

EXISTENCE D'UN GENERATEUR SUIVANT UNE SOUS-SUITE DE DENSITE SUPERIEURE NULLE

PAR
SÉBASTIEN FERENCZI

ABSTRACT

Ergodic theory: for every dynamical system (X, \mathcal{A}, T, μ) , totally ergodic and of finite entropy, there exist a sequence S of integers, of upper density zero, and a partition Q of X , such that $\bigvee_{i \in S} T^{-i}Q$ is the whole σ -algebra \mathcal{A} . Furthermore, there is a "universal" sequence S^0 for which this property is true if we restrict ourselves to the class of strongly mixing systems.

Soit (X, \mathcal{A}, T, μ) un système dynamique d'entropie non nulle; peut-il vérifier $\mathcal{A} = \bigvee_{i \in S} T^i P$ pour une partition P finie et un sous-ensemble S de \mathbf{Z} de densité supérieure nulle? (S est dit de densité supérieure nulle si, pour tout ε strictement positif, il existe N_0 tel que pour tout N supérieur à N_0 et tout entier j ,

$$\text{card}(S \cap [j - N, j + N]) < 2\varepsilon N.)$$

La réponse est oui, (X, T) peut même être un schéma de Bernoulli. Plus précisément:

PROPOSITION 1. *Soit (X, \mathcal{A}, T, μ) un système dynamique d'entropie finie totalement ergodique (c'est-à-dire où T^n est ergodique pour tout n); alors il existe une partition finie Q de X et un ensemble d'entiers S de densité supérieure nulle tels que $\bigvee_{i \in S} T^{-i}Q$ soit toute la σ -algèbre \mathcal{A} .*

La méthode s'inspire d'un article d'Ornstein et Weiss [1], qui, au passage, démontrent le résultat pour une suite de densité inférieure nulle. Je remercie beaucoup J.-P. Thouvenot qui m'a posé cette question et m'a aidé à y répondre.

DÉMONSTRATION. Soit $P = (P_1, \dots, P_k)$ un générateur fini de (X, T) . On se donne une suite d'entiers g_n tendant vers $+\infty$ et une suite ε_n tendant vers 0, vérifiant:

Received April 24, 1981 and in revised form February 7, 1982

$$(0) \quad \sum_{n=0}^{+\infty} \frac{1}{(2n+1)g_n} < 1,$$

$$(1) \quad g_n \equiv 1 \pmod{2n+1};$$

on précisera d'autres conditions de croissance sur g_n et sur ε_n à la fin.

On va construire pour tout entier n une partition Q_n de X et un sous-ensemble fini S_n de Z vérifiant:

$$(2_n) \quad S_n \subset \{0\} \cup [-R_n, -R_{n-1} - e^n] \cup [R_{n-1} + e^n, R_n]$$

où

$$R_j = \sup_{x \in \cup_{i,j} S_i} |x|,$$

(3_n) deux termes consécutifs de S_n diffèrent d'au moins e^n ,

$$(4_n) \quad Q_n \supset P,$$

$$(5_n) \quad Q_n = \{Q_i^n, 1 \leq i \leq k; \bar{Q}_i^n, 1 \leq i \leq k; Q_{ij}^n, 1 \leq i \leq k, 1 \leq j \leq k\},$$

$$(6_n) \quad \text{si } E_n = \bigcup_{i=1}^k \bar{Q}_i^n, \quad \mu(E_n) \leq \sum_{j=0}^n \frac{1}{(2j+1)g_j},$$

(7_n) $\bigvee_{i \in S_n} T^i Q_n$ raffine $\bigvee_{j=0}^n T^j P$ sauf sur un ensemble de mesure inférieure à $2/g_n + 2\varepsilon_n$,

$$(8_n) \quad |Q_n - Q_{n-1}| < 2/g_n.$$

On part de $S_0 = \{0\}$ et $Q_0 = P$. Supposons la construction réalisée au stade $n - 1$.

CONSTRUCTION DE S_n . On choisit $(2n + 1)^2 g_n$ entiers positifs, notés $u_{h,i,j}$ ($-n \leq h \leq n, 0 \leq i \leq g_n - 1, -n \leq j \leq n$), vérifiant:

$$(9) \quad u_{h,i,j} \equiv i \pmod{g_n} \quad \text{pour tout } (h, i, j),$$

$$(10) \quad u_{h,i,j} \equiv j \pmod{2n+1} \quad \text{pour tout } (h, i, j),$$

$$(11) \quad u_{n,0,-n} > R_{n-1} + 2n + e^n, \quad \text{où } R_{n-1} \text{ est défini par } (2_{n-1}),$$

$$(12) \quad u_{(h,i,j)+1} > 2u_{(h,i,j)} + 2n + e^n,$$

pour tout (h, i, j) , où on note $(h, i, j) + 1$ le successeur de (h, i, j) dans l'ordre lexicographique.

Ces relations peuvent être réalisées simultanément, (9) et (10) étant compatibles grâce à (1). On pose:

$$\bar{S}_n = \{u_{h,i,j}, -n \leq h \leq n, 0 \leq i \leq g_n - 1, -n \leq j \leq n\}$$

$$(A) \quad \cup \{u_{h,i,j} - u_{h,i',j'} + h, -n \leq h \leq n, 0 \leq i \leq g_n - 1, \\ 0 \leq i' \leq g_n - 1, -n \leq j \leq n, -n \leq j' \leq n, \text{ et } (i, j) \neq (i', j')\}.$$

Grâce à (11) et (12), \bar{S}_n est comprise dans les intervalles $]-\infty, -R_{n-1} - e^n]$ et $[R_{n-1} + e^n, +\infty[$ et deux termes consécutifs de \bar{S}_n diffèrent d'au moins e^n .

Soit maintenant $\bar{R}_n = \text{Sup}_{x \in \bar{S}_n} |x|$. On choisit un entier λ_n vérifiant:

$$(13) \quad \lambda_n \equiv 0 \quad [(2n + 1)g_n],$$

$$(14) \quad \lambda_n > \bar{R}_n + e^n.$$

Par (6_{n-1}) , (0) et ergodicité de T^{λ_n} ,

$$\mu \left(\bigcap_{\gamma=-x}^x T^{\gamma \lambda_n} E_{n-1} \right) = 0.$$

Donc, pour un N_n assez grand,

$$\mu \left(\bigcap_{\gamma=-N_n}^{N_n} T^{\gamma \lambda_n} E_{n-1} \right) < \frac{\epsilon_n}{(2n + 1)g_n}.$$

On choisit enfin $(2n + 1)g_n$ entiers positifs notés $v_{\alpha,\beta}$ ($0 \leq \alpha \leq g_n - 1, -n \leq \beta \leq n$), vérifiant

$$(15) \quad v_{\alpha,\beta} \equiv 1 - \alpha \quad [g_n],$$

$$(16) \quad v_{\alpha,\beta} \equiv 1 - \beta \quad [2n + 1],$$

$$(17) \quad \bar{R}_n \leq v_{\alpha,\beta} \leq 2\bar{R}_n,$$

$$(18) \quad \text{deux } v_{\alpha,\beta} \text{ consécutifs diffèrent d'au moins } e^n.$$

C'est possible dès que \bar{R}_n est supérieur à $(2n + 1)g_n [e^n + (2n + 1)g_n]$; or (A) et (12) obligent \bar{R}_n à être supérieur à $e^n [(2n + 1)^2 g_n + (2n + 1)^2 g_n^2]$, ((15) et (16) restant compatibles grâce à (1)). On pose $w_{\alpha,\beta,\gamma} = \gamma \lambda_n + v_{\alpha,\beta}$ et

$$\tilde{S}_n = \{w_{\alpha,\beta,\gamma}, 0 \leq \alpha \leq g_n - 1, -n \leq \beta \leq n, -N_n \leq \gamma \leq N_n\}.$$

On a immédiatement:

$$(19) \quad w_{\alpha,\beta,\gamma} \equiv 1 - \alpha \quad [g_n] \quad \text{pour tout } \alpha, \beta, \gamma,$$

$$(20) \quad w_{\alpha,\beta,\gamma} \equiv 1 - \beta \quad [2n + 1] \quad \text{pour tout } \alpha, \beta, \gamma,$$

$$(21) \quad \mu \left(\bigcap_{\gamma=-N_n}^{N_n} T^{-w_{\alpha,\beta,\gamma}} E_{n-1} \right) < \frac{\epsilon_n}{(2n + 1)g_n} \quad \text{pour tout } \alpha, \beta.$$

En outre, deux termes consécutifs de \tilde{S}_n diffèrent d'au moins e^n , et $\tilde{S}_n \subset \{0\} \cup]-\infty, -\bar{R}_n - e^n] \cup [\bar{R}_n + e^n, +\infty[$.

On pose $S_n = \bar{S}_n \cup \tilde{S}_n$, et S_n vérifie bien (2_n) et (3_n).

CONSTRUCTION DE Q_n . On prend une tour de Rokhlin de hauteur h_n supérieure à $2R_n g_n$, de base F_n , de masse totale

$$\mu \left[\bigcup_{i=0}^{h_n-1} T^i F_n \right] > 1 - \varepsilon_n.$$

On divise les étages en $2n + 3$ groupes:

$$I_{nh} = \{T^l F_n, l \equiv 0 \pmod{g_n} \text{ et } l \equiv h \pmod{2n+1}\},$$

pour tout h entre $-n$ et n ,

$$II_n = \{T^l F_n, l \equiv 1 \pmod{g_n} \text{ et } l \equiv 1 \pmod{2n+1}\},$$

III_n = tous les autres étages.

On note $PN(x) = i$ si x est dans P_i , $1 \leq i \leq k$. Q_n est définie comme suit:

si x est dans III_n ou dans $(X - \bigcup_{i=0}^{h_n-1} T^i F_n)$, pour un n supérieur ou égal à 2, on met x dans Q_i^n , resp \bar{Q}_i^n , resp Q_{ij}^n , si x est dans Q_i^{n-1} , resp \bar{Q}_i^{n-1} , resp Q_{ij}^{n-1} ;

si x est dans III₁ ou dans $(X - \bigcup_{i=0}^{h_1-1} T^i F_1)$, on met x dans Q_i^1 si x est dans P_i ;

si x est dans II_n, on met x dans \bar{Q}_i^n si x est dans P_i ;

si x est dans I_{nh}, on met x dans Q_{ij}^n , où

$$(22) \quad i = PN(x),$$

$$(23) \quad j = \sum_{s=0}^{g_n-1} \sum_{t=-n}^n PN(T^{u_{n,s,t} h} x) \text{ modulo } k.$$

Q_n est une partition finie de X . Par construction, Q_n vérifie (4_n), (5_n), (6_n) parce que Q_{n-1} vérifie (4_{n-1}), (5_{n-1}) et (6_{n-1}) et grâce au fait que:

$$\mu(II_n) < \frac{1}{(2n+1)g_n}.$$

De même, Q_n vérifie (8_n) parce que:

$$\mu \left(II_n \cup \bigcup_{h=-n}^n I_{nh} \right) \leq \frac{1}{(2n+1)g_n} + \frac{1}{g_n} < \frac{2}{g_n}.$$

Pour montrer que Q_n vérifie (7_n), on introduit les notations suivantes: pour tout

entier z , \bar{z} est sa classe modulo g_n , \bar{z} sa classe modulo $2n + 1$, $0 \leq \bar{z} \leq g_n - 1$, $-n \leq \bar{z} \leq n$; pour tout y de X , pour tout i et j ,

$$Q_n N_1(y) = i \text{ si } y \text{ est dans } Q_i^n, \text{ ou dans } \bar{Q}_i^n, \text{ ou dans } Q_{ij}^n,$$

$$Q_n N_2(y) = j \text{ si } y \text{ est dans } Q_j^n \text{ (il est inutile de définir } Q_n N_2 \text{ ailleurs).}$$

Pour tout i de $[0, g_n - 1]$, pour tout j de $[-n, n]$, soient

$$(24) \quad S(n, i, j) = \{u, \text{ éléments de } S_n, \text{ tels que } u \equiv 1 - i [g_n] \text{ et } u \equiv 1 - j [2n + 1]\},$$

$$(25) \quad A_n = \bigcup_{i=0}^{g_n-1} \bigcup_{j=-n}^n \bigcap_{u \in S(n, i, j)} T^{-u} E_{n-1}.$$

Comme S_n contient \bar{S}_n , par (19), (20) et (21),

$$\mu \left(\bigcap_{u \in S(n, i, j)} T^{-u} E_{n-1} \right) < \frac{\epsilon_n}{(2n + 1)g_n},$$

et donc $\mu(A_n)$ est inférieure à ϵ_n .

$$\text{Si } A'_n = \bigcup_{i=2}^{g_n-2} T^i F_n \cap A_n,$$

$$(26) \quad \mu(A'_n) \geq 1 - (2/g_n + 2\epsilon_n).$$

Supposons maintenant que x et y vérifient

$$(27) \quad x \text{ et } y \text{ sont éléments de } A'_n,$$

$$(28) \quad x \text{ et } y \text{ sont dans le même atome de } \bigvee_{i \in S_n} T^{-i} Q_n.$$

Soit $i(x)$ l'étage de la n -tour où se trouve x , et soit

$$B_n(x) = \{u, \text{ éléments de } S_n \text{ tels que } T^u x \text{ soit dans } E_n\};$$

on définit de même $B_n(y)$ et $i(y)$. Il est clair que u est dans $B_n(x)$ si et seulement si $\{T^u x \text{ est dans } E_n\}$ ou bien $\{u + i(x) \equiv 1 [g_n] \text{ et } u + i(x) \equiv 1 [2n + 1]\}$. Donc $B_n(x)$ contient $S(n, \bar{i}(x), \bar{i}(x))$, et, à cause de (27), $B_n(x)$ ne peut contenir aucun autre $S(n, k, l)$ en entier. On a la même propriété en y . Or (28) implique que $B_n(x) = B_n(y)$. Comme les $S(n, k, l)$ forment une partition de S_n , et sont tous non vides, on en déduit:

$$\bar{i}(x) = \bar{i}(y) = \bar{i}, \quad \hat{i}(x) = \hat{i}(y) = \hat{i}.$$

Maintenant, pour tout h de $[-n, n]$, $T^{u, i, h} x$ est dans I_{nh} grâce à (9) et (10). Donc $Q_n N_2(T^{u, i, h} x)$ existe et (22) et (23) donnent la formule explicite

$$PN(T^h x) = Q_n N_2(T^{u, i, h} x) - \sum_{(\alpha, \beta) \in (-\bar{i}, h - \bar{i})} Q_n N_1(T^{u, i, h} x + u_{h\alpha} + \beta x) \pmod{k},$$

on a la même formule en y , et comme tous les termes $u_{n, \dots, i} - u_{n\alpha\beta} + h$ sont dans S_n , (27) et (28) impliquent que x et y sont dans le même atome de $T^{-h}P$, pour tout h de $[-n, n]$. Ce qui, joint à (26), démontre (7_n).

DÉMONSTRATION DE LA PROPOSITION 1.

$$S = \bigcup_{n \geq 0} S_n.$$

(2_n) et (3_n) assurent que pour tout n est pour tout j ,

$$\text{card}[S \cap [j - R_n, j + R_n]] \leq \text{card}[S \cap [-R_n, R_n]] \leq 2R_n \sum_{i=1}^n \frac{R_i}{R_n} e^{-i} < 2ne^{-n}R_n,$$

et donc S est de densité supérieure nulle.

On impose maintenant sur g_n et ε_n les conditions suivantes:

$$(29) \quad \sum_{n \geq 0} 2/g_n < +\infty,$$

et, si $d_{n+1} = \sum_{i \geq n+1} 2/g_i$, si $c_n = \text{card } S_n$,

$$(30) \quad \sum_{n \geq 0} 2/g_n + 2\varepsilon_n + d_{n+1}c_n < +\infty.$$

Alors (8_n) et (29) assurent qu'il existe une partition Q limite des Q_n , vérifiant:

$$(31) \quad |Q_n - Q| < d_{n+1} \quad \text{pour tout } n.$$

Donc $\bigvee_{i \in S_n} T^{-i}Q$ coïncide avec $\bigvee_{i \in S_n} T^{-i}Q_n$ sur un ensemble de mesure supérieure à $(1 - c_n d_{n+1})$.

Donc, d'après (7_n), $\bigvee_{i \in S_n} T^{-i}Q$ raffine $\bigvee_{-n}^n T^iP$ sur un ensemble G_n tel que:

$$(32) \quad \mu(X - G_n) < 2/g_n + 2\varepsilon_n + c_n d_{n+1}.$$

Si $G = \bigcup_{n \geq 0} \bigcap_{i \geq n} G_i$, $\mu(G) = 1$ par (30), (32) et Borel-Cantelli. Et si x et y sont dans G et $T^u x$ et $T^u y$ sont dans le même atome de Q pour tout u de S , x et y sont dans G_i pour tout i assez grand et par conséquent sont dans le même atome de $\bigvee_{-i}^i T^iP$ pour tout i assez grand; donc $x = y$ puisque P est génératrice. Donc:

$$\mathcal{A} = \bigvee_{i \in S} T^{-i}Q. \quad \text{CQFD.}$$

La fin de cette démonstration suit [1] de près. A priori, S dépend du système considéré. On a toutefois:

PROPOSITION 2. *Il existe une suite S^0 d'entiers, de densité supérieure nulle, telle*

que, dans tout système dynamique (X, \mathcal{A}, T, μ) d'entropie finie fortement mélangéant, il existe une partition finie Q de X , telle que $\bigvee_{i \in \mathbb{S}^n} T^{-i} Q$ soit toute la σ -algèbre \mathcal{A} .

DÉMONSTRATION. On construit d'abord la suite S^0 , indépendamment de tout système. Pour cela, on se donne une suite de réels ε_n , et deux suites d'entiers positifs l_n et g_n vérifiant:

$$(1) \quad g_n \equiv 1 \quad [2n + 1] \quad \text{pour tout } n,$$

$$(29) \quad \sum_{n \geq 0} 2/g_n < +\infty,$$

$$(33) \quad \sum_{n=0}^{+\infty} \frac{1}{(2n+1)g_n} < \frac{1}{2},$$

$$(34) \quad \left(2 \sum_{i=0}^{n-1} \frac{1}{(2i+1)g_i} \right)^{l_n} \leq \frac{\varepsilon_n}{(2n+1)g_n} \quad \text{pour tout } n,$$

$$(35) \quad \sum_{n \geq 0} d_{n+1} [(2n+1)^3 g_n^2 + (2n+1)^2 g_n + (2n+1)g_n l_n] + 2\varepsilon_n + \frac{2}{g_n} < +\infty$$

$$\text{si } d_{n+1} = \sum_{i \geq n+1} 2/g_i.$$

De telles suites existent (il suffit de choisir l_n au stade n et de prendre g_{n+1}, g_{n+2}, \dots assez grands). Les g_n tendent vers $+\infty$ et les ε_n vers 0.

On définit par récurrence des suites S'_n :

$$S'_0 = \{0\}. \quad \text{Soit } R_{n-1} = \sup_{x \in \bigcup_{i=0}^{n-1} S'_i} |x|.$$

On choisit des $u_{n,i,j}$ vérifiant (9), (10), (11) et (12) et on définit \bar{S}_n par (A).

Soit $\bar{R}_n = \sup_{x \in \bar{S}_n} |x|$. On choisit $(\sum_{i=0}^{n-1} (2i+1)g_i)$ entiers, notés $v_{k,\alpha,\beta}(n)$, $0 \leq k \leq n-1$,^{*} $0 \leq \alpha \leq g_k - 1$, $-k \leq \beta \leq k$, vérifiant

$$(36) \quad v_{k,\alpha,\beta}(n) \geq \bar{R}_n + e^n,$$

$$(37) \quad v_{k,\alpha,\beta}(n) \equiv 1 - \alpha \quad [g_k],$$

$$(38) \quad v_{k,\alpha,\beta}(n) \equiv 1 - \beta \quad [2k + 1],$$

$$(39) \quad \text{deux } v_{k,\alpha,\beta}(n) \text{ consécutifs diffèrent d'au moins } e^n, \\ \text{(c'est toujours possible par (1))}.$$

* Les $u_{n,i,j}$ dépendent aussi de n mais, dans leur cas, il n'est pas utile de l'indiquer explicitement.

On prend pour \hat{S}_n l'ensemble de ces $v_{k,\alpha,\beta}(n)$; on pose $S'_n = \bar{S}_n \cup \hat{S}_n$; il est clair que S'_n vérifie (2_n) et (3_n).

Soit $S'' = \bigcup_{n \geq 0} S'_n$; S'' est de densité supérieure nulle.

Soit maintenant (X, \mathcal{A}, T, μ) un système dynamique mélangeant; soit $P = (P_1, \dots, P_k)$ un générateur fini de (X, T) ; on va construire, pour tout entier n , une suite S_n et une partition Q_n vérifiant (4_n), (5_n), (6_n), (7_n), (8_n) et “ S'' contient S_n ”. On part de $Q_0 = P, S_0 = \{0\}$.

CONSTRUCTION DE Q_n ET S_n . Soit E_{n-1} l'ensemble défini par (6_{n-1}); soient α un entier compris entre 0 et g_{n-1} et β un entier compris entre $-n$ et n . Pour $k = 1, 2, 3, \dots$ soit $v_{n,\alpha,\beta}(n+k)$ l'élément de la suite \hat{S}_{n+k} défini précédemment (il existe bien puisque $0 \leq n \leq n+k-1, 0 \leq \alpha \leq g_{n-1}, -n \leq \beta \leq n$).

Le mélange et le fait que $v_{n,\alpha,\beta}(n+k)$ tend vers l'infini quand k tend vers l'infini assurent que pour $k_1 = 1$, il existe k_2 tel que:

$$\mu(T^{-v_{n,\alpha,\beta}(n+k_2)}E_{n-1} \cap T^{-v_{n,\alpha,\beta}(n+k_1)}E_{n-1}) < (2\mu(E_{n-1}))^2.$$

De même, il existe k_3, \dots, k_{l_n} , dépendant de α, β , tels que

$$(40) \quad \mu\left(\bigcap_{\gamma=1}^{l_n} T^{-v_{n,\alpha,\beta}(n+k_\gamma)}E_{n-1}\right) < (2\mu(E_{n-1}))^{l_n}$$

On pose $w_{\alpha,\beta,\gamma} = v_{n,\alpha,\beta}(n+k_\gamma(\alpha,\beta)), 0 \leq \alpha \leq g_n - 1, -n \leq \beta \leq n, 1 \leq \gamma \leq l_n$, après avoir fait cette construction pour tous les α, β .

Les $w_{\alpha,\beta,\gamma}$ vérifient (19) grâce à (37), (20) grâce à (38) et (21) grâce à (40), (6_{n-1}) et (34).

On prend pour \tilde{S}_n l'ensemble de ces $w_{\alpha,\beta \in \gamma}$, et $S_n = \bar{S}_n \cup \tilde{S}_n$. S'' contient bien S_n .

On suit désormais exactement la démonstration de la proposition 1, en remplaçant R_n par $\tilde{R}_n = \text{Sup}_{x \in S_n} |x|$.

On construit ainsi Q_n vérifiant (4_n) à (8_n). Pour la suite, on remarque que, par construction:

$$(41) \quad c_n \leq (2n+1)^3 g_n^2 + (2n+1)^2 g_n + (2n+1)g_n l_n,$$

et que donc (30) est vérifiée grâce à (35), et (29) par hypothèse. On conclut donc à l'existence de Q telle que $\bigvee_{i \in S''} T^{-i}Q = \mathcal{A}$. CQFD

REMARQUE. Dans les deux propositions, si P a k éléments, Q en a $(k^2 + 2k)$. D'autre part, puisqu'on peut commencer la construction à n'importe quel stade (c'est-à-dire prendre $Q_{n-1} = P$), on peut obtenir Q arbitrairement proche de P ; en particulier, pour tout ϵ , on peut obtenir Q vérifiant

$$\mathcal{A} = \bigvee_{i \in S} T^{-i}Q \quad \text{et} \quad E(Q) < E(P) + \varepsilon.$$

Questions. Peut-on étendre la proposition 1 ou la proposition 2 à tout système ergodique?

Peut-on trouver un système (X, \mathcal{A}, T, μ) ergodique, une partition Q de X , une suite S de densité supérieure nulle tels que $\mathcal{A} = \bigvee_{i \in S} T^{-i}Q$ et $\{T^{-i}Q, i \text{ élément de } S\}$ soit une suite de partitions indépendantes?

RÉFÉRENCE

I. D. Ornstein et B. Weiss, *Every transformation is bilaterally deterministic*, Isr. J. Math. **21** (1975), 154–158.

UNIVERSITÉ PARIS VI
LABORATOIRE DE PROBABILITÉS
4 PLACE JUSSIEU
75005 PARIS, FRANCE