

7. előadás

2016. október 24.

Konvex és konkáv függvények

Megjegyzés. Valós-valós függvények konvexitását és konkávitását **intervallumon** fogjuk értelmezni. **Intervallumon** mindig nem üres és nem egyetlen pontból álló \mathbb{R} -beli halmazt értünk. A továbbiakban gyakran használt

„ $I \subset \mathbb{R}$ (tetszőleges) intervallum”

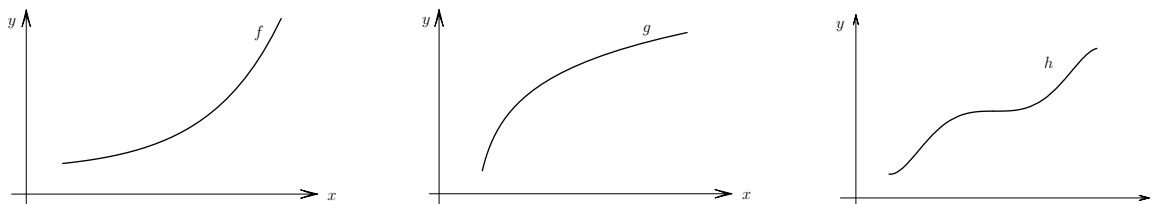
kijelentésen (hacsak mást nem mondunk) azt értjük, hogy I korlátos vagy nem korlátos, nyílt, zárt, félig nyílt vagy félig zárt intervallum. A következő halmazok mindegyike intervallum:

$(-1, 1)$, $[-1, 1]$, $[-1, 0)$, $[0, +\infty)$, $(-\infty, 0)$, $(-\infty, +\infty)$. ■

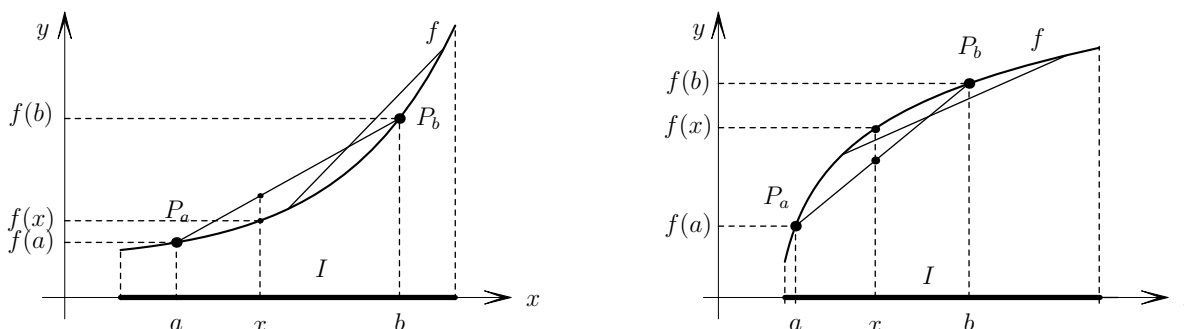
• A konvexitás és a konkávitás szemléletes jelentése

Célunk továbbra is függvények általános tulajdonságainak a leírása, jellemzése. Azt már láttuk, hogy a differenciálszámítás milyen hatékony eszközöket kínál a monotonitás és a szélsőértékek vizsgálatához.

Most tovább folytatjuk függvények „alaki” tulajdonságainak a tanulmányozását. Számos *konkrét* függvény grafikonját már jól ismerjük. Gondoljunk most a *monoton növekedésre*. Világos, hogy egy függvény többféleképpen is lehet monoton növekedő:



A jobb oldali grafikonnal ellentétben a másik kettő bizonyos jellegzetes „szabályosságot” mutat. Ezeket a tulajdonságokat célszerű definiálni. Az f függvényt (bal oldali ábra) **konvexnek**, g -t pedig (középső ábra) **konkávnak** fogjuk nevezni. A definíció megfogalmazásához használjuk fel a derivált definíciójánál már bevált *ötletet*: húzzunk be húrokat:



Szemléletesen világos, hogy az I intervallum tetszőleges $a < b$ pontjai esetén az f (a g) függvény grafikonjának az (a, b) intervallumhoz tartozó része a P_a és P_b pontokat összekötő húr alatt (felett) van. A szóban forgó húr egyenesének az egyenlete:

$$y = \frac{f(b) - f(a)}{b - a}(x - a) + f(a), \quad \text{vagy} \quad y = \frac{f(b) - f(a)}{b - a}(x - b) + f(b).$$

A fentiek alapján eléggé természetesek a következő definíciók. ■

• A konvexitás és a konkávitás fogalma

Definíció. Az $f \in \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ függvény **konvex az $I \subset \mathbb{R}$ intervallumon**, ha

$$\forall a, b \in I, a < b \text{ esetén}$$

$$(*) \quad f(x) \leq \frac{f(b) - f(a)}{b - a}(x - a) + f(a) \quad (\forall x \in (a, b)).$$

Ha $(*)$ -ban \leq helyett $<$ áll, akkor f -et **I -n szigorúan konvexnek**, ha \geq , illetve $>$ áll, akkor f -et **I -n konkávnak**, illetve **szigorúan konkávnak** nevezzük.

Megjegyzések.

1° Ha az f függvény elsőfokú \mathbb{R} -en, azaz $f(x) = cx + d$ ($x \in \mathbb{R}$) valamely c és d állandóval, akkor $(*)$ -ban egyenlőség áll minden x -re. Tehát egy elsőfokú függvény egyszerre konvex és konkáv is.

2° Az abs függvény konvex, de nem szigorúan konvex \mathbb{R} -en. ■

A konvexitást jellemző egyenlőtlenséget érdemes más formában is megadni.

Tétel. Az $I \subset \mathbb{R}$ intervallumon értelmezett $f : I \rightarrow \mathbb{R}$ függvény akkor és csak akkor konvex I -n, ha

$$\forall a, b \in I, a < b \text{ és } \forall \lambda \in (0, 1) \text{ esetén}$$

$$f(\lambda a + (1 - \lambda)b) \leq \lambda f(a) + (1 - \lambda)f(b).$$

Megjegyzés. Szigorúan konvex, konkáv, illetve szigorúan konkáv függvényekre hasonló állítások érvényesek. ■

Bizonyítás. Legyen $a, b \in I, a < b$ és $0 < \lambda < 1$. Ekkor

$$x = \lambda a + (1 - \lambda)b \in (a, b),$$

mert

$$a = \lambda a + (1 - \lambda)a < \lambda a + (1 - \lambda)b = x < \lambda b + (1 - \lambda)b = b.$$

Másrészt az (a, b) intervallum minden eleme előáll $\lambda a + (1 - \lambda)b$ alakban, ahol $0 < \lambda < 1$. Ha ugyanis $x \in (a, b)$, akkor a

$$\lambda := \frac{b - x}{b - a}$$

választás megfelelő, mert

$$\frac{b - x}{b - a} \cdot a + \left(1 - \frac{b - x}{b - a}\right) \cdot b = x.$$

A definíció szerint az f függvény konvex az I intervallumon, ha $\forall a, b \in I, a < b$ esetén

$$f(x) \leq \frac{f(b) - f(a)}{b - a}(x - a) + f(a) \quad (\forall x \in (a, b)).$$

Ha $a < x < b$ és $x = \lambda a + (1 - \lambda)b$, akkor a fenti egyenlőtlenség azzal ekvivalens, hogy

$$\begin{aligned} f(\lambda a + (1 - \lambda)b) &\leq \frac{f(b) - f(a)}{b - a}([\lambda a + (1 - \lambda)b - a]) + f(a) = \\ &= \frac{f(b) - f(a)}{b - a}[(1 - \lambda)(b - a)] + f(a) = \lambda f(a) + (1 - \lambda)f(b), \end{aligned}$$

és ez az állítás bizonyítását jelenti. ■

Korábban láttuk, hogy függvények monotonitása kapcsolatba hozható azok különbségihányados-függvényeivel. Hasonló a helyzet a konvexitás és a konkávitás esetében is. Emlékeztetünk arra, hogy ha $f \in \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}$ és $c \in \text{int } \mathcal{D}_f$, akkor a

$$\triangle_c f(x) := \frac{f(x) - f(c)}{x - c} \quad (x \in \mathcal{D}_f \setminus \{c\})$$

függvényt neveztük az f függvény c ponthoz tartozó **különbségihányados-függvényének**.

Tétel. Legyen $I \subset \mathbb{R}$ tetszőleges nyílt intervallum, és $f : I \rightarrow \mathbb{R}$. Ekkor

1° f konvex [szigorúan konvex] I -n $\iff \forall c \in I$ esetén $\Delta_c f \nearrow [\uparrow]$.

2° f konkáv [szigorúan konkáv] I -n $\iff \forall c \in I$ esetén $\Delta_c f \searrow [\downarrow]$.

Bizonyítás. A bizonyítások hasonlóak, ezért csak a konvexitásra vonatkozó rész igazolását részletezzük.

\implies Tegyük fel, hogy az f függvény konvex az I intervallumon, azaz

$\forall a, b \in I, a < b$ esetén

$$(*) \quad f(x) \leq \frac{f(b) - f(a)}{b - a}(x - a) + f(a) \quad (\forall x \in (a, b)).$$

Be kell látnunk, hogy tetszőleges $c \in I$ esetén a $\Delta_c f$ függvény monoton növekedő, vagyis hogy

$$(\#) \quad \forall x, t \in I \setminus \{c\}, x < t \text{ esetén } \Delta_c f(x) \leq \Delta_c f(t).$$

A c és az $x < t$ pontok helyzetét illetően három eset lehetséges:

$$1^\circ c < x < t, \quad 2^\circ x < c < t, \quad 3^\circ x < t < c.$$

1° eset ($c < x < t$): Legyen $(*)$ -ban $a := c, x := x, b := t$. Ekkor

$$f(x) \leq \frac{f(t) - f(c)}{t - c}(x - c) + f(c),$$

amiből egyszerű átalakítással azt kapjuk, hogy

$$\frac{f(x) - f(c)}{x - c} \leq \frac{f(t) - f(c)}{t - c}, \quad \text{azaz} \quad \Delta_c f(x) = \frac{f(x) - f(c)}{x - c} \leq \frac{f(t) - f(c)}{t - c} = \Delta_c f(t),$$

vagyis ebben az esetben igaz a $(\#)$ egyenlőtlenség.

2° eset ($x < c < t$): Ha $(*)$ -ban $a := x, x := c$ és $b := t$, akkor

$$f(c) \leq \frac{f(t) - f(x)}{t - x}(c - x) + f(x),$$

amiből ekvivalens átalakításokkal azt kapjuk, hogy

$$\frac{f(c) - f(x)}{c - x} \leq \frac{f(t) - f(c)}{t - c} \iff \frac{f(x) - f(c)}{x - c} \leq \frac{f(t) - f(c)}{t - c}, \quad \text{azaz} \quad \Delta_c f(x) \leq \Delta_c f(t),$$

ezért a $(\#)$ egyenlőtlenség ebben az esetben is teljesül.

3° eset ($x < t < c$): $(*)$ helyett most a vele nyilván ekvivalens

$$f(x) \leq \frac{f(b) - f(a)}{b - a}(x - b) + f(b) \quad (\forall x \in (a, b))$$

egyenlőtlenségből indulunk ki. Ebből az $a := x$, az $x := t$ és az $b := c$ szereposztással azt kapjuk, hogy

$$f(t) \leq \frac{f(c) - f(x)}{c - x}(t - c) + f(c).$$

Vegyük figyelembe, hogy $t < c$, azaz $t - c < 0$, ezért

$$\frac{f(t) - f(c)}{t - c} \geq \frac{f(c) - f(x)}{c - x}.$$

Következésképpen

$$\Delta_c f(t) = \frac{f(t) - f(c)}{t - c} \geq \frac{f(c) - f(x)}{c - x} = \frac{f(x) - f(c)}{x - c} = \Delta_c f(x) \quad (x < t),$$

és ez azt jelenti, hogy a $(\#)$ egyenlőtlenség ebben az esetben is teljesül.

Az állítás \implies részét tehát bebizonyítottuk.

\Leftarrow Tegyük fel, hogy $\forall c \in I$ -re $\Delta_c f \nearrow$. Be kell látnunk, hogy f konvex I -n, vagyis hogy

$\forall a, b \in I, a < b$ és $\forall x \in (a, b)$ esetén

$$f(x) \leq \frac{f(a) - f(b)}{b - a}(x - a) + f(a).$$

Valóban, legyen $c := a$ és $(a <) x < b$. Mivel $\Delta_a f \nearrow$, ezért

$$\Delta_a f(x) = \frac{f(x) - f(a)}{x - a} \leq \Delta_a f(b) = \frac{f(b) - f(a)}{b - a},$$

amiből átrendezéssel az adódik, hogy

$$f(x) \leq \frac{f(a) - f(b)}{b - a}(x - a) + f(a),$$

és ez éppen azt jelenti, hogy az f függvény konvex az I intervallumon. ■

• A konvexitás-konkávitás és a folytonosság, illetve a deriválhatóság kapcsolata

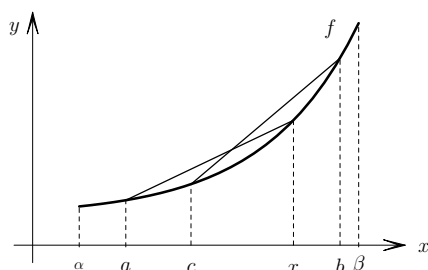
A következő tétel azt állítja, hogy a konvexitás a folytonosság és a deriválhatóság fogalma „között” van abban az értelemben, hogy a konvexitás fogalma a folytonosságnál „erősebb”, a deriválhatóságnál pedig „gyengébb” fogalom.

Tétel.

$\left. \begin{array}{l} \text{Tegyük fel, hogy az } f \text{ függvény} \\ \text{konvex az} \\ (\alpha, \beta) \subset \mathbb{R} \text{ intervallumon.} \end{array} \right\} \Rightarrow$	$\begin{array}{l} 1^\circ f \text{ az } (\alpha, \beta) \text{ intervallum minden } c \text{ pontjában folytonos.} \\ 2^\circ f \text{ az } (\alpha, \beta) \text{ intervallum minden } c \text{ pontjában} \\ \text{jobbról is és balról is deriválható.} \end{array}$
--	---

Bizonyítás.

1° Rögzítsük a $c \in (\alpha, \beta)$ pontot és válasszuk meg a -t és b -t úgy, hogy $\alpha < a < c < b < \beta$. Vegyünk egy tetszőleges $x \in (c, b)$ elemet, és tekintsük a következő ábrát:



Alkalmazzuk az f függvényre a konvexitás definícióját a $c < x < b$ pontokban:

$$f(x) \leq \frac{f(b) - f(c)}{b - c}(x - c) + f(c).$$

Írjuk most fel az $a < c < x$ pontokban is a megfelelő egyenlőtlenséget:

$$f(c) \leq \frac{f(x) - f(a)}{x - a}(c - a) + f(a).$$

Ebből átrendezéssel azt kapjuk, hogy

$$\frac{f(c) - f(a)}{c - a}(x - a) + f(a) \leq f(x).$$

Így

$$\frac{f(c) - f(a)}{c - a}(x - a) + f(a) \leq f(x) \leq \frac{f(b) - f(c)}{b - c}(x - c) + f(c) \quad (x \in (c, b)).$$

A fenti egyenlőtlenség bal és jobb oldalán álló függvények folytonosak c -ben, és

$$\lim_{x \rightarrow c+0} \left(\frac{f(c) - f(a)}{c - a} (x - a) + f(a) \right) = \lim_{x \rightarrow c+0} \left(\frac{f(b) - f(c)}{b - c} (x - c) + f(c) \right) = f(c),$$

ezért a függvény határértékére vonatkozó közrefogási elv alapján

$$\lim_{x \rightarrow c+0} f(x) = f(c).$$

Ugyanígy adódik, hogy

$$\lim_{x \rightarrow c-0} f(x) = f(c),$$

és ez azt jelenti, hogy az f függvény folytonos a c pontban.

2° Legyen $c \in (\alpha, \beta)$. Egyik korábbi tételünk szerint az f függvény tetszőleges $c \in (\alpha, \beta)$ ponthoz tartozó különbségihányados-függvénye, vagyis a

$$\Delta_c f(x) = \frac{f(x) - f(c)}{x - c} \quad (x \in (\alpha, \beta) \setminus \{c\})$$

függvény monoton növekedő. Rögzítsünk egy $d \in (\alpha, c)$ számot. Ekkor

$$\frac{f(d) - f(c)}{d - c} \leq \frac{f(x) - f(c)}{x - c} \quad (x \in (c, \beta)),$$

tehát $\Delta_c f$ monoton növekedő és alulról korlátos a (c, β) intervallumon, ezért a monoton függvények szakadási helyeire vonatkozó állításból következik, hogy a

$$\lim_{x \rightarrow c+0} \frac{f(x) - f(c)}{x - c}$$

határérték létezik és véges, ami éppen azt jelenti, hogy f jobbról deriválható c -ben. Ugyanígy bizonyítható, hogy f balról is differenciálható c -ben. ■

Tétel. Legyen $\alpha, \beta \in \mathbb{R}$, $\alpha < \beta$, és tegyük fel, hogy $f \in D(\alpha, \beta)$.

1° Az f függvény konvex [szigorúan konvex] (α, β) -n \iff az f' függvény \nearrow [\uparrow].

2° Az f függvény konkáv [szigorúan konkáv] (α, β) -n \iff az f' függvény \searrow [\downarrow].

Bizonyítás. A bizonyítások hasonlóak, ezért csak a konvexitásra vonatkozó rész igazolását részletezzük.

\implies Tegyük fel, hogy az f függvény konvex az (α, β) intervallumon, azaz

$$\forall a, b \in (\alpha, \beta), \quad a < b \quad \text{esetén}$$

$$f(x) \leq \frac{f(b) - f(a)}{b - a} (x - a) + f(a) \quad (\forall x \in (a, b)).$$

Ebből következik, hogy a $\Delta_a f$ függvény \nearrow az $(\alpha, \beta) \setminus \{a\}$ halmazon, ezért

$$\Delta_a f(x) = \frac{f(x) - f(a)}{x - a} \leq \frac{f(b) - f(a)}{b - a} \quad \forall x < b, \quad x \neq a \text{ esetén.}$$

Mivel $f'(a) = \lim_{x \rightarrow a} \Delta_a f(x)$, ezért

$$(*) \quad f'(a) \leq \frac{f(b) - f(a)}{b - a}.$$

Hasonlóan, a $\Delta_b f$ függvény \nearrow az $(\alpha, \beta) \setminus \{b\}$ halmazon, ezért

$$\frac{f(b) - f(a)}{b - a} = \frac{f(a) - f(b)}{a - b} = \Delta_b f(a) \leq \Delta_b f(x) = \frac{f(x) - f(b)}{x - b} \quad \forall a < x, \quad x \neq b \text{ esetén.}$$

Mivel $f'(b) = \lim_{x \rightarrow b} \Delta_b f(x)$, ezért

$$\frac{f(b) - f(a)}{b - a} \leq f'(b).$$

Így (*) alapján azt kapjuk, hogy $f'(a) \leq f'(b)$. Mivel ez minden $a, b \in (\alpha, \beta)$, $a < b$ -re igaz, ezért f' monoton növekedő az (α, β) intervallumon.

◁ Tegyük fel, hogy f' monoton növekedő (α, β) -n. Legyen $a, b \in (\alpha, \beta)$, $a < b$ és $x \in (a, b)$ tetszőleges. f -re a Lagrange-féle középértéktételt először az $[a, x]$, majd az $[x, b]$ intervallumra alkalmazva azt kapjuk, hogy

$$\exists \xi_1 \in (a, x) : f'(\xi_1) = \frac{f(x) - f(a)}{x - a} \quad \text{és} \quad \exists \xi_2 \in (x, b) : f'(\xi_2) = \frac{f(b) - f(x)}{b - x}.$$

Mivel $\xi_1 < \xi_2$ és $f' \nearrow$, ezért $f'(\xi_1) \leq f'(\xi_2)$. Így

$$\begin{aligned} \frac{f(x) - f(a)}{x - a} &\leq \frac{f(b) - f(x)}{b - x} = \frac{[f(b) - f(a)] - [f(x) - f(a)]}{b - x} \iff \\ \iff [f(x) - f(a)] \cdot [(b - x) + (x - a)] &\leq [f(b) - f(a)] \cdot (x - a) \iff f(x) \leq \frac{f(b) - f(a)}{b - a}(x - a) + f(a). \end{aligned}$$

Ez az egyenlőtlenség minden $a, b \in (\alpha, \beta)$, $a < b$ és $x \in (a, b)$ esetén fennáll, ami éppen azt jelenti, hogy az f függvény konvex az (α, β) intervallumon. ■

Tétel. Legyen $\alpha, \beta \in \mathbb{R}$, $\alpha < \beta$, és tegyük fel, hogy $f \in D^2(\alpha, \beta)$. Ekkor

1° f konvex (α, β) -n $\iff f''(x) \geq 0$ ($\forall x \in (\alpha, \beta)$),

2° f konkáv (α, β) -n $\iff f''(x) \leq 0$ ($\forall x \in (\alpha, \beta)$),

3° ha $f''(x) > 0$ ($\forall x \in (\alpha, \beta)$) $\implies f$ szigorúan konvex (α, β) -n,

4° ha $f''(x) < 0$ ($\forall x \in (\alpha, \beta)$) $\implies f$ szigorúan konkáv (α, β) -n.

Bizonyítás. A tétel állításai az előző tétel, valamint a monotonitás és a derivált kapcsolatára vonatkozó állítások egyszerű következményei. ■

Tétel.

Legyen $\alpha, \beta \in \mathbb{R}$, $\alpha < \beta$. Tegyük fel, hogy $\left. \begin{array}{l} \bullet f \in D(\alpha, \beta), \\ \bullet f \text{ konvex } (\alpha, \beta)\text{-n.} \end{array} \right\} \iff \begin{array}{l} \forall c \in (\alpha, \beta) \text{ pontban} \\ f(x) \geq f'(c)(x - c) + f(c) \quad (\forall x \in (\alpha, \beta)). \end{array}$

Bizonyítás. Nélkül. ■

Megjegyzés. A tétel geometriai tartalma a következő: Az f függvény akkor és csak akkor konvex (α, β) -n, ha minden $c \in (\alpha, \beta)$ esetén az f függvény grafikonja a c pontban húzott érintő felett halad. ■

• Inflexiós pont

Definíció. Legyen $\alpha, \beta \in \mathbb{R}$, $\alpha < \beta$, és tegyük fel, hogy $f \in D(\alpha, \beta)$. Azt mondjuk, hogy a $c \in (\alpha, \beta)$ pont az f függvénynek **inflexiós pontja**, ha

$\exists \delta > 0 : f$ konvex $(c, c - \delta)$ -n és konkáv $[c, c + \delta)$ -n vagy fordítva.

Tétel. (Szükséges feltétel az inflexiós pontra.)

Legyen $\alpha, \beta \in \mathbb{R}$, $\alpha < \beta$. Tegyük fel, hogy $\left. \begin{array}{l} \bullet f \in D^2(\alpha, \beta) \text{ és} \\ \bullet c \in (\alpha, \beta) \text{ inflexiós pontja } f\text{-nek.} \end{array} \right\} \implies f''(c) = 0.$

Magasabb rendű elégséges feltételek a lokális szélsőértékekre és az inflexióra.

Tétel. Legyen $\alpha, \beta \in \mathbb{R}$, $\alpha < \beta$. Tegyük fel, hogy $f : (\alpha, \beta) \rightarrow \mathbb{R}$ és

- valamilyen $n \in \mathbb{N}$ számra egy $c \in (\alpha, \beta)$ pontban $f \in D^n\{c\}$, továbbá
- $f'(c) = f''(c) = \dots = f^{(n-1)}(c) = 0$ és $f^{(n)}(c) \neq 0$.

Ekkor a következő állítások teljesülnek:

- 1° $A \ c \in (\alpha, \beta)$ pont az f függvénynek lokális szélsőérték helye \iff ha n páros (ha $f^{(n)}(c) > 0$, illetve $f^{(n)}(c) < 0$ akkor az f függvénynek c -ben lokális minimuma, illetve lokális maximuma van).
- 2° $A \ c \in (\alpha, \beta)$ pont az f függvénynek inflexiós pontja \iff ha n páratlan.

Aszimptoták

Definíció. Legyen $a \in \mathbb{R}$ és $f : (a, +\infty) \rightarrow \mathbb{R}$. Azt mondjuk, hogy az f függvénynek **van aszimptotája $(+\infty)$ -ben**, ha

$$\exists l(x) = Ax + B \quad (x \in \mathbb{R})$$

elsőfokú függvény, amelyre

$$\lim_{x \rightarrow +\infty} (f(x) - l(x)) = 0.$$

Ebben az esetben az $l(x) = Ax + B$ ($x \in \mathbb{R}$) egyenes az f függvény **aszimptotája $(+\infty)$ -ben**.

Megjegyzés. Hasonló módon értelmezzük a $(-\infty)$ -beli aszimptotát. ■

Tétel. Legyen $a \in \mathbb{R}$. Az $f : (a, +\infty) \rightarrow \mathbb{R}$ függvénynek akkor és csak akkor van aszimptotája $(+\infty)$ -ben, ha léteznek és végesek a következő határértékek:

$$\lim_{x \rightarrow +\infty} \frac{f(x)}{x} =: A \in \mathbb{R} \quad \lim_{x \rightarrow +\infty} (f(x) - Ax) =: B \in \mathbb{R}.$$

Ekkor az

$$l(x) = Ax + B \quad (x \in \mathbb{R})$$

egyenes az f függvény aszimptotája $(+\infty)$ -ben.

Megjegyzés. Hasonló állítás érvényes a $(-\infty)$ -beli aszimptoták meghatározására. ■

Teljes függvényvizsgálat

Adott f valós-valós függvény **teljes függvényvizsgálatán** f analitikus és geometriai tulajdonságainak a megállapítását értjük. Ennek során a következőket kell meghatározni:

- 1° Kezdeti vizsgálatok. (Deriválhatóság, paritás, periodicitás megállapítása.)
- 2° Monotonitási intervallumok.
- 3° Lokális és abszolút szélsőértékek.
- 4° Konvexitási, konkávitási intervallumok.
- 5° A határértékek a $\mathcal{D}'_f \setminus \mathcal{D}_f$ pontokban.
- 6° Aszimptota $(\pm\infty)$ -ben.
- 7° A függvény grafikonjának felrajzolása.