

# Höhere Analysis und Numerik

Das Skript zum Modul "Höhere Analysis und Numerik" ist ein interaktives Skript. Die Codes sind direkt ausführbar.

## Note

Das Skript zum Modul ist am entstehen.

Der erste Teil des Skripts folgt dem Buch [\[BWHM10\]](#). Für Details und Ergänzungen wird das Buch empfohlen. Es steht als pdf-Download in der Bibliothek der ZHAW zur Verfügung.

## Python

Für numerische Berechnungen benutzen wir im Kurs Python. Eine gute Einführung in Python ist im interaktiven Jupyter-Book [Python Programming And Numerical Methods: A Guide For Engineers And Scientists](#) zu finden.

Im wesentlichen werden wir fundamentale Funktionalität von Python benutzen. Für numerische Berechnungen werden wir auf NumPy und SciPy zurückgreifen. Die Visualisierung kann sehr matlab nahe mit Hilfe von Matplotlib umgesetzt werden.

- [Python](#)
- [NumPy](#)
- [SciPy](#)
- [Matplotlib](#)

Falls Sie Python mit den entsprechenden Module noch nie benutzt haben, ist es sehr sinnvoll sich vorab mit dem wesentlichen auseinander zu setzen.

## NGSolve

Im Rahmen der numerischen Methoden für partielle Differentialgleichungen werden wir die Methode der finiten Elemente kennen lernen. Wir werden für die Umsetzung auf eine C++ Bibliothek [NGSolve](#) zurückgreifen, welche eine umfangreiche Python-Schnittstelle zur Verfügung stellt.

Netgen/NGSolve ist eine hochleistungsfähige Multiphysik-Finite-Elemente-Software. Sie wird häufig zur Analyse von Modellen aus den Bereichen Festkörpermechanik, Strömungsmechanik und Elektromagnetik eingesetzt. Dank der flexiblen Python-Schnittstelle können neue physikalische Gleichungen und Lösungsalgorithmen leicht implementiert werden.

Das Ziel des Moduls besteht in der Vermittlung der mathematischen Grundlagen und insbesondere auch numerischen Anwendung derer auf konkrete Beispiele aus der Ingenieur Praxis.

## Note

Installieren Sie NGSolve auf ihrem Rechner. Die dazu notwendigen Anleitungen finden Sie auf <https://ngsolve.org> unter dem Abschnitt INSTALLATION:

- [Downloads NGSolve](#)
- [Using Jupyter notebook](#)

In diesem Kapitel wird das notwendige Rüstzeug für die Behandlung partieller Differentialgleichungen und numerischen Methoden bereit gestellt.

## Grundlegende Räume

### Vektorräume

In den Modulen linearen Algebra, Analysis und Numerik wurden Vektorräume und Normen mit dem  $\mathbb{R}^n$  eingeführt und benutzt. Wir definieren hier der Vollständigkeit halber die Begriffe nochmals und erweitern die Anwendung auf allgemeinere Räume, insbesondere müssen diese nicht endlich dimensional sein.

Beginnen wir mit dem Begriff der Vektorräume. Um diesen definieren zu können, benötigen wir einen Zahlkörper. In aller Regel benutzen wir die reellen Zahlen  $\mathbb{R}$ . Wir legen mit dem folgenden Axiom fest, was die reellen Zahlen sind:

### **Definition: reelle Zahlen**

Es existiere eine Menge  $\mathbb{R}$  mit folgenden Eigenschaften:

- Es existieren Operationen

$$\begin{aligned} & \left[ \begin{array}{l} \begin{array}{l} + : \mathbb{R} \times \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R} \\ \cdot : \mathbb{R} \times \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R} \end{array} \end{array} \right] \end{aligned}$$

mit den Eigenschaften:

- Assoziativgesetze

$$\begin{aligned} & (a+b) + c = a + (b+c) \quad \forall a, b, c \in \mathbb{R} \\ & (a \cdot b) \cdot c = a \cdot (b \cdot c) \quad \forall a, b, c \in \mathbb{R} \end{aligned}$$

- Kommutativgesetze

$$\begin{aligned} & a + b = b + a \quad \forall a, b \in \mathbb{R} \\ & a \cdot b = b \cdot a \quad \forall a, b \in \mathbb{R} \end{aligned}$$

- Neutrale Elemente

$$\begin{aligned} & \exists 0 : a + 0 = a \quad \forall a \in \mathbb{R} \\ & \exists 1 : a \cdot 1 = a \quad \forall a \in \mathbb{R} \end{aligned}$$

- Inverse Elemente

$$\begin{aligned} & \forall a \in \mathbb{R} \exists a' \in \mathbb{R} : a + a' = 0 \\ & \forall a \in \mathbb{R} \setminus \{0\} \exists \tilde{a} \in \mathbb{R} : a \cdot \tilde{a} = 1 \end{aligned}$$

Schreibweise:  $(-a := a', a - a := a + (-a), \frac{1}{a} := \tilde{a}, \frac{a}{a} := a \cdot \frac{1}{a})$

- Distributivgesetz

$$a \cdot (b+c) = a \cdot b + a \cdot c$$

- $\mathbb{R}$  ist geordnet, d.h. es existiert eine Relation  $\leq$  so, dass gilt

- $\mathbb{R}$  ist totalgeordnet, d.h.

1.  $\mathbb{R}$  ist teilgeordnet, d.h.

- Für alle  $x \in \mathbb{R}$  gilt:  $x \leq x$ .
- Ist  $x \leq y$  und  $y \leq z$  für  $x, y, z \in \mathbb{R}$ , so ist  $x \leq z$ .
- Ist  $x \leq y$  und  $y \leq x$  für  $x, y \in \mathbb{R}$ , so ist  $x = y$ .

(Mit  $x < y$  bezeichnen wir den Fall  $x \leq y$  und  $x \neq y$ .)

2. Für je zwei Elemente  $x, y \in \mathbb{R}$  gilt

$$x \leq y \quad \text{oder} \quad y \leq x$$

- Die Ordnung ist verträglich mit Addition und Multiplikation, d.h. für  $(a, b, c \in \mathbb{R})$  gilt

$$\begin{aligned} & a \leq b \Rightarrow a+c \leq b+c \\ & a \leq b, 0 \leq c \Rightarrow a \cdot c \leq b \cdot c \end{aligned}$$

- $\mathbb{R}$  ist vollständig. Das heisst, dass jede nicht leere nach oben beschränkte Menge reeller Zahlen eine kleinste obere Schranke besitzt.

Im Allgemeinen ist ein (Zahlen)-Körper über eine Gruppe wie folgt definiert:

### **Definition: Gruppe**

Ein Tupel  $(G, \cdot)$  bestehend aus einer Menge  $G$  und einer Verknüpfung  $\cdot : G \rightarrow G$  heisst *Gruppe*, falls die Verknüpfung assoziativ ist, ein neutrales Element  $e \in G$  existiert und für alle  $a \in G$  ein  $b \in G$  existiert so dass  $a \cdot b = b \cdot a = e$  gilt. Ist die Verknüpfung kommutativ, nennt man die Gruppe kommutativ.

Ein Körper lässt sich somit wie folgt allgemein definieren:

### **Definition: Körper**

Ein *Körper* ist eine Tripel  $((K, +, \cdot))$  mit folgenden Eigenschaften:

- $((K, +))$  ist eine kommutative Gruppe mit neutralem Element  $(0_K)$ .
- $((K, \cdot))$  ist eine kommutative Gruppe mit neutralem Element  $(1_K)$ .
- (Distributivgesetz) Für alle  $(a, b, c \in K)$  gilt

$$\begin{aligned} a \cdot (b + c) &= a \cdot b + a \cdot c \\ (a + b) \cdot c &= (a \cdot c) + (b \cdot c) \end{aligned}$$

Beispiele für Körper sind folgende Tupel

- $((\mathbb{R}, +, \cdot))$  und  $((\mathbb{Q}, +, \cdot))$  mit der üblichen Addition und Multiplikation,
- $((\mathbb{Z}, +, \cdot))$  bildet **keine** Gruppe.

Mit Hilfe eines Körpers können wir nun einen  $(\mathbb{K})$ -Vektorraum wie folgt definieren:

### **Definition: $(\mathbb{K})$ -Vektorraum**

Ein  $(\mathbb{K})$ -Vektorraum ist ein Tripel  $((V, +, \cdot))$  mit den Eigenschaften

- $((V, +))$  ist eine kommutative Gruppe
- Die Abbildung  $(\cdot : \mathbb{K} \times V \rightarrow V)$  genügt den Eigenschaften
  - $(\alpha \cdot (\beta \cdot x) = (\alpha \cdot \beta) \cdot x)$
  - $(\alpha \cdot (x + y) = (\alpha \cdot x) + (\alpha \cdot y))$
  - $((\alpha + \beta) \cdot x = (\alpha \cdot x) + (\beta \cdot x))$
  - $(1_K \cdot x = x)$

wobei  $(\alpha, \beta \in \mathbb{K}, x, y \in V)$ .

### **Bemerkung**

Wenn man in einem allgemeinen Kontext von Vektoren spricht, so meint man damit die Elemente eines Vektorraumes. Spricht man von Skalaren, so sind die Elemente des zugrundeliegenden Körpers gemeint.

**Beispiele:**

- Vektorraum  $(\mathbb{R}^n)$

Anwendung in python:

```
import numpy as np
x = np.array([1,2,3,4])
y = np.array([-4,-3,-2,-1])

print('x+y=', x+y)
print('5*(x+y)=', 5*(x+y), ' = 5*x+5*y = ', 5*x+5*y)
```

```
x+y= [-3 -1  1  3]
5*(x+y)= [-15  -5   5  15] = 5*x+5*y =  [-15  -5   5  15]
```

- Vektorraum der stetigen Funktionen.

Sei  $(\alpha \in \mathbb{R})$  und  $(u, v : [a, b] \subset \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R})$  zwei stetige Funktionen. Zeige, dass die Summe zweier stetiger Funktionen  $((u+v))$  wieder stetig ist und dass das Vielfache einer stetigen Funktion  $((\alpha u))$  ebenso stetig ist.

### **Aufgabe**

Beweise die Aussage.

## Metrische Räume

### Metrik

In der Analysis will man oft eine Distanz zwischen zwei Elemente eines Vektorraumes angeben. Insbesondere bei Konvergenzbetrachtungen ist der Abstand zweier Elemente existentiell wichtig. Der Konvergenzbegriff in  $\mathbb{R}$  unter Hinzunahme der folgenden Distanzfunktion

$d : \mathbb{R} \times \mathbb{R} \rightarrow \mathbb{R}^+ (x, y) \mapsto d(x, y) := |x - y|$

lautet wie folgt: Die Folge  $(x_n)$  aus  $\mathbb{R}$  heisst konvergent gegen  $x_0 \in \mathbb{R}$ , wenn es zu jedem  $(\varepsilon > 0)$  eine natürliche Zahl  $(n_0 = n_0(\varepsilon))$  gibt, so dass

$|d(x_n, x_0) = |x_n - x_0| < \varepsilon|$   
für alle  $(n \geq n_0)$  gilt.

### Definition: Metrik

Eine nichtleere Menge  $(X)$  mit Elemente  $(x, y, z, \dots)$  heisst ein *metrischer Raum*, wenn jedem Paar  $(x, y \in X)$  eine reelle Zahl  $(d(x, y))$ , genannt *Abstand* oder *Metrik*, zugeordnet ist, mit den Eigenschaften: Für alle  $(x, y, z \in X)$  gilt

- $(d(x, y) \geq 0, d(x, y) = 0)$  genau dann, wenn  $(x = y)$  ist
- $(d(x, y) = d(y, x))$  *Symmetrieeigenschaft*
- $(d(x, y) \leq d(x, z) + d(z, y))$  *Dreiecksungleichung*.

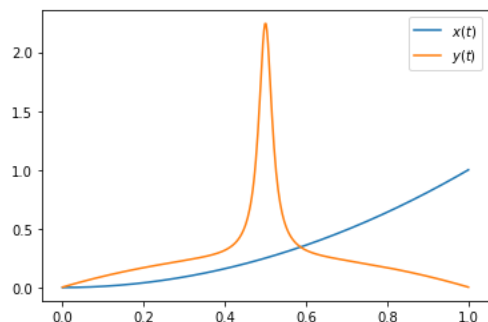
Für metrische Räume verwenden wir wieder die Schreibweisen:  $((X, d))$  oder kurz  $(X)$ , falls der Kontext klar ist.

### Aufgabe

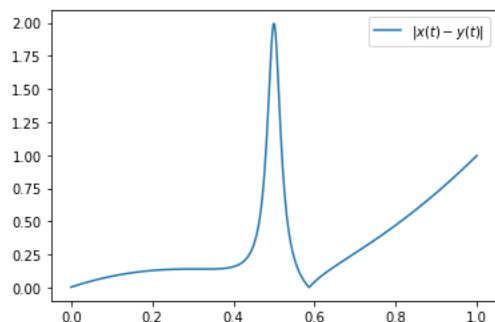
Zeige, dass für  $(X = C[0, 1])$ , den stetigen Funktionen auf dem Intervall  $([0, 1])$  die Abbildung

$d_{\text{max}} : X \times X \rightarrow \mathbb{R}^+ (x, y) \mapsto d_{\text{max}}(x, y) := \max_{t \in [0, 1]} |x(t) - y(t)|$   
eine Metrik definiert (*Maximummetrik*).

Beispiel:



Die Maximummetrik berechnet die maximale Differenz der beiden Funktionen:



### Aufgabe

Berechne analytisch den exakten Wert der Maximummetrik für die beiden Funktionen  $x, y$  aus obigem Beispiel.

Eine weitere wichtige Metrik ist die **Integralmetrik**. Es sei  $(X)$  die Menge aller reellwertigen Funktionen, die auf einem (nicht notwendig beschränkten) Intervall  $((a, b))$  stetig sind und für die das Integral

$$\int_a^b |x(t)|^p dt, \quad 1 \leq p < \infty$$

im Riemannschen Sinne existiert. Setzen wir für  $(x(t), y(t)) \in X$

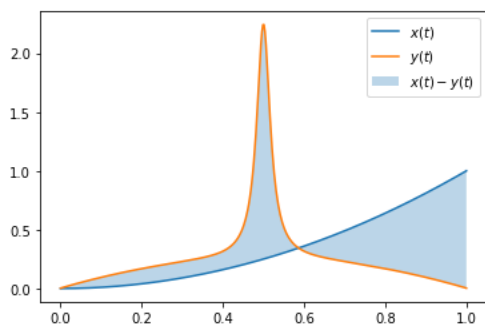
### Definition: Integralmetrik

$$d_p(x, y) := \left( \int_a^b |x(t) - y(t)|^p dt \right)^{1/p}, \quad 1 \leq p < \infty$$

so wird  $(X)$  mit dieser *Integralmetrik* zu einem metrischen Raum. Der Beweis nutzt die Minkowski-Ungleichung für Integrale

$$\left( \int_a^b |u(t) - v(t)|^p dt \right)^{1/p} \leq \left( \int_a^b |u(t)|^p dt \right)^{1/p} + \left( \int_a^b |v(t)|^p dt \right)^{1/p}.$$

**Beispiel:**



### Aufgabe

Berechne die Integralmetrik für  $(p=2)$  und  $(p=1/2)$  für das Beispiel oben.

### Aufgabe

In der Codierungstheorie ist ein  $(n)$ -stelliges Binärwort ein  $(n)$ -Tupel  $((\xi_1, \dots, \xi_n))$ , wobei  $(\xi_k \in \{0, 1\})$  für  $(k=1, \dots, n)$ . Bezeichne  $(X)$  die Menge aller dieser Binärwörter. Für  $(x = (\xi_1, \xi_2, \dots, \xi_n))$ ,  $(y = (\eta_1, \eta_2, \dots, \eta_n))$  ist die *Hamming-Distanz* zwischen  $(x)$  und  $(y)$  durch

$d_H(x, y) := \text{Anzahl der Stellen an denen sich } x \text{ und } y \text{ unterscheiden}$  definiert. Zeige:

- $d_H(x, y)$  lässt sich durch 
$$d_H(x, y) := \sum_{k=1}^n [(\xi_k + \eta_k) \bmod 2]$$
 darstellen.
- $(X, d_H)$  ist ein metrischer Raum.

Die topologischen Begriffe wie *offene Kugel*, *innerer Punkt*, *Häufungspunkt*, *abgeschlossen*, *beschränkt* lassen sich mit Hilfe der Metrik  $(d)$  für einen metrischen Raum  $(X, d)$  direkt aus dem aus der Analysis bekannten  $(\mathbb{R}^n)$  übertragen.

### **Definition: Konvergenz**

Eine Folge  $\{x_n\}_{n \in \mathbb{N}}$  von Elementen aus  $X$  heisst *konvergent*, wenn es ein  $x_0 \in X$  gibt mit

$$d(x_n, x_0) \rightarrow 0 \quad \text{für } n \rightarrow \infty,$$

dh. wenn es zu jedem  $\varepsilon > 0$  ein  $n_0 = n(\varepsilon) \in \mathbb{N}$  gibt, mit

$$d(x_n, x_0) < \varepsilon \quad \text{für alle } n \geq n_0.$$

Schreibweise:  $x_n \rightarrow x_0$  für  $n \rightarrow \infty$  oder  $\lim_{n \rightarrow \infty} x_n = x_0$ ,  $x_0$  heisst *Grenzwert* der Folge  $\{x_n\}$

**Der Grenzwert einer konvergenten Folge ist eindeutig bestimmt.** Dies lässt sich per Widerspruch wie folgt leicht zeigen. Seien  $x_0$  und  $y_0$  zwei verschiedene Grenzwerte. Daher gilt

$$\begin{aligned} 0 &< d(x_0, y_0) \quad \& \leq d(x_0, x_n) + d(x_n, y_0) = \underbrace{d(x_n, x_0)}_{\rightarrow 0} + \underbrace{d(x_n, y_0)}_{\rightarrow 0} \rightarrow 0 \quad \text{für } n \rightarrow \infty. \end{aligned}$$

Es folgt damit  $d(x_0, y_0) = 0$  und damit  $x_0 = y_0$ .

## Funktionenfolgen

Wir starten mit einem intuitiven Begriff der Konvergenz für Funktionenfolgen:

### **Definition: Punktweise Konvergenz**

Man nennt eine Funktionenfolge  $\{x_n(t)\}_{n \in \mathbb{N}} \subset C[a, b]$  *punktweise konvergent*, wenn für jedes  $t \in [a, b]$  die Zahlenfolge  $\{x_1(t), x_2(t), \dots\}$  konvergiert. Die *Grenzfunktion*  $x(t)$  ist dabei durch

$$\lim_{n \rightarrow \infty} x_n(t) = x(t) \quad \text{für jedes } t \in [a, b]$$
 gegeben.

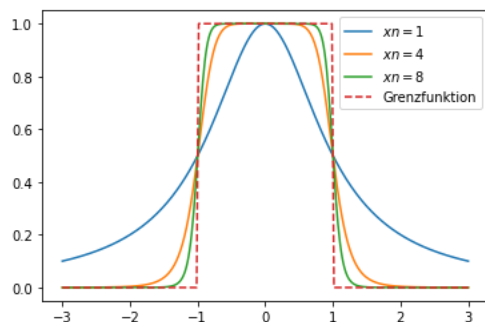
Die punktweise Konvergenz erweist sich für die Analysis als zu schwach. Als Beispiel dazu betrachten wir die Folge der Funktionen  $\{x_n\}_{n \in \mathbb{N}}$

$$x_n(t) = \frac{1}{1+x^{2n}}, \quad n=1,2,3,\dots$$

Wie im Python Code unten leicht zu sehen ist, konvergiert die Folge punktweise gegen

$$x(t) = \begin{cases} 1, & \text{für } |t| < 1 \\ 1/2, & \text{für } |t| = 1 \\ 0, & \text{für } |t| > 1 \end{cases}$$

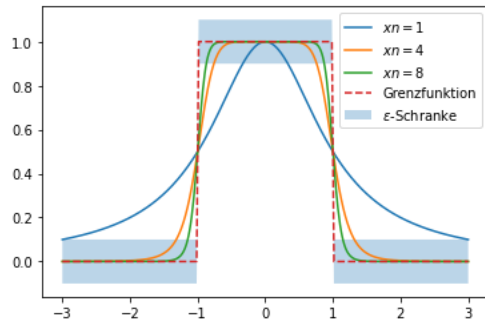
Obwohl alle Funktionen  $x_n$  stetig sind, ist die Grenzfunktion  $x(t)$  unstetig und damit nicht in unserem Funktionenraum (oder Vektorraum)  $C(\mathbb{R})$ ! Das ist für uns unbrauchbar.



Das Problem der punktweisen Konvergenz besteht darin, dass für jedes  $t \in \mathbb{R}$  eine eigene Schranke  $\varepsilon = \varepsilon(t)$  gewählt werden kann. Dies ist zu schwach, um garantieren zu können, dass eine konvergente Funktionenfolge wieder stetig ist. Wir benutzen nun die Maximumsmetrik (1). Daraus folgt, dass zu jedem  $\varepsilon > 0$  es ein  $n_0 = n_0(\varepsilon) \in \mathbb{N}$  mit

$$\max_{t \in \mathbb{R}} |x_n(t) - x(t)| < \varepsilon \quad \text{für alle } n \geq n_0$$

geben muss. Zu jedem  $\varepsilon > 0$  ist hier im Sinne von "beliebig klein" zu verstehen. Der grosse Unterschied zur punktweisen Konvergenz ist, dass hier das  $\varepsilon$  für alle  $t \in \mathbb{R}$  das selbe ist. In diesem Sinne ist jedoch die Funktionenfolge  $\{x_n\}$  nicht mehr konvergent:



Für ein  $\varepsilon < 1$  (Sprunghöhe) finden wir kein  $n_0$  so, dass der Abstand zur Grenzfunktion der Bedingung genügt. Die Funktionenfolge ist daher nicht konvergent bezüglich der Maximummetrik.

### Definition: Gleichmäßige Konvergenz

Die Konvergenz in  $(C[a, b], d_{\max})$  nennt man **gleichmäßige** Konvergenz auf dem Intervall  $[a, b]$ .

### Note

Ist eine stetige Funktionenfolge gleichmäßig konvergent, so ist die Grenzfunktion wiederum stetig.

## Cauchy-Folge

Der Begriff der Cauchy-Folge folge kann direkt auf metrische Räume übertragen werden:

### Definition: Cauchy-Folge

Eine Folge  $\{x_n\}$  aus dem metrischen Raum  $(X)$  heisst *Cauchy-Folge*, wenn

$$\lim_{m, n \rightarrow \infty} d(x_n, x_m) = 0$$

ist, dh. wenn es zu jedem  $\varepsilon > 0$  eine natürliche Zahl  $n_0 = n_0(\varepsilon) \in \mathbb{N}$  gibt mit

$$d(x_n, x_m) < \varepsilon \quad \text{für alle } n, m \geq n_0$$

### Satz

Jede konvergente Folge im metrischen Raum  $(X)$  ist auch eine Cauchy-Folge.

**Beweis:** Aus der Konvergenz der Folge  $\{x_n\}$  folgt: Zu jedem  $\varepsilon > 0$  gibt es ein  $n_0 = n_0(\varepsilon) \in \mathbb{N}$  und ein  $x_0 \in X$  mit

$$d(x_n, x_0) < \varepsilon \quad \text{und} \quad d(x_m, x_0) < \varepsilon$$

für alle  $n, m \geq n_0$ . Mit Hilfe der Dreiecksungleichung folgt

$$d(x_n, x_m) \leq d(x_n, x_0) + d(x_0, x_m) = d(x_n, x_0) + d(x_m, x_0) < 2\varepsilon$$

für alle  $n, m \geq n_0$ .  $\square$

Die Umkehrung gilt im allgemeinen nicht.

**Beispiel:** Betrachte  $(X = (0, 1))$  mit der Metrik  $d(x, y) := |x - y|$  und der Folge  $\{x_n\}$  mit  $x_n = \frac{1}{1+n}$ . Die Folge ist eine Cauchy-Folge im metrischen Raum  $((X, d))$ , besitzt jedoch keinen Grenzwert in diesem  $(0 \notin X)$ .

Das führt uns zu einem neuen Begriff, der **Vollständigkeit**. Wir interessieren uns insbesondere für diejenigen metrischen Räume, in denen Cauchy-Folgen konvergieren.

### Definition: Vollständig

Ein metrischer Raum  $(X)$  heisst *vollständig*, wenn jede Cauchy-Folge in  $(X)$  gegen ein Element von  $(X)$  konvergiert.

Betrachten wir ein paar Beispiele:

1.  $(\mathbb{R}^n)$  mit der euklidischen Metrik

$$d(x,y) = \sqrt{\sum_{k=1}^n |x_k - y_k|^2}$$

versehen, ist ein vollständiger metrischer Raum. Dies folgt aus dem Cauchyschen Konvergenzkriterium für Punktfolgen.

2.  $(C[a,b])$  mit der Maximumsmetrik

$$d(x,y) = \max_{t \in [a,b]} |x(t) - y(t)|$$

versehen ist vollständig.

Dagegen ist  $(C[a,b])$  bezüglich der Integralmetrik

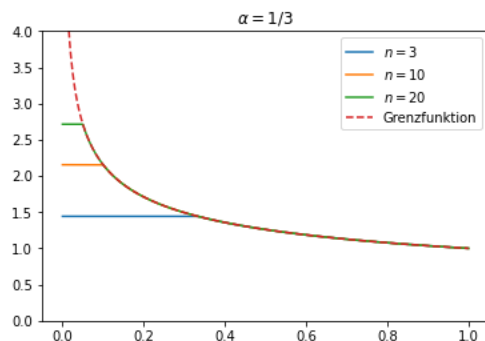
$$d(x,y) = \left( \int_a^b |x(t) - y(t)|^p dt \right)^{1/p}, \quad 1 \leq p < \infty \quad (2)$$

nicht vollständig. Wir betrachten dazu für  $(p=2)$  auf  $(C[0,1])$  folgendes Gegenbeispiel:

Sei  $(t \in [0,1])$

$$x_n(t) := \begin{cases} n^\alpha & \text{für } t \leq 1/n \\ \frac{1}{n} & \text{für } t > 1/n \end{cases} \quad (3)$$

und  $x(t) = \frac{1}{t^\alpha}$  für  $(0 < \alpha < 1/2)$ .



Es gilt  $x_n \in C[0,1]$  für alle  $(n \in \mathbb{N})$  und

$$d(x_n, x)^2 = \int_0^1 |x_n(t) - x(t)|^2 dt = \int_0^{1/n} (n^\alpha - t^{-\alpha})^2 dt.$$

Mit Hilfe der Ungleichung  $((a-b)^2 \leq 2(a^2 + b^2))$  folgt

$$d(x_n, x)^2 \leq 2 \int_0^{1/n} (n^{2\alpha} + t^{-2\alpha}) dt = \frac{2}{n^{1-2\alpha}} + \frac{2}{1-2\alpha} \frac{1}{n^{1-2\alpha}}$$

da  $(1-2\alpha > 0)$  gilt. Mit dem konvergiert die Folge  $(\{x_n\})$  gegen  $(x)$  in der Integralmetrik  $(p=2)$ . Wir zeigen, dass  $(\{x_n(t)\})$  keine auf  $([0,1])$  stetige Grenzfunktion besitzt. Dazu nehmen wir an, dass  $(y(t) \in C[0,1])$  sei Grenzfunktion der Folge  $(\{x_n(t)\})$ . Wir setzen

$$M = \max_{0 \leq t \leq 1} |y(t)|.$$

(Muss für eine wohl definierte Obersumme endlich sein!) Für  $(t \leq (2M)^{-1/\alpha})$  und  $(n > (2M)^{1/\alpha})$  gilt

$$|x_n(t) - y(t)| \geq M \quad \text{für } t \leq (2M)^{-1/\alpha}$$

und somit

$$d^2(x_n, y) = \int_0^1 |x_n(t) - y(t)|^2 dt \geq \int_0^{(2M)^{-1/\alpha}} |x_n(t) - y(t)|^2 dt \geq (2M)^{-1/\alpha} \cdot M^2 > 0,$$

im Widerspruch zur Annahme, dass  $(\{x_n(t)\})$  gegen  $(y(t))$  konvergiert. Damit ist die Behauptung bewiesen.  $\square$

Die Tatsache, daß  $(C[a,b])$ , versehen mit einer Integralmetrik, kein vollständiger metrischer Raum ist, bedeutet einen schwerwiegenden Mangel dieses Raumes. Jedoch gibt es mehrere Wege der Vervollständigung:

1. Man erweitert die Klasse  $(C[a,b])$  zur Klasse der auf  $([a,b])$  Lebesgue-integrierbaren Funktionen und interpretiert das in (2) auftretende Integral im Lebesgueschen Sinn. Dadurch gelangt man zum vollständigen metrischen Raum  $(L_p[a, b])$  (vgl. [Heu08], S. 109).
2. Ein anderer Weg besteht darin, dass der vollständige Erweiterungsraum als Menge von linearen Funktionalen auf einem geeigneten Grundraum nach dem Vorbild der Distributionentheorie aufgefasst wird.



3. Ein weiterer Weg besteht in der abstrakten Konstruktion eines vollständigen Erweiterungsraums mit Hilfe von Cauchy-Folgen. Auf diese Weise lässt sich **jeder** nichtvollständige metrische Raum vervollständigen (vgl. [Heu06], S. 251)

Wir definieren kompakt für metrische Räume wie folgt

#### **Definition: Kompakt**

Sei  $(X)$  ein metrischer Raum.  $(A \subset X)$  heisst *kompakt*, wenn jede Folge  $(\{x_n\})$  aus  $(A)$  eine Teilfolge enthält, die gegen ein Grenzelement  $(x \in A)$  konvergiert.

#### **Satz**

Jede kompakte Teilmenge  $(A)$  eines metrischen Raumes  $(X)$  ist beschränkt und abgeschlossen.

Die Umkehrung gilt im allgemeinen nicht.

## Bestapproximation in metrischen Räumen

In der Approximationstheorie stellt sich das Grundproblem: In einem metrischen Raum  $(X)$  sei eine Teilmenge  $(A)$  und ein fester Punkt  $(y \in X)$  vorgegeben. Zu bestimmen ist ein Punkt  $(x_0 \in A)$ , der von  $(y)$  minimalen Abstand hat. Das Problem beginnt schon damit, dass es nicht klar ist, dass es einen solchen Punkt überhaupt gibt:

Betrachte den Raum  $(\mathbb{R}, d)$  mit  $(d(x_1, x_2) = |x_1 - x_2|)$ . Die Teilmenge  $(A)$  sei gegeben durch  $(A = (0, 1))$  und  $(y = 2)$ . In  $(A)$  gibt es keinen Punkt  $(x_0)$ , für den  $(d(x_0, 2))$  minimal ist  $(1 \notin A)$ .

Zur Erinnerung:

#### **Definition: Supremum, Infimum**

Sei  $(A \subset \mathbb{R})$ , dann bezeichnet man mit dem *Supremum* von  $(A)$  die kleinste reelle Zahl  $(\lambda)$  mit  $(x \leq \lambda)$  für alle  $(x \in A)$ . Analog bezeichnet man mit dem *Infimum* die grösste reelle Zahl  $(\mu)$  mit  $(x \geq \mu)$  für alle  $(x \in A)$ .

#### **Satz**

Es sei  $(X)$  ein metrischer Raum und  $(A)$  eine **kompakte** Teilmenge von  $(X)$ . Dann gibt es zu jedem festen Punkt  $(y \in X)$  einen Punkt  $(x_0 \in A)$ , der von  $(y)$  kleinsten Abstand hat.

Betrachten wir das obige Beispiel angepasst auf die Voraussetzung im Satz: Sei  $(A = [0, 1] \subset \mathbb{R})$  ein kompaktes Intervall, dann ist der Punkt  $(x_0 = 1)$  bestapproximierendes Element.

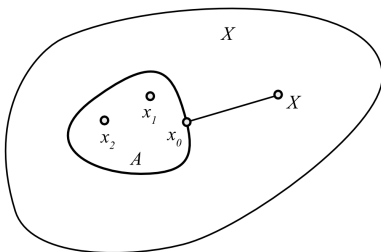


Fig. 1 Bestapproximation

## Normierte Räume. Banachräume

Bis jetzt haben wir sehr wenig Eigenschaften eines Raumes benötigt. Was uns noch fehlt, sind abgesehen vom Abstand der Elemente noch *algebraische* Eigenschaften (addieren, multiplizieren, etc.). Dazu definieren wir den *linearen Raum* (oder *Vektorraum*) wie folgt.

### **Definition: linearer Raum**

Ein *linearer Raum* (oder *Vektorraum*) über einem Körper  $(\mathbb{K})$  besteht aus einer nichtleeren Menge  $(X)$ , sowie

- einer Vorschrift, die jedem Paar  $((x,y))$  mit  $(x,y \in X)$  genau ein Element  $(x+y \in X)$  zuordnet (*Addition*)
- einer Vorschrift, die jedem Paar  $((\lambda, x))$  mit  $(\lambda \in \mathbb{K})$  und  $(x \in X)$  genau ein Element  $(\lambda x \in X)$  zuordnet (*Multiplikation mit Skalaren*), wobei für alle  $(x,y,z \in X)$  und  $(\lambda, \mu \in \mathbb{K})$  folgende Regeln gelten:

$$\begin{aligned} & (x + (y+z)) = (x+y) + z \quad \text{Assoziativgesetz} \\ & (x + y) = (y + x) \quad \text{Kommutativgesetz} \\ & (x + 0) = x \quad \text{Nullelement} \\ & (x + x') = 0 \quad \text{Negatives zu } x \\ & ((\lambda + \mu) x) = (\lambda x + \mu x) \quad \text{1. Distributivgesetz} \\ & (\lambda (x+y)) = (\lambda x + \lambda y) \quad \text{2. Distributivgesetz} \\ & ((\lambda \mu) x) = (\lambda (\mu x)) \quad \text{Assoziativgesetz} \\ & (1 x) = x \quad \text{mit } 1 \in \mathbb{K} \end{aligned}$$

Beispiele für lineare Räume:

- Die Mengen  $(\mathbb{R}^n)$ ,  $(\mathbb{C}^n)$  sind wohl bekannt.
- Menge  $(C[a,b])$  aller reellwertigen *stetigen* Funktionen:  
$$\begin{aligned} & ((x+y)(t)) = (x(t) + y(t)) \\ & ((\lambda x)(t)) = (\lambda x(t)) \\ & (0(t)) = 0 \\ & ((-x)(t)) = (-x(t)) \end{aligned}$$
  
mit  $(t \in [a,b] \subset \mathbb{R})$ ,  $(\lambda \in \mathbb{R})$ .
- $(C^k[a,b])$  Menge aller reellwertigen  $(k)$ -mal stetig differenzierbare Funktionen.
- $(C^\infty[a,b])$  Menge aller beliebig oft stetig differenzierbare Funktionen.
- Menge aller Polynome
- Menge  $(l_p)$  aller Zahlenfolgen  $(x = (x_k))$ , für die  $(\sum_{k=1}^\infty |x_k|^p < \infty)$  konvergiert:  
$$\begin{aligned} & ((x+y)) = ((x_k + y_k)) \\ & ((\lambda x)) = ((\lambda x_k)) \end{aligned}$$
  
 $(x_k, y_k, \lambda \in \mathbb{R})$

Wie in der linearen Algebra sind folgende Begriffe analog definiert

### **Definition: Unterraum, lineare Mannigfaltigkeit, lineare Hülle / Span, linear unabhängig, Dimension, Basis**

- Eine nicht leere Teilmenge  $(S)$  von  $(X)$  heisst *Unterraum* von  $(X)$ , wenn für bel.  $(x,y \in S)$  und  $(\lambda \in \mathbb{K})$  stets  
$$(x+y) \in S \quad \text{und} \quad (\lambda x) \in S$$
  
folgt. Insbesondere ist  $(S)$  selbst ein linearer Raum über  $(\mathbb{K})$ .
- Ist  $(S)$  ein Unterraum von  $(X)$  und  $(x_0 \in X)$  beliebig, so nennt man  
$$(M = x_0 + S := \{x_0 + y \mid y \in S\})$$
  
eine *lineare Mannigfaltigkeit* von  $(X)$ .
- Ist  $(A)$  eine beliebige nichtleere Teilmenge von  $(X)$ , so bilden alle Linearkombinationen  $(\sum_{k=1}^m \lambda_k x_k)$  mit beliebigem  $(m \in \mathbb{N})$ ,  $(\lambda_k \in \mathbb{K})$ ,  $(x_k \in A)$  einen Unterraum  $(S \subset X)$ . Er wird *lineare Hülle* von  $(A)$  oder  $(\mathop{\text{span}} A := S)$  genannt.  
Man sagt:  $(A)$  spannt  $(S)$  auf oder  $(A)$  ist ein *Erzeugendensystem* von  $(S)$ . Im Falle  $(S=X)$  spannt  $(A)$  den ganzen Raum  $(X)$  auf.
- Sind  $(S)$  und  $(T)$  Unterräume von  $(X)$ , dann ist die *Summe*  $(S+T)$  definiert durch  
$$(S+T := \mathop{\text{span}} S \cup T)$$
- Die (endlich vielen) Elemente  $(x_1, \dots, x_n \in X)$  heissen *linear unabhängig*, wenn aus  
$$(\alpha_1 x_1 + \dots + \alpha_n x_n = 0) \quad \text{stets} \quad \alpha_1 = \dots = \alpha_n = 0$$
  
folgt.
- Sei  $(S)$  ein Unterraum von  $(X)$ . Wir sagen,  $(S)$  besitzt die *Dimension*  $(n)$ ,  $(\mathop{\text{dim}} S = n)$ , wenn es  $(n)$  linear unabhängige Elemente von  $(S)$  gibt, aber  $(n+1)$  Elemente von  $(S)$  stets linear abhängig sind.  
 $(S)$  heisst *Basis* von  $(X)$ , wenn die Elemente von  $(S)$  linear unabhängig sind und  $(\mathop{\text{span}} S = X)$  gilt.  
Besitzt  $(X)$  keine endlich dimensionale Basis, nennt man  $(X)$  *unendlich-dimensional*  $(\mathop{\text{dim}} X = \infty)$ .

**Bemerkungen:** Die oben erwähnten Funktionenräume  $(C[a,b])$ ,  $(C^k[a,b])$ , Polynome sind unendlich-dimensional. Ebenso ist der Folgenraum  $(l_p)$  unendlich-dimensional:

Man betrachte

$$\{x^{(k)}\} = \{0, \dots, 0, 1, 0, \dots\} \text{ in } \ell_p$$

mit 1 an der Stelle  $(k)$ .

Im folgenden sind wir an Räumen interessiert, für welche eine lineare Struktur und eine Metrik gegeben ist.

### Definition: normierter Raum

Sei  $(X)$  ein metrischer und linearer Raum. Zu dem sei die Metrik  $d(\cdot)$  von  $(X)$  *translationsinvariant*

$$d(x+z, y+z) = d(x, y) \quad \text{für alle } x, y, z \in X$$

und *homogen*

$$d(\alpha x, \alpha y) = |\alpha| d(x, y) \quad \text{für alle } \alpha \in \mathbb{K}, x, y \in X$$

Dann nennt man  $(X)$  einen *normierten Raum*. Der durch

$$\|x\| := d(x, 0) \quad \text{für alle } x \in X$$

erklärte Ausdruck heisst *Norm* von  $(X)$ .

### Bemerkungen:

- Neben der kurzen Schreibweise  $(X)$ , verwendet man häufig auch die Bezeichnung  $(X, \|\cdot\|)$ . Der Punkt in  $(\cdot)$  ist als Platzhalter zu verstehen.
- Führt man den normierten Raum  $(X)$  mit Hilfe einer Norm ein, so ist durch  $d(x, y) = \|x - y\|$  für alle  $x, y \in X$  eine Metrik in  $(X)$  gegeben.

### Folgerung

Ein normierter Raum  $(X, \|\cdot\|)$  ist ein linearer Raum, auf dem eine Norm  $\|\cdot\|$  erklärt ist, die für alle  $x, y \in X$  und  $\alpha \in \mathbb{K}$

$$\begin{aligned} & \|x\| \geq 0, \quad \|x\| = 0 \quad \text{genau dann, wenn } x = 0 \text{ ist,} \\ & \|\alpha x\| = |\alpha| \|x\| \quad \text{für alle } \alpha \in \mathbb{K}, x \in X \\ & \|x + y\| \leq \|x\| + \|y\| \end{aligned}$$

erfüllt.

Damit können wir einen wichtigen Begriff der Funktionalanalysis einführen, den Banachraum:

### Definition: Banachraum

*Vollständig normierte* Räume  $(X)$  sind diejenigen, für die jede Cauchy-Folge in  $(X)$  gegen ein Element in  $(X)$  konvergiert.

Ein vollständiger normierter Raum heisst *Banachraum*.

**Beispiele:** Folgende Räume sind Banachräume

- $(\mathbb{R}^n)$  mit der Norm  $\|x\| = \sqrt{\sum_{k=1}^n |x_k|^2}$ .
- $(C[a, b])$  mit der Norm  $\|x\| := \max_{a \leq t \leq b} |x(t)|$ .
- $(C^k[a, b])$  mit der Norm  $\|x\| := \max_{a \leq t \leq b} |x(t)| + \max_{a \leq t \leq b} |x'(t)| + \dots + \max_{a \leq t \leq b} |x^{(k)}(t)|$ .
- $(\ell_p)$  ( $1 \leq p < \infty$ ) mit der Norm  $\|x\| = \left( \sum_{k=1}^{\infty} |x_k|^p \right)^{1/p}$ .

### Definition: abzählbare Basis

Man sagt, dass  $(X)$  eine *abzählbare Basis*  $(\{x_k\}_{k=1}^{\infty})$  mit  $(x_k \in X)$  besitzt, falls jedes  $x \in X$  eindeutig in der Form  $x = \sum_{k=1}^{\infty} \alpha_k x_k$  darstellbar ist, wobei die Konvergenz bezüglich der Norm von  $(X)$  zu verstehen ist.

Lineare Räume können durchaus verschieden normiert werden. Als Beispiel betrachte dazu den Raum  $(X = \mathbb{R}^n)$  mit den Normen

$$\begin{aligned} \|x\|_1 &= \sum_{k=1}^n |x_k| \quad \text{(Betragsnorm)} \\ \|x\|_2 &= \sqrt{\sum_{k=1}^n |x_k|^2} \quad \text{(Euklidische Norm, Quadratnorm)} \\ \|x\|_\infty &= \max_{1 \leq k \leq n} |x_k| \quad \text{(Maximumsnorm)} \end{aligned}$$

### Aufgabe

Stelle den Einheitskreis  $\{x \in \mathbb{R}^n, \|x\| = 1\}$  bezüglich den drei verschiedenen Normen  $\|\cdot\|$  graphisch dar.

Die drei verschiedenen Normen führen zur Frage, wie die Normen zusammenhängen.

### Definition: äquivalente Normen

Zwei Normen  $\|\cdot\|_a$  und  $\|\cdot\|_b$  heißen *äquivalent*, wenn jede bezüglich der Norm  $\|\cdot\|_a$  konvergente Folge auch bezüglich der Norm  $\|\cdot\|_b$  konvergent ist und umgekehrt.

Im endlich dimensionalen gilt ein pauschaler Satz:

### Satz

Alle Normen in einem **endlich**-dimensionalen Raum  $(X)$  sind äquivalent.

Dieses Resultat gilt für unendlich-dimensionale Räume **nicht**. Als Beispiel sei der lineare Raum  $(C[a,b])$  mit der Maximumsnorm und der Quadratnorm erwähnt. Die beiden Normen sind nicht äquivalent, vgl. das Gegenbeispiel (3).

Mit diesem Satz folgt

### Satz

Jeder endlich-dimensionale normierte Raum  $(X)$  ist vollständig, also ein Banachraum.

## Skalarprodukträume. Hilberträume

Das aus der linearen Algebra bekannte Skalarprodukt lässt sich auch auf unendlich-dimensionale Räume übertragen. Wir definieren ganz allgemein

### Definition: Skalarprodukt, Skalarproduktraum

Unter einem *Skalarproduktraum* versteht man einen linearen Raum  $(X)$  über  $(\mathbb{K})$ , in dem ein *Skalarprodukt*  $((x,y))$  mit folgenden Eigenschaften definiert ist: Für beliebige  $(x,y,z \in X)$  und  $(\alpha \in \mathbb{K})$  ist

$((\cdot, \cdot) : X \times X \rightarrow \mathbb{K})$   
und es gilt

$$\begin{aligned} (x,x) &\geq 0, \quad (x,x) = 0 \iff x=0 \\ (x,y) &= \overline{(y,x)} \\ (\alpha x, y) &= \alpha (x,y) \\ (x+\alpha y, z) &= (x,z) + \alpha (y,z). \end{aligned} \quad (4)$$

Beispielsweise lässt sich auf  $(X=C[a,b])$  Menge der reellwertigen stetigen Funktionen auf dem Intervall  $[a,b]$  durch

$$(x,y) := \int_a^b x(t)y(t) dt \quad x,y \in X \quad (5)$$

ein Skalarprodukt definieren.

### Aufgabe

Weise die Eigenschaften (4) für das Skalarprodukt (5) nach.

### **i Satz**

Es sei  $(X)$  ein Skalarproduktraum. Für beliebige  $(x, y, z) \in X$  und  $(\alpha \in \mathbb{K})$  gilt

$$\begin{aligned} \langle \alpha x, y \rangle &= \overline{\alpha} \langle x, y \rangle \\ \langle x, y+z \rangle &= \langle x, y \rangle + \langle x, z \rangle \end{aligned}$$

**Beweis:** selber durchführen.

### **i Satz: induzierte Norm**

In jedem Skalarproduktraum lässt sich durch

$$\|x\| := \sqrt{\langle x, x \rangle}$$

eine Norm definieren. Man bezeichnet sie als *die durch das Skalarprodukt  $\langle \cdot, \cdot \rangle$  induzierte Norm*.

Der Beweis lässt sich einfach mit Hilfe der *Schwarz'schen Ungleichung* durchführen.

### **i Satz: Schwarzsche Ungleichung**

Es sei  $(X)$  ein Skalarproduktraum. Dann gilt für alle  $(x, y) \in X$

$$|\langle x, y \rangle| \leq \|x\| \|y\|$$

Die Beweise sind dem Leser überlassen (vgl. [\[BWHM10\]](#) S. 43, 44).

### **i Satz**

Sei  $(X)$  ein Skalarproduktraum. Ferner seien  $(x_n)$  und  $(y_n)$  Folgen aus  $(X)$  mit  $x_n \rightarrow x$  und  $y_n \rightarrow y$  für  $n \rightarrow \infty$ , wobei die Konvergenz im Sinne der induzierten Norm zu verstehen ist. Dann gilt

$$\langle x_n, y_n \rangle \rightarrow \langle x, y \rangle \quad \text{für } n \rightarrow \infty$$

dh. das Skalarprodukt ist eine stetige Funktion bezüglich der Normkonvergenz.

### **i Definition: Hilbertraum**

Ein Skalarproduktraum  $(X)$ , der bezüglich der durch das Skalarprodukt induzierten Norm

$$\|x\| = \sqrt{\langle x, x \rangle} \quad \text{für } x \in X$$

vollständig ist, heisst *Hilbertraum*.

### **Beispiele:**

- $(\mathbb{R}^n)$  bzw.  $(\mathbb{C}^n)$  sind mit den Skalarprodukten  
 $\langle x, y \rangle = \sum_{k=1}^n x_k \overline{y_k} \quad \text{bzw.} \quad \langle x, y \rangle = \sum_{k=1}^n x_k \overline{y_k}$   
Hilberträume.
- $(L_2)$  ist mit dem Skalarprodukt  
 $\langle x, y \rangle = \sum_{k=1}^{\infty} x_k \overline{y_k}$   
ein Hilbertraum.
- $(C[a, b])$  ist bezüglich der Quadratnorm  
 $\|x\|_2 = \sqrt{\langle x, x \rangle} = \left( \int_a^b |x(t)|^2 dt \right)^{1/2}$   
**kein** Hilbertraum, da  $((C[a, b]), \|\cdot\|_2)$  nicht vollständig ist. Der Raum  $(L_2[a, b])$  erweist sich als Vervollständigung dieses Raumes, welcher jedoch eine Verallgemeinerung des Riemannschen Integralbegriffs (dem Lebesgues Mass) erfordert.

Viele Eigenschaften des euklidischen Raumes  $(\mathbb{R}^n)$ , die mit dem Skalarprodukt zusammenhängen, können auf einen beliebigen Hilbertraum übertragen werden. Der Begriff der Orthogonalität ist dabei sehr zentral.

### **Definition: orthogonal**

Es sei  $(X)$  ein Hilbertraum.

- Zwei Elemente  $(x, y \in X)$  heissen *orthogonal* ( $(x \perp y)$ ), wenn  $[(x, y) = 0]$  gilt.
- Zwei Teilmengen  $(A, B \subset X)$  heissen *orthogonal* ( $(A \perp B)$ ), wenn  $[(x, y) = 0 \quad \forall x \in A, y \in B]$  gilt.
- Sei  $(M \subset X)$ , dann heisst  $[M^\perp := \{y \in X \mid (x, y) = 0 \quad \forall x \in M\}]$  *Orthogonalraum* von  $(M)$ .
- Sei  $(X')$  ein abgeschlossener Unterraum von  $(X)$ .  $(X'')$  wird *orthogonales Komplement* von  $(X')$  genannt, wenn  $[X'' \perp X' \quad \text{und} \quad X' \oplus X'' = X]$  gilt. Mit  $(\oplus)$  ist die direkte Summe bezeichnet.

Es gilt

### **Satz: Pythagoras**

Es sei  $(X)$  ein Hilbertraum und seien  $(x, y \in X)$  mit  $(x \perp y)$ . Dann gilt

$$[(\|x+y\|)^2 = \|x\|^2 + \|y\|^2.]$$

**Beweis:** Einfaches Nachrechnen.

### **Satz**

Es sei  $(X)$  ein Hilbertraum und  $(M)$  eine beliebige Teilmenge von  $(X)$ . Dann ist der Orthogonalraum  $(M^\perp)$  von  $(M)$  ein abgeschlossener Unterraum von  $(X)$ .

Für den Beweis sei auf [\[BWHM10\]](#) S. 50 verwiesen.

Wir kommen nun auf das Approximationsproblem aus [Bestapproximation in metrischen Räumen](#) zurück und können die Struktureigenschaften des Hilbertraumes nutzen:

### **Satz**

Es sei  $(X')$  ein abgeschlossener Unterraum von  $(X)$  und  $(x \in X)$  beliebig.

- Dann existiert genau ein  $(x_0 \in X')$  mit  $[\|x - x_0\| = \min_{\{x' \in X'\}} \|x - x'\|,]$  dh. zu jedem  $(x \in X)$  gibt es genau ein bestapproximierendes Element bezüglich  $(X')$ .
- Es gilt  $(x_0 \in X)$  ist genau dann bestapproximierend an  $(x \in X)$ , wenn  $[(x - x_0, y) = 0 \quad \forall y \in X']$  gilt.

Für den Fall, dass  $(X')$  endlich-dimensional ist, lässt sich das bestapproximierende Element konstruieren. Es gilt

### **Satz**

Sei  $(X' \subset X)$  mit  $(\dim X' < \infty)$  ein Unterraum des Hilbertraumes  $(X)$  und sei  $(x_1, \dots, x_n)$  eine Basis von  $(X')$ . Dann lässt sich das eindeutig bestimmte bestapproximierende Element  $(x_0 \in X')$  an  $(x \in X)$  in der Form

$$[x_0 = \sum_{k=1}^n \lambda_k x_k]$$

darstellen, wobei die Koeffizienten  $(\lambda_1, \dots, \lambda_n)$  durch das lineare Gleichungssystem

$$[(x - x_0, x_i) = (x, x_i) - \sum_{k=1}^n \lambda_k (x_k, x_i) = 0 \quad \forall i = 1, \dots, n] \quad (6)$$

gegeben sind.

**Bemerkung:** Bildet  $\{x_k\}, \{k=1, \dots, n\}$  ein *Orthonormalsystem*

$$\begin{cases} \langle x_i, x_k \rangle = \delta_{ik} = \begin{cases} 0 & \text{für } i \neq k \\ 1 & \text{für } i = k \end{cases} \end{cases}$$

so folgt aus (6) sofort

$$\lambda_i = \langle x, x_i \rangle \quad i = 1, \dots, n$$

Die Koeffizienten  $\lambda_i$  nennt man auch Fourierkoeffizienten!

Wir werden zeigen, dass sich mit Hilfe des Schmidtschen Orthogonalisierungsverfahrens aus  $\{n\}$  linear unabhängigen Elementen stets ein Orthogonalsystem konstruieren lässt.

### **Definition: Orthonormalsystem (ONS)**

Es sei  $(X)$  ein Hilbertraum. Man nennt die Folge  $\{x_k\}_{k \in \mathbb{N}}$  ein (abzählbares) *Orthonormalsystem* (kurz ONS) von  $(X)$ , wenn

$$\begin{cases} \langle x_j, x_k \rangle = \delta_{jk} = \begin{cases} 0 & \text{für } j \neq k \\ 1 & \text{für } j = k \end{cases} \end{cases} \quad \text{für alle } j, k \in \mathbb{N}$$

erfüllt ist.

### **Beispiele**

- Im  $(L_2)$  bilden die Folgen  $\{1, 0, 0, \dots\}, \{0, 1, 0, \dots\}, \dots$  ein ONS.
- Für den (nicht vollständigen) reellen Skalarproduktraum  $(C[0, 2\pi])$  bilden die trigonometrischen Funktionen

$$\left\{ \frac{1}{\sqrt{2\pi}}, \frac{1}{\sqrt{\pi}} \cos t, \frac{1}{\sqrt{\pi}} \sin t, \frac{1}{\sqrt{\pi}} \cos 2t, \frac{1}{\sqrt{\pi}} \sin 2t, \dots \right\}$$

ein ONS.

- Weitere Beispiele sind Hermite'sche und Legendre'sche Polynome.

Es gilt ganz allgemein:

### **Satz: Orthogonalisierungsverfahren nach Erhard Schmidt**

Gegeben sei eine abzählbare (nicht zwingend endliche) linear unabhängige Folge  $\{y_k\} \subset X$  aus dem Hilbertraum  $(X)$ . Dann gibt es ein ONS aus  $\{n\}$  bzw. abzählbar unendlich viele Elementen  $\{x_k\}$  so, dass der von der Folge  $\{y_k\}$  aufgespannte (abgeschlossene) Unterraum mit dem der Folge  $\{x_k\}$  aufgespannten (abgeschlossene) Unterraum übereinstimmt.

Der Beweis beruht auf der Konstruktion: sei

$$x_1 = \frac{y_1}{\|y_1\|}$$

so ist  $\text{span}\{y_1\} = \text{span}\{x_1\}$ . Wir nehmen nun an, es seien bereits  $\{k\}$  orthonormierte Elemente  $\{x_1, \dots, x_k\}$  mit  $\text{span}\{y_1, \dots, y_k\} = \text{span}\{x_1, \dots, x_k\}$  konstruiert. Dann setze

$$z_{k+1} = y_{k+1} - \sum_{j=1}^k \langle y_{k+1}, x_j \rangle x_j$$

In dem Fall gilt  $\langle z_{k+1}, x_i \rangle = 0$  für alle  $i = 1, \dots, k$ . Mit

$$x_{k+1} = \frac{z_{k+1}}{\|z_{k+1}\|}$$

folgt  $\text{span}\{y_1, \dots, y_{k+1}\} = \text{span}\{x_1, \dots, x_{k+1}\}$ .

**Bemerkung:** Das Verfahren wird auch in der Numerik angewandt.

### **See also**

[Beispiel für das Orthogonalisierungsverfahren.](#)

Die Elemente eines Hilbertraumes können mit Hilfe eines vollständigen Orthogonalsystems dargestellt werden. Dies gelingt mit Hilfe der *verallgemeinerten Fourierreihen*:

### **Satz: Fourierentwicklung**

Sei  $(X)$  ein Hilbertraum mit einem vollständigen ONS  $(\{x_k\}_{k \in \mathbb{N}})$ .

- Dann lässt sich jedes  $x \in X$  in der Summenform  
$$x = \sum_{k=1}^{\infty} a_k x_k$$
 mit eindeutig bestimmten Koeffizienten  
$$a_k = \langle x, x_k \rangle$$
 darstellen und die Reihe  $\sum_{k=1}^{\infty} |a_k|^2$  ist konvergent.
- Umgekehrt gibt es zu jeder Zahlenfolge  $(a_k)_{k \in \mathbb{N}}$  in  $\mathbb{K}$ , für die  $\sum_{k=1}^{\infty} |a_k|^2$  konvergiert, genau ein  $x \in X$  mit  $x = \sum_{k=1}^{\infty} a_k x_k$ .

**Bemerkung:** Aufgrund der Darstellung  $x = \sum_{k=1}^{\infty} a_k x_k$  nennt man ein vollständiges ONS auch eine *Hilbertraumbasis*.

### **Satz: Struktur von Hilberträumen**

Es sei  $(X)$  ein Hilbertraum und  $(\{x_k\}_{k \in \mathbb{N}})$  ein (abzählbares) ONS in  $(X)$ . Dann sind die folgenden Aussagen äquivalent:

- $X = \overline{\text{span}\{x_k\}}$ .
- Das ONS  $(\{x_k\}_{k \in \mathbb{N}})$  ist abgeschlossen.
- Für alle  $x \in X$  gilt die *Parsevalsche Gleichung*  
$$\sum_{k=1}^{\infty} |\langle x, x_k \rangle|^2 = \|x\|^2$$
 (Vollständigkeitsrelation)
- Jedes Element  $x \in X$  besitzt die Fourierentwicklung  
$$x = \sum_{k=1}^{\infty} \langle x, x_k \rangle x_k$$

### **See also**

[Beispiel zur Fourierentwicklung.](#)

## Beispiel Orthogonalisierungsverfahren

nach Erhard Schmidt

```
import numpy as np
from sympy import symbols, integrate, lambdify
import matplotlib.pyplot as plt
```

Der Raum der quadratisch integrierbaren (nach Lebesgues) Funktionen  $L^2[-1,1]$  ist mit dem Skalarprodukt

$$\langle x, y \rangle = \int_{-1}^1 x(t) y(t) dt$$

und der induzierten Norm

$$\|x\|_2 = \sqrt{\langle x, x \rangle}$$

ein Hilbertraum. Wir definieren daher das Skalarprodukt (dot-product) und die norm wie folgt:

```
t = symbols('t')
def dot(x, y):
    return integrate(x*y, (t, -1, 1))
def norm(x):
    return dot(x, x)**(1/2)
```

Wir betrachten die Folge  $(t^n)_{n \in \mathbb{N}} \subset L^2[-1,1]$  von Monomen:

```
yi = [t**i for i in range(5)]
print(yi)
```

```
[1, t, t**2, t**3, t**4]
```

Die Monome sind nicht orthogonal, jedoch linear unabhängig. Falls dem so wäre müsste die Einheitsmatrix entstehen:

```
m = [[dot(yi[i], yi[j]) for j in range(5)] for i in range(5)]
m
```



```
[[2, 0, 2/3, 0, 2/5],
 [0, 2/3, 0, 2/5, 0],
 [2/3, 0, 2/5, 0, 2/7],
 [0, 2/5, 0, 2/7, 0],
 [2/5, 0, 2/7, 0, 2/9]]
```

Wir berechnen nun ein orthonormales System, basierend auf den Monomen nach dem Verfahren von Schmidt:

```
xi = [yi[0]/norm(yi[0])]
for i in range(1,5):
    s = 0
    for j in range(i):
        s += dot(yi[i],xi[j])*xi[j]
    zi=yi[i]-s
    xi.append(zi/norm(zi))
```

Das Orthonormalsystem ist damit gegeben durch:

```
xi
```

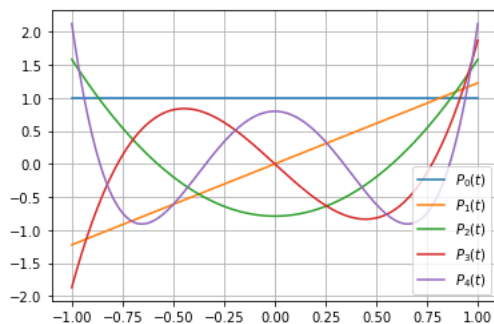
```
[0.707106781186547,
 1.22474487139159*t,
 2.37170824512628*t**2 - 0.790569415042095,
 4.67707173346743*t**3 - 2.80624304008046*t,
 9.2807765030735*t**4 - 7.95495128834872*t**2 + 0.795495128834872]
```

Test des Orthonormalsystems ergibt die Einheitsmatrix:

```
m = [[dot(xi[i],xi[j]) for j in range(5)] for i in range(5)]
np.round(np.array(m,dtype=float),8)
```

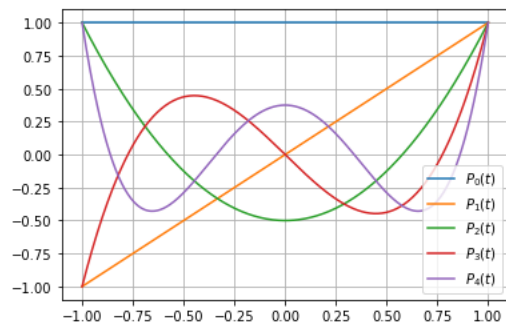
```
array([[ 1.,  0.,  0.,  0., -0.],
       [ 0.,  1.,  0.,  0.,  0.],
       [ 0.,  0.,  1.,  0.,  0.],
       [ 0.,  0.,  0.,  1.,  0.],
       [-0.,  0.,  0.,  0.,  1.]])
```

```
tp = np.linspace(-1,1,400)
n = 0
plt.plot(tp,np.ones_like(tp),label='$P_{'+str(n)+'}(t)$')
for xii in xi[1:]:
    n += 1
    f = lambdify(t,xii,'numpy')
    plt.plot(tp, f(tp),label='$P_{'+str(n)+'}(t)$')
plt.grid()
plt.legend()
plt.show()
```



Das Resultat sind bezüglich der  $(L_2)$ -Norm normierte Legendre'sche Polynome. Üblicher weise werden die Polynome mit  $(P_n(1) = 1)$  normiert:

```
tp = np.linspace(-1,1,400)
n = 0
plt.plot(tp,np.ones_like(tp),label='$P_{'+str(n)+'}(t)$')
for xii in xi[1:]:
    n += 1
    f = lambdify(t,xii,'numpy')
    plt.plot(tp, f(tp)/f(1),label='$P_{'+str(n)+'}(t)$')
plt.grid()
plt.legend()
plt.show()
```



Die ersten fünf Legendre'sche Polynome sind gegeben durch:

```
lp = [xii/xii.subs(t,1) for xii in xi]
print(lp)
```

```
[1.000000000000000, 1.0*t, 1.5*t**2 - 0.5, 2.5*t**3 - 1.5*t, 4.375*t**4 - 3.75*t**2 + 0.375]
```

## Beispiel zur Fourierentwicklung

```
import numpy as np
from sympy import symbols, integrate, lambdify, exp, sin, cos, pi
import scipy.integrate as scint
import matplotlib.pyplot as plt
```

Für das Beispiel benutzen wir zwei verschiedene orthonormale Basen für den  $(L_2[-1,1])$

```
t = symbols('t')
def dot(x,y):
    return integrate(x*y,(t,-1,1))
def norm(x):
    return dot(x,x)**(1/2)
def dotN(x,y):
    xy = lambdify(t, x*y,'numpy')
    return scint.quad(xy, -1, 1)[0]
def normN(x):
    return dotN(x,x)**(1/2)
```

## Legendre'sche Polynome

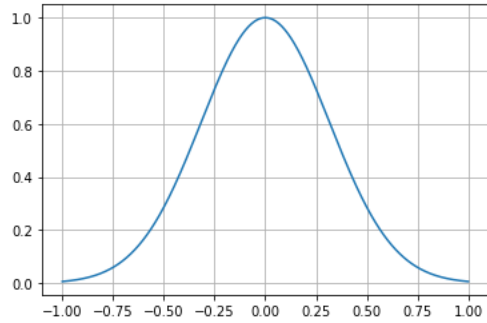
```
# Orthonormalbasis nach Schmidt
N = 9
yi = [t**i for i in range(N)]
xi = [yi[0]/norm(yi[0])]
for i in range(1,N):
    s = 0
    for j in range(i):
        s += dot(yi[i],xi[j])*xi[j]
    zi=yi[i]-s
    xi.append(zi/norm(zi))
```

```
xi
```

```
[0.707106781186547,
 1.22474487139159*t,
 2.37170824512628*t**2 - 0.790569415042095,
 4.67707173346743*t**3 - 2.80624304008046*t,
 9.2807765030735*t**4 - 7.95495128834872*t**2 + 0.795495128834872,
 18.4685120543048*t**5 - 20.5205689492276*t**3 + 4.39726477483448*t,
 36.8085471137468*t**6 - 50.1934733369281*t**4 + 16.7311577789763*t**2 -
 0.796721798998898,
 73.4290553655431*t**7 - 118.616166359723*t**5 + 53.9164392544196*t**3 -
 5.99071547271328*t,
 146.570997825634*t**8 - 273.599195941123*t**6 + 157.845689965986*t**4 -
 28.6992163574405*t**2 + 0.797200454372895]
```

```
f = exp(-5*t**2)
fn = lambdify(t, f, 'numpy')
```

```
tp = np.linspace(-1,1,400)
plt.plot(tp, fn(tp))
plt.grid()
plt.show()
```



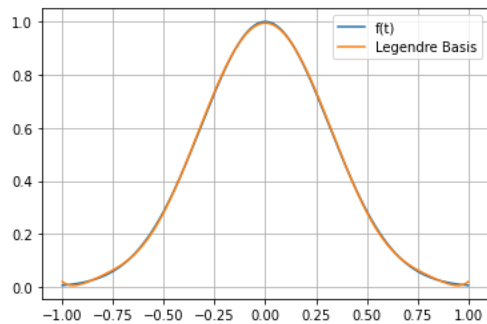
```
alpha = [dotN(f, xii) for xii in xi]
alpha
```

```
[0.5596217150491691,
 0.0,
 -0.4411693576778274,
 0.0,
 0.2148123794839546,
 0.0,
 -0.07762200243541717,
 0.0,
 0.0221421344164393]
```

```
s = 0
for alphai, xii in zip(alpha,xi):
    s += alphai*xii
sn = lambdify(t, s, 'numpy')
s
```

$$\begin{aligned} & 3.24539473540683 t^8 - 8.91522330646548 t^6 + 9.38478407796753 t^4 - \\ & 4.68931489413068 t^2 + 0.994864373177097 \end{aligned}$$

```
tp = np.linspace(-1,1,400)
plt.plot(tp, fn(tp),label='f(t)')
plt.plot(tp, sn(tp),label='Legendre Basis')
plt.legend()
plt.grid()
plt.show()
```



Parsevallsche Gleichung (Vollständigkeitsrelation):

$$\left\| \sum_{k=1}^N |(x, x_k)|^2 \right\| \leq \sum_{k=1}^{\infty} |(x, x_k)|^2 = \|x\|^2$$

```
np.sum(np.array(alpha)**2)-normN(f)**2
```

```
-2.810714668699532e-05
```

## Trigonometrische Funktionen

```
# Orthonormalbasis nach Schmidt
yi = []
N = 5
yi.append(1/2)
for i in range(1,N):
    yi.append(cos(pi*i*t))
    yi.append(sin(pi*i*t))
print('Anzahl Basisfunktionen: '+str(len(yi)))
xi = [yi[0]/normN(yi[0])]
for i in range(1,2*N-1):
    s = 0
    for j in range(i):
        s += dotN(yi[i],xi[j])*xi[j]
    zi=yi[i]-s
    xi.append(zi/normN(zi))
```

Anzahl Basisfunktionen: 9

xi

```
[0.7071067811865475,
 1.0*cos(pi*t) - 9.81307786677359e-17,
 1.0*sin(pi*t),
 -1.22011185168313e-17*cos(pi*t) + 1.0*cos(2*pi*t) + 1.03037317601123e-16,
 -9.90337261694782e-18*sin(pi*t) + 1.0*sin(2*pi*t),
 1.23822596516741e-33*cos(pi*t) - 1.01484627287186e-16*cos(2*pi*t) + 1.0*cos(3*pi*t)
 - 1.58362563377161e-17,
 2.04850984122971e-34*sin(pi*t) - 2.0684971882448e-17*sin(2*pi*t) + 1.0*sin(3*pi*t),
 -4.42531299261824e-17*cos(pi*t) + 1.31330734865152e-16*cos(2*pi*t) +
 8.86382073502645e-17*cos(3*pi*t) + 1.0*cos(4*pi*t) - 3.92523114670944e-17,
 7.95881701368516e-17*sin(pi*t) - 1.53007052862912e-17*sin(2*pi*t) -
 6.41357085318366e-17*sin(3*pi*t) + 1.0*sin(4*pi*t)]
```

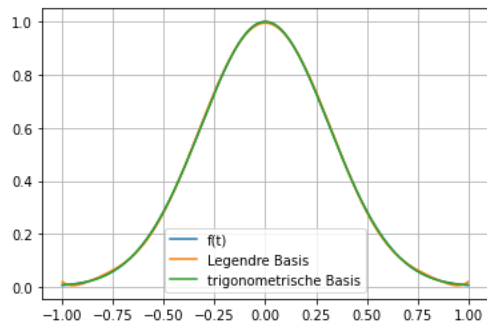
```
alpha2 = [dotN(f, xii) for xii in xi]
alpha2
```

```
[0.5596217150491691,
 0.4850805845912827,
 0.0,
 0.10914699708164807,
 0.0,
 0.010077740674845966,
 0.0,
 -0.00025517128989830523,
 0.0]
```

```
s2 = 0
for alphai, xii in zip(alpha2,xi):
    s2 += alphai*xii
s2n = lambdify(t, s2, 'numpy')
s2
```

$$0.485080584591283 \cos(\pi t) + 0.109146997081648 \cos(2\pi t) + 0.010077740674846 \cos(3\pi t) - 0.000255171289898305 \cos(4\pi t) + 0.395712309610513$$

```
tp = np.linspace(-1,1,400)
plt.plot(tp, fn(tp),label='f(t)')
plt.plot(tp, sn(tp),label='Legendre Basis')
plt.plot(tp, s2n(tp),label='trigonometrische Basis')
plt.legend()
plt.grid()
plt.show()
```



Parsevallsche Gleichung (Vollständigkeitsrelation):

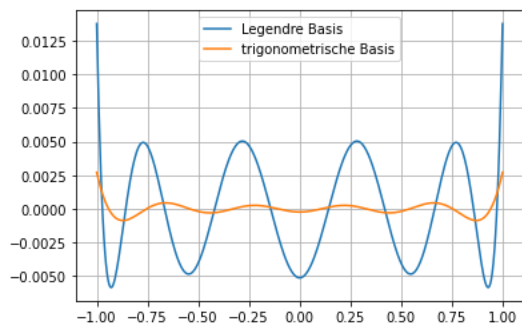
$$\|\sum_{k=1}^N |(x, x_k)|^2 \|e\| \sum_{k=1}^{\infty} |(x, x_k)|^2 = \|x\|^2$$

```
np.sum(np.array(alpha2)**2)-normN(f)**2
```

```
-4.505698535384184e-07
```

## Vergleich

```
plt.plot(tp, sn(tp)-fn(tp),label='Legendre Basis')
plt.plot(tp, s2n(tp)-fn(tp),label='trigonometrische Basis')
plt.legend()
plt.grid()
plt.show()
```



## Lineare Operatoren

Viele Aufgaben in der Mathematik und den Anwendungen führen auf Gleichungen der Form

$$[T(x) = T x = y,]$$

wobei  $(T: X \rightarrow Y)$  eine "lineare Abbildung",  $(X, Y)$  normierte Räume sind und  $(y \in Y)$  ein gegeben ist.

### **Definition: lineare Abbildung**

Die Abbildung  $(T)$  des normierten Raumes  $(X)$  in den normierten Raum  $(Y)$  heisst *linear*, wenn für alle  $(x, y \in X)$  und alle  $(\alpha \in \mathbb{K})$

$$[T(x+y) = T x + T y]$$

## Beschränkte lineare Operatoren

Analog zum Stetigkeitsbegriff aus der Analysis definiert man die Stetigkeit und Beschränktheit bei linearen Operatoren wie folgt:

### **Definition: stetig**

Sei  $(T: X \rightarrow Y)$  ein linearer Operator und  $(X, Y)$  normierte Räume. Der lineare Operator  $(T)$  heisst *stetig* in  $(x_0 \in X)$ , wenn es zu jedem  $(\epsilon > 0)$  ein  $(\delta = \delta(\epsilon, x_0) > 0)$  gibt, so dass

$$[ \|T x - T x_0\|_Y < \epsilon \text{ für alle } x \in X \text{ mit } \|x - x_0\|_X < \delta ]$$

gilt. Man nennt  $(T)$  *stetig in  $(X)$* , wenn  $(T)$  in jedem Punkt von  $(X)$  stetig ist.

### **Definition: beschränkt**

Es seien  $(X, Y)$  normierte Räume. Der lineare Operator  $(T: X \rightarrow Y)$  heisst *beschränkt*, wenn es eine Konstante  $(C > 0)$  mit

$$[ \|T x\|_Y \leq C \|x\|_X \text{ für alle } x \in X ]$$

gibt.

(7)

Die Menge aller linearen Abbildungen mit der sogenannten Operatornorm versehen, liefert uns wieder einen normierten Vektorraum. Die Operatornorm (vgl. Matrixnorm aus der Numerik oder linearen Algebra) ist gegeben durch

### **Definition: Operatornorm**

Die kleinste Zahl  $\|T\|$  für die (2.7) gilt, heisst *Operatornorm* von  $T$  und ist durch

$$\|T\| := \sup_{\|x\|=1} \|Tx\| \quad (8)$$

definiert.

**Bemerkung:** Mit der Norm von  $T$  lässt sich die Ungleichung (2.7) auch in der Form

$$\|Tx\| \leq \|T\| \|x\|$$

schreiben. Die Operatornorm lässt sich anstelle der Schreibweise (8) auch durch

$$\|T\| = \sup_{\|x\|=1} \|Tx\| = \sup_{\|x\|=1} \sqrt{\langle Tx, Tx \rangle} = \sqrt{\langle T^*T x, x \rangle} = \sqrt{\lambda_{\max}(T^*T)}$$

schreiben.

Zwischen stetigen und beschränkten Operatoren besteht der Zusammenhang

### **Satz**

Sei  $T: X \rightarrow Y$  ein linearer Operator und  $(X, Y)$  normierte Räume. Dann gilt

$$T \text{ ist beschränkt} \iff T \text{ ist stetig.}$$

**Beweis:** a) Sei  $T$  beschränkt durch  $C > 0$  und  $x_0 \in X$  beliebig. Wir zeigen nun, dass es zu jedem  $\epsilon > 0$  ein  $\delta = \delta(\epsilon, x_0)$  gibt, so dass

$$\|Tx - Tx_0\| < \epsilon \quad \text{für alle } \|x - x_0\| < \delta.$$

Wähle  $\delta = \frac{\epsilon}{C}$ , dann folgt

$$\|Tx - Tx_0\| = \|T(x - x_0)\| \leq C \|x - x_0\| < \epsilon \quad \text{für } \|x - x_0\| < \delta.$$

dh.  $T$  ist in  $x_0$  stetig und da  $x_0 \in X$  beliebig ist, in ganz  $X$ .

b) Sei nun  $T$  auf  $X$  stetig. Wir zeigen im Widerspruch, dass  $T$  beschränkt ist. Daher nehmen wir an:  $T$  sei nicht beschränkt. Also gibt es eine Folge  $\{x_k\} \subset X$  mit  $\|x_k\| = 1$  und  $\|Tx_k\| > k$  für alle  $k \in \mathbb{N}$ . Setze nun  $y_k = \frac{Tx_k}{\|Tx_k\|}$ , so folgt  $\|y_k\| = 1$  und

$$\|y_k\| = 1 \quad \text{für alle } k \in \mathbb{N}. \quad (9)$$

Andererseits gilt:  $\|y_k\| = \frac{\|Tx_k\|}{\|Tx_k\|} = 1$  für  $k \rightarrow \infty$  bzw.  $\|y_k\| \rightarrow 0$ . Aus der Stetigkeit von  $T$  in  $0$  folgt  $\|Ty_k\| \rightarrow 0$  für  $k \rightarrow \infty$ , was im Widerspruch zu (9) steht.  $\square$

Bei linearen Operatoren sind Stetigkeit und Beschränktheit äquivalente Eigenschaften.

**Beispiel:** Sei  $X=Y=C[a,b]$ ,  $\langle f, g \rangle = \int_a^b f(x)g(x)dx$  und  $\|f\| = \max_{x \in [a,b]} |f(x)|$ . Betrachte den *Integraloperator*  $T$  mit

$$(Tx)(x) := \int_a^b K(x,y) f(y) dy, \quad x \in [a,b]$$

mit  $K: [a,b] \times [a,b] \rightarrow \mathbb{R}$  stetigem Kern.

- $T$  ist ein linearer Operator, der  $C[a,b]$  auf sich abbildet.
- Da  $f \mapsto \int_a^b f(y) dy$  stetig auf  $C[a,b]$  ist, ist  $f \mapsto \int_a^b K(x,y) f(y) dy$  stetig auf  $[a,b] \times [a,b]$  und damit ist auch (vgl. Satz 7.17 in [BWHM17])

$$F(x) := \int_a^b K(x,y) f(y) dy$$

stetig auf  $[a,b]$ .

- Da  $K$  stetig auf  $[a,b] \times [a,b]$  ist, existiert

$$M = \max_{x,y \in [a,b]} |K(x,y)|$$

und somit

$$\|Tx\| = \max_{x \in [a,b]} |(Tx)(x)| \leq \max_{x \in [a,b]} \int_a^b |K(x,y)| |f(y)| dy \leq M \int_a^b |f(y)| dy \leq M(b-a) \|f\|$$

Damit ist  $T$  bezüglich der Maximumsnorm beschränkt. Es gilt

$$\|T\| = \sup_{\|f\|=1} \|Tx\| \leq M(b-a)$$

### **Satz**

Seien  $(X, Y)$  normierte Räume und mit  $(L(X, Y))$  die Menge aller beschränkten linearen Operatoren von  $(X)$  in  $(Y)$  bezeichnet. Dann ist  $(L(X, Y))$  bezüglich der Operatornorm

$$\|\cdot\|_{\text{split}} = \sup_{\{x \in X \mid x \neq 0\}} \frac{\|Tx\|_Y}{\|x\|_X}$$
wieder ein normierter Raum.

Ist  $(X)$  ein normierter Raum und  $(Y)$  ein *Banachraum*, dann ist  $(L(X, Y))$  ein Banachraum.

## Lineare Funktionale

Wir betrachten nun spezielle lineare Operatoren, welche in den zugrunde liegenden Zahlenkörper abbilden.

### **Definition: lineares Funktional**

Sei  $(X)$  ein normierter Raum. Dann nennt man den Operator  $(F: X \rightarrow \mathbb{K})$  ( $(\mathbb{R})$  oder  $(\mathbb{C})$ ) *lineares Funktional*.

Normiert man  $(\mathbb{K})$  mit

$$\|\alpha\| := |\alpha|, \quad \alpha \in \mathbb{K}$$

so ist  $(\mathbb{K})$  ein Banachraum und damit die Menge aller beschränkten linearen Funktionale auf  $(X)$  ein Banachraum. Dieser Raum ist insbesondere im Zusammenhang mit partiellen Differentialgleichungen sehr wichtig.

### **Dualraum von $(X)$**

Der Banachraum  $(L(X, \mathbb{K}))$  aller beschränkten linearen Funktionale auf  $(X)$  heisst der zu  $(X)$  *konjugierte* oder *duale Raum* und wird mit  $(X^*)$  oder  $(X')$  bezeichnet.

**Beispiel:** Sei  $(X)$  ein Hilbertraum und  $(y_0)$  ein beliebiges (festes) Element aus  $(X)$ . Für  $(x \in X)$  wird durch

$$F : X \rightarrow \mathbb{R} \mid x \mapsto y = Fx := (x, y_0)$$

ein lineares Funktional  $(F)$  definiert. (Die Linearität folgt direkt aus den Eigenschaften des Skalarprodukts.) Mit Hilfe der Schwarzschen Ungleichung folgt

$$\|Fx\| = |Fx| = |(x, y_0)| \leq \|x\| \|y_0\| \quad \text{für alle } x \in X.$$

Damit folgt

$$\frac{\|Fx\|}{\|x\|} \leq \|y_0\| \quad \text{für alle } x \in X,$$

sprich  $(F)$  ist ein beschränktes lineares Funktional,  $(F \in X^*)$  mit  $\|F\| \leq \|y_0\|$ . Da für  $(x=y_0)$

$$\|Fy_0\| = |(y_0, y_0)| = \|y_0\|^2 = \|y_0\| \|y_0\|$$

gilt, folgt

$$\|F\| = \sup_{\{x \in X \mid x \neq 0\}} \frac{\|Fx\|}{\|x\|} = \|y_0\|.$$

Wir kommen nun zum Rieszschen Darstellungssatz: Beschränkte lineare Funktionale eines Hilbertraumes  $(X)$  lassen sich besonders einfach darstellen. Die Darstellung aus obigem Beispiel erfasst **alle** beschränkten linearen Funktionale. Es gilt

### **Satz: Darstellungssatz von Riesz**

Sei  $(X)$  ein Hilbertraum und  $(F \in X^*)$  beliebig. Dann gibt es ein *eindeutig* bestimmtes  $(y \in X)$ , so dass  $(F)$  die Darstellung

$$Fx = (x, y) \quad \text{für alle } x \in X$$
 besitzt.

**Bemerkung:** Dieser Satz ist das zentrale Ergebnis der Hilbertraum-Theorie. Neben seiner Bedeutung als Darstellungssatz kann er auch als Existenz- und Eindeutigkeitsprinzip aufgefasst werden. Diese Bedeutung des Rieszschen Satzes ist Grundlage für die moderne Theorie der elliptischen partiellen Differentialgleichungen.

# Sobolevräume

Im Kapitel stellen wir die für die Behandlung von partiellen Differentialgleichungen geeigneten *Funktionenräume* vor. In den Beispielen für Hilberträume wurde erwähnt, dass der Funktionenraum der stetigen Funktionen versehen mit der Quadratnorm  $\|u\|_2 = \sqrt{\int_a^b |u(t)|^2 dt}$  nicht vollständig und damit kein Banachraum ist. Das Problem muss für die Behandlung der partiellen Differentialgleichungen gelöst werden und führt uns zu den sogenannten Sobolevräumen.

## Hilbertraum $(L_2(\Omega))$

Da der Fokus in der Bearbeitung von partiellen Differentialgleichungen liegt, werden wir im Folgenden Funktionen auf beliebigen  $(n)$  dimensionalen Gebieten  $(\Omega \subset \mathbb{R}^n)$  und nicht nur zwingend auf Intervallen  $([a, b] \subset \mathbb{R})$  betrachten.

Sei daher das Integrationsgebiet bzw. der Definitionsbereich der Funktion gegeben durch  $(\Omega)$  eine beliebige (nichtleere) offene Menge in  $(\mathbb{R}^n)$ . Mit  $(C(\Omega))$  bezeichnen wir die Menge aller stetigen Funktionen auf  $(\Omega)$ .

### **Definition: Support**

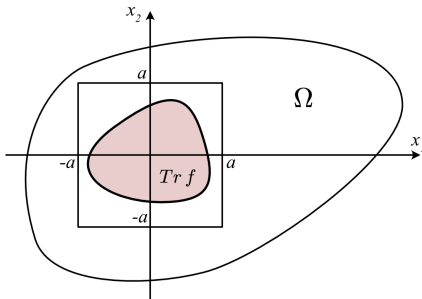
Für  $(f \in C(\Omega))$  definieren wir den *Träger* oder *Support* von  $(f)$  durch

$$\text{Tr } f := \overline{\{x \in \mathbb{R}^n \mid f(x) \neq 0\}}$$

wobei mit  $(\overline{A})$  die Abschlüssung einer Menge  $(A \subset \mathbb{R}^n)$  bezeichnet.

Mit  $(C_0(\Omega))$  bezeichnen wir stetige Funktionen mit *beschränktem Support in  $(\Omega)$* . Das Integral für  $(f \in C_0(\Omega))$  existiert: mit  $(a > 0)$  hinreichend gross gilt

$$\int_{\Omega} f(x) dx = \int_{-a}^a \left( \int_{\dots} \int_{-a}^a f(x_1, \dots, x_n) dx_1 \dots dx_n \right) dx_n.$$



**Fig. 2** Berechnung von  $(\int_{\Omega} f(x) dx)$  in  $(\mathbb{R}^2)$ .

### **Definition: $(C_0^\infty(\Omega))$ und $(L_2(\Omega))$**

Mit  $(C_0^\infty(\Omega))$  bezeichnen wir die Menge aller Funktionen, welche in  $(\Omega)$  beliebig oft stetig differenzierbar sind und einen beschränkten in  $(\Omega)$  enthaltenen Support haben.

Mit der Quadratnorm

$$\|u\|_2 = \sqrt{\int_{\Omega} |u(x)|^2 dx}$$

definieren wir  $(L_2(\Omega))$  als den zu  $(C_0^\infty(\Omega), \|\cdot\|_2)$  konjugierten (dualen) Raum:

$$(L_2(\Omega) := (C_0^\infty(\Omega), \|\cdot\|_2)^*.)$$

Man kann zeigen, dass sich die klassischen Funktionen aus  $(C_0^\infty(\Omega))$  in  $(L_2(\Omega))$  wiederfinden. Mathematisch bedeutet das, dass  $(C_0^\infty(\Omega))$  als Unterraum von  $(L_2(\Omega))$  aufgefasst werden kann.

$$(C_0^\infty(\Omega) \subset L_2(\Omega))$$

Man sagt in dem Fall,  $(C_0^\infty(\Omega))$  ist in  $(L_2(\Omega))$  *eingebettet*. Es gilt



### **Satz**

Es gilt:

- $C_0^\infty(\Omega)$  liegt dicht in  $L_2(\Omega)$
- $\overline{C_0^\infty(\Omega)}$  ist vollständig.
- $L_2(\Omega) = \overline{C_0^\infty(\Omega)}$

## Sobolevräume

Mit den Sobolevräumen kommt nun die Ableitung von Elementen aus dem  $L_2(\Omega)$  ins Spiel. Wir definieren den Sobolevraum  $H_m(\Omega)$  wie folgt

### **Definition: Sobolevraum $H_m(\Omega)$**

Unter dem Sobolevraum  $H_m(\Omega)$  versteht man den linearen Raum aller linearen Funktionale  $(F)$  auf  $C_0^\infty(\Omega)$ , für die  $(F)$  und sämtliche Ableitungen  $(D^p F)$  der Ordnung  $(|p| \leq m)$  zu  $L_2(\Omega)$  gehören:

$$H_m(\Omega) := \{F \in L_2(\Omega) \mid D^p F \in L_2(\Omega), |p| \leq m\}.$$

Nicht klar ist an dieser Stelle, was  $(D^p F)$  zu bedeuten hat, da  $(F)$  ein beschränktes lineares Funktional ist. Der klassische Ableitungsbegriff genügt nicht der in der Definition benutzten Ableitung, da dieser für Funktionale verallgemeinert werden muss.

Betrachten wir das Ganze mit Hilfe eines eindimensionalen Gebietes  $(\Omega = [0,1])$  und für Funktionale  $(F_u \in L_2([0,1]))$ , welche durch Funktionen  $(u \in C^1([0,1]))$  induziert sind:

$$(F_u | \varphi) = \int_0^1 u(t) \varphi(t) dt \quad \text{für } \varphi \in C_0^\infty([0,1]).$$

Die Ableitung  $(\frac{\partial}{\partial x} F_u)$  definieren wir wie folgt:

$$(\frac{\partial}{\partial x} F_u := F_{- \frac{\partial u}{\partial x}})$$

Mit der Definition und partieller Integration erhalten wir

$$\begin{aligned} \int_0^1 \frac{\partial}{\partial x} F_u \varphi(x) dx &= F_{- \frac{\partial u}{\partial x}}(\varphi) = \int_0^1 \frac{\partial u}{\partial x} \varphi(x) dx \\ &= \underbrace{\int_0^1 \frac{\partial}{\partial x} (u(x) \varphi(x)) dx}_{=0, \text{ da } \varphi(0)=\varphi(1)=0} - \int_0^1 u(x) \frac{\partial \varphi}{\partial x}(x) dx = - \int_0^1 u(x) \frac{\partial \varphi}{\partial x}(x) dx. \end{aligned}$$

Wir erhalten somit

$$\frac{\partial}{\partial x} F_u = - F_{\frac{\partial u}{\partial x}} \quad \text{für } \varphi \in C_0^\infty([0,1]).$$

Oder für mehrdimensionale Gebiete  $(\Omega)$

$$\frac{\partial}{\partial x} F_u = - F_{\frac{\partial u}{\partial x}} \quad \text{für } \varphi \in C_0^\infty(\Omega).$$

Damit können wir eine verallgemeinerte Ableitung definieren, welche auch auf Funktionen  $(u(x))$ , welche selber nicht im klassischen Sinne differenzierbar sind, anwendbar ist:

### **Definition: Verallgemeinerte Ableitung (generalized derivative)**

Für  $(u \in L_2(\Omega))$  definieren wir  $(g \in L_2(\Omega))$  als die verallgemeinerte Ableitung  $(D^p u)$  von  $(u)$  wobei

$$\int_\Omega g(x) \varphi(x) dx = (-1)^{|p|} \int_\Omega u(x) D^p \varphi(x) dx \quad \text{für alle } \varphi \in C_0^\infty(\Omega).$$

Unter der partiellen Ableitung  $(\frac{\partial}{\partial x})$

- partielle Ableitung
- Sobolevraum

## Einführung PDE

# Numerik für partielle Differentialgleichungen

## Anwendungen

Anwendungen

## Literaturverzeichnis

### [BWHM10]

Klemens Burg, Friedrich Wille, Herbert Haf, and Andreas Meister. *Partielle Differentialgleichungen und funktionalanalytische Grundlagen*. Vieweg + Teubner Verlag, 2010. URL: <https://www.springer.com/de/book/9783834812940>.

### [BWHM17]

Klemens Burg, Friedrich Wille, Herbert Haf, and Andreas Meister. *Höhere Mathematik für Ingenieure Band I: Analysis*. Vieweg + Teubner Verlag, 2017. URL: <https://www.springer.com/de/book/9783834824387>.

### [Heu06]

Harro Heuser. *Funktionalanalysis*. Vieweg + Teubner Verlag, 2006. URL: <https://www.springer.com/de/book/9783835100268>.

### [Heu08]

Harro Heuser. *Lehrbuch der Analysis*. Volume 2. Vieweg + Teubner Verlag, 2008. URL: <https://www.springer.com/de/book/9783322968128>.

---

By Simon Stingelin

© Copyright 2021.