ -Doppelbaum.

*Beweis.* Ist  $\epsilon > 0$ , und hat  $G(P) = (V, E, w)$  einen  $\epsilon$ -Doppelbaum  $B = (G', T_1, T_2)$ , so gilt

$$\sum_{(i,j) \in I_1 \times I_2} p_{i,j} \geq \sum_{e \in E_{T_1}} w(e) \geq \sum_{e \in E_{T_1}} f_1(e) = \infty$$

wegen Lemma 2.3.4. Das steht im Gegensatz zur Voraussetzung. ■

**Korollar 2.4.5.** Satz 2.2.6.

*Beweis.* Seien die Voraussetzungen und Bezeichnungen also wie in Satz 2.2.6. Nach Satz 2.4.3 ist nur noch zu zeigen, daß  $G(P)$  für kein  $\epsilon > 0$  einen  $\epsilon$ -Doppelbaum haben kann, und das ist gerade die Aussage von Lemma 2.4.4. ■

Die folgenden Beispiele stammen aus [4] und zeigen die Anwendung von Satz 2.4.3 auf einige konkret vorgegebene Matrizen.

**Beispiel 2.4.6.**  $P_a$  sei die folgende in (2.31) in Abhängigkeit des Parameters  $a > 0$  definierte Matrix (die Matrix bestehe bis auf die angegebenen Elemente nur aus Nullen, wobei die beiden Diagonalen aus Dreien, wie angedeutet, ins

Unendliche fortgesetzt werden sollen).

$$(2.31) \quad \begin{matrix} & y_1 & y_2 & y_3 & y_4 & y_5 & y_6 & y_7 & y_8 & y_9 & y_{10} & y_{11} & \dots \\ \begin{matrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \\ x_4 \\ x_5 \\ x_6 \\ x_7 \\ x_8 \\ x_9 \\ x_{10} \\ x_{11} \\ x_{12} \\ \vdots \end{matrix} & \left( \begin{array}{cccccccccccc} a & & & 6 & 8 & 5 & & & & & & & \\ 2 & & & & & & & & & & & & \\ & 1 & & & & & & & & & & & \\ 3 & & & & & & & 4 & & & & & \\ & 2 & 3 & & & & & & & & & & \\ & & & 3 & & & 5 & 1 & 2 & & & & \\ & & & & & & & 2 & & & & & \\ & & & & & & 2 & & & & 3 & & \\ & & & & & & & & & & 3 & 3 & \\ & & & & & & & & & & & 3 & 3 \\ & & & & & & & & & & & & 3 & 3 \\ & & & & & & & & & & & & & \ddots \end{array} \right) & =: P_a \end{matrix}$$

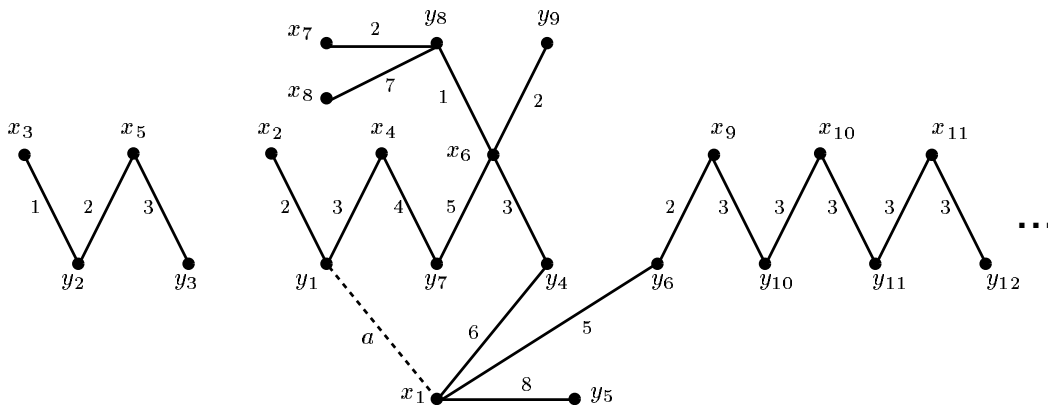


Abbildung 2.2:  $G(P_a)$

$G(P_a) = (V, E, w)$  ist in Abbildung 2.2 dargestellt. Man erkennt, daß  $G(P_a)$  genau dann einen Kreis hat, wenn  $a > 0$ . Genau in diesem Fall ist  $P_a \notin \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}(P_a)))$ . Dazu ist nach Satz 2.4.3 nur noch zu zeigen, daß  $G(P_a)$  für kein  $\epsilon > 0$  einen  $\epsilon$ -Doppelbaum haben kann. Hätte  $G(P_a)$  für ein  $\epsilon > 0$  einen  $\epsilon$ -Doppelbaum, so gäbe es nach Definition 2.3.7 und Lemma 2.3.4 eine Kante  $e = \{q_1, q_2\} \in E$ , so daß  $(V, E \setminus \{e\})$  zwei Zusammenhangskomponenten mit unendlich vielen Ecken hat. Bei entfernen einer Kante aus  $G(P_a)$  entsteht aber höchstens eine Zusammenhangskomponente mit unendlich vielen Ecken.

**Beispiel 2.4.7.**  $P$  sei die folgende in (2.32) definierte Matrix. In diesem Fall ist es möglicherweise übersichtlicher, das Bildungsgesetz für die Matrix über den



Graphen  $G(P)$  zu erklären (das ist nach Bemerkung 2.1.5 legitim).  $G(P)$  soll wie in Abbildung 2.3 (a) angedeutet nach links und rechts ins Unendliche fortgesetzt werden. Wie dort angegeben, werden die Ecken spaltenweise durchnummeriert und zwar immer abwechselnd eine Spalte links und eine Spalte rechts.

(2.32)

$$\begin{array}{cccccccccccccccc}
 & y_1 & y_2 & y_3 & y_4 & y_5 & y_6 & y_7 & y_8 & y_9 & y_{10} & y_{11} & y_{12} & y_{13} & y_{14} & y_{15} & \dots \\
 x_1 & \left( \begin{array}{c} 2 \\ 1 \end{array} \right. & & & \frac{1}{2} & \frac{1}{3} & & & & & & & & & & & & \\
 x_2 & & \frac{1}{2} & \frac{1}{2} & & & & & & & & & & & & & & \\
 x_3 & & \frac{1}{4} & & & & \frac{1}{8} & \frac{1}{8} & & & & & & & & & & \\
 x_4 & & \frac{1}{4} & & & & & & \frac{1}{8} & \frac{1}{8} & & & & & & & & \\
 x_5 & & & \frac{1}{4} & & & & & & & \frac{1}{8} & \frac{1}{8} & & & & & & \\
 x_6 & & & \frac{1}{4} & & & & & & & & & \frac{1}{8} & \frac{1}{8} & & & & \\
 x_7 & & & & \frac{1}{2} & & & & & & & & & & \frac{1}{2} & & & \\
 x_8 & & & & & \frac{1}{2} & & & & & & & & & & \frac{1}{2} & & \\
 x_9 & & & & & & \frac{1}{16} & & & & & & & & & & \dots & \\
 x_{10} & & & & & & \frac{1}{16} & & & & & & & & & & & \\
 x_{11} & & & & & & & \frac{1}{16} & & & & & & & & & & \\
 x_{12} & & & & & & & \frac{1}{16} & & & & & & & & & & \\
 x_{13} & & & & & & & & \frac{1}{16} & & & & & & & & & \\
 x_{14} & & & & & & & & \frac{1}{16} & & & & & & & & & \\
 \vdots & & & & & & & & & \dots & & & & & & & & 
 \end{array} \right) =: P$$

Sei  $G(P) = (V, E, w)$ . In Abbildung 2.3 ist  $G(P)$  zusammen mit zwei Subgraphen  $H_1$  und  $H_2$  dargestellt. Mit  $q_1 := y_1, T_1$  links von  $q_1, q_2 := x_2, T_2$  rechts von  $q_2$  wird  $H_1$  zu einem  $\frac{5}{6}$ -Doppelbaum, wobei die  $\frac{5}{6}$ -Flüsse  $f_1 \leq w$  auf  $T_1$  und  $f_2 \leq w$  auf  $T_2$  der Abbildung 2.3 (b) zu entnehmen sind. Entsprechend wird  $H_2$  mit  $q_1 := x_2, T_1$  oberhalb von  $x_2, q_2 := y_3, T_2$  unterhalb von  $y_3$  zu einem  $\frac{1}{4}$ -Doppelbaum, wobei die  $\frac{1}{4}$ -Flüsse  $f_1 \leq w$  auf  $T_1$  und  $f_2 \leq w$  auf  $T_2$  diesmal der Abbildung 2.3 (c) zu entnehmen sind. Nach Satz 2.4.3 ist also  $P \notin E(\mathcal{D}(\mathcal{I}(P)))$ .

**Beispiel 2.4.8.**  $P$  sei die folgende in (2.33) definierte Matrix. Wieder betrachte man für das Bildungsgesetz der Elemente von  $P$  den Graphen  $G(P)$  (siehe Abbildung 2.4). Die Ecken sind analog zu Abbildung 2.3 (a) nummeriert. Diesmal sind die Kantengewichte auf der rechten Seite  $\frac{1}{4^n}$  im Gegensatz zu  $\frac{1}{2^n}$  in

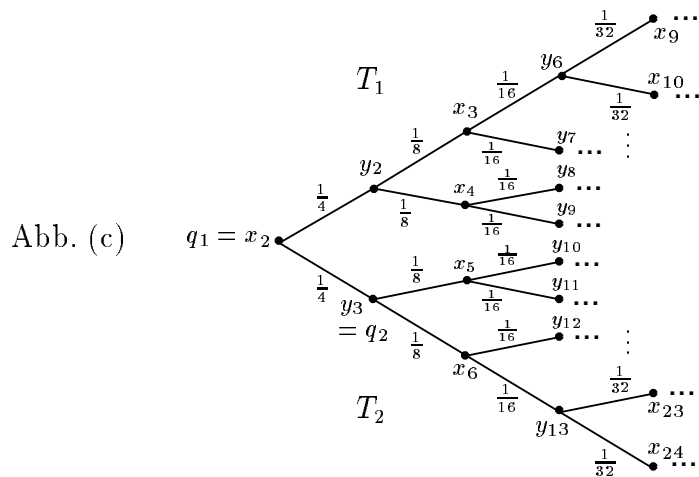
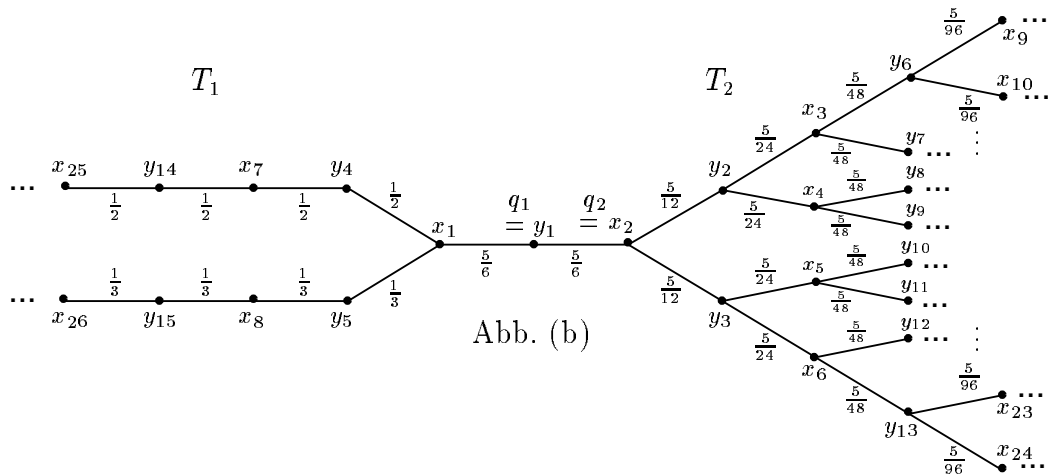
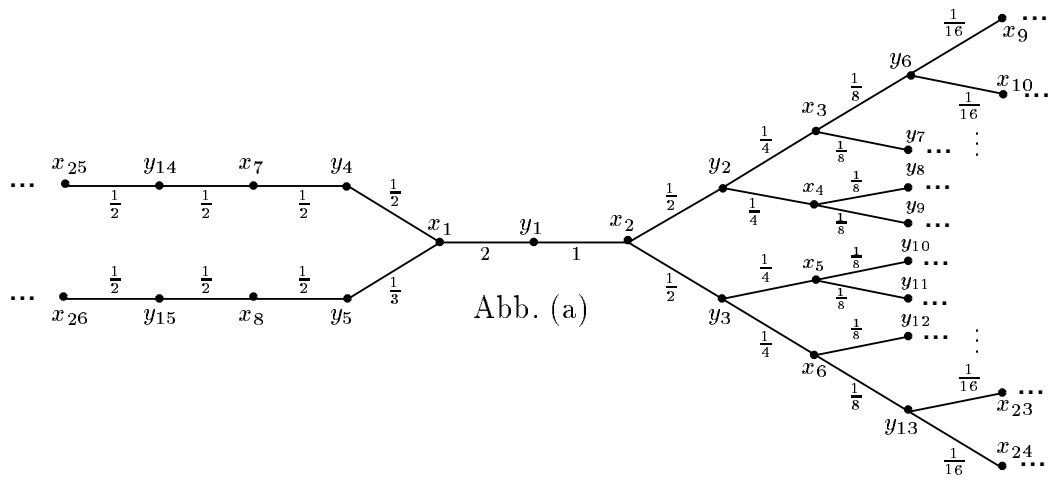


Abbildung 2.3:  $G(P)$  (in (a)) und zwei Teilgraphen  $H_1 \leq G(P)$  (in (b)),  $H_2 \leq G(P)$  (in (c))

Abbildung 2.3 (a).

$$(2.33) \quad \begin{matrix} & y_1 & y_2 & y_3 & y_4 & y_5 & y_6 & y_7 & y_8 & y_9 & y_{10} & y_{11} & y_{12} & y_{13} & \dots \\ \begin{matrix} x_1 \\ x_2 \\ x_3 \\ x_4 \\ x_5 \\ x_6 \\ x_7 \\ \vdots \end{matrix} & \left( \begin{array}{cccccccccccccc} 1 & & & & & & & & & & & & & & \\ & \frac{1}{4} & \frac{1}{4} & & & & & & & & & & & & \\ & 1 & & 1 & & & & & & & & & & & \\ & & \frac{1}{16} & & & \frac{1}{64} & \frac{1}{64} & & & & & & & & \\ & & \frac{1}{16} & & & & & \frac{1}{64} & \frac{1}{64} & & & & & & \\ & & & \frac{1}{16} & & & & & & \frac{1}{64} & \frac{1}{64} & & & & \\ & & & \frac{1}{16} & & & & & & & & \frac{1}{64} & \frac{1}{64} & & \\ & & & & 1 & & & & & & & & & 1 & \\ & & & & & \ddots & & & & & & & & & \ddots \end{array} \right) =: P \end{matrix}$$

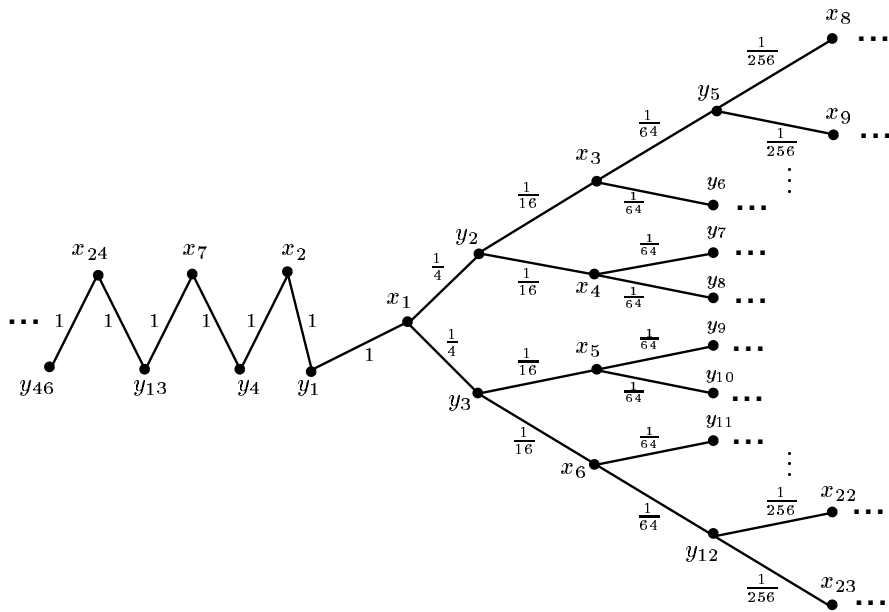


Abbildung 2.4:  $G(P)$

In Abbildung 2.4 erkennt man, daß  $G(P) = (V, E, w)$  keinen Kreis hat. Außerdem hat  $G(P)$  für kein  $\epsilon > 0$  einen  $\epsilon$ -Doppelbaum: Nimmt man an, es gibt  $\epsilon > 0$ , so daß  $G(P)$  einen  $\epsilon$ -Doppelbaum besitzt, so folgt nach Definition 2.3.7 und Lemma 2.3.4, daß es eine Kante  $e = \{q_1, q_2\} \in E$  gibt, so daß  $(V, E \setminus \{e\})$  zwei Zusammenhangskomponenten  $T_1, T_2$  hat mit  $\sum_{e \in E(T_\mu)} w(e) = \infty$  für  $\mu = 1, 2$ . Entfernt man aus  $G(P)$  eine Kante, so liegt in genau einer der entstehenden Zusammenhangskomponenten  $T_1$  und  $T_2$  ein Subgraph des Weges  $(x_1, y_1, x_2, \dots)$ . Dies sei ohne Beschränkung der Allgemeinheit für  $T_1$  der Fall. Enthält dann  $E(T_2)$  noch

$n \in \mathbb{N}_0$  Kanten  $e$  mit  $w(e) = 1$ , so gilt  $\sum_{e \in E(T_2)} w(e) \leq n + \sum_{k=1}^{\infty} \frac{2^k}{4^k} < \infty$ . Also ist  $P \in E(\mathcal{D}(\mathcal{I}(P)))$  nach Satz 2.4.3.

Als eine weitere Anwendung von Satz 2.4.3 soll jetzt im folgenden Satz 2.4.11 gezeigt werden, daß die Einträge einer extremalen Matrix in der von den Randverteilungen erzeugten additiven Untergruppe von  $\mathbb{R}$  liegen, sofern diese abgeschlossen ist. Das folgende Korollar 2.4.12 umfaßt die von KENDAL (siehe [7]) und ISBEL (siehe [5]) bewiesene Verallgemeinerung von Satz 2.2.10. Zunächst ein paar Vorbereitungen:

**Lemma 2.4.9.** Ist  $\mathcal{G}$  eine abgeschlossene additive Untergruppe von  $\mathbb{R}$ , so ist  $\mathcal{G} = \mathbb{R}$ , oder es gibt  $t \in \mathbb{R}_0^+$ , so daß  $\mathcal{G} = t\mathbb{Z}$ .

*Beweis.* Fall 1:  $\mathcal{G}$  hat einen Häufungspunkt  $c$ . Dann gibt es eine Folge  $(c_n)_{n \in \mathbb{N}}$  in  $\mathcal{G} \setminus \{c\}$  mit  $\lim_{n \rightarrow \infty} c_n = c$ , das heißt  $\lim_{n \rightarrow \infty} (c_n - c) = 0$ . Da  $\forall_{n \in \mathbb{N}} 0 \neq c_n - c \in \mathcal{G}$  und  $\forall_{g \in \mathcal{G}} \{zg : z \in \mathbb{Z}\} \subseteq \mathcal{G}$ , muß  $\mathcal{G}$  in  $\mathbb{R}$  dicht liegen. Da  $\mathcal{G}$  abgeschlossen ist, folgt  $\mathcal{G} = \mathbb{R}$ .

Fall 2:  $\mathcal{G}$  hat keinen Häufungspunkt. Dann gilt  $\exists_{\tilde{t} > 0} \forall_{\substack{g, h \in \mathcal{G} \\ g \neq h}} |g - h| \geq \tilde{t}$  (denn sonst

wäre 0 ein Häufungspunkt von  $\mathcal{G}$ ). Es sei  $t := \sup \left\{ \tilde{t} : \forall_{\substack{g, h \in \mathcal{G} \\ g \neq h}} |g - h| \geq \tilde{t} \right\}$ .

$t \in \mathcal{G}$ : Andernfalls wäre  $\forall_{\substack{g, h \in \mathcal{G} \\ g \neq h}} |g - h| > t$ . Wegen der Abgeschlossenheit von  $\mathcal{G}$

könnte es auch keine Folgen  $(g_n)_{n \in \mathbb{N}}$ ,  $(h_n)_{n \in \mathbb{N}}$  in  $\mathcal{G}$  geben mit  $\lim_{n \rightarrow \infty} |g_n - h_n| = t$ .

Es gäbe also  $t' > t$ , so daß  $\forall_{\substack{g, h \in \mathcal{G} \\ g \neq h}} |g - h| \geq t'$  im Widerspruch zur Definition von  $t$ .

$\mathcal{G} = t\mathbb{Z}$ : Es ist nur noch „ $\subseteq$ “ zu zeigen. Wäre  $g \in \mathcal{G} \setminus t\mathbb{Z}$ , so wäre  $t > \text{dist}(g, t\mathbb{Z}) \in \mathcal{G}$  im Widerspruch zur Definition von  $t$ . ■

**Lemma 2.4.10.** Es sei  $\mathcal{G} := t\mathbb{Z}$  mit  $t \in \mathbb{R}_0^+$ . Ist dann für  $p \in \mathbb{R}$   $di(p) := \text{dist}(p, \mathcal{G})$ , so gilt:

(a) Für alle  $p \in \mathbb{R}$  ist  $di(p) = di(-p)$ .

(b) Für jede reelle Folge  $(p_i)_{i \in \mathbb{N}}$  mit  $S := \sum_{i=1}^{\infty} p_i \in \mathbb{R}$  gilt  $di(S) \leq \sum_{i=1}^{\infty} di(p_i)$ .

*Beweis.* (a) ist klar.

(b) Zunächst seien  $p, q \in \mathbb{R}$  gegeben. Dann ist

$$(2.34) \quad \begin{aligned} di(p+q) &= \inf_{g \in \mathcal{G}} \{|p+q-g|\} = \inf_{g, h \in \mathcal{G}} \{|p+q-g-h|\} \leq \inf_{g, h \in \mathcal{G}} \{|p-g| + |q-h|\} \\ &= \inf_{g \in \mathcal{G}} \{|p-g|\} + \inf_{h \in \mathcal{G}} \{|q-h|\} = di(p) + di(q). \end{aligned}$$

Nun folgt  $di(S) \leq \sum_{i=1}^{\infty} di(p_i)$  aus der Stetigkeit von  $di$ . ■

**Satz 2.4.11.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein Randsystem mit  $\#I_1, \#I_2 \leq \omega$  oder  $\#I_{1,nt} = \#I_{2,nt}$ . Ist  $\mathcal{G} := \mathcal{G}(\mathcal{I})$  abgeschlossen, so gilt

$$(2.35) \quad P \in \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I})) \Rightarrow \{p_{i,j} : (i,j) \in I_1 \times I_2\} \subseteq \mathcal{G}.$$

*Beweis.* Wegen Lemma 2.4.9 kann man ohne Einschränkung annehmen, daß  $\mathcal{G} = t\mathbb{Z}$  für ein  $t \in \mathbb{R}^+$ . Zunächst wird der Fall  $\#I_1 = \#I_2 = \omega$  behandelt. Sei  $P \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$ . Angenommen, es gibt  $(i_0, j_0) \in I_1 \times I_2$  mit  $p_{i_0, j_0} \notin \mathcal{G}$ . Es wird gezeigt, daß  $P \notin \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ . Falls  $G(P)$  einen Kreis hat, folgt das wegen Satz 2.4.3. Man kann also annehmen, daß  $G(P) = (V, E, w)$  kreisfrei ist. Dann gibt es ein  $\epsilon > 0$ , so daß  $G(P)$  einen  $\epsilon$ -Doppelbaum  $B$  hat (womit dann wieder wegen Satz 2.4.3 alles gezeigt ist). Die Konstruktion des  $\epsilon$ -Doppelbaumes erfolgt mit der gleichen Methode wie im „ $\Leftarrow$ “-Teil des Beweises von Satz 2.4.3.

*Behauptung 1.* Ist  $(i, j) \in I_1 \times I_2$ , so gilt  $\sum_{\mu \in I_1 \setminus \{i\}} di(p_{\mu, j}) \geq di(p_{i, j})$  und  $\sum_{\nu \in I_2 \setminus \{j\}} di(p_{i, \nu}) \geq di(p_{i, j})$  (zur Definition von  $di$  siehe Lemma 2.4.10).

*Beweis.* Es gilt

$$(2.36) \quad di(p_{i, j}) = di\left(\sum_{\mu \in I_1} p_{\mu, j} - \sum_{\mu \in I_1 \setminus \{i\}} p_{\mu, j}\right) \stackrel{(2.4.10 (a), (b))}{\leq} \sum_{\mu \in I_1 \setminus \{i\}} di(p_{\mu, j}),$$

da  $\sum_{\mu \in I_1} p_{\mu, j} \in \mathcal{G}$ .  $\sum_{\nu \in I_2 \setminus \{j\}} di(p_{i, \nu}) \geq di(p_{i, j})$  folgt ganz analog.  $\blacktriangle$

Setze  $\epsilon := \frac{1}{2}di(p_{i_0, j_0})$ ,  $q_1 := x_{i_0}$ ,  $q_2 := y_{j_0}$ . Damit bekommt man einen Doppelbaum  $B' = (\text{Zhk}_{G(P)}(x_{i_0}, T'_1, T'_2)$ ,  $T'_1 = (V_{T'_1}, E_{T'_1}, q_1) := \text{Zhk}_{G(P) - \{q_1, q_2\}}(q_1)$ ,  $T'_2 = (V_{T'_2}, E_{T'_2}, q_2) := \text{Zhk}_{G(P) - \{q_1, q_2\}}(q_2)$ . Nun zur Konstruktion von  $B = (G, T_1, T_2) \leq B'$ . Zunächst wird  $T_1 = (V_{T_1}, E_{T_1}, q_1) \leq T'_1$  und ein  $\epsilon$ -Fluß  $f_1$  auf  $T_1$  konstruiert, und zwar werden dazu Mengen  $L_n(q_1) \subseteq L'_n(q_1)$  und  $E_n(q_1) \subseteq E'_n(q_1)$  definiert. Die Definition von  $L_n(q_1)$ ,  $E_n(q_1)$  erfolgt rekursiv unter Benutzung von Behauptung 1 aus Lemma 2.3.5. Dazu setze im ersten Schritt  $I := \{j \in I_2 \setminus \{j_0\} : p_{i_0, j} \notin \mathcal{G}\}$ ,  $E := (p_{i_0, j})_{j \in I}$ ,  $\tilde{\epsilon} := \sum_{j \in I} di(p_{i_0, j})$ ,  $\tilde{\delta} := \epsilon$  (beachte, daß  $\tilde{\epsilon} \geq 2\tilde{\delta} > \tilde{\delta}$  wegen obiger Behauptung 1). Behauptung 1 von Lemma 2.3.5 liefert dann  $I'$  und  $D$ . Setze  $N(q_1) := \{y_j : j \in I'\}$ ,  $L_0(q_1) := \{q_1\}$ ,  $L_1(q_1) := N(q_1)$ ,  $E_1(q_1) := \{\{q_1, y_j\} \in E'_1(q_1) : y_j \in N(q_1)\}$ ,  $f_1\{q_1, y_j\} := d_j$  für alle  $y_j \in N(q_1)$ . Dann ist  $\sum_{y_j \in N(q_1)} f_1\{q_1, y_j\} = \epsilon$  und

$$\forall_{y_j \in N(q_1)} f_1\{q_1, y_j\} < di(p_{i_0, j}) \leq p_{i_0, j} = w\{q_1, y_j\}.$$

Nun sei  $n \geq 1$  ungerade, und für alle  $m \leq n$  seien  $L_m(q_1) \subseteq L'_m(q_1)$ ,  $E_m(q_1) \subseteq E'_m(q_1)$ ,  $0 < f_1|_{E_m(q_1)} < (di \circ w)|_{E_m(q_1)} \leq \min\{t, w|_{E_m(q_1)}\}$ , bereits konstruiert, so daß  $\forall_{v \in L_m(q_1), m \neq 0} v^- \in L_{m-1}(q_1)$ . Sei  $y_{j_n} \in L_n(q_1)$ ,

$$x_{j_n} := y_{j_n}^-. \text{ Dann ist } 0 < f_1\{x_{i_n}, y_{j_n}\} < di(p_{i_n, j_n}) \leq \min\{t, w\{x_{i_n}, y_{j_n}\}\}.$$

Zur Anwendung von Behauptung 1 von Lemma 2.3.5 setze diesmal  $I := \{i \in I_1 \setminus \{i_n\} : p_{i, j_n} \notin \mathcal{G}\}$ ,  $E := (di(p_{i, j_n}))_{i \in I}$ ,  $\tilde{\epsilon} := \sum_{i \in I} di(p_{i, j_n})$ ,

$\tilde{\delta} := f_1\{x_{i_n}, y_{j_n}\}$  (beachte, daß  $\tilde{\delta} = f_1\{x_{i_n}, y_{j_n}\} < di(p_{i_n, j_n}) \leq \tilde{\epsilon}$  wegen obiger Behauptung 1). Behauptung 1 von Lemma 2.3.5 liefert dann wieder  $I'$  und  $D$ . Setze  $N(y_{j_n}) := \{x_i : i \in I'\}$ ,  $f_1\{x_i, y_{j_n}\} := d_i$  für alle  $x_i \in N(y_{j_n})$ . Nach Lemma 2.3.2 (b) sind alle  $N(y)$ ,  $y \in L_n(q_1)$  disjunkt. Setze  $L_{n+1}(q_1) := \dot{\bigcup}_{y \in L_n(q_1)} N(y)$ ,  $E_{n+1}(q_1) := \{\{x, y\} \in E'_{n+1} : x \in L_{n+1}(q_1), y \in L_n(q_1)\}$ . Dann ist  $\forall_{y \in L_n(q_1)} \sum_{x \in N(y)} f_1\{x, y\} = f_1\{y, y^-\}$ .

Wie im Beweis von Satz 2.4.3 erfolgen die Definitionen von  $L_{n+1}(q_1)$  und  $E_{n+1}(q_1)$  für gerade  $n \geq 1$  ganz analog. Setze noch  $V_{T_1} := \dot{\bigcup}_{n=0}^{\infty} L_n(q_1)$ ,  $E_{T_1} := \dot{\bigcup}_{n=1}^{\infty} E_n(q_1)$ . Da  $f_1$ , wie schon während der Konstruktion gezeigt, die Bedingung (2.27) erfüllt, ist  $f_1$  ein  $\epsilon$ -Fluß auf  $T_1$ .

Die Konstruktion von  $T_2$  und  $f_2$  erfolgt genau in der gleichen Weise wie die von  $T_1$  und  $f_1$ . Sei schließlich  $\hat{V} := V_{T_1} \dot{\cup} V_{T_2}$ ,  $\hat{E} := E_{T_1} \dot{\cup} E_{T_2} \dot{\cup} \{\{q_1, q_2\}\}$ . Dann ist  $B$  mit  $G = (\hat{V}, \hat{E}, w|_{\hat{E}})$  nach Definition 2.3.7 ein  $\epsilon$ -Doppelbaum. Damit ist (2.35) bewiesen.

Den Fall, daß  $\min\{\#I_1, \#I_2\} < \omega$ , kann man auf den Fall  $\#I_1 = \#I_2 = \omega$  zurückführen, indem man abzählbar viele Nullzeilen beziehungsweise Nullspalten hinzufügt. Bleibt der Fall  $\#I_{1,nt} = \#I_{2,nt} > \omega$ . Erneut nehme man an, daß es  $(i_0, j_0) \in I_1 \times I_2$  gibt mit  $p_{i_0, j_0} \notin \mathcal{G}$ . Wieder wird gezeigt, daß  $P \notin E(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ . Betrachte  $G(P)$ . Es sei  $Z := \text{Zhk}(x_{i_0})$  und  $I_{1,Z} := \{i \in I_1 : x_i \in V(Z)\}$ ,  $I_{2,Z} := \{j \in I_2 : y_j \in V(Z)\}$ . Wie im Beweis von Satz 2.1.19 gesehen, sind  $I_{1,Z}$  und  $I_{2,Z}$  abzählbar und nach Definition von  $Z$  ist  $\mathcal{I}(P|_{I_{1,Z} \times I_{2,Z}}) = (I_{1,Z}, I_{2,Z}, r|_{I_{1,Z}}, s|_{I_{2,Z}})$ . Da der Beweis für den Fall  $\max\{\#I_1, \#I_2\} \leq \omega$  schon geführt wurde, ist  $P|_{I_{1,Z} \times I_{2,Z}} \notin E(\mathcal{D}(\mathcal{I}(P|_{I_{1,Z} \times I_{2,Z}})))$ . Also ist nach Satz 2.1.19 (b)  $P \notin E(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ . ■

**Korollar 2.4.12.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein Randsystem mit  $\#I_1 = \#I_2 = \alpha$  ( $\alpha$  beliebige Kardinalzahl) und  $\forall_{(i,j) \in I_1 \times I_2} r_i = s_j = 1$ . Dann ist  $E(\mathcal{D}(\mathcal{I})) = \mathcal{M}_p(I_1, I_2)$ .

*Beweis.* „ $\supseteq$ “ folgt wieder, da 0,1 die Extrempunkte des Intervalls  $[0,1]$  sind. „ $\subseteq$ “: Das folgt sofort aus Satz 2.4.11, denn  $\mathbb{Z}$  ist abgeschlossen, und  $p_{i,j} \in \mathbb{Z} \Rightarrow p_{i,j} \in \{0,1\}$  wegen der Voraussetzung. ■

Ist die von den Randverteilungen erzeugte Gruppe  $\mathcal{G}$  nicht abgeschlossen, so kann es vorkommen, daß  $P \in E(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$  und dennoch  $p_{i,j} \notin \mathcal{G}$  (sogar für alle  $(i,j) \in I_1 \times I_2$ ). Um das zu sehen, dient das folgende Beispiel 2.4.13.

**Beispiel 2.4.13.** Es sei

$$(2.37) \quad P := \begin{pmatrix} 1 - a_1 & a_2 & & & & & \\ a_2 & & 1 - a_3 & & & & \\ & 1 - a_3 & & a_4 & & & \\ & & a_4 & & 1 - a_5 & & \\ & & & 1 - a_5 & & & \\ & & & & & \ddots & \\ & & & & & & \ddots \end{pmatrix},$$

$\mathcal{I} := \mathcal{I}(P)$ . Dabei sei für  $n \in \mathbb{N}$ ,

$$(2.38) \quad a_n := (10^n \sqrt{2} - \lfloor 10^n \sqrt{2} \rfloor) \cdot 10^{-n}$$

( $\sqrt{2}$  könnte dabei durch jede andere Zahl aus  $\mathbb{R}^+ \setminus \mathbb{Q}$  ersetzt werden). Die  $a_n$  sind dann alle irrational und positiv.  $\langle \{r_i : i \in I_1\} \cup \{s_j : j \in I_2\} \rangle \subseteq \mathbb{Q}$ , denn für alle  $n \in \mathbb{N}$  ist

$$(2.39) \quad \begin{aligned} -\alpha_n + \alpha_{n+1} &= -(10^n \sqrt{2} - \lfloor 10^n \sqrt{2} \rfloor) \cdot 10^{-n} + (10^{n+1} \sqrt{2} - \lfloor 10^{n+1} \sqrt{2} \rfloor) \cdot 10^{-n-1} \\ &= (\lfloor 10^n \sqrt{2} \rfloor - \frac{1}{10} \lfloor 10^{n+1} \sqrt{2} \rfloor) 10^{-n} \in \mathbb{Q} \end{aligned}$$

und damit auch  $\alpha_n - \alpha_{n+1} \in \mathbb{Q}$ , das heißt  $\forall_{i \in I_1} r_i \in \mathbb{Q}$ ,  $\forall_{j \in I_2} s_j \in \mathbb{Q}$ .

Dennoch ist  $P \in E(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$  nach Lemma 2.1.13 (b), denn für eine Matrix  $E \in \mathcal{M}_{\mathbb{R}}(\mathbb{N}, \mathbb{N})$  mit  $P \pm E \geq 0$ , deren Linien sich alle

zu Null summieren, gilt  $E = \begin{pmatrix} e_0 & e_1 & & & \\ f_1 & & e_2 & & \\ & f_2 & & & \\ & & & \ddots & \\ & & & & e_3 \end{pmatrix}$  und weiterhin

$\cdots - e_3 = f_2 = -e_1 = e_0 = -f_1 = e_2 = -f_3 = \cdots \leq \inf \{a_n : n \in \mathbb{N}\} = 0$ , das heißt  $E = 0$ .

Das folgende Beispiel zeigt, daß die Umkehrung von Satz 2.4.11 nicht gilt.

**Beispiel 2.4.14.** Betrachte das Randsystem  $\mathcal{I} := (\{1, 2\}, \{1, 2\}, (4, 5), (5, 4))$  und die Matrix  $P := \begin{pmatrix} 3 & 1 \\ 2 & 3 \end{pmatrix}$ . Dann ist  $P \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$ , und  $G(P)$  hat einen Kreis. Also ist  $P \notin E(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ . Andererseits ist aber  $\{1, 2, 3\} \subseteq \langle \{4, 5\} \rangle = \mathbb{Z}$ .

**Lemma 2.4.15.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein Randsystem und  $P \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$ . Gilt dann

$$(2.40) \quad (\tilde{P} \in \mathcal{D}(\mathcal{I}) \text{ und } \text{supp}(\tilde{P}) \subseteq \text{supp}(P)) \Rightarrow \tilde{P} = P,$$

so ist  $P \in E(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ .

*Beweis.* Angenommen  $P \notin \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ . Dann gibt es nach Lemma 2.1.13 (b)  $E \in \mathcal{M}_{\mathbb{R}}(I_1, I_2)$ , so daß sich alle Linien von  $E$  zu Null summieren und  $P \pm E \geq 0$ . Also ist  $P \neq P \pm E \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$  und  $\text{supp}(P \pm E) \subseteq \text{supp}(P)$ . ■

**Satz 2.4.16.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein Randsystem mit  $\sum_{i \in I_1} r_i = \sum_{j \in I_2} s_j < \infty$  und  $P \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$ . Dann gilt

$$(2.41) \quad (\tilde{P} \in \mathcal{D}(\mathcal{I}) \text{ und } \text{supp}(\tilde{P}) \subseteq \text{supp}(P)) \Rightarrow \tilde{P} = P$$

genau dann, wenn  $P \in \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ .

*Beweis.* Wegen Lemma 2.4.15 ist nur „ $\Leftarrow$ “ zu zeigen. Dazu nehme man an, daß es  $\tilde{P} \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$  gibt mit  $\tilde{P} \neq P$  und  $\text{supp}(\tilde{P}) \subseteq \text{supp}(P)$ . Setze  $T := P - \tilde{P}$ . Wegen  $P, \tilde{P} \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$  addieren sich alle Linien von  $T$  zu Null. Da  $\tilde{P} \neq P$  gilt, gibt es  $(i_0, j_0) \in I_1 \times I_2$  mit  $t_{i_0, j_0} > 0$ . Wegen  $\forall_{(i,j) \in I_1 \times I_2} (p_{i,j} = 0 \Rightarrow t_{i,j} = 0)$  gilt mit  $G := G(P) = (V, E, w)$  und  $\tilde{G} := G(T) = (\tilde{V}, \tilde{E}, \tilde{w})$ , daß  $(\tilde{V}, \tilde{E}) \leq (V, E)$ . Hat dann  $\tilde{G}$  einen Kreis, so auch  $G$ , und es folgt  $P \notin \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ . Man kann also annehmen, daß  $\tilde{G}$  kreisfrei ist. Dann folgt wie im „ $\Leftarrow$ “-Teil des Beweises von Satz 2.4.3, daß  $G(|T|)$  einen  $t_{i_0, j_0}$ -Doppelbaum hat. Daraus folgt nach Lemma 2.4.4, daß  $\sum_{(i,j) \in I_1 \times I_2} |t_{i,j}| = \infty$ . Das steht aber wegen  $|t_{i,j}| \leq p_{i,j} + \tilde{p}_{i,j}$  im Widerspruch zur Voraussetzung  $\sum_{i \in I_1} r_i = \sum_{j \in I_2} s_j < \infty$ . ■

Der Beweis ist analog zu dem von Proposition 1 in [4], nur daß dort die Voraussetzung  $\sum_{i \in I_1} r_i = \sum_{j \in I_2} s_j < \infty$  vergessen wurde. Das folgende Beispiel 2.4.17 zeigt, daß diese Voraussetzung wesentlich ist.

**Beispiel 2.4.17.** Sei  $P$  die Matrix aus Beispiel 2.4.13,  $\mathcal{I} := \mathcal{I}(P)$  und

$$(2.42) \quad E := \begin{pmatrix} -\frac{1}{2} & \frac{1}{2} & & \\ \frac{1}{2} & & -\frac{1}{2} & \\ & -\frac{1}{2} & & \\ & & & \ddots \end{pmatrix}.$$

Da für die nach (2.38) definierten  $a_n$  gilt  $\forall_{n \in \mathbb{N}} 0 < a_n < \frac{1}{10}$ , ist  $P + E \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$ . Dann ist  $\text{supp}(P + E) = \text{supp}(P)$ ,  $P \neq P + E$  und dennoch, wie in Beispiel 2.4.13 gezeigt,  $P \in \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$  (es ist  $P - E \notin \mathcal{D}(\mathcal{I})$ !).

Aus Satz 2.4.16 ergibt sich

**Korollar 2.4.18.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein Randsystem und  $P \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$ . Gilt für jede Zusammenhangskomponente  $H$  von  $G(P)$ , daß  $\sum_{x_i \in V(H)} r_i < \infty$ , so ist

$$(2.43) \quad (\tilde{P} \in \mathcal{D}(\mathcal{I}) \text{ und } \text{supp}(\tilde{P}) \subseteq \text{supp}(P)) \Rightarrow \tilde{P} = P$$

genau dann richtig, wenn  $P \in \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ .



*Beweis.* Wieder ist wegen Lemma 2.4.15 nur „ $\Leftarrow$ “ zu zeigen. Angenommen, es gibt  $\tilde{P} \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$  mit  $\text{supp}(\tilde{P}) \subseteq \text{supp}(P)$  und  $P \neq \tilde{P}$ . Wähle  $(i_0, j_0) \in I_1 \times I_2$  mit  $p_{i_0, j_0} \neq \tilde{p}_{i_0, j_0}$ . Definiert man dann  $H := \text{Zhk}_{G(P)}(x_{i_0})$  und  $I_{1,H} := \{i \in I_1 : x_i \in V(H)\}$ ,  $I_{2,H} := \{j \in I_2 : y_j \in V(H)\}$ . Nach dem Beweis von Satz 2.1.19, sind  $I_{1,H}$  und  $I_{2,H}$  abzählbar, und nach Definition von  $H$  ist  $\tilde{\mathcal{I}} := \mathcal{I}(P|_{I_{1,H} \times I_{2,H}}) = (I_{1,H}, I_{2,H}, r|_{I_{1,H}}, s|_{I_{2,H}})$ . Weiterhin sind  $P|_{I_{1,H} \times I_{2,H}}, \tilde{P}|_{I_{1,H} \times I_{2,H}} \in \mathcal{D}(\tilde{\mathcal{I}})$ ,  $\text{supp}(P|_{I_{1,H} \times I_{2,H}}) \supseteq \text{supp}(\tilde{P}|_{I_{1,H} \times I_{2,H}})$  sowie  $P|_{I_{1,H} \times I_{2,H}} \neq \tilde{P}|_{I_{1,H} \times I_{2,H}}$ . Aus der Voraussetzung des Korollars und Satz 2.4.16 folgt damit  $P|_{I_{1,H} \times I_{2,H}} \notin \mathbf{E}(\mathcal{D}(\tilde{\mathcal{I}}))$ . Nach Satz 2.1.14 (b) ist also auch  $P \notin \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ . ■

Der folgende Satz 2.4.23 gibt eine graphentheoretische Charakterisierung der Extrempunkte von  $\mathcal{D}(\leq \mathcal{I})$ . Dazu sind zwei weitere technische Definitionen (2.4.19 und 2.4.21) notwendig.

**Definition 2.4.19.** Sei  $G = (V, E, w)$  ein gewichteter Graph und  $\epsilon > 0$ . Ein *unendlicher  $\epsilon$ -Weg*  $W$  ist ein Weg  $W \leq G$ , so daß  $w|_{E(W)} \geq \epsilon$  und  $l(W) = \infty$ .

**Bemerkung 2.4.20.** Sei  $G = (V, E, w)$  ein gewichteter Graph,  $\epsilon > 0$  und  $W \leq G$  ein unendlicher  $\epsilon$ -Weg. Dann gilt  $\sum_{e \in E(W)} w(e) \geq \infty \cdot \epsilon = \infty$ , das heißt, insbesondere ist  $\sum_{e \in E} w(e) = \infty$ .

**Definition 2.4.21.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein  $\leq$ -Randsystem,  $P \in \mathcal{D}(\leq \mathcal{I})$ ,  $G(P) = (V, E, w)$ . Setze

$$V_{<} = V_{<}(P) := \{x_i \in V : \sum_{j \in I_2} p_{i,j} < r_i\} \dot{\cup} \{y_j \in V : \sum_{i \in I_1} p_{i,j} < s_j\}.$$

**Lemma 2.4.22.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein  $\leq$ -Randsystem,  $P \in \mathcal{D}(\leq \mathcal{I})$ ,  $G := G(P) = (V, E, w)$ . Gibt es eine Zusammenhangskomponente  $H$  von  $G$  mit  $\#(V(H) \cap V_{<}) \geq 2$ , so ist  $P \notin \mathbf{E}(\mathcal{D}(\leq \mathcal{I}))$ .

*Beweis.* Sei also  $H$  eine Zusammenhangskomponente von  $G$  und  $x_{i_0}, y_{j_0} \in V(H) \cap V_{<}$  (die Fälle  $x_{i_1}, x_{i_2} \in V(H) \cap V_{<}$ ,  $i_1 \neq i_2$  und  $y_{j_1}, y_{j_2} \in V(H) \cap V_{<}$ ,  $j_1 \neq j_2$  lassen sich ganz analog behandeln). Da  $H$  zusammenhängend ist, gibt es einen  $x_{i_0}y_{j_0}$ -Weg  $W = (x_{i_1}, y_{j_1}, \dots, x_{i_k}, y_{j_k})$ . Es sei

(2.44)

$$\epsilon := \min\{r_{i_0} - \sum_{j \in I_2} p_{i_0,j}, s_{j_0} - \sum_{i \in I_1} p_{i,j_0}, p_{i_1,j_1}, p_{i_2,j_1}, p_{i_2,j_2}, \dots, p_{i_k,j_{k-1}}, p_{i_k,j_k}\}.$$

Nun definiere eine Matrix  $E = (e_{i,j})_{(i,j) \in I_1 \times I_2} \in \mathcal{M}_{\mathbb{R}}(I_1, I_2)$  durch

$$(2.45) \quad e_{i,j} := \begin{cases} \epsilon & \text{für } (i,j) = (i_\mu, j_\mu), \quad 1 \leq \mu \leq k, \\ -\epsilon & \text{für } (i,j) = (i_\mu, j_{\mu-1}), \quad 2 \leq \mu \leq k, \\ 0 & \text{sonst.} \end{cases}$$

Dann erfüllt  $E$  die Bedingungen 2.8 und 2.9 aus Lemma 2.1.13 (a). Daher ist  $P \notin E(\mathcal{D}(\leq \mathcal{I}))$ . ■

**Satz 2.4.23.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein  $\leq$ -Randsystem mit  $\#I_1, \#I_2 \leq \omega$ ,  $P \in \mathcal{D}(\leq \mathcal{I})$ ,  $G := G(P) = (V, E, w)$ . Dann gilt  $P \in E(\mathcal{D}(\leq \mathcal{I}))$  genau dann, wenn die folgenden Bedingungen (i), (ii) und (iii) gelten.

- (i)  $G$  ist ein Wald und hat für kein  $\epsilon > 0$  einen  $\epsilon$ -Doppelbaum.
- (ii) Für alle Zusammenhangskomponenten  $H$  von  $G$  ist  $\#(V(H) \cap V_{<}) \leq 1$ .
- (iii) Für alle Zusammenhangskomponenten  $H$  von  $G$  gilt, daß  $H$  nur für  $V(H) \cap V_{<} = \emptyset$  für ein  $\epsilon > 0$  einen unendlichen  $\epsilon$ -Weg  $W \leq H$  haben kann.

*Beweis.* „ $\Rightarrow$ “: Ist (i) nicht erfüllt und  $\tilde{\mathcal{I}} := \mathcal{I}(P)$ , so ist nach Satz 2.4.3  $P \notin E(\mathcal{D}(\tilde{\mathcal{I}}))$ , das heißt  $P = \frac{1}{2}P_1 + \frac{1}{2}P_2$  mit  $P \neq P_1, P_2 \in \mathcal{D}(\tilde{\mathcal{I}})$ . Da dann auch  $P_1, P_2 \in \mathcal{D}(\leq \mathcal{I})$ , ist  $P \notin E(\mathcal{D}(\leq \mathcal{I}))$ . Man kann jetzt also annehmen, daß (i) erfüllt ist. Ist (ii) nicht erfüllt, so ist  $P \notin E(\mathcal{D}(\leq \mathcal{I}))$  nach Lemma 2.4.22. Ab jetzt sei auch (ii) erfüllt. Ist nun (iii) nicht erfüllt, so gibt es eine Zusammenhangskomponente  $H$  von  $G$  mit  $V(H) \cap V_{<} \neq \emptyset$  und ein  $\tilde{\epsilon} > 0$ , so daß  $H$  einen unendlichen  $\tilde{\epsilon}$ -Weg  $\tilde{W} = (x_{\tilde{i}_1}, y_{\tilde{j}_1}, \dots)$  hat. Gibt es  $x_{\tilde{i}_0} \in V(H) \cap V_{<}$ , so sei  $U := (x_{\tilde{i}_0}, y_{\tilde{j}_0}, \dots, x_{\tilde{i}_1})$  ein  $x_{\tilde{i}_0}x_{\tilde{i}_1}$ -Weg. Mit  $\epsilon := \min\{\tilde{\epsilon}, \min\{w(e) : e \in E(U)\}$  ist dann  $W = (x_{i_0}, y_{j_0}, \dots) := (x_{\tilde{i}_0}, y_{\tilde{j}_0}, \dots, x_{\tilde{i}_1}, y_{\tilde{j}_1}, \dots)$  ein unendlicher  $\epsilon$ -Weg in  $H$ . Sei nun  $\delta := \inf\{r_{i_0} - \sum_{j \in I_2} p_{i_0, j}, p_{i_0, j_0}, p_{i_1, j_0}, \dots\}$ . Dann ist  $\delta > 0$ . Setze  $T = (t_{i, j})_{(i, j) \in I_1 \times I_2}$  mit

$$(2.46) \quad t_{i, j} := \begin{cases} \delta & \text{für } (i, j) = (i_k, j_k), k \in \mathbb{N}_0, \\ -\delta & \text{für } (i, j) = (i_{k+1}, j_k), k \in \mathbb{N}_0, \\ 0 & \text{sonst.} \end{cases}$$

Damit ist dann  $P \pm T \geq 0$ ,  $\forall_{j \in I_2} \sum_{i \in I_1} t_{i, j} = 0$  und

$$(2.47) \quad \sum_{j \in I_2} t_{i, j} = \begin{cases} \delta \leq r_{i_0} - \sum_{j \in I_2} p_{i_0, j} & \text{für } i = i_0, \\ 0 & \text{für } i \in I_1 \setminus \{i_0\}. \end{cases}$$

Nach Lemma 2.1.13 (a) ist dann  $P \notin E(\mathcal{D}(\leq \mathcal{I}))$ . Gibt es nur ein  $y_{\tilde{j}_0} \in V(H) \cap V_{<}$ , so folgt  $P \notin E(\mathcal{D}(\leq \mathcal{I}))$  ganz analog.

„ $\Leftarrow$ “: Seien die Bedingungen (i), (ii), (iii) erfüllt und  $P = \frac{1}{2}P_1 + \frac{1}{2}P_2$ ,  $P_1, P_2 \in \mathcal{D}(\leq \mathcal{I})$ . Setze  $T := P_1 - P = P - P_2$ . Dann ist  $\forall_{(i, j) \in I_1 \times I_2} |t_{i, j}| \leq p_{i, j}$ . Ziel ist es, zu zeigen, daß  $T = 0$ . Wegen  $|t_{i, j}| \leq p_{i, j}$  ist  $(V(G(|T|)), E(G(|T|))) \leq (V, E)$ . Also ist  $G(|T|)$  wegen (i) ein Wald und hat

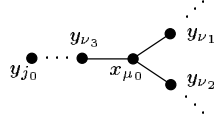


Abbildung 2.5

für kein  $\epsilon > 0$  einen  $\epsilon$ -Doppelbaum. Nun sei  $H$  eine Zusammenhangskomponente von  $G(|T|)$  und

$$(2.48) \quad V_{\neq 0} := \{x_i \in V(H) : \sum_{j \in I_2} t_{i,j} \neq 0\} \cup \{y_j \in V(H) : \sum_{i \in I_1} t_{i,j} \neq 0\}.$$

Wegen  $P \pm T \in \mathcal{D}(\leq \mathcal{I})$  ist  $V_{\neq 0} \subseteq V_{<}$ . Nach (ii) ist also  $\#V_{\neq 0} \leq 1$ . Angenommen, es gilt  $\#V_{\neq 0} = 1$ . Sei ohne Beschränkung der Allgemeinheit  $V_{\neq 0} = \{x_{i_0}\}$ , (der Fall  $V_{\neq 0} = \{y_{j_0}\}$  wird analog behandelt). Es gibt dann  $j_0 \in I_2$  mit  $t_{i_0, j_0} \neq 0$ . Entfernt man aus  $H$  die Kante  $\{x_{i_0}, y_{j_0}\}$ , so entstehen, da  $H$  ein Baum ist, zwei Zusammenhangskomponenten.  $B$  sei diejenige mit  $y_{j_0} \in V(B)$ .

*Behauptung 1.*  $\forall_{v \in V(B)} d_B(v) \leq 2$ .

*Beweis.* Angenommen, es gibt  $x_{\mu_0} \in V(B)$  mit  $d_B(x_{\mu_0}) \geq 3$ . Dann gibt es  $\nu_1, \nu_2, \nu_3 \in I_2$  mit  $t_{\mu_0, \nu_1}, t_{\mu_0, \nu_2}, t_{\mu_0, \nu_3} \neq 0$ . Nach eventuellem Vertauschen von  $\nu_1, \nu_2, \nu_3$  kann man ohne Beschränkung der Allgemeinheit annehmen, daß  $d(y_{j_0}, y_{\nu_3}) < d(y_{j_0}, y_{\nu_1}), d(y_{j_0}, y_{\nu_2})$  und  $|t_{\mu_0, \nu_1}| \leq |t_{\mu_0, \nu_2}|$  (siehe Abbildung 2.5). Setze  $\delta := -\frac{t_{\mu_0, \nu_1}}{t_{\mu_0, \nu_2}}$ , das heißt  $0 < |\delta| \leq 1$ . Entfernt man die Ecke  $x_{\mu_0}$  aus  $B$ , so entstehen mehrere Zusammenhangskomponenten. Sei  $B_1 := \text{Zhk}_{B-x_{\mu_0}}(y_{\nu_1})$ ,  $B_2 := \text{Zhk}_{B-x_{\mu_0}}(y_{\nu_2})$ . Definiere eine Matrix  $S = (s_{i,j})_{(i,j) \in I_1 \times I_2}$  durch

$$(2.49) \quad s_{i,j} := \begin{cases} t_{i,j} & \text{für } \{x_i, y_j\} \in E(B_1) \cup \{x_{\mu_0}, y_{\nu_1}\}, \\ \delta t_{i,j} & \text{für } \{x_i, y_j\} \in E(B_2) \cup \{x_{\mu_0}, y_{\nu_2}\}, \\ 0 & \text{sonst.} \end{cases}$$

Dann ist  $\forall_{(i,j) \in I_1 \times I_2} |s_{i,j}| \leq |t_{i,j}|$ , und es gilt

$$(2.50) \quad \begin{aligned} \sum_{j \in I_2} s_{\mu_0, j} &= t_{\mu_0, \nu_1} + \delta t_{\mu_0, \nu_2} = 0, \\ \forall_{x_i \in V(B_1)} \sum_{j \in I_2} s_{i,j} &= \sum_{j \in I_2} t_{i,j} = 0, & \forall_{y_j \in V(B_1)} \sum_{i \in I_1} s_{i,j} &= \sum_{i \in I_1} t_{i,j} = 0, \\ \forall_{x_i \in V(B_2)} \sum_{j \in I_2} s_{i,j} &= \sum_{j \in I_2} \delta t_{i,j} = 0, & \forall_{y_j \in V(B_2)} \sum_{i \in I_1} s_{i,j} &= \sum_{i \in I_1} \delta t_{i,j} = 0. \end{aligned}$$

$S$  erfüllt damit die Bedingungen von Lemma 2.1.13 b), das heißt  $P \notin \mathbb{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}(P)))$ , was nach Satz 2.4.3 im Widerspruch dazu steht, daß  $G$  (i) erfüllt. Bleibt noch zu bemerken, daß der Fall  $y_{\nu_0} \in V(B)$  analog behandelt werden kann.  $\blacktriangle$

Behauptung 1 besagt, daß  $B = (y_{j_0}, x_{i_1}, y_{i_1}, \dots)$  ein Weg ist. Also muß  $t_{i_0, j_0} = -t_{i_1, j_0} = t_{i_1, j_1} = \dots$  sein, das heißt,  $B$  ist ein unendlicher  $t_{i_0, j_0}$ -Weg im Widerspruch zu (iii). Damit ist gezeigt, daß  $V_{\neq 0} = \emptyset$  gelten muß. Da weiterhin  $H$  eine beliebige Zusammenhangskomponente von  $G(|T|)$  war, folgt, daß sich alle Linien von  $T$  zu Null summieren. Wäre  $T \neq 0$ , so wäre nach Lemma 2.1.13 (b) wieder  $P \notin \mathbb{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}(P)))$ .  $\blacksquare$

**Lemma 2.4.24.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein  $\leq$ -Randsystem mit  $\min\{\sum_{i \in I_1} r_i, \sum_{j \in I_2} s_j\} < \infty$ ,  $P \in \mathcal{D}(\leq \mathcal{I})$ ,  $G := G(P) = (V, E, w)$ . Dann kann es für kein  $\epsilon > 0$  einen unendlichen  $\epsilon$ -Weg  $W \leq G$  geben.

*Beweis.* Ist  $\epsilon > 0$  und  $W \leq G$  ein unendlicher  $\epsilon$ -Weg, so ist nach Bemerkung 2.4.20  $\min\{\sum_{i \in I_1} r_i, \sum_{j \in I_2} s_j\} \geq \sum_{(i,j) \in I_1 \times I_2} p_{i,j} = \sum_{e \in E} w(e) = \infty$ .  $\blacksquare$

**Korollar 2.4.25.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein  $\leq$ -Randsystem mit  $\min\{\sum_{i \in I_1} r_i, \sum_{j \in I_2} s_j\} < \infty$ ,  $P \in \mathcal{D}(\leq \mathcal{I})$ ,  $G := G(P) = (V, E, w)$ . Dann ist  $P \in \mathbb{E}(\mathcal{D}(\leq \mathcal{I}))$  genau dann, wenn  $G$  ein Wald ist und für alle Zusammenhangskomponenten  $H$  von  $G$  gilt, daß  $\#(V(H) \cap V_{<}) \leq 1$ .

*Beweis.* Zunächst kann man wegen  $\min\{\sum_{i \in I_1} r_i, \sum_{j \in I_2} s_j\} < \infty$  ohne Beschränkung der Allgemeinheit annehmen, daß  $\#I_1, \#I_2 \leq \omega$ . Nach Satz 2.4.23 ist dann nur noch zu zeigen, daß für  $\min\{\sum_{i \in I_1} r_i, \sum_{j \in I_2} s_j\} < \infty$  (iii) aus Satz 2.4.23 immer erfüllt ist, und das ergibt sich aus Lemma 2.4.24.  $\blacksquare$

Das folgende Beispiel 2.4.26 liefert den einfachsten Fall einer doppelt substochastischen Matrix  $P$  bezüglich eines endlichen Randsystems, so daß  $G(P)$  ein Wald,  $P$  jedoch nicht extremal ist. Wegen Satz 2.2.4 folgt daraus, daß sich Satz 1.4.1 nicht auf  $\mu \in \mathcal{D}(\leq m_1, \leq m_2)$  verallgemeinern läßt.

**Beispiel 2.4.26.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  mit  $I_1 = I_2 = \{1\}$ ,  $r = s = (1)$ ,  $P := (\frac{1}{2})$ . Dann ist  $P \in \mathcal{D}(\leq \mathcal{I})$ , wegen  $P = \frac{1}{2}(1) + \frac{1}{2}(0)$  ist  $P \notin \mathcal{D}(\leq \mathcal{I})$  (das ist Fall (ii) von Satz 2.4.23).  $G(P)$  hat nur zwei Ecken und ist damit ein Wald.

Der folgende Satz 2.4.27 und Korollar 2.4.28 stellen die zu Satz 2.4.11 und Korollar 2.4.12 analogen Ergebnisse für doppelt substochastische Matrizen dar. Sie verallgemeinern einen Satz von MIRSKY (siehe [10]).

**Satz 2.4.27.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein  $\leq$ -Randsystem mit  $\#I_1 = \alpha$ ,  $\#I_2 = \beta$ . Ist  $\mathcal{G} := \mathcal{G}(\mathcal{I})$  abgeschlossen, so gilt

$$(2.51) \quad P \in \mathbb{E}(\mathcal{D}(\leq \mathcal{I})) \Rightarrow \{p_{i,j} : (i,j) \in I_1 \times I_2\} \subseteq \mathcal{G}.$$

*Beweis.* Nach Lemma 2.4.9 kann man wieder ohne Einschränkung annehmen, daß  $\mathcal{G} = t\mathbb{Z}$  für ein  $t \in \mathbb{R}^+$ . Zunächst nehme man an, daß  $\alpha = \beta = \omega$ . Sei  $P \in \mathcal{D}(\leq \mathcal{I})$  gegeben. Angenommen, es gibt  $(i_0, j_0) \in I_1 \times I_2$  mit  $p_{i_0, j_0} \notin \mathcal{G}$ . Es soll gezeigt werden, daß dann  $P \notin \mathcal{E}(\mathcal{D}(\leq \mathcal{I}))$ . Hat  $G(P)$  einen Kreis, so folgt das aus Satz 2.4.23. Man kann also annehmen, daß  $G := G(P) = (V, E, w)$  ein Wald ist. Weiterhin kann man annehmen, daß für alle Zusammenhangskomponenten  $H$  von  $G$ ,  $\#(V(H) \cap V_{<}) \leq 1$ , denn andernfalls ist  $P \notin \mathcal{E}(\mathcal{D}(\leq \mathcal{I}))$  nach Satz 2.4.23 (ii).

*Behauptung 1.* Gilt  $\mathcal{G}_P := \mathcal{G}(\mathcal{I}(P)) \leq \mathcal{G}$ , so ist  $P \notin \mathcal{E}(\mathcal{D}(\leq \mathcal{I}))$ .

*Beweis.* Wegen  $\mathcal{G} = t\mathbb{Z}$  ist  $\mathcal{G}_P = \tilde{t}\mathbb{Z}$ , wobei  $\tilde{t} \in \{kt : k \in \mathbb{N}\}$ . Wegen  $p_{i_0, j_0} \notin \mathcal{G}$  ist  $P \notin \mathcal{M}_{\mathcal{G}_P}(I_1, I_2)$  und damit  $P \notin \mathcal{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}(P)))$  nach Satz 2.4.11. Dann gibt es  $\epsilon > 0$ , so daß  $G(P)$  einen  $\epsilon$ -Doppelbaum hat. Wegen Satz 2.4.23 ist also  $P \notin \mathcal{E}(\mathcal{D}(\leq \mathcal{I}))$ .  $\blacktriangle$

Nach Behauptung 1 gibt es eine Linie von  $P$ , deren Summe nicht in  $\mathcal{G}$  liegt. Insbesondere gilt für die zu dieser Linie gehörende Zusammenhangskomponente  $H$ , daß  $\#(V(H) \cap V_{<}) = 1$ . Man kann daher ohne Beschränkung der Allgemeinheit annehmen, daß  $V(H) \cap V_{<} = \{x_{i_0}\}$  (der Fall  $\{y_{j_0}\} = V(H) \cap V_{<}$  ist wie üblich, analog zu gewinnen). Wegen  $\#(V(H) \cap V_{<}) = 1$  ist  $\bigvee_{x_i \in V(H) \setminus \{x_{i_0}\}} \sum_{j \in I_2} p_{i,j} \in \mathcal{G}$  und  $\bigvee_{y_j \in V(H)} \sum_{i \in I_1} p_{i,j} \in \mathcal{G}$ . Entfernt man aus  $H$  die Kante  $\{x_{i_0}, y_{j_0}\}$ , so entstehen, da  $H$  ein Baum ist, zwei Zusammenhangskomponenten. Sei  $T$  diejenige mit  $y_{j_0} \in V(T)$ .

*Behauptung 2.* Ist  $P \in \mathcal{E}(\mathcal{D}(\leq \mathcal{I}))$ , so gilt für  $i \in I_1$  mit  $x_i \in V(T)$ , daß  $\#\{p_{i,\nu} : p_{i,\nu} \notin \mathcal{G}\} \leq 2$  und für  $j \in I_2$  mit  $y_j \in V(T)$ , daß  $\#\{p_{\mu,j} : p_{\mu,j} \notin \mathcal{G}\} \leq 2$ .

*Beweis.* Angenommen, es gibt  $x_{\mu_0} \in V(T)$  mit  $\#\{p_{\mu_0,\nu} : p_{\mu_0,\nu} \notin \mathcal{G}\} \geq 3$  (im Fall daß es  $y_{\nu_0} \in V(T)$  mit  $\#\{p_{\mu,\nu_0} : p_{\mu,\nu_0} \notin \mathcal{G}\} \geq 3$  gibt, kann man ganz analog argumentieren). Dann gibt es  $\nu_1, \nu_2, \nu_3 \in I_2$  mit  $p_{\mu_0,\nu_1}, p_{\mu_0,\nu_2}, p_{\mu_0,\nu_3} \notin \mathcal{G}$ . Nach eventuellem Vertauschen von  $\nu_1, \nu_2, \nu_3$  kann man annehmen, daß  $d(y_{j_0}, y_{\nu_3}) < d(y_{j_0}, y_{\nu_1}), d(y_{j_0}, y_{\nu_2})$ . Entfernt man die Ecke  $x_{\mu_0}$  aus  $T$ , so entstehen mehrere Zusammenhangskomponenten. Setze  $\epsilon := \frac{1}{2} \min\{di(p_{\mu_0,\nu_1}), di(p_{\mu_0,\nu_2})\}$  ( $di$  wie in Lemma 2.4.10),  $q_1 := x_{\mu_0}$ ,  $q_2 := y_{\nu_2}$ ,  $T_1'' := \text{Zhk}_{T-x_{\mu_0}}(y_{\nu_1})$ ,  $T_1' := (V_{T_1'}, E_{T_1'}, q_1)$  mit  $V_{T_1'} := V(T_1'') \cup \{x_{\mu_0}\}$ ,  $E_{T_1'} := E(T_1'') \cup \{x_{\mu_0}, y_{\nu_1}\}$ ,  $T_2' := (V_{T_2'}, E_{T_2'}, q_2) := \text{Zhk}_{T-x_{\mu_0}}(y_{\nu_2})$ ,  $G' = (V', E', w')$  mit  $V' := V(T_1') \cup V(T_2')$ ,  $E' := E(T_1') \cup E(T_2')$ ,  $w' := w|_{E'}$ . Damit ist  $B' := (G', T_1', T_2')$  ein Doppelbaum. Nun kann man genau wie im Beweis von Satz 2.4.11 einen  $\epsilon$ -Doppelbaum  $B \leq B'$  ( $\epsilon > 0$ ) konstruieren (das heißt, wegen Satz 2.4.23 (i) ist dann  $P \notin \mathcal{E}(\mathcal{D}(\leq \mathcal{I}))$ ). Setze dazu noch  $\tilde{q}_1 := y_{\nu_1}$ , und ersetze im Beweis von Satz 2.4.11  $q_1$  durch  $\tilde{q}_1$ . Ersetze dann weiterhin zur Konstruktion von  $E_n(\tilde{q}_1)$ ,  $L_n(\tilde{q}_1)$ ,  $i_0$  durch  $\mu_0$ ,  $j_0$  durch  $\nu_1$ ,  $T_1'$  durch  $T_1''$ , und am Ende setze  $V_{T_1} := \bigcup_{n=0}^{\infty} L_n(\tilde{q}_1) \cup \{q_1\}$ ,

$E_{T_1} := \bigcup_{n=0}^{\infty} E_n(\tilde{q}_1) \cup \{q_1, \tilde{q}_1\}$ ,  $f_1\{q_1, \tilde{q}_1\} := \epsilon$ . In der Konstruktion von  $E_n(q_2)$ ,  $L_n(q_2)$  ersetze  $i_0$  durch  $\mu_0$  und  $j_0$  durch  $\nu_2$ .  $\blacktriangle$

Wegen Behauptung 2 kann man nun annehmen, daß  $T = (y_{j_0}, x_{i_1}, y_{j_1}, \dots)$  ein Weg ist. Für  $p, q \in \mathbb{R}$  mit  $p + q \in \mathcal{G}$  gilt  $di(p) = di(p + q - q) \leq di(q)$ . Vertauschen von  $p$  und  $q$  liefert  $di(q) \leq di(p)$ . Also ist  $di(p) = di(q)$ . Daraus folgt, daß  $T$  ein unendlicher  $di(p_{i_0, j_0})$ -Weg ist. Nach Satz 2.4.23 (iii) ist auch in diesem Fall  $P \notin \mathbf{E}(\mathcal{D}(\leq \mathcal{I}))$ . Damit ist im Fall  $\alpha = \beta = \omega$  alles bewiesen.

Der Fall  $\alpha, \beta \leq \omega$  kann wieder auf den Fall  $\alpha = \beta = \omega$  zurückgeführt werden, indem man abzählbar viele Nulllinien einfügt. Bleibt der allgemeine Fall. Erneut nehme man an, daß es  $(i_0, j_0) \in I_1 \times I_2$  gibt mit  $p_{i_0, j_0} \notin \mathcal{G}$ . Wieder wird gezeigt, daß  $P \notin \mathbf{E}(\mathcal{D}(\leq \mathcal{I}))$ . Betrachte  $G(P)$ . Es sei  $Z := \text{Zhk}(x_{i_0})$  und  $I_{1,Z} := \{i \in I_1 : x_i \in V(Z)\}$ ,  $I_{2,Z} := \{j \in I_2 : y_j \in V(Z)\}$ . Wie im Beweis von Satz 2.1.19 gesehen, sind  $I_{1,Z}$  und  $I_{2,Z}$  abzählbar, und nach Definition von  $Z$  ist  $\mathcal{I}(P|_{I_{1,Z} \times I_{2,Z}}) = (I_{1,Z}, I_{2,Z}, r|_{I_{1,Z}}, s|_{I_{2,Z}})$ . Da der Beweis für den Fall  $\max\{\#I_1, \#I_2\} \leq \omega$  schon geführt wurde, ist  $P|_{I_{1,Z} \times I_{2,Z}} \notin \mathbf{E}(\mathcal{D}(\leq \mathcal{I}(P|_{I_{1,Z} \times I_{2,Z}})))$ . Also ist nach Satz 2.1.19 (a)  $P \notin \mathbf{E}(\mathcal{D}(\leq \mathcal{I}))$ .  $\blacksquare$

**Korollar 2.4.28.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein  $\leq$ -Randsystem mit  $\#I_1 = \alpha$ ,  $\#I_2 = \beta$  und  $\forall_{(i,j) \in I_1 \times I_2} r_i = s_j = 1$ . Dann ist  $\mathbf{E}(\mathcal{D}(\leq \mathcal{I})) = \mathcal{M}_{sp}(I_1, I_2)$ .

*Beweis.* „ $\supseteq$ “ gilt wieder, da 0, 1 die Extrempunkte von  $[0, 1]$  sind.

„ $\subseteq$ “: Das folgt sofort aus Satz 2.4.27; denn  $\mathbb{Z}$  ist abgeschlossen und  $p_{i,j} \in \mathbb{Z} \Rightarrow p_{i,j} \in \{0, 1\}$  wegen der Voraussetzung.  $\blacksquare$

## 2.5 Charakterisierungen der Extrempunkte für endliche Randsysteme

Das Hauptergebnis dieses Abschnitts besteht in Satz 2.5.15, der eine Vielzahl verschiedener Charakterisierungen der Extrempunkte für endliche Randsysteme liefert.

Zunächst wird für endliche Randsysteme  $\mathcal{I}$  rekursiv eine Menge  $\mathcal{E}(\mathcal{I})$  definiert, die sich dann anschließend gerade als die Menge der Extrempunkte erweisen wird (siehe Lemma 2.5.5).

Die Konstruktion von  $\mathcal{E}(\mathcal{I})$  erfolgt, indem man, sofern es mindestens zwei Zeilen und mindestens zwei Spalten gibt, für alle Indexpaare  $(i, j)$  untersucht, ob  $r_i \leq s_j$  oder  $r_i \geq s_j$  gilt. Im ersten Fall entfernt man  $i$  und  $r_i$  aus dem Randsystem  $\mathcal{I}$  und ersetzt  $s_j$  durch  $s_j - r_i$ . So entsteht ein kleineres Randsystem  $\tilde{\mathcal{I}}$ . Die zugehörigen Elemente von  $\mathcal{E}(\mathcal{I})$  bekommt man nun rekursiv, indem man in alle Elemente

von  $\mathcal{E}(\hat{\mathcal{I}})$  eine zusätzliche  $i$ -te Zeile einfügt, die an der  $j$ -ten Stelle  $r_i$  stehen hat und sonst nur Nullen. Im Fall  $r_i \geq s_j$  geht man analog vor, nur daß die Rollen der Zeilen und Spalten vertauscht sind. Die formalen Details dieser Konstruktion erfolgen jetzt in Definition 2.5.1.

**Definition 2.5.1.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein endliches Randsystem. Setze  $m := l(r)$ ,  $n := l(s)$ ,

$$(2.52) \quad M(\mathcal{I}) := \{(i, j) \in I_1 \times I_2 : r_i \leq s_j\}, \quad N(\mathcal{I}) := \{(i, j) \in I_1 \times I_2 : r_i \geq s_j\}.$$

Für  $(i_0, j_0) \in M(\mathcal{I})$  und  $m \geq 2$  definiere ein Randsystem  $\mathcal{I}_M^{i_0, j_0} := (I_1 \setminus \{i_0\}, I_2, r_M^{i_0}, s_M^{j_0})$  durch

$$(2.53) \quad r_M^{i_0} := r|_{I_1 \setminus \{i_0\}}, \quad (s_M^{j_0})_j := \begin{cases} s_j & \text{für } j \neq j_0, \\ s_{j_0} - r_{i_0} & \text{für } j = j_0. \end{cases}$$

Für  $(i_0, j_0) \in N(\mathcal{I})$  und  $n \geq 2$  definiere ein Randsystem  $\mathcal{I}_N^{i_0, j_0} := (I_1, I_2 \setminus \{j_0\}, r_N^{i_0}, s_N^{j_0})$  durch

$$(2.54) \quad s_N^{j_0} := s|_{I_2 \setminus \{j_0\}}, \quad (r_N^{i_0})_i := \begin{cases} r_i & \text{für } i \neq i_0, \\ r_{i_0} - s_{j_0} & \text{für } i = i_0. \end{cases}$$

Die Menge  $\mathcal{E}(\mathcal{I})$  sei dann rekursiv, wie folgt, definiert:

Für  $\min\{m, n\} = 1$  sei  $\mathcal{E}(\mathcal{I}) := \mathcal{D}(\mathcal{I})$ . Seien nun  $m, n \geq 2$ , und für alle Randsysteme  $\hat{\mathcal{I}} := (\hat{I}_1, \hat{I}_2, \hat{r}, \hat{s})$  mit  $\hat{m} := l(\hat{r}) < m$  oder  $\hat{n} := l(\hat{s}) < n$  sei  $\mathcal{E}(\hat{\mathcal{I}})$  bereits konstruiert. Definiere für  $(i_0, j_0) \in M(\mathcal{I})$  und  $m \geq 2$

$$(2.55) \quad \mathcal{M}_{i_0, j_0}(\mathcal{I}) := \left\{ P \in \mathcal{M}_{\mathbb{R}_0^+}(I_1, I_2) : \right. \\ \left. P|_{(I_1 \setminus \{i_0\}) \times I_2} \in \mathcal{E}(\mathcal{I}_M^{i_0, j_0}) \text{ und } p_{i_0, j} = \begin{cases} 0 & \text{für } j \neq j_0, \\ r_{i_0} & \text{für } j = j_0 \end{cases} \right\}$$

und für  $(i_0, j_0) \in N(\mathcal{I})$  und  $n \geq 2$

$$(2.56) \quad \mathcal{N}_{i_0, j_0}(\mathcal{I}) := \left\{ P \in \mathcal{M}_{\mathbb{R}_0^+}(I_1, I_2) : \right. \\ \left. P|_{I_1 \times (I_2 \setminus \{j_0\})} \in \mathcal{E}(\mathcal{I}_N^{i_0, j_0}) \text{ und } p_{i, j_0} = \begin{cases} 0 & \text{für } i \neq i_0, \\ s_{j_0} & \text{für } i = i_0 \end{cases} \right\}.$$

Schließlich sei  $\mathcal{E}(\mathcal{I}) := \mathcal{M}(\mathcal{I}) \cup \mathcal{N}(\mathcal{I})$  mit

$$(2.57) \quad \mathcal{M}(\mathcal{I}) := \bigcup_{(i, j) \in M(\mathcal{I})} \mathcal{M}_{i, j}(\mathcal{I}), \quad \mathcal{N}(\mathcal{I}) := \bigcup_{(i, j) \in N(\mathcal{I})} \mathcal{N}_{i, j}(\mathcal{I}).$$

Zur Illustration von Definition 2.5.1 dient das folgende Beispiel 2.5.2. In Abschnitt A.1 des Anhangs befindet sich der Quellcode einer Implementation des in Definition 2.5.1 gegebenen Algorithmus.

**Beispiel 2.5.2.** Gegeben sei das Randsystem  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  mit  $I_1 := \{1, 2\}$ ,  $I_2 := \{1, 2, 3\}$ ,  $r := (2, 5)$ ,  $s := (1, 1, 5)$ . Es soll nun  $\mathcal{E}(\mathcal{I})$  explizit bestimmt werden. Es ist  $M(\mathcal{I}) = \{(1, 3), (2, 3)\}$  und  $N(\mathcal{I}) = \{(1, 1), (1, 2), (2, 1), (2, 2), (2, 3)\}$ . Man erhält

$$\begin{aligned} \mathcal{I}_M^{1,3} &= (\{2\}, I_2, (5), (1, 1, 3)), & \mathcal{M}_{1,3}(\mathcal{I}) &= \left\{ \begin{pmatrix} 0 & 0 & 2 \\ 1 & 1 & 3 \end{pmatrix} \right\}, \\ \mathcal{I}_M^{2,3} &= (\{1\}, I_2, (2), (1, 1, 0)), & \mathcal{M}_{2,3}(\mathcal{I}) &= \left\{ \begin{pmatrix} 1 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 5 \end{pmatrix} \right\}, \end{aligned}$$

sowie  $\mathcal{I}_N^{1,1} = (I_1, \{2, 3\}, (1, 5), (1, 5))$ ,  $M(\mathcal{I}_N^{1,1}) = \{(1, 2), (1, 3), (2, 3)\}$ ,  
 $N(\mathcal{I}_N^{1,1}) = \{(1, 2), (2, 2), (2, 3)\}$ ,

$$\begin{aligned} (\mathcal{I}_N^{1,1})_M^{1,2} &= (\{2\}, \{2, 3\}, (5), (0, 5)), & \mathcal{M}_{1,2}(\mathcal{I}_N^{1,1}) &= \left\{ \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 5 \end{pmatrix} \right\}, \\ (\mathcal{I}_N^{1,1})_M^{1,3} &= (\{2\}, \{2, 3\}, (5), (1, 4)), & \mathcal{M}_{1,3}(\mathcal{I}_N^{1,1}) &= \left\{ \begin{pmatrix} 0 & 1 \\ 1 & 4 \end{pmatrix} \right\}, \\ (\mathcal{I}_N^{1,1})_M^{2,3} &= (\{1\}, \{2, 3\}, (1), (1, 0)), & \mathcal{M}_{2,3}(\mathcal{I}_N^{1,1}) &= \left\{ \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 5 \end{pmatrix} \right\}, \\ (\mathcal{I}_N^{1,1})_N^{1,2} &= (I_1, \{3\}, (0, 5), (5)), & \mathcal{M}_{1,2}(\mathcal{I}_N^{1,1}) &= \left\{ \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 5 \end{pmatrix} \right\}, \\ (\mathcal{I}_N^{1,1})_N^{2,2} &= (I_1, \{3\}, (1, 4), (5)), & \mathcal{M}_{2,2}(\mathcal{I}_N^{1,1}) &= \left\{ \begin{pmatrix} 0 & 1 \\ 1 & 4 \end{pmatrix} \right\}, \\ (\mathcal{I}_N^{1,1})_N^{2,3} &= (I_1, \{2\}, (1, 0), (1)), & \mathcal{M}_{2,3}(\mathcal{I}_N^{1,1}) &= \left\{ \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 0 & 5 \end{pmatrix} \right\}, \end{aligned}$$

also  $\mathcal{N}_{1,1}(\mathcal{I}) = \left\{ \begin{pmatrix} 1 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 5 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 1 & 0 & 1 \\ 0 & 1 & 4 \end{pmatrix} \right\}$ . Ganz analog bekommt man

$$\begin{aligned} \mathcal{I}_N^{1,2} &= (I_1, \{1, 3\}, (1, 5), (1, 5)), & \mathcal{N}_{1,2}(\mathcal{I}) &= \left\{ \begin{pmatrix} 1 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 5 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 1 & 1 \\ 1 & 0 & 4 \end{pmatrix} \right\}, \\ \mathcal{I}_N^{2,1} &= (I_1, \{2, 3\}, (2, 4), (1, 5)), & \mathcal{N}_{2,1}(\mathcal{I}) &= \left\{ \begin{pmatrix} 0 & 0 & 2 \\ 1 & 1 & 3 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 1 & 1 \\ 1 & 0 & 4 \end{pmatrix} \right\}, \\ \mathcal{I}_N^{2,2} &= (I_1, \{1, 3\}, (2, 4), (1, 5)), & \mathcal{N}_{2,2}(\mathcal{I}) &= \left\{ \begin{pmatrix} 0 & 0 & 2 \\ 1 & 1 & 3 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 1 & 0 & 1 \\ 0 & 1 & 4 \end{pmatrix} \right\}, \\ \mathcal{I}_N^{2,3} &= (I_1, \{1, 2\}, (2, 0), (1, 1)), & \mathcal{N}_{2,3}(\mathcal{I}) &= \left\{ \begin{pmatrix} 1 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 5 \end{pmatrix} \right\}. \end{aligned}$$



Damit hat man insgesamt

$$\mathcal{E}(\mathcal{I}) = \mathcal{M}(\mathcal{I}) \cup \mathcal{N}(\mathcal{I}) = \left\{ \begin{pmatrix} 0 & 0 & 2 \\ 1 & 1 & 3 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 1 & 1 \\ 1 & 0 & 4 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 1 & 0 & 1 \\ 0 & 1 & 4 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 1 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 5 \end{pmatrix} \right\}.$$

**Lemma 2.5.3.** Für jedes endliche Randsystem  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ist  $\mathcal{E}(\mathcal{I}) \subseteq \mathcal{D}(\mathcal{I})$ .

*Beweis.* Der Beweis erfolgt durch Induktion über  $m + n$ . Für  $m = 1$  oder  $n = 1$  folgt die Behauptung sofort aus Definition 2.5.1. Sei also  $m, n \geq 2$  und  $P \in \mathcal{E}(\mathcal{I})$ . Ist  $P \in \mathcal{M}(\mathcal{I})$ , so gibt es  $(i_0, j_0) \in M(\mathcal{I})$  mit  $P \in \mathcal{M}_{i_0, j_0}(\mathcal{I})$ , das heißt

$$P|_{(I_1 \setminus \{i_0\}) \times I_2} \in \mathcal{E}(\mathcal{I}_M^{i_0, j_0}) \text{ und } p_{i_0, j} = \begin{cases} 0 & \text{für } j \neq j_0, \\ r_{i_0} & \text{für } j = j_0. \end{cases}$$

Per Induktion ist  $P|_{(I_1 \setminus \{i_0\}) \times I_2} \in \mathcal{D}(\mathcal{I}_M^{i_0, j_0})$ , das heißt

$$(2.58) \quad \begin{aligned} \forall_{i \in I_1} \sum_{j \in I_2} p_{i, j} &= \begin{cases} (r_M^{i_0})_i = r_i & \text{für } i \neq i_0, \\ r_{i_0} & \text{für } i = i_0, \end{cases} \\ \forall_{j \in I_2} \sum_{i \in I_1} p_{i, j} &= p_{i_0, j} + \sum_{i \in I_1 \setminus \{i_0\}} p_{i, j} = \begin{cases} (s_M^{j_0})_j = s_j & \text{für } j \neq j_0, \\ (s_M^{j_0})_{j_0} + r_{i_0} = s_{j_0} & \text{für } j = j_0, \end{cases} \end{aligned}$$

also  $P \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$ . Eine analoge Rechnung zeigt, daß  $P \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$  auch für  $P \in \mathcal{N}(\mathcal{I})$  gilt. ■

**Lemma 2.5.4.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein endliches Randsystem und  $P \in \mathcal{E}(\mathcal{I})$ . Dann ist  $\# \text{supp}(P) \leq m + n - 1$ .

*Beweis.* Wieder erfolgt eine Induktion über  $m + n$ . Für  $m = 1$  ist  $\# \text{supp}(P) \leq n = n + m - 1$ , für  $n = 1$  ist  $\# \text{supp}(P) \leq m = m + n - 1$ . Sei nun  $m, n \geq 2$  und  $P \in \mathcal{E}(\mathcal{I})$ . Angenommen  $P \in \mathcal{M}_{i_0, j_0}(\mathcal{I})$ ,  $(i_0, j_0) \in M(\mathcal{I})$ . Es gilt

$$\# \text{supp}(P) = \# \text{supp}(P|_{(I_1 \setminus \{i_0\}) \times I_2}) + 1 \stackrel{\text{(Induktion)}}{\leq} m - 1 + n - 1 + 1 = m + n - 1.$$

Ist hingegen  $P \in \mathcal{N}_{i_0, j_0}(\mathcal{I})$ ,  $(i_0, j_0) \in N(\mathcal{I})$ , so ist

$$\begin{aligned} \# \text{supp}(P) &= \# \text{supp}(P|_{I_1 \times (I_2 \setminus \{j_0\})}) + 1 \stackrel{\text{(Induktion)}}{\leq} m + n - 1 - 1 + 1 \\ &= m + n - 1. \end{aligned}$$

■

**Lemma 2.5.5.** Ist  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein endliches Randsystem, so ist  $\mathcal{E}(\mathcal{I}) = \mathbb{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ .

*Beweis.* Der Beweis erfolgt erneut durch Induktion über  $m + n$ . Für  $m = 1$  oder  $n = 1$  ist nichts zu zeigen. Seien also  $m, n \geq 2$ .

„ $\supseteq$ “: Sei  $P \in \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ . Nach Korollar 2.2.9 hat  $P$  eine Linie mit höchstens einem positiven Element. Angenommen, es handelt sich dabei um die  $i_0$ -te Zeile (der Fall, daß es sich um die  $j_0$ -te Spalte handelt, geht völlig analog). Setze  $Q := P|_{(I_1 \setminus \{i_0\}) \times I_2}$ ,  $\tilde{\mathcal{I}} := \mathcal{I}(Q)$ . Nach Lemma 2.1.14 ist dann  $Q \in \mathbf{E}(\mathcal{D}(\tilde{\mathcal{I}}))$ . Per Induktion ist dann  $Q \in \mathcal{E}(\tilde{\mathcal{I}})$ , und es folgt (beachte dazu  $(i_0, j_0) \in M(\mathcal{I})$  wegen  $p_{i_0, j_0} = r_{i_0}$ )  $P \in \mathcal{M}_{i_0, j_0}(\mathcal{I})$ , das heißt  $P \in \mathcal{E}(\mathcal{I})$ .

„ $\subseteq$ “: Sei nun  $P \in \mathcal{E}(\mathcal{I})$ ,  $P = \frac{1}{2}P^{(1)} + \frac{1}{2}P^{(2)}$  und  $P^{(1)}, P^{(2)} \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$ . Angenommen  $P \in \mathcal{M}_{i_0, j_0}(\mathcal{I})$ ,  $(i_0, j_0) \in M(\mathcal{I})$ . Sei  $Q := P|_{(I_1 \setminus \{i_0\}) \times I_2}$ , und für  $k = 1, 2$  sei  $Q^{(k)} := P^{(k)}|_{(I_1 \setminus \{i_0\}) \times I_2}$ . Dann gilt  $Q = \frac{1}{2}Q^{(1)} + \frac{1}{2}Q^{(2)}$ . Sei  $\tilde{\mathcal{I}} := \mathcal{I}(Q)$ . Per Induktion ist  $Q \in \mathbf{E}(\mathcal{D}(\tilde{\mathcal{I}}))$ , das heißt  $Q^{(1)} = Q^{(2)} = Q$ . Wegen  $P, P^{(1)}, P^{(2)} \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$  folgt daraus auch  $P|_{\{i_0\} \times I_2} = P^{(1)}|_{\{i_0\} \times I_2} = P^{(2)}|_{\{i_0\} \times I_2}$ , das heißt  $P = P^{(1)} = P^{(2)}$ . Also ist  $P \in \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ . Ein völlig analoges Argument zeigt  $P \in \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$  auch für  $P \in \mathcal{N}_{i_0, j_0}(\mathcal{I})$ ,  $(i_0, j_0) \in N(\mathcal{I})$ . ■

**Lemma 2.5.6.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein endliches Randsystem und  $P \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$ . Dann ist  $P \in \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$  genau dann, wenn jede Submatrix  $Q$  von  $P$  eine Linie mit höchstens einem positiven Element enthält.

*Beweis.* „ $\Rightarrow$ “ folgt aus Korollar 2.2.9 und Lemma 2.1.14. Der Beweis von „ $\Leftarrow$ “ ist wiederum eine Induktion über  $m + n$ . Für  $m = 1$  oder  $n = 1$  ist nichts zu beweisen. Sei nun  $m, n \geq 2$ . Nach Voraussetzung hat  $P$  eine Linie mit höchstens einem positiven Element. Angenommen, es handelt sich um die  $i_0$ -te Zeile (der Fall, daß es sich um die  $j_0$ -te Spalte handelt, geht dann wieder analog). Wähle  $j_0$  so, daß  $\forall_{j \in I_2 \setminus \{j_0\}} p_{i_0, j} = 0$ . Sei  $Q := P|_{(I_1 \setminus \{i_0\}) \times I_2}$ . Da jede Submatrix von  $Q$  auch eine Submatrix von  $P$  ist, enthält jede Submatrix von  $Q$  eine Linie mit höchstens einem positiven Element. Per Induktion ist dann  $Q \in \mathcal{E}(\mathcal{I}_M^{i_0, j_0})$  (beachte dazu, daß  $(i_0, j_0) \in M(\mathcal{I})$ , da  $p_{i_0, j_0} = r_{i_0}$ ). Also ist  $P \in \mathcal{M}_{i_0, j_0}(\mathcal{I})$  und damit  $P \in \mathcal{E}(\mathcal{I}) = \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ . ■

**Korollar 2.5.7.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein endliches Randsystem und  $P \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$ . Dann ist  $P \in \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$  genau dann, wenn für jede Submatrix  $Q$  von  $P$  mit  $\tilde{m}$  Zeilen und  $\tilde{n}$  Spalten gilt, daß  $\# \text{supp}(Q) \leq \tilde{m} + \tilde{n} - 1$ .

*Beweis.* „ $\Rightarrow$ “: Sei  $P \in \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$  und  $\tilde{\mathcal{I}} := \mathcal{I}(Q)$ . Dann ist  $Q \in \mathbf{E}(\mathcal{D}(\tilde{\mathcal{I}}))$ , das heißt  $Q \in \mathcal{E}(\tilde{\mathcal{I}})$  und damit  $\# \text{supp}(Q) \leq \tilde{m} + \tilde{n} - 1$ .

„ $\Leftarrow$ “: Aus  $\# \text{supp}(Q) \leq \tilde{m} + \tilde{n} - 1$  folgt, daß  $Q$  eine Linie mit höchstens einem positiven Element besitzt, denn andernfalls wäre  $\# \text{supp}(Q) \geq 2 \max(\tilde{m}, \tilde{n}) \geq \tilde{m} + \tilde{n} > \tilde{m} + \tilde{n} - 1$ . Nach Lemma 2.5.6 ist dann  $P \in \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ . ■

Die folgende Definition 2.5.8 dient dazu, extremale Matrizen durch Permutation der Zeilen und Spalten in einfache Formen zu bringen.

**Definition 2.5.8.** Sei  $I_1 = \{1, \dots, m\}$ ,  $I_2 = \{1, \dots, n\}$ ,  $P \in \mathcal{M}_{\mathbb{R}}(I_1, I_2)$ .

(a)  $P$  ist eine *obere Dreiecksmatrix* (upper triangular matrix) genau dann, wenn

$$(2.59) \quad (m \leq n \text{ und } \forall_{\substack{(i,j) \in I_1 \times I_2 \\ i > j}} p_{i,j} = 0) \text{ oder } (m > n \text{ und } \forall_{\substack{(i,j) \in I_2^2 \\ i > j}} p_{i+m-n,j} = 0).$$

Die Menge der oberen Dreiecksmatrizen bezeichne mit  $\text{UT}(m, n)$ .

(b)  $P$  ist eine *untere Dreiecksmatrix* (lower triangular matrix) genau dann, wenn

$$(2.60) \quad (m \leq n \text{ und } \forall_{\substack{(i,j) \in I_1^2 \\ i < j}} p_{i,j+n-m} = 0) \text{ oder } (m > n \text{ und } \forall_{\substack{(i,j) \in I_1 \times I_2 \\ i < j}} p_{i,j} = 0).$$

Die Menge der unteren Dreiecksmatrizen bezeichne mit  $\text{LT}(m, n)$ .

**Beispiel 2.5.9.** (a) Die folgenden Matrizen sind obere Dreiecksmatrizen:

$$(2.61) \quad \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \\ 1 \\ 1 \\ 1 \end{pmatrix}, (1 \ 1 \ 1 \ 1 \ 1), \begin{pmatrix} 1 & 1 \\ 1 & 1 \\ 0 & 1 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 1 & 1 & 1 & 1 & 1 \\ 0 & 1 & 1 & 1 & 1 \end{pmatrix}.$$

(b) Die folgenden Matrizen sind untere Dreiecksmatrizen:

$$(2.62) \quad \begin{pmatrix} 1 \\ 1 \\ 1 \\ 1 \\ 1 \end{pmatrix}, (1 \ 1 \ 1 \ 1 \ 1), \begin{pmatrix} 1 & 0 \\ 1 & 1 \\ 1 & 1 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 1 & 1 & 1 & 1 & 0 \\ 1 & 1 & 1 & 1 & 1 \end{pmatrix}.$$

**Lemma 2.5.10.** Sei  $I_1 = \{1, \dots, m\}$ ,  $I_2 = \{1, \dots, n\}$ ,  $P \in \mathcal{M}_{\mathbb{R}}(I_1, I_2)$ . Dann gilt:  $P \in \text{LT}(m, n) \Leftrightarrow P^t \in \text{UT}(n, m)$  (dabei ist  $P^t := (p_{j,i})_{(i,j) \in I_1 \times I_2}$  die zu  $P$  transponierte Matrix).

*Beweis.* „ $\Rightarrow$ “: Ist  $m < n$ , so gilt  $m^t = n > n^t = m$ . Dann ist  $\forall_{\substack{(j,i) \in I_1^2 \\ j > i}} p_{j+m^t-n^t,i}^t = p_{i,j+n-m} = 0$ . Ist  $m \geq n$ , so gilt  $m^t \leq n = n^t = m$  und  $\forall_{\substack{(j,i) \in I_2 \times I_1 \\ j > i}} p_{j,i}^t = p_{i,j} = 0$ . „ $\Leftarrow$ “ folgt durch eine ganz analoge Rechnung. ■

**Definition 2.5.11.** Sei  $I$  eine endliche Menge und  $P \in \mathcal{M}_{\mathbb{R}}(I, I)$ . Dann definiere  $(\Sigma := \Sigma(I))$  sei die Menge der Permutationen von  $I$

$$(2.63) \quad \text{per}(P) := \sum_{\sigma \in \Sigma} \prod_{i \in I} p_{i, \sigma(i)}.$$

$\text{per}(P)$  nennt man die *Permanente* von  $P$ .

**Lemma 2.5.12.** Für eine endliche Menge  $I$  und  $P, Q \in \mathcal{M}_{\mathbb{R}_0^+}(I, I)$  gilt  $\text{per}(P) + \text{per}(Q) \leq \text{per}(P + Q)$ .

*Beweis.* Seien  $P, Q \in \mathcal{M}_{\mathbb{R}_0^+}(I, I)$ ,  $\Sigma := \Sigma(I)$ . Dann ist

$$\begin{aligned} \text{per}(P + Q) &= \sum_{\sigma \in \Sigma} \prod_{i \in I} (p + q)_{i, \sigma(i)} = \sum_{\sigma \in \Sigma} \prod_{i \in I} (p_{i, \sigma(i)} + q_{i, \sigma(i)}) \\ &\geq \sum_{\sigma \in \Sigma} \prod_{i \in I} p_{i, \sigma(i)} + \sum_{\sigma \in \Sigma} \prod_{i \in I} q_{i, \sigma(i)} = \text{per}(P) + \text{per}(Q). \end{aligned}$$

■

**Lemma 2.5.13.** Ist  $I$  eine endliche Menge und  $P \in \mathcal{M}_p(I)$ , so ist  $\text{per}(P) = 1$ .

*Beweis.* Das folgt sofort aus Definition 2.5.11, wenn man beachtet, daß für  $P \in \mathcal{M}_p(I)$  genau ein  $\sigma \in \Sigma(I)$  existiert, so daß  $\forall_{i \in I} p_{i, \sigma(i)} \neq 0$ , und daß für dieses  $\sigma$ ,  $\forall_{i \in I} p_{i, \sigma(i)} = 1$ . ■

**Lemma 2.5.14.** Ist  $I = \{1, \dots, m\}$ ,  $P \in \mathcal{M}_{\mathbb{R}}(I, I)$  und  $P \in \text{UT}(m, m)$  oder  $P \in \text{LT}(m, m)$ , so ist  $\text{per}(P) = \prod_{i=1}^m p_{i, i}$ .

*Beweis.* Die Behauptung folgt sofort aus Definition 2.5.11, da es für  $\text{Id} \neq \sigma \in \Sigma(I)$  immer  $i, j \in I$  gibt, so daß  $i < \sigma(i)$  und  $j > \sigma(j)$ . Ist  $P \in \text{UT}(m, m)$ , so ist  $p_{j, \sigma(j)} = 0$ , ist  $P \in \text{LT}(m, m)$ , so ist  $p_{i, \sigma(i)} = 0$ . ■

**Satz 2.5.15.** Ist  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein endliches Randsystem und  $P \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$ , so sind die folgenden Aussagen (i) bis (xii) äquivalent (für eine Submatrix  $Q$  von  $P$  sei  $\tilde{\mathcal{I}} := (\tilde{I}_1, \tilde{I}_2, \tilde{r}, \tilde{s}) := \mathcal{I}(Q)$ ):

- (i)  $P \in \text{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ .
- (ii)  $P \in \mathcal{E}(\mathcal{I})$ .
- (iii)  $G(P)$  ist ein Wald.
- (iv) Für jede Submatrix  $Q$  von  $P$  gilt  $Q \in \text{E}(\mathcal{D}(\tilde{\mathcal{I}}))$ .

- (v) Jede Submatrix  $Q$  von  $P$  hat eine Linie mit höchstens einem positiven Element.
- (vi) Für jede Submatrix  $Q$  von  $P$  mit  $\tilde{m}$  Zeilen und  $\tilde{n}$  Spalten gilt  $\# \text{supp}(Q) \leq \tilde{m} + \tilde{n} - 1$ .
- (vii) Für jede Submatrix  $Q$  von  $P$  mit  $\tilde{m}$  Zeilen und  $\tilde{n}$  Spalten gibt es Bijektionen

$$\sigma_U, \sigma_L : \tilde{I}_1 \longrightarrow \{1, \dots, \tilde{m}\},$$

$$\tau_U, \tau_L : \tilde{I}_2 \longrightarrow \{1, \dots, \tilde{n}\},$$

so daß  $\tilde{P}^U = (\tilde{p}_{i,j}^U)_{(i,j) \in \{1, \dots, \tilde{m}\} \times \{1, \dots, \tilde{n}\}} \in \text{UT}(\tilde{m}, \tilde{n})$  mit  $\tilde{p}_{i,j}^U = p_{\sigma_U^{-1}(i), \tau_U^{-1}(j)}$  und  $\tilde{P}^L = (\tilde{p}_{i,j}^L)_{(i,j) \in \{1, \dots, \tilde{m}\} \times \{1, \dots, \tilde{n}\}} \in \text{LT}(\tilde{m}, \tilde{n})$  mit  $\tilde{p}_{i,j}^L = p_{\sigma_L^{-1}(i), \tau_L^{-1}(j)}$ .

- (viii) Es gibt keine quadratische Submatrix  $Q$  von  $P$ , so daß  $S(Q) = P_1 + P_2$  mit  $P_1, P_2 \in \mathcal{M}_p(\tilde{I}_1, \tilde{I}_2)$  (für die Definition von  $S(Q)$  siehe 2.1.3 (c)).
- (ix) Für jede quadratische Submatrix  $Q$  von  $P$  ist  $\text{per}(S(Q)) \leq 1$ .
- (x) ( $\tilde{P} \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$  und  $\text{supp}(\tilde{P}) \subseteq \text{supp}(P)$ )  $\Rightarrow \tilde{P} = P$ .
- (xi) Ist  $Q$  eine Submatrix von  $P$ , so gilt ( $\tilde{Q} \in \mathcal{D}(\tilde{\mathcal{I}})$  und  $\text{supp}(\tilde{Q}) \subseteq \text{supp}(Q)$ )  $\Rightarrow \tilde{Q} = Q$ .
- (xii) Ist  $Q$  eine quadratische Submatrix von  $P$ , so gibt es  $(i_0, j_0) \in \tilde{I}_1 \times \tilde{I}_2$ , so daß die  $i_0$ -te Zeile und die  $j_0$ -te Spalte von  $Q$  jeweils höchstens ein positives Element enthalten.

*Beweis.* Die Äquivalenz der Aussagen (i) bis (vi) wurde bereits bewiesen (siehe Lemma 2.5.5, Lemma 2.1.14, Lemma 2.5.6, Korollar 2.5.7 und Satz 2.2.6). Zum Beweis des Satzes werden nun folgende Implikationen gezeigt:

$$(ii) \Rightarrow (vii) \Rightarrow (ix) \Rightarrow (viii) \Rightarrow (iii), \quad (vi) \Rightarrow (xii) \Rightarrow (v), \quad (i) \Rightarrow (xi) \Rightarrow (x) \Rightarrow (i).$$

„(i) $\Rightarrow$ (vii)“: Wegen (iv) kann man ohne Beschränkung der Allgemeinheit annehmen, daß  $P = Q$ . Der Beweis erfolgt nun durch Induktion über  $m + n$ . Für  $m = 1$  oder  $n = 1$  kann man für  $\sigma_U$  und  $\sigma_L$  beziehungsweise  $\tau_U$  und  $\tau_L$  jede Bijektion  $\sigma : I_1 \longrightarrow \{1, \dots, m\}$  beziehungsweise  $\tau : I_2 \longrightarrow \{1, \dots, n\}$  wählen. Sei nun  $m, n \geq 2$ . Zunächst sollen  $\sigma_U, \tau_U$  konstruiert werden. Angenommen  $P \in \mathcal{M}_{i_0, j_0}(\mathcal{I})$ ,  $(i_0, j_0) \in M(\mathcal{I})$ . Sei  $Q := P|_{(I_1 \setminus \{i_0\}) \times (I_2 \setminus \{j_0\})}$ ,  $\tilde{\mathcal{I}} := (I_1 \setminus \{i_0\}, I_2 \setminus \{j_0\}, \tilde{r}, \tilde{s}) := \mathcal{I}(Q)$ . Dann ist  $Q \in \mathcal{E}(\tilde{\mathcal{I}})$ , daß heißt, per Induktion gibt es  $\tilde{\sigma}_U : I_1 \setminus \{i_0\} \longrightarrow \{1, \dots, m-1\}$ ,  $\tilde{\tau}_U : I_2 \setminus \{j_0\} \longrightarrow \{1, \dots, n-1\}$ ,

so daß  $(q_{\tilde{\sigma}_U^{-1}(i), \tilde{\tau}_U^{-1}(j)})_{(i,j) \in \{1, \dots, m-1\} \times \{1, \dots, n-1\}} \in \text{UT}(m-1, n-1)$  ist. Definiere  $\sigma_U : I_1 \rightarrow \{1, \dots, m\}$  und  $\tau_U : I_2 \rightarrow \{1, \dots, n\}$  durch

$$(2.64) \quad \sigma_U(i) := \begin{cases} \tilde{\sigma}_U(i) & \text{für } i \neq i_0, \\ m & \text{für } i = i_0, \end{cases} \quad \tau_U(j) := \begin{cases} \tilde{\tau}_U(j) & \text{für } j \neq j_0, \\ n & \text{für } j = j_0. \end{cases}$$

Angenommen, es ist  $m \leq n$ . Zu zeigen ist dann  $i > j \Rightarrow p_{\sigma_U^{-1}(i), \tau_U^{-1}(j)} = 0$ . Für  $i < m$ ,  $j < n$  gilt  $p_{\sigma_U^{-1}(i), \tau_U^{-1}(j)} = p_{\tilde{\sigma}_U^{-1}(i), \tilde{\tau}_U^{-1}(j)} = 0$ , für  $j = n$  ist immer  $i \leq j$ , und für  $i = m$ ,  $j < n$  ist immer  $p_{\sigma_U^{-1}(i), \tau_U^{-1}(j)} = 0$ . Ist hingegen  $m > n$ , so ist zu zeigen, daß für  $1 \leq i, j \leq n$ ,  $i > j \Rightarrow p_{\sigma_U^{-1}(i+m-n), \tau_U^{-1}(j)} = 0$ . Ist  $j = n$ , so ist immer  $i \leq j$ . Sei also  $j \leq n-1$ . Dann ist für  $i < n$   $p_{\sigma_U^{-1}(i+m-n), \tau_U^{-1}(j)} = p_{\tilde{\sigma}_U^{-1}(i+m-1-(n-1)), \tilde{\tau}_U^{-1}(j)} = 0$  und für  $i = n$ ,  $p_{\sigma_U^{-1}(i+m-n), \tau_U^{-1}(j)} = p_{i_0, \tau_U^{-1}(j)} = 0$ .

Nun nehme man an, daß  $P \in \mathcal{N}_{i_0, j_0}(\mathcal{I})$ ,  $(i_0, j_0) \in N(\mathcal{I})$ . Es seien  $\tilde{\sigma}_U, \tilde{\tau}_U$  wie oben. Definiere  $\sigma_U : I_1 \rightarrow \{1, \dots, m\}$  und  $\tau_U : I_2 \rightarrow \{1, \dots, n\}$  durch

$$(2.65) \quad \sigma_U(i) := \begin{cases} \tilde{\sigma}_U(i) + 1 & \text{für } i \neq i_0, \\ 1 & \text{für } i = i_0, \end{cases} \quad \tau_U(j) := \begin{cases} \tilde{\tau}_U(j) + 1 & \text{für } j \neq j_0, \\ 1 & \text{für } j = j_0. \end{cases}$$

Angenommen, es ist  $m \leq n$ . Zu zeigen ist dann wiederum  $i > j \Rightarrow p_{\sigma_U^{-1}(i), \tau_U^{-1}(j)} = 0$ . Für  $i > 1$ ,  $j > 1$  gilt  $p_{\sigma_U^{-1}(i), \tau_U^{-1}(j)} = p_{\tilde{\sigma}_U^{-1}(i-1), \tilde{\tau}_U^{-1}(j-1)} = 0$ , für  $i = 1$  ist immer  $i \leq j$ , und für  $j = 1$ ,  $i > 1$  ist immer  $p_{\sigma_U^{-1}(i), \tau_U^{-1}(j)} = 0$ . Ist hingegen  $m > n$ , so ist zu zeigen, daß für  $1 \leq i, j \leq n$ ,  $i > j \Rightarrow p_{\sigma_U^{-1}(i+m-n), \tau_U^{-1}(j)} = 0$ . Ist  $i = 1$ , so ist immer  $i \leq j$ . Sei also  $i > 1$ . Dann ist für  $j > 1$ ,  $p_{\sigma_U^{-1}(i+m-n), \tau_U^{-1}(j)} = p_{\tilde{\sigma}_U^{-1}(i-1+m-1-(n-1)), \tilde{\tau}_U^{-1}(j-1)} = 0$  und für  $j = 1$ ,  $p_{\sigma_U^{-1}(i+m-n), \tau_U^{-1}(j)} = p_{\tilde{\sigma}_U^{-1}(i-1+m-1-(n-1)), j_0} = 0$ .

Um  $\sigma_L$  und  $\tau_L$  zu konstruieren, kann man entweder eine analoge Konstruktion wie für  $\sigma_U$  und  $\tau_U$  durchführen oder, wie folgt, argumentieren: Wegen  $P \in \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$  ist  $P^t \in \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}^t))$  bezüglich des Randsystems  $\mathcal{I}^t := (I_2, I_1, s, r)$ . Also gibt es Bijektionen  $\sigma_L : I_1 \rightarrow \{1, \dots, m\}$ ,  $\tau_L : I_2 \rightarrow \{1, \dots, n\}$ , so daß  $\tilde{P}^U = (\tilde{p}_{j,i}^U)_{(i,j) \in \{1, \dots, m\} \times \{1, \dots, n\}} \in \text{UT}(n, m)$  mit  $\tilde{p}_{j,i}^U = p_{\tau_L^{-1}(j), \sigma_L^{-1}(i)}$ . Nach Lemma 2.5.10 ist dann  $(\tilde{P}^U)^t = (p_{\sigma_L^{-1}(i), \tau_L^{-1}(j)})_{(i,j) \in \{1, \dots, m\} \times \{1, \dots, n\}} \in \text{LT}(m, n)$ .

„(vii) $\Rightarrow$ (ix)“: Sei also  $Q$  eine quadratische Submatrix von  $P$  und  $\sigma_U, \tau_U, \tilde{P}^U$  wie in (vii). Dann ist (setze  $\tilde{Q} := S(Q)$ ,  $\tilde{P} := S(\tilde{P}^U)$  und  $\Sigma := \Sigma(\tilde{I}_1)$ )

$$(2.66) \quad \begin{aligned} \text{per}(\tilde{Q}) &= \sum_{\sigma \in \Sigma} \prod_{i \in \tilde{I}_1} \tilde{q}_{i, \sigma(i)} \stackrel{(*)}{=} \sum_{\tau \in \Sigma_{\tilde{m}}} \prod_{\mu \in \{1, \dots, \tilde{m}\}} \tilde{q}_{\sigma_U^{-1}(\mu), \tau_U^{-1}(\tau(\mu))} \\ &= \sum_{\tau \in \Sigma_{\tilde{m}}} \prod_{\mu \in \{1, \dots, \tilde{m}\}} \tilde{p}_{\mu, \tau(\mu)} \stackrel{(2.5.14)}{\leq} 1. \end{aligned}$$

Zum Beweis der Gleichheit bei „(\*)“, setze man  $i = \sigma_U^{-1}(\mu)$  und  $\sigma = \tau_U^{-1} \tau \sigma_U$  und beachte, daß  $\mu$  die Menge  $\{1, \dots, \tilde{m}\}$  genau dann durchläuft, wenn  $\sigma_U^{-1}(\mu)$  die

Menge  $\tilde{I}_1$  durchläuft, und  $\tau$  die Menge  $\Sigma_{\tilde{m}}$  genau dann durchläuft, wenn  $\tau_U^{-1}\tau\sigma_U$  die Menge  $\Sigma$  durchläuft.

„(ix) $\Rightarrow$ (viii)“: Angenommen, es gibt eine quadratische Submatrix  $Q$  von  $P$  mit  $S(Q) = P_1 + P_2$  und  $P_1, P_2 \in \mathcal{M}_p(\tilde{I}_1, \tilde{I}_2)$ . Dann ist nach den Lemmata 2.5.12 und 2.5.13  $\text{per}(S(Q)) = \text{per}(P_1 + P_2) \geq \text{per}(P_1) + \text{per}(P_2) = 2$ .

„(viii) $\Rightarrow$ (iii)“: Angenommen,  $G(P)$  ist kein Wald. Dann sei  $K := (x_{i_1}, y_{j_1}, \dots, x_{i_k}, y_{j_k})$  ein kürzester Kreis in  $G(P)$ . Da  $G(P)$  bipartit ist, ist  $\#V(K)$  gerade. Setze  $\tilde{I}_1 := \{i_1, \dots, i_k\}$ ,  $\tilde{I}_2 := \{j_1, \dots, j_k\}$ ,  $Q := P|_{\tilde{I}_1 \times \tilde{I}_2}$ . Dann ist  $K = G(Q)$ , denn sonst gäbe es  $\mu, \nu \in \{1, \dots, k\}$  mit  $\{x_{i_\mu}, y_{j_\nu}\} \in E(G(P)) \setminus E(K)$ , das heißt, es wäre  $\nu > \mu$  mit  $(i_\mu, j_\nu) \neq (i_1, j_k)$  oder  $\nu + 1 < \mu$ . Im ersten Fall wäre  $(x_{i_1}, y_{j_1}, \dots, x_{i_{\mu-1}}, y_{j_{\mu-1}}, x_{i_\mu}, y_{j_\nu}, x_{i_{\nu+1}}, y_{j_{\nu+1}}, \dots, x_{i_k}, y_{j_k})$  ein Kreis in  $G(P)$ , kürzer als  $K$ , im zweiten Fall wäre  $(x_{i_1}, y_{j_1}, \dots, y_{j_{\nu-1}}, x_{i_\nu}, y_{j_\nu}, x_{i_\mu}, y_{j_\mu}, x_{i_{\mu+1}}, \dots, x_{i_k}, y_{j_k})$  ein Kreis in  $G(P)$ , kürzer als  $K$ , im Widerspruch zur Annahme, daß  $K$  ein kürzester Kreis in  $G(P)$  ist. Nun definiere  $P^{(1)} = (p_{i,j}^{(1)})_{(i,j) \in \tilde{I}_1 \times \tilde{I}_2}$  und  $P^{(2)} = (p_{i,j}^{(2)})_{(i,j) \in \tilde{I}_1 \times \tilde{I}_2}$  durch

$$(2.67) \quad p_{i,j}^{(1)} := \begin{cases} 1 & \text{für } (i, j) = (i_\mu, j_\mu), \mu \in \{1, \dots, k\}, \\ 0 & \text{sonst,} \end{cases}$$

$$p_{i,j}^{(2)} := \begin{cases} 1 & \text{für } (i, j) = (i_1, j_k), \\ 1 & \text{für } (i, j) = (i_{\mu+1}, j_\mu), \mu \in \{1, \dots, k-1\}, \\ 0 & \text{sonst.} \end{cases}$$

$P^{(1)}$  und  $P^{(2)}$  haben dann in jeder Linie genau eine Eins, das heißt  $P^{(1)}, P^{(2)} \in \mathcal{M}_p(\tilde{I}_1, \tilde{I}_2)$ . Wegen  $E(G(K)) = E(G(P^{(1)})) \cup E(G(P^{(2)}))$  und  $K = G(Q)$  gilt nun  $S(Q) = P^{(1)} + P^{(2)}$ .

„(vi) $\Rightarrow$ (xii)“: Es ist zu zeigen, daß jede quadratische Submatrix  $Q$  von  $P$  je eine Zeile und eine Spalte mit höchstens einem positiven Element besitzt. Hätte jede Zeile (Spalte) von  $Q$  mindestens zwei positive Elemente, so wäre  $\# \text{supp}(Q) \geq 2 \#\tilde{I}_1 > 2 \#\tilde{I}_1 - 1$ .

„(xii) $\Rightarrow$ (v)“: Es ist nur zu bemerken, daß jede Submatrix mit  $\tilde{m}$  Zeilen und  $\tilde{n}$  Spalten eine quadratische Submatrix mit  $\min(\tilde{m}, \tilde{n})$  Zeilen und Spalten hat.

„(i) $\Rightarrow$ (xi)“: Wegen (iv) kann man ohne Beschränkung der Allgemeinheit annehmen, daß  $P = Q$ , das heißt es genügt (x) zu zeigen. Das gilt aber wegen Satz 2.4.16.

„(xi) $\Rightarrow$ (x)“: (x) ist ein Spezialfall von (xi).

„(x) $\Rightarrow$ (i)“: Das wurde in Lemma 2.4.15 allgemein bewiesen. ■

In Analogie zu Satz 2.4.11 wird im folgenden Satz 2.5.17 gezeigt, daß für endliche Randsysteme  $\mathcal{I}$  die Einträge einer extremalen Matrix  $P$  in  $\mathcal{G}(\mathcal{I})$  liegen, selbst

wenn  $\mathcal{G}(\mathcal{I})$  nicht abgeschlossen ist. Mit Hilfe von Lemma 2.5.16 kann sogar noch eine etwas schärfere Aussage gewonnen werden. Beispiel 2.5.18 liefert ein endliches Randsystem  $\mathcal{I}$ , so daß  $\mathcal{G}(\mathcal{I})$  nicht abgeschlossen ist.

**Lemma 2.5.16.** Ist  $(\mathcal{G}, \cdot)$  eine Gruppe und  $M \subseteq \mathcal{G}$ . Dann ist

$$(2.68) \quad \langle M \rangle = \bigcup_{n=0}^{\infty} D_n,$$

wobei die  $D_n = D_n(M)$  rekursiv definiert sind durch

$$(2.69) \quad D_0 := M \cup \{g^{-1} : g \in M\}, \quad D_{n+1} := D_n \cup \{gh : g, h \in D_n\}.$$

Insbesondere gilt dann

$$(2.70) \quad \#\langle M \rangle \leq \omega \cdot \#M.$$

*Beweis.* Es ist nur (2.68) zu beweisen. „ $\supseteq$ “ folgt, da eine Induktion zeigt, daß  $D_n \subseteq \langle M \rangle$  für alle  $n \in \mathbb{N}$ . Um „ $\subseteq$ “ zu zeigen, genügt es, zu sehen, daß  $\bigcup_{n=0}^{\infty} D_n$  eine Untergruppe von  $\mathcal{G}$  ist. Dazu bemerke, daß, da die  $D_n$  aufsteigend sind, für  $g, h \in \bigcup_{n=0}^{\infty} D_n$  ein  $n \in \mathbb{N}$  existiert, so daß  $g, h \in D_n$ . Nach (2.69) ist dann  $gh \in D_{n+1} \subseteq \bigcup_{n=0}^{\infty} D_n$ . Schließlich folgt durch eine Induktion, daß

$$(2.71) \quad \forall_{n \in \mathbb{N}} g \in D_n \Rightarrow g^{-1} \in D_n.$$

Damit ist alles gezeigt. ■

**Satz 2.5.17.** Ist  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein endliches Randsystem,  $k := \max\{0, m + n - 3\}$  und  $P \in \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ , so folgt mit  $M := \{r_i : i \in I_1\} \cup \{s_j : j \in I_2\}$ , daß  $P \in \mathcal{M}_{D_k}(I_1, I_2)$ , wobei  $D_k$  wie in (2.69) definiert ist ( $M$  ist hier allerdings, als Teilmenge der additiven Gruppe auf  $\mathbb{R}$  aufzufassen). Insbesondere sind also alle Einträge von  $P$  in  $\mathcal{G}(P)$ .

*Beweis.* Induktion über  $m + n$ : Ist  $m = 1$  oder  $n = 1$ , so ist nichts zu zeigen. Sei also  $m, n \geq 2$ . Für den Induktionsschritt benutze man, daß  $P \in \mathcal{E}(\mathcal{I})$ . Per Induktion gilt mit

$$(2.72) \quad \begin{aligned} M_M^{i_0, j_0} &:= \{r_i : i \in I_1 \setminus \{i_0\}\} \cup \{(s_M^{j_0})_j : j \in I_2\} \text{ und} \\ M_N^{i_0, j_0} &:= \{(r_N^{i_0})_i : i \in I_1\} \cup \{s_j : j \in I_2 \setminus \{j_0\}\} : \end{aligned}$$

$$(2.73) \quad \begin{aligned} \forall_{(i_0, j_0) \in M(\mathcal{I})} P \in \mathcal{M}_{i_0, j_0}(\mathcal{I}) &\Rightarrow P \in \mathcal{M}_{D_{k-1}(M_M^{i_0, j_0})}(I_1, I_2), \\ \forall_{(i_0, j_0) \in N(\mathcal{I})} P \in \mathcal{N}_{i_0, j_0}(\mathcal{I}) &\Rightarrow P \in \mathcal{N}_{D_{k-1}(M_N^{i_0, j_0})}(I_1, I_2). \end{aligned}$$

Damit ist alles gezeigt, denn es gilt für alle  $k \in \mathbb{N}$ , daß  $D_{k-1}(M_M^{i_0, j_0}) \subseteq D_k(M)$  und  $D_{k-1}(M_N^{i_0, j_0}) \subseteq D_k(M)$  (für  $k = 1$  folgt das sofort aus (2.69) und (2.72); für  $k > 1$  durch eine Induktion, da das Bilden von  $D_n$ ,  $n \in \mathbb{N}$ , Inklusionen erhält). ■



**Beispiel 2.5.18.** Für das Randsystem  $\mathcal{I} := (\{1, 2\}, \{1, 2\}, (1, \sqrt{2}), (1, \sqrt{2}))$  ist  $\mathcal{G} := \mathcal{G}(\mathcal{I})$  nicht abgeschlossen. Nach (2.70) ist  $\mathcal{G}$  abzählbar. Daher genügt es wegen Lemma 2.4.9 zu zeigen, daß  $\mathcal{G} \neq t\mathbb{Z}$  für alle  $t \in \mathbb{R}_0^+$ . Das ist aber klar, denn je nachdem, ob  $t$  rational oder irrational ist, sind alle Elemente von  $t\mathbb{Z} \setminus \{0\}$  rational oder irrational.  $\mathcal{G} \setminus \{0\}$  hingegen enthält sowohl rationale wie irrationale Elemente.

Nun soll gezeigt werden, daß sich für endliche Randsysteme  $\mathcal{I}$  die Menge der Extrempunkte von  $\mathcal{D}(\leq \mathcal{I})$  aus  $\mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$  gewinnen läßt. Dazu wird in Definition 2.5.20 eine Menge  $\mathcal{E}(\leq \mathcal{I})$  definiert und in Lemma 2.5.22 gezeigt, daß dies gerade die Menge der Extrempunkte ist. Die Konstruktion stammt von BRUALDI (siehe [2]).

Um die formale Definition von  $\mathcal{E}(\leq \mathcal{I})$  durchsichtiger zu machen, soll das Verfahren zur Gewinnung der Elemente von  $\mathcal{E}(\leq \mathcal{I})$  wie bei der Konstruktion von  $\mathcal{E}(\mathcal{I})$  zunächst verbal beschrieben werden. Die Elemente von  $\mathcal{E}(\leq \mathcal{I})$  lassen sich aus den Elementen von  $\mathcal{E}(\mathcal{I})$  wie folgt gewinnen: Ist  $P \in \mathcal{E}(\mathcal{I})$ , so lösche man in jeder Zusammenhangskomponente von  $G(P)$  einen Teilbaum und ersetze die den gelöschten Ecken entsprechenden Einträge von  $P$  durch Nullen. Die entstandene Matrix ist ein Element von  $\mathcal{E}(\leq \mathcal{I})$ .

**Definition 2.5.19.** Gegeben sei ein Randsystem  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$ . Definiere  $S_r := \sum_{i \in I_1} r_i$ , sowie  $S_s := \sum_{j \in I_2} s_j$ . Ist  $P \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$ , so sei  $\mathcal{Z}(P) := \text{Zhk}(G(P))$ . Für  $H \in \mathcal{Z}(P)$  definiere  $\mathcal{T}(H) := \{T \leq H : T \text{ ist ein Baum}\} \cup \{(\emptyset, \emptyset)\}$ . Weiterhin sei  $\mathcal{F}(P)$  die Menge der Funktionen  $f$  auf  $\mathcal{Z}(P)$  mit  $\forall_{H \in \mathcal{Z}(P)} f(H) \in \mathcal{T}(H)$  (die Funktionen in  $\mathcal{F}(P)$  ordnen also jeder Zusammenhangskomponente von  $G(P)$  einen ihrer Teilbäume zu). Schließlich sei für  $f \in \mathcal{F}(P)$ ,

$$(2.74) \quad \mathcal{E}(f) := \{(i, j) \in I_1 \times I_2 : \{x_i, y_j\} \in \bigcup_{T \in f(\mathcal{Z}(P))} E(T)\}$$

und  $\mathcal{E}(P) := \{\mathcal{E}(f) : f \in \mathcal{F}(P)\}$ .

**Definition 2.5.20.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein endliches Randsystem. Für  $P \in \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$  und  $I \in \mathcal{E}(P)$  definiere  $P^I = (p_{i,j}^I)_{(i,j) \in I_1 \times I_2}$  durch

$$(2.75) \quad p_{i,j}^I := \begin{cases} 0 & \text{für } (i, j) \in I, \\ p_{i,j} & \text{sonst.} \end{cases}$$

Dann sei  $\mathcal{E}(\leq \mathcal{I}) := \{P^I : P \in \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I})), I \in \mathcal{E}(P)\}$ .

Wie schon Definition 2.5.1 soll auch Definition 2.5.20 zunächst an einem Beispiel demonstriert werden. Im folgenden Beispiel 2.5.21 wird dazu für das Randsystem  $\mathcal{I}$  aus Beispiel 2.5.2  $\mathcal{E}(\leq \mathcal{I})$  explizit berechnet.

**Beispiel 2.5.21.** Gegeben sei das Randsystem  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  mit  $I_1 := \{1, 2\}$ ,  $I_2 := \{1, 2, 3\}$ ,  $r := (2, 5)$ ,  $s := (1, 1, 5)$ . Nach Beispiel 2.5.2 ist

$$E(\mathcal{D}(\mathcal{I})) = \mathcal{E}(\mathcal{I}) = \{P_1, P_2, P_3, P_4\} \quad \text{mit}$$

$$P_1 := \begin{pmatrix} 0 & 0 & 2 \\ 1 & 1 & 3 \end{pmatrix}, \quad P_2 := \begin{pmatrix} 0 & 1 & 1 \\ 1 & 0 & 4 \end{pmatrix}, \quad P_3 := \begin{pmatrix} 1 & 0 & 1 \\ 0 & 1 & 4 \end{pmatrix}, \quad P_4 := \begin{pmatrix} 1 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 5 \end{pmatrix}.$$

$G(P_1)$ ,  $G(P_2)$  und  $G(P_3)$  haben alle nur eine Zusammenhangskomponente. Ersetzt man jeweils die Elemente, die Kanten eines Teilbaumes entsprechen, durch Nullen, so bekommt man die Mengen

$$E_1 := \left\{ \begin{pmatrix} 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 0 & 2 \\ 0 & 0 & 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 0 & 0 \\ 1 & 0 & 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 0 & 0 \\ 1 & 1 & 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 0 & 2 \\ 0 & 0 & 3 \end{pmatrix}, \right. \\ \left. \begin{pmatrix} 0 & 0 & 2 \\ 1 & 0 & 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 0 & 2 \\ 0 & 1 & 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 0 & 0 \\ 1 & 1 & 3 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 0 & 2 \\ 0 & 1 & 3 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 0 & 2 \\ 1 & 0 & 3 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 0 & 2 \\ 1 & 1 & 0 \end{pmatrix}, \right. \\ \left. \begin{pmatrix} 0 & 0 & 2 \\ 1 & 1 & 3 \end{pmatrix} \right\} \quad \text{aus } P_1,$$

$$E_2 := \left\{ \begin{pmatrix} 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 0 & 0 \\ 1 & 0 & 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 1 & 1 \\ 0 & 0 & 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 0 & 0 \\ 1 & 0 & 4 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 1 & 0 \\ 1 & 0 & 0 \end{pmatrix}, \right. \\ \left. \begin{pmatrix} 0 & 0 & 1 \\ 1 & 0 & 4 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 1 & 0 \\ 1 & 0 & 4 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 1 & 1 \\ 0 & 0 & 4 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 1 & 1 \\ 1 & 0 & 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 1 & 1 \\ 1 & 0 & 4 \end{pmatrix} \right\} \quad \text{aus } P_2,$$

$$E_3 := \left\{ \begin{pmatrix} 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 1 & 0 & 1 \\ 0 & 0 & 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 4 \end{pmatrix}, \right. \\ \left. \begin{pmatrix} 1 & 0 & 1 \\ 0 & 1 & 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 1 & 0 & 1 \\ 0 & 0 & 4 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 4 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 0 & 1 \\ 0 & 1 & 4 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 1 & 0 & 1 \\ 0 & 1 & 4 \end{pmatrix} \right\} \quad \text{aus } P_3.$$

$G(P_4)$  hat hingegen zwei Zusammenhangskomponenten. Hier wird also jeweils in jeder der beiden Zusammenhangskomponenten ein Teilbaum gelöscht, und die Elemente von  $P_4$ , die zu den gelöschten Kanten gehören, werden durch Nullen ersetzt. So bekommt man aus  $P_4$  die Menge

$$E_4 := \left\{ \begin{pmatrix} 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 1 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 5 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 5 \end{pmatrix}, \right. \\ \left. \begin{pmatrix} 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 5 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 1 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 5 \end{pmatrix} \right\}.$$

Wegen  $\mathcal{E}(\leq \mathcal{I}) = E_1 \cup E_2 \cup E_3 \cup E_4$  bekommt man damit insgesamt

$$\mathcal{E}(\leq \mathcal{I}) = \left\{ \begin{array}{l} \begin{pmatrix} 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 0 & 2 \\ 0 & 0 & 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 0 & 0 \\ 1 & 0 & 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 0 \end{pmatrix}, \\ \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 5 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 0 & 0 \\ 1 & 1 & 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 0 & 2 \\ 0 & 0 & 3 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 0 & 2 \\ 1 & 0 & 0 \end{pmatrix}, \\ \begin{pmatrix} 0 & 0 & 2 \\ 0 & 1 & 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 1 & 1 \\ 0 & 0 & 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 0 & 0 \\ 1 & 0 & 4 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 1 & 0 \\ 1 & 0 & 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 1 & 0 & 1 \\ 0 & 0 & 0 \end{pmatrix}, \\ \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 4 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 1 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 0 & 5 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 5 \end{pmatrix}, \\ \begin{pmatrix} 0 & 0 & 0 \\ 1 & 1 & 3 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 0 & 2 \\ 0 & 1 & 3 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 0 & 2 \\ 1 & 0 & 3 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 0 & 2 \\ 1 & 1 & 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 0 & 1 \\ 1 & 0 & 4 \end{pmatrix}, \\ \begin{pmatrix} 0 & 1 & 0 \\ 1 & 0 & 4 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 1 & 1 \\ 0 & 0 & 4 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 1 & 1 \\ 1 & 0 & 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 1 & 0 & 1 \\ 0 & 1 & 0 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 1 & 0 & 1 \\ 0 & 0 & 4 \end{pmatrix}, \\ \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 4 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 0 & 1 \\ 0 & 1 & 4 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 1 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 5 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 0 & 2 \\ 1 & 1 & 3 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 1 & 1 \\ 1 & 0 & 4 \end{pmatrix}, \\ \begin{pmatrix} 1 & 0 & 1 \\ 0 & 1 & 4 \end{pmatrix} \end{array} \right\}.$$

**Lemma 2.5.22.** Für ein endliches Randsystem  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  gilt  $\mathcal{E}(\leq \mathcal{I}) = \mathbb{E}(\mathcal{D}(\leq \mathcal{I}))$ .

*Beweis.* „ $\subseteq$ “: Sei  $Q \in \mathcal{E}(\leq \mathcal{I})$  gegeben. Nach Definition 2.5.20 gibt es  $P \in \mathbb{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$  und  $I \in \mathcal{E}(P)$ , so daß  $Q = P^I$ . Wegen (2.75) ist  $Q \in \mathcal{D}(\leq \mathcal{I})$  und  $\text{supp}(Q) = \text{supp}(P) \setminus I$ . Damit folgt  $G(Q) \leq G(P)$ , und da  $G(P)$  ein Wald ist, muß auch  $G(Q)$  ein Wald sein. Weiterhin gibt es nach Definition 2.5.19  $f \in \mathcal{F}(P)$  mit  $I = \mathcal{E}(f)$ . Ist nun  $H \in \mathcal{Z}(Q)$ , so gibt es genau ein  $\tilde{H} \in \mathcal{Z}(P)$  mit  $H \leq \tilde{H}$ . Setze  $T := f(\tilde{H})$ . Nach Korollar 2.4.25 ist zu zeigen, daß  $\#(V(H) \cap V_{<}(Q)) \leq 1$ . Betrachte  $\tilde{H} - E(T)$ . Wegen (2.75) gilt dann  $H \leq \tilde{H} - T$ . Außerdem können  $H$  und  $T$  höchstens eine gemeinsame Ecke haben; denn sonst hätte  $H +_e E(T) \leq G(Q)$  wegen  $H \leq \tilde{H} - E(T)$  einen Kreis. Dies stände im Widerspruch dazu, daß  $G(Q)$  ein Wald ist. Wegen

$$(2.76) \quad v \in V(H) \cap V_{<}(Q) \Rightarrow \exists_{(i,j) \in I} (\{x_i, y_j\} \in E(T), v \in \{x_i, y_j\})$$

ist damit  $\#(V(H) \cap V_{<}(Q)) \leq 1$  gezeigt und  $Q \in \mathbb{E}(\mathcal{D}(\leq \mathcal{I}))$  nach Korollar 2.4.25.

„ $\supseteq$ “: Angenommen  $Q \in \mathbb{E}(\mathcal{D}(\leq \mathcal{I}))$ . Nach Korollar 2.4.25 sind alle  $H \in \mathcal{Z}(Q)$  Bäume, und es gilt  $\#(V(H) \cap V_{<}(Q)) \leq 1$ . Setze  $\tilde{I}_1 := \{i \in I_1 : x_i \in V_{<}(Q)\}$ ,  $\tilde{I}_2 := \{j \in I_2 : y_j \in V_{<}(Q)\}$ . Da  $\mathcal{I}$  ein Randsystem ist, gilt entweder  $\tilde{I}_1 = \tilde{I}_2 = \emptyset$  oder  $\tilde{I}_1, \tilde{I}_2 \neq \emptyset$ . Ist  $\tilde{I}_1 = \tilde{I}_2 = \emptyset$ , so folgt  $Q \in \mathbb{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ , und  $Q \in \mathcal{E}(\leq \mathcal{I})$  ist klar.

Sei nun  $\tilde{I}_1, \tilde{I}_2 \neq \emptyset$ .  $\tilde{Q} := Q|_{\tilde{I}_1 \times \tilde{I}_2}$ . Es folgt  $\text{supp}(\tilde{Q}) = \emptyset$  (das heißt  $\tilde{Q} = 0$ ); denn gäbe es  $(i, j) \in \text{supp}(\tilde{Q})$ , so wäre  $\#(V(\text{Zhk}_{G(Q)}(x_i)) \cap V_{<}(Q)) \geq 2$ . Setze nun  $\Delta \mathcal{I} := (\tilde{I}_1, \tilde{I}_2, \Delta r, \Delta s)$  mit

$$(2.77) \quad (\Delta r)_i := r_i - \sum_{j \in \tilde{I}_2} q_{i,j}, \quad (\Delta s)_j := s_j - \sum_{i \in \tilde{I}_1} q_{i,j}.$$

Nun wähle eine Matrix  $\tilde{P} \in \mathbb{E}(\mathcal{D}(\Delta \mathcal{I}))$  und definiere  $P = (p_{i,j})_{(i,j) \in I_1 \times I_2}$  durch

$$(2.78) \quad p_{i,j} := \begin{cases} \tilde{p}_{i,j} & \text{für } (i, j) \in \tilde{I}_1 \times \tilde{I}_2, \\ q_{i,j} & \text{sonst.} \end{cases}$$

Nach Satz 2.2.6 ist  $G(\tilde{P})$  ein Wald. Außerdem ist  $G(\tilde{P}) \leq G(P)$  und  $E(G(P)) = E(G(\tilde{P})) \cup E(G(Q))$ .

*Behauptung 1.*  $P \in \mathbb{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ .

*Beweis.* Nach den Definitionen (2.77) und (2.78) sowie der Wahl von  $\tilde{P}$  ist klar, daß  $P \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$ . Es bleibt daher zu zeigen, daß  $G(P)$  ein Wald ist. Ist  $\tilde{H} \in \mathcal{Z}(Q)$ , so haben  $\tilde{H}$  und  $G(\tilde{P})$  wegen

$$v \in V(\tilde{H}) \cap V(G(\tilde{P})) \Rightarrow v \in V(\tilde{H}) \cap V_{<}(Q)$$

höchstens eine gemeinsame Ecke. Ist also  $H \in \mathcal{Z}(P)$  und  $V(H) \cap V(G(\tilde{P})) \cap V(G(Q)) \neq \emptyset$ , so gibt es eine Ecke  $v \in V(H)$ , so daß  $H - v$  in zwei disjunkte Bäume zerfällt. In jedem Fall ist also  $H$  ein Baum.  $\blacktriangle$

Wie gerade im Beweis von Behauptung 1 gesehen, gibt es zu  $H \in \mathcal{Z}(P)$  höchstens eine Zusammenhangskomponente  $\tilde{H}(H)$  von  $G(\tilde{P})$  mit  $\tilde{H}(H) \leq H$ . Definiere nun auf  $\mathcal{Z}(P)$  eine Funktion  $f$  durch

$$(2.79) \quad f(H) := \begin{cases} \tilde{H}(H) & \text{sofern } \tilde{H}(H) \text{ existiert,} \\ (\emptyset, \emptyset) & \text{sonst.} \end{cases}$$

Dann ist  $f \in \mathcal{F}(P)$  und  $I := \mathcal{E}(f) = \text{supp}(\tilde{P})$ . Also ist mit der Bezeichnung aus Definition 2.5.20  $Q = P^I$  (wegen (2.75) und  $\tilde{Q} = 0$ ), das heißt  $Q \in \mathcal{E}(\leq \mathcal{I})$ .  $\blacksquare$

Bleibt noch zu bemerken, daß es wünschenswert wäre, die in 2.5.20 gegebene Definition von  $\mathcal{E}(\leq \mathcal{I})$  auf  $\leq$ -Randsysteme auszudehnen, so daß Lemma 2.5.22 richtig bleibt.

## 2.6 Exponierte Punkte von Mengen doppelt stochastischer Matrizen

Betrachtet man konvexe Mengen, so gibt es außer den Extrempunkten noch weitere ausgezeichnete Punkte, die sogenannten exponierten Punkte (siehe Definition 2.6.1). In diesem Abschnitt sollen exponierte Punkte von Mengen doppelt stochastischer Matrizen und deren Zusammenhang mit den Extrempunkten untersucht werden.

**Definition 2.6.1.** Sei  $X$  ein reeller Vektorraum,  $M \subseteq X$  konvex und  $x_0 \in M$ . Man nennt  $x_0$  einen *exponierten Punkt* von  $M$  genau dann, wenn es ein lineares Funktional (das heißt eine lineare Abbildung  $\xi : X \rightarrow \mathbb{R}$ ) gibt, so daß

$$(2.80) \quad \forall_{x \in M \setminus \{x_0\}} \xi(x) < \xi(x_0).$$

Die Menge der exponierten Punkte von  $M$  wird mit  $\text{Exp}(M)$  bezeichnet.

**Bemerkung 2.6.2.** Sei  $X$  ein reeller Vektorraum,  $M$  eine konvexe Teilmenge von  $X$  und  $x_0 \in M$ . Dann ist  $x_0$  genau dann ein exponierter Punkt von  $M$ , wenn es eine affine Abbildung  $\tilde{\xi} : M \rightarrow \mathbb{R}$  gibt, so daß

$$(2.81) \quad \forall_{x \in M \setminus \{x_0\}} \tilde{\xi}(x) < \tilde{\xi}(x_0).$$

Insbesondere ist also die Menge  $\text{Exp}(M)$  unabhängig davon, in welchen Vektorraum  $X$  die Menge  $M$  eingebettet ist, solange die lineare Struktur auf  $M$  die gleiche bleibt.

**Lemma 2.6.3.** Ist  $X$  ein reeller Vektorraum und  $M \subseteq X$  konvex, so ist  $\text{Exp}(M) \subseteq \text{E}(M)$ .

*Beweis.* Es sei  $x_0 \in \text{Exp}(M)$  gegeben. Dann gibt es ein lineares Funktional  $\xi$ , so daß (2.80) gilt. Ist dann  $x_0 := \frac{1}{2}x_1 + \frac{1}{2}x_2$  mit  $x_1, x_2 \in M$ , so folgt  $x_1 = 2x_0 - x_2$ . Also ist  $\xi(x_1) = 2\xi(x_0) - \xi(x_2) \geq \xi(x_0)$ . Wegen (2.80) ist dann  $x_1 = x_0$  und damit dann auch  $x_2 = x_0$ . ■

Die Umkehrung von Lemma 2.6.3 ist im allgemeinen falsch (ein Beispiel findet sich auf Seite 91 unten in [9]). Die Frage, ob sie im Fall  $M = \mathcal{D}(\mathcal{I})$  für Randsysteme  $\mathcal{I} = (I_1, I_2, r, s)$  richtig ist, erscheint schwierig (dabei kann  $\mathcal{D}(\mathcal{I})$  zum Beispiel als Teilmenge des reellen Vektorraums  $\mathbb{R}^{I_1 \times I_2}$  aufgefaßt werden). Der Untersuchung dieser Frage dient die folgende Definition 2.6.4.

**Definition 2.6.4.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein Randsystem und  $P \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$ . Im folgenden sollen für  $n \in \mathbb{N}$  Mengen  $M_n(P), m_n(P) \subseteq I_1 \times I_2$  definiert werden. Ist

$(i, j) \in M_n(P)$  ( $(i, j) \in m_n(P)$ ), so heißt  $p_{i,j}$  ein  $\mathcal{D}(\mathcal{I})$ - $n$ -maximales ( $\mathcal{D}(\mathcal{I})$ - $n$ -minimales) Element von  $P$ . Setze dann  $E_n(P) := M_n(P) \cup m_n(P)$  für  $n \in \mathbb{N}$ . Für  $(i, j) \in E_n(P)$  heißt dann  $p_{i,j}$  ein  $\mathcal{D}(\mathcal{I})$ - $n$ -extremes Element von  $P$ . Sind keine Verwechslungen möglich, so schreibe auch  $n$ -maximal ( $n$ -minimal,  $n$ -extrem) statt  $\mathcal{D}(\mathcal{I})$ - $n$ -maximal ( $\mathcal{D}(\mathcal{I})$ - $n$ -minimal,  $\mathcal{D}(\mathcal{I})$ - $n$ -extrem) und lasse dabei  $n$  für  $n = 1$  weg. Nun zu den Definitionen von  $M_n(P)$  und  $m_n(P)$ :

(2.82)

$$M_1(P) := \{(i, j) \in I_1 \times I_2 : \forall_{Q \in \mathcal{D}(\mathcal{I})} q_{i,j} \leq p_{i,j}\},$$

$$m_1(P) := \{(i, j) \in I_1 \times I_2 : \forall_{Q \in \mathcal{D}(\mathcal{I})} q_{i,j} \geq p_{i,j}\},$$

$$M_n(P) := \left\{ (i, j) \in (I_1 \times I_2) \setminus \bigcup_{k=1}^{n-1} E_k(P) : \forall_{Q \in \mathcal{D}(\mathcal{I})} \left( \left( Q \upharpoonright_{\bigcup_{k=1}^{n-1} E_k(P)} = P \upharpoonright_{\bigcup_{k=1}^{n-1} E_k(P)} \right) \Rightarrow q_{i,j} \leq p_{i,j} \right) \right\}, \quad n > 1,$$

$$m_n(P) := \left\{ (i, j) \in (I_1 \times I_2) \setminus \bigcup_{k=1}^{n-1} E_k(P) : \forall_{Q \in \mathcal{D}(\mathcal{I})} \left( \left( Q \upharpoonright_{\bigcup_{k=1}^{n-1} E_k(P)} = P \upharpoonright_{\bigcup_{k=1}^{n-1} E_k(P)} \right) \Rightarrow q_{i,j} \geq p_{i,j} \right) \right\}, \quad n > 1.$$

**Bemerkung 2.6.5.** Ist  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein Randsystem und  $P \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$ , so ist  $(I_1 \times I_2) \setminus \text{supp}(P) \subseteq m_1(P) \subseteq E_1(P)$ .

**Satz 2.6.6.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein Randsystem,  $\#I_1, \#I_2 \leq \omega$  und  $P \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$ . Gilt

$$(2.83) \quad \forall_{Q \in \mathcal{D}(\mathcal{I})} (Q \upharpoonright_{E_1(P)} = P \upharpoonright_{E_1(P)}) \Rightarrow P = Q,$$

so ist  $P \in \text{Exp}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ .

*Beweis.* Nach Bemerkung 2.6.2 genügt es, eine affine Abbildung  $\tilde{\xi} : \mathcal{D}(\mathcal{I}) \rightarrow \mathbb{R}$  anzugeben, so daß

$$(2.84) \quad \forall_{Q \in \mathcal{D}(\mathcal{I}) \setminus \{P\}} \tilde{\xi}(Q) < \tilde{\xi}(P).$$

Dazu sei  $(\alpha_i)_{i \in I_1}$  eine Familie in  $\mathbb{R}^+$ , so daß  $\sum_{i \in I_1} \alpha_i = 1$  und

$$(2.85) \quad \sigma : I_1 \times I_2 \rightarrow \mathbb{R}, \quad \sigma(i, j) = \begin{cases} 1 & \text{für } (i, j) \in M_1(P), \\ -1 & \text{für } (i, j) \in m_1(P), \\ 0 & \text{sonst.} \end{cases}$$

Definiere dann  $\tilde{\xi} : \mathcal{D}(\mathcal{I}) \longrightarrow \mathbb{R}$  durch

$$(2.86) \quad \tilde{\xi}(Q) := \sum_{(i,j) \in I_1 \times I_2} \sigma(i,j) \frac{\alpha_i}{r_i} q_{i,j}.$$

Wegen

$$(2.87) \quad \forall_{Q \in \mathcal{D}(\mathcal{I})} |\tilde{\xi}(Q)| \leq \sum_{(i,j) \in I_1 \times I_2} |\sigma(i,j) \frac{\alpha_i}{r_i} q_{i,j}| \leq \sum_{(i,j) \in I_1 \times I_2} \frac{\alpha_i}{r_i} q_{i,j} = \sum_{j \in I_2} \frac{\alpha_j}{r_i} r_i = 1$$

ist  $\tilde{\xi}$  wohldefiniert. Es ist dann klar, daß  $\tilde{\xi}$  affin ist. Daß (2.84) gilt, folgt sofort aus den Definitionen von  $M_1(P)$  und  $m_1(P)$  sowie der Voraussetzung

$$(2.88) \quad \forall_{Q \in \mathcal{D}(\mathcal{I})} Q|_{E_1(P)} = P|_{E_1(P)} \Rightarrow P = Q. \quad \blacksquare$$

**Korollar 2.6.7.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein Randsystem,  $\#I_1, \#I_2 \leq \omega$  und  $P \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$ . Gilt

$$(2.89) \quad \forall_{Q \in \mathcal{D}(\mathcal{I})} (\text{supp}(Q) \subseteq \text{supp}(P) \Rightarrow P = Q),$$

so ist  $P \in \text{Exp}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ .

*Beweis.* Die Behauptung folgt wegen

$$(2.90) \quad \forall_{Q \in \mathcal{D}(\mathcal{I})} \left( Q|_{E_1(P)} = P|_{E_1(P)} \stackrel{(2.6.5)}{\Rightarrow} Q|_{(I_1 \times I_2) \setminus \text{supp}(P)} = P|_{(I_1 \times I_2) \setminus \text{supp}(P)} \right. \\ \left. \Rightarrow \text{supp}(Q) \subseteq \text{supp}(P) \Rightarrow P = Q \right)$$

aus Satz 2.6.6. ■

**Korollar 2.6.8.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein Randsystem mit  $\sum_{i \in I_1} r_i = \sum_{j \in I_2} s_j < \infty$ , so gilt  $\text{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I})) = \text{Exp}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ .

*Beweis.* Nach Lemma 2.6.3 ist nur „ $\subseteq$ “ zu zeigen, und das folgt aus Korollar 2.6.7 und Satz 2.4.16. ■

Korollar 2.6.8 ist gerade Proposition 2 aus [4], wobei dort die Voraussetzung  $\sum_{i \in I_1} r_i = \sum_{j \in I_2} s_j < \infty$  fehlt. Der in [4] gegebene Beweis, ist jedoch nur unter dieser Voraussetzung richtig.

**Korollar 2.6.9.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein Randsystem,  $\#I_1, \#I_2 \leq \omega$  und  $P \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$ . Gilt für jede Zusammenhangskomponente  $H$  von  $G(P)$ , daß  $\sum_{x_i \in V(H)} r_i < \infty$ , so ist  $P \in \text{Exp}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$  genau dann, wenn  $P \in \text{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ .

*Beweis.* Nach Lemma 2.6.3 ist nur „ $\Leftarrow$ “ zu zeigen, und das folgt aus Korollar 2.6.7 und Korollar 2.4.18.  $\blacksquare$

**Beispiel 2.6.10.** Definiere

$$(2.91) \quad P := \begin{pmatrix} 1 & \frac{1}{2} & & \\ \frac{1}{2} & & \frac{1}{3} & \\ & & & \ddots \end{pmatrix}$$

und  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s) := \mathcal{I}(P)$ . Dann gilt

$$(2.92) \quad \forall_{Q \in \mathcal{D}(\mathcal{I})} (\text{supp}(Q) \subseteq \text{supp}(P) \Rightarrow P = Q).$$

Nach Korollar 2.6.7 ist daher  $P \in \text{Exp}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ .

Es stellt sich heraus, daß Satz 2.6.6 nicht wirklich allgemeiner ist als Korollar 2.6.7. Es gilt das folgende Lemma:

**Lemma 2.6.11.**  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  sei ein Randsystem und  $P \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$ . Dann gilt

$$(2.93) \quad \begin{aligned} & \forall_{Q \in \mathcal{D}(\mathcal{I})} (\text{supp}(Q) \subseteq \text{supp}(P) \Rightarrow P = Q) \\ \Leftrightarrow & \forall_{Q \in \mathcal{D}(\mathcal{I})} (Q|_{E_1(P)} = P|_{E_1(P)} \Rightarrow P = Q). \end{aligned}$$

*Beweis. Behauptung 1.* Gilt  $\#\text{supp}(P) \geq 2$ , so ist  $m_1(P) = (I_1 \times I_2) \setminus \text{supp}(P)$ .

*Beweis.* Es ist nur „ $\subseteq$ “ zu zeigen. Sind  $(i_1, j_1)$  und  $(i_2, j_2)$  zwei beliebige aber verschiedene Elemente aus dem Träger von  $P$ , so sei  $\epsilon := \min\{p_{i_1, j_1}, p_{i_2, j_2}\}$  und  $Q = (q_{i, j})_{(i, j) \in I_1 \times I_2}$  definiert durch  $Q|_{(I_1 \times I_2) \setminus \{(i_1, j_1), (i_2, j_2)\}} = P|_{(I_1 \times I_2) \setminus \{(i_1, j_1), (i_2, j_2)\}}$ ,

$$(2.94) \quad q_{i, j} := \begin{cases} p_{i_1, j_1} - \epsilon & \text{für } (i, j) = (i_1, j_1), \\ p_{i_2, j_2} - \epsilon & \text{für } (i, j) = (i_2, j_2), \\ p_{i, j} + \epsilon & \text{für } (i, j) \in \{(i_1, j_2), (i_2, j_1)\}. \end{cases}$$

Dann ist  $Q \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$  und  $q_{i_1, j_1} < p_{i_1, j_1}$ ,  $q_{i_2, j_2} < p_{i_2, j_2}$ . Also gilt  $(i_1, j_1), (i_2, j_2) \notin m_1(P)$ .  $\blacktriangle$

*Behauptung 2.* Für  $(i, j) \in I_1 \times I_2$  gilt  $(i, j) \in M_1(P)$  genau dann, wenn  $p_{i, j} \in \{r_i, s_j\}$ .

*Beweis.* Es ist nur „ $\Rightarrow$ “ zu zeigen. Angenommen, es ist  $p_{i, j} \notin \{r_i, s_j\}$ . Dann gibt es Elemente  $i_2 \in I_1$  und  $j_1 \in I_2$ , so daß  $(i, j_1), (i_2, j) \in \text{supp}(P)$ . Setze nun  $i_1 := i$  und  $j_2 := j$ , und definiere eine Matrix  $Q$  wie in Behauptung 1. Dann ist  $q_{i, j} = q_{i_1, j_2} > p_{i, j}$ , womit  $(i, j) \notin M_1(P)$  gezeigt ist.  $\blacktriangle$



Für den Beweis des Lemmas ist nach dem Argument aus Korollar 2.6.7 nur noch „ $\Leftarrow$ “ zu zeigen, und man kann annehmen, daß  $\#supp(P) \geq 2$ . Ist nun  $Q \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$  und  $supp(Q) \subseteq supp(P)$ , so gilt  $Q|_{(I_1 \times I_2) \setminus supp(P)} = P|_{(I_1 \times I_2) \setminus supp(P)}$ , und das heißt  $Q|_{m_1(P)} = P|_{m_1(P)}$  nach Behauptung 1. Dann folgt aber aus Behauptung 2 sofort, daß auch  $Q|_{M_1(P)} = P|_{M_1(P)}$  gelten muß. Also gilt  $Q|_{E_1(P)} = P|_{E_1(P)}$  und damit  $P = Q$ . ■

Offene Fragen sind zur Zeit, ob Satz 2.6.6 richtig bleibt, wenn  $E_1(\ )$  durch  $\bigcup_{n=1}^k E_n(\ )$ ,  $k \in \mathbb{N} \cup \{\infty\}$  ersetzt wird oder wenn die Einschränkungen  $\#I_1, \#I_2 \leq \omega$  fallen gelassen wird. Generell scheint es ziemlich aussichtslos zu sein, zu zeigen, daß eine extremale Matrix  $P$  nach Definition 2.6.1 nicht exponiert ist. Es wird wahrscheinlich notwendig sein, die Definition so abzuändern, daß nur noch stetige lineare Abbildungen bezüglich einer noch zu verbarenden Topologie für die Abbildung  $\xi$  zugelassen werden. Der Beweis, daß eine Matrix nicht exponiert ist, könnte dann mit Hilfe einer Darstellung aller solchen stetigen linearen Funktionale erfolgen.

**Beispiel 2.6.12.** Sei  $P$  die Matrix aus Beispiel 2.4.13. Dann gilt  $M_2(P) = A$  und  $m_2(P) = B$  mit

$$(2.95) \quad \begin{aligned} A &:= \{(1, 1)\} \cup \{(i, j) \in I_1 \times I_2 : (j = i + 1, i \text{ gerade}) \\ &\quad \text{oder } (i = j + 1, i \text{ ungerade})\}, \\ B &:= ((I_1 \times I_2) \setminus supp(P)) \cup \{(i, j) \in I_1 \times I_2 : (j = i + 1, i \text{ ungerade}) \\ &\quad \text{oder } (i = j + 1, i \text{ gerade})\} : \end{aligned}$$

Ist  $Q \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$  mit  $Q|_{(I_1 \times I_2) \setminus supp(P)} = P|_{(I_1 \times I_2) \setminus supp(P)}$  sowie  $q_{i,j} > p_{i,j}$  für ein  $(i, j) \in A$  oder  $q_{i,j} < p_{i,j}$  für ein  $(i, j) \in B$ , so folgt mit  $\delta := |p_{i,j} - q_{i,j}|$ , daß wegen

$$\begin{aligned} \dots &= p_{4,3} - q_{4,3} = q_{2,3} - p_{2,3} = p_{2,1} - q_{2,1} = q_{1,1} - p_{1,1} = p_{1,2} - q_{1,2} = q_{3,2} - p_{3,2} \\ &= p_{3,4} - q_{3,4} = \dots \end{aligned}$$

für alle nach (2.38) definierten  $a_n$ ,  $n \in \mathbb{N}$  gilt, daß  $\delta \leq a_n$ . Daraus folgt dann aber  $\delta = 0$ . Offen bleibt, ob  $P$  exponiert ist oder nicht.

Ein Weiteres Beispiel einer extremalen Matrix, für die zur Zeit nicht klar ist, ob sie exponiert ist oder nicht, ist durch den Graphen in Abbildung 2.6 gegeben (nach der in Bemerkung 2.1.5 beschriebenen Identifikation).

Alle Elemente außer  $p_{1,1}$  sind 2-extrem.  $p_{1,1}$  ist nicht 2-extrem, jedoch sowohl 3-minimal als auch 3-maximal. Durch Einfügen immer weiterer Graphen (abzählbar vieler), wie in den Abbildungen 2.7 und 2.8 beschrieben, lassen sich nun beliebig komplizierte Matrizen mit  $k$ -extremen Elementen unterschiedlichster Ordnung erzeugen. Für alle diese Matrizen müßte man die Frage der Exponiertheit klären, um das Problem, ob es extremale Matrizen geben kann, die nicht exponiert sind, lösen zu können; denn es gilt in Verallgemeinerung von Lemma 2.4.15 der folgende Satz:

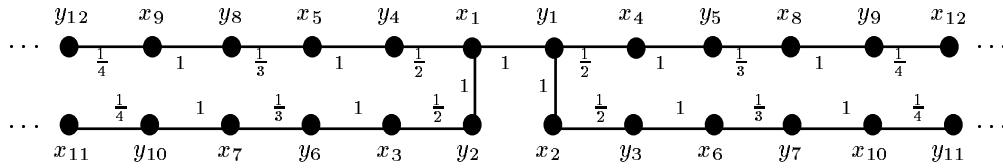


Abbildung 2.6: Der Graph soll, wie angedeutet, nach links und rechts ins Unendliche fortgesetzt werden. Das Bildungsgesetz für die Ecken ist dabei links oben  $\dots, y_{4(n+1)}, x_{4n+1}, \dots$ , links unten  $\dots, x_{4n+3}, y_{4n+2}, \dots$ , rechts oben  $\dots, y_{4n+1}, x_{4(n+1)}, \dots$ , rechts unten  $\dots, x_{4n+2}, y_{4n+3}, \dots$ .

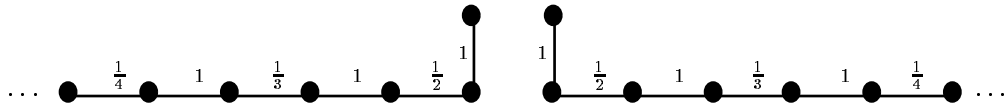


Abbildung 2.7: Graphen dieser Form sollen an den Graphen aus Abbildung 2.6 so angefügt werden, daß die beiden Zusammenhangskomponenten durch eine Kante mit Gewicht Eins überbrückt werden.

**Satz 2.6.13.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein Randsystem. Ist  $P \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$ , und gilt

$$(2.96) \quad \forall_{Q \in \mathcal{D}(\mathcal{I})} (Q|_{\bigcup_{n \in \mathbb{N}} E_n(P)} = P|_{\bigcup_{n \in \mathbb{N}} E_n(P)} \Rightarrow P = Q),$$

so ist  $P \in \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ .

*Beweis.* Angenommen,  $P \notin \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ . Dann gibt es nach Lemma 2.1.13 (b)  $E \in \mathcal{M}_{\mathbb{R}}(I_1, I_2)$ , so daß sich alle Linien von  $E$  zu Null summieren und  $P \pm E \geq 0$ . Das Ziel ist, zu zeigen, daß  $E = 0$ . Nach Voraussetzung genügt es dazu,  $E|_{\bigcup_{n \in \mathbb{N}} E_k(P)} = 0$  zu beweisen. Dafür wird nun durch Induktion nach  $n$  gezeigt, daß  $E|_{E_n(P)} = 0$ . Sei  $n = 1$ . Angenommen, es ist  $(i, j) \in E_1(P)$  und  $e_{i,j} \neq 0$ . Dann ist  $p_{i,j} + e_{i,j} > p_{i,j}$  und  $p_{i,j} - e_{i,j} < p_{i,j}$ , was wegen  $P \pm E \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$  und Definition von  $E_1(P)$  jedoch nicht sein kann. Für  $n > 1$  gilt per Induktion  $(P \pm E)|_{\bigcup_{k=1}^{n-1} E_k(P)} = P|_{\bigcup_{k=1}^{n-1} E_k(P)}$ . Nun folgt wie für  $n = 1$ , daß auch  $E|_{E_n(P)} = 0$ . ■

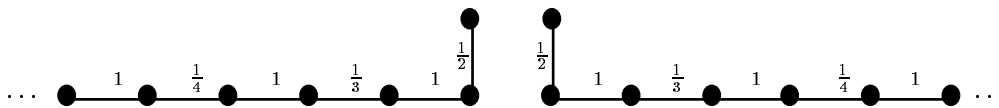


Abbildung 2.8: Graphen dieser Form sollen an den Graphen aus Abbildung 2.6 so angefügt werden, daß die beiden Zusammenhangskomponenten durch eine Kante mit Gewicht  $\frac{1}{n}$  überbrückt werden.

# Kapitel 3

## Kardinalitätsbetrachtungen für Mengen extremaler Matrizen

### 3.1 Allgemeines

In diesem Abschnitt geht es darum, für gegebene Randsysteme (und gelegentlich für  $\leq$ -Randsysteme)  $\mathcal{I}$  die Kardinalität von  $\mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$  (von  $\mathbf{E}(\mathcal{D}(\leq \mathcal{I}))$ ) zu untersuchen.

**Bemerkung 3.1.1.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein  $\leq$ -Randsystem. Ist dann  $\tilde{\mathcal{I}} := (\tilde{I}_1, \tilde{I}_2, \tilde{r}, \tilde{s})$  ein weiteres  $\leq$ -Randsystem mit  $I_{1,nt} = \tilde{I}_{1,nt}$ ,  $I_{2,nt} = \tilde{I}_{2,nt}$ ,  $r|_{I_{1,nt}} = \tilde{r}|_{\tilde{I}_{1,nt}}$ ,  $s|_{I_{2,nt}} = \tilde{s}|_{\tilde{I}_{2,nt}}$ , so gilt  $\#\mathcal{D}(\leq \mathcal{I}) = \#\mathcal{D}(\leq \tilde{\mathcal{I}})$ ,  $\#\mathcal{D}(\mathcal{I}) = \#\mathcal{D}(\tilde{\mathcal{I}})$ ,  $\#\mathbf{E}(\mathcal{D}(\leq \mathcal{I})) = \#\mathbf{E}(\mathcal{D}(\leq \tilde{\mathcal{I}}))$ ,  $\#\mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I})) = \#\mathbf{E}(\mathcal{D}(\tilde{\mathcal{I}}))$ . Die Kardinalität von  $\mathcal{D}(\leq \mathcal{I})$ ,  $\mathcal{D}(\mathcal{I})$ ,  $\mathbf{E}(\mathcal{D}(\leq \mathcal{I}))$  und  $\mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$  hängt also nur von den nichttrivialen Indizes ab.

**Bemerkung 3.1.2.** Es sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein  $\leq$ -Randsystem.

(a) Ist  $\tilde{\mathcal{I}} := (\tilde{I}_1, \tilde{I}_2, \tilde{r}, \tilde{s})$  ein weiteres  $\leq$ -Randsystem, und gibt es Bijektionen  $b_1 : I_1 \rightarrow \tilde{I}_1$ ,  $b_2 : I_2 \rightarrow \tilde{I}_2$  mit  $\forall_{i \in I_1} r_i = \tilde{r}_{b_1(i)}$  und  $\forall_{j \in I_2} s_j = \tilde{s}_{b_2(j)}$ , so ist durch

$$(3.1) \quad L : \mathcal{D}(\leq \mathcal{I}) \rightarrow \mathcal{D}(\leq \tilde{\mathcal{I}}), \quad P \mapsto \tilde{P} := L(P)$$

mit  $\forall_{(i,j) \in \tilde{I}_1 \times \tilde{I}_2} \tilde{p}_{i,j} = p_{b_1^{-1}(i), b_2^{-1}(j)}$  eine affine Bijektion gegeben, das heißt, insbesondere gilt  $\#\mathbf{E}(\mathcal{D}(\leq \mathcal{I})) = \#\mathbf{E}(\mathcal{D}(\leq \tilde{\mathcal{I}}))$  nach Bemerkung 1.1.4. Die Aussage bleibt richtig, wenn man die  $\leq$ -Zeichen wegläßt.

(b) Definiere das transponierte  $\leq$ -Randsystem  $\mathcal{I}^t := (I_2, I_1, s, r)$ . Dann ist durch

$$(3.2) \quad L_t : \mathcal{D}(\leq \mathcal{I}) \rightarrow \mathcal{D}(\leq \mathcal{I}^t), \quad L_t(P) = P^t$$

eine affine Bijektion gegeben. Insbesondere also  $\#E(\mathcal{D}(\leq \mathcal{I})) = \#E(\mathcal{D}(\leq \mathcal{I}^t))$ . Die Aussage gilt noch immer, wenn man die  $\leq$ -Zeichen wegläßt.

(c) Für  $m \in \mathbb{R}^+$  definiere  $m\mathcal{I} := (I_1, I_2, mr, ms)$ . Dann ist durch

$$(3.3) \quad L_m : \mathcal{D}(\leq \mathcal{I}) \longrightarrow \mathcal{D}(\leq \mathcal{I}^t), \quad L_m(P) = mP$$

eine affine Bijektion gegeben, das heißt, wiederum gilt  $\#E(\mathcal{D}(\leq \mathcal{I})) = \#E(\mathcal{D}(\leq \mathcal{I}))$ . Erneut gilt die Aussage auch ohne die  $\leq$ -Zeichen.

**Satz 3.1.3.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein Randsystem.

(a) Für  $\min\{\#I_{1,nt}, \#I_{2,nt}\} \leq 1$  ist  $\#E(\mathcal{D}(\mathcal{I})) = \#\mathcal{D}(\mathcal{I}) = 1$ .

(a $_{\leq}$ ) Für  $\min\{\#I_{1,nt}, \#I_{2,nt}\} \leq 1$  ist  $\#E(\leq \mathcal{D}(\mathcal{I})) = 2^{\max\{\#I_{1,nt}, \#I_{2,nt}\}}$ .

(b) Für  $\#I_{1,nt}, \#I_{2,nt} < \infty$  ist  $\#E(\mathcal{D}(\mathcal{I})) < \infty$ .

(b $_{\leq}$ ) Für  $\#I_{1,nt}, \#I_{2,nt} < \infty$  ist  $\#E(\leq \mathcal{D}(\mathcal{I})) < \infty$ .

(c) Ist  $2 \leq \min\{\#I_{1,nt}, \#I_{2,nt}\}$ ,  $\max\{\#I_{1,nt}, \#I_{2,nt}\} = \alpha \geq \omega$  und  $\omega \cdot \#I_{1,nt} = \omega \cdot \#I_{2,nt}$ , so ist  $\#E(\mathcal{D}(\mathcal{I})) = 2^\alpha$ .

(c $_{\leq}$ ) Ist  $2 \leq \min\{\#I_{1,nt}, \#I_{2,nt}\}$ ,  $\max\{\#I_{1,nt}, \#I_{2,nt}\} = \alpha \geq \omega$  und  $\omega \cdot \#I_{1,nt} = \omega \cdot \#I_{2,nt}$ , so ist  $\#E(\leq \mathcal{D}(\mathcal{I})) = 2^\alpha$ .

*Beweis.* (a) ist klar.

(b) folgt aus Satz 2.5.17 und der Tatsache, daß für endliches  $M$  auch alle in (2.69) definierten  $D_n(M)$  endlich sind.

(c) Ohne Beschränkung der Allgemeinheit kann man annehmen, daß  $I_1 = I_{1,nt}$  und  $I_2 = I_{2,nt}$ . „ $\leq$ “ folgt dann wegen  $E(\mathcal{D}(\mathcal{I})) \subseteq \mathbb{R}^{I_1 \times I_2}$  und  $\#\mathbb{R}^{I_1 \times I_2} = (2^\omega)^\alpha = 2^\alpha$ .

„ $\geq$ “: Zunächst sei  $\sum_{i \in I_1} r_i = \sum_{j \in I_2} s_j < \infty$ . Dann folgt  $\#I_1, \#I_2 \leq \omega$ . Ohne Beschränkung der Allgemeinheit sei  $\#I_2 = \omega$ . Wähle  $i_0 \in I_1$  beliebig und  $j_0 \in I_2$ , so daß  $s_{j_0} = \max\{s_j : j \in I_2\}$ .

*Behauptung 1.* Es gibt eine endliche Menge  $T_e \subseteq I_2 \setminus \{j_0\}$  mit

$$(3.4) \quad r_{i_0} - s_{j_0} < \sum_{j \in T_e} s_j < r_{i_0}.$$

*Beweis.* Für  $s_{j_0} \geq r_{i_0}$  ist das klar. Sei nun  $s_{j_0} < r_{i_0}$ . Wegen  $r_{i_0} - s_{j_0} < \sum_{j \in I_2 \setminus \{j_0\}} s_j$  gibt es eine endliche Menge  $T_e \subseteq I_2 \setminus \{j_0\}$  mit  $r_{i_0} - s_{j_0} < \sum_{j \in T_e} s_j$  und  $\exists_{\nu \in T_e} \sum_{j \in T_e \setminus \{\nu\}} s_j \leq r_{i_0} - s_{j_0}$ . Für  $s_{j_0} < r_{i_0}$  folgt daraus wegen  $s_{j_0} = \max\{s_j : j \in I_2\}$ , daß  $T_e$  (3.4) erfüllt.  $\blacktriangle$

Setze  $\delta := \frac{r_{i_0} - \sum_{j \in T_e} s_j}{2}$  und wähle  $T_\omega \subseteq (I_2 \setminus \{j_0\}) \setminus T_e$  mit  $\sum_{j \in T_\omega} s_j \leq \delta$ . Ist dann

$$(3.5) \quad \mathcal{T} := \{T_e \dot{\cup} T : T \subseteq T_\omega\},$$

so ist  $\#\mathcal{T} = 2^\omega$ . Für  $T \in \mathcal{T}$  definiere  $\mathcal{I}^T := (I_1^T, I_2, r^T, s^T)$  mit  $I_1^T := I_1 \setminus \{i_0\}$ ,  $r^T := r|_{I_1^T}$  sowie  $s^T = (s_j^T)_{j \in I_2}$  mit

$$(3.6) \quad s_j^T := \begin{cases} 0 & \text{für } j \in T, \\ s_j & \text{für } j \in I_2 \setminus (T \cup \{j_0\}), \\ s_{j_0} - r_{i_0} + \sum_{\nu \in T} s_\nu & \text{für } j = j_0. \end{cases}$$

$\mathcal{I}^T$  ist wegen (3.4) ein Randsystem. Nun wähle eine Matrix  $Q \in \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}^T))$  und definiere  $P^T = (p_{i,j}^T)_{(i,j) \in I_1 \times I_2}$  durch  $P^T|_{I_1^T \times I_2} := Q$  und

$$(3.7) \quad p_{i_0,j}^T := \begin{cases} s_j & \text{für } j \in T, \\ r_{i_0} - \sum_{\nu \in T} s_\nu & \text{für } j = j_0, \\ 0 & \text{sonst.} \end{cases}$$

*Behauptung 2.*  $P^T \in \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ .

*Beweis.* Angenommen, es gilt  $P^T = \frac{1}{2}P^{(1)} + \frac{1}{2}P^{(2)}$ ,  $P^{(1)}, P^{(2)} \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$ . Mit  $Q := P|_{I_1^T \times I_2}$ ,  $Q^{(k)} := P^{(k)}|_{I_1^T \times I_2}$  für  $k = 1, 2$  gilt  $Q = \frac{1}{2}Q^{(1)} + \frac{1}{2}Q^{(2)}$ . Nach Definition von  $P^T$  ist  $Q \in \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}^T))$ . Also folgt  $Q^{(1)} = Q^{(2)} = Q$ . Wegen  $P, P^{(1)}, P^{(2)} \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$  folgt daraus  $P = P^{(1)} = P^{(2)}$ . Also ist  $P \in \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ .  $\blacktriangle$

Wegen (3.7) ist die durch  $T \mapsto P^T$  gegebene Abbildung injektiv. Damit folgt  $\#\mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I})) \geq 2^\omega$ .

Nun soll der Fall  $\sum_{i \in I_1} r_i = \sum_{j \in I_2} s_j = \infty$  betrachtet werden. In diesem Fall ist  $\#I_1, \#I_2 \geq \omega$ , und das bedeutet wegen  $\omega \cdot \#I_1 = \omega \cdot \#I_2$ , daß  $\#I_1 = \#I_2 = \alpha$ . Es gibt nun Randsysteme  $(\mathcal{I}_k = (I_{1,k}, I_{2,k}, r^k, s^k))_{k \in \alpha}$ , so daß für alle  $k \in \alpha$ ,  $\mathcal{I}_k \leq \mathcal{I}$ ,  $I_1 = \bigcup_{k \in \alpha} I_{1,k}$ ,  $I_2 = \bigcup_{k \in \alpha} I_{2,k}$ ,  $\#I_{1,k} = \#I_{2,k} = \omega$  sowie  $\sum_{i \in I_{1,k}} r_i = \sum_{j \in I_{2,k}} s_j = \infty$ . Für  $\alpha > \omega$  ist das gerade die Aussage von Behauptung 1 von Satz 2.1.18. Für  $\alpha = \omega$  kann man wie folgt vorgehen: Man konstruiert eine Familie  $(T_{k,n})_{(k,n) \in \omega \times \omega}$  von paarweise disjunkten Teilmengen von  $I_1$ , so daß  $\bigvee_{(k,n) \in \omega \times \omega} \sum_{i \in T_{k,n}} r_i \geq 1$  (die formale Konstruktion der  $T_{k,n}$  erfolgt rekursiv unter Verwendung einer Abzählung von  $\omega \times \omega$  und der Voraussetzung  $\sum_{i \in I_1} r_i = \infty$ ). Nun setze noch  $I_{1,k} := \bigcup_{n \in \omega} T_{k,n}$  für  $k \in \omega$ . Analog bekommt man aus  $I_2$  die Mengen  $I_{2,k}$ ,  $k \in \omega$ .

Als nächstes bemerke man, daß es für jedes der Randsysteme  $\mathcal{I}_k$  Matrizen  $P^{(k)}, Q^{(k)} \in \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}_k))$  mit  $P^{(k)} \neq Q^{(k)}$  gibt. Das folgt aus Beispiel 2.1.17: Dort wurde in Abhängigkeit von gegebenen Abzählungen von  $I_1$  und  $I_2$  ein Element

$P \in \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$  konstruiert. Die Konstruktion erfolgte so, daß für  $0 \neq r_1, s_1$  auch  $0 \neq p_{1,1}$ . Man muß also lediglich die gleiche Konstruktion an einer Stelle  $(i_0, j_0)$  beginnen, an der  $p_{i_0, j_0} = 0$  ist, und man bekommt eine Matrix  $Q \neq P$ .

Ist nun eine Funktion  $f : \alpha \rightarrow 2$  gegeben, so definiere  $P^f = (p_{i,j}^f)_{(i,j) \in I_1 \times I_2}$  durch

$$(3.8) \quad p_{i,j}^f := \begin{cases} p_{i,j}^{(k)} & \text{für } (i,j) \in I_{1,k} \times I_{2,k} \text{ und } f(k) = 0, \\ q_{i,j}^{(k)} & \text{für } (i,j) \in I_{1,k} \times I_{2,k} \text{ und } f(k) = 1, \\ 0 & \text{sonst.} \end{cases}$$

Wie in Behauptung 2 von Satz 2.1.18 folgt, daß  $P^f \in \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ . Da die durch  $f \mapsto P^f$  definierte Abbildung nach (3.8) injektiv ist, folgt  $\#\mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I})) \geq 2^\alpha$ .

Für den Beweis von  $(a_{\leq})$ ,  $(b_{\leq})$  und  $(c_{\leq})$  seien die Bezeichnungen wie in Definition 2.5.19.

$(a_{\leq})$ : Sei  $\mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I})) = \{P\}$ . In diesem Fall hat  $G(P)$  höchstens eine Zusammenhangskomponente  $Z$ , deren Kantenmenge nicht leer ist. Ohne Beschränkung der Allgemeinheit kann man annehmen, daß  $V(Z) = \{x_{i_1}\} \cup \{y_j : j \in I_2\}$ ,  $E(Z) = \{\{x_{i_1}, y_j\} : j \in I_2\}$ . Jede Teilmenge von  $E(Z)$  liefert ein Element von  $\mathcal{E}(P)$  und umgekehrt. Also folgt  $\#\mathbf{E}(\mathcal{D}(\leq \mathcal{I})) = \#\mathcal{E}(P) = 2^{\max\{\#I_{1,nt}, \#I_{2,nt}\}}$ .

$(b_{\leq})$ : Da  $\mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$  endlich ist und für  $P \in \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$  die Mengen  $\mathcal{Z}(P)$ ,  $\mathcal{F}(P)$ ,  $\mathcal{E}(P)$  alle endlich sind, muß auch  $\mathcal{E}(\leq \mathcal{I}) = \mathbf{E}(\mathcal{D}(\leq \mathcal{I}))$  endlich sein.

$(c_{\leq})$ : „ $\leq$ “ folgt analog zu dem entsprechenden Beweis in (c). „ $\geq$ “ folgt wegen  $\mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I})) \subseteq \mathbf{E}(\mathcal{D}(\leq \mathcal{I}))$  sofort aus (c). ■

Die Frage, wie  $(a_{\leq})$ ,  $(b_{\leq})$  und  $(c_{\leq})$  modifiziert werden müssen, wenn  $\mathcal{I}$  ein  $\leq$ -Randsystem jedoch kein Randsystem ist, soll hier jetzt nicht weiter untersucht werden. Meine Vermutung ist, daß die Aussage  $(b_{\leq})$  richtig bleibt. Ein Beweis könnte sich zum Beispiel ergeben, wenn es gelingt, die Definition von  $\mathcal{E}(\leq \mathcal{I})$  aus 2.5.20 auf beliebige  $\leq$ -Randsysteme  $\mathcal{I}$  auszudehnen, so daß Lemma 2.5.22 richtig bleibt. Für den Fall, daß in  $(c_{\leq})$   $\mathcal{I}$  ein Randsystem mit  $\beta := \min\{\#I_{1,nt}, \#I_{2,nt}\} < \alpha$  ist, muß man vermutlich die Zahl  $2^\alpha$  durch  $\alpha \cdot 2^\beta$  ersetzen.

## 3.2 Der Fall $2 \times \omega$

Im folgenden werden Randsysteme  $\mathcal{I} = (I_1, I_2, r, s)$  untersucht, bei denen eine der beiden Indextmengen nur zwei Elemente hat. Es wird ein Verfahren zur Gewinnung der Extrempunkte angegeben. Dazu wird in Definition 3.2.1 eine Menge  $\mathcal{E}_2(\mathcal{I})$  konstruiert und dann in Satz 3.2.3 gezeigt, daß  $\mathcal{E}_2(\mathcal{I}) = \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ . Anschließend werden daraus Informationen über  $\#\mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$  gewonnen.

**Definition 3.2.1.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein Randsystem mit  $\min\{\#I_{1,nt}, \#I_{2,nt}\} = 2$ . Dann definiere eine Menge  $\mathcal{E}_2(\mathcal{I})$ , wie folgt:

Zunächst nehme man an, daß  $I_1 = \{i_1, i_2\}$ ,  $i_1 \neq i_2$ ,  $r_{i_2} \geq r_{i_1} > 0$  und  $I_2 = I_{2,nt}$ .  
Definiere

$$(3.9) \quad \mathcal{T}_=(\mathcal{I}) := \{T \subseteq I_2 : \sum_{j \in T} s_j = r_{i_1}\}$$

und für  $j_0 \in I_2$  definiere

$$(3.10) \quad \mathcal{T}_{j_0}(\mathcal{I}) := \{T \subseteq I_2 \setminus \{j_0\} : r_{i_1} - s_{j_0} < \sum_{j \in T} s_j < r_{i_1}\}.$$

Ist  $T \in \mathcal{T}_=(\mathcal{I})$ , so definiere  $P^{T,=} = (p_{i,j}^{T,=})_{(i,j) \in I_1 \times I_2}$  durch

$$(3.11) \quad p_{i_1,j}^{T,=} := \begin{cases} s_j & \text{für } j \in T, \\ 0 & \text{sonst,} \end{cases} \quad p_{i_2,j}^{T,=} := \begin{cases} s_j & \text{für } j \in (I_2 \setminus T), \\ 0 & \text{sonst} \end{cases}$$

sowie

$$(3.12) \quad \mathcal{E}_2^=(\mathcal{I}) := \{P^{T,=} : T \in \mathcal{T}_=\}.$$

Ist hingegen  $T \in \mathcal{T}_{j_0}(\mathcal{I})$ , so sei  $P^{T,j_0} = (p_{i,j}^{T,j_0})_{(i,j) \in I_1 \times I_2}$  definiert durch

$$(3.13) \quad p_{i_1,j}^{T,j_0} := \begin{cases} s_j & \text{für } j \in T, \\ 0 & \text{für } j \in (I_2 \setminus T) \setminus \{j_0\}, \\ r_{i_1} - \sum_{\nu \in T} s_\nu & \text{für } j = j_0, \end{cases}$$

$$p_{i_2,j}^{T,j_0} := \begin{cases} 0 & \text{für } j \in T, \\ s_j & \text{für } j \in (I_2 \setminus T) \setminus \{j_0\}, \\ r_{i_2} - \sum_{\nu \in (I_2 \setminus T) \setminus \{j_0\}} s_\nu & \text{für } j = j_0 \end{cases}$$

sowie

$$(3.14) \quad \mathcal{E}_2^{j_0}(\mathcal{I}) := \{P^{T,j_0} : T \in \mathcal{T}_{j_0}(\mathcal{I})\}.$$

Schließlich sei

$$(3.15) \quad \mathcal{E}_2(\mathcal{I}) := \mathcal{E}_2^=(\mathcal{I}) \cup \bigcup_{j_0 \in I_2} \mathcal{E}_2^{j_0}(\mathcal{I}).$$

Ist  $I_1 \neq I_{1,nt}$  oder  $I_2 \neq I_{2,nt}$ , so wird  $\mathcal{E}_2(\mathcal{I})$  genauso konstruiert, nur daß noch entsprechend viele Nullzeilen eingefügt werden. Für  $\#I_{2,nt} = 2$  erfolgt die Definition von  $\mathcal{E}_2(\mathcal{I})$  analog, nur daß die Rollen von  $I_1$  und  $I_2$  sowie die Rollen von  $r$  und  $s$  vertauscht sind.

In Beispiel 3.2.2 wird die Konstruktion aus Definition 3.2.1 für ein konkretes Randsystem durchgeführt. Es wird erneut das Randsystem aus Beispiel 2.5.2 verwendet. Insbesondere wird somit der Unterschied der Konstruktionen von Definition 3.2.1 und Definition 2.5.1 herausgestellt.



**Beispiel 3.2.2.** Gegeben sei das Randsystem  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  mit  $I_1 := \{1, 2\}$ ,  $I_2 := \{1, 2, 3\}$ ,  $r := (2, 5)$ ,  $s := (1, 1, 5)$ . Es soll nun  $\mathcal{E}_2(\mathcal{I})$  explizit berechnet werden. Setze  $i_1 := 1$ ,  $i_2 := 2$ . Dann ist  $r_{i_2} = 5 > r_{i_1} = 2 > 0$ . Weiterhin ist  $r_{i_1} - s_1 = r_{i_1} - s_2 = 1$  sowie  $r_{i_1} - s_3 = -3$ , also nach (3.9) und (3.10)

$$\mathcal{T}_=(\mathcal{I}) = \{\{1, 2\}\}, \quad \mathcal{T}_1(\mathcal{I}) = \emptyset, \quad \mathcal{T}_2(\mathcal{I}) = \emptyset, \quad \mathcal{T}_3(\mathcal{I}) = \{\emptyset, \{1\}, \{2\}\}.$$

Nach (3.11) und (3.13) ist dann

$$P^{\{1,2\},=} = \begin{pmatrix} 1 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 5 \end{pmatrix}, \quad P^{\emptyset,3} = \begin{pmatrix} 0 & 0 & 2 \\ 1 & 1 & 3 \end{pmatrix}, \quad P^{\{1\},3} = \begin{pmatrix} 1 & 0 & 1 \\ 0 & 1 & 4 \end{pmatrix},$$

$$P^{\{2\},3} = \begin{pmatrix} 0 & 1 & 1 \\ 1 & 0 & 4 \end{pmatrix}.$$

Damit ergibt sich folglich

$$(3.16) \quad \mathcal{E}_2(\mathcal{I}) = \mathcal{E}_2^=(\mathcal{I}) \cup \bigcup_{j_0 \in I_2} \mathcal{E}_2^{j_0}(\mathcal{I}) = \left\{ \begin{pmatrix} 1 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 5 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 0 & 2 \\ 1 & 1 & 3 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 1 & 0 & 1 \\ 0 & 1 & 4 \end{pmatrix}, \begin{pmatrix} 0 & 1 & 1 \\ 1 & 0 & 4 \end{pmatrix} \right\}$$

in Übereinstimmung mit Beispiel 2.5.2.

Daß dies kein Zufall war, besagt folgender

**Satz 3.2.3.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein Randsystem mit  $\min\{\#_{nt}I_1, \#_{nt}I_2\} = 2$ . Dann gilt  $\mathcal{E}_2(\mathcal{I}) = \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ .

*Beweis.* Angenommen, es ist  $\#_{I_1,nt} = 2$ . Ohne Beschränkung der Allgemeinheit sei  $I_1 = \{i_1, i_2\}$ ,  $i_1 \neq i_2$ ,  $r_{i_2} \geq r_{i_1} > 0$ ,  $I_2 = I_{2,nt}$ .

„ $\supseteq$ “: Sei  $P \in \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ . Wähle  $j_0 \in I_2$ , so daß  $p_{i_1, j_0} > 0$  und  $\bigvee_{j \in I_2 \setminus \{j_0\}} 0 \in \{p_{i_1, j}, p_{i_2, j}\}$  (so ein  $j_0$  gibt es, da  $r_{i_1} > 0$  und  $G(P)$  kreisfrei ist). Setze  $T := \{j \in I_2 \setminus \{j_0\} : p_{i_1, j} > 0\}$ . Dann ist  $\bigvee_{j \in T} p_{i_1, j} = s_j$ , das heißt

$$(3.17) \quad \sum_{j \in T \cup \{j_0\}} s_j = r_{i_1} \quad \text{oder} \quad r_{i_1} - s_{j_0} < r_{i_1} - p_{i_1, j_0} = \sum_{j \in T} s_j < r_{i_1}.$$

Im ersten Fall ist  $T \cup \{j_0\} \in \mathcal{T}_=(\mathcal{I})$  und  $P = P^{T \cup \{j_0\},=}$  nach (3.11). Also  $P \in \mathcal{E}_2(\mathcal{I})$ . Im zweiten Fall ist  $T \in \mathcal{T}_{j_0}(\mathcal{I})$ . Nach (3.13) ist dann  $P = P^{T, j_0}$  und damit wieder  $P \in \mathcal{E}_2(\mathcal{I})$ .

„ $\subseteq$ “: Ist  $P \in \mathcal{E}_2(\mathcal{I})$ , so sind nach Definition 3.2.1 zwei Fälle zu unterscheiden. Erster Fall:  $T := \{j \in I_2 : p_{i_1, j} > 0\} \in \mathcal{T}_=(\mathcal{I})$  und  $P = P^{T,=}$ . Dann ist klar, daß  $P \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$ , und da in jeder Spalte höchstens ein positives Element steht, ist  $G(P)$  kreisfrei, das heißt  $P \in \mathbf{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ . Zweiter Fall: Es gibt  $j_0 \in I_2$  und  $T \in \mathcal{T}_{j_0}(\mathcal{I})$ , so

daß  $P = P^{T,j_0}$  nach (3.13). Dann folgt zunächst, daß  $\forall_{(i,j) \in I_1 \times I_2} p_{i,j} \geq 0$ : Nur für  $j = j_0$  ist etwas zu zeigen. Es gilt  $p_{i_1,j_0} = r_{i_1} - \sum_{j \in T} s_j > 0$ , da  $r_{i_1} > \sum_{j \in T} s_j$ ,

$$p_{i_2,j_0} = r_{i_2} - \sum_{j \in (I_2 \setminus T) \setminus \{j_0\}} s_j = \sum_{j \in I_2} s_j - r_{i_1} - \sum_{j \in (I_2 \setminus T) \setminus \{j_0\}} s_j = \sum_{j \in T} s_j + s_{j_0} - r_{i_1} > 0,$$

da  $\sum_{j \in T} s_j > r_{i_1} - s_{j_0}$ . Um  $P \in \mathcal{D}(\mathcal{I})$  einzusehen, ist lediglich  $p_{i_1,j_0} + p_{i_2,j_0} = s_{j_0}$  zu zeigen (dann ist klar, daß sich alle anderen Linien, wie gewünscht, summieren). Es gilt

$$\begin{aligned} p_{i_1,j_0} + p_{i_2,j_0} &= r_{i_1} + r_{i_2} - \sum_{j \in T} s_j - \sum_{j \in (I_2 \setminus T) \setminus \{j_0\}} s_j = \sum_{j \in I_2} s_j - \sum_{j \in T} s_j - \sum_{j \in (I_2 \setminus T) \setminus \{j_0\}} s_j \\ &= s_{j_0}. \end{aligned}$$

Wegen  $\forall_{j \in I_2 \setminus \{j_0\}} 0 \in \{p_{i_1,j}, p_{i_2,j}\}$  ist  $G(P)$  kreisfrei. Damit ist auch im zweiten Fall  $P \in \mathcal{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$  gezeigt.

Der Beweis im Fall  $\#I_{2,nt} = 2$  verläuft völlig analog. ■

**Korollar 3.2.4.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein Randsystem mit  $\min\{\#I_{1,nt}, \#I_{2,nt}\} = 2$ . Dann gilt

$$(3.18) \quad \#\mathcal{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I})) = \begin{cases} \sum_{j \in I_2} \#\mathcal{T}_j(\mathcal{I}) + \#\mathcal{T}_=(\mathcal{I}) & \text{für } \#I_{1,nt} = 2, \\ \sum_{i \in I_1} \#\mathcal{T}_i(\mathcal{I}) + \#\mathcal{T}_=(\mathcal{I}) & \text{für } \#I_{2,nt} = 2. \end{cases}$$

*Beweis.* Es ist lediglich zu bemerken, daß die Vereinigung in (3.15) eine disjunkte Vereinigung ist. Das folgt aus (3.11) und (3.13), denn danach folgt für  $T \neq T'$ , daß  $P^{T,j} \neq P^{T',j}$  sowie, daß Elemente aus  $\mathcal{T}_j(\mathcal{I})$  sich von allen Elementen, die nicht in  $\mathcal{T}_j(\mathcal{I})$  liegen, zumindest in der  $j$ -ten Spalte (Zeile) unterscheiden. ■

In Abschnitt A.2 des Anhangs befindet sich der Quellcode eines Programms, das die in (3.18) gegebene Formel benutzt, um  $\#\mathcal{E}(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$  für endliche Randsysteme der Dimension  $2 \times n$  zu berechnen.

Das folgende Lemma 3.2.5 wendet Korollar 3.2.4 auf einige endliche Spezialfälle an. Die Ergebnisse werden anschließend in Beispiel 3.2.6 benutzt, um für  $2 \times 2$ -Randsysteme (in Teil (a)) und  $2 \times 3$ -Randsysteme (in Teil (b)) die möglichen Kardinalitäten der Extrempunkt Mengen vollständig zu klassifizieren.

**Lemma 3.2.5.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein Randsystem mit  $\#I_{1,nt} = 2$  und  $\#I_{2,nt} = n < \infty$ . Wählt man  $i_1, i_2 \in I_1$ , sowie  $j_1, j_2, j_3 \in I_2$ , so daß  $r_{i_1} = \min\{r_i : i \in I_{1,nt}\}$ ,  $r_{i_2} = \max\{r_i : i \in I_{1,nt}\}$ ,  $s_{j_1} = \min\{s_j : j \in I_{2,nt}\}$ ,  $s_{j_2} = \min\{s_j : j \in I_{2,nt} \setminus \{j_1\}\}$ ,  $s_{j_3} = \min\{s_j : j \in I_{2,nt} \setminus \{j_1, j_2\}\}$ , so gelten die Aussagen (a), (b) und (c).

- (a) Ist  $r_{i_1} \leq s_{j_1}$ , so gilt  $\#E(\mathcal{D}(\mathcal{I})) = n$ .
- (b) Ist  $s_{j_1} < r_{i_1} \leq s_{j_2}$ , so gilt  $\#E(\mathcal{D}(\mathcal{I})) = 2(n - 1)$ .
- (c) Ist  $s_{j_2} < r_{i_1} \leq s_{j_3}$ , so gilt:
- $\#E(\mathcal{D}(\mathcal{I})) = 3(n - 2) + 2$  für  $s_{j_1} + s_{j_2} > r_{i_1}$ .
  - $\#E(\mathcal{D}(\mathcal{I})) = 3(n - 2) + 1$  für  $s_{j_1} + s_{j_2} = r_{i_1}$ .
  - $\#E(\mathcal{D}(\mathcal{I})) = 4(n - 2)$  für  $s_{j_1} + s_{j_2} < r_{i_1}$ .

Entsprechende Aussagen gelten, falls  $\#I_{2,nt} = 2$  und  $\#I_{1,nt} = n < \infty$ .

*Beweis.* Ohne Beschränkung der Allgemeinheit kann man annehmen, daß  $I_1 = \{i_1, i_2\}$  mit  $r_{i_2} \geq r_{i_1} > 0$  und  $I_2 = I_{2,nt}$ .

(a) Für alle  $j \in I_2$  ist  $s_j \geq r_{i_1}$  und  $r_{i_1} - s_j \leq 0$ . Nach Definition 3.2.1 folgt daher

$$(3.19) \quad \mathcal{T}_=(\mathcal{I}) = \{\{j\} : j \in I_2, \mathcal{T}_j(\mathcal{I}) = \emptyset\}$$

sowie

$$(3.20) \quad \bigvee_{\substack{j \in I_2, \\ \{j\} \notin \mathcal{T}_=(\mathcal{I})}} \mathcal{T}_j(\mathcal{I}) = \{\emptyset\}.$$

Formel (3.18) liefert nun die Behauptung  $\#E(\mathcal{D}(\mathcal{I})) = n$ .

(b) Für alle  $j \in I_2 \setminus \{j_1\}$  ist  $s_j \geq r_{i_1}$  und  $r_{i_1} - s_j \leq 0$ . Wie in (a) bekommt man  $\mathcal{T}_=(\mathcal{I}) = \{\{j\} : j \in I_2 \setminus \{j_1\}, \emptyset \notin \mathcal{T}_j(\mathcal{I})\}$ . Weiterhin ist  $s_{j_1} < r_{i_1}$  und  $r_{i_1} - s_{j_1} < s_{j_1}$  für  $j \neq j_1$ . Also ist

$$(3.21) \quad \mathcal{T}_{j_1}(\mathcal{I}) = \emptyset, \quad \bigvee_{\substack{j \in I_2 \setminus \{j_1\}, \\ \{j\} \notin \mathcal{T}_=(\mathcal{I})}} \mathcal{T}_j(\mathcal{I}) = \{\emptyset, \{j_1\}\}, \quad \bigvee_{\substack{j \in I_2 \setminus \{j_1\}, \\ \{j\} \in \mathcal{T}_=(\mathcal{I})}} \mathcal{T}_j(\mathcal{I}) = \{\{j_1\}\}.$$

Mit (3.18) folgt daraus  $\#E(\mathcal{D}(\mathcal{I})) = 2(n - 1)$ .

(c)  $s_{j_1} + s_{j_2} > r_{i_1}$ : Es folgt  $\mathcal{T}_=(\mathcal{I}) = \{\{j\} : j \in I_2 \setminus \{j_1, j_2\}, \emptyset \notin \mathcal{T}_j(\mathcal{I})\}$ ,  $\mathcal{T}_{j_1}(\mathcal{I}) = \{\{j_2\}\}$ ,  $\mathcal{T}_{j_2}(\mathcal{I}) = \{\{j_1\}\}$  sowie

$$(3.22) \quad \bigvee_{\substack{j \in I_2 \setminus \{j_1, j_2\}, \\ \{j\} \notin \mathcal{T}_=(\mathcal{I})}} \mathcal{T}_j(\mathcal{I}) = \{\emptyset, \{j_1\}, \{j_2\}\}, \quad \bigvee_{\substack{j \in I_2 \setminus \{j_1, j_2\}, \\ \{j\} \in \mathcal{T}_=(\mathcal{I})}} \mathcal{T}_j(\mathcal{I}) = \{\{j_1\}, \{j_2\}\}.$$

(3.18) liefert daher  $\#E(\mathcal{D}(\mathcal{I})) = 3(n - 2) + 2$ .

$s_{j_1} + s_{j_2} = r_{i_1}$ : Dann gilt

$$(3.23) \quad \mathcal{T}_=(\mathcal{I}) = \{\{j\} : j \in I_2 \setminus \{j_1, j_2\}, \emptyset \notin \mathcal{T}_j(\mathcal{I})\} \cup \{\{j_1, j_2\}\}, \quad \mathcal{T}_{j_1}(\mathcal{I}) = \mathcal{T}_{j_2}(\mathcal{I}) = \emptyset,$$

$$(3.24) \quad \forall_{\substack{j \in I_2 \setminus \{j_1, j_2\}, \\ \{j\} \notin \mathcal{T}_=(\mathcal{I})}} \mathcal{T}_j(\mathcal{I}) = \{\emptyset, \{j_1\}, \{j_2\}\}, \quad \forall_{\substack{j \in I_2 \setminus \{j_1, j_2\}, \\ \{j\} \in \mathcal{T}_=(\mathcal{I})}} \mathcal{T}_j(\mathcal{I}) = \{\{j_1\}, \{j_2\}\}.$$

Diesmal liefert (3.18) also  $\#E(\mathcal{D}(\mathcal{I})) = 3(n-2) + 1$ .

$$s_{j_1} + s_{j_2} < r_{i_1}: \quad \text{Es gilt} \quad \mathcal{T}_=(\mathcal{I}) = \{\{j\} : j \in I_2 \setminus \{j_1, j_2\}, \emptyset \notin \mathcal{T}_j(\mathcal{I})\}, \\ \mathcal{T}_{j_1}(\mathcal{I}) = \mathcal{T}_{j_2}(\mathcal{I}) = \emptyset,$$

$$(3.25) \quad \forall_{\substack{j \in I_2 \setminus \{j_1, j_2\}, \\ \{j\} \notin \mathcal{T}_=(\mathcal{I})}} \mathcal{T}_j(\mathcal{I}) = \{\emptyset, \{j_1\}, \{j_2\}, \{j_1, j_2\}\}, \quad \forall_{\substack{j \in I_2 \setminus \{j_1, j_2\}, \\ \{j\} \in \mathcal{T}_=(\mathcal{I})}} \mathcal{T}_j(\mathcal{I}) = \{\{j_1\}, \{j_2\}, \{j_1, j_2\}\}.$$

Also ist  $\#E(\mathcal{D}(\mathcal{I})) = 4(n-2)$  nach (3.18). ■

**Beispiel 3.2.6.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein Randsystem mit  $\#I_{1,nt} = 2$ . Die Bezeichnungen seien wie in Lemma 3.2.5.

(a) Gilt  $\#I_{2,nt} = 2$ , so ist  $\#E(\mathcal{D}(\mathcal{I})) = 2$ :

Das folgt wegen  $r_{i_1} \leq s_{j_2}$  und  $2 = 2 \cdot (2-1)$  sofort aus (a) und (b) von Lemma 3.2.5.

(b) Gilt  $\#I_{2,nt} = 3$ , so ist

- (i)  $\#E(\mathcal{D}(\mathcal{I})) = 3$  für  $r_{i_1} \leq s_{j_1}$ .
- (ii)  $\#E(\mathcal{D}(\mathcal{I})) = 4$  für  $s_{j_1} < r_{i_1} \leq s_{j_2}$ .
- (iii)  $\#E(\mathcal{D}(\mathcal{I})) = 4$  für  $s_{j_2} < r_{i_1} \leq r_{i_2} \leq s_{j_3}$ .
- (iv)  $\#E(\mathcal{D}(\mathcal{I})) = 5$  für  $s_{j_2} < r_{i_1} \leq s_{j_3} < r_{i_2}$ .
- (v)  $\#E(\mathcal{D}(\mathcal{I})) = 6$  für  $s_{j_3} < r_{i_1}$ .

Eine entsprechende Aussage gilt, wenn man die Rollen  $I_1$  und  $I_2$  vertauscht.

Die folgenden Angaben (a), (b), (c) beziehen sich auf Lemma 3.2.5. (i) folgt aus (a), (ii) folgt aus (b), (iii) folgt aus (c), da  $s_{j_1} + s_{j_2} \leq r_{i_1}$  und  $4(3-2) = 3(3-2) + 1 = 4$ , (iv) folgt aus (c),  $s_{j_1} + s_{j_2} > r_{i_1}$ . (v) ergibt sich wie folgt: Es ist  $\mathcal{T}_=(\mathcal{I}) = \emptyset$ ,  $\mathcal{T}_{j_1}(\mathcal{I}) = \{\{j_2\}, \{j_3\}\}$ ,  $\mathcal{T}_{j_2}(\mathcal{I}) = \{\{j_1\}, \{j_3\}\}$ ,  $\mathcal{T}_{j_3}(\mathcal{I}) = \{\{j_2\}, \{j_1\}\}$ , da  $\min\{s_{j_1} + s_{j_2}, s_{j_1} + s_{j_3}, s_{j_1} + s_{j_2}\} > r_{i_1}$ . Wegen (3.18) ist dann  $\#E(\mathcal{D}(\mathcal{I})) = 6$ .

Die Ergebnisse von Beispiel 3.2.6 und die Berechnung von Extremalpunktanzahlen in diversen Spezialfällen mit Hilfe des in Abschnitt A.1 des Anhangs angegebenen Programmes führen zu der Vermutung, daß für vorgegebene Dimension des Randsystems immer alle Zahlen unterhalb eines Maximalwertes für Extremalpunktanzahlen vorkommen (Nullen in den Randvektoren zugelassen).

Es ist recht unbefriedigend, daß es bisher keinen Algorithmus gibt, der im Fall endlicher Randsysteme die Anzahl der Extrempunkte berechnet, ohne die Extrempunkte alle explizit zu bestimmen. Obwohl durch die Konstruktion aus Definition 3.2.1 für den  $2 \times n$ -Fall ein solcher Algorithmus gegeben ist, kann die Aufgabe wohl auch für diesen Fall noch nicht als gelöst betrachtet werden. Zur Berechnung der nach (3.9) und (3.10) definierten Mengen muß das sogenannte „Knapsack-Problem“ gelöst werden, welches, wie schon in der Einleitung erwähnt, NP-vollständig ist. Ob es für die Bestimmung der Anzahl der Extrempunkte polynomielle Algorithmen geben kann, ist unbekannt.

Zum Abschluß soll für endliche  $2 \times n$ -Randsysteme eine Prozedur für einen Zufallsspaziergang auf den Extrempunkten konstruiert werden, der es erlaubt,  $\#E(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$  über einen probabilistischen Algorithmus zu bestimmen. Leider ist es bisher nicht gelungen, die Prozedur auf  $k \times n$ -Randsysteme mit  $k > 2$  auszuweiten.

**Definition 3.2.7.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein Randsystem mit  $\#I_1 = 2$ ,  $2 \leq n := \#I_2 < \infty$ ,  $I_1 = \{i_1, i_2\}$  mit  $r_{i_2} \geq r_{i_1} > 0$  und  $I_2 = I_{2,nt}$ . Definiere dann eine Funktion  $F : E(\mathcal{D}(\mathcal{I})) \rightarrow 2^{\mathcal{M}_{\mathbb{R}}(I_1, I_2)}$ , wie folgt: Zunächst sei  $f : E(\mathcal{D}(\mathcal{I})) \rightarrow I_2$  eine Funktion, so daß  $\forall_{P \in E(\mathcal{D}(\mathcal{I}))} \forall_{j \in I_2 \setminus \{f(P)\}} 0 \in \{p_{i_1, j}, p_{i_2, j}\}$ .

Für  $P \in E(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$  sei

$$(3.26) \quad T(P) := \{(j_1, j_2) \in I_2 \times I_2 : j_1 \neq j_2, f(P) \in \{j_1, j_2\}, p_{i_1, j_1} > 0, p_{i_2, j_2} > 0\}.$$

Für  $(j_1, j_2) \in T(P)$  definiere  $\delta^{(j_1, j_2)} := \min\{p_{i_1, j_1}, p_{i_2, j_2}\}$  sowie  $P^{(j_1, j_2)} = (p_{i, j}^{(j_1, j_2)})_{(i, j) \in I_1 \times I_2}$  durch  $P^{(j_1, j_2)}|_{I_1 \times (I_2 \setminus \{j_1, j_2\})} := P|_{I_1 \times (I_2 \setminus \{j_1, j_2\})}$  und

$$(3.27) \quad p_{i, j}^{(j_1, j_2)} := \begin{cases} p_{i, j} + \delta^{(j_1, j_2)} & \text{für } (i, j) \in \{(i_1, j_2), (i_2, j_1)\}, \\ p_{i, j} - \delta^{(j_1, j_2)} & \text{für } (i, j) \in \{(i_1, j_1), (i_2, j_2)\}. \end{cases}$$

Schließlich sei

$$(3.28) \quad F(P) := \{P^{(j_1, j_2)} : (j_1, j_2) \in T(P)\}.$$

Im Fall, daß  $\mathcal{I} = (I_1, I_2, r, s)$  ein beliebiges Randsystem mit  $\min\{\#I_{1,nt}, \#I_{2,nt}\} = 2$ ,  $\max\{\#I_{1,nt}, \#I_{2,nt}\} < \infty$  ist, kann die Funktion  $F$  ganz analog definiert werden.

**Lemma 3.2.8.** Sei  $\mathcal{I} := (I_1, I_2, r, s)$  ein Randsystem mit  $\min\{\#I_{1,nt}, \#I_{2,nt}\} = 2$ ,  $2 \leq n := \max\{\#I_{1,nt}, \#I_{2,nt}\} < \infty$  und  $F : E(\mathcal{D}(\mathcal{I})) \rightarrow 2^{\mathcal{M}_{\mathbb{R}}(I_1, I_2)}$  gemäß Definition 3.2.7.

(a) Für  $P \in E(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$  gilt  $F(P) \subseteq E(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ .

(b) Für  $P, Q \in E(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$  gibt es eine endliche Folge  $(P_i)_{i \in \{1, \dots, k\}} \subseteq E(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$  mit  $P_1 = P, P_k = Q, \forall_{i \in \{1, \dots, k-1\}} P_{i+1} \in F(P_i)$ .

*Beweis.* Ohne Beschränkung der Allgemeinheit kann man annehmen, daß  $\#I_1 = 2, 2 \leq n := \#I_2 < \infty, I_1 = \{i_1, i_2\}$  mit  $r_{i_2} \geq r_{i_1} > 0, I_2 = I_{2,nt}$  und  $s_{j_1} = \min\{s_j : j \in I_2\}$ . Die Bezeichnungen seien wie in 3.2.7.

(a) Nach Wahl von  $f$  gilt  $\forall_{(j_1, j_2) \in T(P)} \forall_{j \in I_2 \setminus \{j_1, j_2\}} 0 \in \{p_{i_1, j}, p_{i_2, j}\}$ , und nach Definition von  $\delta^{(j_1, j_2)}$  und (3.27) ist

$$(3.29) \quad \forall_{(j_1, j_2) \in T(P)} (0 \in \{p_{i_1, j_1}, p_{i_2, j_1}\} \text{ oder } 0 \in \{p_{i_1, j_2}, p_{i_2, j_2}\}).$$

Also ist  $G(P^{(j_1, j_2)})$  kreisfrei für alle  $(j_1, j_2) \in T(P)$ .

(b) Man definiere auf  $E(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$  eine Relation „ $\sim$ “, wie folgt: Für  $P, Q \in E(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$  gelte  $P \sim Q$  genau dann, wenn es eine endliche Folge  $(P_i)_{i \in \{1, \dots, k\}} \subseteq E(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$  mit  $P_1 = P, P_k = Q, \forall_{i \in \{1, \dots, k-1\}} P_{i+1} \in F(P_i)$  gibt. Dann ist klar, daß „ $\sim$ “ reflexiv und transitiv ist. Da nach (3.27)  $\forall_{Q \in F(P)} P \in F(Q)$  gilt, ist „ $\sim$ “ außerdem symmetrisch.

Damit ist „ $\sim$ “ eine Äquivalenzrelation. Der Beweis von (b) erfolgt nun durch Induktion nach  $n$ . Aus der Definition von  $\delta^{(j_1, j_2)}$  und (3.27) folgt, daß  $P \notin F(P)$ . Damit ist für  $n = 2$  wegen  $\#E(\mathcal{D}(\mathcal{I})) = 2$  nichts mehr zu zeigen. Sei also  $n > 2$ . Setze

$$(3.30) \quad \begin{aligned} \mathcal{P}_{(*)}^{(0)} &:= \{P \in E(\mathcal{D}(\mathcal{I})) : p_{i_1, j_1} = 0, p_{i_2, j_1} = s_{j_1}\}, \\ \mathcal{P}_{(*)}^{(0)} &:= \{P \in E(\mathcal{D}(\mathcal{I})) : p_{i_1, j_1} = s_{j_1}, p_{i_2, j_1} = 0\}, \\ \mathcal{P}_{(*)}^{(*)} &:= \{P \in E(\mathcal{D}(\mathcal{I})) : p_{i_1, j_1}, p_{i_2, j_1} > 0\}. \end{aligned}$$

Sind  $P, Q \in \mathcal{P}_{(*)}^{(0)}$  und bezeichnet man die zu „ $\sim$ “ analoge Relation auf  $\mathcal{I}(P|_{I_1 \times (I_2 \setminus \{j_1\})})$  wieder mit „ $\sim$ “, so gilt per Induktion, daß  $P|_{I_1 \times (I_2 \setminus \{j_1\})} \sim Q|_{I_1 \times (I_2 \setminus \{j_1\})}$  (man kann annehmen, daß für die zu  $f$  analoge Funktion  $\tilde{f}$  auf  $E(\mathcal{D}(\mathcal{I}(P|_{I_1 \times (I_2 \setminus \{j_1\})}))$ ) gilt, daß  $\forall_{Q \in E(\mathcal{D}(\mathcal{I}))} f(Q) = \tilde{f}(Q|_{I_1 \times (I_2 \setminus \{j_1\})})$ ). Daraus folgt nun  $P \sim Q$ . Da „ $\sim$ “ eine Äquivalenzrelation ist und  $E(\mathcal{D}(\mathcal{I})) = \mathcal{P}_{(*)}^{(0)} \cup \mathcal{P}_{(*)}^{(0)} \cup \mathcal{P}_{(*)}^{(*)}$  gilt, wird der Beweis von (b) durch die folgenden Behauptungen 1 und 2 vollständig.

*Behauptung 1.*  $\forall_{P \in \mathcal{P}_{(*)}^{(*)}} \exists_{Q \in \mathcal{P}_{(*)}^{(0)}} Q \sim P$ .

*Beweis.* Für  $P \in \mathcal{M}_{\mathbb{R}}(I_1, I_2)$  sei  $S_P := \{j \in I_2 \setminus \{j_1\} : p_{i_2, j} > 0\}$  und  $m_P := \#S_P$ . Angenommen, Behauptung 1 ist falsch. Dann gibt es ein „mi-

nimales Gegenbeispiel“, das heißt,

$$(3.31) \quad \exists_{P \in \mathcal{P}_{(*)}^{(0)}} \left( \forall_{Q \in \mathcal{P}_{(*)}^{(0)}} Q \not\sim P \text{ und } \forall_{\substack{\tilde{P} \in \mathcal{P}_{(*)}^{(0)}, \\ m_{\tilde{P}} < m_P}} \exists_{Q \in \mathcal{P}_{(*)}^{(0)}} Q \sim \tilde{P} \right).$$

Insbesondere muß dann  $m_P > 0$  gelten, da das für jedes Element von  $\mathcal{D}(\mathcal{I})$  gilt. Nun sei  $j \in S_P$ . Dann ist  $(j_1, j) \in T(P)$ . Wegen  $P^{(j_1, j)} \notin \mathcal{P}_{(*)}^{(0)}$  muß  $p_{i_2, j} < p_{i_1, j_1}$  gelten. Dann ist aber  $P^{(j_1, j)}$  ein Gegenbeispiel zu Behauptung 1 mit  $m_{P^{(j_1, j)}} < m_P$  im Widerspruch zur Wahl von  $P$ .  $\blacktriangle$

*Behauptung 2.*  $\forall_{P \in \mathcal{P}_{(*)}^{(0)}} \exists_{Q \in \mathcal{P}_{(*)}^{(0)} \cup \mathcal{P}_{(*)}^{(0)}} Q \in F(P)$ .

*Beweis.* Sei  $P \in \mathcal{P}_{(*)}^{(0)}$  gegeben. Wähle dann  $j \in I_2 \setminus \{j_1\}$  mit  $(j_1, j) \in T(P)$ . Nach (3.27) ist  $p_{i_2, j_1}^{(j_1, j_2)} > 0$ , das heißt, es gilt  $P^{(j_1, j_2)} \in \mathcal{P}_{(*)}^{(0)}$  oder  $P^{(j_1, j_2)} \in \mathcal{P}_{(*)}^{(0)}$ .  $\blacktriangle$

■

# Anhang A

## Quelltexte implementierter Algorithmen

### A.1 Mathematica-Implementation eines Algorithmus zur Bestimmung extremaler Matrizen im endlichen Fall

```
s[l_]:=Apply[Plus,l]

ok[v_,w_]:=s[v]==s[w]

line[a_,j_,n_]:=ReplacePart[nline[n],a,j]
nline[n_]:=Table[0,{n}]

index[i_,j_]:=Partition[Flatten[Table[{k,l},{k,i},{1,j}]],2]
mindex[v_,w_]:=Select[index[Length[v],Length[w]],
    testmind[#,v,w] &]
testmind[{i_,j_},v_,w_]:=v[[i]]<=w[[j]]
nindex[v_,w_]:=Select[index[Length[v],Length[w]],
    testnind[#,v,w] &]
testnind[{i_,j_},v_,w_]:=v[[i]]>w[[j]]

ran[min_,max_,{m_,n_},a_]
:=Map[anzex,Map[conv,
    Table[{Table[Random[Integer,{min,max}],{m}],
    Table[Random[Integer,{min,max}],{n}]}],{a}]]]

conv[{l1_,l2_}]:={l1,l2} /; s[l1]==s[l2]
```



```

conv[{l1_,l2_}]
  :={l1,ReplacePart[l2,s[l1]-s[l2]+Last[l2],Length[l2]]}
  /; s[l1]>s[l2]
conv[{l1_,l2_}]
  :={ReplacePart[l1,s[l2]-s[l1]+Last[l1],Length[l1]],l2}
  /; s[l1]<s[l2]

mex[v_,w_]:=Map[MatrixForm,ex[v,w]] /; ok[v,w]
anzex[{v_,w_}]:={{v,w},Length[ex[v,w]]} /; ok[v,w]

ex[{x_},w_]:={{w}} /; ok[{x},w]
ex[v_,{x_}]:={Transpose[{v}]}
ex[v_,w_]:=Union[m[v,w],n[v,w]]

m[v_,w_]:=Apply[Union,Map[mij[v,w,#] &,mindex[v,w]]]
mij[v_,w_,{i_,j_}]
  :=Map[rowin[v,w,i,j,#] &,ex[Delete[v,i],
    ReplacePart[w,w[[j]]-v[[i]],j]]]

rowin[v_,w_,i_,j_,mat_]:=rin[mat,line[v[[i]],j,Length[w]],i]
rin[mat_,r_,i_]:=Insert[mat,r,i]

n[v_,w_]:=Apply[Union,Map[nij[v,w,#] &,nindex[v,w]]]
nij[v_,w_,{i_,j_}]
  :=Map[colin[v,w,i,j,#] &,ex[ReplacePart[v,v[[i]]-w[[j]],i],
    Delete[w,j]]]

colin[v_,w_,i_,j_,mat_]:=cin[mat,line[w[[j]],i,Length[v]],j]
cin[mat_,l_,j_]:=Transpose[rin[Transpose[mat],l,j]]

```

Kurze Beschreibung des Programms (im folgenden sei  $\mathcal{I}$  das zu gegebenen Randvektoren  $v, w$  gehörende Randsystem):

$s[l_]$  berechnet die Summe einer Liste  $l$  von Zahlen.  $ok[v_, w_]$  testet, ob  $v, w$  Randvektoren eines Randsystems sind.  $nline[n_]$  erzeugt eine Liste, die aus  $n$  Nullen besteht.  $line[a_, j_, n_]$  ersetzt in einer Liste, die aus  $n$  Nullen besteht, das  $j$ -te Element durch  $a$ .  $index[i_, j_]$  erzeugt eine Liste, die genau alle Indizes einer  $i \times j$  Matrix enthält.  $mindex[v_, w_]$  und  $nindex[v_, w_]$  erzeugen Listen, die aus den Elementen der Mengen  $M(\mathcal{I})$  beziehungsweise  $N(\mathcal{I})$  gemäß (2.52) bestehen.  $rin[mat_, r_, i_]$  ( $cin[mat_, l_, j_]$ ) fügt in die Matrix  $mat$  eine neue  $i$ -te Zeile  $r$  ( $j$ -te Spalte  $l$ ) ein.  $rowin[v_, w_, i_, j_, mat_]$  ( $colin[v_, w_, i_, j_, mat_]$ ) fügt in die Matrix  $mat$  eine  $i$ -te Zeile ( $j$ -te Spalte) ein, die an der  $j$ -ten ( $i$ -ten) Stelle  $v[[i]]$  ( $w[[j]]$ ) stehen hat und sonst nur

Nullen. `mij[v_,w_,{i_,j_}]` erzeugt eine Liste der Elemente von  $\mathcal{M}_{i,j}(\mathcal{I})$  gemäß (2.55); entsprechend erzeugt `nij[v_,w_,{i_,j_}]` eine Liste der Elemente von  $\mathcal{N}_{i,j}(\mathcal{I})$  gemäß (2.56). `m[v_,w_]` beziehungsweise `n[v_,w_]` erzeugen eine Liste der Elemente von  $\mathcal{M}(\mathcal{I})$  beziehungsweise  $\mathcal{N}(\mathcal{I})$  gemäß (2.57). `ex[v_,w_]` liefert eine Liste der extremalen Matrizen, das heißt der Elemente von  $\mathcal{E}(\mathcal{I})$  gemäß Definition 2.5.1. `mex[v_,w_]` gibt die Elemente von `ex[v_,w_]` in Matrixform aus. `anzex[{v_,w_}]` berechnet  $\#E(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ . `ran[min_,max_,{m_,n_},a_]` wendet die Funktion `anzex` auf a „zufällig“ erzeugte Randsysteme mit `m` Zeilen und `n` Spalten an, wobei die Einträge der Randvektoren ganze Zahlen zwischen `min` und `max` sind.

**Bemerkung A.1.1.** Damit die Funktionen dieses Programms zuverlässig funktionieren, muß Mathematica exakte Größenvergleiche durchführen können. Deshalb darf das Programm nur auf ganze Zahlen oder Brüche, nicht aber auf Fließkommazahlen angewendet werden.

## A.2 Mathematica-Implementation eines Algorithmus zur Bestimmung von $\#E(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$ im $2 \times n$ Fall

Das folgende Programm benutzt die Funktion `s` aus Abschnitt A.1.

```
fanzex[{v_,w_}] := {v,w}, sanzex[Sort[v],Sort[w]]}
sanzex[{r1_,r2_},w_] := s[Table[cex[r1,i,w],{i,Length[w]}]]
      +rcex[r1,w]

subsets[{}]:={{}
subsets[v_]:=Flatten[Map[h1[#,Last[v]] &,subsets[Drop[v,-1]]],1]
h1[l_,e_]:= {1,Append[l,e]}

valid[l_,min_,max_] := 1 /; min<s[l]<max
valid[l_,min_,max_] := 0
valtab[s_,min_,max_] := Map[valid[#,min,max] &,s]

cex[r1_,i_,w_] := s[valtab[subsets[subl[r1,i,w]],r1-w[[i]],r1]]
subl[r1_,i_,w_] := Select[Delete[w,i],#<r1 &]

rval[r1_,l_] := 1 /; s[l]==r1
rval[r1_,l_] := 0
rvaltab[r1_,s_] := Map[rval[r1,#] &,s]
```

```
rcex[r1_,w_]:=s[rvaltab[r1,subsets[rsubl[r1,w]]]]
rsubl[r1_,w_]:=Select[w,#<=r1 &]
```

Kurze Beschreibung des Programms (wieder sei  $\mathcal{I}$  das zu gegebenen Randvektoren  $\mathbf{v}, \mathbf{w}$  gehörende Randsystem; dabei wird jetzt immer vorausgesetzt, daß  $\mathbf{v}$  zweielementig ist):

`subsets[m_]` liefert eine Liste aller Teilmengen von  $m$ . `valid[l_,min_,max_]` testet, ob die Summe der Elemente von  $l$  echt zwischen  $min$  und  $max$  liegt. Ist das der Fall, so wird  $1$  ausgegeben, ansonsten  $0$ . `valtab[s_,min_,max_]` wendet `valid[l_,min_,max_]` auf eine Liste von Listen  $s$  an und liefert eine Tabelle der entsprechenden Wahrheitswerte ( $0$  oder  $1$ ). `subl[r1_,i_,w_]` entfernt aus der Liste  $w$  das  $i$ -te Element sowie alle Elemente, die nicht kleiner als  $r1$  sind. `cex[r1_,i_,w_]` berechnet die Kardinalität der nach (3.10) definierten Menge  $\mathcal{T}_i(\mathcal{I})$ . Die Funktion `rval` entspricht der Funktion `valid`, nur daß `rval[r1_,l_]` testet, ob die Summe der Elemente von  $l$  gleich  $r1$  ist. In der gleichen Weise entsprechen die Funktionen `rvaltab`, `rcex`, `rsubl` den Funktionen `valtab`, `cex` und `subl`. `sanzex[v_,w_]` berechnet  $\#E(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$  nach (3.18), wobei vorausgesetzt wird, daß die Elemente von  $\mathbf{v}$  und  $\mathbf{w}$  der Größe nach sortiert sind. `fanzex[{v_,w_}]` gibt  $\#E(\mathcal{D}(\mathcal{I}))$  zusammen mit  $\{\mathbf{v}, \mathbf{w}\}$  aus, wobei die Elemente von  $\mathbf{v}$  und  $\mathbf{w}$  nicht mehr sortiert sein müssen.

Wieder ist Bemerkung A.1.1 zu beachten.

# Literaturverzeichnis

- [1] G.D. BIRKHOFF. *Tres observaciones sobre el algebra lineal*. Univ. Nac. Tucumán Rev. Ser. A, vol. 5 (1946), pp. 147-151.
- [2] \_\_\_\_\_. *Combinatorial properties of symmetric non-negative matrices*. Colloquio Internazionale sulle Theorie Combinatorie Roma, 3-15 settembre 1973, Tomo II, Roma, Accademia Nazionale Dei Lincei, 1976, pp. 99-120.
- [3] M.R. GAREY / D.S. JOHNSON. *Computers and intractability*. W.H. Freeman and Company, New York, 1984.
- [4] R. GRZAŚLEWICZ. *On extreme infinite double stochastic matrices*. Illinois J. of Math., vol. 31 (1987), pp. 529-543.
- [5] J.R. ISBELL. *Infinite doubly stochastic matrices*. Canadian Math. Bull., vol. 5 (1962), pp. 1-4.
- [6] G.J.O. JAMESON. *Topology and Normed Spaces*. Chapman and Hall, London, 1974.
- [7] M.G. KENDAL. *On infinite doubly stochastic matrices and Birkhoff's problem 111*. J. London Math. Soc., vol. 35 (1960), pp. 81-84.
- [8] J. LINDENSTRAUSS. *A remark on extreme doubly stochastic matrix measures*. Amer. Math. Monthly, vol. 72 (1965), pp. 379-382.
- [9] J.T. MARTI. *Konvexe Analysis*. Birkhäuser Verlag, Basel, 1977.
- [10] L. MIRSKY. *On a convex set of matrices*. Arch. math., vol. 10 (1959), pp. 88-92.
- [11] H.L. ROYDEN. *Real Analysis 3rd edition*. Macmillian Publ., New York, 1988.
- [12] W. RUDIN. *Real and Complex Analysis 3rd edition*. McGraw-Hill Book Company, New York, 1987.
- [13] D.B. WEST. *Introduction to Graph Theory*. Prentice Hall, 1996.

- [14] S. WOLFRAM. *Mathematica. A system for doing mathematics by computer.* 2nd edition. Addison-Wesley, 1993.